

# 中银中证800交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要

编制日期：2020年8月26日

送出日期：2020年8月28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	中银 800	基金代码	515610
基金管理人	中银基金管理有限公司	基金托管人	中信银行股份有限公司
基金合同生效日	2020-07-16	上市交易所及上市日期	上海证券交易所 2020-08-18
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	赵建忠	开始担任本基金基金经理的日期	2020-07-16
		证券从业日期	2007-08-01

## 二、基金投资与净值表现

### (一) 投资目标与投资策略

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。在正常市场情况下，力争控制本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%，年跟踪误差不超过2%。
投资范围	<p>本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数的成份股及其备选成份股、其他股票(包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票)、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、超短期融资券等)、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)。</p> <p>本基金还可参与融资和转融通证券出借业务。</p> <p>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。</p> <p>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%，且不低于非现金基金资产的80%；股指期货、股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。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。</p>
主要投资策略	本基金主要采取完全复制法，即按照标的指数的成份股的构成及其权

重建指数化投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整。本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%,且不低于非现金基金资产的80%。

在一般情形下,本基金将根据标的指数的成份股票的构成及其权重构建股票资产投资组合,但在特殊情况下,本基金可以选择其它证券或证券组合对标的指数中的股票加以替换,这些情况包括但不限于以下情形:(1)法律法规的限制;(2)标的指数成份股流动性严重不足;(3)标的指数的成份股票长期停牌;(4)其它合理原因导致本基金管理人对标的指数的跟踪构成严重制约等。

在正常市场情况下,力争控制本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%,年跟踪误差不超过2%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围,基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

<b>业绩比较基准</b>	中证800指数收益率
<b>风险收益特征</b>	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。

## (二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

### 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

投资人在申购或赎回本基金时,申购赎回代理券商可按照不超过0.5%的标准收取佣金,其中包含证券交易所、登记机构等收取的相关费用。

### (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
管理费	0.45%
托管费	0.05%
指数许可使用费	0.03%

注: 本基金交易证券、基金等产生的费用和税负,按实际发生额从基金资产扣除。

## 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。

本基金可能的面临的风险包括市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险、管理风险等。

本基金面临的特定风险包括标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险、标的指数波动的风险、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险、标的指数变更的风险、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险等。

基金资产投资于股指期货、股票期权等衍生品，需承受市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险和法律风险等。由于衍生品通常具有杠杆效应，价格波动比标的工具更为剧烈，有时候比投资标的资产要承担更高的风险。并且由于衍生品定价相当复杂，不适当的估值有可能使基金资产面临损失风险。

同时，基金资产投资于可转债，其条款相对于普通债券和股票而言更为复杂，在极端市场情况下价格涨跌幅较大，上述因素可能会使价格剧烈波动，从而导致投资风险的增加。

投资者应认真阅读《基金合同》、《招募说明书》等法律文件，及时关注本公司出具的适当性意见，各销售机构关于适当性的意见不必然一致，本公司的适当性匹配意见并不表明对基金的风险和收益做出实质性判断或者保证。基金合同中关于基金风险收益特征与基金风险等级因考虑因素不同而存在差异。投资者应了解基金的风险收益情况，结合自身投资目的、期限、投资经验及风险承受能力谨慎决策并自行承担风险，不应采信不符合法律法规要求的销售行为及违规宣传推介材料。

## **(二) 重要提示**

1. 中国证监会对本基金募集的注册或核准，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。

2. 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。

3. 各方当事人同意，因本基金的《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上海国际经济贸易仲裁委员会，按照上海国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为上海市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力，仲裁费用、律师费由败诉方承担。《基金合同》受中国法律（不含港澳台立法）管辖。

## **五、其他资料查询方式**

以下资料详见基金管理人网站[网址：[www.bocim.com](http://www.bocim.com)][客服电话：4008855566 或 021-38834788]

1. 基金合同、托管协议、招募说明书
2. 定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告
3. 基金份额净值
4. 基金销售机构及联系方式
5. 其他重要资料