中银基金管理有限公司关于中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金转型为中银中证 800 指数型发起式证券投资基金并修改基金合同等法律文件的提示性公告

中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(A 类基金代码:014226,C 类基金代码:014227,以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会证监许可[2021]3445 号文注册,于 2021 年 12 月 7 日正式成立,基金托管人为中信银行股份有限公司(以下简称“中信银行”)。本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”)基金份额。

目标 ETF 于 2022 年 7 月 21 日触发基金合同终止条款,根据《中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)约定,如目标 ETF 终止上市或目标 ETF 基金合同终止,本基金可在履行适当程序后由投资于目标 ETF 的联接基金变更为直接投资该标的指数的指数基金,无需召开基金份额持有人大会。

中银基金管理有限公司(以下简称“本公司”)根据《基金合同》的约定,经与基金托管人中信银行协商一致,并报中国证券监督管理委员会备案,将本基金转型为“中银中证 800 指数型发起式证券投资基金”,并相应修改基金合同等法律文件。

为维护基金份额持有人的利益,本公司进行如下提示:

1、预计自 2022 年 10 月 10 日起,本基金将转型为“中银中证 800 指数型发起式证券投资基金”。

2、转型后的中银中证 800 指数型发起式证券投资基金基金托管人及基金登记机构不变。

3、本基金的 A 类基金份额结转为中银中证 800 指数型发起式证券投资基金的 A 类基金份额,基金代码保持不变,为“014226”;本基金的 C 类基金份额结转为中银中证 800 指数型发起式证券投资基金的 C 类基金份额,基金代码保持不变,为“014227”。

4、基金份额持有人继续持有转型后的中银中证 800 指数型发起式证券投资基金的基金份额的,对应基金份额的持有期将自基金份额持有人认购、申购、转换转入本基金的基金份额登记日起连续计算。但基金份额持有人后续选择按照相关基金合同的约定,在其所持有的中银中证 800 指数型发起式证券投资基金及本公司旗下其他基金间办理转换业务的,转换转入基金份额持有期自基金转换申请确认日起重新计算。

5、为保护投资者利益,自 2022 年 7 月 22 日起,本基金已暂停申购、转换转入及定期定额投资业务,自 2022 年 8 月 5 日起,本基金已暂停赎回、转换转出业务并暂停估值。转型生效后,中银中证 800 指数型发起式证券投资基金将开放日常申购、赎回等业务,本公司将按照相关规定发布开放日常申购、赎回等业务的公告,敬请投资者留意。

6、《基金合同》中投资目标、投资范围、投资策略、基金费用计提方法、估值对象以及估值方法等相关内容进行了修改,具体修改的条目和内容请见附件。

7、本公司经与基金托管人中信银行协商一致,在对《基金合同》进行修订后,也将对基金托管协议涉及的上述相关内容进行相应修订,并将在更新的招募说明书和基金产品资料概要中作相应调整。合同全文和招募说明书全文将在本公司网站(www.bocim.com)和中国证监会基金电子披露网站(http://eid.csrc.gov.cn/fund)披露,供投资者查阅。投资者可登录本基金管理人网站(www.bocim.com)或拨打本公司客服电话(021-38834788/400-888-5566)咨询相关事宜。

风险提示:

基金管理人承诺依照诚实信用、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,在市场波动等因素的影响下,基金投资存在本金损失的风险。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现,基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人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,由投资者自行负担。

本基金转型为中银中证 800 指数型发起式证券投资基金,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。转型后的中银中证 800 指数型发起式证券投资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。

投资人办理基金交易等相关业务前,应仔细阅读该基金的基金合同、招募说明书、产品资料概要及其更新、风险提示及相关业务规则和操作指南等文件了解拟投资基金的风险收益特征,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,并按照销售机构的要求完成风险承受能力与产品风险之间的匹配检验。敢请投资者注意投资风险。

特此公告。

附件:《中银中证 800 指数型发起式证券投资基金基金合同》、《中银中证 800 指数型发起式证券投资基金托管协议》修改对照表

中银基金管理有限公司

2022 年 9 月 26 日

附件:《中银中证 800 指数型发起式证券投资基金基金合同》、《中银中证 800 指数型发起式证券投资基金托管协议》修改对照表

本公司已就修订内容与基金托管人协商一致,并已报中国证监会备案。

《基金合同》的修订内容具体如下:

原基金合同涉及修改章节	原基金合同表述	修改后表述
全文	中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	中银中证 800 指数型发起式证券投资基金
第一部分 前言	2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国民法典》、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称“《流动性风险管理规定》”)、《公开募集证券投资基金运作指引第 2 号——基金份额持有人大会指引》、《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》(以下简称“《指数基金指引》”)和其他有关法律法规。	2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国民法典》、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称“《流动性风险管理规定》”)、《公开募集证券投资基金运作指引第 2 号——基金份额持有人大会指引》、《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》(以下简称“《指数基金指引》”)和其他有关法律法规。
第一部分 前言	三、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由基金管理人依照《基金法》、基金合同及其他有关规定募集,并经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)注册。 中国证监会对本基金募集的注册,并不表明其对本基金的投资价值和市场前景做出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。	三、中银中证 800 指数型发起式证券投资基金由中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金转型而来。 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经 2021 年 11 月 1 日中国证券监督管理委员会证监许可【2021】3445 号文准予募集注册,自 2021 年 11 月 22 日至 2021 年 12 月 2 日期间向全社会公开募集。募集有效认购总户数为 318 户,募集资金及其产生的利息共计 10,967,932.20 元,折合基金份额 10,967,932.20 份。中银基金管理有限公司向中国证监会办理完毕基金备案手续后,于 2021 年 12 月 7 日获书面确认,《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》自该日起正式生效。 2022 年 7 月 21 日,中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金触发合同终止条款。根据《中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》的约定,如目标 ETF 终止上市或目标 ETF 基金合同终止,则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基金,无需召开基金份额持有人大会。基金的投资目标、投资范围、投资策略、基金费用计提方法、估值对象以及估值方法等相关内容将作相应修改。 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于中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金终止上市后,变更为中银中证 800 指数型发起式证券投资基金,自 2022 年 10 月 10 日,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变更为中银中证 800 指数型发起式证券投资基金,(中银中证 800 指数型发起式证券投资基金基金合同)自该日起生效。
第四部分 基金份额的发售	第四部分 基金份额的发售 一、基金份额的发售时间、发售方式、发售对象 1、发售时间 自基金份额发售之日起最长不得超过 3 个月,具体发售时间见基金份额发售公告。 2、发售方式 通过各销售机构的基金销售网点公开发售,各销售机构的具体名单见基金管理人披露的基金销售机构名录。 3、发售对象 符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者、人民币合格境外机构投资者、发起资金提供方以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。 二、基金份额的认购 1、认购费用 本基金 A 类基金份额在认购时收取基金认购费用,C 类基金份额不收取认购费用。 本基金 A 类基金份额的认购费率由基金管理人决定,并在招募说明书及基金产品资料概要中列示。基金认购费用不列入基金财产。 2、募集期利息的处理方式 有效认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有,其中利息转份额以登记机构的记录为准。 3、基金认购份额的计算方法在招募说明书中列示。 4、认购份额余额的处理方式 认购份额的计算保留到小数点后 2 位,小数点 2 位以后的部分四舍五入,由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。 5、认购申请的确认 销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功,而仅代表该销售机构确实接收到认购申请。认购的确认以登记机构的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况,投资人应及时查询并妥善行使合法权利。 三、基金份额认购金额的限制 1、投资人认购时,需按销售机构规定的方式全额缴款。 2、基金管理人可以对每个基金交易账户的单笔最低认购金额进行限制,具体限制请参看招募说明书或相关公告。 3、基金管理人可以对募集期间的单个投资人的累计认购金额进行限制,具体限制和处理方法请参看招募说明书或相关公告。 4、投资人在基金募集期内可以多次认购基金份额。认购申请一经受理不得撤销。 四、发起资金的认购 发起资金提供方认购金额不低于 1000 万元人民币,认购的基金份额持有期限不少于 3 年。 本基金发起资金的认购情况见基金管理人届时发布的公告。	第四部分 基金的历史沿革 中银中证 800 指数型发起式证券投资基金由中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金转型而来。 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经 2021 年 11 月 1 日中国证券监督管理委员会证监许可【2021】3445 号文准予募集注册,自 2021 年 11 月 22 日至 2021 年 12 月 2 日期间向全社会公开募集。募集有效认购总户数为 318 户,募集资金及其产生的利息共计 10,967,932.20 元,折合基金份额 10,967,932.20 份。中银基金管理有限公司向中国证监会办理完毕基金备案手续后,于 2021 年 12 月 7 日获书面确认,《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》自该日起正式生效。 2022 年 7 月 21 日,中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金触发合同终止条款。根据《中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》的约定,如目标 ETF 终止上市或目标 ETF 基金合同终止,则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基金,无需召开基金份额持有人大会。基金的投资目标、投资范围、投资策略、基金费用计提方法、估值对象以及估值方法等相关内容将作相应修改。 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于中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金终止上市后,变更为中银中证 800 指数型发起式证券投资基金,自 2022 年 10 月 10 日,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变更为中银中证 800 指数型发起式证券投资基金,(中银中证 800 指数型发起式证券投资基金基金合同)自该日起生效。
第五部分 基金备案	第五部分 基金备案 一、基金备案的条件 本基金自基金份额发售之日起 3 个月内,在基金募集份额总额不少于 1000 万份,基金募集金额不少于 1000 万元人民币且发起资金提供方承诺持有期限不少于 3 年的条件下,同时本基金的目标 ETF 符合备案条件的,基金募集期届满或基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售,并在 10 日内聘请法定验资机构验资,验资报告需对发起资金的持有人及其持有份额进行专门说明,自收到验资报告之日起 10 日内,向中国证监会办理基金备案手续。 基金募集达到基金备案条件的,自基金管理人办理完毕基金备案手续并获得中国证监会书面确认之日起,《基金合同》生效;否则《基金合同》不生效。基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对《基金合同》生效事宜予以公告。基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户,在基金募集行为结束前,任何人不得动用。 二、基金合同不能生效时募集资金的处理方式 如果募集期限届满,未满足基金备案条件,基金管理人应当承担下列责任: 1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用; 2、在基金募集期限届满后 30 日内返还投资者已缴纳的款项,并加计银行同期存款利息; 3、如基金募集失败,基金管理人、基金托管人及销售机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和销售机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。 三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模 《基金合同》生效之日起三年后的年度对应日,若基金资产净值低于 2 亿元的,《基金合同》自动终止,不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续。若届时的法律法规或中国证监会规定发生变化,上述终止规定被取消、更改或补充时,则本基金可以参照届时有效的法律法规或中国证监会规定执行。 《基金合同》生效满三年后继续存续的,连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的,基金管理人应当在定期报告中予以披露;连续 50 个工作日出现前述情形的,本基金应当按照本基金合同的约定程序进行清算并终止,且无需召开基金份额持有人大会。 法律法规或中国证监会另有规定时,从其规定。	第五部分 基金的存续 《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》生效之日起三年后的年度对应日,若基金资产净值低于 2 亿元的,《基金合同》自动终止,不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续。若届时的法律法规或中国证监会规定发生变化,上述终止规定被取消、更改或补充时,则本基金可以参照届时有效的法律法规或中国证监会规定执行。 《基金合同》生效满三年后继续存续的,连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的,基金管理人应当在定期报告中予以披露;连续 50 个工作日出现前述情形的,本基金应当按照本基金合同的约定程序进行清算并终止,且无需召开基金份额持有人大会。 法律法规或中国证监会另有规定时,从其规定。
第六部分 基金份额的申购与赎回	七、拒绝或暂停申购的情形 7、所投资的目标 ETF 暂停估值,导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。 8、所投资的目标 ETF 暂停申购、二级市场交易停牌,达到或接近申购上限。 9、基金管理人、基金托管人、基金销售机构或登记机构的异常情况导致基金销售系统、基金登记系统或基金会计系统无法正常运行 10、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述第 1、2、3、5、6、7、8、9、10 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人申购申请时,基金管理人应当根据有关规定在规定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝的,被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时,基金管理人应及时恢复申购业务的办理。	七、拒绝或暂停申购的情形 7、基金管理人、基金托管人、基金销售机构或登记机构的异常情况导致基金销售系统、基金登记系统或基金会计系统无法正常运行。 8、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者(基金管理人、基金管理人高级管理人员或基金经理等人员作为发起资金提供方除外)持有基金份额的比例达到或者超过 50%,或者变相规避 50%集中度的情形。 9、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述第 1、2、3、5、6、7、8、9 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人申购申请时,基金管理人应当根据有关规定在规定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝的,被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时,基金管理人应及时恢复申购业务的办理。
第六部分 基金份额的申购与赎回	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 5、本基金的目标 ETF 暂停估值,导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。 6、本基金的目标 ETF 暂停赎回或二级市场交易停牌,且基金管理人认为有必要暂停本基金赎回的。	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形
第六部分 基金份额的申购与赎回	九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 (3)如发生单个开放日内单个基金份额持有人中请赎回的基金份额超过前一开放日的基金总份额的 20%时,本基金管理人对该单个基金份额持有人持有的赎回申请实施延期办理。基金管理人有权先行对该单个基金份额持有人超出 20%的赎回申请实施延期办理,而对该单个基金份额持有人 20%以内(含 20%)的赎回申请,基金管理人根据前段“(1)全额赎回”或“(2)部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。对于未能赎回部分,投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回选择延期赎回的,将自动转入下一个开放日继续赎回,直到全部赎回为止;选择取消赎回的,当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理,无优先权并以下一开放日的该类基金份额净值为基础计算赎回金额,以此类推,直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择,投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。部分延期赎回不受单笔赎回最低份额的限制。	九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 (3)如发生单个开放日内单个基金份额持有人中请赎回的基金份额超过前一开放日的基金总份额的 20%时,基金管理人有权先行对该单个基金份额持有人超出 20%的赎回申请实施延期办理,而对该单个基金份额持有人 20%以内(含 20%)的赎回申请,基金管理人根据前段“(1)全额赎回”或“(2)部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。对于未能赎回部分,投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回选择延期赎回的,将自动转入下一个开放日继续赎回,直到全部赎回为止;选择取消赎回的,当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理,无优先权并以下一开放日的该类基金份额净值为基础计算赎回金额,以此类推,直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择,投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。部分延期赎回不受单笔赎回最低份额的限制。
第七部分 基金合同当事人及权利义务	一、基金管理人 (二)基金管理人的权利与义务 1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金管理人的权利包括但不限于: (14) 代表基金份额持有人的利益行使因基金财产投资于目标 ETF 所产生的权利,基金合同另有约定的除外; (17)在符合有关法律、法规的前提下,制订和调整有关基金认购、申购、赎回等业务、转换和非交易过户规则;	一、基金管理人 (二)基金管理人的权利与义务 1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金管理人的权利包括但不限于: (16)在符合有关法律、法规的前提下,制订和调整有关基金申购、赎回等业务、转换和非交易过户规则;
第七部分 基金合同当事人及权利义务	一、基金管理人 (二)基金管理人的权利与义务 2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金管理人的义务包括但不限于: (1)依法募集资金,办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜; (8)采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定,按有关规定计算并公告基金净值信息,确定基金份额申购、赎回的价格; (24) 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件,《基金合同》不能生效,基金管理人承担全部募集费用,将已募集资金并加计银行同期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人;	一、基金管理人 (二)基金管理人的权利与义务 2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金管理人的义务包括但不限于: (1)依法募集资金,办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的销售、申购、赎回和登记事宜; (8)采取适当合理的措施使计算基金份额申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定,按有关规定计算并公告基金净值信息,确定基金份额申购、赎回的价格;
第七部分 基金合同当事人及权利义务	三、基金份额持有人 1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金份额持有人的权利包括但不限于: (6) 按照目标 ETF 基金合同的约定出席或者委派代表出席目标 ETF 基金份额持有人大会并对目标 ETF 基金份额持有人大会审议事项行使表决权;	三、基金份额持有人 1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金份额持有人的权利包括但不限于:
第七部分 基金合同当事人及权利义务	三、基金份额持有人 2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金份额持有人的义务包括但不限于: (4)交纳基金认购、申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用; (11) 发起资金提供方认购的基金份额持有期限不少于 3 年;	三、基金份额持有人 2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金份额持有人的义务包括但不限于: (4)交纳基金申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用; (11) 发起资金提供方认购的基金份额持有期限自《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》生效之日起不少于 3 年;
第八部分 基金份额持有人大会	基金份额持有人大会由基金份额持有人组成,基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。 鉴于本基金是目标 ETF 的联接基金,本基金的基金份额持有人可以凭所持有的本基金份额直接参加或者委派代表参加目标 ETF 基金份额持有人大会并表决。在计算参会份额和票数时,本基金的基金份额持有人持有的享有表决权的参会份额数和表决票数为:在目标 ETF 基金份额持有人大会的权益登记日,本基金持有目标 ETF 基金份额的总数乘以该基金份额持有人所持有的本基金份额占本基金总份额的比例,计算结果按照四舍五入的方法,保留到整数位。本基金份额折算为目标 ETF 后的每一参会份额和目标 ETF 的每一参会份额拥有平等的投票权。若本基金启用侧袋机制且特定资产不包括目标 ETF,则本基金的主袋账户份额持有人可以凭持有的主袋账户份额直接参加或者委派代表参加目标 ETF 基金份额持有人大会并表决。 本基金的基金管理人不应以本基金的名义代表本基金的全体基金份额持有人以目标 ETF 的基金份额持有人的身份行使表决权,但可接受本基金的特定基金份额持有人的委托,以本基金的基金份额持有人代理人的身份出席目标 ETF 的基金份额持有人大会并参与表决。 本基金的基金管理人代表本基金的基金份额持有人提议召开或召集目标 ETF 基金份额持有人大会的,须先邀请本基金(基金合同)的约定召开本基金的基金份额持有人大会,本基金的基金份额持有人大会,本基金的基金份额持有人大会决定提议召开或召集目标 ETF 基金份额持有人大会的,由本基金基金管理人代表本基金的基金份额持有人提议召开或召集目标 ETF 基金份额持有人大会。 本基金份额持有人大会不设日常机构。若将来法律法规对基金份额持有人大会另有规定的,以届时有效的法律法规为准。	基金份额持有人大会由基金份额持有人组成,基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。 本基金份额持有人大会不设日常机构。若将来法律法规对基金份额持有人大会另有规定的,以届时有效的法律法规为准。
第八部分 基金份额持有人大会	一、召开事由 2、在法律法规规定和《基金合同》约定的范围内且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下,以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改,不需召开基金份额持有人大会: (7) 由于目标 ETF 变更标的指数、变更交易方式、终止上市或基金合同终止而变更基金投资目标、范围或策略;	一、召开事由 2、在法律法规规定和《基金合同》约定的范围内且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下,以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改,不需召开基金份额持有人大会: ● 标的指数变更或分拆变生配股、增发、分红等行为; ● 指数成份股出现停牌限制、流动性问题等情况; ● 其他影响指数复制的因素。
第十二部分 基金的投资	一、投资目标 通过投资于目标 ETF,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。在正常市场情况下,本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过 0.3%,年跟踪误差不超过 4%。	一、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%。
第十二部分 基金的投资	二、投资范围 本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。本基金可少量投资于其他股票(包括创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票)、存托凭证、股指期货、股票期权、债券(包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券(含分离交易可转债的纯债部分)、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、同业存单、现金,以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。 本基金将根据法律法规的规定参与转融通证券出借及融资业务。 如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。 本基金投资于目标 ETF 的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。 如法律法规或中国证监会允许,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。	二、投资范围 本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。本基金可少量投资于其他股票(包括创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票)、存托凭证、股指期货、股票期权、债券(包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券(含分离交易可转债的纯债部分)、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、同业存单、现金,以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。 本基金将根据法律法规的规定参与转融通证券出借及融资业务。 如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。 本基金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。 如法律法规或中国证监会允许,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。
第十二部分 基金的投资	三、投资策略	三、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。本基金在建仓期内,按照中证 800 指数各成份股的基准权重对其逐步买入,在力求跟踪误差最小化的前提下,本基金可采取适当的方法降低买入成本,当遇到以下情况时,本基金管理人可以根据市场的具体情况,对指数投资部分进行适当调整,以便实现对跟踪误差的有效控制: ● 预期标的指数成份股将调整; ● 标的指数成份股发生配股、增发、分红等行为; ● 指数成份股出现停牌限制、流动性问题等情况; ● 其他影响指数复制的因素。 本基金采取“跟踪误差”和“跟踪偏离度”这两个指标对投资组合进行日常的监控与管理,其中,跟踪误差为核心监控指标,跟踪偏离度为辅助监控指标。基金管理人将建立事后跟踪误差监控体系,实施严格的事后跟踪误差管理,同时通过对组合事前跟踪误差的估计与分解获取有效的降低跟踪误差的组合调整方法,以求有效控制投资组合相对于业绩基准的偏离风险。 本基金对标的指数的跟踪目标是:力争使基金净值增长率与业绩比较基准增长率之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%,年化跟踪误差不超过 4%。如因标的指数编制规则调整等其他原因,导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过了上述范围,基金管理人应采取合理措施,避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。
第十二部分 基金的投资	四、投资限制 1、组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制: (1)本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%; …… 除上述(1)、(2)、(9)、(16)、(17)情形之外,因证券/期货市场波动、上市公司合并、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制、目标 ETF 暂停申购、赎回或二级市场交易停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的,基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整,但中国证监会规定的特殊情形除外。因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合第(15)项规定的,基金管理人不得新增出借业务。因证券市场波动、标的指数成份股流动性限制、目标 ETF 暂停申购、赎回或二级市场交易停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合第(1)项投资比例的,基金管理人应当在 20 个交易日内进行调整,但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的,从其规定。 基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内,本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。	四、投资限制 1、组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制: (1) 本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的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%; (19)本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行; …… 除上述(1)、(2)、(9)、(16)、(17)情形之外,因证券/期货市场波动、上市公司合并、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的,基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整,但中国证监会规定的特殊情形除外。因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合第(15)项规定的,基金管理人不得新增出借业务。法律法规另有规定的,从其规定。 基金管理人应当自基金转型之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内,本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。
第十二部分 基金的投资	四、投资限制 2、禁止行为 (4)买卖除目标 ETF 以外的其他基金份额,但是中国证监会另有规定的除外;	四、投资限制 2、禁止行为 (4)买卖其他基金份额,但是中国证监会另有规定的除外;
第十二部分 基金的投资	五、业绩比较基准 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的情形除外),指数编制机构出台等情形,基金管理人应当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,本基金合同终止,但下文“目标 ETF 发生相关变更情形时的处理”另有约定的除外。	五、业绩比较基准 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。
第十二部分 基金的投资	六、风险收益特征 本基金的目标 ETF 为股票型基金,其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为 ETF 联接基金,通过投资于目标 ETF 跟踪标的指数表现,具有与标的指数以及标的指数所代表的证券市场相似的风险收益特征。	六、风险收益特征 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。
第十二部分 基金的投资	八、目标 ETF 发生相关变更情形时的处理 目标 ETF 出现下述情形之一的,本基金将由投资于目标 ETF 的联接基金变更为直接投资该标的指数的指数基金:若届时本基金管理人已有以该指数作为标的指数的指数基金,则本基金将本着维护投资人合法权益的原则,履行适当的程序后选取其他合适的指数作为标的指数。相应地,本基金基金合同中将删除关于目标 ETF 的表述部分,或将变更标的指数,届时将由基金管理人另行公告。 1、目标 ETF 交易方式发生重大变更致使本基金的投资策略难以实现; 2、目标 ETF 终止上市; 3、目标 ETF 基金合同终止; 4、目标 ETF 的基金管理人发生变更(但变更后的本基金与目标 ETF 的基金管理人相同 除外)。 若目标 ETF 变更标的指数,本基金将在履行适当程序后相应变更标的指数且继续投资于该目标 ETF。但目标 ETF 召开基金份额持有人大会审议变更目标 ETF 标的指数事项的,本基金的基金份额持有人可出席目标 ETF 基金份额持有人大会并进行表决。	八、目标 ETF 发生相关变更情形时的处理 目标 ETF 出现下述情形之一的,本基金将由投资于目标 ETF 的联接基金变更为直接投资该标的指数的指数基金;若届时本基金管理人已有以该指数作为标的指数的指数基金,则本基