

兴证全球基金管理有限公司关于旗下部分基金修改基金合同的公告

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引》、《存托凭证发行与交易管理办法（试行）》等法律法规和相关公开募集证券投资基金（以下简称“基金”）基金合同的规定，经与相关基金的基金托管人协商一致，并向中国证监会备案，兴证全球基金管理有限公司（以下简称“本公司”）对旗下部分基金补充指数基金指引内容和/或投资范围中增加存托凭证并修订基金合同等法律文件。现将有关修订内容说明如下：

（1）根据法律法规的规定和基金合同的约定，本公司旗下部分基金补充指数基金指引内容并对基金合同中有关章节的相关条款进行修订，包括在前言、释义、基金的投资等章节补充指数基金相关内容，并在基金招募说明书（更新）、产品资料概要中增加指数基金特有的风险揭示。

（2）部分基金本次修订内容包括明确投资范围包含存托凭证、增加存托凭证的投资策略、投资比例限制、估值方法等，并在基金招募说明书（更新）、基金产品资料概要（更新）中增加投资存托凭证的风险揭示。

本次修订基金的基金合同经基金管理人与各基金托管人协商一致，修订的内容和程序均符合法律法规的规定及基金合同的约定。本次修订自2021年3月31日起生效。所涉基金的托管协议、招募说明书、产品资料概要涉及上述相关内容的部分均按法规要求进行相应修订。投资人办理本公告所涉基金交易等相关业务前，应仔细阅读各基金的基金合同、招募说明书、产品资料概要、风险提示及相关业务规则和操作指南等文件。

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，投资者投资于本基金管理人旗下基金时应认真阅读相关基金合同、招募说明书、基金产品资料概要等文件。投资有风险，敬请投资人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。

如有疑问,请拨打客户服务热线:400-678-0099(免长话费)、021-38824536,
或登陆网站 <http://www.xqfunds.com> 获取相关信息。

特此公告。

兴证全球基金管理有限公司

2021年3月31日

附件：

一、本次修改基金合同的基金

序号	基金名称	基金托管人
1	兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF)	农业银行股份有限公司
2	兴全中证 800 六个月持有期指数增强型证券投资基金	招商银行股份有限公司

二、兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金合同修改对照表

章节	修改前	修改后
一、前言	<p>(一) 订立本基金合同的目的、依据和原则</p> <p>2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《中华人民共和国合同法》、《证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称“《流动性风险管理规定》”)和其他有关法律法规。</p>	<p>(一) 订立本基金合同的目的、依据和原则</p> <p>2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《中华人民共和国合同法》、《证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称“《流动性风险管理规定》”)、《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》(以下简称“《指数基金指引》”)和其他有关法律法规。</p> <p>(五) 本基金为指数基金, 投资者投资于本基金面临跟踪误差控制未达约定目标、指数编制机构停止服务、成份券停牌或违约等潜在风险, 详见本基金招募说明书。</p>
二、释义		增加: 14、《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
十二、基金的投资	<p>(四) 标的指数</p> <p>本基金的标的指数是沪深 300 指数。</p> <p>沪深 300 指数是由上海和深圳证券交易所市场中选取 300 只 A 股作为样本编制而成的成份股指数,覆盖了沪深市场六成左右的市值,具有良好的市场代表性。它是中国第一条由权威机构编制、发布的全市场指数,流动性高,可投资性强,综合反映了中国证券市场最具市场影响力的一批蓝筹股的整体状况,能够反映 A 股市场总体发展趋势,适合作为指数基金的跟踪标的。</p> <p>如果沪深 300 指数被停止编制及发布,或沪深 300 指数由其他指数替代(单纯更名除外),或由于指数编制方法等重大变更导致沪深 300 指数不宜继续作为标的指数或证券市场上出现其他代表性更强,更合适投资的指数作为本基金的标的指数,本基金管理人可以依据审慎性原则,在充分考虑持有人利益的前提下,履行适当程序后,更换本基金的标的指数;并依据市场代表性、流动性、与原指数的相关性等诸多因素选择确定新的标的指数。基金管理人应在调整前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定媒介上公告,并在更新的招募说明书中列示。</p>	<p>(四) 标的指数</p> <p>本基金的标的指数是沪深 300 指数。</p> <p>沪深 300 指数是由上海和深圳证券交易所市场中选取 300 只 A 股作为样本编制而成的成份股指数,覆盖了沪深市场六成左右的市值,具有良好的市场代表性。它是中国第一条由权威机构编制、发布的全市场指数,流动性高,可投资性强,综合反映了中国证券市场最具市场影响力的一批蓝筹股的整体状况,能够反映 A 股市场总体发展趋势,适合作为指数基金的跟踪标的。</p> <p>未来若出现标的指数不符合要求(因成份股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。</p> <p>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。</p> <p>(五) 投资策略</p> <p>.....</p> <p>6、股票指数化投资日常投资组合管理</p> <p>.....</p> <p>(2) 不定期调整</p> <p>.....</p>

	<p>(六) 业绩比较基准</p> <p>本基金的业绩基准为: 沪深 300 指数×95%+同业存款利率×5%</p> <p>如果指数编制单位停止计算编制该指数或更改指数名称、或有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出, 本基金管理人有权对此基准进行调整。业绩比较基准的变更须经基金管理人和基金托管人协商一致, 并报中国证监会备案, 基金管理人应在调整前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定媒介上公告, 并在更新的招募说明书中列示。</p>	<p>E、指数成份股发生明显负面事件面临退市风险, 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, 综合考虑成份股的退市风险、其在指数中的权重以及对跟踪误差的影响, 据此制定成份股替代策略, 并对投资组合进行相应调整。</p> <p>.....</p> <p>(六) 业绩比较基准</p> <p>本基金的业绩基准为: 沪深 300 指数×95%+同业存款利率×5%</p> <p>未来若出现标的指数不符合要求(因成份股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。</p> <p>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。</p>
--	---	---

三、兴全中证 800 六个月持有期指数增强型证券投资基金基金合同修改对照表

章节	修改前	修改后
第一部分 前言	<p>一、订立本基金合同的目的、依据和原则</p> <p>2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》(以下简称“《合同法》”)、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《证券</p>	<p>一、订立本基金合同的目的、依据和原则</p> <p>2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》(以下简称“《合同法》”)、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《证券</p>

	<p>投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称“《流动性风险管理规定》”)和其他有关法律法规。</p>	<p>投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称“《流动性风险管理规定》”)、《公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引》(以下简称“《指数基金指引》”)和其他有关法律法规。</p> <p>八、本基金为指数基金,投资者投资于本基金面临跟踪误差控制未达约定目标、指数编制机构停止服务、成份券停牌或违约等潜在风险,详见本基金招募说明书。</p>
第二部分 释义		<p>增加:</p> <p>14、《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</p>
第十二部分 基金的投资	<p>二、投资范围</p> <p>本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括中证800指数的成份股及其备选成份股、其他非指数成分股(包含主板、中小板、创业板及其他国内依法发行上市的股票、港股通标的股票)、债券(国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券(含分离交易可转债的纯债部分)、可交换公司债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、金融衍生工具(包括股指期货、国债期货、股票期权)、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。</p> <p>.....</p>	<p>二、投资范围</p> <p>本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括中证800指数的成份股及其备选成份股、其他非指数成分股(包含主板、中小板、创业板及其他国内依法发行上市的股票及存托凭证、港股通标的股票)、债券(国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券(含分离交易可转债的纯债部分)、可交换公司债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、金融衍生工具(包括股指期货、国债期货、股票期权)、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。</p>

	<p>五、业绩比较基准</p> <p>本基金业绩比较基准：中证 800 指数收益率×90%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×5%+银行活期存款利率（税后）×5%</p> <p>中证 800 指数由中证指数有限公司编制，其成份股由中证 500 和沪深 300 指数成份股组成，旨在综合反映中国 A 股市场大中小市值公司的股票价格表现。</p>	<p>.....</p> <p>三、投资策略</p> <p>.....</p> <p>1、股票投资策略</p> <p>.....</p> <p>（3）股票组合调整</p> <p>.....</p> <p>2) 不定期调整</p> <p>.....</p> <p>③指数成份股发生明显负面事件面临退市风险，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，综合考虑成份股的退市风险、其在指数中的权重以及对跟踪误差的影响，据此制定成份股替代策略，并对投资组合进行相应调整。</p> <p>.....</p> <p>2、存托凭证投资策略</p> <p>本基金基于对基础证券投资价值的研究判断，根据审慎原则合理参与存托凭证的投资，以更好地实现投资目标。</p> <p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>.....</p> <p>（19）本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票进行，与境内上市交易的股票合并计算；</p> <p>.....</p> <p>五、业绩比较基准</p> <p>本基金业绩比较基准：中证 800 指数收益率×90%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×5%+银行活期存款利率（税后）×5%</p> <p>中证 800 指数由中证指数有限公司编制，其成份股由中证 500 和沪深 300 指数成份股组成，旨在综合反映中国 A 股市场大中小市值公司的股票价格表现。</p>
--	--	---

	<p>恒生指数是由恒生指数服务有限公司编制，以香港股票市场中的50家上市股票为成份股样本，以其发行量为权数的加权平均股价指数，是反映香港股市价幅趋势最有影响的一种股价指数，本基金选择该指数来衡量港股投资部分的绩效。</p> <p>本基金为指数增强型基金，将通过指数复制的方法拟合、跟踪中证800指数，在严格控制跟踪误差和下方跟踪误差的前提下进行相对增强的组合管理，结合本基金的投资范围、资产配置比例和对流动性的需求，本基金业绩比较基准为：中证800指数收益率×90%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×5%+银行活期存款利率（税后）×5%。</p> <p>如果指数编制单位变更或停止标的指数的编制、发布或授权，或标的指数由其他指数替代、或由于指数编制方法的重大变更等事项导致本基金管理人认为原标的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投资人合法权益的原则，在按监管部门要求履行适当程序后变更本基金的标的指数、业绩比较基准和基金名称。若变更标的指数对基金投资范围和投资策略无实质性影响（包括但不限于指数编制单位变更、指数更名等事项），则无需召开基金份额持有人大会，基金管理人应与基金托管人协商一致后，报中国证监会备案并及时公告。</p>	<p>恒生指数是由恒生指数服务有限公司编制，以香港股票市场中的50家上市股票为成份股样本，以其发行量为权数的加权平均股价指数，是反映香港股市价幅趋势最有影响的一种股价指数，本基金选择该指数来衡量港股投资部分的绩效。</p> <p>本基金为指数增强型基金，将通过指数复制的方法拟合、跟踪中证800指数，在严格控制跟踪误差和下方跟踪误差的前提下进行相对增强的组合管理，结合本基金的投资范围、资产配置比例和对流动性的需求，本基金业绩比较基准为：中证800指数收益率×90%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×5%+银行活期存款利率（税后）×5%。</p> <p>未来若出现标的指数不符合要求（因成份股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。</p> <p>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。</p>
<p>第十四部分 基金资产估值</p>		<p>四、估值方法</p> <p>.....</p> <p>9、本基金投资存托凭证的估值核算，依照境内上市交易的股票执行。</p> <p>.....</p>

	<p>十、特殊情况的处理</p> <p>1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 11 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。</p>	<p>十、特殊情况的处理</p> <p>1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 12 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。</p>
--	---	---