

中银量化价值混合型证券投资基金

2022 年中期报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：中银基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年八月三十日

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，并由董事长签发。

基金托管人根据本基金合同规定，于 2022 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 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
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
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遵规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
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.....	13
5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
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.....	13
6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	17
7 投资组合报告	50
7.1 期末基金资产组合情况.....	50
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	50
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.....	51
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	57
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.....	57
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.....	57
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.....	57
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.....	57
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	58
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	58
7.12 投资组合报告附注.....	58
8 基金份额持有人信息	59
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	59

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	59
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的情况	59
9 开放式基金份额变动	60
10 重大事件揭示	60
10.1 基金份额持有人大会决议	60
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	60
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	60
10.4 基金投资策略的改变	60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	60
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	60
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	60
10.8 其他重大事件	62
11 影响投资者决策的其他重要信息	64
12 备查文件目录	64
12.1 备查文件目录	64
12.2 存放地点	65
12.3 查阅方式	65

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中银量化价值混合型证券投资基金	
基金简称	中银量化价值混合	
基金主代码	004881	
交易代码	004881	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 11 月 24 日	
基金管理人	中银基金管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	181,961,818.09 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中银量化价值混合 A	中银量化价值混合 C
下属分级基金的交易代码	004881	010311
报告期末下属分级基金的份额总额	181,462,003.74 份	499,814.35 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过量化投资模型精选个股，在严格控制风险的前提下，追求基金资产的长期稳定增值，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金建立数量化投资策略投资模型，将投资思想通过具体指标、参数的确定体现在模型中，在投资过程中充分发挥数量化投资纪律严格、投资视野宽阔、风险水平可控等优势，切实贯彻自上而下的资产配置和自下而上的个股精选的投资策略，以保证在控制风险的前提下实现收益最大化。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×80% + 中债综合指数收益率×20%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等风险水平的投资品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中银基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	欧阳向军	李真
	联系电话	021-38834999	021-52629999-212051
	电子邮箱	clientservice@bocim.com	tgb_lizhen@cib.com.cn
客户服务电话		021-38834788 400-888-5566	95561
传真		021-68873488	021-62159217
注册地址		上海市银城中路200号中银大厦45层	福建省福州市台江区江滨中大道398号兴业银行大厦
办公地址		上海市银城中路200号中银大厦10层、11层、26层、45层	上海市银城路167号兴业大厦4楼
邮政编码		200120	200120

法定代表人	章砚	吕家进
-------	----	-----

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日）	
	中银量化价值混合 A	中银量化价值混合 C
本期已实现收益	-30,267,392.48	-396,411.50
本期利润	-24,807,571.82	-806,150.47
加权平均基金份额本期利润	-0.1350	-0.3348
本期加权平均净值利润率	-10.13%	-24.02%
本期基金份额净值增长率	-8.65%	-8.84%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)	
	中银量化价值混合 A	中银量化价值混合 C
期末可供分配利润	62,492,817.94	167,652.22
期末可供分配基金份额利润	0.3444	0.3354
期末基金资产净值	251,618,829.99	688,582.45
期末基金份额净值	1.3866	1.3777
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)	
	中银量化价值混合 A	中银量化价值混合 C
基金份额累计净值增长率	38.66%	-1.47%

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

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

分配利润（已实现部分扣除未实现部分）。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中银量化价值混合 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
过去一个月	10.30%	1.06%	7.60%	0.86%	2.70%	0.20%
过去三个月	5.96%	1.35%	5.11%	1.15%	0.85%	0.20%
过去六个月	-8.65%	1.34%	-7.19%	1.16%	-1.46%	0.18%
过去一年	-11.47%	1.16%	-10.90%	1.00%	-0.57%	0.16%
过去三年	60.80%	1.18%	15.47%	1.01%	45.33%	0.17%
自基金合同生效日起	38.66%	1.17%	10.98%	1.05%	27.68%	0.12%

中银量化价值混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	10.27%	1.06%	7.60%	0.86%	2.67%	0.20%
过去三个月	5.85%	1.35%	5.11%	1.15%	0.74%	0.20%
过去六个月	-8.84%	1.34%	-7.19%	1.16%	-1.65%	0.18%
过去一年	-11.84%	1.16%	-10.90%	1.00%	-0.94%	0.16%
自基金合同生效日起	-1.47%	1.18%	-5.61%	0.99%	4.14%	0.19%

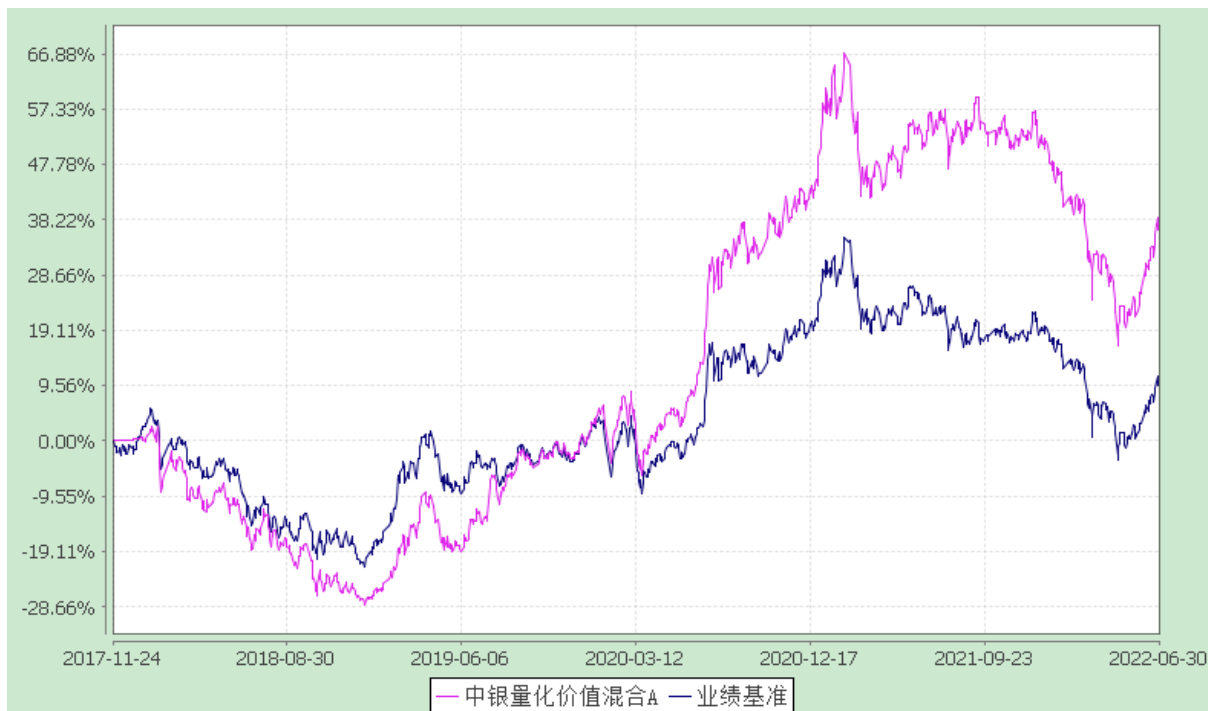
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

中银量化价值混合型证券投资基金

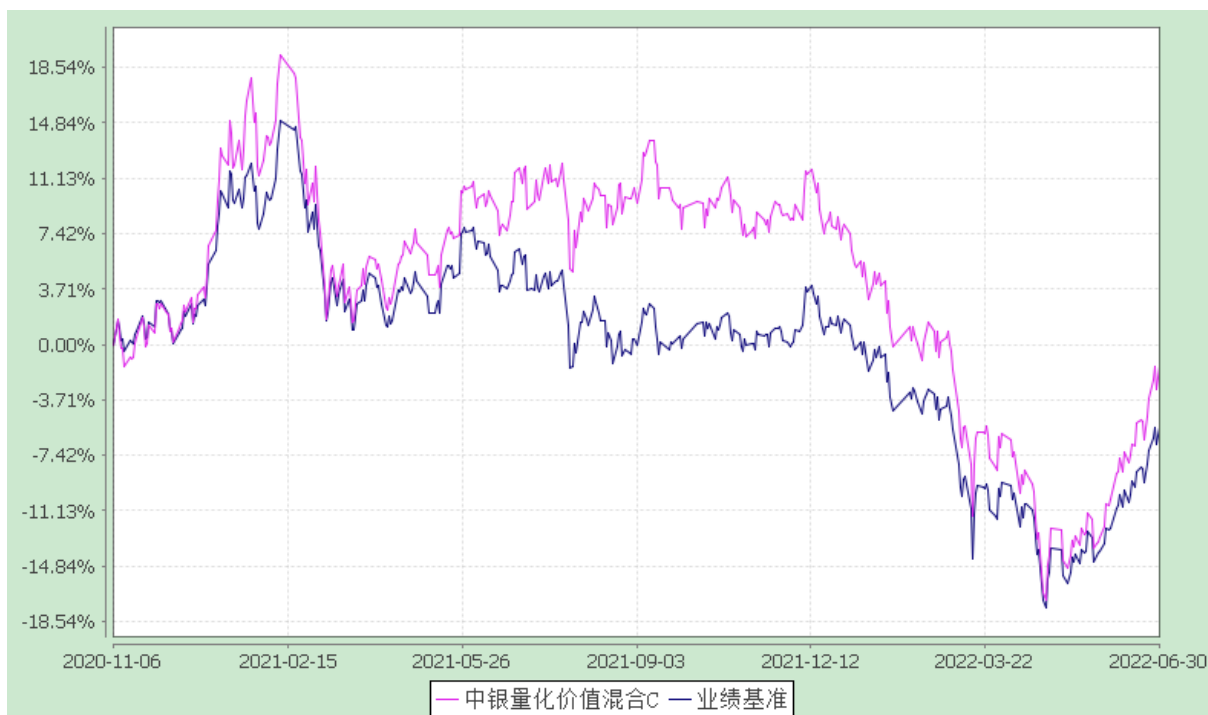
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2017 年 11 月 24 日至 2022 年 6 月 30 日)

中银量化价值混合 A



中银量化价值混合 C



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

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至 2022 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理中银中国精选混合型开放式证券投资基金、中银货币市场证券投资基金、中银持续增长混合型证券投资基金、中银收益混合型证券投资基金等 153 只开放式证券投资基金，同时管理着多个私募资产管理计划。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
赵志华	基金经理	2017-11-24	-	17	中银基金管理有限公司助理副总裁（AVP），金融工程博士。曾任华泰证券金融创新部量化投资经理，资产管理总部投资主办。2011 年加入中银基金管理有限公司，曾担任基金经理助理、专户投资经理。2015 年 7 月至 2018 年 2 月任中银优秀企业基金基金经理，2016 年 6 月至 2018 年 2 月任中银腾利基金基金经理，2016 年 11 月至 2019 年 10 月任中银研究精选基金基金经理，2016 年 12 月至今任中银量化精选基金基金经理，2017 年 11 月至今任中银量化价值基金基金经理。具备基金从业资格。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

本报告期内，本基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未发现异常交易行为。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

1. 宏观经济分析

国外经济方面，上半年全球发达国家在高通胀和金融条件收紧背景下经济下行压力加大。美国消费有回落压力，通胀走高，就业市场维持偏紧状态，6 月失业率较 2021 年 12 月下降 0.3 个百分点至 3.6%，6 月制造业 PMI 较 2021 年 12 月回落 5.8 个百分点至 53%，6 月服务业 PMI 较 2021 年 12 月回落 7 个百分点至 55.3%。美联储 3 月、5 月、6 月分别加息 25bps、50bps、75bps，并于 6 月开启缩表。欧元区经济增速放缓，6 月失业率较 2021 年末回落 0.4 个百分点至 6.6%，6 月制造业 PMI 较 2021 年末回落 5.9 个百分点至 52.1%，6 月服务业 PMI 较 2021 年末回落 0.1 个百分点至 53%，欧央行 7 月加息 50bps。日本央行维持基准利率不变，经济恢复速度放缓，通胀有所上行，6 月 CPI 同比较 2021 年末回升 1.4 个百分点至 2.4%，6 月制造业 PMI 较 2021 年末回落 1.6 个百分点至 52.7%。综合来看，全球经济下半年经济下行压力进一步加大，主要经济体央行货币政策依然处于继续收紧状态。

国内经济方面，受疫情冲击国内经济数据先下后上，疫后生产修复明显快于需求，经济结构性分化持续，基建维持高位，出口仍有韧性但下行风险加大，消费增速恢复较慢，地产维持负增长，经济总体处于弱复苏状态，PPI 通胀回落但 CPI 通胀上行。具体来看，上半年领先指标中采制造业 PMI 先下后上，6 月值较 2021 年 12 月值走低 0.1 个百分点至 50.2%，同步指标工业增加值 6 月同比增长 3.9%，较 2021 年 12 月回落 0.4 个百分点。从经济增长动力来看，出口韧性尚可，投资总体偏强但内部有分化，消费恢复速度偏慢：6 月美元计价出口增速较 2021 年 12 月回落 2.9 个百分点至 17.9%，6 月社会消费品零售总额增速较 2021 年 12 月回升 1.4 个百分点至 3.1%，基建投资与制造业

投资较强、房地产投资总体负增长，1-6 月固定资产投资增速较 2021 年末回升 1.2 个百分点至 6.1% 的水平。通胀方面，CPI 震荡上行，6 月同比增速从 2021 年 12 月的 1.5% 上升 1 个百分点至 2.5%，PPI 有所回落，6 月同比增速从 2021 年 12 月的 10.3% 回落 4.2 个百分点至 6.1%。

2. 市场回顾

股票市场方面，上半年上证综指下跌 6.63%，中证 100 下跌 8.07%，沪深 300 下跌 9.22%，中证 500 下跌 12.3%，中证 1000 下跌 12.67%，中小板指数下跌 11.56%，创业板指数下跌 15.41%。上半年行业方面分化较大，中信一级行业煤炭 33.74%，消费者服务 8.44%，交通运输 3.20%；与此同时，计算机下跌 20.34%，综合金融下跌 21.36%，传媒下跌 21.80%，电子下跌 23.58%

3. 运行分析

在基金投资策略上，我们坚持按量化模型投资，投资较为分散，风格与沪深 300 相对比较接近，基金管理目标为获取相对业绩基准较为稳定的超额收益。上半年市场波动较大，行业和风格轮动较快，这给模型的运作带来了一些挑战，下半年市场如果运行相对稳定，基金有可能会获取相应的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金 A 类份额净值增长率为-8.65%，同期业绩比较基准收益率为-7.19%。

报告期内，本基金 C 类份额净值增长率为-8.84%，同期业绩比较基准收益率为-7.19%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，全球经济活动依然受到高通胀和金融条件收紧影响，发达经济下行压力加大，四季度衰退风险或进一步提高，新兴经济复苏更为脆弱，美联储有望继续加息。国内经济总体弱复苏；宏观政策更注重稳就业稳物价，保持经济运行在合理区间，现有框架内的稳增长政策仍会继续推进，财政政策推进前期发行专项债尽快形成实物工作量，货币政策稳健偏松，保持流动性合理充裕，同时政策性金融工具有望补充政府债发行缺口。

宏观经济在经历疫情冲击后，伴随前期政策的落地，经济活动短期有望边际修复，而四季度经济下行压力或重现，基建短期仍是稳增长的重要拉动但存在四季度后劲不足的风险，制造业中的技改需求成为重要支撑，消费缓慢修复，出口短期有韧性但四季度伴随海外衰退压力进一步加大有回落压力，地产能否稳定修复取决于销售能否实质性回升，疫情对经济的影响仍存扰动。通胀方面，PPI 同比增速有望继续下行，CPI 同比增速有望先上后下。货币政策整体稳健偏松，再贷款等结构性工具与政策性金融工具将成为主要抓手，流动性保持合理充裕，资金利率有望保持在低位。A 股仍

处于修复过程中，但节奏上会有波折；盈利方面，伴随着疫情的控制及上海的解封，二季度将构成全年经济及企业盈利的低点，但修复的力度与持续性仍待观察；风险偏好方面，内部来看，稳增长政策再加码，政策底进一步确认；外部来看，海外市场预计在紧缩逻辑和衰退逻辑之间反复博弈，波动较大，美股边际下行压力仍较大，可能对国内市场构成扰动。作为基金管理者，我们将一如既往地依靠团队的努力和智慧，为投资人创造应有的回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

根据证监会的相关规定，本公司为建立健全有效的估值政策和程序，经公司执行委员会批准，公司成立估值委员会，明确参与估值流程各方的人员分工和职责，由研究部、风险管理部、基金运营部及投资相关部门的相关人员担任委员会委员。估值委员会委员具备应有的经验、专业胜任能力和独立性，分工明确，在上市公司研究和估值、基金投资、投资品种所属行业的专业研究、估值政策、估值流程和程序、基金的风险控制与绩效评估、会计政策与基金核算以及相关事项的合法合规性审核和监督等各个方面具备专业能力和丰富经验。估值委员会严格按照工作流程诚实守信、勤勉尽责地讨论和决策估值事项。估值委员会审议并依据行业协会提供的估值模型和行业做法选定与当时市场环境相适应的估值方法，基金运营部应征询会计师事务所、基金托管人的相关意见。公司按特殊流程改变估值技术时，导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上的，应就基金管理人所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性等咨询会计师事务所的专业意见，会计师事务所应对公司所采用的相关估值模型、假设、参数及输入的适当性发表审核意见，同时公司按照相关法律法规要求履行信息披露义务。另外，对于特定品种或者投资品种相同，但具有不同特征的，若协会有特定调整估值方法的通知的，比如《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》的，应参照协会通知执行。可根据指引的指导意见，并经估值委员会审议，采用第三方估值机构提供的估值相关的数据服务。

4.6.2 本公司参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突。

4.6.3 定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

本报告期末 A 类基金份额可供分配利润为 62,492,817.94 元，C 类基金份额可供分配利润为 167,652.22 元。本基金本报告期末未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中银量化价值混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	4,292,536.55	54,110,405.38
结算备付金		5,756,480.13	5,822,997.04
存出保证金		88,736.29	92,263.91
交易性金融资产	6.4.7.2	243,115,633.14	298,236,402.13
其中：股票投资		229,491,154.33	280,996,678.33
基金投资		-	-
债券投资		13,624,478.81	17,239,723.80
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-

其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		6,774.11	-
应收股利		-	-
应收申购款		41.75	4,659.44
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	338,880.26
资产总计		253,260,201.97	358,605,608.16
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 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		270,842.23	49,201,262.31
应付赎回款		20.34	18,443.91
应付管理人报酬		295,215.18	348,034.43
应付托管费		49,202.52	58,005.74
应付销售服务费		393.99	5,704.39
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.16	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	337,115.11	444,792.83
负债合计		952,789.53	50,076,243.61
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	181,961,818.09	203,300,584.62
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	70,345,594.35	105,228,779.93
净资产合计		252,307,412.44	308,529,364.55
负债和净资产总计		253,260,201.97	358,605,608.16

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.3866 元，基金份额总额 181,961,818.09 份，其中 A 类基金份额净值 1.3866 元，份额总额 181,462,003.74 份；C 类基金份额净值 1.3777 元，份额总额 499,814.35 份。

6.2 利润表

会计主体：中银量化价值混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022年1月1日至 2022年6月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至 2021年6月30日
一、营业总收入		-23,363,945.79	27,422,617.80
1.利息收入		54,068.37	350,276.55
其中：存款利息收入	6.4.7.9	54,068.37	99,173.33
债券利息收入		-	251,103.22
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-28,472,984.53	50,959,791.77
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-30,032,765.23	51,409,629.25
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	246,906.04	46,782.97
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-227,295.27	-2,484,317.48
股利收益	6.4.7.14	1,540,169.93	1,987,697.03
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	5,050,081.69	-23,951,294.45
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	4,888.68	63,843.93
减：二、营业总支出		2,249,776.50	5,436,925.83
1. 管理人报酬	6.4.10.2	1,852,585.53	3,021,207.49
2. 托管费	6.4.10.2	308,764.27	503,534.51
3. 销售服务费		6,937.64	34,045.89
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		5,650.69	-
其中：卖出回购金融资产支出		5,650.69	-
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		0.26	196.63
8. 其他费用	6.4.7.17	75,838.11	1,877,941.31
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-25,613,722.29	21,985,691.97
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-25,613,722.29	21,985,691.97
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-25,613,722.29	21,985,691.97

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：中银量化价值混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合 收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	203,300,584.62	-	105,228,779.93	308,529,364.55
二、本期期初净资产（基金净值）	203,300,584.62	-	105,228,779.93	308,529,364.55
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-21,338,766.53	-	-34,883,185.58	-56,221,952.11
（一）、综合收益总额	-	-	-25,613,722.29	-25,613,722.29
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-21,338,766.53	-	-9,269,463.29	-30,608,229.82
其中：1.基金申购款	1,868,225.27	-	594,385.03	2,462,610.30
2.基金赎回款	-23,206,991.80	-	-9,863,848.32	-33,070,840.12
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	181,961,818.09	-	70,345,594.35	252,307,412.44
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合 收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	312,585,908.52	-	153,553,152.56	466,139,061.08
二、本期期初净资产（基金净值）	312,585,908.52	-	153,553,152.56	466,139,061.08

三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-74,831,481.02	-	-18,953,493.89	-93,784,974.91
（一）、综合收益总额	-	-	21,985,691.97	21,985,691.97
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-74,831,481.02	-	-40,939,185.86	-115,770,666.88
其中：1.基金申购款	14,953,298.05	-	7,052,887.97	22,006,186.02
2.基金赎回款	-89,784,779.07	-	-47,992,073.83	-137,776,852.90
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	237,754,427.50	-	134,599,658.67	372,354,086.17

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：张家文，主管会计工作负责人：陈宇，会计机构负责人：乐妮

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中银量化价值混合型证券投资基金(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[2017]941 号文《关于准予中银量化价值混合型证券投资基金注册的批复》核准，由基金管理人中银基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中银量化价值混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 333,694,725.60 元，业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2017)验字第 61062100-B14 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《中银量化价值混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 11 月 24 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 333,826,575.55 份基金份额，其中认购资金利息折合 131,849.95 份基金份额。本基金的基金管理人为中银基金管理有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据本基金的基金管理人中银基金管理有限公司于 2020 年 11 月 6 日发布的《关于中银量化价值混合型证券投资基金增加 C 类基金份额并修改基金合同及托管协议的公告》以及更新的《中银量化价值混合型证券投资基金基金合同》和《中银量化价值混合型证券投资基金托管协议》的有关规定，自 2020 年 11 月 6 日起，本基金根据申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者申购时收取前端申购费用、但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；在投资者申购时不收取申购费用，但从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中银量化价值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)、存托凭证、国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、可转换公司债券、可分离交易可转债、可交换债券、中小企业私募债券、中期票据、短期融资券、超级短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货、国债期货、权证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。本基金的投资组合比例为：股票及存托凭证投资占基金资产的比例范围为 60%-95%。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。股指期货、国债期货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 X 80%+中债综合指数收益率 X 20%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《中银量化价值混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2022 年上半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年上半年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

除下述变更后的会计政策外，本基金报告期所采用的其他会计政策、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。

6.4.4.1 会计年度

本期财务报表的实际编制期间系自 2022 年 1 月 1 日起至 2022 年 6 月 30 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

新金融工具准则

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或金融负债。

(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当期损益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

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

以摊余成本计量：

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资、资产支持证券投资 and 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。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的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。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

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

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

新金融工具准则

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。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

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。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的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，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的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。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

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

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述赎回包括基金转换所引起的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净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

新金融工具准则

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

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

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

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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

税后的净额确认为利息收入。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

6.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

6.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成

果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

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

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”), 财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》, 公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外, 中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《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>》, 本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金 2022 年上半年度财务报表, 对本基金财务报表的影响列示如下: 1. 会计政策变更的性质、内容和原因(a) 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或金融负债。(1) 金融资产金融资产于初始确认时分类为: 以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。债务工具本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具, 分别采用以下两种方式进行计量: 以摊余成本计量: 本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标, 且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致, 即在特定日期产生的现金流量, 仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。以公允价值计量且其变动计入当期损益: 本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具, 以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资, 在资产负债表中以交易性金融资产列示。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。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。(3) 衍生金融工具本基金将持有的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。(b) 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。对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。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。(c) 收入/(损失)的确认和计量 股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后

的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。2. 当期报表中受影响的项目名称和调整金额(a) 金融工具根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息和应收申购款，金额分别为 54,110,405.38 元、5,822,997.04 元、92,263.91 元、338,880.26 元和 4,659.44 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息和应收申购款，金额分别为 54,111,499.79 元、5,825,595.05 元、92,309.56 元、0.00 元和 5,242.75 元。原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 298,236,402.13 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 298,570,961.01 元。原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付证券清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付交易费用和应付利息，金额分别为 0.00 元、49,201,262.31 元、18,443.91 元、348,034.43 元、58,005.74 元、5,704.39 元、300,443.52 元和-5,650.69 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、其他负债-应付交易费用和其他负债-应付利息，金额分别为-5,650.69 元、49,201,262.31 元、18,443.91 元、348,034.43 元、58,005.74 元、5,704.39 元、300,443.52 元和 0.00 元。于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目下列示，无期初留存收益影响。(b) 根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《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>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

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]127 号《财政部国家税务总局证监会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》、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。

对基金通过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。基金通过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。

(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。基金通过深港通买卖、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。

(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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	4,292,536.55
等于：本金	4,292,068.66
加：应计利息	467.89
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	4,292,536.55

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

		2022 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		221,446,704.75	-	229,491,154.33	8,044,449.58
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	13,457,749.80	217,432.41	13,624,478.81	-50,703.40
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	13,457,749.80	217,432.41	13,624,478.81	-50,703.40
	资产支持证券	-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		234,904,454.55	217,432.41	243,115,633.14	7,993,746.18

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	232,731.35
其中：交易所市场	232,731.35
银行间市场	-

应付利息	-
应付信息披露费	59,507.37
应付审计费	44,876.39
合计	337,115.11

6.4.7.7 实收基金

中银量化价值混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	193,424,783.77	193,424,783.77
本期申购	417,685.17	417,685.17
本期赎回（以“-”号填列）	-12,380,465.20	-12,380,465.20
本期末	181,462,003.74	181,462,003.74

中银量化价值混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	9,875,800.85	9,875,800.85
本期申购	1,450,540.10	1,450,540.10
本期赎回（以“-”号填列）	-10,826,526.60	-10,826,526.60
本期末	499,814.35	499,814.35

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

中银量化价值混合 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	98,286,601.49	1,892,309.10	100,178,910.59
本期利润	-30,267,392.48	5,459,820.66	-24,807,571.82
本期基金份额交易产生的变动数	-5,526,391.07	311,878.55	-5,214,512.52
其中：基金申购款	163,782.53	-36,791.05	126,991.48
基金赎回款	-5,690,173.60	348,669.60	-5,341,504.00
本期已分配利润	-	-	-
本期末	62,492,817.94	7,664,008.31	70,156,826.25

中银量化价值混合 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,949,391.49	100,477.85	5,049,869.34

本期利润	-396,411.50	-409,738.97	-806,150.47
本期基金份额交易产生的变动数	-4,385,327.77	330,377.00	-4,054,950.77
其中：基金申购款	597,351.09	-129,957.54	467,393.55
基金赎回款	-4,982,678.86	460,334.54	-4,522,344.32
本期已分配利润	-	-	-
本期末	167,652.22	21,115.88	188,768.10

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
活期存款利息收入	16,520.86	
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	36,762.01	
其他	785.50	
合计	54,068.37	

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期	
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
卖出股票成交总额	534,023,717.52	
减：卖出股票成本总额	562,985,657.95	
减：交易费用	1,070,824.80	
买卖股票差价收入	-30,032,765.23	

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
债券投资收益——利息收入	194,223.67	
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	52,682.37	
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	246,906.04	

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	19,234,425.03
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	18,792,251.78
减：应计利息总额	389,472.86
减：交易费用	18.02
买卖债券差价收入	52,682.37

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
股指期货投资收益	-227,295.27
减：交易费用	1,215.27

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,540,169.93
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	1,540,169.93

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
1.交易性金融资产	5,050,081.69
——股票投资	5,086,422.31
——债券投资	-36,340.62
——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	5,050,081.69

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
基金赎回费收入	1,325.31
基金转换费收入	3,563.37
合计	4,888.68

注：1.本基金的赎回费率按持有期间递减，其中，A类基金份额将不低于赎回费总额的25%归入基金资产，C类基金份额将赎回费收入全额归入基金资产。

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，A类基金份额将不低于赎回费总额的25%归入转出基金的基金资产，C类基金份额将赎回费收入全额归入转出基金的基金资产。

6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
审计费用	14,876.39
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	1,454.35
合计	75,838.11

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中银基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售

	机构
兴业银行股份有限公司(“兴业银行”)	基金托管人、基金销售机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金管理人的控股股东、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月 30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6 月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,852,585.53	3,021,207.49
其中：支付销售机构的客户维护费	75,407.77	241,218.06

注：基金管理费每日计算，逐日累至每月月末,按月支付。基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月 30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	308,764.27	503,534.51

注：基金托管费每日计算，逐日累至每月月末,按月支付。基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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	本期
------------	----

关联方名称	2022年1月1日至2022年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中银量化价值混合A	中银量化价值混合C	合计
中国银行	-	217.80	217.80
中银基金管理有限公司	-	1,719.34	1,719.34
合计	-	1,937.14	1,937.14
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中银量化价值混合A	中银量化价值混合C	合计
中国银行	-	2.31	2.31
中银基金管理有限公司	-	11,783.70	11,783.70
合计	-	11,786.01	11,786.01

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.40% 年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算方法如下：

C 类基金份额的日销售服务费 = C 类基金份额前一日基金资产净值 × 0.40% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行股份有限公司	4,292,536.55	16,520.86	5,220,031.84	34,062.54

注：本基金的银行存款由基金托管人兴业银行保管，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

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

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2022年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688400	凌云光	2022-06-27	1个月内	新股未上市	21.93	21.93	4,204	92,193.72	92,193.72	-
301175	中科环保	2022-06-30	6个月	新股未上市	3.82	3.82	24,044	91,848.08	91,848.08	-
688150	莱特光电	2022-03-10	6个月	新股锁定期内	22.05	19.60	4,340	95,697.00	85,064.00	-
688193	仁度生物	2022-03-23	6个月	新股锁定期内	72.65	51.57	1,635	118,782.75	84,316.95	-
301239	普瑞眼科	2022-06-22	1个月内	新股未上市	33.65	33.65	2,370	79,750.50	79,750.50	-
301233	盛帮股份	2022-06-24	1个月内	新股未上市	41.52	41.52	1,418	58,875.36	58,875.36	-

688115	思林杰	2022-03-07	6 个月	新股锁定期内	65.65	38.46	1,464	96,111.60	56,305.44	-
301238	瑞泰新材	2022-06-10	6 个月	新股锁定期内	19.18	32.07	686	13,157.48	22,000.02	-
301266	宇邦新材	2022-05-30	6 个月	新股锁定期内	26.86	47.07	442	11,872.12	20,804.94	-
301215	中汽股份	2022-02-28	6 个月	新股锁定期内	3.80	6.39	2,877	10,932.60	18,384.03	-
301120	新特电气	2022-04-11	6 个月	新股锁定期内	13.73	15.49	1,018	13,977.14	15,768.82	-
301112	信邦智能	2022-06-20	6 个月	新股锁定期内	27.53	45.04	337	9,277.61	15,178.48	-
301122	采纳股份	2022-01-19	6 个月	新股锁定期内	50.31	70.37	205	10,313.55	14,425.85	-
301298	东利机械	2022-05-27	6 个月	新股锁定期内	12.68	20.83	634	8,039.12	13,206.22	-
301263	泰恩康	2022-03-22	6 个月	新股锁定期内	19.93	31.38	409	8,151.37	12,834.42	-
301153	中科江南	2022-05-10	6 个月	新股锁定期内	33.68	43.98	279	9,396.72	12,270.42	-
301256	华融化学	2022-03-14	6 个月	新股锁定期内	8.05	10.08	1,180	9,499.00	11,894.40	-
301116	益客食品	2022-01-10	6 个月	新股锁定期内	11.40	20.46	577	6,577.80	11,805.42	-
301302	华如科技	2022-06-16	6 个月	新股锁定期内	52.03	56.42	207	10,770.21	11,678.94	-
301212	联盛化学	2022-04-07	6 个月	新股锁定期内	29.67	33.28	338	10,028.46	11,248.64	-
301220	亚香股份	2022-06-15	6 个月	新股锁定	35.98	39.15	285	10,254.30	11,157.75	-

				期内						
30109 7	天益 医疗	2022-0 3-25	6 个月	新股 锁定 期内	52.37	47.83	219	11,469 .03	10,474 .77	-
30113 7	哈焊 华通	2022-0 3-14	6 个月	新股 锁定 期内	15.37	15.99	622	9,560. 14	9,945. 78	-
30124 8	杰创 智能	2022-0 4-13	6 个月	新股 锁定 期内	39.07	29.87	313	12,228 .91	9,349. 31	-
301117	佳缘 科技	2022-0 1-07	6 个月	新股 锁定 期内	46.80	54.44	169	7,909. 20	9,200. 36	-
30128 8	清研 环境	2022-0 4-14	6 个月	新股 锁定 期内	19.09	19.98	452	8,628. 68	9,030. 96	-
30112 5	腾亚 精工	2022-0 5-27	6 个月	新股 锁定 期内	22.49	27.42	327	7,354. 23	8,966. 34	-
30116 3	宏德 股份	2022-0 4-11	6 个月	新股 锁定 期内	26.27	32.33	277	7,276. 79	8,955. 41	-
30114 8	嘉戎 技术	2022-0 4-14	6 个月	新股 锁定 期内	38.39	23.90	374	14,357 .86	8,938. 60	-
30113 0	西点 药业	2022-0 2-16	6 个月	新股 锁定 期内	22.55	37.70	237	5,344. 35	8,934. 90	-
30123 9	普瑞 眼科	2022-0 6-22	6 个月	新股 锁定 期内	33.65	33.65	264	8,883. 60	8,883. 60	-
30121 6	万凯 新材	2022-0 3-21	6 个月	新股 锁定 期内	35.68	29.84	276	9,847. 68	8,235. 84	-
30122 2	浙江 恒威	2022-0 3-02	6 个月	新股 锁定 期内	33.98	28.96	273	9,276. 54	7,906. 08	-
30113 5	瑞德 智能	2022-0 4-01	6 个月	新股 锁定 期内	31.98	26.26	300	9,594. 00	7,878. 00	-
30115 8	德石 股份	2022-0 1-07	6 个月	新股 锁定 期内	15.64	20.38	379	5,927. 56	7,724. 02	-
30122	实朴	2022-0	6 个月	新股	20.08	20.34	373	7,489.	7,586.	-

8	检测	1-21		锁定期内				84	82	
301233	盛帮股份	2022-06-24	6 个月	新股锁定期内	41.52	41.52	158	6,560.16	6,560.16	-
301151	冠龙节能	2022-03-30	6 个月	新股锁定期内	30.82	21.46	305	9,400.10	6,545.30	-
301181	标榜股份	2022-02-11	6 个月	新股锁定期内	40.25	30.59	213	8,573.25	6,515.67	-
301258	富士莱	2022-03-21	6 个月	新股锁定期内	48.30	41.68	155	7,486.50	6,460.40	-
301219	腾远钴业	2022-03-10	6 个月	新股锁定期内	173.98	87.82	72	6,959.20	6,323.04	-
301110	青木股份	2022-03-04	6 个月	新股锁定期内	63.10	39.85	139	8,770.90	5,539.15	-

注：1、根据中国证监会《关于修改<上市公司证券发行管理办法>的决定》、《关于修改<创业板上市公司证券发行管理暂行办法>的决定》以及《关于修改<上市公司非公开发行股票实施细则>的决定》，本基金所认购的非公开发行股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

2、基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

3、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

4、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

5、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告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，本基金未持有银行间市场债券正回购交易中作为质押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为质押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了包括风险管理委员会、风险管理与内部控制委员会、督察长、风险管理部、内控与法律合规部、审计部和相关业务部门构成的多级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理与内部控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间

同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于 2022 年 06 月 30 日，本基金未持有除国债、央行票据、同业存单和政策性金融债以外的固定收益投资(2021 年 12 月 31 日:同)。

本基金固定收益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 2022年6月30日	上年末 2021年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	13,624,478.81	17,239,723.80
合计	13,624,478.81	17,239,723.80

注：未评级债券一般为国债、政策性金融债、中央票据。

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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发行的证券不得超过该证券的 10%。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，因此除附注列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2022 年 06 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(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	4,292,536.55	-	-	-	4,292,536.55
结算备付金	5,756,480.13	-	-	-	5,756,480.13
存出保证金	88,736.29	-	-	-	88,736.29
交易性金融资产	13,624,478.81	-	-	229,491,154.33	243,115,633.14
应收证券清算款	-	-	-	6,774.11	6,774.11
应收申购款	-	-	-	41.75	41.75
资产总计	23,762,231.78	-	-	229,497,970.19	253,260,201.97
负债					
应付证券清算款	-	-	-	270,842.23	270,842.23

应付赎回款	-	-	-	20.34	20.34
应付管理人报酬	-	-	-	295,215.18	295,215.18
应付托管费	-	-	-	49,202.52	49,202.52
应付销售服务费	-	-	-	393.99	393.99
应交税费	-	-	-	0.16	0.16
其他负债	-	-	-	337,115.11	337,115.11
负债总计	-	-	-	952,789.53	952,789.53
利率敏感度缺口	23,762,231.78	-	-	228,545,180.66	252,307,412.44
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	54,110,405.38	-	-	-	54,110,405.38
结算备付金	5,822,997.04	-	-	-	5,822,997.04
存出保证金	92,263.91	-	-	-	92,263.91
交易性金融资产	17,239,723.80	-	-	280,996,678.33	298,236,402.13
应收利息	-	-	-	338,880.26	338,880.26
应收申购款	199.97	-	-	4,459.47	4,659.44
资产总计	77,265,590.10	-	-	281,340,018.06	358,605,608.16
负债					
应付证券清算款	-	-	-	49,201,262.31	49,201,262.31
应付赎回款	-	-	-	18,443.91	18,443.91
应付管理人报酬	-	-	-	348,034.43	348,034.43
应付托管费	-	-	-	58,005.74	58,005.74
应付销售服务费	-	-	-	5,704.39	5,704.39
应付交易费用	-	-	-	300,443.52	300,443.52
应付利息	-	-	-	-5,650.69	-5,650.69
其他负债	-	-	-	150,000.00	150,000.00
负债总计	-	-	-	50,076,243.61	50,076,243.61
利率敏感度缺口	77,265,590.10	-	-	231,263,774.45	308,529,364.55

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约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

于 2022 年 06 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例低于 10%（2021 年 12 月 31 日：同），银行存款、结算备付金、存出保证金和部分应收申购款均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2021 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。

6.4.13.4.3 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的股票，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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”与“自下而上”相结合的主动投资管理策略，将定性分析与定量分析贯穿于大类资产配置、行业配置和个股筛选中，精选经济新变化和发展趋势中的大类资产和个股个券，构建投资组合。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。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于股票资产的比例为基金资产的 60%-95%。每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计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。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，包括特定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 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 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	229,491,154. 33	90.96	280,996,678.3 3	91.08
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	229,491,154. 33	90.96	280,996,678.3 3	91.08

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1.本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变；2.以下分析，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
	1. 业绩比较基准上升5%	增加约 1,418	增加约 1,790
2. 业绩比较基准下降5%	减少约 1,418	减少约 1,790	

6.4.14 公允价值**6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法**

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具**6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值**

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	228,570,187.42	277,461,398.31
第二层次	13,962,590.23	17,344,427.03
第三层次	582,855.49	3,430,576.79
合计	243,115,633.14	298,236,402.13

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

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本报告期内没有有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

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	229,491,154.33	90.61
	其中：股票	229,491,154.33	90.61
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	13,624,478.81	5.38
	其中：债券	13,624,478.81	5.38
	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	10,049,016.68	3.97
8	其他各项资产	95,552.15	0.04
9	合计	253,260,201.97	100.00

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

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	522,085.00	0.21
B	采矿业	7,745,060.00	3.07
C	制造业	145,892,711.45	57.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,377,832.00	1.34

E	建筑业	3,164,408.00	1.25
F	批发和零售业	917,993.02	0.36
G	交通运输、仓储和邮政业	3,509,205.00	1.39
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,768,341.24	2.68
J	金融业	44,328,053.74	17.57
K	房地产业	2,531,750.00	1.00
L	租赁和商务服务业	3,820,052.00	1.51
M	科学研究和技术服务业	3,565,280.25	1.41
N	水利、环境和公共设施管理业	112,417.53	0.04
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	3,235,965.10	1.28
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	229,491,154.33	90.96

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	7,500	15,337,500.00	6.08
2	300750	宁德时代	15,300	8,170,200.00	3.24
3	600036	招商银行	175,100	7,389,220.00	2.93
4	000001	平安银行	406,800	6,093,864.00	2.42
5	601318	中国平安	117,700	5,495,413.00	2.18
6	601012	隆基绿能	66,056	4,401,311.28	1.74
7	000858	五粮液	21,200	4,280,916.00	1.70
8	002594	比亚迪	12,600	4,201,974.00	1.67
9	601888	中国中免	16,400	3,820,052.00	1.51
10	300896	爱美客	6,100	3,660,061.00	1.45
11	603799	华友钴业	38,250	3,657,465.00	1.45
12	603486	科沃斯	29,500	3,595,755.00	1.43
13	603259	药明康德	33,860	3,521,101.40	1.40
14	300059	东方财富	133,021	3,378,733.40	1.34
15	600900	长江电力	146,100	3,377,832.00	1.34

16	002475	立讯精密	99,883	3,375,046.57	1.34
17	000333	美的集团	55,500	3,351,645.00	1.33
18	002142	宁波银行	88,500	3,169,185.00	1.26
19	300015	爱尔眼科	70,300	3,147,331.00	1.25
20	002812	恩捷股份	12,502	3,131,125.90	1.24
21	300661	圣邦股份	17,200	3,130,744.00	1.24
22	002241	歌尔股份	92,400	3,104,640.00	1.23
23	002352	顺丰控股	53,800	3,002,578.00	1.19
24	600438	通威股份	48,400	2,897,224.00	1.15
25	601877	正泰电器	75,500	2,701,390.00	1.07
26	601398	工商银行	560,100	2,671,677.00	1.06
27	300122	智飞生物	23,900	2,653,139.00	1.05
28	600760	中航沈飞	43,600	2,635,620.00	1.04
29	600309	万华化学	26,400	2,560,536.00	1.01
30	000002	万科A	123,500	2,531,750.00	1.00
31	600030	中信证券	113,225	2,452,453.50	0.97
32	300613	富瀚微	28,710	2,434,608.00	0.96
33	000625	长安汽车	138,100	2,391,892.00	0.95
34	600887	伊利股份	61,100	2,379,845.00	0.94
35	000792	盐湖股份	78,200	2,342,872.00	0.93
36	002444	巨星科技	122,600	2,309,784.00	0.92
37	002459	晶澳科技	28,500	2,248,650.00	0.89
38	002049	紫光国微	11,500	2,181,780.00	0.86
39	300628	亿联网络	27,800	2,116,970.00	0.84
40	601211	国泰君安	139,000	2,112,800.00	0.84
41	300763	锦浪科技	9,850	2,098,050.00	0.83
42	000166	申万宏源	479,200	2,055,768.00	0.81
43	688111	金山办公	10,100	1,990,912.00	0.79
44	300735	光弘科技	190,100	1,986,545.00	0.79
45	000651	格力电器	57,900	1,952,388.00	0.77
46	002129	TCL 中环	32,300	1,902,147.00	0.75
47	300760	迈瑞医疗	5,900	1,847,880.00	0.73
48	000762	西藏矿业	33,000	1,845,690.00	0.73
49	000895	双汇发展	60,700	1,778,510.00	0.70
50	002920	德赛西威	12,000	1,776,000.00	0.70
51	000596	古井贡酒	6,800	1,697,688.00	0.67
52	603260	合盛硅业	14,300	1,686,828.00	0.67
53	000733	振华科技	11,600	1,577,252.00	0.63
54	603032	德新交运	19,800	1,564,200.00	0.62
55	002466	天齐锂业	12,500	1,560,000.00	0.62
56	688303	大全能源	22,831	1,559,813.92	0.62
57	601939	建设银行	255,800	1,550,148.00	0.61
58	601328	交通银行	309,200	1,539,816.00	0.61
59	688110	东芯股份	40,273	1,527,152.16	0.61

60	600089	特变电工	55,000	1,506,450.00	0.60
61	600845	宝信软件	27,000	1,474,200.00	0.58
62	600809	山西汾酒	4,400	1,429,120.00	0.57
63	600028	中国石化	347,100	1,416,168.00	0.56
64	601857	中国石油	254,500	1,348,850.00	0.53
65	600176	中国巨石	76,000	1,323,160.00	0.52
66	000063	中兴通讯	50,000	1,276,500.00	0.51
67	300363	博腾股份	14,900	1,162,051.00	0.46
68	002756	永兴材料	7,200	1,095,912.00	0.43
69	601799	星宇股份	6,400	1,094,400.00	0.43
70	601088	中国神华	32,800	1,092,240.00	0.43
71	603659	璞泰来	12,700	1,071,880.00	0.42
72	300124	汇川技术	15,600	1,027,572.00	0.41
73	601390	中国中铁	164,400	1,009,416.00	0.40
74	600188	兖矿能源	25,400	1,002,792.00	0.40
75	300014	亿纬锂能	10,100	984,750.00	0.39
76	600893	航发动力	21,300	969,363.00	0.38
77	600919	江苏银行	133,700	951,944.00	0.38
78	601117	中国化学	100,200	942,882.00	0.37
79	601238	广汽集团	60,700	925,068.00	0.37
80	000963	华东医药	19,900	898,684.00	0.36
81	601601	中国太保	36,900	868,257.00	0.34
82	300401	花园生物	47,300	820,182.00	0.33
83	688099	晶晨股份	8,000	808,000.00	0.32
84	002493	荣盛石化	52,230	803,819.70	0.32
85	300775	三角防务	16,600	799,290.00	0.32
86	603619	中曼石油	38,700	796,059.00	0.32
87	600132	重庆啤酒	5,200	762,320.00	0.30
88	601688	华泰证券	48,200	684,440.00	0.27
89	601658	邮储银行	123,800	667,282.00	0.26
90	300573	兴齐眼药	4,300	659,276.00	0.26
91	002415	海康威视	18,000	651,600.00	0.26
92	601868	中国能建	272,600	646,062.00	0.26
93	601377	兴业证券	90,200	635,910.00	0.25
94	600660	福耀玻璃	14,900	622,969.00	0.25
95	603908	牧高笛	6,400	608,960.00	0.24
96	601009	南京银行	57,400	598,108.00	0.24
97	002088	鲁阳节能	27,900	587,295.00	0.23
98	002304	洋河股份	3,200	586,080.00	0.23
99	601668	中国建筑	106,400	566,048.00	0.22
100	601628	中国人寿	18,100	562,548.00	0.22
101	601818	光大银行	186,200	560,462.00	0.22
102	002460	赣锋锂业	3,700	550,190.00	0.22
103	300595	欧普康视	9,600	549,024.00	0.22

104	688690	纳微科技	6,600	533,346.00	0.21
105	600018	上港集团	86,900	506,627.00	0.20
106	600031	三一重工	26,100	497,466.00	0.20
107	688385	复旦微电	7,600	495,444.00	0.20
108	000568	泸州老窖	1,800	443,772.00	0.18
109	600926	杭州银行	28,700	429,926.00	0.17
110	300861	美畅股份	4,300	398,567.00	0.16
111	688981	中芯国际	8,800	397,496.00	0.16
112	002176	江特电机	15,000	375,600.00	0.15
113	603668	天马科技	18,300	374,967.00	0.15
114	600328	中盐化工	14,900	350,895.00	0.14
115	002371	北方华创	1,200	332,544.00	0.13
116	300871	回盛生物	15,000	331,800.00	0.13
117	603566	普莱柯	11,600	310,068.00	0.12
118	300505	川金诺	9,600	297,216.00	0.12
119	600111	北方稀土	8,200	288,312.00	0.11
120	601336	新华保险	8,900	286,491.00	0.11
121	002041	登海种业	12,700	267,843.00	0.11
122	002891	中宠股份	10,400	264,368.00	0.10
123	002714	牧原股份	4,600	254,242.00	0.10
124	000100	TCL 科技	51,900	248,601.00	0.10
125	601666	平煤股份	17,900	243,261.00	0.10
126	601319	中国人保	34,100	172,546.00	0.07
127	688400	凌云光	4,204	92,193.72	0.04
128	301175	中科环保	24,044	91,848.08	0.04
129	301239	普瑞眼科	2,634	88,634.10	0.04
130	688150	莱特光电	4,340	85,064.00	0.03
131	688193	仁度生物	1,635	84,316.95	0.03
132	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.03
133	688115	思林杰	1,464	56,305.44	0.02
134	688236	春立医疗	2,701	53,479.80	0.02
135	601089	福元医药	1,322	27,828.10	0.01
136	301238	瑞泰新材	686	22,000.02	0.01
137	301266	宇邦新材	442	20,804.94	0.01
138	301215	中汽股份	2,877	18,384.03	0.01
139	603127	昭衍新药	160	18,208.00	0.01
140	301120	新特电气	1,018	15,768.82	0.01
141	301112	信邦智能	337	15,178.48	0.01
142	301122	采纳股份	205	14,425.85	0.01
143	301298	东利机械	634	13,206.22	0.01
144	301263	泰恩康	409	12,834.42	0.01
145	600570	恒生电子	289	12,583.06	0.00
146	301153	中科江南	279	12,270.42	0.00
147	301256	华融化学	1,180	11,894.40	0.00

148	301116	益客食品	577	11,805.42	0.00
149	301302	华如科技	207	11,678.94	0.00
150	301127	天源环保	1,045	11,630.85	0.00
151	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
152	301212	联盛化学	338	11,248.64	0.00
153	301220	亚香股份	285	11,157.75	0.00
154	301097	天益医疗	219	10,474.77	0.00
155	301137	哈焊华通	622	9,945.78	0.00
156	301248	杰创智能	313	9,349.31	0.00
157	301117	佳缘科技	169	9,200.36	0.00
158	301288	清研环境	452	9,030.96	0.00
159	301125	腾亚精工	327	8,966.34	0.00
160	301163	宏德股份	277	8,955.41	0.00
161	301148	嘉戎技术	374	8,938.60	0.00
162	301130	西点药业	237	8,934.90	0.00
163	301216	万凯新材	276	8,235.84	0.00
164	301222	浙江恒威	273	7,906.08	0.00
165	301135	瑞德智能	300	7,878.00	0.00
166	301158	德石股份	379	7,724.02	0.00
167	301228	实朴检测	373	7,586.82	0.00
168	301182	凯旺科技	294	6,985.44	0.00
169	301190	善水科技	281	6,668.13	0.00
170	301151	冠龙节能	305	6,545.30	0.00
171	301181	标榜股份	213	6,515.67	0.00
172	301166	优宁维	110	6,474.60	0.00
173	301258	富士莱	155	6,460.40	0.00
174	301219	腾远钴业	72	6,323.04	0.00
175	301110	青木股份	139	5,539.15	0.00
176	300346	南大光电	40	1,439.20	0.00
177	600958	东方证券	104	1,061.84	0.00
178	600276	恒瑞医药	1	37.09	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300122	智飞生物	6,733,928.00	2.18
2	002812	恩捷股份	6,540,933.00	2.12
3	002049	紫光国微	5,778,144.72	1.87
4	601688	华泰证券	5,458,301.79	1.77
5	300124	汇川技术	5,159,998.00	1.67

6	601919	中远海控	5,098,980.97	1.65
7	300760	迈瑞医疗	5,001,239.00	1.62
8	600438	通威股份	4,892,523.00	1.59
9	000651	格力电器	4,813,906.00	1.56
10	002241	歌尔股份	4,714,776.00	1.53
11	601888	中国中免	4,596,966.00	1.49
12	002129	TCL 中环	4,390,868.00	1.42
13	603799	华友钴业	4,319,729.50	1.40
14	600309	万华化学	4,294,947.36	1.39
15	600031	三一重工	4,233,266.00	1.37
16	002304	洋河股份	4,211,474.00	1.37
17	600893	航发动力	4,191,935.00	1.36
18	600028	中国石化	4,162,354.00	1.35
19	601668	中国建筑	4,102,849.00	1.33
20	688008	澜起科技	4,056,530.50	1.31

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000776	广发证券	6,423,388.19	2.08
2	600048	保利发展	6,299,056.00	2.04
3	002304	洋河股份	5,869,526.70	1.90
4	601225	陕西煤业	5,822,566.00	1.89
5	000002	万科 A	5,748,685.00	1.86
6	601919	中远海控	5,572,355.00	1.81
7	601668	中国建筑	5,525,211.00	1.79
8	601857	中国石油	5,460,896.00	1.77
9	600585	海螺水泥	5,376,504.00	1.74
10	600309	万华化学	5,337,547.00	1.73
11	300760	迈瑞医疗	5,268,102.00	1.71
12	688008	澜起科技	5,073,548.80	1.64
13	600690	海尔智家	5,058,938.00	1.64
14	000651	格力电器	4,992,547.00	1.62
15	002352	顺丰控股	4,845,881.66	1.57
16	002027	分众传媒	4,845,284.00	1.57
17	603986	兆易创新	4,762,889.00	1.54
18	000568	泸州老窖	4,492,454.00	1.46
19	300122	智飞生物	4,434,020.00	1.44
20	600519	贵州茅台	4,413,562.00	1.43

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	506,393,711.64
卖出股票的收入（成交）总额	534,023,717.52

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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	13,624,478.81	5.40
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	13,624,478.81	5.40

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	019648	20 国债 18	133,430	13,624,478.81	5.40

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

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

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

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

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金报告期内未参与国债期货投资，无相关投资评价。

7.12 投资组合报告附注

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

7.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	88,736.29
2	应收清算款	6,774.11
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	41.75
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	95,552.15

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算中四舍五入的原因，本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

8 基金份额持有人信息**8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
中银量化价值混合 A	547	331,740.41	167,056,951.75	92.0617%	14,405,051.99	7.9383%
中银量化价值混合 C	595	840.02	66,167.04	13.2383%	433,647.31	86.7617%
合计	1,142	159,336.09	167,123,118.79	91.8452%	14,838,699.30	8.1548%

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

8.2 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	中银量化价值混合 A	308,814.75	0.1702%
	中银量化价值混合 C	7,151.54	1.4308%
	合计	315,966.29	0.1736%

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

8.3 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的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人	中银量化价值混合 A	10~50
	中银量化价值混合 C	0

持有本开放式基金	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	中银量化价值混合 A	0~10
	中银量化价值混合 C	0
	合计	0~10

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中银量化价值混合 A	中银量化价值混合 C
基金合同生效日（2017 年 11 月 24 日）基金份额总额	333,826,575.55	-
本报告期期初基金份额总额	193,424,783.77	9,875,800.85
本报告期基金总申购份额	417,685.17	1,450,540.10
减：本报告期基金总赎回份额	12,380,465.20	10,826,526.60
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	181,462,003.74	499,814.35

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

本报告期内，经董事会决议通过，陈卫星先生担任副执行总裁，详情请参见基金管理人 2022 年 6 月 7 日刊登的《中银基金管理有限公司关于高级管理人员变更公告》。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内没有改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内管理人、托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	----	------	-----------	----

	单元数量	成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国信证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	1,034,218,556.32	100.00%	438,376.44	100.00%	-
广发证券	1	-	-	-	-	-

注：1、专用交易单元的选择标准和程序：根据中国证监会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》（证监基字[1998]29号）及《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）有关规定，本公司租用证券公司专用交易单元的选择标准主要包括：券商基本面评价（财务状况、经营状况）、券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）、券商每日信息评价（及时性和有效性）和券商协作表现评价等方面。本公司租用证券公司专用交易单元的选择程序：首先根据租用证券公司专用交易单元的选择标准形成《券商研究所服务质量评分表》，然后根据评分高低进行选择基金专用交易单元并与其签订交易单元租用协议。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：新租用德邦证券上海、深圳交易单元各一个，中信证券上海交易单元一个，广发证券北京交易单元一个。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国信证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-

国泰君安	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	17,900,936.50	100.00%	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中银基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证监会规定媒介	2022-01-01
2	中银基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	中国证监会规定媒介	2022-01-05
3	中银基金管理有限公司关于新增诺亚正行基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2022-01-10
4	中银基金管理有限公司关于新增上海基煜基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2022-01-13
5	中银基金管理有限公司关于旗下部分基金估值变更的提示性公告	中国证监会规定媒介	2022-01-14
6	中银基金管理有限公司关于旗下部分基金增加西部证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2022-01-17
7	中银基金管理有限公司关于新增上海基煜基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2022-01-18
8	中银基金管理有限公司关于新增泰信财富基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2022-01-21
9	中银量化价值混合型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2022-01-21
10	中银基金管理有限公司关于新增上海联泰基金销售有限公司为旗下部分证券投资基金销	中国证监会规定媒介	2022-01-24

	售机构的公告		
11	中银基金管理有限公司关于新增上海联泰基金销售有限公司为旗下部分证券投资基金销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2022-01-25
12	中银基金管理有限公司关于旗下部分基金增加华金证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2022-01-27
13	中银基金管理有限公司关于新增宜信普泽(北京)基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2022-03-24
14	中银基金管理有限公司关于新增宜信普泽(北京)基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2022-03-25
15	中银量化价值混合型证券投资基金 2021 年年度报告	中国证监会规定媒介	2022-03-30
16	中银基金管理有限公司关于新增北京汇成基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2022-04-11
17	中银基金管理有限公司关于旗下部分基金增加招商银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2022-04-14
18	中银基金管理有限公司关于新增北京汇成基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2022-04-18
19	中银量化价值混合型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2022-04-21
20	中银基金管理有限公司关于为部分基金销售机构开通转换业务的公告	中国证监会规定媒介	2022-05-06
21	中银基金管理有限公司关于为部分基金销售机构开通转换业务的公告	中国证监会规定媒介	2022-05-09
22	中银基金管理有限公司关于新增平安证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2022-05-13
23	中银基金管理有限公司关于旗下部分基金增加宁波银行股份有限公司同业易管家平台为销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2022-05-27
24	中银基金管理有限公司关于新增泰信财富基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构并开通转换业务公告	中国证监会规定媒介	2022-06-02
25	中银基金管理有限公司关于新增泰信财富基金销售有限公司为部分基金开通转换业务的公告	中国证监会规定媒介	2022-06-06
26	中银基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证监会规定媒介	2022-06-07
27	中银基金管理有限公司关于新增国信证券股份有限公司为中银量化价值混合型证券投资基金销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2022-06-09

28	中银基金管理有限公司关于新增嘉实财富管理有限公司为旗下部分基金销售机构并开通转换业务公告	中国证监会规定媒介	2022-06-13
30	中银基金管理有限公司关于新增嘉实财富管理有限公司为旗下部分基金销售机构并开通转换业务公告	中国证监会规定媒介	2022-06-14
31	中银基金管理有限公司董事、监事、高级管理人员和分支机构负责人的人员名单	中国证监会规定媒介	2022-06-21
32	中银基金管理有限公司关于新增济安财富(北京)基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构并开通转换业务的公告	中国证监会规定媒介	2022-06-21
33	中银基金管理有限公司关于新增济安财富(北京)基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构并开通转换业务的公告	中国证监会规定媒介	2022-06-22

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20220101-20220630	45,333,585.19	0.00	0.00	45,333,585.19	24.9138%
	2	20220101-20220630	46,077,780.85	0.00	0.00	46,077,780.85	25.3228%
产品特有风险							
<p>本基金由于存在上述单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况，存在以下特有风险：（1）持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大额赎回导致的基金份额净值波动风险；（2）持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大额赎回导致的流动性风险；（3）持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大额赎回导致的巨额赎回风险；（4）持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大额赎回导致的基金资产净值持续低于5000万元的风险。</p>							

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量化价值混合型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《中银量化价值混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《中银量化价值混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《中银量化价值混合型证券投资基金招募说明书》；
- 5、法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；

- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 8、报告期内在指定报刊上披露的各项公告；
- 9、中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

以上备查文件存放在基金管理人、基金托管人处，供公众查阅。

12.3 查阅方式

投资人在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件。

中银基金管理有限公司
二〇二二年八月三十日