

中银证券价值精选灵活配置混合型证券投资 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：中国建设银行股份有限公司

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、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。

基金托管人中国建设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 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	5
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	6
3.3 其他指标	7
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	11
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
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	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
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	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	45
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	45
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	45

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	45
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	46
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	46
7.12 投资组合报告附注	46
§ 8 基金份额持有人信息	47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	47
8.2 盈利投资者数量占比	47
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	47
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	47
§ 9 开放式基金份额变动	47
§ 10 重大事件揭示	48
10.1 基金份额持有人大会决议	48
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	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	48
10.4 基金投资策略的改变	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	48
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	48
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	49
10.8 其他重大事件	50
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	51
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	51
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	51
§ 12 备查文件目录	51
12.1 备查文件目录	51
12.2 存放地点	51
12.3 查阅方式	51

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中银证券价值精选灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	中银证券价值精选混合
基金主代码	002601
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 5 月 10 日
基金管理人	中银国际证券股份有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	70,571,555.25 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过对权益类资产和固定收益类资产的灵活配置充分捕捉各证券子市场的绝对收益机会，在合理控制风险、保障基金资产流动性的前提下，力求持续高效地获取稳健回报。
投资策略	本基金通过资产配置策略、权益类资产投资策略（股票投资策略、权证投资策略）、固定收益类资产投资策略（目标久期策略、收益率曲线策略、相对价值策略、骑乘策略、利差套利策略、信用类债券投资策略、可转债投资策略、中小企业私募债投资策略、资产支持证券投资策略），以期获得长期稳定收益。
业绩比较基准	60%×沪深 300 指数收益率+40%×中国债券总指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，其预期收益和风险高于货币市场基金、债券型基金，而低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险品种。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	盖文国	王小飞
	联系电话	021-20328000	021-60637103
	电子邮箱	gmkf@bocichina.com	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		956026, 400-620-8888	021-60637228
传真		021-50372474	021-60635778
注册地址		上海市浦东新区银城中路 200 号 中银大厦 39F	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		上海市浦东新区银城中路 200 号 中银大厦 39F	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		200120	100033
法定代表人		周权	张金良

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
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 楼

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	19,776,916.81
本期利润	-3,922,773.97
加权平均基金份额本期利润	-0.0480
本期加权平均净值利润率	-2.92%
本期基金份额净值增长率	-6.49%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-3,569,468.11
期末可供分配基金份额利润	-0.0506
期末基金资产净值	97,596,069.85
期末基金份额净值	1.3829
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	33.19%

- 注：1、本基金合同生效日为 2019 年 5 月 10 日。
- 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、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。
- 4、上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 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

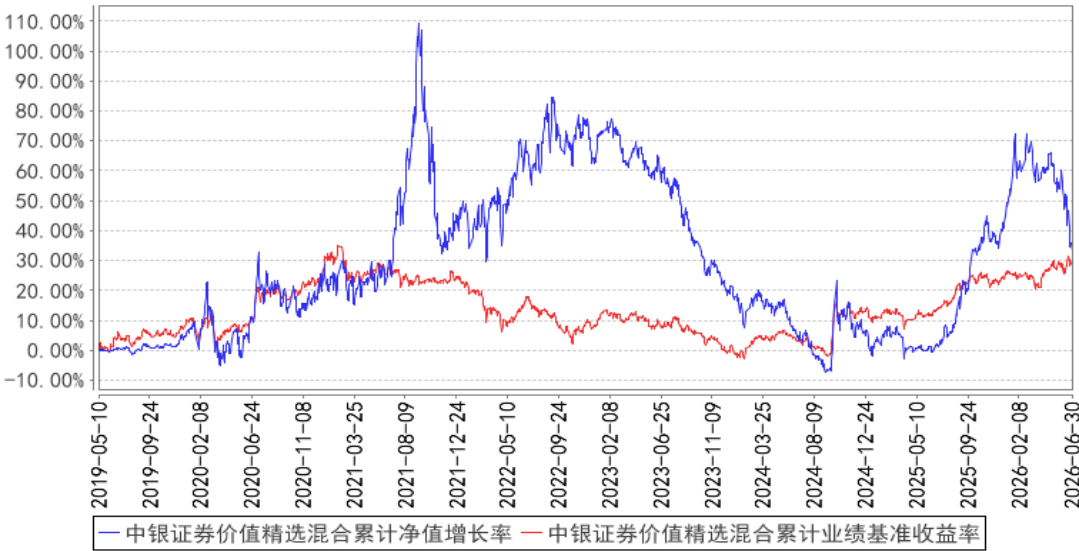
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-15.79%	1.47%	7.31%	0.76%	-23.10 %	0.71%
过去六个月	-6.49%	1.62%	4.91%	0.68%	-11.40 %	0.94%

过去一年	31.24%	1.44%	15.01%	0.61%	16.23%	0.83%
过去三年	-16.99%	1.36%	20.24%	0.66%	-37.23%	0.70%
过去五年	2.57%	1.61%	2.01%	0.66%	0.56%	0.95%
过去七年	32.44%	1.61%	25.00%	0.69%	7.44%	0.92%
自基金合同生效起至今	33.19%	1.60%	30.05%	0.69%	3.14%	0.91%

注：本基金合同生效日为 2019 年 5 月 10 日，本基金的业绩比较基准为：60%×沪深 300 指数收益率+40%×中国债券总指数收益率

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

中银证券价值精选混合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



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		
林博	本基金的	2023 年 2	-	12 年	林博程，硕士研究生，中国国籍，已取得

程	基金经理	月 22 日			证券、基金从业资格。2013 年 9 月至 2014 年 4 月任职于招商证券股份有限公司，担任银行业分析师；2014 年 4 月至 2015 年 10 月任职于华泰证券股份有限公司，担任银行业分析师；2015 年 10 月至 2021 年 7 月任职于申万菱信基金管理有限公司，担任基金经理；2021 年 7 月加入中银国际证券股份有限公司，历任中银证券优势成长混合型证券投资基金基金经理，现任中银证券科技创新混合型证券投资基金 (LOF)、中银证券精选行业股票型证券投资基金、中银证券价值精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
赵颖芳	本基金的基金经理	2025 年 3 月 24 日	-	11 年	赵颖芳，硕士研究生，中国国籍，已取得证券、基金从业资格。2014 年 12 月至 2015 年 6 月任职于中银国际证券股份有限公司上海欧阳路证券营业部，担任投资顾问助理；2015 年 6 月加入中银国际证券股份有限公司资产管理板块，曾任研究与交易部、信评与投资监督部周期行业研究员，现任中银证券价值精选灵活配置混合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遵规守信情况的说明

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同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 年上半年权益市场呈现显著的结构分化格局，市场交投持续维持高位。受全球 AI 算力资本开支扩张、国内半导体产业国产替代及新质生产力相关政策支撑，科创板与创业板指数涨幅居前；相反上证 50 与沪深 300 等大盘指数表现偏弱，消费、地产与金融等传统内需板块资金持续流出，市场资金高度集中于科技赛道。上半年红利价值与科技成长走出罕见的极端分化行情；行情运行节奏同时受国内流动性环境、内需修复偏弱、海外美联储政策预期波动及地缘风险等多重内外因素共同影响。在此期间，我们根据行业基本面趋势、市场预期并结合上市公司业绩情况进行了相应的持仓调整，提升能源、有色等板块的配置，整体投资策略保持均衡，以动态低估值行业与公司为主。

站在中长期的维度看，寻找估值底部特征明显的行业与标的是本产品的主要方向，例如资源类、顺周期、内需消费等，并优选各行业和细分领域的龙头公司进行投资，以期为投资人带来良好的长期成长。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.3829 元；本报告期基金份额净值增长率为-6.49%，业绩比较基准收益率为 4.91%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2026 年下半年，海外方面，需核心关注美联储货币政策的推进节奏与全球地缘博弈演变，两者将持续影响全球市场风险偏好。国内方面，需重点关注内需修复力度，“反内卷”相关政策落地执行情况，以及高端制造产业升级带来结构性投资机会。我们认为在当下环境中，金属矿产等泛资源类板块战略价值持续强化，优选供给刚性或持续出清、需求具备支撑、且估值处于合理区间的标的。从长周期视角来看，当下国内正处于新旧经济动能迭代转型的关键时期，中长期经济增长动能充足。未来我们将持续跟踪产业政策与景气度变化，动态调整行业与个股布局。

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

本基金报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金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合规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 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：中银证券价值精选灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	7,654,478.23	11,979,659.96
结算备付金		966,764.96	1,545,123.03
存出保证金		105,392.72	109,886.55
交易性金融资产	6.4.7.2	88,415,251.58	123,962,620.00
其中：股票投资		88,017,142.85	123,962,620.00
基金投资		-	-
债券投资		398,108.73	-
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		3,231,091.03	-
应收股利		-	-
应收申购款		40,295.74	22,207.34
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		100,413,274.26	137,619,496.88
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		1,436,212.99	1,160,627.65
应付赎回款		1,048,992.90	1,254,434.01
应付管理人报酬		111,002.27	137,643.14
应付托管费		18,500.36	22,940.51
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.29	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	202,495.60	318,290.03
负债合计		2,817,204.41	2,893,935.34
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	70,571,555.25	91,099,011.73
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	27,024,514.60	43,626,549.81
净资产合计		97,596,069.85	134,725,561.54
负债和净资产总计		100,413,274.26	137,619,496.88

注： 报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.3829 元，基金份额总额 70,571,555.25 份。

6.2 利润表

会计主体：中银证券价值精选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-2,910,849.72	-2,770,729.85
1. 利息收入		23,626.75	25,955.75
其中：存款利息收入	6.4.7.13	23,626.75	25,955.75
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		20,684,944.63	-3,198,476.28
其中：股票投资收益	6.4.7.14	19,314,610.65	-5,220,931.20
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	8.48	-
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
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	1,370,325.50	2,022,454.92
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	-23,699,690.78	395,653.66
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	80,269.68	6,137.02
减：二、营业总支出		1,011,924.25	965,275.17
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	798,575.51	758,935.09
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	133,095.87	126,489.16
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		0.04	-
8. 其他费用	6.4.7.23	80,252.83	79,850.92

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-3,922,773.97	-3,736,005.02
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-3,922,773.97	-3,736,005.02
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-3,922,773.97	-3,736,005.02

6.3 净资产变动表

会计主体：中银证券价值精选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	91,099,011.73	-	43,626,549.81	134,725,561.54
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	91,099,011.73	-	43,626,549.81	134,725,561.54
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-20,527,456.48	-	-16,602,035.21	-37,129,491.69
（一）、综合收益总额	-	-	-3,922,773.97	-3,922,773.97
（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）	-20,527,456.48	-	-12,679,261.24	-33,206,717.72
其中：1. 基金申购款	10,825,326.57	-	7,187,267.11	18,012,593.68
2. 基金赎回款	-31,352,783.05	-	-19,866,528.35	-51,219,311.40
（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	70,571,555.25	-	27,024,514.60	97,596,069.85
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	125,841,408.59	-	10,744,546.00	136,585,954.59
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	125,841,408.59	-	10,744,546.00	136,585,954.59
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-11,378,125.84	-	-4,597,125.49	-15,975,251.33
(一)、综合收益总额	-	-	-3,736,005.02	-3,736,005.02
(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)	-11,378,125.84	-	-861,120.47	-12,239,246.31
其中：1. 基金申购款	3,997,965.41	-	250,445.70	4,248,411.11
2. 基金赎回款	-15,376,091.25	-	-1,111,566.17	-16,487,657.42
(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	114,463,282.75	-	6,147,420.51	120,610,703.26

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：

<u>周冰</u>	<u>沈锋</u>	<u>金坚</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中银证券价值精选灵活配置混合型证券投资基金是根据原中银证券保本 1 号混合型证券投资基金(以下简称“中银证券保本 1 号混合基金”)《中银证券保本 1 号混合型证券投资基金基金合同》的约定,由中银证券保本 1 号混合基金转型而来。原中银证券保本 1 号混合型证券投资基金为契约型开放式基金,存续期限不定,中银证券保本 1 号混合基金第一个保本期于 2019 年 4 月 29 日到期,但中银证券保本 1 号混合基金不能满足现行法律法规规定的避险策略型基金运作的条件,基金管理人经与托管人协商一致,根据《中银证券价值精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的约定转型为非保本的混合型基金,即自 2019 年 5 月 10 日起,中银证券保本 1 号混合基金更名为中银证券价值精选灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”),《中银证券价值精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于同一日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为中银国际证券股份有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中银证券价值精选灵活配置混合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,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证等权益类金融工具,债券等固定收益类金融工具(包括国债、中央银行票据、政策性金融债、金融债及次级债、企业债、公司债、可转换债券、分离交易可转换债券、可交换债券、短期融资券、中期票据、地方政府债、城投债、中小企业私募债、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单等)以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。本基金的投资组合比例为:股票投资占基金资产的比例为 0%-95%;每个交易日日终应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券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;权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率*60%+中国债券总指数收益率*40%。

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》和中国证监会、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的要求，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 01 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 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

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

根据财政部、国家税务总局财税[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[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《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[2016]36 号《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《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《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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市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。

(4) 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。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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	7,654,478.23
等于：本金	7,653,702.30
加：应计利息	775.93
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	7,654,478.23

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		101,889,836.34	-	88,017,142.85	-13,872,693.49
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	398,100.00	8.73	398,108.73	0.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	398,100.00	8.73	398,108.73	0.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		102,287,936.34	8.73	88,415,251.58	-13,872,693.49

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：本基金本报告期内及上年度可比期间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	307.53
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	123,757.15
其中：交易所市场	123,757.15
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	78,430.92
合计	202,495.60

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	91,099,011.73	91,099,011.73
本期申购	10,825,326.57	10,825,326.57
本期赎回（以“-”号填列）	-31,352,783.05	-31,352,783.05
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	70,571,555.25	70,571,555.25

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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-24,715,187.54	68,341,737.35	43,626,549.81
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-24,715,187.54	68,341,737.35	43,626,549.81
本期利润	19,776,916.81	-23,699,690.78	-3,922,773.97
本期基金份额交易产生的变动数	1,368,802.62	-14,048,063.86	-12,679,261.24
其中：基金申购款	-1,140,058.23	8,327,325.34	7,187,267.11
基金赎回款	2,508,860.85	-22,375,389.20	-19,866,528.35
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-3,569,468.11	30,593,982.71	27,024,514.60

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	21,350.89
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	2,073.49
其他	202.37
合计	23,626.75

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1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	19,314,610.65
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	19,314,610.65

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1日至2026年6月30日
卖出股票成交总额	903,711,438.92
减：卖出股票成本总额	883,039,952.25
减：交易费用	1,356,876.02
买卖股票差价收入	19,314,610.65

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 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	8.48
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	—
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	8.48

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益—买卖债券差价收入。

6.4.7.15.3 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。

6.4.7.15.4 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。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益**6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成**

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资。

6.4.7.16.2 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—买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.16.3 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。

6.4.7.16.4 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

6.4.7.17 贵金属投资收益**6.4.7.17.1 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。

6.4.7.17.2 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。

6.4.7.17.3 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。

6.4.7.17.4 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。

6.4.7.18 衍生工具收益**6.4.7.18.1 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。

6.4.7.18.2 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。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,370,325.50
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	1,370,325.50

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-23,699,690.78
股票投资	-23,699,690.78
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
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	-23,699,690.78

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	70,630.71
基金转换费收入	9,638.97
合计	80,269.68

注：本基金赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取，并全额归入基金财产。

6.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	18,923.55
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	1,821.91
合计	80,252.83

6.4.7.24 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。

6.4.8 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

截至资产负债表日，本基金无须作披露的日后事项。

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
中国建设银行股份有限公司（“建设银行”）	基金托管人、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	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

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

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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

	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例（%）	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例（%）
中银证券	1,774,505,604.80	100.00	464,913,496.63	100.00

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 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1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	791,252.24	100.00	123,757.15	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日			
	当期 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	207,303.39	100.00	46,573.96	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 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	798,575.51	758,935.09
其中：应支付销售机构的客户维护费	386,289.78	348,657.34

应支付基金管理人的净管理费	412,285.73	410,277.75
---------------	------------	------------

注：支付基金管理人中银国际证券股份有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

基金管理人报酬计算公式为：日管理人报酬＝前一日基金资产净值 X 1.20% / 当年天数。

客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	133,095.87	126,489.16

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20%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× 0.20% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无销售服务费。

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

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：本基金本报告期内及上年度可比期间未有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情况。

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：本基金本报告期内及上年度可比期间未有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。

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及上年度可比期间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及上年度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 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	7,654,478.23	21,350.89	13,953,849.71	25,356.90

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，并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：本基金本报告期内及上年度可比期间未有在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
127114	宣化转债	2026 年 6 月 26 日	1 个月内（含）	新债未上市	100.00	100.00	3,981	398,100.00	398,108.73	-

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

注：本基金本报告期末无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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末未持有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

本基金主要投资于股票、债券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

本基金为混合型证券投资基金，其预期收益和风险高于货币市场基金、债券型基金，而低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险品种。本基金主要投资于股票、债券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建设银行，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

注：本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度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：本基金本报告期末及上年度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	上年度末 2025 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	398,108.73	-
未评级	-	-
合计	398,108.73	-

注：本基金上年度末未持有按长期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度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：本基金本报告期末及上年度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，本基金所承担的全部金融负债的合约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，因此账面余额即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期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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为货币资金、结算备付金、存出保证金和债券投资等。

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	7,654,478.23	-	-	-	7,654,478.23
结算备付金	966,764.96	-	-	-	966,764.96
存出保证金	105,392.72	-	-	-	105,392.72
交易性金融资产	398,108.73	-	-	88,017,142.85	88,415,251.58
应收申购款	-	-	-	40,295.74	40,295.74
应收清算款	-	-	-	3,231,091.03	3,231,091.03
资产总计	9,124,744.64	-	-	91,288,529.62	100,413,274.26
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,048,992.90	1,048,992.90
应付管理人报酬	-	-	-	111,002.27	111,002.27
应付托管费	-	-	-	18,500.36	18,500.36
应付清算款	-	-	-	1,436,212.99	1,436,212.99
应交税费	-	-	-	0.29	0.29
其他负债	-	-	-	202,495.60	202,495.60
负债总计	-	-	-	2,817,204.41	2,817,204.41
利率敏感度缺口	9,124,744.64	-	-	88,471,325.21	97,596,069.85

上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	11,979,659.96	-	-	-	11,979,659.96
结算备付金	1,545,123.03	-	-	-	1,545,123.03
存出保证金	109,886.55	-	-	-	109,886.55
交易性金融资产	-	-	-	123,962,620.00	123,962,620.00
应收申购款	-	-	-	22,207.34	22,207.34
资产总计	13,634,669.54	-	-	123,984,827.34	137,619,496.88
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,254,434.01	1,254,434.01
应付管理人报酬	-	-	-	137,643.14	137,643.14
应付托管费	-	-	-	22,940.51	22,940.51
应付清算款	-	-	-	1,160,627.65	1,160,627.65
其他负债	-	-	-	318,290.03	318,290.03
负债总计	-	-	-	2,893,935.34	2,893,935.34
利率敏感度缺口	13,634,669.54	-	-	-121,090,892.00	134,725,561.54

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

注：于 2026 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金净资产的比例为 0.41%（2025 年 12 月 31 日：未持有交易性债券投资），因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响（2025 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：不适用。

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：不适用。

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。

本基金的股票投资占基金资产的比例为 0%-95%。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		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	88,017,142.85	90.19	123,962,620.00	92.01
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	88,017,142.85	90.19	123,962,620.00	92.01

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准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）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	7,036,536.31	10,971,634.10
	业绩比较基准下降	-7,036,536.31	-10,971,634.10

	5%		
--	----	--	--

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	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	88,017,142.85	122,053,580.00
第二层次	398,108.73	1,909,040.00
第三层次	-	-
合计	88,415,251.58	123,962,620.00

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（2025 年 12 月 31 日：同）。

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	88,017,142.85	87.65
	其中：股票	88,017,142.85	87.65
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	398,108.73	0.40
	其中：债券	398,108.73	0.40
	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	8,621,243.19	8.59
8	其他各项资产	3,376,779.49	3.36
9	合计	100,413,274.26	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	25,055,802.85	25.67
C	制造业	40,073,900.00	41.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,535,000.00	2.60
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	6,984,740.00	7.16

J	金融业	12,284,500.00	12.59
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	1,083,200.00	1.11
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	88,017,142.85	90.19

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票投资。

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	600938	中国海油	209,919	5,699,300.85	5.84
2	601899	紫金矿业	196,500	4,940,010.00	5.06
3	002648	卫星化学	200,000	4,698,000.00	4.81
4	002895	川恒股份	160,000	4,672,000.00	4.79
5	000933	神火股份	220,000	4,664,000.00	4.78
6	000807	云铝股份	210,000	4,649,400.00	4.76
7	600096	云天化	140,000	4,256,000.00	4.36
8	600989	宝丰能源	200,000	4,066,000.00	4.17
9	601168	西部矿业	147,800	4,011,292.00	4.11
10	601898	中煤能源	320,000	3,897,600.00	3.99
11	603993	洛阳钼业	222,000	3,896,100.00	3.99
12	601336	新华保险	50,000	2,983,000.00	3.06
13	601211	国泰海通	160,000	2,912,000.00	2.98
14	600595	中孚实业	510,000	2,866,200.00	2.94
15	601628	中国人寿	80,000	2,828,000.00	2.90
16	001286	陕西能源	250,000	2,535,000.00	2.60
17	601995	中金公司	70,000	2,530,500.00	2.59
18	603444	吉比特	7,000	2,508,940.00	2.57
19	603799	华友钴业	50,000	2,413,000.00	2.47
20	002558	巨人网络	80,000	2,204,800.00	2.26
21	000792	盐湖股份	70,000	2,113,300.00	2.17
22	688802	沐曦股份	2,000	1,656,600.00	1.70
23	601225	陕西煤业	80,000	1,628,000.00	1.67
24	688981	中芯国际	10,000	1,588,200.00	1.63
25	002460	赣锋锂业	20,000	1,308,000.00	1.34

26	002624	完美世界	100,000	1,242,000.00	1.27
27	300568	星源材质	60,000	1,123,200.00	1.15
28	605098	行动教育	20,000	1,083,200.00	1.11
29	601688	华泰证券	50,000	1,031,000.00	1.06
30	688099	晶晨股份	10,000	1,029,000.00	1.05
31	600985	淮北矿业	70,000	983,500.00	1.01

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初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	17,684,830.00	13.13
2	000807	云铝股份	16,829,707.00	12.49
3	601225	陕西煤业	13,410,498.00	9.95
4	600489	中金黄金	13,392,357.20	9.94
5	688012	中微公司	12,735,199.37	9.45
6	000960	锡业股份	12,619,310.00	9.37
7	601601	中国太保	12,309,113.00	9.14
8	688361	中科飞测	12,013,731.65	8.92
9	002460	赣锋锂业	11,247,937.80	8.35
10	601168	西部矿业	11,145,038.00	8.27
11	601898	中煤能源	10,214,486.00	7.58
12	000630	铜陵有色	9,725,987.00	7.22
13	001301	尚太科技	9,681,160.00	7.19
14	603659	璞泰来	9,625,350.22	7.14
15	600383	金地集团	9,225,640.00	6.85
16	600585	海螺水泥	9,209,778.50	6.84
17	603619	中曼石油	9,166,250.00	6.80
18	002043	兔宝宝	9,124,606.00	6.77
19	002415	海康威视	9,086,143.00	6.74
20	000408	藏格矿业	8,835,870.00	6.56
21	601888	中国中免	8,808,398.00	6.54
22	600988	赤峰黄金	8,735,110.36	6.48
23	002466	天齐锂业	8,659,073.50	6.43
24	600989	宝丰能源	8,404,701.00	6.24
25	600872	中炬高新	8,328,736.00	6.18
26	600886	国投电力	8,225,263.00	6.11
27	601088	中国神华	8,186,499.00	6.08
28	600985	淮北矿业	8,017,196.00	5.95
29	600795	国电电力	7,964,086.00	5.91
30	600256	广汇能源	7,748,140.00	5.75
31	603993	洛阳钼业	7,701,404.00	5.72
32	601155	新城控股	7,537,369.00	5.59

33	002409	雅克科技	7,314,559.00	5.43
34	000933	神火股份	7,293,815.00	5.41
35	001979	招商蛇口	7,272,923.00	5.40
36	001286	陕西能源	7,148,149.00	5.31
37	601899	紫金矿业	7,007,785.00	5.20
38	601336	新华保险	6,984,697.00	5.18
39	300896	爱美客	6,938,725.00	5.15
40	605117	德业股份	6,823,077.00	5.06
41	600115	中国东航	6,543,404.00	4.86
42	300750	宁德时代	6,542,881.00	4.86
43	600258	首旅酒店	6,476,707.00	4.81
44	600938	中国海油	6,390,041.21	4.74
45	600188	兖矿能源	6,326,192.00	4.70
46	600941	中国移动	6,196,213.00	4.60
47	601101	昊华能源	6,132,211.00	4.55
48	300390	天华新能	5,975,400.00	4.44
49	600346	恒力石化	5,936,033.00	4.41
50	603393	新天然气	5,896,758.00	4.38
51	688390	固德威	5,760,357.27	4.28
52	600111	北方稀土	5,682,600.00	4.22
53	688347	华虹宏力	5,401,698.20	4.01
54	600887	伊利股份	5,336,220.00	3.96
55	000725	京东方 A	5,328,660.00	3.96
56	601211	国泰海通	5,269,342.00	3.91
57	688411	海博思创	5,261,992.67	3.91
58	601688	华泰证券	5,229,600.00	3.88
59	002497	雅化集团	5,028,904.00	3.73
60	000422	湖北宜化	4,983,805.00	3.70
61	600029	南方航空	4,932,700.00	3.66
62	601628	中国人寿	4,832,783.00	3.59
63	002648	卫星化学	4,829,907.00	3.58
64	300347	泰格医药	4,812,807.00	3.57
65	600399	抚顺特钢	4,726,600.00	3.51
66	600549	厦门钨业	4,722,725.00	3.51
67	688802	沐曦股份	4,637,591.17	3.44
68	688120	华海清科	4,623,849.03	3.43
69	601069	西部黄金	4,613,933.00	3.42
70	000831	中国稀土	4,574,195.00	3.40
71	002557	洽洽食品	4,528,223.00	3.36
72	600096	云天化	4,518,946.00	3.35
73	300014	亿纬锂能	4,502,936.80	3.34
74	301358	湖南裕能	4,480,418.00	3.33
75	605499	东鹏饮料	4,361,133.31	3.24

76	600406	国电南瑞	4,360,324.00	3.24
77	603259	药明康德	4,262,516.00	3.16
78	300274	阳光电源	4,135,184.00	3.07
79	600707	彩虹股份	4,109,227.00	3.05
80	000733	振华科技	4,065,068.00	3.02
81	301026	浩通科技	4,006,342.00	2.97
82	600674	川投能源	3,986,753.00	2.96
83	000951	中国重汽	3,938,857.60	2.92
84	000983	山西焦煤	3,909,339.00	2.90
85	000792	盐湖股份	3,862,470.70	2.87
86	600595	中孚实业	3,781,084.00	2.81
87	300763	锦浪科技	3,771,653.00	2.80
88	002092	中泰化学	3,755,618.00	2.79
89	688480	赛恩斯	3,714,498.76	2.76
90	002244	滨江集团	3,674,794.72	2.73
91	600519	贵州茅台	3,637,561.00	2.70
92	002624	完美世界	3,625,168.00	2.69
93	300483	首华燃气	3,619,462.00	2.69
94	002895	川恒股份	3,551,607.00	2.64
95	600578	京能电力	3,503,000.00	2.60
96	000617	中油资本	3,458,620.00	2.57
97	000333	美的集团	3,455,734.00	2.57
98	002601	龙佰集团	3,443,555.00	2.56
99	600737	中粮糖业	3,363,429.00	2.50
100	002292	奥飞娱乐	3,302,237.00	2.45
101	600901	江苏金租	3,268,500.00	2.43
102	601058	赛轮轮胎	3,234,257.00	2.40
103	688472	阿特斯	3,212,683.95	2.38
104	002142	宁波银行	3,207,360.00	2.38
105	601021	春秋航空	3,164,638.45	2.35
106	002386	天原股份	3,145,400.00	2.33
107	603733	仙鹤股份	3,136,857.00	2.33
108	000031	大悦城	2,971,384.00	2.21
109	600048	保利发展	2,964,000.00	2.20
110	600415	小商品城	2,961,112.00	2.20
111	601919	中远海控	2,950,915.00	2.19
112	688303	大全能源	2,945,611.21	2.19
113	002271	东方雨虹	2,926,084.00	2.17
114	603816	顾家家居	2,922,448.00	2.17
115	600150	中国船舶	2,901,274.49	2.15
116	300737	科顺股份	2,881,850.00	2.14
117	300073	当升科技	2,865,306.00	2.13
118	000060	中金岭南	2,840,928.00	2.11

119	301078	孩子王	2,801,772.00	2.08
120	000636	风华高科	2,701,026.00	2.00

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初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600489	中金黄金	19,911,650.84	14.78
2	600988	赤峰黄金	17,727,512.00	13.16
3	601318	中国平安	16,939,853.00	12.57
4	000960	锡业股份	15,623,447.00	11.60
5	688012	中微公司	15,467,104.38	11.48
6	603619	中曼石油	14,513,060.27	10.77
7	688361	中科飞测	13,525,393.52	10.04
8	002466	天齐锂业	12,838,380.36	9.53
9	601225	陕西煤业	12,038,386.00	8.94
10	601601	中国太保	11,459,422.00	8.51
11	002460	赣锋锂业	11,168,563.52	8.29
12	600258	首旅酒店	10,628,854.00	7.89
13	603659	璞泰来	10,133,006.00	7.52
14	000807	云铝股份	10,126,226.00	7.52
15	600115	中国东航	10,058,324.00	7.47
16	000630	铜陵有色	9,955,735.00	7.39
17	600346	恒力石化	9,500,327.00	7.05
18	002409	雅克科技	9,273,291.00	6.88
19	002415	海康威视	9,163,123.00	6.80
20	002043	兔宝宝	9,146,475.86	6.79
21	600383	金地集团	9,110,114.00	6.76
22	600585	海螺水泥	9,008,681.00	6.69
23	001301	尚太科技	8,888,302.00	6.60
24	601168	西部矿业	8,721,985.00	6.47
25	601899	紫金矿业	8,712,692.00	6.47
26	000408	藏格矿业	8,521,158.00	6.32
27	601101	昊华能源	8,489,813.00	6.30
28	000792	盐湖股份	8,465,618.00	6.28
29	600872	中炬高新	8,267,405.98	6.14
30	600886	国投电力	8,221,607.00	6.10
31	600985	淮北矿业	8,143,146.00	6.04
32	601888	中国中免	8,101,054.00	6.01
33	600029	南方航空	8,002,153.00	5.94
34	600188	兖矿能源	7,923,857.00	5.88
35	601958	金钼股份	7,894,577.00	5.86
36	601088	中国神华	7,580,290.00	5.63

37	600795	国电电力	7,566,000.00	5.62
38	600256	广汇能源	6,968,215.00	5.17
39	601155	新城控股	6,835,193.00	5.07
40	001979	招商蛇口	6,833,491.17	5.07
41	300390	天华新能	6,832,637.00	5.07
42	300896	爱美客	6,715,595.00	4.98
43	605117	德业股份	6,605,044.00	4.90
44	300750	宁德时代	6,573,721.20	4.88
45	601898	中煤能源	6,571,994.12	4.88
46	601688	华泰证券	6,532,179.00	4.85
47	600941	中国移动	6,089,280.00	4.52
48	600961	株冶集团	6,074,899.00	4.51
49	688390	固德威	6,066,291.86	4.50
50	600547	山东黄金	5,990,841.00	4.45
51	600549	厦门钨业	5,587,706.89	4.15
52	603393	新天然气	5,577,144.00	4.14
53	688347	华虹宏力	5,565,113.71	4.13
54	600111	北方稀土	5,500,505.00	4.08
55	601069	西部黄金	5,494,254.00	4.08
56	600938	中国海油	5,259,453.94	3.90
57	600887	伊利股份	5,250,157.00	3.90
58	000830	鲁西化工	5,249,211.00	3.90
59	300274	阳光电源	5,195,878.53	3.86
60	000725	京东方 A	5,115,000.00	3.80
61	688411	海博思创	5,092,109.89	3.78
62	600499	科达制造	4,979,633.00	3.70
63	000422	湖北宜化	4,903,180.00	3.64
64	600096	云天化	4,896,637.00	3.63
65	000831	中国稀土	4,826,425.00	3.58
66	002497	雅化集团	4,765,250.00	3.54
67	300347	泰格医药	4,730,962.00	3.51
68	688120	华海清科	4,653,920.05	3.45
69	603259	药明康德	4,603,219.00	3.42
70	002557	洽洽食品	4,495,819.00	3.34
71	002895	川恒股份	4,433,090.56	3.29
72	600399	抚顺特钢	4,404,510.00	3.27
73	301358	湖南裕能	4,283,496.00	3.18
74	301026	浩通科技	4,269,188.80	3.17
75	300014	亿纬锂能	4,239,853.40	3.15
76	600406	国电南瑞	4,215,564.93	3.13
77	000951	中国重汽	4,208,694.00	3.12
78	001286	陕西能源	4,192,962.00	3.11
79	002812	恩捷股份	4,176,600.00	3.10

80	002092	中泰化学	4,162,596.00	3.09
81	605499	东鹏饮料	4,106,313.00	3.05
82	600707	彩虹股份	3,872,078.00	2.87
83	600674	川投能源	3,854,276.00	2.86
84	600075	新疆天业	3,852,760.00	2.86
85	601336	新华保险	3,829,958.00	2.84
86	600578	京能电力	3,744,741.00	2.78
87	600519	贵州茅台	3,717,501.00	2.76
88	000733	振华科技	3,703,173.00	2.75
89	603225	新凤鸣	3,675,615.00	2.73
90	600966	博汇纸业	3,610,230.00	2.68
91	601233	桐昆股份	3,590,042.00	2.66
92	300763	锦浪科技	3,520,105.00	2.61
93	002292	奥飞娱乐	3,433,251.00	2.55
94	002714	牧原股份	3,425,779.40	2.54
95	000333	美的集团	3,425,298.04	2.54
96	600901	江苏金租	3,424,571.00	2.54
97	000617	中油资本	3,332,000.00	2.47
98	300483	首华燃气	3,292,111.00	2.44
99	601058	赛轮轮胎	3,285,024.00	2.44
100	000983	山西焦煤	3,259,813.00	2.42
101	002601	龙佰集团	3,258,004.00	2.42
102	002244	滨江集团	3,257,762.00	2.42
103	002142	宁波银行	3,251,237.00	2.41
104	002386	天原股份	3,197,500.00	2.37
105	600737	中粮糖业	3,190,382.00	2.37
106	603993	洛阳钼业	3,169,353.00	2.35
107	603733	仙鹤股份	3,154,035.00	2.34
108	601600	中国铝业	3,133,587.00	2.33
109	688480	赛恩斯	3,099,083.99	2.30
110	600089	特变电工	3,078,568.40	2.29
111	688802	沐曦股份	3,070,067.00	2.28
112	601021	春秋航空	3,060,917.00	2.27
113	002705	新宝股份	3,019,073.00	2.24
114	000636	风华高科	3,018,031.00	2.24
115	002128	电投能源	2,954,473.00	2.19
116	000060	中金岭南	2,916,000.00	2.16
117	600048	保利发展	2,910,000.00	2.16
118	600688	上海石化	2,907,784.00	2.16
119	000031	大悦城	2,906,278.00	2.16
120	688472	阿特斯	2,906,248.72	2.16
121	300737	科顺股份	2,900,567.00	2.15
122	688303	大全能源	2,892,262.82	2.15

123	002271	东方雨虹	2, 891, 454. 00	2. 15
124	600150	中国船舶	2, 874, 358. 00	2. 13
125	603816	顾家家居	2, 859, 813. 00	2. 12
126	300073	当升科技	2, 819, 323. 00	2. 09
127	601699	潞安环能	2, 743, 309. 00	2. 04
128	601918	新集能源	2, 733, 961. 00	2. 03
129	301078	孩子王	2, 705, 021. 00	2. 01

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	870, 794, 165. 88
卖出股票收入（成交）总额	903, 711, 438. 92

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	-	-
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）	398, 108. 73	0. 41
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	398, 108. 73	0. 41

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	127114	宜化转债	3, 981	398, 108. 73	0. 41

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投资。

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投资。

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投资。

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，无相关投资评价。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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：

河南神火煤电股份有限公司在报告编制日前一年内受到中国证券监督管理委员会河南监管局、深圳证券交易所的行政监督管理措施。

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。

7.12.2 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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	105,392.72
2	应收清算款	3,231,091.03
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	40,295.74
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,376,779.49

7.12.4 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的处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.6 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

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 (%)
14,155	4985.63	372079.78	0.53	70199475.47	99.47

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年（2025 年 7 月 1 日-2026 年 6 月 30 日）
盈利投资者数量占比（%）	94.90

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	493,429.66	0.6992

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2019 年 5 月 10 日） 基金份额总额	478,638,726.35
本报告期期初基金份额总额	91,099,011.73
本报告期基金总申购份额	10,825,326.57
减：本报告期基金总赎回份额	31,352,783.05
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	70,571,555.25

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 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。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

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》。

10.6.2 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》。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

注：无。

10.6.4 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。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中银证券	3	1,774,505,604.80	100.00	791,252.24	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。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
中银证券	-	-	-	-	-	-

注：本基金报告期内未有租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况。

- 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服务；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 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旗下基金 2025 年第 4 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 1 月 22 日
2	中银证券价值精选灵活配置混合型证券投资基金 2025 年第四季度报告	公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 1 月 22 日
3	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
4	中银国际证券股份有限公司旗下基金 2025 年年度报告提示性公告	规定报刊、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 3 月 31 日
5	中银证券价值精选灵活配置混合型证券投资基金 2025 年年度报告	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	中银证券价值精选灵活配置混合型证券投资基金 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	中银证券价值精选灵活配置混合型证	公司官网及中国证监会	2026 年 6 月 27 日

	证券投资基金基金合同更新	基金电子披露网站	
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	中银证券价值精选灵活配置混合型证券投资基金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：本基金本报告期内未有单一投资者持有基金份额比例达到或超过 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、中国证监会准予中银证券保本 1 号混合型证券投资基金基金募集注册的文件
- 2、中银证券价值精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同
- 3、中银证券价值精选灵活配置混合型证券投资基金托管协议
- 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，也可登陆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