

# 中银中证 100 交易型开放式指数证券投资基金

## 2023 年中期报告

### 2023 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：中信证券股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年八月三十日

## 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。

基金托管人中信证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 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 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>1 重要提示及目录</b> .....	2
1.1 重要提示.....	2
<b>2 基金简介</b> .....	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
<b>3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>4 管理人报告</b> .....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
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.....	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.....	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
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
<b>5 托管人报告</b> .....	11
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	11
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.....	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
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	16
<b>7 投资组合报告</b> .....	38
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	39
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.....	40
7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	40
7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	43
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.....	45
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	45
7.12 投资组合报告附注.....	45

<b>8 基金份额持有人信息</b> .....	46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	46
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	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的情况.....	47
<b>9 开放式基金份额变动</b> .....	48
<b>10 重大事件揭示</b> .....	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、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	49
10.8 其他重大事件.....	49
<b>11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	50
<b>12 备查文件目录</b> .....	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	中银中证 100 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	中银 100
场内简称	中银中证 100ETF
基金主代码	515670
交易代码	515670
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2020 年 4 月 17 日
基金管理人	中银基金管理有限公司
基金托管人	中信证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	91,822,480.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2020 年 5 月 20 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。在正常市场情况下，力争控制本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不得超过 2%。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即按照标的指数的成份股的构成及其权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整。
业绩比较基准	中证 100 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为被动式投资的股票型指数基金，主要采用完全复制策略，跟踪中证 100 指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

### 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	中信证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	欧阳向军	杨军智
	联系电话	021-38848999	010-60834299
	电子邮箱	clientservice@bocim.com	yjz@citics.com
客户服务电话		021-38834788 400-888-5566	010-60836588
传真		021-68873488	010-60834004
注册地址		上海市银城中路200号中银大厦45层	广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座
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	北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦5层
邮政编码		200120	100125
法定代表人		章砚	张佑君

## 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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## 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（2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	2,241,094.52
本期利润	2,171,274.58
加权平均基金份额本期利润	0.0211
本期加权平均净值利润率	2.07%
本期基金份额净值增长率	0.07%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-1,671,483.88
期末可供分配基金份额利润	-0.0182
期末基金资产净值	90,150,996.12
期末基金份额净值	0.9818
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-1.82%

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。期末可供分配利润，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）。

基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去收益分配金额后可能低于面值。

### 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
过去一个月	2.88%	0.94%	1.96%	0.94%	0.92%	0.00%
过去三个月	-4.67%	0.87%	-5.85%	0.87%	1.18%	0.00%
过去六个月	0.07%	0.89%	-1.26%	0.90%	1.33%	-0.01%
过去一年	-14.17%	1.04%	-16.29%	1.06%	2.12%	-0.02%
过去三年	-7.38%	1.22%	-12.10%	1.23%	4.72%	-0.01%
自基金合同生效日起	-1.82%	1.19%	-5.16%	1.21%	3.34%	-0.02%

#### 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

中银中证 100 交易型开放式指数证券投资基金  
 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  
 (2020 年 4 月 17 日至 2023 年 6 月 30 日)



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(英国)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 2023 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一百余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		
赵建忠	基金经理	2020-04-17	-	17	中银基金管理有限公司助理副总裁(AVP),金融学硕士。2007年加入中银基金管理有限公司,曾担任基金运营部基金会计、研究部研究员、基金经理助理。2015年6月至今任中银中证100基金基金经理,2015年6月至今任国企ETF基金基金经理,2015年6月至今任中银300E基金基金经理,2016年8月至2018年2月任中银宏利基金基金经理,2016年8月至2018年2月任中银丰利基金基金经理,2020年4月至今任中银100基金基金经理,2020年7月至2022年8月任中银800基金基金经理,2020年8月至今任中银黄金基金基金经理,2020年9月至今任中银上海金ETF联接基金基金经理,2020年11月至今任中银中证100ETF联接基金基金经理,2021年12月至今任中银中证800基金(原目标ETF基金)基金经理。具备基金、期货从业资格。

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边际走弱，不过体现出一定韧性。美国通胀回落，经济有所分化但仍有韧性，就业市场维持偏紧状态，6 月 CPI 较 2022 年 12 月回落 3.5 个百分点至 3.0%，6 月制造业 PMI 较 2022 年 12 月回落 2.4 个百分点至 46.0%，6 月服务业 PMI 较 2022 年 12 月回升 4.7 个百分点至 53.9%，6 月失业率较 2022 年 12 月小幅抬升 0.1 个百分点至 3.6%。美联储 2 月、3 月、5 月各加息 25bps，联邦基金目标利率区间上限升至 5.25%。欧元区经济表现分化，服务业好于制造业，4 月失业率较 2022 年末回落 0.2 个百分点至 6.5%，6 月制造业 PMI 较 2022 年末回落 4.4 个百分点至 43.4%，6 月服务业 PMI 较 2022 年末抬升 2.2 个百分点至 52.0%，欧央行 2 月和 3 月各加息 50bps、5 月和 6 月各加息 25bps。日本央行调整 YCC，维持政策利率不变，但将购债操作利率由 0.5% 上调至 1%，经济边际向好，通胀有所回落，6 月 CPI 同比较 2022 年末回落 0.7 个百分点至 3.3%，6 月制造业 PMI 较 2022 年末回升 0.9 个百分点至 49.8%，6 月服务业 PMI 较 2022 年末抬升 2.9 个百分点至 54.0%。综合来看，全球经济下半年经济下行压力仍存，主要经济体央行货币政策依然处于继续收紧状态，不过可能接近于加息尾声。

国内经济方面，经济依然处于弱复苏状态，经济内生修复动能仍待提振，国内经济数据边际走弱，仍体现结构性分化，基建维持在一定强度，消费增速继续恢复，地产维持负增长，出口走弱，CPI 与 PPI 通胀整体走低。具体来看，上半年领先指标中采制造业 PMI 先上后下，6 月值较 2022 年 12 月值走高 2.0 个百分点至 49.0%，同步指标工业增加值 6 月同比增长 4.4%，较 2022 年 12 月回升 3.1 个百分点。从经济增长动力来看，出口与投资走弱，消费有所恢复：6 月美元计价出口增速较 2022 年 12 月回落 1.0 个百分点至-12.4%，6 月社会消费品零售总额增速较 2022 年 12 月回升 4.9 个百分点至 3.1%，基建投资较强，制造业投资仍在相对低位，房地产投资延续负增长，1-6 月固定资产投资增速较 2022 年末回落 1.3 个百分点至 3.8%的水平。通胀方面，CPI 震荡走低，6 月同比增速从 2022 年 12 月的 1.8%降低 1.8 个百分点至 0.0%，PPI 负值走阔，6 月同比增速从 2022 年 12 月的-0.7%回落 4.7 个百分点至-5.4%。

## 2、行情回顾

上半年市场集中在 TMT 和“中特估”两条主线。年初由于对今年经济强复苏的预期，股市大幅反弹，春节后“弱预期、弱现实”市场进入波动调整期。经济基本面与市场预期的阶段性错配，叠加在相对宽松的流动性背景下，OpenAI 为代表的科技企业引发的 AIGC 生产力变革，使硬件和软件应用端具备发展潜力的板块表现较突出。从各行业来看，通信(50.66%)、传媒(42.75%)、计算机(27.57%)等行业表现较好，商贸零售(-23.44%)、房地产(-14.29%)、美容护理(-13.61%)等行业跌幅较大。最终，沪深 300 等权指数涨跌幅度为 2.47%；中证 100 涨跌幅-1.26%；上证国企指数涨跌幅 0.36%，中证 800 指数涨跌 0.02%。

## 3. 运行分析

本报告期为基金的正常运作期。我们严格遵守基金合同，采用完全复制策略跟踪指数，在因指数权重调整或基金申赎发生变动时，根据市场的流动性情况采用量化模型优化交易以降低冲击成本和减少跟踪误差。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金份额净值增长率为 0.07%，同期业绩比较基准收益率为-1.26%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，政策底已现，叠加人民币阶段性企稳和美国加息进程进入尾声，预期有所修复。之前市场的下行压力主要来自流动性压力以及对经济中长期前景的担忧。而政治局会议对房地产政策和资本市场的基调发生变化，提振了“稳增长”信心，政策加码后经济有望向好，上市公司盈利拐点将至，景气不断修复可期。

本基金将严格按照契约规定，采用完全复制投资策略，被动跟踪指数，保持跟踪误差在较小范

围内。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，由基金运营、风险管理、研究及投资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。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。当改变估值技术时，导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上的，会计师事务所应对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

根据本基金基金合同的规定，当基金累计报酬率超过同期业绩比较基准累计报酬率达到 1.0% 以上时，可进行收益分配。

本报告期末可供分配利润为-1,671,483.88 元。本基金本报告期末进行利润分配。

#### 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

本报告期内，中信证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在对中银中证 100 交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《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、基金份额申购赎回价格的计算以及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

本报告期，由中银基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关中银中证 100 交易型开放式指数证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

# 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：中银中证 100 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	965,450.08	1,748,865.01
结算备付金		48,178.24	32,564.87
存出保证金		74,778.29	237,617.80
交易性金融资产	6.4.7.2	89,189,498.33	137,184,481.81
其中：股票投资		89,189,498.33	137,184,481.81
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		-	131,917.72
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	75,616.24	-
资产总计		90,353,521.18	139,335,447.21
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>

		2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
<b>负债：</b>			
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		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		34,672.42	42,036.65
应付托管费		6,934.48	8,407.36
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	160,918.16	633,861.75
负债合计		202,525.06	684,305.76
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	91,822,480.00	141,322,480.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-1,671,483.88	-2,671,338.55
净资产合计		90,150,996.12	138,651,141.45
负债和净资产总计		90,353,521.18	139,335,447.21

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.9818 元，基金份额总额 91,822,480.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：中银中证 100 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		2,696,863.55	-4,360,758.39
1.利息收入		11,338.68	6,359.13
其中：存款利息收入	6.4.7.9	11,338.68	6,359.13
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,629,221.52	-3,578,818.19
其中：股票投资收益	6.4.7.10	1,510,509.71	-4,367,012.29
基金投资收益		-	-

债券投资收益	6.4.7.11	-	14,138.09
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	-	-
股利收益	6.4.7.14	1,118,711.81	774,056.01
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	-69,819.94	-870,137.79
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	126,123.29	81,838.46
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>525,588.97</b>	<b>428,271.11</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2	235,021.92	170,453.49
2. 托管费	6.4.10.2	47,004.34	34,090.67
3. 销售服务费		-	-
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		-	-
7. 税金及附加		-	0.03
8. 其他费用	6.4.7.17	243,562.71	223,726.92
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>2,171,274.58</b>	<b>-4,789,029.50</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>2,171,274.58</b>	<b>-4,789,029.50</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		<b>2,171,274.58</b>	<b>-4,789,029.50</b>

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：中银中证 100 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 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）	141,322,480.00	-	-2,671,338.55	138,651,141.45
二、本期期初净资产（基金净值）	141,322,480.00	-	-2,671,338.55	138,651,141.45

三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-49,500,000.00	-	999,854.67	-48,500,145.33
（一）、综合收益总额	-	-	2,171,274.58	2,171,274.58
（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）	-49,500,000.00	-	-1,171,419.91	-50,671,419.91
其中：1.基金申购款	30,000,000.00	-	591,951.94	30,591,951.94
2.基金赎回款	-79,500,000.00	-	-1,763,371.85	-81,263,371.85
（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）	91,822,480.00	-	-1,671,483.88	90,150,996.12
项目	上年度可比期间 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）	66,322,480.00	-	15,571,582.60	81,894,062.60
二、本期期初净资产（基金净值）	66,322,480.00	-	15,571,582.60	81,894,062.60
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	10,500,000.00	-	-4,515,267.85	5,984,732.15
（一）、综合收益总额	-	-	-4,789,029.50	-4,789,029.50
（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）	10,500,000.00	-	273,761.65	10,773,761.65
其中：1.基金申购款	25,500,000.00	-	1,876,159.82	27,376,159.82
2.基金赎回	-15,000,000.00	-	-1,602,398.17	-16,602,398.17

款				7
(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)	76,822,480.00	-	11,056,314.75	87,878,794.75

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

中银中证 100 交易型开放式指数证券投资基金(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[2019]2050 号《关于准予中银中证 100 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》注册，由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《中银中证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金，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 319,816,000.00 元(无募集股票市值)，业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2020)验字第 61062100\_B07 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《中银中证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2020 年 4 月 17 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 319,822,480.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 6,480.00 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，基金托管人为中信证券股份有限公司。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2020]125 号审核同意，本基金 319,822,480.00 份基金份额于 2020 年 5 月 20 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中银中证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化；投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数的成份股及其备选成份股、其他股票(包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票)、股指期货、股票期权、债券(包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券(含分离交易可转债的纯债



部分)、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、同业存单、现金,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)。本基金还可参与融资和转融通证券出借业务。本基金的投资组合比例为:标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%,且不低于非现金基金资产的 80%;股指期货、股票期权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。在正常市场情况下,本基金对标的指数的跟踪目标是:力争控制本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%,年跟踪误差不超过 2%。本基金的业绩比较基准为:中证 100 指数收益率。

本基金的基金管理人中银基金管理有限公司以本基金为目标 ETF,募集成立了中银中证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“中银中证 100 ETF 联接基金”)。中银中证 100 ETF 联接基金为交易型开放式基金,投资目标与本基金类似,将绝大多数基金资产投资于本基金。

本财务报表由本基金的基金管理人中银基金管理有限公司于 2023 年 8 月 29 日批准。

#### 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、《资产管理产品相关会计处理规定》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》、《中银中证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 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于 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

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。

##### 6.4.4.1 会计年度

本期财务报表的实际编制期间系自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 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

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

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。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加

权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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。

#### 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

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。

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。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

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,当基金累计报酬率超过同期业绩比较基准累计报酬率达到 1.0% 以上时,可进行分配。收益分配后基金累计报酬率尽可能贴近业绩比较基准同期累计报酬率,本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提,收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 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(可转换债券和可交换债券除外)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(可转换债券和可交换债券除外)，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

本基金本报告期无会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 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。

(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 2023 年 6 月 30 日
活期存款	965,450.08
等于：本金	965,159.63
加：应计利息	290.45
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	965,450.08

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	92,144,380.94	-	89,189,498.33	-2,954,882.61
贵金属投资-金交	-	-	-	-

所黄金合约				
债券	交易所		-	
	市场	-		-
	银行间		-	
	市场	-		-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计	92,144,380.94	-	89,189,498.33	-2,954,882.61

### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	75,616.24
合计	75,616.24

### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 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	26,739.21

其中：交易所市场	26,739.21
银行间市场	-
应付利息	-
IOPV 计算发布费	24,795.19
应付信息披露费	59,507.37
应付审计费	14,876.39
应付指数使用费	35,000.00
合计	160,918.16

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	141,322,480.00	141,322,480.00
本期申购	30,000,000.00	30,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-79,500,000.00	-79,500,000.00
本期末	91,822,480.00	91,822,480.00

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购、赎回单位的整数倍。

#### 6.4.7.8 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	13,087,508.98	-15,758,847.53	-2,671,338.55
本期利润	2,241,094.52	-69,819.94	2,171,274.58
本期基金份额交易产生的变动数	-4,816,705.09	3,645,285.18	-1,171,419.91
其中：基金申购款	3,136,465.81	-2,544,513.87	591,951.94
基金赎回款	-7,953,170.90	6,189,799.05	-1,763,371.85
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,511,898.41	-12,183,382.29	-1,671,483.88

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
	活期存款利息收入
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	796.39
其他	1,639.72

合计	11,338.68
----	-----------

**6.4.7.10 股票投资收益****6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	117,667.28
股票投资收益——赎回差价收入	1,392,842.43
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	1,510,509.71

**6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	39,840,608.02
减：卖出股票成本总额	39,623,206.09
减：交易费用	99,734.65
买卖股票差价收入	117,667.28

**6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	81,263,371.85
减：现金支付赎回款总额	34,651,684.85
减：赎回股票成本总额	45,218,844.57
减：交易费用	-
赎回差价收入	1,392,842.43

**6.4.7.11 债券投资收益**

本基金本报告期无债券投资收益。

**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**

本基金本报告期无衍生工具收益。

**6.4.7.14 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,118,711.81
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	1,118,711.81

#### 6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
1.交易性金融资产	-69,819.94
——股票投资	-69,819.94
——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	-69,819.94

#### 6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	126,123.29
合计	126,123.29

#### 6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023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	-
ETF 注册登记费	74,383.76
其他	24,795.19
指数使用费	70,000.00
合计	243,562.71

## 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

本基金本会计期间内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
中信证券股份有限公司(“中信证券”)	基金托管人

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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
中信证券	4,198,257.20	7.16%	20,536,137.64	32.39%

#### 6.4.10.1.2 权证交易

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权证交易。

#### 6.4.10.1.3 债券交易

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债券交易。

#### 6.4.10.1.4 债券回购交易

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债券回购交易。

#### 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 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期	占当期佣金	期末应付佣金余额	占期末应付佣

	佣金	总量的比例		金总额的比例
中信证券	3,867.79	7.15%	3,666.50	13.71%
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022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
中信证券	18,917.08	32.30%	18,643.91	37.41%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

#### 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 2023年1月1日至2023年6月 30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	235,021.92	170,453.49
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.45% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.45\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 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 2023年1月1日至2023年6月 30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	47,004.34	34,090.67

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.09% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.09\% \div \text{当年天数}$$

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

##### 6.4.10.3 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自有资金投资本基金的情况**

本基金的基金管理人本报告期内及上年度可比期间均未运用自有资金投资本基金。

**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**

份额单位：份

关联方名称	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
中信证券股份有限公司	3,225,900.00	3.51%	3,388,700.00	2.40%

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方投资本基金所采用的费率适用招募说明书以及管理人发布的最新公告规定的费率结构。

**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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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
中信证券股份有限公司	965,450.08	8,902.57	944,590.65	5,837.99

注：本基金的托管人为中信证券，银行存款存放在具有基金托管资格的中国工商银行股份有限公司，按银行同业利率或约定利率计息。

**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

本基金本报告期未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2023 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
688502	茂莱光学	2023-02-28	6 个月	新股锁定期内	69.72	178.59	446	31,095.12	79,651.14	-
688535	华海诚科	2023-03-28	6 个月	新股锁定期内	35.00	51.23	65	2,275.00	3,329.95	-
688433	华曙高科	2023-04-07	6 个月	新股锁定期内	26.66	31.50	84	2,239.44	2,646.00	-
603135	中重科技	2023-03-29	6 个月	新股锁定期内	17.80	17.89	101	1,797.80	1,806.89	-
601065	江盐集团	2023-03-31	6 个月	新股锁定期内	10.36	11.84	126	1,305.36	1,491.84	-
603137	恒尚节能	2023-04-10	6 个月	新股锁定期内	15.90	17.09	86	1,367.40	1,469.74	-
603125	常青科技	2023-03-30	6 个月	新股锁定期内	25.98	24.53	37	961.26	907.61	-

##### 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。

##### 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“期末本基金持有的流通受限证券”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。

于本报告期末，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额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。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 2023 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	965,450.08	-	-	-	965,450.08
结算备付金	48,178.24	-	-	-	48,178.24
存出保证金	74,778.29	-	-	-	74,778.29
交易性金融资产	-	-	-	89,189,498.33	89,189,498.33
其他资产	-	-	-	75,616.24	75,616.24
资产总计	1,088,406.61	-	-	89,265,114.57	90,353,521.18
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	34,672.42	34,672.42
应付托管费	-	-	-	6,934.48	6,934.48
其他负债	-	-	-	160,918.16	160,918.16
负债总计	-	-	-	202,525.06	202,525.06
利率敏感度缺口	1,088,406.61	-	-	89,062,589.51	90,150,996.12
上年度末 2022 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	1,748,865.01	-	-	-	1,748,865.01
结算备付金	32,564.87	-	-	-	32,564.87
存出保证金	237,617.80	-	-	-	237,617.80
交易性金融资产	-	-	-	137,184,481.81	137,184,481.81
应收证券清算款	-	-	-	131,917.72	131,917.72
资产总计	2,019,047.68	-	-	137,316,399.53	139,335,447.21
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	42,036.65	42,036.65
应付托管费	-	-	-	8,407.36	8,407.36
其他负债	-	-	-	633,861.75	633,861.75
负债总计	-	-	-	684,305.76	684,305.76
利率敏感度缺口	2,019,047.68	-	-	136,632,093.77	138,651,141.45

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

本报告期末，本基金持有的固定收益品种投资公允价值占基金净资产的比例低于 10%，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响（上年度末：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或银行间同业市场交易的证券，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。

##### 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 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	89,189,498.33	98.93	137,184,481.81	98.94
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	89,189,498.33	98.93	137,184,481.81	98.94

##### 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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	1. 业绩比较基准上升 5%	增加约 445	增加约 688
	2. 业绩比较基准下降 5%	减少约 445	减少约 688

#### 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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	89,098,195.16	137,167,701.17
第二层次	-	-
第三层次	91,303.17	16,780.64
合计	89,189,498.33	137,184,481.81

##### 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、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

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	89,189,498.33	98.71
	其中：股票	89,189,498.33	98.71
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	1,013,628.32	1.12
8	其他各项资产	150,394.53	0.17
9	合计	90,353,521.18	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 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	939,102.00	1.04
B	采矿业	4,940,912.00	5.48
C	制造业	54,816,927.93	60.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,958,110.00	3.28
E	建筑业	1,623,610.00	1.80
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,399,618.00	1.55
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,406,153.00	7.11
J	金融业	10,397,831.20	11.53
K	房地产业	1,878,139.00	2.08
L	租赁和商务服务业	1,482,115.60	1.64
M	科学研究和技术服务业	1,310,398.80	1.45
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	721,520.80	0.80
R	文化、体育和娱乐业	212,102.00	0.24
S	综合	-	-

合计	89,086,540.33	98.82
----	---------------	-------

注：股票投资合计如与报告期末资产组合情况中期末股票公允价值存在差异是因为本表不考虑可退替代款估值增值。

## 7.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	96,063.71	0.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,469.74	0.00
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	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	5,424.55	0.01
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	102,958.00	0.11

## 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

## 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

### 7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	5,200	8,793,200.00	9.75
2	300750	宁德时代	21,840	4,996,773.60	5.54



3	601318	中国平安	89,800	4,166,720.00	4.62
4	600036	招商银行	101,700	3,331,692.00	3.70
5	000333	美的集团	40,700	2,398,044.00	2.66
6	002594	比亚迪	7,500	1,937,025.00	2.15
7	600900	长江电力	80,900	1,784,654.00	1.98
8	600276	恒瑞医药	36,588	1,752,565.20	1.94
9	601899	紫金矿业	135,000	1,534,950.00	1.70
10	300059	东方财富	105,646	1,500,173.20	1.66
11	601012	隆基绿能	49,772	1,426,963.24	1.58
12	601398	工商银行	290,300	1,399,246.00	1.55
13	000651	格力电器	37,600	1,372,776.00	1.52
14	600309	万华化学	15,500	1,361,520.00	1.51
15	002475	立讯精密	40,729	1,321,656.05	1.47
16	002415	海康威视	38,500	1,274,735.00	1.41
17	000725	京东方 A	311,600	1,274,444.00	1.41
18	000063	中兴通讯	26,200	1,193,148.00	1.32
19	300760	迈瑞医疗	3,900	1,169,220.00	1.30
20	603259	药明康德	16,680	1,039,330.80	1.15
21	002230	科大讯飞	15,000	1,019,400.00	1.13
22	300274	阳光电源	8,700	1,014,681.00	1.13
23	600028	中国石化	155,600	989,616.00	1.10
24	300124	汇川技术	15,400	988,834.00	1.10
25	601668	中国建筑	171,800	986,132.00	1.09
26	002714	牧原股份	22,280	939,102.00	1.04
27	601888	中国中免	8,320	919,609.60	1.02
28	002352	顺丰控股	20,200	910,818.00	1.01
29	002129	TCL 中环	26,850	891,420.00	0.99
30	000792	盐湖股份	45,300	868,401.00	0.96
31	601088	中国神华	27,200	836,400.00	0.93
32	688981	中芯国际	16,177	817,262.04	0.91
33	600031	三一重工	48,700	809,881.00	0.90
34	000002	万科 A	55,800	782,316.00	0.87
35	600438	通威股份	22,400	768,544.00	0.85
36	600048	保利发展	58,700	764,861.00	0.85
37	600406	国电南瑞	32,907	760,151.70	0.84
38	688111	金山办公	1,600	755,552.00	0.84
39	600050	中国联通	156,200	749,760.00	0.83
40	600436	片仔癀	2,600	744,536.00	0.83
41	002371	北方华创	2,300	730,595.00	0.81
42	601728	中国电信	129,300	727,959.00	0.81
43	600690	海尔智家	31,000	727,880.00	0.81
44	300015	爱尔眼科	38,896	721,520.80	0.80
45	600089	特变电工	31,900	711,051.00	0.79
46	600941	中国移动	7,500	699,750.00	0.78

47	601857	中国石油	92,900	693,963.00	0.77
48	603501	韦尔股份	6,800	666,672.00	0.74
49	601766	中国中车	99,400	646,100.00	0.72
50	601390	中国中铁	84,100	637,478.00	0.71
51	600905	三峡能源	117,300	629,901.00	0.70
52	300014	亿纬锂能	10,200	617,100.00	0.68
53	002466	天齐锂业	8,800	615,208.00	0.68
54	000938	紫光股份	18,800	598,780.00	0.66
55	601225	陕西煤业	31,800	578,442.00	0.64
56	603986	兆易创新	5,400	573,750.00	0.64
57	002460	赣锋锂业	9,280	565,708.80	0.63
58	002027	分众传媒	82,600	562,506.00	0.62
59	000338	潍柴动力	44,600	555,716.00	0.62
60	600570	恒生电子	12,430	550,524.70	0.61
61	601985	中国核电	77,100	543,555.00	0.60
62	002049	紫光国微	5,580	520,335.00	0.58
63	600111	北方稀土	20,900	501,182.00	0.56
64	603799	华友钴业	10,700	491,237.00	0.54
65	601919	中远海控	52,000	488,800.00	0.54
66	000100	TCL 科技	123,100	485,014.00	0.54
67	600585	海螺水泥	19,700	467,678.00	0.52
68	600893	航发动力	10,800	456,408.00	0.51
69	002555	三七互娱	12,800	446,464.00	0.50
70	002271	东方雨虹	16,300	444,338.00	0.49
71	300122	智飞生物	9,800	433,160.00	0.48
72	002812	恩捷股份	4,400	423,940.00	0.47
73	600019	宝钢股份	72,900	409,698.00	0.45
74	000661	长春高新	2,800	381,640.00	0.42
75	002709	天赐材料	9,200	378,948.00	0.42
76	600426	华鲁恒升	12,200	373,686.00	0.41
77	688599	天合光能	8,700	370,707.00	0.41
78	601600	中国铝业	64,800	355,752.00	0.39
79	002410	广联达	10,840	352,191.60	0.39
80	600745	闻泰科技	7,200	352,080.00	0.39
81	002241	歌尔股份	19,700	349,675.00	0.39
82	300142	沃森生物	13,200	349,140.00	0.39
83	600588	用友网络	16,800	344,400.00	0.38
84	300450	先导智能	9,200	332,764.00	0.37
85	600010	包钢股份	185,800	332,582.00	0.37
86	001979	招商蛇口	25,400	330,962.00	0.37
87	603993	洛阳钼业	57,700	307,541.00	0.34
88	002493	荣盛石化	24,900	289,836.00	0.32
89	600176	中国巨石	19,800	280,368.00	0.31
90	300347	泰格医药	4,200	271,068.00	0.30

91	000301	东方盛虹	21,500	254,130.00	0.28
92	600346	恒力石化	17,200	246,476.00	0.27
93	300661	圣邦股份	2,860	234,891.80	0.26
94	600989	宝丰能源	18,000	226,980.00	0.25
95	603260	合盛硅业	3,100	217,062.00	0.24
96	300413	芒果超媒	6,200	212,102.00	0.24
97	002648	卫星化学	13,860	207,345.60	0.23
98	002601	龙佰集团	11,700	193,050.00	0.21
99	300628	亿联网络	3,980	139,578.60	0.15
100	000708	中信特钢	8,400	133,056.00	0.15

### 7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	688502	茂莱光学	446	79,651.14	0.09
2	301367	怡和嘉业	42	6,230.28	0.01
3	301267	华夏眼科	89	5,424.55	0.01
4	688535	华海诚科	65	3,329.95	0.00
5	688433	华曙高科	84	2,646.00	0.00
6	603135	中重科技	101	1,806.89	0.00
7	601065	江盐集团	126	1,491.84	0.00
8	603137	恒尚节能	86	1,469.74	0.00
9	603125	常青科技	37	907.61	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	300750	宁德时代	1,813,494.60	1.31
2	300760	迈瑞医疗	867,969.00	0.63
3	000333	美的集团	798,693.07	0.58
4	688111	金山办公	708,780.00	0.51
5	300059	东方财富	669,650.00	0.48
6	600519	贵州茅台	523,822.00	0.38
7	002415	海康威视	521,674.00	0.38
8	002594	比亚迪	520,005.00	0.38
9	300124	汇川技术	498,915.00	0.36
10	002475	立讯精密	489,690.00	0.35
11	300015	爱尔眼科	474,490.00	0.34
12	000651	格力电器	464,431.00	0.33

13	002129	TCL 中环	456,764.00	0.33
14	002714	牧原股份	439,607.00	0.32
15	000725	京东方 A	437,744.00	0.32
16	300014	亿纬锂能	374,388.00	0.27
17	002230	科大讯飞	370,971.00	0.27
18	002352	顺丰控股	354,469.00	0.26
19	688599	天合光能	346,085.00	0.25
20	600941	中国移动	345,499.00	0.25

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	300750	宁德时代	4,664,748.48	3.36
2	000333	美的集团	2,089,216.00	1.51
3	300760	迈瑞医疗	1,731,679.00	1.25
4	300059	东方财富	1,670,337.40	1.20
5	002594	比亚迪	1,477,761.00	1.07
6	002415	海康威视	1,279,838.58	0.92
7	000651	格力电器	1,190,506.00	0.86
8	002475	立讯精密	1,163,694.00	0.84
9	000725	京东方 A	1,091,903.00	0.79
10	300124	汇川技术	1,091,134.00	0.79
11	002714	牧原股份	1,011,306.11	0.73
12	300015	爱尔眼科	993,123.00	0.72
13	002352	顺丰控股	986,771.00	0.71
14	002129	TCL 中环	906,669.00	0.65
15	000792	盐湖股份	888,663.00	0.64
16	000002	万科 A	862,540.00	0.62
17	300014	亿纬锂能	825,889.00	0.60
18	002230	科大讯飞	812,493.21	0.59
19	002460	赣锋锂业	742,281.60	0.54
20	000063	中兴通讯	684,985.00	0.49

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

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	19,319,898.12
卖出股票的收入（成交）总额	39,840,608.02

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**

本基金本报告期末未持有债券。

#### **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**

本基金本报告期末未持有债券。

#### **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**

本基金以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标，在风险可控的前提下，根据风险管理原则，以套期保值为目的，本着谨慎原则，参与股指期货投资。本基金将根据对现货和期货市场的分析，发挥股指期货杠杆效应和流动性好的特点，采用股指期货在短期内取代部分现货，获取市场敞口，投资策略包括多头套期保值和空头套期保值。

#### **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中，招商银行受到中国证券监督管理委员会采取责令改正措施，受到中国银行间交易商协会予以警告的自律处分。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。基金管理人将密切跟踪相关进展，遵循价值投资的理念进行投资决策。报告期内，本基金投资的前十名证券的其余的 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	74,778.29
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	75,616.24
8	其他	-
9	合计	150,394.53

#### 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

##### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末持有的指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

##### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	688502	茂莱光学	79,651.14	0.09	新股锁定期内
2	688535	华海诚科	3,329.95	0.00	新股锁定期内
3	688433	华曙高科	2,646.00	0.00	新股锁定期内

注：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

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		中信证券股份有限公司—中银中证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
288	318,828.06	87,681,380.00	95.4901%	4,141,100.00	4.5099%	51,332,900.00	55.9045%

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含“中信证券股份有限公司—中银中证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金”的“持有份额”和“占总份额比例”数据。

## 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	紫金信托有限责任公司	10,001,200.00	10.89%
2	中国人寿保险股份有限公司	9,900,000.00	10.78%
3	华泰证券股份有限公司	4,554,400.00	4.96%
4	中信证券股份有限公司	3,225,900.00	3.51%
5	东方证券股份有限公司	2,362,800.00	2.57%
6	中国银行股份有限公司企业年金计划—农行	2,250,900.00	2.45%
7	海通证券股份有限公司	1,780,000.00	1.94%
8	广发证券股份有限公司	1,254,180.00	1.37%
9	陕西省国际信托股份有限公司	1,019,000.00	1.11%
10	张洁	250,000.00	0.27%
11	中信证券股份有限公司—中银中证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	51,332,900.00	55.90%

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本报告期末基金管理人的从业人员未持有本开放式基金。

## 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的情况

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	0

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2020 年 4 月 17 日）基金份额总额	319,822,480.00
本报告期期初基金份额总额	141,322,480.00
本报告期基金总申购份额	30,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	79,500,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	91,822,480.00

## 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，本基金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，公司原董事曾仲诚（Paul Chung Shing Tsang）先生辞去公司董事。经 2023 年第一次股东会审议通过，同意金贤泽（Hyun Taek Kim）先生担任公司董事。

经董事会决议通过，奚鹏洲先生不再担任投资总监（固定收益），详情请参见基金管理人 2023 年 1 月 5 日刊登的《中银基金管理有限公司基金行业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

本报告期无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的，与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

### 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

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

#### 10.6.2 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，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	
兴业证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	54,417,185.08	92.84%	50,205.91	92.85%	-
中信证券股份有限公司	1	4,198,257.20	7.16%	3,867.79	7.15%	-

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》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：无。

### 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
兴业证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

## 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	2023-01-05
2	中银中证 100 交易型开放式指数证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2023-01-20

3	中银基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	中国证监会规定媒介	2023-02-28
4	中银基金管理有限公司关于新增中国银河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	2023-02-28
5	中银基金管理有限公司关于旗下部分基金增加杭州银行股份有限公司杭 E 家同业平台为销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2023-03-03
6	中银基金管理有限公司关于新增兴业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	2023-03-08
7	中银基金管理有限公司关于新增泛华普益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	2023-03-20
8	中银基金管理有限公司关于提醒投资者防范金融诈骗的公告	中国证监会规定媒介	2023-03-21
9	中银中证 100 交易型开放式指数证券投资基金 2022 年年度报告	中国证监会规定媒介	2023-03-30
10	中银中证 100 交易型开放式指数证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2023-04-21
11	中银基金管理有限公司关于旗下部分基金增加销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2023-04-28

## 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
中信证券股份有限公司—中银中证100交易型开放式指数证券投资基金联接基金	1	2023-01-01至2023-06-30	57,762,900.00	12,690,000.00	19,120,000.00	51,332,900.00	55.9045%
产品特有风险							
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。

## 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中证 100 交易型开放式指数证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《中银中证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《中银中证 100 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4、《中银中证 100 交易型开放式指数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  
二〇二三年八月三十日