

# 关于招商沪深 300 指数增强型证券投资基金修改基金合同和托管协议的公告

为更好地满足投资者需求，维护基金份额持有人利益，招商基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”或“本公司”）根据《公开募集证券投资基金参与转融通证券出借业务指引（试行）》的相关规定对旗下招商沪深 300 指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金合同和托管协议等相关法律文件进行了修改。本次修订系因政策法规变更而做出的必要修改，未对基金份额持有人的利益形成实质性不利影响。本次修订已与基金托管人中国银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案。

本基金基金合同和托管协议的修订自公告之日起生效，投资者可访问本公司网站 ([www.cmfchina.com](http://www.cmfchina.com)) 查阅修订后的本基金基金合同、托管协议。本基金招募说明书将根据《基金合同》的内容进行相应修改，并按规定更新。

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，基金管理人并不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现，基金管理人管理的其他基金的业绩不构成对本基金业绩表现的保证。投资有风险，敬请投资者在投资基金前认真阅读《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。敬请投资者在购买基金前认真考虑、谨慎决策。

特此公告。

附件 1：《招商沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同、托管协议修改前后文对照表》

招商基金管理有限公司

2019 年 12 月 26 日

附件 1:

招商沪深 300 指数增强型证券投资基金  
基金合同、托管协议修改前后文对照表

基金合同修改情况:

章节 原文条款 修改后条款

第二部分释义 无

57、转融通证券出借业务：指本基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司出借证券，中国证券金融股份有限公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务

第七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：李浩

注册资本：2.1 亿元人民币

法定代表人：刘辉

注册资本：13.1 亿元人民币

第七部分基金合同当事人及权利义务

## 二、基金托管人

### （一）基金托管人简况

法定代表人：田国立

注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹  
亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍  
元整

法定代表人：刘连舸

注册资本：人民币 29,438,779.1241 万元整

## 第十二部分基金的投资

### 三、投资策略

#### 7、融资及转融通证券出借业务投资策略

本基金在参与融资、转融通证券出借业务时将根据风险管理的原则，在法律法规允许的范围和比例内、风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与融资和转融通证券出借业务。参与融资业务时，本基金将力争利用融资的杠杆作用，降低因申购造成基金仓位较低带来的跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。参与转融通证券出借业务时，本基金将从基金持有的融券标的股票中选择流动性好、交易活跃的股票作为转融通出借交易对象，力争为本基金份额持有人增厚投资收益。

为更好地实现投资目标，在加强风险防范并遵守审慎原则的前提下，本基金可根据投资管理的需要参与融资、转融通证券出借业务。参与融资业务时，本基金将力争利用融资的杠杆作用，降低因申购造成基金仓位较低带来的跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。参与转融通证券出借业务时，本基金将在分析市场情况、投资者类型与结构、基金历史申赎情况、出借证券流动性情况等因素的基础上，合理确定出借证券的范围、期限和比例。

## 第十二部分基金的投资

### 五、投资限制

#### 1、组合限制

（17）本基金在任何交易日日终，参与转融通证券出借交易的资产不得超过基金资产净值的 50%，证券出借的平均剩余期限不得超过 301 天，平均剩余期限按照市值加权平均计算；

（17）本基金参与转融通证券出借业务，出借证券资产不得超过基金资产净值的 30%，出借期限在 10 个交

易日以上的出借证券应纳入《流动性规定》所述流动性受限证券的范围；参与出借业务的单只证券不得超过本基金持有该证券总量的 50%；最近 6 个月内日均基金资产净值不得低于 2 亿元；证券出借的平均剩余期限不得超过 301 天，平均剩余期限按照市值加权平均计算；因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合本条上述规定的，基金管理人不得新增出借业务；

## 第十二部分基金的投资

### 五、投资限制

#### 1、组合限制

除上述第（10）、（19）、（20）项外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。

除上述第（10）、（17）、（19）、（20）项外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个工作日内进行调整。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。

## 第十四部分基金资产估值

### 四、估值方法

7、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

8、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

7、本基金参与转融通证券出借业务，按照相关法律法规和行业协会的相关规定进行估值。

8、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

9、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

## 第十四部分基金资产估值

## 九、特殊情况的处理

1、基金管理人或基金托管人按“估值方法”的第7项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

1、基金管理人或基金托管人按“估值方法”的第8项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

## 第十八部分基金的信息披露

### 五、公开披露的基金信息

#### （十四）参与融资及转融通证券出借交易信息披露

基金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露参与融资和转融通证券出借交易情况，包括投资策略、业务开展情况、损益情况、风险及其管理情况等。

基金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露参与融资和转融通证券出借交易情况，包括投资策略、业务开展情况、损益情况、风险及其管理情况等，并就转融通证券出借业务在报告期内发生的重大关联交易事项做详细说明。

#### 托管协议修改情况：

章节 原文条款 修改后条款

#### 一、托管协议当事人

（一）基金管理人（或简称“管理人”）

法定代表人：李浩

注册资本：2.1 亿元人民币

法定代表人：刘辉

注册资本：13.1 亿元人民币

#### 一、托管协议当事人

（一）基金托管人（或简称“托管人”）

法定代表人：田国立

注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹

亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

法定代表人：刘连舸

注册资本：人民币 29,438,779.1241 万元整

#### 三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

（一）基金托管人根据有关法律法

规的规定及《基金合同》的约定，建立相关的技术系统，对基金管理人的下列投资运作进行监督。主要包括以下方面：

## 2、对基金投融资比例进行监督：

（15）本基金在任何交易日日终，参与转融通证券出借交易的资产不得超过基金资产净值的 50%，证券出借的平均剩余期限不得超过 30 天，平均剩余期限按照市值加权平均计算；

（15）本基金参与转融通证券出借业务，出借证券资产不得超过基金资产净值的 30%，出借期限在 10 个交易日以上的出借证券应纳入《流动性规定》所述流动性受限证券的范围；参与出借业务的单只证券不得超过本基金持有该证券总量的 50%；最近 6 个月内日均基金资产净值不得低于 2 亿元；证券出借的平均剩余期限不得超过 30 天，平均剩余期限按照市值加权平均计算；因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合本条上述规定的，基金管理人不得新增出借业务；

## 三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

（一）基金托管人根据有关法律法

规的规定及《基金合同》的约定，建立相关的技术系统，对基金管理人的下列投资运作进行监督。主要包括以下方面：

## 2、对基金投融资比例进行监督：

除上述第（8）、（17）、（18）项外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。

除上述第（8）、（15）、（17）、（18）项外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定