

华夏基金管理有限公司关于修订华夏野村日经 225 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)基金合同的公告

为更好地跟踪标的指数以及更好地满足投资者 ETF 投资需求,维护投资者利益,根据华夏野村日经 225 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)(以下简称“本基金”,基金代码:513520,场内简称:日经 ETF,基金扩位简称:日经 225ETF 基金)基金合同、招募说明书(更新)的有关规定,经协商基金托管人同意,并报中国证监会备案,华夏基金管理有限公司(以下简称“本公司”)决定自 2020 年 5 月 15 日起,将本基金估值计算中涉及的主要货币对人民币汇率的基准由“中国人民银行或其授权机构公布的人民币与主要货币的汇率中间价”调整为能够较好反映外汇市场公允价格的“中国外汇交易中心公布的日本东京证券交易所正常交易日收市时点或能够取到的最近时点(北京时间)人民币对主要货币参考汇率”,并相应修订本基金基金合同中外汇汇率有关内容。现将主要修订情况公告如下:

一、对基金合同“第十五部分 基金资产估值”中“四、估值方法 10、外汇汇率”的修订:

修订前:

“10、外汇汇率

(1) 估值计算中涉及美元、港币、日元、欧元、英镑等五种主要货币对人民币汇率的,将依据下列信息提供机构所提供的汇率为基准:当日中国人民银行或其授权机构公布的人民币与主要货币的汇率中间价。

(2) 其他货币采用美元作为中间货币进行换算,与美元的汇率则以估值日彭博(伦敦时间)16:00 报价数据为准。

若无法取得上述汇率价格信息时,以托管银行中国建设银行或境外托管人所提供的合理公开外汇市场交易价格为准。”

修订后:

“10、外汇汇率

(1) 估值计算中涉及美元、港币、日元、欧元、英镑等五种主要货币对人民币汇率的,将依据下列信息提供机构所提供的汇率为基准:中国外汇交易中心公布的日本东京证券交易所正常交易日收市时点或能够取到的最近时点(北京时间)人民币对主要货币参考汇率,如未公布上述参考汇率,则为中国人民银行或其授权机构最新公布的人民币汇率中间价。如果上述汇率公布时间发生变更、或者出现管理人认为更权威、更能被市场普遍接受的汇率,基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,调整基金的估值汇率。

(2) 其他货币采用美元作为中间货币进行换算,与美元的汇率则以估值日彭博(北京时间)16:00 报价数据为准。

若无法取得上述汇率价格信息时,以托管银行中国建设银行或境外托管人所提供的合理公开外汇市场交易价格为准。”

二、对招募说明书(更新)的修订

(一)对“八、基金份额的上市交易”中“(三)基金份额参考净值(IOPV)的计算与公告”第 1 点的修订

修订前:

“1、基金份额参考净值计算公式为:

基金份额参考净值=(申购赎回清单中必须用现金替代的成份证券的必须替代金额之和+申购赎回清单中退补现金替代的成份证券的数量与最新成交价乘积之和+申购赎回清单中的

预估现金部分)/最小申购、赎回单位对应的基金份额(最新成交价按照汇率公允价调整为人民币价格)

汇率公允价包括中证指数公司在发布和计算境外指数产品中采用的实时汇率价格、基金管理人与基金托管人商定的其他公允价格(如:中国人民银行或国家外汇管理局或中国外汇交易中心正式对外发文后公布的北京时间 16:30 的人民币兑主要外汇当日收盘价,如上述机构未正式发文规定公布上述收盘价,则为中国人民银行或其授权机构最新公布的人民币汇率中间价)等。”

修订后:

“1、基金份额参考净值计算公式为:

基金份额参考净值=(申购赎回清单中必须用现金替代的成份证券的必须替代金额之和+申购赎回清单中退补现金替代的成份证券的数量与最新成交价乘积之和+申购赎回清单中的预估现金部分)/最小申购、赎回单位对应的基金份额(最新成交价按照汇率公允价调整为人民币价格)

汇率公允价包括中证指数公司在发布和计算境外指数产品中采用的实时汇率价格、基金管理人与基金托管人商定的其他公允价格(如:中国外汇交易中心公布的人民币对主要货币参考汇率,如未公布上述参考汇率,则为中国人民银行或其授权机构最新公布的人民币汇率中间价)等。”

(二)对“十二、基金资产的估值”中“(四)估值方法 10、外汇汇率”的修订

修订前:

“10、外汇汇率

(1)估值计算中涉及美元、港币、日元、欧元、英镑等五种主要货币对人民币汇率的,将依据下列信息提供机构所提供的汇率为基准:当日中国人民银行或其授权机构公布的人民币与主要货币的汇率中间价。

(2)其他货币采用美元作为中间货币进行换算,与美元的汇率则以估值日彭博(伦敦时间)16:00 报价数据为准。

若无法取得上述汇率价格信息时,以托管银行中国建设银行或境外托管人所提供的合理公开外汇市场交易价格为准。”

修订后:

“10、外汇汇率

(1)估值计算中涉及美元、港币、日元、欧元、英镑等五种主要货币对人民币汇率的,将依据下列信息提供机构所提供的汇率为基准:中国外汇交易中心公布的日本东京证券交易所正常交易日收市时点或能够取到的最近时点(北京时间)人民币对主要货币参考汇率,如未公布上述参考汇率,则为中国人民银行或其授权机构最新公布的人民币汇率中间价。如果上述汇率公布时间发生变更、或者出现管理人认为更权威、更能被市场普遍接受的汇率,基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,调整基金的估值汇率。

(2)其他货币采用美元作为中间货币进行换算,与美元的汇率则以估值日彭博(北京时间)16:00 报价数据为准。

若无法取得上述汇率价格信息时,以托管银行中国建设银行或境外托管人所提供的合理公开外汇市场交易价格为准。”

本次修订不涉及基金合同当事人权利义务关系变化,对基金份额持有人利益无实质性不利影响,且已履行了规定的程序,符合相关法律法规及基金合同的规定。本次修订自2020年5月15日起生效,届时投资者可登录基金管理人网站(www.ChinaAMC.com)查阅修订后的基金合同及招募说明书(更新)。

特此公告

华夏基金管理有限公司
二〇二〇年四月二十四日