

关于建信国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金调整申购赎回条款并修改基金合同等法律文件的公告

为了更好地满足基金运作的需求，维护投资者利益，建信基金管理有限责任公司（以下简称“本公司”）旗下建信国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金（扩位证券简称：新能源车电池 ETF；交易代码：159775；以下简称“本基金”），由于本基金标的指数将于 2024 年 6 月 17 日纳入北京证券交易所股票，本基金根据深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则，以及本基金基金合同、招募说明书等有关规定，经与基金托管人中信证券股份有限公司协商一致，决定自 2024 年 6 月 17 日起调整本基金基金合同等法律文件中关于申购赎回有关条款，并更新基金管理人信息。

一、本基金《基金合同》相应条款修改

| | 修订前 | 修订后 |
|-------------------|--|--|
| 第八部分 基金份额的申购与赎回 | 本基金采用“深市股票实物申赎，沪市股票现金替代”的申赎模式。“深市股票实物申赎，沪市股票现金替代”申赎模式通过深圳证券交易所办理。未来，本基金管理人可选择根据市场和产品运行情况，适时增加场外实物申购赎回模式，无须召开基金份额持有人大会审议。 | 本基金采用“深市股票实物申赎，非深市股票现金替代”的申赎模式。“深市股票实物申赎，非深市股票现金替代”申赎模式通过深圳证券交易所办理。未来，本基金管理人可选择根据市场和产品运行情况，适时增加场外实物申购赎回模式，无须召开基金份额持有人大会审议。 |
| 第九部分 基金合同当事人及权利义务 | 一、基金管理人 (一) 基金管理人简况 法定代表人：孙志晨 | 一、基金管理人 (一) 基金管理人简况 法定代表人：生柳荣 |

二、本基金《招募说明书》相应条款修改

| | 修订前 | 修订后 |
|--------|---|---|
| 全文 | 基金管理人 法定代表人：刘军 | 基金管理人 法定代表人：生柳荣 |
| 【重要提示】 | 本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资人在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金 | 本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资人在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的特定风 |

| | | |
|-----------------|---|---|
| | <p>的特定风险等。投资本基金可能遇到的风险包括：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以及基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险，基金份额二级市场交易价格折溢价的风险，基金的退市风险，投资者申购、赎回失败的风险、基金份额赎回对价的变现风险、指数编制机构停止服务以及成份券停牌或违约等等。</p> <p>.....</p> <p>本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他仅投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与中国存托凭证发行机制相关的风险。</p> <p>.....</p> <p>本基金为交易型开放式指数证券投资基金（ETF），将在深圳证券交易所上市。由于本基金的标的指数组合证券横跨深圳及上海两个证券交易所，其申购、赎回流程与组合证券仅在<u>深圳或上海</u>证券交易所上市的ETF产品有所差异。本基金采用场内“深市股票实物申赎，<u>沪市股票现金替代</u>”的申赎模式。“深市股票实物申赎，<u>沪市股票现金替代</u>”申赎模式通过深圳证券交易所办理。</p> | <p>险等。投资本基金可能遇到的风险包括：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以及基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险，基金份额二级市场交易价格折溢价的风险，基金的退市风险，投资者申购、赎回失败的风险、基金份额赎回对价的变现风险、指数编制机构停止服务以及成份券停牌或违约、<u>投资北京证券交易所股票</u>的风险等等。</p> <p>.....</p> <p>本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他仅投资于沪深北市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与中国存托凭证发行机制相关的风险。</p> <p>.....</p> <p>本基金为交易型开放式指数证券投资基金（ETF），将在深圳证券交易所上市。由于本基金的标的指数组合证券横跨深圳及上海、<u>北京</u>三个证券交易所，其申购、赎回流程与组合证券仅在<u>单个</u>证券交易所上市的ETF产品有所差异。本基金采用场内“深市股票实物申赎，<u>非深市股票现金替代</u>”的申赎模式。“深市股票实物申赎，<u>非深市股票现金替代</u>”申赎模式通过深圳证券交易所办理。</p> |
| 第十部分 基金份额的申购与赎回 | <p>本基金采用“深市股票实物申赎，<u>沪市股票现金替代</u>”的申赎模式。“深市股票实物申赎，<u>沪市股票现金替代</u>”申赎模式通过深圳证券交易所办理。未来，本基金管理人可选择根据市场和产品运行情况，适时增加场外实物申购赎回模式，无须召开基金份额持有人大会审议。</p> | <p>本基金采用“深市股票实物申赎，<u>非深市股票现金替代</u>”的申赎模式。“深市股票实物申赎，<u>非深市股票现金替代</u>”申赎模式通过深圳证券交易所办理。未来，本基金管理人可选择根据市场和产品运行情况，适时增加场外实物申购赎回模式，无须召开基金份额持有人大会审议。</p> |
| | <p>七、申购赎回清单的内容与格式 4、现金替代相关内容</p> | <p>七、申购赎回清单的内容与格式 4、现金替代相关内容</p> |

| | | |
|--|--|---|
| | <p>对于标志为可以现金替代的<u>上海</u>证券交易所上市的成份股,申购赎回基金份额时,均使用现金作为替代,根据基金管理人买卖情况,与投资者进行退款或补款。</p> <p>.....</p> <p>(2) 关于<u>上海</u>证券交易所成分券可以现金替代的情形</p> <p>1) 适用情形: 适用于本基金成分券中<u>上海</u>证券交易所上市的股票。</p> <p>2) 替代金额:</p> <p>申购的替代金额=替代证券数量×该证券参考价格×(1+申购现金替代溢价比例)。</p> <p>赎回的替代金额=替代证券数量×该证券参考价格×(1-赎回现金替代折价比例)。</p> <p>其中,“该证券参考价格”定义为“该证券前一交易日除权除息后的收盘价”。如果<u>上海</u>证券交易所对上述计算方式另有规定的,以<u>上海</u>证券交易所最新规定为准。</p> <p>.....</p> <p>3) 替代金额的处理程序</p> <p>.....</p> <p>实时申报的原则为:基金管理人在<u>上海</u>证券交易所连续竞价期间,根据收到的深圳证券交易所申购赎回确认记录,在技术系统允许的情况下实时向<u>上海</u>证券交易所申报被替代证券的交易指令。</p> <p>.....</p> <p>特例情况:若自 T 日起,<u>上海</u>证券交易所正常交易日已达到 20 日而该证券正常交易日低于 2 日,则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本(包括买入价格与交易费用)加上按照最近一次收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额,确定基金应退还申购投资者或申购投资者应补交的款项,以替代金额与所卖出的部分被替代证券实际卖出收入(卖出价格扣除交易费用)加上按照最</p> | <p>对于标志为可以现金替代的在<u>深圳</u>证券交易所以外交易所(以下简称“<u>其他</u>交易所”)上市的成份股,申购赎回基金份额时,均使用现金作为替代,根据基金管理人买卖情况,与投资者进行退款或补款。</p> <p>.....</p> <p>(2) 关于<u>其他</u>交易所成分券可以现金替代的情形</p> <p>1) 适用情形: 适用于本基金成分券中在<u>其他</u>交易所上市的股票。</p> <p>2) 替代金额:</p> <p>申购的替代金额=替代证券数量×该证券参考价格×(1+申购现金替代溢价比例)。</p> <p>赎回的替代金额=替代证券数量×该证券参考价格×(1-赎回现金替代折价比例)。</p> <p>其中,“该证券参考价格”定义为“该证券前一交易日除权除息后的收盘价”。如果<u>其他</u>交易所对上述计算方式另有规定的,以<u>其他</u>交易所最新规定为准。</p> <p>.....</p> <p>3) 替代金额的处理程序</p> <p>.....</p> <p>实时申报的原则为:基金管理人在<u>其他</u>交易所连续竞价期间,根据收到的深圳证券交易所申购赎回确认记录,在技术系统允许的情况下实时向<u>其他</u>交易所申报被替代证券的交易指令。</p> <p>.....</p> <p>特例情况:若自 T 日起,<u>其他</u>交易所正常交易日已达到 20 日而该证券正常交易日低于 2 日,则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本(包括买入价格与交易费用)加上按照最近一次收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额,确定基金应退还申购投资者或申购投资者应补交的款项,以替代金额与所卖出的部分被替代证券实际卖出收入(卖出价格扣除交易</p> |
|--|--|---|

| | | |
|-------------|--|--|
| | 近一次收盘价计算的未卖出的部分被替代证券价值的差额,确定基金应退还赎回投资者或赎回投资者应补交的款项。 | 费用)加上按照最近一次收盘价计算的未卖出的部分被替代证券价值的差额,确定基金应退还赎回投资者或赎回投资者应补交的款项。 |
| 第十一部分 基金的投资 | <p>三、标的指数及其编制信息</p> <p>(一) 标的指数 国证新能源车电池指数</p> <p>(二) 编制方案</p> <p>1、样本空间 满足下列条件的<u>沪深 A 股和红筹企业发行的存托凭证</u>： (1) 非 ST、*ST 证券； (2) <u>主板、创业板证券上市时间超过 6 个月，科创板证券、北交所证券上市时间超过 1 年；</u> (3) 公司最近一年无重大违规、财务报告无重大问题； (4) 公司最近一年经营无异常、无重大亏损； (5) 考察期内证券价格无异常波动； (6) <u>公司业务范畴属于新能源储能电池主题，包括电池制造、储能电池逆变器、储能电池系统集成、电池温控消防等相关领域。</u></p> <p>2、选样方法 首先，计算入围选样空间证券在最近半年的日均成交金额和日均总市值； 然后，剔除选样空间内最近半年的日均成交金额排名后 10%的证券； 最后，对选样空间剩余证券按照最近半年的日均总市值从高到低排序，选取前 50 只证券作为指数样本，样本数量不足时按实际数量纳入。</p> <p>(三) 指数信息查询 有关标的指数具体编制方案及成份股信息详见深圳证券信息有限公司网站，网址：www.cnindex.com.cn/。</p> | <p>三、标的指数及其编制信息</p> <p>(一) 标的指数 国证新能源车电池指数</p> <p>(二) 编制方案</p> <p>1、样本空间 满足下列条件的 A 股和红筹企业发行的存托凭证： (1) 非 ST、*ST 证券； (2) <u>科创板证券、北交所证券上市时间超过 1 年；其他证券上市时间超过 6 个月；</u> (3) 公司最近一年无重大违规、财务报告无重大问题； (4) 公司最近一年经营无异常、无重大亏损； (5) 考察期内证券价格无异常波动； (6) <u>公司业务领域涉及新能源车电池（正极材料、负极材料、电解液、隔膜等）、新能源车电池管理系统及新能源车充电桩等。</u></p> <p>2、选样方法 首先，计算入围选样空间证券在最近半年的日均成交金额和日均总市值； 其次，剔除选样空间内最近半年的日均成交金额排名后 10%的证券； 然后，对选样空间剩余证券按照最近半年的日均总市值从高到低排序，选取前 30 名证券作为指数样本。</p> <p>(三) 指数信息查询 有关标的指数具体编制方案及成份股信息详见深圳证券信息有限公司网站，网址：www.cnindex.com.cn。</p> |
| 第十九部分 风险揭示 | 三、本基金特有的风险 10、 <u>上海证券交易所上市的成份股可以现金替代方式</u> 的风险 | 三、本基金特有的风险 10、 <u>其他交易所上市的成份股可以现金替代方式</u> 的风险 |

| | | |
|--|--|---|
| | <p>在通过深圳证券交易所申购赎回的模式中，<u>上海证券交易所</u>上市的成份股可以现金替代方式不同于现有其他现金替代方式，可能给申购和赎回投资者带来价格的不确定性，从而间接影响本基金二级市场价格的折溢价水平。极端情况下，如果使用<u>上海证券交易所</u>可以现金替代证券的权重增加，该方式带来的不确定性可能导致本基金的二级市场价格折溢价处于相对较高水平。</p> <p>.....</p> <p>19、投资存托凭证的风险</p> <p>本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他仅投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与中国存托凭证发行机制相关的风险，包括存托凭证持有人与境外基础证券发行人的股东在法律地位、享有权利等方面存在差异可能引发的风险；存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等方面的特殊安排可能引发的风险；存托协议自动约束存托凭证持有人的风险；因多地上市造成存托凭证价格差异以及波动的风险；存托凭证持有人权益被摊薄的风险；存托凭证退市的风险；已在境外上市的基础证券发行人，在持续信息披露监管方面与境内可能存在差异的风险；境内外证券交易机制、法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险。</p> | <p>在通过深圳证券交易所申购赎回的模式中，<u>其他交易所</u>上市的成份股可以现金替代方式不同于现有其他现金替代方式，可能给申购和赎回投资者带来价格的不确定性，从而间接影响本基金二级市场价格的折溢价水平。极端情况下，如果使用<u>其他交易所</u>可以现金替代证券的权重增加，该方式带来的不确定性可能导致本基金的二级市场价格折溢价处于相对较高水平。</p> <p>.....</p> <p>19、投资存托凭证的风险</p> <p>本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他仅投资于沪深北市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与中国存托凭证发行机制相关的风险，包括存托凭证持有人与境外基础证券发行人的股东在法律地位、享有权利等方面存在差异可能引发的风险；存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等方面的特殊安排可能引发的风险；存托协议自动约束存托凭证持有人的风险；因多地上市造成存托凭证价格差异以及波动的风险；存托凭证持有人权益被摊薄的风险；存托凭证退市的风险；已在境外上市的基础证券发行人，在持续信息披露监管方面与境内可能存在差异的风险；境内外证券交易机制、法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险。</p> <p>.....</p> <p>22、投资北京证券交易所股票的风险</p> <p><u>(1) 流动性风险</u>：由于北京证券交易所股票的投资者门槛较高，股票流动性弱于其他 A 股板块，投资者可能在特定阶段对北京证券交易所股票个股形成一致性预期，因此存在基金持有股票无法正常交易的风险。</p> |
|--|--|---|

| | | |
|--|--|--|
| | | <p><u>(2) 经营风险：由于北京证券交易所企业规模标准可能低于 A 股市场板块准入标准，上市公司在企业持续经营能力，核心技术、经营、管理团队稳定性，财务数据稳定性及企业应对外部政策、市场等风险的水平上具有较大的经营风险，由此可能导致基金持仓股价的较大负向波动。</u></p> <p><u>(3) 退市风险：北京证券交易所股票可能因触及退市情形被终止上市，由此对基金流动性管理、资产处置带来了更大的风险管理压力，也可能给基金净值带来不利影响。</u></p> <p><u>(4) 股价波动风险：北京证券交易所股票采用连续竞价交易，涨跌幅限制大于包括创业板和科创板在内的 A 股市场其他板块，可能给基金净值带来较大的波动风险。</u></p> <p><u>(5) 由于存在表决权差异安排可能引发的风险。北京证券交易所允许上市公司存在表决权差异安排。根据此项安排，上市公司可能存在控制权相对集中，以及因每一特别表决权股份拥有的表决权数量大于每一普通股份拥有的表决权数量等情形，而使普通投资者的表决权利及对公司日常经营等事务的影响力受到限制。</u></p> <p><u>以上所述因素可能会给本基金投资带来特殊交易风险。</u></p> |
|--|--|--|

三、重要提示

本次修订对基金份额持有人的利益无实质性不利影响，也不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化，无需召开基金份额持有人大会。

基金管理人将根据本公告更新本基金的招募说明书、基金产品资料概要相关内容。

投资者可通过本基金管理人的网站：www.ccbfund.cn 或客户服务电话：400-81-95533（免长途通话费）了解详情。

上述修改内容自本公告发布之日起生效执行。本公告的解释权归我公司所有。

风险提示：本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财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。投资者购买证券投资基金并不等于将资金作为存款存放在银行或者存款类金融机构，基金的过往业绩并不代表其将来表现。投资有风险，敬请投资者认真阅读基金的相关法律文件，并选择适合自身风险承受能力的投资品种进行投资。

特此公告。

建信基金管理有限责任公司

2024年6月17日