

# 中银新回报灵活配置混合型证券投资基金

## 2023 年第 3 季度报告

### 2023 年 9 月 30 日

基金管理人：中银基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年十月二十四日

## §1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 10 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	中银新回报混合	
基金主代码	000190	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 7 月 17 日	
报告期末基金份额总额	1,231,701,332.29 份	
投资目标	本基金通过对不同资产类别的动态配置以及个券精选，在严格控制风险的基础上，力争实现基金资产的长期稳健增值。	
投资策略	本基金基于自上而下、定性和定量相结合的宏观及市场分析，判断各大类资产的市场趋势和预期风险收益，动态调整大类资产配置比例，在此基础上，自下而上精选个券构建投资组合，并适时动态地调整优化。	
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50%+中债综合指数收益率×45%+银行活期存款利率（税后）×5%	
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。	
基金管理人	中银基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	中银新回报混合 A	中银新回报混合 C
下属两级基金的交易代码	000190	010172
报告期末下属两级基金的份额总额	1,229,615,095.46 份	2,086,236.83 份

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2023 年 7 月 1 日-2023 年 9 月 30 日)	
	中银新回报混合 A	中银新回报混合 C
1.本期已实现收益	-4,121,383.55	-10,233.46
2.本期利润	-8,823,577.85	-17,944.53
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0069	-0.0084
4.期末基金资产净值	2,014,728,607.30	3,379,385.49
5.期末基金份额净值	1.639	1.620

注：1、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。

2、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。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 本报告期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

###### 1、中银新回报混合 A：

阶段	净值增长率 ①	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	-0.43%	0.12%	-1.93%	0.45%	1.50%	-0.33%
过去六个月	-0.43%	0.15%	-4.04%	0.43%	3.61%	-0.28%
过去一年	-2.61%	0.16%	-0.93%	0.49%	-1.68%	-0.33%
过去三年	-1.80%	0.23%	-7.38%	0.56%	5.58%	-0.33%
过去五年	25.21%	0.29%	9.66%	0.62%	15.55%	-0.33%
自基金合同 生效日起	49.00%	0.26%	3.87%	0.65%	45.13%	-0.39%

###### 2、中银新回报混合 C：

阶段	净值增长率 ①	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	-0.55%	0.12%	-1.93%	0.45%	1.38%	-0.33%
过去六个月	-0.61%	0.15%	-4.04%	0.43%	3.43%	-0.28%
过去一年	-2.99%	0.16%	-0.93%	0.49%	-2.06%	-0.33%
过去三年	-2.99%	0.23%	-7.38%	0.56%	4.39%	-0.33%
自基金合同 生效日起	-3.34%	0.23%	-9.18%	0.56%	5.84%	-0.33%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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

中银新回报灵活配置混合型证券投资基金  
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  
(2015 年 7 月 17 日至 2023 年 9 月 30 日)

#### 1. 中银新回报混合 A:



#### 2. 中银新回报混合 C:



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

## §4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李建	基金经理	2015-07-17	-	26	中银基金管理有限公司投资总监（权益）、权益投资部总经理，董事总经理(MD)，经济学学士。曾任联合证券有限责任公司固定收益研究员，恒泰证券有限责任公司固定收益研究员，上海远东证券有限公司投资经理。2005 年加入中银基金管理有限公司，2007 年 8 月至 2011 年 3 月任中银货币基金基金经理，2008 年 11 月至 2014 年 3 月任中银增利基金基金经理，2010 年 11 月至 2012 年 6 月任中银双利基金基金经理，2011 年 6 月至 2022 年 11 月任中银转债基金基金经理，2012 年 9 月至 2020 年 5 月任中银稳健策略（原中银保本）基金基金经理，2013 年 9 月至今任中银新回报基金（原中银保本二号）基金经理，2014 年 3 月至今任中银多策略混合基金基金经理，2014 年 6 月至 2015 年 6 月任中银聚利分级债券基金基金经理，2015 年 1 月至今任中银恒利基

					金基金经理，2018 年 9 月至今任中银双息回报基金基金经理，2020 年 6 月至今任中银顺兴回报基金基金经理，2021 年 1 月至 2023 年 5 月任中银顺泽回报基金基金经理，2021 年 11 月至 2023 年 3 月任中银兴利稳健回报基金基金经理。具备基金、证券、期货和银行间债券交易员从业资格。
赵志华	基金经理	2023-07-25	-	18	中银基金管理有限公司助理副总裁（AVP），金融工程博士。曾任华泰证券金融创新部量化投资经理，资产管理总部投资主办。2011 年加入中银基金管理有限公司，曾担任基金经理助理、专户投资经理。2015 年 7 月至 2018 年 2 月任中银优秀企业基金基金经理，2016 年 6 月至 2018 年 2 月任中银腾利基金基金经理，2016 年 11 月至 2019 年 10 月任中银研究精选基金基金经理，2016 年 12 月至今任中银量化精选基金基金经理，2017 年 11 月至今任中银量化价值基金基金经理，2023 年 7 月至今任中银新回报基金（原中银保本二号）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 报告期内本基金运作合规守信情况说明

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 公平交易专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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。

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，本报告期内未发生异常交易行为。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未发现异常交易行为。

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

## 4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

### 1. 宏观经济分析

国外经济方面，三季度全球发达国家通胀有所反复，货币政策收紧节奏趋缓，经济表现不一。美国经济基本面有所修复，通胀水平抬升，8 月 CPI 同比较 6 月抬升 0.7 个百分点至 3.7%，就业市场维持偏紧状态，9 月失业率较 6 月上行 0.2 个百分点至 3.8%，9 月制造业 PMI 较 6 月回升 3.0 个百分点至 49.0%，9 月服务业 PMI 较 6 月回落 0.3 个百分点至 53.6%。美联储 7 月加息 25bps，

9 月再度暂停加息，但点阵图显示美联储预期年内可能还有一次 25bps 的加息。欧元区经济动能趋弱，8 月失业率较 6 月持平于 5.90%，9 月制造业 PMI 较 6 月持平于 43.4%，9 月服务业 PMI 较 6 月回落 3.3 个百分点至 48.7%，欧央行 8 月、9 月各加息 25bps。日本央行 7 月上调 YCC 上限，经济表现边际趋弱，通胀水平相对稳定，8 月 CPI 同比较 6 月回落 0.1 个百分点至 3.2%，9 月制造业 PMI 较 6 月回落 1.3 个百分点至 48.5%，9 月服务业 PMI 较 6 月回落 0.2 个百分点至 53.8%。综合来看，全球通胀整体回落不过仍有所反复，主要经济体央行货币政策可能会继续维持收紧状态，年内或难以看到政策转向。

国内经济方面，国内经济数据整体仍偏弱，但经济动能环比略有回暖，PPI 与 CPI 通胀低位回升。具体来看，三季度领先指标中采制造业 PMI 逐步回升至荣枯线上方，9 月值较 6 月值回升 1.2 个百分点至 50.2%，同步指标工业增加值 8 月同比增长 4.50%，较 6 月回升 0.1 个百分点。从经济增长动力来看，出口增速降幅收窄，消费同比增速有所回升，投资增速小幅回落：8 月美元计价出口增速较 6 月回升 3.6 个百分点至 -8.8%，8 月社会消费品零售总额增速较 6 月低位小幅回升 1.5 个百分点至 4.6%，基建投资有所放缓，制造业投资低位回升，房地产投资延续负增长，1-8 月固定资产投资增速较 1-6 月回落 0.6 个百分点至 3.2% 的水平。通胀方面，CPI 低位企稳，8 月同比增速从 6 月的 0.0% 小幅回升 0.1 个百分点至 0.1%，PPI 降幅收窄，8 月同比增速从 6 月的 -5.4% 回升 2.4 个百分点至 -3.0%。

## 2. 市场回顾

债券市场方面，三季度债市收益率涨跌互现，但考虑票息收益后整体收涨。其中，三季度中债总财富指数上涨 0.62%，中债银行间国债财富指数上涨 0.60%，中债企业债总财富指数上涨 1.19%。在收益率曲线上，三季度收益率曲线有所抬升。其中，三季度 10 年期国债收益率从 2.635% 上行 4bp 至 2.675%，10 年期金融债（国开）收益率从 2.77% 下行 3bp 至 2.74%。货币市场方面，央行于 2023 年 8 月中旬调降 OMO 操作利率 10bp、MLF 操作利率 15bp，于 9 月中旬降准 25bp，公开市场超额续作 MLF 且在跨月、跨季时期增量投放逆回购，不过受政府债券发行提速、银行信贷再度发力等因素影响，银行间资金面趋于紧平衡，资金价格涨跌不一，其中，三季度银行间 1 天回购加权平均利率均值在 1.71% 左右，较上季度均值上行 12bp，银行间 7 天回购利率均值在 2.01% 左右，较上季度均值下行 14bp。

可转债方面，三季度中证转债指数下跌 0.52%。权益市场震荡收跌，转债估值相对波澜不惊。

股票市场方面，三季度上证综指收跌 2.86%，代表大盘股表现的沪深 300 指数收跌 3.98%，中小板综合指数收跌 7.42%，创业板综合指数收跌 8.25%。



### 3. 运行分析

三季度权益市场震荡收跌，债券市场各品种上涨为主，本基金三季度根据市场状况小幅调降了权益仓位，整体仍以公用事业、食品饮料、金融等为主要配置方向，减持了部分计算机类个股，并积极参与一级市场新股申购；债券方面，仍以票息策略把握绝对收益为主，借此提升基金的业绩表现。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金 A 类份额净值增长率为-0.43%，同期业绩比较基准收益率为-1.93%。

报告期内，本基金 C 类份额净值增长率为-0.55%，同期业绩比较基准收益率为-1.93%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	316,486,268.60	11.54
	其中：股票	316,486,268.60	11.54
2	固定收益投资	2,356,745,495.05	85.91
	其中：债券	2,356,745,495.05	85.91
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	64,940,467.31	2.37
7	其他各项资产	5,088,720.74	0.19
8	合计	2,743,260,951.70	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。

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.2.1 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	26,112,172.00	1.29
C	制造业	150,008,440.92	7.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	46,867,276.13	2.32
E	建筑业	11,369.83	0.00
F	批发和零售业	63,735.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	1,118,880.00	0.06
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,239,344.82	0.51
J	金融业	82,001,698.06	4.06
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	32,809.24	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	9,357.14	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	21,185.46	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	316,486,268.60	15.68

### 5.2.2 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。

### 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002832	比音勒芬	1,479,949	49,770,684.87	2.47
2	600900	长江电力	1,491,384	33,168,380.16	1.64
3	601225	陕西煤业	843,500	15,571,010.00	0.77
4	603179	新泉股份	311,400	15,457,896.00	0.77
5	000921	海信家电	590,000	13,882,700.00	0.69
6	601998	中信银行	2,390,200	13,671,944.00	0.68
7	000568	泸州老窖	49,100	10,637,515.00	0.53
8	600028	中国石化	1,736,600	10,541,162.00	0.52
9	601658	邮储银行	2,119,000	10,531,430.00	0.52
10	601398	工商银行	2,227,900	10,426,572.00	0.52

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净
----	------	---------	--------

			值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	386,865,719.68	19.17
	其中：政策性金融债	121,234,112.02	6.01
4	企业债券	1,969,879,775.37	97.61
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	2,356,745,495.05	116.78

#### 5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	232380004	23 农行二级资本债 01A	1,300,000	133,737,052.46	6.63
2	115674	23 浦土 01	1,100,000	109,853,769.31	5.44
3	138910	23 中证 G2	1,000,000	101,756,202.74	5.04
4	115419	23 陆集 02	1,000,000	101,125,309.59	5.01
5	115448	23 中金 G3	1,000,000	100,885,978.08	5.00

#### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

#### 5.7 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。

#### 5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未参与股指期货投资。

##### 5.9.2 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。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 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。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未参与国债期货投资。

### 5.10.3 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。

## 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 2023 年 5 月 19 日，中信银行股份有限公司昆明分行因：一、部分分支机构基金销售业务负责人未取得基金从业资格。零售银行部（负责基金销售）部门负责人、合规管理人员未取得基金从业资格。二、分行由总部统一执行代销基金业务年度监察稽核工作，但总部 2020 年度、2021 年度个人代销基金业务监察稽核报告未见审核、发文留痕。三、2022 年上半年代销产品销售自查报告包含投资者适当性内容，但未见审核、发文留痕。四、基金销售业务反洗钱工作制度和相关落实情况未报备。被云南证监局采取责令改正的监督管理措施。

2023 年 5 月 25 日，邮储银行股份有限公司宁夏分行因：一、基金销售业务负责人未取得基金从业资格。违反了《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》(证监会令第 175 号,以下简称《监督管理办法》)第八条第(四)项的规定。二、存在未取得基金从业资格人员参与基金销售的情形。违反了《监督管理办法》第三十条第二款的规定。三、通过互联网等非现场方式向风险承受能力最低类别的投资者销售或者提供风险等级高于其风险承受能力的产品或者服务时未妥善留痕。违反了《证券期货投资者适当性管理办法》(证监会令第 202 号,以下简称《适当性管理办法》)第二十五条的规定。被宁夏证监局采取责令改正的行政监管措施。

2023 年 4 月 24 日，中国工商银行股份有限公司江西省分行在开展基金销售业务中，省分行及部分下辖分、支行存在基金销售业务部门负责人未取得基金从业资格、负责基金销售业务的部门取得基金从业资格的人员低于该部门员工人数的 1/2 等问题，被江西证监局采取责令改正措施的决

定。

2023 年 5 月 17 日，中国农业银行股份有限公司因烟台保税港区支行贷款业务管理不到位，被烟台银保监分局罚款 35 万元。

2023 年 2 月 10 日，中信证券股份有限公司因 1、未按规定履行客户身份识别义务；2、未按规定保存客户身份资料和交易记录；3、未按规定报送大额交易报告或者可疑交易报告，被中国人民银行罚款 1376 万元。

2022 年 11 月 29 日，中国国际金融股份有限公司因子公司中金前海(深圳)私募股权基金管理有限公司与中金前海(深圳)股权投资基金管理有限公司及管理的 15 只产品未按期完成整改,相关产品涉及底层项目较多,且产品间存在嵌套投资、交叉投资底层项目的复杂情况。违反了《证券公司监督管理条例》第二十七条第一款的规定。北京证监局对公司采取责令改正措施的决定。

2023 年 6 月 8 日，招商证券股份有限公司收到深圳证监局处罚文件，公司发布证券研究报告业务存在以下问题：一是市场影响评估机制不完善，对个别研究报告的市场影响力评估不充分，提级审核管理不到位。二是在分析师调研活动管理、服务客户、公开发表言论等方面的内控管理有效性不足。三是个别研报制作不审慎，存在内容表述不严谨、未注明引用信息、数据来源披露不当、研报署名不规范等情形。证监局决定对公司采取出具警示函的行政监管措施。

2023 年 6 月 16 日，海通证券因保荐核查工作履职尽责不到位以及保荐业务内部质量控制存在薄弱环节，被上海证券交易所予以监管警示。

2022 年 12 月 28 日，北京证监局官网披露了一则银河证券的罚单，指出银河证券存在的两点问题：一是对重点业务领域和关键岗位廉洁风险梳理不全面，未及时识别评估公募基金代销业务廉洁风险，未按要求持续跟踪报告廉洁从业风险事件；二是在适当性管理和融资融券业务开展中存在员工执业不规范的情况。基于上述问题，北京证监局对银河证券出具警示函的行政监管措施。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规、基金合同及公司投资制度的要求。基金管理人将密切跟踪相关进展，遵循价值投资的理念进行投资决策。报告期内，本基金投资的前十名证券的其余发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2 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。

### 5.11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	289,966.98

2	应收证券清算款	4,770,378.05
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	28,375.71
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	5,088,720.74

#### 5.11.4 报告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。

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 5.11.6 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。

### §6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中银新回报混合A	中银新回报混合C
本报告期期初基金份额总额	1,331,833,830.19	2,204,884.08
本报告期基金总申购份额	1,707,357.84	26,177.11
减：本报告期基金总赎回份额	103,926,092.57	144,824.36
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	1,229,615,095.46	2,086,236.83

### §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

#### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

#### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，基金管理人未运用固有资金申购、赎回或买卖本基金。

### §8 备查文件目录

#### 8.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予中银保本二号混合型证券投资基金变更注册的文件；
- 2、《中银新回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《中银新回报灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、关于申请中银保本二号混合型证券投资基金变更注册之法律意见书；
- 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。

### **8.2存放地点**

基金管理人和基金托管人的办公场所，部分文件同时登载于基金管理人互联网站。

### **8.3查阅方式**

投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

中银基金管理有限公司  
二〇二三年十月二十四日