

# 宝盈基金管理有限公司关于宝盈中证 100 指数增强型 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、托管协议等法律文件有关条 款的公告

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《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》等法律法规及《宝盈中证 100 指数增强型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）的规定，经与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致，并向中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）备案，宝盈基金管理有限公司（以下简称“本公司”或“基金管理人”）决定对宝盈中证 100 指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”）基金合同、托管协议等法律文件进行修订，并同步更新招募说明书。本次修订后的宝盈中证 100 指数增强型证券投资基金的基金合同和托管协议将自 2021 年 3 月 31 日起正式生效。现就基金合同、托管协议等法律文件的修改情况及招募说明书的更新内容公告如下：

一、基金合同主要修改内容如下：

1、“一、前言”中增加内容如下：

（1）增加订立依据：“《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》’）”；

（2）增加风险提示：“本基金为指数基金，投资者投资于本基金可能面临跟踪误差控制未达约定目标、指数编制机构停止服务、成份股停牌或退市等潜在风险，详见本基金招募说明书。”

2、“二、释义”中增加“《指数基金指引》”内容如下：

“61.《指数基金指引》：指中国证监会 2021 年 1 月 18 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”。

3、将“三、基金的基本情况”中“(四)标的指数”内容修订为：

#### “中证 100 指数

若未来法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的标的指数推出，或者市场发生变化导致本标的指数不再适用或本标的指数停止发布或更改名称，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，在履行适当的程序后变更本基金的标的指数，并同时更换本基金的基金名称与业绩比较基准。

未来若出现标的指数不符合要求（因成份股价格波动、流动性不足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 10 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。

自指数编制机构停止标的指数编制及发布至解决方案确定并实施前，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，遵循基金投资目标和基金份额持有人利益优先原则维持基金投资运作。

尽管有前述约定，但若标的指数变更对基金投资无实质性影响（包括但不限于编制机构变更、指数更名等）且在不损害基金份额持有人利益的前提下，则无需召开基金份额持有人大会，基金管理人可以在与基金托管人协商一致并报中国证监会备案后调整标的指数并及时公告。基金合同另有约定的从其规定。”

4、将“十二、基金的投资”中“(四)业绩比较基准”内容修订为：

“本基金的业绩比较基准为：

中证 100 指数×95%+活期存款利率（税后）×5%

中证 100 指数是从沪深 300 指数样本股中挑选规模最大的 100 只股票组成样本股，它流动性高，可投资性强，综合反映了中国证券市场最具市场影响力的一批优质大盘企业的整体状况，其中包括的上市公司对中国经济的发展具有举足轻重的作用，能够作为指数基金的标的指数。

若未来法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的标的指数推出，或者市场发生变化导致本标的指数不再适用或本标的指数停止发布或更改名称，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，在履行适当的程序后变更本基金的标的指数，并同时更换本基金的基金名称与业绩比较基

准。

未来若出现标的指数不符合要求（因成份股价格波动、流动性不足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 10 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。

自指数编制机构停止标的指数编制及发布至解决方案确定并实施前，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，遵循基金投资目标和基金份额持有人利益优先原则维持基金投资运作。

尽管有前述约定，但若标的指数变更对基金投资无实质性影响（包括但不限于编制机构变更、指数更名等）且在不损害基金份额持有人利益的前提下，则无需召开基金份额持有人大会，基金管理人可以在与基金托管人协商一致并报中国证监会备案后调整标的指数和业绩比较基准并及时公告。基金合同另有约定的从其规定。”

5、在“十五、基金的费用与税收”中“(三)基金费用计提方法、计提标准和支付方式”中增加如下内容：

“5.本基金标的指数许可使用费由基金管理人承担。”

6、将“十五、基金的费用与税收”中“(四)不列入基金费用的项目”内容修订为：

“基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。本基金标的指数许可使用费不从基金财产中列支，由基金管理人承担。”

二、 托管协议主要修改内容如下：

1、在“十一、基金费用”中增加如下内容：

“（五）本基金标的指数许可使用费由基金管理人承担。”

2、将“十一、基金费用”中“（五）不列入基金费用的项目”内容修订为：

“（六）不列入基金费用的项目

基金合同生效前的律师费、会计师费和信息披露费用不得从基金财产中列支。基金管理人与基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。本基金标的指数许可使用费不从基金财产中列支，由基金管理人承担。”

三、 招募说明书的主要更新内容如下：

1、根据本基金基金合同、托管协议的修订而进行的一致性修改。

2、在“重要提示”中增加内容如下：

(1)列明有关指数的编制方法，以及可供投资者免费查询指数信息的途径：

“1、本基金标的指数为中证 100 指数。

(1) 指数样本空间

沪深 300 指数样本

(2) 选样方法

对样本空间内证券按照过去一年的日均总市值由高到低排名，原则上选取排名前 100 的证券作为指数样本。

(3) 指数计算

指数计算公式为：

$$\text{报告期指数} = \frac{\text{报告期样本的调整市值}}{\text{除数}} \times 1000$$

其中，调整市值 =  $\sum$  (证券价格 × 调整股本数)。调整股本数的计算方法、除数修正方法参见计算与维护细则。

(4) 指数样本和权重调整

1) 定期调整

指数样本每半年调整一次，样本调整实施时间分别为每年 6 月和 12 月的第二个星期五的下一交易日。每次调整的样本比例一般不超过 10%。定期调整设置缓冲区，排名在 80 名之前的新样本优先进入；排名在 120 名之前的老样本优先保留。定期调整设置备选名单，备选名单中证券数量一般为指数样本数量的 5%。

2) 临时调整

特殊情况下将对指数进行临时调整。当样本退市时，将其从指数样本中剔除。

样本公司发生收购、合并、分拆等情形的处理，参照计算与维护细则处理。对新发行证券的发行总市值（公式为：发行价\*总股本）和全部证券自该新发行证券上市公告日起过去一年的日均总市值进行比较，对于符合样本空间条件、且发行总市值排名在沪深市场前 10 位的新发行证券，启用快速进入指数的规则，即在其上市第十个交易日结束后将其纳入指数，同时剔除原样本中过去一年日均总市值排名最低的证券，科创板和创业板上市证券不适用该规则。

有关标的指数具体编制方案及成份股信息详见中证指数有限公司网站，网址：<http://www.csindex.com.cn/>。”

（2）增加风险提示：“3、本基金为指数基金，投资者投资于本基金可能面临跟踪误差控制未达约定目标、指数编制机构停止服务、成份股停牌或退市等潜在风险。敬请投资人仔细阅读本招募说明书“风险揭示”，以便全面了解本基金运作过程中的潜在风险。”

3、将“十七、风险揭示”中“（四）本基金特有的风险”内容修订为：

“1、本基金不低于基金资产的 80%投资于中证 100 指数成份股，指数化投资相关的风险即成为本基金及投资者主要面对的特有的投资风险。

1) 标的指数的风险

①标的指数下跌的风险

标的指数成份股的价格可能受到政治因素、经济因素、投资者心理和交易制度等各种因素的影响而波动，导致指数值波动，从而使基金收益水平发生变化，产生风险。

②标的指数计算出错的风险

指数编制方法的缺陷可能导致标的指数的表现与总体市场表现产生差异，从而使基金收益发生变化。同时，中证指数有限公司不对指数的实时性、完整性和准确性做出任何承诺。标的指数值可能出现错误，投资者若参考指数值进行投资决策可能导致损失。

③标的指数变更的风险

未来若出现标的指数不符合要求（因成份股价格波动、流动性不足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，本基金将根据基金合同的约定自该情形发生之日起 10 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。为此，本基金在运作中存在标的指数变更风险。

另一方面，若未来法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的标的指数推出，或者市场发生变化导致本标的指数不再适用或本标的指数停止发布或更改名称，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，在履行适当的程序后变更本基金的标的指数。

标的指数变更可能造成基金投资随之调整，基金的风险收益特征将与新标的指数一致，投资者须承担此项调整带来的风险与成本。

#### 2) 跟踪误差控制未达约定目标的风险

本基金力争取得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不超过 0.5%、年跟踪误差不超过 7.75%，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。

#### 3) 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，发生成份股停牌时可能面临如下风险：

①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。

②在极端情况下，标的指数成份股可能大面积停牌，基金可能无法及时卖出成份股以获取足额的符合要求的赎回款项，由此基金管理人可能设置较低的赎回份额上限或者采取暂停赎回的措施，投资者将面临无法赎回全部或部分基金份额的风险。

#### 4) 成份股退市的风险

指数成份股发生明显负面事件面临退市风险，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，综合考虑成份股的退市风险、其在指数中的权重以及对跟踪误差的影响，据此制定成份股替代策略，并对投资组合进行相应调整。

#### 5) 指数编制机构停止服务的风险

本基金的标的指数由指数编制机构发布并管理和维护。未来如发生指数编制

机构停止对指数的管理和维护或指数编制机构退出等情形，本基金将根据基金合同的约定自该情形发生之日起 10 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。在此情形下，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并实施前，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，遵循基金投资目标和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。”

四、 本次修改系因相应的法律法规发生变动而对基金合同进行的修改，且对基金份额持有人利益无实质性不利影响，并已履行规定程序，符合相关法律法规及基金合同的规定。

五、 宝盈中证 100 指数增强型证券投资基金的基金合同、托管协议的修改自 2021 年 3 月 31 日起生效，修改后的基金合同、托管协议文本将于同日在本公司网站和中国证监会基金电子披露网站等规定网站披露。同时，根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等法律法规的有关规定，本公司将在三个工作日内相应更新宝盈中证 100 指数增强型证券投资基金招募说明书和基金产品资料概要，并登载在本公司网站和中国证监会基金电子披露网站等规定网站。本公司网站和中国证监会基金电子披露网站网址如下：

本公司网站网址：<http://www.byfunds.com>

中国证监会基金电子披露网站网址：<http://eid.csrc.gov.cn/fund>

投资者可登陆本公司网站查询相关信息或拨打客户服务电话（400-8888-300）咨询相关事宜。

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。销售机构根据法规要求对投资者类别、风险承受能力和基金的风险等级进行划分，并提出适当性匹配意见。投资者在投资基金前应认真阅读基金合同和招募说明书等基金法律文件，全面认识基金产品的风险收益特征，在了解产品情况及听取销售机构适当性意见的基础上，

根据自身的风险承受能力、投资期限和投资目标，对基金投资作出独立决策，选择合适的基金产品。

特此公告。

宝盈基金管理有限公司

2021年3月31日