

中银证券安怡债券型证券投资基金 2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：中银国际证券股份有限公司

基金托管人：江苏银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 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。

基金托管人江苏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 28 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	5
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
3.3 其他指标	8
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
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合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§ 6 半年度财务会计报告（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	48
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	49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	52
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	52
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	52

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	52
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	52
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53
7.12 本报告期投资基金情况	53
7.13 投资组合报告附注	53
§ 8 基金份额持有人信息	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
8.3 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情况	55
§ 9 开放式基金份额变动	55
§ 10 重大事件揭示	56
10.1 基金份额持有人大会决议	56
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	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
10.4 基金投资策略的改变	56
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件	56
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况	56
10.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	56
10.8 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	57
10.9 其他重大事件	58
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	59
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	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	60
§ 12 备查文件目录	60
12.1 备查文件目录	60
12.2 存放地点	60
12.3 查阅方式	60

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中银证券安怡债券型证券投资基金	
基金简称	中银证券安怡债券	
基金主代码	026242	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2026 年 1 月 28 日	
基金管理人	中银国际证券股份有限公司	
基金托管人	江苏银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	403,054,793.87 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中银证券安怡债券 A	中银证券安怡债券 C
下属分级基金的交易代码	026242	026243
报告期末下属分级基金的份额总额	188,127,092.30 份	214,927,701.57 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，通过积极挖掘市场投资机会，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金通过大类资产配置策略、债券投资策略、股票投资策略、基金投资策略、可转换债券投资策略、资产支持证券投资策略及信用衍生品投资策略，力争实现基金资产的长期稳健增值。
业绩比较基准	中债综合全价指数收益率*89%+中证 800 指数收益率*10%+中证港股通综合指数收益率*1%
风险收益特征	本基金是债券型基金，其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金。本基金若投资港股通标的股票，则需承担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		中银国际证券股份有限公司	江苏银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	盖文国	田作全
	联系电话	021-20328000	025-58588321
	电子邮箱	gmkf@bocichina.com	tianzuoquan@jsbchina.cn
客户服务电话		956026, 400-620-8888	95319
传真		021-50372474	025-58588155
注册地址		上海市浦东新区银城中路 200 号 中银大厦 39F	江苏省南京市中华路 26 号
办公地址		上海市浦东新区银城中路 200 号	江苏省南京市中华路 26 号

	中银大厦 39F	
邮政编码	200120	210001
法定代表人	周权	袁军

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.bocifunds.com
基金中期报告置备地点	基金管理人及基金托管人办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中银国际证券股份有限公司	上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	中国北京东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 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	2026 年 1 月 28 日（基金合同生效日）-2026 年 6 月 30 日	
和指标	中银证券安怡债券 A	中银证券安怡债券 C
本期已实现收益	4,653,680.30	4,676,574.50
本期利润	10,494,440.81	11,624,760.91
加权平均基金份额本期利润	0.0316	0.0271
本期加权平均净值利润率	3.15%	2.70%
本期基金份额净值增长率	3.75%	3.60%
3.1.2 期末数据	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
和指标		
期末可供分配利润	3,011,963.89	3,119,222.45
期末可供分配基金份额利润	0.0160	0.0145
期末基金资产净值	195,181,910.12	222,659,529.96
期末基金份额净值	1.0375	1.0360

值		
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	3.75%	3.60%

- 注：1、本基金合同于 2026 年 01 月 28 日生效，截至本报告期末基金成立未满半年；
- 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；
- 3、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；
- 4、期末可供分配利润是指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。

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

中银证券安怡债券 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	4.56%	0.27%	1.81%	0.15%	2.75%	0.12%
自基金合同生效起至今	3.75%	0.23%	1.05%	0.15%	2.70%	0.08%

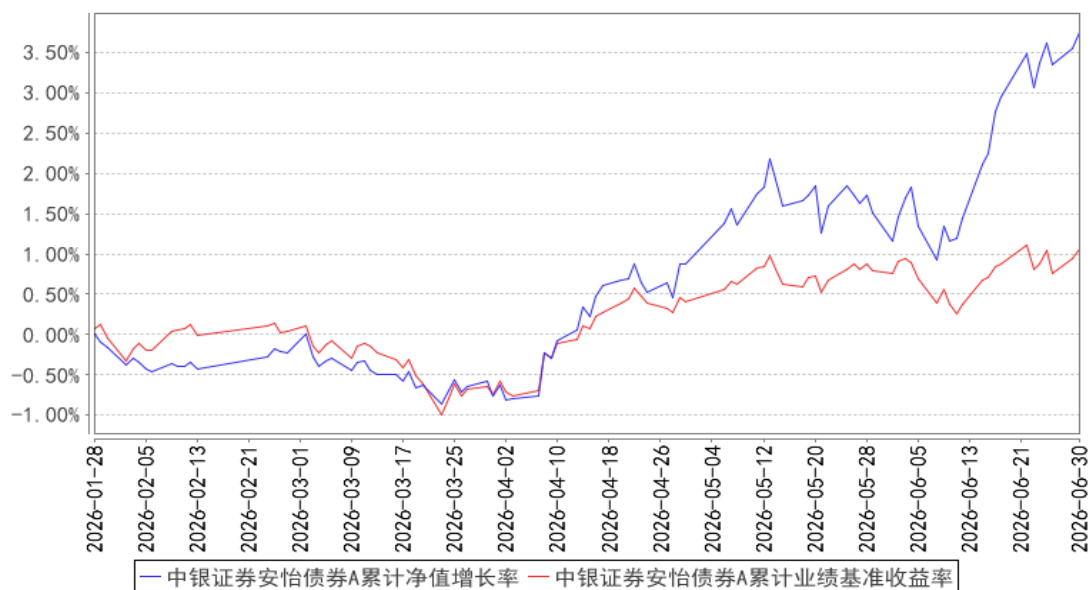
中银证券安怡债券 C

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	4.47%	0.27%	1.81%	0.15%	2.66%	0.12%
自基金合同生效起至今	3.60%	0.23%	1.05%	0.15%	2.55%	0.08%

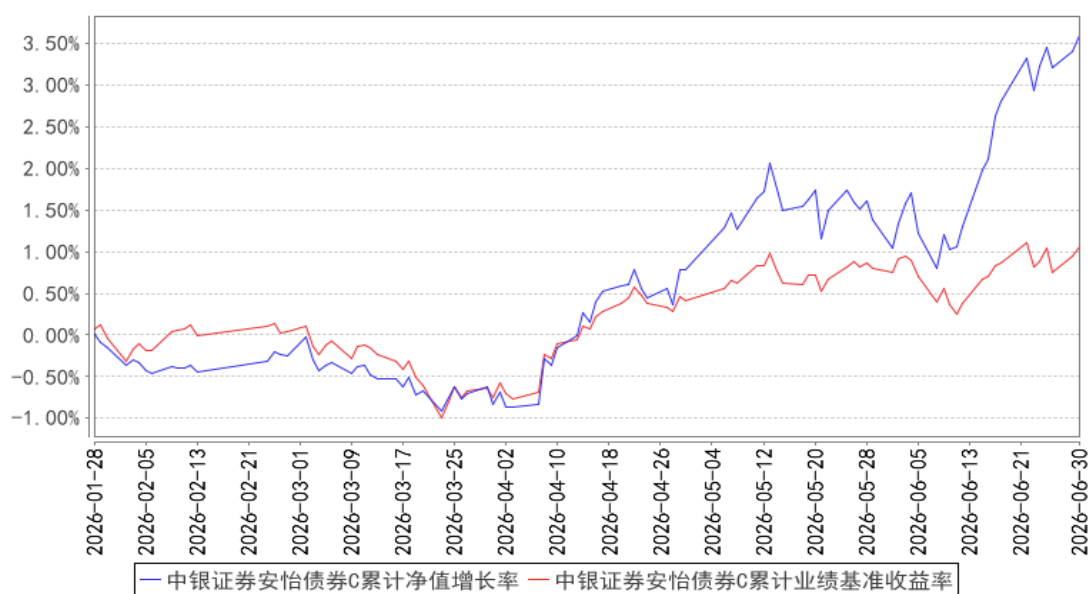
注：业绩比较基准=中债综合全价指数收益率*89%+中证 800 指数收益率*10%+中证港股通综合指数收益率*1%。

3.2.2 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

中银证券安怡债券A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



中银证券安怡债券C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金合同于 2026 年 01 月 28 日生效，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，截至报告期末，本基金尚在建仓期内。

3.3 其他指标

注：无。

§ 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

中银国际证券股份有限公司(以下简称“中银证券”)经中国证监会批准于 2002 年 2 月 28 日在上海成立,注册资本 27.78 亿元人民币。截至 2026 年 6 月 30 日,前十名股东包括中银国际控股有限公司、中国石油集团资本有限责任公司、江西铜业股份有限公司、中国建设银行股份有限公司—国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金、中国建设银行股份有限公司—华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金、杨竣凯、香港中央结算有限公司、朱晔、刘龙贵、付卫平。中银证券的经营范围包括:证券经纪;证券投资咨询;与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问;证券承销与保荐;证券自营;证券资产管理;证券投资基金代销;融资融券;代销金融产品;公开募集证券投资基金管理业务;为期货公司提供中间介绍业务。

截至 2026 年 6 月 30 日,本基金管理人共管理 43 只证券投资基金,包括:中银证券价值精选灵活配置混合型证券投资基金(原中银证券保本 1 号混合型证券投资基金)、中银证券健康产业灵活配置混合型证券投资基金、中银证券现金管家货币市场基金、中银证券安进债券型证券投资基金、中银证券安弘债券型证券投资基金、中银证券汇宇定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券聚瑞混合型证券投资基金、中银证券汇嘉定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券安誉债券型证券投资基金、中银证券汇享定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券新能源灵活配置混合型证券投资基金、中银证券安源债券型证券投资基金、中银证券中高等级债券型证券投资基金、中银证券安泽债券型证券投资基金、中银证券科技创新混合型证券投资基金(LOF)、中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、中银证券安沛债券型证券投资基金、中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中银证券汇远一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券汇兴一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券优选行业龙头混合型证券投资基金、中银证券安汇三年定期开放债券型证券投资基金、中银证券创业板交易型开放式指数证券投资基金、中银证券安怡债券型证券投资基金、中银证券精选行业股票型证券投资基金、中银证券汇福一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券盈瑞混合型证券投资基金、中银证券优势制造股票型证券投资基金、中银证券安灝债券型证券投资基金、中银证券安业债券型证券投资基金、中银证券内需增长混合型证券投资基金、中银证券恒瑞 9 个月持有期混合型证券投资基金、中银证券远见价值混合型证券投资基金、中银证券慧泽稳健 3 个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)、中银证券慧泽平衡 3 个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)、

中银证券安添 3 个月定期开放债券型证券投资基金、中银证券汇裕一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券凌瑞 6 个月持有期混合型证券投资基金、中银证券安澈债券型证券投资基金、中银证券中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、中银证券鸿瑞债券型证券投资基金、中银证券中证 A500 指数型证券投资基金、中银证券创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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		
曹张琪	本基金的基金经理	2026 年 1 月 28 日	—	12 年	曹张琪，硕士研究生，中国国籍，已取得证券、基金从业资格。2009 年 6 月至 2012 年 8 月任职于中诚信证券评估有限责任公司，担任信用分析师；2012 年 9 月至 2013 年 10 月任职于太平资产管理有限公司，担任信用分析师；2013 年 11 月加入中银国际证券股份有限公司，历任中银证券安沛债券型证券投资基金、中银证券安业债券型证券投资基金、中银证券安灝债券型证券投资基金、中银证券汇兴一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理，现任中银证券安汇三年定期开放债券型证券投资基金、中银证券安泽债券型证券投资基金、中银证券安添 3 个月定期开放债券型证券投资基金、中银证券安灝债券型证券投资基金、中银证券安怡债券型证券投资基金基金经理。
罗雨	本基金的基金经理	2026 年 1 月 28 日	—	12 年	罗雨，硕士研究生，中国国籍，已取得证券、基金从业资格。曾任职于莫尼塔（上海）投资发展有限公司；2013 年 12 月至 2015 年 9 月任职于国泰君安证券股份有限公司，担任研究员；2015 年 9 月加入中银国际证券股份有限公司，现任中银证券安弘债券型证券投资基金、中银证券盈瑞混合型证券投资基金、中银证券内需增长混合型证券投资基金、中银证券安怡债券型证券投资基金基金经理。

注：1、上述任职日期为根据公司确定的聘任日期，离任日期为根据公司确定的解聘日期；首任基金经理的任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的涵义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无

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》、《中华人民共和国证券法》、基金合同以及其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，不存在损害基金份额持有人利益的行为、违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

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

为了保证公司管理的不同投资组合得到公平对待，保护投资者合法权益，本基金管理人根据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规，建立了《资产管理业务公平交易管理办法》、《资产管理业务异常交易监控与报告管理办法》等公平交易相关制度体系。公司旗下投资组合严格按照制度的规定，参与股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，主要包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关环节。研究团队负责提供投资研究支持，投资团队负责投资决策，交易室负责实施交易并实时监控，投资监督团队负责事前监督、事中检查和事后稽核，对交易情况进行合理性分析。通过多部门的协作互控，保证了公平交易的可操作、可稽核和可持续。

公司一直严格遵循公平交易相关规章制度，执行严格的公平交易行为。在严格方针指导下，报告期内，未出现任何异常关联交易以及与禁止交易对手间的交易行为。

报告期内，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗口下（如：1 日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合向交易开展交易价差分析。分析结果表明，本报告期内公司对各投资组合公平对待，不存在利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未发生同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量 5%的情况。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

2026 年上半年，国内经济整体呈现 K 型分化，表现强势的出口和科技方向整体超出年初市场

的预期，而弱势的消费、投资、地产等方向的变化基本与市场最保守的预判相当。这和 2025 年下半年国内经济的趋势并没有特别明显的区别和变化。和资本市场息息相关的国内通胀走势，受到一季度末海外地缘政治冲突的影响，向上波动超过了市场的一致预期，但更能影响债券价格和股价的核心通胀则持续处于低位，市场盼望的上游涨价带动下游商品和服务价格改善的情况并未出现，相反，受到金银饰品等高基数的影响，二季度核心通胀甚至略微低于市场的预期。国内资本市场出现了股债双牛，商品价格则先强后弱，地缘政治冲突缓和以后，部分商品价格甚至跌到了年初的水平以下。

本产品根据宏观环境和市场走势的变化，维持了较高的成长股持仓，因此在上半年取得了相对产品基准较好的收益表现。在债券这边，由于股票市场价格波动明显放大，出于对冲风险的考虑，我们维持了较高的组合久期，且为了方便股票和转债交易的需要，小幅降低了组合的杠杆率。债券收益率整体的下行，使得我们长久期的债券组合有所受益，在转债整体走势相对一般的情况下，令产品非 A 股的部分持仓，在上半年也取得了不错的绝对收益。

坚信业绩是股价变动的锚是我们对权益持仓进行调整的核心标准。一季报电子和通信行业业绩的集中爆发，使得我们在成长方向的持仓逐渐向这些行业集中。根据我们的测算，截至报告期，电子行业单行业营收和盈利能力双加速公司的占比，达到了所有行业的历史新高。我们对电子行业的超配固然是基本面导向的结果，但也变相增加了产品整体净值波动的风险。因此，我们自 6 月初开始小幅减少了成长风格整体的持仓比例，并增加了与其走势负相关较强的红利方向股票的持仓。事后看，虽然 6 月我们错过了一些涨幅，但在 7 月初的市场调整中，帮助产品的净值减少了一部分市场大幅波动带来的损失。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末中银证券安怡债券 A 基金份额净值为 1.0375 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.75%；同期业绩比较基准收益率为 1.05%。截至本报告期末中银证券安怡债券 C 基金份额净值为 1.0360 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.60%；同期业绩比较基准收益率为 1.05%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对于大多数金融机构及从业者而言，对宏观经济周期和资本市场走势“常态”的研究相对而言是充分且深入的，而对“非常态”的研究往往是较浅且仓促的。我们认为，上半年和 7 月市场走势的主要矛盾，仍然集中在大多数人对于股市走势的核心驱动力的判断上。在 2025 年的年报中我们就曾提到，多数股票投资者对于后续经济复苏和上市公司盈利改善抱有较强的预期，而现实和预期的背离，是导致 A 股市场过去半年（1-3 月和 7 月）出现两次大幅波动的主要原因。如果下半年市场的主流预期对于宏观经济走向和企业盈利的预期没有向现实进行修正，我们认为权益

市场的整体走势将会是风险多于机会的。

展望 2026 年下半年，国内经济是否能展现出复苏的信号，和以什么样的方式展现复苏的信号，仍然将是决定资本市场走势的关键。这里有两种市场乐见的情况，一种是上半年预期的延续，另一种则是 A 股在 7 月波动之后的新需求：我们认为，市场对政策在需求端发力仍有较高的期望，投资者希望看到国家政策以某种形式带动房地产市场进一步企稳，或者推动以居民为主的终端消费出现明显改善；商品价格在上半年的大幅波动，破坏了市场对原材料类商品涨价向内、向下游传导的美好期望，但由于科技股近期出现的大幅波动，市场转而希望国产科技链要么出现实质上的技术突破、要么摆脱海外科技公司预期的频繁扰动，出现独立的业绩改善。内需的变化仍然是实现市场预期核心，在价格信号持续低于预期的情况下，市场预期正在向现实变化妥协。目前主流投资者对于经济的整体趋势的要求在降低，对特定行业的期望，如地产、半导体的要求却在加强。

基于上面的假设，我们认为 2026 年下半年权益和转债市场的整体投资难度是大于上半年的。下半年外部环境实际上是更加复杂的：地缘政治冲突带来的国际商品价格、特别是油价的波动仍未平息，欧美央行出于通胀压力是否加息也尚未可知。在这样的宏观环境下，一个朴素的判断是国内政策很难选择在这样的时点加力。从过去几年的经验观察，等待而不是决断的概率更高。另一方面，随着长鑫科技的上市，科技方向的国内产业链固然有望独立于海外科技行业的发展，走出独立的基本面趋势，但上半年股价上涨在先，科技类上市公司的营收和盈利实际上是很难超越以及被股价波动吊高的投资者预期的。因此，我们认为下半年权益和转债市场，更有可能是在较宽的范围内大幅波动：其下限，约在 7 月大幅下跌之后的下沿；而其上限，应该不高于 5-6 月指数的高点。和海外利率逐渐抬升、投资者向业绩集中略有不同，我们认为利率的下行将重新成为权益的主线，小市值公司走势强于大市值公司，主题方向强于行业业绩改善可能是下半年区别上半年最主要的特征。因此，虽然下半年产品仍将以成长股持仓为主，但随着行情的发展，我们可能在适当的时点，加速地把我们的成长持仓往更稳健和波动更小的方向转移。

在持续缺乏政策驱动的宏观环境下，我们认为债券将成为国内市场的焦点。一方面，利率债、特别是超长利率债所展现的性价比将出现兑现的机会，10-30 年利差很有可能因为某种契机，快速朝历史均值向下回归；另一方面，随着市场对信用评级相关问题的讨论频率和范围的增加，信用利差可能出现几年来首次的趋势上行。通胀仍然是刺激债市走势的重要因素，但和多数人的期望不同，国内通胀很有可能和国际通胀再次形成分化，持续低于市场预期的国内工业品出厂价格（PPI）和服务业 CPI，将成为利率债走势的重要催化剂。由于多数机构投资者在长久期利率债方向仍然低配，我们认为所持有的长债头寸，可能将成为产品下半年净值表现主要推动力。

多资产对冲仍将成为本产品净值变动的重要稳定器。虽然上半年我们在港股通和黄金股上的投资并未为产品净值带来明显的正贡献。考虑到下半年复杂多变的国内政经环境，价格信号在不同资产之间的流转和联动可能成为固收加产品稳定净值走势的重要因素。对于安怡债基的运营，我们仍将继续发挥产品合同授予我们的权力，将我们风险资产的敞口，广泛地分布在各市场的各类不同走势的品种和行业方向上。我们预计黄金股仍将是我们的产品组合中的重要组成部分。同时，港股通内一些 A 股所没有的行业方向，也会是我们挖掘机会和平衡净值风险的重要工具。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益，设立了中银国际证券股份有限公司估值委员会（以下简称“估值委员会”），制定了估值政策和估值程序。由分管运营服务部的公司领导担任主席，成员由分管公募投资部的公司领导、公募投资部、资管业务管理部、内控与法律合规部、风险管理部、运营服务部等部门负责人组成。估值委员会成员均具有专业工作经历，具备良好的专业经验和专业胜任能力，具有绝对的独立性。估值委员会的职责主要包括有：保证基金估值的公平、合理；制订健全、有效的估值政策和程序；确保对投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性；定期对估值政策和程序进行评价等。

参与估值流程的各方还包括本基金托管银行和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管银行有责任要求基金管理人作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金报告期内未实施利润分配。

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

本基金报告期内不存在连续二十个工作日基金持有人数低于 200 人或基金资产净值低于 5000 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

本报告期内，本基金托管人——江苏银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资

基金法》及其他有关法律法规的规定以及《托管协议》的约定，尽职尽责履行了托管人应尽的义务，没有从事任何损害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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本基金托管人——江苏银行股份有限公司未发现中银国际证券股份有限公司在基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上存在损害基金份额持有人利益的行为，或违反《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、在各重要方面的运作违反基金合同规定的情况。

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

本报告期内，由基金管理人所编制和披露的定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、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中银证券安怡债券型证券投资基金

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
资 产：		
货币资金	6.4.7.1	9,936,389.34
结算备付金		4,921,229.86
存出保证金		172,041.54
交易性金融资产	6.4.7.2	451,007,875.25
其中：股票投资		38,356,982.37
基金投资		3,168,000.00
债券投资		409,482,892.88
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	—
债权投资	6.4.7.5	—
其中：债券投资		—
资产支持证券投资		—
其他投资		—
其他债权投资	6.4.7.6	—

其他权益工具投资	6.4.7.7	-
应收清算款		16,908,596.67
应收股利		20,952.93
应收申购款		139,333.00
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.8	-
资产总计		483,106,418.59
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 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		43,500,372.60
应付清算款		-
应付赎回款		21,253,307.60
应付管理人报酬		259,835.70
应付托管费		43,305.95
应付销售服务费		79,737.77
应付投资顾问费		-
应交税费		18,237.83
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.9	110,181.06
负债合计		65,264,978.51
净资产:		
实收基金	6.4.7.10	403,054,793.87
其他综合收益	6.4.7.11	-
未分配利润	6.4.7.12	14,786,646.21
净资产合计		417,841,440.08
负债和净资产总计		483,106,418.59

注：本基金合同生效日为 2026 年 01 月 28 日，本报告期自基金合同生效日 2026 年 01 月 28 日起至 2026 年 06 月 30 日止。报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 403,054,793.87 份，其中中银证券安怡债券 A 基金份额总额 188,127,092.30 份，基金份额净值 1.0375 元；中银证券安怡债券 C 基金份额总额 214,927,701.57 份，基金份额净值 1.0360 元。

6.2 利润表

会计主体：中银证券安怡债券型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 28 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
-----	-----	----

		2026 年 1 月 28 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
一、营业总收入		25,110,310.82
1. 利息收入		2,796,290.02
其中：存款利息收入	6.4.7.13	1,086,899.91
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		1,709,390.11
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		9,509,687.08
其中：股票投资收益	6.4.7.14	8,799,147.42
基金投资收益		-2,582,058.14
债券投资收益	6.4.7.15	2,786,283.14
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-
股利收益	6.4.7.19	506,314.66
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	12,788,946.92
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	15,386.80
减：二、营业总支出		2,991,109.10
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,929,652.00
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	6.4.10.2.2	321,608.71
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	634,362.10
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		20,649.15
其中：卖出回购金融资产支出		20,649.15
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-
7. 税金及附加		12,953.38
8. 其他费用	6.4.7.23	71,883.76
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		22,119,201.72
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		22,119,201.72
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		22,119,201.72

6.3 净资产变动表

会计主体：中银证券安怡债券型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 28 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 28 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	922,271,513.15	-	-	922,271,513.15
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-519,216,719.28	-	14,786,646.21	-504,430,073.07
（一）、综合收益总额	-	-	22,119,201.72	22,119,201.72
（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）	-519,216,719.28	-	-7,332,555.51	-526,549,274.79
其中：1. 基金申购款	110,729,829.03	-	1,769,345.34	112,499,174.37
2. 基金赎回款	-629,946,548.31	-	-9,101,900.85	-639,048,449.16
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	403,054,793.87	-	14,786,646.21	417,841,440.08

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：

周冰

基金管理人负责人

沈锋

主管会计工作负责人

金坚

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中银证券安怡债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)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[2025]2454 号《关于准予中银证券安怡债券型证券投资基金注册的批复》准予注册,由中银国际证券股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中银证券安怡债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定。经向中国证监会备案,《中银证券安怡债券型证券投资基金基金合同》于 2026 年 1 月 28 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 922,271,513.15 份基金份额,业经会计师事务所验证。本基金的基金管理人为中银国际证券股份有限公司(以下简称“中银证券”),基金托管人为江苏银行股份有限公司(以下简称“江苏银行”)。

根据《中银证券安怡债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/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;在投资者认购/申购时不收取认购/申购费用,并从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类两种收费模式并存,由于基金费用的不同,本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中银证券安怡债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行或上市的股票(包括主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证)、港股通标的股票、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、政府支持债券、政府支持机构债、次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券(含可分离交易可转换债券的纯债部分)、可交换债券等)、经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金(包括股票型 ETF、本基金管理人旗下的股票型基金及计入权益类资产的混合型基金,不包括 QDII 基金、香港互认基金、基金中基金、其他可投资公募基金的非基金中基金、货币市场基金、同一基金经理管理的其他基金、非本基金管理人管理的基金(股票型 ETF 除外))、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、信用衍生品及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他

金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为:本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%,本基金投资于股票、存托凭证、股票型基金、混合型基金等权益类资产及可转换债券、可交换债券资产的比例合计为基金资产的 5%-20%;其中投资于境内股票资产(含股票型 ETF)的比例不低于基金资产的 5%,投资于港股通标的股票占本基金股票资产的比例为 0%-50%;其中,本基金所指的计入权益类资产的混合型基金指基金合同中明确约定股票投资占基金资产的比例为 60%以上或者最近 4 个季度披露的股票投资占基金资产的比例均在 60%以上的混合型基金。本基金对经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金投资比例不超过基金资产净值的 10%。本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:中债综合全价指数收益率*89%+中证 800 指数收益率*10%+中证港股通综合指数收益率*1%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称“企业会计准则”)的要求,同时亦按照中国证券投资基金业协会(以下简称“基金业协会”)颁布的《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》及财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求,真实、完整地反映了本基金 2026 年 06 月 30 日的财务状况、自 2026 年 01 月 28 日(基金合同生效日)至 2026 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日至 12 月 31 日止。

本期财务报表的实际编制期间为自 2026 年 1 月 28 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日止期间。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币,编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币

的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

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。本基金以摊余成本计量的金融资产主要为货币资金、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、资产支持证券投资和基金投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(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。

(3) 衍生金融工具

本基金将衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

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

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据企业会计准则的规定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。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，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，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，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。采用估值技术确定公允价值时，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。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，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份额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。

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基金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基金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

利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额，在证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时扣除适用情况下的相关税费后的净额计入证券出借业务利息收入。

投资收益

股票投资收益、债券投资收益、资产支持证券投资收益、基金投资收益和衍生工具投资收益按相关金融资产于处置日成交金额与其初始计量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资，在其持有期间，按票面金额和票面利率计算的利息计入投资收益。

公允价值变动收益

公允价值变动收益核算基金采用公允价值模式计量的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、衍生工具、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。不包括本基金以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资在持有期间按票面利率计算的利息。

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

1) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利按除权日的该类别基金份额净值自动转为相应类别的基金份额进行再投资，且基金份额持有人可对 A 类、C 类基金份额选择不同的分红方式；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；2) 基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去该类别每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；3) 由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同；本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；4) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。本基金每次收益分配比例详见届时基金管理人发布的公告。在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会。法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

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

编制财务报表时，本基金需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入和支出的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本基金对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

对于证券交易所上市的股票，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《中国证券监督管理委员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。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，根据中基协发[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》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值

日流通受限股票的价值。

根据《关于固定收益品种的估值处理标准》（以下简称“估值处理标准”）在银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所及中国证券监督管理委员会认可的其他交易场所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值基准服务机构提供的价格数据进行估值或减值。

对于基金投资，根据中基协发[2017]3 号《关于发布〈基金中基金估值业务指引（试行）〉的通知》之附件《基金中基金估值业务指引（试行）》，按如下方法估值：

(a) 对于交易型开放式指数基金、境内上市定期开放式基金及封闭式基金，按所投资基金估值日的收盘价估值；

(b) 对于境内上市开放式基金 (LOF) 及其他境内非货币市场基金，按所投资基金估值日的份额净值估值；

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》、财税 [2014] 81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税 [2016] 127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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》、中投信〔2021〕20号《关于香港联合交易所有限公司上调股票交易印花税率有关提示的通知》、财政部税务总局公告2023年第2号《关于延续实施有关个人所得税优惠政策的公告》、财政部 税务总局 中国证监会公告2023年第23号《关于延续实施沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、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) 对投资者从本基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

对本基金从中国内地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。

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。

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称中国结算）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。对本基金通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的股息红利所得，按照上述规定计征个人所得税。

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的转让差价所得和通过基金互认买卖香港基金份额取得的转让差价所得，继续暂免征收个人所得税，执行至 2027 年 12 月 31 日。

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。对于本基金通过沪港通、深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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	9,936,389.34
等于：本金	9,933,539.85
加：应计利息	2,849.49
减：坏账准备	—
定期存款	—
等于：本金	—
加：应计利息	—
减：坏账准备	—
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	—
减：坏账准备	—
合计	9,936,389.34

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		23,620,855.84	-	38,356,982.37	14,736,126.53
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	162,940,362.32	1,143,893.69	164,181,693.69	97,437.68
	银行间市场	244,183,495.74	1,155,199.19	245,301,199.19	-37,495.74
	合计	407,123,858.06	2,299,092.88	409,482,892.88	59,941.94
资产支持证券		-	-	-	-
基金		5,175,121.55	-	3,168,000.00	-2,007,121.55
其他		-	-	-	-
合计		435,919,835.45	2,299,092.88	451,007,875.25	12,788,946.92

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

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金本报告期末未持有期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

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

注：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

注：本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

本基金本报告期内未计提买入返售金融资产减值准备。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期内未计提债权投资减值准备。

6.4.7.6 其他债权投资**6.4.7.6.1 其他债权投资情况**

注：本基金本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期内未计提其他债权投资减值准备。

6.4.7.7 其他权益工具投资**6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况**

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.9 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	291.24
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	38,067.26
其中：交易所市场	32,960.51
银行间市场	5,106.75
应付利息	-
预提费用	71,822.56
合计	110,181.06

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

中银证券安怡债券 A

项目	本期 2026 年 1 月 28 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	386,843,178.18	386,843,178.18
本期申购	53,003,698.99	53,003,698.99
本期赎回（以“-”号填列）	-251,719,784.87	-251,719,784.87
基金拆分/份额折算前	-	-

基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	188,127,092.30	188,127,092.30

中银证券安怡债券 C

项目	本期 2026 年 1 月 28 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	535,428,334.97	535,428,334.97
本期申购	57,726,130.04	57,726,130.04
本期赎回（以“-”号填列）	-378,226,763.44	-378,226,763.44
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	214,927,701.57	214,927,701.57

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期内无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

中银证券安怡债券 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	4,653,680.30	5,840,760.51	10,494,440.81
本期基金份额交易产生的变动数	-1,641,716.41	-1,797,906.58	-3,439,622.99
其中：基金申购款	625,783.04	268,127.67	893,910.71
基金赎回款	-2,267,499.45	-2,066,034.25	-4,333,533.70
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,011,963.89	4,042,853.93	7,054,817.82

中银证券安怡债券 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-

本期期初	-	-	-
本期利润	4,676,574.50	6,948,186.41	11,624,760.91
本期基金份额交易产生的变动数	-1,557,352.05	-2,335,580.47	-3,892,932.52
其中：基金申购款	642,612.06	232,822.57	875,434.63
基金赎回款	-2,199,964.11	-2,568,403.04	-4,768,367.15
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,119,222.45	4,612,605.94	7,731,828.39

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 28 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	1,069,802.13
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	16,936.24
其他	161.54
合计	1,086,899.91

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月28日（基金合同生效日）至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	8,799,147.42
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	8,799,147.42

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 28 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	150,983,879.95
减：卖出股票成本总额	141,930,336.58
减：交易费用	254,395.95
买卖股票差价收入	8,799,147.42

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益-证券出借差价收入。

6.4.7.15 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 1 月 28 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	51,477,354.91
减：卖出/赎回基金成本总额	54,052,412.31
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	2,572.30
减：交易费用	4,428.44
基金投资收益	-2,582,058.14

6.4.7.16 债券投资收益

6.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2026年1月28日（基金合同生效日）至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	1,972,321.24
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	813,961.90
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	2,786,283.14

6.4.7.16.2 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28日（基金合同生效日）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	253,004,200.28
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	250,623,730.02
减：应计利息总额	1,562,283.36
减：交易费用	4,225.00
买卖债券差价收入	813,961.90

6.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益-赎回差价收入。

6.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益-申购差价收入。

6.4.7.17 资产支持证券投资收益**6.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成**

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.17.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益-买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益-赎回差价收入。

6.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益-申购差价收入。

6.4.7.18 贵金属投资收益**6.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成**

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益-买卖贵金属差价收入。

6.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益-赎回差价收入。

6.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益-申购差价收入。

6.4.7.19 衍生工具收益**6.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期内无衍生工具收益-买卖权证差价收入。

6.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期内无衍生工具收益-其他投资收益。

6.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 28 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	506,314.66
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	506,314.66

6.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 28 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	12,788,946.92
股票投资	14,736,126.53
债券投资	59,941.94
资产支持证券投资	-
基金投资	-2,007,121.55
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
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	12,788,946.92

6.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 28 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	15,007.65
基金转换费收入	379.79
其他	-0.64
合计	15,386.80

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.7.23 持有基金产生的费用

项目	本期 2026 年 1 月 28 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	-
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	40,453.88
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	8,101.09

注：上述费用为根据所投资基金的招募说明书列明的计算方法对销售服务费、管理费和托管费进行的估算；上述费用已在本基金所持有基金的净值中体现，不构成本基金的费用项目。

6.4.7.24 信用减值损失

注：本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.25 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 28 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	15,647.94
信息披露费	54,674.62
证券出借违约金	-
账户维护费	1,500.00
其他费用	61.20
合计	71,883.76

6.4.7.26 分部报告

无。

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，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作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**

无。

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
中银国际证券股份有限公司（“中银证券”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	中银国际控股有限公司（基金管理人股东）的控股股东、基金销售机构
江苏银行股份有限公司（“江苏银行”）	基金托管人、基金销售机构

注：下述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****6.4.10.1.1 股票交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 28 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
中银证券	316, 535, 072. 37	100. 00

6. 4. 10. 1. 2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 28 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例（%）
中银证券	594, 316, 631. 57	100. 00

6. 4. 10. 1. 3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 28 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例（%）
中银证券	9, 402, 939, 000. 00	100. 00

6. 4. 10. 1. 4 基金交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 28 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期基金 成交总额的比例（%）
中银证券	110, 704, 888. 77	100. 00

6. 4. 10. 1. 5 权证交易

注：本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

6. 4. 10. 1. 6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月28日（基金合同生效日）至2026年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
中银证券	142, 171. 80	100. 00	32, 960. 51	100. 00

注：1、上述佣金以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示，2024 年 6 月 30 日起证券交易佣金费率水平按照中国证券监督管理委员会于 2024 年 4 月 19 日制定发布的《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》相关要求执行。

2、因基金管理人中银证券属于具有公募管理人资格的综合类券商，根据交易所会员交易席位管理的相关要求，基金管理人旗下公募基金参与证券交易仅能使用基金管理人自有交易席位进行，暂不能使用其他证券公司的交易席位进行证券交易。

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 28 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,929,652.00
其中：应支付销售机构的客户维护费	900,994.25
应支付基金管理人的净管理费	1,028,657.75

注：本基金投资于基金管理人所管理的其他基金部分不收取管理费。支付基金管理人中银证券的管理人报酬按前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金管理人管理的其他基金份额所对应资产净值后剩余部分的 0.60%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬＝前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金管理人管理的其他基金份额所对应资产净值后剩余部分（若为负数，则取 0）×0.60%/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 28 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	321,608.71

注：本基金投资于基金托管人所托管的其他基金部分不收取托管费。支付基金托管人江苏银行的托管费按前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金托管人托管的其他基金份额所对应资产净值后剩余部分的 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费＝前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金托管人托管的其他基金份额所对应资产净值后剩余部分（若为负数，则取 0）×0.10%/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 28 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中银证券安怡债券 A	中银证券安怡债券 C	合计
江苏银行	-	27,136.85	27,136.85

中国银行	-	578,104.21	578,104.21
中银证券	-	32,971.68	32,971.68
合计	-	638,212.74	638,212.74

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.35% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给中银证券，再由中银证券计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 C 类基金份额的基金资产净值 × 0.35% / 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

注：本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(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

注：本基金本报告期内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

注：本基金本报告期内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

注：本基金的基金管理人于本基金本报告期内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

注：于本基金本报告期末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

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 28 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
江苏银行	9,936,389.34	1,069,802.13

注：本基金的银行存款由基金托管人江苏银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

注：本基金本报告期内无交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用。

6.4.11 利润分配情况

注：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

注：本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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 06 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 8,500,372.60 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
210205	21 国开 05	2026 年 7 月 1 日	110.68	90,000	9,961,500.82
合计				90,000	9,961,500.82

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 06 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 35,000,000.00 元，于 2026 年 07 月 01 日前陆续到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末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

本基金主要投资于债券、股票等具有良好流动性的金融工具。与这些金融工具相关的风险，以及本基金的基金管理人对于相关风险采取的风险管理政策如下所述。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为债券型证券投资基金，其预期收益和风险高于货币市场基金，而低于混合型及股票

型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种。本基金主要投资于债券、股票等具有良好流动性的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括管理风险、技术风险及市场风险。本基金在有效控制投资风险的前提下，通过积极主动的投资管理，力争获取超越业绩比较基准的投资收益，追求基金资产的长期稳定增值。

本基金的基金管理人在公司风险管理体系的基础上构建明晰基金业务的风险管理组织架构和职能，由董事会及其风险控制委员会、总裁办公会、风险管理委员会、风险管理部、公募投资部、中后线部门等相关业务部门构成多层级风险管理框架体系。董事会决定公司风险偏好，并在风险控制委员会的协助下监察公司基金业务的总体风险及管理状况。总裁办公会领导公司基金业务的风险管理。风险管理委员会协助总裁办公会在董事会授权范围内听取和审议包括公募基金在内的资产管理业务风险相关报告，评估风险管理状况。在业务操作层面，风险管理部、资管业务管理部负责落实公司基金业务的风险管理制度，协调并与各部门合作履行风险管理职责。业务主管对各自业务的风险管理负有首要责任。财务管理部、运营服务部、审计部、内控与法律合规部等中后线部门在各自职能范围内支持或监督公司风险管理。

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同责任，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。本基金的银行存款存放在本基金的托管人江苏银行，因而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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026 年 6 月 30 日
A-1	—
A-1 以下	—
未评级	22,142,602.19
合计	22,142,602.19

注：未评级部分包括国债。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026 年 6 月 30 日
AAA	142,850,547.94
AAA 以下	—
未评级	244,489,742.75
合计	387,340,290.69

注：未评级部分包括公司债、中期票据、政策性金融债、国债。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时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。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。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。

于 2026 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 43,500,372.60 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（净资产）无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：不适用。

6.4.13.3.2 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在基金运作过程中严格按照《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》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见“期末本基金持有的流通受限证券”附注。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。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2026 年 6 月 30 日，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2026 年 6 月 30 日，本基金确认的净赎回申请未超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购

交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

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。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

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	9,936,389.34	-	-	-	9,936,389.34
结算备付金	4,921,229.86	-	-	-	4,921,229.86
存出保证金	172,041.54	-	-	-	172,041.54
交易性金融资产	22,142,602.19	307,243,741.36	80,096,549.33	41,524,982.37	451,007,875.25
应收股利	-	-	-	20,952.93	20,952.93
应收申购款	-	-	-	139,333.00	139,333.00
应收清算款	-	-	-	16,908,596.67	16,908,596.67
资产总计	37,172,262.93	307,243,741.36	80,096,549.33	58,593,864.97	483,106,418.59
负债					
应付赎回款	-	-	-	21,253,307.60	21,253,307.60
应付管理人报酬	-	-	-	259,835.70	259,835.70
应付托管费	-	-	-	43,305.95	43,305.95
卖出回购金融资产款	43,500,372.60	-	-	-	43,500,372.60
应付销售服务费	-	-	-	79,737.77	79,737.77
应交税费	-	-	-	18,237.83	18,237.83
其他负债	-	-	-	110,181.06	110,181.06
负债总计	43,500,372.60	-	-	21,764,605.91	65,264,978.51
利率敏感度缺口	-6,328,109.67	307,243,741.36	80,096,549.33	36,829,259.06	417,841,440.08

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

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变	
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：人民币元）
		本期末（2026 年 6 月 30 日）
	市场利率下降 25 个基点	4,883,610.91
	市场利率上升 25 个基点	-4,762,401.05

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。本基金持有不以记账本位币人民币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	2,936,741.27	-	2,936,741.27
资产合计	-	2,936,741.27	-	2,936,741.27
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇 风险敞口净额	-	2,936,741.27	-	2,936,741.27

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变	
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：人民币元）
		本期末（2026 年 6 月 30 日）
	所有外币相对人民币升值 5%	146,837.06

	所有外币相对人民币贬值 5%	-146,837.06
--	----------------	-------------

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股票和债券，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。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金充分发挥基金管理人的研究优势，在注重风险控制的基础上，将严谨的定性分析和规范的定量模型相结合，动态调整稳健资产和风险资产的配置比例；在此基础上精选债券和股票，以实现基金资产的稳健增值。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，投资于股票、存托凭证、股票型基金、混合型基金等权益类资产及可转换债券、可交换债券资产的比例合计为基金资产的 5%-20%；其中投资于境内股票资产（含股票型 ETF）的比例不低于基金资产的 5%，投资于港股通标的股票占本基金股票资产的比例为 0%-50%；其中，本基金所指的计入权益类资产的混合型基金指基金合同中明确约定股票投资占基金资产的比例为 60%以上或者最近 4 个季度披露的股票投资占基金资产的比例均在 60%以上的混合型基金。本基金对经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金投资比例不超过基金资产净值的 10%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

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	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	38,356,982.37	9.18
交易性金融资产—基金投资	3,168,000.00	0.76
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	41, 524, 982. 37	9. 94
----	------------------	-------

6. 4. 13. 4. 3. 2 其他价格风险的敏感性分析

注：于 2026 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金净资产的比例为 9. 94%，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金净资产无重大影响。

6. 4. 13. 4. 4 采用风险价值法管理风险

注：不适用。

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层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下： 第一层次：在计量日能够取得的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到的输入值； 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
第一层次	41, 524, 982. 37
第二层次	409, 482, 892. 88
第三层次	—
合计	451, 007, 875. 25

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。 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，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股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。
--

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2026 年 06 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

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	38,356,982.37	7.94
	其中：股票	38,356,982.37	7.94
2	基金投资	3,168,000.00	0.66
3	固定收益投资	409,482,892.88	84.76
	其中：债券	409,482,892.88	84.76
	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	14,857,619.20	3.08
8	其他各项资产	17,240,924.14	3.57
9	合计	483,106,418.59	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合**7.2.1 报告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（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	33,230,241.10	7.95
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	2,190,000.00	0.52
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	-	-
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	35,420,241.10	8.48

7.2.2 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（%）
基础材料	153,733.35	0.04
消费者非必需品	-	-
消费者常用品	-	-
能源	-	-
金融	-	-
医疗保健	2,561,180.25	0.61
工业	-	-
信息技术	221,827.67	0.05
电信服务	-	-
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	2,936,741.27	0.70

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

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

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688525	佰维存储	7,200	3,562,056.00	0.85
2	688012	中微公司	7,053	3,304,330.50	0.79
3	688498	源杰科技	1,725	3,253,350.00	0.78
4	688766	普冉股份	3,900	2,989,740.00	0.72
5	300308	中际旭创	2,200	2,794,000.00	0.67
6	300857	协创数据	6,600	2,243,340.00	0.54
7	300475	香农芯创	7,300	2,190,000.00	0.52
8	300223	北京君正	6,800	1,692,520.00	0.41
9	688519	南亚新材	4,000	1,520,160.00	0.36

10	300054	鼎龙股份	11,900	1,261,043.00	0.30
11	300666	江丰电子	3,400	1,253,240.00	0.30
12	300548	长芯博创	4,000	1,112,000.00	0.27
13	300346	南大光电	10,600	982,090.00	0.24
14	300390	天华新能	10,100	944,451.00	0.23
15	301358	湖南裕能	10,600	804,222.00	0.19
16	688220	翱捷科技	5,700	708,624.00	0.17
17	02359	药明康德	5,000	667,480.68	0.16
18	301377	鼎泰高科	1,200	661,080.00	0.16
19	688110	东芯股份	3,200	651,840.00	0.16
20	06990	科伦博泰生物	1,600	606,178.42	0.15
21	300398	飞凯材料	9,400	580,450.00	0.14
22	300903	科翔股份	5,300	536,943.00	0.13
23	300438	鹏辉能源	6,000	497,100.00	0.12
24	301536	星辰科技	3,100	399,001.00	0.10
25	02315	百奥赛图-B	9,000	365,364.24	0.09
26	03347	泰格医药	12,000	362,289.58	0.09
27	02269	药明生物	12,000	360,621.96	0.09
28	300503	昊志机电	3,700	341,510.00	0.08
29	301150	中一科技	4,760	300,403.60	0.07
30	300769	德方纳米	3,800	252,700.00	0.06
31	301392	汇成真空	800	230,912.00	0.06
32	06869	长飞光纤光缆	1,000	221,827.67	0.05
33	02252	微创机器人-B	10,000	199,245.37	0.05
34	02259	紫金黄金国际	2,000	153,733.35	0.04
35	301606	绿联科技	2,500	152,550.00	0.04
36	300855	图南股份	4,500	140,670.00	0.03
37	301500	飞南资源	2,300	59,915.00	0.01

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	300308	中际旭创	7,408,366.00	1.77
2	688072	拓荆科技	5,875,767.19	1.41
3	300502	新易盛	5,720,836.00	1.37
4	688525	佰维存储	5,104,052.93	1.22
5	300857	协创数据	4,887,333.80	1.17
6	688766	普冉股份	4,837,484.46	1.16
7	300033	同花顺	4,809,475.60	1.15
8	688012	中微公司	4,770,349.48	1.14
9	300408	三环集团	4,760,496.00	1.14
10	688498	源杰科技	4,713,968.77	1.13

11	688183	生益电子	4,247,878.35	1.02
12	01385	上海复旦	1,977,801.05	0.47
13	688385	复旦微电	1,543,161.85	0.37
14	300475	香农芯创	3,367,613.00	0.81
15	300433	蓝思科技	3,016,477.00	0.72
16	301358	湖南裕能	2,969,935.00	0.71
17	300390	天华新能	2,896,562.00	0.69
18	300548	长芯博创	2,864,057.00	0.69
19	688702	盛科通信	2,570,193.63	0.62
20	300223	北京君正	2,275,501.00	0.54

注：本项“买入金额”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。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	300308	中际旭创	8,897,117.00	2.13
2	688072	拓荆科技	6,763,363.71	1.62
3	300502	新易盛	6,434,571.00	1.54
4	300408	三环集团	4,966,688.50	1.19
5	300033	同花顺	4,799,338.80	1.15
6	688183	生益电子	4,779,238.00	1.14
7	688525	佰维存储	4,677,468.28	1.12
8	688766	普冉股份	4,241,851.46	1.02
9	688702	盛科通信	4,069,670.60	0.97
10	688498	源杰科技	3,836,377.00	0.92
11	688012	中微公司	3,582,698.72	0.86
12	300390	天华新能	3,446,267.00	0.82
13	01385	上海复旦	1,874,971.23	0.45
14	688385	复旦微电	1,487,762.94	0.36
15	300857	协创数据	3,291,941.00	0.79
16	300475	香农芯创	2,418,857.00	0.58
17	300433	蓝思科技	2,386,633.00	0.57
18	301358	湖南裕能	2,178,526.00	0.52
19	300548	长芯博创	1,859,981.00	0.45
20	300474	景嘉微	1,789,925.00	0.43

注：本项“卖出金额”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。

7.4.3 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

买入股票成本（成交）总额	165,551,192.42
卖出股票收入（成交）总额	150,983,879.95

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”和“卖出股票的收入（成交）总额”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

金额单位: 人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	82,375,162.48	19.71
2	央行票据	—	—
3	金融债券	165,050,668.49	39.50
	其中: 政策性金融债	53,068,991.78	12.70
4	企业债券	142,039,091.50	33.99
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	20,017,970.41	4.79
7	可转债(可交换债)	—	—
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	409,482,892.88	98.00

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

金额单位: 人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	2600001	26 超长特别国债 01	400,000	40,097,092.90	9.60
2	210205	21 国开 05	300,000	33,205,002.74	7.95
3	232680007	26 兴业银行二级资本债 01	300,000	30,214,116.16	7.23
4	232680009	26 工行二级资本债 02BC	300,000	30,112,224.66	7.21
5	019827	26 国债 01	220,000	22,142,602.19	5.30

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

注: 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

注: 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

注: 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

本基金投资范围未包括股指期货, 无相关投资政策。

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

本基金投资范围未包括国债期货，无相关投资政策。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金投资范围未包括国债期货。

7.12 本报告期投资基金情况

7.12.1 投资政策及风险说明

7.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金
1	517520	永赢中证沪深港黄金产业股票ETF	交易型开放式（ETF）	2,000,000.00	3,168,000.00	0.76	否

7.12.3 报告期末基金持有的全部公开募集不动产投资信托基金情况

注：本基金本报告期末未持有公开募集不动产投资信托基金。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

本基金投资的前十名证券的发行主体在报告编制日前一年内受到处罚如下：

国家开发银行在报告编制日前一年内受到中国人民银行、国家外汇管理局北京市分局的行政处罚。

兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局的行政处罚，受到中国银行间市场交易商协会的行政监督管理措施。

中国工商银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局、中国人民银行、国家外汇管理局北京市分局的行政处罚。

中国建设银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局、中国人民银

行的行政处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规、基金合同及公司投资制度的要求。

本基金投资的前十名证券的其他发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年以内受到公开谴责、处罚的情形。

7.13.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，不存在投资于超出基金合同约定备选股票库之外的股票。

7.13.3 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	172,041.54
2	应收清算款	16,908,596.67
3	应收股利	20,952.93
4	应收利息	-
5	应收申购款	139,333.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,240,924.14

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的股票。

7.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，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 (%)
中银证券	1,473	127,716.97	-	-	188,127,092.30	100.00

安怡债券 A						
中银证券安怡债券 C	1,119	192,071.23	6,922,624.48	3.22	208,005,077.09	96.78
合计	2,592	155,499.53	6,922,624.48	1.72	396,132,169.39	98.28

注：机构投资者/个人投资者持有份额占总份额比例计算中，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），
 户均持有的基金份额的合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

8.2 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	中银证券安怡债券 A	69,709.08	0.0371
	中银证券安怡债券 C	100.08	0.0000
	合计	69,809.16	0.0173

8.3 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	中银证券安怡债券 A	0~10
	中银证券安怡债券 C	—
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	中银证券安怡债券 A	—
	中银证券安怡债券 C	—
	合计	—

注：本基金本报告期末本基金基金经理未持有本基金。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中银证券安怡债券 A	中银证券安怡债券 C
基金合同生效日 (2026 年 1 月 28 日) 基金份额总额	386,843,178.18	535,428,334.97
基金合同生效日起至 报告期期末基金总申 购份额	53,003,698.99	57,726,130.04
减：基金合同生效日 起至报告期期末基金	251,719,784.87	378,226,763.44

总赎回份额		
基金合同生效日起至 报告期期末基金拆分 变动份额	-	-
本报告期期末基金份 额总额	188, 127, 092. 30	214, 927, 701. 57

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 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，基金管理人无涉及基金管理业务的重大人事变动，公司其他董事、监事、高级管理人员变动情况请参见《中银国际证券股份有限公司 2026 年半年度报告》。

本报告期，基金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

一、本报告期内，本基金管理人无涉及基金管理业务的诉讼，公司其他主要诉讼、仲裁事项请参见《中银国际证券股份有限公司 2026 年半年度报告》；

二、本报告期内，无涉及基金财产的诉讼事项；

三、本报告期内，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.7.1 管理人受调查或处罚等情况

注：本报告期内，公司基金管理业务未有管理人受调查或处罚等情况，其他受处罚情况请参见《中银国际证券股份有限公司 2026 年半年度报告》。

10.7.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内，公司基金管理业务未有从业人员受调查或处罚等情况，其他受处罚情况请参见

《中银国际证券股份有限公司 2026 年半年度报告》。

10.7.3 托管人受调查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人未受到调查或处罚。

10.7.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人相关从业人员未受到调查或处罚。

10.8 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

10.8.1 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 (%)	
中银证券	2	316,535,072.37	100.00	142,171.80	100.00	-

注：1、由于交易所系统限制，本基金管理人作为上海和深圳证券交易所的会员单位目前尚不能再租用其他证券公司的交易单元。

2、今后基金专用交易席位的选择标准如下：

- (1)经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (2)具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3)具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

3、今后基金专用交易席位的选择程序如下：

- (1)本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构。
- (2)基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

10.8.2 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		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债	成交金额	占当期债	成交	占当	成交金额	占当期基

		券成交总额的 比例 (%)		券回购成交总额的 比例 (%)	金 额	期权证成交总额的 比例 (%)		金成交总额的 比例 (%)
中 银 证 券	594,316,631.57	100.00	9,402,939,000.00	100.00	-	-	110,704,888.77	100.00

注：1、由于交易所系统限制，本基金管理人作为上海和深圳证券交易所的会员单位目前尚不能再租用其他证券公司的交易单元。

2、今后基金专用交易席位的选择标准如下：

- (1)经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (2)具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3)具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

3、今后基金专用交易席位的选择程序如下：

- (1)本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构。
- (2)基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

10.9 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	中银国际证券股份有限公司关于旗下中银证券安怡债券型证券投资基金新增中国银行股份有限公司为销售机构的公告	规定报刊、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 1 月 5 日
2	中银国际证券股份有限公司关于旗下中银证券安怡债券型证券投资基金新增江苏银行股份有限公司为销售机构	规定报刊、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 1 月 12 日

	的公告		
3	中银证券安怡债券型证券投资基金基金合同生效公告	规定报刊、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 1 月 29 日
4	中银证券安怡债券型证券投资基金开放日常申购（赎回、转换、定期定额投资）业务公告	规定报刊、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 3 月 21 日
5	中银国际证券股份有限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）	规定报刊、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 3 月 31 日
6	中银国际证券股份有限公司对外行使投票表决权（2025 年度）情况信息披露	公司官网	2026 年 4 月 11 日
7	中银国际证券股份有限公司旗下基金 2026 年第 1 季度报告提示性公告	规定报刊、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 4 月 21 日
8	中银证券安怡债券型证券投资基金 2026 年第一季度报告	公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 4 月 21 日
9	中银国际证券股份有限公司关于旗下部分基金新增上海万得基金销售有限公司为销售机构并进行费率优惠的公告	规定报刊、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 4 月 23 日
10	中银国际证券股份有限公司关于增加深圳前海微众银行股份有限公司为旗下基金销售机构并进行费率优惠的公告	规定报刊、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 6 月 2 日
11	中银证券安怡债券型证券投资基金基金合同更新	公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 6 月 27 日
12	中银国际证券股份有限公司关于旗下部分基金调整业绩比较基准并修订基金合同等法律文件的公告	规定报刊、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 6 月 27 日
13	中银证券安怡债券型证券投资基金(A 类份额)基金产品资料概要更新	公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 6 月 27 日
14	中银证券安怡债券型证券投资基金(C 类份额)基金产品资料概要更新	公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 6 月 27 日

注：全部公告均在公司网站披露，部分公告在公司网站及报纸披露。

§ 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

注：本基金本报告期内单一投资者持有基金份额比例未有达到或者超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据《公开募集证券投资基金业绩比较基准指引》的相关规定，为更好地反映基金投资风格，提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性，经与基金托管人协商一致，本基金管理人决定自 2026 年 7 月 27 日起调整本基金的业绩比较基准并对基金合同等法律文件有关条款进行修订。详细内容请阅读本基金管理人于 2026 年 6 月 27 日发布的《中银国际证券股份有限公司关于旗下部分基金调整业绩比较基准并修订基金合同等法律文件的公告》。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予本基金募集注册的文件
- 2、基金合同
- 3、托管协议
- 4、法律意见书
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 7、中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可以在开放时间内至基金管理人或基金托管人住所免费查阅，也可登录基金管理人基金网站 www.bocifunds.com 查阅。

中银国际证券股份有限公司

2026 年 8 月 31 日