

中银基金管理有限公司关于调整中银中证800交易型开放式指数证券投资基金网下股票认购清单的提示性公告

中银中证800交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”,认购代码:515610,基金简称:中银800,基金扩位简称:中银中证800ETF),本基金自2020年4月30日至2020年7月24日通过销售机构公开发售。发售期间,投资人可选择网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购三种方式认购本基金。其中,网下现金认购和网下股票认购的日期为2020年4月30日至2020年7月24日,网下现金认购的日期为2020年7月24日,网下股票认购的日期为2020年7月24日。

中银基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)于2020年4月27日发布的《中银中证800交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告》已列明了本基金募集期间的网下股票认购清单信息。为方便投资者认购,根据近期标的指数的成份股定期调整情况,基金管理人对本基金的网下股票认购清单更新如下:

Table with columns: 股票代码, 股票简称, 股票代码, 股票简称, 股票代码, 股票简称, 股票代码, 股票简称. Lists various companies like 中国平安, 万科A, 神州高铁, etc.

Table with columns: 股票代码, 股票简称, 股票代码, 股票简称, 股票代码, 股票简称, 股票代码, 股票简称. Lists various companies like 东方财富, 中顺洁柔, 中顺洁柔, etc.

本公告仅对本基金网下股票认购可用成份股进行提示性公告,关于本基金认购的其他相关信息,以本基金基金合同、招募说明书、基金份额发售公告及已发布的相关最新公告为准。

中银基金管理有限公司 2020年6月15日

(上接 C11 版)

注册地址: www.citicfund.com 39号中银大厦(北京)投资有限公司 注册地: 北京市西城区东直门内大街2号2-45层 办公地址: 北京市西城区东直门内大街1号环球金融中心A座5层 法定代表人: 吴波 联系人: 沈强 客户服务热线: 4008-9009-9 网址: www.yink.com 40项证券投资基金 注册地: 深圳市福田区宝华路6号105室-3491 办公地址: 广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼B1201-1203 法定代表人: 肖冰 联系人: 王奕 客户服务热线: 020-89290066 网址: www.yimg.com 基金管理人将根据相关法律法规要求,根据实际,选择其他符合要求的机构销售本基金或变更上述机构,并在基金管理人网站公示。

(二) 关联方 名称: 鹏华基金管理有限公司 住所: 深圳市福田区福华三路168号深圳国际商会中心43层 办公地址: 深圳市福田区福华三路168号深圳国际商会中心43层 联系电话: (0755) 82012187 传真: (0755) 82011165 负责人: 邓伟 联系人: 范迪 经办律师: 闵钧 经办律师: 闵钧 名称: 鹏华基金律师事务所 住所: 深圳市福田区笋岗东路中民时代广场A座201 办公地址: 深圳市福田区笋岗东路中民时代广场A座201 联系电话: (0755) 33031280 传真: (0755) 33033086 联系人: 闵钧 经办律师: 闵钧 名称: 鹏华会计师事务所(特殊普通合伙) 住所: 深圳市福田区福安路1318号鹏华大厦6楼 办公地址: 深圳市福田区福安路1318号鹏华大厦6楼 联系电话: (021) 23238880 传真: (021) 23238880 联系人: 潘晓怡 经办会计师: 单峰、潘晓怡

四、基金的投资 基金名称: 鹏华丰利定期开放债券型证券投资基金 基金运作方式及类型: 契约型债券型基金, 本基金采取在封闭期内封闭运作、封闭期与封闭期之间定期开放的方式运作。 影响债券型基金, 本基金采取在封闭期内封闭运作、封闭期与封闭期之间定期开放的方式运作。 六、基金的投资目标 在有效控制风险的基础上, 通过每年定期开放的形式保持适度流动性, 力求取得超越基金业绩比较基准的收益。

七、基金的投资方向 本基金的投资范围主要为依法发行的固定收益类品种, 包括国内依法发行的国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、地方政府债、中期票据、短期融资券、可转换债券(含分离交易可转债)、资产支持证券、中小企业私募债、次级债、银行存款、同业存单、货币市场基金、中国证监会允许基金投资的其它金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。 本基金不直接买入股票、权证等权益类金融工具, 因参与可转换公司债券转股所形成的股票, 因投资于分离交易可转债而产生的权证, 在其可上市交易之日起不超过10个交易日到期或到期前出售的除外。 如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种, 基金管理人可在履行适当程序后, 将其纳入投资范围。 基金的投资组合比例为: 本基金对债券的投资比例不低于基金资产的80%, 但在每次开放前两个月、开放期内及开放期结束后三个月的期间内, 本基金不受上述比例限制; 开放期内现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例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。 八、基金的投资策略 本基金的投资策略主要采取久期策略, 同时辅以之收益曲线策略、骑乘策略、息差策略、息差策略、选择策略等积极投资策略, 在有效控制风险的基础上, 通过每年定期开放的形式保持适度流动性, 力求取得超越基金业绩比较基准的收益。

九、基金的风险控制 在资产配置方面, 本基金通过对宏观经济形势、经济周期阶段、利率曲线变化趋势和信用利差变化趋势的重点分析, 比较未来一定时期内不同债券品种和债券市场的相对预期收益率, 在基金固定收益资产范围内对不同久期、信用等级的债券, 及债券与现金类资产之间进行动态调整。 十、基金的估值 本基金将采取久期策略, 通过自上而下的组合久期管理策略, 以实现相对利率风险的有效的控制。 十一、基金的费用 基金名称: 鹏华丰利定期开放债券型证券投资基金 基金运作方式及类型: 契约型债券型基金, 本基金采取在封闭期内封闭运作、封闭期与封闭期之间定期开放的方式运作。 影响债券型基金, 本基金采取在封闭期内封闭运作、封闭期与封闭期之间定期开放的方式运作。 六、基金的投资目标 在有效控制风险的基础上, 通过每年定期开放的形式保持适度流动性, 力求取得超越基金业绩比较基准的收益。

6. 债券选择策略 根据两个债券到期收益率相对于市场收益率曲线的偏离程度, 结合信用等级、流动性、选择权条款、期权价格等因素, 确定其投资价值, 选择定价合理或低估的债券进行投资。

7. 中小企业私募债投资策略 本基金管理人将深入研究中小企业私募债发行主体、增信措施、募投项目、偿债能力、流动性、信用风险、法律风险等因素, 合理确定中小企业私募债的投资策略, 在基金投资过程中密切跟踪债券信用风险, 及时评估和动态调整中小企业私募债的投资策略, 力求实现超越业绩比较基准的投资目标, 并获取超额收益。

8. 股指期货投资策略 本基金管理人将根据风险管理原则, 以套期保值为目的, 有选择性地投资于股指期货。 基金管理人将根据风险管理原则, 以套期保值为目的, 有选择性地投资于股指期货。 基金管理人将根据风险管理原则, 以套期保值为目的, 有选择性地投资于股指期货。

9. 基金业绩比较基准 本基金业绩比较基准为: 中证800指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40%。 本基金业绩比较基准为: 中证800指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40%。 本基金业绩比较基准为: 中证800指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40%。

10. 基金的风险控制 在资产配置方面, 本基金通过对宏观经济形势、经济周期阶段、利率曲线变化趋势和信用利差变化趋势的重点分析, 比较未来一定时期内不同债券品种和债券市场的相对预期收益率, 在基金固定收益资产范围内对不同久期、信用等级的债券, 及债券与现金类资产之间进行动态调整。 十一、基金的估值 本基金将采取久期策略, 通过自上而下的组合久期管理策略, 以实现相对利率风险的有效的控制。

Table with columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%). Lists assets like 权益投资, 其中: 股票, 其中: 可转债, etc.

2. 报告期内按行业分类的股票投资组合 (1) 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合 注:无 (2) 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合 注:无

3. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细 注:无 4. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 注:无

Table with columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Lists bonds like 16天足债, 17开利债, etc.

5. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细 注:无

Table with columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Lists asset-backed securities like 16天足债, 17开利债, etc.

6. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细 注:无 7. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 注:无 8. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细 注:无 9. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 注:无 10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 (1) 本期国债期货投资情况 注:无 (2) 本期国债期货投资情况 注:无 (3) 本期国债期货投资情况 注:无

11. 基金投资组合报告 本基金投资组合报告 本基金投资组合报告 本基金投资组合报告

Table with columns: 序号, 名称, 金额(元). Lists assets like 存出保证金, 应收证券清算款, etc.

12. 基金投资组合报告 本基金投资组合报告 本基金投资组合报告 本基金投资组合报告

Table with columns: 序号, 名称, 金额(元). Lists assets like 存出保证金, 应收证券清算款, etc.

13. 基金投资组合报告 本基金投资组合报告 本基金投资组合报告 本基金投资组合报告

Table with columns: 序号, 名称, 金额(元). Lists assets like 存出保证金, 应收证券清算款, etc.

14. 基金投资组合报告 本基金投资组合报告 本基金投资组合报告 本基金投资组合报告

Table with columns: 序号, 名称, 金额(元). Lists assets like 存出保证金, 应收证券清算款, etc.

15. 基金投资组合报告 本基金投资组合报告 本基金投资组合报告 本基金投资组合报告

Table with columns: 序号, 名称, 金额(元). Lists assets like 存出保证金, 应收证券清算款, etc.

16. 基金投资组合报告 本基金投资组合报告 本基金投资组合报告 本基金投资组合报告

Table with columns: 序号, 名称, 金额(元). Lists assets like 存出保证金, 应收证券清算款, etc.

5. 基金份额持有人大会费用; 6. 基金的证券交易费用; 7. 基金的银行汇划费用; 8. 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。

9. 基金费用计提方法、计提标准和支付方式 1. 基金管理人的管理费 本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.7%年费率计提。管理费的计算方法如下: H=E×0.7%÷当年天数 H为每日应计提的基金管理费 E为前一日的基金资产净值

基金管理人每月计算, 逐日累计至每月月末, 按月支付, 由基金管理人向基金托管人发送基金管理人划款指令, 基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等, 支付日期顺延。

2. 基金托管人的托管费 本基金托管费按前一日基金资产净值的0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下: H=E×0.2%÷当年天数 H为每日应计提的基金托管费 E为前一日的基金资产净值

基金管理人每月计算, 逐日累计至每月月末, 按月支付, 由基金管理人向基金托管人发送基金托管划款指令, 基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等, 支付日期顺延。

3. 基金合同生效前的相关费用: 4. 其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

(四) 基金销售费用 1. 申购费率 本基金对通过直销柜台申购的老客户予以除此之外的其他投资者实施差别申购费率。

2. 赎回费率 本基金对通过直销柜台赎回的老客户予以除此之外的其他投资者实施差别赎回费率。

3. 基金合同生效后的相关费用: 4. 其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

10. 基金投资组合报告 本基金投资组合报告 本基金投资组合报告 本基金投资组合报告

Table with columns: 申购金额(M), 一般申购费率, 特定申购费率. Lists rates for different investment amounts.

本基金申购赎回基金费用的基金费用承担人, 在基金费用承担人赎回基金份额时收取。赎回费用总额的100%归入基金财产。 申购费用由投资人承担, 不列入基金财产, 主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用。

2. 赎回费用 本基金对通过直销柜台赎回的老客户予以除此之外的其他投资者实施差别赎回费率。

3. 基金合同生效后的相关费用: 4. 其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

11. 基金投资组合报告 本基金投资组合报告 本基金投资组合报告 本基金投资组合报告

Table with columns: 序号, 名称, 金额(元). Lists assets like 存出保证金, 应收证券清算款, etc.

12. 基金投资组合报告 本基金投资组合报告 本基金投资组合报告 本基金投资组合报告