
中银中证 800 指数型发起式证券投资基金
(原中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金)
2022 年第 4 季度报告
2022 年 12 月 31 日

基金管理人：中银基金管理有限公司
基金托管人：中信银行股份有限公司
报告送出日期：二〇二三年一月二十日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 1 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。其中，2022 年 10 月 10 日起，“中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金”转型为“中银中证 800 指数型发起式证券投资基金”，基金合同及托管协议即日生效。

§ 2 基金产品概况

2.1 中银中证 800 指数型发起式证券投资基金

基金简称	中银中证 800 指数型发起式
基金主代码	014226
交易代码	014226
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022 年 10 月 10 日
报告期末基金份额总额	10,645,657.17 份
投资目标	本基金通过指数化投资策略，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。在正常市场情况下，本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。
投资策略	本基金为被动式股票指数基金，采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数，即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

	<p>的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。在正常市场情况下，本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。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。</p> <p>指数成份股发生明显负面事件面临退市风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人将按照基金份额持有人利益优先的原则，综合考虑成份股的退市风险、其在指数中的权重以及对跟踪误差的影响，据此制定成份股替代策略，通过提请召开临时投资决策委员会，及时对投资组合进行相应调整。</p>	
业绩比较基准	<p>本基金的标的指数为中证 800 指数。 本基金业绩比较基准为标的指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%</p>	
风险收益特征	<p>本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为被动式投资的股票型指数基金，主要采用完全复制策略，跟踪中证 800 指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。</p>	
基金管理人	中银基金管理有限公司	
基金托管人	中信银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	中银中证 800 指数型发起式 A	中银中证 800 指数型发起式 C
下属两级基金的交易代码	014226	014227
报告期末下属两级基金的份额总额	10,499,201.64 份	146,455.53 份

2.2 中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金

基金简称	中银中证 800ETF 发起式联接
基金主代码	014226
交易代码	014226
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 12 月 7 日
报告期末基金份额总额	10,630,339.65 份
投资目标	<p>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。在正常市场情况下，本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过 0.3%，年跟踪误差不超过 4%。</p>

投资策略	<p>本基金以目标 ETF 作为其主要投资标的，方便特定的客户群通过本基金投资目标 ETF。本基金并不参与目标 ETF 的管理。在正常市场情况下，本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过 0.3%，年跟踪误差不超过 4%。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。</p> <p>指数成份股发生明显负面事件面临退市风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人将按照基金份额持有人利益优先的原则，综合考虑成份股的退市风险、其在指数中的权重以及对跟踪误差的影响，据此制定成份股替代策略，通过提请召开临时投资决策委员会，及时对投资组合进行相应调整。</p>	
业绩比较基准	<p>本基金的标的指数为中证 800 指数。</p> <p>本基金业绩比较基准为标的指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%。</p>	
风险收益特征	<p>本基金的目标 ETF 为股票型基金，其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为 ETF 联接基金，通过投资于目标 ETF 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证券市场相似的风险收益特征。</p>	
基金管理人	中银基金管理有限公司	
基金托管人	中信银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	中银中证 800ETF 发起式联接 A	中银中证 800ETF 发起式联接 C
下属两级基金的交易代码	014226	014227
报告期末下属两级基金的份额总额	10,492,397.72 份	137,941.93 份

2.3 目标基金基本情况

2.3 中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金

基金名称	中银中证 800 指数
基金主代码	515610
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2020 年 7 月 16 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 8 月 18 日
基金管理人名称	中银基金管理有限公司
基金托管人名称	中信银行股份有限公司

2.4 目标基金产品说明

2.4 中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。在正常市场情况下，力争控制本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即按照标的指数的成份股的构成及其权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为被动式投资的股票型指数基金，主要采用完全复制策略，跟踪中证 800 指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

3.1.1 中银中证 800 指数型发起式证券投资基金

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2022 年 10 月 10 日（基金合同生效日）-2022 年 12 月 31 日)	
	中银中证 800 指数型发起式 A	中银中证 800 指数型发起式 C
1.本期已实现收益	9,929.67	-10.01
2.本期利润	277,299.57	2,925.26
3.加权平均基金份额本期利润	0.0264	0.0215
4.期末基金资产净值	9,136,627.53	126,905.80
5.期末基金份额净值	0.8702	0.8665

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、中银 800 指数发起由原中银 800ETF 联接于 2022 年 10 月 10 日转型而来。

3.1.2 中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金

单位:人民币元

主要财务指标	报告期 (2022 年 10 月 1 日-2022 年 10 月 9 日)	
	中银中证 800ETF 发起式联接 A	中银中证 800ETF 发起式联接 C
	1.本期已实现收益	-1,111.22
2.本期利润	-1,111.22	-26.01
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0001	-0.0002
4.期末基金资产净值	8,852,849.28	115,997.67
5.期末基金份额净值	0.8437	0.8409

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、中银 800ETF 联接于 2022 年 10 月 10 日转型为中银 800 指数发起。

3.2 基金净值表现

3.2.1 中银中证 800 指数型发起式证券投资基金

(报告期: 2022年10月10日-2022年12月31日)

3.2.1.1 本报告期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

1. 中银中证 800 指数型发起式 A:

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标	①—③	②—④

				准差④		
自基金合同 生效日起	3.13%	1.05%	1.88%	1.13%	1.25%	-0.08%

2. 中银中证 800 指数型发起式 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
自基金合同 生效日起	3.02%	1.05%	1.88%	1.13%	1.14%	-0.08%

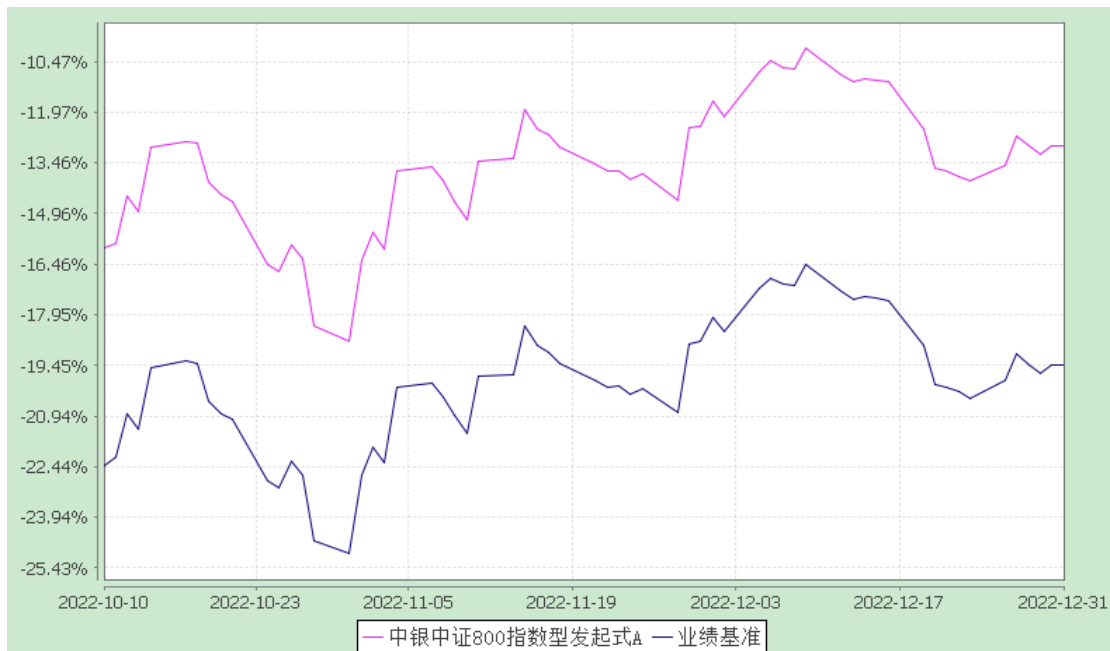
3.2.1.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

中银中证 800 指数型发起式证券投资基金

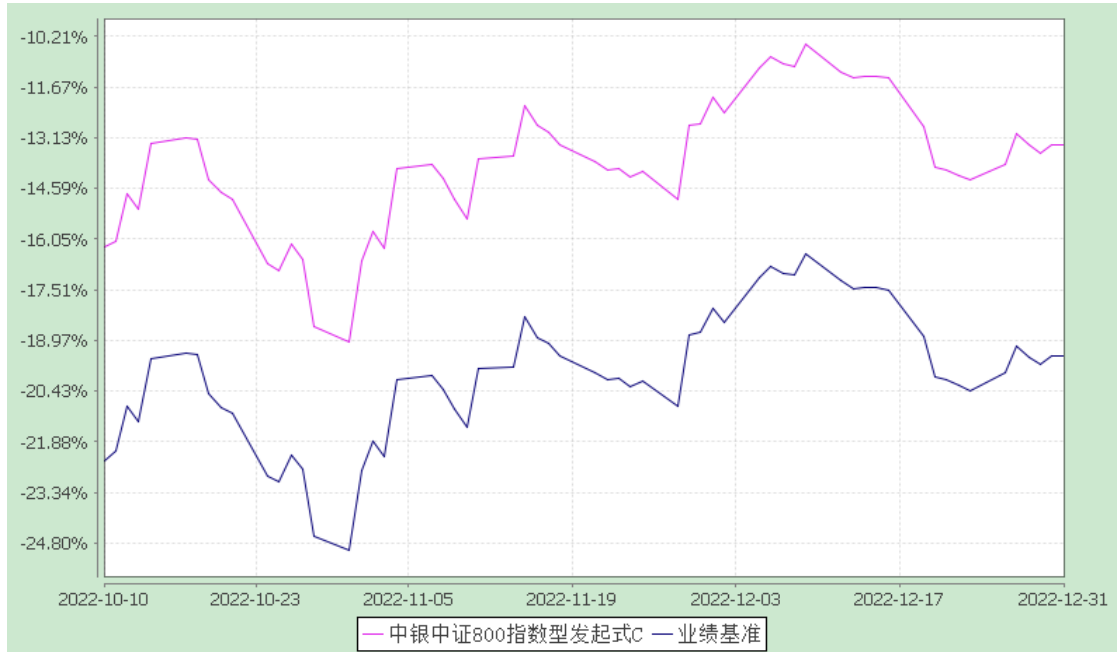
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2022 年 10 月 10 日至 2022 年 12 月 31 日)

1、中银中证 800 指数型发起式 A



2、中银中证 800 指数型发起式 C



注：截至报告期末，本基金转型未满一年。按基金合同规定，本基金自基金合同生效起6个月内为建仓期，截至报告期末，本基金尚在建仓期内。

3.2.2 中银中证800交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金

（报告期：2022年10月1日-2022年10月9日）

3.2.2.1 本报告期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 1. 中银中证800ETF 发起式联接 A:

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	-	-	-	-	-	-
过去六个月	-7.27%	0.50%	-13.60%	0.88%	6.33%	-0.38%
过去一年	-15.12%	1.08%	-21.75%	1.23%	6.63%	-0.15%
自基金合同 生效日起	-15.62%	1.05%	-20.92%	1.20%	5.30%	-0.15%

注：自2022年10月10日转型为新基金，报告期内无交易日，无净值数据。

2. 中银中证800ETF 发起式联接 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	-	-	-	-	-	-

过去六个月	-7.37%	0.50%	-13.60%	0.88%	6.23%	-0.38%
过去一年	-15.37%	1.08%	-21.75%	1.23%	6.38%	-0.15%
自基金合同 生效日起	-15.89%	1.05%	-20.92%	1.20%	5.03%	-0.15%

注：自 2022 年 10 月 10 转型为新基金，报告期内无交易日，无净值数据。

3.2.2.2 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

中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2021 年 12 月 7 日至 2022 年 10 月 9 日)

1、中银中证 800ETF 发起式联接 A



2、中银中证 800ETF 发起式联接 C



注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期，截至建仓结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

§ 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		
赵建忠	基金经理	2021-12-07	-	16	中银基金管理有限公司助理副总裁（AVP），金融学硕士。2007 年加入中银基金管理有限公司，曾担任基金运营部基金会计、研究部研究员、基金经理助理。2015 年 6 月至今任中银中证 100 基金基金经理，2015 年 6 月至今任国企 ETF 基金基金经理，2015 年 6 月至今任中银 300E 基

					金基金经理，2016年8月至2018年2月任中银宏利基金基金经理，2016年8月至2018年2月任中银丰利基金基金经理，2020年4月至今任中银100基金基金经理，2020年7月至2022年8月任中银800基金基金经理，2020年8月至今任中银黄金基金基金经理，2020年9月至今任中银上海金ETF联接基金基金经理，2020年11月至今任中银中证100ETF联接基金基金经理，2021年12月至今任中银中证800基金(原目标ETF基金)基金经理。具备基金、期货从业资格。
--	--	--	--	--	---

注：1、首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日，非首任基金经理的“任职日期”为根据公司决定确定的聘任日期，基金经理的“离任日期”均为根据公司决定确定的解聘日期；2、证券从业年限的计算标准及含义遵从《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

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》、中国证监会的有关规则和其他有关法律法规的规定，严格遵循本基金基金合同，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。本报告期内，本基金运作合法合规，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

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《中银基金管理有限公司公平交易管理办法》，建立了《新股询价申购和参与公开增发管理办法》、《债券询价申购管理办法》、《集中交易管理办法》等公平交易相关制度体系，通过制度确保不同投资组合在投资管理活动中得到公平对待，严格防范不同投资组合之间进行利益输送。公司建立了投资决策委员会领导下的投资决策及授权制度，以科学规范的投资决策体系，采用集中交易管理加强交易执行环节的内部控制，通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现；通过建立层级完备的公司证券池及组合风格库，完善各类具体资产管理业务组织结构，规范各项业务之间的关系，在保证各投资组合既具有相对独立性的同时，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；通过对异常交易行为的实时监控、分析评估、监察稽核和信息披露确保公平交易过程和结果的有效监督。

本报告期内，本公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。各投资组合均严格按照法律、法规和公司制度执行投资交易，本报告期内未发生异常交易行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未发现异常交易行为。

本报告期内，基金管理人未发生所有投资组合参与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的 5%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

1. 宏观经济分析

国外经济方面，四季度全球发达国家在高通胀和金融条件收紧背景下经济下行压力加大。欧美经济差有收窄迹象，美国通胀见顶回落，就业市场维持偏紧状态，11月失业率较9月上行0.2个百分点至3.7%，11月制造业PMI较9月回落1.9个百分点至49%，11月服务业PMI较9月回落0.2个百分点至56.5%。美联储11月加息75bps，12月加息50bps，缩表速度于9月达峰值。欧元区经济增速放缓，10月失业率较9月下行0.1个百分点至6.5%，12月制造业PMI较9月回落0.6个百分点至47.8%，12月服务业PMI较9月上行0.3个百分点至49.1%，欧央行11月、12月各加息75bps、50bps。日本央行维持基准利率不变，但扩大

收益率曲线控制区间，经济恢复速度放缓，通胀有所上行，11月CPI同比较9月回升0.8个百分点至3.8%，11月制造业PMI较9月回落1.8个百分点至49%。综合来看，全球经济2023年下行压力或进一步加大，主要经济体央行货币政策依然处于继续收紧状态。

国内经济方面，国内经济数据受疫情扰动有所回落，基建增速小幅回落，出口增速转负，消费受疫情冲击增速转负，地产维持负增长，经济总体处于二次探底状态，PPI与CPI通胀均回落。具体来看，四季度领先指标中采制造业PMI有所回落，12月值较9月值走低3.1个百分点至47%，同步指标工业增加值11月同比增长2.2%，较9月回落4.1个百分点。从经济增长动力来看，出口增速转负，消费受疫情冲击增速转负，投资相对尚可但也在走弱：11月美元计价出口增速较9月回落14.6个百分点至-8.9%，11月社会消费品零售总额增速较9月回落8.4个百分点至-5.9%，基建投资与制造业投资相对尚可，房地产投资总体负增长，1-11月固定资产投资增速较1-9月回落0.6个百分点至5.3%的水平。通胀方面，CPI回落，11月同比增速从9月的2.8%回落1.2个百分点至1.6%，PPI有所回落，11月同比增速从9月的0.9%回落2.2个百分点至-1.3%。

2. 市场回顾

季度初市场再次探底，股市结构转向“自主可控、国家安全”方向，外资连续净流出，进一步压制风险偏好。11月美国CPI同比小幅下降，美联储加息节奏有望放缓。国内方面，在降准以及房地产第二支箭、第三支箭等政策的强力刺激下，房地产链条、金融板块表现相对强势，抑制市场预期以及风险偏好的因素有所改善，股市开始反弹。随着防疫政策优化持续落地，管控优化预期也进一步增强，消费服务、零售、出行等行业出现反弹，年末一系列重磅会议的召开，国内政策因素逐渐成为市场行情内核。从各行业来看，社会服务(21.84%)、计算机(14.18%)、传媒(14.08%)等行业表现较好，煤炭(-16.37%)、石油石化(-5.12%)、电力设备(-3.89%)等行业跌幅较大。最终，沪深300等权指数涨跌幅度为3.01%；中证100涨跌幅1.01%；上证国企指数涨跌幅1.52%，中证800指数涨跌1.96%。

3. 投资策略和运行分析

本报告期为基金的正常运作期。我们严格遵守基金合同，采用完全复制策略跟踪指数，在因指数权重调整或基金申赎发生变动时，根据市场的流动性情况采用量化模型优化交易以降低冲击成本和减少跟踪误差。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

4.4.2.1 中银中证800指数型发起式证券投资基金

转型后(2022.10.10-2022.12.31)：

报告期内，本基金A类份额净值增长率为3.13%，同期业绩比较基准收益率为1.88%。

报告期内，本基金 C 类份额净值增长率为 3.02%，同期业绩比较基准收益率为 1.88%。

4.4.2.2 中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金

转型前（2022.10.1-2022.10.9）：

无交易日，无净值数据。

4.4.3 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内无需要说明的相关情况。

§ 5 投资组合报告

5.1 中银中证 800 指数型发起式证券投资基金

（报告期：2022年10月10日-2022年12月31日）

5.1.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	8,352,635.00	89.77
	其中：股票	8,352,635.00	89.77
2	固定收益投资	506,457.01	5.44
	其中：债券	506,457.01	5.44
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	438,882.25	4.72
7	其他各项资产	6,850.31	0.07
8	合计	9,304,824.57	100.00

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票，本基金本报告期末未参与转融通证券出借业务。

5.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.1.2.1 指数投资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	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	98,605.00	1.06
B	采矿业	280,271.00	3.03
C	制造业	4,788,798.00	51.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	254,418.00	2.75
E	建筑业	155,106.00	1.67
F	批发和零售业	97,789.00	1.06
G	交通运输、仓储和邮政业	250,160.00	2.70
H	住宿和餐饮业	4,960.00	0.05
I	信息传输、软件和信息技术服务业	413,315.00	4.46
J	金融业	1,491,824.00	16.10
K	房地产业	156,571.00	1.69
L	租赁和商务服务业	111,759.00	1.21
M	科学研究和技术服务业	117,918.00	1.27
N	水利、环境和公共设施管理业	11,570.00	0.12
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	65,429.00	0.71
R	文化、体育和娱乐业	36,585.00	0.39
S	综合	15,226.00	0.16
	合计	8,350,304.00	90.14

5.1.2.2 积极投资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	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	2,331.00	0.03
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	-	-
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	2,331.00	0.03

5.1.2.3 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港股通投资股票。

5.1.3 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

5.1.3.1 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前十名股票投

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	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	200	345,400.00	3.73
2	300750	宁德时代	500	196,710.00	2.12
3	601318	中国平安	3,700	173,900.00	1.88
4	600036	招商银行	4,200	156,492.00	1.69
5	000858	五粮液	700	126,483.00	1.37
6	601012	隆基绿能	2,100	88,746.00	0.96
7	000333	美的集团	1,700	88,060.00	0.95
8	601166	兴业银行	4,900	86,191.00	0.93
9	600900	长江电力	3,900	81,900.00	0.88
10	002594	比亚迪	300	77,091.00	0.83

5.1.3.2 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前五名股票投资明细

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	占基金资产净值比例(%)
1	001965	招商公路	300	2,331.00	0.03

5.1.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	506,457.01	5.47
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	其他	-	-

9	合计	506,457.01	5.47
---	----	------------	------

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	019638	20 国债 09	4,000	405,172.93	4.37
2	019674	22 国债 09	1,000	101,284.08	1.09

5.1.6 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。

5.1.7 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。

5.1.8 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。

5.1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.1.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未参与股指期货投资。

5.1.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

5.1.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.1.10.1 本期国债期货投资政策

本基金投资范围未包括国债期货，无相关投资政策。

5.1.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未参与国债期货投资。

5.1.10.3本期国债期货投资评价

本基金报告期内未参与国债期货投资，无相关投资评价。

5.1.11投资组合报告附注

5.1.11.1 报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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。

5.1.11.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.1.11.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	4,050.28
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,800.03
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,850.31

5.1.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.1.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.1.11.6 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.1.11.7 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

5.1.11.8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。

5.2 中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金

(报告期: 2022年10月1日-2022年10月9日)

5.2.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,067,977.00	11.87
	其中: 股票	1,067,977.00	11.87
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	100,972.93	1.12
	其中: 债券	100,972.93	1.12
	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	7,825,288.82	86.98
7	其他各项资产	2,000.16	0.02
8	合计	8,996,238.91	100.00

注: 本基金本报告期末未持有港股通投资股票, 本基金本报告期末未参与转融通证券出借业务。

5.2.2 期末投资目标基金明细

本基金本报告期末未持有中银800ETF基金份额。

5.2.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.3.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	78,109.00	0.87
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	211,689.00	2.36

E	建筑业	99,748.00	1.11
F	批发和零售业	14,763.00	0.16
G	交通运输、仓储和邮政业	97,706.00	1.09
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	433,269.00	4.83
K	房地产业	124,993.00	1.39
L	租赁和商务服务业	5,428.00	0.06
M	科学研究和技术服务业	2,272.00	0.03
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	1,067,977.00	11.91

5.2.3.2 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港股通投资股票。

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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600900	长江电力	3,700	84,138.00	0.94
2	300059	东方财富	3,400	59,908.00	0.67
3	600030	中信证券	3,200	55,744.00	0.62
4	600048	保利发展	2,300	41,400.00	0.46
5	601816	京沪高铁	6,300	28,476.00	0.32
6	002352	顺丰控股	600	28,332.00	0.32
7	600837	海通证券	3,100	26,846.00	0.30
8	600585	海螺水泥	800	23,048.00	0.26
9	601688	华泰证券	1,900	23,028.00	0.26
10	601211	国泰君安	1,500	20,505.00	0.23

5.2.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	100,972.93	1.13
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
8	其他	-	-
9	合计	100,972.93	1.13

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	019674	22 国债 09	1,000	100,972.93	1.13

5.2.7 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。

5.2.8 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

5.2.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.2.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未参与股指期货投资。

5.2.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

5.2.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.2.11.1 本期国债期货投资政策

本基金投资范围未包括国债期货，无相关投资政策。

5.2.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未参与国债期货投资。

5.2.11.3 本期国债期货投资评价

本基金报告期内未参与国债期货投资，无相关投资评价。

5.2.12 投资组合报告附注

5.2.12.1 报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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。

5.2.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.2.12.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,000.16
2	应收证券清算款	-
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	2,000.16

5.2.12.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.2.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.2.12.6 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。

§6 开放式基金份额变动

6.1 中银中证800指数型发起式证券投资基金

单位：份

项目	中银中证800指数型发起式A	中银中证800指数型发起式C
基金合同生效日基金份额总额	10,492,397.72	137,941.93
报告期间基金总申购份额	47,818.63	126,917.90
减：报告期间基金总赎回份额	41,014.71	118,404.30
报告期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	10,499,201.64	146,455.53

6.2 中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金

单位：份

项目	中银中证800ETF发起式联接A	中银中证800ETF发起式联接C
本报告期期初基金份额总额	10,492,397.72	137,941.93
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-	-
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-	-

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）	-	-
本报告期末基金份额总额	10,492,397.72	137,941.93

}

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

7.1.1 中银中证800指数型发起式证券投资基金

本基金管理人本报告期内未运用固有资金申购、赎回本基金。

7.1.2 中银中证800交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金

本基金管理人本报告期内未运用固有资金申购、赎回本基金。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

8.1 中银中证800指数型发起式证券投资基金

项目	持有份额 总数	持有份额占 基金总份额 比例	发起份额 总数	发起份额占 基金总份额 比例	发起份额承诺 持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	93.94%	10,000,000.00	93.94%	三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,000.00	93.94%	10,000,000.00	93.94%	-

8.2 中银中证800交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金

项目	持有份额 总数	持有份额占 基金总份额 比例	发起份额 总数	发起份额占 基金总份额 比例	发起份额承诺 持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	94.07%	10,000,000.00	94.07%	三年

基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,000.00	94.07%	10,000,000.00	94.07%	-

§ 9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 中银中证800指数型发起式证券投资基金

9.1.1 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	2022-10-10 至 2022-12-31	10,000,000.00	0.00	0.00	10,000,000.00	93.9350%
产品特有风险							
<p>本基金由于存在上述单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况，存在以下特有风险：（1）持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大额赎回导致的基金份额净值波动风险；（2）持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大额赎回导致的流动性风险；（3）持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大额赎回导致的巨额赎回风险；（4）持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大额赎回导致的基金资产净值持续低于5000万元的风险。</p>							

9.2 中银中证800交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金

9.2.1 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	2022-10-01 至 2022-10-09	10,000,000.00	0.00	0.00	10,000,000.00	94.0704%
产品特有风险							

本基金由于存在上述单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况，存在以下特有风险：（1）持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大额赎回导致的基金份额净值波动风险；（2）持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大额赎回导致的流动性风险；（3）持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大额赎回导致的巨额赎回风险；（4）持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大额赎回导致的基金资产净值持续低于5000万元的风险。

§ 10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

中国证监会准予中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金募集注册的文件；

- 2、《中银中证 800 指数型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《中银中证 800 指数型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、关于申请募集注册中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金之法律意见书；
- 5、关于修改《中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》之法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 8、中国证监会要求的其他文件。

10.2 存放地点

以上备查文件存放在基金管理人、基金托管人所在地，供公众查阅。

10.3 查阅方式

投资人在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件。

中银基金管理有限公司
二〇二三年一月二十日