

恒生前海基金管理有限公司

关于旗下部分基金修订基金合同、托管协议的公告

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信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金侧袋机制指引（试行）》（以下简称“《侧袋机制指引》”）、《存托凭证发行与交易管理办法（试行）》（以下简称“《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》（以下简称“《指数基金指引》”）等法律法规规定及各基金基金合同的约定，经与各基金托管人协商一致，并向中国证监会备案，恒生前海基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）决定对旗下9只公募基金的基金合同、托管协议等法律文件进行修改，及对基金管理人、基金托管人的信息进行更新，本次修订将自2021年3月31日起正式生效。现将基金合同、托管协议修订情况公告如下：

一、本次主要修订内容

本次修订涉及基金管理人旗下9只公募基金，其中涉及根据《侧袋机制指引》修订基金合同的共4只基金，涉及根据《管理办法》修订基金合同的共6只基金，涉及根据《指数基金指引》修订基金合同的共3只基金，详细名单见本公告的附表。

序号	基金名称	修订事项		
		是否根据《公开募集证券投资基金侧袋机制指引（试行）》修订基金合同	是否根据《存托凭证发行与交易管理办法（试行）》修订基金合同	是否根据《公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引》修订基金合同
1	恒生前海沪港深新兴产业精选混合型证券投资基金	否	是	否
2	恒生前海消费升级混合型证券投资基金	否	是	否
3	恒生前海港股通高股息低波动指数证券投资基金	否	是	是
4	恒生前海中证质量成长低波动指数证券投资基金	否	是	是
5	恒生前海恒生沪深港通细分行业龙头指数证券投资基金	否	是	是
6	恒生前海恒锦裕利混合型证券投资基金	是	是	否
7	恒生前海恒扬纯债债券型证券投资基金	是	否	否
8	恒生前海短债债券型发起式证券投资基金	是	否	否
9	恒生前海恒颐五年定期开放债券型证券投资基金	是	否	否

二、基金合同和托管协议修订内容

1、根据《侧袋机制指引》修订基金合同

(1) “释义”章节增加相关表述：“侧袋机制：指将基金投资组合中的特定资产从原有账户分离至一个专门账户进行处置清算，目的在于有效隔离并化解风险，确保投资者得到公平对待，属于流动性风险管理工具。侧袋机制实施期间，原有账户称为主袋账户，专门账户称为侧袋账户”、“特定资产：包括：（一）无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性的资产；（二）按摊余成本计量且计提资产减值准备仍导致资产价值存在重大不确定性的资产；（三）其他资产价值存在重大不确定性的资产”

(2) “基金份额的申购与赎回”章节增加实施侧袋机制期间本基金的申购与赎回安排：“本基金实施侧袋机制的，本基金的申购和赎回安排详见招募说明书或相关公告。”

(3) “基金份额持有人大会”章节增加实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定：“若本基金实施侧袋机制，则相关基金份额或表决权的比例指主袋份额持有人和侧袋份额持有人分别持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例，但若相关基金份额持有人大会召集和审议事项不涉及侧袋账户的，则仅指主袋份额持有人持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例：1、基金份额持有人行使提议权、召集权、提名权所需单独或合计代表相关基金份额10%以上（含10%）；2、现场开会的到会者在权益登记日代表的基金份额不少于本基金在权益登记日相关基金份额的二分之一（含二分之一）；3、通讯开会的直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日相关基金份额的二分之一（含二分之一）；4、在参与基金份额持有人大会投票的基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日相关基金份额的二分之一、召集人在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内就原定审议事项重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）相关基金份额的持有人参与或授权他人参与基金份额持有人大会投票；5、现场开会由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的50%以上（含50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人；6、一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过；7、特别决议应当经参加大会的基金份额持有

人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过。同一主侧袋账户内的每份基金份额具有平等的表决权。”

（4）“基金的投资”章节增加侧袋机制的实施和投资运作安排：“当基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，根据最大限度保护基金份额持有人利益的原则，基金管理人经与基金托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制。侧袋机制实施期间，本部分约定的投资组合比例、投资策略、组合限制、业绩比较基准、风险收益特征等约定仅适用于主袋账户。侧袋账户的实施条件、实施程序、运作安排、投资安排、特定资产的处置变现和支付等对投资者权益有重大影响的事项详见招募说明书的规定。”

（5）“基金资产估值”章节将暂停估值情形中的“当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停估值”调整为“当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上的，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停估值”，并增加实施侧袋机制期间的基金资产估值表述：“本基金实施侧袋机制的，应根据本部分的约定对主袋账户资产进行估值并披露主袋账户的基金净值信息，暂停披露侧袋账户的基金份额净值。”

（6）“基金费用与税收”章节增加实施侧袋机制期间的基金费用表述：“本基金实施侧袋机制的，与侧袋账户有关的费用可以从侧袋账户中列支，但应待侧袋账户资产变现后方可列支，有关费用可酌情收取或减免，但不得收取管理费，详见招募说明书的规定。”

（7）“基金的收益与分配”章节增加实施侧袋机制期间的收益分配表述：“本基金实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配，详见招募说明书的规定。”

（8）“基金的信息披露”章节增加实施侧袋机制期间的信息披露表述：“本基金实施侧袋机制的，相关信息披露义务人应当根据法律法规、基金合同和招募说明书的规定进行信息披露，详见招募说明书的规定。”

2、根据《管理办法》修订基金合同

（1）“前言”增加了基金投资存托凭证的风险提示内容：“本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他仅投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临投资存托凭证的特殊风险，详见本基金招募说明书。”

(2)“投资范围”部分明确了“股票”包含存托凭证，以恒生前海沪港深新兴产业精选混合型证券投资基金为例，投资范围修改为“国内依法发行上市的股票(包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证)、港股通标的股票、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债、可分离交易可转债及其他经中国证监会允许投资的债券或票据)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单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相关规定)。”

(3)“投资策略”部分增加存托凭证投资策略，以恒生前海沪港深新兴产业精选混合型证券投资基金为例：“本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，结合对宏观经济状况、行业景气度、公司竞争优势、公司治理结构、估值水平等因素的分析判断，进行存托凭证的投资。”

(4)“投资限制”部分增加存托凭证投资限制：“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执行，与境内上市交易的股票合并计算”。

(5)“基金资产估值”章节的估值对象增加存托凭证，以恒生前海沪港深新兴产业精选混合型证券投资基金为例，由“基金所拥有的股票、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债”调整为“基金所拥有的股票、存托凭证、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债”，并增加了存托凭证的估值方法：“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”。

3、根据《指数基金指引》修订基金合同

(1)“前言”增加了指数基金的风险提示内容：“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、标的指数供应商停止服务、成份股停牌或违约等潜在风险，详见本基金招募说明书。”增加了订立基金合同的依据“《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》’)”。

(2)“释义”章节增加相关表述：“《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)“投资策略”部分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：

“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)、标的指数供应商退出等情形，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。

自标的指数供应商停止标的指数的编制及发布至解决方案确定期间，基金管理人应按照标的指数供应商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。”

4、托管协议涉及上述内容的条款已一并调整。

5、本次修订已履行规定程序，符合相关法律法规及各基金基金合同的规定。

三、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及托管协议全文将与本公告同日登载于基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站(<http://eid.csrc.gov.cn/fund>)。根据修改的基金合同及托管协议，基金管理人将更新各基金的招募说明书和基金产品资料概要相关内容，并揭示风险。

四、其他事项

1、投资者可通过以下途径咨询有关详情

客户服务电话：400-620-6608

网址：www.hsqhfund.com

2. 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，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。销售机构根据法规要求对投资者类别、风险承受能力和基金的风险等级进行划分，并提出适当性匹配意见。投资者在投资

基金前应认真阅读基金合同、招募说明书（更新）和基金产品资料概要（更新）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。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

特此公告。

恒生前海基金管理有限公司

2021年3月31日