

---

中银沪深 300 指数增强型证券投资基金  
(原中银量化价值混合型证券投资基金)  
2024 年第 1 季度报告  
2024 年 3 月 31 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：二〇二四年四月十九日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 4 月 18 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。其中，2024 年 3 月 20 日起，“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”，基金合同及托管协议即日生效。

## § 2 基金产品概况

### 2.1 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	2024 年 3 月 20 日
报告期末基金份额总额	300,771,990.64 份
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

	<p>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。</p> <p>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。</p>	
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	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等风险水平的投资品种。	
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	
下属两级基金的基金简称	中银沪深 300 指数增强 A	中银沪深 300 指数增强 C
下属两级基金的交易代码	004881	010311
报告期末下属两级基金的份额总额	179,142,624.02 份	121,629,366.62 份

## 2.2 中银量化价值混合型证券投资基金

基金简称	中银量化价值混合
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
报告期末基金份额总额	299,329,771.22 份
投资目标	本基金通过量化投资模型精选个股，在严格控制风险的前提下，追求基金资产的长期稳定增值，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金建立数量化投资策略投资模型，将投资思想通过具体指标、参数的确定体现在模型中，在投资过程中充分发挥数量化投资纪律严格、投资视野宽阔、风险水平可控等优势，切实贯彻自上而下的资产配置和自下而上的个股精选的投资策略，以保证在控制风险的前提下实现收益最大化。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×80% + 中债综合指数收益率×20%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平

	高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等风险水平的投资品种。	
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	
下属两级基金的基金简称	中银量化价值混合 A	中银量化价值混合 C
下属两级基金的交易代码	004881	010311
报告期末下属两级基金的份额总额	178,937,583.46 份	120,392,187.76 份

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

##### 3.1.1 中银沪深 300 指数增强型证券投资基金

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2024 年 3 月 20 日 (基金合同生效日) -2024 年 3 月 31 日)	
	中银沪深 300 指数增强 A	中银沪深 300 指数增强 C
1.本期已实现收益	170,853.22	97,119.55
2.本期利润	627,432.39	410,467.01
3.加权平均基金份额本期利润	0.0035	0.0034
4.期末基金资产净值	188,933,930.31	126,427,243.97
5.期末基金份额净值	1.0547	1.0394

注：1、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。

2、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。

3、本基金于 2024 年 3 月 20 日转型为中银沪深 300 指数增强型证券投资基金。

### 3.1.2 中银量化价值混合型证券投资基金

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2024年1月1日-2024年3月19日)	
	中银量化价值混合 A	中银量化价值混合 C
1.本期已实现收益	-2,573,476.40	-477,899.03
2.本期利润	7,975,009.79	5,997,207.55
3.加权平均基金份额本期利润	0.0455	0.0662
4.期末基金资产净值	188,092,115.88	124,742,778.41
5.期末基金份额净值	1.0512	1.0361

注：1、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。

2、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。

3、本基金由原中银量化价值混合型证券投资基金于2024年3月20日转型而来，截止报告期末未满一季度。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 中银沪深300指数增强型证券投资基金

（报告期：2024年3月20日-2024年3月31日）

#### 3.2.1.1 本报告期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

##### 1. 中银沪深300指数增强 A:

阶段	净值增长率 ①	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
自基金合同 生效日起	0.33%	0.56%	-1.06%	0.61%	1.39%	-0.05%

##### 2. 中银沪深300指数增强 C:

阶段	份额净值增	份额净值增	业绩比较基	业绩比较基	①-③	②-④
----	-------	-------	-------	-------	-----	-----

	长率①	长率标准差 ②	准收益率③	准收益率标 准差④		
自基金合同 生效日起	0.32%	0.56%	-1.06%	0.61%	1.38%	-0.05%

### 3.2.1.2 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的历史走势对比图

(2024 年 3 月 20 日至 2024 年 3 月 31 日)

#### 1、中银沪深 300 指数增强 A



#### 2、中银沪深 300 指数增强 C



注：截至报告期末，本基金转型未满一年。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，截至报告期末，本基金尚在建仓期内。

### 3.2.2 中银量化价值混合型证券投资基金

(报告期：2024年1月1日-2024年3月19日)

#### 3.2.2.1 本报告期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 1. 中银量化价值混合 A:

阶段	净值增长率 ①	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	4.24%	0.94%	3.72%	0.86%	0.52%	0.08%
过去六个月	-1.49%	0.78%	-1.94%	0.75%	0.45%	0.03%
过去一年	-6.37%	0.76%	-8.76%	0.72%	2.39%	0.04%
自基金合同 生效日起	15.12%	1.09%	-6.44%	0.98%	21.56%	0.11%

#### 2. 中银量化价值混合 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	4.15%	0.94%	3.72%	0.86%	0.43%	0.08%
过去六个月	-1.68%	0.78%	-1.94%	0.75%	0.26%	0.03%

过去一年	-6.74%	0.76%	-8.76%	0.72%	2.02%	0.04%
自基金合同生效日起	-18.77%	1.73%	-20.42%	0.88%	1.65%	0.85%

### 3.2.2.2 自基金合同生效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

中银量化价值混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2017年11月24日至2024年3月19日)

#### 1、中银量化价值混合 A



#### 2、中银量化价值混合 C



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 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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	-	19	中银基金管理有限公司助理副总裁（AVP），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月至今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月至今任中银新回报基金（原中银保本二号）基金经理，2023年10月至今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月至今任中银中证1000基金基金经理，2023年12月至今任中银中证500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合规守信情况的说明

本报告期内，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 公平交易专项说明

### 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，本报告期内未发生异常交易行为。

### 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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

#### 一、宏观经济、行情回顾与运作分析

##### 1. 宏观经济分析

国外经济方面，一季度全球发达国家通胀压力缓解，经济表现有所分化，货币政策转向在即。美国经济维持韧性，通胀水平继续回落，2月CPI同比较2023年12月回落0.2个百分点至3.2%，就业市场边际降温，2月失业率较2023年12月抬升0.2个百分点至3.9%，3月制造业PMI较2023年12月抬升3.2个百分点至50.3%，2月服务业PMI较2023年12月抬升2.1个百分点至52.6%。美联储2月与3月均未调整政策利率，3月点阵图显示年内3次降息预期。欧元区经济表现延续分化，1月失业率较2023年12月抬升0.1个百分点至6.0%，3月

---

制造业 PMI 较 2023 年 12 月抬升 1.7 个百分点至 46.1%，3 月服务业 PMI 较 2023 年 12 月抬升 2.3 个百分点至 51.1%，欧央行一季度亦皆维持政策利率不变。日本经济呈现向好趋势，通胀水平回升，2 月 CPI 同比较 2023 年 12 月抬升 0.2 个百分点至 2.8%，3 月制造业 PMI 较 2023 年 12 月抬升 0.3 个百分点至 48.2%，3 月服务业 PMI 较 2023 年 12 月抬升 2.6 个百分点至 54.1%，日央行或将退出负利率政策。综合来看，美国和日本经济动能整体强于欧洲，主要经济体货币政策或在年内迎来转向。

国内经济方面，国内经济基本面有所回暖，消费增速回落，投资增速有所回升，出口韧性仍强，地产延续负增长，经济动能边际增强，CPI 由负转正而 PPI 仍居负值区间。具体来看，一季度领先指标中采制造业 PMI 波动回升至荣枯线上方，3 月值较 2023 年 12 月值回升 1.8 个百分点至 50.8%，同步指标工业增加值 1-2 月累计同比增长 7.0%，较 2023 年 12 月回升 2.4 个百分点。从经济增长动力来看，出口增速持续正增长，消费同比增速有所回落，投资增速边际回升：2 月美元计价出口增速自 2023 年 12 月抬升 3.4 个百分点至 5.6%，1-2 月社会消费品零售总额增速较 2023 年 12 月回落 1.9 个百分点至 5.5%，基建投资有所放缓，制造业投资边际走强，房地产投资延续负增长，1-2 月固定资产投资增速较 2023 年 1-12 月抬升 1.2 个百分点至 4.2%的水平。通胀方面，CPI 由负转正，2 月同比增速从 2023 年 12 月的-0.3%抬升 1.0 个百分点至 0.7%，PPI 继续处于负值区间，2 月同比增速与 2023 年 12 月持平于-2.7%。

## 2. 市场回顾

股票市场方面，一季度市场上证指数宽幅震荡，不同宽基指数分化较大。一季度上证综指上涨 2.23%，中证 100 上涨 3.4%，沪深 300 上涨 3.1%，中证 500 下跌 2.64%，中证 1000 下跌 7.58%，中证 2000 上涨 11.05%，创业板指数下跌 3.87%，中证红利指数上涨 8.27%。一季度行业分化较大，中信一级行业石油石化上涨 12.05%，家电上涨 10.79%，银行上涨 10.78%，煤炭上涨 10.23%；与此同时中信一级行业综合下跌 15.69%，医药下跌 11.85%，消费者服务下跌 11.2%，电子下跌 10.18%。

## 3. 运行分析

一季度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

#### 4.4.2.1 中银沪深 300 指数增强型证券投资基金

报告期内，本基金 A 类份额净值增长率为 0.33%，同期业绩比较基准收益率为-1.06%。

报告期内，本基金 C 类份额净值增长率为 0.32%，同期业绩比较基准收益率为-1.06%。

#### 4.4.2 中银量化价值混合型证券投资基金

报告期内，本基金 A 类份额净值增长率为 4.24%，同期业绩比较基准收益率为 3.72%。

报告期内，本基金 C 类份额净值增长率为 4.15%，同期业绩比较基准收益率为 3.72%。

#### 4.4.3 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

### 5.1 中银沪深 300 指数增强型证券投资基金

(报告期：2024年3月20日-2024年3月31日)

#### 5.1.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	287,136,302.89	90.86
	其中：股票	287,136,302.89	90.86
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	26,370,738.05	8.34
7	其他各项资产	2,525,714.39	0.80

8	合计	316,032,755.33	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。

## 5.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.1.2.1 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	-	-
B	采矿业	16,838,791.28	5.34
C	制造业	132,250,448.75	41.94
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,286,939.00	3.90
E	建筑业	6,876,365.00	2.18
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	4,968,583.00	1.58
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,904,216.56	3.77
J	金融业	61,869,564.00	19.62
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	2,992,388.00	0.95
M	科学研究和技术服务业	2,770.80	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	249,990,066.39	79.27

#### 5.1.2.2 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	632,790.00	0.20
C	制造业	25,232,353.20	8.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,089,207.00	0.35
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	536,448.00	0.17
G	交通运输、仓储和邮政业	1,589,572.65	0.50
H	住宿和餐饮业	385,020.00	0.12
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,210,046.70	0.70
J	金融业	51,192.00	0.02
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	907,292.40	0.29
M	科学研究和技术服务业	1,300,714.29	0.41
N	水利、环境和公共设施管理业	3,354.26	0.00
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	3,208,246.00	1.02
S	综合	-	-
	合计	37,146,236.50	11.78

#### 5.1.2.3 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。

### 5.1.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

#### 5.1.3.1 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前十名股票投资明细

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	600519	贵州茅台	10,000	17,029,000.00	5.40
2	300750	宁德时代	51,180	9,732,388.80	3.09
3	601318	中国平安	173,100	7,064,211.00	2.24
4	600036	招商银行	202,600	6,523,720.00	2.07
5	000858	五粮液	35,300	5,418,903.00	1.72
6	601658	邮储银行	998,600	4,743,350.00	1.50
7	601398	工商银行	862,900	4,556,112.00	1.44
8	600887	伊利股份	161,600	4,508,640.00	1.43
9	002371	北方华创	14,700	4,492,320.00	1.42
10	000333	美的集团	66,300	4,257,786.00	1.35

#### 5.1.3.2 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前五名股票投资明细

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	688349	三一重能	103,117	2,843,966.86	0.90
2	600737	中粮糖业	212,200	2,037,120.00	0.65
3	300442	润泽科技	63,900	1,981,539.00	0.63
4	600801	华新水泥	132,800	1,814,048.00	0.58
5	603228	景旺电子	78,100	1,545,599.00	0.49

### 5.1.4 报告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。

### 5.1.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

### 5.1.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

### 5.1.7 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。

### 5.1.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 5.1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 5.1.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量	合约市值 (元)	公允价值 变动(元)	风险说明
IF2404	IF2404	6.00	6,363,720.00	-94,560.00	-
公允价值变动总额合计(元)					-94,560.00
股指期货投资本期收益(元)					959,700.54
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-94,560.00

#### 5.1.9.2 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。

### 5.1.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 5.1.10.1 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。

#### 5.1.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未参与国债期货投资。

#### 5.1.10.3 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。

### 5.1.11 投资组合报告附注

5.1.11.1 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。

5.1.11.2 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。

#### 5.1.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	971,830.11
2	应收证券清算款	309,116.44
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,244,767.84
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,525,714.39

#### 5.1.11.4 报告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。

#### 5.1.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 5.1.11.6 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中不存在流通受限的情况。

#### 5.1.11.7 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。

#### 5.1.11.8 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。

## 5.2 中银量化价值混合型证券投资基金

(报告期: 2024年1月1日-2024年3月19日)

### 5.2.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	281,736,371.98	88.48
	其中: 股票	281,736,371.98	88.48
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	18,291,116.16	5.74
	其中: 债券	18,291,116.16	5.74
	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	12,468,340.08	3.92
7	其他各项资产	5,912,467.59	1.86
8	合计	318,408,295.81	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。

### 5.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.2.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	16,596,050.04	5.31
C	制造业	153,186,093.23	48.97
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,208,141.00	4.22
E	建筑业	7,768,071.00	2.48
F	批发和零售业	340,707.00	0.11
G	交通运输、仓储和邮政业	6,404,716.15	2.05

H	住宿和餐饮业	406,620.00	0.13
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,060,245.68	4.49
J	金融业	62,085,666.63	19.85
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	4,103,765.23	1.31
M	科学研究和技术服务业	952,991.62	0.30
N	水利、环境和公共设施管理业	3,564.40	0.00
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	2,619,740.00	0.84
S	综合	-	-
	合计	281,736,371.98	90.06

#### 5.2.2.2 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。

#### 5.2.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	9,900	16,909,398.00	5.41
2	300750	宁德时代	50,280	9,414,930.00	3.01
3	601318	中国平安	168,900	7,065,087.00	2.26
4	600036	招商银行	198,000	6,098,400.00	1.95
5	000858	五粮液	34,500	5,429,265.00	1.74
6	601658	邮储银行	973,500	4,585,185.00	1.47
7	002371	北方华创	15,200	4,485,216.00	1.43
8	600887	伊利股份	153,300	4,459,497.00	1.43
9	601398	工商银行	845,200	4,352,780.00	1.39
10	601688	华泰证券	291,500	4,180,110.00	1.34

#### 5.2.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	18,291,116.16	5.85

2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
8	其他	-	-
9	合计	18,291,116.16	5.85

#### 5.2.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	019709	23 国债 16	181,000	18,291,116.16	5.85

#### 5.2.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

#### 5.2.7 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。

#### 5.2.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.2.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 5.2.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量	合约市值	公允价值	风险说明
----	----	-----	------	------	------

			(元)	变动(元)	
IF2404	IF2404	12.00	12,906,720.00	-9,840.00	-
公允价值变动总额合计(元)					-9,840.00
股指期货投资本期收益(元)					1,039,429.99
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-9,840.00

### 5.2.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

### 5.2.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 5.2.10.1 本期国债期货投资政策

国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。管理人将按照相关法律法规的规定，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现基金资产的长期稳定增值。

#### 5.2.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未参与国债期货投资。

#### 5.2.10.3 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。

### 5.2.11 投资组合报告附注

5.2.11.1 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。

5.2.11.2 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。

#### 5.2.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,888,119.90
2	应收证券清	4,024,347.69

	算款	
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,912,467.59

#### 5.2.11.4 报告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。

#### 5.2.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 5.2.11.6 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。

## §6 开放式基金份额变动

### 6.1 中银沪深300指数增强型证券投资基金

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
基金合同生效日基金份额总额	178,937,583.46	120,392,187.76
本报告期期初基金份额总额	178,937,583.46	120,392,187.76
报告期间基金总申购份额	219,528.87	1,240,879.09
减：报告期间基金总赎回份额	14,488.31	3,700.23
报告期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	179,142,624.02	121,629,366.62

注：本基金合同生效日为2024年3月20日。

## 6.2 中银量化价值混合型证券投资基金

单位：份

项目	中银量化价值混合A	中银量化价值混合C
本报告期期初基金份额总额	170,766,173.35	36,858,056.09
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	8,683,718.60	110,721,765.87
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	512,308.49	27,187,634.20
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	178,937,583.46	120,392,187.76

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

#### 7.2.1 中银沪深300指数增强型证券投资基金

本报告期内，基金管理人未运用固有资金申购、赎回或买卖本基金。

#### 7.2.2 中银量化价值混合型证券投资基金

本报告期内，基金管理人未运用固有资金申购、赎回或买卖本基金。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 中银沪深300指数增强型证券投资基金

#### 8.1.1 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	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

		20%的时间区间					
机构	1	20240320-20240331	70,060,378.04	0.00	0.00	70,060,378.04	23.2935%
产品特有风险							
<p>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。</p>							

## 8.2中银量化价值混合型证券投资基金

### 8.2.1 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	20240101-20240207	49,631,333.04	0.00	0.00	49,631,333.04	16.5808%
	2	20240101-20240207	50,446,080.49	0.00	0.00	50,446,080.49	16.8530%
	3	20240227-20240319	0.00	70,060,378.04	0.00	70,060,378.04	23.4058%
产品特有风险							
<p>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。</p>							

## § 9 备查文件目录

### 9.1备查文件目录

- 1、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。

## **9.2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。

## **9.3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

二〇二四年四月十九日