

# 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 2020 年年度报告

2020 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：2021 年 3 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 2021 年 3 月 30 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 2020 年 5 月 14 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 .....	6
2.4 信息披露方式 .....	6
2.5 其他相关资料 .....	7
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	7
3.2 基金净值表现 .....	8
3.3 其他指标 .....	10
3.4 过去三年基金的利润分配情况 .....	10
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	13
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 .....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 .....	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	15
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 .....	15
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 .....	16
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	16
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 .....	16
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 .....	16
<b>§ 6 审计报告</b> .....	<b>16</b>
6.1 审计报告基本信息 .....	16
6.2 审计报告的基本内容 .....	16
<b>§ 7 年度财务报表</b> .....	<b>18</b>
7.1 资产负债表 .....	18
7.2 利润表 .....	20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	21
7.4 报表附注 .....	21
<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>48</b>

8.1 期末基金资产组合情况 .....	48
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	49
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 .....	50
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	55
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	57
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 .....	57
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 .....	57
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 .....	57
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 .....	57
8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细 .....	57
8.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	57
8.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	58
8.13 投资组合报告附注 .....	58
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>59</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	59
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	60
9.3 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 .....	60
9.4 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 .....	60
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>60</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>61</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	61
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 .....	61
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	61
11.4 基金投资策略的改变 .....	61
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	61
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 .....	61
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	62
11.8 其他重大事件 .....	63
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>65</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 .....	65
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	65
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>66</b>
13.1 备查文件目录 .....	66
13.2 存放地点 .....	66
13.3 查阅方式 .....	66

## § 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联接基金	
基金简称	中银证券中证 500ETF 联接基金	
基金主代码	008258	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 5 月 14 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	57,924,665.15 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中银证券中证 500ETF 联接 A	中银证券中证 500ETF 联接 C
下属分级基金的交易代码	008258	008259
报告期末下属分级基金的份额总额	41,779,026.70 份	16,145,638.45 份

#### 2.1.1 目标基金基本情况

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
基金管理人名称	中银国际证券股份有限公司
基金托管人名称	招商银行股份有限公司

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过主要投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。本基金力争将本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35% 以内，年化跟踪误差控制在 4% 以内。
投资策略	本基金为 ETF 联接基金，通过把全部或接近全部的基金资产投资于目标 ETF、标的指数成份股和备选成份股进行被动式指数化投资，实现对业绩比较基准的紧密跟踪。本基金通过资产配置策略、目标 ETF 投资策略、股票投资策略、债券投资策略、股指期货投资策略、资产支持证券投资策略及融资和转融通证券出借业务策略，以期获得长期稳定收益。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率 $\times$ 95% + 银行活期存款税后利率 $\times$ 5%。
风险收益特征	本基金为中银证券中证 500ETF 的联接基金，主要通过投资于中银证券中证 500ETF 来实现对标的指数的紧密跟踪。因此，本基金的业绩

	表现与中证 500 指数及中银证券中证 500ETF 的表现密切相关。本基金的长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。
--	--

### 2.2.1 目标基金产品说明

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	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	《上海证券报》
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)	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
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

## § 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	2020 年 5 月 14 日(基金合同生效日)-2020 年 12 月 31 日	
	中银证券中证 500ETF 联接 A	中银证券中证 500ETF 联接 C
本期已实现收益	15,138,354.60	5,124,767.40
本期利润	24,338,622.33	7,660,917.59
加权平均基金份额 本期利润	0.3028	0.2408
本期加权平均 净值利润率	26.72%	21.48%
本期基金份额 净值增长率	22.35%	22.19%
3.1.2 期末数 据和指标	2020 年末	
期末可供分配 利润	8,483,342.79	3,252,156.93
期末可供分配 基金份额利润	0.2031	0.2014
期末基金资产 净值	51,115,517.45	19,728,389.35
期末基金份额 净值	1.2235	1.2219
3.1.3 累计期 末指标	2020 年末	
基金份额累计 净值增长率	22.35%	22.19%

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

中银证券中证 500ETF 联接 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.93%	1.08%	2.70%	1.10%	0.23%	-0.02%
过去六个月	14.45%	1.31%	8.20%	1.38%	6.25%	-0.07%
自基金合同生效起至今	22.35%	1.19%	14.30%	1.30%	8.05%	-0.11%

中银证券中证 500ETF 联接 C

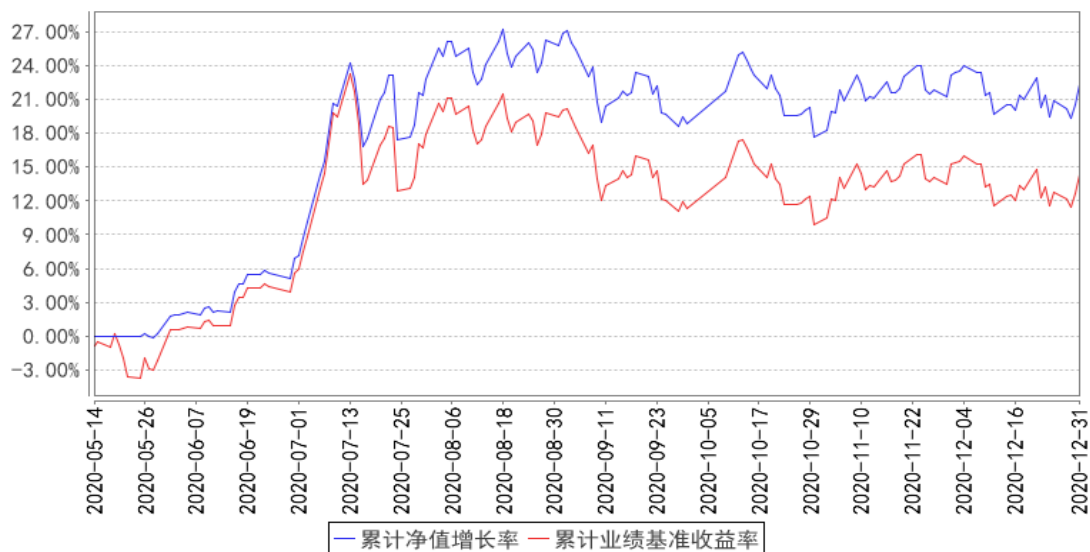
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.87%	1.08%	2.70%	1.10%	0.17%	-0.02%
过去六个月	14.34%	1.31%	8.20%	1.38%	6.14%	-0.07%
自基金合同生效起至今	22.19%	1.19%	14.30%	1.30%	7.89%	-0.11%

注：本基金成立于 2020 年 5 月 14 日，本基金的业绩比较基准为中证 500 指数收益率\*95%+银行活期存款税后利率\*5%。

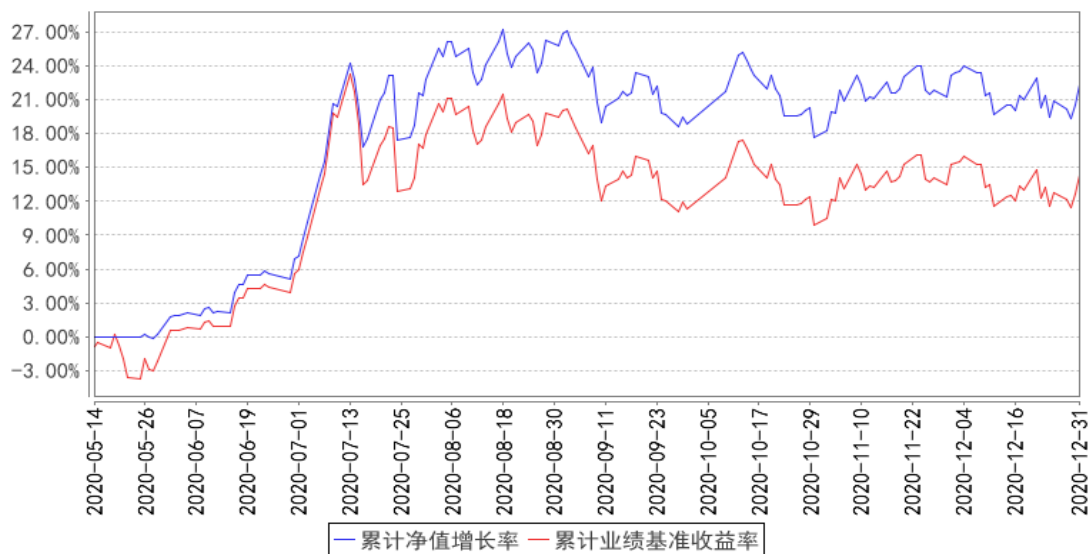


### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

中银证券中证500ETF联接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



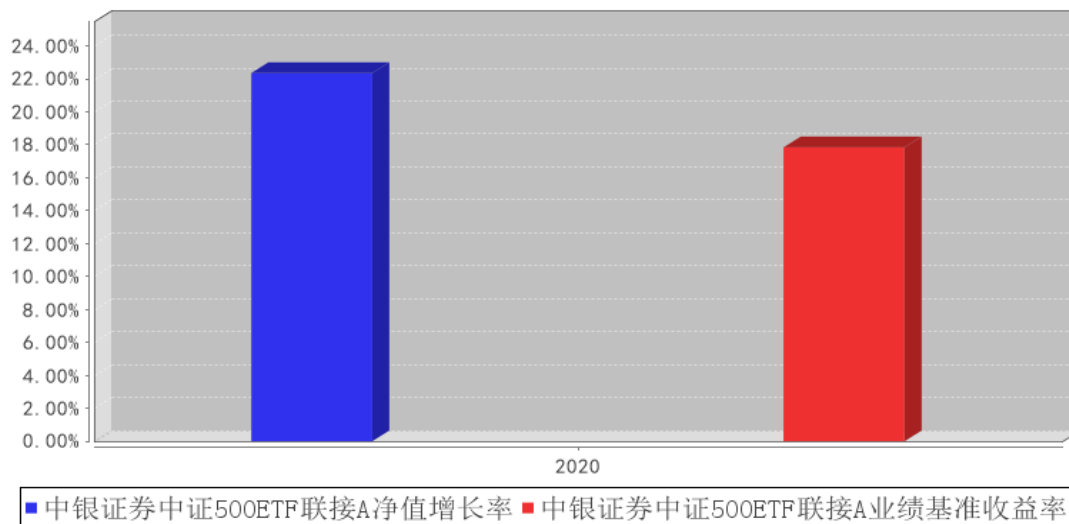
中银证券中证500ETF联接C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



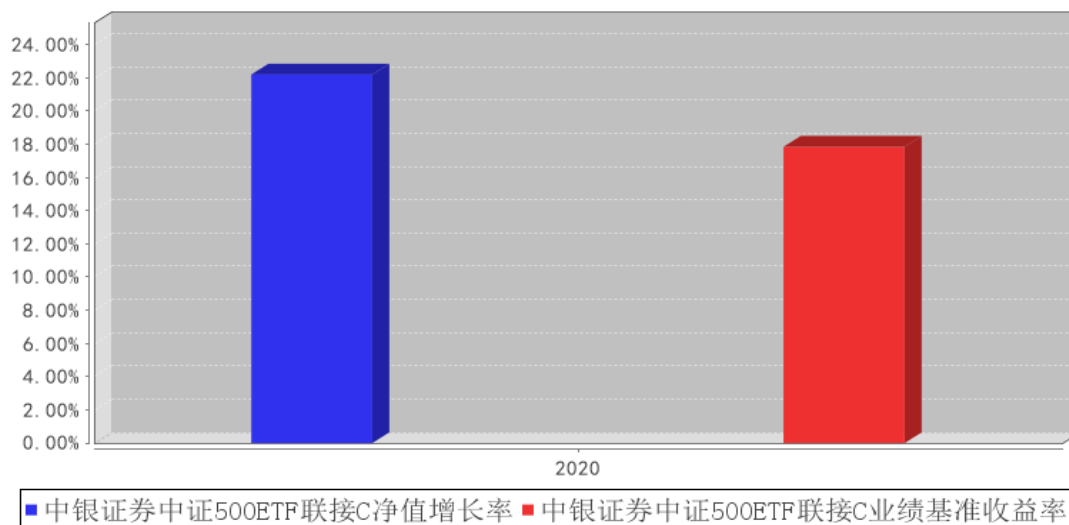
注：本基金合同于 2020 年 5 月 14 日生效。

### 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联接A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



中银证券中证500ETF联接C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“中银国际证券”)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。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、上海金融发展投资基金(有限合伙)、云南省投资控股集团有限公司、江西铜业股份有限公司、中国通用技术(集团)控股有限责任公司、上海祥众投资合伙企业(有限合伙)、信泰人寿保险股份有限公司—传统产品、江苏洋河酒厂股份有限公司、上海郝乾企业管理中心(有限合伙)。中银国际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 2020 年 12 月 31 日,本管理人共管理二十七只证券投资基金,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,中银证券祥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 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金、中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、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。

#### 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		
阳桦	本基金的基金经理	2020 年 5 月 14 日	-	10 年	阳桦，硕士研究生，中国国籍，已取得证券、基金从业资格。2008 年 7 月至 2009 年 6 月任职于富邦证券（上海代表处），担任行业研究员；2009 年 7 月至 2010 年 6 月任职于中山证券有限责任公司，担任行业研究员；2010 年 6 月加入中银国际证券股份有限公司，担任行业研究员、投资经理，历任中银证券价值精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理，现任中银证券祥瑞混合型证券投资基金、中银证券科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金、中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、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基金经理。
张艺敏	本基金的基金经理	2020 年 9 月 15 日	-	3 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行业协会《证券从业人员资格管理办法》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

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	-	-

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

基金经理薪酬由固定薪酬、福利和年度奖金三部分组成。其中固定薪酬指每月固定发放的工资；年度奖金指在每个考核年度发放给员工的现金奖励。固定薪酬与年度奖金共同构成年度现金总收入。

#### 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，建立了基金管理业务、资产管理业务公平交易管理办法、产品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

本基金为 ETF 联接基金，通过将主要基金资产投资于目标 ETF 及标的指数成分和备选成分股，以实现对标指数的紧密跟踪，力争基金跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。报告期内本基金 A 类份额日均跟踪偏离度为 0.04%，年化跟踪误差为 5.37%，C 类份额日均跟踪偏离度为 0.04%，年化跟踪误差为 5.37%。本基金的跟踪误差主要来源于基金成立初期建仓、基金份额的申购赎回、标的指数成分股调整等。

#### 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中证 500ETF 联接 A 基金份额净值为 1.2235 元，本报告期基金份额净值增长率为 22.35%；同期业绩比较基准收益率为 14.30%。截至本报告期末中银证券中证 500ETF 联接 C 基金份额净值为 1.2219 元，本报告期基金份额净值增长率为 22.19%；同期业绩比较基准收益率为 14.30%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金作为目标 ETF 的联接基金，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。

### 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，并定期向监管机构、公司董事会出具监察稽核报告。

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

本基金管理人为了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、业务营运部、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(2021)第 21755 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联接基金全体基金份额持有人：
审计意见	（一）我们审计的内容 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联接基金(以下简称“中银证券中证 500ETF 联接基金”)的财务报表，包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表，2020 年 5 月 14 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附



	<p>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 联接基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年 5 月 14 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。</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 联接基金, 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 联接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 联接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 联接基金、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 联接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</p>

	<p>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，就可能对导致对中银证券中证 500ETF 联接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 联接基金不能持续经营。</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	张振波   叶尔甸
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场二座普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2021 年 3 月 26 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联接基金

报告截止日：2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	7.4.7.1	5,114,729.24
结算备付金		-
存出保证金		68,340.61
交易性金融资产	7.4.7.2	67,179,064.76
其中：股票投资		1,522,170.60
基金投资		65,656,894.16
债券投资		-

资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		222,491.57
应收利息	7.4.7.5	549.40
应收股利		-
应收申购款		284,417.31
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		72,869,592.89
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020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		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		1,887,879.54
应付管理人报酬		620.49
应付托管费		206.88
应付销售服务费		3,068.53
应付交易费用	7.4.7.7	3,761.56
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	130,149.09
负债合计		2,025,686.09
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	7.4.7.9	57,924,665.15
未分配利润	7.4.7.10	12,919,241.65
所有者权益合计		70,843,906.80
负债和所有者权益总计		72,869,592.89

注：1. 报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额总额 57,924,665.15 份，其中中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 A 类基金份额净值 1.2235 元，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 A 类基金份额 41,779,026.70 份；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 C 类基金份额净值 1.2219 元，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 C 类基金份额 16,145,638.45 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2020 年 5 月 14 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日止

期间。

## 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联接基金

本报告期：2020 年 5 月 14 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 5 月 14 日（基金合同 生效日）至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		32,503,510.57
1. 利息收入		78,429.06
其中：存款利息收入	7.4.7.11	78,429.06
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		-
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		20,403,000.15
其中：股票投资收益	7.4.7.12	2,219,760.53
基金投资收益	7.4.7.13	18,086,287.53
债券投资收益	7.4.7.14	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.14.5	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-
股利收益	7.4.7.17	96,952.09
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	11,736,417.92
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	285,663.44
减：二、费用		503,970.65
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	28,631.42
2. 托管费	7.4.10.2.2	9,543.89
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	44,290.49
4. 交易费用	7.4.7.20	281,411.01
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		-
7. 其他费用	7.4.7.21	140,093.84
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		31,999,539.92
减：所得税费用		-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		31,999,539.92
-------------------	--	---------------

### 7.3 所有者权益（基金净值）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联接基金

本报告期：2020 年 5 月 14 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 5 月 14 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	311,722,044.27	-	311,722,044.27
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	31,999,539.92	31,999,539.92
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-253,797,379.12	-19,080,298.27	-272,877,677.39
其中：1. 基金申购款	60,769,182.18	11,322,855.63	72,092,037.81
2. 基金赎回款	-314,566,561.30	-30,403,153.90	-344,969,715.20
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	57,924,665.15	12,919,241.65	70,843,906.80

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：

宁敏

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联接基金（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]2051 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联接基金注册的批复》准予注册, 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联接基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式, 存续期限不定, 首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 311, 586, 865. 16 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 0381 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联接基金基金合同》于 2020 年 5 月 14 日正式生效, 基金合同生效日的基金份额总额为 311, 722, 044. 27 份基金份额, 其中认购资金利息折合 135, 179. 11 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”)。

根据《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基金合同》的有关规定, 本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同, 将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购时收取认购、申购费用, 在赎回时收取赎回费, 但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额, 称为 A 类基金份额; 在投资者认购、申购时不收取认购、申购费用, 但赎回时收取赎回费, 并从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额, 称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类两种收费模式并存, 由于基金费用的不同, 本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别计算基金份额净值, 计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

本基金为中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“目标 ETF”)的联接基金。目标 ETF 是采用完全复制法实现对中证 500 指数紧密跟踪的被动指数基金, 本基金主要通过投资于目标 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪, 力争使将本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0. 35%, 年化跟踪误差不超过 4%。

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联接基金基金合同》的有关规定, 本基金以目标 ETF 基金份额、标的指数成份股及备选成份股为主要投资对象。此外, 为更好地实现投资目标, 本基金可少量投资于非成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、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、超短期融资券等)、货币市场工具、股指期货、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)、资产支持证券、同业存单、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)。

本基金可以根据相关法律法规的规定参与融资和转融通证券出借业务。本基金投资于目标 ETF 的资产比例不低于基金资产净值的 90%，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，持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%，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：中证 500 指数收益率×95%+银行活期存款税后利率×5%。

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 2021 年 3 月 26 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》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》《中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》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 2020 年 5 月 14 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日止期间的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年 5 月 14 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

##### 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。本期财务报表的实际编制期间为 2020 年 5 月 14 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日。

#### 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

##### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

##### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。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。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 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于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的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，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的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。

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、基金投资、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。上述申购和赎回分

别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 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值比例计算的金额。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值比例计算的金额。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。基金投资在持有期间应取得的红利于除息日确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债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利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

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在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

其他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

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 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) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)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《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度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、资产支持证券和私募债券除外)，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。

(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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	5,114,729.24
定期存款	-
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	-
合计	5,114,729.24

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,504,144.17	1,522,170.60	18,026.43
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债   交易所市场	-	-	-

券	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		53,938,502.67	65,656,894.16	11,718,391.49
其他		-	-	-
合计		55,442,646.84	67,179,064.76	11,736,417.92

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 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：本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日
应收活期存款利息	515.63
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	33.77
合计	549.40

#### 7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2020 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	3,761.56
银行间市场应付交易费用	-
合计	3,761.56

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	149.09
应付证券出借违约金	-
预提费用	130,000.00
合计	130,149.09

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

中银证券中证 500ETF 联接 A

项目	本期 2020 年 5 月 14 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	180,246,324.48	180,246,324.48
本期申购	36,997,137.96	36,997,137.96
本期赎回（以“-”号填列）	-175,464,435.74	-175,464,435.74
-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	41,779,026.70	41,779,026.70

中银证券中证 500ETF 联接 C

项目	本期 2020 年 5 月 14 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	131,475,719.79	131,475,719.79
本期申购	23,772,044.22	23,772,044.22
本期赎回（以“-”号填列）	-139,102,125.56	-139,102,125.56
-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	16,145,638.45	16,145,638.45

注：1. 申购含级别调整入份额；赎回含级别调整出份额。

2. 本基金自 2020 年 4 月 7 日至 2020 年 5 月 8 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人

人民币 311,586,865.16 元,折合为 311,586,865.16 份基金份额(其中 A 类基金份额 180,145,305.66 份, C 类基金份额 131,441,559.50 份)。根据《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招募说明书》的规定,本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币 135,179.11 元在本基金成立后,折合为 135,179.11 份基金份额(其中 A 类基金份额 101,018.82 份, C 类基金份额 34,160.29 份),划入基金份额持有人账户。

3. 根据《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基金合同》、《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招募说明书》及《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开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告》的相关规定,本基金于 2020 年 5 月 14 日(基金合同生效日)至 2020 年 5 月 20 日止期间暂不向投资人开放基金交易,申购业务、赎回业务和转换业务自 2020 年 5 月 21 日起开始办理。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位:人民币元

中银证券中证 500ETF 联接 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	15,138,354.60	9,200,267.73	24,338,622.33
本期基金份额交易产生的变动数	-6,655,011.81	-8,347,119.77	-15,002,131.58
其中:基金申购款	3,418,927.07	3,599,304.12	7,018,231.19
基金赎回款	-10,073,938.88	-11,946,423.89	-22,020,362.77
本期已分配利润	-	-	-
本期末	8,483,342.79	853,147.96	9,336,490.75

中银证券中证 500ETF 联接 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	5,124,767.40	2,536,150.19	7,660,917.59
本期基金份额交易产生的变动数	-1,872,610.47	-2,205,556.22	-4,078,166.69
其中:基金申	2,616,550.70	1,688,073.74	4,304,624.44



购款			
基金赎回款	-4,489,161.17	-3,893,629.96	-8,382,791.13
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,252,156.93	330,593.97	3,582,750.90

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2020年5月14日（基金合同生效日）至2020年12月31日	
活期存款利息收入		74,557.81
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		3,200.84
其他		670.41
合计		78,429.06

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2020年5月14日（基金合同生效日）至2020年12月31日	
股票投资收益——买卖股票差价收入		1,773,182.46
股票投资收益——赎回差价收入		-
股票投资收益——申购差价收入		446,578.07
股票投资收益——证券出借差价收入		-
合计		2,219,760.53

##### 7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2020年5月14日（基金合同生效日）至2020年12月31日	
卖出股票成交总额		110,899,977.34
减：卖出股票成本总额		109,126,794.88
买卖股票差价收入		1,773,182.46

**7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入**

注：本基金本报告期无股票投资收益——赎回差价收入。

**7.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2020年5月14日（基金合同生效日）至2020年12月 31日
申购基金份额总额	106,016,271.50
减：现金支付申购款总额	60,241,870.53
减：申购股票成本总额	45,327,822.90
申购差价收入	446,578.07

**7.4.7.12.5 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。

**7.4.7.13 基金投资收益**

单位：人民币元

项目	本期 2020年5月14日（基金合同生效日）至2020年12月31日
卖出/赎回基金成交总额	157,577,738.51
减：卖出/赎回基金成本总额	139,491,450.98
基金投资收益	18,086,287.53

**7.4.7.14 债券投资收益****7.4.7.14.1 债券投资收益项目构成**

注：本基金本报告期无债券投资收益。

**7.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

注：本基金本报告期无债券投资收益——买卖债券差价收入。

**7.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入**

注：本基金本报告期无债券投资收益——赎回差价收入。

**7.4.7.14.4 债券投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期无债券投资收益——申购差价收入。

**7.4.7.14.5 资产支持证券投资收益**

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

**7.4.7.15 贵金属投资收益****7.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成**

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

**7.4.7.15.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

注：本基金本报告期无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

**7.4.7.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

注：本基金本报告期无贵金属投资收益——赎回差价收入。

**7.4.7.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期无贵金属投资收益——申购差价收入。

**7.4.7.16 衍生工具收益****7.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期无衍生工具投资收益——买卖权证差价收入。

**7.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益**

注：本基金本报告期无衍生工具投资收益——其他投资收益。

**7.4.7.17 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2020年5月14日（基金合同生效日）至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	96,952.09
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	96,952.09

## 7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2020 年 5 月 14 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	11,736,417.92
股票投资	18,026.43
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	11,718,391.49
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	11,736,417.92

## 7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020 年 5 月 14 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	285,216.80
基金转换费收入	446.06
其他	0.58
合计	285,663.44

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

## 7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020 年 5 月 14 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	273,655.79
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	7,755.22
其中：申购费	1,499.33

赎回费	2,099.81
交易费	4,156.08
合计	281,411.01

#### 7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020 年 5 月 14 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
审计费用	50,000.00
信息披露费	80,000.00
证券出借违约金	-
银行费用	8,193.84
账户维护费	1,500.00
其他费用	400.00
合计	140,093.84

#### 7.4.7.22 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。

#### 7.4.8 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	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构

券”)	
中国银行股份有限公司 (“中国银行”)	基金管理人股东的控股股东、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、基金销售机构
中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 (“中证 500ETF”)	本基金的目标 ETF

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

##### 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 2020 年 5 月 14 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
中银证券	198,425,404.49	100.00

###### 7.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的债券交易。

###### 7.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期内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 基金交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 5 月 14 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期基金 成交总额的比例 (%)
中银证券	92,219,285.70	100.00

###### 7.4.10.1.5 权证交易

注：本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

## 7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年5月14日（基金合同生效日）至2020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	145,107.24	100.00	3,761.56	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 2020年5月14日（基金合同生效日）至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	28,631.42
其中：支付销售机构的客户维护费	48,762.29

注：本基金基金资产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费。支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 基金份额部分所对应的基金资产后的余额（若为负数，则取 0）的 0.15% 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扣除前一日所持有目标 ETF 基金份额部分所对应的基金资产后的余额（若为负数，则取 0）\* 0.15% / 当年天数。

## 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年5月14日（基金合同生效日）至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	9,543.89

注：本基金基金资产中投资于目标 ETF 的部分不收取托管费。支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 基金份额部分所对应的基金资产后的余额（若为负数，则取 0）

的 0.05% 年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值扣除前一日所持有目标 ETF 基金份额部分所对应的基金资产后的余额（若为负数，则取 0）\*0.15%/当年天数。

#### 7.4.10.2.3 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 2020 年 5 月 14 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中银证券中证 500ETF 联接 A	中银证券中证 500ETF 联接 C	合计
招商银行	-	6,049.35	6,049.35
中银证券	-	27,725.08	27,725.08
中国银行	-	5,491.05	5,491.05
合计	-	39,265.48	39,265.48

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 0.2% 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：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类的基金资产净值} \times 0.2\% / \text{当年天数}。$$

#### 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：本基金本报告期无与关联方进行银行间同业市场的债券交易。

#### 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

注：于本基金本报告期内除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

#### 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 2020年5月14日（基金合同生效日）至2020年12月 31日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司	5,114,729.24	74,557.81

#### 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2020年12月31日，本基金持有52,174,900.00份目标ETF基金份额，占其总份额的比例为65.66%。

#### 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(2020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：本基金本报告期末未有因认购新发/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

注：本基金本报告期末未有暂时停牌等流通受限股票。

##### 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

本基金为 ETF 联接基金，通过把全部或接近全部的基金资产投资于目标 ETF、标的指数成份股和备选成份股进行被动式指数化投资，实现对业绩比较基准的紧密跟踪。本基金力争将本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35% 以内，年化跟踪误差控制在 4% 以内。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

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确定、调整基金业务的业务权限、讨论重大决策以及检查风险管理状况。风险管理部负责监控和报告公司基金业务的风险敞口和限额使用情况。业务主管对各自业务的风险管理负有首要责任。财务、业务营运、稽核、法律及合规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。

##### 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行招商银行，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，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

#### **7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

注：截至 2020 年 12 月 31 日，本基金未持有期限在一年以内(含)的债券。

#### **7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

注：截至 2020 年 12 月 31 日，本基金未持有期限在一年以内(含)的资产支持证券。

#### **7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

注：截至 2020 年 12 月 31 日，本基金未持有期限在一年以内(含)的同业存单。

#### **7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

注：截至 2020 年 12 月 31 日，本基金未持有期限大于一年的债券。

#### **7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

注：截至 2020 年 12 月 31 日，本基金未持有期限大于一年的资产支持证券。

#### **7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

注：截至 2020 年 12 月 31 日，本基金未持有期限大于一年的同业存单。

### **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 2020 年 12 月 31 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(所有者权益)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。

#### 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、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期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 2020 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 2020 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。

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银行存款、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 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	5,114,729.24	-	-	-	5,114,729.24
存出保证金	68,340.61	-	-	-	68,340.61
交易性金融资产	-	-	-	67,179,064.76	67,179,064.76
应收利息	-	-	-	549.40	549.40
应收申购款	-	-	-	284,417.31	284,417.31
应收证券清算款	-	-	-	222,491.57	222,491.57
资产总计	5,183,069.85	-	-	67,686,523.04	72,869,592.89
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,887,879.54	1,887,879.54
应付管理人报酬	-	-	-	620.49	620.49
应付托管费	-	-	-	206.88	206.88
应付销售服务费	-	-	-	3,068.53	3,068.53
应付交易费用	-	-	-	3,761.56	3,761.56

其他负债	-	-	-	130,149.09	130,149.09
负债总计	-	-	-	2,025,686.09	2,025,686.09
利率敏感度缺口	5,183,069.85	-	-	65,660,836.95	70,843,906.80

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：不适用。

#### 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。

本基金为目标 ETF 联接基金，投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%，所以本基金面临诸如目标 ETF 的管理风险与操作风险、目标 ETF 基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、目标 ETF 的技术风险等风险；本基金作为普通的开放式基金，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仍需保留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，会导致本基金与标的指数

之间的跟踪误差。另外，本基金作为开放式基金，需在每个开放日接受投资者的申购或赎回申请，当发生大额申购和赎回时，将可能对基金净值产生一定冲击。本基金投资于目标 ETF 的方式以申购和赎回为主，但在目标 ETF 二级市场流动性较好的情况下，为了更好地实现本基金的投资目标，减小与标的指数的跟踪偏离度和跟踪误差，也可以通过二级市场交易买卖目标 ETF。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，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 2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	1,522,170.60	2.15
交易性金融资产—基金投资	65,656,894.16	92.68
交易性金融资产—债券投资	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—
其他	—	—
合计	67,179,064.76	94.83

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	—	
	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（2020 年 12 月 31 日）
分析	业绩比较基准上升 5%	2,304,906.51
	业绩比较基准下降 5%	-2,304,906.51

#### 7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：不适用。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 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。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2020 年 12 月 31 日，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中属于第一层次的余额为 67,179,064.76 元，无属于第二层次的余额，无属于第三层次的余额

##### (ii) 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公允价值应属第二层次还是第三层次。

##### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

##### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2020 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。

##### (d) 不以公允价值计量的金融工具

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。

(2) 除公允价值外，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	1,522,170.60	2.09
	其中：股票	1,522,170.60	2.09
2	基金投资	65,656,894.16	90.10
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	5,114,729.24	7.02
8	其他各项资产	575,798.89	0.79
9	合计	72,869,592.89	100.00

## 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	13,484.00	0.02
B	采矿业	66,847.00	0.09
C	制造业	906,985.00	1.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	49,317.60	0.07
E	建筑业	29,872.00	0.04
F	批发和零售业	93,139.00	0.13
G	交通运输、仓储和邮政业	57,407.00	0.08
H	住宿和餐饮业	11,519.00	0.02
I	信息传输、软件和信息技术服务业	59,127.00	0.08
J	金融业	107,314.00	0.15
K	房地产业	71,187.00	0.10
L	租赁和商务服务业	11,914.00	0.02
M	科学研究和技术服务业	1,961.00	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	10,039.00	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	1,936.00	0.00
Q	卫生和社会工作	12,812.00	0.02
R	文化、体育和娱乐业	12,280.00	0.02
S	综合	5,030.00	0.01
	合计	1,522,170.60	2.15

## 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末投资于港股。

## 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

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	600426	华鲁恒升	700	26,110.00	0.04
2	600089	特变电工	2,400	24,360.00	0.03
3	600079	人福医药	700	23,716.00	0.03
4	603589	口子窖	300	20,670.00	0.03
5	601233	桐昆股份	1,000	20,590.00	0.03
6	601799	星宇股份	100	20,050.00	0.03
7	603345	安井食品	100	19,287.00	0.03
8	600143	金发科技	1,100	18,854.00	0.03
9	601966	玲珑轮胎	500	17,585.00	0.02
10	601099	太平洋	4,200	17,136.00	0.02
11	600316	洪都航空	300	17,061.00	0.02
12	600739	辽宁成大	700	17,024.00	0.02
13	600885	宏发股份	300	16,266.00	0.02
14	600699	均胜电子	600	15,216.00	0.02
15	600529	山东药玻	300	15,045.00	0.02
16	600460	士兰微	600	15,000.00	0.02
17	601168	西部矿业	1,200	14,856.00	0.02
18	600511	国药股份	300	14,793.00	0.02
19	600201	生物股份	700	14,623.00	0.02
20	600219	南山铝业	4,400	13,904.00	0.02
21	600486	扬农化工	100	13,200.00	0.02
22	603882	金域医学	100	12,812.00	0.02
23	601997	贵阳银行	1,600	12,720.00	0.02
24	600884	杉杉股份	700	12,621.00	0.02
25	601128	常熟银行	1,700	12,546.00	0.02
26	600862	中航高科	400	12,040.00	0.02
27	600132	重庆啤酒	100	11,899.00	0.02
28	601689	拓普集团	300	11,529.00	0.02
29	600909	华安证券	1,400	11,200.00	0.02
30	600563	法拉电子	100	10,755.00	0.02
31	600867	通化东宝	800	10,704.00	0.02
32	600879	航天电子	1,400	10,472.00	0.01
33	600315	上海家化	300	10,419.00	0.01
34	600733	北汽蓝谷	1,200	10,404.00	0.01
35	603338	浙江鼎力	100	10,119.00	0.01

36	600549	厦门钨业	600	10,110.00	0.01
37	600765	中航重机	400	10,000.00	0.01
38	600516	方大炭素	1,400	9,898.00	0.01
39	600153	建发股份	1,200	9,852.00	0.01
40	600418	江淮汽车	800	9,784.00	0.01
41	600859	王府井	300	9,774.00	0.01
42	600380	健康元	700	9,737.00	0.01
43	600667	太极实业	1,000	9,450.00	0.01
44	600415	小商品城	1,700	9,367.00	0.01
45	600580	卧龙电驱	600	9,360.00	0.01
46	600155	华创阳安	700	9,233.00	0.01
47	603858	步长制药	400	9,228.00	0.01
48	600166	福田汽车	2,900	9,135.00	0.01
49	600535	天士力	600	8,874.00	0.01
50	603486	科沃斯	100	8,849.00	0.01
51	600827	百联股份	600	8,760.00	0.01
52	603806	福斯特	100	8,540.00	0.01
53	601456	国联证券	400	8,532.00	0.01
54	600170	上海建工	2,800	8,428.00	0.01
55	600642	申能股份	1,600	8,352.00	0.01
56	600779	水井坊	100	8,302.00	0.01
57	600801	华新水泥	400	8,252.00	0.01
58	603317	天味食品	100	8,224.00	0.01
59	600409	三友化工	800	8,200.00	0.01
60	601992	金隅集团	2,700	8,019.00	0.01
61	600008	首创股份	2,820	7,980.60	0.01
62	600372	中航电子	400	7,860.00	0.01
63	600598	北大荒	400	7,700.00	0.01
64	600497	驰宏锌锗	1,600	7,680.00	0.01
65	601717	郑煤机	700	7,651.00	0.01
66	601615	明阳智能	400	7,592.00	0.01
67	600325	华发股份	1,200	7,452.00	0.01
68	601866	中远海发	2,500	7,425.00	0.01
69	600392	盛和资源	800	7,112.00	0.01
70	600256	广汇能源	2,500	7,075.00	0.01
71	603816	顾家家居	100	7,051.00	0.01
72	600528	中铁工业	800	6,992.00	0.01
73	600704	物产中大	1,600	6,992.00	0.01
74	600875	东方电气	700	6,979.00	0.01
75	603638	艾迪精密	100	6,894.00	0.01
76	600060	海信视像	600	6,888.00	0.01
77	600895	张江高科	400	6,816.00	0.01

78	600167	联美控股	600	6,810.00	0.01
79	600737	中粮糖业	700	6,776.00	0.01
80	600515	海航基础	1,000	6,750.00	0.01
81	600839	四川长虹	2,300	6,670.00	0.01
82	600811	东方集团	1,800	6,570.00	0.01
83	600260	凯乐科技	600	6,540.00	0.01
84	600881	亚泰集团	2,100	6,510.00	0.01
85	600597	光明乳业	400	6,504.00	0.01
86	600820	隧道股份	1,200	6,492.00	0.01
87	600160	巨化股份	800	6,488.00	0.01
88	600446	金证股份	400	6,484.00	0.01
89	600258	首旅酒店	300	6,366.00	0.01
90	600435	北方导航	700	6,300.00	0.01
91	603883	老百姓	100	6,283.00	0.01
92	600038	中直股份	100	6,271.00	0.01
93	600718	东软集团	600	6,246.00	0.01
94	600282	南钢股份	2,000	6,240.00	0.01
95	600410	华胜天成	700	6,202.00	0.01
96	600064	南京高科	600	6,162.00	0.01
97	600908	无锡银行	1,000	6,080.00	0.01
98	600728	佳都科技	800	6,072.00	0.01
99	600188	兖州煤业	600	6,042.00	0.01
100	600567	山鹰国际	2,000	6,040.00	0.01
101	603866	桃李面包	100	5,910.00	0.01
102	601118	海南橡胶	1,200	5,784.00	0.01
103	603568	伟明环保	300	5,679.00	0.01
104	600572	康恩贝	1,200	5,652.00	0.01
105	600171	上海贝岭	400	5,608.00	0.01
106	600273	嘉化能源	600	5,544.00	0.01
107	601179	中国西电	1,200	5,532.00	0.01
108	600037	歌华有线	600	5,520.00	0.01
109	600216	浙江医药	400	5,440.00	0.01
110	600039	四川路桥	1,200	5,412.00	0.01
111	600804	鹏博士	800	5,376.00	0.01
112	600026	中远海能	800	5,344.00	0.01
113	600755	厦门国贸	800	5,344.00	0.01
114	601005	重庆钢铁	3,600	5,328.00	0.01
115	601975	招商南油	2,100	5,271.00	0.01
116	600754	锦江酒店	100	5,153.00	0.01
117	600398	海澜之家	800	5,136.00	0.01
118	600195	中牧股份	400	5,124.00	0.01
119	600546	山煤国际	600	5,106.00	0.01

120	601106	中国一重	1,700	5,083.00	0.01
121	603000	人民网	300	5,070.00	0.01
122	601860	紫金银行	1,200	5,052.00	0.01
123	600673	东阳光	1,000	5,030.00	0.01
124	600021	上海电力	700	4,984.00	0.01
125	600158	中体产业	400	4,904.00	0.01
126	600967	内蒙一机	400	4,864.00	0.01
127	600022	山东钢铁	3,400	4,862.00	0.01
128	600507	方大特钢	700	4,858.00	0.01
129	600970	中材国际	700	4,816.00	0.01
130	600120	浙江东方	800	4,776.00	0.01
131	601608	中信重工	1,200	4,752.00	0.01
132	600006	东风汽车	500	4,720.00	0.01
133	600376	首开股份	800	4,696.00	0.01
134	601333	广深铁路	2,100	4,662.00	0.01
135	600466	蓝光发展	1,000	4,630.00	0.01
136	600782	新钢股份	1,000	4,590.00	0.01
137	601699	潞安环能	700	4,550.00	0.01
138	603885	吉祥航空	400	4,548.00	0.01
139	600643	爱建集团	600	4,512.00	0.01
140	601000	唐山港	1,800	4,464.00	0.01
141	600928	西安银行	800	4,448.00	0.01
142	600141	兴发集团	400	4,412.00	0.01
143	601598	中国外运	1,000	4,400.00	0.01
144	601611	中国核建	600	4,368.00	0.01
145	601200	上海环境	400	4,360.00	0.01
146	601778	晶科科技	600	4,356.00	0.01
147	600649	城投控股	800	4,344.00	0.01
148	600056	中国医药	300	4,299.00	0.01
149	600312	平高电气	600	4,284.00	0.01
150	600131	国网信通	300	4,269.00	0.01
151	600808	马钢股份	1,600	4,256.00	0.01
152	601718	际华集团	1,400	4,242.00	0.01
153	600126	杭钢股份	800	4,232.00	0.01
154	600500	中化国际	800	4,216.00	0.01
155	600648	外高桥	300	4,191.00	0.01
156	603712	七一二	100	4,165.00	0.01
157	600073	上海梅林	400	4,116.00	0.01
158	601016	节能风电	1,200	4,116.00	0.01
159	600266	城建发展	800	4,064.00	0.01
160	600373	中文传媒	400	4,036.00	0.01
161	600675	中华企业	1,200	4,032.00	0.01

162	600094	大名城	1,000	4,020.00	0.01
163	603927	中科软	100	4,009.00	0.01
164	601865	福莱特	100	3,990.00	0.01
165	600959	江苏有线	1,200	3,972.00	0.01
166	600348	华阳股份	700	3,927.00	0.01
167	601880	大连港	2,000	3,860.00	0.01
168	600901	江苏租赁	700	3,857.00	0.01
169	601098	中南传媒	400	3,812.00	0.01
170	600556	天下秀	300	3,795.00	0.01
171	600639	浦东金桥	300	3,720.00	0.01
172	600863	内蒙华电	1,400	3,598.00	0.01
173	600062	华润双鹤	300	3,597.00	0.01
174	600776	东方通信	300	3,555.00	0.01
175	600388	龙净环保	400	3,552.00	0.01
176	603198	迎驾贡酒	100	3,490.00	0.00
177	600985	淮北矿业	300	3,357.00	0.00
178	600717	天津港	700	3,346.00	0.00
179	603260	合盛硅业	100	3,344.00	0.00
180	600307	酒钢宏兴	2,000	3,300.00	0.00
181	600633	浙数文化	400	3,256.00	0.00
182	600823	世茂股份	700	3,227.00	0.00
183	600664	哈药股份	1,000	3,190.00	0.00
184	600338	西藏珠峰	300	3,144.00	0.00
185	601958	金钼股份	500	3,105.00	0.00
186	603650	彤程新材	100	3,100.00	0.00
187	600339	中油工程	1,000	3,080.00	0.00
188	600582	天地科技	1,000	3,080.00	0.00
189	603515	欧普照明	100	3,021.00	0.00
190	600259	广晟有色	100	3,017.00	0.00
191	603228	景旺电子	100	3,015.00	0.00
192	600748	上实发展	600	2,946.00	0.00
193	601139	深圳燃气	400	2,896.00	0.00
194	600729	重庆百货	100	2,890.00	0.00
195	600968	海油发展	1,200	2,868.00	0.00
196	603077	和邦生物	2,000	2,840.00	0.00
197	600291	西水股份	500	2,835.00	0.00
198	600869	远东股份	700	2,793.00	0.00
199	600787	中储股份	600	2,766.00	0.00
200	601869	长飞光纤	100	2,704.00	0.00
201	601228	广州港	800	2,688.00	0.00
202	600707	彩虹股份	400	2,664.00	0.00
203	601298	青岛港	400	2,572.00	0.00

204	601828	美凯龙	300	2,547.00	0.00
205	601928	凤凰传媒	400	2,532.00	0.00
206	600350	山东高速	400	2,472.00	0.00
207	600545	卓郎智能	700	2,450.00	0.00
208	600517	国网英大	400	2,432.00	0.00
209	600657	信达地产	600	2,430.00	0.00
210	600277	亿利洁能	800	2,392.00	0.00
211	603328	依顿电子	300	2,385.00	0.00
212	600871	石化油服	1,200	2,352.00	0.00
213	600575	淮河能源	1,000	2,320.00	0.00
214	603708	家家悦	100	2,130.00	0.00
215	600566	济川药业	100	2,023.00	0.00
216	600645	中源协和	100	1,961.00	0.00
217	600053	九鼎投资	100	1,955.00	0.00
218	600835	上海机电	100	1,946.00	0.00
219	603377	东方时尚	100	1,936.00	0.00
220	603379	三美股份	100	1,910.00	0.00
221	601801	皖新传媒	400	1,900.00	0.00
222	603888	新华网	100	1,900.00	0.00
223	601969	海南矿业	300	1,794.00	0.00
224	600329	中新药业	100	1,752.00	0.00
225	600623	华谊集团	300	1,740.00	0.00
226	601127	小康股份	100	1,708.00	0.00
227	601003	柳钢股份	300	1,557.00	0.00
228	603225	新凤鸣	100	1,390.00	0.00
229	600903	贵州燃气	100	1,270.00	0.00
230	603056	德邦股份	100	1,269.00	0.00
231	600640	号百控股	100	1,225.00	0.00
232	601512	中新集团	100	994.00	0.00
233	603256	宏和科技	100	883.00	0.00
234	600917	重庆燃气	100	686.00	0.00
235	601068	中铝国际	100	356.00	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末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	600745	闻泰科技	893,260.00	1.26
2	600584	长电科技	771,214.00	1.09
3	600201	生物股份	694,229.00	0.98
4	600763	通策医疗	667,933.00	0.94
5	600143	金发科技	608,355.00	0.86

6	600079	人福医药	576,882.00	0.81
7	600739	辽宁成大	571,172.00	0.81
8	601099	太平洋	568,066.00	0.80
9	002371	北方华创	555,300.00	0.78
10	600426	华鲁恒升	547,315.00	0.77
11	600845	宝信软件	509,084.00	0.72
12	600536	中国软件	501,898.00	0.71
13	601128	常熟银行	496,567.00	0.70
14	600298	安琪酵母	495,045.00	0.70
15	601799	星宇股份	492,181.00	0.69
16	002127	南极电商	489,894.24	0.69
17	600161	天坛生物	468,385.00	0.66
18	600521	华海药业	456,669.00	0.64
19	300253	卫宁健康	454,861.00	0.64
20	002821	凯莱英	449,488.00	0.63

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末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	600739	辽宁成大	1,097,969.00	1.55
2	600201	生物股份	980,347.00	1.38
3	601799	星宇股份	942,136.00	1.33
4	600143	金发科技	877,497.00	1.24
5	600079	人福医药	877,350.00	1.24
6	601099	太平洋	839,095.00	1.18
7	600426	华鲁恒升	816,396.00	1.15
8	600298	安琪酵母	799,453.00	1.13
9	600161	天坛生物	778,433.00	1.10
10	600521	华海药业	752,622.00	1.06
11	600529	山东药玻	735,847.00	1.04
12	603659	璞泰来	713,175.00	1.01
13	601128	常熟银行	703,523.00	0.99
14	600859	王府井	693,169.00	0.98
15	603883	老百姓	640,493.00	0.90
16	603882	金域医学	638,609.00	0.90
17	603939	益丰药房	622,674.00	0.88
18	600486	扬农化工	620,317.00	0.88
19	603517	绝味食品	611,239.00	0.86
20	600885	宏发股份	609,903.00	0.86



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	87,525,701.95
卖出股票收入（成交）总额	110,899,977.34

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投资债券。

#### 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投资债券。

#### 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投资资产支持证券。

#### 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投资贵金属。

#### 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投资权证。

#### 8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	中银证券 中证 500ETF	ETF	交易型开放式(ETF)	中银国际 证券股份 有限公司	65,656,894.16	92.68

#### 8.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 8.11.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

##### 8.11.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货，无相关投资政策。

## 8.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.12.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未有国债期货持仓。

### 8.12.2 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有国债期货持仓。

### 8.12.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未有国债期货持仓，无相关评价。

## 8.13 投资组合报告附注

### 8.13.1

本报告编制日前一年以内，本基金持有的金发科技的发行主体金发科技股份有限公司于 2020 年 9 月 23 日收到中国证券监督管理委员会广东监管局下发的《关于对金发科技股份有限公司、袁志敏、宁凯军采取出示警示函措施的决定》；经查，金发科技股份有限公司（以下简称金发科技或公司）存在以下信息披露违规行为：2020 年 5 月 18 日，金发科技发布《关于子公司签订特别重大合同的公告》，披露子公司广东金发科技有限公司（以下简称广东金发）于 5 月 16 日收到美国某公司（以下简称买方）关于 KN95 口罩的采购订单，订购金额 9.75 亿美元，双方签订了《货物买卖合同》，在合同期限内，广东金发将根据合同约定向买方出售 KN95 口罩。金发科技后续披露，买方未按照约定支付采购订单金额 40% 的前期款项。核查发现，7 月 10 日至 11 日，买方向金发科技发来电子邮件，表示要取消 9.75 亿美元的 KN95 口罩订单，后续金发科技多次尝试与买方沟通是否继续履约，但买方一直未予回复。这一重大合同进展披露不及时、风险揭示不充分。8 月 10 日，金发科技发布《关于子公司特别重大合同终止的公告》，披露该合同订单终止。金发科技在知悉买方拟取消重大合同订单的情况下，未及时履行重大合同进展信息披露义务，未及时充分揭示相关风险，其行为违反了《上市公司信息披露管理办法》第二条、第三十二条的相关规定。袁志敏作为金发科技董事长、宁凯军作为董事会秘书，未按照《上市公司信息披露管理办法》第三条的规定履行勤勉尽责义务，对公司上述违规行为负有主要责任。根据《上市公司信息披露管理办法》第五十九条的规定，决定对金发科技采取出具警示函的行政监管措施。

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末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。

## 8.13.2

报告期内，本基金基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

## 8.13.3 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	68,340.61
2	应收证券清算款	222,491.57
3	应收股利	-
4	应收利息	549.40
5	应收申购款	284,417.31
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	575,798.89

## 8.13.4 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可转债。

## 8.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：前十名股票中不存在流通受限情况。

## 8.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算中四舍五入的原因，本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

## 9.1 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（%）
中银证券中证 500ETF 联接 A	2,595	16,099.82	302,636.94	0.72	41,476,389.76	99.28
中银证券中证 500ETF 联接 C	1,410	11,450.81	0.00	0.00	16,145,638.45	100.00

合计	4,005	14,463.09	302,636.94	0.52	57,622,028.21	99.48
----	-------	-----------	------------	------	---------------	-------

### 9.2 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	中银证券中证 500ETF 联接 A	-	-
	中银证券中证 500ETF 联接 C	63,875.66	0.40
	合计	63,875.66	0.40

### 9.3 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	中银证券中证 500ETF 联接 A	0
	中银证券中证 500ETF 联接 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	中银证券中证 500ETF 联接 A	0
	中银证券中证 500ETF 联接 C	0
	合计	0

### 9.4 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

基金经理姓名	产品类型	持有本人管理的产品份额总量的数量区间（万份）
-	公募基金	0
	私募资产管理计划	0
	合计	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中银证券中证 500ETF 联接 A	中银证券中证 500ETF 联接 C
基金合同生效日 (2020 年 5 月 14 日) 基金份额总额	180,246,324.48	131,475,719.79
基金合同生效日起至 报告期期末基金总申 购份额	36,997,137.96	23,772,044.22
减：基金合同生效日 起至报告期期末基金	175,464,435.74	139,102,125.56

总赎回份额		
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	41,779,026.70	16,145,638.45

## § 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

2020 年 2 月，中银国际证券股份有限公司聘任元磊为公司合规总监兼公司公募基金管理业务合规负责人，解聘赵向雷兼任的公司合规总监兼公司公募基金管理业务合规负责人职务。

2020 年 8 月，中银国际证券股份有限公司副执行总裁沈锋分管资产管理板块等，董事会秘书翟增军不再分管资产管理板块。2020 年 3 月，公司股东大会选举李军先生为公司第一届董事会独立董事，公司股东大会同意管涛先生辞任公司独立董事的议案。2020 年 6 月，公司股东大会选举文兰女士、艾富华先生为公司第一届董事会董事，公司股东大会同意王海权先生、廖胜森先生辞任公司董事的议案。

自 2020 年 8 月 28 日起，刘波先生担任招商银行股份有限公司资产托管部总经理职务。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产的诉讼，无涉及基金托管业务的诉讼

### 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 50,000 元人民币，其已提供审计服务的连续年限为 1 年。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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。

本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无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	2	198,425,404.49	100.00%	145,107.24	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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
中银证券	-	-	-	-	-	-	92,219,285.70	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 2019 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	2020 年 1 月 17 日
2	中银国际证券股份有限公司关于 2020 年春节假期延长期间暂停办理申购赎回等业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司官网	2020 年 1 月 30 日
3	中银国际证券股份有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司官网	2020 年 3 月 3 日
4	中银国际证券股份有限公司关于推迟披露旗下基金 2019 年年度报告的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司官网	2020 年 3 月 24 日
5	中银国际证券股份有限公司关于增加江苏汇林保大基金销售有限公司为旗下基金销售机构并进行费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司官网	2020 年 3 月 30 日
6	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招募说明书	上海证券报、公司官网	2020 年 4 月 3 日
7	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基金合同	公司官网	2020 年 4 月 3 日
8	中银证券中证 500 交易型开放式指数	公司官网	2020 年 4 月 3 日

	证券投资基金联接基金托管协议		
9	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基金份额发售公告	公司官网	2020 年 4 月 3 日
10	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基金合同及招募说明书提示性公告	上海证券报	2020 年 4 月 3 日
11	中银国际证券股份有限公司关于增加中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金代理销售机构的公告	上海证券报、公司官网	2020 年 4 月 7 日
12	中银国际证券股份有限公司关于增加中信建投证券股份有限公司为旗下基金销售机构并进行费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司官网、上交所	2020 年 4 月 13 日
13	中银国际证券股份有限公司关于增加中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金代理销售机构的公告	上海证券报、公司官网	2020 年 4 月 13 日
14	中银国际证券股份有限公司旗下基金 2020 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	2020 年 4 月 21 日
15	中银国际证券股份有限公司关于增加北京百度百盈基金销售有限公司为旗下基金销售机构并进行费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、公司官网、上交所	2020 年 4 月 23 日
16	中银国际证券股份有限公司旗下基金 2019 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	2019 年 4 月 30 日
17	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基金合同生效公告	上海证券报、公司官网	2020 年 5 月 15 日
18	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开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告	上海证券报、公司官网	2020 年 5 月 21 日
19	中银国际证券股份有限公司关于调整旗下基金长期停牌股票估值方法的公告	上海证券报、证券日报、公司官网、上交所	2020 年 5 月 23 日
20	中银国际证券股份有限公司旗下基金 2020 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、证券日报、上交所	2020 年 7 月 21 日
21	中银国际证券股份有限公司关于旗下基金参与招商银行费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司官网、上交所	2020 年 7 月 28 日



22	中银国际证券股份有限公司关于增加苏宁基金及蛋卷基金为旗下基金销售机构并进行费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司官网、上交所	2020 年 8 月 6 日
23	中银国际证券股份有限公司旗下基金 2020 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、上交所	2020 年 8 月 31 日
24	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(A 类份额)基金产品资料概要更新	公司官网	2020 年 8 月 31 日
25	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(C 类份额)基金产品资料概要更新	公司官网	2020 年 8 月 31 日
26	中银国际证券股份有限公司关于调整旗下基金长期停牌股票估值方法的公告	上海证券报、公司官网	2020 年 9 月 11 日
27	中银国际证券股份有限公司关于中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理变更的公告	上海证券报、公司官网	2020 年 9 月 15 日
28	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更新招募说明书(2020 年第 1 号)	公司官网	2020 年 9 月 16 日
29	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(A 类份额)基金产品资料概要更新	公司官网	2020 年 9 月 16 日
30	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(C 类份额)基金产品资料概要更新	公司官网	2020 年 9 月 16 日
31	中银国际证券股份有限公司旗下基金 2020 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、上交所	2020 年 10 月 28 日
32	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 2020 年第 3 季度报告	公司官网	2020 年 10 月 28 日
33	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	公司官网	2020 年 12 月 31 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

注：报告期内本基金未有单一投资者持有基金份额达到或超过 20%的情况。

### 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

2021 年 3 月 31 日