中银沪深 300 指数增强型证券投资基金

2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：中银基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二六年八月三十一日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录 2
1.1 重要提示 2
1.2 目录 3
2 基金简介 5
2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 6
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6
3 主要财务指标和基金净值表现 6
3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 7
4 管理人报告 10
4.1 基金管理人及基金经理情况 10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 14
5 托管人报告 14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 15
6 中期财务会计报告（未经审计） 15
6.1 资产负债表 15
6.2 利润表 16
6.3 净资产变动表 17
6.4 报表附注 19
7 投资组合报告 48
7.1 期末基金资产组合情况 48
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 49
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 50
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 59
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 61
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 61
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 61
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 61
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 61
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 61
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 61
7.12 投资组合报告附注 62
8 基金份额持有人信息 63

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 63
8.2 盈利投资者数量占比 63
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 63
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 64
9 开放式基金份额变动 64
10 重大事件揭示 65
10.1 基金份额持有人大会决议 65
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 65
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 65
10.4 基金投资策略的改变 65
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 65
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 65
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况 65
10.8 其他重大事件 68
11 影响投资者决策的其他重要信息 68
12 备查文件目录 69
12.1 备查文件目录 69
12.2 存放地点 69
12.3 查阅方式 69

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中银沪深 300 指数增强型证券投资基金		
基金简称	中银沪深 300 指数增强		
基金主代码	004881		
交易代码	004881		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2017 年 11 月 24 日		
基金管理人	中银基金管理有限公司		
基金托管人	兴业银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	737,151,655.70 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	中银沪深 300 指数增强 A	中银沪深 300 指数增强 C	中银沪深 300 指数增强 E
下属分级基金的交易代码	004881	010311	021851
报告期末下属分级基金的份额总额	296,296,693.53 份	189,277,694.89 份	251,577,267.28 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票指数增强型基金，在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，追求实现超越业绩比较基准的投资回报，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金为指数增强型基金，以沪深 300 指数为标的指数，基金股票投资方面主要采用指数增强量化投资策略。力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%，以实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人将采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。 指数成份股发生明显负面事件面临退市风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人将按照基金份额持有人利益优先的原则，综合考虑成份股的退市风险、其在指数中的权重以及对跟踪误差的影响，据此制定成份股替代策略，通过提请召开临时投资决策委员会，及时对投资组合进行相应调整。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金为股票型指数增强基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。 本基金可投资港股通标的股票，将面临需承担汇率风险、境外市场风险以及港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中银基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈卫星	冯萌
	联系电话	021-38848999	021-52629999-213310
	电子邮箱	clientservice@bocim.com	fengmeng@cib.com.cn
客户服务电话		021-38834788 400-888-5566	95561
传真		021-68873488	021-62159217
注册地址		上海市银城中路200号中银大厦45层	福建省福州市台江区江滨中大道398号兴业银行大厦
办公地址		上海市银城中路200号中银大厦10层、11层、26层、45层	上海市浦东新区银城路167号4楼
邮政编码		200120	200120
法定代表人		刘信群	吕家进

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.bocim.com
基金中期报告置备地点	上海市浦东新区银城中路 200 号 26 楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中银基金管理有限公司	上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 10 层、11 层、26 层、45 层

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日）		
	中银沪深 300 指数增强 A	中银沪深 300 指数增强 C	中银沪深 300 指数增强 E
本期已实现收益	41,214,349.88	10,282,671.33	9,765,827.45
本期利润	67,741,445.74	17,663,925.52	27,936,415.88
加权平均基金份额本期利润	0.1908	0.2001	0.3160

本期加权平均净值利润率	13.82%	14.60%	22.87%
本期基金份额净值增长率	12.76%	12.53%	12.54%
3.1.2 期末数据和指标	**报告期末(2026 年 6 月 30 日)**		
	中银沪深 300 指数增强 A	中银沪深 300 指数增强 C	中银沪深 300 指数增强 E
期末可供分配利润	141,713,411.48	83,794,015.23	117,403,175.15
期末可供分配基金份额利润	0.4783	0.4427	0.4667
期末基金资产净值	444,730,143.27	277,208,067.00	374,592,324.94
期末基金份额净值	1.5010	1.4646	1.4890
3.1.3 累计期末指标	**报告期末(2026 年 6 月 30 日)**		
	中银沪深 300 指数增强 A	中银沪深 300 指数增强 C	中银沪深 300 指数增强 E
基金份额累计净值增长率	50.08%	20.81%	46.84%

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额），即如果期末未分配利润（报表数，下同）的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分，如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分扣除未实现部分）。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中银沪深 300 指数增强 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	15.64%	1.23%	11.30%	1.19%	4.34%	0.04%
过去六个月	12.76%	1.11%	7.20%	1.07%	5.56%	0.04%
过去一年	33.52%	1.00%	25.13%	0.97%	8.39%	0.03%
自基金合同生效日起	50.08%	1.08%	28.37%	1.14%	21.71%	-0.06%

中银沪深 300 指数增强 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	15.52%	1.23%	11.30%	1.19%	4.22%	0.04%

过去六个月	12.53%	1.11%	7.20%	1.07%	5.33%	0.04%
过去一年	32.99%	1.00%	25.13%	0.97%	7.86%	0.03%
自基金合同生效日起	20.81%	1.08%	9.18%	1.11%	11.63%	-0.03%

中银沪深 300 指数增强 E

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	15.52%	1.23%	11.30%	1.19%	4.22%	0.04%
过去六个月	12.54%	1.11%	7.20%	1.07%	5.34%	0.04%
过去一年	33.01%	1.00%	25.13%	0.97%	7.88%	0.03%
自基金合同生效日起	46.84%	1.14%	41.29%	1.16%	5.55%	-0.02%

注：1.以上基金净值表现为本基金自 2017 年 11 月 24 日成立以来包含转型前后阶段的数据。

2.本基金于 2024 年 3 月 20 日由中银量化价值混合型证券投资基金转型为中银沪深 300 指数增强型证券投资基金;转型前业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×80% ＋中债综合指数收益率×20%；转型后业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。

3.2.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

中银沪深 300 指数增强型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2017 年 11 月 24 日至 2026 年 6 月 30 日）

中银沪深 300 指数增强 A



中银沪深 300 指数增强 C



中银沪深 300 指数增强 E



注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期，截至建仓结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为中银基金管理有限公司，由中国银行股份有限公司和贝莱德投资管理（英国）有限公司两大全球著名领先金融品牌强强联合组建的中外合资基金管理公司，致力于长期参与中国基金业的发展，努力成为国内领先的基金管理公司。

截至 2026 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理中银中国精选混合型开放式证券投资基金、中银货币市场证券投资基金、中银持续增长混合型证券投资基金、中银收益混合型证券投资基金等 188 只开放式证券投资基金，同时管理着多个私募资产管理计划。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
赵志华	基金经理	2017-11-24	-	21	金融工程博士。曾任华泰证券金融创新部量化投资经理，资产管理总部投资主办。2011 年加入中银基金管理有限公司，曾担任基金经理助理、专户投资经理。2015 年 7 月至 2018 年 2 月任中银优秀企业基金基金经理，2016 年 6 月至 2018 年 2 月任中银腾利基金基金经理，2016 年 11 月至 2019 年 10 月任中银研究精选基金基金经理，2016 年 12 月至 2026 年 3 月任中银量化精选基金基金经理，2017 年 11 月至今任中银沪深 300 基金（原中银量化价值基金）基金经理，2023 年 7 月至 2024 年 8 月任中银新回报基金（原中银保本二号）基金经理，2023 年 10 月至 2025 年 12 月任中银新财富基金基金经理，2023 年 11 月至今任中银 MSCI 中国 A50 基金基金经理，2023 年 12 月至 2025 年 3 月任中银中证 1000 基金基金经理，2023 年 12 月至 2025 年 1 月任中银中证 500 基金基金经理，2024 年 6 月至今任中银量化选股基金基金经理，2025

					年 1 月至 2026 年 3 月任中银沪深 300 指数基金基金经理，2025 年 4 月至 2026 年 5 月任中银新华中诚信红利价值指数基金基金经理，2025 年 5 月至今任中银中证 A500 基金基金经理。具备基金从业资格。

注：1、首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日，非首任基金经理的“任职日期”为根据公司决定确定的聘任日期，基金经理的“离任日期”均为根据公司决定确定的解聘日期；2、证券从业年限的计算标准及含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、中国证监会的有关规则和其他有关法律法规的规定，严格遵循本基金基金合同，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《中银基金管理有限公司公平交易管理办法》，建立了《新股询价申购管理办法》、《投资流通受限类证券和参与公开增发管理办法》、《债券询价申购管理办法》、《集中交易管理办法》等公平交易相关制度体系，通过制度确保不同投资组合在投资管理活动中得到公平对待，严格防范不同投资组合之间进行利益输送。公司建立了投资决策委员会领导下的投资决策及授权制度，以科学规范的投资决策体系，采用集中交易管理加强交易执行环节的内部控制，通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现；通过建立层级完备的公司证券池及组合风格库，完善各类具体资产管理业务组织结构，规范各项业务之间的关系，在保证各投资组合既具有相对独立性的同时，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；通过对异常交易行为的实时监控、分析评估、监察稽核和信息披露确保公平交易过程和结果的有效监督。

本报告期内，本公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。各投资组合均严格按照法律、法规和公司制度执行投资交易，本报告期内公司整体公平交易制度执行情况良好，未发现有违背公平交易的相关情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未发现异常交易行为。

本报告期内，基金管理人未发生所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

1.宏观经济分析

全球宏观方面，上半年全球经济运行从年初的温和修复预期快速转向地缘冲击主导下的波动格局。AI 相关投资扩张继续支撑全球总需求，但中东局势升级及霍尔木兹海峡阶段性受阻显著推升能源价格并扰动全球供应链，全球通胀中枢重新抬升，主要经济体货币政策路径也由原先的继续宽松预期转向分化调整。美国经济延续韧性，通胀因油价飙升，但 CPI 同比或已在 5 月达到年内高点，美联储继续按兵不动保持观望。欧元区受能源依赖、内需疲弱及区域分化影响，经济增长进一步承压，欧央行于 6 月加息 25bps，结束此前宽松周期。日本经济保持温和增长，“工资-物价”循环继续改善，日央行 6 月加息 25bps 至 1.0%。

国内宏观方面，上半年面对外部地缘冲击和不确定性加大的形势，国内坚持以我为主，围绕十五五纲要和两会部署，在正确政绩观引导下有序推进经济高质量发展。宏观调控政策保持连续稳定，财政政策强调固本增效，货币政策维持适度宽松。上半年经济增速位于全年目标区间内。结构方面，出口增速明显抬升，对经济形成重要拉动，而消费和投资增速在一季度靠前发力后有所放缓。经济动能方面，AI 等新兴产业对出口、投资和价格的贡献进一步抬升。价格方面，通胀呈上升趋势，名义 GDP 增速改善。整体上，中国经济展现出较强活力与韧性，科技创新与产业升级仍是重要主线。

2.市场回顾

股票市场方面，上半年上证综指上涨 3.16%，沪深 300 上涨 7.55%，中证 500 上涨 20.97%，中证 1000 上涨 15.99%，中证 2000 上涨 9.1%，创业板指数上涨 35.58%。上半年行业方面分化较大，中信一级行业电子上涨 85.49%，通信上涨 74.54%，建材上涨 43.7%，基础化工上涨 18.56% ；与此同时，消费者服务下跌 31.88 %，综合金融下跌 29.58 %，农林牧渔下跌 24.76% ，商贸零售下跌 22.18%

3. 运行分析

上半年基金严格按照量化指数增强模型运作，较为严格的控制了行业和风格偏离，努力在控制风险的基础上追求超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金 A 类份额净值增长率为 12.76%，同期业绩比较基准收益率为 7.20%。

报告期内，本基金 C 类份额净值增长率为 12.53%，同期业绩比较基准收益率为 7.20%。

报告期内，本基金 E 类份额净值增长率为 12.54%，同期业绩比较基准收益率为 7.20%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

全球宏观方面，下半年全球经济走势的关键变量仍在于中东局势及油价冲击的持续时间：若供给扰动较快消退，全球经济有望延续温和增长，主要央行也可保留一定政策灵活性；若能源价格长期高企，则滞胀风险和货币政策约束均将明显上升。在此背景下，若能源价格逐步回落、美国就业和通胀温和降温，美联储仍存在重启降息的可能；但若油价维持高位并推动通胀预期重新上行，美联储面临的紧缩压力或进一步上升。欧央行同样需要在增长偏弱与输入性通胀回升之间进行权衡，但进一步加息的门槛有所提高。日本方面，在工资增长、价格传导和日元贬值压力下，预计日央行将继续推进政策正常化，但加息节奏或保持审慎。

国内宏观方面，在 7 月中共中央政治局会议精神的指导下，或将充分发挥各项存量政策效能，加快财政支出和债券资金使用进度，推进“两重”建设和“两新”工作，综合运用并适时调整货币政策工具。财政脉冲有望再度抬升，叠加低基数的影响，传统动能增速预计回升。而在新兴产业蓬勃发展和全球产业链重构推动的产能周期上行背景下，出口和高端制造业投资预计仍将对经济形成重要支撑。预计全年将顺利实现经济增速目标，结构上，上半年经济展现的内外需分化、新旧动能分化的特征，或在下半年边际走向收敛。价格方面，下半年 PPI 或触顶后温和回落，通胀整体或将维持偏平稳态势。

本基金将严格按照契约规定，严格按照量化指增模型进行投资管理。作为基金管理者，我们将一如既往地依靠团队的努力和智慧，力争为投资人创造应有的回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

4.6.1 有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

根据证监会的相关规定，本公司为建立健全有效的估值政策和程序，成立估值委员会，明确参与估值流程各方的人员分工和职责，由基金运营、风险管理、研究及投资相关人员担任委员会委员。估值委员会委员具备应有的经验、专业胜任能力和独立性，分工明确。估值委员会严格按照工作流

程诚实守信、勤勉尽责地讨论和决策估值事项。估值委员会审议并依据行业协会提供的估值模型和行业做法选定与当时市场环境相适应的估值方法，基金运营部应征询会计师事务所、基金托管人的相关意见。当改变估值技术时，导致基金资产净值的变化在 0.25%以上的，会计师事务所应对基金管理人所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性发表审核意见，同时公司按照相关法律法规要求履行信息披露义务。另外，对于特定品种或者投资品种相同，但具有不同特征的，若协会有特定调整估值方法的通知，比如《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》，应参照协会通知执行。可根据指引的指导意见，并经估值委员会审议，采用第三方估值机构提供的估值相关的数据服务。

4.6.2 本公司参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突。

4.6.3 定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同，在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。

本报告期期末 A 类基金份额可供分配利润为 141,713,411.48 元，C 类基金份额可供分配利润为 83,794,015.23 元，E 类基金份额可供分配利润为 117,403,175.15 元。本基金本报告期未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金在报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

报告期内，本托管人根据自身能够获取的数据和信息，依据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的

行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人根据自身能够获取的数据和信息，认真复核了本中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

6 中期财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中银沪深 300 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资　产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	142,031,537.53	53,796,809.16
结算备付金		55,011,248.15	12,786,094.42
存出保证金		12,327,569.49	2,400,337.39
交易性金融资产	6.4.7.2	935,185,999.07	621,776,616.99
其中：股票投资		935,185,999.07	621,776,616.99
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		244,731.12	-
应收股利		-	-
应收申购款		35,786,863.53	9,858,602.48
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		1,180,587,948.89	700,618,460.44
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2026 年 6 月 30 日**	**上年度末 2025 年 12 月 31 日**
负 债：			

短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		82,605,432.27	24,396,719.91
应付赎回款		205,350.77	714,096.77
应付管理人报酬		538,003.51	333,088.49
应付托管费		100,875.67	62,454.08
应付销售服务费		126,883.42	32,389.62
应付投资顾问费		-	-
应交税费		127,427.15	7,493.48
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	353,440.89	351,505.57
负债合计		84,057,413.68	25,897,747.92
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	737,151,655.70	508,905,719.70
未分配利润	6.4.7.8	359,378,879.51	165,814,992.82
净资产合计		1,096,530,535.21	674,720,712.52
负债和净资产总计		1,180,587,948.89	700,618,460.44

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额总额 737,151,655.70 份，其中 A 类基金份额净值 1.5010 元，基金份额 296,296,693.53 份；C 类基金份额净值 1.4646 元，基金份额 189,277,694.89 份；E 类基金份额净值 1.4890 元，基金份额 251,577,267.28 份。

6.2 利润表

会计主体：中银沪深 300 指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		117,364,808.14	12,725,267.27
1.利息收入		203,488.15	155,125.13
其中：存款利息收入	6.4.7.9	203,488.15	155,125.13
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		63,936,972.37	22,458,448.45
其中：股票投资收益	6.4.7.10	52,468,297.78	13,726,736.75
基金投资收益		-	-

债券投资收益	6.4.7.11	18,055.40	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	4,831,626.58	1,148,717.04
股利收益	6.4.7.14	6,618,992.61	7,582,994.66
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	52,078,938.48	-9,910,892.75
4.汇兑收益（损失以“一”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	1,145,409.14	22,586.44
减：二、营业总支出		4,023,021.00	3,773,666.67
1．管理人报酬	6.4.10.2	2,894,679.69	2,740,998.55
2．托管费	6.4.10.2	542,752.47	513,937.23
3．销售服务费		472,703.49	428,907.61
4．投资顾问费		-	-
5．利息支出		8,228.65	-
其中：卖出回购金融资产支出		8,228.65	-
6. 信用减值损失		-	-
7．税金及附加		17,501.50	4,174.67
8．其他费用	6.4.7.17	87,155.20	85,648.61
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**113,341,787.14**	**8,951,600.60**
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		**113,341,787.14**	**8,951,600.60**
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		113,341,787.14	8,951,600.60

6.3 净资产变动表

会计主体：中银沪深 300 指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	508,905,719.70	165,814,992.82	674,720,712.52
二、本期期初净资产	508,905,719.70	165,814,992.82	674,720,712.52
三、本期增减变动额（减少以	228,245,936.00	193,563,886.69	421,809,822.69

“-”号填列）			
（一）、综合收益总额	-	113,341,787.14	113,341,787.14
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	228,245,936.00	80,222,099.55	308,468,035.55
其中：1.基金申购款	777,487,012.47	284,213,603.75	1,061,700,616.22
2.基金赎回款	-549,241,076.47	-203,991,504.20	-753,232,580.67
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	737,151,655.70	359,378,879.51	1,096,530,535.21
项目	**上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日**		
	实收基金	**未分配利润**	**净资产合计**
一、上期期末净资产	737,879,300.41	110,352,229.15	848,231,529.56
二、本期期初净资产	737,879,300.41	110,352,229.15	848,231,529.56
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-282,528,427.73	-56,312,878.12	-338,841,305.85
（一）、综合收益总额	-	8,951,600.60	8,951,600.60
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-282,528,427.73	-36,746,887.56	-319,275,315.29
其中：1.基金申购款	77,935,919.92	8,925,053.54	86,860,973.46
2.基金赎回款	-360,464,347.65	-45,671,941.10	-406,136,288.75
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净	-	-28,517,591.16	-28,517,591.16

资产变动数（净资产减少以“-”号填列）			
四、本期期末净资产	455,350,872.68	54,039,351.03	509,390,223.71

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：陈卫星，主管会计工作负责人：宁瑞洁，会计机构负责人：乐妮

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中银沪深 300 指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)系由原中银量化价值混合型证券投资基金(以下简称“原基金”)转型而来。本基金的基金管理人为中银基金管理有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。原基金经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2017]941 号文《关于准予中银量化价值混合型证券投资基金注册的批复》核准，由基金管理人中银基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中银量化价值混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。原基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 333,694,725.60 元，业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2017)验字第 61062100_B14 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《中银量化价值混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 11 月 24 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 333,826,575.55 份基金份额，其中认购资金利息折合 131,849.95 份基金份额。

根据《中银量化价值混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效及决议生效后的基金转型安排的公告》，原中银量化价值混合型证券投资基金变更为中银沪深 300 指数增强型证券投资基金，修改后的《中银沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》自 2024 年 3 月 20 日起生效。

根据本基金的基金管理人中银基金管理有限公司于 2020 年 11 月 6 日发布的《关于中银量化价值混合型证券投资基金增加 C 类基金份额并修改基金合同及托管协议的公告》以及更新的《中银量化价值混合型证券投资基金基金合同》和《中银量化价值混合型证券投资基金托管协议》的有关规定，自 2020 年 11 月 6 日起，本基金增设 C 类基金份额。根据 2024 年 7 月 12 日发布的《中银基金

管理有限公司关于中银沪深300指数增强型证券投资基金增加E类基金份额并修改基金合同的公告》以及更新的《中银沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》和《中银沪深 300 指数增强型证券投资基金托管协议》的有关规定，自 2024 年 7 月 12 日起，本基金增设 E 类基金份额。本基金根据申购费、赎回费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者申购时收取申购费用、但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；在投资者申购时不收取申购费用，但从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 C 类、E 类基金份额。本基金 A 类基金份额、C 类基金份额和 E 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额、C 类基金份额和 E 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

本财务报表由本基金的基金管理人中银基金管理有限公司于 2026 年 8 月 28 日批准。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则－基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号 - 年度报告和中期报告》《证券投资基金会计核算业务指引》、《中银沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2026 年 1 月 1 日起至 2026 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

6.4.4.1会计年度

本期财务报表的实际编制期间系自 2026 年 1 月 1 日起至 2026 年 6 月 30 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

(1)金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

(2)金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑在资产负债表日无须付出不必要的额外成本和努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利

率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2)

实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

本基金参与的转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司(以下简称“证金公司”)出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息，以及出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为当期损益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称""指引"")，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566 号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税 [2004] 78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2012] 85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2015] 101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税 [2008] 1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016] 36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税 [2016] 140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税 [2017] 2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税 [2017] 56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023] 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部 税务总局公告 2024 年第 8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2025] 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

a) 本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照3%的规定征收率计算缴纳增值税。

本基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入，自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，免征增值税；对金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。本基金管理人运营本基金提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

b) 对本基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

对投资者从本基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

c) 对本基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对本基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

对本基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向本基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。

d) 本基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

e) 对本基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照本基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

6.4.7重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	142,031,537.53
等于：本金	142,024,269.82
加：应计利息	7,267.71
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-

加：应计利息	-
合计	142,031,537.53

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		854,147,329.39	-	935,185,999.07	81,038,669.68
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		854,147,329.39	-	935,185,999.07	81,038,669.68

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	97,532,640.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	97,532,640.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IF2607	IF2607	67.00	98,932,200.00	1,399,560.00

合计	-	-	-	1,399,560.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	1,399,560.00
净额	-	-	-	0.00

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	211.43
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	271,406.60
其中：交易所市场	271,406.60
银行间市场	-
应付利息	-
应付信息披露费	59,507.37
应付审计费	22,315.49
合计	353,440.89

6.4.7.7 实收基金

中银沪深 300 指数增强 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	
	基金份额	账面金额

上年度末	379,282,150.44	379,282,150.44
本期申购	137,494,396.05	137,494,396.05
本期赎回（以“-”号填列）	-220,479,852.96	-220,479,852.96
本期末	296,296,693.53	296,296,693.53

中银沪深 300 指数增强 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	77,900,383.13	77,900,383.13
本期申购	198,069,952.01	198,069,952.01
本期赎回（以“-”号填列）	-86,692,640.25	-86,692,640.25
本期末	189,277,694.89	189,277,694.89

中银沪深 300 指数增强 E

金额单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	51,723,186.13	51,723,186.13
本期申购	441,922,664.41	441,922,664.41
本期赎回（以“-”号填列）	-242,068,583.26	-242,068,583.26
本期末	251,577,267.28	251,577,267.28

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

中银沪深 300 指数增强 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	136,946,556.16	-11,331,558.58	125,614,997.58
本期期初	136,946,556.16	-11,331,558.58	125,614,997.58
本期利润	41,214,349.88	26,527,095.86	67,741,445.74
本期基金份额交易产生的	-36,447,494.56	-8,475,499.02	-44,922,993.58

变动数			
其中：基金申购款	56,555,414.59	-9,033,427.07	47,521,987.52
基金赎回款	-93,002,909.15	557,928.05	-92,444,981.10
本期已分配利润	-	-	-
本期末	141,713,411.48	6,720,038.26	148,433,449.74

中银沪深 300 指数增强 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	25,778,482.74	-2,291,936.68	23,486,546.06
本期期初	25,778,482.74	-2,291,936.68	23,486,546.06
本期利润	10,282,671.33	7,381,254.19	17,663,925.52
本期基金份额交易产生的变动数	47,732,861.16	-952,960.63	46,779,900.53
其中：基金申购款	79,247,612.44	-3,692,441.50	75,555,170.94
基金赎回款	-31,514,751.28	2,739,480.87	-28,775,270.41
本期已分配利润	-	-	-
本期末	83,794,015.23	4,136,356.88	87,930,372.11

中银沪深 300 指数增强 E

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	18,255,990.37	-1,542,541.19	16,713,449.18
本期期初	18,255,990.37	-1,542,541.19	16,713,449.18
本期利润	9,765,827.45	18,170,588.43	27,936,415.88
本期基金份额交易产生的变动数	89,381,357.33	-11,016,164.73	78,365,192.60
其中：基金申购款	185,762,035.21	-24,625,589.92	161,136,445.29
基金赎回款	-96,380,677.88	13,609,425.19	-82,771,252.69
本期已分配利润	-	-	-
本期末	117,403,175.15	5,611,882.51	123,015,057.66

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	99,980.55
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	101,514.54
其他	1,993.06
合计	203,488.15

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,165,461,171.77
减：卖出股票成本总额	1,111,776,009.53
减：交易费用	1,216,864.46
买卖股票差价收入	52,468,297.78

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	19,498.40
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-1,443.00
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	18,055.40

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	87,827,468.22
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	87,288,838.00
减：应计利息总额	540,073.22
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-1,443.00

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股指期货投资收益	4,831,626.58

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资产生的股利收益	6,618,992.61
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	6,618,992.61

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
1.交易性金融资产	51,157,607.63
——股票投资	51,157,607.63
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	921,330.85
——权证投资	-
——期货	921,330.85
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	52,078,938.48

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
基金赎回费收入	1,140,609.21
基金转换费收入	4,799.93
合计	1,145,409.14

6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
审计费用	22,315.49
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	5,332.34
合计	87,155.20

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中银基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
兴业银行股份有限公司(“兴业银行”)	基金托管人、基金销售机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金管理人的控股股东、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日

当期发生的基金应支付的管理费	2,894,679.69	2,740,998.55
其中：应支付销售机构的客户维护费	586,780.59	435,737.74
应支付基金管理人的净管理费	2,307,899.10	2,305,260.81

注：支付基金管理人的基金管理费按前一日基金资产净值 0.80%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金管理费=前一日基金资产净值×0.80%/当年天数

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	542,752.47	513,937.23

注：支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.15%/当年天数

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	中银沪深 300 指数增强 A	中银沪深 300 指数增强 C	中银沪深 300 指数增强 E	合计
中国银行	-	84,572.55	-	84,572.55
中银基金管理有限公司	-	64,468.02	16,813.22	81,281.24
合计	-	149,040.57	16,813.22	165,853.79
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	中银沪深 300 指数增强 A	中银沪深 300 指数增强 C	中银沪深 300 指数增强 E	合计
中国银行	-	23,525.16	-	23,525.16
中银基金管理有限公司	-	380,661.52	81.75	380,743.27
合计	-	404,186.68	81.75	404,268.43

注：基金销售服务费每日计提，按月支付。基金销售服务费可用于本基金的市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。本基金分为不同的类别，适用不同的销售服务费率。其中，A

类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%；E 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%。本基金 C/E 类销售服务费按前一日 C/E 类基金资产净值及各自年费率分别计提，计算方法如下：

日销售服务费＝前一日 C/E 类的基金资产净值 × 约定年费率/ 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人本报告期内及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行股份有限公司	142,031,537.53	99,980.55	60,047,910.58	86,870.90

注：本基金的活期银行存款由基金托管人兴业银行保管，按银行同业利率或协议利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间均未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688795	摩尔线程	2025-11-26	6 个月以上	新股锁定期内	114.28	676.94	1,624	185,590.72	1,099,350.56	-
688802	沐曦股份	2025-12-09	6 个月以上	新股锁定期内	104.66	768.89	1,165	121,928.90	895,756.85	-
301666	大普微	2026-04-08	1-6 个月（含）	新股锁定期内	46.08	463.33	836	38,522.88	387,343.88	-
001248	华润新能	2026-06-24	1 个月内（含）	新股未上市	10.11	10.11	35,491	358,814.01	358,814.01	-
688808	联讯仪器	2026-04-16	1-6 个月（含）	新股锁定期内	81.88	1,584.33	163	13,346.44	258,245.79	-
688781	视涯科技	2026-03-18	6 个月以上	新股锁定期内	22.68	42.16	4,865	110,338.20	205,108.40	-
688790	昂瑞微	2025-12-09	6 个月以上	新股锁定期内	83.06	126.45	1,275	105,901.50	161,223.75	-
688818	电科蓝天	2026-02-03	1-6 个月（含）	新股锁定期内	9.47	70.14	1,659	15,710.73	116,362.26	-
688820	盛合晶微	2026-04-13	1-6 个月（含）	新股锁定期内	19.68	141.49	813	15,999.84	115,031.37	-
001399	惠科股份	2026-06-16	1-6 个月	新股锁定	10.12	27.73	3,977	40,247.24	110,282.21	-

			（含）	期内						
688797	臻宝科技	2026-06-16	1-6 个月（含）	新股锁定期内	44.56	468.67	207	9,223.92	97,014.69	-
301682	宏明电子	2026-03-18	1-6 个月（含）	新股锁定期内	69.66	160.06	487	33,924.42	77,949.22	-
688712	北芯生命	2026-01-28	1-6 个月（含）	新股锁定期内	17.52	35.92	1,500	26,280.00	53,880.00	-
688785	恒运昌	2026-01-20	1-6 个月（含）	新股锁定期内	92.18	463.15	116	10,692.88	53,725.40	-
688635	长进光子	2026-05-20	1-6 个月（含）	新股锁定期内	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	-
001257	盛龙股份	2026-03-24	1-6 个月（含）	新股锁定期内	7.82	20.74	1,743	13,630.26	36,149.82	-
603459	红板科技	2026-03-31	1-6 个月（含）	新股锁定期内	17.70	84.32	330	5,841.00	27,825.60	-
001365	天海电子	2026-05-11	1-6 个月（含）	新股锁定期内	27.19	31.31	719	19,549.61	22,511.89	-
688811	有研复材	2026-04-01	1-6 个月（含）	新股锁定期内	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-
301696	三瑞智能	2026-03-31	1-6 个月（含）	新股锁定期内	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-
001237	惠康科技	2026-05-15	1-6 个月（含）	新股锁定期内	53.26	58.74	285	15,179.10	16,740.90	-
301669	高特电子	2026-06-02	1-6 个月（含）	新股锁定期内	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-
301687	新广益	2025-12-24	1-6 个月（含）	新股锁定期内	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-
001393	维通利	2026-05-08	1-6 个月（含）	新股锁定期内	30.38	38.99	387	11,757.06	15,089.13	-
30153	春光	2026-0	1-6 个	新股	13.30	51.56	290	3,857.	14,952	-

1	集团	4-28	月（含）	锁定期内				00	.40	
301599	理奇智能	2026-04-22	1-6 个月（含）	新股锁定期内	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	-
301680	固德电材	2026-02-27	1-6 个月（含）	新股锁定期内	58.00	112.16	117	6,786.00	13,122.72	-
301683	慧谷新材	2026-03-24	1-6 个月（含）	新股锁定期内	78.38	121.77	96	7,524.48	11,689.92	-
601112	振石股份	2026-01-21	1-6 个月（含）	新股锁定期内	11.18	17.59	576	6,439.68	10,131.84	-
688816	易思维	2026-02-04	1-6 个月（含）	新股锁定期内	55.95	57.10	177	9,903.15	10,106.70	-
603407	长裕集团	2026-04-29	1-6 个月（含）	新股锁定期内	13.86	73.46	137	1,898.82	10,064.02	-
301513	尚水智能	2026-04-10	1-6 个月（含）	新股锁定期内	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-
603435	嘉德利	2026-05-15	1-6 个月（含）	新股锁定期内	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603352	至信股份	2026-01-08	1-6 个月（含）	新股锁定期内	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-
603293	埃泰克	2026-04-09	1-6 个月（含）	新股锁定期内	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-
001312	福恩股份	2026-04-14	1-6 个月（含）	新股锁定期内	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	-
603284	林平发展	2026-02-03	1-6 个月（含）	新股锁定期内	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	-
001220	世盟股份	2026-01-27	1-6 个月（含）	新股锁定期内	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026-06-29	重大事项停牌	832.00	2026-07-13	890.99	3,004	2,075,305.85	2,499,328.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 日止，本基金未持有银行间市场债券正回购交易中作为质押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 日止，本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为质押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中面临的相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了包括风险管理委员会、风险管理与内部控制委员会、督察长、风险管理部、内控与法律合规部、审计部和相关业务部门构成的多级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理与内部控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征

通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指在履行以交付现金或其他金融资产的方式结算的义务时发生资金短缺的风险。对于本基金而言，体现在所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可在基金每个开放日要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。同时，对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

除本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节中所列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，本基金本报告期末的其他资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于本报告期末，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为六个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险 。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	142,031,537.53	-	-	-	142,031,537.53
结算备付金	55,011,248.15	-	-	-	55,011,248.15
存出保证金	455,705.49	-	-	11,871,864.00	12,327,569.49
交易性金融资产	-	-	-	935,185,999.07	935,185,999.07
应收清算款	-	-	-	244,731.12	244,731.12
应收申购款	-	-	-	35,786,863.53	35,786,863.53
资产总计	197,498,491.17	-	-	983,089,457.72	1,180,587,948.89
负债					
应付清算款	-	-	-	82,605,432.27	82,605,432.27
应付赎回款	-	-	-	205,350.77	205,350.77

应付管理人报酬	-	-	-	538,003.51	538,003.51
应付托管费	-	-	-	100,875.67	100,875.67
应付销售服务费	-	-	-	126,883.42	126,883.42
应交税费	-	-	-	127,427.15	127,427.15
其他负债	-	-	-	353,440.89	353,440.89
负债总计	-	-	-	84,057,413.68	84,057,413.68
利率敏感度缺口	197,498,491.17	-	-	899,032,044.04	1,096,530,535.21
上年度末 2025 年 12 月 31 日	**1 年以内**	**1-5 年**	**5 年以上**	**不计息**	**合计**
资产					
货币资金	53,796,809.16	-	-	-	53,796,809.16
结算备付金	12,786,094.42	-	-	-	12,786,094.42
存出保证金	238,926.19	-	-	2,161,411.20	2,400,337.39
交易性金融资产	-	-	-	621,776,616.99	621,776,616.99
应收申购款	-	-	-	9,858,602.48	9,858,602.48
资产总计	66,821,829.77	-	-	633,796,630.67	700,618,460.44
负债					
应付清算款	-	-	-	24,396,719.91	24,396,719.91
应付赎回款	-	-	-	714,096.77	714,096.77
应付管理人报酬	-	-	-	333,088.49	333,088.49
应付托管费	-	-	-	62,454.08	62,454.08
应付销售服务费	-	-	-	32,389.62	32,389.62
应交税费	-	-	-	7,493.48	7,493.48
其他负债	-	-	-	351,505.57	351,505.57
负债总计	-	-	-	25,897,747.92	25,897,747.92
利率敏感度缺口	66,821,829.77	-	-	607,898,882.75	674,720,712.52

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本报告期末，本基金持有的固定收益品种投资公允价值占基金净资产的比例低于 10%，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响（上年度末：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产－股票投资	935,185,999.07	85.29	621,776,616.99	92.15
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产－权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	935,185,999.07	85.29	621,776,616.99	92.15

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资(附注 7.4.7.3)。在当日无负债结算制度下，期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1.本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变；2.以下分析，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	1. 业绩比较基准上升 5%	增加约 5,625	增加约 3,374
	2. 业绩比较基准下降 5%	减少约 5,625	减少约 3,374

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	928,362,515.67	615,423,552.34
第二层次	2,858,142.01	4,300,664.20
第三层次	3,965,341.39	2,052,400.45
合计	935,185,999.07	621,776,616.99

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	935,185,999.07	79.21
	其中：股票	935,185,999.07	79.21
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	197,042,785.68	16.69
8	其他各项资产	48,359,164.14	4.10
9	合计	1,180,587,948.89	100.00

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票，本基金本报告期末未参与转融通证券出借业务。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 指数投资期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	1,672,522.00	0.15
B	采矿业	37,910,570.00	3.46
C	制造业	542,048,089.98	49.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	24,120,572.00	2.20
E	建筑业	8,303,776.00	0.76
F	批发和零售业	433,048.00	0.04
G	交通运输、仓储和邮政业	15,916,124.00	1.45
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	45,264,687.25	4.13
J	金融业	164,267,971.76	14.98
K	房地产业	988,830.00	0.09
L	租赁和商务服务业	1,858,853.00	0.17
M	科学研究和技术服务业	12,874,334.00	1.17
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	674,842.00	0.06
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	856,334,219.99	78.09

7.2.2 积极投资期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	36,149.82	0.00

C	制造业	65,727,722.81	5.99
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	358,814.01	0.03
E	建筑业	971,500.00	0.09
F	批发和零售业	4,770,000.00	0.44
G	交通运输、仓储和邮政业	724,021.46	0.07
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,853,805.00	0.53
J	金融业	-	-
K	房地产业	407,322.00	0.04
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	2,443.98	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	78,851,779.08	7.19

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	300308	中际旭创	40,640	51,612,800.00	4.71
2	300750	宁德时代	94,681	37,210,579.81	3.39
3	300502	新易盛	47,880	29,063,160.00	2.65
4	600519	贵州茅台	20,950	24,836,015.50	2.26
5	603986	兆易创新	28,400	23,146,000.00	2.11
6	600036	招商银行	561,200	19,922,600.00	1.82
7	601318	中国平安	350,100	16,713,774.00	1.52

8	688256	寒武纪	10,035	16,011,344.25	1.46
9	601899	紫金矿业	530,000	13,324,200.00	1.22
10	603259	药明康德	103,400	12,874,334.00	1.17
11	000333	美的集团	168,946	12,760,491.38	1.16
12	600030	中信证券	409,500	11,764,935.00	1.07
13	002371	北方华创	13,200	11,676,192.00	1.06
14	688008	澜起科技	37,400	11,590,260.00	1.06
15	002384	东山精密	43,700	11,464,695.00	1.05
16	002475	立讯精密	160,383	11,290,963.20	1.03
17	301308	江波龙	15,500	10,908,900.00	0.99
18	600900	长江电力	409,900	10,850,053.00	0.99
19	601398	工商银行	1,503,500	10,629,745.00	0.97
20	688981	中芯国际	65,100	10,339,182.00	0.94
21	688012	中微公司	22,059	10,334,641.50	0.94
22	688041	海光信息	27,585	10,214,725.50	0.93
23	000651	格力电器	239,900	8,996,250.00	0.82
24	601138	工业富联	122,500	8,838,375.00	0.81
25	600887	伊利股份	368,800	8,836,448.00	0.81
26	605117	德业股份	77,560	8,235,320.80	0.75
27	600183	生益科技	47,100	8,167,140.00	0.74
28	600150	中国船舶	237,700	8,031,883.00	0.73
29	600276	恒瑞医药	144,801	7,535,444.04	0.69
30	000725	京东方 A	851,900	7,394,492.00	0.67
31	601658	邮储银行	1,480,900	7,300,837.00	0.67
32	601995	中金公司	197,600	7,143,240.00	0.65
33	002415	海康威视	204,400	6,990,480.00	0.64
34	600522	中天科技	107,900	6,547,372.00	0.60
35	600941	中国移动	75,200	6,476,976.00	0.59
36	601688	华泰证券	310,200	6,396,324.00	0.58
37	601211	国泰海通	338,300	6,157,060.00	0.56
38	688521	芯原股份	16,300	6,049,582.00	0.55
39	601288	农业银行	984,000	5,972,880.00	0.54
40	601328	交通银行	913,500	5,873,805.00	0.54
41	600489	中金黄金	311,700	5,626,185.00	0.51
42	600919	江苏银行	502,800	5,420,184.00	0.49
43	300476	胜宏科技	15,300	5,300,379.00	0.48
44	300408	三环集团	31,500	5,257,350.00	0.48
45	000938	紫光股份	180,700	5,215,002.00	0.48
46	300274	阳光电源	32,200	5,120,444.00	0.47
47	600989	宝丰能源	247,300	5,027,609.00	0.46
48	002594	比亚迪	62,300	4,965,310.00	0.45
49	000338	潍柴动力	180,500	4,918,625.00	0.45
50	688111	金山办公	21,700	4,623,185.00	0.42
51	002463	沪电股份	29,600	4,522,880.00	0.41

52	300059	东方财富	221,700	4,518,246.00	0.41
53	000988	华工科技	23,800	4,393,718.00	0.40
54	300394	天孚通信	14,280	4,322,270.40	0.39
55	000657	中钨高新	44,300	4,240,396.00	0.39
56	603993	洛阳钼业	228,500	4,010,175.00	0.37
57	600019	宝钢股份	728,200	3,954,126.00	0.36
58	600000	浦发银行	456,000	3,926,160.00	0.36
59	601816	京沪高铁	793,100	3,592,743.00	0.33
60	002493	荣盛石化	327,500	3,520,625.00	0.32
61	002466	天齐锂业	55,400	3,397,128.00	0.31
62	002202	金风科技	142,100	3,396,190.00	0.31
63	002142	宁波银行	113,200	3,360,908.00	0.31
64	601601	中国太保	117,400	3,348,248.00	0.31
65	000001	平安银行	332,200	3,338,610.00	0.30
66	600089	特变电工	144,600	3,253,500.00	0.30
67	000807	云铝股份	144,200	3,192,588.00	0.29
68	002353	杰瑞股份	20,600	3,141,500.00	0.29
69	002916	深南电路	6,800	3,113,720.00	0.28
70	600886	国投电力	233,200	3,103,892.00	0.28
71	600547	山东黄金	133,000	3,070,970.00	0.28
72	600176	中国巨石	42,100	3,068,248.00	0.28
73	601229	上海银行	340,700	2,957,276.00	0.27
74	601939	建设银行	290,300	2,795,589.00	0.25
75	600549	厦门钨业	32,400	2,760,480.00	0.25
76	603019	中科曙光	25,600	2,745,088.00	0.25
77	600016	民生银行	850,000	2,737,000.00	0.25
78	003816	中国广核	694,300	2,714,713.00	0.25
79	600660	福耀玻璃	52,700	2,658,188.00	0.24
80	600584	长电科技	25,100	2,599,105.00	0.24
81	300124	汇川技术	38,600	2,560,338.00	0.23
82	600926	杭州银行	173,700	2,509,965.00	0.23
83	688072	拓荆科技	3,004	2,499,328.00	0.23
84	601169	北京银行	507,000	2,484,300.00	0.23
85	601668	中国建筑	566,700	2,459,478.00	0.22
86	000425	徐工机械	293,000	2,370,370.00	0.22
87	002028	思源电气	13,400	2,318,200.00	0.21
88	601088	中国神华	59,300	2,315,072.00	0.21
89	600690	海尔智家	110,500	2,255,305.00	0.21
90	600309	万华化学	32,900	2,250,689.00	0.21
91	601857	中国石油	255,300	2,216,004.00	0.20
92	600346	恒力石化	124,600	2,206,666.00	0.20
93	600111	北方稀土	44,300	2,128,615.00	0.19
94	000100	TCL 科技	364,300	2,120,226.00	0.19
95	601009	南京银行	211,700	2,093,713.00	0.19

96	000063	中兴通讯	56,400	2,041,116.00	0.19
97	601872	招商轮船	115,800	2,034,606.00	0.19
98	688396	华润微	20,800	2,029,040.00	0.19
99	601628	中国人寿	57,100	2,018,485.00	0.18
100	601225	陕西煤业	98,100	1,996,335.00	0.18
101	300433	蓝思科技	34,900	1,872,734.00	0.17
102	601818	光大银行	635,800	1,837,462.00	0.17
103	603288	海天味业	55,300	1,833,748.00	0.17
104	600031	三一重工	103,900	1,795,392.00	0.16
105	000538	云南白药	37,700	1,785,849.00	0.16
106	600938	中国海油	65,500	1,778,325.00	0.16
107	601117	中国化学	237,100	1,742,685.00	0.16
108	300014	亿纬锂能	26,600	1,729,798.00	0.16
109	002050	三花智控	39,200	1,718,136.00	0.16
110	002460	赣锋锂业	26,100	1,706,940.00	0.16
111	601336	新华保险	28,500	1,700,310.00	0.16
112	000792	盐湖股份	55,600	1,678,564.00	0.15
113	002714	牧原股份	47,800	1,672,522.00	0.15
114	002648	卫星化学	70,500	1,656,045.00	0.15
115	601919	中远海控	123,900	1,642,914.00	0.15
116	600406	国电南瑞	70,300	1,606,355.00	0.15
117	601838	成都银行	87,100	1,541,670.00	0.14
118	300033	同花顺	6,240	1,503,840.00	0.14
119	002001	新和成	52,720	1,498,302.40	0.14
120	601825	沪农商行	198,200	1,484,518.00	0.14
121	002602	世纪华通	103,300	1,456,530.00	0.13
122	601006	大秦铁路	312,600	1,441,086.00	0.13
123	600875	东方电气	50,000	1,438,500.00	0.13
124	600893	航发动力	37,200	1,426,248.00	0.13
125	601728	中国电信	272,000	1,411,680.00	0.13
126	603501	豪威集团	14,800	1,403,780.00	0.13
127	601012	隆基绿能	106,100	1,392,032.00	0.13
128	600015	华夏银行	217,800	1,391,742.00	0.13
129	600011	华能国际	182,000	1,381,380.00	0.13
130	002230	科大讯飞	33,700	1,376,308.00	0.13
131	600999	招商证券	65,000	1,371,500.00	0.13
132	601916	浙商银行	516,400	1,358,132.00	0.12
133	002352	顺丰控股	42,000	1,312,920.00	0.12
134	601985	中国核电	144,100	1,301,223.00	0.12
135	002709	天赐材料	25,000	1,285,750.00	0.12
136	002938	鹏鼎控股	12,200	1,285,636.00	0.12
137	603799	华友钴业	26,600	1,283,716.00	0.12
138	600026	中远海能	71,500	1,282,710.00	0.12
139	000977	浪潮信息	18,000	1,260,000.00	0.11

140	601998	中信银行	181,600	1,258,488.00	0.11
141	600160	巨化股份	23,600	1,251,036.00	0.11
142	601766	中国中车	235,200	1,223,040.00	0.11
143	000776	广发证券	51,700	1,209,780.00	0.11
144	300442	润泽科技	14,400	1,196,208.00	0.11
145	601390	中国中铁	282,400	1,177,608.00	0.11
146	688126	沪硅产业	28,900	1,152,821.00	0.11
147	601600	中国铝业	138,900	1,141,758.00	0.10
148	600028	中国石化	255,100	1,137,746.00	0.10
149	688082	盛美上海	2,600	1,123,200.00	0.10
150	600460	士兰微	20,400	1,115,064.00	0.10
151	688472	阿特斯	102,800	1,112,296.00	0.10
152	601077	渝农商行	181,700	1,110,187.00	0.10
153	002600	领益智造	64,000	1,109,760.00	0.10
154	600050	中国联通	273,600	1,094,400.00	0.10
155	300661	圣邦股份	7,600	1,090,448.00	0.10
156	002837	英维克	13,400	1,066,104.00	0.10
157	002049	紫光国微	11,931	1,058,876.25	0.10
158	002179	中航光电	22,300	1,030,260.00	0.09
159	601100	恒立液压	9,400	1,011,064.00	0.09
160	002625	光启技术	33,200	1,006,624.00	0.09
161	000568	泸州老窖	12,900	1,000,008.00	0.09
162	002241	歌尔股份	43,500	980,055.00	0.09
163	600188	兖矿能源	54,400	966,688.00	0.09
164	000408	藏格矿业	13,700	949,684.00	0.09
165	601689	拓普集团	16,700	942,214.00	0.09
166	002027	分众传媒	194,300	940,412.00	0.09
167	600809	山西汾酒	8,500	929,645.00	0.08
168	600905	三峡能源	250,300	928,613.00	0.08
169	600025	华能水电	103,800	922,782.00	0.08
170	601888	中国中免	17,100	918,441.00	0.08
171	000630	铜陵有色	140,800	895,488.00	0.08
172	600010	包钢股份	396,000	883,080.00	0.08
173	688271	联影医疗	8,700	880,701.00	0.08
174	000301	东方盛虹	76,900	880,505.00	0.08
175	601127	赛力斯	14,300	875,875.00	0.08
176	000617	中油资本	132,100	870,539.00	0.08
177	600958	东方证券	91,504	863,797.76	0.08
178	600118	中国卫星	10,400	853,320.00	0.08
179	600760	中航沈飞	19,900	817,890.00	0.07
180	000975	山金国际	47,800	812,600.00	0.07
181	600362	江西铜业	18,200	788,060.00	0.07
182	300450	先导智能	19,200	781,824.00	0.07
183	601727	上海电气	110,400	772,800.00	0.07

184	000708	中信特钢	60,900	768,558.00	0.07
185	688183	生益电子	5,800	767,920.00	0.07
186	600233	圆通速递	48,400	762,300.00	0.07
187	002422	科伦药业	19,500	751,140.00	0.07
188	600803	新奥股份	47,400	748,920.00	0.07
189	603296	华勤技术	10,020	744,185.40	0.07
190	601319	中国人保	109,300	738,868.00	0.07
191	601377	兴业证券	121,000	730,840.00	0.07
192	600795	国电电力	156,100	728,987.00	0.07
193	600585	海螺水泥	42,000	711,900.00	0.06
194	601669	中国电建	150,800	708,760.00	0.06
195	603893	瑞芯微	3,700	696,932.00	0.06
196	300316	晶盛机电	11,500	694,600.00	0.06
197	000166	申万宏源	157,800	694,320.00	0.06
198	300760	迈瑞医疗	5,100	692,733.00	0.06
199	300015	爱尔眼科	81,700	674,842.00	0.06
200	601698	中国卫通	22,200	671,550.00	0.06
201	601066	中信建投	22,800	662,796.00	0.06
202	601868	中国能建	244,800	653,616.00	0.06
203	600482	中国动力	19,900	652,720.00	0.06
204	002558	巨人网络	23,300	642,148.00	0.06
205	300418	昆仑万维	15,800	637,688.00	0.06
206	000625	长安汽车	87,000	623,790.00	0.06
207	600066	宇通客车	23,200	621,992.00	0.06
208	600426	华鲁恒升	25,900	619,528.00	0.06
209	002532	天山铝业	56,800	609,464.00	0.06
210	600221	海航控股	450,200	607,770.00	0.06
211	000157	中联重科	87,000	606,390.00	0.06
212	688036	传音控股	10,100	595,395.00	0.05
213	300803	指南针	6,400	586,688.00	0.05
214	605499	东鹏饮料	4,721	582,713.03	0.05
215	600048	保利发展	125,800	582,454.00	0.05
216	600741	华域汽车	37,300	578,896.00	0.05
217	600438	通威股份	47,300	572,803.00	0.05
218	600115	中国东航	149,100	568,071.00	0.05
219	002236	大华股份	34,300	565,607.00	0.05
220	600570	恒生电子	26,500	561,535.00	0.05
221	002736	国信证券	53,800	537,462.00	0.05
222	601360	三六零	61,300	532,697.00	0.05
223	601058	赛轮轮胎	46,100	531,533.00	0.05
224	002074	国轩高科	19,000	522,690.00	0.05
225	601901	方正证券	72,100	519,120.00	0.05
226	688047	龙芯中科	3,331	515,205.77	0.05
227	600009	上海机场	21,800	503,580.00	0.05

228	000768	中航西飞	24,400	499,712.00	0.05
229	601111	中国国航	81,700	494,285.00	0.05
230	601788	光大证券	34,200	493,506.00	0.05
231	600029	南方航空	94,400	488,992.00	0.04
232	601456	国联民生	55,000	486,200.00	0.04
233	600674	川投能源	34,100	483,197.00	0.04
234	600219	南山铝业	120,600	481,194.00	0.04
235	601186	中国铁建	80,600	479,570.00	0.04
236	601881	中国银河	38,100	478,917.00	0.04
237	601877	正泰电器	18,800	471,316.00	0.04
238	601898	中煤能源	38,000	462,840.00	0.04
239	301236	软通动力	10,900	462,705.00	0.04
240	600372	中航机载	42,400	460,040.00	0.04
241	601878	浙商证券	48,100	456,950.00	0.04
242	301269	华大九天	3,800	453,796.00	0.04
243	000963	华东医药	15,400	433,048.00	0.04
244	002920	德赛西威	5,200	423,800.00	0.04
245	601800	中国交建	73,500	419,685.00	0.04
246	688506	百利天恒	1,400	411,642.00	0.04
247	000895	双汇发展	18,200	407,680.00	0.04
248	001979	招商蛇口	63,200	406,376.00	0.04
249	300866	安克创新	3,800	397,100.00	0.04
250	601021	春秋航空	8,600	391,988.00	0.04
251	002311	海大集团	8,400	374,724.00	0.03
252	600023	浙能电力	70,400	370,304.00	0.03
253	600039	四川路桥	45,700	357,374.00	0.03
254	688223	晶科能源	72,000	342,000.00	0.03
255	601633	长城汽车	21,900	330,471.00	0.03
256	001965	招商公路	35,700	327,012.00	0.03
257	600027	华电国际	69,200	307,940.00	0.03
258	601618	中国中冶	125,000	305,000.00	0.03
259	300628	亿联网络	8,900	300,998.00	0.03
260	603260	合盛硅业	6,200	299,212.00	0.03
261	302132	中航成飞	5,100	297,432.00	0.03
262	600918	中泰证券	55,500	295,260.00	0.03
263	600061	国投资本	44,800	293,440.00	0.03
264	600930	华电新能	58,400	278,568.00	0.03
265	601059	信达证券	17,000	275,230.00	0.03
266	000999	华润三九	11,700	263,133.00	0.02
267	600018	上港集团	53,100	250,632.00	0.02
268	688009	中国通号	45,300	215,628.00	0.02
269	601018	宁波港	68,100	214,515.00	0.02
270	688303	大全能源	11,200	195,216.00	0.02
271	001280	中国铀业	2,900	193,430.00	0.02

272	301165	锐捷网络	2,300	185,035.00	0.02
273	601136	首创证券	9,500	132,525.00	0.01
274	000858	五粮液	57	4,218.00	0.00

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	300223	北京君正	26,500	6,595,850.00	0.60
2	001309	德明利	6,100	5,751,690.00	0.52
3	688525	佰维存储	9,700	4,798,881.00	0.44
4	301536	星宸科技	37,200	4,788,012.00	0.44
5	300475	香农芯创	15,900	4,770,000.00	0.44
6	688235	百济神州	15,641	3,982,355.01	0.36
7	688498	源杰科技	1,900	3,583,400.00	0.33
8	600685	中船防务	113,400	2,884,896.00	0.26
9	300857	协创数据	8,020	2,725,998.00	0.25
10	002414	高德红外	138,600	1,837,836.00	0.17
11	603124	江南新材	8,900	1,664,122.00	0.15
12	603444	吉比特	4,200	1,505,364.00	0.14
13	300285	国瓷材料	12,900	1,331,022.00	0.12
14	301377	鼎泰高科	2,400	1,322,160.00	0.12
15	688257	新锐股份	11,800	1,202,420.00	0.11
16	688795	摩尔线程	1,624	1,099,350.56	0.10
17	000951	中国重汽	49,900	973,549.00	0.09
18	605289	罗曼股份	6,700	971,500.00	0.09
19	301086	鸿富瀚	4,500	941,760.00	0.09
20	601233	桐昆股份	43,400	939,610.00	0.09
21	688045	必易微	11,600	937,048.00	0.09
22	001389	广合科技	3,800	901,550.00	0.08
23	603049	中策橡胶	20,000	896,200.00	0.08
24	688802	沐曦股份	1,165	895,756.85	0.08
25	002245	蔚蓝锂芯	47,748	893,365.08	0.08
26	688777	中控技术	7,500	881,250.00	0.08
27	603195	公牛集团	20,800	814,320.00	0.07
28	002111	威海广泰	89,200	802,800.00	0.07
29	300782	卓胜微	7,300	799,934.00	0.07
30	688515	裕太微	3,200	796,032.00	0.07
31	688017	绿的谐波	1,900	793,934.00	0.07
32	688768	容知日新	14,000	721,560.00	0.07
33	688449	联芸科技	8,100	699,111.00	0.06
34	300054	鼎龙股份	6,300	667,611.00	0.06

35	600487	亨通光电	6,000	656,040.00	0.06
36	688766	普冉股份	800	613,280.00	0.06
37	002636	金安国纪	4,900	587,853.00	0.05
38	688120	华海清科	1,820	586,367.60	0.05
39	601298	青岛港	71,800	577,990.00	0.05
40	301217	铜冠铜箔	3,500	577,745.00	0.05
41	603268	松发股份	3,700	515,336.00	0.05
42	688536	思瑞浦	1,400	509,726.00	0.05
43	301349	信德新材	6,600	485,760.00	0.04
44	688653	康希通信	27,800	483,164.00	0.04
45	301358	湖南裕能	6,000	455,220.00	0.04
46	688002	睿创微纳	2,800	433,132.00	0.04
47	301511	德福科技	3,000	431,550.00	0.04
48	688090	瑞松科技	4,030	428,993.50	0.04
49	300870	欧陆通	1,200	414,828.00	0.04
50	601155	新城控股	39,700	407,322.00	0.04
51	688800	瑞可达	4,200	403,074.00	0.04
52	002379	宏桥控股	26,800	395,836.00	0.04
53	301666	大普微	836	387,343.88	0.04
54	001248	华润新能	35,491	358,814.01	0.03
55	300390	天华新能	3,300	308,583.00	0.03
56	688571	杭华股份	32,093	280,813.75	0.03
57	688301	奕瑞科技	2,240	277,760.00	0.03
58	601869	长飞光纤	500	272,950.00	0.02
59	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.02
60	688619	罗普特	15,600	253,188.00	0.02
61	688700	东威科技	2,800	250,320.00	0.02
62	688781	视涯科技	4,865	205,108.40	0.02
63	600271	航天信息	26,500	174,370.00	0.02
64	688719	爱科赛博	2,100	161,700.00	0.01
65	688790	昂瑞微	1,275	161,223.75	0.01
66	601107	四川成渝	29,600	144,448.00	0.01
67	688818	电科蓝天	1,659	116,362.26	0.01
68	688820	盛合晶微	813	115,031.37	0.01
69	001399	惠科股份	3,977	110,282.21	0.01
70	688692	达梦数据	400	97,716.00	0.01
71	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.01
72	688809	强一股份	135	84,105.00	0.01
73	301682	宏明电子	487	77,949.22	0.01
74	301317	鑫磊股份	1,100	61,732.00	0.01
75	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.00
76	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.00
77	688635	长进光子	128	39,448.32	0.00
78	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.00

79	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
80	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
81	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
82	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
83	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
84	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
85	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
86	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
87	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
88	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
89	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
90	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
91	601112	振石股份	576	10,131.84	0.00
92	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
93	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
94	001369	双欣材料	713	9,639.76	0.00
95	688169	石头科技	100	9,497.00	0.00
96	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
97	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
98	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
99	001396	誉帆科技	69	2,443.98	0.00
100	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
101	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
102	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
103	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占**期初**基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	37,164,854.00	5.51
2	300308	中际旭创	30,368,207.90	4.50
3	600519	贵州茅台	26,216,438.50	3.89
4	600036	招商银行	21,583,043.00	3.20
5	300502	新易盛	20,711,231.20	3.07
6	601899	紫金矿业	17,830,935.00	2.64
7	601318	中国平安	17,351,559.56	2.57
8	000333	美的集团	14,858,563.00	2.20
9	603986	兆易创新	13,647,529.00	2.02
10	600887	伊利股份	12,857,674.00	1.91

11	688256	寒武纪	12,359,921.37	1.83
12	688008	澜起科技	11,317,787.50	1.68
13	600030	中信证券	11,289,861.00	1.67
14	603259	药明康德	11,215,274.00	1.66
15	600900	长江电力	10,972,452.00	1.63
16	601995	中金公司	10,728,843.00	1.59
17	601138	工业富联	10,586,528.00	1.57
18	000651	格力电器	10,541,966.00	1.56
19	600150	中国船舶	10,456,210.05	1.55
20	002475	立讯精密	10,360,889.00	1.54

注：“买入金额”按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占**期初**基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	26,828,753.00	3.98
2	300308	中际旭创	20,929,975.00	3.10
3	600519	贵州茅台	19,225,643.50	2.85
4	600036	招商银行	17,230,673.00	2.55
5	601899	紫金矿业	15,829,234.60	2.35
6	300502	新易盛	14,820,617.29	2.20
7	601318	中国平安	14,046,902.00	2.08
8	000333	美的集团	12,175,357.50	1.80
9	002916	深南电路	11,666,456.60	1.73
10	688256	寒武纪	10,736,362.85	1.59
11	002028	思源电气	10,332,612.00	1.53
12	600276	恒瑞医药	9,812,076.00	1.45
13	600183	生益科技	9,720,893.20	1.44
14	600030	中信证券	9,706,429.65	1.44
15	300274	阳光电源	9,464,729.00	1.40
16	002475	立讯精密	9,416,671.00	1.40
17	603993	洛阳钼业	9,056,211.00	1.34
18	601138	工业富联	9,031,380.00	1.34
19	002594	比亚迪	8,839,490.00	1.31
20	000338	潍柴动力	8,700,448.00	1.29

注：“卖出金额”按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	1,374,027,783.98
卖出股票的收入（成交）总额	1,165,461,171.77

注："买入股票成本"、"卖出股票收入"均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

基金参与股指期货交易，应当根据风险管理的原则，以套期保值为目。在此基础上，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，以提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

基金参与国债期货交易，应当根据风险管理的原则，以套期保值为目。基金管理人将充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征， 在风险可控的前提下， 适度参与国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金报告期内未参与国债期货投资，无相关投资评价。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	12,327,569.49
2	应收清算款	244,731.12
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	35,786,863.53
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	48,359,164.14

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算中四舍五入的原因，本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
中银沪深 300 指数增强 A	2,618	113,176.74	244,864,961.15	82.6418%	51,431,732.38	17.3582%
中银沪深 300 指数增强 C	972	194,730.14	161,646,502.22	85.4018%	27,631,192.67	14.5982%
中银沪深 300 指数增强 E	477	527,415.65	251,009,793.10	99.7744%	567,474.18	0.2256%
合计	4,067	181,251.94	657,521,256.47	89.1976%	79,630,399.23	10.8024%

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.2 盈利投资者数量占比

本基金不适用相关披露要求。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	中银沪深 300 指数增强 A	393,735.78	0.1329%
	中银沪深 300 指数增强 C	91,828.94	0.0485%

	中银沪深 300 指数增强 E	561.99	0.0002%
	合计	486,126.71	0.0659%

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	中银沪深 300 指数增强 A	10~50
	中银沪深 300 指数增强 C	0
	中银沪深 300 指数增强 E	0~10
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	中银沪深 300 指数增强 A	0~10
	中银沪深 300 指数增强 C	0
	中银沪深 300 指数增强 E	0~10
	合计	0~10

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中银沪深 300 指数增强 A	中银沪深 300 指数增强 C	中银沪深 300 指数增强 E
基金合同生效日（2017 年 11 月 24 日）基金份额总额	178,937,583.46	120,392,187.76	-
本报告期期初基金份额总额	379,282,150.44	77,900,383.13	51,723,186.13
本报告期基金总申购份额	137,494,396.05	198,069,952.01	441,922,664.41
减：本报告期基金总赎回份额	220,479,852.96	86,692,640.25	242,068,583.26

本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	296,296,693.53	189,277,694.89	251,577,267.28

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，经董事会决议通过，邢科先生不再担任公司联席投资总监（固定收益），详情请参见基金管理人 2026 年 1 月 15 日刊登的《中银基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告》。

报告期内托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的，与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内没有改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，管理人没有受到调查或处罚。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，管理人相关从业人员没有受到调查或处罚。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

报告期内，本基金托管人在开展基金托管业务过程中无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

报告期内，本基金托管人相关从业人员在开展基金托管业务过程中无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国信证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	3	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
国泰海通	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券	2	1,402,722,822.62	55.30%	260,767.83	55.32%	-
中信证券股份有限公司	1	1,131,956,500.95	44.63%	210,428.06	44.64%	-
广发证券	2	1,750,086.61	0.07%	201.32	0.04%	-

注：1、研究部根据相关标准，遴选符合条件的证券公司，详细说明评价依据及入库理由后提出建议，报公司投资决策委员会审议同意，形成公司合作券商库；选择合作券商的标准如下：（1）能全面贯彻落实中央金融工作会议精神和国务院发布的《关于加强监管防范风险推动资本市场高质量发展的若干意见》（国发<2024>10 号），坚守资本市场工作的政治性和人民性，在服务国家重大战略和推动经济社会高质量发展中实现资本市场稳定健康发展；（2）严格遵守国家法律法规和监管规定，建立完善的内控管理体系和有效的风险隔离制度，合法合规经营；（3）公司财务状况良好；（4）上市证券公司优先；（5）最近一年未受到暂停开展证券投资咨询业务的监管处罚；（6）应有专门的对买方机构提供研究服务的研究部门，研究领域全面，研究实力行业排名前列，研究工作流程规范，研究服务意识强，有专门的交易单元；（7）证券交易服务能力强，能够提供安全、便捷、优质的证券交易服务。

2、合作券商库形成后，应保持动态维护：（1）定期调整。每年应至少重检一次，研究部负责全面重新评估本年度合作券商库，根据以上标准进行评估，并报公司投资决策委员会审议同意。（2）不定期调整。年内如库中证券公司发生不宜合作的重大事件（如重大合规风险事件或重大经营变化、

重大人员调整），研究部应及时报公司投资决策委员会审议同意后将该券商剔除出库；年内确有必要在库中调整合作券商的，研究部亦需详细说明理由，报公司投资决策委员会审议同意后方可入库。

3、证券交易单元的租用及变更：所有新租用的交易单元必须从合作券商库中选择；当需要租用新交易单元时，交易部负责发起申请，经相关部门及领导审批同意方可执行，需详细说明新增交易单元的理由，申请通过后，由交易部牵头与证券公司签署《交易单元租用协议》，首次签约的证券公司还须同时签订《研究服务协议》。研究部等投研相关部门可根据证券公司对公司投资研究的服务情况和合作意向，发起交易单元增加、更换或终止的申请；交易部可根据每季度证券公司交易单元实际交易量，发起交易单元的增加、更换或终止的申请；经相关部门及领导审批同意后，由交易部牵头办理交易单元增加、更换或终止的相关手续，并及时通知基金运营部。

4、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：无。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国信证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	174,576,233.00	100.00%	213,000,000.00	100.00%	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中银基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证监会规定媒介	2026-01-15
2	中银沪深 300 指数增强型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2026-01-22
3	中银基金管理有限公司关于旗下产品信息服务方式的公告	中国证监会规定媒介	2026-03-18
4	中银基金管理公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）	中国证监会规定媒介	2026-03-31
5	中银沪深 300 指数增强型证券投资基金 2025 年年度报告	中国证监会规定媒介	2026-03-31
6	中银沪深 300 指数增强型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2026-04-22
7	2025 年度公募基金管理人以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	中国证监会规定媒介	2026-04-29
8	中银基金管理有限公司关于开展电子直销平台费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2026-05-06
9	中银沪深 300 指数增强型证券投资基金（中银沪深 300 指数增强 A）产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2026-05-20
10	中银沪深 300 指数增强型证券投资基金（中银沪深 300 指数增强 C）产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2026-05-20
11	中银沪深 300 指数增强型证券投资基金（中银沪深 300 指数增强 E）产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2026-05-20
12	中银沪深 300 指数增强型证券投资基金更新招募说明书（2026 年第 1 号）	中国证监会规定媒介	2026-05-20
13	中银基金管理有限公司关于旗下部分基金估值变更的提示性公告	中国证监会规定媒介	2026-06-19
14	中银基金管理有限公司关于旗下部分基金估值变更的提示性公告	中国证监会规定媒介	2026-06-24

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20260116-20260323	88,202,748.10	90,352,519.22	88,202,748.10	90,352,519.22	12.2570%
产品特有风险							

本基金由于存在上述单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况，存在以下特有风险：（1）持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大额赎回导致的基金份额净值波动风险；（2）持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大额赎回导致的流动性风险；（3）持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大额赎回导致的巨额赎回风险；（4）持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大额赎回导致的基金资产净值持续低于5000万元的风险。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

、中国证监会准予中银量化价值混合型证券投资基金变更注册为中银沪深 300 指数增强型证券投资基金的文件；

2、《中银沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》；

3、《中银沪深 300 指数增强型证券投资基金托管协议》；

4、关于申请中银量化价值混合型证券投资基金变更注册为中银沪深 300 指数增强型证券投资基金之法律意见书；

5、基金管理人业务资格批件、营业执照；

6、基金托管人业务资格批件、营业执照；

7、中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

以上备查文件存放在基金管理人、基金托管人所在地，供公众查阅。

12.3 查阅方式

投资人在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件。

中银基金管理有限公司

二〇二六年八月三十一日