

# 东吴基金管理有限公司

## 关于旗下部分基金根据《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》（以下简称“《指数基金指引》”）等法律法规、《东吴沪深300指数型证券投资基金基金合同》、《东吴中证新兴产业指数证券投资基金基金合同》及《东吴中证可转换债券指数证券投资基金基金合同》的约定，经与各相关基金托管人协商一致，并向中国证券监督管理委员会备案，东吴基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）决定对旗下3只基金的基金合同、托管协议等法律文件进行修改。本次修订将自2021年3月31日起正式生效。

现将相关事项公告如下：

### 一、修订依据及修订基金范围

基金管理人根据《指数基金指引》对旗下3只基金的基金合同、托管协议等法律文件进行修订。具体明细如下：

序号	基金全称	基金托管人
1	东吴沪深300指数型证券投资基金	中国建设银行股份有限公司
2	东吴中证新兴产业指数证券投资基金	中国农业银行股份有限公司
3	东吴中证可转换债券指数证券投资基金	平安银行股份有限公司

二、本次修改基金合同等法律文件事项系因相应法律法规发生变动、基金管理人基本信息更新而进行的修改，主要根据《指数基金指引》在基金合同、招募说明书中增加标的指数不符合要求、指数编制机构退出等情形时的应急处置安排、揭示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）等潜在风险等相关条款，其余法律文件涉及到上述相关内容也已进行相应修订。

### 三、重要提示

1、修改后的基金合同自2021年3月31日起生效，基金管理人已履行了规定程序，符合相关法律法规的规定及各基金基金合同的约定。修改后的各基金基金合同以及托管协议全文将与本公告同日登载于基金管理人网站（www.scfund.com.cn）及中国证监会

基金电子披露网站 (<http://eid.csrc.gov.cn/fund>)。本次修订后的招募说明书(更新)和产品资料概要(更新)将在基金管理人网站发布,供投资者查阅。

2、投资者可登录本基金管理人网站 ([www.scfund.com.cn](http://www.scfund.com.cn)) 或拨打本基金管理人的客户服务电话 (400-821-0588、021-50509666) 进行咨询、查询。

**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。基金的过往业绩并不代表其未来表现。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。

特此公告。

东吴基金管理有限公司

二〇二一年三月三十日

附件 1:《东吴沪深 300 指数型证券投资基金基金合同》修改前后条款对照表

章节	原表述	修改后表述
<p>第一部分 前言</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“《流动性风险规定》”）和其他有关法律法规。</p> <p>三、东吴沪深 300 指数型证券投资基金由东吴深证 100 指数增强型证券投资基金 (LOF) 变更注册而来。中国证监会对东吴深证 100 指数增强型证券投资基金 (LOF) 的变更注册，并不表明其对本基金的投资价值、市场前景和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。</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“《流动性风险规定》”）、<u>《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》</u>（以下简称“<u>《指数基金指引》</u>”）和其他有关法律法规。</p> <p>三、东吴沪深 300 指数型证券投资基金由东吴深证 100 指数增强型证券投资基金 (LOF) 变更注册而来。中国证监会对东吴深证 100 指数增强型证券投资基金 (LOF) 的变更注册，并不表明其对本基金的投资价值、市场前景和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。</p> <p><u>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。</u></p>
<p>第二部分 释义</p>		<p><u>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</u></p>
<p>第七部分 基金合同当事人 及权利义务</p>	<p>一、基金管理人</p> <p>（一）基金管理人简况</p> <p>住所：<del>上海市浦东新区源深路 279 号</del></p>	<p>一、基金管理人</p> <p>（一）基金管理人简况</p> <p>住所：<u>中国（上海）自由贸易试验区银城路 117 号 9 楼 901、902 室</u></p>

	法定代表人： <u>王炯</u>	法定代表人： <u>邓晖</u>
第十二部分 基金的投资	<p>三、投资策略</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>(2) 股票投资组合的调整</p> <p>五、业绩比较基准</p> <p>如果指数编制单位变更或停止沪深 300 指数的编制、发布或授权，或沪深 300 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沪深 300 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者合法权益的原则，在履行适当程序后变更本基金的标的指数、业绩比较基准和基金名称。其中，若变更标的指数涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更，则基金管理人应就变更标的指数召开基金份额持有人大会，并报中国证监会备案且在指定媒介公告。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>三、投资策略</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>(2) 股票投资组合的调整</p> <p><u>当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。</u></p> <p>五、业绩比较基准</p> <p><u>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，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，本基金合同终止。</u></p> <p><u>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。</u></p> <p><u>若标的指数变更对基金投资无实质性影响且在不损害基金份额持有人利益的前提下，无需召开基金份额持有人大会，基金管理人与基金托管人协商一致，按照监管部门的要求履行适当程序后在指定媒介上及时公告，并在更新的招募说明书中列示。</u></p>
第十九部分 基金合同的变	二、《基金合同》的终止事由	二、《基金合同》的终止事由 3、出现标的指数不符合要求（因成份股价格波

更、终止与基金 财产的清算		<u>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，基金管理人召集基金份额持有人大会对解决方案进行表决，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；</u>
------------------	--	---

附件 2:《东吴中证新兴产业指数证券投资基金基金合同》修改前后条款对照表

章节	原表述	修改后表述
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“《流动性风险规定》”)和其他有关法律法规。</p> <p>(三)东吴中证新兴产业指数证券投资基金由基金管理人依照《基金法》、基金合同及其他有关规定募集,并经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)核准。</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“《流动性风险规定》”)、<u>《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》”)</u>和其他有关法律法规。</p> <p>(三)东吴中证新兴产业指数证券投资基金由基金管理人依照《基金法》、基金合同及其他有关规定募集,并经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)核准。</p> <p><u>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。</u></p>
二、释义		<p><u>15、《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</u></p>
七、基金合同当事人及权利义务	<p>(一)基金管理人</p> <p>1、基金管理人简况</p> <p>注册地址:上海市浦东新区源深路 279 号</p> <p>办公地址:上海市浦东新区源深路 279 号</p> <p>邮政编码: 200135</p>	<p>(一)基金管理人</p> <p>1、基金管理人简况</p> <p>注册地址:中国(上海)自由贸易试验区银城路 117 号 9 楼 901、902 室</p> <p>办公地址:上海市浦东新区银城路 117 号瑞明大厦 9F</p> <p>邮政编码: 200120</p>

	<p>(二)基金托管人</p> <p>1、基金托管人简况</p> <p>法定代表人：<u>周慕冰</u></p>	<p>(二)基金托管人</p> <p>1、基金托管人简况</p> <p>法定代表人：<u>谷澎</u></p>
<p>十二、基金的投资</p>	<p>(四) 标的指数</p> <p>如果相关法律法规发生变化，或中证新兴产业指数被停止编制及发布，或中证新兴产业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中证新兴产业指数不宜继续作为标的指数，或证券市场上出现其他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维护投资者合法权益的原则，与托管人协商一致并履行相关程序后，变更本基金的标的指数，相应更换基金名称和业绩比较基准，并在报中国证监会备案后及时公告。</p> <p>(五) 股票投资策略</p> <p>2、股票投资组合的调整</p> <p>(1) 组合调整原则</p>	<p>(四) 标的指数</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，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，本基金合同终止。</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>若标的指数变更对基金投资无实质性影响且在不损害基金份额持有人利益的前提下，无需召开基金份额持有人大会，基金管理人与基金托管人协商一致，按照监管部门的要求履行适当程序后在指定媒介上及时公告，并在更新的招募说明书中列示。</p> <p>(五) 股票投资策略</p> <p>2、股票投资组合的调整</p> <p>(1) 组合调整原则</p> <p>当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>(七)业绩比较基准</p>	<p>(七)业绩比较基准</p> <p><u>若基金标的指数发生变更，基金业绩比较基准随之变更，由基金管理人根据标的指数变更情形履行对应适当程序，并在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在中国证监会指定媒介上刊登公告。</u></p>
<p>十九、基金合同的变更、终止与基金财产的清算</p>	<p>(二)本基金合同的终止</p> <p>有下列情形之一的，本基金合同经中国证监会核准后将终止：</p>	<p>(二)本基金合同的终止</p> <p>有下列情形之一的，本基金合同经中国证监会核准后将终止：</p> <p><u>4. 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，基金管理人召集基金份额持有人大会对解决方案进行表决，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；</u></p>



附件 3:《东吴中证可转换债券指数证券投资基金基金合同》修改前后条款对照表

章节	原表述	修改后表述
<p>第一部分 前言</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“《流动性风险规定》”）和其他有关法律法规。</p> <p>三、东吴中证可转换债券指数证券投资基金由东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金变更注册而来。</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“《流动性风险规定》”）、<u>《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》</u>（以下简称“<u>《指数基金指引》</u>”）和其他有关法律法规。</p> <p>三、东吴中证可转换债券指数证券投资基金由东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金变更注册而来。</p> <p><u>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。</u></p>
<p>第二部分 释义</p>		<p><u>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</u></p>
<p>第三部分 基金的基本情况</p>	<p>四、标的指数</p> <p><u>如果指数发布机构变更或停止该指数的编制及发布，或由于指数编制方法等重大变更导致该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者合法权益的原则，在履行适当程序后变更本基金的标的指数。</u></p>	<p>四、标的指数</p> <p><u>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</u></p>

		<p><u>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，本基金合同终止。</u></p> <p><u>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。</u></p> <p><u>若标的指数变更对基金投资无实质性影响且在不损害基金份额持有人利益的前提下，无需召开基金份额持有人大会，基金管理人与基金托管人协商一致，按照监管部门的要求履行适当程序后在指定媒介上及时公告，并在更新的招募说明书中列示。</u></p>
<p>第十二部分 基金的投资</p>	<p>四、投资策略</p> <p>（二）指数投资策略</p> <p>五、业绩比较基准</p> <p><u>随着市场环境的变化，如果指数发布机构变更或停止该指数的编制及发布，或由于指数编制方法等重大变更导致该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者合法权益的原则，在履行适当程序后变更本基金的标的指数，并同时变更本基金的基金名称与业绩比较基准。其中，若标的指数变更涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更，则基金管理人应就变更标的指数召开基金份额持有人大会，并报中国证监会备案。若</u></p>	<p>四、投资策略</p> <p>（二）指数投资策略</p> <p><u>当指数成份券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，综合考虑成份券的退市风险、其在指数中的权重以及对跟踪误差的影响，据此制定成份券替代策略，并对投资组合进行相应调整。</u></p> <p>五、业绩比较基准</p> <p><u>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，本基金合同终止。</u></p> <p><u>自指数编制机构停止标的指数的编制及发布至</u></p>

	<p>标的指数变更对基金投资无实质性影响（包括但不限手编制机构变更、指数更名等），则无需召开基金份额持有人大会，基金管理人应在取得基金托管人同意后，报中国证监会备案，并依照《信息披露办法》的规定在指定媒介上刊登公告。</p>	<p><u>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。</u></p> <p><u>若标的指数变更对基金投资无实质性影响且在不损害基金份额持有人利益的前提下，无需召开基金份额持有人大会，基金管理人与基金托管人协商一致，按照监管部门的要求履行适当程序后在指定媒介上及时公告，并在更新的招募说明书中列示。</u></p>
<p>第十九部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算</p>	<p>二、《基金合同》的终止事由</p> <p>有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：</p>	<p>二、《基金合同》的终止事由</p> <p>有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：</p> <p><u>3、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，基金管理人召集基金份额持有人大会对解决方案进行表决，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；</u></p>