

**中银淳利三个月持有期债券型证券投资基金**  
**2025 年第 3 季度报告**  
**2025 年 9 月 30 日**

基金管理人：中银基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二五年十月二十八日

## §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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 10 月 27 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 2025 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

|            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
|------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称       | 中银淳利三个月持有债券                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
| 基金主代码      | 023275                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 基金合同生效日    | 2025 年 2 月 20 日                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 报告期末基金份额总额 | 2,715,527,469.71 份                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 投资目标       | 本基金在有效控制投资组合风险的前提下，追求基金资产的长期稳健增值。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 投资策略       | <p>本基金主要通过宏观经济指标、货币政策和财政政策、国家产业政策以及资本市场资金环境的分析，预判宏观经济发展趋势及利率走势，据此评价未来一定时间段内债券、股票市场相对收益率，同时评估各类资产在未来一定时间段内流动性和信用水平，以本基金投资风格、投资目标为指导，动态调整债券、股票及现金类资产等的配置比例，以期实现本基金投资目标。</p> <p>本基金将通过战略性资产配置为主，战术性资产配置为辅的方式进行大类资产配置；通过战略性资产配置在较长时间框架内考察评判各类资产的预期收益和风险，然后确定最能满足本基金风险收益特征的资产组合；通过战术性资产配置在较短时间框架内考察各类资产的收益能力，预测短期收益率，动态调整大类资产配置，获取市场时机选择的超额收益。</p> <p>投资策略包括资产配置策略、债券投资策略、股票投资策略、港股投资策略、存托凭证投资策略、国债期货投资策略。</p> |
| 业绩比较基准     | 中债综合全价（总值）指数收益率*95%+沪深 300 指数收                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |

|                 |                                                                                                                             |                  |
|-----------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|
|                 | 收益率*4%+恒生指数收益率（按估值汇率折算）*1%                                                                                                  |                  |
| 风险收益特征          | 本基金属于债券型证券投资基金，其预期风险和收益水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。<br>本基金若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。 |                  |
| 基金管理人           | 中银基金管理有限公司                                                                                                                  |                  |
| 基金托管人           | 中国农业银行股份有限公司                                                                                                                |                  |
| 下属两级基金的基金简称     | 中银淳利三个月持有债券 A                                                                                                               | 中银淳利三个月持有债券 C    |
| 下属两级基金的交易代码     | 023275                                                                                                                      | 023276           |
| 报告期末下属两级基金的份额总额 | 1,837,554,712.73 份                                                                                                          | 877,972,756.98 份 |

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标         | 报告期<br>(2025 年 7 月 1 日-2025 年 9 月 30 日) |                |
|----------------|-----------------------------------------|----------------|
|                | 中银淳利三个月持有债券 A                           | 中银淳利三个月持有债券 C  |
| 1.本期已实现收益      | 15,293,801.39                           | 3,200,442.39   |
| 2.本期利润         | 46,873,247.55                           | 12,027,066.80  |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0304                                  | 0.0312         |
| 4.期末基金资产净值     | 1,907,713,683.62                        | 909,276,195.50 |
| 5.期末基金份额净值     | 1.0382                                  | 1.0357         |

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。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 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、中银淳利三个月持有债券 A：

| 阶段            | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③   | ②—④   |
|---------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|-------|-------|
| 过去三个月         | 3.03%      | 0.12%         | -0.65%         | 0.07%                 | 3.68% | 0.05% |
| 过去六个月         | 3.92%      | 0.10%         | 0.46%          | 0.07%                 | 3.46% | 0.03% |
| 自基金合同<br>生效日起 | 3.82%      | 0.09%         | -0.65%         | 0.08%                 | 4.47% | 0.01% |

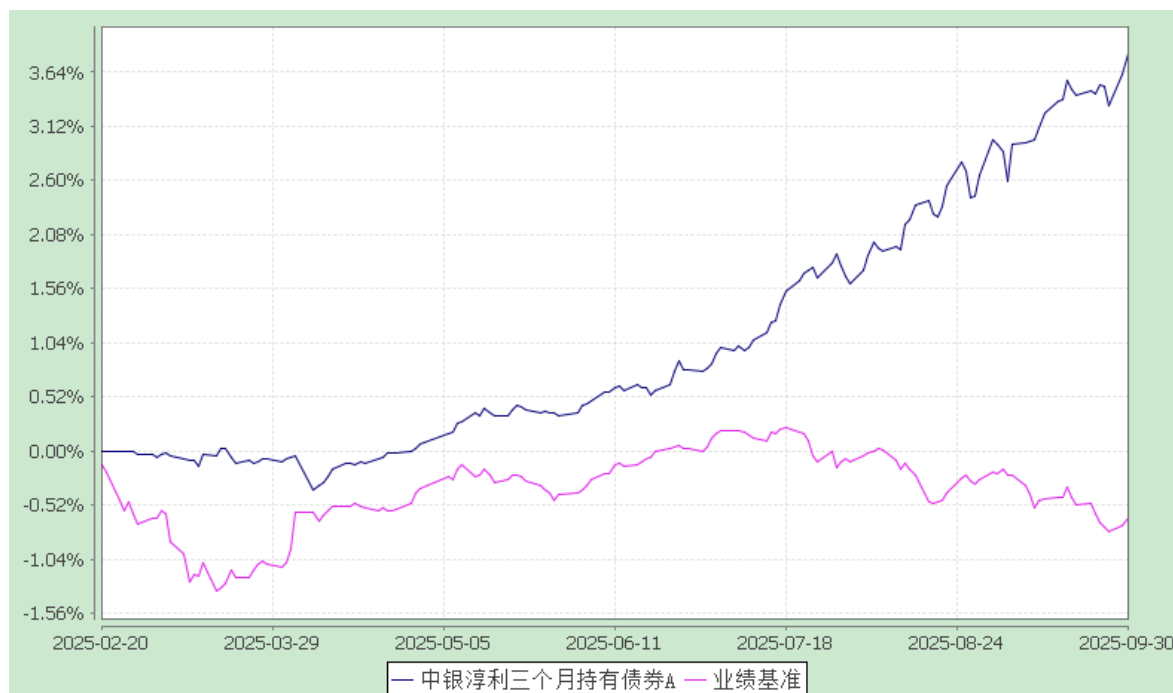
## 2、中银淳利三个月持有债券 C:

| 阶段            | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③   | ②—④   |
|---------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|-------|-------|
| 过去三个月         | 2.93%      | 0.12%         | -0.65%         | 0.07%                 | 3.58% | 0.05% |
| 过去六个月         | 3.73%      | 0.10%         | 0.46%          | 0.07%                 | 3.27% | 0.03% |
| 自基金合同<br>生效日起 | 3.57%      | 0.09%         | -0.65%         | 0.08%                 | 4.22% | 0.01% |

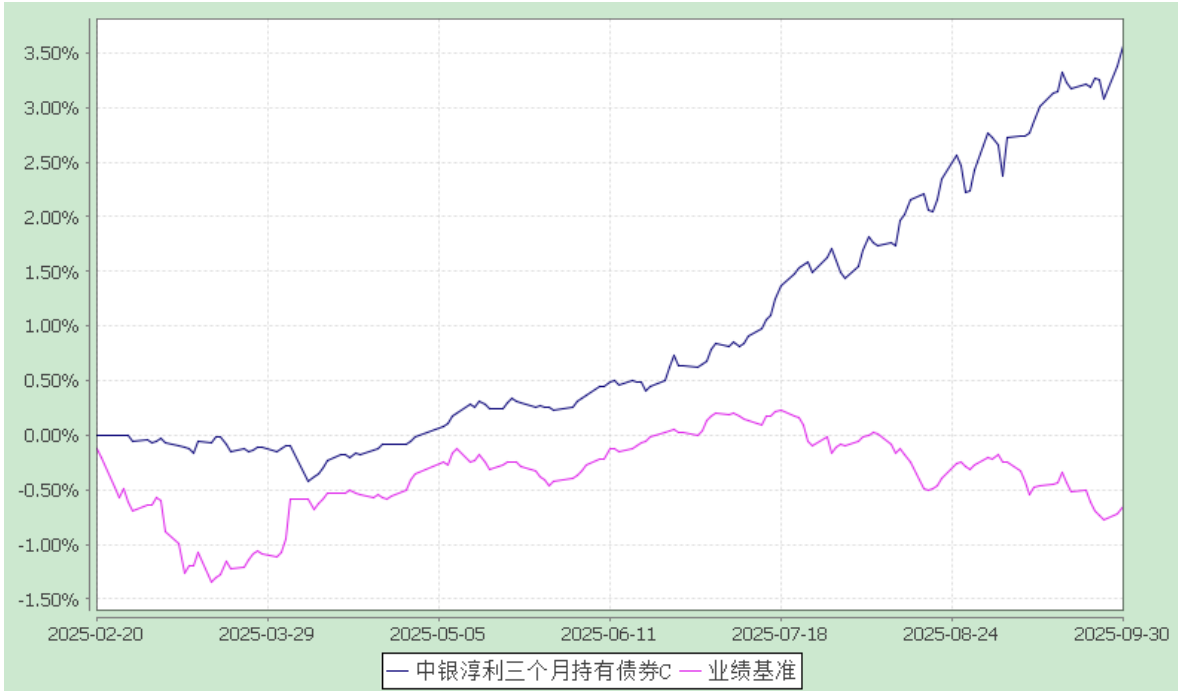
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

中银淳利三个月持有期债券型证券投资基金  
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  
(2025 年 2 月 20 日至 2025 年 9 月 30 日)

#### 1. 中银淳利三个月持有债券 A:



#### 2. 中银淳利三个月持有债券 C:



注：截至报告期末，本基金成立未满一年。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 |        |                                                                                                                                                                                                                       |
| 陈玮 | 基金经理 | 2025-02-20  | -    | 17     | 中银基金管理有限公司固定收益投资部副总经理，董事（D），应用数学硕士。曾任上海浦东发展银行总行金融市场部高级交易员。2014 年加入中银基金管理有限公司，曾担任固定收益基金经理助理。2014 年 12 月至 2024 年 1 月任中银纯债基金基金经理，2014 年 12 月至今任中银添利基金基金经理，2014 年 12 月至 2020 年 12 月任中银盛利纯债基金基金经理,2015 年 5 月至 2018 年 2 月任中 |

|  |  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
|--|--|--|--|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | 银新趋势基金基金经理,2015 年 6 月至 2021 年 5 月任中银聚利基金基金经理,2019 年 9 月至今任中银招利基金基金经理,2020 年 10 月至 2022 年 5 月任中银中高等级债券基金基金经理,2021 年 2 月至今任中银恒优基金基金经理,2021 年 6 月至今任中银通利基金基金经理,2022 年 1 月至今任中银恒悦 180 天基金基金经理,2022 年 3 月至今任中银民利基金基金经理,2023 年 1 月至 2025 年 1 月任中银招盈基金基金经理,2023 年 10 月至今任中银稳汇短债基金基金经理,2024 年 1 月至今任中银荣享基金基金经理,2025 年 2 月至今任中银淳利基金基金经理,2025 年 3 月至今任中银丰进基金基金经理。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 报告期内基金投资策略和运作分析

#### 1. 宏观经济分析

国外经济方面，贸易关税扰动边际缓和，全球 GDP 增速小幅反弹，但中长期不确定性上升。亚特兰大联储 GDPNow 预估三季度 GDP 环比折年率最新值为 3.8%，显示贸易关税扰动边际缓和，经济增速有所修复。PMI 作为领先指标指示中长期全球增长不确定仍较高，9 月美国 ISM 制造业 PMI 为 49%，服务业 PMI 环比大幅回落至 50%；欧元区 9 月制造业 PMI 初值 49.5%，其中德国制造业 PMI 从 8 月 49.8% 进一步下滑至 48.5%；欧元区服务业 PMI 为 51.4%，但法国制造业和服务业 PMI 双双下滑，综合 PMI 为 48.4%，其收缩速度创 5 月以来最快。货币政策方面，美联储 9 月降息 25bp，欧央行和日本央行三季度维持政策利率不变，符合市场预期。市场普遍预测美联储年内还有 1-2 次降息空间，但欧央行货币政策宽松周期或已接近尾声，不过考虑到美对欧洲加征关税对欧洲出口需求的负面冲击仍存，后市欧洲央行仍存降息可能性。

国内经济方面，三季度经济增速较二季度有所回落，但整体仍保持相对良好态势。价格方面，

CPI 与 PPI 在低位徘徊。具体来看，中采制造业 PMI 连续六个月维持在荣枯线以下，9 月值继续低位维持在 49.8%。8 月工业增加值同比增长 5.2%，较 6 月回落 1.6 个百分点。从经济增长动力来看，消费增速放缓，8 月社会消费品零售总额增速较 6 月值回落 1.4 个百分点至 3.4%。投资中基建、制造业投资增速回落，房地产投资延续负增长，8 月固定资产投资累计同比增速较 6 月回落 2.3 个百分点至 0.5%。通胀方面，8 月 CPI 同比增速较 6 月回落 0.5 个百分点至 -0.4%。PPI 负值收窄，8 月同比增速较 6 月回升 0.7 个百分点至 -2.9%，显示仍有一定的通缩压力。

## 2. 市场回顾

三季度债市整体下跌，结构上信用债相对表现更好。其中，中债总财富指数下跌 0.97%，中债银行间国债财富指数下跌 1.19%，中债企业债总财富指数上涨 0.1%。在收益率曲线方面，国债收益率曲线走势陡峭化。其中，10 年国债收益率（中债）从 1.65% 上行 21.36bps 至 1.86%，30 年国债收益率（中债）从 1.86% 上升 38.5bps 至 2.25%，10 年期国开收益率（中债）从 1.69% 上行 34.72bps 至 2.04%。

股票市场方面，三季度上证综指上涨 12.73%，代表大盘股表现的沪深 300 指数上涨 17.9%，中小板综合指数上涨 21.69%，创业板综合指数上涨 30.01%。可转债方面，三季度中证转债指数上涨 9.43%。

## 3. 运行分析

三季度股强债弱。策略上，本基金始终做好流动性管理，在规模增长阶段积极配置各类资产，尽力保持债券久期相对平稳。权益部分继续在保持低波风格情况下阶段性积极运作，继续以股票为主，转债为辅。股票部分在行业适度均衡的基础上总体继续以估值合理、未来基本面确定性较强的龙头公司为主，并把握符合新兴产业方向的科技成长类公司投资机会，维持较高的港股通比例，港股中重点关注估值更加具有吸引力的中国企业标的和具有稀缺性的恒生科技标的；行业上在互联网平台、机械电子通信等新质生产力方向以及非银金融、有色、医药、军工等行业相对超配，适当降低银行等行业配置比例；可转债本季度继续以偏估值比较的思维参与，在估值偏高阶段进行减仓；纯债方面以信用债为主要投资方向，重点关注中短期限高等级信用债的配置机会，保持较高的静态收益率，努力在不承担过多信用风险前提下维持适当的收益并控制波动风险，适时进行资产轮动调整，不断优化调整债券组合，借此提升基金的业绩表现。

## 4.5 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 3.03%，同期业绩比较基准收益率为 -0.65%。

报告期内，本基金 C 类份额净值增长率为 2.93%，同期业绩比较基准收益率为-0.65%。

#### 4.6 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 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              | 270,379,277.40   | 9.50         |
|    | 其中：股票             | 270,379,277.40   | 9.50         |
| 2  | 固定收益投资            | 2,297,735,102.94 | 80.74        |
|    | 其中：债券             | 2,297,735,102.94 | 80.74        |
|    | 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          | 129,534,141.99   | 4.55         |
|    | 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      | 43,500,865.23    | 1.53         |
| 7  | 其他各项资产            | 104,692,776.57   | 3.68         |
| 8  | 合计                | 2,845,842,164.13 | 100.00       |

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为117,305,102.62元，占资产净值比4.16%，本基金本报告期末未参与转融通证券出借业务。

#### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

##### 5.2.1 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              | 20,691,283.00  | 0.73         |
| C  | 制造业              | 118,576,841.78 | 4.21         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -              | -            |
| E  | 建筑业              | -              | -            |
| F  | 批发和零售业           | -              | -            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | -              | -            |
| H  | 住宿和餐饮业           | -              | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 13,806,050.00  | 0.49         |

|   |               |                |      |
|---|---------------|----------------|------|
| J | 金融业           | -              | -    |
| K | 房地产业          | -              | -    |
| L | 租赁和商务服务业      | -              | -    |
| M | 科学研究和技术服务业    | -              | -    |
| 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            | 153,074,174.78 | 5.43 |

## 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别   | 公允价值（人民币）      | 占基金资产净值比例（%） |
|--------|----------------|--------------|
| 非必需性消费 | 22,898,360.08  | 0.81         |
| 必需性消费  | 2,604,129.37   | 0.09         |
| 医疗保健业  | 20,610,030.48  | 0.73         |
| 电讯业    | 4,935,186.43   | 0.18         |
| 金融业    | 37,642,430.17  | 1.34         |
| 资讯科技业  | 28,614,966.09  | 1.02         |
| 合计     | 117,305,102.62 | 4.16         |

## 5.3 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  | 09988  | 阿里巴巴-W | 141,700 | 22,898,360.08 | 0.81         |
| 2  | 00700  | 腾讯控股   | 37,000  | 22,396,312.38 | 0.80         |
| 3  | 300750 | 宁德时代   | 43,200  | 17,366,400.00 | 0.62         |
| 4  | 601899 | 紫金矿业   | 572,900 | 16,866,176.00 | 0.60         |
| 5  | 600276 | 恒瑞医药   | 223,100 | 15,962,805.00 | 0.57         |
| 6  | 02628  | 中国人寿   | 754,000 | 15,213,350.93 | 0.54         |
| 7  | 002050 | 三花智控   | 261,000 | 12,640,230.00 | 0.45         |
| 8  | 603986 | 兆易创新   | 51,900  | 11,070,270.00 | 0.39         |
| 9  | 600887 | 伊利股份   | 382,200 | 10,426,416.00 | 0.37         |
| 10 | 09926  | 康方生物   | 79,000  | 10,184,109.30 | 0.36         |

## 5.4 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 | -       | -            |
| 2  | 央行票据 | -       | -            |

|    |           |                  |       |
|----|-----------|------------------|-------|
| 3  | 金融债券      | 468,216,310.03   | 16.62 |
|    | 其中：政策性金融债 | 151,223,802.74   | 5.37  |
| 4  | 企业债券      | 1,642,947,954.01 | 58.32 |
| 5  | 企业短期融资券   | 30,474,768.77    | 1.08  |
| 6  | 中期票据      | 155,355,575.62   | 5.51  |
| 7  | 可转债（可交换债） | 740,494.51       | 0.03  |
| 8  | 同业存单      | -                | -     |
| 9  | 其他        | -                | -     |
| 10 | 合计        | 2,297,735,102.94 | 81.57 |

#### 5.5 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<br>净值比例<br>（%） |
|----|--------|----------|-----------|----------------|----------------------|
| 1  | 250206 | 25 国开 06 | 1,100,000 | 110,866,679.45 | 3.94                 |
| 2  | 242045 | 24 中财 G3 | 800,000   | 81,438,750.69  | 2.89                 |
| 3  | 240875 | 24 兴业 03 | 800,000   | 81,333,089.31  | 2.89                 |
| 4  | 175986 | 21 财金 02 | 800,000   | 81,248,810.96  | 2.88                 |
| 5  | 115825 | 23 华福 G2 | 700,000   | 70,792,131.51  | 2.51                 |

#### 5.6 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。

#### 5.7 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。

#### 5.8 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。

#### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未参与股指期货投资。

##### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资范围未包括股指期货，无相关投资政策。

#### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 5.10.1 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。基金管理人将按照相关法律法规的规定，根据风险管理原则，以套期保值为目的，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。

#### 5.10.2 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。

#### 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2 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。

#### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额(元)          |
|----|---------|----------------|
| 1  | 存出保证金   | 493,770.64     |
| 2  | 应收证券清算款 | 14,000,000.00  |
| 3  | 应收股利    | 147,569.28     |
| 4  | 应收利息    | -              |
| 5  | 应收申购款   | 90,051,436.65  |
| 6  | 其他应收款   | -              |
| 7  | 其他      | -              |
| 8  | 合计      | 104,692,776.57 |

#### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称  | 公允价值(元)    | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|-------|------------|--------------|
| 1  | 127049 | 希望转 2 | 740,494.51 | 0.03         |

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 5.11.6 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

单位：份

| 项目            | 中银淳利三个月持有债券A     | 中银淳利三个月持有债券C   |
|---------------|------------------|----------------|
| 本报告期期初基金份额总额  | 2,362,895,768.13 | 464,605,865.71 |
| 本报告期基金总申购份额   | 909,151,106.78   | 668,892,712.62 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 1,434,492,162.18 | 255,525,821.35 |
| 本报告期基金拆分变动份额  | -                | -              |
| 本报告期期末基金份额总额  | 1,837,554,712.73 | 877,972,756.98 |

## **§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**

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 备查文件目录**

### **8.1 备查文件目录**

- 1、中国证监会准予中银淳利三个月持有期债券型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《中银淳利三个月持有期债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《中银淳利三个月持有期债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、关于申请募集中银淳利三个月持有期债券型证券投资基金之法律意见；
- 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。

### **8.2 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。

### **8.3 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  
二〇二五年十月二十八日