中银证券优势制造股票型证券投资基金
2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：中银国际证券股份有限公司

基金托管人：浙商银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 31 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会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。 本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人浙商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 29 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 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2
1.1 重要提示 2
1.2 目录 3
§2 基金简介 5
2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 5
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6
§3 主要财务指标和基金净值表现 6
3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 7
3.3 其他指标 8
§4 管理人报告 9
4.1 基金管理人及基金经理情况 9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 13
§5 托管人报告 13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 13
§6 半年度财务会计报告（未经审计） 14
6.1 资产负债表 14
6.2 利润表 15
6.3 净资产变动表 16
6.4 报表附注 18
§7 投资组合报告 39
7.1 期末基金资产组合情况 39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 44
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 44
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 44

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 44
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 44
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 44
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 44
7.12 投资组合报告附注 44
§8 基金份额持有人信息 45
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 45
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 46
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 46
§9 开放式基金份额变动 46
§10 重大事件揭示 46
10.1 基金份额持有人大会决议 46
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 47
10.4 基金投资策略的改变 47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 47
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 47
10.8 其他重大事件 49
§11 影响投资者决策的其他重要信息 50
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 50
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 50
§12 备查文件目录 50
12.1 备查文件目录 50
12.2 存放地点 50
12.3 查阅方式 50

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中银证券优势制造股票型证券投资基金	
基金简称	中银证券优势制造股票	
基金主代码	011269	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 7 月 8 日	
基金管理人	中银国际证券股份有限公司	
基金托管人	浙商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	97,383,769.54 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中银证券优势制造股票 A	中银证券优势制造股票 C
下属分级基金的交易代码	011269	011270
报告期末下属分级基金的份额总额	73,958,226.41 份	23,425,543.13 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于优势制造主题相关的上市公司，在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金通过股票投资策略、存托凭证投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、股票期权投资策略，以实现基金资产的长期稳定增值。
业绩比较基准	申银万国制造业指数收益率*85%+中债综合全价指数收益率*15%
风险收益特征	本基金为股票型证券投资基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中银国际证券股份有限公司	浙商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	亓磊	朱巍
	联系电话	021-20328000	0571-87659806
	电子邮箱	gmkf@bocichina.com	zsyhzctgb@czbank.com
客户服务电话		021-61195566,400-620-8888	95527
传真		021-50372474	0571-88268688
注册地址		上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39F	杭州市萧山区鸿宁路 1788 号
办公地址		上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39F	杭州市拱墅区环城西路 76 号
邮政编码		200120	310006
法定代表人		宁敏	陆建强

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.bocifunds.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中银国际证券股份有限公司	上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)	
	中银证券优势制造股票 A	中银证券优势制造股票 C
本期已实现收益	-18,578,676.95	-6,451,822.83
本期利润	-14,894,513.18	-5,474,468.08
加权平均基金份额本期利润	-0.1940	-0.2053
本期加权平均净值利润率	-24.60%	-26.29%
本期基金份额净值增长率	-20.65%	-20.83%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	-19,426,677.23	-6,361,557.21
期末可供分配基金份额利润	-0.2627	-0.2716
期末基金资产净值	54,531,549.18	17,063,985.92
期末基金份额净值	0.7373	0.7284
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	

基金份额累计净值增长率	-26.27%	-27.16%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

3、期末可供分配利润是指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中银证券优势制造股票 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	-0.04%	1.76%	-3.10%	1.04%	3.06%	0.72%
过去三个月	-9.13%	1.76%	-4.67%	1.23%	-4.46%	0.53%
过去六个月	-20.65%	2.18%	-8.81%	1.55%	-11.84%	0.63%
过去一年	-34.97%	1.81%	-18.16%	1.28%	-16.81%	0.53%
自基金合同生效起至今	-26.27%	1.90%	-25.81%	1.28%	-0.46%	0.62%

中银证券优势制造股票 C

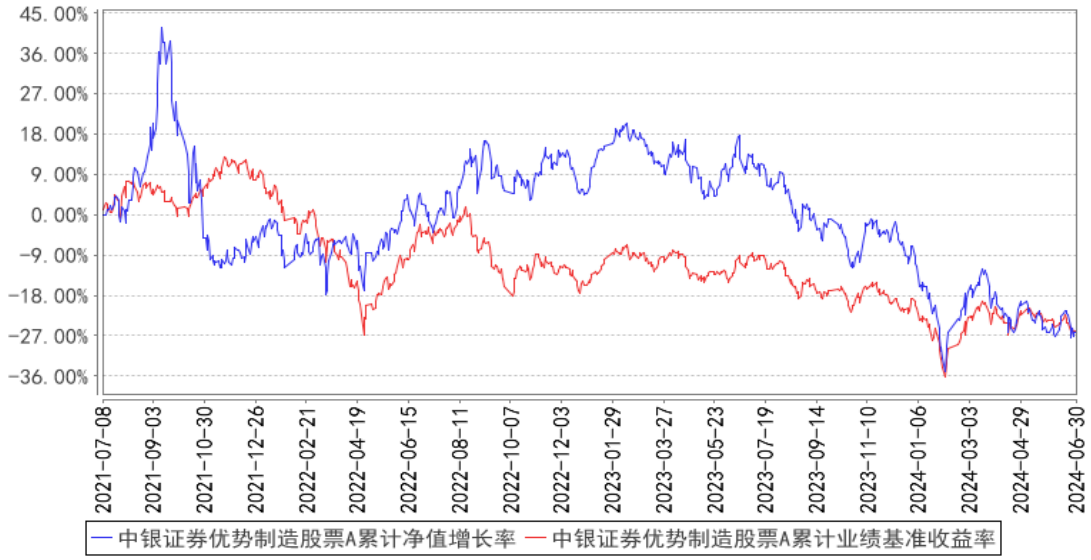
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	-0.08%	1.76%	-3.10%	1.04%	3.02%	0.72%
过去三个月	-9.22%	1.76%	-4.67%	1.23%	-4.55%	0.53%
过去六个月	-20.83%	2.18%	-8.81%	1.55%	-12.02%	0.63%
过去一年	-35.25%	1.81%	-18.16%	1.28%	-17.09%	0.53%

自基金合同生效起至今	-27.16%	1.90%	-25.81%	1.28%	-1.35%	0.62%

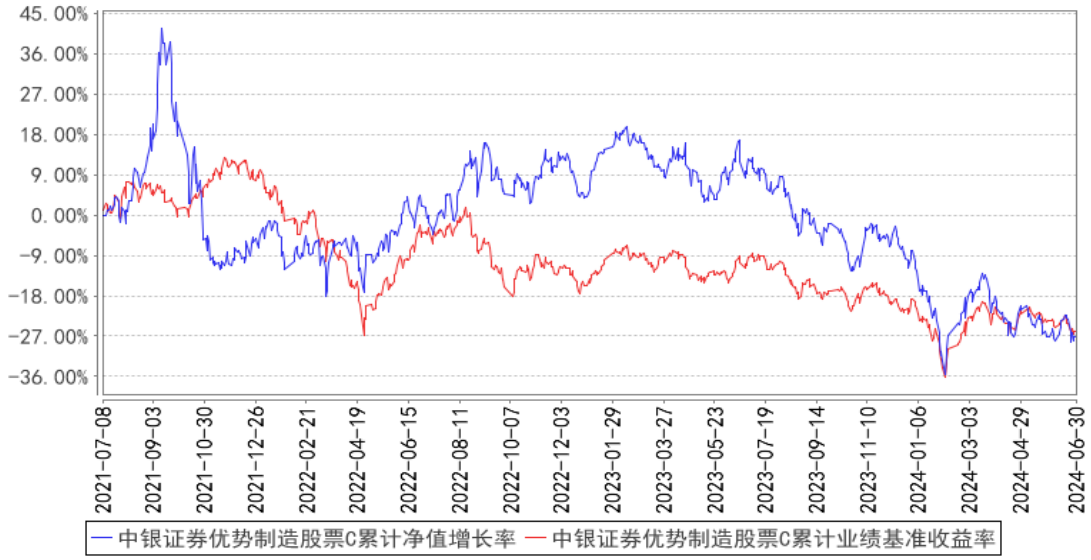
注：业绩比较基准收益率=申银万国制造业指数收益率*85%+中债综合全价指数收益率*15%。

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

中银证券优势制造股票A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



中银证券优势制造股票C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金合同于 2021 年 7 月 8 日生效。

3.3 其他指标

注：无。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中银国际证券股份有限公司(以下简称“中银证券”)经中国证监会批准于 2002 年 2 月 28 日在上海成立，注册资本 27.78 亿元人民币。截至 2024 年 3 月 31 日，前十名股东包括中银国际控股有限公司、中国石油集团资本有限责任公司、江西铜业股份有限公司、江苏洋河酒厂股份有限公司、中国通用技术（集团）控股有限责任公司、香港中央结算有限公司、中国建设银行股份有限公司－国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金、中国建设银行股份有限公司－华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金、井冈山郝乾企业管理中心（有限合伙）、中国农业银行股份有限公司－中证 500 交易型开放式指数证券投资基金。中银证券的经营范围包括：证券经纪;证券投资咨询;与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问;证券承销与保荐;证券自营;证券资产管理;证券投资基金代销;融资融券;代销金融产品;公开募集证券投资基金管理业务;为期货公司提供中间介绍业务。

截至 2024 年 6 月 30 日，本管理人共管理 45 只证券投资基金，包括：中银证券价值精选灵活配置混合型证券投资基金(原中银证券保本 1 号混合型证券投资基金)、中银证券健康产业灵活配置混合型证券投资基金、中银证券现金管家货币市场基金、中银证券安进债券型证券投资基金、中银证券安弘债券型证券投资基金、中银证券汇宇定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券聚瑞混合型证券投资基金、中银证券汇嘉定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券安誉债券型证券投资基金、中银证券汇享定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券新能源灵活配置混合型证券投资基金、中银证券安源债券型证券投资基金、中银证券中高等级债券型证券投资基金、中银证券安泽债券型证券投资基金、中银证券科技创新混合型证券投资基金（LOF)、中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、中银证券安沛债券型证券投资基金、中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中银证券汇远一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券汇兴一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券安泰债券型证券投资基金、中银证券优选行业龙头混合型证券投资基金、中银证券安汇三年定期开放债券型证券投资基金、中银证券创业板交易型开放式指数证券投资基金、中银证券鑫瑞 6 个月持有期混合型证券投资基金、中银证券精选行业股票型证券投资基金、中银证券汇福一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券均衡成长混合型证券投资基金、中银证券盈瑞混合型证券投资基金、中银证券优势制造股票型证券投资基金、中银证券安灏债券型证券投资基金、中银证券安业债券型证券投资基金、中银证券内需增长混合型证券投资基金、中银证券恒瑞 9 个月持有期混合型证

券投资基金、中银证券远见价值混合型证券投资基金、中银证券慧泽稳健 3 个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)、中银证券慧泽进取 3 个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)、中银证券慧泽平衡 3 个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)、中银证券安添 3 个月定期开放债券型证券投资基金、中银证券汇裕一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券优势成长混合型证券投资基金、中银证券凌瑞 6 个月持有期混合型证券投资基金、中银证券安澈债券型证券投资基金、中银证券中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、中银证券和瑞一年持有期混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张丽新	本基金的基金经理	2023 年 2 月 22 日	-	10 年	张丽新，硕士研究生，中国国籍，已取得证券、基金从业资格。曾任职于北京索爱电子有限公司、蓝竹电子设备股份有限公司；2013 年 7 月至 2014 年 2 月任职于安信证券股份有限公司，担任助理分析师；2014 年 3 月加入中银国际证券股份有限公司，现任中银证券新能源灵活配置混合型证券投资基金、中银证券优势制造股票型证券投资基金基金经理。

注：1、上述任职日期为根据公司确定的聘任日期，离任日期为根据公司确定的解聘日期；首任基金经理的任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的涵义遵从《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、基金合同以及其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了保证公司管理的不同投资组合得到公平对待，保护投资者合法权益，本基金管理人根据

《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规，建立了《资产管理业务公平交易管理办法》、《资产管理业务异常交易监控与报告管理办法》等公平交易相关制度体系。公司旗下投资组合严格按照制度的规定，参与股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，主要包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关环节。研究团队负责提供投资研究支持，投资团队负责投资决策，交易室负责实施交易并实时监控，投资监督团队负责事前监督、事中检查和事后稽核，对交易情况进行合理性分析。通过多部门的协作互控，保证了公平交易的可操作、可稽核和可持续。

公司一直严格遵循公平交易相关规章制度，执行严格的公平交易行为。在严格方针指导下，报告期内，未出现任何异常关联交易以及与禁止交易对手间的交易行为。

报告期内，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗口下（如：1 日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易开展交易价差分析。分析结果表明，本报告期内公司对各投资组合公平对待，不存在利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未发生同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量 5%的情况。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2024 年上半年，欧美去库存结束，海外需求较好，全球经济处于弱复苏状态，其中印度、东南亚等新兴国家表现较好，美国经济仍相对强韧，高科技发展表现亮眼，欧洲经济复苏较温和。美国对中国高科技限制以及强势制造业打压持续，贸易保护和壁垒问题增加，为全球化发展带来不确定性，但国际环境的压力对国内优势制造企业来说也是压力与机会并存。

对国内经济来说，中游制造业面临短期产能相对过剩、上游价格较高的压力，于此同时需求方面总体消费需求较弱，中游制造业发展压力较大。A 股市场在经济预期较弱和外部环境较差的情况下，市场信心不足，成长方向表现较弱，但是考虑到当前整体成长的估值水平以及发展前景，优选细分方向投资。本产品结合优势制造主题基金特点，综合考虑 2024 年经济发展趋势，优选 AI 和电子方向为主，增加成长加修复方向的新能源和医药方向。秉承一贯的投资理念，综合考虑成长性与估值性价比选择合适的投资标的，争取为持有人带来更好的回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末中银证券优势制造股票 A 基金份额净值为 0.7373 元，本报告期基金份额净值增长率为-20.65%；同期业绩比较基准收益率为-8.81%。截至本报告期末中银证券优势制造股票 C 基金份额净值为 0.7284 元，本报告期基金份额净值增长率为-20.83%；同期业绩比较基准收益率为-8.81%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后续，海外经济在下半年预计仍是弱复苏状态，美国大选的不确定性带来中美贸易格局的紧张，但是预计美国对中国高科技限制以及强势制造业打压的趋势不变，对国内优秀制造企业来说，寻求结构化发展是必经之路。经济结构转型是持续发展重点，侧重高质量发展，建立现代产业体系是我国经济发展的长期趋势。

维持看好中国制造业的发展韧性，沿着高质量发展趋势，展望 2024 年下半年的投资方向，本基金选择如下四个投资方向为主。

1. TMT 方向：

（1）AI 方向持续看好。海外 AI 算力投资高增，国内虽然在高端算力上受阻，但是也在积极发展国产算力。虽然 AI 应用还有待进一步落实，但是 AI 带来的变化值得预期。因此持续看好 AI 方向的投资机会。从细分方向上看，优先业绩率先落地的 AI 算力方向，其次是 AI 应用方向。

（2）电子方向侧重变化。本身周期见底，已有部分子方向开始出现涨价。需求方面叠加了 AI 手机和 AIPC 带来的换机可能，从横向和纵向方面都有机会。

（3）自主可控的半导体机会。

2. 医药方向：自主可控方向是中国高质量发展的重要一环，其中医药方向具备较大的投资机会，虽然年初以来，医药表现不佳，有政策余波影响，也有海外对国内的医药产业打压的因素，但是考虑到医药创新的重要性以及当前的估值情况，积极寻找医药方向的投资机会。

3. 电气设备：看好需求周期的电网设备机会，以及机器人和低空经济的主题机会。

4. 其他：包含一些大宗周期、教育等方向机会。

秉承一贯的投资理念，综合考虑成长性与估值性价比选择合适的投资标的，争取为持有人带来更好的回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益，设立了中银国际证券股份有限公司估值委员会（以下简

称“估值委员会”），制定了估值政策和估值程序。由公司领导担任主席，成员由资产管理板块负责人、基金管理部、信评与投资监督部、运营管理总部、内控与法律合规部、风险管理部等部门负责人组成。估值委员会成员均具有专业工作经历，具备良好的专业经验和专业胜任能力，具有绝对的独立性。估值委员会的职责主要包括有：保证基金估值的公平、合理；制订健全、有效的估值政策和程序；确保对投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性；定期对估值政策和程序进行评价等。

参与估值流程的各方还包括本基金托管银行和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管银行有责任要求基金管理人作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金在本报告期内未进行收益分配。

本基金将严格按照法律法规及基金合同约定进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金报告期内不存在连续二十个工作日基金持有人数低于 200 人或基金资产净值低于 5000 万元的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人——中银国际证券股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对中银国际证券股份有限公司编制和披露的中银证券优势制造股票型证券投资

基金 2024 年中期报告中财务指标、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进行了复核，以上内容真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中银证券优势制造股票型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	5,630,327.36	7,358,903.17
结算备付金		339,296.49	258,647.49
存出保证金		69,756.42	76,164.42
交易性金融资产	6.4.7.2	66,720,344.35	93,610,834.36
其中：股票投资		66,720,344.35	93,610,834.36
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	28,971.36
应收股利		-	-
应收申购款		121,233.01	212,718.59
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		72,880,957.63	101,546,239.39
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2024 年 6 月 30 日**	**上年度末 2023 年 12 月 31 日**
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-

卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		648,715.19	284,341.68
应付赎回款		456,584.44	251,641.88
应付管理人报酬		72,725.79	103,794.50
应付托管费		12,120.97	17,299.09
应付销售服务费		5,913.14	9,382.10
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	89,363.00	215,670.73
负债合计		1,285,422.53	882,129.98
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	97,383,769.54	108,623,592.41
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-25,788,234.44	-7,959,483.00
净资产合计		71,595,535.10	100,664,109.41
负债和净资产总计		72,880,957.63	101,546,239.39

注： 报告截止日 2024 年 06 月 30 日,基金份额总额 97,383,769.54 份，其中中银证券优势制造股票 A 基金份额总额 73,958,226.41 份，基金份额净值 0.7373 元。中银证券优势制造股票 C 基金份额总额 23,425,543.13 份， 基金份额净值 0.7284 元。

6.2 利润表

会计主体：中银证券优势制造股票型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-19,700,564.73	13,765,512.52
1.利息收入		9,084.14	37,985.53
其中：存款利息收入	6.4.7.13	9,084.14	37,985.53
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）		-24,400,351.34	10,085,289.63
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-24,648,926.92	9,107,788.31
基金投资收益		-	-

债券投资收益	6.4.7.15	-	395,989.34
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	248,575.58	581,511.98
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	4,661,518.52	3,118,170.38
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	29,183.95	524,066.98
减：二、营业总支出		668,416.53	1,801,911.37
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	484,635.44	1,385,093.04
其中：暂估管理人报酬		-	-
2．托管费	6.4.10.2.2	80,772.53	184,679.04
3．销售服务费	6.4.10.2.3	41,308.46	161,275.04
4．投资顾问费		-	-
5．利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6．信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7．税金及附加		-	0.79
8．其他费用	6.4.7.23	61,700.10	70,863.46
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-20,368,981.26	11,963,601.15
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-20,368,981.26	11,963,601.15
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-20,368,981.26	11,963,601.15

6.3 净资产变动表

会计主体：中银证券优势制造股票型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	108,623,592.41	-	-7,959,483.00	100,664,109.41
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	108,623,592.41	-	-7,959,483.00	100,664,109.41
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-11,239,822.87	-	-17,828,751.44	-29,068,574.31
（一）、综合收益总额	-	-	-20,368,981.26	-20,368,981.26
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-11,239,822.87	-	2,540,229.82	-8,699,593.05
其中：1.基金申购款	14,662,988.12	-	-3,127,992.83	11,534,995.29
2.基金赎回款	-25,902,810.99	-	5,668,222.65	-20,234,588.34
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	97,383,769.54	-	-25,788,234.44	71,595,535.10
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	183,413,313.73	-	7,961,359.37	191,374,673.10
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	183,413,313.73	-	7,961,359.37	191,374,673.10
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-65,486,225.22	-	7,526,607.37	-57,959,617.85
(一)、综合收益总额	-	-	11,963,601.15	11,963,601.15
(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)	-65,486,225.22	-	-4,436,993.78	-69,923,219.00
其中：1.基金申购款	191,244,618.81	-	31,385,043.11	222,629,661.92
2.基金赎回款	-256,730,844.03	-	-35,822,036.89	-292,552,880.92
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	117,927,088.51	-	15,487,966.74	133,415,055.25

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

周冰	沈锋	戴景义
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中银证券优势制造股票型证券投资基金(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[2020]3629 号《关于准予中银证券优势制造股票型证券投资基金注册的批复》核准，由中银国际证券股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》

和《中银证券优势制造股票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基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 316,050,683.21 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2021)第 0674 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《中银证券优势制造股票型证券投资基金基金合同》于 2021 年 7 月 8 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 316,217,765.16 份基金份额，其中认购资金利息折合 167,081.95 份基金份额。本基金的基金管理人为中银国际证券股份有限公司，基金托管人为浙商银行股份有限公司(以下简称“浙商银行”)。

根据《中银证券优势制造股票型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金根据认购、申购费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购时收取认购、申购费用，在赎回时收取赎回费，不从本类别基金资产中计提销售服务费的称为 A 类基金份额；在投资者认购、申购时不收取认购、申购费用，但赎回时收取赎回费，从本类别基金资产中计提销售服务费的称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 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别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中银证券优势制造股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证)、债券(包括国债、地方政府债券、金融债券、企业债券、公司债券、中央银行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持债券、政府支持机构债券、可转换债券、可分离交易可转债、可交换债券等)、债券回购、资产支持证券、同业存单、银行存款(包含协议存款、通知存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、股指期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为：本基金股票投资的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于基金界定的优势制造主题相关的股票不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终，在扣除股指期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。业绩比较基准为：申银万国制造业指数收益率×85%+中债综合全价指数收益率×15%。

本财务报表由本基金的基金管理人中银国际证券股份有限公司于 2024 年 8 月 30 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则－基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(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》、《中银证券优势制造股票型证券投资基金基金合同》和其他中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日止期间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 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税

[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	5,630,327.36
等于：本金	5,630,061.83
加：应计利息	265.53
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-

加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	5,630,327.36

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2024 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		68,504,260.81	-	66,720,344.35	-1,783,916.46
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		68,504,260.81	-	66,720,344.35	-1,783,916.46

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金本报告期末未持有期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间未计提买入返售金融资产减值准备。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

注：无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	138.44
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	34,524.46
其中：交易所市场	34,524.46
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	54,700.10
合计	89,363.00

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

中银证券优势制造股票 A

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	79,114,274.71	79,114,274.71
本期申购	9,236,684.33	9,236,684.33
本期赎回（以“-”号填列）	-14,392,732.63	-14,392,732.63
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	73,958,226.41	73,958,226.41

中银证券优势制造股票 C

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	29,509,317.70	29,509,317.70
本期申购	5,426,303.79	5,426,303.79
本期赎回（以“-”号填列）	-11,510,078.36	-11,510,078.36
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	23,425,543.13	23,425,543.13

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期内无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

中银证券优势制造股票 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,177,329.47	-6,778,247.92	-5,600,918.45
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	1,177,329.47	-6,778,247.92	-5,600,918.45
本期利润	-18,578,676.95	3,684,163.77	-14,894,513.18
本期基金份额交易产生的变动数	723,226.90	345,527.50	1,068,754.40
其中：基金申购款	-1,007,251.33	-1,002,195.84	-2,009,447.17
基金赎回款	1,730,478.23	1,347,723.34	3,078,201.57

本期已分配利润	-	-	-
本期末	-16,678,120.58	-2,748,556.65	-19,426,677.23

中银证券优势制造股票 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	154,534.70	-2,513,099.25	-2,358,564.55
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	154,534.70	-2,513,099.25	-2,358,564.55
本期利润	-6,451,822.83	977,354.75	-5,474,468.08
本期基金份额交易产生的变动数	807,798.77	663,676.65	1,471,475.42
其中：基金申购款	-601,404.15	-517,141.51	-1,118,545.66
基金赎回款	1,409,202.92	1,180,818.16	2,590,021.08
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-5,489,489.36	-872,067.85	-6,361,557.21

6.4.7.13 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 6 月 30 日
活期存款利息收入	5,624.01
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	2,918.09
其他	542.04
合计	9,084.14

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-24,648,926.92
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	-24,648,926.92

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

卖出股票成交总额	277,330,655.76
减：卖出股票成本总额	301,397,696.65
减：交易费用	581,886.03
买卖股票差价收入	-24,648,926.92

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益-证券出借差价收入。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益-买卖债券差价收入。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益-赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益-申购差价收入。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益-买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益-赎回差价收入。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益-申购差价收入。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益-买卖贵金属差价收入。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益-赎回差价收入。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益-申购差价收入。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内无衍生工具收益-买卖权证差价收入。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期内无衍生工具收益-其他投资收益。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	248,575.58
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	248,575.58

6.4.7.20 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 6 月 30 日
1.交易性金融资产	4,661,518.52
股票投资	4,661,518.52
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2.衍生工具	-
权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	4,661,518.52

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	21,588.57
基金转换费收入	7,595.38
合计	29,183.95

6.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	9,918.54
信息披露费	39,781.56
证券出借违约金	-
账户维护费	12,000.00
合计	61,700.10

6.4.7.24 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

无。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中银国际证券股份有限公司（“中银证券”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
浙商银行股份有限公司（“浙商银行”）	基金托管人、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	中银国际控股有限公司（基金管理人股东）的控股股东、基金销售机构

注：下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
中银证券	547,176,343.88	100.00	1,133,497,490.56	100.00

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）
中银证券	-	-	2,024,076.89	100.00

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
中银证券	408,138.91	100.00	34,524.46	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
中银证券	828,932.55	100.00	90,908.00	100.00

注：1、上述佣金以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。2024 年 6 月 30 日起证券交易佣金费率水平按照中国证券监督管理委员会于 2024 年 4 月 19 日制定发布的《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》相关要求执行；

2. 因我司属于具有公募管理人资格的综合类券商，根据交易所会员交易席位管理的相关要求，我司旗下公募基金参与证券交易仅能使用我司自有交易席位进行，暂不能使用其他证券公司的交易席位进行证券交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	484,635.44	1,385,093.04
其中：应支付销售机构的客户维护费	222,180.28	612,634.93
应支付基金管理人的净管理费	262,455.16	772,458.11

注：于 2023 年 7 月 23 日前，支付基金管理人中银证券的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬＝前一日基金资产净值　×　1.50%/　当年天数。

根据基金管理人于 2023 年 7 月 22 日公告的《中银国际证券股份有限公司关于调低旗下部分基金费率并修改基金合同的公告》，自 2023 年 7 月 24 日起，支付基金管理人中银证券的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬＝前一日基金资产净值　×　1.20%/　当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	80,772.53	184,679.04

注：支付基金托管人浙商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：

日托管费＝前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

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 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中银证券优势制造股票	中银证券优势制造股票	合计

	A	C	
中银证券	-	1,674.04	1,674.04
浙商银行	-	1,733.32	1,733.32
中国银行	-	4,928.94	4,928.94
合计	-	8,336.30	8,336.30

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 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中银证券优势制造股票 A	中银证券优势制造股票 C	合计
中银证券	-	2,313.38	2,313.38
浙商银行	-	2,051.11	2,051.11
中国银行	-	8,405.51	8,405.51
合计	-	12,770.00	12,770.00

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

日销售服务费＝前一日 C 类基金份额的基金资产净值×0.40%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未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。

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无基金管理人运用固有资本投资本基金的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：于本基金本报告期末及上年度末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
浙商银行	5,630,327.36	5,624.01	10,183,336.23	30,454.74

注：本基金的银行存款由基金托管人浙商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2024 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本期未因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金主要投资于股票、债券等具有良好流动性的金融工具。与这些金融工具相关的风险，以及本基金的基金管理人对于相关风险采取的风险管理政策如下所述。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型证券投资基金，其预期收益和预期风险水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，属于证券投资基金中的高风险品种。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括管理风险、技术风险及市场风险。本基金在有效控制投资风险的前提下，通过积极主动的投资管理，力争获取超越业绩比较基准的投资收益，追求基金资产的长期稳定增值。

本基金的基金管理人在公司风险管理体系的基础上构建明晰基金业务的风险管理组织架构和职能，由董事会及其风险控制委员会、执行委员会、风险管理委员会、风险管理部、基金管理部、中后线部门等相关业务部门构成多层级风险管理框架体系。董事会决定公司风险偏好，并在风险控制委员会的协助下监察公司基金业务的总体风险及管理状况。执行委员会领导公司基金业务的风险管理。风险管理委员会协助执行委员会在董事会授权范围内听取和审议包括公募基金在内的资产管理业务风险相关报告，评估风险管理状况。在业务操作层面，风险管理部、信评与投资监督部负责落实公司基金业务的风险管理制度，协调并与各部门合作履行风险管理职责。业务主管对各自业务的风险管理负有首要责任。财务部、运营管理总部、审计部、内控与法律合规部等中后线部门在各自职能范围内支持或监督公司风险管理。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，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。本基金的银行存款存放在本基金的托管人浙商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2024 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（净资产）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：不适用。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及

《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见“期末本基金持有的流通受限证券”附注。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2024 年 6 月 30 日，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2024 年 6 月 30 日，本基金确认的净赎回申请未超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	5,630,327.36	-	-	-	5,630,327.36
结算备付金	339,296.49	-	-	-	339,296.49
存出保证金	69,756.42	-	-	-	69,756.42
交易性金融资产	-	-	-	66,720,344.35	66,720,344.35
应收申购款	-	-	-	121,233.01	121,233.01
资产总计	6,039,380.27	-	-	66,841,577.36	72,880,957.63
负债					
应付赎回款	-	-	-	456,584.44	456,584.44
应付管理人报酬	-	-	-	72,725.79	72,725.79
应付托管费	-	-	-	12,120.97	12,120.97
应付清算款	-	-	-	648,715.19	648,715.19
应付销售服务费	-	-	-	5,913.14	5,913.14
其他负债	-	-	-	89,363.00	89,363.00
负债总计	-	-	-	1,285,422.53	1,285,422.53
利率敏感度缺口	6,039,380.27	-	-	65,556,154.83	71,595,535.10
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	7,358,903.17	-	-	-	7,358,903.17
结算备付金	258,647.49	-	-	-	258,647.49
存出保证金	76,164.42	-	-	-	76,164.42
交易性金融资产	-	-	-	93,610,834.36	93,610,834.36
应收申购款	-	-	-	212,718.59	212,718.59
应收清算款	-	-	-	28,971.36	28,971.36
资产总计	7,693,715.08	-	-	93,852,524.31	101,546,239.39
负债					
应付赎回款	-	-	-	251,641.88	251,641.88
应付管理人报酬	-	-	-	103,794.50	103,794.50
应付托管费	-	-	-	17,299.09	17,299.09
应付清算款	-	-	-	284,341.68	284,341.68
应付销售服务费	-	-	-	9,382.10	9,382.10

其他负债	-	-	-	215,670.73	215,670.73
负债总计	-	-	-	882,129.98	882,129.98
利率敏感度缺口	7,693,715.08	-	-	92,970,394.33	100,664,109.41

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2024 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2023 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响(2023 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注:不适用。

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：不适用。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金充分发挥基金管理人的研究优势，在注重风险控制的基础上，将严谨的定性分析和规范的定量模型相结合，动态调整稳健资产和风险资产的配置比例；在此基础上精选债券和股票，以实现基金资产的稳健增值。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金投资组合中股票资产的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于基金合同界定的优势制造主题相关的股票不低于非现金基金资产的 80%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 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	66,720,344.35	93.19	93,610,834.36	92.99
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产－权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	66,720,344.35	93.19	93,610,834.36	92.99

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	4,680,461.37	5,872,057.82
	业绩比较基准下降 5%	-4,680,461.37	-5,872,057.82

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：不适用。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	66,720,344.35	93,610,834.36
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	66,720,344.35	93,610,834.36

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2024 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2023 年 12 月 31 日：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	66,720,344.35	91.55
	其中：股票	66,720,344.35	91.55

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	5,969,623.85	8.19
8	其他各项资产	190,989.43	0.26
9	合计	72,880,957.63	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	57,444,564.05	80.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,862,180.30	8.19
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	2,181,600.00	3.05
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	1,232,000.00	1.72
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	66,720,344.35	93.19

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300308	中际旭创	40,000	5,515,200.00	7.70
2	300502	新易盛	50,980	5,380,939.00	7.52
3	688522	纳睿雷达	75,048	3,518,250.24	4.91
4	688322	奥比中光	110,000	2,938,100.00	4.10
5	688256	寒武纪	14,090	2,799,260.30	3.91
6	300394	天孚通信	30,000	2,652,600.00	3.70
7	002273	水晶光电	150,400	2,553,792.00	3.57
8	002241	歌尔股份	128,800	2,512,888.00	3.51
9	300476	胜宏科技	77,000	2,484,020.00	3.47
10	000807	云铝股份	174,700	2,360,197.00	3.30
11	688012	中微公司	16,000	2,260,160.00	3.16
12	688668	鼎通科技	46,058	1,809,618.82	2.53
13	688290	景业智能	55,645	1,786,204.50	2.49
14	688037	芯源微	19,933	1,774,037.00	2.48
15	688197	首药控股	40,005	1,746,618.30	2.44
16	300492	华图山鼎	18,000	1,695,600.00	2.37
17	600131	国网信通	100,000	1,687,000.00	2.36
18	688192	迪哲医药	45,050	1,659,642.00	2.32
19	601138	工业富联	60,100	1,646,740.00	2.30
20	688062	迈威生物	50,075	1,449,170.50	2.02
21	688025	杰普特	34,957	1,411,913.23	1.97
22	688111	金山办公	6,048	1,375,920.00	1.92
23	688383	新益昌	25,033	1,304,469.63	1.82
24	001309	德明利	15,000	1,296,000.00	1.81
25	688629	华丰科技	48,340	1,274,242.40	1.78
26	000526	学大教育	20,000	1,232,000.00	1.72
27	688502	茂莱光学	13,000	1,209,130.00	1.69
28	002916	深南电路	10,500	1,110,585.00	1.55
29	603507	振江股份	30,000	984,600.00	1.38
30	002156	通富微电	40,000	895,600.00	1.25
31	603228	景旺电子	24,000	763,200.00	1.07
32	688981	中芯国际	15,593	718,837.30	1.00
33	688381	帝奥微	36,601	712,987.48	1.00
34	002085	万丰奥威	50,000	662,000.00	0.92
35	300347	泰格医药	10,000	486,000.00	0.68
36	688772	珠海冠宇	24,149	359,820.10	0.50
37	603009	北特科技	19,900	356,807.00	0.50
38	688601	力芯微	7,695	336,194.55	0.47

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	688017	绿的谐波	5,743,679.58	5.71
2	300308	中际旭创	4,171,215.00	4.14
3	300364	中文在线	3,905,556.00	3.88
4	688256	寒武纪	3,842,206.05	3.82
5	000807	云铝股份	3,731,567.00	3.71
6	002709	天赐材料	3,704,842.84	3.68
7	688717	艾罗能源	3,653,277.38	3.63
8	300394	天孚通信	3,615,080.00	3.59
9	688522	纳睿雷达	3,503,060.63	3.48
10	688408	中信博	3,379,093.31	3.36
11	300491	通合科技	3,327,589.00	3.31
12	688037	芯源微	3,220,621.84	3.20
13	688472	阿特斯	3,201,690.31	3.18
14	300354	东华测试	2,957,153.00	2.94
15	301308	江波龙	2,954,366.00	2.93
16	300442	润泽科技	2,946,888.00	2.93
17	605117	德业股份	2,923,049.00	2.90
18	688192	迪哲医药	2,897,157.85	2.88
19	300476	胜宏科技	2,886,708.00	2.87
20	688668	鼎通科技	2,866,516.49	2.85
21	688322	奥比中光	2,801,125.16	2.78
22	600131	国网信通	2,729,036.00	2.71
23	002920	德赛西威	2,598,710.00	2.58
24	002273	水晶光电	2,471,439.00	2.46
25	002156	通富微电	2,460,277.00	2.44
26	601800	中国交建	2,450,161.00	2.43
27	603806	福斯特	2,444,563.48	2.43
28	688390	固德威	2,426,762.73	2.41
29	002241	歌尔股份	2,393,249.00	2.38
30	600312	平高电气	2,359,586.00	2.34
31	002850	科达利	2,249,372.00	2.23
32	601138	工业富联	2,227,780.00	2.21
33	688111	金山办公	2,226,557.38	2.21
34	000526	学大教育	2,197,277.00	2.18
35	300199	翰宇药业	2,165,938.00	2.15
36	688223	晶科能源	2,117,510.39	2.10
37	688260	昀冢科技	2,099,257.85	2.09
38	603799	华友钴业	2,038,369.00	2.02

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	688017	绿的谐波	5,099,018.20	5.07
2	688472	阿特斯	4,814,451.99	4.78
3	301308	江波龙	4,684,078.00	4.65
4	603728	鸣志电器	4,180,275.00	4.15
5	002517	恺英网络	4,132,742.00	4.11
6	300394	天孚通信	3,930,110.00	3.90
7	300567	精测电子	3,544,637.00	3.52
8	002709	天赐材料	3,522,497.00	3.50
9	688717	艾罗能源	3,500,435.08	3.48
10	300364	中文在线	3,411,571.00	3.39
11	300491	通合科技	3,406,103.00	3.38
12	688408	中信博	3,330,471.57	3.31
13	600975	新五丰	3,276,830.00	3.26
14	300002	神州泰岳	3,204,146.00	3.18
15	605117	德业股份	3,144,194.00	3.12
16	300418	昆仑万维	3,099,131.00	3.08
17	688120	华海清科	3,026,358.37	3.01
18	688088	虹软科技	2,905,839.74	2.89
19	300354	东华测试	2,818,870.00	2.80
20	688177	百奥泰	2,788,427.04	2.77
21	688372	伟测科技	2,704,920.86	2.69
22	600587	新华医疗	2,582,409.00	2.57
23	300442	润泽科技	2,571,031.00	2.55
24	002597	金禾实业	2,517,923.00	2.50
25	601800	中国交建	2,479,391.00	2.46
26	002920	德赛西威	2,463,015.00	2.45
27	002850	科达利	2,368,767.00	2.35
28	688111	金山办公	2,367,517.93	2.35
29	603806	福斯特	2,334,981.00	2.32
30	300308	中际旭创	2,332,910.62	2.32
31	600312	平高电气	2,314,081.00	2.30
32	688383	新益昌	2,184,402.47	2.17
33	688390	固德威	2,172,245.34	2.16
34	688223	晶科能源	2,144,681.20	2.13
35	688046	药康生物	2,127,934.10	2.11
36	000960	锡业股份	2,124,500.00	2.11
37	688581	安杰思	2,103,386.40	2.09
38	688676	金盘科技	2,064,980.67	2.05

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	269,845,688.12
卖出股票收入（成交）总额	277,330,655.76

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金投资范围未包括国债期货，无相关投资政策。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

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

本基金持有的“水晶光电”的发行主体浙江水晶光电科技股份有限公司在报告编制日前一年内受到深圳证券交易所的监管措施。

本基金管理人将密切跟踪相关进展，在严格遵守法律法规和基金合同基础上进行投资决策。

本基金投资的前十名证券的其他发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年以内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	69,756.42
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	121,233.01
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	190,989.43

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的股票。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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（%）
中银证券优势制造股票 A	4,504	16,420.57	102,762.44	0.14	73,855,463.97	99.86
中银证券优势制造股票 C	3,288	7,124.56	0.00	0.00	23,425,543.13	100.00
合计	7,792	12,497.92	102,762.44	0.11	97,281,007.10	99.89

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	中银证券优势制造股票 A	87,843.71	0.1188
	中银证券优势制造股票 C	564,738.37	2.4108
	合计	652,582.08	0.6701

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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	中银证券优势制造股票 A	0~10
	中银证券优势制造股票 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	中银证券优势制造股票 A	0~10
	中银证券优势制造股票 C	0~10
	合计	0~10

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中银证券优势制造股票 A	中银证券优势制造股票 C
基金合同生效日（2021 年 7 月 8 日）基金份额总额	289,328,445.54	26,889,319.62
本报告期期初基金份额总额	79,114,274.71	29,509,317.70
本报告期基金总申购份额	9,236,684.33	5,426,303.79
减：本报告期基金总赎回份额	14,392,732.63	11,510,078.36
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	73,958,226.41	23,425,543.13

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2024 年 4 月，董事艾富华先生因工作安排原因申请辞去公司董事、董事会风险控制委员会委员职务。2024 年 4 月，公司 2024 年第一次临时股东大会审议通过《关于选举公司第二届董事会非独立董事的议案》，选举沈金艳先生担任公司董事。

2024 年 6 月，董事王军先生因工作安排原因申请辞去公司董事、董事会风险控制委员会主任职务。2024 年 6 月，公司 2023 年年度股东大会审议通过《关于选举非独立董事的议案》，选举王晓卫先生担任公司董事。

2024 年 6 月，独立董事王娴女士因工作安排原因申请辞去公司独立董事、董事会薪酬与提名委员会委员职务。2024 年 6 月，公司 2023 年年度股东大会审议通过《关于选举独立董事的议案》，选举江萍女士担任公司独立董事。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

一、本报告期内，本基金管理人无涉及基金管理业务的诉讼，公司其他主要诉讼、仲裁事项请参见《中银国际证券股份有限公司 2024 年半年度报告》；

二、本报告期内，无涉及基金财产的诉讼事项；

三、本报告期内，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，公司基金管理业务未有管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况，其他受处罚情况请参见《中银国际证券股份有限公司 2024 年半年度报告》。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	佣金	占当期佣金总量的比例(%)	
中银证券	2	547,176,343.88	100.00	408,138.91	100.00	-

注：1、由于交易所系统限制，本基金管理人作为上海和深圳证券交易所的会员单位目前尚不能再租用其他证券公司的交易单元。

2、今后基金专用交易席位的选择标准如下：

(1)经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；

(2)具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；

(3)具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

3、今后基金专用交易席位的选择程序如下：

(1)本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构。

(2)基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

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

注：1、由于交易所系统限制，本基金管理人作为上海和深圳证券交易所的会员单位目前尚不能再租用其他证券公司的交易单元。

2、今后基金专用交易席位的选择标准如下：

(1)经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；

(2)具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；

(3)具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能

力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

3、今后基金专用交易席位的选择程序如下：

(1)本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构。

(2)基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于增加上海中正达广基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	规定报刊、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 1 月 11 日
2	中银国际证券股份有限公司关于增加中欧财富为旗下基金销售机构并进行费率优惠的公告	规定报刊、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 1 月 17 日
3	中银国际证券股份有限公司旗下基金 2023 年第 4 季度报告提示性公告	规定报刊、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 1 月 19 日
4	中银证券优势制造股票型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 1 月 19 日
5	关于增加国金证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构及参与其费率优惠活动的公告	规定报刊、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 1 月 30 日
6	中银国际证券股份有限公司旗下基金 2023 年年度报告提示性公告	规定报刊、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 3 月 29 日
7	中银证券优势制造股票型证券投资基金 2023 年年度报告	公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 3 月 29 日
8	中银证券优势制造股票型证券投资基金 2024 年第一季度报告	公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 4 月 19 日
9	中银国际证券股份有限公司旗下基金 2024 年第一季度报告提示性公告	规定报刊、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 4 月 19 日
10	关于增加上海攀赢基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构及参与其费率优惠活动的公告	规定报刊、上交所、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 6 月 12 日
11	关于增加利得基金为旗下部分基金销售机构及参与其费率优惠活动的公告	规定报刊、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 6 月 14 日
12	关于增加中国银行股份有限公司同 e	规定报刊、公司官网及	2024 年 6 月 18 日

	赢平台为旗下部分基金销售机构及参与其费率优惠活动的公告	中国证监会基金电子披露网站	
13	中银证券优势制造股票型证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要更新	公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 6 月 28 日
14	中银证券优势制造股票型证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要更新	公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 6 月 28 日

注：全部公告均在公司网站披露,部分公告在公司网站及报纸披露。

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：报告期内单一投资者持有基金份额比例不存在达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1、中国证监会准予本基金募集注册的文件

2、基金合同

3、托管协议

4、法律意见书

5、基金管理人业务资格批件和营业执照

6、基金托管人业务资格批件和营业执照

7、中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

除第 6 项在基金托管人处外，其余文件均在基金管理人的住所。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

中银国际证券股份有限公司

2024 年 8 月 31 日