

中银证券创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金（C类份额）

基金产品资料概要更新

编制日期：2026年06月26日

送出日期：2026年06月27日

本概要提供本基金的重要信息，是招募说明书的一部分。

作出投资决定前，请阅读完整的招募说明书等销售文件。

一、产品概况

基金简称	中银证券创业板ETF联接	基金代码	026772
下属基金简称	中银证券创业板ETF联接C	下属基金交易代码	026773
基金管理人	中银国际证券股份有限公司	基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金合同生效日	2026年3月17日	上市交易所及上市日期	-
基金类型	股票型	交易币种	人民币
运作方式	普通开放式	开放频率	每个开放日
基金经理	张艺敏	开始担任本基金基金经理的日期	2026年3月17日
		证券从业日期	2017年7月27日

注：未来若出现标的指数不符合要求（因成份股价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求以及法律法规、监管机构另有规定的情形除外）、指数编制机构退出等情形，基金管理人应当自该情形发生之日起十个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如更换基金标的指数、转换运作方式，与其他基金合并、或者终止基金合同等，并在6个月内召集基金份额持有人大会进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的，本基金合同终止。

二、基金投资与净值表现

（一）投资目标与投资策略

请投资者阅读《招募说明书》“基金的投资”章节了解详细情况

投资目标	通过主要投资于目标ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投资范围	本基金以目标ETF基金份额、标的指数成份股（含存托凭证，下同）及备选成份股（含存托凭证，下同）为主要投资对象。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股（包括主板、创业板及其他依法发行上市的股票、存托凭证）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、货币市场工具、股指期货、股票期权、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）、资产支持证券、同业存单、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）。 本基金可以根据相关法律法规的规定参与融资和转融通证券出借业务。 本基金投资于目标ETF的资产比例不低于基金资产净值的90%；每个交易日日终在扣除

	股指期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。 如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种或变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围或调整上述投资品种的投资比例。
主要投资策略	本基金主要投资于目标ETF基金份额，该部分资产占基金资产净值的比例不低于90%。为更好地实现投资目标，本基金可投资于标的指数成份股及其备选成份股，且可少量投资于非成份股、债券、资产支持证券、债券回购、银行存款、股指期货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相关规定），其目的是为了使本基金在应付申购赎回的前提下，更好地跟踪标的指数。
业绩比较基准	创业板指数收益率×95% + 银行活期存款税后利率×5%
风险收益特征	本基金为中银证券创业板ETF的联接基金，主要通过投资于中银证券创业板ETF来实现对标的指数的紧密跟踪。因此，本基金的业绩表现与创业板指数及中银证券创业板ETF的表现密切相关。本基金的长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

注：详情请阅读《招募说明书》中“基金的投资”章节的相关内容。

（二）投资组合资产配置图表/区域配置图表

注：无。

（三）自基金合同生效以来基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

注：无。

三、投资本基金涉及的费用

（一）基金销售相关费用

以下费用在认购/申购/赎回基金过程中收取：

费用类型	份额（S）或金额（M） /持有期限（N）	收费方式/费率	备注
赎回费	N < 7 天	1.50%	个人投资者
	N ≥ 7 天	0	同上
	N < 7 天	1.50%	机构投资者
	7 天 ≤ N < 30 天	1.00%	同上
	30 天 ≤ N < 180 天	0.50%	同上
	N ≥ 180 天	0	同上

注：本基金C类基金份额在投资者申购时不收取申购费用。

（二）基金运作相关费用

以下费用将从基金资产中扣除：

费用类别	收费方式/年费率或金额	收取方
管理费	0.15%	基金管理人和销售机构
托管费	0.05%	基金托管人
销售服务费	0.20%	销售机构

审计费用	36,252.00 元	会计师事务所
信息披露费	80,000.00 元	规定披露报刊
其他费用	按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。费用类别详见本基金《基金合同》和《招募说明书》及其更新。	相关服务机构

注：1、本基金交易证券、基金等产生的费用和税负，按实际发生额从基金资产扣除。审计费用和信息披露费为基金整体承担费用，非单个份额类别费用，且年金额为预估值，最终实际金额以基金定期报告披露为准。

2、本基金的管理费按前一日基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应的基金资产净值后的余额（若为负数，则取 0）的 0.15% 年费率计提。本基金的托管费按前一日基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应的基金资产净值后的余额（若为负数，则取 0）的 0.05% 的年费率计提。

3、对于中银国际证券股份有限公司销售的 C 类基金份额收取的销售服务费，以及其他销售机构销售的 C 类基金份额持续持有期限超过一年收取的销售服务费采取先收后返模式，基金投资者实际收到的赎回款项或清算款项的金额可能与按披露的基金份额净值计算的结果存在差异。投资者的实际赎回金额和清算资金以登记机构确认数据为准。

（三）基金运作综合费用测算

若投资者认购/申购本基金份额，在持有期间，投资者需支出的运作费率如下表：

注：无

四、风险揭示与重要提示

（一）风险揭示

本基金不提供任何保证。投资者可能损失投资本金。

投资有风险，投资者购买基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》等销售文件。

本基金的主要风险包括市场风险、管理风险、技术风险、流动性风险、特有风险及其他风险。其中特有风险如下：

1、标的指数的风险：即标的指数因为编制方法的缺陷有可能导致标的指数的表现与总体市场表现存在差异，因标的指数编制方法的不成熟也可能导致指数调整较大，增加基金投资成本，并有可能因此而增加跟踪误差，影响投资收益。

2、标的指数波动的风险：标的指数成份股的价格可能受到政治因素、经济因素、上市公司状况、投资人心理和交易制度等各种因素的影响而波动，导致指数波动，从而使基金收益水平发生变化，产生风险。

3、跟踪偏离风险：即基金在跟踪指数时由于各种原因导致基金的业绩表现与标的指数表现之间产生差异的不确定性，包括但不限于以下因素：

- （1）目标 ETF 与标的指数的偏离；
- （2）基金买卖目标 ETF 时所产生的价格差异、交易成本和交易冲击；
- （3）标的指数成份股的配股、增发、分红等公司行为；
- （4）标的指数成份股的调整；
- （5）基金买卖股票时产生的交易成本和交易冲击；
- （6）申购、赎回因素带来的跟踪误差；
- （7）新股市值配售、新股认购带来的跟踪误差；
- （8）基金现金资产的拖累；
- （9）基金的管理费、托管费和销售服务等带来的跟踪误差；
- （10）指数成份股停牌、摘牌，成份股涨、跌停板等因素带来的偏差；

(11) 基金管理人的买入卖出时机选择;

(12) 其他因素带来的偏差。

4、跟踪误差未达约定目标的风险

本基金力争将本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35%以内, 年化跟踪误差控制在 4%以内, 但因标的指数编制规则调整或其他因素可能导致跟踪误差超过上述范围, 本基金净值表现与指数价格走势可能发生较大偏离。

5、指数编制机构停止服务风险

本基金的标的指数由指数编制机构发布并管理和维护, 未来指数编制机构可能由于各种原因停止对指数的管理和维护, 本基金将根据基金合同的约定自该情形发生之日起十个工作日向中国证监会报告并提出解决方案, 如更换基金标的指数、转换运作方式, 与其他基金合并、或者终止基金合同等, 并在 6 个月内召集基金份额持有人大会进行表决, 基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的, 基金合同终止。投资人将面临更换基金标的指数、转换运作方式, 与其他基金合并、或者终止基金合同等风险。

自指数编制机构停止标的指数的编制及发布至解决方案确定期间, 基金管理人应按照指数编制机构提供的最近一个交易日的指数信息遵循基金份额持有人利益优先原则维持基金投资运作, 该期间由于标的指数不再更新等原因可能导致指数表现与相关市场表现存在差异, 影响投资收益。

6、成份股停牌的风险

标的指数成份股可能因各种原因临时或长期停牌, 发生成份股停牌时, 基金可能因无法及时调整投资组合而导致跟踪偏离度和跟踪误差扩大。

7、标的指数变更的风险

根据基金合同的规定, 因标的指数的编制与发布等原因, 导致原标的指数不宜继续作为本基金的投资标的指数及业绩比较基准, 本基金可能变更标的指数, 本基金的投资组合随之调整, 基金收益风险特征可能发生变化, 投资人需承担投资组合调整所带来的风险与成本。

8、投资于目标 ETF 基金带来的风险

本基金为目标 ETF 联接基金, 投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%, 所以本基金会面临诸如目标 ETF 的管理风险与操作风险、目标 ETF 基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、目标 ETF 的技术风险等风险。

9、投资存托凭证的风险

本基金投资存托凭证, 将面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险, 以及与中国存托凭证发行机制相关的风险, 包括存托凭证持有人与境外基础证券发行人的股东在法律地位、享有权利等方面存在差异可能引发的风险; 存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等方面的特殊安排可能引发的风险; 存托协议自动约束存托凭证持有人的风险; 因多地上市造成存托凭证价格差异以及波动的风险; 存托凭证持有人权益被摊薄的风险; 存托凭证退市的风险; 已在境外上市的基础证券发行人, 在持续信息披露监管方面与境内可能存在差异的风险; 境内外法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险。

10、投资股指期货的风险

股指期货采用保证金交易制度, 由于保证金交易具有杠杆性, 当出现不利行情时, 股价指数微小的变动就可能会使投资人权益遭受较大损失。股指期货采用每日无负债结算制度, 如果没有在规定的时间内补足保证金, 按规定将被强制平仓, 可能给投资带来重大损失。

11、投资股票期权的风险

本基金投资股票期权, 股票期权价格主要受到标的资产价格水平、标的资产价格波动率、期权到期时间、市场利率水平等因素的影响。因此, 投资股票期权主要存在 Delta 风险、Gamma 风险、Vega 风险、Theta 风险以及 Rho 风险。同时, 进行股票期权投资还面临流动性风险、信用风险、操作风险等。

12、投资资产支持证券的风险

本基金投资资产支持证券, 资产支持证券具有一定的价格波动风险、流动性风险、信用风险等风险。价格波动风险指的是市场利率波动会导致资产支持证券的收益率和价格波动。流动性风险指的是受资产支

持证券市场规模及交易活跃程度的影响，资产支持证券可能无法在同一价格水平上进行较大数量的买入或卖出，存在一定的流动性风险。信用风险指的基金所投资的资产支持证券之债务人出现违约，或在交易过程中发生交收违约，或由于资产支持证券信用质量降低导致证券价格下降，造成基金财产损失。

13、融资及转融通证券出借业务风险。

本基金可参与转融通证券出借业务，面临的风险包括但不限于：（1）流动性风险：面临大额赎回时，可能因证券出借原因发生无法及时变现支付赎回款项的风险；（2）信用风险：证券出借对手方可能无法及时归还证券、无法支付相应权益补偿及借券费用的风险；（3）市场风险：证券出借后可能面临出借期间无法及时处置证券的市场风险。

此外，本基金可根据法律法规和基金合同的约定参与融资业务，可能存在杠杆风险和对手方交易风险等融资业务特有风险。

14、本基金作为普通的开放式基金，每个交易日日终在扣除股指期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后仍需保留不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等，会导致本基金与标的指数之间的跟踪误差。另外，本基金作为开放式基金，需在每个开放日接受投资者的申购或赎回申请，当发生大额申购和赎回时，将可能对基金净值产生一定冲击。

15、对于中银国际证券股份有限公司销售的 C 类基金份额收取的销售服务费，以及其他销售机构销售的 C 类基金份额持续持有期限超过一年收取的销售服务费采取先收后返模式，基金投资者实际收到的赎回款项或清算款项的金额可能与按披露的基金份额净值计算的结果存在差异。投资者的实际赎回金额和清算资金以登记机构确认数据为准。

（二）重要提示

中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人。

基金产品资料概要信息发生重大变更的，基金管理人将在三个工作日内更新，其他信息发生变更的，基金管理人每年更新一次。因此，本文件内容相比基金的实际情况可能存在一定的滞后，如需及时、准确获取基金的相关信息，敬请同时关注基金管理人发布的相关临时公告等。

五、其他资料查询方式

以下资料详见本基金管理人网站 www.bocifunds.com（客服热线：956026/400-620-8888（免长途通话费）选择 6 公募基金业务转人工）：

1. 基金合同、托管协议、招募说明书
2. 本基金季度报告、中期报告和年度报告
3. 基金份额净值
4. 基金销售机构及联系方式