

长城基金管理有限公司关于长城中债3-5年国开行债券指数证券投资基金根据《公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引》修改基金合同部分条款的公告

根据《公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引》及《长城中债3-5年国开行债券指数证券投资基金基金合同》的约定,经与长城中债3-5年国开行债券指数证券投资基金(以下简称“本基金”)基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致,并报中国证监会备案,长城基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)决定对本基金的基金合同有关条款进行修订,托管协议涉及的条款也将相应修改。有关情况如下:

一、基金合同修改的内容

1、“前言”章节

(1)在“订立本基金合同的目的、依据和原则”中增加《公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引》作为订立基金合同的依据;

(2)“前言”章节增加:“本基金为指数基金,投资者可能面临跟踪误差控制未达约定目标、指数编制机构停止服务、成份券停牌、摘牌或违约等潜在风险。”

2、“释义”章节

“释义”章节增加:“《指数基金指引》:指中国证监会2021年1月22日颁布、同年2月1日实施的《公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引》及颁布机关对其不时做出的修订”。

3、“基金的投资”章节

(1)在“投资策略”中增加:“本基金运作过程中,当指数成份券发生明显负面事件面临退市或违约风险,且指数编制机构暂未作出调整的,基金管理人将按照基金份额持有人利益优先的原则,履行内部决策程序后及时对相关成份券进行调整。”

(2)在“投资限制”中增加:“本基金持有一家公司发行的证券,其市值不超过基金资产净值的10%,完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的基金品种可以不受此条款规定的比例限制;”和“本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券,不超过该证券的10%,完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的基金品种可以不受此条款规定的比例限制;”

(3)在“标的指数和业绩比较基准”中增加:“未来若出现标的指数不符合要求(因成份券价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外)、指数编制机构退出等情形,基金管理人应当自该情形发生之日起十个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案,如更换基金标的指数、转换运作方式,与其他基金合并、或者终止基金合同等,并在6个月内召集基金份额持有人大会进行表决,基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的,基金合同终止。”

自指数编制机构停止标的指数的编制及发布至解决方案确定期间,基金管理人应严格按照指数编制机构提供的最近一个交易日的指数信息遵循基金份额持有人利益优先原则维持基金投资运作。”

同时删除:“如果指数发布机构变更或者停止上述标的指数编制及发布,或者上述标的指数由其他指数代替,或由于指数编制方法等重大变更导致上述指数不宜继续作为标的指数,或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时,本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则,在履行适当程序后变更本基金的标的指数,并同时更换本基金的基金名称与业绩比较基准。若标的指数、业绩比较基准变更对基金投资无实质性影响(包括但不限于编制机构变更、指数更名等),则无需召开基金份额持有人大会,基金管理人可在取得基金托管人同意后变更标的指数和业绩比较基准,报中国证监会备案并及时公告。”

二、修改后的基金合同自2021年3月30日起生效,本次修订系根据法律法规而作出,符合相关法律法规和基金合同的规定,并已履行规定程序。本次修订后的基金合同、托管协议、招募说明书和基金产品资料概要将在本公司网站及中国证监会基金电子信息披露网站发布。

投资者可拨打本公司客户服务热线(400-8868-666)或登录本公司网站(www.ccfund.com.cn)了解相关信息。

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财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其将来表现,基金管理人所管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。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。

长城基金管理有限公司
2021年3月30日