
中银证券恒瑞 9 个月持有期混合型证券投资 基金 2022 年第 3 季度报告

2022 年 9 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：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：2022 年 10 月 25 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 10 月 24 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 2022 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	中银证券恒瑞 9 个月持有期混合	
基金主代码	013929	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 11 月 23 日	
报告期末基金份额总额	922,233,013.71 份	
投资目标	在严格控制风险的前提下，通过积极挖掘市场投资机会，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳健增值。	
投资策略	本基金通过资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、信用债券投资策略、可转换债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略及股票期权投资策略，以实现基金资产的长期稳健增值。	
业绩比较基准	中证 800 指数收益率*20%+中债综合全价指数收益率*75%+同期银行活期存款利率(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。	
基金管理人	中银国际证券股份有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	中银证券恒瑞 9 个月持有期混合 A	中银证券恒瑞 9 个月持有期混合 C
下属分级基金的交易代码	013929	013930
报告期末下属分级基金的份额总额	678,617,910.10 份	243,615,103.61 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（2022 年 7 月 1 日-2022 年 9 月 30 日）	
	中银证券恒瑞 9 个月持有期混合 A	中银证券恒瑞 9 个月持有期混合 C
1. 本期已实现收益	5,386,771.32	1,805,420.93
2. 本期利润	-25,318,673.79	-9,186,436.75
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0342	-0.0346
4. 期末基金资产净值	650,789,718.83	233,227,229.33
5. 期末基金份额净值	0.9590	0.9574

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、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、本基金合同于 2021 年 11 月 23 日生效，截至本报告期末基金成立未满一年。

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

中银证券恒瑞 9 个月持有期混合 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	-3.56%	0.34%	-2.45%	0.19%	-1.11%	0.15%
过去六个月	0.24%	0.34%	-1.14%	0.24%	1.38%	0.10%
自基金合同生效起至今	-4.10%	0.30%	-3.46%	0.25%	-0.64%	0.05%

中银证券恒瑞 9 个月持有期混合 C

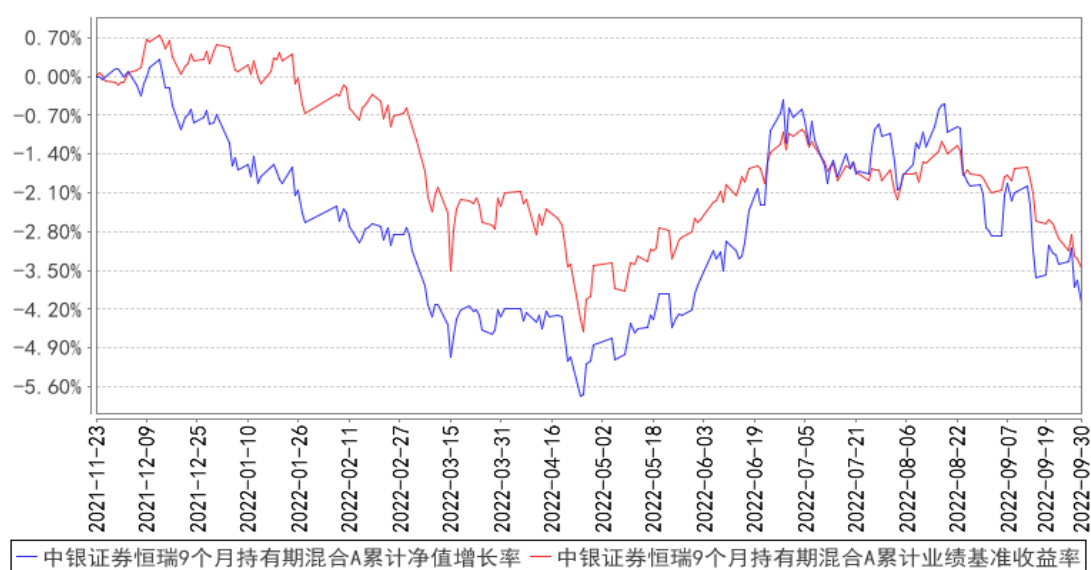
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-3.60%	0.34%	-2.45%	0.19%	-1.15%	0.15%
过去六个月	0.14%	0.34%	-1.14%	0.24%	1.28%	0.10%

自基金合同 生效起至今	-4.26%	0.30%	-3.46%	0.25%	-0.80%	0.05%
----------------	--------	-------	--------	-------	--------	-------

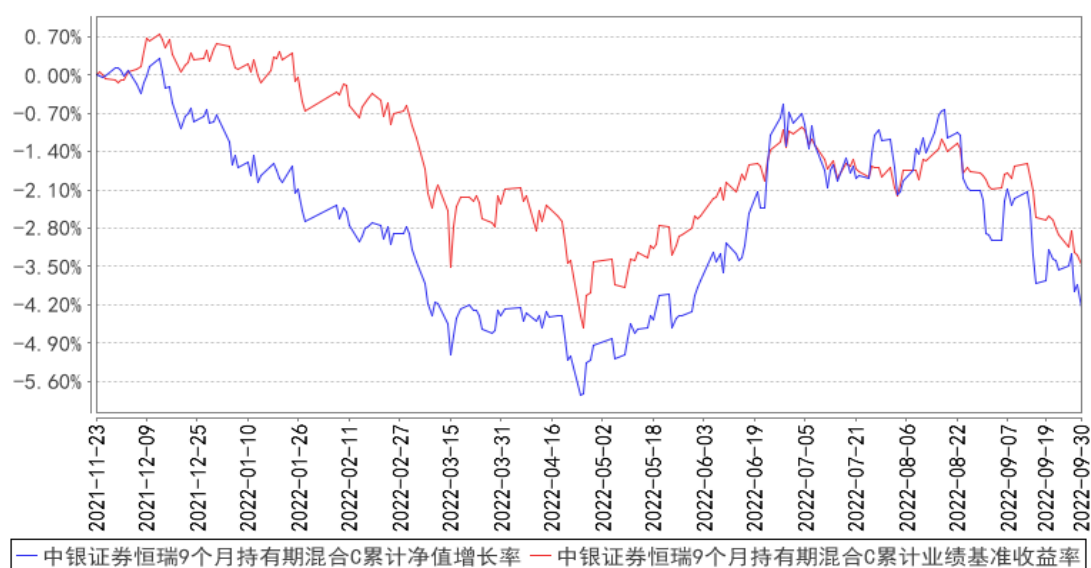
注：业绩比较基准收益率=中证 800 指数收益率*20%+中债综合全价指数收益率*75%+同期银行活期存款利率(税后)*5%。

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

中银证券恒瑞9个月持有期混合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



中银证券恒瑞9个月持有期混合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 11 月 23 日生效，截至本报告期末基金成立未满一年；自基金成立日起 6 个月内为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.3 其他指标

注：无。

§ 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		
蒲延杰	本基金的基金经理	2021 年 11 月 23 日	-	11 年	蒲延杰，博士研究生，中国国籍，已取得证券、基金从业资格。2009 年 7 月至 2010 年 12 月任职于中国工商银行股份有限公司，担任投资经理；2010 年 12 月至 2015 年 7 月任职于瑞银证券有限责任公司，担任策略分析师；2015 年 7 月至 2020 年 5 月任职于申万菱信基金管理有限公司，历任高级研究员、基金经理助理、基金经理，固定收益投资总部总监助理、权益研究部负责人、权益投资部负责人；2020 年 6 月加入中银国际证券股份有限公司，历任中银证券安泰债券型证券投资基金基金经理，现任基金管理部权益投资总监及中银证券安弘债券型证券投资基金、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、中银证券恒瑞 9 个月持有期混合型证券投资基金、中银证券成长领航混合型证券投资基金、中银证券专精特新股票型证券投资基金基金经理。
王玉玺	本基金的基金经理	2021 年 11 月 23 日	-	5 年	王玉玺，硕士研究生，中国国籍，已取得证券、基金从业资格。2006 年 7 月至 2008 年 7 月任职于中国农业银行资金运营部，担任交易员；2008 年 8 月至 2016 年 6 月任职于中国农业银行金融市场部，担任交易员、高级交易员；2016 年 6 月加入中银国际证券股份有限公司，历任中银证券瑞享定期开放灵活配置混合型证券投资基金、中银证券聚瑞混合型证券投资基金、中银证券保本 1 号混合型证券投资基金、中银证券瑞丰定期开放灵活配置混合型证券投资基金、中银证券安誉债券型证券投资基金、中银证券汇嘉定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券汇宇定期开放债券型发起式证券投资基

					金、中银证券汇享定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券安源债券型证券投资基金、中银证券安泽债券型证券投资基金、中银证券价值精选灵活配置混合型证券投资基金、中银证券瑞益灵活配置混合型证券投资基金、中银证券祥瑞混合型证券投资基金、中银证券鑫瑞 6 个月持有期混合型证券投资基金、中银证券安泰债券型证券投资基金、中银证券盈瑞混合型证券投资基金基金经理，现任基金管理部副总经理及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、中银证券中高等级债券型证券投资基金、中银证券安汇三年定期开放债券型证券投资基金、中银证券汇兴一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券恒瑞 9 个月持有期混合型证券投资基金、中银证券汇福一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券安添 3 个月定期开放债券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用日期，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期；

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

4.1.1 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

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
—	公募基金	0	—	—
	私募资产管理计划	0	—	—
	其他组合	0	—	—
	合计	0	—	—

注：无

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定，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 公平交易专项说明

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，建立了基金管理业务、资产管理业务公平交易管理办法、研究与交易部交易室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 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度债券市场先扬后抑，收益率曲线整体下移。7 月份债券市场开局表现平淡，随着局部疫情反复，“停贷”风波的发酵，债券走强，特别是信用债，在资产荒的助推下，收益率大幅下行，信用利差不断创新低。8 月中旬，央行意外降息，再次点燃了债市的做多热情，收益率创出年内新低，10 年国债一度下行至 2.6%附近。进入 9 月中下旬，美元不断走强，受人民币汇率相对贬值、不断出台的房地产宽松政策和资金价格中枢上移等多因素影响，债券市场收益率全线回升至降息前水平。报告期内，本产品继续维持中性久期和适当杠杆运作，并积极参与了利率债的波段操作，取得了较好的效果。股票方面，为应对基金的首次开放，将仓位降低至 20%，持仓以新

能源、白酒、医药、智能汽车、低估值的金融地产为主。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末中银证券恒瑞 9 个月持有期混合 A 基金份额净值为 0.9590 元,本报告期基金份额净值增长率为-3.56%; 同期业绩比较基准收益率为-2.45%。截至本报告期末中银证券恒瑞 9 个月持有期混合 C 基金份额净值为 0.9574 元,本报告期基金份额净值增长率为-3.60%; 同期业绩比较基准收益率为-2.45%。

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 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	178,156,011.72	16.42
	其中：股票	178,156,011.72	16.42
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	869,571,280.45	80.14
	其中：债券	869,571,280.45	80.14
	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	23,001,888.43	2.12
	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	7,404,840.19	0.68
8	其他资产	6,965,753.51	0.64
9	合计	1,085,099,774.30	100.00

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	9,835,408.00	1.11
B	采矿业	—	—
C	制造业	142,888,433.12	16.16
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	—	—
J	金融业	15,809,016.00	1.79
K	房地产业	5,578,854.60	0.63
L	租赁和商务服务业	4,044,300.00	0.46
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	178,156,011.72	20.15

5.2.2 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。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 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	600519	贵州茅台	6,200	11,609,500.00	1.31
2	300750	宁德时代	25,200	10,102,428.00	1.14
3	002714	牧原股份	180,400	9,835,408.00	1.11
4	000858	五粮液	57,900	9,798,417.00	1.11
5	002459	晶澳科技	145,420	9,312,696.80	1.05
6	603198	迎驾贡酒	157,800	8,863,626.00	1.00
7	600030	中信证券	478,300	8,331,986.00	0.94
8	300122	智飞生物	92,700	8,012,061.00	0.91
9	600036	招商银行	222,200	7,477,030.00	0.85
10	600933	爱柯迪	407,391	7,406,368.38	0.84

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	28,496,590.50	3.22
2	央行票据	—	—
3	金融债券	40,693,654.79	4.60
	其中：政策性金融债	20,418,893.15	2.31

4	企业债券	212,333,847.95	24.02
5	企业短期融资券	96,816,950.68	10.95
6	中期票据	316,679,141.37	35.82
7	可转债（可交换债）	75,262,793.79	8.51
8	同业存单	99,288,301.37	11.23
9	其他	-	-
10	合计	869,571,280.45	98.37

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	112292431	22 宁波银行 CD044	1,000,000	99,288,301.37	11.23
2	012280667	22 西安高新 SCP002	650,000	66,085,240.00	7.48
3	102103104	21 宜兴城投 MTN002	500,000	52,019,410.96	5.88
4	102280043	22 苏沙钢 MTN001	400,000	41,429,429.04	4.69
5	112729	18 申宏 02	400,000	41,135,824.66	4.65

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

注：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

注：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

注：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

注：本基金本报告期末投资股指期货。

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，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。

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

本基金投资范围未包括国债期货，无相关投资政策。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金投资范围未包括国债期货，无相关投资政策。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本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

本报告编制日前一年以内，本基金持有的“22 苏沙钢 MTN001”的发行主体江苏沙钢集团有限公司于 2022 年 5 月 11 日收到中国证券监督管理委员会《行政处罚事先告知书》（处罚字〔2022〕31 号）；经查，江苏沙钢集团存在隐瞒其与锦麟丰泰的一致行动关系，导致沙钢股份 2019 年及 2020 年年度报告存在虚假记载，2020 年 6 月 29 日持股比例减少百分之一时未告知上市公司及时公告，违反了《证券法》第六十三条第三款、第七十八条第一款、第二款的规定，构成《证券法》第一百九十七条第二款所述发行人的控股股东、实际控制人隐瞒相关事项导致信息披露义务人披露的信息有虚假记载的行为，中国证券监督管理委员会对其责令改正、给予警告，并处以 250 万元罚款。本基金持有的“22 宁波银行 CD044”的发行主体宁波银行股份有限公司（以下简称“宁波银行”），于 2021 年 7 月 13 日收到中国人民银行宁波市中心支行的行政处罚（甬银处罚字〔2021〕2 号）；经查，存在违规为存款人多头开立银行结算账户、占压财政存款等六项违规行为，中国人民银行给予警告，并处罚款 286.2 万元。于 2021 年 6 月 10 日、7 月 30 日、12 月 29 日、2022 年 4 月 11 日、4 月 21 日、5 月 27 日收到中国银行保险监督管理委员会宁波监管局的行政处罚（甬银保监罚决字〔2021〕36 号）、（甬银保监罚决字〔2021〕57 号）、（甬银保监罚决字〔2021〕81 号）、（甬银保监罚决字〔2022〕28 号）、（甬银保监罚决字〔2022〕30 号）、（甬银保监罚决字〔2022〕35 号）、（甬银保监罚决字〔2022〕44 号）；经查，宁波银行存在代理销售保险不规范、贷款被挪用于缴纳土地款或土地收储、开发贷款支用审核不严、房地产贷款授信管理不到位、代理保险销售不规范、薪酬管理不到位、关联交易管理不规范、资金用途管控不严、贷款风险分类不准确、非现场统计数据差错等多项违规行为，依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条、第四十八条，宁波银保监局分别对其处以罚款 25 万元、275 万元、30 万元、220 万元、30 万元、270 万元、290 万元。

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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	104,186.33
2	应收证券清算款	6,861,567.18
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	其他	—
8	合计	6,965,753.51

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	110059	浦发转债	6,453,073.97	0.73
2	113044	大秦转债	6,041,732.72	0.68
3	123085	万顺转 2	3,547,865.86	0.40
4	123078	飞凯转债	2,526,905.78	0.29
5	113047	旗滨转债	2,517,868.49	0.28
6	110075	南航转债	2,428,159.07	0.27
7	127018	本钢转债	2,178,331.78	0.25
8	110079	杭银转债	2,092,412.16	0.24
9	128128	齐翔转 2	2,068,030.90	0.23
10	113593	沪工转债	1,793,632.00	0.20
11	128132	交建转债	1,452,557.75	0.16
12	113623	凤 21 转债	1,427,437.40	0.16
13	110081	闻泰转债	1,423,610.41	0.16
14	123127	耐普转债	1,366,865.42	0.15
15	113629	泉峰转债	1,349,323.56	0.15
16	110080	东湖转债	1,342,181.92	0.15
17	127040	国泰转债	1,190,353.97	0.13
18	123077	汉得转债	1,169,703.01	0.13
19	111000	起帆转债	1,165,328.63	0.13
20	118000	嘉元转债	1,164,993.15	0.13

21	127012	招路转债	1,145,384.11	0.13
22	110064	建工转债	1,126,846.58	0.13
23	127019	国城转债	1,115,009.59	0.13
24	110074	精达转债	1,103,953.97	0.12
25	123124	晶瑞转 2	1,068,343.89	0.12
26	127033	中装转 2	1,063,841.10	0.12
27	123103	震安转债	958,100.16	0.11
28	113602	景 20 转债	934,186.30	0.11
29	123100	朗科转债	903,981.81	0.10
30	128137	洁美转债	853,897.01	0.10
31	123128	首华转债	832,796.93	0.09
32	113626	伯特转债	739,449.04	0.08
33	123142	申昊转债	722,217.21	0.08
34	127058	科伦转债	712,375.90	0.08
35	110061	川投转债	683,500.68	0.08
36	123107	温氏转债	656,019.18	0.07
37	123025	精测转债	616,507.53	0.07
38	128140	润建转债	592,367.56	0.07
39	127037	银轮转债	590,148.49	0.07
40	113504	艾华转债	581,218.28	0.07
41	123122	富瀚转债	573,506.85	0.06
42	123115	捷捷转债	567,006.16	0.06
43	113549	白电转债	561,006.85	0.06
44	127041	弘亚转债	548,415.75	0.06
45	127025	冀东转债	544,996.58	0.06
46	110062	烽火转债	531,170.55	0.06
47	123083	朗新转债	516,763.15	0.06
48	113637	华翔转债	513,152.44	0.06
49	123112	万讯转债	508,360.11	0.06
50	113619	世运转债	467,496.11	0.05
51	113640	苏利转债	465,796.05	0.05
52	113534	鼎胜转债	396,775.34	0.04
53	113642	上 22 转债	393,812.14	0.04
54	128087	孚日转债	369,453.70	0.04
55	127021	特发转 2	351,541.64	0.04
56	127020	中金转债	346,188.00	0.04
57	113616	韦尔转债	341,318.55	0.04
58	113037	紫银转债	312,252.33	0.04
59	128046	利尔转债	307,394.79	0.03
60	123071	天能转债	298,007.40	0.03
61	113598	法兰转债	264,651.78	0.03
62	128134	鸿路转债	253,422.47	0.03

63	123120	隆华转债	249,773.32	0.03
64	113641	华友转债	237,992.00	0.03
65	128014	永东转债	222,364.11	0.03
66	123067	斯莱转债	212,500.68	0.02
67	113048	晶科转债	117,126.44	0.01
68	110055	伊力转债	5,758.43	0.00

5.11.5 报告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。

5.11.6 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。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中银证券恒瑞 9 个月持有期混合 A	中银证券恒瑞 9 个月持有期混合 C
报告期期初基金份额总额	763,943,890.79	276,491,805.95
报告期期间基金总申购份额	160,223.63	11,721.52
减：报告期期间基金总赎回份额	85,486,204.32	32,888,423.86
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	678,617,910.10	243,615,103.61

注：本基金合同于 2021 年 11 月 23 日生效。

§ 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

注：本报告期内管理人未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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：本基金本报告期内单一投资者持有基金份额比例未有达到或超过 20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 9 备查文件目录

9.1 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

9.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人基金网站 www.bocifunds.com。

9.3 查阅方式

投资者可以在开放时间内至基金管理人或基金托管人住所免费查阅，也可登陆基金管理人基金网站 www.bocifunds.com 查阅。

中银国际证券股份有限公司

2022 年 10 月 25 日