

**中银中证 800 指数型发起式证券投资基金**  
**2023 年年度报告**  
**2023 年 12 月 31 日**

基金管理人：中银基金管理有限公司  
基金托管人：中信银行股份有限公司  
报告送出日期：二〇二四年三月二十九日

## § 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 2024 年 3 月 28 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。普华永道中天会计师事务所（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 2023 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b>	2
1.1 重要提示	2
<b>§2 基金简介</b>	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	7
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	11
<b>§4 管理人报告</b>	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
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	17
<b>§5 托管人报告</b>	17
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	17
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	17
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	17
<b>§6 审计报告</b>	17
6.1 审计意见	18
6.2 形成审计意见的基础	18
6.3 其他信息	18
6.4 管理层和治理层对财务报表的责任	19
6.5 注册会计师对财务报表审计的责任	19
<b>§7 年度财务报表</b>	20
7.1 资产负债表	20
7.2 利润表	21
7.3 净资产变动表	23
7.4 报表附注	24
<b>§8 投资组合报告</b>	52
8.1 期末基金资产组合情况	52
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	53
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	54
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	71

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	73
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	73
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	74
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	74
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	74
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	74
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	74
8.12 投资组合报告附注 .....	74
<b>§9 基金份额持有人信息</b> .....	<b>76</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	76
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	76
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	76
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	77
<b>§10 开放式基金份额变动</b> .....	<b>77</b>
<b>§11 重大事件揭示</b> .....	<b>78</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	78
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 .....	78
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	78
11.4 基金投资策略的改变 .....	78
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	78
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 .....	78
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	79
11.8 其他重大事件 .....	80
<b>12 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>81</b>
<b>§13 备查文件目录</b> .....	<b>82</b>
13.1 备查文件目录 .....	82
13.2 存放地点 .....	82
13.3 查阅方式 .....	82

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

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	14,104,987.63 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	10,842,742.74 份	3,262,244.89 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过指数化投资策略，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。在正常市场情况下，本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。
投资策略	本基金为被动式股票指数基金，采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标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

	<p>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<math>\times 95\%</math>+银行人民币活期存款利率(税后)<math>\times 5\%</math></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	方合英

## 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 26 楼

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	上海市浦东新区东育路 588 号 前滩中心 42 楼
注册登记机构	中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、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2023 年		2022 年 10 月 10 日(基金合同生效日) 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	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	62,238.51	-7,057.90	9,929.67	-10.01
本期利润	-814,763.06	-124,112.77	277,299.57	2,925.26
加权平均基金份额本 期利润	-0.0758	-0.1486	0.0264	0.0215
本期加权平均净值利 润率	-8.68%	-17.77%	3.06%	2.50%
本期基金份额净值增 长率	-8.40%	-8.76%	3.13%	3.02%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末		2022 年末	
	中银中证 800 指 数型发起式 A	中银中证 800 指 数型发起式 C	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	-2,199,745.53	-683,122.93	-1,485,123.14	-21,205.26
期末可供分配基金份	-0.2029	-0.2094	-0.1415	-0.1448

额利润				
期末基金资产净值	8,642,997.21	2,579,121.96	9,136,627.53	126,905.80
期末基金份额净值	0.7971	0.7906	0.8702	0.8665
3.1.3 累计期末指标	2023 年末		2022 年末	
	中银中证 800 指数型发起式 A	中银中证 800 指数型发起式 C	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	-5.53%	-6.00%	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。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

#### 1. 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
过去三个月	-5.82%	0.72%	-6.06%	0.74%	0.24%	-0.02%
过去六个月	-9.21%	0.76%	-9.87%	0.79%	0.66%	-0.03%
过去一年	-8.40%	0.75%	-9.83%	0.78%	1.43%	-0.03%
自基金合同生效日起	-5.53%	0.82%	-8.13%	0.86%	2.60%	-0.04%

#### 2. 中银中证 800 指数型发起式 C:



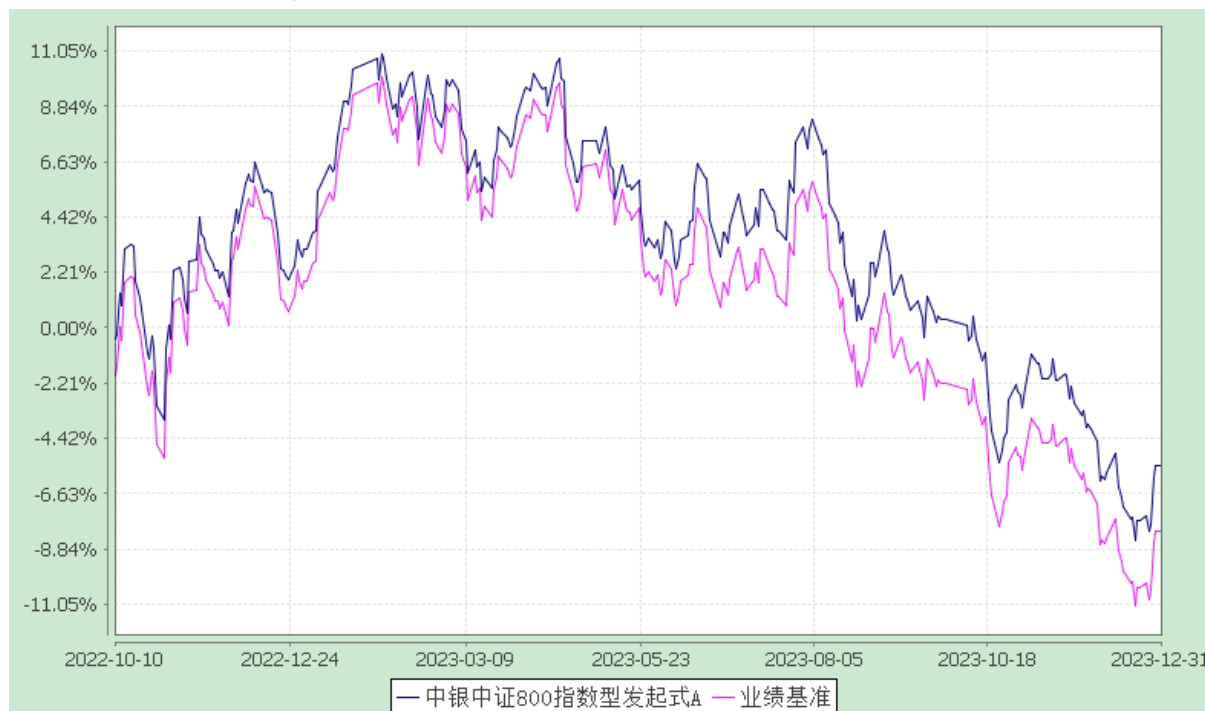
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①—③	②—④
过去三个 月	-5.91%	0.72%	-6.06%	0.74%	0.15%	-0.02%
过去六个 月	-9.39%	0.76%	-9.87%	0.79%	0.48%	-0.03%
过去一年	-8.76%	0.75%	-9.83%	0.78%	1.07%	-0.03%
自基金合 同生效日 起	-6.00%	0.82%	-8.13%	0.86%	2.13%	-0.04%

### 3.2.2 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

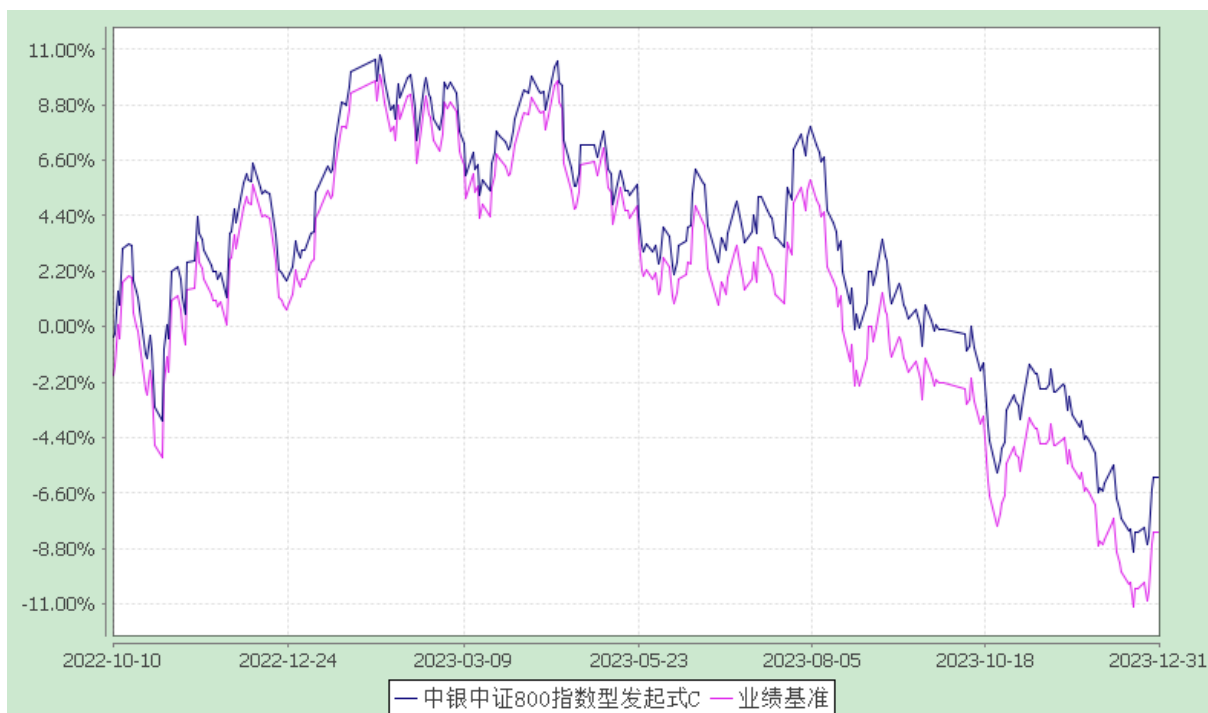
中银中证 800 指数型发起式证券投资基金

自基金转型以来基金份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
(2022 年 10 月 10 日至 2023 年 12 月 31 日)

#### 1、中银中证 800 指数型发起式 A



#### 2、中银中证 800 指数型发起式 C



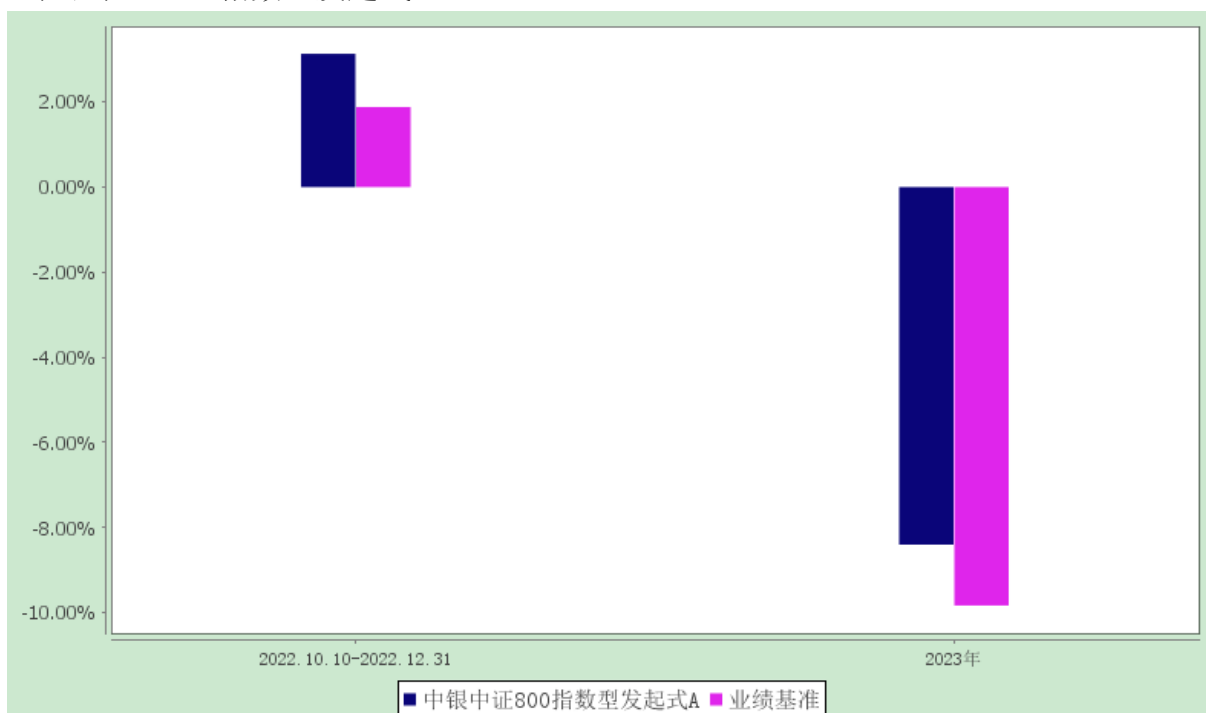
注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期，截至建仓结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

### 3.2.3 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

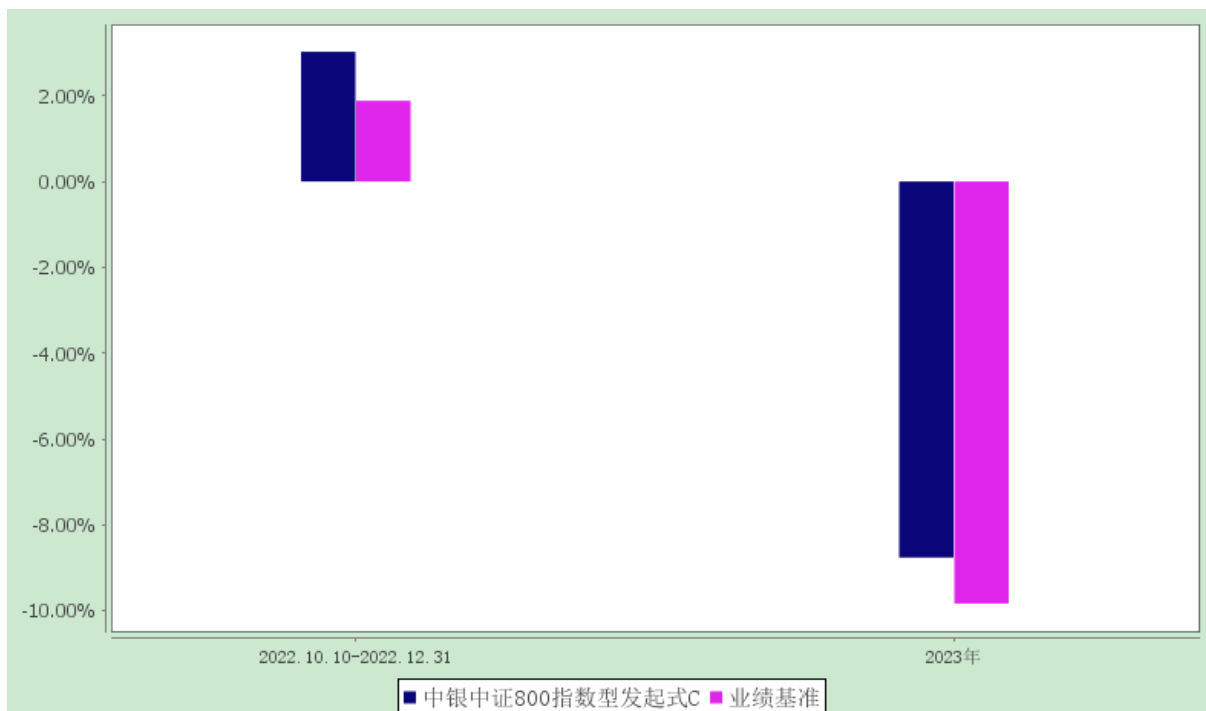
中银中证 800 指数型发起式证券投资基金

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

#### 1、中银中证 800 指数型发起式 A



## 2、中银中证 800 指数型发起式 C



注：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。

### 3.3 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
2023 年	-	-	-	-	-
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
2023 年	-	-	-	-	-

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。

## § 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(英国)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 2023 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）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理) 期限		证券从 业年限	说明
		任职日期	离任日期		
赵建忠	基金经 理	2021-12-07	-	17	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 2024 年 2 月任中银中证 100ETF 联接基金基金经理，2021 年 12 月至今任中银中证 800 基金（原目标 ETF 基金）基金经理。具备基金、期货从业资格。
--	--	--	--	--	---

注：1、首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日，非首任基金经理的“任职日期”为根据公司决定确定的聘任日期，基金经理的“离任日期”均为根据公司决定确定的解聘日期；2、证券从业年限的计算标准及含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、中国证监会的有关规则和其他有关法律法规的规定，严格遵循本基金基金合同，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。

本报告期内，本基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 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，未发现有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，2023 年美国通胀整体高位回落，而经济韧性仍存。具体看，在政府财政扩张背景下，2023 年美国居民消费韧性仍在，而商业投资保持强劲，推动美国经济维持复苏态势，美国前三季度 GDP 环比折年率分别为 2.2%，2.1%，4.9%，GDP 不变价同比分别录得 2.1%，2.5%，2.8%。随着此轮持续快速加息效应逐渐显现，2023 年美国通胀趋于降温，全年 CPI 同比呈现波动回落走势，CPI 同比自 1 月 6.4% 逐步回落至 6 月的 3.0%，随后震荡反弹至 12 月的 3.4%，美联储加息周期或也已步入尾声。欧元区通胀水平也在此轮激进加息周期中快速回落，HICP 同比从 1 月的 8.6% 波动回落至 9 月的 4.3%，在四季度迅速降至 3.0% 下方，12 月 HICP 同比录得 2.9%。在缺少经济增长引擎叠加全球地缘政治局势不稳风险下，欧元区经济复苏乏力，前三季度 GDP 不变价同比分别为 1.5%，0.3%，-0.3%。日本经济则明显复苏，前三季度 GDP 实际增速分别录得 2.5%，2.2%，1.5%，通胀水平虽从 1 月的 4.3% 整体回落至 12 月的 2.6%，但仍维持在 2.0% 上方，货币政策或也有望退出负利率。

2023 年国内经济修复动能偏弱，不过在低基数效应下增速有所回升。受低基数效应及政策托举节奏影响，经济增速全年呈现波浪形走势，四个季度实际 GDP 同比增速分别录得 4.5%，6.3%，4.9%，5.2%，全年经济实际增速 5.2% 左右。分部门来看，投资全年主要依靠基建托底，地产投资仍维持负增不过较上一年有所收窄，基建投资上半年强度相对高于下半年，全年固定资产投资累计增速录得 3.0%；规模以上工业增加值全年增长 4.6%，整体呈现稳步增长趋势；消费受基数效应影响上半年表现好于下半年，社零总额年末累计同比录得 7.2%。对外贸易方面，全年进口在内需疲弱背景下整体持续负增，出口在美国经济边际趋弱背景下改善空间受限。通胀方面，PPI 同比全年处于负值区间，全年均值 -3.0%；CPI 同比全年在消费需求疲软等因素带动下整体偏弱，全年均值 0.2%。

基于偏低通胀与偏弱经济基本面，全年货币政策维持均衡偏宽状态，M0 同比增长 8.3%，相对低于 2022 年的 15.3%，而高于 2021 年的 7.7%。社融和信贷增长仍较为疲弱，2023 年全年新增人民币贷款 22.75 万亿元，较 2022 年多增 1.31 万亿元，经济基本面偏弱背景下实体融资需求未明显提振；全年居民贷款增加 4.33 万亿元，较 2022 年仅多增 0.5 万亿元；全年企业贷款增加 17.91 万亿元，较 2022 年仅多增 0.8 万亿元。2023 年全年社会融资增量 35.59 万亿元，较 2022 年多增 3.41 万亿元，全年社融增速从 2022 年的 9.6% 降至 9.5%，融资需求低迷背景下，社融增长持续乏力。

## 2、行情回顾

2023 年股票市场总体震荡收跌。年初由于对经济强复苏的预期，股市大幅反弹，春节后“弱预期、弱现实”市场进入波动调整期，AI 和中特估两大主线表现较突出。724 政治局会议定调活跃资本市场，在诸多利好刺激下市场没能摆脱下跌趋势，最后在一万亿特别国债、中美关系预期缓和的多重作用下，10 月底市场对利空因素逐渐弱化，有所企稳。从各行业来看，通信（25.75%）、传媒（16.80%）、计算机（8.97%）等行业表现较好，美容护理（-32.03%）、商贸零售（-31.30%）、房地产（-26.39%）等行业跌幅较大。最终，沪深 300 等权指数涨跌幅度为-9.32%；中证 100 涨跌幅-12.64%；上证国企指数涨跌幅-4.30%，中证 800 指数涨跌-10.37%。

## 3. 运行分析

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

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金 A 类份额净值增长率为-8.40%，同期业绩比较基准收益率为-9.83%。

报告期内，本基金 C 类份额净值增长率为-8.76%，同期业绩比较基准收益率为-9.83%。

### 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 2024 年，GDP 增长目标维持偏积极，政策延续积极基调，有助于提振市场信心，对股市形成支撑。流动性方面，美联储货币政策逐步转向，美债收益率、美元指数中枢有望下行，汇率压力减轻之下国内货币政策也存在进一步宽松空间。风险偏好方面，外部环境或有所改善，稳增长政策效果将继续显现，国内需求有望持续修复。消费、基建和制造业投资有望较快增长，房地产投资降幅或小幅收窄，经济将向潜在增速水平回归，权益市场有望温和上行。

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，力争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、研究及投资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；

本报告期期末 A 类基金份额可供分配利润为-2,199,745.53 元,C 类基金份额可供分配利润为-683,122.93 元。本基金本报告期末进行利润分配。

#### 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 2023 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 2023 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，未发现有损害基金持有人利益的行为。

### § 6 审计报告

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 审计意见

### (一)我们审计的内容

我们审计了中银中证 800 指数型发起式证券投资基金(以下简称“中银中证 800 指数发起式基金”)的财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年度的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。

### (二)我们的意见

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了中银中证 800 指数发起式基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。

## 6.2 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。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。

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 指数发起式基金，并履行了职业道德方面的其他责任。

## 6.3 其他信息

中银中证 800 指数发起式基金的基金管理人中银基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括中银中证 800 指数发起式基金 2023 年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。基于我们已经执行的工作，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。

#### 6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估中银中证 800 指数发起式基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算中银中证 800 指数发起式基金、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督中银中证 800 指数发起式基金的财务报告过程。

#### 6.5 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：

(一)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(二)了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(三)评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(四)对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对中银中证 800 指数发起式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 指数发起式基金不能持续经营。

(五)评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

叶尔甸 耿亚男

上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼

2024 年 3 月 28 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：中银中证 800 指数型发起式证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	492,462.61	438,882.25
结算备付金		6,247.19	-
存出保证金		532.28	4,050.28
交易性金融资产	7.4.7.2	10,748,409.44	8,859,092.01
其中：股票投资		10,137,525.71	8,352,635.00
基金投资		-	-
债券投资		610,883.73	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	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-

应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		137,549.79	2,800.03
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		11,385,201.31	9,304,824.57
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2022 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		0.01	0.01
应付赎回款		125,826.29	-
应付管理人报酬		4,092.12	3,569.25
应付托管费		454.69	396.60
应付销售服务费		717.98	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	31,991.05	37,289.00
负债合计		163,082.14	41,291.24
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.7	14,104,987.63	10,645,657.17
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	-2,882,868.46	-1,382,123.84
净资产合计		11,222,119.17	9,263,533.33
负债和净资产总计		11,385,201.31	9,304,824.57

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额总额 14,104,987.63 份，其中 A 类基金份额净值 0.7971 元，基金份额 10,842,742.74 份；C 类基金份额净值 0.7906 元，基金份额 3,262,244.89 份。

## 7.2 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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日 至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 10 月 10 日（基金合同生效日） 至 2022 年 12 月 31 日
----	-----	--	---

一、营业总收入		-855,159.34	297,711.87
1.利息收入		1,483.75	588.12
其中：存款利息收入	7.4.7.9	1,483.75	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）		136,342.54	26,774.62
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-79,422.51	8,948.57
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	11,927.47	2,561.92
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.13	-	-
股利收益	7.4.7.14	203,837.58	15,264.13
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益（若有）		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	-994,056.44	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）	7.4.7.16	1,070.81	43.96
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>83,716.49</b>	<b>17,487.04</b>
1. 管理人报酬	7.4.10.2	45,336.92	9,400.03
2. 托管费	7.4.10.2	5,037.53	1,044.45
3. 销售服务费		2,730.03	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	7.4.7.17	30,612.01	6,935.60
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-938,875.83</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>-938,875.83</b>	<b>280,224.83</b>
五、其他综合收益的税后净额		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-938,875.83</b>	<b>280,224.83</b>

## 7.3 净资产变动表

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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	10,645,657.17	-1,382,123.84	9,263,533.33
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
二、本期期初净资产	10,645,657.17	-1,382,123.84	9,263,533.33
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	3,459,330.46	-1,500,744.62	1,958,585.84
（一）、综合收益总额	-	-938,875.83	-938,875.83
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	3,459,330.46	-561,868.79	2,897,461.67
其中：1. 基金申购款	9,092,802.10	-1,624,238.87	7,468,563.23
2. 基金赎回款	-5,633,471.64	1,062,370.08	-4,571,101.56
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	14,104,987.63	-2,882,868.46	11,222,119.17

项目	上年度可比期间 2022 年 10 月 10 日（基金合同生效日）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	10,630,339.65	-1,661,492.70	8,968,846.95
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
二、本期期初净资产	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净资产变动数（净资产减少以“-”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净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况



中银中证 800 指数型发起式证券投资基金是根据原中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金以下简称“中银中证 800 ETF 联接基金”)《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,由原中银中证 800 ETF 联接基金转型而来。中银中证 800 ETF 联接基金主要投资于中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“目标 ETF 基金”),目标 ETF 基金于 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,目标 ETF 终止上市或目标 ETF 基金合同终止,中银中证 800 ETF 联接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。本基金的基金管理人中银基金管理有限公司经与基金托管人中信银行股份有限公司协商一致,并报中国证券监督管理委员会备案,自 2022 年 10 月 10 日将中银中证 800 ETF 联接基金转型为“中银中证 800 指数型发起式证券投资基金”(以下简称“本基金”),《中银中证 800 指数型发起式证券投资基金基金合同》于同一日生效。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。

本基金为发起式基金,发起资金认购部分为 10,000,000.00 份基金份额,发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

根据《中银中证 800 指数型发起式证券投资基金招募说明书》,本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用的基金份额,并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为 A 类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费,并不收取认购/申购费用的基金份额,称为 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中银中证 800 指数型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股。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。本基金的投资组合比例为:投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%;投资于标的指数的成份股及其备选成份股的比例不低于非

现金基金资产的 80%，每个交易日日终在扣除股指期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：标的指数收益率 X 95%+银行人民币活期存款利率(税后) X 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 2024 年 3 月 28 日批准。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《中银中证 800 指数型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，发起式基金的基金合同生效三年后，若基金资产净值低于人民币两亿元的，基金合同自动终止。于 2023 年 12 月 31 日，本基金的基金资产净值为 11,222,119.17 元，且本基金的基金合同将于未来 12 个月内生效满三年，本基金的管理人预计基金资产净值届时将高于人民币两亿元，故本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2023 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金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。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

#### 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

#### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

### 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

### (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

### (3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

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

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。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。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现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）”。

#### 7.4.4.9 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。

#### 7.4.4.10 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。

#### 7.4.4.11 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。

#### 7.4.4.12 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。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

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



券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和可交换债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

### 7.4.5.3 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。

## 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。

资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	492,462.61	438,882.25
等于：本金	492,416.21	438,841.04
加：应计利息	46.40	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	492,462.61	438,882.25

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	10,916,836.48	-	10,137,525.71	-779,310.77	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	601,519.00	10,313.73	610,883.73	-949.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	601,519.00	10,313.73	610,883.73	-949.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	11,518,355.48	10,313.73	10,748,409.44	-780,259.77	
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	

股票		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

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

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。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

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。

##### 7.4.7.4.2 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。

#### 7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

#### 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-

应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	1,991.05	7,289.00
其中：交易所市场	1,991.05	7,289.00
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
应付审计费	30,000.00	30,000.00
合计	31,991.05	37,289.00

**7.4.7.7 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 2023年1月1日至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	10,499,201.64	10,499,201.64
本期申购	733,597.70	733,597.70
本期赎回（以“-”号填列）	-390,056.60	-390,056.60
本期末	10,842,742.74	10,842,742.74

**中银中证 800 指数型发起式 C**

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	146,455.53	146,455.53
本期申购	8,359,204.40	8,359,204.40
本期赎回（以“-”号填列）	-5,243,415.04	-5,243,415.04
本期末	3,262,244.89	3,262,244.89

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

**7.4.7.8 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
上年度末	-1,485,123.14	122,549.03	-1,362,574.11

本期期初	-1,485,123.14	122,549.03	-1,362,574.11
本期利润	62,238.51	-877,001.57	-814,763.06
本期基金份额交易产生的变动数	-47,948.77	25,540.41	-22,408.36
其中：基金申购款	-101,641.30	26,011.33	-75,629.97
基金赎回款	53,692.53	-470.92	53,221.61
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,470,833.40	-728,912.13	-2,199,745.53

### 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
上年度末	-21,205.26	1,655.53	-19,549.73
本期期初	-21,205.26	1,655.53	-19,549.73
本期利润	-7,057.90	-117,054.87	-124,112.77
本期基金份额交易产生的变动数	-436,452.31	-103,008.12	-539,460.43
其中：基金申购款	-1,172,447.29	-376,161.61	-1,548,608.90
基金赎回款	735,994.98	273,153.49	1,009,148.47
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-464,715.47	-218,407.46	-683,122.93

### 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年10月10日（基金合 同生效日）至2022年12月 31日
活期存款利息收入	1,428.41	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	32.89	107.58
其他	22.45	13.45
合计	1,483.75	588.12

### 7.4.7.10 股票投资收益

## 7.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年10月10日（基金合 同生效日）至2022年 12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-79,422.51	8,948.57
股票投资收益——赎回差价收入	-	-
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	-79,422.51	8,948.57

## 7.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年10月10日（基金合 同生效日）至2022年12月 31日
卖出股票成交总额	792,735.78	433,854.00
减：卖出股票成本总额	867,482.39	416,564.20
减：交易费用	4,675.90	8,341.23
买卖股票差价收入	-79,422.51	8,948.57

## 7.4.7.11 债券投资收益

## 7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年10月10日（基金合 同生效日）至2022年 12月31日
----	---------------------------------	---

债券投资收益——利息收入	12,352.33	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	-424.86	-
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	11,927.47	2,561.92

#### 7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年10月10日(基金合 同生效日)至2022年12 月31日
卖出债券(债转股及债券到期兑付)成交总额	517,538.82	-
减: 卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	506,582.50	-
减: 应计利息总额	11,380.93	-
减: 交易费用	0.25	-
买卖债券差价收入	-424.86	-

#### 7.4.7.12 资产支持证券投资收益

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。

#### 7.4.7.13 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。

#### 7.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年10月10日(基金合 同生效日)至2022年12月31日
股票投资产生的股利收益	203,837.58	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	203,837.58	15,264.13

#### 7.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年10月10日（基金合同 生效日）至2022年12月31日
1.交易性金融资产	-994,056.44	270,305.17
——股票投资	-994,299.94	271,595.17
——债券投资	243.50	-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	-994,056.44	270,305.17

#### 7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年10月10日（基金合同生效 日）至2022年12月31日
基金赎回费收入	1,017.07	43.96
基金转换费收入	53.74	-
合计	1,070.81	43.96

#### 7.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年10月10日（基金合同生效日）至2022年12月31日
审计费用	30,000.00	6,822.42
信息披露费	-	-
证券出借违约金	-	-
银行汇划费	609.00	112.50
其他	3.01	0.68
合计	30,612.01	6,935.60

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中银基金管理有限公司	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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

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。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

**7.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年10月10日（基金 合同生效日）至2022年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	45,336.92	9,400.03
其中：应支付销售机构的客户维护费	2,094.61	166.45
应支付基金管理人的净管理费	43,242.31	9,233.58

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。

**7.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年10月10日（基金 合同生效日）至2022年 12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	5,037.53	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。

**7.4.10.2.3 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 2023年1月1日至2023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	-	199.09	199.09
合计	-	199.09	199.09

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2022年10月10日（基金合同生效日）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	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：

日销售服务费 = 前一日 C 类的基金资产净值 × 0.40% / 当年天数。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

##### 7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

项目	本期		上年度可比期间	
	2023年1月1日至2023年12月31日		2022年10月10日（基金合同生效日）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	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	-	-	10,000,000.0 0	-
报告期初持有的基金 份额	10,000,000.00	-	-	-
报告期间申购/买入 总份额	-	-	-	-
报告期间因拆分变动 份额	-	-	-	-
减: 报告期间赎回/卖 出总份额	-	-	-	-
报告期末持有的基金 份额	10,000,000.00	-	10,000,000.0 0	-
报告期末持有的基金 份额占基金总份额比 例	92.23%	-	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。

#### 7.4.10.5.2 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。

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位: 人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年10月10日(基金合同生效日) 至2022年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信银行股份有限公司	492,462.61	1,428.41	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。

#### 7.4.10.7 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。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
127102	浙建转债	2023-12-25	1 个月内	配债未上市	100.00	100.01	2	200.00	200.01	-

##### 7.4.12.2 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。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2023 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。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 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。

#### 7.4.12.4 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。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 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。

#### 7.4.13.2 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。

#### 7.4.13.3 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。

#### 7.4.13.3.1 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。

除本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节中所列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，本基金本报告期末的其他资产均能及时变现。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同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。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或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。



## 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	492,462.61	-	-	-	492,462.61
结算备付金	6,247.19	-	-	-	6,247.19
存出保证金	532.28	-	-	-	532.28
交易性金融资产	610,683.72	-	200.01	10,137,525.71	10,748,409.44
应收申购款	-	-	-	137,549.79	137,549.79
资产总计	1,109,925.80	-	200.01	10,275,075.50	11,385,201.31
负债					
应付证券清算款	-	-	-	0.01	0.01
应付赎回款	-	-	-	125,826.29	125,826.29
应付管理人报酬	-	-	-	4,092.12	4,092.12
应付托管费	-	-	-	454.69	454.69
应付销售服务费	-	-	-	717.98	717.98
其他负债	-	-	-	31,991.05	31,991.05
负债总计	-	-	-	163,082.14	163,082.14
利率敏感度缺口	1,109,925.80	-	200.01	10,111,993.36	11,222,119.17
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
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。

#### 7.4.13.4.1.2 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）。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 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。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	10,137,525.71	90.34	8,352,635.00	90.17
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

合计	10,137,525.71	90.34	8,352,635.00	90.17
----	---------------	-------	--------------	-------

#### 7.4.13.4.3.2 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 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
	1. 业绩比较基准上升 5%	增加约 54	-
2. 业绩比较基准下降 5%	减少约 54	-	

注：于上年度末，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。

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	10,137,525.71	8,342,666.00
第二层次	610,883.73	516,426.01
第三层次	-	-
合计	10,748,409.44	8,859,092.01

###### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌

停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票、债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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

#### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	10,137,525.71	89.04
	其中:股票	10,137,525.71	89.04
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	610,883.73	5.37
	其中:债券	610,883.73	5.37
	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	498,709.80	4.38

8	其他各项资产	138,082.07	1.21
9	合计	11,385,201.31	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 期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

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	109,280.00	0.97
B	采矿业	477,588.50	4.26
C	制造业	5,768,063.55	51.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	351,364.00	3.13
E	建筑业	158,944.20	1.42
F	批发和零售业	143,684.86	1.28
G	交通运输、仓储和邮政业	266,885.00	2.38
H	住宿和餐饮业	9,104.00	0.08
I	信息传输、软件和信息技术服务业	585,829.80	5.22
J	金融业	1,837,148.80	16.37
K	房地产业	120,277.00	1.07
L	租赁和商务服务业	78,074.00	0.70
M	科学研究和技术服务业	107,339.40	0.96
N	水利、环境和公共设施管理业	12,152.00	0.11
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	8,160.00	0.07
Q	卫生和社会工作	52,338.60	0.47
R	文化、体育和娱乐业	39,409.00	0.35
S	综合	11,883.00	0.11
	合计	10,137,525.71	90.34

### 8.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

### 8.2.3 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。

## 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

### 8.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	300	517,800.00	4.61
2	300750	宁德时代	1,200	195,912.00	1.75
3	601318	中国平安	4,800	193,440.00	1.72
4	600036	招商银行	5,400	150,228.00	1.34
5	000858	五粮液	900	126,279.00	1.13
6	000333	美的集团	2,200	120,186.00	1.07
7	601166	兴业银行	6,300	102,123.00	0.91
8	600900	长江电力	4,300	100,362.00	0.89
9	601899	紫金矿业	7,300	90,958.00	0.81
10	600276	恒瑞医药	2,000	90,460.00	0.81
11	600030	中信证券	4,300	87,591.00	0.78
12	300760	迈瑞医疗	300	87,180.00	0.78
13	002594	比亚迪	400	79,200.00	0.71
14	300059	东方财富	5,640	79,185.60	0.71
15	002475	立讯精密	2,200	75,790.00	0.68
16	600887	伊利股份	2,800	74,900.00	0.67
17	601398	工商银行	15,000	71,700.00	0.64
18	601328	交通银行	11,800	67,732.00	0.60
19	603259	药明康德	900	65,484.00	0.58
20	000651	格力电器	2,000	64,340.00	0.57
21	688111	金山办公	200	63,240.00	0.56
22	000725	京东方 A	16,200	63,180.00	0.56
23	300124	汇川技术	1,000	63,140.00	0.56
24	601658	邮储银行	14,300	62,205.00	0.55
25	600795	国电电力	14,900	61,984.00	0.55
26	601012	隆基绿能	2,700	61,830.00	0.55
27	600309	万华化学	800	61,456.00	0.55
28	002415	海康威视	1,700	59,024.00	0.53
29	603233	大参林	2,240	55,776.00	0.50

30	600919	江苏银行	8,200	54,858.00	0.49
31	000568	泸州老窖	300	53,826.00	0.48
32	688981	中芯国际	1,000	53,020.00	0.47
33	000975	银泰黄金	3,400	51,000.00	0.45
34	601816	京沪高铁	10,100	49,692.00	0.44
35	002714	牧原股份	1,200	49,416.00	0.44
36	601288	农业银行	13,300	48,412.00	0.43
37	601088	中国神华	1,500	47,025.00	0.42
38	600809	山西汾酒	200	46,146.00	0.41
39	002352	顺丰控股	1,100	44,440.00	0.40
40	300498	温氏股份	2,200	44,132.00	0.39
41	600028	中国石化	7,900	44,082.00	0.39
42	300274	阳光电源	500	43,795.00	0.39
43	688041	海光信息	600	42,588.00	0.38
44	601668	中国建筑	8,800	42,328.00	0.38
45	600406	国电南瑞	1,840	41,068.80	0.37
46	600941	中国移动	400	39,792.00	0.35
47	600016	民生银行	10,600	39,644.00	0.35
48	000001	平安银行	4,100	38,499.00	0.34
49	000792	盐湖股份	2,400	38,280.00	0.34
50	002230	科大讯飞	800	37,104.00	0.33
51	000063	中兴通讯	1,400	37,072.00	0.33
52	601728	中国电信	6,800	36,788.00	0.33
53	601988	中国银行	9,200	36,708.00	0.33
54	600837	海通证券	3,900	36,543.00	0.33
55	600031	三一重工	2,600	35,802.00	0.32
56	601601	中国太保	1,500	35,670.00	0.32
57	601225	陕西煤业	1,700	35,513.00	0.32
58	600050	中国联通	8,100	35,478.00	0.32
59	601857	中国石油	5,000	35,300.00	0.31
60	600000	浦发银行	5,200	34,424.00	0.31
61	002142	宁波银行	1,700	34,187.00	0.30
62	300308	中际旭创	300	33,873.00	0.30
63	000625	长安汽车	2,000	33,660.00	0.30
64	300122	智飞生物	550	33,610.50	0.30
65	600690	海尔智家	1,600	33,600.00	0.30
66	601888	中国中免	400	33,476.00	0.30
67	002304	洋河股份	300	32,970.00	0.29
68	300015	爱尔眼科	2,080	32,905.60	0.29
69	000100	TCL 科技	7,600	32,680.00	0.29
70	601688	华泰证券	2,300	32,085.00	0.29
71	603501	韦尔股份	300	32,013.00	0.29
72	000002	万 科 A	3,000	31,380.00	0.28
73	688012	中微公司	200	30,720.00	0.27

74	600048	保利发展	3,100	30,690.00	0.27
75	600438	通威股份	1,200	30,036.00	0.27
76	000338	潍柴动力	2,200	30,030.00	0.27
77	600150	中国船舶	1,000	29,440.00	0.26
78	002050	三花智控	1,000	29,400.00	0.26
79	600089	特变电工	2,120	29,256.00	0.26
80	601985	中国核电	3,800	28,500.00	0.25
81	600104	上汽集团	2,100	28,413.00	0.25
82	300782	卓胜微	200	28,200.00	0.25
83	002466	天齐锂业	500	27,895.00	0.25
84	603986	兆易创新	300	27,717.00	0.25
85	688036	传音控股	200	27,680.00	0.25
86	688271	联影医疗	200	27,402.00	0.24
87	688256	寒武纪	200	26,992.00	0.24
88	601211	国泰君安	1,800	26,784.00	0.24
89	601169	北京银行	5,900	26,727.00	0.24
90	603288	海天味业	700	26,565.00	0.24
91	600660	福耀玻璃	700	26,173.00	0.23
92	688390	固德威	200	26,116.00	0.23
93	601919	中远海控	2,700	25,866.00	0.23
94	601766	中国中车	4,800	25,248.00	0.22
95	601229	上海银行	4,200	25,074.00	0.22
96	600905	三峡能源	5,700	24,909.00	0.22
97	002027	分众传媒	3,900	24,648.00	0.22
98	002371	北方华创	100	24,571.00	0.22
99	601390	中国中铁	4,300	24,424.00	0.22
100	600436	片仔癀	100	24,199.00	0.22
101	601138	工业富联	1,600	24,192.00	0.22
102	688008	澜起科技	400	23,504.00	0.21
103	000596	古井贡酒	100	23,280.00	0.21
104	002179	中航光电	590	23,010.00	0.21
105	600585	海螺水泥	1,000	22,560.00	0.20
106	600019	宝钢股份	3,800	22,534.00	0.20
107	601818	光大银行	7,700	22,330.00	0.20
108	600760	中航沈飞	520	21,933.60	0.20
109	600999	招商证券	1,600	21,824.00	0.19
110	002460	赣锋锂业	500	21,400.00	0.19
111	600111	北方稀土	1,100	21,274.00	0.19
112	300014	亿纬锂能	500	21,100.00	0.19
113	601989	中国重工	5,100	21,063.00	0.19
114	002241	歌尔股份	1,000	21,010.00	0.19
115	002129	TCL 中环	1,325	20,723.00	0.18
116	601600	中国铝业	3,600	20,304.00	0.18
117	002049	紫光国微	300	20,235.00	0.18



118	601006	大秦铁路	2,800	20,188.00	0.18
119	600958	东方证券	2,300	20,010.00	0.18
120	601628	中国人寿	700	19,845.00	0.18
121	603799	华友钴业	600	19,758.00	0.18
122	603019	中科曙光	500	19,745.00	0.18
123	000538	云南白药	400	19,660.00	0.18
124	601939	建设银行	3,000	19,530.00	0.17
125	000938	紫光股份	1,000	19,350.00	0.17
126	600938	中国海油	900	18,873.00	0.17
127	600893	航发动力	500	18,690.00	0.17
128	000776	广发证券	1,300	18,577.00	0.17
129	601377	兴业证券	3,100	18,197.00	0.16
130	688516	奥特维	200	18,100.00	0.16
131	002311	海大集团	400	17,964.00	0.16
132	600584	长电科技	600	17,916.00	0.16
133	000166	申万宏源	4,000	17,760.00	0.16
134	002252	上海莱士	2,200	17,600.00	0.16
135	600845	宝信软件	360	17,568.00	0.16
136	002422	科伦药业	600	17,430.00	0.16
137	002271	东方雨虹	900	17,280.00	0.15
138	600570	恒生电子	600	17,256.00	0.15
139	688114	华大智造	200	17,204.00	0.15
140	601669	中国电建	3,500	17,115.00	0.15
141	002812	恩捷股份	300	17,046.00	0.15
142	600745	闻泰科技	400	16,924.00	0.15
143	000963	华东医药	400	16,584.00	0.15
144	600426	华鲁恒升	600	16,554.00	0.15
145	600009	上海机场	500	16,390.00	0.15
146	600085	同仁堂	300	16,110.00	0.14
147	300496	中科创达	200	16,012.00	0.14
148	600547	山东黄金	700	16,009.00	0.14
149	000425	徐工机械	2,900	15,834.00	0.14
150	300033	同花顺	100	15,687.00	0.14
151	002028	思源电气	300	15,612.00	0.14
152	601916	浙商银行	6,100	15,372.00	0.14
153	601995	中金公司	400	15,220.00	0.14
154	300418	昆仑万维	400	14,960.00	0.13
155	600600	青岛啤酒	200	14,950.00	0.13
156	300502	新易盛	300	14,796.00	0.13
157	002236	大华股份	800	14,760.00	0.13
158	300408	三环集团	500	14,725.00	0.13
159	601689	拓普集团	200	14,700.00	0.13
160	603369	今世缘	300	14,625.00	0.13
161	000661	长春高新	100	14,580.00	0.13

162	300142	沃森生物	600	14,106.00	0.13
163	688220	翱捷科技	200	14,088.00	0.13
164	600926	杭州银行	1,400	14,014.00	0.12
165	601111	中国国航	1,900	13,946.00	0.12
166	301236	软通动力	300	13,860.00	0.12
167	600115	中国东航	3,500	13,580.00	0.12
168	688363	华熙生物	200	13,386.00	0.12
169	601009	南京银行	1,800	13,284.00	0.12
170	000977	浪潮信息	400	13,280.00	0.12
171	300316	晶盛机电	300	13,227.00	0.12
172	688234	天岳先进	200	13,214.00	0.12
173	600886	国投电力	1,000	13,180.00	0.12
174	002555	三七互娱	700	13,167.00	0.12
175	601799	星宇股份	100	13,111.00	0.12
176	603993	洛阳钼业	2,500	13,000.00	0.12
177	002920	德赛西威	100	12,951.00	0.12
177	300751	迈为股份	100	12,951.00	0.12
179	600188	兖矿能源	650	12,876.50	0.11
180	002459	晶澳科技	620	12,846.40	0.11
181	601633	长城汽车	500	12,610.00	0.11
182	688099	晶晨股份	200	12,526.00	0.11
183	600196	复星医药	500	12,515.00	0.11
184	600588	用友网络	700	12,453.00	0.11
185	688331	荣昌生物	200	12,412.00	0.11
186	001979	招商蛇口	1,300	12,389.00	0.11
187	600015	华夏银行	2,200	12,364.00	0.11
188	601186	中国铁建	1,600	12,176.00	0.11
189	688126	沪硅产业	700	12,124.00	0.11
190	600674	川投能源	800	12,096.00	0.11
191	002601	龙佰集团	700	11,991.00	0.11
192	000988	华工科技	400	11,904.00	0.11
193	601066	中信建投	500	11,830.00	0.11
194	600989	宝丰能源	800	11,816.00	0.11
195	000733	振华科技	200	11,768.00	0.10
196	002821	凯莱英	100	11,610.00	0.10
197	300759	康龙化成	400	11,592.00	0.10
198	300661	圣邦股份	130	11,571.30	0.10
199	600011	华能国际	1,500	11,550.00	0.10
200	600010	包钢股份	7,900	11,534.00	0.10
201	688599	天合光能	400	11,412.00	0.10
202	002493	荣盛石化	1,100	11,385.00	0.10
203	601901	方正证券	1,400	11,284.00	0.10
204	000768	中航西飞	500	11,185.00	0.10
205	002517	恺英网络	1,000	11,170.00	0.10

206	000157	中联重科	1,700	11,101.00	0.10
207	002463	沪电股份	500	11,060.00	0.10
208	688065	凯赛生物	200	10,996.00	0.10
209	300347	泰格医药	200	10,994.00	0.10
210	688276	百克生物	200	10,962.00	0.10
211	600029	南方航空	1,900	10,944.00	0.10
212	601100	恒立液压	200	10,936.00	0.10
213	300601	康泰生物	400	10,860.00	0.10
214	601360	三六零	1,200	10,812.00	0.10
215	601788	光大证券	700	10,794.00	0.10
216	688520	神州细胞	200	10,774.00	0.10
217	000895	双汇发展	400	10,684.00	0.10
218	688122	西部超导	200	10,646.00	0.09
219	002410	广联达	620	10,626.80	0.09
220	301269	华大九天	100	10,585.00	0.09
221	601058	赛轮轮胎	900	10,575.00	0.09
222	600157	永泰能源	7,700	10,549.00	0.09
223	600372	中航机载	800	10,544.00	0.09
224	603392	万泰生物	140	10,518.20	0.09
225	600515	海南机场	2,800	10,360.00	0.09
226	300450	先导智能	400	10,240.00	0.09
227	601555	东吴证券	1,400	10,234.00	0.09
228	603260	合盛硅业	200	10,200.00	0.09
229	002001	新和成	600	10,176.00	0.09
230	601021	春秋航空	200	10,040.00	0.09
231	002709	天赐材料	400	10,032.00	0.09
232	688521	芯原股份	200	9,992.00	0.09
233	601168	西部矿业	700	9,989.00	0.09
234	600489	中金黄金	1,000	9,960.00	0.09
235	000999	华润三九	200	9,946.00	0.09
236	600079	人福医药	400	9,944.00	0.09
237	000423	东阿阿胶	200	9,864.00	0.09
238	002340	格林美	1,800	9,828.00	0.09
239	600418	江淮汽车	600	9,690.00	0.09
240	601881	中国银河	800	9,640.00	0.09
241	603939	益丰药房	240	9,609.60	0.09
242	300699	光威复材	360	9,601.20	0.09
243	603195	公牛集团	100	9,565.00	0.09
244	300037	新宙邦	200	9,460.00	0.08
245	601868	中国能建	4,500	9,450.00	0.08
246	000786	北新建材	400	9,344.00	0.08
247	601336	新华保险	300	9,339.00	0.08
248	600129	太极集团	200	9,292.00	0.08
249	600161	天坛生物	300	9,282.00	0.08

250	600563	法拉电子	100	9,260.00	0.08
251	002156	通富微电	400	9,248.00	0.08
252	300433	蓝思科技	700	9,240.00	0.08
253	002603	以岭药业	400	9,228.00	0.08
254	600346	恒力石化	700	9,219.00	0.08
255	300394	天孚通信	100	9,152.00	0.08
255	002841	视源股份	200	9,152.00	0.08
257	601800	中国交建	1,200	9,120.00	0.08
258	603659	璞泰来	435	9,104.55	0.08
259	002384	东山精密	500	9,090.00	0.08
260	601233	桐昆股份	600	9,078.00	0.08
261	603589	口子窖	200	9,060.00	0.08
262	002180	纳思达	400	9,052.00	0.08
263	601838	成都银行	800	9,008.00	0.08
264	601077	渝农商行	2,200	8,976.00	0.08
265	002738	中矿资源	240	8,954.40	0.08
266	688396	华润微	200	8,938.00	0.08
267	300144	宋城演艺	900	8,883.00	0.08
268	300866	安克创新	100	8,860.00	0.08
269	002007	华兰生物	400	8,852.00	0.08
270	688002	睿创微纳	200	8,844.00	0.08
271	601699	潞安环能	400	8,764.00	0.08
272	603688	石英股份	100	8,688.00	0.08
273	000301	东方盛虹	900	8,640.00	0.08
274	601877	正泰电器	400	8,604.00	0.08
275	002074	国轩高科	400	8,600.00	0.08
276	600332	白云山	300	8,580.00	0.08
277	603606	东方电缆	200	8,550.00	0.08
278	002736	国信证券	1,000	8,540.00	0.08
279	601108	财通证券	1,100	8,536.00	0.08
280	000630	铜陵有色	2,600	8,528.00	0.08
281	300012	华测检测	600	8,520.00	0.08
282	002850	科达利	100	8,446.00	0.08
283	002044	美年健康	1,400	8,414.00	0.07
284	600988	赤峰黄金	600	8,406.00	0.07
285	000933	神火股份	500	8,400.00	0.07
286	002966	苏州银行	1,300	8,398.00	0.07
287	003816	中国广核	2,700	8,397.00	0.07
288	605117	德业股份	100	8,390.00	0.07
289	688180	君实生物	200	8,366.00	0.07
290	600536	中国软件	230	8,339.80	0.07
291	600885	宏发股份	300	8,292.00	0.07
292	601117	中国化学	1,300	8,268.00	0.07
293	002648	卫星化学	560	8,260.00	0.07

294	600160	巨化股份	500	8,245.00	0.07
295	000009	中国宝安	700	8,218.00	0.07
296	600486	扬农化工	130	8,205.60	0.07
297	600109	国金证券	900	8,172.00	0.07
298	002607	中公教育	2,000	8,160.00	0.07
299	600741	华域汽车	500	8,140.00	0.07
300	002262	恩华药业	300	8,136.00	0.07
301	002138	顺络电子	300	8,103.00	0.07
302	002439	启明星辰	300	8,100.00	0.07
303	300003	乐普医疗	500	8,080.00	0.07
304	688561	奇安信	200	8,018.00	0.07
305	002202	金风科技	1,000	8,000.00	0.07
306	688005	容百科技	200	7,960.00	0.07
307	300487	蓝晓科技	150	7,959.00	0.07
308	688778	厦钨新能	200	7,928.00	0.07
309	000983	山西焦煤	800	7,904.00	0.07
310	600176	中国巨石	800	7,864.00	0.07
311	002472	双环传动	300	7,806.00	0.07
312	002865	钧达股份	100	7,748.00	0.07
313	688385	复旦微电	200	7,726.00	0.07
314	002465	海格通信	600	7,710.00	0.07
315	002185	华天科技	900	7,668.00	0.07
316	688297	中无人机	200	7,666.00	0.07
317	601618	中国中冶	2,500	7,650.00	0.07
318	600765	中航重机	400	7,644.00	0.07
319	300073	当升科技	200	7,640.00	0.07
320	000408	藏格矿业	300	7,602.00	0.07
321	300604	长川科技	200	7,598.00	0.07
322	300413	芒果超媒	300	7,560.00	0.07
322	600352	浙江龙盛	900	7,560.00	0.07
324	002432	九安医疗	200	7,534.00	0.07
325	601615	明阳智能	600	7,524.00	0.07
326	603899	晨光股份	200	7,510.00	0.07
327	600155	华创云信	900	7,506.00	0.07
328	000876	新希望	800	7,456.00	0.07
329	601162	天风证券	2,400	7,416.00	0.07
330	600732	爱旭股份	420	7,408.80	0.07
331	300724	捷佳伟创	100	7,401.00	0.07
332	002625	光启技术	500	7,390.00	0.07
333	300207	欣旺达	500	7,380.00	0.07
334	600023	浙能电力	1,600	7,376.00	0.07
335	600233	圆通速递	600	7,374.00	0.07
336	688107	安路科技	200	7,356.00	0.07
337	600039	四川路桥	980	7,340.20	0.07

338	600183	生益科技	400	7,324.00	0.07
339	600415	小商品城	1,000	7,320.00	0.07
340	300395	菲利华	200	7,312.00	0.07
341	002078	太阳纸业	600	7,302.00	0.07
342	601878	浙商证券	700	7,301.00	0.07
343	688187	时代电气	200	7,266.00	0.06
344	300454	深信服	100	7,229.00	0.06
345	000932	华菱钢铁	1,400	7,210.00	0.06
346	600482	中国动力	400	7,204.00	0.06
347	002385	大北农	1,200	7,152.00	0.06
348	600362	江西铜业	400	7,144.00	0.06
349	002916	深南电路	100	7,099.00	0.06
350	300628	亿联网络	240	7,092.00	0.06
351	000066	中国长城	700	7,084.00	0.06
352	300136	信维通信	300	7,080.00	0.06
353	300474	景嘉微	100	7,071.00	0.06
354	300118	东方日升	400	7,060.00	0.06
355	600219	南山铝业	2,400	7,056.00	0.06
356	600298	安琪酵母	200	7,036.00	0.06
357	603816	顾家家居	200	7,000.00	0.06
357	601238	广汽集团	800	7,000.00	0.06
359	000783	长江证券	1,300	6,994.00	0.06
360	300763	锦浪科技	100	6,990.00	0.06
361	002797	第一创业	1,200	6,972.00	0.06
362	603833	欧派家居	100	6,961.00	0.06
363	300285	国瓷材料	300	6,936.00	0.06
364	603596	伯特利	100	6,930.00	0.06
365	002223	鱼跃医疗	200	6,916.00	0.06
366	603160	汇顶科技	100	6,910.00	0.06
367	600839	四川长虹	1,300	6,877.00	0.06
368	600918	中泰证券	1,000	6,860.00	0.06
369	600460	士兰微	300	6,849.00	0.06
370	300957	贝泰妮	100	6,817.00	0.06
371	300146	汤臣倍健	400	6,812.00	0.06
372	603806	福斯特	280	6,795.60	0.06
373	002756	永兴材料	130	6,787.30	0.06
374	002273	水晶光电	500	6,770.00	0.06
375	002600	领益智造	1,000	6,760.00	0.06
376	002444	巨星科技	300	6,756.00	0.06
377	601607	上海医药	400	6,692.00	0.06
378	600873	梅花生物	700	6,685.00	0.06
379	002558	巨人网络	600	6,684.00	0.06
380	300999	金龙鱼	200	6,676.00	0.06
381	603737	三棵树	140	6,665.40	0.06

382	600862	中航高科	300	6,645.00	0.06
382	600132	重庆啤酒	100	6,645.00	0.06
384	600066	宇通客车	500	6,625.00	0.06
385	600177	雅戈尔	1,000	6,550.00	0.06
386	002294	信立泰	200	6,532.00	0.06
387	688567	孚能科技	400	6,524.00	0.06
388	002739	万达电影	500	6,510.00	0.06
389	601872	招商轮船	1,100	6,468.00	0.06
390	300223	北京君正	100	6,465.00	0.06
391	300058	蓝色光标	900	6,462.00	0.06
392	002407	多氟多	420	6,392.40	0.06
393	601128	常熟银行	1,000	6,390.00	0.06
394	601990	南京证券	800	6,384.00	0.06
395	603893	瑞芯微	100	6,340.00	0.06
396	603712	七一二	200	6,302.00	0.06
397	300212	易华录	200	6,290.00	0.06
398	300017	网宿科技	800	6,280.00	0.06
399	600060	海信视像	300	6,270.00	0.06
400	603882	金域医学	100	6,257.00	0.06
401	600096	云天化	400	6,240.00	0.06
402	002008	大族激光	300	6,216.00	0.06
403	688223	晶科能源	700	6,202.00	0.06
404	601696	中银证券	600	6,174.00	0.06
405	300568	星源材质	400	6,168.00	0.05
405	600879	航天电子	800	6,168.00	0.05
407	000728	国元证券	900	6,147.00	0.05
408	688728	格科微	300	6,141.00	0.05
409	002195	岩山科技	2,000	6,140.00	0.05
410	600061	国投资本	900	6,066.00	0.05
411	600497	驰宏锌锗	1,200	6,060.00	0.05
412	300001	特锐德	300	6,030.00	0.05
413	300776	帝尔激光	100	6,026.00	0.05
414	300088	长信科技	900	6,021.00	0.05
415	002532	天山铝业	1,000	6,010.00	0.05
416	000723	美锦能源	900	5,994.00	0.05
417	600754	锦江酒店	200	5,980.00	0.05
418	002595	豪迈科技	200	5,954.00	0.05
419	689009	九号公司	200	5,932.00	0.05
420	002624	完美世界	500	5,920.00	0.05
421	688303	大全能源	200	5,914.00	0.05
422	002368	太极股份	200	5,906.00	0.05
423	603826	坤彩科技	100	5,903.00	0.05
424	000997	新大陆	300	5,883.00	0.05
425	600348	华阳股份	600	5,856.00	0.05

426	600875	东方电气	400	5,848.00	0.05
427	002430	杭氧股份	200	5,842.00	0.05
428	600399	抚顺特钢	600	5,832.00	0.05
429	300390	天华新能	230	5,830.50	0.05
430	601998	中信银行	1,100	5,819.00	0.05
431	601898	中煤能源	600	5,814.00	0.05
432	600895	张江高科	300	5,790.00	0.05
433	601666	平煤股份	500	5,780.00	0.05
434	600642	申能股份	900	5,778.00	0.05
435	601966	玲珑轮胎	300	5,769.00	0.05
436	601198	东兴证券	700	5,761.00	0.05
437	002673	西部证券	900	5,733.00	0.05
438	603658	安图生物	100	5,701.00	0.05
439	002281	光迅科技	200	5,700.00	0.05
440	000998	隆平高科	400	5,640.00	0.05
441	002353	杰瑞股份	200	5,622.00	0.05
442	000708	中信特钢	400	5,616.00	0.05
443	603000	人民网	200	5,596.00	0.05
444	688819	天能股份	200	5,584.00	0.05
445	000591	太阳能	1,000	5,580.00	0.05
446	002409	雅克科技	100	5,573.00	0.05
447	000831	中国稀土	200	5,534.00	0.05
448	688690	纳微科技	200	5,484.00	0.05
449	605358	立昂微	200	5,478.00	0.05
450	600141	兴发集团	300	5,475.00	0.05
451	002131	利欧股份	2,400	5,472.00	0.05
452	600884	杉杉股份	400	5,448.00	0.05
453	002192	融捷股份	100	5,421.00	0.05
454	600867	通化东宝	500	5,415.00	0.05
455	600699	均胜电子	300	5,388.00	0.05
456	000703	恒逸石化	800	5,376.00	0.05
457	603517	绝味食品	200	5,372.00	0.05
458	600583	海油工程	900	5,346.00	0.05
459	601865	福莱特	200	5,340.00	0.05
460	601319	中国人保	1,100	5,324.00	0.05
461	002032	苏泊尔	100	5,301.00	0.05
462	000683	远兴能源	900	5,283.00	0.05
463	600499	科达制造	500	5,275.00	0.05
464	600637	东方明珠	700	5,264.00	0.05
464	300979	华利集团	100	5,264.00	0.05
466	600546	山煤国际	300	5,253.00	0.05
467	000893	亚钾国际	200	5,248.00	0.05
468	600516	方大炭素	1,000	5,240.00	0.05
469	002497	雅化集团	400	5,236.00	0.05



470	601698	中国卫通	300	5,193.00	0.05
471	600025	华能水电	600	5,178.00	0.05
472	600118	中国卫星	200	5,164.00	0.05
473	300558	贝达药业	100	5,155.00	0.05
474	002299	圣农发展	300	5,154.00	0.05
474	600549	厦门钨业	300	5,154.00	0.05
476	600170	上海建工	2,200	5,148.00	0.05
477	601997	贵阳银行	1,000	5,140.00	0.05
478	600529	山东药玻	200	5,120.00	0.05
479	603338	浙江鼎力	100	5,117.00	0.05
480	600535	天士力	300	5,106.00	0.05
481	600392	盛和资源	500	5,090.00	0.05
482	600803	新奥股份	300	5,046.00	0.04
483	603267	鸿远电子	100	5,020.00	0.04
484	600985	淮北矿业	300	4,989.00	0.04
485	600380	健康元	400	4,972.00	0.04
486	603077	和邦生物	2,100	4,956.00	0.04
487	002065	东华软件	800	4,936.00	0.04
488	002568	百润股份	200	4,922.00	0.04
489	000629	钒钛股份	1,500	4,920.00	0.04
490	300919	中伟股份	100	4,913.00	0.04
491	600369	西南证券	1,200	4,908.00	0.04
492	002152	广电运通	400	4,904.00	0.04
493	600018	上港集团	1,000	4,900.00	0.04
494	600004	白云机场	500	4,890.00	0.04
495	600909	华安证券	1,000	4,880.00	0.04
496	600704	物产中大	1,100	4,873.00	0.04
497	000021	深科技	300	4,863.00	0.04
498	300383	光环新网	500	4,860.00	0.04
498	000617	中油资本	900	4,860.00	0.04
500	603456	九洲药业	200	4,842.00	0.04
501	600153	建发股份	500	4,815.00	0.04
502	002025	航天电器	100	4,802.00	0.04
503	002939	长城证券	600	4,800.00	0.04
503	300676	华大基因	100	4,800.00	0.04
505	600143	金发科技	600	4,794.00	0.04
506	600859	王府井	300	4,791.00	0.04
507	601577	长沙银行	700	4,774.00	0.04
508	300244	迪安诊断	200	4,762.00	0.04
509	688208	道通科技	200	4,750.00	0.04
510	300024	机器人	400	4,748.00	0.04
511	002414	高德红外	650	4,745.00	0.04
512	600739	辽宁成大	400	4,712.00	0.04
513	002064	华峰化学	700	4,697.00	0.04

514	600435	北方导航	400	4,696.00	0.04
515	300677	英科医疗	200	4,672.00	0.04
516	603185	弘元绿能	140	4,659.20	0.04
517	600166	福田汽车	1,700	4,641.00	0.04
518	600820	隧道股份	800	4,608.00	0.04
519	000750	国海证券	1,300	4,602.00	0.04
520	000039	中集集团	600	4,590.00	0.04
521	603026	胜华新材	100	4,586.00	0.04
522	002240	盛新锂能	200	4,550.00	0.04
523	000623	吉林敖东	300	4,542.00	0.04
524	300595	欧普康视	200	4,516.00	0.04
525	002268	电科网安	200	4,492.00	0.04
526	601216	君正集团	1,200	4,488.00	0.04
527	002373	千方科技	400	4,484.00	0.04
528	002938	鹏鼎控股	200	4,464.00	0.04
528	002429	兆驰股份	800	4,464.00	0.04
530	002203	海亮股份	400	4,460.00	0.04
531	600398	海澜之家	600	4,452.00	0.04
532	300529	健帆生物	200	4,446.00	0.04
533	002019	亿帆医药	300	4,434.00	0.04
534	688772	珠海冠宇	200	4,402.00	0.04
535	600521	华海药业	300	4,401.00	0.04
536	000400	许继电气	200	4,392.00	0.04
537	600998	九州通	626	4,388.26	0.04
538	002506	协鑫集成	1,600	4,384.00	0.04
539	300114	中航电测	100	4,375.00	0.04
540	000878	云南铜业	400	4,356.00	0.04
540	002508	老板电器	200	4,356.00	0.04
542	000069	华侨城 A	1,400	4,354.00	0.04
543	600655	豫园股份	700	4,347.00	0.04
544	002372	伟星新材	300	4,341.00	0.04
545	601456	国联证券	400	4,336.00	0.04
546	600325	华发股份	600	4,326.00	0.04
547	000729	燕京啤酒	500	4,315.00	0.04
548	300253	卫宁健康	600	4,314.00	0.04
549	002500	山西证券	800	4,312.00	0.04
550	000960	锡业股份	300	4,296.00	0.04
551	600863	内蒙华电	1,100	4,290.00	0.04
552	002128	电投能源	300	4,281.00	0.04
553	002092	中泰化学	700	4,270.00	0.04
554	000050	深天马 A	400	4,260.00	0.04
554	603225	新凤鸣	300	4,260.00	0.04
556	600271	航天信息	400	4,256.00	0.04
557	603156	养元饮品	200	4,252.00	0.04

558	600021	上海电力	500	4,230.00	0.04
558	601933	永辉超市	1,500	4,230.00	0.04
560	000519	中兵红箭	300	4,212.00	0.04
561	601016	节能风电	1,400	4,200.00	0.04
561	300296	利亚德	700	4,200.00	0.04
563	603486	科沃斯	100	4,144.00	0.04
564	601636	旗滨集团	600	4,104.00	0.04
565	000636	风华高科	300	4,098.00	0.04
566	300009	安科生物	400	4,088.00	0.04
567	600282	南钢股份	1,100	4,070.00	0.04
568	002056	横店东磁	300	4,062.00	0.04
569	002791	坚朗五金	100	4,049.00	0.04
570	600008	首创环保	1,500	4,035.00	0.04
571	002683	广东宏大	200	4,016.00	0.04
572	000830	鲁西化工	400	4,012.00	0.04
573	000877	天山股份	600	4,008.00	0.04
574	300070	碧水源	800	3,992.00	0.04
575	000155	川能动力	300	3,987.00	0.04
576	000738	航发控制	200	3,980.00	0.04
577	002936	郑州银行	1,980	3,979.80	0.04
578	603305	旭升集团	200	3,946.00	0.04
579	000060	中金岭南	900	3,888.00	0.03
580	002926	华西证券	500	3,880.00	0.03
581	600038	中直股份	100	3,853.00	0.03
582	601717	郑煤机	300	3,795.00	0.03
583	601880	辽港股份	2,600	3,770.00	0.03
584	600906	财达证券	500	3,750.00	0.03
585	600390	五矿资本	800	3,744.00	0.03
586	600970	中材国际	400	3,736.00	0.03
587	002120	韵达股份	500	3,730.00	0.03
588	002670	国盛金控	400	3,728.00	0.03
589	300888	稳健医疗	100	3,725.00	0.03
590	600528	中铁工业	500	3,720.00	0.03
591	002507	涪陵榨菜	260	3,715.40	0.03
592	000887	中鼎股份	300	3,711.00	0.03
593	600977	中国电影	300	3,672.00	0.03
594	300373	扬杰科技	100	3,670.00	0.03
595	600673	东阳光	500	3,665.00	0.03
596	003022	联泓新科	200	3,662.00	0.03
597	688538	和辉光电	1,500	3,645.00	0.03
598	603885	吉祥航空	300	3,600.00	0.03
599	600580	卧龙电驱	300	3,519.00	0.03
600	000513	丽珠集团	100	3,501.00	0.03
601	601000	唐山港	1,000	3,500.00	0.03

602	600755	厦门国贸	500	3,485.00	0.03
603	002557	洽洽食品	100	3,482.00	0.03
604	002531	天顺风能	300	3,480.00	0.03
605	601179	中国西电	700	3,451.00	0.03
606	600606	绿地控股	1,500	3,450.00	0.03
607	601155	新城控股	300	3,423.00	0.03
608	000598	兴蓉环境	600	3,414.00	0.03
609	002958	青农商行	1,300	3,406.00	0.03
610	603858	步长制药	200	3,402.00	0.03
611	603379	三美股份	100	3,400.00	0.03
612	600481	双良节能	400	3,384.00	0.03
613	600707	彩虹股份	500	3,375.00	0.03
614	600329	达仁堂	100	3,365.00	0.03
615	600056	中国医药	300	3,351.00	0.03
616	000547	航天发展	400	3,348.00	0.03
617	002155	湖南黄金	300	3,342.00	0.03
618	603650	彤程新材	100	3,330.00	0.03
619	300861	美畅股份	100	3,329.00	0.03
620	600498	烽火通信	200	3,328.00	0.03
621	603127	昭衍新药	140	3,319.40	0.03
622	600737	中粮糖业	400	3,296.00	0.03
623	300682	朗新集团	200	3,278.00	0.03
624	601866	中远海发	1,400	3,276.00	0.03
625	600582	天地科技	600	3,264.00	0.03
626	300251	光线传媒	400	3,260.00	0.03
627	600208	新湖中宝	1,500	3,255.00	0.03
628	300748	金力永磁	160	3,235.20	0.03
629	000027	深圳能源	500	3,225.00	0.03
630	603568	伟明环保	200	3,200.00	0.03
631	002572	索菲亚	200	3,190.00	0.03
632	002080	中材科技	200	3,184.00	0.03
633	300850	新强联	100	3,183.00	0.03
634	600416	湘电股份	200	3,176.00	0.03
635	002408	齐翔腾达	600	3,168.00	0.03
636	601991	大唐发电	1,300	3,146.00	0.03
637	601598	中国外运	600	3,144.00	0.03
638	600566	济川药业	100	3,143.00	0.03
639	600959	江苏有线	1,000	3,140.00	0.03
640	601665	齐鲁银行	800	3,128.00	0.03
641	600258	首旅酒店	200	3,124.00	0.03
642	000970	中科三环	300	3,105.00	0.03
643	000739	普洛药业	200	3,078.00	0.03
644	002266	浙富控股	900	3,060.00	0.03
645	000778	新兴铸管	800	3,056.00	0.03

646	600378	昊华科技	100	3,048.00	0.03
647	002867	周大生	200	3,036.00	0.03
648	600131	国网信通	200	3,030.00	0.03
649	601231	环旭电子	200	3,022.00	0.03
650	600848	上海临港	300	3,015.00	0.03
651	000581	威孚高科	200	3,014.00	0.03
652	000987	越秀资本	500	3,010.00	0.03
653	002511	中顺洁柔	300	3,000.00	0.03
653	603707	健友股份	200	3,000.00	0.03
655	603927	中科软	100	2,998.00	0.03
656	603883	老百姓	100	2,989.00	0.03
657	000825	太钢不锈	800	2,984.00	0.03
658	000709	河钢股份	1,400	2,982.00	0.03
659	300026	红日药业	700	2,968.00	0.03
660	000883	湖北能源	700	2,961.00	0.03
661	601156	东航物流	200	2,956.00	0.03
662	601808	中海油服	200	2,924.00	0.03
663	002244	滨江集团	400	2,908.00	0.03
664	002030	达安基因	300	2,904.00	0.03
665	300357	我武生物	100	2,900.00	0.03
666	601106	中国一重	1,000	2,880.00	0.03
667	601992	金隅集团	1,500	2,865.00	0.03
668	600517	国网英大	600	2,862.00	0.03
668	600511	国药股份	100	2,862.00	0.03
670	000937	冀中能源	400	2,856.00	0.03
671	600827	百联股份	300	2,847.00	0.03
672	601958	金钼股份	300	2,835.00	0.03
673	300438	鹏辉能源	100	2,829.00	0.03
674	002518	科士达	100	2,760.00	0.02
675	002831	裕同科技	100	2,751.00	0.02
676	600901	江苏金租	560	2,710.40	0.02
677	600126	杭钢股份	500	2,665.00	0.02
678	002487	大金重工	100	2,662.00	0.02
679	601928	凤凰传媒	300	2,643.00	0.02
680	600373	中文传媒	200	2,636.00	0.02
681	003035	南网能源	500	2,630.00	0.02
682	600663	陆家嘴	300	2,625.00	0.02
683	001227	兰州银行	1,000	2,600.00	0.02
684	000559	万向钱潮	500	2,595.00	0.02
685	301029	怡合达	100	2,578.00	0.02
686	000089	深圳机场	400	2,572.00	0.02
687	001286	陕西能源	300	2,565.00	0.02
688	600871	石化油服	1,400	2,562.00	0.02
689	000401	冀东水泥	400	2,556.00	0.02

690	000800	一汽解放	300	2,550.00	0.02
691	601118	海南橡胶	600	2,544.00	0.02
692	601187	厦门银行	500	2,535.00	0.02
693	002153	石基信息	260	2,532.40	0.02
694	300363	博腾股份	100	2,515.00	0.02
695	603529	爱玛科技	100	2,504.00	0.02
696	600764	中国海防	100	2,495.00	0.02
697	600801	华新水泥	200	2,486.00	0.02
698	600967	内蒙一机	300	2,478.00	0.02
699	603218	日月股份	200	2,474.00	0.02
700	600022	山东钢铁	1,800	2,466.00	0.02
701	600598	北大荒	200	2,394.00	0.02
702	000958	电投产融	600	2,364.00	0.02
703	002468	申通快递	300	2,337.00	0.02
704	002326	永太科技	200	2,324.00	0.02
705	601608	中信重工	600	2,316.00	0.02
706	002653	海思科	100	2,315.00	0.02
707	002010	传化智联	500	2,310.00	0.02
707	000785	居然之家	700	2,310.00	0.02
709	601236	红塔证券	300	2,277.00	0.02
710	603228	景旺电子	100	2,256.00	0.02
711	600095	湘财股份	300	2,253.00	0.02
712	000156	华数传媒	300	2,211.00	0.02
713	600500	中化国际	500	2,210.00	0.02
714	688779	长远锂科	300	2,190.00	0.02
715	600808	马钢股份	800	2,176.00	0.02
716	000563	陕国投 A	700	2,128.00	0.02
717	600315	上海家化	100	2,118.00	0.02
718	600316	洪都航空	100	2,117.00	0.02
719	601778	晶科科技	600	2,100.00	0.02
720	002505	鹏都农牧	1,300	2,080.00	0.02
721	601611	中国核建	300	2,079.00	0.02
722	002761	浙江建投	200	2,052.00	0.02
723	600377	宁沪高速	200	2,050.00	0.02
724	601098	中南传媒	200	2,034.00	0.02
724	001203	大中矿业	200	2,034.00	0.02
726	002423	中粮资本	300	2,004.00	0.02
727	600968	海油发展	700	1,995.00	0.02
728	000898	鞍钢股份	800	1,992.00	0.02
728	000930	中粮科技	300	1,992.00	0.02
730	001289	龙源电力	100	1,981.00	0.02
731	002608	江苏国信	300	1,971.00	0.02
732	002690	美亚光电	100	1,964.00	0.02
733	000539	粤电力 A	400	1,956.00	0.02

734	002925	盈趣科技	100	1,947.00	0.02
735	000537	中绿电	200	1,926.00	0.02
736	000967	盈峰环境	400	1,900.00	0.02
737	601568	北元集团	400	1,896.00	0.02
738	603317	天味食品	140	1,860.60	0.02
739	600062	华润双鹤	100	1,860.00	0.02
740	603866	桃李面包	240	1,838.40	0.02
741	600339	中油工程	600	1,818.00	0.02
742	600597	光明乳业	200	1,746.00	0.02
743	002563	森马服饰	300	1,731.00	0.02
744	000959	首钢股份	500	1,730.00	0.02
745	600167	联美控股	300	1,701.00	0.02
746	600928	西安银行	500	1,665.00	0.01
747	001872	招商港口	100	1,596.00	0.01
748	300257	开山股份	100	1,576.00	0.01
749	600927	永安期货	100	1,571.00	0.01
750	601228	广州港	500	1,565.00	0.01
751	601828	美凯龙	400	1,548.00	0.01
752	002945	华林证券	100	1,510.00	0.01
753	000402	金融街	400	1,452.00	0.01
754	603056	德邦股份	100	1,447.00	0.01
755	000553	安道麦 A	200	1,388.00	0.01
755	600350	山东高速	200	1,388.00	0.01
757	601139	深圳燃气	200	1,378.00	0.01
758	601298	青岛港	200	1,236.00	0.01
759	001914	招商积余	100	1,196.00	0.01
760	000031	大悦城	400	1,188.00	0.01
761	002399	海普瑞	100	1,173.00	0.01
762	601158	重庆水务	200	1,134.00	0.01
763	600995	南网储能	100	986.00	0.01
764	600956	新天绿能	100	813.00	0.01
765	600032	浙江新能	100	806.00	0.01
766	600299	安迪苏	100	800.00	0.01

### 8.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比
----	------	------	----------	------------

				例 (%)
1	600519	贵州茅台	179,186.00	1.93
2	300750	宁德时代	112,859.00	1.22
3	601318	中国平安	65,861.00	0.71
4	600036	招商银行	62,302.00	0.67
5	000858	五 粮 液	57,354.00	0.62
6	603233	大参林	53,088.00	0.57
7	600795	国电电力	50,678.00	0.55
8	688041	海光信息	44,772.00	0.48
9	688256	寒武纪	44,400.00	0.48
10	601658	邮储银行	44,332.00	0.48
11	000975	银泰黄金	43,290.00	0.47
12	000333	美的集团	42,557.00	0.46
13	300751	迈为股份	35,677.00	0.39
14	601166	兴业银行	35,122.00	0.38
15	600887	伊利股份	33,367.00	0.36
16	601689	拓普集团	32,240.00	0.35
17	300124	汇川技术	31,382.00	0.34
18	601888	中国中免	30,123.00	0.33
19	300760	迈瑞医疗	29,600.00	0.32
20	688271	联影医疗	29,394.00	0.32

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。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金 资产净值比 例 (%)
1	300750	宁德时代	53,761.00	0.58
2	601689	拓普集团	34,870.00	0.38
3	000858	五 粮 液	28,763.00	0.31
4	600036	招商银行	22,837.00	0.25
5	002415	海康威视	16,673.00	0.18
6	603605	珀莱雅	16,386.20	0.18
7	601318	中国平安	15,784.00	0.17
8	688122	西部超导	15,634.00	0.17
9	000333	美的集团	15,162.00	0.16
10	603345	安井食品	15,092.00	0.16
11	300751	迈为股份	14,297.00	0.15
12	600887	伊利股份	13,627.00	0.15
13	600900	长江电力	13,458.00	0.15
14	000651	格力电器	13,184.00	0.14



15	000625	长安汽车	12,936.00	0.14
16	601166	兴业银行	12,744.00	0.14
17	688777	中控技术	12,182.90	0.13
18	002850	科达利	12,060.00	0.13
19	601888	中国中免	11,701.00	0.13
20	002304	洋河股份	11,310.00	0.12

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。

#### 8.4.3 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	3,646,673.04
卖出股票的收入（成交）总额	792,735.78

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。

#### 8.5 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	610,683.72	5.44
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）	200.01	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	610,883.73	5.44

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

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	019670	22 国债 05	4,000	407,566.03	3.63
2	019694	23 国债 01	1,000	101,942.90	0.91
3	019678	22 国债 13	1,000	101,174.79	0.90
4	127102	浙建转债	2	200.01	0.00

**8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细**  
本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**  
本基金本报告期末未持有贵金属。

**8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**  
本基金本报告期末未持有权证。

#### **8.10 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

#### **8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

##### **8.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金投资范围未包括国债期货，无相关投资政策。

##### **8.11.2 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。

#### **8.12 投资组合报告附注**

**8.12.1 报告编制日前一年内，招商银行、兴业银行受到国家金融监督管理总局公开处罚。**

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规、基金合同及公司投资制度的要求。基金管理人将密切跟踪相关进展，遵循价值投资的理念进行投资决策。报告期内，本基金投资的前十名证券的其余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。

**8.12.2** 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。

### 8.12.3 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	532.28
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	137,549.79
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	138,082.07

### 8.12.4 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。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

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。

#### 8.12.5.2 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。

### 8.12.6 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 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 800 指 数型发起式 A	261	41,543.08	10,000,000.00	92.2276 %	842,742.74	7.7724 %
中银中证 800 指 数型发起式 C	984	3,315.29	-	-	3,262,244.89	100.000 0%
合计	1,245	11,329.31	10,000,000.00	70.8969 %	4,104,987.63	29.1031 %

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 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	-	-
	中银中证 800 指数型发 起式 C	509,862.39	15.6292%
	合计	509,862.39	3.6148%

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）。

## 9.3 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	50~100

	式 C	
	合计	50~100
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

#### 9.4 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	70.90%	10,000,000.00	70.90%	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	70.90%	10,000,000.00	70.90%	-

#### § 10 开放式基金份额变动

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
本报告期期初基金份额总额	10,499,201.64	146,455.53
本报告期基金总申购份额	733,597.70	8,359,204.40
减：本报告期基金总赎回份额	390,056.60	5,243,415.04
本报告期基金拆分变动份额	-	-

本报告期末基金份额总额	10,842,742.74	3,262,244.89
-------------	---------------	--------------

## § 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，公司原董事曾仲诚（Paul Chung ShingTsang）先生辞去公司董事。经 2023 年第一次股东会决议同意金贤泽（Hyun Taek Kim）先生担任公司董事；2023 年第三股东会决议同意李祥林先生担任公司独立董事；2023 年公司第五次股东会决议同意韩尚武先生担任公司董事，韩温先生不再担任公司董事；经董事会决议通过，奚鹏洲先生不再担任投资总监（固定收益），详情请参见基金管理人 2023 年 1 月 5 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》；闫黎平女士不再担任副总经理，详情请参见基金管理人 2023 年 12 月 9 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

本报告期无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的，与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

### 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

本报告期内改聘普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），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未受到稽查或处罚等情况。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东吴证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	3	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
国投证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	2,677,330.82	60.31%	2,280.40	60.04%	-
中金公司	1	1,762,078.00	39.69%	1,517.59	39.96%	-

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：退租西部证券上海、深圳交易单元各一个。

#### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期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
东吴证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	605,115.35	99.61%	-	-	-	-
中金公司	2,362.47	0.39%	-	-	-	-

### 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	2023-01-05
2	中银中证 800 指数型发起式证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2023-01-20
3	中银基金管理有限公司关于新增京东肯特瑞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	2023-02-20
4	中银基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	中国证监会规定媒介	2023-02-28
5	中银基金管理有限公司关于新增中国银河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	2023-02-28
6	中银基金管理有限公司关于旗下部分基金增加杭州银行股份有限公司杭 E 家同业平台为销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2023-03-03
7	中银基金管理有限公司关于新增兴业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	2023-03-08
8	中银基金管理有限公司关于新增泛华普益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	2023-03-20



9	中银基金管理有限公司关于提醒投资者防范金融诈骗的公告	中国证监会规定媒介	2023-03-21
10	中银基金管理有限公司关于新增国金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	2023-03-22
11	中银中证 800 指数型发起式证券投资基金 2022 年年度报告	中国证监会规定媒介	2023-03-30
12	中银中证 800 指数型发起式证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2023-04-21
13	中银基金管理有限公司关于旗下部分基金增加销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2023-04-28
14	中银中证 800 指数型发起式证券投资基金 2023 年第 2 季度报告	中国证监会规定媒介	2023-07-20
15	中银中证 800 指数型发起式证券投资基金更新招募说明书（2023 年第 1 号）	中国证监会规定媒介	2023-08-17
16	中银中证 800 指数型发起式证券投资基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2023-08-17
17	中银基金管理有限公司关于运用自有资金投资本公司旗下权益类基金的公告	中国证监会规定媒介	2023-08-25
18	中银中证 800 指数型发起式证券投资基金 2023 年中期报告	中国证监会规定媒介	2023-08-30
19	中银中证 800 指数型发起式证券投资基金 2023 年第 3 季度报告	中国证监会规定媒介	2023-10-24
20	中银基金管理有限公司关于更新旗下公募基金风险等级的公告	中国证监会规定媒介	2023-10-31
21	关于防范不法分子冒用公募基金名义进行非法活动的重要提示	中国证监会规定媒介	2023-11-27
22	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	2023-12-09

## 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20230101-20231231	10,000,000.00	-	-	10,000,000.00	70.8969%
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  
二〇二四年三月二十九日

