

宝盈纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金 (QDII)

(宝盈纳斯达克 100 指数发起 (QDII) C 人民币份额)

基金产品资料概要 (更新)

编制日期: 2024 年 6 月 28 日

送出日期: 2024 年 6 月 29 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	宝盈纳斯达克100指数发起 (QDII)	基金主代码	019736
下属基金简称	宝盈纳斯达克100指数发起 (QDII) C人民币	下属基金代码	019737
基金管理人	宝盈基金管理有限公司	基金托管人	中国建设银行股份有限公司 摩根大通银行 (JPMorgan Chase Bank, National Association)
境外投资顾问	不适用	境外托管人	
基金合同生效日	2024-03-22	上市交易所及上市日期	暂未上市
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	蔡丹	开始担任本基金基金经理的日期	2024-03-22
		证券从业日期	2010-07-19

注: 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。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。

《基金合同》生效之日起三年后的对应日 (若无对应日则顺延至下一日), 若基金资产净值低于 2 亿元, 基金合同自动终止, 且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续基金合同期限。若届时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, 则本基金可参照届时有效的法律法规或中国证监会规定执行。

二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

投资者可以阅读《宝盈纳斯达克100指数型发起式证券投资基金 (QDII) 招募说明书》第四部分了解详细情况。

投资目标 本基金进行被动指数化投资, 紧密跟踪标的指数, 追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小

投资范围	<p>化。</p> <p>本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标,本基金还可投资于在境内外市场依法发行的金融工具。</p> <p>境外市场投资工具包括已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的跟踪同一标的指数的公募基金(包括开放式基金和交易型开放式基金(ETF));已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证;政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券以及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券;银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具;与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构性投资产品;远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品;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。其中在投资香港市场时,本基金可通过合格境内机构投资者(QDII)境外投资额度或内地与香港股票市场交易互联互通机制进行投资。</p> <p>境内市场投资工具包括国内依法发行或上市的股票(包括创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证)、债券(包括国债、金融债、地方政府债、公开发行的次级债券、政府支持债券、政府支持机构债券、企业债、公司债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、国债期货、股指期货、股票期权、银行存款、同业存单、货币市场工具、债券回购、资产支持证券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)。</p> <p>本基金将根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。未来在法律法规允许的前提下,本基金可根据相关法律法规规定参与融券业务。</p> <p>基金的投资组合比例为:本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的80%;投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不得低于基金资产净值的80%;每个交易日日终在扣除股指期货、股票期权和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金持有的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%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</p> <p>如法律法规或中国证监会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,可以调整上述投资品种的投资比例。</p>
主要投资策略	<p>本基金主要采用完全复制法跟踪标的指数,即原则上按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。</p> <p>本基金的投资策略由资产配置策略、股票投资策略、衍生品投资策略、境外市场公募基金投资策略、债券投资策略、可转换债券(含可交换债券)投资策略、资产支持证券投资策略、存托凭证投资策略、融资和转融通证券出借和境外回购交易及证券借贷交易策略十个部分组成。</p>
业绩比较基准	<p>纳斯达克100指数收益率(使用估值汇率调整)×95%+人民币活期存款收益率(税后)×5%</p>
风险收益特征	<p>本基金为股票型基金,其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金为指数型基金,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。</p> <p>本基金投资于境外证券,除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外,本基金还面临汇率风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险</p>

险。

(二) 投资组合资产配置图表

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

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	持有期限 (N)	收费方式/费率
赎回费	N<7日	1.50%
	N≥7日	0%

(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	0.50%	基金管理人和销售机构
托管费	0.15%	基金托管人
C类销售服务费	0.25%	销售机构
审计费用	50,000.00元	会计师事务所
信息披露费	-	规定披露报刊
其他费用	其他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费用	相关服务机构

注:《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费或仲裁费;基金份额持有人大会费用;基金的证券/期货交易或结算产生的费用(包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、权证交易的结算费、融资融券费、证券账户相关费用及其他类似性质的费用等)、所投资基金的交易费用和管理费用及在境外市场的开户、交易、清算、登记等各项费用;基金的银行汇划费用;其他为基金的利益而产生的费用,如代表基金投票产生的费用、与基金有关的追索费等;基金开销户费用、账户维护费用、以及因开销户发生的翻译费、公证费、领事认证费;基金进行外汇兑换交易的相关费用;基金依照有关法律法规应当缴纳的、购买或处置证券有关的任何税收、征费、关税、印花税、交易及其他税收及预扣提税(以及与前述各项有关的任何利息、罚金及费用)以及相关手续费、汇款费、基金的税务代理费、顾问费等;除基金管理人和基金托管人因自身原因而导致的更换基金管理人、更换基金托管人及基金资产由原任基金托管人转移至新任基金托管人以及由于境外托管人更换导致基金资产转移所引起的费用;为应付赎回和交易清算而进行临时借款所发生的费用;因投资港股通标的股票而产生的各项合理费用;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等列入当期基金费用,由基金托管人从基金财产中支付。

本基金证券交易等产生的费用和税负,按实际发生额从基金资产扣除。其中,基金管理费率、托管费率、销售服务费率(若有)为基金现行费率。审计费用、信息披露费金额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。本基金的指数许可使用费由基金管理人承担,不从基金资产中列支。

(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:

宝盈纳斯达克 100 指数发起 (QDII) C 人民币份额

基金运作综合费率 (年化)

持有期间

注: 基金运作综合费用包含由基金资产承担的费用, 其中, 基金管理费率、托管费率、销售服务费率 (若有) 为基金现行费率, 其他运作费用以最近一次基金年报披露的相关数据为基准测算。本基金的指数许可使用费由基金管理人承担, 不从基金资产中列支。

截至本文件编制日, 本基金尚未披露过年度报告, 暂无基金运作综合费率测算。

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。

本基金主要投资于境外证券市场, 基金净值会因为境外证券市场波动等因素产生波动, 投资者根据所持有的基金份额享受基金收益, 同时承担相应的投资风险。投资者在投资本基金前, 应全面了解本基金的产品特性, 充分考虑自身的风险承受能力, 理性判断市场, 并承担基金投资中出现的各类风险, 包括: 市场风险、信用风险、债券收益率曲线变动风险、流动性风险、管理风险、操作或技术风险、合规风险、人员流失风险、本基金特有的投资风险、境外投资风险及其他风险等。本基金特有风险包括: 指数化投资风险、开通外币申赎的风险、引入境外托管人的风险、投资衍生品投资风险、投资资产支持证券投资风险、融资和转融通证券出借业务的主要风险、投资存托凭证投资风险、发起式基金终止基金合同的风险、证券借贷/正回购/逆回购风险等。

(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

以下资料详见基金管理人网站 (www.byfunds.com); 投资者也可以拨打本公司客户服务电话 (400-8888-300) 咨询有关信息。

- 1、宝盈纳斯达克100指数型发起式证券投资基金 (QDII) 基金合同
- 2、宝盈纳斯达克100指数型发起式证券投资基金 (QDII) 托管协议
- 3、宝盈纳斯达克100指数型发起式证券投资基金 (QDII) 招募说明书及其更新
- 4、定期报告, 包括基金季度报告、中期报告和年度报告
- 5、基金份额净值
- 6、基金销售机构及联系方式
- 7、其他重要资料

六、其他情况说明

1、各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局性的，并对各方当事人均有约束力。除非仲裁裁决另有决定，仲裁费用由败诉方承担。

2、基金管理人、基金托管人在履行各自职责的过程中，违反《基金法》等法律法规的规定或者《基金合同》约定，给基金财产或者基金份额持有人造成损害的，应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任；因共同行为给基金财产或者基金份额持有人造成损害的，应当承担连带赔偿责任，对损失的赔偿，仅限于直接损失。如发生下列情况，相应的当事人免责：

（1）不可抗力。

（2）基金管理人、基金托管人按照当时有效的法律法规、市场交易规则或中国证监会的规定以及基金财产投资所在地法律法规、监管要求、证券市场规则或市场惯例作为或不作为而造成的损失等。

（3）基金管理人由于按照基金合同规定的投资原则进行投资或不投资而造成的损失等。