

**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**  
**接基金转型)**  
**2022 年年度报告**  
**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

送出日期：二〇二三年三月三十日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 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。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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 3 月 29 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。

本报告中财务资料已经审计。安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2022 年 1 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。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b>	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§2 基金简介</b>	5
2.1 基金基本情况	5
2.1.1 中银中证 800 指数型发起式证券投资基金	5
2.1.2 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	6
2.2 基金产品说明	7
2.2.1 中银中证 800 指数型发起式证券投资基金	7
2.2.2 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	7
2.3 基金管理人和基金托管人	8
2.4 信息披露方式	9
2.5 其他相关资料	9
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现及利润分配情况</b>	9
3.1 中银中证 800 指数型发起式证券投资基金	9
3.1.1 主要会计数据和财务指标	9
3.1.2 基金净值表现	11
3.1.3 过去三年基金的利润分配情况	13
3.2 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	14
3.2.1 主要会计数据和财务指标	14
3.2.2 基金净值表现	16
3.2.3 过去三年基金的利润分配情况	19
<b>§4 管理人报告</b>	19
4.1 基金管理人及基金经理情况	19
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	20
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	20
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	21
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	23
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	23
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	24
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	25
<b>4.9 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</b>	25
<b>§5 托管人报告</b>	25
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	25
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	25
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	25
<b>§6 审计报告</b>	25
6.1 中银中证 800 指数型发起式证券投资基金	25
6.1.1 审计意见	26
6.1.2 形成审计意见的基础	26
6.1.3 其他信息	26
6.1.4 管理层和治理层对财务报表的责任	26

6.1.5	注册会计师的责任 .....	27
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 .....	28
6.2.1	审计意见 .....	28
6.2.2	形成审计意见的基础 .....	28
6.2.3	其他信息 .....	28
6.2.4	管理层和治理层对财务报表的责任 .....	28
6.2.5	注册会计师对财务报表审计的责任 .....	29
<b>§7</b>	<b>年度财务报表</b> .....	<b>30</b>
7.1	中银中证 800 指数型发起式证券投资基金 .....	30
7.1.1	资产负债表 .....	30
7.1.2	利润表 .....	31
7.1.3	净资产（基金净值）变动表 .....	32
7.1.4	报表附注 .....	33
7.2	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 .....	56
7.2.1	资产负债表 .....	56
7.2.2	利润表 .....	57
7.2.3	净资产（基金净值）变动表 .....	59
7.2.4	报表附注 .....	60
<b>§8</b>	<b>投资组合报告</b> .....	<b>87</b>
8.1	中银中证 800 指数型发起式证券投资基金 .....	87
8.1.1	期末基金资产组合情况 .....	87
8.1.2	报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	88
8.1.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细 .....	90
8.1.4	报告期内股票投资组合的重大变动 .....	107
8.1.5	期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	108
8.1.6	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 .....	109
8.1.7	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 .....	109
8.1.8	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贵金属投资明细 .....	109
8.1.9	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 .....	109
8.1.10	本基金投资股指期货的投资政策 .....	109
8.1.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	109
8.1.12	投资组合报告附注 .....	110
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 .....	110
8.2.1	期末基金资产组合情况 .....	110
8.2.2	报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	111
8.2.3	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 .....	112
8.2.4	报告期内股票投资组合的重大变动 .....	115
8.2.5	期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	116
8.2.6	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 .....	117
8.2.7	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 .....	117
8.2.8	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 .....	117
8.2.9	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 .....	117
8.2.10	本基金投资股指期货的投资政策 .....	117
8.2.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	117
8.2.12	投资组合报告附注 .....	117

<b>§9 基金份额持有人信息</b> .....	118
9.1 中银中证 800 指数型发起式证券投资基金.....	118
<b>9.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构</b> .....	118
<b>9.1.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况</b> .....	119
<b>9.1.3 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的情况</b> .....	120
<b>9.1.4 发起式基金发起资金持有份额情况</b> .....	120
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.....	120
9.2.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	120
<b>9.2.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况</b> .....	121
<b>9.2.3 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的情况</b> .....	122
<b>9.2.4 发起式基金发起资金持有份额情况</b> .....	122
<b>§10 开放式基金份额变动</b> .....	122
10.1 中银中证 800 指数型发起式证券投资基金.....	122
10.2 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.....	123
<b>§11 重大事件揭示</b> .....	123
11.1 基金份额持有人大会决议.....	123
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.....	123
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	123
11.4 基金投资策略的改变.....	124
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	124
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.....	124
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	124
11.8 其他重大事件.....	127
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	131
12.1 中银中证 800 指数型发起式证券投资基金.....	131
12.2 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.....	132
<b>§13 备查文件目录</b> .....	132
13.1 备查文件目录.....	132
13.2 存放地点.....	132
13.3 查阅方式.....	132

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

#### 2.1.1 中银中证 800 指数型发起式证券投资基金

基金名称	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

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	
报告期末基金份额总额	10,645,657.17 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中银中证 800 指数型发起 式 A	中银中证 800 指数型发起 式 C
下属分级基金的交易代码	014226	014227
报告期末下属分级基金的份额总 额	10,499,201.64 份	146,455.53 份

### 2.1.2 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

基金名称	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	
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	
报告期末基金份额总额	10,630,339.65 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中银中证 800ETF 发起式联 接 A	中银中证 800ETF 发起式 联接 C
下属分级基金的交易代码	014226	014227
报告期末下属分级基金的份额总 额	10,492,397.72 份	137,941.93 份

## 2.2 基金产品说明

### 2.2.1 中银中证 800 指数型发起式证券投资基金

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	<p>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。</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>

### 2.2.2 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

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>

### 2.2.1 目标基金产品说明

投资目标	<p>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%。</p>
投资策略	<p>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。</p>
业绩比较基准	<p>中证 800 指数收益率</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>

### 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	中银基金管理有限公司	中信银行股份有限公司



信息披露 负责人	姓名	欧阳向军	姜敏
	联系电话	021-38848999	4006800000
	电子邮箱	clientservice@bocim.com	jiangmin@citicbank.com
客户服务电话		021-38834788 400-888-5566	95558
传真		021-68873488	010-85230024
注册地址		上海市银城中路200号中银大厦45层	北京市朝阳区光华路10号院1号楼6-30层、32-42层
办公地址		上海市银城中路200号中银大厦10层、11层、26层、45层	北京市朝阳区光华路10号院1号楼6-30层、32-42层
邮政编码		200120	100020
法定代表人		章砚	朱鹤新

## 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	<a href="http://www.bocim.com">http://www.bocim.com</a>
基金年度报告备置地点	上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 26 层

## 2.5 其他相关资料

### 2.5.1 中银中证800指数型发起式证券投资基金

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层
注册登记机构	中银基金管理有限公司	上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 10 层、11 层、26 层、45 层

### 2.5.2 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

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层
注册登记机构	中银基金管理有限公司	上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 10 层、11 层、26 层、45 层

## §3 主要财务指标和基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 中银中证 800 指数型发起式证券投资基金

#### 3.1.1 主要会计数据和财务指标

3.1.1.1 期间数据和指标	报告期
-----------------	-----

	2022 年 10 月 10 日至 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
本期已实现收益	9,929.67	-10.01
本期利润	277,299.57	2,925.26
加权平均基金份额本期利润	0.0264	0.0215
本期加权平均净值利润率	3.06%	2.50%
本期基金份额净值增长率	3.13%	3.02%
<b>3.1.1.2 期末数据和指标</b>	<b>2022 年末</b>	
	中银中证 800 指数型发起式 A	中银中证 800 指数型发起式 C
期末可供分配利润	-1,485,123.14	-21,205.26
期末可供分配基金份额利润	-0.1415	-0.1448
期末基金资产净值	9,136,627.53	126,905.80
期末基金份额净值	0.8702	0.8665
<b>3.1.1.3 累计期末指标</b>	<b>2022 年末</b>	
	中银中证 800 指数型发起式 A	中银中证 800 指数型发起式 C
基金份额累计净值增长率	3.13%	3.02%

注：1、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。

2、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。期末可供分配利润，采用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（为期末余额），即如果期末未分配利润（报表数，下同）的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分，如果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（已实现部分扣除未实现部分）。

3、本基金由原中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金于 2022 年 10 月 10 日转型而来，截止报告期末未满三年。

### 3.1.2 基金净值表现

#### 3.1.2.1 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

中银中证 800 指数型发起式 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
自基金合同生效日起	3.13%	1.05%	1.88%	1.13%	1.25%	-0.08%

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%

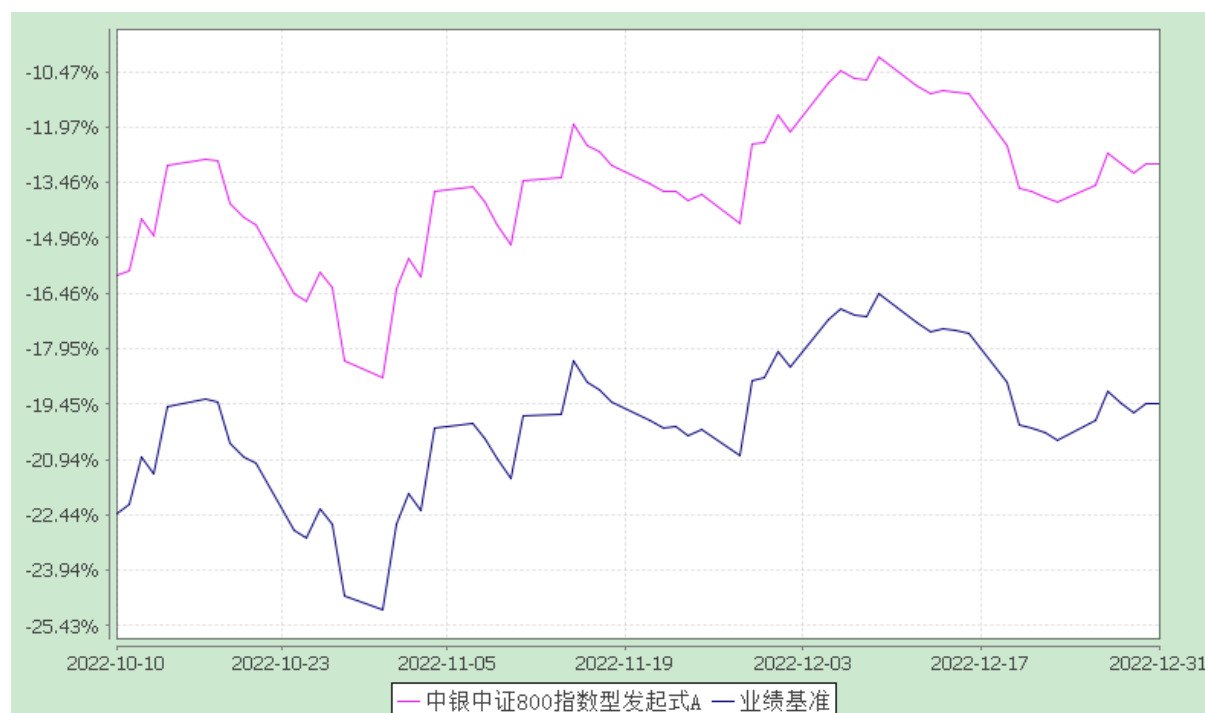
#### 3.1.2.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

中银中证 800 指数型发起式证券投资基金

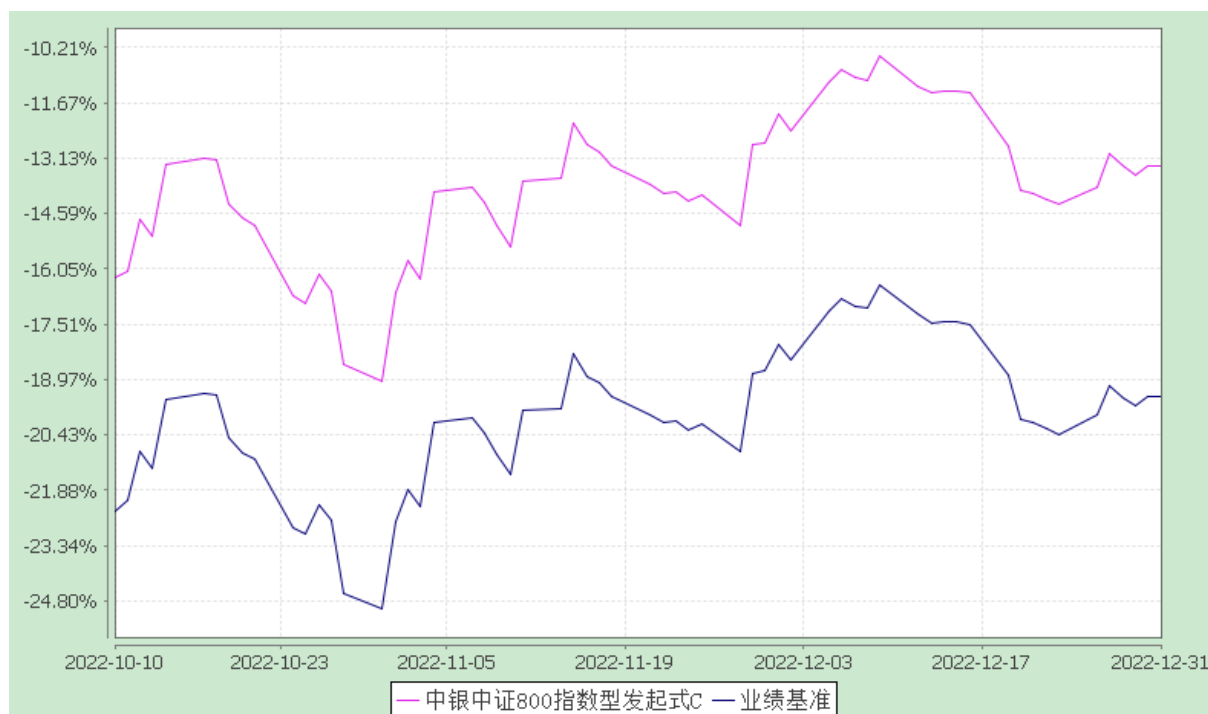
自基金转型以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2022 年 10 月 10 日至 2022 年 12 月 31 日)

中银中证 800 指数型发起式 A



中银中证 800 指数型发起式 C



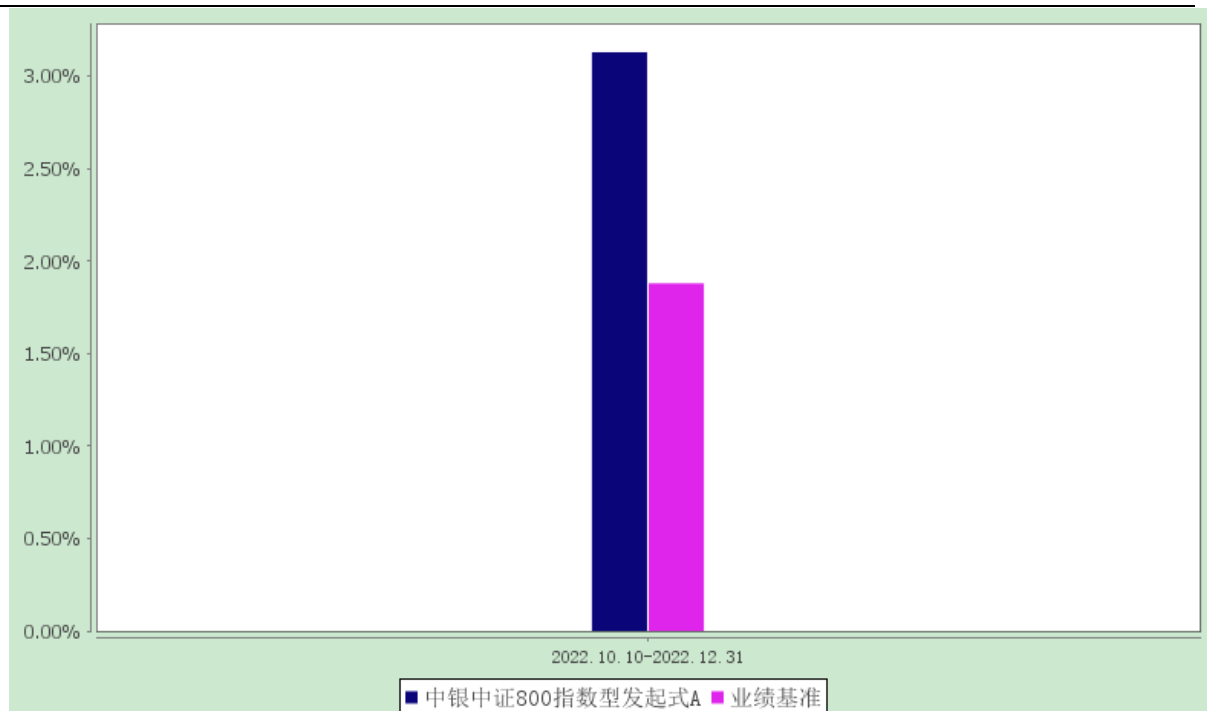
注：截至报告期末，本基金转型未满一年。按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期，截至报告期末，本基金尚在建仓期内。

### 3.1.2.3 自基金转型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

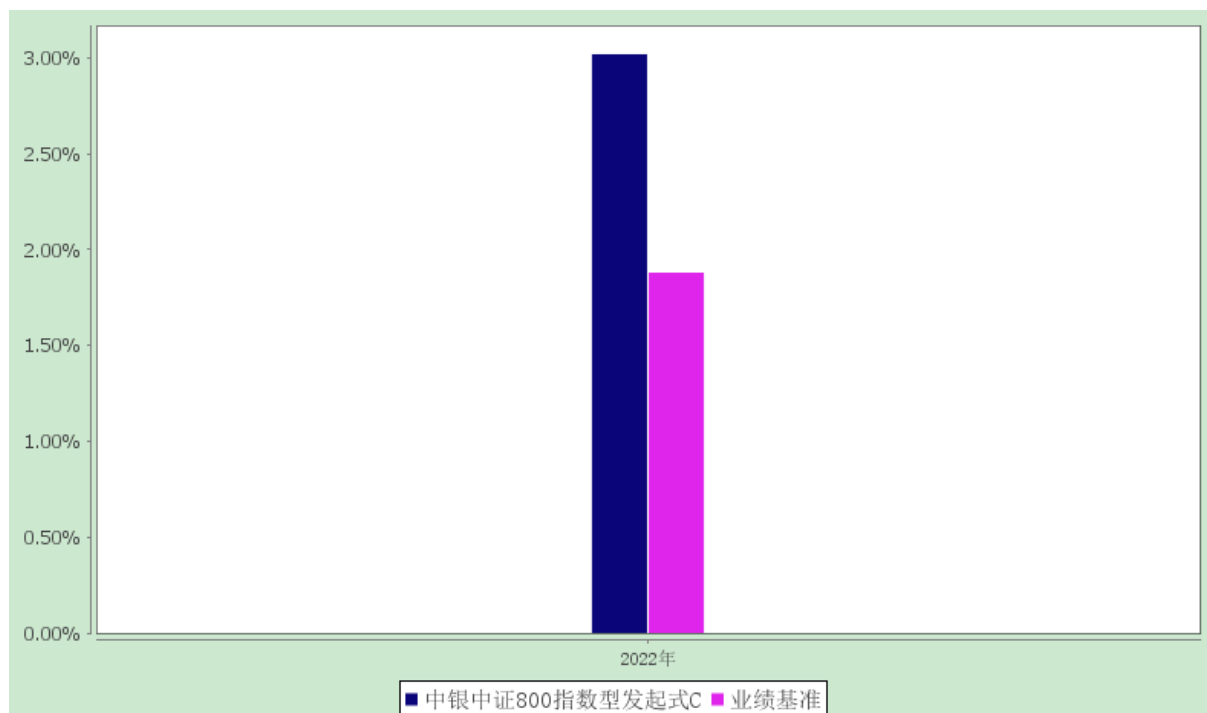
中银中证 800 指数型发起式证券投资基金

自基金转型以来净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图

中银中证 800 指数型发起式 A



中银中证 800 指数型发起式 C



注：基金合同于 2022 年 10 月 10 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满五年。合同生效当年的本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.1.3 过去三年基金的利润分配情况

#### 1、中银中证 800 指数型发起式 A:

单位：人民币元

年度	每10份基金 份额分红数	现金形式发放总 额	再投资形式发放总 额	年度利润分配合 计	备注
2022 年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

2、中银中证 800 指数型发起式 C:

单位：人民币元

年度	每10份基金 份额分红数	现金形式发放总 额	再投资形式发放总 额	年度利润分配合 计	备注
2022 年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

注：本基金由原中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金于 2022 年 10 月 10 日转型而来，自基金合同生效日（2022 年 10 月 10 日）至本报告期末未发生利润分配。

3.2 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

3.2.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.2.1.1 期 间数据和 指标	报告期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 10 月 9 日		上年度可比期间 2021 年 12 月 7 日至 2021 年 12 月 31 日	
	中银中证 800ETF 发起式联接 A	中银中证 800ETF 发 起式联接 C	中银中证 800ETF 发 起式联接 A	中银中证 800ETF 发 起式联接 C
本期已 实现收 益	-1,479,837.30	-64,689.21	-16,409.51	-255.57
本期利 润	-1,623,184.45	69,706.99	-63,343.73	-878.90
加权平 均基金 份额本 期利润	-0.1527	0.1326	-0.0059	-0.0061
本期加 权平均	-17.45%	15.04%	-0.59%	-0.61%

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  
年度报告

净值利 润率				
本期基 金份 额 净 值 增 长 率	-15.12%	-15.37%	-0.59%	-0.61%
<b>3.2.1.2 期</b>	<b>报告期末(2022 年 10 月 9 日)</b>		<b>2021 年末</b>	
<b>末数据和 指标</b>	中银中证 800ETF 发 起式联接 A	中银中证 800ETF 发起 式联接 C	中银中证 800ETF 发起 式联接 A	中银中证 800ETF 发起 式联接 C
期末可 供分 配 利 润	-1,639,548.44	-21,944.26	-63,343.73	-878.90
期末可 供分 配 基 金 份 额 利 润	-0.1563	-0.1591	-0.0059	0.0061
期末基 金资 产 净 值	8,852,849.28	115,997.67	10,760,820.22	142,889.35
期末基 金份 额 净 值	0.8437	0.8409	0.9941	0.9939
<b>3.2.1.3 累</b>	<b>报告期末(2022 年 10 月 9 日)</b>		<b>2021 年末</b>	
<b>计期末指 标</b>	中银中证 800ETF 发起式联接 A	中银中证 800ETF 发 起式联接 C	中银中证 800ETF 发 起式联接 A	中银中证 800ETF 发 起式联接 C
基金份 额累 计 净 值 增 长 率	-15.62%	-15.89%	-0.59%	-0.60%

注：1、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。

2、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。期末可供分配利润，采用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（为期末余额），即如果期末未分配利润（报表数，下同）的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分，如果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（已实现部分扣除未实现部分）。

3、本基金基金合同于 2021 年 12 月 7 日生效，截止报告期末未满三年。

4、本基金于 2022 年 10 月 10 日转型为中银中证 800 指数型发起式证券投资基金。

### 3.2.2 基金净值表现

#### 3.2.2.1 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

中银中证 800ETF 发起式联接 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	-	-	-	-	-	-
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%

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%

#### 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



自基金合同生效日以来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)

### 中银中证 800ETF 发起式联接 A



### 中银中证 800ETF 发起式联接 C



注：截至报告期末，本基金成立未满一年。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。

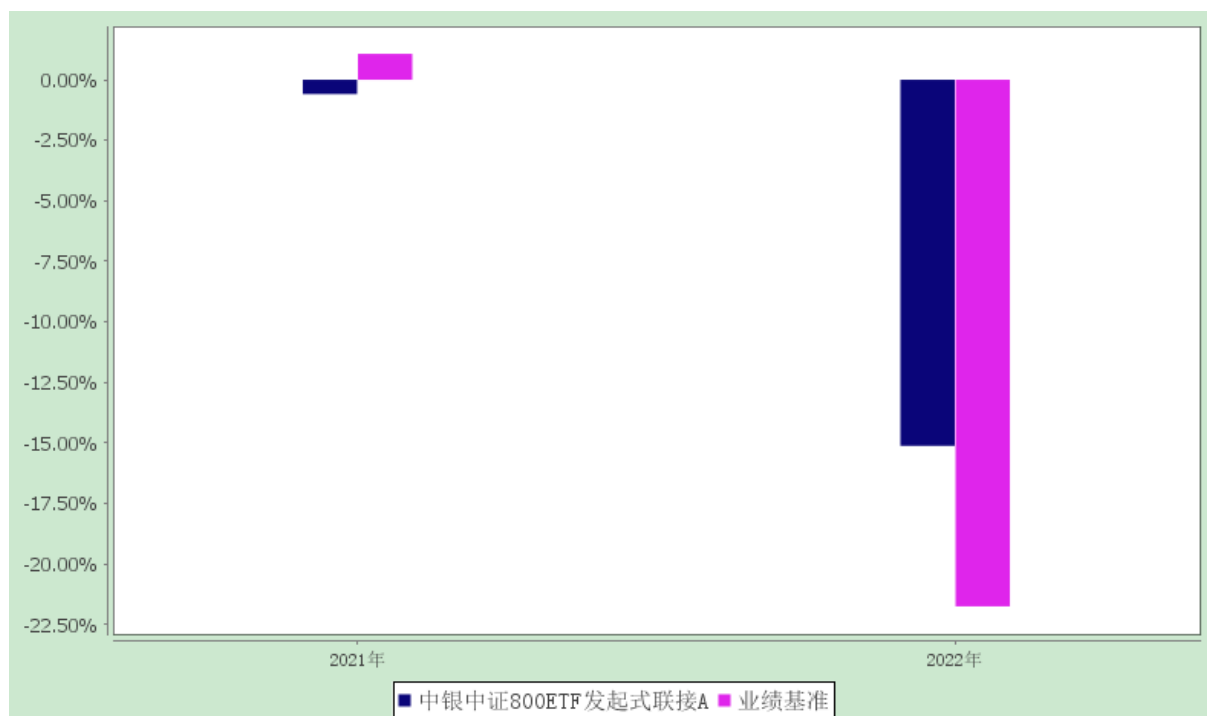
### 3.2.2.3 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比

较

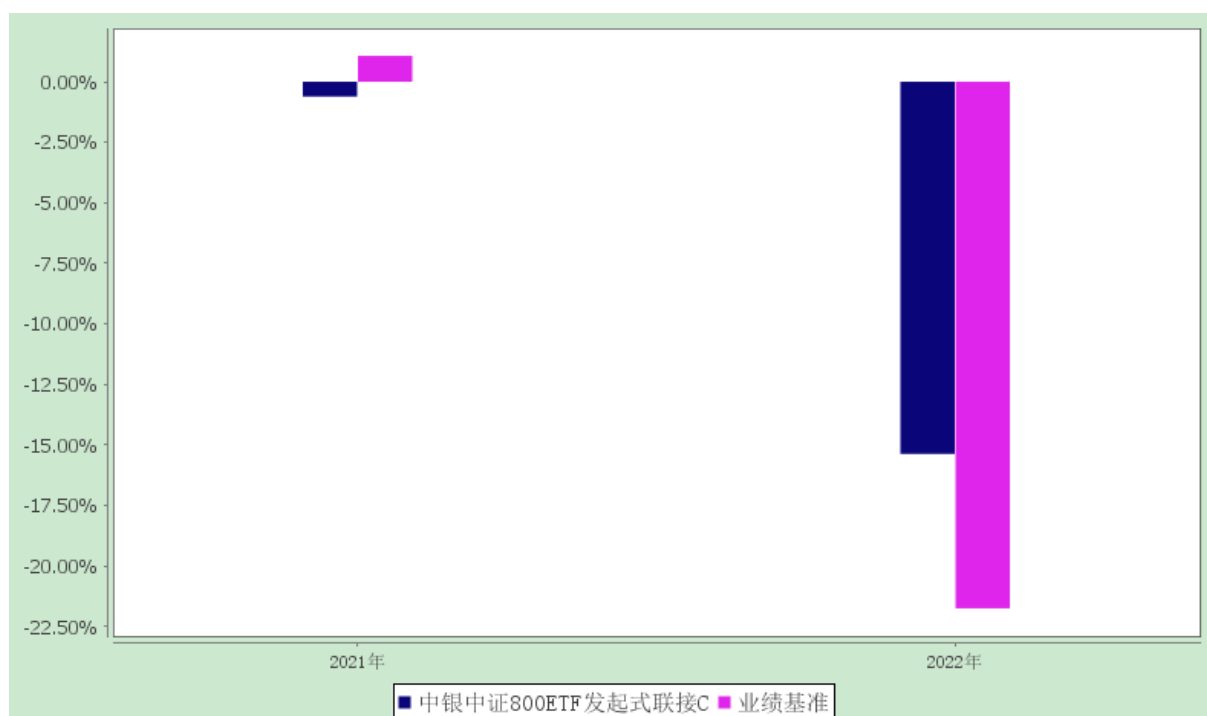
中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金

自基金合同生效日以来净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图

中银中证 800ETF 发起式联接 A



中银中证 800ETF 发起式联接 C



注：基金合同于2021年12月07日生效，截至报告期末本基金合同生效未满五年。合同生效当年的本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.2.3 过去三年基金的利润分配情况

#### 1、中银中证 800ETF 发起式联接 A:

单位：人民币元

年度	每10份基金 份额分红数	现金形式发放总 额	再投资形式发放总 额	年度利润分配合 计	备注
2022 年	-	-	-	-	-
2021 年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

#### 2、中银中证 800ETF 发起式联接 C:

单位：人民币元

年度	每10份基金 份额分红数	现金形式发放总 额	再投资形式发放总 额	年度利润分配合 计	备注
2022 年	-	-	-	-	-
2021 年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

注：本基金于 2022 年 10 月 10 日转型为中银中证 800 指数型发起式证券投资基金，本基金自基金合同生效日（2021 年 12 月 7 日）至转型日未发生利润分配。

## §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

本基金管理人为中银基金管理有限公司，由中国银行股份有限公司和贝莱德投资管理有限公司两大全球著名领先金融品牌强强联合组建的中外合资基金管理公司，致力于长期参与中国基金业的发展，努力成为国内领先的基金管理公司。

截至 2022 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理中银中国精选混合型开放式证券投资基金、中银货币市场证券投资基金、中银持续增长混合型证券投资基金、中银收益混合型证券投资基金等一百多余只开放式证券投资基金，同时管理着多个私募资产管理计划。

#### 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	证券从业	说明
----	----	-------------	------	----

		理) 期限		年限	
		任职日期	离任日期		
赵建忠	基金经理	2021-12-07	-	-	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 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

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。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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，本报告期内公司整体公平交易制度执行情况良好，未发现违背公平交易的相关情况。

#### 4.3.3 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 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

##### 1、宏观经济分析

国外经济方面，2022 年美国主线上半年仍为抗通胀，自三季度通胀出现明显下行趋势后，衰退成为新的宏观主题。具体看，美国四个季度 GDP 环比折年率分别为-1.6%，-0.6%，3.2%，2.9%，GDP 不变价同比分别录得 3.68%，1.8%，1.94%，0.96%，美国消费增长结构总体从商品消费为主转为服务消费为主，生产端的修复总体不明显。全年 CPI 呈现高位倒 U 型走势，CPI 自 1 月 7.5% 上行至 6 月最高点 9.1%，随后震荡回落至 12 月的 6.5% 左右，全年 CPI 同比涨 8%。美国就业市场维持偏紧状态，失业率从 1 月的 4.0% 逐步回落至 12 月的 3.5%。在通胀持续超预期的背景下，美联储 2022 年持续加息，截止 12 月末，联邦基金目标利率达到了 4.5%。欧元区在受到俄乌冲突影响更大的背

景下，滞胀风险高于美国，欧元区通胀在 2 月俄乌事件情况恶化后受能源价格上涨影响快速抬升，HICP 通胀率从 1 月的 5.1% 持续上行至年内高点的 10 月同比 10.6%，随后缓慢回落至 12 月的 9.2%。高通胀与低复苏动能双重影响下，欧元区经济增长也趋于疲软，前三季度 GDP 不变价同比分别为 5.6%，4.3%，2.4%。日本前三季度 GDP 实际增速分别录得 0.4%，1.6%，1.5%，时隔多年日本通胀出现明显回升，CPI 通胀同比增速从 1 月的 0.5% 上行至 12 月的 4%。日央行鸽派态度在 2022 年并未发生明显变化，需关注 2023 年 BOJ 新任行长可能带来的调整。

2022 年国内经济增长压力相对较大，受二季度华东疫情扰动和四季度疫情防控政策先紧后松的影响全年呈现波浪形走势，四个季度实际 GDP 增速分别录得 4.8%，0.4%，3.9%，2.9%，全年经济实际增速 3% 左右。分部门来看，投资全年依靠基建托底，地产投资直至 11 月全年呈加速下行态势，最低为 11 月录得 -19.7%，基建投资自 6 月起持续保持 10% 以上较高速增长，全年固定投资累计增速录得 5.1%；规模以上工业增加值全年增长 3.6%，相较于其他指标而言全年波动较小；消费为 2022 年另一大对经济增长施压的项目，全年录得负增长 -0.25%，二、四季度在居民实际收入和收入信心下行的影响下，消费增速均为负。对外贸易方面，全年进口在内需疲弱背景下持续位于低位，出口在外需放缓背景下自三季度起快速下行，出口同比从 9 月的 5.6% 快速下行至 12 月的 -9.9%。通胀方面，PPI 全年呈回落态势并于四季度转负，全年均值 4.2%，CPI 全年在消费需求疲软，猪周期影响逐步消退带动下也较为温和，全年均值 2.0%。基于温和通胀与较疲弱的经济基本面，全年货币政策维持较为宽松状态，全年 M0 平均同比达 13.2%，远高于 2021 年的 5.05%，也高于 2020 年的 9.82%。但社融和信贷增长仍较为疲弱，2022 年全年新增贷款 21.31 万亿元，较 2021 年多增 1.36 万亿元，2022 年疫情持续影响经济背景下，政策持续推动信贷投放，使得全年信贷增长有所加快；全年居民贷款增加 3.83 万亿元，较 2021 年少增 4.09 万亿元，由于消费和购房支出大幅减少，全年居民贷款需求大幅下降；全年企业贷款增加 17.09 万亿元，较 2021 年多增 5.07 万亿元，疫情冲击背景下政策着力稳增长，推动对企业信贷投放明显增加。2022 年全年社会融资增量 32.01 万亿元，较 2021 年多增 6689 亿元，全年社融增速从 2021 年的 10.3% 降至 9.6%，融资需求低迷背景下，社融增长持续乏力。

## 2、行情回顾

回顾 2022 年，年初到 4 月份，投资者担心中国经济存在硬着陆的风险，对经济增长极度悲观，叠加俄乌事件带动全球政治格局动荡，导致在疫情防控期间，市场跌幅较大。5 月随着上海解封，疫情好转，宏观政策积极，疫情防控科学化，投资者对经济的增长预期好转，风险偏好回升，指数反转向上。7 月随着疫情前积压的需求集中释放告一段落、叠加疫情反复和房地产停贷风波冲击，国内经济有所回落，各国加息引发海外衰退预期，A 股缩量下探。四季度股市结构转向“自主可控、

国家安全”方向，11 月美联储加息节奏有望放缓，国内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，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，煤炭(10.95%)、综合(10.57%)、社会服务(-2.23%)等行业表现较好，电子(-36.54%)、建筑建材(-26.13%)、传媒(-26.07%)等行业跌幅较大。最终，沪深 300 等权指数涨跌幅度为-21.62%；中证 100 涨跌幅-22.07%；上证国企指数涨跌幅-13.9%，中证 800 指数涨跌-21.32%。

### 3. 运行分析

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

转型前（2022.1.1-2022.10.9）：

报告期内，本基金 A 类份额净值增长率为-15.12%，同期业绩比较基准收益率为-21.75%。

报告期内，本基金 C 类份额净值增长率为-15.37%，同期业绩比较基准收益率为-21.75%。

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%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2023 年，对市场看法相对乐观。从长期的角度来看 A 股在 2022 年完成二次探底，目前仍处于底部区域，慢牛的逻辑如经济转型升级、居民财富迁移、外资持续流入、国家重视科技创新等仍未改变。盈利方面，全年 A 股非金融或实现接近 10%的正增长，呈现逐季回升态势。流动性方面，国内货币政策将保持宽松，信贷增速上行有望提振市场估值，海外美联储紧缩逐渐退坡，美债收益率有望下行，居民超额储蓄释放，私募、险资、外资都有望流入增量资金。风险偏好方面，政策环境偏暖对市场构成支撑，权益资产在 2023 年具备较好的配置价值。

本基金将严格按照契约规定，采用完全复制投资策略，被动跟踪指数，保持跟踪误差在较小范围内。作为基金管理者，我们将一如既往地依靠团队的努力和智慧，为投资人创造应有的回报。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人坚持一切从防范风险、保护基金份额持有人利益出发，致力于内控机

制的完善,加强内部风险的控制与防范,确保各项法规和制度的落实,保证基金合同得到严格履行。公司内控部门与审计部按照制度,通过基金运作监控和内部审计等方法,独立地开展工作,发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改。

本报告期内,本基金的监察稽核主要工作情况如下:

(1) 深入开展审计检查,确保基金运作合规性

主要措施有:对基金运作涉及的投资、研究、交易、风险管理、信息资讯等业务环节开展独立检查,及时发现业务流程中存在的风险并督促整改,确保相关业务运作符合法律法规及公司制度的规定。

(2) 修订内部管理制度,完善投资业务流程

根据监管机关的规定,定期更新公司内部投资管理制度,不断加强内部流程控制,动态作出各项合规提示,防范投资风险。

通过以上工作的开展,在本报告期内,本基金运作过程中未发生违规关联交易、内幕交易,基金运作整体合法合规。本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,不断提高合规与审计工作的科学性和有效性,努力防范各种风险,为基金份额持有人谋求最大利益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

##### 4.7.1 有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

根据证监会的相关规定,本公司为建立健全有效的估值政策和程序,经公司执行委员会批准,公司成立估值委员会,明确参与估值流程各方的人员分工和职责,由基金运营、风险管理、研究及相关人员担任委员会委员。估值委员会委员具备应有的经验、专业胜任能力和独立性,分工明确。估值委员会严格按照工作流程诚实守信、勤勉尽责地讨论和决策估值事项。估值委员会审议并依据行业协会提供的估值模型和行业做法选定与当时市场环境相适应的估值方法,基金运营部应征询会计师事务所、基金托管人的相关意见。当改变估值技术时,导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上的,会计师事务所应对基金管理人所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性发表审核意见,同时公司按照相关法律法规要求履行信息披露义务。另外,对于特定品种或者投资品种相同,但具有不同特征的,若协会有特定调整估值方法的通知的,比如《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》的,应参照协会通知执行。可根据指引的指导意见,并经估值委员会审议,采用第三方估值机构提供的估值相关的数据服务。

##### 4.7.2 本公司参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突。



4.7.3 定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

本报告期末 A 类基金份额可供分配利润为-1,485,123.14 元,C 类基金份额可供分配利润为-21,205.26 元。本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 4.9 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

本报告期内无需要说明的相关情况。

### §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

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对中银中证 800 指数型发起式证券投资基金 2022 年的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

#### 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

本托管人认为，中银基金管理有限公司在中银中证 800 指数型发起式证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

#### 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

本托管人认为，中银基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的 2022 年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

### §6 审计报告

#### 6.1 中银中证 800 指数型发起式证券投资基金

安永华明（2023）审字第 61062100\_B53 号

中银中证 800 指数型发起式证券投资基金全体基金份额持有人：

### 6.1.1 审计意见

我们审计了中银中证 800 指数型发起式证券投资基金的财务报表，包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表，2022 年 10 月 10 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日止期间的利润表、净资产（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的中银中证 800 指数型发起式证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了中银中证 800 指数型发起式证券投资基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年 10 月 10 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。

### 6.1.2 形成审计意见的基础

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。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于中银中证 800 指数型发起式证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。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。

### 6.1.3 其他信息

中银中证 800 指数型发起式证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

### 6.1.4 管理层和治理层对财务报表的责任

管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，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。

在编制财务报表时，管理层负责评估中银中证 800 指数型发起式证券投资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，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。

治理层负责监督中银中证 800 指数型发起式证券投资基金的财务报告过程。

### 6.1.5 注册会计师的责任

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。

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：

(1) 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。

(2) 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。

(3) 评价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。

(4) 对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，就可能导致对中银中证 800 指数型发起式证券投资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中证 800 指数型发起式证券投资基金不能持续经营。

(5) 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。

我们与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。

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

陈露 徐雯

北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层

2023 年 3 月 29 日

## 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

安永华明（2023）审字第 61062100\_B52 号

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全体基金份额持有人：

### 6.2.1 审计意见

我们审计了中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的财务报表，包括 2022 年 10 月 9 日（即《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》失效前日，以下简称“基金合同失效前日”）的资产负债表，2022 年 1 月 1 日至 2022 年 10 月 9 日（基金合同失效前日）止期间的利润表、净资产（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 2022 年 10 月 9 日（基金合同失效前日）的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 10 月 9 日（基金合同失效前日）止期间的经营成果和净值变动情况。

### 6.2.2 形成审计意见的基础

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。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金，并履行了职业道德方面的其他责任。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。

### 6.2.3 其他信息

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管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

### 6.2.4 管理层和治理层对财务报表的责任

管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，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。

在编制财务报表时，管理层负责评估中银中证 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，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。

治理层负责监督中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的财务报告过程。

#### 6.2.5 注册会计师对财务报表审计的责任

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。

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：

（1）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。

（2）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。

（3）评价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。

（4）对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，就可能导致对中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式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中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金不能持续经营。

（5）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。

我们与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。

陈露 徐雯

北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层

2023 年 3 月 29 日

## §7 年度财务报表

### 7.1 中银中证 800 指数型发起式证券投资基金

#### 7.1.1 资产负债表

会计主体：中银中证 800 指数型发起式证券投资基金

报告截止日：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日
资产：		-
银行存款	7.4.7.1	438,882.25
结算备付金		-
存出保证金		4,050.28
交易性金融资产	7.4.7.2	8,859,092.01
其中：股票投资		8,352,635.00
基金投资		-
债券投资		506,457.01
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	-
应收清算款		-
应收股利		-
应收申购款		2,800.03
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.5	-
<b>资产总计</b>		<b>9,304,824.57</b>
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日
负债：		-
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		0.01
应付赎回款		-
应付管理人报酬		3,569.25
应付托管费		396.60
应付销售服务费		36.38
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	7.4.7.6	37,289.00
<b>负债合计</b>		<b>41,291.24</b>
<b>净资产：</b>		<b>-</b>
实收基金	7.4.7.7	10,645,657.17
未分配利润	7.4.7.8	-1,382,123.84
<b>净资产合计</b>		<b>9,263,533.33</b>
<b>负债和净资产总计</b>		<b>9,304,824.57</b>

注：1.报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额总额 10,645,657.17 份，其中 A 类基金份额净值 0.8702 元，基金份额 10,499,201.64 份；C 类基金份额净值 0.8665 元，基金份额 146,455.53 份。

2.该基金合同于 2022 年 10 月 10 日生效。

### 7.1.2 利润表

会计主体：中银中证 800 指数型发起式证券投资基金

本报告期：2022 年 10 月 10 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期
		2022 年 10 月 10 日至 2022 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		<b>297,711.87</b>
1.利息收入		588.12
其中：存款利息收入	<b>7.4.7.9</b>	588.12
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）		26,774.62

其中：股票投资收益	7.4.7.10	8,948.57
基金投资收益	7.4.7.11	-
债券投资收益	7.4.7.12	2,561.92
资产支持证券投资收益	7.4.7.13	-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	7.4.7.14	-
股利收益	7.4.7.15	15,264.13
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	270,305.17
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	43.96
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>17,487.04</b>
1. 管理人报酬	7.4.10.2	9,400.03
2. 托管费	7.4.10.2	1,044.45
3. 销售服务费		106.96
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. 税金及附加		-
8. 其他费用	7.4.7.18	6,935.60
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>280,224.83</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>280,224.83</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>280,224.83</b>

### 7.1.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：中银中证 800 指数型发起式证券投资基金

本报告期：2022 年 10 月 10 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 10 月 10 日至 2022 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	10,630,339.65	-1,661,492.70	8,968,846.95



加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	10,630,339.65	-1,661,492.70	8,968,846.95
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	15,317.52	279,368.86	294,686.38
（一）、综合收益总额	-	280,224.83	280,224.83
（二）、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）	15,317.52	-855.97	14,461.55
其中：1.基金申购款	174,736.53	-23,777.94	150,958.59
2.基金赎回款	-159,419.01	22,921.97	-136,497.04
（三）、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）	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	10,645,657.17	-1,382,123.84	9,263,533.33

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码（序号）从 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：张家文，主管会计工作负责人：陈宇，会计机构负责人：乐妮

## 7.1.4 报表附注

### 7.1.4.1 基金基本情况

中银中证 800 指数型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”），是由中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金转型而来。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，系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[2021]3445 号文《关于准予中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金注册的批复》准予注册，由基金管理人中银基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于 2021 年 12 月 7 日正式生效，首次设立募集规模为 10,967,887.69 份基金份额。

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目标 ETF 于 2022 年 7 月 21 日触发基金合同终止条款，根据《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》的约定，如目标 ETF 终止上市或目标 ETF 基金合同终止，本基金可在履行适当程序后由投资于目标 ETF 的联接基金变更为直接投资该标的指数的指数基金，无需召开基金份额持有人大会。2022 年 10 月 10 日，《中银中证 800 指数型发起式证券投资基金基金合同》自该日起生效，基金合同生效日的规模为 10,630,339.65 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构均为中银基金管理有限公司，基金托管人为中信银行股份有限公司。

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。本基金可少量投资于其他股票(包括创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票)、存托凭证、股指期货、股票期权、债券(包括国债、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(含分离交易可转债的纯债部分)、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、同业存单、现金，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)。本基金将根据法律法规的规定参与转融通证券出借及融资业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金业绩比较基准为：中证 800 指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%。

本财务报表由本基金的基金管理人中银基金管理有限公司于 2023 年 3 月 29 日批准。

#### 7.1.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 7.1.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年 10 月 10 日（基金合同生效日）起至 2022 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 7.1.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.1.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系 2022 年 10 月 10 日（基金合同生效日）起至 2022 年 12 月 31 日止期间。

#### 7.1.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

#### 7.1.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

##### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

##### (2) 金融负债分类

本基金的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、以摊余成本计量的金融负债。

#### 7.1.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为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，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，

本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

#### 7.1.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债

的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

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和金融负债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，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，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) 不存在活跃市场的金融工具，应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。采用估值技术确定公允价值时，应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，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.1.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.1.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。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确认。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。

#### 7.1.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益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利得/（损失）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确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### 7.1.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

(3) 债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或预期收益率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(6) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(7) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(8) 公允价值变动收益系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、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(9) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致本基金资产增加或者负债减少、且经济利益的流入

额能够可靠计量时予以确认。

#### 7.1.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

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。

#### 7.1.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(3) 基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.1.4.4.12 分部报告

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) 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) 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。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 7.1.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

#### 7.1.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.1.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

#### 7.1.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 7.1.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 7.1.4.6 税项

##### 7.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

##### 7.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；



根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金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。对证券投资基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

#### 7.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个  
人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加  
的单位外）及地方教育费附加。

#### 7.4.6.4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，  
自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用  
基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通  
知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，  
暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，  
对证券投资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，股权的股息、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。

#### 7.4.6.5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通  
知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，  
暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得  
有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人

所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25% 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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

#### 7.1.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.1.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	438,882.25
等于：本金	438,841.04
加：应计利息	41.21
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
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	-
合计	438,882.25

##### 7.1.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	8,137,645.83	-	8,352,635.00	214,989.17

贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	501,582.50	6,067.01	506,457.01	-1,192.50
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	501,582.50	6,067.01	506,457.01	-1,192.50
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		8,639,228.33	6,067.01	8,859,092.01	213,796.67

### 7.1.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 7.1.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

### 7.1.4.7.4 买入返售金融资产

#### 7.1.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 7.1.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

### 7.1.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

### 7.1.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 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	7,289.00
其中：交易所市场	7,289.00
银行间市场	-
应付利息	-
应付审计费	30,000.00
合计	37,289.00

#### 7.1.4.7.7 实收基金

中银中证 800 指数型发起式 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年10月10日至2022年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	10,492,397.72	10,492,397.72
本期申购	47,818.63	47,818.63
本期赎回（以“-”号填列）	-41,014.71	-41,014.71
本期末	10,499,201.64	10,499,201.64

中银中证 800 指数型发起式 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年10月10日至2022年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	137,941.93	137,941.93
本期申购	126,917.90	126,917.90
本期赎回（以“-”号填列）	-118,404.30	-118,404.30
本期末	146,455.53	146,455.53

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 7.1.4.7.8 未分配利润

中银中证 800 指数型发起式 A

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
基金合同生效日	-1,494,091.96	-145,456.48	-1,639,548.44
本期利润	9,929.67	267,369.90	277,299.57
本期基金份额交易产生的 变动数	-960.85	635.61	-325.24
其中：基金申购款	-6,830.99	1,119.07	-5,711.92
基金赎回款	5,870.14	-483.46	5,386.68

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  
年度报告

本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,485,123.14	122,549.03	-1,362,574.11

中银中证 800 指数型发起式 C

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
基金合同生效日	-19,993.45	-1,950.81	-21,944.26
本期利润	-10.01	2,935.27	2,925.26
本期基金份额交易产生的 变动数	-1,201.80	671.07	-530.73
其中：基金申购款	-18,466.49	400.47	-18,066.02
基金赎回款	17,264.69	270.60	17,535.29
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-21,205.26	1,655.53	-19,549.73

7.1.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 10 月 10 日至 2022 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	467.09
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	107.58
其他	13.45
合计	588.12

7.1.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 10 月 10 日至 2022 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	433,854.00
减：卖出股票成本总额	416,564.20
减：交易费用	8,341.23
买卖股票差价收入	8,948.57

#### 7.1.4.7.11 基金投资收益

本基金本报告期无基金投资收益。

#### 7.1.4.7.12 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年10月10日至2022年12月31日
债券投资收益——利息收入	2,561.92
债券投资收益——买卖债券(债转股及债券到期兑付)差价收入	-
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	2,561.92

#### 7.1.4.7.13 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 7.1.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 7.1.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年10月10日至2022年12月31日
股票投资产生的股利收益	15,264.13
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	15,264.13

#### 7.1.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年10月10日至2022年12月31日
1.交易性金融资产	270,305.17
——股票投资	271,595.17
——债券投资	-1,290.00
——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	270,305.17

#### 7.1.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年10月10日至2022年12月31日
基金赎回费收入	43.96
基金转换费收入	-
合计	43.96

#### 7.1.4.7.18其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2022年10月10日至2022年12月31日
审计费用	6,822.42
信息披露费	-
证券出借违约金	-
其他	0.68
银行汇划费	112.50
合计	6,935.60

#### 7.1.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.1.4.8.1或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

##### 7.1.4.8.2资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 7.1.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中银基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中信银行股份有限公司(“中信银行”)	基金托管人
贝莱德投资管理(英国)有限公司	基金管理人的股东
中国银行股份有限公司	基金管理人的控股股东
中银国际证券股份有限公司	受中国银行重大影响
中银资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司
中银(新加坡)资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.1.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.1.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行交易。

##### 7.1.4.10.2 关联方报酬

###### 7.1.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2022年10月10日至2022年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	9,400.03
其中：支付销售机构的客户维护费	166.45

注：支付基金管理人中银基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.45% 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：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.45% / 当年天数。

###### 7.1.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2022年10月10日至2022年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,044.45

注：支付基金托管人中信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：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.05% / 当年天数。

###### 7.1.4.10.2.3 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 2022年10月10日至2022年12月31日 当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中银中证 800 指数型发起式 A	中银中证 800 指数型发起式 C	合计
	中银基金管理有限公司	-	10.53
合计	-	10.53	10.53

注：A 类基金份额不收取销售服务费。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 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给中银基金管理有限公司，再由中银基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类的基金资产净值} \times 0.40\% / \text{当年天数}。$$

#### 7.1.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 7.1.4.10.4 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

##### 7.1.4.10.4.1 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

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。

##### 7.1.4.10.4.2 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

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。

#### 7.1.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

项目	本期 2022年10月10日至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
基金合同生效 日(2022年10 月10日)持有 的基金份额	10,000,000.00	-
期初持有的基 金份额	-	-

期间申购/买入 总份额	-	-
期间因拆分变 动份额	-	-
减：期间赎回/ 卖出总份额	-	-
期末持有的基 金份额	10,000,000.00	-
期末持有的基 金份额占基金 总份额比例	95.25%	-

注：（1）期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额。期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

（2）本基金管理人运用固有资金投资本基金所采用的费率适用招募说明书以及管理人发布的最新公告规定的费率结构。

#### 7.1.4.10.5.2 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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末未投资本基金。

#### 7.1.4.10.6 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 2022年10月10日至2022年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中信银行股份有限公司	438,882.25	467.09

注：本基金的银行存款由基金托管人中信银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.1.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 7.1.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 7.1.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

于 2022 年 12 月 31 日，本基金持有 1,100 股中信银行的 A 股普通股，成本总额为人民币 5,093.00 元，估值总额为人民币 5,478.00 元，占基金资产净值的比例为 0.06%；本基金持有 600 股中银证券

的 A 股普通股，成本总额为人民币 6,701.00 元，估值总额为人民币 6,342.00 元，占基金资产净值的比例为 0.07%；本基金持有 7,100 股中国银行的 A 股普通股，成本总额为人民币 21,939.00 元，估值总额为人民币 22,436.00 元，占基金资产净值的比例为 0.24%。

#### 7.1.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 7.1.4.12 期末（2022年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.1.4.12.1 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 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300850	新强联	2022-12-30	重大事项停牌	53.28	2023-01-10	56.88	100	6,006.00	5,328.00	
600038	中直股份	2022-12-26	重大资产重组	46.41	2023-01-10	51.05	100	3,799.00	4,641.00	

##### 7.1.4.12.2 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.1.4.12.2.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 12 月 31 日止，本基金未持有银行间市场债券正回购交易中作为质押的债券。

###### 7.1.4.12.2.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 12 月 31 日止，本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为质押的债券。

##### 7.1.4.12.3 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 7.1.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.1.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中面临的相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了包括风险管理委员会、风险管理与内部控制委员会、督察长、风险管理部、内控与法律合规部、审计部和相关业务部门构成的多级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理与内部控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。

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，将风险控制可在可承受的范围内。

#### **7.1.4.13.2 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。本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，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。

#### **7.1.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指在履行以交付现金或其他金融资产的方式结算的义务时发生资金短缺的风险。对于本基金而言，体现在所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可在基金每个开放日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。

##### **7.1.4.13.3.1 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》等有关法规的要求建立健全流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行

管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。同时，对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。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。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。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，因此除附注“期末本基金持有的流通受限证券”列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。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。

于本报告期末，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(净资产)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。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 7.1.4.13.4 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。

##### 7.1.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。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。

##### 7.1.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	438,882.25	-	-	-	438,882.25

存出保证金	4,050.28	-	-	-	4,050.28
交易性金融资产	506,457.01	-	-	8,352,635.00	8,859,092.01
应收申购款	0.03	-	-	2,800.00	2,800.03
资产总计	949,389.57	-	-	8,355,435.00	9,304,824.57
负债					
应付证券清算款	-	-	-	0.01	0.01
应付管理人报酬	-	-	-	3,569.25	3,569.25
应付托管费	-	-	-	396.60	396.60
应付销售服务费	-	-	-	36.38	36.38
其他负债	-	-	-	37,289.00	37,289.00
负债总计	-	-	-	41,291.24	41,291.24
利率敏感度缺口	949,389.57	-	-	8,314,143.76	9,263,533.33

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。

#### 7.1.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本报告期末，本基金持有的固定收益品种投资公允价值占基金净资产的比例低于 10%，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响。

#### 7.1.4.13.4.2 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。

#### 7.1.4.13.4.3 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证券，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。

#### 7.1.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022 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	8,352,635.00	90.17
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	-	-
合计	8,352,635.00	90.17

#### 7.1.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于本报告期末，本基金成立未满半年，无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金净资产的影响。

#### 7.1.4.14 公允价值

##### 7.1.4.14.1 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。

##### 7.1.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.1.4.14.2.1 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 2022 年 12 月 31 日
第一层次	8,342,666.00
第二层次	516,426.01
第三层次	-
合计	8,859,092.01

###### 7.1.4.14.2.2 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。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，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投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

###### 7.1.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

###### 7.1.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

#### 7.1.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大承诺事项。

##### 7.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

##### 7.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2023 年 3 月 29 日经本基金的基金管理人批准。

### 7.2 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

#### 7.2.1 资产负债表

会计主体：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

报告截止日：2022 年 10 月 9 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 10 月 9 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	7.4.7.1	7,825,288.82	817,131.33
结算备付金		-	-
存出保证金		2,000.16	-
交易性金融资产	7.4.7.2	1,168,949.93	10,086,945.00
其中：股票投资		1,067,977.00	-
基金投资		-	9,587,700.00
债券投资		100,972.93	499,245.00
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	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	5,158.18



资产总计		8,996,238.91	10,909,234.51
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 10 月 9 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
负 债:		-	-
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		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		2,808.43	510.93
应付托管费		312.06	56.78
应付销售服务费		49.80	37.75
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	7.4.7.6	24,221.67	4,919.48
<b>负债合计</b>		<b>27,391.96</b>	<b>5,524.94</b>
<b>净资产:</b>		-	-
实收基金	7.4.7.7	10,630,339.65	10,967,932.20
未分配利润	7.4.7.8	-1,661,492.70	-64,222.63
<b>净资产合计</b>		<b>8,968,846.95</b>	<b>10,903,709.57</b>
<b>负债和净资产总计</b>		<b>8,996,238.91</b>	<b>10,909,234.51</b>

注：1.报告截止日 2022 年 10 月 9 日，基金份额总额 10,630,339.65 份，其中 A 类基金份额净值 0.8437 元，份额总额 10,492,397.72 份；C 类基金份额净值 0.8409 元，份额总额 137,941.93 份。

2.以下比较数据已根据本年《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>》中的资产负债表格式的要求进行列示：上年度末资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，上年度末资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

3.自 2022 年 10 月 10 日起，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基金合同》失效，《中银中证 800 指数型发起式证券投资基金基金合同》生效。

## 7.2.2 利润表

会计主体：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

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 10 月 9 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 10 月 9 日	上年度可比期间 2021 年 12 月 7 日至 2021 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		<b>-1,521,849.52</b>	<b>-37,731.91</b>
1.利息收入		3,357.87	1,284.38
其中：存款利息收入	7.4.7.9	3,357.87	491.95
债券利息收入		-	792.43
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）		-1,516,767.61	8,541.23
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-1,132.77	8,541.23
基金投资收益	7.4.7.11	-1,523,215.36	-
债券投资收益	7.4.7.12	7,580.52	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-8,950.95	-47,557.55
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	511.17	0.03
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>31,627.94</b>	<b>26,490.72</b>
1. 管理人报酬	7.4.10.2	5,821.23	510.93
2. 托管费	7.4.10.2	646.72	56.78
3. 销售服务费		1,333.91	37.75
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. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	7.4.7.18	23,826.08	25,885.26
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-1,553,477.46</b>	<b>-64,222.63</b>

减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-1,553,477.46</b>	<b>-64,222.63</b>
五、其他综合收益的税后净额		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-1,553,477.46</b>	<b>-64,222.63</b>

注：以下比较数据已根据本年《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>》中的利润表格式的要求进行列示：上年度可比期间利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本期利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

### 7.2.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：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

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 10 月 9 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 10 月 9 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	10,967,932.20	-64,222.63	10,903,709.57
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	10,967,932.20	-64,222.63	10,903,709.57
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-337,592.55	-1,597,270.07	-1,934,862.62
（一）、综合收益总额	-	-1,553,477.46	-1,553,477.46
（二）、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）	-337,592.55	-43,792.61	-381,385.16
其中：1.基金申购款	10,243,725.76	-1,209,530.30	9,034,195.46
2.基金赎回款	-10,581,318.31	1,165,737.69	-9,415,580.62
（三）、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）	-	-	-
四、本期期末净资产	10,630,339.65	-1,661,492.70	8,968,846.95

产（基金净值）			
项目	上年度可比期间 2021 年 12 月 7 日至 2021 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	10,967,932.20	-	10,967,932.20
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-	-64,222.63	-64,222.63
（一）、综合收益总额	-	-64,222.63	-64,222.63
（二）、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）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
（三）、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）	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	10,967,932.20	-64,222.63	10,903,709.57

注：本基金于 2022 年 10 月 10 日转型为中银中证 800 指数型发起式证券投资基金。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码（序号）从 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：张家文，主管会计工作负责人：陈宇，会计机构负责人：乐妮

## 7.2.4 报表附注

### 7.2.4.1 基金基本情况

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(以下简称“本基金”),系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[2021]3445 号文《关于准予中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金注册的批复》准予注册,由基金管理人中银基金管理有限公司向社会公开发行募集,基金合同于 2021 年 12 月 7 日正式生效,首次设立募集规模为

10,967,887.69 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构均为中银基金管理有限公司，基金托管人为中信银行股份有限公司。

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目标 ETF 于 2022 年 7 月 21 日触发基金合同终止条款，根据《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》的约定，如目标 ETF 终止上市或目标 ETF 基金合同终止，本基金可在履行适当程序后由投资于目标 ETF 的联接基金变更为直接投资该标的指数的指数基金，无需召开基金份额持有人大会。中银基金管理有限公司（以下简称“本公司”）根据《基金合同》的约定，经与基金托管人中信银行协商一致，并报中国证券监督管理委员会备案，将本基金转型为“中银中证 800 指数型发起式证券投资基金”，并相应修改基金合同等法律文件。

本基金主要投资于目标 ETF、标的指数成份股、备选成份股。本基金可少量投资于其他股票(包括创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票)、股指期货、股票期权、债券(包括国债、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(含分离交易可转债的纯债部分)、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、同业存单、现金，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)。本基金将根据法律法规的规定参与转融通证券出借及融资业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金业绩比较基准为：中证 800 指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%。

本财务报表由本基金的基金管理人中银基金管理有限公司于 2023 年 3 月 30 日批准。

#### 7.2.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 7.2.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 2022 年 10 月 9 日（基金合同失效前日）的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日起至 2022 年 10 月 9 日（基金合同失效前日）止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 7.2.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.2.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系 2022 年 1 月 1 日起至 2022 年 10 月 9 日（基金合同失效前日）止。

##### 7.2.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

##### 7.2.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

###### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

###### (2) 金融负债分类

本基金的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、以摊余成本计量的金融负债。

##### 7.2.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为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，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产

生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金

融负债进行终止确认。

#### 7.2.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

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和金融负债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，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，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) 不存在活跃市场的金融工具，应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。采用估值技术确定公允价值时，应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，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；



(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.2.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.2.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。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确认。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。

#### 7.2.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益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利得/（损失）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确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### 7.2.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或预期收益率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关

税费后的净额入账;

(4) 处置衍生工具的投资收益于交易日确认,并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账,同时转出已确认的公允价值变动收益;

(5) 买入返售金融资产收入,按实际利率法确认利息收入,在回购期内逐日计提;

(6) 公允价值变动收益系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、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失;

(7) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致本基金资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时予以确认。

#### 7.2.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则,在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

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。

#### 7.2.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下,本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配,具体分配方案以公告为准,若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配;

(2) 本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资人可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资;若投资人不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;

(3) 基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值;即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值;

(4) 本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权;

(5) 法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

#### 7.2.4.4.12 分部报告

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) 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) 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。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 7.2.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

#### 7.2.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.2.4.5.1 会计政策变更的说明

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(统称“新金融工具准则”)、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法规的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理。此外，本基金亦已执行财政部于 2022 年发布的《关于印发<资产管理产品相关会计处理规定>的通知》(财会[2022]14 号)。新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。根据新金融工具准则的衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与原准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。于首次执行日(2022 年 1 月 1 日)，原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：以摊余成本计量的金融资产：银行存款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 817,131.33 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 79.40 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 817,210.73 元。应收利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 5,158.18 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 79.40 元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币 5,078.78 元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。以公允价值计

量且其变动计入当期损益的金融资产：交易性金融资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 10,086,945.00 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 5,078.78 元。经上述重分类后，交易性金融资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 10,092,023.78 元。除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产和金融负债项目无影响。于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

#### 7.2.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 7.2.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 7.2.4.6 税项

##### 7.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

##### 7.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得

的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金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。对证券投资基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

#### 7.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

#### 7.4.6.4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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，股权的股息、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。

#### 7.4.6.5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25% 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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

#### 7.2.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.2.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 10 月 9 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
活期存款	7,825,288.82	817,131.33
等于：本金	7,823,919.56	817,131.33
加：应计利息	1,369.26	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
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	-	-
合计	7,825,288.82	817,131.33

#### 7.2.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2022 年 10 月 9 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		1,124,583.00	-	1,067,977.00	-56,606.00
贵金属投资-金交所 黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	99,982.50	892.93	100,972.93	97.50
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	99,982.50	892.93	100,972.93	97.50
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,224,565.50	892.93	1,168,949.93	-56,508.50
项目		上年度末 2021 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		-	-	-	-
贵金属投资-金交所黄 金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	499,195.20	-	499,245.00	49.80
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	499,195.20	-	499,245.00	49.80
资产支持证券		-	-	-	-
基金		9,635,307.35	-	9,587,700.00	-47,607.35
其他		-	-	-	-
合计		10,134,502.55	-	10,086,945.00	-47,557.55

#### 7.2.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.2.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.2.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.2.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

#### 7.2.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.2.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 10 月 9 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应收利息	-	5,158.18
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	5,158.18

#### 7.2.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 10 月 9 日	上年度末 2021 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	1,044.09	4,919.48
其中：交易所市场	1,044.09	4,919.48
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
应付审计费	23,177.58	-
合计	24,221.67	4,919.48

#### 7.2.4.7.7 实收基金

中银中证 800ETF 发起式联接 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年10月9日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	10,824,163.95	10,824,163.95
本期申购	139,458.96	139,458.96



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  
年度报告

本期赎回（以“-”号填列）	-471,225.19	-471,225.19
本期末	10,492,397.72	10,492,397.72

中银中证 800ETF 发起式联接 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年10月9日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	143,768.25	143,768.25
本期申购	10,104,266.80	10,104,266.80
本期赎回（以“-”号填列）	-10,110,093.12	-10,110,093.12
本期末	137,941.93	137,941.93

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.2.4.7.8 未分配利润

中银中证 800ETF 发起式联接 A

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	-16,409.51	-46,934.22	-63,343.73
本期利润	-1,479,837.30	-143,347.15	-1,623,184.45
本期基金份额交易产生的 变动数	2,154.85	44,824.89	46,979.74
其中：基金申购款	-451.35	-24,485.14	-24,936.49
基金赎回款	2,606.20	69,310.03	71,916.23
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,494,091.96	-145,456.48	-1,639,548.44

中银中证 800ETF 发起式联接 C

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	-255.57	-623.33	-878.90

本期利润	-64,689.21	134,396.20	69,706.99
本期基金份额交易产生的变动数	44,951.33	-135,723.68	-90,772.35
其中：基金申购款	-72,254.45	-1,112,339.36	-1,184,593.81
基金赎回款	117,205.78	976,615.68	1,093,821.46
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-19,993.45	-1,950.81	-21,944.26

#### 7.2.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 10 月 9 日	2021 年 12 月 7 日至 2021 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	3,170.20	491.95
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	157.33	-
其他	30.34	-
合计	3,357.87	491.95

#### 7.2.4.7.10 股票投资收益

##### 7.2.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 10 月 9 日	2021 年 12 月 7 日至 2021 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-1,132.77	-
股票投资收益——赎回差价收入	-	-
股票投资收益——申购差价收入	-	8,541.23
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	-1,132.77	8,541.23

##### 7.2.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 10 月 9 日	2021 年 12 月 7 日至 2021 年 12 月 31 日

	月 9 日	12 月 31 日
卖出股票成交总额	-	-
减：卖出股票成本总额	-	-
减：交易费用	1,132.77	-
买卖股票差价收入	-1,132.77	-

#### 7.2.4.7.10.3 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 10 月 9 日	上年度可比期间 2021 年 12 月 7 日至 2021 年 12 月 31 日
申购基金份额总额	-	9,636,300.00
减：现金支付申购款总额	-	4,345,529.83
减：申购股票成本总额	-	5,282,228.94
减：交易费用	-	-
申购差价收入	-	8,541.23

#### 7.2.4.7.11 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 10 月 9 日	上年度可比期间 2021 年 12 月 7 日至 2021 年 12 月 31 日
卖出/赎回基金成交总额	11,904,456.71	-
减：卖出/赎回基金成本总额	13,427,373.55	-
减：买卖基金差价收入应缴纳增值 税额	-	-
减：交易费用	298.52	-
基金投资收益	-1,523,215.36	-

#### 7.2.4.7.12 债券投资收益

##### 7.2.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 10 月 9 日	上年度可比期间 2021 年 12 月 7 日至 2021 年 12 月 31 日
债券投资收益——利息收入	8,516.42	-
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券 到期兑付）差价收入	-935.90	-

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	7,580.52	-

#### 7.2.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年10月 9日	上年度可比期间 2021年12月7日至2021年12 月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	611,566.13	-
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	599,177.70	-
减：应计利息总额	13,324.13	-
减：交易费用	0.20	-
买卖债券差价收入	-935.90	-

#### 7.2.4.7.13 资产支持证券投资收益

##### 7.2.4.7.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

#### 7.2.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

#### 7.2.4.7.15 股利收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无股利收益。

#### 7.2.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年10月9日	上年度可比期间 2021年12月7日至2021年12月31 日
1.交易性金融资产	-8,950.95	-47,557.55
——股票投资	-56,606.00	-
——债券投资	47.70	49.80
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	47,607.35	-47,607.35
——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	-8,950.95	-47,557.55

#### 7.2.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年10月9日	上年度可比期间 2021年12月7日至2021年12月31日
基金赎回费收入	295.40	-
基金转换费收入	215.77	-
其他	-	0.03
合计	511.17	0.03

#### 7.2.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年10月9日	上年度可比期间 2021年12月7日至2021年12月31日
审计费用	23,177.58	-
信息披露费	-	20,000.00
证券出借违约金	-	-
其他	-	400.00
银行汇划费	648.50	-
交易费用	-	5,485.26
合计	23,826.08	25,885.26

#### 7.2.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.2.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

##### 7.2.4.8.2 资产负债表日后事项

2022 年 7 月 21 日目标 ETF 触发基金合同终止条款，根据《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》约定，如目标 ETF 终止上市或目标 ETF 基金合同终止，本基

金可在履行适当程序后由投资于目标 ETF 的联接基金变更为直接投资该标的指数的指数基金，无需召开基金份额持有人大会。自 2022 年 10 月 10 日，《中银中证 800 指数型发起式证券投资基金基金合同》生效，《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》同日起失效。中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金正式转型为中银中证 800 指数型发起式证券投资基金，基金合同当事人将按照《中银中证 800 指数型发起式证券投资基金基金合同》享有权利并承担义务。

除上述的披露事项外，截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 7.2.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中银基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中信银行股份有限公司(“中信银行”)	基金托管人
贝莱德投资管理(英国)有限公司	基金管理人的股东
中国银行股份有限公司	基金管理人的控股股东
中银国际证券股份有限公司	受中国银行重大影响
中银资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司
中银(新加坡)资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.2.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.2.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

##### 7.2.4.10.2 关联方报酬

###### 7.2.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年10 月9日	上年度可比期间 2021年12月7日至2021年12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	5,821.23	510.93
其中：支付销售机构的客户维护费	1,120.51	81.69

注：支付基金管理人中银基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.45% 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：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.45% / 当年天数。

#### 7.2.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年10 月9日	上年度可比期间 2021年12月7日至2021年12 月31日
当期发生的基金应支付的托管费	646.72	56.78

注：支付基金托管人中信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：

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

#### 7.2.4.10.2.3 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 2022年1月1日至2022年10月9日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中银中证 800ETF 发起式联接 A	中银中证 800ETF 发起式联接 C	合计
中银基金管理有限公司	-	33.74	33.74
合计	-	33.74	33.74
获得销售服务费的各 关联方名称	上年度可比期间 2021年12月7日至2021年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中银中证800ETF发起式联接A	中银中证800ETF发起式联接C	合计
合计	-	2.83	2.83

注：A 类基金份额不收取销售服务费。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 0.40%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给中银基金管理有限公司，再由中银基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类的基金资产净值} \times 0.40\% / \text{当年天数}。$$

#### 7.2.4.10.3与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 7.2.4.10.4 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

##### 7.2.4.10.4.1 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

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。

#### 7.2.4.10.4.2 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

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。

#### 7.2.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

项目	本期 2022年1月1日至2022年10月9日		上年度可比期间 2021年12月7日至2021年12月31日	
	中银中证800ETF发 起式联接A	中银中证800ETF发起 式联接C	中银中证800ETF发 起式联接A	中银中证800ETF 发起式联接C
基金合同生效 日（2021年 12月7日）持 有的基金份额	-	-	10,000,000.00	-
期初持有的基 金份额	10,000,000.00	-	-	-
期间申购/买入 总份额	-	-	-	-
期间因拆分变 动份额	-	-	-	-
减：期间赎回/ 卖出总份额	-	-	-	-
期末持有的基 金份额	10,000,000.00	-	10,000,000.00	-
期末持有的基 金份额占基金 总份额比例	95.31%	-	92.39%	-

注：（1）期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额。期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

（2）本基金管理人运用固有资金投资本基金所采用的费率适用招募说明书以及管理人发布的最新公告规定的费率结构。



#### 7.2.4.10.5.2 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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

#### 7.2.4.10.6 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 2022年1月1日至2022年10月9日		上年度可比期间 2021年12月7日至2021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
中信银行股份有限公司	7,825,288.82	3,170.20	817,131.33	491.95

注：本基金的银行存款由基金托管人中信银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.2.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间均未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 7.2.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 7.2.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

于本报告期末，本基金持有 500 股中银证券的 A 股普通股，成本总额为人民币 5,655.00 元，估值总额为人民币 5,245.00 元，占基金资产净值的比例为 0.06%。于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有 9,000,000.00 份目标 ETF 基金份额，占其份额的比例为 20.06%。

#### 7.2.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 7.2.4.12 期末（2022年10月9日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.2.4.12.1 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 7.2.4.12.2 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.2.4.12.2.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 10 月 9 日止，本基金未持有银行间市场债券正回购交易中作为质押的债券。

###### 7.2.4.12.2.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 10 月 9 日止，本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为质押的

债券。

#### 7.2.4.12.3 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 7.2.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.2.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中面临的相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了包括风险管理委员会、风险管理与内部控制委员会、督察长、风险管理部、内控与法律合规部、审计部和相关业务部门构成的多级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理与内部控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。

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。

##### 7.2.4.13.2 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。本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，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。

##### 7.2.4.13.2.1 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022年10月9日	上年末 2021年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	-	499,245.00
合计	-	499,245.00

注：评级取自第三方评级机构。

### 7.2.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指在履行以交付现金或其他金融资产的方式结算的义务时发生资金短缺的风险。对于本基金而言，体现在所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可在基金每个开放日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。

#### 7.2.4.13.3.1 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》等有关法规的要求建立健全流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。同时，对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。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。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。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，因此除附注“期末本基金持有的流通受限证券”列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。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。

于本报告期末，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(净资产)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。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 7.2.4.13.4 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。

##### 7.2.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。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。

##### 7.2.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 10 月 9 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	7,825,288.82	-	-	-	7,825,288.82
存出保证金	2,000.16	-	-	-	2,000.16
交易性金融资产	100,972.93	-	-	1,067,977.00	1,168,949.93
资产总计	7,928,261.91	-	-	1,067,977.00	8,996,238.91
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	2,808.43	2,808.43
应付托管费	-	-	-	312.06	312.06
应付销售服务费	-	-	-	49.80	49.80
其他负债	-	-	-	24,221.67	24,221.67
负债总计	-	-	-	27,391.96	27,391.96
利率敏感度缺口	7,928,261.91	-	-	1,040,585.04	8,968,846.95
上年度末 2021 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	817,131.33	-	-	-	817,131.33
交易性金融资产	499,245.00	-	-	9,587,700.00	10,086,945.00
应收利息	-	-	-	5,158.18	5,158.18
资产总计	1,316,376.33	-	-	9,592,858.18	10,909,234.51
负债					

应付管理人报酬	-	-	-	510.93	510.93
应付托管费	-	-	-	56.78	56.78
应付销售服务费	-	-	-	37.75	37.75
其他负债	-	-	-	4,919.48	4,919.48
负债总计	-	-	-	5,524.94	5,524.94
利率敏感度缺口	1,316,376.33	-	-	9,587,333.24	10,903,709.57

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.2.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本报告期末，本基金持有的固定收益品种投资公允价值占基金净资产的比例低于 10%，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响（上年度末同）。

#### 7.2.4.13.4.2 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。

#### 7.2.4.13.4.3 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证券，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。

#### 7.2.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 10 月 9 日		上年度末 2021 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	1,067,977.00	11.91	-	-
交易性金融资产—基金投资	-	-	9,587,700.00	87.93
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
合计	1,067,977.00	11.91	9,587,700.00	87.93

#### 7.2.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1.本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险,即从长期来看,本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关,且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变;2.以下分析,除市场基准发生变动,其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
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:人民币万元)	
		本期末 2022年10月9日	上年度末 2021年12月31日
	1. 业绩比较基准上升 5%	增加约 37	-
2. 业绩比较基准下降 5%	减少约 37	-	

#### 7.2.4.14 公允价值

##### 7.2.4.14.1 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。

##### 7.2.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.2.4.14.2.1 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 2022年10月9日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	1,067,977.00	9,587,700.00
第二层次	100,972.93	499,245.00
第三层次	-	-
合计	1,168,949.93	10,086,945.00

###### 7.2.4.14.2.2 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。对于公开市场交易的股票、债券等投资,若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况,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投资的公允价值列入第一层次,并根据估值调整中采用的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,确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

#### 7.2.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 7.2.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

#### 7.2.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大承诺事项。

##### 7.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

##### 7.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2023 年 3 月 29 日经本基金的基金管理人批准。

## §8 投资组合报告

### 8.1 中银中证 800 指数型发起式证券投资基金

#### 8.1.1 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	8,352,635.00	89.77
	其中：普通股	-	-
2	基金投资	-	-
3	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	-	-
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	438,882.25	4.72

	计		
8	其他各项资产	6,850.31	0.07
9	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。

## 8.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.1.2.1 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
--	----	--------------	-------

### 8.1.2.2 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

### 8.1.2.3 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。

### 8.1.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 8.1.3.1 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	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
11	300059	东方财富	3,600	69,840.00	0.75
12	000568	泸州老窖	300	67,284.00	0.73
13	600030	中信证券	3,300	65,703.00	0.71
14	600887	伊利股份	2,100	65,100.00	0.70
15	601888	中国中免	300	64,809.00	0.70
16	300760	迈瑞医疗	200	63,194.00	0.68
17	600276	恒瑞医药	1,500	57,795.00	0.62
18	600809	山西汾酒	200	56,998.00	0.62
19	603259	药明康德	700	56,700.00	0.61
20	600309	万华化学	600	55,590.00	0.60
21	002415	海康威视	1,600	55,488.00	0.60
22	002475	立讯精密	1,700	53,975.00	0.58
23	688111	金山办公	200	52,898.00	0.57
24	000651	格力电器	1,600	51,712.00	0.56
25	601398	工商银行	11,900	51,646.00	0.56
26	601899	紫金矿业	4,900	49,000.00	0.53
27	002352	顺丰控股	800	46,208.00	0.50
28	300274	阳光电源	400	44,720.00	0.48
29	601328	交通银行	9,300	44,082.00	0.48
30	002714	牧原股份	900	43,875.00	0.47
31	000001	平安银行	3,300	43,428.00	0.47
32	000725	京东方 A	12,800	43,264.00	0.47
33	002142	宁波银行	1,300	42,185.00	0.46
34	000002	万科 A	2,300	41,860.00	0.45
35	300124	汇川技术	600	41,700.00	0.45
36	000792	盐湖股份	1,800	40,842.00	0.44

37	601816	京沪高铁	8,100	39,852.00	0.43
38	603288	海天味业	500	39,800.00	0.43
39	601668	中国建筑	7,100	38,553.00	0.42
40	300015	爱尔眼科	1,200	37,284.00	0.40
41	600048	保利发展	2,400	36,312.00	0.39
42	300014	亿纬锂能	400	35,160.00	0.38
43	600438	通威股份	900	34,722.00	0.37
44	300498	温氏股份	1,700	33,371.00	0.36
45	002304	洋河股份	200	32,100.00	0.35
46	600690	海尔智家	1,300	31,798.00	0.34
47	601288	农业银行	10,900	31,719.00	0.34
48	600031	三一重工	2,000	31,600.00	0.34
49	002466	天齐锂业	400	31,596.00	0.34
50	601088	中国神华	1,100	30,382.00	0.33
51	002129	中环股份	800	30,128.00	0.33
52	600837	海通证券	3,400	29,546.00	0.32
53	601601	中国太保	1,200	29,424.00	0.32
54	600016	民生银行	8,500	29,325.00	0.32
55	600919	江苏银行	4,000	29,160.00	0.31
56	600000	浦发银行	4,000	29,120.00	0.31
57	600436	片仔癀	100	28,846.00	0.31
58	000063	中兴通讯	1,100	28,446.00	0.31
59	600050	中国联通	6,300	28,224.00	0.30
60	002460	赣锋锂业	400	27,804.00	0.30
61	600406	国电南瑞	1,100	26,840.00	0.29
62	000596	古井贡酒	100	26,690.00	0.29
63	002049	紫光国微	200	26,364.00	0.28
64	300122	智飞生物	300	26,349.00	0.28
65	002812	恩捷股份	200	26,258.00	0.28
66	600089	特变电工	1,300	26,104.00	0.28
67	688599	天合光能	400	25,504.00	0.28
68	601688	华泰证券	2,000	25,480.00	0.28
69	688981	中芯国际	600	24,684.00	0.27
70	601225	陕西煤业	1,300	24,154.00	0.26
71	002027	分众传媒	3,600	24,048.00	0.26
72	002271	东方雨虹	700	23,499.00	0.25
73	600104	上汽集团	1,600	23,056.00	0.25
74	601919	中远海控	2,200	22,638.00	0.24
75	002371	北方华创	100	22,530.00	0.24
76	601988	中国银行	7,100	22,436.00	0.24
77	601628	中国人寿	600	22,272.00	0.24
78	603799	华友钴业	400	22,252.00	0.24
79	002709	天赐材料	500	21,930.00	0.24
80	600585	海螺水泥	800	21,904.00	0.24

81	601169	北京银行	5,000	21,550.00	0.23
82	601728	中国电信	5,100	21,369.00	0.23
83	600893	航发动力	500	21,140.00	0.23
84	300347	泰格医药	200	20,960.00	0.23
85	601766	中国中车	4,100	20,951.00	0.23
86	000625	长安汽车	1,700	20,927.00	0.23
87	603986	兆易创新	200	20,494.00	0.22
88	601211	国泰君安	1,500	20,385.00	0.22
89	600570	恒生电子	500	20,230.00	0.22
90	300142	沃森生物	500	20,095.00	0.22
91	601229	上海银行	3,400	20,094.00	0.22
92	601390	中国中铁	3,600	20,016.00	0.22
93	601985	中国核电	3,300	19,800.00	0.21
94	002230	科大讯飞	600	19,698.00	0.21
95	600028	中国石化	4,500	19,620.00	0.21
96	688012	中微公司	200	19,602.00	0.21
97	601669	中国电建	2,700	19,116.00	0.21
98	688122	西部超导	200	18,938.00	0.20
99	601009	南京银行	1,800	18,756.00	0.20
100	000100	TCL 科技	5,000	18,600.00	0.20
101	002311	海大集团	300	18,519.00	0.20
102	000338	潍柴动力	1,800	18,324.00	0.20
103	688777	中控技术	200	18,166.00	0.20
104	002459	晶澳科技	300	18,027.00	0.19
105	601658	邮储银行	3,900	18,018.00	0.19
106	300763	锦浪科技	100	18,005.00	0.19
107	002410	广联达	300	17,985.00	0.19
108	600760	中航沈飞	300	17,589.00	0.19
109	600660	福耀玻璃	500	17,535.00	0.19
109	600111	北方稀土	700	17,535.00	0.19
111	002179	中航光电	300	17,328.00	0.19
112	600009	上海机场	300	17,313.00	0.19
113	600999	招商证券	1,300	17,290.00	0.19
114	300661	圣邦股份	100	17,260.00	0.19
115	601818	光大银行	5,600	17,192.00	0.19
116	600958	东方证券	1,900	16,986.00	0.18
117	600905	三峡能源	3,000	16,950.00	0.18
118	601857	中国石油	3,400	16,898.00	0.18
119	600019	宝钢股份	3,000	16,770.00	0.18
120	000661	长春高新	100	16,645.00	0.18
121	600426	华鲁恒升	500	16,575.00	0.18
122	603345	安井食品	100	16,188.00	0.17
123	300450	先导智能	400	16,100.00	0.17
124	600745	闻泰科技	300	15,774.00	0.17

125	002180	纳思达	300	15,567.00	0.17
126	000895	双汇发展	600	15,558.00	0.17
127	000776	广发证券	1,000	15,490.00	0.17
128	603501	韦尔股份	200	15,418.00	0.17
129	600763	通策医疗	100	15,299.00	0.17
130	002821	凯莱英	100	14,800.00	0.16
131	600010	包钢股份	7,700	14,784.00	0.16
132	600588	用友网络	600	14,502.00	0.16
133	601377	兴业证券	2,500	14,350.00	0.15
134	688099	晶晨股份	200	14,102.00	0.15
135	600196	复星医药	400	14,096.00	0.15
136	000963	华东医药	300	14,040.00	0.15
137	601006	大秦铁路	2,100	14,028.00	0.15
138	001979	招商蛇口	1,100	13,893.00	0.15
139	300759	康龙化成	200	13,600.00	0.15
140	600941	中国移动	200	13,534.00	0.15
141	002241	歌尔股份	800	13,464.00	0.15
142	300012	华测检测	600	13,380.00	0.14
143	600150	中国船舶	600	13,368.00	0.14
144	603806	福斯特	200	13,288.00	0.14
145	601989	中国重工	3,800	13,262.00	0.14
146	603688	石英股份	100	13,132.00	0.14
147	600926	杭州银行	1,000	13,080.00	0.14
148	601939	建设银行	2,300	12,949.00	0.14
149	600029	南方航空	1,700	12,920.00	0.14
150	601138	工业富联	1,400	12,852.00	0.14
151	600132	重庆啤酒	100	12,738.00	0.14
152	000166	申万宏源	3,200	12,736.00	0.14
153	002050	三花智控	600	12,732.00	0.14
154	000768	中航西飞	500	12,725.00	0.14
155	300316	晶盛机电	200	12,712.00	0.14
156	603392	万泰生物	100	12,670.00	0.14
157	002340	格林美	1,700	12,631.00	0.14
158	601615	明阳智能	500	12,630.00	0.14
158	601100	恒立液压	200	12,630.00	0.14
160	688008	澜起科技	200	12,520.00	0.14
161	600795	国电电力	2,900	12,383.00	0.13
162	002384	东山精密	500	12,365.00	0.13
163	002493	荣盛石化	1,000	12,300.00	0.13
164	300408	三环集团	400	12,284.00	0.13
165	688065	凯赛生物	200	12,258.00	0.13
166	600011	华能国际	1,600	12,176.00	0.13
167	603833	欧派家居	100	12,153.00	0.13
168	600157	永泰能源	7,900	12,087.00	0.13

169	601600	中国铝业	2,700	12,069.00	0.13
170	601633	长城汽车	400	11,848.00	0.13
171	601689	拓普集团	200	11,716.00	0.13
172	601186	中国铁建	1,500	11,595.00	0.13
173	002074	国轩高科	400	11,532.00	0.12
174	600584	长电科技	500	11,525.00	0.12
175	600547	山东黄金	600	11,496.00	0.12
176	300782	卓胜微	100	11,430.00	0.12
177	000733	振华科技	100	11,423.00	0.12
178	300724	捷佳伟创	100	11,402.00	0.12
179	603737	三棵树	100	11,383.00	0.12
180	603993	洛阳钼业	2,500	11,375.00	0.12
181	003816	中国广核	4,200	11,298.00	0.12
182	300454	深信服	100	11,255.00	0.12
183	002001	新 和 成	600	11,250.00	0.12
184	601877	正泰电器	400	11,080.00	0.12
185	600176	中国巨石	800	10,968.00	0.12
186	600015	华夏银行	2,100	10,899.00	0.12
187	000009	中国宝安	900	10,881.00	0.12
188	000538	云南白药	200	10,872.00	0.12
189	600346	恒力石化	700	10,871.00	0.12
190	600886	国投电力	1,000	10,830.00	0.12
191	600600	青岛啤酒	100	10,750.00	0.12
192	601838	成都银行	700	10,710.00	0.12
193	601111	中国国航	1,000	10,600.00	0.11
194	603185	上机数控	100	10,585.00	0.11
195	002920	德赛西威	100	10,534.00	0.11
196	688396	华润微	200	10,530.00	0.11
197	601800	中国交建	1,300	10,465.00	0.11
198	601788	光大证券	700	10,409.00	0.11
199	600486	扬农化工	100	10,390.00	0.11
200	603659	璞泰来	200	10,378.00	0.11
201	000876	新希望	800	10,328.00	0.11
202	603369	今世缘	200	10,180.00	0.11
203	000425	徐工机械	2,000	10,140.00	0.11
204	600188	兖矿能源	300	10,074.00	0.11
205	600233	圆通速递	500	10,045.00	0.11
206	300496	中科创达	100	10,030.00	0.11
207	600885	宏发股份	300	10,023.00	0.11
208	002407	多氟多	300	9,996.00	0.11
209	600115	中国东航	1,800	9,954.00	0.11
210	002202	金风科技	900	9,900.00	0.11
211	300033	同花顺	100	9,861.00	0.11
212	600460	士兰微	300	9,837.00	0.11

213	002385	大北农	1,100	9,790.00	0.11
213	002192	融捷股份	100	9,790.00	0.11
215	000938	紫光股份	500	9,755.00	0.11
216	601868	中国能建	4,200	9,618.00	0.10
217	601901	方正证券	1,500	9,570.00	0.10
218	601117	中国化学	1,200	9,528.00	0.10
219	601066	中信建投	400	9,500.00	0.10
220	002601	龙佰集团	500	9,460.00	0.10
221	600765	中航重机	300	9,327.00	0.10
222	002497	雅化集团	400	9,300.00	0.10
223	000157	中联重科	1,700	9,248.00	0.10
224	002756	永兴材料	100	9,217.00	0.10
225	600383	金地集团	900	9,207.00	0.10
226	300003	乐普医疗	400	9,188.00	0.10
227	002007	华兰生物	400	9,052.00	0.10
228	002555	三七互娱	500	9,050.00	0.10
229	600298	安琪酵母	200	9,044.00	0.10
230	600487	亨通光电	600	9,036.00	0.10
231	600988	赤峰黄金	500	9,025.00	0.10
232	601336	新华保险	300	9,024.00	0.10
233	300413	芒果超媒	300	9,006.00	0.10
234	002603	以岭药业	300	8,988.00	0.10
235	600845	宝信软件	200	8,960.00	0.10
236	600085	同仁堂	200	8,936.00	0.10
237	600352	浙江龙盛	900	8,910.00	0.10
238	002252	上海莱士	1,400	8,876.00	0.10
239	603019	中科曙光	400	8,856.00	0.10
240	603613	国联股份	100	8,844.00	0.10
241	601238	广汽集团	800	8,824.00	0.10
242	300999	金龙鱼	200	8,712.00	0.09
243	600141	兴发集团	300	8,700.00	0.09
244	300037	新宙邦	200	8,694.00	0.09
245	002648	卫星化学	560	8,680.00	0.09
246	601233	桐昆股份	600	8,670.00	0.09
247	600741	华域汽车	500	8,665.00	0.09
248	603816	顾家家居	200	8,542.00	0.09
249	601555	东吴证券	1,300	8,489.00	0.09
250	603456	九洲药业	200	8,486.00	0.09
251	300207	欣旺达	400	8,460.00	0.09
252	600989	宝丰能源	700	8,449.00	0.09
253	600096	云天化	400	8,416.00	0.09
254	603260	合盛硅业	100	8,294.00	0.09
255	300285	国瓷材料	300	8,271.00	0.09
256	600489	中金黄金	1,000	8,190.00	0.09

257	600873	梅花生物	800	8,144.00	0.09
258	000723	美锦能源	900	8,118.00	0.09
259	601058	赛轮轮胎	800	8,016.00	0.09
260	002736	国信证券	900	7,992.00	0.09
261	002422	科伦药业	300	7,983.00	0.09
262	603596	伯特利	100	7,980.00	0.09
263	600418	江淮汽车	600	7,878.00	0.09
264	600219	南山铝业	2,400	7,848.00	0.08
265	000301	东方盛虹	600	7,824.00	0.08
266	603882	金城医学	100	7,820.00	0.08
267	000630	铜陵有色	2,500	7,800.00	0.08
268	000786	北新建材	300	7,764.00	0.08
269	600160	巨化股份	500	7,755.00	0.08
270	002008	大族激光	300	7,695.00	0.08
271	002028	思源电气	200	7,644.00	0.08
272	601995	中金公司	200	7,626.00	0.08
273	002568	百润股份	200	7,472.00	0.08
274	688002	睿创微纳	200	7,438.00	0.08
275	300433	蓝思科技	700	7,371.00	0.08
276	600674	川投能源	600	7,338.00	0.08
277	601618	中国中冶	2,300	7,314.00	0.08
278	300144	宋城演艺	500	7,300.00	0.08
279	603486	科沃斯	100	7,294.00	0.08
280	600884	杉杉股份	400	7,280.00	0.08
281	300699	光威复材	100	7,225.00	0.08
282	002916	深南电路	100	7,215.00	0.08
283	002120	韵达股份	500	7,190.00	0.08
284	600079	人福医药	300	7,167.00	0.08
285	600399	抚顺特钢	500	7,155.00	0.08
286	300595	欧普康视	200	7,140.00	0.08
287	601607	上海医药	400	7,132.00	0.08
288	601108	财通证券	1,000	7,120.00	0.08
289	600161	天坛生物	300	7,119.00	0.08
290	002299	圣农发展	300	7,107.00	0.08
291	601077	渝农商行	2,000	7,060.00	0.08
292	000683	远兴能源	900	7,056.00	0.08
293	688126	沪硅产业	400	7,044.00	0.08
293	300223	北京君正	100	7,044.00	0.08
295	600392	盛和资源	500	7,000.00	0.08
296	600362	江西铜业	400	6,972.00	0.08
297	601878	浙商证券	700	6,951.00	0.08
298	000783	长江证券	1,300	6,929.00	0.07
298	000069	华侨城 A	1,300	6,929.00	0.07
300	603893	瑞芯微	100	6,881.00	0.07



301	300146	汤臣倍健	300	6,846.00	0.07
302	600153	建发股份	500	6,825.00	0.07
303	002625	光启技术	400	6,808.00	0.07
304	601128	常熟银行	900	6,795.00	0.07
305	002236	大华股份	600	6,786.00	0.07
306	603606	东方电缆	100	6,783.00	0.07
307	601699	潞安环能	400	6,740.00	0.07
308	600862	中航高科	300	6,687.00	0.07
309	600039	四川路桥	600	6,672.00	0.07
309	000807	云铝股份	600	6,672.00	0.07
311	002738	中矿资源	100	6,666.00	0.07
312	601865	福莱特	200	6,662.00	0.07
313	002185	华天科技	800	6,632.00	0.07
314	002025	航天电器	100	6,625.00	0.07
315	000975	银泰黄金	600	6,624.00	0.07
316	000629	攀钢钒钛	1,400	6,622.00	0.07
317	000932	华菱钢铁	1,400	6,580.00	0.07
318	000831	五矿稀土	200	6,576.00	0.07
319	002294	信立泰	200	6,570.00	0.07
320	300919	中伟股份	100	6,561.00	0.07
321	600521	华海药业	300	6,558.00	0.07
322	601360	三六零	1,000	6,540.00	0.07
323	600027	华电国际	1,100	6,468.00	0.07
324	000977	浪潮信息	300	6,456.00	0.07
325	000998	隆平高科	400	6,428.00	0.07
326	601021	春秋航空	100	6,425.00	0.07
327	603077	和邦生物	2,100	6,384.00	0.07
327	603939	益丰药房	100	6,384.00	0.07
329	300568	星源材质	300	6,378.00	0.07
330	002223	鱼跃医疗	200	6,372.00	0.07
331	002624	完美世界	500	6,360.00	0.07
332	601696	中银证券	600	6,342.00	0.07
333	601162	天风证券	2,200	6,314.00	0.07
334	688208	道通科技	200	6,310.00	0.07
335	300601	康泰生物	200	6,306.00	0.07
336	300529	健帆生物	200	6,194.00	0.07
337	002797	第一创业	1,100	6,193.00	0.07
338	603658	安图生物	100	6,185.00	0.07
339	300253	卫宁健康	600	6,168.00	0.07
340	601155	新城控股	300	6,150.00	0.07
341	601872	招商轮船	1,100	6,149.00	0.07
342	601168	西部矿业	600	6,120.00	0.07
343	600482	中国动力	400	6,116.00	0.07
344	603517	绝味食品	100	6,109.00	0.07

345	002268	卫士通	200	6,106.00	0.07
346	689009	九号公司	200	6,098.00	0.07
347	600109	国金证券	700	6,090.00	0.07
348	600497	驰宏锌锗	1,200	6,072.00	0.07
349	300628	亿联网络	100	6,059.00	0.07
350	600026	中远海能	500	6,025.00	0.07
351	600332	白云山	200	5,958.00	0.06
352	300866	安克创新	100	5,927.00	0.06
353	002841	视源股份	100	5,904.00	0.06
353	600705	中航产融	1,800	5,904.00	0.06
355	002273	水晶光电	500	5,895.00	0.06
356	000519	中兵红箭	300	5,892.00	0.06
357	600018	上港集团	1,100	5,874.00	0.06
358	600549	厦门钨业	300	5,865.00	0.06
359	000591	太阳能	800	5,864.00	0.06
360	603127	昭衍新药	100	5,841.00	0.06
361	600536	中国软件	100	5,833.00	0.06
362	600143	金发科技	600	5,814.00	0.06
363	600918	中泰证券	900	5,769.00	0.06
364	603589	口子窖	100	5,767.00	0.06
365	600183	生益科技	400	5,764.00	0.06
366	002078	太阳纸业	500	5,760.00	0.06
367	600061	国投资本	900	5,751.00	0.06
368	601319	中国人保	1,100	5,742.00	0.06
369	002602	世纪华通	1,500	5,715.00	0.06
370	600348	华阳股份	400	5,700.00	0.06
371	600177	雅戈尔	900	5,697.00	0.06
371	000728	国元证券	900	5,697.00	0.06
373	601636	旗滨集团	500	5,695.00	0.06
374	600499	科达制造	400	5,684.00	0.06
375	600529	山东药玻	200	5,680.00	0.06
376	300073	当升科技	100	5,640.00	0.06
377	600859	王府井	200	5,628.00	0.06
378	002056	横店东磁	300	5,622.00	0.06
379	002739	万达电影	400	5,600.00	0.06
380	300390	天华超净	100	5,588.00	0.06
381	002353	杰瑞股份	200	5,582.00	0.06
382	002508	老板电器	200	5,552.00	0.06
383	601990	南京证券	700	5,551.00	0.06
384	300357	我武生物	100	5,510.00	0.06
385	603899	晨光股份	100	5,498.00	0.06
386	601997	贵阳银行	1,000	5,490.00	0.06
387	002938	鹏鼎控股	200	5,488.00	0.06
388	002673	西部证券	900	5,481.00	0.06

389	601998	中信银行	1,100	5,478.00	0.06
390	300474	景嘉微	100	5,457.00	0.06
391	600325	华发股份	600	5,436.00	0.06
392	300308	中际旭创	200	5,406.00	0.06
392	688567	孚能科技	200	5,406.00	0.06
394	002683	宏大爆破	200	5,392.00	0.06
395	000155	川能动力	300	5,352.00	0.06
396	300850	新强联	100	5,328.00	0.06
397	000729	燕京啤酒	500	5,310.00	0.06
398	300373	扬杰科技	100	5,260.00	0.06
399	002138	顺络电子	200	5,236.00	0.06
400	002092	中泰化学	700	5,222.00	0.06
401	002439	启明星辰	200	5,216.00	0.06
402	000408	藏格控股	200	5,194.00	0.06
403	601898	中煤能源	600	5,172.00	0.06
404	300676	华大基因	100	5,169.00	0.06
404	600056	中国医药	300	5,169.00	0.06
406	002507	涪陵榨菜	200	5,154.00	0.06
407	000708	中信特钢	300	5,148.00	0.06
408	000738	航发控制	200	5,128.00	0.06
409	002409	雅克科技	100	5,037.00	0.05
410	600739	辽宁成大	400	5,036.00	0.05
411	300244	迪安诊断	200	5,026.00	0.05
412	603160	汇顶科技	100	5,020.00	0.05
413	300832	新产业	100	5,014.00	0.05
414	002557	洽洽食品	100	5,000.00	0.05
415	600258	首旅酒店	200	4,960.00	0.05
416	000830	鲁西化工	400	4,956.00	0.05
417	601016	节能风电	1,300	4,953.00	0.05
417	300136	信维通信	300	4,953.00	0.05
419	002032	苏泊尔	100	4,946.00	0.05
420	002156	通富微电	300	4,944.00	0.05
421	300558	贝达药业	100	4,927.00	0.05
422	000988	华工科技	300	4,923.00	0.05
423	000703	恒逸石化	700	4,921.00	0.05
424	300861	美畅股份	100	4,916.00	0.05
425	600516	方大炭素	800	4,896.00	0.05
426	002465	海格通信	600	4,872.00	0.05
427	600803	新奥股份	300	4,830.00	0.05
428	600704	物产中大	1,000	4,810.00	0.05
429	600372	中航电子	300	4,791.00	0.05
430	300088	长信科技	800	4,776.00	0.05
431	600879	航天电子	700	4,760.00	0.05
432	601577	长沙银行	700	4,732.00	0.05

433	000878	云南铜业	400	4,700.00	0.05
434	000999	华润三九	100	4,681.00	0.05
435	002966	苏州银行	600	4,668.00	0.05
435	002030	达安基因	300	4,668.00	0.05
437	002250	联化科技	300	4,650.00	0.05
438	600038	中直股份	100	4,641.00	0.05
439	002531	天顺风能	300	4,539.00	0.05
440	002203	海亮股份	400	4,520.00	0.05
441	600380	健康元	400	4,516.00	0.05
442	002985	北摩高科	100	4,510.00	0.05
443	688088	虹软科技	200	4,502.00	0.05
444	000623	吉林敖东	300	4,497.00	0.05
445	300604	长川科技	100	4,458.00	0.05
446	603156	养元饮品	200	4,454.00	0.05
447	000636	风华高科	300	4,449.00	0.05
448	002414	高德红外	400	4,400.00	0.05
449	600642	申能股份	800	4,392.00	0.05
450	688289	圣湘生物	200	4,390.00	0.05
451	002326	永太科技	200	4,366.00	0.05
452	600546	山煤国际	300	4,347.00	0.05
453	600673	东阳光	500	4,345.00	0.05
454	000887	中鼎股份	300	4,341.00	0.05
455	601666	平煤股份	400	4,324.00	0.05
456	300418	昆仑万维	300	4,323.00	0.05
457	688009	中国通号	900	4,311.00	0.05
458	600118	中国卫星	200	4,310.00	0.05
459	000739	普洛药业	200	4,308.00	0.05
460	600378	昊华科技	100	4,291.00	0.05
461	002080	中材科技	200	4,286.00	0.05
462	002372	伟星新材	200	4,268.00	0.05
463	605358	立昂微	100	4,260.00	0.05
464	000960	锡业股份	300	4,230.00	0.05
465	000039	中集集团	600	4,224.00	0.05
466	600699	均胜电子	300	4,215.00	0.05
467	300677	英科医疗	200	4,206.00	0.05
468	603858	步长制药	200	4,202.00	0.05
469	600415	小商品城	800	4,192.00	0.05
470	600606	绿地控股	1,400	4,172.00	0.05
471	600271	航天信息	400	4,164.00	0.04
472	600170	上海建工	1,600	4,160.00	0.04
473	600909	华安证券	900	4,131.00	0.04
474	600369	西南证券	1,100	4,125.00	0.04
475	002511	中顺洁柔	300	4,122.00	0.04
476	601966	玲珑轮胎	200	4,096.00	0.04

477	000970	中科三环	300	4,092.00	0.04
478	002600	领益智造	900	4,086.00	0.04
479	300363	博腾股份	100	4,085.00	0.04
480	600060	海信视像	300	4,062.00	0.04
481	603218	日月股份	200	4,060.00	0.04
482	603883	老百姓	100	4,047.00	0.04
483	300058	蓝色光标	800	4,040.00	0.04
484	600259	广晟有色	100	4,020.00	0.04
485	300618	寒锐钴业	100	4,005.00	0.04
486	600021	上海电力	400	4,004.00	0.04
487	000750	国海证券	1,200	3,996.00	0.04
487	002212	天融信	400	3,996.00	0.04
489	000400	许继电气	200	3,994.00	0.04
490	601216	君正集团	1,000	3,990.00	0.04
490	600637	东方明珠	600	3,990.00	0.04
492	002152	广电运通	400	3,976.00	0.04
493	002065	东华软件	700	3,962.00	0.04
494	603233	大参林	100	3,960.00	0.04
494	600025	华能水电	600	3,960.00	0.04
496	002430	杭氧股份	100	3,936.00	0.04
497	600166	福田汽车	1,400	3,934.00	0.04
498	600998	九州通	300	3,912.00	0.04
499	300017	网宿科技	700	3,906.00	0.04
500	000997	新大陆	300	3,903.00	0.04
501	002155	湖南黄金	300	3,885.00	0.04
502	601198	东兴证券	500	3,860.00	0.04
503	002183	怡亚通	600	3,858.00	0.04
504	600985	淮北矿业	300	3,840.00	0.04
505	600863	内蒙华电	1,100	3,839.00	0.04
506	002396	星网锐捷	200	3,832.00	0.04
507	000027	深圳能源	600	3,816.00	0.04
508	600655	豫园股份	500	3,805.00	0.04
509	002444	巨星科技	200	3,796.00	0.04
510	002926	华西证券	500	3,765.00	0.04
511	002936	郑州银行	1,600	3,760.00	0.04
512	002958	青农商行	1,300	3,757.00	0.04
513	000547	航天发展	400	3,756.00	0.04
514	300009	安科生物	400	3,744.00	0.04
515	600580	卧龙电驱	300	3,738.00	0.04
516	601881	中国银河	400	3,716.00	0.04
517	002500	山西证券	700	3,710.00	0.04
518	603568	伟明环保	200	3,706.00	0.04
519	002128	电投能源	300	3,702.00	0.04
520	600820	隧道股份	700	3,689.00	0.04

521	600008	首创环保	1,300	3,679.00	0.04
522	002019	亿帆医药	300	3,675.00	0.04
523	600867	通化东宝	400	3,672.00	0.04
524	600827	百联股份	300	3,636.00	0.04
525	002572	索菲亚	200	3,632.00	0.04
526	603707	健友股份	200	3,608.00	0.04
527	300024	机器人	400	3,592.00	0.04
528	600848	上海临港	300	3,576.00	0.04
529	601992	金隅集团	1,400	3,556.00	0.04
529	600390	五矿资本	700	3,556.00	0.04
529	600208	新湖中宝	1,400	3,556.00	0.04
532	000581	威孚高科	200	3,546.00	0.04
533	002131	利欧股份	2,000	3,540.00	0.04
534	002244	滨江集团	400	3,532.00	0.04
535	002408	齐翔腾达	500	3,520.00	0.04
536	603712	七一二	100	3,492.00	0.04
536	002506	协鑫集成	1,200	3,492.00	0.04
538	600171	上海贝岭	200	3,486.00	0.04
539	600435	北方导航	300	3,480.00	0.04
540	601958	金铂股份	300	3,465.00	0.04
541	000050	深天马 A	400	3,464.00	0.04
541	300251	光线传媒	400	3,464.00	0.04
543	002195	二三四五	1,700	3,417.00	0.04
544	600970	中材国际	400	3,408.00	0.04
545	600895	张江高科	300	3,402.00	0.04
546	300296	利亚德	600	3,396.00	0.04
547	603000	人民网	200	3,374.00	0.04
548	300168	万达信息	400	3,372.00	0.04
549	601717	郑煤机	300	3,348.00	0.04
550	601808	中海油服	200	3,316.00	0.04
551	002939	长城证券	400	3,312.00	0.04
552	300070	碧水源	700	3,311.00	0.04
553	002831	裕同科技	100	3,307.00	0.04
554	601778	晶科科技	600	3,300.00	0.04
555	000060	中金岭南	800	3,280.00	0.04
556	603225	新凤鸣	300	3,264.00	0.04
556	300383	光环新网	400	3,264.00	0.04
558	300869	康泰医学	100	3,257.00	0.04
559	000513	丽珠集团	100	3,248.00	0.04
560	601231	环旭电子	200	3,246.00	0.04
561	603885	吉祥航空	200	3,236.00	0.03
562	600535	天士力	300	3,228.00	0.03
563	000021	深科技	300	3,207.00	0.03
564	300482	万孚生物	100	3,187.00	0.03

565	600315	上海家化	100	3,185.00	0.03
566	600398	海澜之家	600	3,180.00	0.03
567	601005	重庆钢铁	2,000	3,160.00	0.03
568	000089	深圳机场	400	3,144.00	0.03
569	300115	长盈精密	300	3,099.00	0.03
569	002468	申通快递	300	3,099.00	0.03
571	002532	天山铝业	400	3,088.00	0.03
572	603650	彤程新材	100	3,083.00	0.03
573	603866	桃李面包	200	3,080.00	0.03
574	002249	大洋电机	600	3,072.00	0.03
575	002221	东华能源	400	3,052.00	0.03
575	600528	中铁工业	400	3,052.00	0.03
577	300001	特锐德	200	3,042.00	0.03
578	002701	奥瑞金	600	3,030.00	0.03
579	000825	太钢不锈	700	3,024.00	0.03
580	600066	宇通客车	400	3,004.00	0.03
581	002153	石基信息	200	2,998.00	0.03
582	000987	越秀金控	500	2,995.00	0.03
583	600131	国网信通	200	2,992.00	0.03
584	600718	东软集团	300	2,985.00	0.03
585	002670	国盛金控	400	2,964.00	0.03
585	600801	华新水泥	200	2,964.00	0.03
587	603927	中科软	100	2,961.00	0.03
588	000709	河钢股份	1,300	2,938.00	0.03
589	601106	中国一重	1,000	2,930.00	0.03
590	600663	陆家嘴	300	2,922.00	0.03
591	600329	达仁堂	100	2,910.00	0.03
592	600839	四川长虹	1,100	2,904.00	0.03
592	600517	国网英大	600	2,904.00	0.03
592	601866	中远海发	1,200	2,904.00	0.03
595	002191	劲嘉股份	400	2,892.00	0.03
596	002127	南极电商	600	2,886.00	0.03
597	600782	新钢股份	700	2,863.00	0.03
597	000785	居然之家	700	2,863.00	0.03
599	600755	厦门国贸	400	2,856.00	0.03
600	603379	三美股份	100	2,846.00	0.03
601	002416	爱施德	300	2,844.00	0.03
602	300026	红日药业	500	2,840.00	0.03
603	600282	南钢股份	900	2,835.00	0.03
604	002368	太极股份	100	2,813.00	0.03
605	002429	兆驰股份	800	2,792.00	0.03
606	600511	国药股份	100	2,790.00	0.03
607	002048	宁波华翔	200	2,780.00	0.03
608	600737	中粮糖业	400	2,776.00	0.03

609	600871	石化油服	1,400	2,772.00	0.03
610	601179	中国西电	600	2,766.00	0.03
611	601880	辽港股份	1,700	2,754.00	0.03
612	600598	北大荒	200	2,752.00	0.03
613	603317	天味食品	100	2,748.00	0.03
614	601000	唐山港	1,000	2,740.00	0.03
615	002266	浙富控股	700	2,737.00	0.03
616	300376	易事特	400	2,732.00	0.03
617	600566	济川药业	100	2,722.00	0.03
618	002064	华峰化学	400	2,720.00	0.03
619	600201	生物股份	300	2,703.00	0.03
620	000012	南玻 A	400	2,684.00	0.03
621	300182	捷成股份	600	2,682.00	0.03
622	002373	千方科技	300	2,676.00	0.03
623	600959	江苏有线	900	2,673.00	0.03
624	000537	广宇发展	200	2,646.00	0.03
625	600064	南京高科	400	2,644.00	0.03
625	600409	三友化工	400	2,644.00	0.03
625	600500	中化国际	400	2,644.00	0.03
628	600728	佳都科技	500	2,640.00	0.03
629	600498	烽火通信	200	2,628.00	0.03
629	601118	海南橡胶	600	2,628.00	0.03
631	601718	际华集团	900	2,619.00	0.03
632	300072	三聚环保	600	2,616.00	0.03
633	600155	华创阳安	400	2,600.00	0.03
633	600582	天地科技	500	2,600.00	0.03
635	002002	鸿达兴业	800	2,592.00	0.03
636	600667	太极实业	500	2,580.00	0.03
636	002505	鹏都农牧	1,000	2,580.00	0.03
638	000778	新兴铸管	700	2,555.00	0.03
639	000937	冀中能源	400	2,544.00	0.03
640	600808	马钢股份	900	2,529.00	0.03
641	600297	广汇汽车	1,200	2,520.00	0.03
641	000883	湖北能源	600	2,520.00	0.03
643	600316	洪都航空	100	2,519.00	0.03
644	600022	山东钢铁	1,700	2,516.00	0.03
645	000930	中粮科技	300	2,508.00	0.03
646	601333	广深铁路	1,100	2,497.00	0.03
647	600567	山鹰国际	1,000	2,480.00	0.03
648	600967	内蒙一机	300	2,478.00	0.03
649	000401	冀东水泥	300	2,469.00	0.03
650	300630	普利制药	100	2,466.00	0.03
651	000598	兴蓉环境	500	2,445.00	0.03
652	002124	天邦股份	400	2,444.00	0.03



653	000559	万向钱潮	500	2,435.00	0.03
654	002745	木林森	300	2,433.00	0.03
655	688538	和辉光电	900	2,412.00	0.03
656	600507	方大特钢	400	2,408.00	0.03
657	002690	美亚光电	100	2,390.00	0.03
658	601928	凤凰传媒	300	2,376.00	0.03
659	600216	浙江医药	200	2,338.00	0.03
660	001965	招商公路	300	2,331.00	0.03
661	600195	中牧股份	200	2,324.00	0.03
662	000800	一汽解放	300	2,319.00	0.03
663	002595	豪迈科技	100	2,315.00	0.02
664	601598	中国外运	600	2,304.00	0.02
665	600764	中国海防	100	2,296.00	0.02
666	601187	厦门银行	400	2,292.00	0.02
666	000656	金科股份	1,200	2,292.00	0.02
668	601611	中国核建	300	2,280.00	0.02
669	600376	首开股份	400	2,276.00	0.02
670	601568	北元集团	400	2,268.00	0.02
670	003035	南网能源	400	2,268.00	0.02
670	600095	湘财股份	300	2,268.00	0.02
673	000959	首钢股份	600	2,262.00	0.02
674	601456	国联证券	200	2,250.00	0.02
675	000156	华数传媒	300	2,247.00	0.02
676	601991	大唐发电	800	2,232.00	0.02
677	002653	海思科	100	2,225.00	0.02
678	601236	红塔证券	300	2,220.00	0.02
679	300682	朗新科技	100	2,198.00	0.02
680	600901	江苏租赁	400	2,192.00	0.02
681	600597	光明乳业	200	2,152.00	0.02
682	002423	中粮资本	300	2,148.00	0.02
683	002010	传化智联	400	2,136.00	0.02
683	000898	鞍钢股份	800	2,136.00	0.02
685	000563	陕国投 A	700	2,121.00	0.02
686	000402	金融街	400	2,100.00	0.02
687	601608	中信重工	600	2,094.00	0.02
688	603056	德邦股份	100	2,083.00	0.02
689	600707	彩虹股份	500	2,070.00	0.02
690	600126	杭钢股份	500	2,065.00	0.02
691	300212	易华录	100	2,041.00	0.02
692	603228	景旺电子	100	2,024.00	0.02
693	600556	天下秀	300	2,022.00	0.02
694	600968	海油发展	700	2,016.00	0.02
694	002948	青岛银行	600	2,016.00	0.02
696	601098	中南传媒	200	1,996.00	0.02

697	000415	渤海租赁	900	1,989.00	0.02
698	000540	中天金融	1,300	1,963.00	0.02
699	002081	金螳螂	400	1,940.00	0.02
700	600373	中文传媒	200	1,914.00	0.02
701	600167	联美控股	300	1,896.00	0.02
701	600623	华谊集团	300	1,896.00	0.02
703	002110	三钢闽光	400	1,880.00	0.02
704	001289	龙源电力	100	1,827.00	0.02
705	000967	盈峰环境	400	1,816.00	0.02
706	600307	酒钢宏兴	1,100	1,815.00	0.02
707	000553	安道麦 A	200	1,810.00	0.02
708	600062	华润双鹤	100	1,789.00	0.02
709	600339	中油工程	600	1,788.00	0.02
710	600928	西安银行	500	1,760.00	0.02
710	000990	诚志股份	200	1,760.00	0.02
712	300463	迈克生物	100	1,730.00	0.02
713	000877	天山股份	200	1,704.00	0.02
714	601298	青岛港	300	1,683.00	0.02
715	600006	东风汽车	300	1,674.00	0.02
716	002705	新宝股份	100	1,665.00	0.02
717	002925	盈趣科技	100	1,652.00	0.02
718	002242	九阳股份	100	1,648.00	0.02
719	600377	宁沪高速	200	1,644.00	0.02
720	600927	永安期货	100	1,612.00	0.02
721	002434	万里扬	200	1,610.00	0.02
722	002563	森马服饰	300	1,572.00	0.02
722	002281	光迅科技	100	1,572.00	0.02
724	001914	招商积余	100	1,538.00	0.02
725	601156	东航物流	100	1,526.00	0.02
726	002146	荣盛发展	700	1,519.00	0.02
727	600906	财达证券	200	1,514.00	0.02
728	000031	大悦城	400	1,504.00	0.02
729	300257	开山股份	100	1,500.00	0.02
730	603638	艾迪精密	100	1,492.00	0.02
731	600787	中储股份	300	1,491.00	0.02
732	601969	海南矿业	200	1,482.00	0.02
733	001872	招商港口	100	1,436.00	0.02
734	002867	周大生	100	1,403.00	0.02
735	002945	华林证券	100	1,318.00	0.01
736	000961	中南建设	600	1,314.00	0.01
737	601139	深圳燃气	200	1,308.00	0.01
738	001203	大中矿业	100	1,293.00	0.01
739	002399	海普瑞	100	1,285.00	0.01
740	601228	广州港	400	1,260.00	0.01

741	000062	深圳华强	100	1,221.00	0.01
742	600648	外高桥	100	1,195.00	0.01
743	600032	浙江新能	100	1,149.00	0.01
744	601698	中国卫通	100	1,142.00	0.01
745	600350	山东高速	200	1,138.00	0.01
746	601158	重庆水务	200	1,026.00	0.01
747	601828	美凯龙	200	938.00	0.01
748	600917	重庆燃气	100	796.00	0.01

### 8.1.3.2 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

### 8.1.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.1.4.1 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	600519	贵州茅台	356,101.00	3.84
2	300750	宁德时代	206,463.00	2.23
3	601318	中国平安	157,678.00	1.70
4	600036	招商银行	138,852.00	1.50
5	000858	五粮液	109,475.00	1.18
6	601012	隆基绿能	96,183.00	1.04
7	601166	兴业银行	84,202.00	0.91
8	000333	美的集团	81,674.00	0.88
9	002594	比亚迪	76,470.00	0.83
10	600887	伊利股份	70,548.00	0.76
11	600309	万华化学	63,487.00	0.69
12	000568	泸州老窖	63,127.00	0.68
13	300760	迈瑞医疗	59,793.00	0.65
14	688111	金山办公	57,800.00	0.62
15	601888	中国中免	56,427.00	0.61
16	600809	山西汾酒	55,755.00	0.60
17	000651	格力电器	54,357.00	0.59
18	601398	工商银行	54,118.00	0.58
19	600276	恒瑞医药	53,950.00	0.58
20	002714	牧原股份	52,228.00	0.56

注：“买入金额”按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

#### 8.1.4.2 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	603345	安井食品	16,443.00	0.18
2	600522	中天科技	16,210.00	0.17
3	600256	广汇能源	16,192.00	0.17
4	601799	星宇股份	12,852.00	0.14
5	688180	君实生物	11,588.00	0.13
6	603026	胜华新材	10,692.00	0.12
7	600309	万华化学	9,249.00	0.10
8	601916	浙商银行	9,090.00	0.10
9	000983	山西焦煤	8,869.00	0.10
10	002240	盛新锂能	8,706.00	0.09
11	600875	东方电气	8,624.00	0.09
12	603501	韦尔股份	8,306.00	0.09
13	600732	爱旭股份	8,096.00	0.09
14	000066	中国长城	7,938.00	0.09
15	300124	汇川技术	7,148.00	0.08
16	600036	招商银行	7,104.00	0.08
17	000538	云南白药	5,921.00	0.06
18	600009	上海机场	5,793.00	0.06
19	603198	迎驾贡酒	5,712.00	0.06
20	002180	纳思达	5,191.00	0.06

注：“卖出金额”按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

#### 8.1.4.3 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

买入股票的成本（成交）总额	7,429,627.03
卖出股票的收入（成交）总额	433,854.00

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”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。

#### 8.1.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	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	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	506,457.01	5.47

### 8.1.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	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

### 8.1.7 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 8.1.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 8.1.9 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

本基金本报告期末未持有权证。

### 8.1.10 本基金投资股指期货的投资政策

#### 8.1.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 8.1.11.1 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。

##### 8.1.11.2 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。

### 8.1.12 投资组合报告附注

**8.1.12.1** 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。

**8.1.12.2** 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。

### 8.1.12.3 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	4,050.28
2	应收清算款	-
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

### 8.1.12.4 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。

### 8.1.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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

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。

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

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。

### 8.1.12.6 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。

## 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

### 8.2.1 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	1,067,977.00	11.87
	其中：普通股	-	-
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
8	其他各项资产	2,000.16	0.02
9	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。

## 8.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
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

### 8.2.2.2 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港股通投资股票。

### 8.2.3 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	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
11	601985	中国核电	3,000	17,550.00	0.20
12	601669	中国电建	2,500	17,425.00	0.19
13	601390	中国中铁	3,300	17,259.00	0.19
14	001979	招商蛇口	1,000	16,340.00	0.18
15	002271	东方雨虹	600	15,822.00	0.18
16	600905	三峡能源	2,800	15,764.00	0.18
17	600999	招商证券	1,200	14,808.00	0.17
18	000776	广发证券	1,000	14,270.00	0.16
19	600958	东方证券	1,700	13,073.00	0.15
20	601006	大秦铁路	1,900	12,863.00	0.14
21	601377	兴业证券	2,200	11,990.00	0.13
22	600795	国电电力	2,900	11,803.00	0.13
23	000166	申万宏源	2,900	11,194.00	0.12
24	600886	国投电力	1,000	10,740.00	0.12
25	600011	华能国际	1,400	10,626.00	0.12
26	601186	中国铁建	1,500	10,455.00	0.12
27	600383	金地集团	900	10,341.00	0.12



28	003816	中国广核	3,800	10,032.00	0.11
29	601117	中国化学	1,200	9,612.00	0.11
30	601868	中国能建	4,200	9,408.00	0.10
31	601066	中信建投	400	9,268.00	0.10
32	601901	方正证券	1,300	8,515.00	0.09
33	600233	圆通速递	400	8,300.00	0.09
34	601555	东吴证券	1,300	8,008.00	0.09
35	601788	光大证券	600	7,890.00	0.09
36	002120	韵达股份	500	7,825.00	0.09
37	601800	中国交建	1,100	7,821.00	0.09
38	002736	国信证券	900	7,740.00	0.09
39	000786	北新建材	300	7,215.00	0.08
40	601128	常熟银行	900	7,164.00	0.08
41	601077	渝农商行	2,000	7,140.00	0.08
42	600153	建发股份	500	6,925.00	0.08
43	601995	中金公司	200	6,882.00	0.08
44	601618	中国中冶	2,300	6,877.00	0.08
45	000783	长江证券	1,300	6,773.00	0.08
46	601108	财通证券	1,000	6,760.00	0.08
47	603486	科沃斯	100	6,670.00	0.07
48	600027	华电国际	1,100	6,545.00	0.07
49	000069	华侨城 A	1,300	6,253.00	0.07
50	600039	四川路桥	600	6,132.00	0.07
51	601162	天风证券	2,200	6,006.00	0.07
52	002797	第一创业	1,100	5,995.00	0.07
53	600918	中泰证券	900	5,940.00	0.07
54	000728	国元证券	900	5,760.00	0.06
55	601878	浙商证券	600	5,688.00	0.06
56	600109	国金证券	700	5,348.00	0.06
57	601990	南京证券	700	5,341.00	0.06
58	002673	西部证券	900	5,247.00	0.06
59	601696	中银证券	500	5,245.00	0.06
60	601155	新城控股	300	5,244.00	0.06
61	600325	华发股份	500	4,925.00	0.05
62	600236	桂冠电力	800	4,688.00	0.05
63	002032	苏泊尔	100	4,613.00	0.05
64	600642	申能股份	800	4,608.00	0.05
65	601016	节能风电	1,000	4,400.00	0.05
66	002244	滨江集团	400	4,188.00	0.05
67	600863	内蒙华电	1,100	4,136.00	0.05
68	600025	华能水电	600	4,128.00	0.05
69	600704	物产中大	1,000	4,120.00	0.05
69	002372	伟星新材	200	4,120.00	0.05
71	600909	华安证券	900	4,095.00	0.05

72	600369	西南证券	1,100	4,037.00	0.05
73	600606	绿地控股	1,400	3,906.00	0.04
74	000750	国海证券	1,200	3,876.00	0.04
75	002958	青农商行	1,300	3,835.00	0.04
76	601198	东兴证券	500	3,700.00	0.04
77	002926	华西证券	500	3,665.00	0.04
78	601881	中国银河	400	3,600.00	0.04
79	600021	上海电力	400	3,596.00	0.04
80	600848	上海临港	300	3,546.00	0.04
81	002500	山西证券	700	3,542.00	0.04
82	601992	金隅集团	1,400	3,486.00	0.04
83	600820	隧道股份	700	3,451.00	0.04
84	600208	新湖中宝	1,400	3,430.00	0.04
85	000027	深圳能源	600	3,366.00	0.04
86	600801	华新水泥	200	3,350.00	0.04
87	002183	怡亚通	600	3,312.00	0.04
88	000690	宝新能源	700	3,304.00	0.04
89	600970	中材国际	400	3,284.00	0.04
90	002939	长城证券	400	3,272.00	0.04
91	000686	东北证券	500	3,225.00	0.04
92	600895	张江高科	300	3,117.00	0.03
93	002670	国盛金控	400	3,052.00	0.03
94	600663	陆家嘴	300	2,889.00	0.03
95	600064	南京高科	400	2,764.00	0.03
96	600155	华创阳安	400	2,736.00	0.03
97	601778	晶科科技	600	2,694.00	0.03
98	601991	大唐发电	800	2,656.00	0.03
99	000883	湖北能源	600	2,634.00	0.03
100	600755	厦门国贸	400	2,552.00	0.03
101	002468	申通快递	200	2,550.00	0.03
102	000401	冀东水泥	300	2,508.00	0.03
102	000656	金科股份	1,200	2,508.00	0.03
104	000537	广宇发展	200	2,484.00	0.03
105	601860	紫金银行	900	2,448.00	0.03
106	601611	中国核建	300	2,310.00	0.03
107	003035	南网能源	400	2,272.00	0.03
108	002233	塔牌集团	300	2,250.00	0.03
109	601236	红塔证券	300	2,196.00	0.02
110	601333	广深铁路	1,100	2,145.00	0.02
111	600167	联美控股	300	2,124.00	0.02
112	002010	传化智联	400	2,116.00	0.02
113	000402	金融街	400	2,032.00	0.02
114	600095	湘财股份	300	1,899.00	0.02
115	000540	中天金融	1,300	1,833.00	0.02

116	002081	金螳螂	400	1,808.00	0.02
117	000877	天山股份	200	1,778.00	0.02
118	002705	新宝股份	100	1,772.00	0.02
119	600376	首开股份	400	1,752.00	0.02
120	601456	国联证券	200	1,748.00	0.02
121	603056	德邦股份	100	1,645.00	0.02
121	002146	荣盛发展	700	1,645.00	0.02
123	601825	沪农商行	300	1,593.00	0.02
124	601156	东航物流	100	1,588.00	0.02
125	000671	阳光城	800	1,560.00	0.02
126	000718	苏宁环球	500	1,540.00	0.02
127	001914	招商积余	100	1,526.00	0.02
128	002242	九阳股份	100	1,477.00	0.02
129	600787	中储股份	300	1,458.00	0.02
130	600377	宁沪高速	200	1,438.00	0.02
131	000961	中南建设	600	1,392.00	0.02
132	600906	财达证券	200	1,370.00	0.02
133	601139	深圳燃气	200	1,360.00	0.02
134	000031	大悦城	400	1,340.00	0.01
135	002945	华林证券	100	1,304.00	0.01
136	600648	外高桥	100	1,166.00	0.01
137	600350	山东高速	200	1,086.00	0.01
138	600823	世茂股份	400	944.00	0.01
139	600917	重庆燃气	100	797.00	0.01

## 8.2.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.2.4.1 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	600900	长江电力	86,950.00	0.97
2	300059	东方财富	66,878.00	0.75
3	600030	中信证券	58,880.00	0.66
4	600048	保利发展	41,630.00	0.46
5	002352	顺丰控股	29,274.00	0.33
6	601816	京沪高铁	28,791.00	0.32
7	600837	海通证券	28,117.00	0.31
8	600585	海螺水泥	24,845.00	0.28
9	601688	华泰证券	23,750.00	0.26
10	601211	国泰君安	21,195.00	0.24
11	601669	中国电建	18,775.00	0.21

12	601985	中国核电	18,570.00	0.21
13	601390	中国中铁	18,315.00	0.20
14	002271	东方雨虹	17,940.00	0.20
15	001979	招商蛇口	16,080.00	0.18
16	600905	三峡能源	15,988.00	0.18
17	000776	广发证券	15,730.00	0.18
18	600999	招商证券	15,492.00	0.17
19	600958	东方证券	13,787.00	0.15
20	601377	兴业证券	12,870.00	0.14

注：“买入金额”按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

#### 8.2.4.2 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

本基金本报告期末未卖出股票。

#### 8.2.4.3 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

买入股票的成本（成交）总额	1,124,583.00
卖出股票的收入（成交）总额	-

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”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。

#### 8.2.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	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	-	-
9	其他	-	-
10	合计	100,972.93	1.13

### 8.2.6 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

金额单位：人民币元

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

### 8.2.7 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 8.2.8 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。

### 8.2.9 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

本基金本报告期末未持有权证。

### 8.2.10 本基金投资股指期货的投资政策

#### 8.2.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 8.2.11.1 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。

##### 8.2.11.2 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。

### 8.2.12 投资组合报告附注

**8.2.12.1** 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。

**8.2.12.2** 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。

#### 8.2.12.3 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	2,000.16
2	应收清算款	-
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

#### 8.2.12.4 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。

#### 8.2.12.5 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。

#### 8.2.12.6 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。

### 9 基金份额持有人信息

#### 9.1 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)

##### 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

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 中 证 8 0 0 指 数 型	1 8 0 6	56,4 47.3 2	10,000, 000.00	95.2 453 %	499,2 01.64	4.7547%

发起式 A						
中银中证 800 指数型发起式 C	800	1,830.69	-	-	146,455.53	100.0000%
合计	266	40,021.27	10,000,000.00	93.9350%	645,657.17	6.0650%

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 9.1.2 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	中银中证 800 指数型发起式 A	64,952.58	0.6186%
	中银中证 800 指数型发起式 C	-	-
	合计	64,952.58	0.6101%

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 9.1.3 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的情况

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	中银中证 800 指数型发起式 A	0
	中银中证 800 指数型发起式 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	中银中证 800 指数型发起式 A	0
	中银中证 800 指数型发起式 C	0
	合计	0

### 9.1.4 发起式基金发起资金持有份额情况

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%	-

## 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

（报告期：2022年1月1日-2022年10月9日）

### 9.2.1 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
中银中证	187	56,109.08	10,000,000.00	95.3071%	492,397.72	4.6929%



800 ET F发 起 式 联 接 A						
中 银 中 证 800 ET F发 起 式 联 接 C	9 4	1,46 7.47	-	-	137,9 41.93	100.0000%
合 计	2 8 1	37,8 30.3 9	10,000, 000.00	94.0 704 %	630,3 39.65	5.9296%

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 9.2.2 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	中银中证 800ETF 发起 式联接 A	64,952.58	0.6190%
	中银中证 800ETF 发起 式联接 C	-	-
	合计	64,952.58	0.6110%

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 9.2.3 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的情况

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	中银中证 800ETF 发起式联接 A	0
	中银中证 800ETF 发起式联接 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基 金	中银中证 800ETF 发起式联接 A	0
	中银中证 800ETF 发起式联接 C	0
	合计	0

### 9.2.4 发起式基金发起资金持有份额情况

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%	-

## §10 开放式基金份额变动

### 10.1 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）

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（2022 年 10 月 10 日）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末	47,818.63	126,917.90

基金总申购份额		
减：基金合同生效日起至报告期末基金总赎回份额	41,014.71	118,404.30
基金合同生效日起至报告期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	10,499,201.64	146,455.53

## 10.2 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1月1日-2022年10月9日)

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
基金合同生效日（2021 年 12 月 7 日）基金份额总额	10,824,163.95	143,768.25
本报告期期初基金份额总额	10,824,163.95	143,768.25
本报告期基金总申购份额	139,458.96	10,104,266.80
减：本报告期基金总赎回份额	471,225.19	10,110,093.12
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	10,492,397.72	137,941.93

## §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，本基金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

本报告期内，经董事会决议通过，陈卫星先生担任副执行总裁，详情请参见基金管理人 2022 年 6 月 7 日刊登的《中银基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告》。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，没有涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼。

#### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未发生改变。

#### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金未有改聘为其审计的会计师事务所，报告期内本基金应支付给会计师事务所的报酬为 30,000.00 元，目前事务所已为本基金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

##### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

##### 11.6.2 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，托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

#### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

##### 11.7.1 中银中证 800 指数型发起式证券投资基金

##### 11.7.1.1 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	
华创证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	3,409,734.00	43.37%	3,141.39	43.10%	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	3	-	-	-	-	-
长江证券	2	4,453,063.03	56.63%	4,147.61	56.90%	-

注：1、专用交易单元的选择标准和程序：根据中国证监会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》（证监基字<1998>29 号）及《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48 号）有关规定，本公司租用证券公司专用交易单元的选择标准主要包括：券商基

本面评价（财务状况、经营状况）、券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）、券商每日信息评价（及时性和有效性）和券商协作表现评价等方面。本公司租用证券公司专用交易单元的选择程序：首先根据租用证券公司专用交易单元的选择标准形成《券商研究所服务质量评分表》，然后根据评分高低进行选择基金专用交易单元，并与其签订交易单元租用协议。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：新租用兴业证券上海、深圳、北京交易单元各一个。

### 11.7.1.2 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		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
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	401,600.00	100.00%	-	-	-	-	-	-

## 11.7.2 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

### 11.7.2.1 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	
华创证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	317,278.00	28.21%	292.30	28.00%	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	3	-	-	-	-	-
长江证券	2	807,305.00	71.79%	751.79	72.00%	-

注：1、专用交易单元的选择标准和程序：根据中国证监会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》（证监基金字<1998>29号）及《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）有关规定，本公司租用证券公司专用交易单元的选择标准主要包括：券商基本面评价（财务状况、经营状况）、券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）、券商每日信息评价（及时性和有效性）和券商协作表现评价等方面。本公司租用证券公司专用交易单元的选择程序：首先根据租用证券公司专用交易单元的选择标准形成《券商研究所服务质量评分表》，然后根据评分高低进行选择基金专用交易单元，并与其签订交易单元租用协议。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：新租用兴业证券上海、深圳、北京交易单元各一个。

### 11.7.2.2 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		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

华创 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
西部 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
西南 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
安信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
民生 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国金 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中金 公司	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰 君安	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东方 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
广发 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
长江 证券	400,207.0 0	100.00 %	-	-	-	-	7,463,169 .00	100.00 %	

### 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	中银基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证监会规定媒介	2022-01-01
2	中银基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	中国证监会规定媒介	2022-01-05
3	中银基金管理有限公司关于新增诺亚正行基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2022-01-10
4	中银基金管理有限公司关于新增上海基煜基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2022-01-13
5	中银基金管理有限公司关于旗下部分基金估值变更的提示性公告	中国证监会规定媒介	2022-01-14
6	中银基金管理有限公司关于旗下部分基金增加西部证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2022-01-17

7	中银基金管理有限公司关于新增上海基煜基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2022-01-18
8	中银基金管理有限公司关于新增泰信财富基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2022-01-21
9	中银基金管理有限公司关于新增上海联泰基金销售有限公司为旗下部分证券投资基金销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2022-01-24
10	中银基金管理有限公司关于新增上海联泰基金销售有限公司为旗下部分证券投资基金销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2022-01-25
11	中银基金管理有限公司关于旗下部分基金增加华金证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2022-01-27
12	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开放日常申购、赎回、转换及定期定额投资业务公告	中国证监会规定媒介	2022-03-03
13	中银基金管理有限公司关于新增宜信普泽(北京)基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2022-03-24
14	中银基金管理有限公司关于新增宜信普泽(北京)基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2022-03-25
15	中银基金管理有限公司关于新增北京汇成基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2022-04-11
16	中银基金管理有限公司关于新增北京汇成基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2022-04-18
17	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 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2022-04-21
18	中银基金管理有限公司关于为部分基金销售机构开通转换业务的公告	中国证监会规定媒介	2022-05-06
19	中银基金管理有限公司关于新增上海万得基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2022-05-09
20	中银基金管理有限公司关于为部分基金销售机构开通转换业务的公告	中国证监会规定媒介	2022-05-09
21	中银基金管理有限公司关于旗下部分基金增加宁波银行股份有限公司同业易管家平台为销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2022-05-27
22	中银基金管理有限公司关于新增泰信财富基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构并开通转换业务公告	中国证监会规定媒介	2022-06-02



23	中银基金管理有限公司关于新增泰信财富基金销售有限公司为部分基金开通转换业务的公告	中国证监会规定媒介	2022-06-06
24	中银基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证监会规定媒介	2022-06-07
25	中银基金管理有限公司关于新增嘉实财富管理有限公司为旗下部分基金销售机构并开通转换业务公告	中国证监会规定媒介	2022-06-13
26	中银基金管理有限公司关于新增嘉实财富管理有限公司为旗下部分基金销售机构并开通转换业务公告	中国证监会规定媒介	2022-06-14
27	中银基金管理有限公司董事、监事、高级管理人员和分支机构负责人的人员名单	中国证监会规定媒介	2022-06-21
28	中银基金管理有限公司关于新增济安财富(北京)基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构并开通转换业务的公告	中国证监会规定媒介	2022-06-21
29	中银基金管理有限公司关于新增济安财富(北京)基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构并开通转换业务的公告	中国证监会规定媒介	2022-06-22
30	中银基金管理有限公司关于新增上海长量基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构并开通转换业务公告	中国证监会规定媒介	2022-07-07
31	中银基金管理有限公司关于新增上海长量基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构并开通转换业务公告	中国证监会规定媒介	2022-07-08
32	中银基金管理有限公司关于中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金可能触发基金合同终止情形的提示性公告	中国证监会规定媒介	2022-07-08
33	中银基金管理有限公司关于新增华宝证券股份有限公司为旗下部分产品销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2022-07-12
34	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 2 季度报告	中国证监会规定媒介	2022-07-20
35	关于中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金暂停申购、转换转入及定期定额投资业	中国证监会规定媒介	2022-07-22
36	中银基金管理有限公司关于诺亚正行基金销售有限公司开通转换业务的公告	中国证监会规定媒介	2022-07-28
37	关于中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金暂停赎回、转换转出业务并暂停估值的提示性公告	中国证监会规定媒介	2022-08-04
38	关于中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金暂停赎回、转换转出业务并暂停估值的公告	中国证监会规定媒介	2022-08-05
39	中银基金管理有限公司关于提醒投资者及时	中国证监会规定媒介	2022-08-16

	提供或更新身份信息资料的公告		
40	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(中银中证 800ETF 发起式联接 A) 产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2022-08-17
41	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更新招募说明书(2022 年第 1 号)	中国证监会规定媒介	2022-08-17
42	中银基金管理有限公司关于办公电话变更的公告	中国证监会规定媒介	2022-08-18
43	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 年中期报告	中国证监会规定媒介	2022-08-30
44	中银基金管理有限公司关于开展电子直销平台费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2022-08-31
45	中银基金管理有限公司关于新增招商证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2022-09-08
46	中银基金管理有限公司关于旗下部分基金在兴业银行银银平台机构投资交易平台进行销售的公告	中国证监会规定媒介	2022-09-21
47	关于中银中证 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并修改基金合同等法律文件的提示性公告	中国证监会规定媒介	2022-09-26
48	中银中证 800 指数型发起式证券投资基金(中银中证 800 指数型发起式 C) 产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2022-09-30
49	中银中证 800 指数型发起式证券投资基金(中银中证 800 指数型发起式 A) 产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2022-09-30
50	中银中证 800 指数型发起式证券投资基金基金合同	中国证监会规定媒介	2022-09-30
51	中银中证 800 指数型发起式证券投资基金托管协议	中国证监会规定媒介	2022-09-30
52	中银中证 800 指数型发起式证券投资基金招募说明书	中国证监会规定媒介	2022-09-30
53	中银中证 800 指数型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	中国证监会规定媒介	2022-09-30
54	关于中银中证 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并修改基金合同等法律文件的公告	中国证监会规定媒介	2022-09-30
55	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 3 季度报告	中国证监会规定媒介	2022-10-25
56	中银基金管理有限公司关于新增北京创金启	中国证监会规定媒介	2022-11-03

	富基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告		
57	中银基金管理有限公司关于新增北京创金启富基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2022-11-04
58	中银基金管理有限公司关于新增上海攀赢基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2022-11-11
59	中银基金管理有限公司关于新增上海攀赢基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2022-11-14
60	中银基金管理有限公司关于新增博时财富基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2022-11-22
61	中银基金管理有限公司关于新增博时财富基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2022-11-23
62	中银基金管理有限公司关于新增平安银行股份有限公司行 E 通平台为旗下部分基金销售机构及参加其申购费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2022-11-29
63	中银基金管理有限公司关于新增海通证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2022-11-30
64	中银基金管理有限公司关于新增国泰君安证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2022-12-02
65	中银基金管理有限公司关于设立新加坡子公司及获批相关业务牌照的公告	中国证监会规定媒介	2022-12-09

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 中银中证 800 指数型发起式证券投资基金

#### 12.1.1 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	20221010-20221231	10,000,000.00	-	-	10,000,000.00	93.9350%
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。

## 12.2 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

### 12.2.1 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	20220101-20221009	10,000,000.00	-	-	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。

## §13 备查文件目录

### 13.1 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。

### 13.2 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。

### 13.3 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  
二〇二三年三月三十日