

# 中银国际证券股份有限公司关于旗下中银证券中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金投资关联方发行同业存单的公告

根据《中银证券中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金合同》的约定，本基金主要采用抽样复制和动态最优化的方法，选取标的指数成份券和备选成份券中流动性较好的品种，或选择非成份券作为替代，构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合，以实现对标指数的有效跟踪。

中银国际证券股份有限公司(以下简称“本公司”)根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等有关规定，已履行相关程序，现将本基金参与以及因标的指数成份券和备选成份券调整可能参与投资的关联方发行的同业存单情况披露如下：

基金名称	关联方证券	与本基金的关系
中银证券中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金	兴业银行股份有限公司发行的同业存单	基金托管人
中银证券中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金	中国银行股份有限公司发行的同业存单	中银国际控股有限公司(基金管理人股东)的控股股东

为最大限度地降低上述基金投资的跟踪误差，保护基金份额持有人的合法权益，本公司将上述同业存单纳入本基金的投资标的，并将严格按法律、法规和上述基金合同的规定进行日常投资管理。相关投资情况将按规定在定期报告中进行披露。

**风险提示：**本公司承诺以诚实信用、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，也不保证最低收益。投资者投资于上述基金时应认真阅读上述基金的基金合同、招募说明书等文件，了解所投资基金的风险收益特征，并根

据自身投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资者的风险承受能力相匹配。基金的过往业绩并不预示其未来表现，本公司提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担，敬请投资者留意投资风险。

特此公告。

中银国际证券股份有限公司

二〇二三年十月十二日