

# 中融中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金

2021年第1季度报告

2021年03月31日

基金管理人:中融基金管理有限公司

基金托管人:中国光大银行股份有限公司

报告送出日期:2021年04月21日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年4月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2021年1月1日起至2021年3月31日止。

## § 2 基金产品概况

### 2.1 基金基本情况

|            |  |
|------------|--|
| 基金简称       | 中融中证500ETF联接   |
| 基金主代码      | 007885   |
| 基金运作方式     | 契约型开放式   |
| 基金合同生效日    | 2019年12月31日  |
| 报告期末基金份额总额 | 20,013,395.07份   |
| 投资目标       | 本基金主要通过投资于目标ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。  |
| 投资策略       | 1、投资组合的投资方式；<br>2、投资组合的调整；<br>3、债券投资策略；<br>4、股指期货投资策略；<br>5、资产支持证券投资策略。                    |
| 业绩比较基准     | 中证500指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%   |
| 风险收益特征     | 本基金为ETF联接基金，预期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。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，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。  |               |
| 基金管理人           | 中融基金管理有限公司     |               |
| 基金托管人           | 中国光大银行股份有限公司   |               |
| 下属分级基金的基金简称     | 中融中证500ETF联接A  | 中融中证500ETF联接C |
| 下属分级基金的交易代码     | 007885         | 007886        |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 19,834,803.68份 | 178,591.39份   |

### 2.1.1 目标基金基本情况

|              |                       |
|--------------|-----------------------|
| 基金名称         | 中融中证500交易型开放式指数证券投资基金 |
| 基金主代码        | 515550                |
| 基金运作方式       | 交易型开放式（ETF）           |
| 基金合同生效日      | 2019-11-15            |
| 基金份额上市的证券交易所 | 上海证券交易所               |
| 上市日期         | 2019-12-25            |
| 基金管理人名称      | 中融基金管理有限公司            |
| 基金托管人名称      | 中国光大银行股份有限公司          |

### 2.1.2 目标基金产品说明

|        |  |
|--------|--|
| 投资目标   | 中融中证500交易型开放式指数证券投资基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。  |
| 投资策略   | 中融中证500交易型开放式指数证券投资基金主要采取完全复制策略，即按照标的指数的成份股构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（如流动性不足、成份股长期停牌、法律法规限制等）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，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，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 | 中融中证500交易型开放式指数证券投资基金为股票   |

|  |   |
|--|---|
|  | 型基金，预期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。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，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。 |
|--|---|

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标          | 报告期(2021年01月01日 - 2021年03月31日) |               |
|-----------------|--------------------------------|---------------|
|                 | 中融中证500ETF联接A                  | 中融中证500ETF联接C |
| 1. 本期已实现收益      | 2,633,070.54                   | 8,538.19      |
| 2. 本期利润         | -105,111.55                    | -2,379.71     |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0044                        | -0.0213       |
| 4. 期末基金资产净值     | 23,268,507.16                  | 209,073.78    |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.1731                         | 1.1707        |

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、上述本基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，例如：基金的申购、赎回费等，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 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

中融中证500ETF联接A净值表现

| 阶段         | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④    |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月      | -1.19% | 1.09%     | -1.66%     | 1.17%         | 0.47%  | -0.08% |
| 过去六个月      | 1.12%  | 1.05%     | 0.99%      | 1.13%         | 0.13%  | -0.08% |
| 过去一年       | 23.41% | 1.18%     | 22.87%     | 1.26%         | 0.54%  | -0.08% |
| 自基金合同生效起至今 | 17.31% | 1.22%     | 18.49%     | 1.47%         | -1.18% | -0.25% |

中融中证500ETF联接C净值表现

| 阶段 | 净值增长 | 净值增长 | 业绩比较 | 业绩比较基 | ①-③ | ②-④ |
|----|------|------|------|-------|-----|-----|
|----|------|------|------|-------|-----|-----|

|                | 率①     | 率标准差<br>② | 基准收益<br>率③ | 准收益率标<br>准差④ |        |        |
|----------------|--------|-----------|------------|--------------|--------|--------|
| 过去三个月          | -1.26% | 1.09%     | -1.66%     | 1.17%        | 0.40%  | -0.08% |
| 过去六个月          | 1.04%  | 1.05%     | 0.99%      | 1.13%        | 0.05%  | -0.08% |
| 过去一年           | 23.49% | 1.18%     | 22.87%     | 1.26%        | 0.62%  | -0.08% |
| 自基金合同生<br>效起至今 | 17.07% | 1.22%     | 18.49%     | 1.47%        | -1.42% | -0.25% |

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

中融中证500ETF联接A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2019年12月31日-2021年03月31日)



中融中证500ETF联接C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2019年12月31日-2021年03月31日)



注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同的有关约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务  | 任本基金的基金经理期限 |      | 证券从业年限 | 说明   |
|----|---|-------------|------|--------|--|
|    |   | 任职日期        | 离任日期 |        |  |
| 赵菲 | 中融中证银行指数证券投资基金（LOF）、中融国证钢铁行业指数型证券投资基金、中融中证煤炭指数型证券投资基金、中融央视财经50交易型开放式指数证券投资基金、中融央视财经50交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中融中证500交易型开 | 2019-12-31  | -    | 12     | 赵菲先生，中国国籍，毕业于北京师范大学概率论与数理统计专业，研究生、硕士学位，具有基金从业资格，证券从业年限12年。2008年8月至2011年5月曾任国泰君安证券股份有限公司证券及衍生品投资总部投资经理；2011年5月至2012年11月曾任嘉实基金 |

|     |   |            |   |   |  |
|-----|---|------------|---|---|--|
|     | 放式指数证券投资基金、中融中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中融智选对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、中融智选红利股票型证券投资基金的基金经理及指数投资部总经理。                                     |            |   |   | 管理有限公司结构产品投资部专户投资经理。2012年11月加入中融基金管理有限公司，现任指数投资部总经理职位。   |
| 陈薪羽 | 中融央视财经50交易型开放式指数证券投资基金、中融央视财经50交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中融中证500交易型开放式指数证券投资基金、中融中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中融量化智选混合型证券投资基金、中融智选红利股票型证券投资基金的基金经理。 | 2019-12-31 | - | 5 | 陈薪羽先生，中国国籍，毕业于北京大学概率论与数理统计专业，研究生、硕士学位，具有基金从业资格，证券从业年限5年。2015年8月至2016年10月任中国人保寿险首席投资官秘书。2016年10月加入中融基金管理有限公司，现任指数投资部基金经理。 |

注：（1）上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写；基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日。

（2）证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项配套法规、基金合同和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本公司制定了《公平交易管理办法》并严格执行，公司通过建立科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节

的内部控制，在研究、决策、交易执行等各环节，通过制度、流程、技术手段等各方面措施确保了公平对待所管理的投资组合，保证公平交易原则的实现。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好，不同的投资组合受到了公平对待，未发生不公平的交易事项。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2021年一季度，A股市场在经历了春季上涨行情，于春节后全线快速下跌，并在最后几个交易日企稳回升，中证500指数下跌1.78%，本基金为目标 ETF 的联接基金，主要通过投资于目标 ETF 来实现对业绩比较基准的紧密跟踪，也可以通过买入标的指数成份股来跟踪标的指数。基金在投资管理上，运用智能指数投资系统进行精细化管理，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，严格控制本基金的跟踪偏离度和跟踪误差，给投资者提供一个标准化的中证500指数的投资工具。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中融中证500ETF联接A基金份额净值为1.1731元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-1.19%，同期业绩比较基准收益率为-1.66%；截至报告期末中融中证500ETF联接C基金份额净值为1.1707元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-1.26%，同期业绩比较基准收益率为-1.66%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金存在连续20个工作日基金资产低于5000万的情形。

### § 5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目     | 金额(元)         | 占基金总资产的比例<br>(%) |
|----|--------|---------------|------------------|
| 1  | 权益投资   | -             | -                |
|    | 其中：股票  | -             | -                |
| 2  | 基金投资   | 22,072,059.00 | 93.35            |
| 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      | 1,558,837.14  | 6.59   |
| 8 | 其他资产              | 14,428.26     | 0.06   |
| 9 | 合计                | 23,645,324.40 | 100.00 |

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票投资。

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票投资。

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

本基金本报告期末未持有股票投资。

## 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

## 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

## 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券投资。

## 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

## 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

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

| 序号 | 基金名称  | 类型    | 运作方式   | 管理人        | 公允价值<br>(元)   | 占基金资产净值<br>比例(%) |
|----|-------|-------|--------|------------|---------------|------------------|
| 1  | 中融500 | ETF基金 | 契约型开放式 | 中融基金管理有限公司 | 22,072,059.00 | 94.01            |

#### 5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

#### 5.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 5.12 投资组合报告附注

5.12.1 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查，或者在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.12.2 基金投资的前十名股票未超过基金合同规定的备选股票库。

#### 5.12.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额(元)     |
|----|---------|-----------|
| 1  | 存出保证金   | 4,390.55  |
| 2  | 应收证券清算款 | 9,049.99  |
| 3  | 应收股利    | -         |
| 4  | 应收利息    | 347.33    |
| 5  | 应收申购款   | 640.39    |
| 6  | 其他应收款   | -         |
| 7  | 其他      | -         |
| 8  | 合计      | 14,428.26 |

#### 5.12.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

#### 5.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末本基金未持有股票。

#### 5.12.6 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，各比例的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

|                               | 中融中证500ETF联接A | 中融中证500ETF联接C |
|-------------------------------|---------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额                   | 32,925,582.91 | 94,036.01     |
| 报告期期间基金总申购份额                  | 683,492.06    | 114,311.76    |
| 减：报告期期间基金总赎回份额                | 13,774,271.29 | 29,756.38     |
| 报告期期间基金拆分变动份额<br>(份额减少以“-”填列) | -             | -             |
| 报告期期末基金份额总额                   | 19,834,803.68 | 178,591.39    |

注：总申购份额含红利再投资、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本报告期内本基金不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予中融中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金募集的文件
- (2) 《中融中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》
- (3) 《中融中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》
- (4) 《中融中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (6) 基金托管人业务资格批件、营业执照
- (7) 中国证监会要求的其他文件

### 9.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的住所

### 9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可在支付工本费后，在合理时间取得上述文件的复印件。

咨询电话：中融基金管理有限公司客户服务电话400-160-6000，（010）56517299。

网址：<http://www.zrfunds.com.cn/>

中融基金管理有限公司

2021年04月21日