

中银基金管理有限公司关于中银中债 1-3 年期国开行债券指数证券投资基金根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》修改基金合同部分条款的公告

根据《中华人民共和国证券法》、《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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》等法律法规的规定及《中银中债 1-3 年期国开行债券指数证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”或“基金合同”）的有关约定，经与中银中债 1-3 年期国开行债券指数证券投资基金（以下简称“本基金”）基金托管人兴业银行股份有限公司协商一致，并向中国证监会备案，中银基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）对《基金合同》进行修改。本次修改将自 2021 年 3 月 29 日起正式生效。现将基金合同等法律文件的修订情况公告如下：

一、《基金合同》的修订内容

（一）“前言”章节

“前言”章节的“订立本基金合同的目的、依据和原则”增加“《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》”）”的法规依据，并增加：

“本基金为指数基金，投资者投资于本基金面临跟踪误差控制未达约定目标、指数编制机构停止服务、成份券停牌、摘牌或违约等潜在风险，详见本基金招募说明书。”

（二）“释义”章节

“释义”章节增加：

“《指数基金指引》：指中国证监会 2021 年 1 月 22 日颁布、同年 2 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》及颁布机关对其不时做出的修订”

（三）“基金的基本情况”章节

“基金的基本情况”章节的“五、基金的标的指数”删除：

“如果指数发布机构变更或停止该指数的编制及发布、或由于指数编制方法等重大变更导致该指数不宜继续作为标的指数，或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的

指数推出，或在指数使用许可协议到期后基金管理人与指数发布机构就后续指数许可使用费协商不成时，本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，在与基金托管人协商一致并按照监管部门要求履行适当程序后变更本基金的标的指数。

若标的指数变更涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更，则基金管理人应就变更标的指数召开基金份额持有人大会，并报中国证监会备案。若标的指数变更对基金投资无实质性影响（包括但不限于标的指数供应商变更、指数更名等），则无需召开基金份额持有人大会。变更标的指数应当在指定媒介上及时公告。无需召开基金份额持有人大会的，基金管理人应在取得基金托管人同意后，报中国证监会备案并公告。标的指数更换后，基金管理人可根据需要替换或删除基金名称中与原标的指数相关的商号或字样。”

（四）“基金的投资”章节

1、“基金的投资”章节的“三、投资策略”增加：

“指数成份券发生明显负面事件面临退市或违约风险，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，综合考虑成份券退市或违约风险、其在指数中的权重以及对跟踪误差的影响，据此制定成份券替代策略，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。”

2、“基金的投资”章节的“五、标的指数与业绩比较基准”中的“（一）标的指数”增加：

“未来若出现标的指数不符合要求（因成份券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。

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。”

同时删除“如果指数发布机构变更或停止该指数的编制及发布、或由于指数编制方法等 重大变更导致该指数不宜继续作为标的指数，或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出，或在指数使用许可协议到期后基金管理人与指数发布机构就后续

指数许可使用费协商不成时，本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，在履行适当程序后变更本基金的标的指数。其中，若变更标的指数对基金投资范围 和投资策略无实质性影响（包括但不限于指数编制单位变更、指数更名等事项）， 则无需召开基金份额持有人大会，基金管理人应与基金托管人协商一致后，报中国证监会备案并及时公告。”

3、“基金的投资”章节的“五、标的指数与业绩比较基准”中的“（二）业绩比较基准”增加：

“若基金标的指数发生变更，基金业绩比较基准随之变更，由基金管理人根据标的指数变更情形履行适当程序。”

同时删除“若基金标的指数发生变更，基金业绩比较基准随之变更，基金管理人可依据维护基金份额持有人合法权益的原则，根据投资情况和市场惯例调整基金业绩比较基准，无需召开基金份额持有人大会，但基金管理人调整业绩比较基准应按照监管部门要求履行适当程序并取得基金托管人同意后，报中国证监会备案，基金管理人应在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在中国证监会指定媒介上刊登公告。”

（五）“基金合同的变更、终止与基金财产的清算”章节

“基金合同的变更、终止与基金财产的清算”章节的“二、《基金合同》的终止事由”增加：

“4、出现标的指数不符合要求（因成份券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，基金管理人召集基金份额持有人大会对解决方案进行表决，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；”

（六）基金合同中与上述相关的其他内容一并修改。

二、修改后的基金合同自 2021 年 3 月 29 日起生效，基金管理人已履行了规定程序，符合相关法律法规的规定及本基金基金合同的约定。基金管理人根据修改的基金合同更新本基金招募说明书和基金产品资料概要的相关内容，并揭示风险。修改后的本基金基金合同全文和招募说明书全文与本公告同日登载于基金管理人网站（www.bocim.com）及中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）。

三、其他事项

投资者可登录本基金管理人网站（www.bocim.com）查阅修订后的基金合同、招募说明书（更新）、基金产品资料概要等法律文件，也可拨打本基金管理人客户服务电话（021-38834788 / 400-888-5566）了解相关信息。

四、风险提示

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，也不保证最低收益。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。

投资者在投资基金之前，请仔细阅读基金的基金产品资料概要、招募说明书和基金合同等信息披露文件，全面认识基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，在了解产品情况、听取销售机构适当性匹配意见的基础上，理性判断市场，谨慎做出投资决策。基金具体风险评级结果以销售机构提供的评级结果为准。

特此公告

中银基金管理有限公司
二〇二一年三月二十九日