

中银证券中证 500 交易型开放式指数证券 投资基金 2020 年年度报告

2020 年 12 月 31 日

基金管理人：中银国际证券股份有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2021 年 3 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 3 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2020 年 4 月 30 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	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	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
3.4 过去三年基金的利润分配情况	8
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	13
4.10 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	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 审计报告	14
6.1 审计报告基本信息	14
6.2 审计报告的基本内容	14
§ 7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表	16
7.2 利润表	17
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	18
7.4 报表附注	19
§ 8 投资组合报告	46

8.1 期末基金资产组合情况	46
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	46
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	48
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	60
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	62
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	62
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	62
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	62
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	62
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	62
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	62
8.12 投资组合报告附注	63
§ 9 基金份额持有人信息	64
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	64
9.2 期末上市基金前十名持有人	64
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	64
9.4 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情况	65
9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	65
§ 10 开放式基金份额变动	65
§ 11 重大事件揭示	65
11.1 基金份额持有人大会决议	65
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	65
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	66
11.4 基金投资策略的改变	66
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	66
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	66
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	66
11.8 其他重大事件	67
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	70
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	70
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	70
§ 13 备查文件目录	70
13.1 备查文件目录	70
13.2 存放地点	71
13.3 查阅方式	71

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	中银证券中证 500ETF
场内简称	BOCI500 扩位简称：中银证券 500ETF
基金主代码	515190
基金运作方式	契约型开放（ETF）
基金合同生效日	2020 年 4 月 30 日
基金管理人	中银国际证券股份有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	79,466,080.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2020 年 5 月 27 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.2% 以内，年化跟踪误差控制在 2% 以内。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即完全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。 当预期指数成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将通过投资非成份股、成份股个股衍生品等方式进行替代，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为交易型开放式指数基金，采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票相似的风险收益特征。

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		中银国际证券股份有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	亓磊	张燕
	联系电话	021-20328000	0755-83199084
	电子邮箱	gmkf@bocichina.com	yan_zhang@cmbchina.com

客户服务电话	021-61195566, 400-620-8888	95555
传真	021-50372474	0755-83195201
注册地址	上海市浦东新区银城中路 200 号 中银大厦 39F	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址	上海市浦东新区银城中路 200 号 中银大厦 39F	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	200120	518040
法定代表人	宁敏	缪建民

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	www.bocifunds.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人办公地址

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)	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 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	2020 年 4 月 30 日（基金合同生效日）-2020 年 12 月 31 日
本期已实现收益	51,020,540.39
本期利润	61,550,899.76
加权平均基金份额本期利润	0.3661
本期加权平均净值利润率	31.51%
本期基金份额净值增长率	25.84%
3.1.2 期末数据和指标	2020 年末
期末可供分配利润	20,537,902.19
期末可供分配基金份额利润	0.2584
期末基金资产净值	100,003,982.19
期末基金份额净值	1.2584
3.1.3 累计期末指标	2020 年末
基金份额累计净值增长率	25.84%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

3、期末可供分配利润是指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。

3.2 基金净值表现

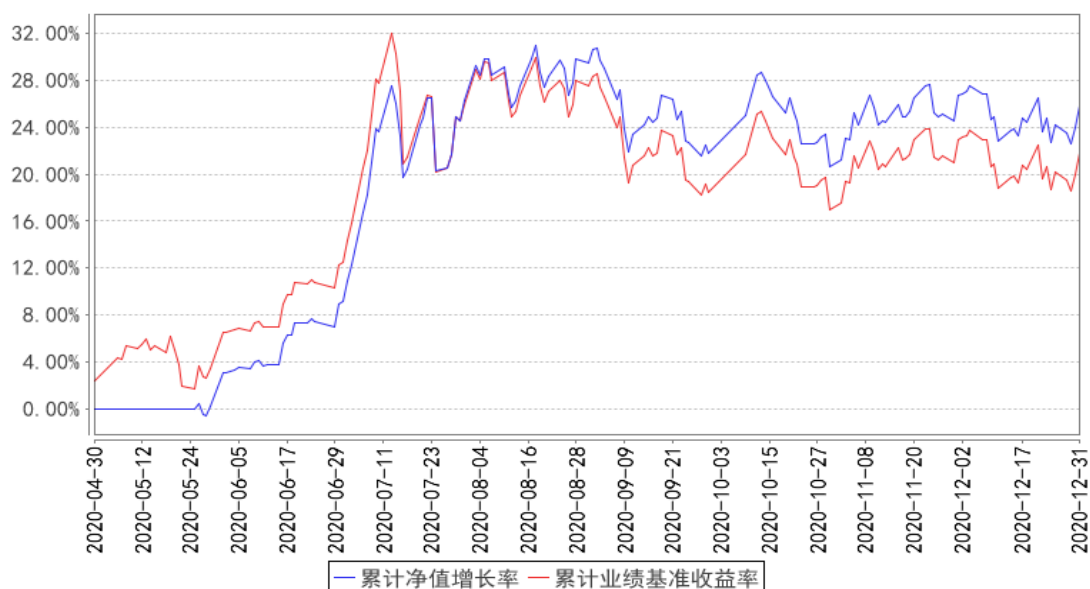
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	3.33%	1.14%	2.82%	1.16%	0.51%	-0.02%
过去六个月	15.59%	1.38%	8.57%	1.45%	7.02%	-0.07%
自基金合同生效起至今	25.84%	1.25%	21.82%	1.36%	4.02%	-0.11%

注：本基金成立于 2020 年 4 月 30 日，业绩比较基准为中证 500 指数。

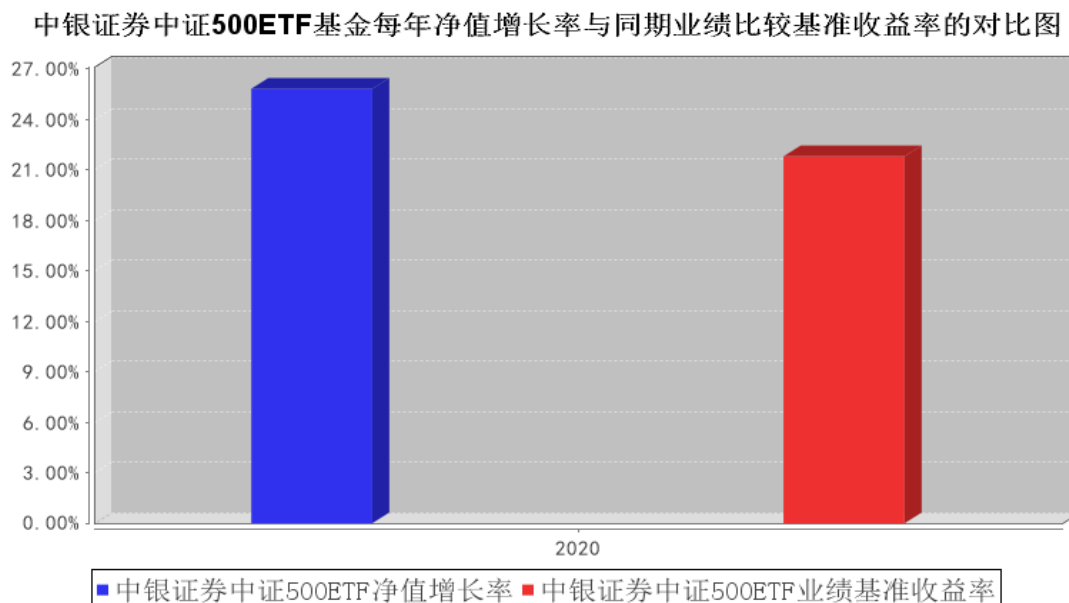
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

中银证券中证500ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金合同于 2020 年 4 月 30 日生效。

3.2.3 自基金合同生效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



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 其他指标

注：无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金未实施利润分配。

§ 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

中银国际证券股份有限公司(以下简称“中银国际证券”)经中国证监会批准于 2002 年 2 月 28 日在上海成立,注册资本 27.78 亿元人民币。前十名股东包括中银国际控股有限公司、中国石油集团资本有限责任公司、上海金融发展投资基金(有限合伙)、云南省投资控股集团有限公司、江西铜业股份有限公司、中国通用技术(集团)控股有限责任公司、上海祥众投资合伙企业(有限合伙)、信泰人寿保险股份有限公司—传统产品、江苏洋河酒厂股份有限公司、上海郝乾企业管理中心(有限合伙)。中银国际证券的经营范围包括:证券经纪;证券投资咨询;与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问;证券承销与保荐;证券自营;证券资产管理;证券投资基金代销;融资融券;代销金融产品;公开募集证券投资基金管理业务;为期货公司提供中间介绍业务。截至 2020 年 12 月 31 日,本管理人共管理二十七只证券投资基金,包括:中银证券价值精选灵活配置混合型证券

投资基金(原中银证券保本 1 号混合型证券投资基金)、中银证券健康产业灵活配置混合型证券投资基金、中银证券现金管家货币市场基金、中银证券安进债券型证券投资基金、中银证券瑞益灵活配置混合型证券投资基金(原中银证券瑞益定期开放灵活配置混合型证券投资基金)、中银证券安弘债券型证券投资基金、中银证券汇宇定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券聚瑞混合型证券投资基金, 中银证券祥瑞混合型证券投资基金、中银证券汇嘉定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券安誉债券型证券投资基金、中银证券汇享定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券新能源灵活配置混合型证券投资基金、中银证券安源债券型证券投资基金、中银证券中高等级债券型证券投资基金、中银证券安泽债券型证券投资基金、中银证券科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金、中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、中银证券安沛债券型证券投资基金、中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中银证券汇远一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券汇兴一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券安泰债券型证券投资基金、中银证券优选行业龙头混合型证券投资基金、中银证券安汇三年定期开放债券型证券投资基金、中银证券创业板交易型开放式指数证券投资基金、中银证券鑫瑞 6 个月持有期混合型证券投资基金。

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 (助理) 期限		证券从 业年限	说明
		任职日期	离任日期		
阳桦	本基金的 基金经理	2020 年 4 月 30 日	-	10 年	阳桦, 硕士研究生, 中国国籍, 已取得证券、基金从业资格。2008 年 7 月至 2009 年 6 月任职于富邦证券(上海代表处), 担任行业研究员; 2009 年 7 月至 2010 年 6 月任职于中山证券有限责任公司, 担任行业研究员; 2010 年 6 月加入中银国际证券股份有限公司, 担任行业研究员、投资经理, 历任中银证券价值精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 现任中银证券祥瑞混合型证券投资基金、中银证券科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金、中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中银证券创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理。
张 艺 敏	本基金的 基金经理	2020 年 9 月 15 日	-	3 年	张艺敏, 硕士研究生, 中国国籍, 已取得证券、基金从业资格。2017 年 7 月至 2020

					年 5 月任职于汇安基金管理有限公司，历任产品及创新业务部产品经理、ETF 投资部基金经理助理，2020 年 5 月加入中银国际证券股份有限公司，现任中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中银证券创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：1、上述任职日期为根据公司确定的聘用日期，离任日期为根据公司确定的解聘日期；首任基金经理的任职日期为基金合同生效日期；

2、证券从业的涵义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
—	公募基金	0	—	—
	私募资产管理计划	0	—	—
	其他组合	0	—	—
	合计	0	—	—

4.1.4 基金经理薪酬机制

基金经理薪酬由固定薪酬、福利和年度奖金三部分组成。其中固定薪酬指每月固定发放的工资；年度奖金指在每个考核年度发放给员工的现金奖励。固定薪酬与年度奖金共同构成年度现金总收入。

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》、《中华人民共和国证券法》、基金合同以及其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

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

为了保证公司管理的不同投资组合得到公平对待，保护投资者合法权益，本基金管理人根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规，建立了基金管理业务、资产管理业务公平交易管理办法、产品与交易部

交易室异常交易监控与报告管理办法等公平交易相关制度体系。

公司基金管理业务、资产管理业务公平交易管理办法所规范的范围涵盖境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动，同时涵盖包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

公平交易的控制方法主要包括：建立科学、制衡的投资决策体系，在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，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；严格隔离投资管理职能和交易执行职能，实行包括所有投资品种的集中交易制度，并进行公平的交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会；通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司一直严格遵循公平交易相关规章制度，执行严格的公平交易行为。在严格方针指导下，报告期内，公司未出现任何异常关联交易以及与禁止交易对手间的交易行为。

报告期内，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗口下（如：1 日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合向交易开展交易价差分析。分析结果表明，本报告期内公司对各投资组合公平对待，不存在利益输送的行为。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

无。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未发生同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量 5%的情况。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

本基金主要采取完全复制法以紧密跟踪标的指数表现，力争基金跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金自上市以来日均跟踪偏离度为 0.04%，年化跟踪误差为 2.81%。本基金的跟踪误差主要来源于基金份额的申购赎回、标的指数成分股调整等。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.2584 元；本报告期基金份额净值增长率为 25.84%，业绩比较基准收益率为 21.82%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金作为一只投资于中证 500 指数的被动投资管理产品，将继续秉承指数化投资策略，严格遵守基金合同，积极应对基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击，降低本基金的跟踪误差，为投资者提供一个标准化的中证 500 指数投资工具。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人始终坚持基金份额持有人利益优先原则，从规范运作、防范风险、保护基金持有人利益出发，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实。公司审计部依据法律法规的规定及公司内部控制的整体要求，独立对旗下基金投资组合、基金宣传推介材料及员工行为等的合规性进行了定期和不定期检查，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，并定期向监管机构、公司董事会出具监察稽核报告。

在合规管理方面，公司开展多种形式的合规培训，定期进行合规信息收集，不断提升员工的合规守法意识；加强事前事中合规风险管理，严格审核信息披露文件、基金宣传推介材料，防范各类合规风险。在风险管理方面，公司秉承全员风险管理的理念，采取事前防范、事中控制和事后监督等三阶段工作，加强对日常投资运作的管理和监控，督促投研交易业务的合规开展；在监察稽核方面，公司定期和不定期开展多项内部稽核，对投资研究、公平交易、基金销售，投资管理人员通讯管理等关键业务和岗位进行检查监督，促进公募基金业务合规运作、稳健经营。

报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规。本基金管理人将继续以风险控制为核心，坚持基金份额持有人利益优先的原则，提高监察稽核工作有效性，切实保障基金安全、合规运作。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益，设立了中银国际证券股份有限公司估值委员会（以下简称“估值委员会”），制定了估值政策和估值程序。由公司领导担任组长，成员由基金管理部、运营管理总部、内控与法律合规部、审计部、风险管理部等部门指派人员组成。估值委员会成员均具有专业工作经历，具备良好的专业经验和专业胜任能力，具有绝对的独立性。估值委员会的职

责主要包括有：保证基金估值的公平、合理；制订健全、有效的估值政策和程序；确保对投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性；定期对估值政策和程序进行评价等。

参与估值流程的各方还包括本基金托管银行和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管银行有责任要求基金管理人作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内未实施利润分配。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.10 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

本基金报告期内不存在连续二十个工作日基金持有人数低于 200 人或基金资产净值低于 5000 万元的情形。

§ 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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

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

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2021)第 21757 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	(一)我们审计的内容 我们审计了中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“中银证券中证 500ETF 基金”)的财务报表，包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表，2020 年 4 月 30 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)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，公允反映了中银证券中证 500ETF 基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年 4 月 30 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。
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，我们独立于中银证券中证 500ETF 基金，并履行了职业道德方面的其他责任。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	无
管理层和治理层对财务报表的责任	中银证券中证 500ETF 基金的基金管理人中银国际证券股份有限公司(以下简称“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证券中证 500ETF 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证券中证 500ETF 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证券中证 500ETF 基金的财务报告过程。	
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，就可能导致对中银证券中证 500ETF 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证券中证 500ETF 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。	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	张振波	叶尔甸
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场二座普华永道	

	中心 11 楼
审计报告日期	2021 年 3 月 26 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	7.4.7.1	1,112,320.04
结算备付金		144,931.74
存出保证金		97,712.48
交易性金融资产	7.4.7.2	98,922,855.94
其中：股票投资		98,922,855.94
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		-
应收利息	7.4.7.5	293.04
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		100,278,113.24
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 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		-
应付证券清算款		24,222.13
应付赎回款		-
应付管理人报酬		14,968.85
应付托管费		4,989.64
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	44,950.43

应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	185,000.00
负债合计		274,131.05
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	79,466,080.00
未分配利润	7.4.7.10	20,537,902.19
所有者权益合计		100,003,982.19
负债和所有者权益总计		100,278,113.24

注：本基金合同生效日为 2020 年 04 月 30 日，本报告期自基金合同生效日 2020 年 04 月 30 日起至 2020 年 12 月 31 日止。报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.2584 元，基金份额总额 79,466,080.00 份。

7.2 利润表

会计主体：中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020 年 4 月 30 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2020 年 4 月 30 日（基金合同 生效日）至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		63,164,519.78
1. 利息收入		82,319.93
其中：存款利息收入	7.4.7.11	82,319.93
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		-
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		51,720,686.84
其中：股票投资收益	7.4.7.12	49,448,487.60
基金投资收益	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-
股利收益	7.4.7.16	2,272,199.24
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号	7.4.7.17	10,530,359.37

填列)		
4. 汇兑收益 (损失以“-”号填列)		-
5. 其他收入 (损失以“-”号填列)	7.4.7.18	831,153.64
减: 二、费用		1,613,620.02
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	196,361.36
2. 托管费	7.4.10.2.2	65,453.89
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-
4. 交易费用	7.4.7.19	930,478.53
5. 利息支出		-
其中: 卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		-
7. 其他费用	7.4.7.20	421,326.24
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		61,550,899.76
减: 所得税费用		-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		61,550,899.76

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期: 2020 年 4 月 30 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

项目	本期 2020 年 4 月 30 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	251,466,080.00	-	251,466,080.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	61,550,899.76	61,550,899.76
三、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)	-172,000,000.00	-41,012,997.57	-213,012,997.57
其中: 1. 基金申购款	98,000,000.00	2,475,920.03	100,475,920.03
2. 基金赎回款	-270,000,000.00	-43,488,917.60	-313,488,917.60
四、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)			
五、期末所有者 权益(基金净值)	79,466,080.00	20,537,902.19	100,003,982.19

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

宁敏

沈锋

戴景义

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)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[2019]2052 号《关于准予中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》核准,由中银国际证券股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 251,438,000.00 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2020)第 0351 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2020 年 4 月 30 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 251,466,080.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 28,080.00 份基金份额。本基金的基金管理人为中银国际证券股份有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2020]135 号文审核同意,本基金于 2020 年 5 月 27 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中银证券中证 500 交易型开放式指数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及其备选成份股。为更好地实现投资目标,本基金还可投资于非成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、股指期货、债券(包括国债、央行票据、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、可交换债券、可分离交易可转债的纯债部分、中期票据、短期融资券、超短期融资券、政府支持债券、政府支持机构债券等)、银行存款(包括协议存款、定期存款、通知存款和其他银行存款)、同业存单、货币市场工具、资产支持证券、债券回购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%,且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合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。

本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率。

本基金的基金管理人中银国际证券股份有限公司以本基金为目标 ETF，募集成立了中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“中证 500 ETF 联接基金”)。中证 500 ETF 联接基金为交易型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

本财务报表由本基金的基金管理人中银国际证券股份有限公司于 2021 年 3 月 26 日批准报出。

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》、《中银证券中证 500 交易型开放式指数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。

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 2020 年 4 月 30 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日止期间的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 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年 4 月 30 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

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。本期财务报表的实际编制期间为 2020 年 4 月 30 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产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资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具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。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

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及其他金融负债。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。本基金持有的其他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。

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于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的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，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的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。

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。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现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损益占基金净值比例计算的金额。未实现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损益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认列，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

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项,根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分,将本金部分冲减资产支持证券投资成本,并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益;于处置时,其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他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

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点,本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提,收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部,以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。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) 本基金的基金管理人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) 本基金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。

本基金目前以一个单一的经营分部运作,不需要披露分部信息。

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、债券投资和资产支持证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、资产支持证券和私募债券除外)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《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度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、资产支持证券和私募债券除外),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。

(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。

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

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

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。

(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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	1,112,320.04
定期存款	—
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	—
合计	1,112,320.04

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	88,392,496.57	98,922,855.94	10,530,359.37
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—
债券	交易所市场	—	—
	银行间市场	—	—
	合计	—	—
资产支持证券	—	—	—
基金	—	—	—
其他	—	—	—
合计	88,392,496.57	98,922,855.94	10,530,359.37

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款估值增值。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末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

注：本基金本报告期末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

注：本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	173.03
应收定期存款利息	—
应收其他存款利息	—
应收结算备付金利息	71.72
应收债券利息	—
应收资产支持证券利息	—
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	—
应收黄金合约拆借孳息	—
应收出借证券利息	—
其他	48.29
合计	293.04

7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	44,950.43
银行间市场应付交易费用	—
合计	44,950.43

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 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	—
预提费用	150,000.00
应付指数使用费	35,000.00
合计	185,000.00

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2020 年 4 月 30 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	251,466,080.00	251,466,080.00
本期申购	98,000,000.00	98,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-270,000,000.00	-270,000,000.00
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	79,466,080.00	79,466,080.00

注：1. 本基金自 2020 年 3 月 30 日至 2020 年 4 月 24 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币 251,438,000.00 元，折合为 251,438,000.00 份基金份额。根据《中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币 28,080.00 元在本基金成立后，折合为 28,080.00 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

2. 根据《中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》及《中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定投业务的公告》的相关规定，本基金于 2020 年 4 月 30 日（基金合同生效日）至 2020 年 5 月 26 日止期间暂不向投资人开放基金交易，申购业务、赎回业务和转换业务自 2020 年 5 月 27 日起开始办理。

7.4.7.10 未分配利润

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	-	-	-
本期利润	51,020,540.39	10,530,359.37	61,550,899.76
本期基金份额交易产生的变动数	-26,565,028.60	-14,447,968.97	-41,012,997.57
其中：基金申购款	407,964.64	2,067,955.39	2,475,920.03
基金赎回款	-26,972,993.24	-16,515,924.36	-43,488,917.60
本期已分配利润	-	-	-
本期末	24,455,511.79	-3,917,609.60	20,537,902.19

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020 年 4 月 30 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	74,079.70
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	7,057.60
其他	1,182.63
合计	82,319.93

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年4月30日（基金合同生效日）至2020年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	35,216,854.88
股票投资收益——赎回差价收入	14,231,632.72
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	49,448,487.60

7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年4月30日（基金合同生效日）至2020年12月31日
卖出股票成交总额	303,718,145.53
减：卖出股票成本总额	268,501,290.65
买卖股票差价收入	35,216,854.88

7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年4月30日（基金合同生效日）至2020年12月31日
赎回基金份额对价总额	313,488,917.60
减：现金支付赎回款总额	174,823,437.60
减：赎回股票成本总额	124,433,847.28
赎回差价收入	14,231,632.72

7.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无股票投资收益——申购差价收入。

7.4.7.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期无股票投资收益——证券出借差价收入。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无债券投资收益。

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期无债券投资收益——买卖债券差价收入。

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期无债券投资收益——赎回差价收入。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无债券投资收益——申购差价收入。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期无贵金属投资收益——赎回差价收入。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无贵金属投资收益——申购差价收入。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无衍生工具投资收益——买卖权证差价收入。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具投资收益——其他投资收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 4 月 30 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	2,272,199.24
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	2,272,199.24

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020 年 4 月 30 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	10,530,359.37
股票投资	10,530,359.37
债券投资	—
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	10,530,359.37

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 4 月 30 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	—

替代损益	785,118.64
其他	46,035.00
合计	831,153.64

注：注：替代损益是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 4 月 30 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	930,478.53
银行间市场交易费用	—
合计	930,478.53

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 4 月 30 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
审计费用	60,000.00
信息披露费	90,000.00
证券出借违约金	—
银行费用	3,244.02
账户维护费	1,500.00
其他费用	172,736.07
指数使用费	93,846.15
合计	421,326.24

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的年费率 0.03% 每日计提，自基金成立之日的下一季度（自然季度）起，指数使用许可费收取下限为每季度（自然季度）3.5 万元，即不足 3.5 万元时按照 3.5 万元收取。

7.4.7.21 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。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）本基金的基金管理人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）本基金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。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

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，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作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
中银国际证券股份有限公司（“中银证券”）	基金管理人、基金销售机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金管理人股东的控股股东、基金销售机构
中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“中证 500ETF 联接基金”）	基金管理人管理的其他基金

注：下述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

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 4 月 30 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
中银证券	731,334,473.54	100.00

7.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年4月30日（基金合同生效日）至2020年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
中银证券	534,823.95	100.00	44,950.43	100.00

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示；

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

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 2020年4月30日（基金合同生效日）至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	196,361.36
其中：支付销售机构的客户维护费	27.72

注：支付基金管理人中银证券的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.15%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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年4月30日（基金合同生效日）至2020年12月31日
----	---------------------------------------

	日
当期发生的基金应支付的托管费	65,453.89

注：支付基金托管人招商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：

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

7.4.10.2.3 销售服务费

注：本基金本报告期内无支付给各关联方的销售服务费。

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

注：本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券（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

注：本基金本报告期内转融通证券出借业务未发生重大关联交易事项。

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

注：本基金本报告期内转融通证券出借业务未发生重大关联交易事项。

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

注：本基金的基金管理人于本基金本报告期内未运用固有资金投资本基金。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2020 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例（%）
中证500ETF联接基金	52,174,900.00	65.66

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 2020 年 4 月 30 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司	1,112,320.04	74,079.70

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，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

注：本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末(2020 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：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
003031	中瓷电子	2020 年 12 月 24 日	2021 年 1 月 4 日	新股流通受限	15.27	15.27	387	5,909.49	5,909.49	-
300860	锋尚文化	2020 年 8 月 6 日	2021 年 2 月 24 日	新股流通受限	138.02	126.67	83	11,455.66	10,513.61	-
300861	美畅股份	2020 年 8 月 6 日	2021 年 2 月 24 日	新股流通受限	43.76	51.10	239	10,458.64	12,212.90	-
300863	卡倍亿	2020 年 8 月 11 日	2021 年 2 月 24 日	新股流通受限	18.79	103.22	3,421	64,280.59	353,115.62	-
300868	杰美特	2020 年 8 月 12 日	2021 年 2 月 24 日	新股流通受限	41.26	43.28	216	8,912.16	9,348.48	-
300869	康泰医学	2020 年 8 月 12 日	2021 年 2 月 24 日	新股流通受限	10.16	110.88	862	8,757.92	95,578.56	-
300871	回盛	2020 年	2021 年	新股流	33.61	38.70	378	12,704.58	14,628.60	-

	生物	8月13日	2月24日	通受限						
300879	大叶股份	2020年8月25日	2021年3月1日	新股流通受限	10.58	27.12	466	4,930.28	12,637.92	-
300880	迦南智能	2020年8月25日	2021年3月1日	新股流通受限	9.73	34.73	3,732	36,312.36	129,612.36	-
300881	盛德鑫泰	2020年8月25日	2021年3月1日	新股流通受限	14.17	32.31	291	4,123.47	9,402.21	-
300886	华业香料	2020年9月8日	2021年3月16日	新股流通受限	18.59	45.67	147	2,732.73	6,713.49	-
300887	谱尼测试	2020年9月9日	2021年3月16日	新股流通受限	44.47	74.52	150	6,670.50	11,178.00	-
300890	翔丰华	2020年9月10日	2021年3月17日	新股流通受限	14.69	48.85	286	4,201.34	13,971.10	-
300892	品渥食品	2020年9月11日	2021年3月24日	新股流通受限	26.66	60.01	227	6,051.82	13,622.27	-
300893	松原股份	2020年9月17日	2021年3月24日	新股流通受限	13.47	35.08	276	3,717.72	9,682.08	-
300895	铜牛信息	2020年9月17日	2021年3月24日	新股流通受限	12.65	45.30	283	3,579.95	12,819.90	-
300919	中伟股份	2020年12月15日	2021年6月23日	新股流通受限	24.60	61.51	137	3,370.20	8,426.87	-
300922	天秦装备	2020年12月18日	2021年6月25日	新股流通受限	16.05	31.58	207	3,322.35	6,537.06	-
300926	博俊科技	2020年12月29日	2021年1月7日	新股流通受限	10.76	10.76	3,285	35,346.60	35,346.60	-
300999	金龙鱼	2020年9月29日	2021年4月15日	新股流通受限	25.70	88.29	909	23,361.30	80,255.61	-
688069	德林海	2020年7月15日	2021年1月22日	新股流通受限	67.20	62.45	1,577	105,974.40	98,483.65	-

688185	康希诺	2020 年 8 月 4 日	2021 年 2 月 18 日	新股流 通受限	209.71	355.68	839	175,946.69	298,415.52	-
688386	泛亚微透	2020 年 10 月 9 日	2021 年 4 月 16 日	新股流 通受限	16.28	47.41	3,217	52,372.76	152,517.97	-
688569	铁科轨道	2020 年 8 月 21 日	2021 年 3 月 1 日	新股流 通受限	22.46	20.10	3,109	69,828.14	62,490.90	-
688589	力合微	2020 年 7 月 15 日	2021 年 1 月 22 日	新股流 通受限	17.91	35.33	3,562	63,795.42	125,845.46	-

注：1、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

2、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

3、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

7.4.12.2 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（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300182	捷成股份	2020 年 12 月 30 日	重大事项	3.23	2021 年 1 月 7 日	3.40	36,600	168,071.87	118,218.00	-

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

注：本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末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

本基金主要投资于股票、债券等具有良好流动性的金融工具。与这些金融工具相关的风险，以及本基金的基金管理人对于相关风险采取的风险管理政策如下所述。

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是指数型基金，紧密跟踪中证 500 指数，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。本基金采用完全复制法，跟踪中证 500 指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代，力求与标的指数的跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。

本基金的基金管理人在公司风险管理体系的基础上构建明晰基金业务的风险管理组织架构和职能，由董事会及其风险控制委员会、执行委员会、风险管理委员会、风险管理部、基金管理部、中后线部门等相关业务部门构成多层级风险管理框架体系。董事会决定公司风险偏好，并在风险控制委员会的协助下监察公司基金业务的总体风险及管理状况。执行委员会领导公司基金业务的风险管理。风险管理委员会协助执行委员会在董事会授权范围内确定、调整基金业务的业务权限、讨论重大决策以及检查风险管理状况。风险管理部负责监控和报告公司基金业务的风险敞口和限额使用情况。业务主管对各自业务的风险管理负有首要责任。财务、业务营运、稽核、法律及合规等中后线部门在各自职能范围内支持或监督公司风险管理。

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同责任，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。本基金的银行存款存放在本基金的托管行招商银行，因而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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

于 2020 年 12 月 31 日，本基金无债券投资。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：截至 2020 年 12 月 31 日，本基金未持有期限在一年以内(含)的债券。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：截至 2020 年 12 月 31 日，本基金未持有期限在一年以内(含)的资产支持证券。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：截至 2020 年 12 月 31 日，本基金未持有期限在一年以内(含)的同业存单。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：截至 2020 年 12 月 31 日，本基金未持有期限大于一年的债券。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：截至 2020 年 12 月 31 日，本基金未持有期限大于一年的资产支持证券。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：截至 2020 年 12 月 31 日，本基金未持有期限大于一年的同业存单。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时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。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。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。

于 2020 年 12 月 31 日，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(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：不适用。

7.4.13.3.2 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在基金运作过程中严格按照《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》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注。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。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2020 年 12 月 31 日，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未

超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2020 年 12 月 31 日，本基金确认的净赎回申请未超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和存出保证金等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 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	1,112,320.04	-	-	-	1,112,320.04
结算备付金	144,931.74	-	-	-	144,931.74
存出保证金	97,712.48	-	-	-	97,712.48
交易性金融资产	-	-	-	98,922,855.94	98,922,855.94

应收利息	-	-	-	293.04	293.04
资产总计	1,354,964.26	-	-	98,923,148.98	100,278,113.24
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	14,968.85	14,968.85
应付托管费	-	-	-	4,989.64	4,989.64
应付证券清算款	-	-	-	24,222.13	24,222.13
应付交易费用	-	-	-	44,950.43	44,950.43
其他负债	-	-	-	185,000.00	185,000.00
负债总计	-	-	-	274,131.05	274,131.05
利率敏感度缺口	1,354,964.26	-	-	98,649,017.93	100,003,982.19

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

注：于 2020 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：不适用。

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：不适用。

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股票和债券，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。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金主要采取完全复制法，即完全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。当预期指数成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能

带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将通过投资非成份股、成份股个股衍生品等方式进行替代，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。

本基金投资于标的指数成分股及其备选成分股的比例不低于基金资产净值的 90%，且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合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

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 2020 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	98,922,855.94	98.92
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	98,922,855.94	98.92

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变	
	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：人民币元）
		本期末（2020 年 12 月 31 日）
分析	业绩比较基准上升 5%	4,943,696.86
	业绩比较基准下降 5%	-4,943,696.86

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

不适用。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 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。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2020 年 12 月 31 日，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中属于第一层次的余额为 97,215,371.71 元，属于第二层次的余额为 1,707,484.23 元，无属于第三层次的余额。

(ii) 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，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2020 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。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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。

(2) 基金申购款

于 2020 年 4 月 30 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日止期间，本基金申购基金份额的

对价总额为 100,475,920.03 元,其中包括以股票支付的申购款 45,775,521.00 元和以现金支付的申购款 54,700,399.03 元。

(3) 除基金申购款和公允价值外,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	98,922,855.94	98.65
	其中:股票	98,922,855.94	98.65
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中:债券	—	—
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	1,257,251.78	1.25
8	其他各项资产	98,005.52	0.10
9	合计	100,278,113.24	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末指数投资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	1,090,360.00	1.09
B	采矿业	3,092,708.40	3.09
C	制造业	62,390,432.83	62.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,217,251.30	2.22
E	建筑业	1,373,160.00	1.37
F	批发和零售业	3,660,437.80	3.66
G	交通运输、仓储和邮政业	1,895,493.60	1.90
H	住宿和餐饮业	471,060.00	0.47
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,363,773.09	7.36
J	金融业	5,894,700.27	5.89

K	房地产业	2,856,755.60	2.86
L	租赁和商务服务业	965,702.60	0.97
M	科学研究和技术服务业	894,559.00	0.89
N	水利、环境和公共设施管理业	897,972.30	0.90
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	79,376.00	0.08
Q	卫生和社会工作	872,076.00	0.87
R	文化、体育和娱乐业	795,998.00	0.80
S	综合	463,353.00	0.46
	合计	97,275,169.79	97.27

8.2.2 报告期末积极投资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	1,356,507.02	1.36
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	13,622.27	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	157,381.60	0.16
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	11,178.00	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	98,483.65	0.10
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	10,513.61	0.01
S	综合	-	-

	合计	1,647,686.15	1.65
--	----	--------------	------

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末投资于港股。

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300274	阳光电源	17,500	1,264,900.00	1.26
2	300012	华测检测	28,600	782,782.00	0.78
3	600426	华鲁恒升	19,600	731,080.00	0.73
4	002074	国轩高科	17,600	688,512.00	0.69
5	600089	特变电工	63,700	646,555.00	0.65
6	600079	人福医药	18,600	630,168.00	0.63
7	603882	金域医学	4,800	614,976.00	0.61
8	300496	中科创达	5,200	608,400.00	0.61
9	000547	航天发展	22,100	607,750.00	0.61
10	300285	国瓷材料	13,300	599,963.00	0.60
11	002709	天赐材料	5,700	591,660.00	0.59
12	300207	欣旺达	19,000	583,490.00	0.58
13	600143	金发科技	31,000	531,340.00	0.53
14	601233	桐昆股份	25,700	529,163.00	0.53
15	002185	华天科技	37,700	513,474.00	0.51
16	600739	辽宁成大	21,100	513,152.00	0.51
17	002797	第一创业	50,500	502,475.00	0.50
18	600132	重庆啤酒	4,200	499,758.00	0.50
19	600885	宏发股份	9,100	493,402.00	0.49
20	002568	百润股份	4,700	490,163.00	0.49
21	002385	大北农	50,400	486,864.00	0.49
22	601799	星宇股份	2,400	481,200.00	0.48
23	601099	太平洋	117,100	477,768.00	0.48
24	002340	格林美	65,700	459,243.00	0.46
25	603806	福斯特	5,340	456,036.00	0.46
26	300595	欧普康视	5,300	434,176.00	0.43
27	688002	睿创微纳	3,900	432,900.00	0.43
28	603589	口子窖	6,200	427,180.00	0.43
29	600486	扬农化工	3,200	422,400.00	0.42
30	300357	我武生物	5,500	421,850.00	0.42
31	600316	洪都航空	7,400	420,838.00	0.42
32	601966	玲珑轮胎	11,900	418,523.00	0.42
33	000636	风华高科	12,300	414,510.00	0.41

34	002625	光启技术	18,500	411,625.00	0.41
35	600529	山东药玻	8,200	411,230.00	0.41
36	002507	涪陵榨菜	9,600	406,080.00	0.41
37	600201	生物股份	19,400	405,266.00	0.41
38	601168	西部矿业	32,700	404,826.00	0.40
39	300699	光威复材	4,500	400,725.00	0.40
40	600219	南山铝业	123,100	388,996.00	0.39
41	603816	顾家家居	5,500	387,805.00	0.39
42	002078	太阳纸业	26,800	386,724.00	0.39
43	603345	安井食品	2,000	385,740.00	0.39
44	000750	国海证券	65,400	383,244.00	0.38
45	002013	中航机电	33,400	382,430.00	0.38
46	300088	长信科技	42,000	373,380.00	0.37
47	002030	达安基因	10,600	363,580.00	0.36
48	600862	中航高科	12,000	361,200.00	0.36
49	600699	均胜电子	14,100	357,576.00	0.36
50	600884	杉杉股份	19,610	353,568.30	0.35
51	601997	贵阳银行	44,300	352,185.00	0.35
52	002131	利欧股份	116,000	351,480.00	0.35
53	601128	常熟银行	47,100	347,598.00	0.35
54	002353	杰瑞股份	9,900	346,500.00	0.35
55	603486	科沃斯	3,900	345,111.00	0.35
56	002465	海格通信	31,700	343,311.00	0.34
57	603338	浙江鼎力	3,380	342,022.20	0.34
58	603444	吉比特	800	340,800.00	0.34
59	600460	士兰微	13,600	340,000.00	0.34
60	002212	天融信	16,100	338,261.00	0.34
61	300316	晶盛机电	11,100	333,888.00	0.33
62	000009	中国宝安	44,300	333,579.00	0.33
63	002075	沙钢股份	30,300	332,391.00	0.33
64	002500	山西证券	37,030	331,418.50	0.33
65	300146	汤臣倍健	13,600	328,440.00	0.33
66	600867	通化东宝	24,500	327,810.00	0.33
67	002683	宏大爆破	9,100	327,145.00	0.33
68	000630	铜陵有色	126,500	325,105.00	0.33
69	000988	华工科技	13,900	322,341.00	0.32
70	600511	国药股份	6,500	320,515.00	0.32
71	600038	中直股份	5,100	319,821.00	0.32
72	002791	坚朗五金	2,200	316,800.00	0.32
73	000998	隆平高科	15,900	314,979.00	0.31
74	300482	万孚生物	3,500	312,235.00	0.31
75	300463	迈克生物	6,700	312,220.00	0.31

76	600733	北汽蓝谷	36,000	312,120.00	0.31
77	300168	万达信息	14,300	310,167.00	0.31
78	002250	联化科技	12,700	304,673.00	0.30
79	300001	特锐德	10,300	302,408.00	0.30
80	600909	华安证券	37,400	299,200.00	0.30
81	002223	鱼跃医疗	10,400	293,384.00	0.29
82	300223	北京君正	3,200	292,768.00	0.29
83	300070	碧水源	38,000	290,700.00	0.29
84	002156	通富微电	11,500	290,260.00	0.29
85	002444	巨星科技	9,300	289,323.00	0.29
86	000021	深科技	15,200	288,952.00	0.29
87	600754	锦江酒店	5,600	288,568.00	0.29
88	603737	三棵树	1,900	287,850.00	0.29
89	002557	洽洽食品	5,300	285,405.00	0.29
90	002572	索菲亚	11,000	284,900.00	0.28
91	002299	圣农发展	10,700	283,978.00	0.28
92	688099	晶晨股份	3,600	283,428.00	0.28
93	600779	水井坊	3,400	282,268.00	0.28
94	002926	华西证券	22,600	282,048.00	0.28
95	300418	昆仑万维	14,100	281,295.00	0.28
96	600380	健康元	20,200	280,982.00	0.28
97	601689	拓普集团	7,300	280,539.00	0.28
98	002080	中材科技	11,600	280,488.00	0.28
99	600879	航天电子	37,400	279,752.00	0.28
100	600418	江淮汽车	22,800	278,844.00	0.28
101	603866	桃李面包	4,700	277,770.00	0.28
102	600155	华创阳安	21,043	277,557.17	0.28
103	600516	方大炭素	39,200	277,144.00	0.28
104	000039	中集集团	18,400	275,816.00	0.28
105	002670	国盛金控	20,000	275,000.00	0.27
106	002138	顺络电子	11,100	272,172.00	0.27
107	300271	华宇软件	11,300	269,731.00	0.27
108	002603	以岭药业	10,400	265,200.00	0.27
109	300024	机器人	21,500	264,450.00	0.26
110	000623	吉林敖东	16,000	263,520.00	0.26
111	600372	中航电子	13,300	261,345.00	0.26
112	002081	金螳螂	27,700	260,103.00	0.26
113	002373	千方科技	13,600	260,032.00	0.26
114	000513	丽珠集团	6,400	259,200.00	0.26
115	600415	小商品城	46,700	257,317.00	0.26
116	300244	迪安诊断	7,500	257,100.00	0.26
117	300115	长盈精密	10,400	256,360.00	0.26

118	000878	云南铜业	17,500	253,225.00	0.25
119	688088	虹软科技	3,600	251,712.00	0.25
120	000050	深天马 A	16,900	249,106.00	0.25
121	600166	福田汽车	79,000	248,850.00	0.25
122	600563	法拉电子	2,300	247,365.00	0.25
123	300618	寒锐钴业	2,600	246,766.00	0.25
124	000975	银泰黄金	28,640	246,590.40	0.25
125	601615	明阳智能	12,900	244,842.00	0.24
126	600549	厦门钨业	14,500	244,325.00	0.24
127	600801	华新水泥	11,800	243,434.00	0.24
128	002273	水晶光电	21,000	243,390.00	0.24
129	600765	中航重机	9,700	242,500.00	0.24
130	300315	掌趣科技	47,400	242,214.00	0.24
131	600153	建发股份	29,500	242,195.00	0.24
132	300009	安科生物	16,480	241,926.40	0.24
133	002064	华峰化学	23,900	241,151.00	0.24
134	002019	亿帆医药	12,700	240,411.00	0.24
135	600667	太极实业	25,400	240,030.00	0.24
136	000739	普洛药业	10,200	237,456.00	0.24
137	000686	东北证券	24,100	236,662.00	0.24
138	002705	新宝股份	5,600	236,600.00	0.24
139	002511	中顺洁柔	11,300	235,831.00	0.24
140	002920	德赛西威	2,800	235,592.00	0.24
141	600598	北大荒	12,200	234,850.00	0.23
142	002831	裕同科技	7,600	232,712.00	0.23
143	300017	网宿科技	33,700	232,193.00	0.23
144	600535	天士力	15,600	230,724.00	0.23
145	002124	天邦股份	15,800	230,680.00	0.23
146	600170	上海建工	76,400	229,964.00	0.23
147	000401	冀东水泥	16,200	229,230.00	0.23
148	000540	中天金融	72,200	227,430.00	0.23
149	000738	航发控制	9,900	227,007.00	0.23
150	600895	张江高科	13,300	226,632.00	0.23
151	603858	步长制药	9,800	226,086.00	0.23
152	000830	鲁西化工	17,600	224,928.00	0.22
153	603883	老百姓	3,560	223,674.80	0.22
154	002506	协鑫集成	52,300	222,275.00	0.22
155	002195	二三四五	98,300	222,158.00	0.22
156	002152	广电运通	20,800	222,144.00	0.22
157	002648	卫星石化	8,500	222,020.00	0.22
158	002966	苏州银行	28,700	220,416.00	0.22
159	600642	申能股份	42,200	220,284.00	0.22

160	600409	三友化工	21,300	218,325.00	0.22
161	600859	王府井	6,700	218,286.00	0.22
162	000690	宝新能源	29,900	218,270.00	0.22
163	603290	斯达半导	900	216,810.00	0.22
164	600392	盛和资源	24,100	214,249.00	0.21
165	002056	横店东磁	14,100	214,179.00	0.21
166	600008	首创股份	75,610	213,976.30	0.21
167	603638	艾迪精密	3,100	213,714.00	0.21
168	601456	国联证券	10,000	213,300.00	0.21
169	601992	金隅集团	71,600	212,652.00	0.21
170	002382	蓝帆医疗	10,000	210,900.00	0.21
171	002028	思源电气	10,500	210,630.00	0.21
172	600580	卧龙电驱	13,500	210,600.00	0.21
173	600497	驰宏锌锗	43,800	210,240.00	0.21
174	002281	光迅科技	7,200	209,088.00	0.21
175	002690	美亚光电	4,700	208,116.00	0.21
176	000060	中金岭南	42,900	206,778.00	0.21
177	000729	燕京啤酒	24,200	206,184.00	0.21
178	300058	蓝色光标	34,300	205,800.00	0.21
179	300212	易华录	6,680	204,742.00	0.20
180	002595	豪迈科技	6,900	204,585.00	0.20
181	002294	信立泰	7,200	203,976.00	0.20
182	002372	伟星新材	10,900	203,830.00	0.20
183	000807	云铝股份	26,900	202,557.00	0.20
184	601866	中远海发	68,100	202,257.00	0.20
185	002221	东华能源	19,900	201,786.00	0.20
186	000581	威孚高科	8,700	201,753.00	0.20
187	600827	百联股份	13,800	201,480.00	0.20
188	600315	上海家化	5,800	201,434.00	0.20
189	600528	中铁工业	23,000	201,020.00	0.20
190	000983	山西焦煤	35,250	198,810.00	0.20
191	600256	广汇能源	69,600	196,968.00	0.20
192	603605	珀莱雅	1,100	195,800.00	0.20
193	601717	郑煤机	17,900	195,647.00	0.20
194	300296	利亚德	30,600	194,616.00	0.19
195	000997	新大陆	12,700	194,056.00	0.19
196	000960	锡业股份	17,300	193,760.00	0.19
197	002429	兆驰股份	31,100	192,820.00	0.19
198	300630	普利制药	4,559	190,976.51	0.19
199	600875	东方电气	19,100	190,427.00	0.19
200	600704	物产中大	43,500	190,095.00	0.19
201	600160	巨化股份	23,300	188,963.00	0.19

202	600260	凯乐科技	17,200	187,480.00	0.19
203	002396	星网锐捷	8,100	186,786.00	0.19
204	002745	木林森	12,772	186,343.48	0.19
205	600811	东方集团	51,000	186,150.00	0.19
206	600839	四川长虹	63,400	183,860.00	0.18
207	600728	佳都科技	24,200	183,678.00	0.18
208	002368	太极股份	7,019	183,266.09	0.18
209	600258	首旅酒店	8,600	182,492.00	0.18
210	300474	景嘉微	2,600	181,766.00	0.18
211	002092	中泰化学	29,500	181,425.00	0.18
212	600515	海航基础	26,800	180,900.00	0.18
213	600325	华发股份	29,100	180,711.00	0.18
214	600167	联美控股	15,700	178,195.00	0.18
215	600737	中粮糖业	18,400	178,112.00	0.18
216	603927	中科软	4,400	176,396.00	0.18
217	600820	隧道股份	32,500	175,825.00	0.18
218	000012	南玻A	23,700	174,906.00	0.17
219	600881	亚泰集团	55,800	172,980.00	0.17
220	603317	天味食品	2,100	172,704.00	0.17
221	600967	内蒙一机	14,200	172,672.00	0.17
222	002085	万丰奥威	26,300	172,528.00	0.17
223	600597	光明乳业	10,600	172,356.00	0.17
224	300002	神州泰岳	33,700	172,207.00	0.17
225	002390	信邦制药	20,100	170,448.00	0.17
226	002242	九阳股份	5,300	169,812.00	0.17
227	002268	卫士通	10,100	168,670.00	0.17
228	600446	金证股份	10,400	168,584.00	0.17
229	600410	华胜天成	18,900	167,454.00	0.17
230	000999	华润三九	6,700	167,098.00	0.17
231	600567	山鹰国际	55,300	167,006.00	0.17
232	603712	七一二	4,000	166,600.00	0.17
233	002174	游族网络	12,600	165,816.00	0.17
234	600804	鹏博士	24,600	165,312.00	0.17
235	000877	天山股份	10,900	164,590.00	0.16
236	600282	南钢股份	52,700	164,424.00	0.16
237	000709	河钢股份	73,000	163,520.00	0.16
238	601179	中国西电	35,300	162,733.00	0.16
239	000930	中粮科技	19,300	162,506.00	0.16
240	603000	人民网	9,600	162,240.00	0.16
241	600435	北方导航	17,900	161,100.00	0.16
242	002387	维信诺	14,100	160,740.00	0.16
243	000629	攀钢钒钛	73,800	160,146.00	0.16

244	600273	嘉化能源	17,300	159,852.00	0.16
245	600026	中远海能	23,900	159,652.00	0.16
246	002807	江阴银行	37,300	159,644.00	0.16
247	600216	浙江医药	11,700	159,120.00	0.16
248	300166	东方国信	14,500	158,775.00	0.16
249	000301	东方盛虹	16,700	158,316.00	0.16
250	001914	招商积余	7,300	157,169.00	0.16
251	002233	塔牌集团	12,300	156,702.00	0.16
252	600718	东软集团	14,900	155,109.00	0.16
253	600060	海信视像	13,500	154,980.00	0.15
254	002985	北摩高科	800	154,640.00	0.15
255	600037	歌华有线	16,800	154,560.00	0.15
256	600908	无锡银行	25,400	154,432.00	0.15
257	600188	兖州煤业	15,300	154,071.00	0.15
258	600064	南京高科	14,900	153,023.00	0.15
259	000778	新兴铸管	41,100	151,248.00	0.15
260	600572	康恩贝	32,100	151,191.00	0.15
261	000932	华菱钢铁	31,600	151,048.00	0.15
262	002004	华邦健康	27,200	150,688.00	0.15
263	000400	许继电气	10,400	150,384.00	0.15
264	600755	厦门国贸	22,500	150,300.00	0.15
265	601975	招商南油	59,500	149,345.00	0.15
266	000027	深圳能源	24,500	149,205.00	0.15
267	601005	重庆钢铁	100,700	149,036.00	0.15
268	002925	盈趣科技	2,300	147,959.00	0.15
269	600039	四川路桥	32,800	147,928.00	0.15
270	000598	兴蓉环境	30,800	147,840.00	0.15
271	000887	中鼎股份	12,600	147,546.00	0.15
272	603198	迎驾贡酒	4,200	146,580.00	0.15
273	002128	露天煤业	13,200	144,408.00	0.14
274	000089	深圳机场	17,600	143,792.00	0.14
275	002701	奥瑞金	29,000	143,260.00	0.14
276	600398	海澜之家	22,300	143,166.00	0.14
277	002110	三钢闽光	21,200	142,676.00	0.14
278	600158	中体产业	11,600	142,216.00	0.14
279	300026	红日药业	31,000	141,980.00	0.14
280	601118	海南橡胶	29,400	141,708.00	0.14
281	000825	太钢不锈	39,100	141,151.00	0.14
282	601106	中国一重	47,200	141,128.00	0.14
283	002191	劲嘉股份	15,100	139,373.00	0.14
284	002563	森马服饰	13,900	139,278.00	0.14
285	000970	中科三环	14,600	137,970.00	0.14

286	600120	浙江东方	23,040	137,548.80	0.14
287	300072	三聚环保	24,200	137,456.00	0.14
288	600171	上海贝岭	9,700	135,994.00	0.14
289	002867	周大生	5,100	135,915.00	0.14
290	000488	晨鸣纸业	21,100	135,462.00	0.14
291	002048	宁波华翔	8,700	135,459.00	0.14
292	600022	山东钢铁	94,000	134,420.00	0.13
293	002936	郑州银行	30,080	134,156.80	0.13
294	600195	中牧股份	10,472	134,146.32	0.13
295	601699	潞安环能	20,600	133,900.00	0.13
296	000090	天健集团	22,500	133,650.00	0.13
297	600056	中国医药	9,300	133,269.00	0.13
298	688321	微芯生物	3,600	133,236.00	0.13
299	002839	张家港行	21,800	132,980.00	0.13
300	000402	金融街	20,600	132,870.00	0.13
301	000967	盈峰环境	16,300	132,682.00	0.13
302	603228	景旺电子	4,400	132,660.00	0.13
303	601860	紫金银行	31,500	132,615.00	0.13
304	002217	合力泰	32,200	132,020.00	0.13
305	300133	华策影视	21,200	131,016.00	0.13
306	600376	首开股份	22,200	130,314.00	0.13
307	000528	柳工	17,700	130,272.00	0.13
308	600006	东风汽车	13,800	130,272.00	0.13
309	000883	湖北能源	33,500	129,980.00	0.13
310	600673	东阳光	25,800	129,774.00	0.13
311	601333	广深铁路	58,300	129,426.00	0.13
312	603077	和邦生物	90,900	129,078.00	0.13
313	688029	南微医学	700	128,807.00	0.13
314	000563	陕国投A	34,100	128,557.00	0.13
315	600507	方大特钢	18,500	128,390.00	0.13
316	000990	诚志股份	10,817	128,289.62	0.13
317	600021	上海电力	18,000	128,160.00	0.13
318	600928	西安银行	23,000	127,880.00	0.13
319	601200	上海环境	11,687	127,388.30	0.13
320	300376	易事特	15,900	126,564.00	0.13
321	601000	唐山港	50,900	126,232.00	0.13
322	000685	中山公用	15,200	126,160.00	0.13
323	600782	新钢股份	27,400	125,766.00	0.13
324	600500	中化国际	23,800	125,426.00	0.13
325	300180	华峰超纤	21,200	125,292.00	0.13
326	000898	鞍钢股份	41,200	125,248.00	0.13
327	002266	浙富控股	27,730	124,785.00	0.12

328	002317	众生药业	11,300	124,526.00	0.12
329	002203	海亮股份	16,800	124,152.00	0.12
330	601865	福莱特	3,100	123,690.00	0.12
331	300113	顺网科技	7,200	123,480.00	0.12
332	600126	杭钢股份	23,300	123,257.00	0.12
333	600970	中材国际	17,900	123,152.00	0.12
334	603568	伟明环保	6,500	123,045.00	0.12
335	002244	滨江集团	26,700	122,553.00	0.12
336	002155	湖南黄金	14,400	122,544.00	0.12
337	000559	万向钱潮	22,800	121,980.00	0.12
338	000758	中色股份	23,800	120,904.00	0.12
339	600466	蓝光发展	26,000	120,380.00	0.12
340	000519	中兵红箭	12,000	120,240.00	0.12
341	601598	中国外运	27,100	119,240.00	0.12
342	600266	城建发展	23,320	118,465.60	0.12
343	300182	捷成股份	36,600	118,218.00	0.12
344	600373	中文传媒	11,700	118,053.00	0.12
345	600649	城投控股	21,700	117,831.00	0.12
346	601016	节能风电	34,300	117,649.00	0.12
347	601098	中南传媒	12,300	117,219.00	0.12
348	300010	豆神教育	12,000	117,120.00	0.12
349	600546	山煤国际	13,700	116,587.00	0.12
350	601608	中信重工	29,400	116,424.00	0.12
351	600073	上海梅林	11,300	116,277.00	0.12
352	600348	阳泉煤业	20,700	116,127.00	0.12
353	603885	吉祥航空	10,200	115,974.00	0.12
354	002458	益生股份	10,300	114,845.00	0.11
355	600388	龙净环保	12,900	114,552.00	0.11
356	000028	国药一致	2,500	114,500.00	0.11
357	601718	际华集团	37,700	114,231.00	0.11
358	000078	海王生物	28,400	113,884.00	0.11
359	600959	江苏有线	34,400	113,864.00	0.11
360	600901	江苏租赁	20,600	113,506.00	0.11
361	002440	闰土股份	12,000	111,840.00	0.11
362	600645	中源协和	5,700	111,777.00	0.11
363	002183	怡亚通	25,600	111,616.00	0.11
364	002505	鹏都农牧	43,900	111,067.00	0.11
365	002399	海普瑞	6,400	110,208.00	0.11
366	600094	大名城	27,400	110,148.00	0.11
367	002640	跨境通	21,400	109,996.00	0.11
368	600633	浙数文化	13,500	109,890.00	0.11
369	002249	大洋电机	24,400	109,800.00	0.11

370	600062	华润双鹤	9,100	109,109.00	0.11
371	600808	马钢股份	41,000	109,060.00	0.11
372	600835	上海机电	5,600	108,976.00	0.11
373	002038	双鹭药业	10,600	107,060.00	0.11
374	002468	申通快递	10,600	106,848.00	0.11
375	000564	供销大集	41,100	106,449.00	0.11
376	600141	兴发集团	9,600	105,888.00	0.11
377	600675	中华企业	31,500	105,840.00	0.11
378	002010	传化智联	22,400	105,504.00	0.11
379	000959	首钢股份	27,300	104,559.00	0.10
380	600643	爱建集团	13,900	104,528.00	0.10
381	601958	金钼股份	16,700	103,707.00	0.10
382	002434	万里扬	11,600	103,472.00	0.10
383	601778	晶科科技	14,200	103,092.00	0.10
384	600863	内蒙华电	39,900	102,543.00	0.10
385	601880	大连港	53,100	102,483.00	0.10
386	000158	常山北明	16,500	102,300.00	0.10
387	000415	渤海租赁	42,500	102,000.00	0.10
388	002408	齐翔腾达	12,200	101,992.00	0.10
389	600729	重庆百货	3,500	101,150.00	0.10
390	000869	张裕A	2,300	100,280.00	0.10
391	601611	中国核建	13,700	99,736.00	0.10
392	600717	天津港	20,820	99,519.60	0.10
393	000826	启迪环境	14,700	99,372.00	0.10
394	600312	平高电气	13,900	99,246.00	0.10
395	002544	杰赛科技	5,900	99,002.00	0.10
396	600776	东方通信	8,300	98,355.00	0.10
397	000031	大悦城	22,100	97,240.00	0.10
398	002583	海能达	15,800	97,012.00	0.10
399	300459	金科文化	30,200	96,338.00	0.10
400	000681	视觉中国	7,300	94,900.00	0.09
401	002635	安洁科技	5,500	94,765.00	0.09
402	002424	贵州百灵	12,100	94,743.00	0.09
403	002589	瑞康医药	18,100	94,663.00	0.09
404	002002	鸿达兴业	31,200	93,600.00	0.09
405	600259	广晟有色	3,100	93,527.00	0.09
406	000501	鄂武商A	8,000	93,200.00	0.09
407	600566	济川药业	4,600	93,058.00	0.09
408	603650	彤程新材	3,000	93,000.00	0.09
409	300324	旋极信息	21,200	89,676.00	0.09
410	603708	家家悦	4,200	89,460.00	0.09
411	600823	世茂股份	19,400	89,434.00	0.09

412	600648	外高桥	6,400	89,408.00	0.09
413	000717	韶钢松山	20,900	89,243.00	0.09
414	000718	苏宁环球	26,000	89,180.00	0.09
415	600307	酒钢宏兴	53,800	88,770.00	0.09
416	600339	中油工程	28,800	88,704.00	0.09
417	600131	国网信通	6,200	88,226.00	0.09
418	002815	崇达技术	6,100	88,084.00	0.09
419	000046	泛海控股	26,800	87,904.00	0.09
420	600582	天地科技	28,500	87,780.00	0.09
421	600329	中新药业	5,000	87,600.00	0.09
422	002375	亚厦股份	11,600	86,304.00	0.09
423	000008	神州高铁	33,400	84,836.00	0.08
424	000156	华数传媒	9,900	84,744.00	0.08
425	600985	淮北矿业	7,500	83,925.00	0.08
426	600968	海油发展	35,000	83,650.00	0.08
427	002948	青岛银行	14,100	83,613.00	0.08
428	601928	凤凰传媒	13,100	82,923.00	0.08
429	600338	西藏珠峰	7,900	82,792.00	0.08
430	000061	农产品	11,700	82,485.00	0.08
431	600664	哈药股份	25,800	82,302.00	0.08
432	600707	彩虹股份	12,300	81,918.00	0.08
433	000543	皖能电力	19,500	81,510.00	0.08
434	300257	开山股份	5,900	80,535.00	0.08
435	603260	合盛硅业	2,400	80,256.00	0.08
436	002416	爱施德	10,700	79,822.00	0.08
437	603377	东方时尚	4,100	79,376.00	0.08
438	603515	欧普照明	2,600	78,546.00	0.08
439	600556	天下秀	6,200	78,430.00	0.08
440	600748	上实发展	15,900	78,069.00	0.08
441	002302	西部建设	8,800	77,264.00	0.08
442	601298	青岛港	12,000	77,160.00	0.08
443	600869	远东股份	19,100	76,209.00	0.08
444	000937	冀中能源	18,200	75,712.00	0.08
445	601127	小康股份	4,400	75,152.00	0.08
446	600639	浦东金桥	5,800	71,920.00	0.07
447	601139	深圳燃气	9,900	71,676.00	0.07
448	601228	广州港	21,300	71,568.00	0.07
449	002503	搜于特	31,900	71,456.00	0.07
450	600277	亿利洁能	23,600	70,564.00	0.07
451	600787	中储股份	15,100	69,611.00	0.07
452	000600	建投能源	12,300	69,003.00	0.07
453	600545	卓郎智能	19,600	68,600.00	0.07

454	000062	深圳华强	5,500	68,420.00	0.07
455	603888	新华网	3,600	68,400.00	0.07
456	000813	德展健康	15,400	68,222.00	0.07
457	300134	大富科技	6,600	68,178.00	0.07
458	603225	新凤鸣	4,900	68,110.00	0.07
459	600640	号百控股	5,500	67,375.00	0.07
460	600350	山东高速	10,800	66,744.00	0.07
461	600517	国网英大	10,900	66,272.00	0.07
462	601828	美凯龙	7,700	65,373.00	0.07
463	600871	石化油服	32,700	64,092.00	0.06
464	600291	西水股份	11,300	64,071.00	0.06
465	603056	德邦股份	5,000	63,450.00	0.06
466	002093	国脉科技	8,700	63,423.00	0.06
467	002419	天虹股份	8,300	63,412.00	0.06
468	600575	淮河能源	26,700	61,944.00	0.06
469	002051	中工国际	8,600	60,974.00	0.06
470	000537	广宇发展	9,700	60,819.00	0.06
471	603379	三美股份	3,160	60,356.00	0.06
472	600657	信达地产	14,700	59,535.00	0.06
473	002901	大博医疗	800	58,984.00	0.06
474	000553	安道麦 A	7,500	58,650.00	0.06
475	603893	瑞芯微	800	57,880.00	0.06
476	601869	长飞光纤	2,100	56,784.00	0.06
477	600623	华谊集团	9,700	56,260.00	0.06
478	000732	泰禾集团	17,200	56,244.00	0.06
479	603328	依顿电子	6,900	54,855.00	0.05
480	603786	科博达	800	54,096.00	0.05
481	002946	新乳业	2,900	51,069.00	0.05
482	600903	贵州燃气	3,900	49,530.00	0.05
483	002653	海思科	2,800	49,056.00	0.05
484	601801	皖新传媒	10,300	48,925.00	0.05
485	603983	丸美股份	900	46,989.00	0.05
486	603719	良品铺子	800	46,936.00	0.05
487	601003	柳钢股份	8,900	46,191.00	0.05
488	603355	莱克电气	1,500	45,345.00	0.05
489	603868	飞科电器	900	42,102.00	0.04
490	601969	海南矿业	6,700	40,066.00	0.04
491	600053	九鼎投资	1,900	37,145.00	0.04
492	002941	新疆交建	3,300	36,300.00	0.04
493	002818	富森美	2,520	35,607.60	0.04
494	002423	中粮资本	3,200	30,976.00	0.03
495	002957	科瑞技术	1,500	30,675.00	0.03

496	001872	招商港口	1,900	30,248.00	0.03
497	601512	中新集团	2,800	27,832.00	0.03
498	603256	宏和科技	3,000	26,490.00	0.03
499	600917	重庆燃气	3,200	21,952.00	0.02
500	601068	中铝国际	5,400	19,224.00	0.02

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

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300863	卡倍亿	3,421	353,115.62	0.35
2	688185	康希诺	839	298,415.52	0.30
3	688386	泛亚微透	3,217	152,517.97	0.15
4	300880	迦南智能	3,732	129,612.36	0.13
5	688589	力合微	3,562	125,845.46	0.13
6	688069	德林海	1,577	98,483.65	0.10
7	300869	康泰医学	862	95,578.56	0.10
8	300999	金龙鱼	909	80,255.61	0.08
9	688569	铁科轨道	3,109	62,490.90	0.06
10	300926	博俊科技	3,285	35,346.60	0.04
11	003026	中晶科技	460	21,693.60	0.02
12	003029	吉大正元	716	18,716.24	0.02
13	003028	振邦智能	432	18,010.08	0.02
14	300871	回盛生物	378	14,628.60	0.01
15	300890	翔丰华	286	13,971.10	0.01
16	300892	品渥食品	227	13,622.27	0.01
17	300895	铜牛信息	283	12,819.90	0.01
18	300879	大叶股份	466	12,637.92	0.01
19	300861	美畅股份	239	12,212.90	0.01
20	300887	谱尼测试	150	11,178.00	0.01
21	300860	锋尚文化	83	10,513.61	0.01
22	300893	松原股份	276	9,682.08	0.01
23	300881	盛德鑫泰	291	9,402.21	0.01
24	300868	杰美特	216	9,348.48	0.01
25	300919	中伟股份	137	8,426.87	0.01
26	300886	华业香料	147	6,713.49	0.01
27	300922	天秦装备	207	6,537.06	0.01
28	003031	中瓷电子	387	5,909.49	0.01

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	002821	凯莱英	3,978,510.85	3.98
2	002127	南极电商	3,019,452.50	3.02
3	002371	北方华创	2,951,768.00	2.95
4	300253	卫宁健康	2,830,369.47	2.83
5	002129	中环股份	2,393,709.00	2.39
6	002049	紫光国微	2,385,185.90	2.39
7	300012	华测检测	2,376,491.00	2.38
8	300014	亿纬锂能	2,354,955.00	2.35
9	002439	启明星辰	2,279,777.88	2.28
10	002185	华天科技	2,251,893.00	2.25
11	002463	沪电股份	2,196,419.68	2.20
12	002075	沙钢股份	2,175,507.00	2.18
13	002131	利欧股份	2,171,838.00	2.17
14	300383	光环新网	2,170,108.00	2.17
15	002384	东山精密	2,147,796.28	2.15
16	002385	大北农	2,024,145.00	2.02
17	002074	国轩高科	2,007,248.00	2.01
18	600745	闻泰科技	1,985,874.00	1.99
19	300529	健帆生物	1,978,438.06	1.98
20	300088	长信科技	1,957,910.00	1.96

注：本项“买入金额”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。

8.4.2 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	688981	中芯国际	5,899,527.95	5.90
2	002821	凯莱英	4,312,057.48	4.31
3	300253	卫宁健康	2,961,405.40	2.96
4	002127	南极电商	2,956,526.93	2.96
5	300014	亿纬锂能	2,910,807.70	2.91
6	002371	北方华创	2,806,818.00	2.81
7	600745	闻泰科技	2,614,967.00	2.61
8	002129	中环股份	2,513,814.00	2.51
9	002384	东山精密	2,381,318.00	2.38
10	002049	紫光国微	2,165,915.00	2.17
11	002463	沪电股份	2,147,739.00	2.15
12	300383	光环新网	2,139,649.50	2.14
13	300012	华测检测	2,113,594.00	2.11
14	600584	长电科技	2,109,492.00	2.11
15	002439	启明星辰	2,102,430.28	2.10

16	300529	健帆生物	2,042,267.00	2.04
17	002414	高德红外	1,969,915.88	1.97
18	002812	恩捷股份	1,962,561.00	1.96
19	600763	通策医疗	1,949,657.00	1.95
20	002185	华天科技	1,903,859.98	1.90

注：本项“卖出金额”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。

8.4.3 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

买入股票成本（成交）总额	435,552,113.50
卖出股票收入（成交）总额	303,718,145.53

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”和“卖出股票的收入（成交）总额”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

注：本基金本报告期末未投资债券。

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

注：本基金本报告期末未投资债券。

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

注：本基金本报告期末未投资资产支持证券。

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

注：本基金本报告期末未投资贵金属。

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

注：本基金本报告期末未投资权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货，无相关投资政策。

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

本基金本报告期末未有国债期货持仓。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未有国债期货持仓。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未有国债期货持仓，无相关评价。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

无。

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	97,712.48
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	293.04
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	98,005.52

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有可转债。

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

注：期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	300863	卡倍亿	353,115.62	0.35	新股流通受限
2	688185	康希诺	298,415.52	0.30	新股流通受限
3	688386	泛亚微透	152,517.97	0.15	新股流通受限
4	300880	迦南智能	129,612.36	0.13	新股流通受限
5	688589	力合微	125,845.46	0.13	新股流通受限

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

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

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 (%)
308	258,006.75	72,282,080.00	90.96	7,184,000.00	9.04

9.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额（份）	占总份额比例（%）
ETF 联接基金	52,174,900.00	65.66

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	招商银行股份有限公司—中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	52,174,900.00	65.66
2	创金合信基金—中国银行—创金合信鼎泰 34 号集合资产管理计划	10,003,600.00	12.59
3	中信证券—中国银行—中信证券瑞丰丰元 1 号集合资产管理计划	10,002,700.00	12.59
4	王栓伟	1,010,000.00	1.27
5	李海兵	500,000.00	0.63
6	凌秀兰	330,000.00	0.42
7	宋利雨	325,000.00	0.41
8	刘英虹	250,000.00	0.31
9	曾雨清	210,000.00	0.26
10	胡汉明	169,400.00	0.21

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	1,000.00	0.00

9.4 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情况

项目	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

基金经理姓名	产品类型	持有本人管理的产品份额总量的数量区间（万份）
—	公募基金	0
	私募资产管理计划	0
	合计	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2020 年 4 月 30 日） 基金份额总额	251,466,080.00
基金合同生效日起至报告期期末基金 总申购份额	98,000,000.00
减：基金合同生效日起至报告期期末基 金总赎回份额	270,000,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金 拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	—
本报告期期末基金份额总额	79,466,080.00

§ 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

2020 年 2 月，中银国际证券股份有限公司聘任亓磊为公司合规总监兼公司公募基金管理业务合规负责人，解聘赵向雷兼任的公司合规总监兼公司公募基金管理业务合规负责人职务。2020 年 8 月，中银国际证券股份有限公司副执行总裁沈锋分管资产管理板块等，董事会秘书翟增军不再分管资产管理板块。2020 年 3 月，公司股东大会选举李军先生为公司第一届董事会独立董事，公司股东大会同意管涛先生辞任公司独立董事的议案。2020 年 6 月，公司股东大会选举文兰女士、艾富华先生为公司第一届董事会董事，公司股东大会同意王海权先生、廖胜森先生辞任公司董事的议案。

自 2020 年 8 月 28 日起，刘波先生担任招商银行股份有限公司资产托管部总经理职务。

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，无涉及基金管理人、基金财产的诉讼，无涉及基金托管业务的诉讼

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。本基金本年度应支付给审计机构普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 60,000 元人民币，其已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

本报告期内，未有管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	
中银证券	4	739,270,259.03	100.00%	534,823.95	100.00%	-

注：1、由于交易所系统限制，本基金管理人作为上海和深圳证券交易所的会员单位目前尚不能再租用其他证券公司的交易单元。

2、今后基金专用交易席位的选择标准如下：

(1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；

(2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；

(3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合

模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

3、今后基金专用交易席位的选择程序如下：

(1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构。

(2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

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		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券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
中银证券	-	-	-	-	-	-

注：1、由于交易所系统限制，本基金管理人作为上海和深圳证券交易所的会员单位目前尚不能再租用其他证券公司的交易单元。

2、今后基金专用交易席位的选择标准如下：

(1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；

(2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；

(3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

3、今后基金专用交易席位的选择程序如下：

(1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构。

(2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

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	中银国际证券股份有限公司旗下基金 2019 年第 4 季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2020 年 1 月 17 日

2	中银国际证券股份有限公司关于 2020 年春节假期延长期间暂停办理申购赎回等业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司官网	2020 年 1 月 30 日
3	中银国际证券股份有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司官网	2020 年 3 月 3 日
4	中银国际证券股份有限公司关于推迟披露旗下基金 2019 年年度报告的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司官网	2020 年 3 月 24 日
5	中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书	证券日报、公司官网、上交所	2020 年 3 月 25 日
6	中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同	公司官网、上交所	2020 年 3 月 25 日
7	中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议	公司官网、上交所	2020 年 3 月 25 日
8	中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告	公司官网、上交所	2020 年 3 月 25 日
9	中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告	证券日报	2020 年 3 月 25 日
10	中银国际证券股份有限公司关于增加江苏汇林保大基金销售有限公司为旗下基金销售机构并进行费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司官网	2020 年 3 月 30 日
11	中银国际证券股份有限公司关于增加中信建投证券股份有限公司为旗下基金销售机构并进行费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司官网、上交所	2020 年 4 月 13 日
12	中银国际证券股份有限公司旗下基金 2020 年第 1 季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2020 年 4 月 21 日
13	中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金上网发售提示性公告	证券日报、公司官网、上交所	2020 年 4 月 22 日
14	中银国际证券股份有限公司关于增加北京百度百盈基金销售有限公司为旗下基金销售机构并进行费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、公司官网、上交所	2020 年 4 月 23 日
15	中银国际证券股份有限公司旗下基金 2019 年年度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2019 年 4 月 30 日
16	中银证券中证 500 交易型开放式指数基金基金合同生效公告	公司官网、证券日报、上交所	2020 年 5 月 6 日
17	关于中银证券中证 500ETF 增加中金公司为申购赎回代办证券公司的公告	证券日报、公司官网、上交所	2020 年 5 月 19 日
18	中银证券中证 500 交易型开放式指数	证券日报、公司官网、	2020 年 5 月 22 日

	证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告	上交所	
19	中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书	公司官网、上交所	2020 年 5 月 22 日
20	中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书提示性公告	证券日报	2020 年 5 月 22 日
21	中银国际证券股份有限公司关于调整旗下基金长期停牌股票估值方法的公告	上海证券报、证券日报、公司官网、上交所	2020 年 5 月 23 日
22	关于中银证券中证 500ETF 增加招商证券为申购赎回代办证券公司的公告	证券日报、公司官网、上交所	2020 年 6 月 8 日
23	中银国际证券股份有限公司旗下基金 2020 年第 2 季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、上交所	2020 年 7 月 21 日
24	中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年第 2 季度报告	公司官网、上交所	2020 年 7 月 21 日
25	中银国际证券股份有限公司关于旗下基金参与招商银行费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司官网、上交所	2020 年 7 月 28 日
26	中银国际证券股份有限公司关于增加苏宁基金及蛋卷基金为旗下基金销售机构并进行费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司官网、上交所	2020 年 8 月 6 日
27	中银国际证券股份有限公司旗下基金 2020 年中期报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、上交所	2020 年 8 月 31 日
28	中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年中期报告	公司官网、上交所	2020 年 8 月 31 日
29	中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	公司官网、上交所	2020 年 8 月 31 日
30	中银国际证券股份有限公司关于调整旗下基金长期停牌股票估值方法的公告	上海证券报、公司官网	2020 年 9 月 11 日
31	中银国际证券股份有限公司关于中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理变更的公告	证券日报、公司官网、上交所	2020 年 9 月 15 日
32	中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书（2020 年第 1 号）	公司官网、上交所	2020 年 9 月 16 日
33	中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	公司官网、上交所	2020 年 9 月 16 日
34	中银国际证券股份有限公司旗下基金 2020 年第 3 季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、上交所	2020 年 10 月 28 日

35	中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年第 3 季度报告	公司官网、上交所	2020 年 10 月 28 日
36	中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书（2020 年第 2 号）	公司官网	2020 年 12 月 31 日

注：全部公告均在公司网站披露，部分公告在公司网站及报纸披露。

§ 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 (%)
联接基金	1	20200528-20201231	0.00	188,174,900.00	136,000,000.00	52,174,900.00	65.66

产品特有风险

本基金由于存在单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况，如遇市场行情突变可能存在大额赎回甚至巨额赎回的风险，增加基金管理人的流动性管理压力。同时，基金管理人应付赎回的变现行为可能使基金资产净值受到不利影响或者产生较大波动。本基金管理人后期将审慎评估大额申购对基金持有集中度的影响，避免单一投资者集中度继续提高，同时将完善流动性风险风险管控机制，加强对基金持有人利益的保护。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予本基金募集注册的文件
- 2、基金合同
- 3、托管协议
- 4、法律意见书
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照

7、中国证监会要求的其他文件

13.2 存放地点

除第 6 项在基金托管人处外，其余文件均在基金管理人的住所。

13.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

中银国际证券股份有限公司

2021 年 3 月 31 日