

关于修改招商深证 100 交易型开放式指数证券投资基金

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”）拟根据《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深证 100 交易型开放式指数证券投资基金（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交通银行股份有限公司协商一致并报监管机构备案。

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）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：《招商深证 100 交易型开放式指数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

2020 年 6 月 11 日

附件 1:

招商深证 100 交易型开放式指数证券投资基金

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	70、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
第九部分 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:彭纯	法定代表人:任德奇
第十四部分 基金的投资 四、投资限制 1、组合限制	(9) 本基金参与转融通证券出借交易,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;	(9) 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《流动性风险管理规定》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 30%;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;
第十四部分 基金的投资 四、投资限制 1、组合限制	对于除第(3)、(10)、(11)项外的其他比例限制,因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制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,但中国证监会规定的特殊情形除外。	对于除第(3)、(9)、(10)、(11)项外的其他比例限制,因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制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,但中国证监会规定的特殊情形除外。

<p>第十六部分 基金资产估值</p> <p>三、估值方法</p>	<p>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。</p> <p>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。</p>	<p>8、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。</p> <p>9、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。</p> <p>10、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。</p>
<p>第十六部分 基金资产估值</p> <p>八、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。</p>	<p>1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第9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>第二十部分 基金的信息披露</p> <p>五、公开披露的基金信息</p> <p>(十五) 参与融资和转融通出借交易的信息披露</p>	<p>本基金参与融资和转融通出借交易的，基金管理人应当在季度报告、中期报告、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。</p>	<p>本基金参与融资和转融通出借交易的，基金管理人应当在季度报告、中期报告、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。</p>
<p>托管协议修改情况：</p>		
<p>章节</p>	<p>原文条款</p>	<p>修改后条款</p>
<p>一、基金托管协议当事人</p> <p>(二) 基金托管人</p>	<p>法定代表人：彭纯</p>	<p>法定代表人：任德奇</p>
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p> <p>(一) 基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权</p> <p>2. 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》和本协议的约定，对基金投资、融资比例进行监督。</p>	<p>(9) 本基金参与转融通证券出借交易，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；</p>	<p>(9) 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《流动性风险管理规定》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30%；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；</p>

<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p> <p>(一)基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权</p> <p>2. 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》和本协议的约定,对基金投资、融资比例进行监督。</p>	<p>对于除第(3)、(10)、(11)项外的其他比例限制,因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制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,但中国证监会规定的特殊情形除外。</p>	<p>对于除第(3)、(9)、(10)、(11)项外的其他比例限制,因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制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,但中国证监会规定的特殊情形除外。</p>
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p> <p>(一)基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权</p>	<p>无</p>	<p>7. 基金参与转融通证券出借业务,基金管理人应当遵守审慎经营原则,配备技术系统和专业人员,制定科学合理的投资策略和 risk 管理制度,完善业务流程,有效防范和控制风险。基金托管人将对基金参与出借业务进行监督和复核。</p>
<p>八、基金资产净值计算和会计核算</p> <p>(一)基金资产净值及基金份额净值的计算与复核</p>	<p>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。</p> <p>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。</p>	<p>8、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。</p> <p>9、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。</p> <p>10、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。</p>
<p>八、基金资产净值计算和会计核算</p> <p>(二)净值差错处理</p>	<p>1. 如采用本协议第八条“基金资产净值及基金份额净值的计算与复核”中估值方法的第1—7、9进行处理时,若基金管理人净值计算出错,基金托管人在复核过程中没有发现,且造成基金份额持有人损失的,应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金,就实际向投资者或基金支付的赔偿金额,由基金管理人与基金托管人按照管理费率 and 托管费率的比例各自承担相应的责任;</p> <p>3. 基金管理人、基金托管人按估值方法的第8项进行估值时,</p>	<p>1. 如采用本协议第八条“基金资产净值及基金份额净值的计算与复核”中估值方法的第1—8、10进行处理时,若基金管理人净值计算出错,基金托管人在复核过程中没有发现,且造成基金份额持有人损失的,应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金,就实际向投资者或基金支付的赔偿金额,由基金管理人与基金托管人按照管理费率 and 托管费率的比例各自承担相应的责任;</p> <p>3. 基金管理人、基金托管人按估值方法的第9项进行估值时,所造成的误差 not 作为基金份额净值错误处理。</p>

	所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。	
--	----------------------	--