

---

中银沪深 300 指数增强型证券投资基金  
(原中银量化价值混合型证券投资基金转型)  
2024 年年度报告  
2024 年 12 月 31 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：二〇二五年三月三十一日

## §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。本年度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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 3 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

本报告中财务资料已经审计。容诚会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。其中，2024 年 3 月 20 日起，“中银量化价值混合型证券投资基金”转型为“中银沪深 300 指数增强型证券投资基金”，基金合同及托管协议即日生效。

## 1.2 目录

§1	重要提示及目录.....	1
§2	基金简介 .....	4
§3	主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 .....	6
3.1	中银沪深 300 指数增强型证券投资基金 .....	6
3.1.1	主要会计数据和财务指标 .....	6
3.1.2	基金净值表现 .....	7
3.1.3	过去三年基金的利润分配情况 .....	10
3.2	中银量化价值混合型证券投资基金 .....	11
3.2.1	主要会计数据和财务指标 .....	11
3.2.2	基金净值表现 .....	12
3.2.3	过去三年基金的利润分配情况 .....	15
§4	管理人报告 .....	15
§5	托管人报告 .....	21
§6	审计报告 .....	22
6.1	中银沪深 300 指数增强型证券投资基金 .....	22
6.2	中银量化价值混合型证券投资基金 .....	24
§7	年度财务报表 .....	26
7.1	中银沪深 300 指数增强型证券投资基金 .....	26
7.1.1	资产负债表 .....	26
7.1.2	利润表 .....	27
7.1.3	净资产变动表 .....	28
7.1.4	报表附注 .....	29
7.2	中银量化价值混合型证券投资基金 .....	54
7.2.1	资产负债表 .....	54
7.2.2	利润表 .....	55
7.2.3	净资产变动表 .....	56
7.2.4	报表附注 .....	58
§8	投资组合报告 .....	85
8.1	中银沪深 300 指数增强型证券投资基金 .....	85
8.1.1	期末基金资产组合情况 .....	85
8.1.2	报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	85
8.1.3	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 .....	86
8.1.4	报告期内股票投资组合的重大变动 .....	92
8.1.5	期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	93
8.1.6	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 .....	93
8.1.7	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 .....	93
8.1.8	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 .....	93
8.1.9	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 .....	93
8.1.10	本基金投资股指期货的投资政策 .....	93
8.1.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	94
8.1.12	投资组合报告附注 .....	94
8.2	中银量化价值混合型证券投资基金 .....	95
8.2.1	期末基金资产组合情况 .....	95
8.2.2	报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	95

8.2.3 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.....	96
8.2.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	100
8.2.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	101
8.2.6 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.....	102
8.2.7 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.....	102
8.2.8 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.....	102
8.2.9 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.....	102
8.2.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	102
8.2.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	102
8.2.12 投资组合报告附注 .....	103
<b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>103</b>
9.1 中银沪深 300 指数增强型证券投资基金 .....	103
9.2 中银量化价值混合型证券投资基金 .....	104
<b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>105</b>
10.1 中银沪深 300 指数增强型证券投资基金 .....	105
10.2 中银量化价值混合型证券投资基金 .....	106
<b>§11 重大事件揭示 .....</b>	<b>106</b>
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>112</b>
12.1 中银沪深 300 指数增强型证券投资基金 .....	112
12.2 中银量化价值混合型证券投资基金 .....	112
<b>§13 备查文件目录 .....</b>	<b>112</b>

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

#### 2.1.1 中银沪深 300 指数增强型证券投资基金

基金名称	中银沪深 300 指数增强型证券投资基金		
基金简称	中银沪深 300 指数增强		
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	2024 年 3 月 20 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	737,879,300.41 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	中银沪深 300 指数增强 A	中银沪深 300 指数增强 C	中银沪深 300 指数增强 E
下属分级基金的交易代码	004881	010311	021851
报告期末下属分级基金的份额总额	434,898,479.84 份	299,617,534.98 份	3,363,285.59 份

#### 2.1.2 中银量化价值混合型证券投资基金

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	299,329,771.22 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	178,937,583.46 份	120,392,187.76 份	

### 2.2 基金产品说明

#### 2.2.1 中银沪深 300 指数增强型证券投资基金

投资目标	本基金为股票指数增强型基金，在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，追求实现超越业绩比较基准的投资回报，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金为指数增强型基金，以沪深 300 指数为标的指数，基金股票投资方面主要采用指数增强量化投资策略。力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%，以实现高于标的指数

	的投资收益和基金资产的长期增值。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人将采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。 指数成份股发生明显负面事件面临退市风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人将按照基金份额持有人利益优先的原则，综合考虑成份股的退市风险、其在指数中的权重以及对跟踪误差的影响，据此制定成份股替代策略，通过提请召开临时投资决策委员会，及时对投资组合进行相应调整。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金为股票型指数增强基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。 本基金可投资港股通标的股票，将面临需承担汇率风险、境外市场风险以及港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

## 2.2.2 中银量化价值混合型证券投资基金

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	陈卫星
	联系电话	021-38848999
	电子邮箱	clientservice@bocim.com
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	上海市浦东新区银城路167号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
登载基金年度报告正文的管理人互联网址	<a href="http://www.bocim.com">http://www.bocim.com</a>
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	容诚会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市西城区阜成门外大街 22 号 1 幢 10 层 1001-1 至 1001-26
注册登记机构	中银基金管理有限公司	上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦

10 层、11 层、26 层、45 层

### §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

#### 3.1 中银沪深 300 指数增强型证券投资基金

##### 3.1.1 主要会计数据和财务指标

		报告期 2024 年 3 月 20 日至 2024 年 12 月 31 日		
3.1.1.1 期间数据和指 标		中银沪深 300 指数增强 A	中银沪深 300 指数增强 C	中银沪深 300 指数增强 E
本期已实现收益		37,576,573.00	36,585,760.64	1,636,255.99
本期利润		45,797,791.79	53,069,941.53	2,347,114.60
加权平均基金份额 本期利润		0.1681	0.2030	0.1525
本期加权平均净值 利润率		15.40%	19.04%	14.15%
本期基金份额净值 增长率		15.77%	13.76%	8.40%
3.1.1.2 期末 数据和指标		报告期末(2024 年 12 月 31 日)		
		中银沪深 300 指数增强 A	中银沪深 300 指数增强 C	中银沪深 300 指数增强 E
期末可供 分配利润		68,593,907.87	41,235,395.13	522,926.15
期末可供 分配基金 份额利润		0.1577	0.1376	0.1555
期末基金 资产净值		503,492,387.71	340,852,930.11	3,886,211.74
期末基金 份额净值		1.1577	1.1376	1.1555
3.1.1.3 累计期末指 标		报告期末(2024 年 12 月 31 日)		

	中银沪深 300 指数增强 A	中银沪深 300 指数增强 C	中银沪深 300 指数增强 E
基金份额累计净值增长率	15.77%	13.76%	8.40%

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）。

3、本基金由原中银量化价值混合型证券投资基金于 2024 年 3 月 20 日转型而来。

4、本基金 E 类份额于 2024 年 7 月 12 日生效，截止报告期末生效未满三年。

### 3.1.2 基金净值表现

#### 3.1.2.1 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

##### 中银沪深 300 指数增强 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-3.17%	1.55%	-1.92%	1.65%	-1.25%	-0.10%
过去六个月	9.62%	1.47%	13.05%	1.58%	-3.43%	-0.11%
自基金合同生效日起	15.77%	1.30%	9.58%	1.33%	6.19%	-0.03%

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-3.27%	1.55%	-1.92%	1.65%	-1.35%	-0.10%
过去六个月	9.41%	1.47%	13.05%	1.58%	-3.64%	-0.11%
自基金合同生效日起	13.76%	1.27%	9.58%	1.33%	4.18%	-0.06%

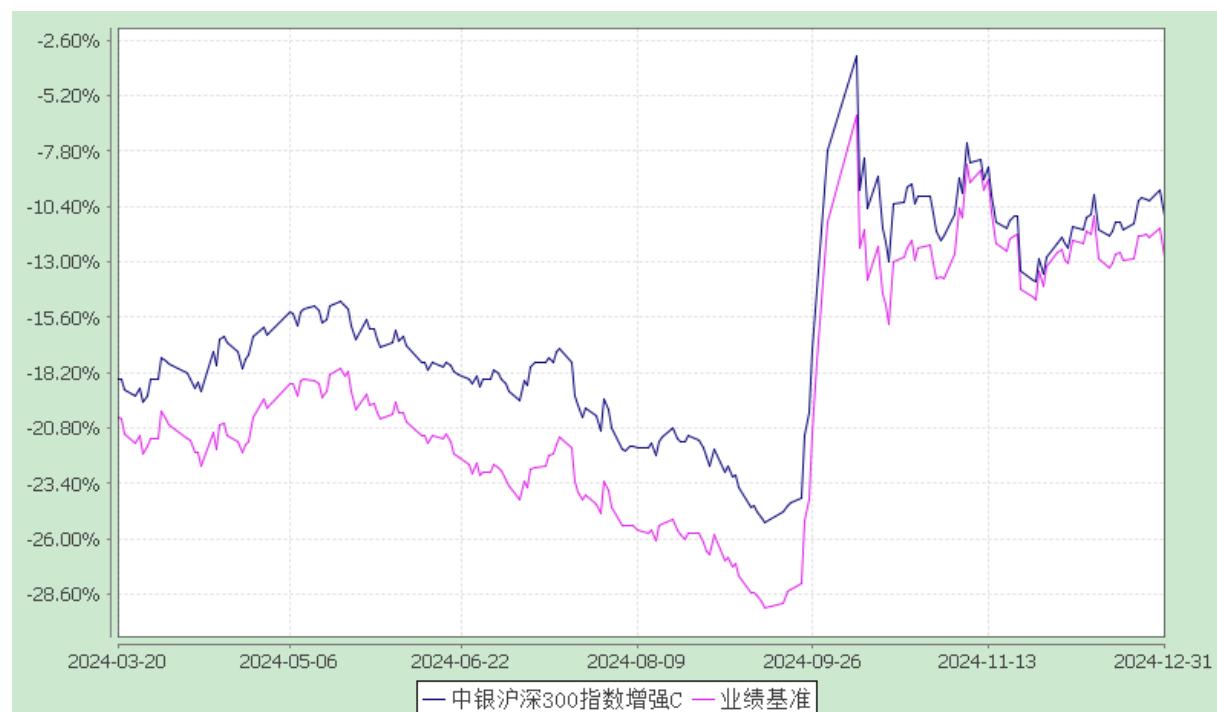
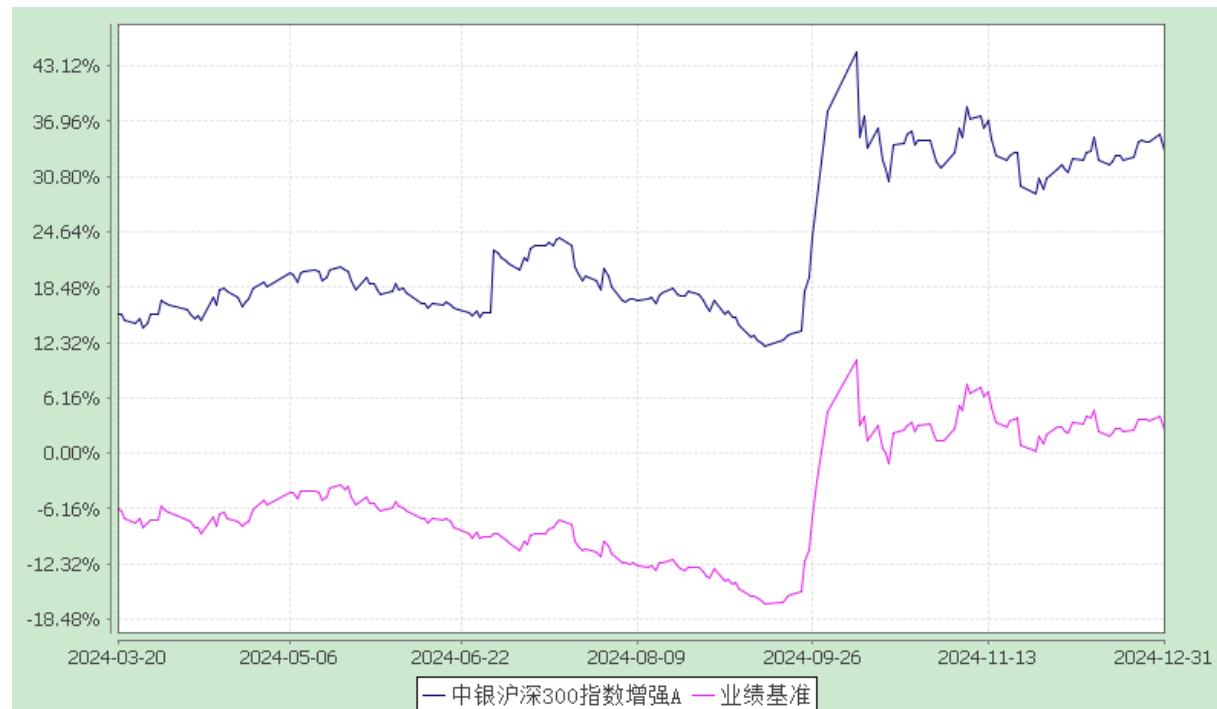
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-3.27%	1.55%	-1.92%	1.65%	-1.35%	-0.10%
自基金合同生效日起	8.40%	1.52%	12.84%	1.63%	-4.44%	-0.11%

### 3.1.2.2 自基金转型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

#### 中银沪深 300 指数增强型证券投资基金

自基金转型以来基金份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
(2024 年 3 月 20 日-2024 年 12 月 31 日)

中银沪深 300 指数增强 A



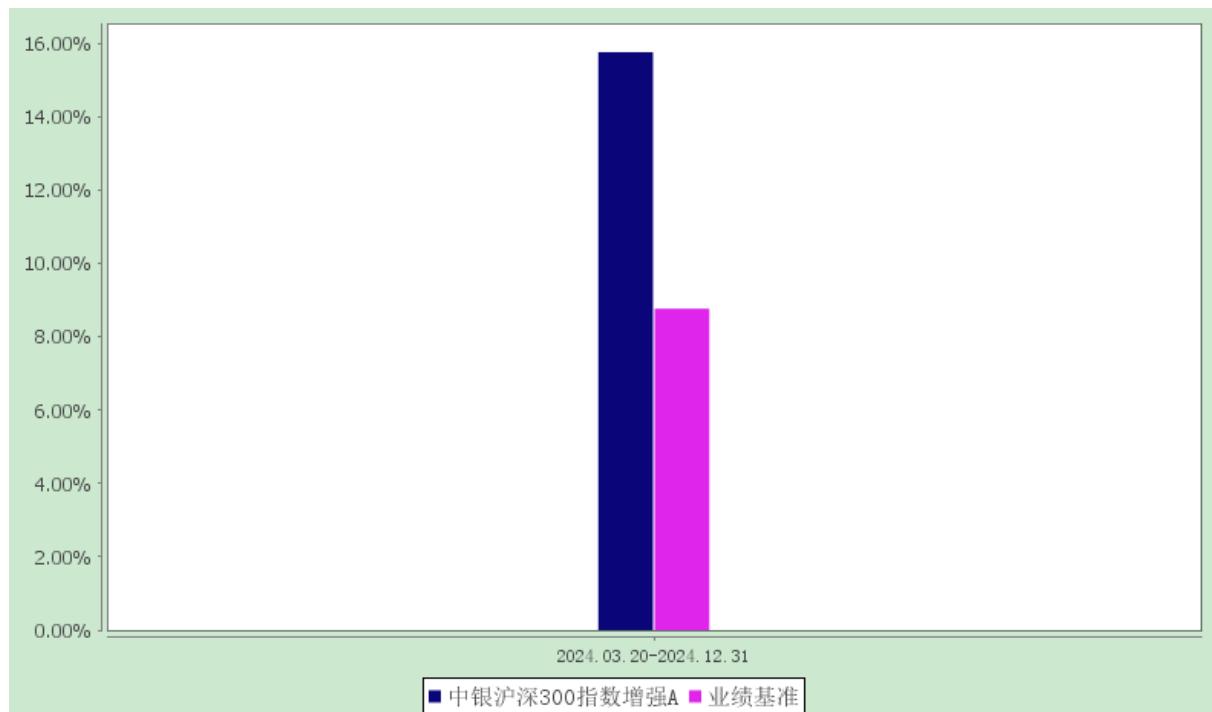


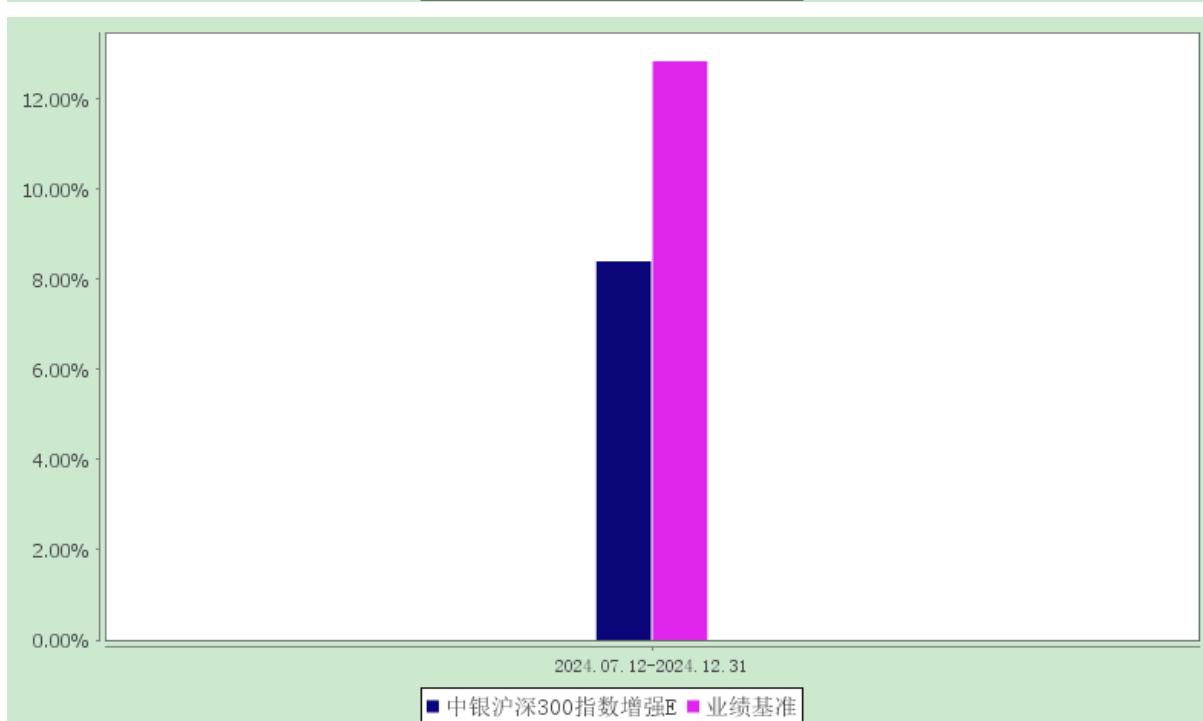
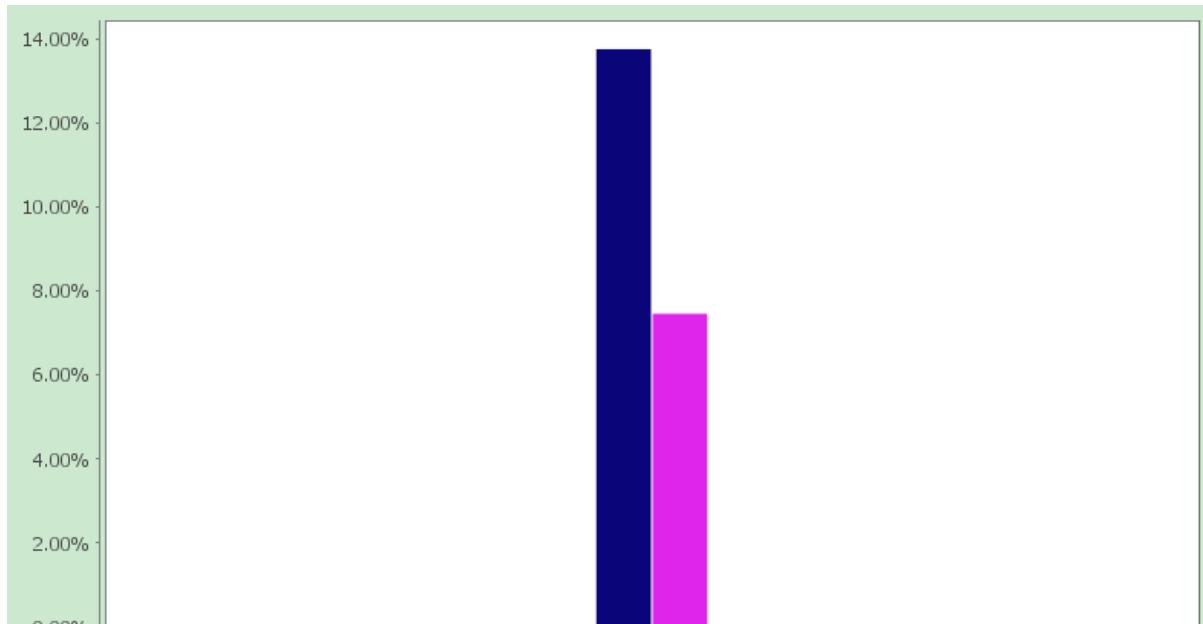
### 3.2.1.3 自基金转型以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中银沪深 300 指数增强型证券投资基金

自基金转型以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

中银沪深 300 指数增强 A





### 3.1.3 过去三年基金的利润分配情况

中银沪深 300 指数增强 A:

单位：人民币元

年度-	每10份基金份额分 红数	现金形式发放 总额	再投资形式发放 总额	年度利润分 配合计	备注
2024 年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

## 中银沪深 300 指数增强 C:

单位：人民币元

年度-	每10份基金份额分 红数	现金形式发放 总额	再投资形式发放 总额	年度利润分 配合计	备注
2024 年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

## 中银沪深 300 指数增强 E:

单位：人民币元

年度-	每10份基金份额分 红数	现金形式发放 总额	再投资形式发放 总额	年度利润分 配合计	备注
2024 年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

注：本基金自合同生效日（2024 年 3 月 20 日）至本报告期末无收益分配事项。

## 3.2 中银量化价值混合型证券投资基金

## 3.2.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.2.1.1 期 间数据和 指标	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 3 月 19 日		2023 年		2022 年	
	中银量化价值混 合 A	中银量化价值混 合 C	中银量化价值混 合 A	中银量化价值混 合 C	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	-2,573,476.40	-477,899.03	-12,737,569.62	-1,763,728.95	-45,277,739.36	-442,787.70
本期利 润	7,975,009.79	5,997,207.55	-12,283,189.55	-958,392.67	-58,226,013.51	-905,876.79
加权平 均基金 份额本 期利润	0.0455	0.0662	-0.0856	-0.0714	-0.3357	-0.6439
本期加 权平均 净值利 润率	4.52%	6.60%	-7.42%	-6.65%	-26.03%	-47.15%
本期基 金份额 净值增 长率	-4.99%	-5.38%	-7.12%	-7.49%	-21.67%	-21.99%
3.2.1.2 期 末数据和 指标	报告期末(2024 年 3 月 19 日)		2023 年末		2022 年末	
	中银量化价值混 合 A	中银量化价值混 合 C	中银量化价值混 合 A	中银量化价值混 合 C	中银量化价值混 合 A	中银量化价值混 合 C
期末可 供分配	8,648,111.66	4,020,946.38	1,432,158.98	-191,951.04	29,653,003.98	78,936.98

利润						
期末可供分配基金份额利润	0.0483	0.0334	0.0084	-0.0052	0.1890	0.1789
期末基金资产净值	188,092,115.88	124,742,778.41	172,198,332.33	36,666,105.05	186,539,383.33	520,073.25
期末基金份额净值	1.0512	1.0361	1.0084	0.9948	1.1890	1.1789
3.2.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 3 月 19 日)		2023 年末		2022 年末	
	中银量化价值混合 A	中银量化价值混合 C	中银量化价值混合 A	中银量化价值混合 C	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	15.12%	-18.77%	10.43%	-22.01%	18.90%	-15.69%

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）。

3.本基金于 2024 年 3 月 20 日转型为中银沪深 300 指数增强型证券投资基金。

### 3.2.2 基金净值表现

#### 3.2.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	6.54%	0.91%	6.24%	0.85%	0.30%	0.06%
过去六个月	-2.14%	0.77%	-2.61%	0.74%	0.47%	0.03%
过去一年	-4.99%	0.75%	-7.05%	0.71%	2.06%	0.04%
过去三年	-20.03%	0.97%	-22.15%	0.85%	2.12%	0.12%
过去五年	34.99%	1.08%	-2.71%	0.95%	37.70%	0.13%
自基金合同生效日起	15.12%	1.09%	-6.44%	0.98%	21.56%	0.11%

阶段	份额净值增长 率①	份额净值增 长率标准差 ②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	6.43%	0.91%	6.24%	0.85%	0.19%	0.06%
过去六个月	-2.33%	0.77%	-2.61%	0.74%	0.28%	0.03%
过去一年	-5.38%	0.75%	-7.05%	0.71%	1.67%	0.04%
过去三年	-21.00%	0.97%	-22.15%	0.85%	1.15%	0.12%
自基金合同生 效日起	-18.77%	1.02%	-20.42%	0.88%	1.65%	0.14%

3.2.1.2 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

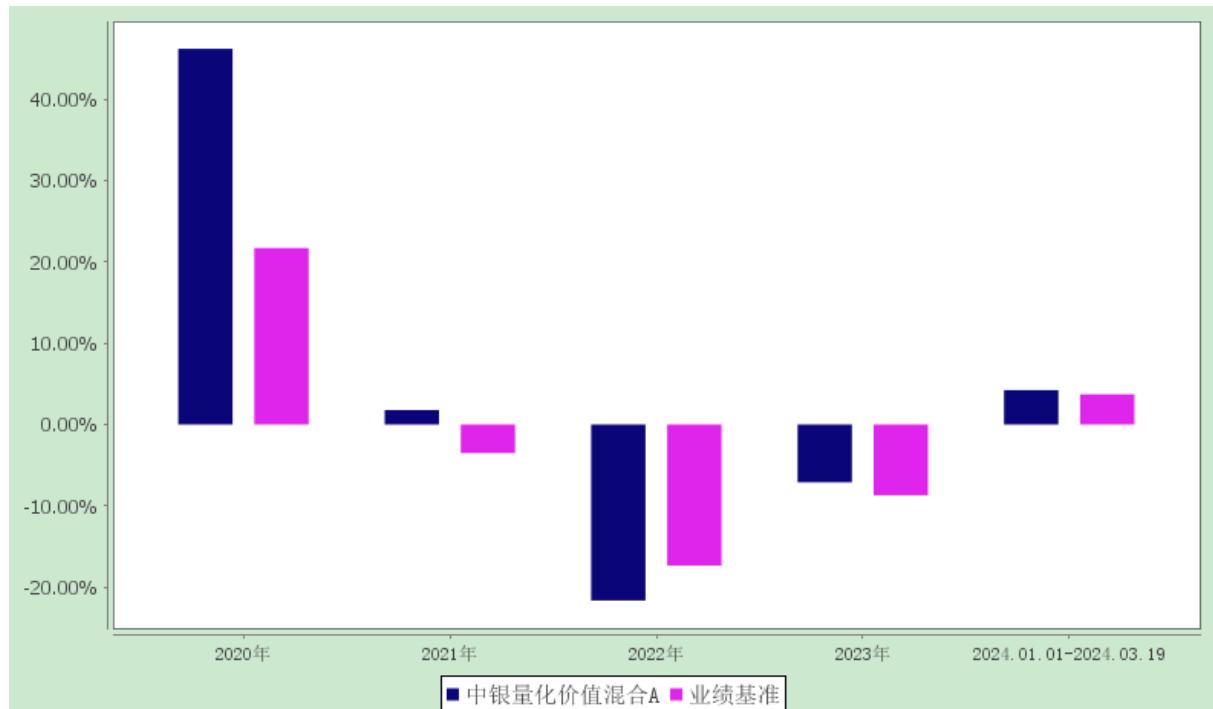
(2017年 11月 24 日至 2024 年 3月 19 日)

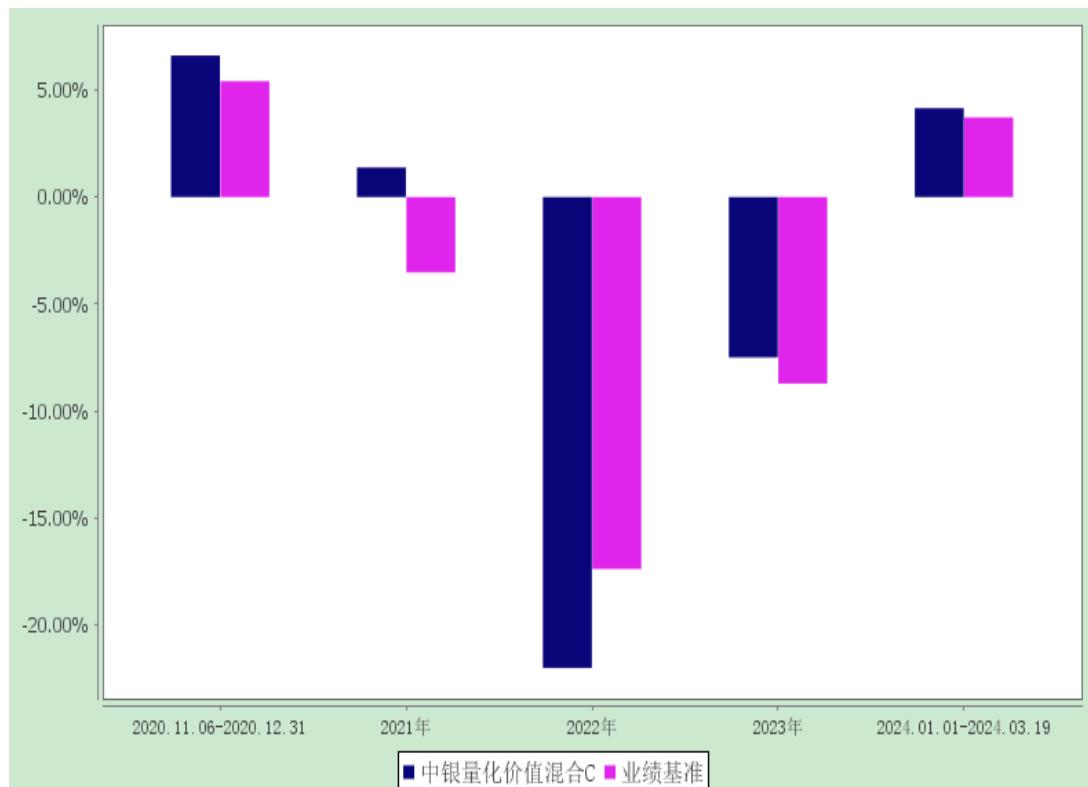




### 3.2.1.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图





### 3.2.3 过去三年基金的利润分配情况

中银量化价值混合 A:

单位: 人民币元

年度-	每10份基金份额分 红数	现金形式发放 总额	再投资形式发 放总额	年度利润分 配合计	备注
2024 年	-	-	-	-	-
2023 年	0.995	5,262,502.21	11,108,273.65	16,370,775.86	-
2022 年	-	-	-	-	-
合计	0.995	5,262,502.21	11,108,273.65	16,370,775.86	-

中银量化价值混合 C:

单位: 人民币元

年度-	每10份基金份额分 红数	现金形式发放 总额	再投资形式发 放总额	年度利润分 配合计	备注
2024 年	-	-	-	-	-
2023 年	0.995	4,639,970.67	32,773.43	4,672,744.10	-
2022 年	-	-	-	-	-
合计	0.995	4,639,970.67	32,773.43	4,672,744.10	-

## §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业的发展，努力成为国内领先的基金管理公司。

截至本报告期末，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

##### 4.1.2.1 中银沪深 300 指数增强型证券投资基金

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	-	19	中银基金管理有限公司高级助理副总裁（SAVP），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 月至今任中银沪深 300 基金（原中银量化价值基金）基金经理，2023 年 7 月至 2024 年 8 月任中银新回报基金（原中银保本二号）基金经理，2023 年 10 月至今任中银新财富基金基金经理，2023 年 11 月至今任中银 MSCI 中国 A50 基金基金经理，2023 年 12 月至 2025 年 3 月任中银中证 1000 基金基金经理，2023 年 12 月至 2025 年 1 月任中银中证 500 基金基金经理，2024 年 6 月至今任中银量化选股基金基金经理，2025 年 1 月至今任中银沪深 300 指数基金基金经理。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。

#### 4.1.2.2 中银量化价值混合型证券投资基金

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	-	19	中银基金管理有限公司高级助理总裁 (SAVP)，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 月至今任中银沪深 300 基金（原中银量化价值基金）基金经理，2023 年 7 月至 2024 年 8 月任中银新回报基金（原中银保本二号）基金经理，2023 年 10 月至今任中银新财富基金基金经理，2023 年 11 月至今任中银 MSCI 中国 A50 基金基金经理，2023 年 12 月至 2025 年 3 月任中银中证 1000 基金基金经理，2023 年 12 月至 2025 年 1 月任中银中证 500 基金基金经理，2024 年 6 月至今任中银量化选股基金基金经理，2025 年 1 月至今任中银沪深 300 指数基金基金经理。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遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、中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 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《中银基金管理有限公司公平交易管理办法》，建立了《新股询价申购和参与公开增发管理办法》、《债券询价申购管理办法》、《集中交易管理办法》等公平交易相关制度体系，通过制度确保不同投资组合在投资管理活动中得到公平对待，严格防范不同投资组合之间进行利益输送。公司建立了投资决策委员会领导下的投资决策及授权制度，以科学规范的投资决策体系，采用集中交易管理加强交易执行环节的内部控制，通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现；通过建立层级完备的公司证券池及组合风格库，完善各类具体资产管理业务组织结构，规范各项业务之间的关系，在保证各投资组合既具有相对独立性的同时，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；通过对异常交易行为的实时监控、分析评估、监察稽核和信息披露确保公平交易过程和结果的有效监督。

##### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期，在同向价差方面，公司对连续四个季度、不同时间窗口下（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合之间的同向交易的交易价差进行分析，在 95%置信水平下以及假设溢价率为 0，对同向交易价差进行 T 分布假设检验，结合该时间窗下组合互相之间的模拟输送金额、样本数量、溢价金额占比、平均溢价率、交易占优等指标综合判断是否存在不公平交易或利益输送的可能。分析结果显示本投资组合与公司管理的其他投资组合在同向交易价差方面未出现异常。

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。

##### 4.3.3 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

全球宏观方面，2024 年总需求增速整体放缓，总供给延续扩张，全球通胀压力缓解。全球财

政回归正常化，欧美经济体普遍步入降息周期。2024 年美国经济韧性仍存，通胀波动下行，美联储开启降息。欧元区经济全年温和复苏，区内经济增长分化，通胀水平震荡回落，欧央行全年降息 135bp。日本“工资-物价”现良性循环迹象，初步走出通缩，经济活力有所增强，日央行于 3 月退出负利率开启加息周期。

2024 年国内经济温和修复，全年实现 5% 的 GDP 增速目标。分部门来看，出口成为支撑 2024 年增长的重要因素；投资方面，地产投资负拖累仍存，而制造业投资表现强劲、广义基建投资同比增速亦有回升；消费动能回落。通胀方面，CPI 在消费需求疲软等因素带动下整体偏弱，PPI 同比全年仍处于负值区间，但跌幅较 2023 年收窄。货币政策定调转为“适度宽松”，财政政策定调“更加积极”。

## 2. 市场回顾

2024 年上证指数走势呈现出明显的先抑后扬态势。年初受微盘股大幅下跌，雪球产品敲入等因素影响上涨指数大幅下跌，指数一度跌破 2700 点，此后市场总体维持宽幅震荡。9 月 24 日金融三部委推出一揽子刺激政策，叠加中央政治局会议确立促进房地产止跌回稳等政策基调，上证指数在 9 月 24 日 - 10 月 8 日 6 个交易日反弹 26.95%，并在 10 月 8 日两市刷新历史成交额记录。2024 年全年上证指数上涨 12.67%，沪深 300 上涨 14.68%，中证 500 上涨 5.46%，中证 1000 上涨 1.2%，创业板指数上涨 13.23%，中证红利指数涨 12.31%。中信一级行业涨幅居前的分别为银行 42.84%，非银行金融 33.67%、家电 31.35%，涨幅靠后的分别为综合-19.07%，医药-12.83%，农林牧渔-9.55%，行业间分化非常明显。

## 3. 运行分析

本基金严格按照量化指数增强模型运作，较为严格的控制了行业和风格偏离，努力在控制风险的基础上追求超额收益。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

转型前（2024.1.1-2024.3.19）：

报告期内，本基金 A 类份额净值增长率为 4.24%，同期业绩比较基准收益率为 3.72%。

报告期内，本基金 C 类份额净值增长率为 4.15%，同期业绩比较基准收益率为 3.72%。

转型后（2024.3.20-2024.12.31）：

报告期内，本基金 A 类份额净值增长率为 15.77%，同期业绩比较基准收益率为 9.37%。

报告期内，本基金 C 类份额净值增长率为 13.76%，同期业绩比较基准收益率为 9.37%。

报告期内，本基金 E 类份额净值增长率为 8.40%，同期业绩比较基准收益率为 12.84%。

#### 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 2025 年，美国经济软着陆仍是基准情形，预计全年实际 GDP 增速在潜在增速附近，受政策扰动或出现阶段性恶化和改善的交替，极端情形下局部时点衰退风险可能放大。全年或“间歇式”降息，货币政策决策继续高度依赖当期经济数据和金融市场状况。欧洲经济延续区域分化和弱复苏，欧洲央行或加快降息步伐以助力增长。日本经济或延续小幅增长，但内外部不确定性增加；货币政策或继续小幅收紧，但节奏和幅度或偏谨慎。

2025 年在外部不确定性加剧的背景下，我国政策重心或将转向需求侧，国内政策有望加码对冲。预计政策组合拳有望推动消费增速回升；投资方面基建投资增速有望加快、制造业有望维持中高增速、地产投资拖累或趋于收敛；出口对经济的拉动或面临压力。我国预计将实施更加积极的财政政策和适度宽松的货币政策，经济增速有望平稳，平减指数有望转正。权益方面，我们认为 2025 年权益市场有望继续上行，但波动或将放大。盈利方面，财政与货币政策均延续宽松，在价格周期见底的支撑下，全 A 非金融盈利增速震荡上行，有望获得正增长。流动性方面，中美货币政策有望共振宽松，宏观流动性维持充裕，微观资金面有望维持增量资金环境，保险资金有望继续贡献增量，外资与居民储蓄的入市仍值得关注。风险偏好方面，特朗普上台加大经济的外部风险，但国内稳增长政策或进一步加码，中美政策博弈将是核心风险扰动因素。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人始终以防范风险、保护基金份额持有人利益为宗旨，不断完善内控机制，强化内部风险的控制与防范。公司风险管理部、内控与法律合规部与审计部按照制度，通过基金运作监控、稽核检查和内部审计等方法，独立地开展工作，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改。

本报告期内，本基金的监察稽核主要工作情况如下：

##### （1）深入开展审计检查，确保基金运作合规性

主要措施有：对基金运作涉及的投资、研究、交易、风险管理、信息资讯等业务环节开展独立检查，及时发现业务流程中存在的风险并督促整改，确保相关业务运作符合法律法规及公司制度的规定。

##### （2）修订内部管理制度，完善投资业务流程

根据监管机关的规定，定期更新公司内部投资管理制度，不断加强内部流程控制，动态作出各项合规提示，防范投资风险。

通过以上工作的开展，在本报告期内，基金运作整体合法合规。本基金管理人承诺将一如既往

地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，为基金份额持有人谋求最大利益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

##### 4.7.1 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。

##### 4.7.2 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。

##### 4.7.3 定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

#### 4.8 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 68,593,907.87 元，C 类基金份额可供分配利润为 41,235,395.13 元，E 类基金份额可供分配利润为 522,926.15 元。本基金本报告期未进行利润分配。

#### 4.9 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 托管人对本年度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年度报告中的财务指标、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 审计报告

### 6.1 中银沪深 300 指数增强型证券投资基金

容诚审字[2025]200Z0407 号

中银沪深 300 指数增强型证券投资基金全体基金份额持有人：

#### 6.1.1 审计意见

我们审计了中银沪深 300 指数增强型证券投资基金（以下简称“中银沪深 300 指数增强基金”）财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 年 3 月 20 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日止期间的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“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，公允反映了中银沪深 300 指数增强基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年 3 月 20 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

#### 6.1.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于中银沪深 300 指数增强基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

### 6.1.3 其他信息

中银沪深 300 指数增强基金的基金管理人中银基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括中银沪深 300 指数增强基金 2024 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

### 6.1.4 管理层和治理层对财务报表的责任

基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估中银沪深 300 指数增强基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算中银沪深 300 指数增强基金、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督中银沪深 300 指数增强基金的财务报告过程。

### 6.1.5 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性

发表意见。

(3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对中银沪深 300 指数增强基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致中银沪深 300 指数增强基金不能持续经营。

(5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

容诚会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

北京市西城区阜成门外大街 22 号 1 幢 10 层 1001-1 至 1001-26

2025 年 3 月 28 日

## 6.2 中银量化价值混合型证券投资基金

容诚审字[2025]200Z0415 号

中银量化价值混合型证券投资基金全体基金份额持有人：

### 6.2.1 审计意见

我们审计了中银量化价值混合型证券投资基金（以下简称“中银量化价值混合基金”）财务报表，包括 2024 年 3 月 19 日（基金合同失效前日）的资产负债表，2024 年 1 月 1 日至 2024 年 3 月 19 日（基金合同失效前日）止期间的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“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，公允反映了中银量化价值混合基金 2024 年 3 月 19 日（基金合同失效前日）的财务状况以及 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 3 月 19 日（基金合同失效前日）止期间的经营成果和净资产变动情况。

### 6.2.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，

我们独立于中银量化价值混合基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

#### 6.2.3 其他信息

中银量化价值混合基金的基金管理人中银基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括中银量化价值混合基金 2024 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

#### 6.2.4 管理层和治理层对财务报表的责任

基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估中银量化价值混合基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算中银量化价值混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督中银量化价值混合基金的财务报告过程。

#### 6.2.5 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未

能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对中银量化价值混合基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致中银量化价值混合基金不能持续经营。

(5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

容诚会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

北京市西城区阜成门外大街 22 号 1 幢 10 层 1001-1 至 1001-26

2025 年 3 月 28 日

## §7 年度财务报表

### 7.1 中银沪深 300 指数增强型证券投资基金

#### 7.1.1 资产负债表

会计主体：中银沪深 300 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2024年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
货币资金	7.1.4.7.1	144,778,997.59
结算备付金		10,444,079.25
存出保证金		394,422.52
交易性金融资产	7.1.4.7.2	789,589,613.49

其中：股票投资		789,589,613.49
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	7.1.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.1.4.7.4	-
应收清算款		-
应收股利		-
应收申购款		565,706.19
递延所得税资产		-
其他资产	7.1.4.7.5	-
资产总计		945,772,819.04
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.1.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		82,108,553.60
应付赎回款		14,218,969.68
应付管理人报酬		506,695.41
应付托管费		95,005.39
应付销售服务费		85,228.34
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	7.1.4.7.6	526,837.06
负债合计		97,541,289.48
<b>净资产：</b>		
实收基金	7.1.4.7.7	737,879,300.41
未分配利润	7.1.4.7.8	110,352,229.15
净资产合计		848,231,529.56
负债和净资产总计		945,772,819.04

注：1. 报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额总额 737,879,300.41 份，其中 A 类基金份额净值 1.1577 元，基金份额 434,898,479.84 份；C 类基金份额净值 1.1376 元，基金份额 299,617,534.98 份；E 类基金份额净值 1.1555 元，基金份额 3,363,285.59 份。

2. 该基金合同于 2024 年 3 月 20 日生效。

## 7.1.2 利润表

会计主体：中银沪深 300 指数增强型证券投资基金

本报告期：2024 年 3 月 20 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期
		2024年3月20日至2024年12月31日
<b>一、营业收入</b>		106,686,211.80
1.利息收入		279,897.12
其中：存款利息收入	7.1.4.7.9	279,897.12
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		80,340,304.87
其中：股票投资收益	7.1.4.7.10	66,046,925.40
基金投资收益		-
债券投资收益	7.1.4.7.11	55,000.53
资产支持证券投资收益	7.1.4.7.12	-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	7.1.4.7.13	60,374.83
股利收益	7.1.4.7.14	14,178,004.11
其他投资收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.1.4.7.15	25,416,258.29
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.1.4.7.16	649,751.52
<b>减：二、营业总支出</b>		5,471,363.88
1.管理人报酬	7.1.4.10.2	3,720,349.72
2.托管费	7.1.4.10.2	697,565.53
3.销售服务费		926,079.00
4.投资顾问费		-
5.利息支出		349.32
其中：卖出回购金融资产支出		349.32
6.信用减值损失		-
7.税金及附加		981.43
8.其他费用	7.1.4.7.17	126,038.88
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		101,214,847.92
<b>减：所得税费用</b>		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		101,214,847.92
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-
<b>六、综合收益总额</b>		101,214,847.92

## 7.1.3 净资产变动表

会计主体：中银沪深 300 指数增强型证券投资基金

本报告期：2024 年 3 月 20 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2024年3月20日至2024年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产			
二、本期期初净资产	299,329,771.22	13,505,123.07	312,834,894.29
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	438,549,529.19	96,847,106.08	535,396,635.27
(一)、综合收益总额	-	101,214,847.92	101,214,847.92
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	438,549,529.19	-4,367,741.84	434,181,787.35
其中：1.基金申购款	1,012,884,454.54	68,655,301.32	1,081,539,755.86
2.基金赎回款	-574,334,925.35	-73,023,043.16	647,357,968.51
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	737,879,300.41	110,352,229.15	848,231,529.56

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告从 7.1.1 至 7.1.4，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：宁瑞洁，会计机构负责人：乐妮

#### 7.1.4 报表附注

##### 7.1.4.1 基金基本情况

中银沪深 300 指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)系由原中银量化价值混合型证券投资基金(以下简称“原基金”)转型而来。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。原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。原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。

根据《中银量化价值混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效及决议生效后的基金转型安排的公告》，原中银量化价值混合型证券投资基金变更为中银沪深 300 指数增强型证券投资基金，修改后的《中银沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》自 2024 年 3 月 20 日起生效。

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，本基金增设 C 类基金份额。根据 2024 年 7 月 12 日发布的《中银基金管理有限公司关于中银沪深 300 指数增强型证券投资基金增加 E 类基金份额并修改基金合同的公告》以及更新的《中银沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》和《中银沪深 300 指数增强型证券投资基金托管协议》的有关规定，自 2024 年 7 月 12 日起，本基金增设 E 类基金份额。本基金根据申购费、赎回费、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、E 类基金份额。本基金 A 类基金份额、C 类基金份额和 E 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额、C 类基金份额和 E 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别基金份额总数。

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 2025 年 3 月 28 日批准。

#### 7.1.4.2 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》、《中银沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 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。

#### 7.1.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2024 年 3 月 20 日(基金合同生效日)至 2024 年 12 月 31 日止期间的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 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年 3 月 20 日(基金合同生效日)至 2024 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 7.1.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.1.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2024 年 3 月 20 日(基金合同生效日)至 2024 年 12 月 31 日。

##### 7.1.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.1.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

##### (1)金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

##### 债务工具

本基金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。

## (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。

### 7.1.4.4.4 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。

本基金考虑在资产负债表日无须付出不必要的额外成本和努力即可获得的有关过去事项、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。

#### 7.1.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的债券投资和资产支持证券投资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的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。

#### 7.1.4.4.6 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。

#### 7.1.4.4.7 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。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征

(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同); (4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征; (5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响); (2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余额。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

#### 7.1.4.4.8 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)。

#### 7.1.4.4.9 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。

本基金参与的转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司(以下简称“证金公司”)出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息，以及出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为当期损益。

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。

#### 7.1.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

#### 7.1.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的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净资产转出。

#### 7.1.4.4.12 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。

#### 7.1.4.4.13 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》及中国基金业协会中基协字[2022]566 号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于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。

#### 7.1.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.1.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 7.1.4.5.2 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。

##### 7.1.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内无须说明的会计差错更正。

#### 7.1.4.6 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[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，包括买卖债券的差价收入，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。

(4) 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比例计算缴纳。

#### 7.1.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.1.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2024 年 12 月 31 日
活期存款	144,778,997.59
等于：本金	144,771,840.09
加：应计利息	7,157.50
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	144,778,997.59

#### 7.1.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	756,357,744.83	-	789,589,613.49	33,231,868.66
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	756,357,744.83	-	789,589,613.49	33,231,868.66

#### 7.1.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.1.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.1.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.1.4.7.4.1 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。

#### 7.1.4.7.4.2 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。

#### 7.1.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

#### 7.1.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末
	2024年12月31日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	21.09
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	371,815.97
其中：交易所市场	371,815.97
银行间市场	-
应付利息	-
应付信息披露费	120,000.00
应付审计费	35,000.00
合计	526,837.06

#### 7.1.4.7.7 实收基金

##### 中银沪深 300 指数增强 A

金额单位：人民币元

项目	本期	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	178,937,583.46	178,937,583.46
本期申购	398,893,022.31	398,893,022.31
本期赎回（以“-”号填列）	-142,932,125.93	-142,932,125.93
本期末	434,898,479.84	434,898,479.84

##### 中银沪深 300 指数增强 C

金额单位：人民币元

项目	本期	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	120,392,187.76	120,392,187.76
本期申购	552,096,525.15	552,096,525.15
本期赎回（以“-”号填列）	-372,871,177.93	-372,871,177.93
本期末	299,617,534.98	299,617,534.98

##### 中银沪深 300 指数增强 E

金额单位：人民币元

项目	本期
	2024年3月20日至2024年12月31日

	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	-	-
本期申购	61,894,907.08	61,894,907.08
本期赎回(以“-”号填列)	-58,531,621.49	-58,531,621.49
本期末	3,363,285.59	3,363,285.59

## 7.1.4.7.8 未分配利润

中银沪深 300 指数增强 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
本期期初	8,648,111.66	506,420.76	9,154,532.42
本期利润	37,576,573.00	8,221,218.79	45,797,791.79
本期基金份额交易产生的变动数	32,001,531.50	-18,359,947.84	13,641,583.66
其中: 基金申购款	47,793,196.93	-13,018,126.09	34,775,070.84
基金赎回款	-15,791,665.43	-5,341,821.75	-21,133,487.18
本期已分配利润	-	-	-
本期末	78,226,216.16	-9,632,308.29	68,593,907.87

中银沪深 300 指数增强 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
本期期初	4,020,946.38	329,644.27	4,350,590.65
本期利润	36,585,760.64	16,484,180.89	53,069,941.53
本期基金份额交易产生的变动数	7,172,075.61	-23,357,212.66	-16,185,137.05
其中: 基金申购款	43,622,759.51	-14,688,128.85	28,934,630.66
基金赎回款	-36,450,683.90	-8,669,083.81	-45,119,767.71
本期已分配利润	-	-	-
本期末	47,778,782.63	-6,543,387.50	41,235,395.13

中银沪深 300 指数增强 E

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
本期期初	-	-	-
本期利润	1,636,255.99	710,858.61	2,347,114.60
本期基金份额交易产生的变动数	-1,038,872.13	-785,316.32	-1,824,188.45
其中: 基金申购款	4,917,608.80	27,991.02	4,945,599.82
基金赎回款	-5,956,480.93	-813,307.34	-6,769,788.27
本期已分配利润	-	-	-
本期末	597,383.86	-74,457.71	522,926.15

## 7.1.4.7.9 存款利息收入

单位: 人民币元

项目	本期
	2024 年 3 月 20 日至 2024 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	126,017.62
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	147,856.52
其他	6,022.98
合计	279,897.12

## 7.1.4.7.10 股票投资收益

## 7.1.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2024年3月20日至2024年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	66,046,925.40
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	66,046,925.40

## 7.1.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年3月20日至2024年12月31日
卖出股票成交总额	2,001,320,170.45
减：卖出股票成本总额	1,932,953,698.66
减：交易费用	2,319,546.39
买卖股票差价收入	66,046,925.40

## 7.1.4.7.11 债券投资收益

## 7.1.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2024年3月20日至2024年12月31日
债券投资收益——利息收入	5,727.53
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	49,273.00
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	55,000.53

## 7.1.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年3月20日至2024年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	18,294,989.69
减：卖出债券（债转股及债券到期兑	18,045,253.00

付) 成本总额	
减: 应计利息总额	200,463.69
减: 交易费用	-
买卖债券差价收入	49,273.00

## 7.1.4.7.12 资产支持证券投资收益

7.1.4.7.12.1 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。

## 7.1.4.7.13 衍生工具收益

单位: 人民币元

项目	本期
	2024年3月20日至2024年12月31日
股指期货投资收益	60,374.83

## 7.1.4.7.14 股利收益

单位: 人民币元

项目	本期
	2024年3月20日至2024年12月31日
股票投资产生的股利收益	14,178,004.11
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	14,178,004.11

## 7.1.4.7.15 公允价值变动收益

单位: 人民币元

项目名称	本期
	2024年3月20日至2024年12月31日
1.交易性金融资产	25,406,418.29
——股票投资	25,457,545.29
——债券投资	-51,127.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	9,840.00
——权证投资	-
——期货	9,840.00
4.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	25,416,258.29

## 7.1.4.7.16 其他收入

单位: 人民币元

项目	本期
	2024年3月20日至2024年12月31日

基金赎回费收入	643,561.93
基金转换费收入	6,189.59
合计	649,751.52

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类和E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类和E类基金份额将赎回费收入全额归入转出基金的基金资产。

#### 7.1.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024年3月20日至2024年12月31日
审计费用	27,445.23
信息披露费	94,098.27
证券出借违约金	-
银行汇划费	4,495.38
其他	-
合计	126,038.88

#### 7.1.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.1.4.8.1 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。

##### 7.1.4.8.2 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。

#### 7.1.4.9 关联方关系

##### 7.1.4.9.1 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
贝莱德投资管理（英国）有限公司	基金管理人的股东
中银资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司
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	基金管理人的控股股东、基金销售机构
中银国际证券股份有限公司	受中国银行重大影响
中银（新加坡）资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司

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。

##### 7.1.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

###### 7.1.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行交易。

## 7.1.4.10.2 关联方报酬

## 7.1.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2024年3月20日至2024年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	3,720,349.72
其中：支付销售机构的客户维护费	287,033.66
应支付基金管理人的净管理费	3,433,316.06

注：支付基金管理人的基金管理费按前一日基金资产净值 0.80% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

$$\text{日基金管理费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.80\% / \text{当年天数}$$

## 7.1.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2024年3月20日至2024年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	697,565.53

注：支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.15% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% / \text{当年天数}$$

## 7.1.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期			
	2024年3月20日至2024年12月31日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
中银沪深 300 指数增强 A	中银沪深 300 指数增强 C	中银沪深 300 指数增强 E	合计	
中国银行	-	15,636.67	-	15,636.67
中银基金管理有限公司	-	769,403.22	23,036.84	792,440.06
合计	-	785,039.89	23,036.84	808,076.73

注：基金销售服务费每日计提，按月支付。基金销售服务费可用于本基金的市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。本基金分为不同的类别，适用不同的销售服务费率。其中，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年费率为 0.40%；E 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%。本基金 C/E 类销售服务费按前一日 C/E 类基金资产净值及各自年费率分别计提，计算方法如下：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C/E 类的基金资产净值} \times \text{约定年费率} / \text{当年天数}。$$

#### 7.1.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

#### 7.1.4.10.4 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

##### 7.1.4.10.4.1 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。

##### 7.1.4.10.4.2 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。

#### 7.1.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.1.4.10.5.1 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内及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

##### 7.1.4.10.5.2 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内及上年度末均未投资本基金。

#### 7.1.4.10.6 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	
	2024年3月20日至2024年12月31日	当期利息收入
兴业银行股份有限公司	144,778,997.59	126,017.62

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。

#### 7.1.4.10.7 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。

#### 7.1.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 7.1.4.10.8.1 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。

#### 7.1.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 7.1.4.12 期末（2024 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.1.4.12.1 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

7.1.4.12.2 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限制期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注

688615	合合信息	2024-09-19	1-6个月(含)	新股锁定期内	55.18	165.78	289	15,947.02	47,910.42	-
301611	珂玛科技	2024-08-07	1-6个月(含)	新股锁定期内	8.00	56.10	804	6,432.00	45,104.40	-
688449	联芸科技	2024-11-20	1-6个月(含)	新股锁定期内	11.25	29.44	1,406	15,817.50	41,392.64	-
688605	先锋精科	2024-12-04	1-6个月(含)	新股锁定期内	11.29	53.68	744	8,399.76	39,937.92	-
688708	佳驰科技	2024-11-27	1-6个月(含)	新股锁定期内	27.08	48.95	780	21,122.40	38,181.00	-
688726	拉普拉斯	2024-10-22	1-6个月(含)	新股锁定期内	17.58	33.06	979	17,210.82	32,365.74	-
001391	国货航	2024-12-23	1-6个月(含)	新股锁定期内	2.30	6.80	4,686	10,777.80	31,864.80	-
301551	无线传媒	2024-09-19	1-6个月(含)	新股锁定期内	9.40	43.23	652	6,128.80	28,185.96	-
603072	天和磁材	2024-12-24	1-6个月(含)	新股锁定期内	12.30	12.30	226	2,779.80	2,779.80	-
603072	天和磁材	2024-12-24	1个月内(含)	新股未上市	12.30	12.30	2,029	24,956.70	24,956.70	-
688750	金天钛业	2024-11-12	1-6个月(含)	新股锁定期内	7.16	15.44	1,685	12,064.60	26,016.40	-
301522	上大股份	2024-10-09	1-6个月(含)	新股锁定期内	6.88	24.84	816	5,614.08	20,269.44	-
688721	龙图光罩	2024-07-30	1-6个月(含)	新股锁定期内	18.50	56.85	279	5,161.50	15,861.15	-
301556	托普云农	2024-10-10	1-6个月(含)	新股锁定期内	14.50	59.05	267	3,871.50	15,766.35	-
301631	壹连科技	2024-11-12	1-6个月(含)	新股锁定期内	72.99	101.96	153	11,167.47	15,599.88	-
301606	绿联科技	2024-07-17	1-6个月(含)	新股锁定期内	21.21	36.49	396	8,399.16	14,450.04	-
301571	国科天成	2024-08-14	1-6个月(含)	新股锁定期内	11.14	40.83	350	3,899.00	14,290.50	-

301622	英思特	2024-11-26	1-6 个月(含)	新股锁定期内	22.36	44.92	306	6,842.16	13,745.52	-
301608	博实结	2024-07-25	1-6 个月(含)	新股锁定期内	44.50	65.38	184	8,188.00	12,029.92	-
301613	新铝时代	2024-10-18	1-6 个月(含)	新股锁定期内	27.70	41.77	276	7,645.20	11,528.52	-
688710	益诺思	2024-08-27	1-6 个月(含)	新股锁定期内	19.06	33.58	332	6,327.92	11,148.56	-
301617	博苑股份	2024-12-03	1-6 个月(含)	新股锁定期内	27.76	39.79	253	7,023.28	10,066.87	-
301603	乔锋智能	2024-07-03	1-6 个月(含)	新股锁定期内	26.50	41.98	233	6,174.50	9,781.34	-
301607	富特科技	2024-08-28	1-6 个月(含)	新股锁定期内	14.00	36.14	257	3,598.00	9,287.98	-
603194	中力股份	2024-12-17	1-6 个月(含)	新股锁定期内	20.32	28.13	291	5,913.12	8,185.83	-
301552	科力装备	2024-07-15	1-6 个月(含)	新股锁定期内	30.00	56.87	143	4,290.00	8,132.41	-
301585	蓝宇股份	2024-12-10	1-6 个月(含)	新股锁定期内	23.95	35.85	210	5,029.50	7,528.50	-
001279	强邦新材	2024-09-27	1-6 个月(含)	新股锁定期内	9.68	27.91	265	2,565.20	7,396.15	-
603395	红四方	2024-11-19	1-6 个月(含)	新股锁定期内	7.98	35.77	154	1,228.92	5,508.58	-
603207	小方制药	2024-08-19	1-6 个月(含)	新股锁定期内	12.47	26.65	185	2,306.95	4,930.25	-
603310	巍华新材	2024-08-07	1-6 个月(含)	新股锁定期内	17.39	17.95	254	4,417.06	4,559.30	-
603091	众鑫股份	2024-09-10	1-6 个月(含)	新股锁定期内	26.50	44.43	94	2,491.00	4,176.42	-
603350	安乃达	2024-06-26	1-6 个月(含)	新股锁定期内	20.56	36.17	106	2,179.36	3,834.02	-
603205	健尔康	2024-10-29	1-6 个月(含)	新股锁定期内	14.65	27.35	128	1,875.20	3,500.80	-

603285	键邦股份	2024-06-28	1-6 个月(含)	新股锁定期内	18.65	22.61	129	2,405.85	2,916.69	-
--------	------	------------	-----------	--------	-------	-------	-----	----------	----------	---

#### 7.1.4.12.3 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002252	上海莱士	2024-12-23	重大事项停牌	7.22	2025-01-07	6.93	108,300	814,291.67	781,926.00	-

#### 7.1.4.12.4 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.1.4.12.4.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 12 月 31 日止，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。

##### 7.1.4.12.4.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 12 月 31 日止，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。

#### 7.1.4.12.5 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。

#### 7.1.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.1.4.13.1 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。

#### 7.1.4.13.2 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。

#### 7.1.4.13.3 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。

##### 7.1.4.13.3.1 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。

除本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节中所列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，本基金本报告期末的其他资产均能及时变现。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约约定到期日均为六个月以内且不计息，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。

#### 7.1.4.13.4 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。

##### 7.1.4.13.4.1 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。

###### 7.1.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年12月31 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	144,778,997.59	-	-	-	144,778,997.59
结算备付金	10,444,079.25	-	-	-	10,444,079.25
存出保证金	394,422.52	-	-	-	394,422.52
交易性金融资产	-	-	-	789,589,613.49	789,589,613.49
应收申购款	-	-	-	565,706.19	565,706.19
资产总计	155,617,499.36	-	-	790,155,319.68	945,772,819.04
负债					
应付证券清算款	-	-	-	82,108,553.60	82,108,553.60
应付赎回款	-	-	-	14,218,969.68	14,218,969.68
应付管理人报酬	-	-	-	506,695.41	506,695.41
应付托管费	-	-	-	95,005.39	95,005.39
应付销售服务费	-	-	-	85,228.34	85,228.34
其他负债	-	-	-	526,837.06	526,837.06
负债总计	-	-	-	97,541,289.48	97,541,289.48
利率敏感度缺口	155,617,499.36	-	-	692,614,030.20	848,231,529.56

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。

##### 7.1.4.13.4.2 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）。

#### 7.1.4.13.4.3 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。

#### 7.1.4.13.4.4 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。

##### 7.1.4.13.4.4.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	789,589,613.49	93.09
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-
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	789,589,613.49	93.09

##### 7.1.4.13.4.5 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 2024 年 12 月 31 日
	1. 业绩比较基准上升 5%	3,970
	2. 业绩比较基准下降 5%	-3,970

#### 7.1.4.14 公允价值

##### 7.1.4.14.1 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。

#### 7.1.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 7.1.4.14.2.1 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 2024年12月31日	
第一层次		788,214,496.69
第二层次		809,662.50
第三层次		565,454.30
合计		789,589,613.49

##### 7.1.4.14.2.2 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。

对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，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投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

##### 7.1.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

###### 7.1.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2024年3月20日至2024年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	157,196.66	157,196.66
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	232,514.63	232,514.63
转出第三层次	-	146,658.52	146,658.52
当期利得或损失总额	-	322,401.53	322,401.53
其中：计入损益的利得或损失	-	322,401.53	322,401.53
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	565,454.30	565,454.30
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	332,939.67	332,939.67

#### 7.1.4.14.2.4 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股票投资	565,454.30	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	0.3423-5.7444	负相关

#### 7.1.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 7.1.4.14.4 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。

#### 7.1.4.15 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。

### 7.2 中银量化价值混合型证券投资基金

#### 7.2.1 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：2024 年 3 月 19 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 3 月 19 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.2.4.7.1	4,879,877.36	2,164,226.20
结算备付金		7,588,462.72	3,493,004.62
存出保证金		1,888,119.90	75,794.64
交易性金融资产	7.2.4.7.2	300,027,488.14	203,635,636.98
其中：股票投资		281,736,371.98	191,974,935.61
基金投资		-	-
债券投资		18,291,116.16	11,660,701.37
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.2.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.2.4.7.4	-	-
应收清算款		4,024,347.69	40,802.65
应收股利		-	-
应收申购款		-	44,966.37
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.2.4.7.5	-	-

<b>资产总计</b>		318,408,295.81	209,454,431.46
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年3月19日</b>	<b>上年度末 2023年12月31日</b>
<b>负债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.2.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		5,042,587.32	1,181.44
应付管理人报酬		199,264.10	202,293.86
应付托管费		33,210.67	33,715.64
应付销售服务费		27,427.41	9,310.61
应付投资顾问费		-	-
应交税费		8,229.39	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.2.4.7.6	262,682.63	343,492.53
负债合计		5,573,401.52	589,994.08
<b>净资产:</b>			
实收基金	7.2.4.7.7	299,329,771.22	207,624,229.44
未分配利润	7.2.4.7.8	13,505,123.07	1,240,207.94
净资产合计		312,834,894.29	208,864,437.38
<b>负债和净资产总计</b>		<b>318,408,295.81</b>	<b>209,454,431.46</b>

注：1. 报告截止日 2024 年 3 月 19 日，基金份额总额 299,329,771.22 份，其中 A 类基金份额净值 1.0512 元，基金份额 178,937,583.46 份；C 类基金份额净值 1.0361 元，基金份额 120,392,187.76 份。

2. 自 2024 年 3 月 20 日起，原《中银量化价值混合型证券投资基金合同》失效，《中银沪深 300 指数增强型证券投资基金合同》生效。

## 7.2.2 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 3 月 19 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年1月1日至 2024年3月19日	上年度可比期间 2023年1月1日至 2023年12月31日
<b>一、营业收入</b>		14,952,924.63	-10,188,276.59
1.利息收入		33,992.39	64,310.33
其中：存款利息收入	7.2.4.7.9	33,992.39	64,310.33
债券利息收入		-	-
资产支持证券投资利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-2,180,119.88	-11,890,458.44

其中：股票投资收益	7.2.4.7.10	-3,255,857.68	-15,205,285.00
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.2.4.7.11	52,691.50	213,421.12
资产支持证券投资收益	7.2.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.2.4.7.13	1,039,429.99	-297,403.94
股利收益	7.2.4.7.14	-16,383.69	3,398,809.38
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.2.4.7.15	17,023,592.77	1,259,716.35
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.2.4.7.16	75,459.35	378,155.17
<b>减：二、营业总支出</b>		980,707.29	3,053,305.63
1.管理人报酬	7.2.4.10.2	700,629.38	2,437,648.02
2.托管费	7.2.4.10.2	116,771.56	406,274.60
3.销售服务费		80,726.40	57,175.92
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	7.22
其中：卖出回购金融资产支出		-	7.22
6.信用减值损失		-	-
7.税金及附加		3,751.69	-
8.其他费用	7.2.4.7.17	78,828.26	152,199.87
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		13,972,217.34	-13,241,582.22
<b>减：所得税费用</b>		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		13,972,217.34	-13,241,582.22
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		13,972,217.34	-13,241,582.22

## 7.2.3 净资产变动表

会计主体：中银量化价值混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 3 月 19 日

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年3月19日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	207,624,229.44	1,240,207.94	208,864,437.38
二、本期期初净资产	207,624,229.44	1,240,207.94	208,864,437.38
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	91,705,541.78	12,264,915.13	103,970,456.91
(一)、综合收益总额	-	13,972,217.34	13,972,217.34
(二)、本期基	91,705,541.78	-1,707,302.21	89,998,239.57

基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)			
其中：1.基金申购款	119,405,484.47	-1,536,181.01	117,869,303.46
2.基金赎回款	-27,699,942.69	-171,121.20	-27,871,063.89
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	299,329,771.22	13,505,123.07	312,834,894.29
项目	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	157,327,515.62	29,731,940.96	187,059,456.58
二、本期期初净资产	157,327,515.62	29,731,940.96	187,059,456.58
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	50,296,713.82	-28,491,733.02	21,804,980.80
(一)、综合收益总额	-	-13,241,582.22	-13,241,582.22
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	50,296,713.82	5,793,369.16	56,090,082.98
其中：1.基金申购款	158,335,152.72	18,262,838.00	176,597,990.72
2.基金赎回款	-108,038,438.90	-12,469,468.84	-120,507,907.74
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-21,043,519.96	-21,043,519.96
四、本期期末净资产	207,624,229.44	1,240,207.94	208,864,437.38

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.2.1 至 7.2.4，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：宁瑞洁，会计机构负责人：乐妮

## 7.2.4 报表附注

### 7.2.4.1 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，本基金增设 C 类基金份额。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。

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 2025 年 3 月 28 日批准。

### 7.2.4.2 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《证券投资基金管理信息披露 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 7.4.4 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。

根据基金管理人中银基金管理有限公司于 2024 年 3 月 13 日发布的《中银量化价值混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效及决议生效后的基金转型安排的公告》，本基金自 2024 年 3 月 20 日起变更为中银沪深 300 指数增强型证券投资基金，存续期限不定，因此本基金财务报表仍以持续经营为基础编制。

#### 7.2.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 3 月 19 日(基金合同失效前日)止期间的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 2024 年 3 月 19 日的财务状况以及 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 3 月 19 日(基金合同失效前日)止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 7.2.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.2.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 3 月 19 日(基金合同失效前日)。

##### 7.2.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.2.4.4.3 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，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。

#### 7.2.4.4.4 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。

#### 7.2.4.4.5 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目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。

#### 7.2.4.4.6 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。

#### 7.2.4.4.7 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。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩且回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

#### 7.2.4.4.8 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)。

#### 7.2.4.4.9 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。

#### 7.2.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

#### 7.2.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的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净资产转出。

#### 7.2.4.4.12 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。

#### 7.2.4.4.13 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》及中国基金业协会中基协字[2022]566 号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于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。

#### 7.2.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.2.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期末发生会计政策变更。

##### 7.2.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

##### 7.2.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内无须说明的会计差错更正。

#### 7.2.4.6 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[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[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。

对基金通过沪港通或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。基金通过沪港通或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。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。基金通过沪港通或深港通买卖、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。

#### 7.2.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.2.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年3月19日	上年度末 2023年12月31日
活期存款	4,879,877.36	2,164,226.20
等于：本金	4,867,498.01	2,163,498.25
加：应计利息	12,379.35	727.95
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	4,879,877.36	2,164,226.20

##### 7.2.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年3月19日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动

股票	273,962,048.61	-	281,736,371.98	7,774,323.37
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	18,045,253.00	194,736.16	18,291,116.16
	银行间市场	-	-	-
	合计	18,045,253.00	194,736.16	18,291,116.16
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	292,007,301.61	194,736.16	300,027,488.14	7,825,450.37
项目	上年度末 2023年12月31日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	201,210,602.01	-	191,974,935.61	-9,235,666.40
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	11,549,116.00	83,901.37	11,660,701.37
	银行间市场	-	-	-
	合计	11,549,116.00	83,901.37	11,660,701.37
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	212,759,718.01	83,901.37	203,635,636.98	-9,207,982.40

#### 7.2.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.2.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末			
	2024年3月19日			备注
	合同/名义金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	12,916,560.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	12,916,560.00	-	-	-

##### 7.2.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量 (买/ 卖)	合约市值	公允价值变动	
IF2404	IF2404	12.00	12,906,720.00		-9,840.00
合计	-	-	-		-9,840.00
减： 可抵销期货暂收款	-	-	-		-9,840.00
净额	-	-	-		0.00

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

#### 7.2.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.2.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

##### 7.2.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.2.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

#### 7.2.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年3月19日	上年度末	
		2023年12月31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	199,226.13	193,492.53	
其中：交易所市场	199,226.13	193,492.53	
银行间市场	-	-	-
应付利息	-	-	-
应付信息披露费	25,901.73	120,000.00	
应付审计费	37,554.77	30,000.00	
合计	262,682.63	343,492.53	

#### 7.2.4.7.7 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 2024年1月1日至2024年3月19日

	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	170,766,173.35	170,766,173.35
本期申购	8,683,718.60	8,683,718.60
本期赎回(以“-”号填列)	-512,308.49	-512,308.49
本期末	178,937,583.46	178,937,583.46

中银量化价值混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年3月19日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	36,858,056.09	36,858,056.09
本期申购	110,721,765.87	110,721,765.87
本期赎回(以“-”号填列)	-27,187,634.20	-27,187,634.20
本期末	120,392,187.76	120,392,187.76

7.2.4.7.8 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	10,795,447.30	-9,363,288.32	1,432,158.98
本期期初	10,795,447.30	-9,363,288.32	1,432,158.98
本期利润	-2,573,476.40	10,548,486.19	7,975,009.79
本期基金份额交易产生的变动数	426,140.76	-678,777.11	-252,636.35
其中：基金申购款	449,906.81	-690,979.56	-241,072.75
基金赎回款	-23,766.05	12,202.45	-11,563.60
本期已分配利润	-	-	-
本期末	8,648,111.66	506,420.76	9,154,532.42

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	1,802,492.57	-1,994,443.61	-191,951.04
本期期初	1,802,492.57	-1,994,443.61	-191,951.04
本期利润	-477,899.03	6,475,106.58	5,997,207.55
本期基金份额交易产生的变动数	2,696,352.84	-4,151,018.70	-1,454,665.86
其中：基金申购款	3,616,598.31	-4,911,706.57	-1,295,108.26
基金赎回款	-920,245.47	760,687.87	-159,557.60
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,020,946.38	329,644.27	4,350,590.65

7.2.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年3月19日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日

活期存款利息收入	11,651.40	22,253.55
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	22,068.67	41,048.10
其他	272.32	1,008.68
合计	33,992.39	64,310.33

#### 7.2.4.7.10 股票投资收益

##### 7.2.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年3月19日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-3,255,857.68	-15,205,285.00
股票投资收益——赎回差价收入	-	-
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	-3,255,857.68	-15,205,285.00

##### 7.2.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年3月19日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
卖出股票成交总额	187,405,411.11	750,845,134.25
减： 卖出股票成本总额	190,339,484.69	764,671,045.20
减： 交易费用	321,784.10	1,379,374.05
买卖股票差价收入	-3,255,857.68	-15,205,285.00

#### 7.2.4.7.11 债券投资收益

##### 7.2.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年3月19日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
债券投资收益——利息收入	52,691.50	166,246.62
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-	47,174.50
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	52,691.50	213,421.12

## 7.2.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年3月 19日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	-	17,546,851.85
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	-	17,275,001.79
减：应计利息总额	-	224,673.93
减：交易费用	-	1.63
买卖债券差价收入	-	47,174.50

## 7.2.4.7.12 资产支持证券投资收益

## 7.2.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

## 7.2.4.7.13 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年3月19日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
股指期货投资收益	1,039,429.99	-297,403.94

## 7.2.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年3月 19日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31 日
股票投资产生的股利收益	-16,383.69	3,398,809.38
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	-16,383.69	3,398,809.38

## 7.2.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年3月19日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31 日
1.交易性金融资产	17,033,432.77	1,259,716.35
——股票投资	17,009,989.77	1,247,782.35
——债券投资	23,443.00	11,934.00
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-

——其他	-	-
2.衍生工具	-9,840.00	-
——权证投资	-	-
——期货	-9,840.00	-
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	17,023,592.77	1,259,716.35

#### 7.2.4.7.16 其他收入

单位: 人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年3月19日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
基金赎回费收入	73,304.72	378,107.64
基金转换费收入	2,154.63	47.53
合计	75,459.35	378,155.17

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。

#### 7.2.4.7.17 其他费用

单位: 人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年3月19日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
审计费用	7,554.77	30,000.00
信息披露费	25,901.73	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费	371.76	2,199.87
其他	45,000.00	-
合计	78,828.26	152,199.87

#### 7.2.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.2.4.8.1 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。

##### 7.2.4.8.2 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。

#### 7.2.4.9 关联方关系

#### 7.2.4.9.1 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
贝莱德投资管理(英国)有限公司	基金管理人的股东
中银资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司
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	基金管理人的控股股东、基金销售机构
中银国际证券股份有限公司	受中国银行重大影响
中银(新加坡)资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司

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。

#### 7.2.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.2.4.10.1 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。

##### 7.2.4.10.2 关联方报酬

###### 7.2.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年3月 19日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月 31日
当期发生的基金应支付的管理费	700,629.38	2,437,648.02
其中：支付销售机构的客户维护费	28,989.94	120,381.15
应支付基金管理人的净管理费	671,639.44	2,317,266.87

注：支付基金管理人的基金管理费按前一日基金资产净值 1.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

$$\text{日基金管理费} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.20\% / \text{当年天数}$$

###### 7.2.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年3月 19日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月 31日
当期发生的基金应支付的托管费	116,771.56	406,274.60

注：支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

###### 7.2.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各 关联方名称	本期		
	2024年1月1日至2024年3月19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	-	123.81	123.81
中银基金管理有限公 司	-	69,201.99	69,201.99
合计	-	69,325.80	69,325.80
获得销售服务费的各 关联方名称	上年度可比期间		
	2023年1月1日至2023年12月31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	-	446.91	446.91
中银基金管理有限公 司	-	23,630.62	23,630.62
合计	-	24,077.53	24,077.53

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给中银基金，再由中银基金计算并支付给各基金销售机构。A 类基金份额不收取销售服务费。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金资产净值} \times 0.40\% / \text{当年天数}。$$

#### 7.2.4.10.3 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债券（含回购）交易。

#### 7.2.4.10.4 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

##### 7.2.4.10.4.1 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。

##### 7.2.4.10.4.2 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。

#### 7.2.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.2.4.10.5.1 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内及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

##### 7.2.4.10.5.2 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。

#### 7.2.4.10.6 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 3 月 19 日			上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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	4,879,877.36	11,651.40	2,164,226.20	22,253.55		

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。

#### 7.2.4.10.7 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。

#### 7.2.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 7.2.4.10.8.1 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。

#### 7.2.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 7.2.4.12 期末（2024 年 3 月 19 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.2.4.12.1 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

7.2.4.12.1.1 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
301538	骏鼎达	2024-03-13	1个月内(含)	新股未上市	55.82	55.82	959	53,531.38	53,531.38	-
603344	星德胜	2024-03-13	1个月内(含)	新股未上市	19.18	19.18	1,788	34,293.84	34,293.84	-
001359	平安电工	2024-03-19	1个月内(含)	新股未上市	17.39	17.39	1,833	31,875.87	31,875.87	-
301516	中远通	2023-12-01	1-6个月(含)	新股锁定期内	6.87	20.56	598	4,108.26	12,294.88	-
301508	中机认检	2023-11-23	1-6个月(含)	新股锁定期内	16.82	34.22	291	4,894.62	9,958.02	-
688709	成都华微	2024-01-31	1-6个月(含)	新股锁定期内	15.69	21.45	422	6,621.18	9,051.90	-
301413	安培龙	2023-12-11	1-6个月(含)	新股锁定期内	33.25	58.65	152	5,054.00	8,914.80	-
688652	京仪	2023-	1-6个	新股	31.95	45.43	164	5,239.80	7,450.52	-

	装备	11-22	月 (含)	锁定 期内						
301555	惠柏 新材	2023- 10-24	1-6 个 月 (含)	新股 锁定 期内	22.88	32.32	224	5,125.12	7,239.68	-
688648	中邮 科技	2023- 11-06	1-6 个 月 (含)	新股 锁定 期内	15.18	23.08	303	4,599.54	6,993.24	-
688653	康希 通信	2023- 11-10	1-6 个 月 (含)	新股 锁定 期内	10.50	13.78	498	5,229.00	6,862.44	-
301568	思泰 克	2023- 11-21	1-6 个 月 (含)	新股 锁定 期内	23.23	40.64	168	3,902.64	6,827.52	-
688695	中创 股份	2024- 03-06	1-6 个 月 (含)	新股 锁定 期内	22.43	36.54	186	4,171.98	6,796.44	-
301459	丰茂 股份	2023- 12-06	1-6 个 月 (含)	新股 锁定 期内	31.90	40.78	163	5,199.70	6,647.14	-
688720	艾森 股份	2023- 11-29	1-6 个 月 (含)	新股 锁定 期内	28.03	40.01	157	4,400.71	6,281.57	-
301538	骏鼎 达	2024- 03-13	1-6 个 月 (含)	新股 锁定 期内	55.82	55.82	107	5,972.74	5,972.74	-
603341	龙旗 科技	2024- 02-23	1-6 个 月 (含)	新股 锁定 期内	26.00	42.46	135	3,510.00	5,732.10	-
688716	中研 股份	2023- 09-13	1-6 个 月 (含)	新股 锁定 期内	29.66	31.96	158	4,686.28	5,049.68	-
688719	爱科 赛博	2023- 09-20	1-6 个 月 (含)	新股 锁定 期内	69.98	55.13	91	6,368.18	5,016.83	-
001378	德冠 新材	2023- 10-23	1-6 个 月 (含)	新股 锁定 期内	31.68	28.95	134	4,245.12	3,879.30	-
688657	浩辰 软件	2023- 09-25	1-6 个 月 (含)	新股 锁定 期内	103.40	67.24	55	5,687.00	3,698.20	-
601033	永兴 股份	2024- 01-11	1-6 个 月 (含)	新股 锁定 期内	16.20	13.40	266	4,309.20	3,564.40	-
603082	北自 科技	2024- 01-23	1-6 个 月 (含)	新股 锁定 期内	21.28	32.21	101	2,149.28	3,253.21	-
601083	锦江 航运	2023- 11-28	1-6 个 月 (含)	新股 锁定 期内	11.25	9.65	331	3,723.75	3,194.15	-
001326	联域	2023-	1-6 个	新股	41.18	37.85	83	3,417.94	3,141.55	-

	股份	11-01	月 (含)	锁定 期内						
001239	永达 股份	2023- 12-04	1-6 个 月 (含)	新股 锁定 期内	12.05	16.58	189	2,277.45	3,133.62	-
603107	上海 汽配	2023- 10-25	1-6 个 月 (含)	新股 锁定 期内	14.23	18.55	153	2,177.19	2,838.15	-
603375	盛景 微	2024- 01-17	1-6 个 月 (含)	新股 锁定 期内	38.18	47.58	59	2,252.62	2,807.22	-
603373	安邦 护卫	2023- 12-13	1-6 个 月 (含)	新股 锁定 期内	19.10	27.29	87	1,661.70	2,374.23	-
603325	博隆 技术	2024- 01-03	1-6 个 月 (含)	新股 锁定 期内	72.46	72.22	32	2,318.72	2,311.04	-
603062	麦加 芯彩	2023- 10-31	1-6 个 月 (含)	新股 锁定 期内	58.08	44.05	51	2,962.08	2,246.55	-
603193	润本 股份	2023- 10-09	1-6 个 月 (含)	新股 锁定 期内	17.38	16.05	139	2,415.82	2,230.95	-
603004	鼎龙 科技	2023- 12-20	1-6 个 月 (含)	新股 锁定 期内	16.80	18.69	108	1,814.40	2,018.52	-
603276	恒兴 新材	2023- 09-18	1-6 个 月 (含)	新股 锁定 期内	25.73	19.98	95	2,444.35	1,898.10	-
603312	西典 新能	2024- 01-04	1-6 个 月 (含)	新股 锁定 期内	29.02	26.87	69	2,002.38	1,854.03	-
603231	索宝 蛋白	2023- 12-06	1-6 个 月 (含)	新股 锁定 期内	21.29	17.79	92	1,958.68	1,636.68	-

#### 7.2.4.12.2 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。

#### 7.2.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.2.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 3 月 19 日止，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。

##### 7.2.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 3 月 19 日止，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。

#### 7.2.4.12.4 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。

#### 7.2.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.2.4.13.1 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。

##### 7.2.4.13.2 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。

##### 7.2.4.13.3 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。

#### 7.2.4.13.3.1 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。

除本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节中所列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，本基金本报告期末的其他资产均能及时变现。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约约定到期日均为六个月以内且不计息，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。

#### 7.2.4.13.4 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。

##### 7.2.4.13.4.1 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。

###### 7.2.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年3月19 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

资产					
货币资金	4,879,877.36	-	-	-	4,879,877.36
结算备付金	7,588,462.72	-	-	-	7,588,462.72
存出保证金	1,888,119.90	-	-	-	1,888,119.90
交易性金融资产	18,291,116.16	-	-	281,736,371.98	300,027,488.14
应收清算款	-	-	-	4,024,347.69	4,024,347.69
资产总计	32,647,576.14	-	-	285,760,719.67	318,408,295.81
负债					
应付赎回款	-	-	-	5,042,587.32	5,042,587.32
应付管理人报酬	-	-	-	199,264.10	199,264.10
应付托管费	-	-	-	33,210.67	33,210.67
应付销售服务费	-	-	-	27,427.41	27,427.41
应交税费	-	-	-	8,229.39	8,229.39
其他负债	-	-	-	262,682.63	262,682.63
负债总计	-	-	-	5,573,401.52	5,573,401.52
利率敏感度缺口	32,647,576.14	-	-	280,187,318.15	312,834,894.29
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	2,164,226.20	-	-	-	2,164,226.20
结算备付金	3,493,004.62	-	-	-	3,493,004.62
存出保证金	75,794.64	-	-	-	75,794.64
交易性金融资产	11,660,701.37	-	-	191,974,935.61	203,635,636.98
应收清算款	-	-	-	40,802.65	40,802.65
应收申购款	-	-	-	44,966.37	44,966.37
资产总计	17,393,726.83	-	-	192,060,704.63	209,454,431.46
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,181.44	1,181.44
应付管理人报酬	-	-	-	202,293.86	202,293.86
应付托管费	-	-	-	33,715.64	33,715.64
应付销售服务费	-	-	-	9,310.61	9,310.61
其他负债	-	-	-	343,492.53	343,492.53
负债总计	-	-	-	589,994.08	589,994.08
利率敏感度缺口	17,393,726.83	-	-	191,470,710.55	208,864,437.38

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。

#### 7.2.4.13.4.1.2 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）。

#### 7.2.4.13.4.2 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。

#### 7.2.4.13.4.3 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。

##### 7.2.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年3月19日		上年度末 2023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	281,736,371.98	90.06	191,974,935.61	91.91
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
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	281,736,371.98	90.06	191,974,935.61	91.91

##### 7.2.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	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)		
	相关风险变量的变动	本期末 2024年3月19日	上年度末 2023年12月31日
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。		2,716	1,138
1. 业绩比较基准上升 5% 2. 业绩比较基准下降 5%		-2,716	-1,138

#### 7.2.4.14 公允价值

##### 7.2.4.14.1 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。

#### 7.2.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 7.2.4.14.2.1 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 2024年3月19日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	281,487,795.33	191,782,263.86
第二层次	18,382,496.15	11,660,701.37
第三层次	157,196.66	192,671.75
合计	300,027,488.14	203,635,636.98

##### 7.2.4.14.2.2 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。

对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，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投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

#### 7.2.4.14.3 第三层次公允价值余额及变动情况

##### 7.2.4.14.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年3月19日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	192,671.75	192,671.75
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	27,335.36	27,335.36
转出第三层次	-	54,746.47	54,746.47
当期利得或损失总额	-	-8,063.98	-8,063.98
其中：计入损益的利得或损失	-	-8,063.98	-8,063.98
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	157,196.66	157,196.66

期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	36,267.97	36,267.97
项目	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	807,009.07	807,009.07
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	152,899.26	152,899.26
转出第三层次	-	976,870.63	976,870.63
当期利得或损失总额	-	209,634.05	209,634.05
其中：计入损益的利得或损失	-	209,634.05	209,634.05
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	192,671.75	192,671.75
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	39,772.49	39,772.49

#### 7.2.4.14.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股票投资	157,196.66	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	0.3723-1.9765	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股票投资	192,671.75	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	0.1962-2.1752	负相关

#### 7.2.4.14.4 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。

#### 7.2.4.14.5 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。

#### 7.2.5 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。

## §8 投资组合报告

### 8.1 中银沪深 300 指数增强型证券投资基金

(报告期：2024年3月20日-2024年12月31日)

#### 8.1.1 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	789,589,613.49	83.49
	其中：股票	789,589,613.49	83.49
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	155,223,076.84	16.41
8	其他各项资产	960,128.71	0.10
9	合计	945,772,819.04	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。

#### 8.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

##### 8.1.2.1 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	10,820,180.00	1.28
B	采矿业	54,743,180.00	6.45
C	制造业	345,903,968.20	40.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	23,275,445.00	2.74
E	建筑业	15,720,434.00	1.85
F	批发和零售业	1,885,700.00	0.22
G	交通运输、仓储和邮政业	20,847,503.00	2.46
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	31,315,927.00	3.69

J	金融业	182,472,114.24	21.51
K	房地产业	831,954.00	0.10
L	租赁和商务服务业	4,131,181.00	0.49
M	科学、研究和技术服务业	1,216,384.00	0.14
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	693,163,970.44	81.72

### 8.1.2.2 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	7,642,511.00	0.90
C	制造业	58,377,974.32	6.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,847,412.00	1.04
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	4,580,832.00	0.54
G	交通运输、仓储和邮政业	2,781,084.80	0.33
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,115,671.37	0.84
J	金融业	5,602,207.00	0.66
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	11,148.56	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,466,802.00	0.17
S	综合	-	-
	合计	96,425,643.05	11.37

### 8.1.2.3 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投资股票。

### 8.1.3 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

#### 8.1.3.1 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	25,500	38,862,000.00	4.58
2	300750	宁德时代	118,381	31,489,346.00	3.71
3	601318	中国平安	407,700	21,465,405.00	2.53
4	000333	美的集团	256,885	19,322,889.70	2.28
5	600036	招商银行	475,200	18,675,360.00	2.20
6	600900	长江电力	624,600	18,456,930.00	2.18
7	601899	紫金矿业	1,008,500	15,248,520.00	1.80
8	601398	工商银行	2,000,200	13,841,384.00	1.63
9	601658	邮储银行	2,316,100	13,155,448.00	1.55
10	601919	中远海控	824,700	12,782,850.00	1.51
11	601688	华泰证券	656,600	11,549,594.00	1.36
12	600999	招商证券	578,300	11,080,228.00	1.31
13	600958	东方证券	1,046,704	11,053,194.24	1.30
14	002594	比亚迪	37,200	10,514,952.00	1.24
15	600938	中国海油	352,000	10,387,520.00	1.22
16	600887	伊利股份	339,400	10,243,092.00	1.21
17	688041	海光信息	67,280	10,077,871.20	1.19
18	600050	中国联通	1,833,500	9,735,885.00	1.15
19	300433	蓝思科技	438,300	9,598,770.00	1.13
20	600276	恒瑞医药	206,201	9,464,625.90	1.12
21	600660	福耀玻璃	143,100	8,929,440.00	1.05
22	002371	北方华创	21,200	8,289,200.00	0.98
23	605499	东鹏饮料	32,770	8,144,000.40	0.96
24	000858	五粮液	57,457	8,046,278.28	0.95
25	603288	海天味业	174,200	7,995,780.00	0.94
26	000001	平安银行	679,200	7,946,640.00	0.94
27	601225	陕西煤业	333,600	7,759,536.00	0.91
28	601328	交通银行	987,300	7,671,321.00	0.90
29	000895	双汇发展	287,600	7,466,096.00	0.88
30	002714	牧原股份	190,600	7,326,664.00	0.86
31	600031	三一重工	432,900	7,134,192.00	0.84
32	000725	京东方 A	1,554,600	6,824,694.00	0.80
33	000977	浪潮信息	123,900	6,427,932.00	0.76
34	688981	中芯国际	67,620	6,398,204.40	0.75
35	601211	国泰君安	338,600	6,314,890.00	0.74
36	601898	中煤能源	517,000	6,297,060.00	0.74
37	601728	中国电信	872,100	6,296,562.00	0.74
38	601288	农业银行	1,177,800	6,289,452.00	0.74
39	600406	国电南瑞	248,200	6,259,604.00	0.74
40	601127	赛力斯	46,900	6,255,991.00	0.74
41	600018	上港集团	1,000,000	6,120,000.00	0.72
42	688012	中微公司	32,000	6,053,120.00	0.71
43	601377	兴业证券	960,000	6,009,600.00	0.71
44	601877	正泰电器	256,000	5,992,960.00	0.71
45	002475	立讯精密	142,383	5,803,531.08	0.68
46	600919	江苏银行	564,400	5,542,408.00	0.65

47	600219	南山铝业	1,408,800	5,508,408.00	0.65
48	601088	中国神华	121,100	5,265,428.00	0.62
49	300442	润泽科技	99,700	5,180,412.00	0.61
50	601668	中国建筑	863,100	5,178,600.00	0.61
51	002001	新和成	227,700	5,002,569.00	0.59
52	605117	德业股份	57,900	4,909,920.00	0.58
53	601766	中国中车	578,100	4,844,478.00	0.57
54	002648	卫星化学	254,200	4,776,418.00	0.56
55	000651	格力电器	103,700	4,713,165.00	0.56
56	603195	公牛集团	66,779	4,690,556.96	0.55
57	600000	浦发银行	453,100	4,662,399.00	0.55
58	300308	中际旭创	37,140	4,587,161.40	0.54
59	600585	海螺水泥	190,000	4,518,200.00	0.53
60	601601	中国太保	131,500	4,481,520.00	0.53
61	603501	韦尔股份	42,800	4,468,748.00	0.53
62	600690	海尔智家	149,700	4,261,959.00	0.50
63	601618	中国中冶	1,257,600	4,150,080.00	0.49
64	300502	新易盛	35,300	4,079,974.00	0.48
65	002938	鹏鼎控股	109,200	3,983,616.00	0.47
66	601857	中国石油	424,600	3,795,924.00	0.45
67	600039	四川路桥	521,400	3,795,792.00	0.45
68	603993	洛阳钼业	545,200	3,625,580.00	0.43
69	601138	工业富联	167,200	3,594,800.00	0.42
70	002027	分众传媒	504,100	3,543,823.00	0.42
71	601169	北京银行	571,500	3,514,725.00	0.41
72	601229	上海银行	383,500	3,509,025.00	0.41
73	300498	温氏股份	211,600	3,493,516.00	0.41
74	688187	时代电气	69,989	3,353,872.88	0.40
75	002142	宁波银行	127,300	3,094,663.00	0.36
76	300274	阳光电源	41,000	3,027,030.00	0.36
77	601633	长城汽车	106,400	2,801,512.00	0.33
78	601818	光大银行	716,300	2,772,081.00	0.33
79	002230	科大讯飞	56,800	2,744,576.00	0.32
80	601628	中国人寿	64,300	2,695,456.00	0.32
81	603799	华友钴业	88,700	2,595,362.00	0.31
82	600436	片仔癀	12,000	2,574,000.00	0.30
83	601939	建设银行	287,800	2,529,762.00	0.30
84	000876	新希望	280,600	2,519,788.00	0.30
85	002463	沪电股份	63,100	2,501,915.00	0.29
86	600438	通威股份	109,000	2,409,990.00	0.28
87	001289	龙源电力	136,100	2,138,131.00	0.25
88	601009	南京银行	200,600	2,136,390.00	0.25
89	600926	杭州银行	137,400	2,007,414.00	0.24
90	601808	中海油服	131,600	2,006,900.00	0.24
91	600015	华夏银行	245,700	1,968,057.00	0.23
92	000963	华东医药	54,500	1,885,700.00	0.22
93	300408	三环集团	45,600	1,756,056.00	0.21
94	601916	浙商银行	581,800	1,693,038.00	0.20
95	601336	新华保险	32,000	1,590,400.00	0.19
96	603986	兆易创新	14,200	1,516,560.00	0.18

97	601800	中国交建	143,000	1,494,350.00	0.18
98	600309	万华化学	19,900	1,419,865.00	0.17
99	601881	中国银河	87,500	1,332,625.00	0.16
100	000538	云南白药	22,200	1,330,890.00	0.16
101	601838	成都银行	77,700	1,329,447.00	0.16
102	603259	药明康德	22,100	1,216,384.00	0.14
103	300124	汇川技术	20,400	1,195,032.00	0.14
104	601816	京沪高铁	193,500	1,191,960.00	0.14
105	002241	歌尔股份	45,000	1,161,450.00	0.14
106	600019	宝钢股份	164,900	1,154,300.00	0.14
107	600875	东方电气	71,200	1,131,368.00	0.13
108	600941	中国移动	9,300	1,098,888.00	0.13
109	600023	浙能电力	183,200	1,036,912.00	0.12
110	601319	中国人保	122,800	935,736.00	0.11
111	000938	紫光股份	31,600	879,428.00	0.10
112	601998	中信银行	125,700	877,386.00	0.10
113	300760	迈瑞医疗	3,400	867,000.00	0.10
114	300979	华利集团	10,900	857,285.00	0.10
115	000338	潍柴动力	62,400	854,880.00	0.10
116	600048	保利发展	93,900	831,954.00	0.10
117	002252	上海莱士	108,300	781,926.00	0.09
118	002920	德赛西威	7,000	770,770.00	0.09
119	003816	中国广核	162,000	669,060.00	0.08
120	600025	华能水电	70,000	665,700.00	0.08
121	600176	中国巨石	56,400	642,396.00	0.08
122	601390	中国中铁	98,400	628,776.00	0.07
123	600415	小商品城	43,800	587,358.00	0.07
124	601689	拓普集团	11,400	558,600.00	0.07
125	002601	龙佰集团	31,000	547,770.00	0.06
126	601111	中国国航	69,100	546,581.00	0.06
127	000063	中兴通讯	13,200	533,280.00	0.06
128	601669	中国电建	86,600	472,836.00	0.06
129	002179	中航光电	11,600	455,880.00	0.05
130	002180	纳思达	16,100	453,537.00	0.05
131	600150	中国船舶	12,500	449,500.00	0.05
132	601989	中国重工	93,100	447,811.00	0.05
133	601901	方正证券	51,900	432,327.00	0.05
134	000568	泸州老窖	3,400	425,680.00	0.05
135	600028	中国石化	53,400	356,712.00	0.04
136	002129	TCL 中环	40,000	354,800.00	0.04
137	600011	华能国际	45,600	308,712.00	0.04
138	601006	大秦铁路	30,400	206,112.00	0.02
139	600061	国投资本	26,200	197,024.00	0.02
140	603296	华勤技术	2,500	177,375.00	0.02
141	300628	亿联网络	3,100	119,660.00	0.01
142	601788	光大证券	6,500	117,715.00	0.01
143	600161	天坛生物	120	2,460.00	0.00

## 8.1.3.2 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	300866	安克创新	86,100	8,406,804.00	0.99
2	000423	东阿阿胶	81,700	5,124,224.00	0.60
3	002128	电投能源	245,100	4,799,058.00	0.57
4	000513	丽珠集团	107,000	4,066,000.00	0.48
5	600021	上海电力	407,500	3,736,775.00	0.44
6	688235	百济神州	21,758	3,503,473.16	0.41
7	688568	中科星图	66,200	3,378,186.00	0.40
8	600648	外高桥	271,600	3,234,756.00	0.38
9	002273	水晶光电	138,100	3,068,582.00	0.36
10	601456	国联民生	218,500	2,954,120.00	0.35
11	600096	云天化	120,400	2,684,920.00	0.32
12	601966	玲珑轮胎	141,200	2,547,248.00	0.30
13	002032	苏泊尔	47,200	2,511,512.00	0.30
14	300724	捷佳伟创	38,855	2,456,024.55	0.29
15	688347	华虹公司	52,343	2,432,379.21	0.29
16	000039	中集集团	282,400	2,194,248.00	0.26
17	600995	南网储能	199,600	2,019,952.00	0.24
18	601156	东航物流	107,800	1,818,586.00	0.21
19	600968	海油发展	419,700	1,792,119.00	0.21
20	601108	财通证券	218,300	1,783,511.00	0.21
21	600496	精工钢构	520,000	1,570,400.00	0.19
22	000729	燕京啤酒	117,800	1,418,312.00	0.17
23	600551	时代出版	162,000	1,394,820.00	0.16
24	301015	百洋医药	55,600	1,346,076.00	0.16
25	688122	西部超导	30,480	1,305,153.60	0.15
26	002202	金风科技	123,900	1,279,887.00	0.15
27	002653	海思科	36,500	1,213,625.00	0.14
28	688083	中望软件	13,000	1,112,410.00	0.13
29	603338	浙江鼎力	17,000	1,096,840.00	0.13
30	600352	浙江龙盛	105,200	1,082,508.00	0.13
31	600380	健康元	96,000	1,081,920.00	0.13
32	600583	海油工程	192,200	1,051,334.00	0.12
33	000966	长源电力	220,200	1,045,950.00	0.12
34	600177	雅戈尔	116,756	1,039,128.40	0.12
35	002625	光启技术	21,100	1,008,580.00	0.12
36	601179	中国西电	132,000	1,001,880.00	0.12
37	600863	内蒙华电	225,600	976,848.00	0.12
38	600522	中天科技	66,800	956,576.00	0.11
39	601298	青岛港	78,400	714,224.00	0.08
40	600517	国网英大	118,600	653,486.00	0.08
41	688213	思特威	8,200	637,304.00	0.08
42	000883	湖北能源	126,800	631,464.00	0.07
43	000997	新大陆	31,100	620,445.00	0.07
44	688233	神工股份	23,959	561,838.55	0.07
45	600582	天地科技	75,700	467,826.00	0.06
46	300888	稳健医疗	10,700	450,256.00	0.05
47	300709	精研科技	11,100	445,887.00	0.05
48	002123	梦网科技	40,700	439,967.00	0.05

49	002608	江苏国信	56,900	436,423.00	0.05
50	688321	微芯生物	22,747	422,639.26	0.05
51	002765	蓝黛科技	49,000	421,400.00	0.05
52	002410	广联达	34,000	399,840.00	0.05
53	688232	新点软件	13,600	394,264.00	0.05
54	600143	金发科技	44,600	385,344.00	0.05
55	688617	惠泰医疗	900	335,097.00	0.04
56	688278	特宝生物	4,400	322,828.00	0.04
57	601717	郑煤机	22,300	289,454.00	0.03
58	600221	海航控股	127,300	216,410.00	0.03
59	300803	指南针	2,200	211,090.00	0.02
60	688488	艾迪药业	22,600	177,636.00	0.02
61	000672	上峰水泥	18,000	137,700.00	0.02
62	002372	伟星新材	10,400	131,352.00	0.02
63	603737	三棵树	2,500	106,500.00	0.01
64	002831	裕同科技	3,700	100,270.00	0.01
65	600733	北汽蓝谷	10,800	86,400.00	0.01
66	600977	中国电影	6,200	71,982.00	0.01
67	301165	锐捷网络	900	64,980.00	0.01
68	688615	合合信息	289	47,910.42	0.01
69	301611	珂玛科技	804	45,104.40	0.01
70	688449	联芸科技	1,406	41,392.64	0.00
71	688605	先锋精科	744	39,937.92	0.00
72	688708	佳驰科技	780	38,181.00	0.00
73	688726	拉普拉斯	979	32,365.74	0.00
74	001391	国货航	4,686	31,864.80	0.00
75	301551	无线传媒	652	28,185.96	0.00
76	603072	天和磁材	2,255	27,736.50	0.00
77	688750	金天钛业	1,685	26,016.40	0.00
78	301522	上大股份	816	20,269.44	0.00
79	688721	龙图光罩	279	15,861.15	0.00
80	301556	托普云农	267	15,766.35	0.00
81	301631	壹连科技	153	15,599.88	0.00
82	301606	绿联科技	396	14,450.04	0.00
83	301571	国科天成	350	14,290.50	0.00
84	301622	英思特	306	13,745.52	0.00
85	301608	博实结	184	12,029.92	0.00
86	301613	新铝时代	276	11,528.52	0.00
87	688710	益诺思	332	11,148.56	0.00
88	301617	博苑股份	253	10,066.87	0.00
89	301603	乔锋智能	233	9,781.34	0.00
90	301607	富特科技	257	9,287.98	0.00
91	603194	中力股份	291	8,185.83	0.00
92	301552	科力装备	143	8,132.41	0.00
93	301585	蓝宇股份	210	7,528.50	0.00
94	001279	强邦新材	265	7,396.15	0.00
95	603395	红四方	154	5,508.58	0.00
96	603207	小方制药	185	4,930.25	0.00
97	603310	巍华新材	254	4,559.30	0.00
98	603091	众鑫股份	94	4,176.42	0.00

99	603350	安乃达	106	3,834.02	0.00
100	603205	健尔康	128	3,500.80	0.00
101	603381	永臻股份	156	3,419.52	0.00
102	603285	键邦股份	129	2,916.69	0.00

#### 8.1.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.1.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	56,262,865.00	6.63
2	300750	宁德时代	37,815,073.00	4.46
3	000333	美的集团	31,388,511.73	3.70
4	600900	长江电力	29,372,183.50	3.46
5	601919	中远海控	29,077,090.20	3.43
6	601899	紫金矿业	25,798,307.38	3.04
7	601318	中国平安	25,019,517.36	2.95
8	600660	福耀玻璃	23,957,188.00	2.82
9	600036	招商银行	22,500,895.36	2.65
10	600050	中国联通	22,278,598.00	2.63
11	600276	恒瑞医药	21,581,875.00	2.54
12	600018	上港集团	20,450,561.00	2.41
13	600958	东方证券	20,172,710.16	2.38
14	601668	中国建筑	20,081,658.00	2.37
15	601225	陕西煤业	19,755,633.00	2.33
16	000725	京东方 A	19,572,391.00	2.31
17	601688	华泰证券	19,505,300.00	2.30
18	300760	迈瑞医疗	19,020,916.60	2.24
19	601728	中国电信	18,913,930.00	2.23
20	603993	洛阳钼业	18,905,066.00	2.23
21	603501	韦尔股份	18,618,522.00	2.19
22	000338	潍柴动力	18,182,746.08	2.14
23	605499	东鹏饮料	18,065,219.00	2.13
24	600938	中国海油	17,868,541.00	2.11
25	600989	宝丰能源	17,260,286.00	2.03
26	002001	新和成	17,216,186.80	2.03
27	600219	南山铝业	17,004,419.00	2.00
28	000651	格力电器	16,990,247.64	2.00

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

##### 8.1.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	33,958,371.48	4.00
2	300750	宁德时代	25,306,131.18	2.98
3	601668	中国建筑	20,617,631.60	2.43
4	000338	潍柴动力	20,429,618.22	2.41

5	300760	迈瑞医疗	20,410,010.00	2.41
6	000333	美的集团	18,890,812.00	2.23
7	601800	中国交建	17,937,684.00	2.11
8	603501	韦尔股份	17,832,616.60	2.10
9	600989	宝丰能源	17,812,815.00	2.10
10	603993	洛阳钼业	17,369,563.66	2.05
11	601919	中远海控	17,072,458.20	2.01
12	601728	中国电信	17,031,397.00	2.01
13	000651	格力电器	16,880,709.00	1.99
14	601318	中国平安	16,831,474.00	1.98
15	601633	长城汽车	16,596,958.30	1.96
16	002027	分众传媒	16,387,807.00	1.93
17	600050	中国联通	16,305,502.00	1.92
18	600276	恒瑞医药	16,098,208.83	1.90
19	600660	福耀玻璃	16,052,843.24	1.89
20	002001	新和成	15,346,674.36	1.81

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

#### 8.1.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,415,349,394.88
卖出股票收入（成交）总额	2,001,320,170.45

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

#### 8.1.5 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。

#### 8.1.6 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。

#### 8.1.7 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。

#### 8.1.8 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。

#### 8.1.9 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。

#### 8.1.10 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。

#### 8.1.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 8.1.11.1 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。

##### 8.1.11.2 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。

#### 8.1.12 投资组合报告附注

8.1.12.1 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。

8.1.12.2 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。

#### 8.1.12.3 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	394,422.52
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	565,706.19
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	960,128.71

#### 8.1.12.4 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。

#### 8.1.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

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

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

### 8.1.12.6 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。

## 8.2 中银量化价值混合型证券投资基金

(报告期：2024年1月1日-2024年3月19日)

### 8.2.1 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	281,736,371.98	88.48
	其中：股票	281,736,371.98	88.48
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	18,291,116.16	5.74
	其中：债券	18,291,116.16	5.74
	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	12,468,340.08	3.92
8	其他各项资产	5,912,467.59	1.86
9	合计	318,408,295.81	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。

### 8.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	16,596,050.04	5.31
C	制造业	153,186,093.23	48.97
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,208,141.00	4.22
E	建筑业	7,768,071.00	2.48
F	批发和零售业	340,707.00	0.11
G	交通运输、仓储和邮政业	6,404,716.15	2.05
H	住宿和餐饮业	406,620.00	0.13
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,060,245.68	4.49
J	金融业	62,085,666.63	19.85
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	4,103,765.23	1.31
M	科学研究和技术服务业	952,991.62	0.30
N	水利、环境和公共设施管理业	3,564.40	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-

Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	2,619,740.00	0.84
S	综合	-	-
	合计	281,736,371.98	90.06

### 8.2.2.2 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投资组合。

### 8.2.3 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	9,900	16,909,398.00	5.41
2	300750	宁德时代	50,280	9,414,930.00	3.01
3	601318	中国平安	168,900	7,065,087.00	2.26
4	600036	招商银行	198,000	6,098,400.00	1.95
5	000858	五粮液	34,500	5,429,265.00	1.74
6	601658	邮储银行	973,500	4,585,185.00	1.47
7	002371	北方华创	15,200	4,485,216.00	1.43
8	600887	伊利股份	153,300	4,459,497.00	1.43
9	601398	工商银行	845,200	4,352,780.00	1.39
10	601688	华泰证券	291,500	4,180,110.00	1.34
11	000333	美的集团	64,200	4,018,920.00	1.28
12	002415	海康威视	113,600	3,785,152.00	1.21
13	000651	格力电器	96,200	3,682,536.00	1.18
14	600309	万华化学	46,400	3,646,112.00	1.17
15	600999	招商证券	259,100	3,637,764.00	1.16
16	601668	中国建筑	699,200	3,628,848.00	1.16
17	601600	中国铝业	524,200	3,506,898.00	1.12
18	600900	长江电力	140,700	3,478,104.00	1.11
19	600905	三峡能源	691,200	3,262,464.00	1.04
20	000001	平安银行	310,700	3,231,280.00	1.03
21	600150	中国船舶	92,200	3,206,716.00	1.03
22	000338	潍柴动力	197,000	3,197,310.00	1.02
23	600332	白云山	108,700	3,162,083.00	1.01
24	601728	中国电信	547,500	3,126,225.00	1.00
25	600406	国电南瑞	125,500	3,053,415.00	0.98
26	600028	中国石化	490,400	3,015,960.00	0.96
27	600276	恒瑞医药	65,101	2,992,692.97	0.96
28	600030	中信证券	140,025	2,916,720.75	0.93
29	300760	迈瑞医疗	9,800	2,869,146.00	0.92
30	601939	建设银行	414,500	2,785,440.00	0.89
31	601328	交通银行	441,600	2,707,008.00	0.87
32	688036	传音控股	16,220	2,660,080.00	0.85
33	600050	中国联通	564,700	2,620,208.00	0.84
34	600025	华能水电	278,700	2,619,780.00	0.84
35	601766	中国中车	398,200	2,564,408.00	0.82
36	601899	紫金矿业	165,000	2,562,450.00	0.82
37	600690	海尔智家	104,700	2,477,202.00	0.79

38	688349	三一重能	83,787	2,437,363.83	0.78
39	000625	长安汽车	140,300	2,422,981.00	0.77
40	600019	宝钢股份	363,900	2,398,101.00	0.77
41	601186	中国铁建	272,100	2,288,361.00	0.73
42	603228	景旺电子	106,500	2,279,100.00	0.73
43	601633	长城汽车	94,300	2,266,029.00	0.72
44	600919	江苏银行	295,400	2,247,994.00	0.72
45	002601	龙佰集团	118,000	2,213,680.00	0.71
46	600875	东方电气	138,400	2,181,184.00	0.70
47	601066	中信建投	94,100	2,175,592.00	0.70
48	002001	新和成	123,100	2,140,709.00	0.68
49	601006	大秦铁路	290,100	2,109,027.00	0.67
50	000538	云南白药	41,000	2,102,070.00	0.67
51	600104	上汽集团	139,600	2,057,704.00	0.66
52	603501	韦尔股份	20,000	2,016,200.00	0.64
53	300124	汇川技术	32,000	2,014,080.00	0.64
54	300442	润泽科技	80,300	2,005,894.00	0.64
55	000895	双汇发展	68,500	1,957,730.00	0.63
56	600737	中粮糖业	207,400	1,928,820.00	0.62
57	600061	国投资本	284,500	1,911,840.00	0.61
58	601857	中国石油	208,900	1,859,210.00	0.59
59	600362	江西铜业	80,900	1,851,801.00	0.59
60	600438	通威股份	68,100	1,791,711.00	0.57
61	601985	中国核电	208,300	1,772,633.00	0.57
62	603993	洛阳钼业	211,900	1,629,511.00	0.52
63	000063	中兴通讯	53,700	1,560,522.00	0.50
64	002739	万达电影	98,500	1,543,495.00	0.49
65	601225	陕西煤业	61,700	1,530,160.00	0.49
66	601888	中国中免	17,100	1,496,250.00	0.48
67	601138	工业富联	58,300	1,487,233.00	0.48
68	600188	兖矿能源	62,300	1,475,887.00	0.47
69	000301	东方盛虹	137,600	1,450,304.00	0.46
70	601800	中国交建	169,700	1,401,722.00	0.45
71	601865	福莱特	46,300	1,347,793.00	0.43
72	002142	宁波银行	63,200	1,324,040.00	0.42
73	002236	大华股份	68,400	1,320,804.00	0.42
74	300433	蓝思科技	98,700	1,320,606.00	0.42
75	600000	浦发银行	187,200	1,312,272.00	0.42
76	601169	北京银行	233,900	1,267,738.00	0.41
77	601601	中国太保	53,500	1,234,245.00	0.39
78	600801	华新水泥	91,400	1,222,018.00	0.39
79	002064	华峰化学	174,200	1,189,786.00	0.38
80	600547	山东黄金	45,400	1,141,356.00	0.36
81	002475	立讯精密	38,483	1,133,709.18	0.36
82	688012	中微公司	7,200	1,105,776.00	0.35
83	002027	分众传媒	168,900	1,075,893.00	0.34
84	600867	通化东宝	103,200	1,072,248.00	0.34
85	600031	三一重工	75,100	1,062,665.00	0.34
86	000581	威孚高科	61,300	1,058,038.00	0.34
87	300001	特锐德	51,900	1,057,722.00	0.34

88	601898	中煤能源	85,800	1,048,476.00	0.34
89	600845	宝信软件	25,360	1,048,382.40	0.34
90	601816	京沪高铁	209,300	1,046,500.00	0.33
91	601229	上海银行	157,200	1,032,804.00	0.33
92	600642	申能股份	137,700	1,032,750.00	0.33
93	601088	中国神华	27,100	1,011,643.00	0.32
94	601211	国泰君安	65,500	966,780.00	0.31
95	002648	卫星化学	56,600	966,728.00	0.31
96	000061	农产品	153,000	963,900.00	0.31
97	601818	光大银行	293,400	947,682.00	0.30
98	603259	药明康德	18,560	943,033.60	0.30
99	002156	通富微电	36,200	924,548.00	0.30
100	600918	中泰证券	130,100	908,098.00	0.29
101	600941	中国移动	8,500	877,030.00	0.28
102	600066	宇通客车	42,900	806,520.00	0.26
103	601628	中国人寿	26,000	751,140.00	0.24
104	601009	南京银行	81,800	723,930.00	0.23
105	601919	中远海控	69,500	713,070.00	0.23
106	000630	铜陵有色	179,200	697,088.00	0.22
107	600038	中直股份	16,900	696,956.00	0.22
108	601916	浙商银行	241,100	694,368.00	0.22
109	300115	长盈精密	61,900	674,710.00	0.22
110	000725	京东方 A	163,900	662,156.00	0.21
111	600760	中航沈飞	17,120	649,875.20	0.21
112	000568	泸州老窖	3,400	648,516.00	0.21
113	002911	佛燃能源	48,300	648,186.00	0.21
114	601098	中南传媒	49,600	634,384.00	0.20
115	600926	杭州银行	57,700	626,045.00	0.20
116	600015	华夏银行	99,600	622,500.00	0.20
117	603187	海容冷链	39,100	615,043.00	0.20
118	688208	道通科技	28,800	612,000.00	0.20
119	002304	洋河股份	5,800	604,650.00	0.19
120	600685	中船防务	22,600	584,436.00	0.19
121	002352	顺丰控股	15,100	581,501.00	0.19
122	000776	广发证券	41,300	579,026.00	0.19
123	601233	桐昆股份	41,200	568,972.00	0.18
124	600057	厦门象屿	85,400	565,348.00	0.18
125	000708	中信特钢	37,100	555,016.00	0.18
126	000921	海信家电	19,900	551,230.00	0.18
127	300735	光弘科技	19,000	534,090.00	0.17
128	688516	奥特维	4,567	521,094.70	0.17
129	600018	上港集团	98,500	518,110.00	0.17
130	601111	中国国航	68,900	512,616.00	0.16
131	600377	宁沪高速	43,600	502,708.00	0.16
132	002422	科伦药业	16,200	486,324.00	0.16
133	300017	网宿科技	45,800	454,336.00	0.15
134	601618	中国中冶	132,100	449,140.00	0.14
135	601238	广汽集团	47,400	445,086.00	0.14
136	601928	凤凰传媒	39,700	441,861.00	0.14
137	688439	振华风光	5,300	434,123.00	0.14

138	603919	金徽酒	19,700	430,642.00	0.14
139	601163	三角轮胎	26,300	427,901.00	0.14
140	601890	亚星锚链	47,900	410,503.00	0.13
141	002859	洁美科技	17,400	409,770.00	0.13
142	600258	首旅酒店	27,000	406,620.00	0.13
143	601336	新华保险	13,000	403,390.00	0.13
144	601699	潞安环能	17,512	396,997.04	0.13
145	003816	中国广核	103,200	394,224.00	0.13
146	002230	科大讯飞	7,800	393,900.00	0.13
147	600535	天士力	20,900	360,316.00	0.12
148	605499	东鹏饮料	1,900	359,784.00	0.12
149	601958	金钼股份	31,800	358,068.00	0.11
150	601028	玉龙股份	33,700	340,707.00	0.11
151	000088	盐田港	65,500	311,780.00	0.10
152	603195	公牛集团	2,985	310,260.90	0.10
153	688235	百济神州	2,200	307,362.00	0.10
154	002078	太阳纸业	21,500	300,570.00	0.10
155	300866	安克创新	3,500	298,655.00	0.10
156	600938	中国海油	10,200	289,884.00	0.09
157	002594	比亚迪	1,300	281,840.00	0.09
158	600985	淮北矿业	16,300	276,448.00	0.09
159	688599	天合光能	10,400	271,336.00	0.09
160	600837	海通证券	29,200	264,260.00	0.08
161	603288	海天味业	6,400	260,544.00	0.08
162	600219	南山铝业	77,200	257,848.00	0.08
163	603345	安井食品	2,800	252,896.00	0.08
164	601319	中国人保	47,900	243,811.00	0.08
165	688111	金山办公	800	243,640.00	0.08
166	300803	指南针	4,900	237,650.00	0.08
167	002373	千方科技	20,800	224,848.00	0.07
168	688041	海光信息	2,600	209,690.00	0.07
169	601717	郑煤机	12,500	180,000.00	0.06
170	600482	中国动力	7,800	156,702.00	0.05
171	600893	航发动力	3,500	123,445.00	0.04
172	002032	苏泊尔	2,000	112,540.00	0.04
173	601021	春秋航空	1,900	106,210.00	0.03
174	301538	骏鼎达	1,066	59,504.12	0.02
175	000596	古井贡酒	200	51,378.00	0.02
176	600901	江苏金租	10,800	50,652.00	0.02
177	603344	星德胜	1,788	34,293.84	0.01
178	001359	平安电工	1,833	31,875.87	0.01
179	301516	中远通	598	12,294.88	0.00
180	301508	中机认检	291	9,958.02	0.00
181	688709	成都华微	422	9,051.90	0.00
182	301413	安培龙	152	8,914.80	0.00
183	688652	京仪装备	164	7,450.52	0.00
184	301555	惠柏新材	224	7,239.68	0.00
185	688648	中邮科技	303	6,993.24	0.00
186	688653	康希通信	498	6,862.44	0.00
187	301568	思泰克	168	6,827.52	0.00

188	688695	中创股份	186	6,796.44	0.00
189	301459	丰茂股份	163	6,647.14	0.00
190	688720	艾森股份	157	6,281.57	0.00
191	603341	龙旗科技	135	5,732.10	0.00
192	688716	中研股份	158	5,049.68	0.00
193	688719	爱科赛博	91	5,016.83	0.00
194	001378	德冠新材	134	3,879.30	0.00
195	688657	浩辰软件	55	3,698.20	0.00
196	601033	永兴股份	266	3,564.40	0.00
197	603082	北自科技	101	3,253.21	0.00
198	601083	锦江航运	331	3,194.15	0.00
199	001326	联域股份	83	3,141.55	0.00
200	001239	永达股份	189	3,133.62	0.00
201	603107	上海汽配	153	2,838.15	0.00
202	603375	盛景微	59	2,807.22	0.00
203	600346	恒力石化	200	2,622.00	0.00
204	603373	安邦护卫	87	2,374.23	0.00
205	603325	博隆技术	32	2,311.04	0.00
206	603062	麦加芯彩	51	2,246.55	0.00
207	603193	润本股份	139	2,230.95	0.00
208	603004	鼎龙科技	108	2,018.52	0.00
209	603276	恒兴新材	95	1,898.10	0.00
210	600570	恒生电子	76	1,872.64	0.00
211	603312	西典新能	69	1,854.03	0.00
212	603231	索宝蛋白	92	1,636.68	0.00
213	600089	特变电工	60	945.00	0.00
214	000100	TCL 科技	10	46.40	0.00
215	600958	东方证券	4	34.88	0.00

## 8.2.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.2.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	6,786,443.00	3.25
2	300750	宁德时代	3,742,756.00	1.79
3	601728	中国电信	3,595,072.00	1.72
4	600150	中国船舶	3,521,992.00	1.69
5	002371	北方华创	3,419,399.75	1.64
6	601600	中国铝业	3,353,524.00	1.61
7	600050	中国联通	3,327,530.00	1.59
8	000333	美的集团	3,310,587.00	1.59
9	600905	三峡能源	3,293,574.00	1.58
10	601985	中国核电	3,290,221.00	1.58
11	000858	五粮液	3,286,521.00	1.57
12	600887	伊利股份	3,132,302.00	1.50
13	600332	白云山	3,046,627.00	1.46
14	600028	中国石化	3,011,989.00	1.44
15	300760	迈瑞医疗	2,932,316.00	1.40

16	600690	海尔智家	2,728,289.00	1.31
17	600061	国投资本	2,705,950.00	1.30
18	688349	三一重能	2,691,965.90	1.29
19	600900	长江电力	2,654,508.00	1.27
20	600875	东方电气	2,639,370.00	1.26

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

#### 8.2.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	000333	美的集团	2,889,192.00	1.38
2	002493	荣盛石化	2,731,988.00	1.31
3	601138	工业富联	2,715,923.00	1.30
4	601985	中国核电	2,457,910.00	1.18
5	603501	韦尔股份	2,447,877.60	1.17
6	000596	古井贡酒	2,348,856.00	1.12
7	601899	紫金矿业	2,191,398.00	1.05
8	600048	保利发展	2,179,608.00	1.04
9	601728	中国电信	2,154,519.00	1.03
10	300760	迈瑞医疗	2,109,902.00	1.01
11	600519	贵州茅台	1,968,262.76	0.94
12	600104	上汽集团	1,942,144.00	0.93
13	601800	中国交建	1,935,349.00	0.93
14	601021	春秋航空	1,932,289.00	0.93
15	601088	中国神华	1,927,876.00	0.92
16	000858	五粮液	1,910,925.00	0.91
17	600845	宝信软件	1,845,122.00	0.88
18	603885	吉祥航空	1,839,320.00	0.88
19	300274	阳光电源	1,838,846.00	0.88
20	002475	立讯精密	1,811,377.00	0.87

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

#### 8.2.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	263,090,931.29
卖出股票收入（成交）总额	187,405,411.11

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

#### 8.2.5 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	18,291,116.16	5.85
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	18,291,116.16	5.85

#### 8.2.6 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	019709	23 国债 16	181,000	18,291,116.16	5.85

#### 8.2.7 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。

#### 8.2.8 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。

#### 8.2.9 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。

#### 8.2.10 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。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。

#### 8.2.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 8.2.11.1 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。

##### 8.2.11.2 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。

#### 8.2.12 投资组合报告附注

8.2.12.1 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。

8.2.12.2 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。

#### 8.2.12.3 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	1,888,119.90
2	应收清算款	4,024,347.69
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	-
8	其他	-
9	合计	5,912,467.59

#### 8.2.12.4 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。

#### 8.2.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 8.2.12.6 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。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 中银沪深 300 指数增强型证券投资基金

(报告期：2024年3月20日-2024年12月31日)

#### 9.1.1 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
中银沪深	1,302	334,023.41	405,122,651.07	93.1534%	29,775,828.77	6.8466%

300 指数增强 A						
中银沪深 300 指数增强 C	779	384,618.15	287,994,308.69	96.1206%	11,623,226.29	3.8794%
中银沪深 300 指数增强 E	1,347	2,496.87	-	-	3,363,285.59	100.0000%
合计	3,428	215,250.67	693,116,959.76	93.9337%	44,762,340.65	6.0663%

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）。

### 9.1.2 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	中银沪深 300 指数增强 A	365,328.11	0.0840%
	中银沪深 300 指数增强 C	8,394.15	0.0028%
	中银沪深 300 指数增强 E	561.25	0.0167%
	合计	374,283.51	0.0507%

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）。

### 9.1.3 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持有本开放式基金	中银沪深 300 指数增强 A	10~50
	中银沪深 300 指数增强 C	0
	中银沪深 300 指数增强 E	0~10
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	中银沪深 300 指数增强 A	0
	中银沪深 300 指数增强 C	0~10
	中银沪深 300 指数增强 E	0~10
	合计	0~10

## 9.2 中银量化价值混合型证券投资基金

（报告期：2024年1月1日-2024年3月19日）

### 9.2.1 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	户均持有	持有人结构
------	------	------	-------

	数(户)	的基金份额	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	490	365,178.74	165,829,039.89	92.6742%	13,108,543.57	7.3258%
中银量化价值混合 C	329	365,933.70	119,614,128.03	99.3537%	778,059.73	0.6463%
合计	819	365,482.02	285,443,167.92	95.3608%	13,886,603.30	4.6392%

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）。

### 9.2.2 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	384,249.17	0.2147%
	中银量化价值混合 C	8,394.15	0.0070%
	合计	392,643.32	0.1312%

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）。

### 9.2.3 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持有本开放式基金	中银量化价值混合 A	10~50
	中银量化价值混合 C	0
	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	0~10
	合计	0~10

## §10 开放式基金份额变动

### 10.1 中银沪深 300 指数增强型证券投资基金

（报告期：2024年3月20日-2024年12月31日）

单位：份

项目	中银沪深 300 指数增强 A	中银沪深 300 指数增强 C	中银沪深 300 指数增强 E
基金合同生效日 (2024 年 3 月 20 日) 基金份额总额	178,937,583.46	120,392,187.76	-
本报告期基金总申 购份额	398,893,022.31	552,096,525.15	61,894,907.08
减：本报告期基金 总赎回份额	142,932,125.93	372,871,177.93	58,531,621.49
本报告期基金拆分 变动份额	-	-	-
本报告期期末基金 份额总额	434,898,479.84	299,617,534.98	3,363,285.59

注：中银沪深 300 指数增强 E 于 2024 年 7 月 12 日生效。

## 10.2 中银量化价值混合型证券投资基金

(报告期：2024年1月1日-2024年3月19日)

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	170,766,173.35	36,858,056.09
本报告期基金总申购份额	8,683,718.60	110,721,765.87
减：本报告期基金总赎回 份额	512,308.49	27,187,634.20
本报告期基金拆分变动份 额	-	-
本报告期期末基金份额总 额	178,937,583.46	120,392,187.76

注：中银量化价值混合 C 于 2020 年 11 月 06 日生效。

## §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金召开基金份额持有人大会于 2024 年 3 月 12 日表决通过了《关于中银量化价值混合型证券投资基金转型的议案》，详细信息请见相关公告。

### 11.2 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，欧阳向军先生因退休不再担任督察长，执行总裁张家文代为履职，详情请参见基金管理人 2024 年 8 月 19 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。

### 11.3 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。

### 11.4 基金投资策略的改变

2024 年 3 月 20 日原“中银量化价值混合型证券投资基金”转型为“中银沪深 300 指数增强型证券投资基金”。中银沪深 300 指数增强型证券投资基金投资策略详见 2024 年 3 月 19 日刊登在本公司网站的《中银沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内改聘容诚会计师事务所（特殊普通合伙）为基金审计的会计师事务所，报告期内本基金应支付给会计师事务所的报酬为 35,000.00 元，目前事务所已为本基金提供审计服务的连续年限为 1 年。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.1 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。

#### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到监管部门的稽查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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

##### 11.7.1.1 中银沪深 300 指数增强型证券投资基金

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	占当期佣金总量的比例	备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例			
国信证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-

光大证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	1	915,273,072.02	20.74%	170,138.18	16.42%	-
长江证券	2	904,222,876.89	20.49%	168,097.89	16.23%	-
天风证券	2	900,059,874.72	20.39%	382,687.88	36.94%	-
兴业证券	3	821,969,359.62	18.62%	152,799.71	14.75%	-
申万宏源证券	2	442,971,821.34	10.04%	82,347.34	7.95%	-
广发证券	2	429,331,824.04	9.73%	79,813.67	7.70%	-

注：1、研究部根据相关标准，遴选符合条件的证券公司，详细说明评价依据及入库理由后提出建议，报公司投资决策委员会审议同意，形成公司合作券商库；选择合作券商的标准如下：（1）能全面贯彻落实中央金融工作会议精神和国务院发布的《关于加强监管防范风险推动资本市场高质量发展的若干意见》（国发<2024>10号），坚守资本市场工作的政治性和人民性，在服务国家重大战略和推动经济社会高质量发展中实现资本市场稳定健康发展；（2）严格遵守国家法律法规和监管规定，建立完善的内控管理体系和有效的风险隔离制度，合法合规经营；（3）公司财务状况良好；（4）上市证券公司优先；（5）最近一年未受到暂停开展证券投资咨询业务的监管处罚；（6）应有专门的对买方机构提供研究服务的研究部门，研究领域全面，研究实力行业排名前列，研究工作流程规范，研究服务意识强，有专门的交易单元；（7）证券交易服务能力强，能够提供安全、便捷、优质的证券交易服务。

2、合作券商库形成后，应保持动态维护：（1）定期调整。每年应至少重检一次，研究部负责全面重新评估本年度合作券商库，根据以上标准进行评估，并报公司投资决策委员会审议同意。（2）不定期调整。年内如库中证券公司发生不宜合作的重大事件（如重大合规风险事件或重大经营变化、重大人员调整），研究部应及时报公司投资决策委员会审议同意后将该券商剔除出库；年内确有必要在库中调整合作券商的，研究部亦需详细说明理由，报公司投资决策委员会审议同意后方可入库。

3、证券交易单元的租用及变更：所有新租用的交易单元必须从合作券商库中选择；当需要租用新交易单元时，交易部负责发起申请，经相关部门及领导审批同意方可执行，需详细说明新增交易单元的理由，申请通过后，由交易部牵头与证券公司签署《交易单元租用协议》，首次签约的证券公司还须同时签订《研究服务协议》。研究部等投研相关部门可根据证券公司对公司投资研究的服务情况和合作意向，发起交易单元增加、更换或终止的申请；交易部可根据每季度证券公司交易单元实际交易量，发起交易单元的增加、更换或终止的申请；经相关部门及领导审批同意后，由交易部牵头办理交易单元增加、更换或终止的相关手续，并及时通知基金运营部。

4、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：新增兴业证券上海交易单元一个，广发证券深圳交易单元一个；退租兴业证券和国泰君安证券上海、深圳交易单元各一个。

5、本报告证券交易及佣金支付统计区间为 2024 年 3 月 20 日-2024 年 12 月 31 日。

## 11.7.1.2 中银量化价值混合型证券投资基金

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	
国信证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
中信证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	450,098,372.97	100.00%	199,226.13	100.00%	-

注：1、研究部根据相关标准，遴选符合条件的证券公司，详细说明评价依据及入库理由后提出建议，报公司投资决策委员会审议同意，形成公司合作券商库；选择合作券商的标准如下：（1）能全面贯彻落实中央金融工作会议精神和国务院发布的《关于加强监管防范风险推动资本市场高质量发展的若干意见》（国发<2024>10 号），坚守资本市场工作的政治性和人民性，在服务国家重大战略和推动经济社会高质量发展中实现资本市场稳定健康发展；（2）严格遵守国家法律法规和监管规定，建立完善的内控管理体系和有效的风险隔离制度，合法合规经营；（3）公司财务状况良好；（4）上市证券公司优先；（5）最近一年未受到暂停开展证券投资咨询业务的监管处罚；（6）应有专门的对买方机构提供研究服务的研究部门，研究领域全面，研究实力行业排名前列，研究工作流程规范，研究服务意识强，有专门的交易单元；（7）证券交易服务能力强，能够提供安全、便捷、优质的证券交易服务。

2、合作券商库形成后，应保持动态维护：（1）定期调整。每年应至少重检一次，研究部负责全面重新评估本年度合作券商库，根据以上标准进行评估，并报公司投资决策委员会审议同意。（2）不定期调整。年内如库中证券公司发生不宜合作的重大事件（如重大合规风险事件或重大经营变化、重大人员调整），研究部应及时报公司投资决策委员会审议同意后将该券商剔除出库；年内确有必

要在库中调整合作券商的，研究部亦需详细说明理由，报公司投资决策委员会审议同意后方可入库。

3、证券交易单元的租用及变更：所有新租用的交易单元必须从合作券商库中选择；当需要租用新交易单元时，交易部负责发起申请，经相关部门及领导审批同意方可执行，需详细说明新增交易单元的理由，申请通过后，由交易部牵头与证券公司签署《交易单元租用协议》，首次签约的证券公司还须同时签订《研究服务协议》。研究部等投研相关部门可根据证券公司对公司投资研究的服务情况和合作意向，发起交易单元增加、更换或终止的申请；交易部可根据每季度证券公司交易单元实际交易量，发起交易单元的增加、更换或终止的申请；经相关部门及领导审批同意后，由交易部牵头办理交易单元增加、更换或终止的相关手续，并及时通知基金运营部。

4、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：无。

5、本报告证券交易及佣金支付统计区间为 2024 年 1 月 1 日-2024 年 3 月 19 日。

### 11.8 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	中银量化价值混合型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2024-01-19
2	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	2024-02-02
3	中银基金管理有限公司关于以通讯方式召开中银量化价值混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告	中国证监会规定媒介	2024-02-08
4	中银基金管理有限公司关于以通讯方式召开中银量化价值混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	中国证监会规定媒介	2024-02-19
5	中银基金管理有限公司关于以通讯方式召开中银量化价值混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	中国证监会规定媒介	2024-02-20
6	中银量化价值混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效及决议生效后的基金转型安排的公告	中国证监会规定媒介	2024-03-13
7	中银基金管理有限公司关于旗下部分基金开通转换业务的公告	中国证监会规定媒介	2024-03-19
8	中银沪深 300 指数增强型证券投资基金基金开放日常申购、赎回、转换及定期定额投资业务公告	中国证监会规定媒介	2024-03-19
9	中银沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同	中国证监会规定媒介	2024-03-19
10	中银沪深 300 指数增强型证券投资基金托管协议	中国证监会规定媒介	2024-03-19
11	关于中银量化价值混合型证券投资基金转型为中银沪深 300 指数增强型证券投资基金的提示性公告	中国证监会规定媒介	2024-03-19
12	中银沪深 300 指数增强型证券投资基金招募说明书	中国证监会规定媒介	2024-03-20
13	中银沪深 300 指数增强型证券投资基金（中银	中国证监会规定媒介	2024-03-20

	沪深 300 指数增强 C) 产品资料概要更新		
14	中银沪深 300 指数增强型证券投资基金(中银沪深 300 指数增强 A) 产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2024-03-20
15	中银量化价值混合型证券投资基金 2023 年年度报告	中国证监会规定媒介	2024-03-29
16	中银沪深 300 指数增强型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2024-04-19
17	中银基金管理有限公司关于更新旗下公募基金风险等级的公告	中国证监会规定媒介	2024-05-10
18	中银沪深 300 指数增强型证券投资基金(中银沪深 300 指数增强 A) 产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2024-06-26
19	中银沪深 300 指数增强型证券投资基金(中银沪深 300 指数增强 C) 产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2024-06-26
20	中银沪深 300 指数增强型证券投资基金更新招募说明书(2024 年第 1 号)	中国证监会规定媒介	2024-06-26
21	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	2024-06-28
22	中银沪深 300 指数增强型证券投资基金托管协议	中国证监会规定媒介	2024-07-12
23	中银沪深 300 指数增强型证券投资基金更新招募说明书(2024 年第 2 号)	中国证监会规定媒介	2024-07-12
24	中银沪深 300 指数增强型证券投资基金(中银沪深 300 指数增强 E) 基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2024-07-12
25	中银沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同	中国证监会规定媒介	2024-07-12
26	中银基金管理有限公司关于中银沪深 300 指数增强型证券投资基金增加 E 类基金份额并修改基金合同的公告	中国证监会规定媒介	2024-07-12
27	中银沪深 300 指数增强型证券投资基金(中银沪深 300 指数增强 C) 基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2024-07-12
28	中银沪深 300 指数增强型证券投资基金(中银沪深 300 指数增强 A) 基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2024-07-12
29	中银沪深 300 指数增强型证券投资基金 2024 年第 2 季度报告	中国证监会规定媒介	2024-07-18
30	中银基金管理有限公司关于旗下部分基金开通转换业务的公告	中国证监会规定媒介	2024-07-29
31	中银基金管理有限公司关于旗下部分基金开通转换业务的公告	中国证监会规定媒介	2024-08-09
32	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	2024-08-19
33	中银沪深 300 指数增强型证券投资基金 2024 年中期报告	中国证监会规定媒介	2024-08-31
34	中银基金管理有限公司关于旗下部分基金估值方法变更的提示性公告	中国证监会规定媒介	2024-09-26
35	中银基金管理有限公司关于旗下部分基金开通转换业务的公告	中国证监会规定媒介	2024-10-21
36	中银沪深 300 指数增强型证券投资基金 2024 年第 3 季度报告	中国证监会规定媒介	2024-10-24
37	中银基金管理有限公司关于注销西南分公司的公告	中国证监会规定媒介	2024-11-09
38	中银基金管理有限公司澄清公告	中国证监会规定媒介	2024-12-06

39	中银基金管理有限公司关于旗下部分基金改聘会计师事务所公告	中国证监会规定媒介	2024-12-07
40	中银基金管理有限公司关于旗下部分基金开通转换业务的公告	中国证监会规定媒介	2024-12-13
41	中银基金管理有限公司华东分公司成立公告	中国证监会规定媒介	2024-12-18

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 中银沪深 300 指数增强型证券投资基金

#### 12.1.1 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	20241127-20241231	-	179,034,106.17	-	179,034,106.17	24.2633%
	2	20240320-20240623	70,060,378.04	122,175,313.14	55,000,000.00	137,235,691.18	18.5987%
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。

### 12.2 中银量化价值混合型证券投资基金

#### 12.2.1 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	20240101-20240207	49,631,333.04	-	-	49,631,333.04	16.5808%
	2	20240101-20240207	50,446,080.49	-	-	50,446,080.49	16.8530%
	3	20240227-20240319	-	70,060,378.04	0.00	70,060,378.04	23.4058%
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。

## §13 备查文件目录

### 13.1 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变更注册为中银沪深 300 指数增强型证券投资基金的文件；
- 2、《中银沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《中银沪深 300 指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 4、关于申请中银量化价值混合型证券投资基金变更注册为中银沪深 300 指数增强型证券投资基金之法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、中国证监会要求的其他文件

### 13.2 存放地点

以上备查文件存放在基金管理人、基金托管人所在地，供公众查阅。

### 13.3 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。

二〇二五年三月三十一日