

关于宝盈中证 100 指数增强型证券投资基金变更基金名称、调低销售服务费率并修订法律文件的公告

根据中证指数有限公司于 2024 年 10 月 11 日发布的《关于调整中证 100 等指数名称的公告》，“中证 100 指数”将于 2024 年 10 月 28 日正式更名为“中证 A100 指数”。相应地，宝盈中证 100 指数增强型证券投资基金（简称为“本基金”）的基金名称、标的指数名称、业绩比较基准以及法律文件的相关条款需同步修订。同时，为了更好地为投资者提供理财服务，降低投资者的理财成本，本基金拟将 C 类基金份额的销售服务费率由年费率 0.80% 调整为年费率 0.30%。

本基金本次变更基金名称、调低销售服务费率的事项不会影响现有基金份额持有人利益，且不涉及基金合同当事人权利义务关系发生重大变化的情形。本基金本次法律文件修订同步更新我公司注册地址、法定代表人信息以及基金托管人中国建设银行股份有限公司法定代表人信息，具体修订内容详见附件《宝盈中证 100 指数增强型证券投资基金基金合同修改对照表》。

本次修改后的《宝盈中证 A100 指数增强型证券投资基金基金合同》、《宝盈中证 A100 指数增强型证券投资基金托管协议》自 2024 年 10 月 28 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本基金的招募说明书和基金

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

2024年10月25日

附件：《宝盈中证 100 指数增强型证券投资基金基金合同修改对照表》

章节	修订前	修订后
基金名称	宝盈 中证 100 指数增强型证券投资基金	宝盈 中证 A100 指数增强型证券投资基金
一、前言	(三)宝盈 中证 100 指数增强型证券投资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”)核准。	(三)宝盈 中证 A100 指数增强型证券投资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”)核准。
二、释义	<p>1.基金或本基金：指宝盈中证 100指数增强型证券投资基金</p> <p>4.基金合同或本基金合同：指《宝盈中证 100指数增强型证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充</p> <p>5.托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《宝盈中证 100指数增强型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充</p> <p>6.招募说明书：指《宝盈中证 100指数增强型证券投资基金招募说明书》及其更新</p> <p>7.基金份额发售公告：指《宝盈中证 100指数增强型证券投资基金份额发售公告》</p> <p>.....</p> <p>60.基金产品资料概要：指《宝盈中证 100指数增强型证券投资基金基金产品资料概要》及其更新（本基金合同约定的基金产品资料概要编制、披露与更新要求，自《信息披露办法》实施之日起一年后开始执行）</p>	<p>1.基金或本基金：指宝盈中证 A100指数增强型证券投资基金</p> <p>4.基金合同或本基金合同：指《宝盈中证 A100指数增强型证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充</p> <p>5.托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《宝盈中证 A100指数增强型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充</p> <p>6.招募说明书：指《宝盈中证 A100指数增强型证券投资基金招募说明书》及其更新</p> <p>7.基金份额发售公告：指《宝盈中证 A100指数增强型证券投资基金份额发售公告》</p> <p>.....</p> <p>60.基金产品资料概要：指《宝盈中证 A100指数增强型证券投资基金基金产品资料概要》及其更新（本基金合同约定的基金产品资料概要编制、披露与更新要求，自《信息披露办法》实施之日起一年后开始执行）</p>
三、基金的基本情况	<p>(一)基金的名称</p> <p>宝盈中证 100指数增强型证券投资基金</p> <p>.....</p> <p>(四)标的指数</p>	<p>(一)基金的名称</p> <p>宝盈中证 A100指数增强型证券投资基金</p> <p>.....</p> <p>(四)标的指数</p>

	<p>中证100指数</p> <p>(五)基金的投资目标 在基金合同规定的范围内,通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段,结合增强收益的主动投资,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%、基金总体投资业绩超越中证100指数的表现。</p>	<p>中证 A100 指数</p> <p>(五)基金的投资目标 在基金合同规定的范围内,通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段,结合增强收益的主动投资,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%、基金总体投资业绩超越中证 A100指数的表现。</p>
七、基金合同当事人及权利义务	<p>(一)基金管理人 住所: 广东省深圳市福田区深圳特区报业大厦第15层 法定代表人: 马永红</p> <p>(二)基金托管人 法定代表人: 田国立</p>	<p>(一)基金管理人 住所: 深圳市福田区莲花街道紫荆社区深南大道 6008 号深圳特区报业大厦 15 层 法定代表人: 严震</p> <p>(二)基金托管人 法定代表人: 张金良</p>
十、基金的托管	<p>基金财产由基金托管人保管。基金管理人应与基金托管人按照《基金法》、基金合同及有关规定订立《宝盈中证100指数增强型证券投资基金托管协议》。订立托管协议的目的是明确基金托管人与基金管理人之间在基金份额持有人名册登记、基金财产的保管、基金财产的管理和运作及相互监督等相关事宜中的权利义务及职责,确保基金财产的安全,保护基金份额持有人的合法权益。</p>	<p>基金财产由基金托管人保管。基金管理人应与基金托管人按照《基金法》、基金合同及有关规定订立《宝盈中证 A100指数增强型证券投资基金托管协议》。订立托管协议的目的是明确基金托管人与基金管理人之间在基金份额持有人名册登记、基金财产的保管、基金财产的管理和运作及相互监督等相关事宜中的权利义务及职责,确保基金财产的安全,保护基金份额持有人的合法权益。</p>
十二、基金的投资	<p>(一)投资目标 在基金合同规定的范围内,通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段,结合增强收益的主动投资,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</p>	<p>(一)投资目标 在基金合同规定的范围内,通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段,结合增强收益的主动投资,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</p>

<p>跟踪误差不超过 7.75%、基金总体投资业绩超越中证 100指数的表现。</p> <p>(二)投资范围</p> <p>本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、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。其中，中证 100指数的成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产的 80%，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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。</p> <p>(三)投资策略</p> <p>本基金为增强型指数基金，对指数投资部分采用完全复制法，按照成份股在中证 100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。本基金对主动投资部分实行双向积极配置策略。</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金将不低于 80%的基金资产投资于中证 100指数成份股和备选成份股，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 5%。</p> <p>本基金将根据市场的实际情况，在基金合同规定的范围内适当调整主动投资部分基金资产的配置比例，以争取实现对标的指数的超越。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>(1) 股票投资组合的构建</p> <p>本基金在建仓期内，指数化投资部分将按照中证 100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</p>	<p>过 0.5%、年跟踪误差不超过 7.75%、基金总体投资业绩超越中证 A100 指数的表现。</p> <p>(二)投资范围</p> <p>本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、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。其中，中证 A100指数的成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产的 80%，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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。</p> <p>(三)投资策略</p> <p>本基金为增强型指数基金，对指数投资部分采用完全复制法，按照成份股在中证 A100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。本基金对主动投资部分实行双向积极配置策略。</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金将不低于 80%的基金资产投资于中证 A100指数成份股和备选成份股，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 5%。</p> <p>本基金将根据市场的实际情况，在基金合同规定的范围内适当调整主动投资部分基金资产的配置比例，以争取实现对标的指数的超越。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>(1) 股票投资组合的构建</p>
---	---

<p>金可采取适当方法，以降低买入成本。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，最终使跟踪误差控制在一定的范围之内。</p> <p>本基金对主动投资部分实行双向积极配置策略，通过公司内部的数量化选股模型，选出流动性高投资价值好的品种，预期股票市场向上时对该类品种进行积极配置，预期股票市场向下时对股票进行低配或者不配并视情况适当提高固定收益类产品的配置。</p> <p>(2) 指数化投资部分股票组合的调整</p> <p>本基金所构建的指数化投资部分股票投资组合将根据中证 100指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。</p> <p>.....</p> <p>(四)业绩比较基准</p> <p>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%</p> <p>.....</p> <p>(五)风险收益特征</p> <p>本基金投资于中证 100指数的成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产的 80%，预期风险收益高于混合型基金、债券基金和货币市场基金，属于较高风险收益预期的证券投资基金产品。</p> <p>(六)投资限制</p> <p>.....</p> <p>(6)中证 100指数的成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产的 80%；</p>	<p>本基金在建仓期内，指数化投资部分将按照中证 A100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，本基金可采取适当方法，以降低买入成本。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，最终使跟踪误差控制在一定的范围之内。</p> <p>本基金对主动投资部分实行双向积极配置策略，通过公司内部的数量化选股模型，选出流动性高投资价值好的品种，预期股票市场向上时对该类品种进行积极配置，预期股票市场向下时对股票进行低配或者不配并视情况适当提高固定收益类产品的配置。</p> <p>(2) 指数化投资部分股票组合的调整</p> <p>本基金所构建的指数化投资部分股票投资组合将根据中证 A100指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。</p> <p>.....</p> <p>(四)业绩比较基准</p> <p>本基金的业绩比较基准为： 中证 A100指数×95%+活期存款利率（税后）×5%</p> <p>.....</p> <p>(五)风险收益特征</p> <p>本基金投资于中证 A100指数的成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产的 80%，预期风险收益高于混合型基金、债券基金和货币市场基金，属于较高风险收益预期的证券投资基金</p>
--	---

		<p>产品。</p> <p>(六)投资限制</p> <p>.....</p> <p>(6)中证 A100 指数的成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产的 80%；</p>
<p>十五、基金的费用与税收</p>	<p>(三)基金费用计提方法、计提标准和支付方式</p> <p>3. 销售服务费</p> <p>本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.80%。</p> <p>本基金 C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.80% 的年费率计提。C 类基金份额的销售服务费计算方法如下：</p> <p>$H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$</p> <p>H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费</p> <p>E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值</p> <p>基金销售服务费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。注册登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构等。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。</p>	<p>(三)基金费用计提方法、计提标准和支付方式</p> <p>3. 销售服务费</p> <p>本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.30%。</p> <p>本基金 C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.30% 的年费率计提。C 类基金份额的销售服务费计算方法如下：</p> <p>$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$</p> <p>H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费</p> <p>E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值</p> <p>基金销售服务费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。注册登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构等。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。</p>