

中银证券中证 500 交易型开放式指数证券  
投资基金  
2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：中银国际证券股份有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2024 年 3 月 29 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 3 月 28 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及其更新。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况 .....	5
2.2 基金产品说明 .....	5
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	5
2.4 信息披露方式 .....	6
2.5 其他相关资料 .....	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>6</b>
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
3.4 过去三年基金的利润分配情况 .....	8
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
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合规守信情况的说明 .....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	11
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 .....	12
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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 .....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	14
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明 .....	14
4.10 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 .....	14
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	14
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 .....	14
<b>§ 6 审计报告</b> .....	<b>14</b>
6.1 审计报告基本信息 .....	14
6.2 审计报告的基本内容 .....	15
<b>§ 7 年度财务报表</b> .....	<b>16</b>
7.1 资产负债表 .....	16
7.2 利润表 .....	18
7.3 净资产变动表 .....	19
7.4 报表附注 .....	21
<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>49</b>

8.1 期末基金资产组合情况 .....	49
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	50
8.3 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 .....	51
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	63
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	64
8.6 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 .....	65
8.7 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 .....	65
8.8 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 .....	65
8.9 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 .....	65
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	65
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	65
8.12 投资组合报告附注 .....	65
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>66</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	66
9.2 期末上市基金前十名持有人 .....	66
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	67
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	67
9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况 .....	67
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>67</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>67</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	67
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 .....	68
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	68
11.4 基金投资策略的改变 .....	68
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	68
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 .....	68
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	69
11.8 其他重大事件 .....	70
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>71</b>
12.1 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 .....	71
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	71
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>72</b>
13.1 备查文件目录 .....	72
13.2 存放地点 .....	72
13.3 查阅方式 .....	72

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	中银证券中证 500ETF
场内简称	BOCI500 扩位简称：中银证券 500ETF
基金主代码	515190
基金运作方式	契约型开放（ETF）
基金合同生效日	2020 年 4 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	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	55,466,080.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2020 年 5 月 27 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.2% 以内，年化跟踪误差控制在 2% 以内。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。 当预期指数成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将通过投资非成份股、成份股个股衍生品等方式进行替代，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为交易型开放式指数基金，采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票相似的风险收益特征。

### 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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	亓磊
	联系电话	021-20328000
	电子邮箱	gmkf@bocichina.com
客户服务电话	021-61195566, 400-620-8888	400-61-95555
传真	021-50372474	0755-83195201

注册地址	上海市浦东新区银城中路 200 号 中银大厦 39F	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址	上海市浦东新区银城中路 200 号 中银大厦 39F	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	200120	518040
法定代表人	宁敏	缪建民

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.bocifunds.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2023 年	2022 年	2021 年
本期已实现收益	-1,300,180.24	310,328.97	15,027,006.88
本期利润	-4,008,484.29	-12,333,027.91	11,416,616.90
加权平均基金份额本期利润	-0.0777	-0.2395	0.2031
本期加权平均净值利润率	-6.46%	-19.23%	15.19%
本期基金份额净值增长率	-6.62%	-18.85%	15.73%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
期末可供分配利润	5,751,030.72	9,362,094.99	20,748,760.86
期末可供分配基金份额利润	0.1037	0.1819	0.4564
期末基金资产	61,217,110.72	60,828,174.99	66,214,840.86

产净值			
期末基金份额净值	1.1037	1.1819	1.4564
3.1.3 累计期末指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
基金份额累计净值增长率	10.37%	18.19%	45.64%

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、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

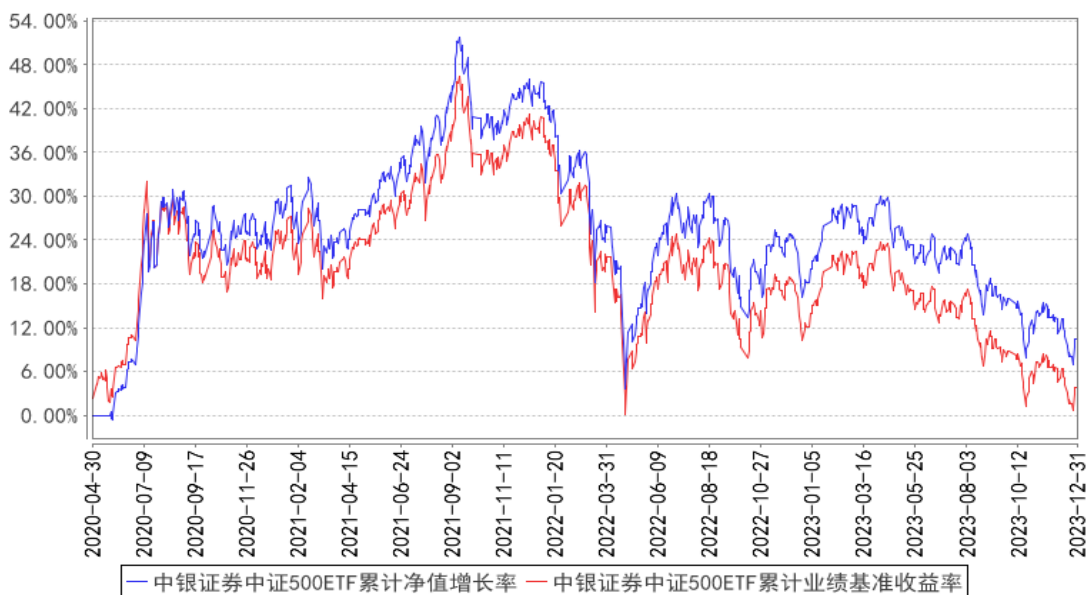
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-4.81%	0.85%	-4.60%	0.86%	-0.21%	-0.01%
过去六个月	-9.50%	0.85%	-9.49%	0.86%	-0.01%	-0.01%
过去一年	-6.62%	0.82%	-7.42%	0.82%	0.80%	0.00%
过去三年	-12.29%	1.07%	-14.73%	1.08%	2.44%	-0.01%
自基金合同生效起至今	10.37%	1.11%	3.87%	1.14%	6.50%	-0.03%

注：业绩比较基准=中证 500 指数收益率。

### 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

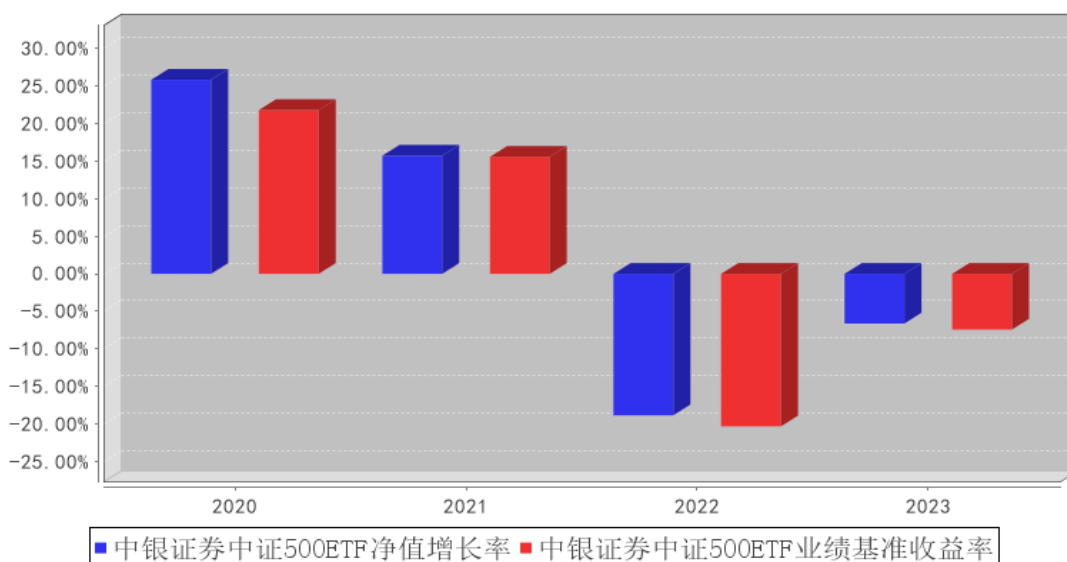
中银证券中证500ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金合同于 2020 年 4 月 30 日生效。

### 3.2.3 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

中银证券中证500ETF基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 其他指标

注：无。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金未实施利润分配。



## § 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 2023 年 9 月 30 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、井冈山郝乾企业管理中心(有限合伙)、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、信泰人寿保险股份有限公司—传统产品。

中银证券的经营经营范围包括: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 2023 年 12 月 31 日,本管理人共管理 50 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、中银证券瑞益灵活配置混合型证券投资基金(原中银证券瑞益定期开放灵活配置混合型证券投资基金)、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、中银证券创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、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、中银证券成长领航混合型证券投资基金、中银证券安瑞 6 个月持有期债券型证券投资基金、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、中银证券专精特新股票型证券投资基金、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		
张艺敏	本基金的基金经理	2020 年 9 月 15 日	-	6 年	张艺敏，硕士研究生，中国国籍，已取得证券、基金从业资格。2017 年 7 月至 2020 年 5 月任职于汇安基金管理有限公司，历任产品及创新业务部产品经理、ETF 投资部基金经理助理，2020 年 5 月加入中银国际证券股份有限公司，现任中银证券中证 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、中银证券创业板交易型开放式指数证券投资基金、中银证券创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，中银证券中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金经理助理。
计伟	本基金的基金经理	2021 年 6 月 8 日	-	15 年	计伟，硕士研究生，中国国籍，已取得证券、基金从业资格。2012 年 1 月至 2016 年 8 月任职于华安基金管理有限公司，担任基金经理；2016 年 8 月至 2019 年 7 月任职于汇安基金管理有限公司，担任指数与量化投资副总经理、ETF 投资部总经理、基金经理；2019 年 10 月加入中银国际证券股份有限公司，历任中银证券祥瑞混合型证券投资基金基金经理，现任基金管理部 ETF 投资团队负责人及中银证券创业板交易型开放式指数证券投资基金、中银证

					券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、中银证券盈瑞混合型证券投资基金、中银证券瑞益灵活配置混合型证券投资基金、中银证券安弘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。

#### 4.1.3 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

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

本基金无基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

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》、《证券投资基金管理公司管理办法》、《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。

公司基金管理业务、资产管理业务公平交易管理办法所规范的范围涵盖境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动，同时涵盖包括授权、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的各个环节。

公平交易的控制方法主要包括：建立科学、制衡的投资决策体系，在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，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；严格隔离投资管理职能和交易执行职能，实行包括所有投资品种的集中交易制度，并进行公平的交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会；通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，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，公司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。

#### 4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

无。

### 4.3.3 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

过去一年权益市场整体下行，特别是下半年下行幅度有所放大，中证 500 下跌 9.5%，全年来看下跌 7.4%，略优于沪深 300、创业板指，万得偏股混合型基金指数，弱于万得全 A。下半年对指数涨幅正贡献最大的三大成分行业为煤炭、非银金融、石油石化，负贡献最大的三大成分行业为电子、电力设备新能源、基础化工。截至 12 月底，中证 500 指数滚动市盈率 21 倍，处于过去三年 40%左右分位。

本基金作为一只投资于中证 500 的指数型产品，将继续秉承指数化投资策略，采用完全复制法跟踪标的指数，严格遵守基金合同，积极应对基金申购赎回、成分调整等因素对指数跟踪效果带来的冲击，降低本基金跟踪误差，为投资者提供一个标准化的中证 500 指数投资工具。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.1037 元；本报告期基金份额净值增长率为-6.62%，业绩比较基准收益率为-7.42%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2023 年全年规模以上工业企业利润同比增速-2.3%，已连续两年负增长，中央经济工作会议中亦点出目前“有效需求不足、社会预期偏弱、部分行业产能过剩”的挑战，权益市场悲观气氛较浓，估值水平持续下行，此前估值水平较高的成长风格股票波动幅度尤其显著。但另一方面我们也看到地产政策、产业政策的持续出台，部分微观数据体现的企稳迹象，以及市场下行所伴随

的风险释放和股票投资性价比的提升。预计随着各项经济政策的效果显现和企业盈利的逐步改善，市场预期有望得到修复，但节奏与强度还有待观察。

本基金作为一只投资于中证 500 的指数产品，将继续秉承指数化投资策略，严格遵守基金合同，积极应对基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击，降低本基金的跟踪误差，为投资者提供一个标准化的中证 500 指数投资工具。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人始终坚持基金份额持有人利益优先原则，从规范运作、防范风险、保护基金持有人利益出发，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实。公司审计部依据法律法规的规定及公司内部控制的整体要求，独立对旗下基金投资组合、基金宣传推介材料及员工行为等的合规性进行了定期和不定期检查，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，并定期出具监察稽核报告。

在合规管理方面，公司开展多种形式的合规培训，定期进行合规信息收集，不断提升员工的合规守法意识；加强事前事中合规风险管理，严格审核信息披露文件、基金宣传推介材料，防范各类合规风险。在风险管理方面，公司秉承全员风险管理的理念，采取事前防范、事中控制和事后监督等三阶段工作，加强对日常投资运作的管理和监控，督促投研交易业务的合规开展；在监察稽核方面，公司定期和不定期开展多项内部稽核，对投资研究、公平交易、基金销售，投资管理人员通讯管理等关键业务和岗位进行检查监督，促进公募基金业务合规运作、稳健经营。

报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规。本基金管理人将继续以风险控制为核心，坚持基金份额持有人利益优先的原则，提高监察稽核工作有效性，切实保障基金安全、合规运作。

#### 4.7 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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内未实施利润分配。

#### 4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

#### 4.10 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

托管人声明:

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度, 我行在履行托管职责中, 严格遵守有关法律法规、托管协议的规定, 尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

### 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款, 对托管产品的投资行为进行监督, 并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则, 独立地设置、登录和保管本产品的全套账册, 进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

### 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

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确, 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 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
------------	---

审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2024)第 21947 号

## 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“中银证券中证 500ETF 基金”)的财务报表,包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表,2023 年度的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>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,公允反映了中银证券中证 500ETF 基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>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。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。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于中银证券中证 500ETF 基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	无
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>中银证券中证 500ETF 基金的基金管理人中银国际证券股份有限公司(以下简称“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。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估中银证券中证 500ETF 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证券中证 500ETF 基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督中银证券中证 500ETF 基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不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</p>

	<p>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。</p> <p>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：</p> <p>(一) 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。</p> <p>(二) 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。</p> <p>(三) 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。</p> <p>(四) 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，就可能导致对中银证券中证 500ETF 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证券中证 500ETF 基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、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。</p> <p>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。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	薛竞   曹阳
会计师事务所的地址	中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
审计报告日期	2024 年 3 月 28 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			



货币资金	7.4.7.1	678,817.35	1,217,747.76
结算备付金		2,024.20	22,766.39
存出保证金		1,070.23	2,677.18
交易性金融资产	7.4.7.2	60,692,263.02	60,077,413.47
其中：股票投资		60,692,263.02	60,077,413.47
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		110,692.39	46,348.57
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		61,484,867.19	61,366,953.37
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年12月31日</b>	<b>上年度末 2022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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	114,211.77
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		7,556.10	7,671.37
应付托管费		2,518.70	2,557.10
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	257,681.67	414,338.14
负债合计		267,756.47	538,778.38
<b>净资产：</b>			

实收基金	7.4.7.10	55,466,080.00	51,466,080.00
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	5,751,030.72	9,362,094.99
净资产合计		61,217,110.72	60,828,174.99
负债和净资产总计		61,484,867.19	61,366,953.37

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.1037 元，基金份额总额 55,466,080.00 份。

## 7.2 利润表

会计主体：中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		-3,402,909.66	-11,693,867.97
1. 利息收入		2,499.67	3,457.50
其中：存款利息收入	7.4.7.13	2,499.67	3,457.50
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）		-728,409.64	860,966.19
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-1,737,006.34	-288,831.76
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	2,355.55	24,728.72
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	1,006,241.15	1,125,069.23
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）	7.4.7.20	-2,708,304.05	-12,643,356.88
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”	7.4.7.21	31,304.36	85,065.22

号填列)			
<b>减：二、营业总支出</b>		605,574.63	639,159.94
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	93,116.01	95,924.45
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	31,038.66	31,974.83
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	7.4.7.23	481,419.96	511,260.66
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-4,008,484.29	-12,333,027.91
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-4,008,484.29	-12,333,027.91
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-4,008,484.29	-12,333,027.91

### 7.3 净资产变动表

会计主体：中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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	51,466,080.00	-	9,362,094.99	60,828,174.99
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	51,466,080.00	-	9,362,094.99	60,828,174.99
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	4,000,000.00	-	-3,611,064.27	388,935.73
（一）、综合收益总额	-	-	-4,008,484.29	-4,008,484.29

(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)	4,000,000.00	-	397,420.02	4,397,420.02
其中: 1. 基金申购款	6,000,000.00	-	952,461.66	6,952,461.66
2. 基金赎回款	-2,000,000.00	-	-555,041.64	-2,555,041.64
(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	55,466,080.00	-	5,751,030.72	61,217,110.72
项目	上年度可比期间			
	2022年1月1日至2022年12月31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	45,466,080.00	-	20,748,760.86	66,214,840.86
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	45,466,080.00	-	20,748,760.86	66,214,840.86
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	6,000,000.00	-	-11,386,665.87	-5,386,665.87
(一)、综合收益总额	-	-	-12,333,027.91	-12,333,027.91
(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)	6,000,000.00	-	946,362.04	6,946,362.04
其中: 1. 基金申购款	14,000,000.00	-	2,747,375.15	16,747,375.15

2. 基金赎回款	-8,000,000.00	-	-1,801,013.11	-9,801,013.11
(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	51,466,080.00	-	9,362,094.99	60,828,174.99

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]2052 号《关于准予中银证券中证 500 交易型开放式指数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《中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息(含募集股票市值)共募集人民币 251,438,000.00 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(2020)第 0351 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2020 年 4 月 30 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 251,466,080.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 28,080.00 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,基金托管人为招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2020]135 号文核准,本基金于 2020 年 5 月 27 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资

基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金还可投资于非成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证)、股指期货、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债的纯债部分、中期票据、短期融资券、超短期融资券、政府支持债券、政府支持机构债券等)、银行存款(包括协议存款、定期存款、通知存款和其他银行存款)、同业存单、货币市场工具、资产支持证券、债券回购以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率。

本基金的基金管理人中银国际证券股份有限公司以本基金为目标 ETF，募集成立了中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“中证 500ETF 联接基金”)。中证 500ETF 联接基金为交易型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

本财务报表由本基金的基金管理人中银国际证券股份有限公司于 2024 年 3 月 28 日批准报出。

#### 7.4.2 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》、《中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 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。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2023 年度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 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 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。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 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商业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商业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。

#### 7.4.4.4 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。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 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。

#### 7.4.4.7 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。

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回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

#### 7.4.4.8 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基金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基金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)。

#### 7.4.4.9 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。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 7.4.4.12 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。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票

的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)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。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 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。

##### 7.4.5.2 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。

##### 7.4.5.3 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。

#### 7.4.6 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。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	678,817.35	1,217,747.76
等于：本金	678,744.75	1,217,635.81
加：应计利息	72.60	111.95
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	678,817.35	1,217,747.76

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	69,123,954.56	-	60,692,263.02	-8,431,691.54
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	69,123,954.56	-	60,692,263.02	-8,431,691.54
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	65,800,800.96	-	60,077,413.47	-5,723,387.49
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	65,800,800.96	-	60,077,413.47	-5,723,387.49

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款估值增值。

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

##### 7.4.7.3.2 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。

**7.4.7.3.3 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。

**7.4.7.4 买入返售金融资产****7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

注：本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

**7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

注：本基金本报告期末及上年度末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

**7.4.7.4.3 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。

**7.4.7.5 债权投资****7.4.7.5.1 债权投资情况**

注：本基金本报告期末及上年度末未持有债权投资。

**7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未计提债权投资减值准备。

**7.4.7.6 其他债权投资****7.4.7.6.1 其他债权投资情况**

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他债权投资。

**7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未计提其他债权投资减值准备。

**7.4.7.7 其他权益工具投资****7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况**

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他权益工具投资。

**7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况**

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他权益工具投资。

**7.4.7.8 其他资产**

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

**7.4.7.9 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022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	12,681.67	14,338.14
其中：交易所市场	12,681.67	14,338.14
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	210,000.00	330,000.00
应付指数使用费	35,000.00	70,000.00
合计	257,681.67	414,338.14

#### 7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2023年1月1日至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	51,466,080.00	51,466,080.00
本期申购	6,000,000.00	6,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-2,000,000.00	-2,000,000.00
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	55,466,080.00	55,466,080.00

#### 7.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期无其他综合收益。

#### 7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	29,570,924.42	-20,208,829.43	9,362,094.99
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	29,570,924.42	-20,208,829.43	9,362,094.99
本期利润	-1,300,180.24	-2,708,304.05	-4,008,484.29
本期基金份额交易产生的变动数	2,225,161.39	-1,827,741.37	397,420.02
其中：基金申购款	3,372,279.92	-2,419,818.26	952,461.66
基金赎回款	-1,147,118.53	592,076.89	-555,041.64
本期已分配利润	-	-	-
本期末	30,495,905.57	-24,744,874.85	5,751,030.72



## 7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
活期存款利息收入	2,229.86	3,022.15
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	235.65	384.55
其他	34.16	50.80
合计	2,499.67	3,457.50

## 7.4.7.14 股票投资收益

## 7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-1,737,176.08	-233,212.52
股票投资收益——赎回差价收入	169.74	-55,619.24
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	-1,737,006.34	-288,831.76

## 7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
卖出股票成交总额	16,802,455.57	26,190,796.20
减：卖出股票成本总额	18,497,335.50	26,352,681.45
减：交易费用	42,296.15	71,327.27
买卖股票差价收入	-1,737,176.08	-233,212.52

## 7.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
赎回基金份额对价总额	2,555,041.64	9,801,013.11
减：现金支付赎回款总额	1,262,860.64	4,656,921.11
减：赎回股票成本总额	1,292,011.26	5,199,711.24
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	169.74	-55,619.24

#### 7.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无股票投资收益-申购差价收入。

#### 7.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无股票投资收益-证券出借差价收入。

#### 7.4.7.15 债券投资收益

##### 7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
债券投资收益——利息收入	1.96	22.20
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	2,353.59	24,706.52
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	2,355.55	24,728.72

##### 7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	16,356.20	142,734.72
减：卖出债券（债转股及	14,000.00	118,000.00

债券到期兑付)成本总额		
减: 应计利息总额	1.96	22.67
减: 交易费用	0.65	5.53
买卖债券差价收入	2,353.59	24,706.52

#### 7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注: 本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益-赎回差价收入。

#### 7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注: 本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益-申购差价收入。

#### 7.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注: 本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

##### 7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注: 本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益-买卖资产支持证券差价收入。

##### 7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注: 本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益-赎回差价收入。

##### 7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注: 本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益-申购差价收入。

#### 7.4.7.17 贵金属投资收益

##### 7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注: 本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

##### 7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注: 本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益-买卖贵金属差价收入。

##### 7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注: 本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益-赎回差价收入。

##### 7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注: 本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益-申购差价收入。

#### 7.4.7.18 衍生工具收益

##### 7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注: 本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益-买卖权证差价收入。

##### 7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注: 本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益-其他投资收益。

## 7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	1,006,241.15	1,125,069.23
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	1,006,241.15	1,125,069.23

## 7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-2,708,304.05	-12,643,356.88
股票投资	-2,708,304.05	-12,643,356.88
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	-2,708,304.05	-12,643,356.88

## 7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	31,304.36	85,065.22
合计	31,304.36	85,065.22

注：替代损益是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

#### 7.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无信用减值损失。

#### 7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
审计费用	10,000.00	40,000.00
信息披露费	80,000.00	80,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	1,380.00	1,239.77
指数使用费	140,000.00	140,000.00
其他费用	250,039.96	250,020.89
合计	481,419.96	511,260.66

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的年费率 0.03% 每日计提，按季支付。标的指数许可使用费的收取下限为：就每个计费季度而言，如当季度日均基金资产净值大于 5,000 万元的，指数使用费的收取下限为每季度 35,000 元；如当季度日均基金资产净值小于或等于 5,000 万元的，无指数许可使用费的收取下限。

#### 7.4.7.24 分部报告

无。

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 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。

##### 7.4.8.2 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。

#### 7.4.9 关联方关系

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、基金销售机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人
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
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（“中证 500ETF 联接基金”）	基金管理人管理的其他基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

无。

## 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

## 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31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	36,539,658.54	100.00	55,670,848.28	100.00

## 7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31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	16,356.20	100.00	142,734.72	100.00

## 7.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

## 7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

## 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31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	26,980.48	100.00	12,681.67	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31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	40,716.67	100.00	14,338.14	100.00

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，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；

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	93,116.01	95,924.45
其中：应支付销售机构的客户维护费	166.97	45.08
应支付基金管理人的净管理费	92,949.04	95,879.37

注：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 0.15%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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% / \text{当年天数}。$$

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	31,038.66	31,974.83

注：支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.05%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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.05\% / \text{当年天数}。$$

##### 7.4.10.2.3 销售服务费

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无支付给各关联方的销售服务费。

##### 7.4.10.3 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。

##### 7.4.10.4 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

###### 7.4.10.4.1 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适用固定期限费率的证券出借业务。

#### 7.4.10.4.2 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。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人于本基金本报告期内及上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

##### 7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2023年12月31日		上年度末 2022年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例 (%)
中证500ETF联接基金	49,501,780.00	89.2500	47,540,080.00	92.3700

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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
招商银行	678,817.35	2,229.86	1,217,747.76	3,022.15

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.10.7 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。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

于 2023 年 12 月 31 日，本基金持有 15,800 股中银证券的普通股，成本总额为人民币 203,850.90 元，估值总额为人民币 162,582.00 元，占基金净资产的比例为 0.27% (2022 年 12 月 31 日：本基金持有 15,900 股中银证券的普通股，成本总额为人民币 206,780.45 元，估值总额为人民币 168,063.00 元，占基金净资产的比例为 0.28%)。

#### 7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。



#### 7.4.12 期末（2023 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 7.4.12.2 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
400174	中天3	2023年8月30日	暂停转让	0.00	-	-	44,600	126,944.97	0.00	-

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 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。

###### 7.4.12.3.2 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。

##### 7.4.12.4 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。

#### 7.4.13 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。

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是指数型基金，紧密跟踪中证 500 指数，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。本基金采用完全复制法，跟踪中证 500 指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代，力求与标的指数的跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。

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次风险管理框架体系。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台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。

#### 7.4.13.2 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招商银行，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。

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的债券投资。

##### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

##### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

#### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的债券投资。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

### 7.4.13.3 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来自调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

于 2023 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不付息。本基金赎回基金采用一篮子股票形式，流动性风险相对较低。

#### 7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：不适用。

#### 7.4.13.3.2 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。

本基金所持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 2023 年 12 月 31 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 2023 年 12 月 31 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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	678,817.35	-	-	-	678,817.35
结算备付金	2,024.20	-	-	-	2,024.20
存出保证金	1,070.23	-	-	-	1,070.23
交易性金融资产	-	-	-	60,692,263.02	60,692,263.02
应收清算款	-	-	-	110,692.39	110,692.39
资产总计	681,911.78	-	-	60,802,955.41	61,484,867.19
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	7,556.10	7,556.10
应付托管费	-	-	-	2,518.70	2,518.70
其他负债	-	-	-	257,681.67	257,681.67
负债总计	-	-	-	267,756.47	267,756.47
利率敏感度缺口	681,911.78	-	-	60,535,198.94	61,217,110.72
上年度末 2022年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					

货币资金	1,217,747.76	-	-	-	1,217,747.76
结算备付金	22,766.39	-	-	-	22,766.39
存出保证金	2,677.18	-	-	-	2,677.18
交易性金融资产	-	-	-	60,077,413.47	60,077,413.47
应收清算款	-	-	-	46,348.57	46,348.57
资产总计	1,243,191.33	-	-	60,123,762.04	61,366,953.37
负债	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	7,671.37	7,671.37
应付托管费	-	-	-	2,557.10	2,557.10
应付清算款	-	-	-	114,211.77	114,211.77
其他负债	-	-	-	414,338.14	414,338.14
负债总计	-	-	-	538,778.38	538,778.38
利率敏感度缺口	1,243,191.33	-	-	59,584,983.66	60,828,174.99

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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2023 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资（2022 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（2022 年 12 月 31 日：同）。

#### 7.4.13.4.2 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。

##### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：不适用。

##### 7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：不适用。

#### 7.4.13.4.3 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。

本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当预期指数成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能

带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将通过投资非成份股、成份股个股衍生品等方式进行替代，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。

本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。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。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	60,692,263.02	99.14	60,077,413.47	98.77
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	60,692,263.02	99.14	60,077,413.47	98.77

#### 7.4.13.4.3.2 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（2023 年 12 月 31 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	3,033,882.98	3,017,885.16
	业绩比较基准下降 5%	-3,033,882.98	-3,017,885.16

#### 7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：不适用。

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 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。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	60,692,263.02	59,862,217.47
第二层次	-	215,196.00
第三层次	-	-
合计	60,692,263.02	60,077,413.47

###### 7.4.14.2.2 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。

###### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

###### 7.4.14.2.3.1 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 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	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	17,840.00	17,840.00
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-17,840.00	-17,840.00
其中：计入损益的利得或损失	-	-17,840.00	-17,840.00
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
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	-	-17,840.00	-17,840.00
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
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	-	-	-

注：计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

#### 7.4.14.2.3.2 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	采用的估值	不可观察输入值
----	-------	-------	---------



	价值	技术	名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股票投资	-	重置成本法	调整后净资产	小于 0	正相关
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
-	-	-	-	-	-

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2022 年 12 月 31 日：同)。

#### 7.4.14.4 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。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 基金申购款

于 2023 年度，本基金申购基金份额的对价总额为 6,952,461.66 元(2022 年度: 16,747,375.15 元)，其中包括以股票支付的申购款 3,302,560.00 元和以现金支付的申购款 3,649,901.66 元(2022 年度: 其中包括以股票支付的申购款 8,656,939.70 元和以现金支付的申购款 8,090,435.45 元)。

(2) 除基金申购款外，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 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	60,692,263.02	98.71
	其中：股票	60,692,263.02	98.71
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-

	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	680,841.55	1.11
8	其他各项资产	111,762.62	0.18
9	合计	61,484,867.19	100.00

注：股票投资的公允价值包含可退替代款估值增值。

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末指数投资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	415,417.00	0.68
B	采矿业	2,359,022.00	3.85
C	制造业	38,274,892.16	62.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,985,370.90	3.24
E	建筑业	487,103.00	0.80
F	批发和零售业	1,847,297.81	3.02
G	交通运输、仓储和邮政业	1,128,544.00	1.84
H	住宿和餐饮业	99,968.00	0.16
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,548,238.21	7.43
J	金融业	5,513,243.65	9.01
K	房地产业	760,701.00	1.24
L	租赁和商务服务业	542,830.00	0.89
M	科学研究和技术服务业	556,451.29	0.91
N	水利、环境和公共设施管理业	324,129.00	0.53
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	168,096.00	0.27
Q	卫生和社会工作	462,926.00	0.76
R	文化、体育和娱乐业	860,679.00	1.41
S	综合	357,354.00	0.58
	合计	60,692,263.02	99.14

### 8.2.2 报告期末积极投资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	-	-

C	制造业	-	-
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	-	-
K	房地产业	0.00	0.00
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	-	-

### 8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金投资范围未包括港股通投资股票，无相关投资政策。

### 8.3 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

#### 8.3.1 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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300502	新易盛	6,700	330,444.00	0.54
2	002422	科伦药业	11,200	325,360.00	0.53
3	002028	思源电气	5,900	307,036.00	0.50
4	300418	昆仑万维	8,100	302,940.00	0.49
5	600157	永泰能源	211,800	290,166.00	0.47
6	002463	沪电股份	12,800	283,136.00	0.46
7	000988	华工科技	9,500	282,720.00	0.46
8	601058	赛轮轮胎	23,800	279,650.00	0.46
9	601555	东吴证券	38,250	279,607.50	0.46
10	000975	银泰黄金	18,540	278,100.00	0.45

11	600079	人福医药	10,900	270,974.00	0.44
12	600418	江淮汽车	16,700	269,705.00	0.44
13	002340	格林美	49,000	267,540.00	0.44
14	601168	西部矿业	18,200	259,714.00	0.42
15	301236	软通动力	5,500	254,100.00	0.42
16	000933	神火股份	15,000	252,000.00	0.41
17	600161	天坛生物	7,900	244,426.00	0.40
18	601233	桐昆股份	16,100	243,593.00	0.40
19	601077	渝农商行	59,000	240,720.00	0.39
20	601108	财通证券	31,000	240,560.00	0.39
21	002384	东山精密	13,100	238,158.00	0.39
22	300394	天孚通信	2,600	237,952.00	0.39
23	000630	铜陵有色	72,400	237,472.00	0.39
24	300037	新宙邦	5,000	236,500.00	0.39
25	002156	通富微电	10,100	233,512.00	0.38
26	000009	中国宝安	19,700	231,278.00	0.38
27	002517	恺英网络	20,500	228,985.00	0.37
28	688122	西部超导	4,300	228,889.00	0.37
29	300012	华测检测	16,100	228,620.00	0.37
30	600109	国金证券	24,900	226,092.00	0.37
31	002966	苏州银行	34,970	225,906.20	0.37
32	600988	赤峰黄金	15,900	222,759.00	0.36
33	600885	宏发股份	7,980	220,567.20	0.36
34	300136	信维通信	9,200	217,120.00	0.35
35	002465	海格通信	16,600	213,310.00	0.35
36	002625	光启技术	14,400	212,832.00	0.35
37	600160	巨化股份	12,900	212,721.00	0.35
38	000423	东阿阿胶	4,300	212,076.00	0.35
39	300207	欣旺达	14,200	209,592.00	0.34
40	002185	华天科技	24,500	208,740.00	0.34
41	600536	中国软件	5,749	208,458.74	0.34
42	600352	浙江龙盛	24,800	208,320.00	0.34
43	002138	顺络电子	7,700	207,977.00	0.34
44	002738	中矿资源	5,520	205,951.20	0.34
45	601162	天风证券	66,100	204,249.00	0.33
46	600298	安琪酵母	5,800	204,044.00	0.33
47	300003	乐普医疗	12,600	203,616.00	0.33
48	000932	华菱钢铁	39,500	203,425.00	0.33
49	603596	伯特利	2,900	200,970.00	0.33
50	688099	晶晨股份	3,200	200,416.00	0.33
51	300724	捷佳伟创	2,700	199,827.00	0.33
52	000783	长江证券	36,900	198,522.00	0.32
53	300144	宋城演艺	20,000	197,400.00	0.32

54	002223	鱼跃医疗	5,700	197,106.00	0.32
55	688169	石头科技	693	196,084.35	0.32
56	002078	太阳纸业	16,000	194,720.00	0.32
57	603939	益丰药房	4,860	194,594.40	0.32
58	002439	启明星辰	7,200	194,400.00	0.32
59	000723	美锦能源	28,800	191,808.00	0.31
60	600415	小商品城	26,100	191,052.00	0.31
61	600096	云天化	12,200	190,320.00	0.31
62	688072	拓荆科技	817	188,972.10	0.31
63	300568	星源材质	12,200	188,124.00	0.31
64	002756	永兴材料	3,600	187,956.00	0.31
65	002385	大北农	31,500	187,740.00	0.31
66	600765	中航重机	9,820	187,660.20	0.31
67	600482	中国动力	10,400	187,304.00	0.31
68	000066	中国长城	18,500	187,220.00	0.31
69	600873	梅花生物	19,600	187,180.00	0.31
70	002797	第一创业	32,100	186,501.00	0.30
71	002532	天山铝业	31,000	186,310.00	0.30
72	600839	四川长虹	35,200	186,208.00	0.30
73	688180	君实生物	4,400	184,052.00	0.30
74	300474	景嘉微	2,600	183,846.00	0.30
75	300395	菲利华	5,000	182,800.00	0.30
76	300017	网宿科技	23,200	182,120.00	0.30
77	002600	领益智造	26,800	181,168.00	0.30
78	002273	水晶光电	13,300	180,082.00	0.29
79	002044	美年健康	29,900	179,699.00	0.29
80	600155	华创云信	21,543	179,668.62	0.29
81	603160	汇顶科技	2,600	179,660.00	0.29
82	002739	万达电影	13,700	178,374.00	0.29
83	300285	国瓷材料	7,700	178,024.00	0.29
84	300866	安克创新	2,000	177,200.00	0.29
85	600862	中航高科	8,000	177,200.00	0.29
86	300601	康泰生物	6,400	173,760.00	0.28
87	600177	雅戈尔	26,500	173,575.00	0.28
88	002294	信立泰	5,300	173,098.00	0.28
89	600129	太极集团	3,700	171,902.00	0.28
90	600497	驰宏锌锗	33,900	171,195.00	0.28
91	300058	蓝色光标	23,800	170,884.00	0.28
92	000728	国元证券	25,000	170,750.00	0.28
93	002472	双环传动	6,500	169,130.00	0.28
94	603882	金域医学	2,700	168,939.00	0.28
95	688120	华海清科	900	168,930.00	0.28
96	600699	均胜电子	9,400	168,824.00	0.28

97	600066	宇通客车	12,700	168,275.00	0.27
98	002607	中公教育	41,200	168,096.00	0.27
99	600348	华阳股份	17,200	167,872.00	0.27
100	002195	岩山科技	54,600	167,622.00	0.27
101	300146	汤臣倍健	9,800	166,894.00	0.27
102	601990	南京证券	20,900	166,782.00	0.27
103	601128	常熟银行	26,100	166,779.00	0.27
104	603606	东方电缆	3,900	166,725.00	0.27
105	000831	中国稀土	6,000	166,020.00	0.27
106	002008	大族激光	8,000	165,760.00	0.27
107	600546	山煤国际	9,400	164,594.00	0.27
108	603816	顾家家居	4,700	164,500.00	0.27
109	688114	华大智造	1,900	163,438.00	0.27
110	002353	杰瑞股份	5,800	163,038.00	0.27
111	000893	亚钾国际	6,200	162,688.00	0.27
112	601696	中银证券	15,800	162,582.00	0.27
113	002673	西部证券	25,500	162,435.00	0.27
114	600529	山东药玻	6,300	161,280.00	0.26
115	300604	长川科技	4,200	159,558.00	0.26
116	688002	睿创微纳	3,600	159,192.00	0.26
117	002262	恩华药业	5,800	157,296.00	0.26
118	601577	长沙银行	23,000	156,860.00	0.26
119	600060	海信视像	7,500	156,750.00	0.26
120	300088	长信科技	23,400	156,546.00	0.26
121	603688	石英股份	1,800	156,384.00	0.26
122	600985	淮北矿业	9,400	156,322.00	0.26
123	600499	科达制造	14,800	156,140.00	0.26
124	600369	西南证券	38,000	155,420.00	0.25
125	000997	新大陆	7,900	154,919.00	0.25
126	603589	口子窖	3,400	154,020.00	0.25
127	002624	完美世界	13,000	153,920.00	0.25
128	601666	平煤股份	13,300	153,748.00	0.25
129	300118	东方日升	8,700	153,555.00	0.25
130	002444	巨星科技	6,800	153,136.00	0.25
131	601198	东兴证券	18,500	152,255.00	0.25
132	688728	格科微	7,400	151,478.00	0.25
133	002409	雅克科技	2,700	150,471.00	0.25
134	600642	申能股份	23,300	149,586.00	0.24
135	000400	许继电气	6,800	149,328.00	0.24
136	300699	光威复材	5,580	148,818.60	0.24
137	603000	人民网	5,300	148,294.00	0.24
138	600884	杉杉股份	10,800	147,096.00	0.24
139	002131	利欧股份	64,400	146,832.00	0.24

140	000683	远兴能源	25,000	146,750.00	0.24
141	600637	东方明珠	19,500	146,640.00	0.24
142	600535	天士力	8,600	146,372.00	0.24
143	002558	巨人网络	13,100	145,934.00	0.24
144	000878	云南铜业	13,400	145,926.00	0.24
145	600486	扬农化工	2,310	145,807.20	0.24
146	600399	抚顺特钢	15,000	145,800.00	0.24
147	600879	航天电子	18,900	145,719.00	0.24
148	000629	钒钛股份	44,300	145,304.00	0.24
149	300073	当升科技	3,800	145,160.00	0.24
150	000591	太阳能	26,000	145,080.00	0.24
151	688521	芯原股份	2,900	144,884.00	0.24
152	002152	广电运通	11,800	144,668.00	0.24
153	600118	中国卫星	5,600	144,592.00	0.24
154	000021	深科技	8,900	144,269.00	0.24
155	600867	通化东宝	13,300	144,039.00	0.24
156	002497	雅化集团	11,000	143,990.00	0.24
157	601997	贵阳银行	27,900	143,406.00	0.23
158	600895	张江高科	7,400	142,820.00	0.23
159	300001	特锐德	7,100	142,710.00	0.23
160	605358	立昂微	5,200	142,428.00	0.23
161	000998	隆平高科	10,100	142,410.00	0.23
162	600143	金发科技	17,800	142,222.00	0.23
163	300390	天华新能	5,610	142,213.50	0.23
164	603712	七一二	4,500	141,795.00	0.23
165	000703	恒逸石化	21,000	141,120.00	0.23
166	600516	方大炭素	26,900	140,956.00	0.23
167	688772	珠海冠宇	6,379	140,401.79	0.23
168	300024	机器人	11,800	140,066.00	0.23
169	600416	湘电股份	8,800	139,744.00	0.23
170	002432	九安医疗	3,700	139,379.00	0.23
171	600549	厦门钨业	8,100	139,158.00	0.23
172	603077	和邦生物	58,900	139,004.00	0.23
173	688390	固德威	1,064	138,937.12	0.23
174	002240	盛新锂能	6,100	138,775.00	0.23
175	600170	上海建工	59,300	138,762.00	0.23
176	002407	多氟多	9,100	138,502.00	0.23
177	600153	建发股份	14,300	137,709.00	0.22
178	002430	杭氧股份	4,700	137,287.00	0.22
179	688301	奕瑞科技	420	136,609.20	0.22
180	601966	玲珑轮胎	7,100	136,533.00	0.22
181	600392	盛和资源	13,400	136,412.00	0.22
182	600141	兴发集团	7,400	135,050.00	0.22

183	000960	锡业股份	9,400	134,608.00	0.22
184	000039	中集集团	17,550	134,257.50	0.22
185	000623	吉林敖东	8,800	133,232.00	0.22
186	300383	光环新网	13,700	133,164.00	0.22
187	688220	翱捷科技	1,886	132,849.84	0.22
188	688052	纳芯微	794	132,478.90	0.22
189	300748	金力永磁	6,540	132,238.80	0.22
190	002065	东华软件	21,400	132,038.00	0.22
191	600704	物产中大	29,700	131,571.00	0.21
192	300212	易华录	4,180	131,461.00	0.21
193	600909	华安证券	26,890	131,223.20	0.21
194	603658	安图生物	2,300	131,123.00	0.21
195	600998	九州通	18,639	130,659.39	0.21
196	601717	郑煤机	10,300	130,295.00	0.21
197	300487	蓝晓科技	2,450	129,997.00	0.21
198	000750	国海证券	36,500	129,210.00	0.21
199	002203	海亮股份	11,400	127,110.00	0.21
200	002064	华峰化学	18,900	126,819.00	0.21
201	600673	东阳光	17,200	126,076.00	0.21
202	603456	九洲药业	5,200	125,892.00	0.21
203	002268	电科网安	5,600	125,776.00	0.21
204	600583	海油工程	21,100	125,334.00	0.20
205	600166	福田汽车	45,800	125,034.00	0.20
206	002025	航天电器	2,600	124,852.00	0.20
207	600521	华海药业	8,500	124,695.00	0.20
208	000050	深天马 A	11,700	124,605.00	0.20
209	002368	太极股份	4,219	124,587.07	0.20
210	300558	贝达药业	2,400	123,720.00	0.20
211	002299	圣农发展	7,200	123,696.00	0.20
212	601456	国联证券	11,400	123,576.00	0.20
213	000738	航发控制	6,200	123,380.00	0.20
214	002939	长城证券	15,400	123,200.00	0.20
215	002568	百润股份	5,000	123,050.00	0.20
216	603338	浙江鼎力	2,400	122,808.00	0.20
217	000513	丽珠集团	3,500	122,535.00	0.20
218	300114	中航电测	2,800	122,500.00	0.20
219	600398	海澜之家	16,500	122,430.00	0.20
220	002506	协鑫集成	44,600	122,204.00	0.20
221	689009	九号公司	4,100	121,606.00	0.20
222	600859	王府井	7,600	121,372.00	0.20
223	002128	电投能源	8,500	121,295.00	0.20
224	600863	内蒙华电	31,100	121,290.00	0.20
225	600820	隧道股份	21,000	120,960.00	0.20



226	002429	兆驰股份	21,600	120,528.00	0.20
227	601216	君正集团	32,200	120,428.00	0.20
228	000636	风华高科	8,800	120,208.00	0.20
229	002092	中泰化学	19,700	120,170.00	0.20
230	600739	辽宁成大	10,200	120,156.00	0.20
231	002414	高德红外	16,300	118,990.00	0.19
232	002373	千方科技	10,600	118,826.00	0.19
233	300253	卫宁健康	16,400	117,916.00	0.19
234	600435	北方导航	10,000	117,400.00	0.19
235	002926	华西证券	15,000	116,400.00	0.19
236	300296	利亚德	19,300	115,800.00	0.19
237	000729	燕京啤酒	13,400	115,642.00	0.19
238	600655	豫园股份	18,600	115,506.00	0.19
239	300676	华大基因	2,400	115,200.00	0.19
240	300595	欧普康视	5,100	115,158.00	0.19
241	300244	迪安诊断	4,800	114,288.00	0.19
242	688567	孚能科技	7,000	114,170.00	0.19
243	300251	光线传媒	14,000	114,100.00	0.19
244	300009	安科生物	11,156	114,014.32	0.19
245	600325	华发股份	15,800	113,918.00	0.19
246	300373	扬杰科技	3,100	113,770.00	0.19
247	600021	上海电力	13,400	113,364.00	0.19
248	002595	豪迈科技	3,800	113,126.00	0.18
249	600008	首创环保	42,010	113,006.90	0.18
250	600271	航天信息	10,600	112,784.00	0.18
251	000519	中兵红箭	8,000	112,320.00	0.18
252	600498	烽火通信	6,700	111,488.00	0.18
253	600563	法拉电子	1,200	111,120.00	0.18
254	601016	节能风电	36,990	110,970.00	0.18
255	002500	山西证券	20,530	110,656.70	0.18
256	600380	健康元	8,900	110,627.00	0.18
257	600004	白云机场	11,300	110,514.00	0.18
258	000830	鲁西化工	11,000	110,330.00	0.18
259	002507	涪陵榨菜	7,710	110,175.90	0.18
260	600566	济川药业	3,500	110,005.00	0.18
261	002372	伟星新材	7,600	109,972.00	0.18
262	603233	大参林	4,410	109,809.00	0.18
263	600282	南钢股份	29,400	108,780.00	0.18
264	002936	郑州银行	53,963	108,465.63	0.18
265	002192	融捷股份	2,000	108,420.00	0.18
266	002281	光迅科技	3,800	108,300.00	0.18
267	688032	禾迈股份	400	108,000.00	0.18
268	600038	中直股份	2,800	107,884.00	0.18

269	000060	中金岭南	24,900	107,568.00	0.18
270	688188	柏楚电子	420	106,306.20	0.17
271	688063	派能科技	1,000	106,000.00	0.17
272	002056	横店东磁	7,800	105,612.00	0.17
273	601636	旗滨集团	15,400	105,336.00	0.17
274	002019	亿帆医药	7,100	104,938.00	0.17
275	300529	健帆生物	4,700	104,481.00	0.17
276	603156	养元饮品	4,900	104,174.00	0.17
277	601880	辽港股份	71,800	104,110.00	0.17
278	300070	碧水源	20,800	103,792.00	0.17
279	300677	英科医疗	4,440	103,718.40	0.17
280	603225	新凤鸣	7,300	103,660.00	0.17
281	688234	天岳先进	1,568	103,597.76	0.17
282	688005	容百科技	2,600	103,480.00	0.17
283	002670	国盛金控	11,100	103,452.00	0.17
284	600511	国药股份	3,600	103,032.00	0.17
285	002120	韵达股份	13,800	102,948.00	0.17
286	600580	卧龙电驱	8,700	102,051.00	0.17
287	002080	中材科技	6,400	101,888.00	0.17
288	300682	朗新集团	6,200	101,618.00	0.17
289	603893	瑞芯微	1,600	101,440.00	0.17
290	002850	科达利	1,200	101,352.00	0.17
291	000547	航天发展	12,100	101,277.00	0.17
292	002557	洽洽食品	2,900	100,978.00	0.16
293	603885	吉祥航空	8,400	100,800.00	0.16
294	600390	五矿资本	21,500	100,620.00	0.16
295	002508	老板电器	4,600	100,188.00	0.16
296	603927	中科软	3,340	100,133.20	0.16
297	600258	首旅酒店	6,400	99,968.00	0.16
298	002531	天顺风能	8,600	99,760.00	0.16
299	688516	奥特维	1,102	99,731.00	0.16
300	688331	荣昌生物	1,600	99,296.00	0.16
301	601000	唐山港	28,200	98,700.00	0.16
302	603737	三棵树	2,060	98,076.60	0.16
303	603444	吉比特	400	98,048.00	0.16
304	601933	永辉超市	34,600	97,572.00	0.16
305	000598	兴蓉环境	17,100	97,299.00	0.16
306	002572	索菲亚	6,100	97,295.00	0.16
307	300026	红日药业	22,900	97,096.00	0.16
308	002958	青农商行	37,000	96,940.00	0.16
309	603517	绝味食品	3,600	96,696.00	0.16
310	002831	裕同科技	3,500	96,285.00	0.16
311	688538	和辉光电	39,600	96,228.00	0.16

312	601179	中国西电	19,500	96,135.00	0.16
313	000970	中科三环	9,260	95,841.00	0.16
314	002487	大金重工	3,600	95,832.00	0.16
315	601778	晶科科技	27,200	95,200.00	0.16
316	601231	环旭电子	6,300	95,193.00	0.16
317	000155	川能动力	7,100	94,359.00	0.15
318	600970	中材国际	10,100	94,334.00	0.15
319	000887	中鼎股份	7,600	94,012.00	0.15
320	300438	鹏辉能源	3,300	93,357.00	0.15
321	603185	弘元绿能	2,800	93,184.00	0.15
322	688200	华峰测控	758	93,082.40	0.15
323	002865	钧达股份	1,200	92,976.00	0.15
324	688536	思瑞浦	635	92,900.50	0.15
325	688385	复旦微电	2,400	92,712.00	0.15
326	600707	彩虹股份	13,700	92,475.00	0.15
327	600906	财达证券	12,300	92,250.00	0.15
328	600848	上海临港	9,100	91,455.00	0.15
329	600329	达仁堂	2,700	90,855.00	0.15
330	002030	达安基因	9,360	90,604.80	0.15
331	600481	双良节能	10,700	90,522.00	0.15
332	603858	步长制药	5,300	90,153.00	0.15
333	600959	江苏有线	28,600	89,804.00	0.15
334	600995	南网储能	9,100	89,726.00	0.15
335	002155	湖南黄金	8,000	89,120.00	0.15
336	000563	陕国投 A	29,300	89,072.00	0.15
337	600755	厦门国贸	12,700	88,519.00	0.14
338	601866	中远海发	37,800	88,452.00	0.14
339	600977	中国电影	7,200	88,128.00	0.14
340	600208	新湖中宝	40,600	88,102.00	0.14
341	000027	深圳能源	13,600	87,720.00	0.14
342	688029	南微医学	900	87,120.00	0.14
343	000778	新兴铸管	22,800	87,096.00	0.14
344	300357	我武生物	3,000	87,000.00	0.14
345	601958	金钼股份	9,200	86,940.00	0.14
346	600316	洪都航空	4,100	86,797.00	0.14
347	600131	国网信通	5,700	86,355.00	0.14
348	002683	广东宏大	4,300	86,344.00	0.14
349	000739	普洛药业	5,600	86,184.00	0.14
350	000987	越秀资本	14,290	86,025.80	0.14
351	600582	天地科技	15,800	85,952.00	0.14
352	601991	大唐发电	35,500	85,910.00	0.14
353	002244	滨江集团	11,800	85,786.00	0.14
354	601665	齐鲁银行	21,800	85,238.00	0.14

355	002266	浙富控股	25,030	85,102.00	0.14
356	300888	稳健医疗	2,280	84,930.00	0.14
357	002032	苏泊尔	1,600	84,816.00	0.14
358	603127	昭衍新药	3,572	84,692.12	0.14
359	600373	中文传媒	6,400	84,352.00	0.14
360	603883	老百姓	2,818	84,230.02	0.14
361	600737	中粮糖业	10,200	84,048.00	0.14
362	000709	河钢股份	39,400	83,922.00	0.14
363	002326	永太科技	7,000	81,340.00	0.13
364	000825	太钢不锈	21,800	81,314.00	0.13
365	600056	中国医药	7,200	80,424.00	0.13
366	603267	鸿远电子	1,600	80,320.00	0.13
367	603379	三美股份	2,360	80,240.00	0.13
368	600598	北大荒	6,700	80,199.00	0.13
369	601611	中国核建	11,500	79,695.00	0.13
370	600801	华新水泥	6,400	79,552.00	0.13
371	600378	昊华科技	2,600	79,248.00	0.13
372	000785	居然之家	24,000	79,200.00	0.13
373	000883	湖北能源	18,700	79,101.00	0.13
374	600528	中铁工业	10,600	78,864.00	0.13
375	688082	盛美上海	755	78,829.55	0.13
376	601598	中国外运	15,000	78,600.00	0.13
377	600901	江苏金租	16,200	78,408.00	0.13
378	600517	国网英大	16,400	78,228.00	0.13
379	300363	博腾股份	3,100	77,965.00	0.13
380	603568	伟明环保	4,860	77,760.00	0.13
381	300776	帝尔激光	1,280	77,132.80	0.13
382	002511	中顺洁柔	7,700	77,000.00	0.13
383	603826	坤彩科技	1,300	76,739.00	0.13
384	603650	彤程新材	2,300	76,590.00	0.13
385	002153	石基信息	7,840	76,361.60	0.12
386	601992	金隅集团	39,700	75,827.00	0.12
387	003035	南网能源	14,400	75,744.00	0.12
388	600500	中化国际	17,100	75,582.00	0.12
389	601106	中国一重	26,100	75,168.00	0.12
390	002653	海思科	3,200	74,080.00	0.12
391	603026	胜华新材	1,600	73,376.00	0.12
392	600827	百联股份	7,700	73,073.00	0.12
393	600062	华润双鹤	3,900	72,540.00	0.12
394	000581	威孚高科	4,800	72,336.00	0.12
395	603228	景旺电子	3,200	72,192.00	0.12
396	000937	冀中能源	10,100	72,114.00	0.12
397	002408	齐翔腾达	13,600	71,808.00	0.12

398	600871	石化油服	38,800	71,004.00	0.12
399	001227	兰州银行	27,200	70,720.00	0.12
400	603707	健友股份	4,661	69,915.00	0.11
401	600022	山东钢铁	50,900	69,733.00	0.11
402	003022	联泓新科	3,800	69,578.00	0.11
403	601098	中南传媒	6,800	69,156.00	0.11
404	601118	海南橡胶	16,300	69,112.00	0.11
405	603305	旭升集团	3,500	69,055.00	0.11
406	600126	杭钢股份	12,900	68,757.00	0.11
407	601156	东航物流	4,600	67,988.00	0.11
408	600315	上海家化	3,200	67,776.00	0.11
409	600764	中国海防	2,700	67,365.00	0.11
410	600967	内蒙一机	8,100	66,906.00	0.11
411	688779	长远锂科	9,100	66,430.00	0.11
412	688276	百克生物	1,202	65,881.62	0.11
413	002690	美亚光电	3,340	65,597.60	0.11
414	688778	厦钨新能	1,654	65,564.56	0.11
415	000559	万向钱潮	12,600	65,394.00	0.11
416	000401	冀东水泥	10,200	65,178.00	0.11
417	000156	华数传媒	8,800	64,856.00	0.11
418	688520	神州细胞	1,201	64,697.87	0.11
419	601928	凤凰传媒	7,300	64,313.00	0.11
420	601187	厦门银行	12,600	63,882.00	0.10
421	002867	周大生	4,200	63,756.00	0.10
422	601608	中信重工	16,500	63,690.00	0.10
423	002518	科士达	2,300	63,480.00	0.10
424	300861	美畅股份	1,900	63,251.00	0.10
425	000089	深圳机场	9,800	63,014.00	0.10
426	688349	三一重能	2,200	62,964.00	0.10
427	603529	爱玛科技	2,500	62,600.00	0.10
428	600808	马钢股份	22,900	62,288.00	0.10
429	600663	陆家嘴	7,100	62,125.00	0.10
430	600095	湘财股份	8,200	61,582.00	0.10
431	001286	陕西能源	7,200	61,560.00	0.10
432	002010	传化智联	13,300	61,446.00	0.10
433	000958	电投产融	15,400	60,676.00	0.10
434	603218	日月股份	4,900	60,613.00	0.10
435	688425	铁建重工	15,200	60,344.00	0.10
436	300257	开山股份	3,800	59,888.00	0.10
437	688208	道通科技	2,500	59,375.00	0.10
438	000930	中粮科技	8,900	59,096.00	0.10
439	002423	中粮资本	8,800	58,784.00	0.10
440	603866	桃李面包	7,613	58,315.58	0.10

441	002505	鹏都农牧	36,400	58,240.00	0.10
442	000967	盈峰环境	12,100	57,475.00	0.09
443	002925	盈趣科技	2,930	57,047.10	0.09
444	002468	申通快递	7,300	56,867.00	0.09
445	000898	鞍钢股份	22,800	56,772.00	0.09
446	600597	光明乳业	6,500	56,745.00	0.09
447	600968	海油发展	19,400	55,290.00	0.09
448	688107	安路科技	1,503	55,280.34	0.09
449	300850	新强联	1,700	54,111.00	0.09
450	601568	北元集团	11,370	53,893.80	0.09
451	002761	浙江建投	5,200	53,352.00	0.09
452	003031	中瓷电子	600	52,938.00	0.09
453	000959	首钢股份	14,800	51,208.00	0.08
454	688006	杭可科技	2,179	51,162.92	0.08
455	000537	中绿电	5,300	51,039.00	0.08
456	603786	科博达	700	49,952.00	0.08
457	688281	华秦科技	367	49,787.22	0.08
458	688690	纳微科技	1,800	49,356.00	0.08
459	600167	联美控股	8,700	49,329.00	0.08
460	600377	宁沪高速	4,800	49,200.00	0.08
461	688348	昱能科技	400	48,952.00	0.08
462	002791	坚朗五金	1,200	48,588.00	0.08
463	600339	中油工程	16,000	48,480.00	0.08
464	001914	招商积余	4,000	47,840.00	0.08
465	002608	江苏国信	7,200	47,304.00	0.08
466	688387	信科移动	6,400	46,144.00	0.08
467	688297	中无人机	1,200	45,996.00	0.08
468	601228	广州港	14,400	45,072.00	0.07
469	001203	大中矿业	4,400	44,748.00	0.07
470	002563	森马服饰	7,700	44,429.00	0.07
471	600350	山东高速	6,400	44,416.00	0.07
472	600927	永安期货	2,800	43,988.00	0.07
473	301029	怡合达	1,680	43,310.40	0.07
474	600928	西安银行	12,700	42,291.00	0.07
475	603056	德邦股份	2,900	41,963.00	0.07
476	000539	粤电力 A	8,500	41,565.00	0.07
477	000402	金融街	11,400	41,382.00	0.07
478	002399	海普瑞	3,500	41,055.00	0.07
479	601298	青岛港	6,600	40,788.00	0.07
480	603317	天味食品	3,056	40,614.24	0.07
481	601828	美凯龙	10,400	40,248.00	0.07
482	600925	苏能股份	7,300	40,223.00	0.07
483	688153	唯捷创芯	600	39,300.00	0.06

484	002945	华林证券	2,600	39,260.00	0.06
485	601139	深圳燃气	5,500	37,895.00	0.06
486	688819	天能股份	1,300	36,296.00	0.06
487	601061	中信金属	4,700	36,237.00	0.06
488	000031	大悦城	12,200	36,234.00	0.06
489	001872	招商港口	2,200	35,112.00	0.06
490	688295	中复神鹰	1,138	34,492.78	0.06
491	688105	诺唯赞	1,007	32,244.14	0.05
492	601158	重庆水务	5,500	31,185.00	0.05
493	600299	安迪苏	3,800	30,400.00	0.05
494	000553	安道麦 A	4,200	29,148.00	0.05
495	600956	新天绿能	3,300	26,829.00	0.04
496	603355	莱克电气	1,080	24,084.00	0.04
497	688375	国博电子	300	23,859.00	0.04
498	603868	飞科电器	400	20,200.00	0.03
499	688248	南网科技	799	19,951.03	0.03
500	600032	浙江新能	2,100	16,926.00	0.03

### 8.3.2 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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	400174	中天 3	44,600	0.00	0.00

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.4.1 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	300502	新易盛	375,917.00	0.62
2	002463	沪电股份	277,804.00	0.46
3	000066	中国长城	265,594.00	0.44
4	300394	天孚通信	258,965.00	0.43
5	002517	恺英网络	251,122.00	0.41
6	000423	东阿阿胶	235,229.00	0.39
7	301236	软通动力	226,154.00	0.37
8	688072	拓荆科技	224,757.38	0.37
9	000933	神火股份	219,232.00	0.36
10	300207	欣旺达	214,157.00	0.35
11	300395	菲利华	214,030.00	0.35
12	600372	中航机载	212,269.00	0.35
13	688122	西部超导	210,430.19	0.35
14	002240	盛新锂能	209,731.00	0.34
15	000723	美锦能源	205,282.00	0.34
16	300601	康泰生物	204,808.00	0.34

17	002008	大族激光	202,682.00	0.33
18	688120	华海清科	200,702.00	0.33
19	603882	金域医学	192,086.00	0.32
20	002607	中公教育	191,096.00	0.31

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。

#### 8.4.2 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	300308	中际旭创	733,897.00	1.21
2	688256	寒武纪	337,937.26	0.56
3	600489	中金黄金	308,425.00	0.51
4	600372	中航机载	290,079.00	0.48
5	603345	安井食品	258,678.00	0.43
6	000807	云铝股份	256,900.00	0.42
7	688122	西部超导	252,204.60	0.41
8	000999	华润三九	240,998.00	0.40
9	601607	上海医药	240,895.00	0.40
10	600487	亨通光电	240,631.00	0.40
11	688777	中控技术	240,269.97	0.39
12	300832	新产业	240,026.00	0.39
13	002603	以岭药业	221,337.00	0.36
14	603605	珀莱雅	214,350.08	0.35
15	688063	派能科技	206,050.12	0.34
16	601699	潞安环能	193,733.00	0.32
17	300168	万达信息	191,880.00	0.32
18	603606	东方电缆	187,595.00	0.31
19	601872	招商轮船	186,489.00	0.31
20	603613	国联股份	185,337.00	0.30

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。

#### 8.4.3 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	19,809,940.36
卖出股票收入（成交）总额	16,802,455.57

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”和“卖出股票的收入（成交）总额”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。

#### 8.5 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投资。



**8.6 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投资。

**8.7 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投资。

**8.8 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投资。

**8.9 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投资。

**8.10 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金本报告期末未包括股指期货投资，无相关投资政策。

**8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****8.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金本报告期末未包括国债期货投资，无相关投资政策。

**8.11.2 本期国债期货投资评价**

本基金本报告期末未包括国债期货投资，无相关投资政策。

**8.12 投资组合报告附注****8.12.1 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“昆仑万维”的发行主体昆仑万维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创业板公司管理部的监管措施。

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。

**8.12.2 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。

**8.12.3 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	1,070.23
2	应收清算款	110,692.39
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	111,762.62

#### 8.12.4 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。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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

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。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	400174	中天3	0.00	0.00	暂停转让

#### 8.12.6 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

#### 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

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 (%)
391	141,856.98	50,959,780.00	91.88	4,506,300.00	8.12

#### 9.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额 (份)	占总份额比例 (%)
联接基金	49,501,780.00	89.25

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	福州经济技术开发区 数为私募基金管理有 限公司—数为富港通3 号私募证券投资基金	1,455,100.00	2.62

2	谭艳玲	406,700.00	0.73
3	李劲松	326,400.00	0.59
4	刘英虹	250,000.00	0.45
5	曾雨清	187,000.00	0.34
6	龚俐	136,000.00	0.25
7	王振卿	127,900.00	0.23
8	李向阳	116,300.00	0.21
9	冯世彦	114,400.00	0.21
10	王飞	102,700.00	0.19
11	招商银行股份有限公司—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	49,501,780.00	89.25

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：本基金本报告期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

### 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

注：本基金本报告期末基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人和本基金基金经理均未持有本基金。

### 9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

注：无

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2020 年 4 月 30 日） 基金份额总额	251,466,080.00
本报告期期初基金份额总额	51,466,080.00
本报告期基金总申购份额	6,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	2,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	55,466,080.00

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。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

## 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

2023 年 4 月，公司董事会收到股东中国石油集团资本有限责任公司（以下简称“中油资本”）提名董事赵雪松先生、郭旭扬先生递交的辞呈。因工作安排原因，赵雪松先生申请辞去公司董事、董事会战略与发展委员会委员职务；郭旭扬先生申请辞去公司董事、董事会审计委员会委员职务。辞任自中油资本提名新任董事正式履职后生效。2023 年 6 月，公司 2022 年年度股东大会审议通过《关于选举公司第二届董事会非独立董事的议案》，选举宣力勇先生、周静女士担任公司董事。2023 年 8 月，公司原股东上海金融发展投资基金（有限合伙）提名的董事吕厚军先生、监事范寅先生因上海金融发展投资基金（有限合伙）不再持有公司股份，分别向公司董事会、监事会递交了辞任报告。吕厚军先生申请辞去第二届董事会董事、董事会战略与发展委员会委员职务；范寅先生申请辞去第二届监事会监事职务。辞任报告自送达董事会、监事会之日起生效。2023 年 4 月 1 日起，赵向雷不再担任公司执行委员会委员、业务总监。2023 年 5 月，解聘徐高公司执行委员会委员、研究总监职务，仍继续担任公司首席经济学家。

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

## 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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 2023 年年度报告》；

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。

## 11.4 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。

## 11.5 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。本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。本基金本年度应支付给审计机构普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 22,000.00 元人民币，其已提供审计服务的连续年限为 4 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

注：本报告期内，未有管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

### 11.6.2 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，未有托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

## 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

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	6	36,539,658.54	100.00	26,980.48	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；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。

### 11.7.2 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	16,356.20	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；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。

### 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	中银国际证券股份有限公司旗下基金 2022 年第 4 季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 1 月 19 日
2	中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2022 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	2023 年 1 月 19 日
3	中银国际证券股份有限公司旗下基金 2022 年年度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 3 月 30 日
4	中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2022 年年度报告	公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 3 月 30 日
5	中银国际证券股份有限公司旗下基金 2023 年第 1 季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 4 月 20 日
6	中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	上交所、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 4 月 20 日
7	中银国际证券股份有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值调整情况的公告	证券日报、上交所、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 6 月 17 日
8	中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2023 年第 2 季度报告	上交所、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 7 月 20 日
9	中银国际证券股份有限公司旗下基金 2023 年第 2 季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日	2023 年 7 月 20 日

		报、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	
10	中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2023 年中期报告	上交所、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 8 月 30 日
11	中银国际证券股份有限公司旗下基金 2023 年中期报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 8 月 30 日
12	中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金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	2023 年 8 月 31 日
13	中银国际证券股份有限公司旗下基金 2023 年第 3 季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 10 月 24 日
14	中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2023 年第 3 季度报告	公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 10 月 24 日
15	中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书（2023 年第 1 号）	公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 12 月 30 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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	20230101-20231231	47,540,080.00	4,148,600.00	2,186,900.00	49,501,780.00	89.25

#### 产品特有风险

本基金由于存在单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况，如遇市场行情突变可能存在大额赎回甚至巨额赎回的风险，增加基金管理人的流动性管理压力。同时，基金管理人应付赎回的变现行为可能使基金资产净值受到不利影响或者产生较大波动。本基金管理人后期将审慎评估大额申购对基金持有集中度的影响，避免单一投资者集中度继续提高，同时将完善流动性风险风险管控机制，加强对基金持有人利益的保护。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

## § 13 备查文件目录

### 13.1 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

### 13.2 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。

### 13.3 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 3 月 29 日