

华夏基金管理有限公司

关于根据《公开募集证券投资基金侧袋机制指引（试行）》

修订旗下部分公募基金基金合同的公告

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信息披露管理办法》《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侧袋机制指引（试行）》等法律法规及各基金基金合同、招募说明书（更新）等规定，经与各基金托管人协商一致，并向中国证监会备案，华夏基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）决定对旗下51只公募基金的基金合同等法律文件进行修订，新增侧袋机制相关约定。本次修订将自2021年4月30日起正式生效。现将基金合同修订情况公告如下：

一、修订基金范围

基金代码	基金名称	基金代码	基金名称
001001	华夏债券投资基金	005862	华夏鼎禄三个月定期开放债券型发起式证券投资基金
288102	华夏稳定双利债券型证券投资基金	006191	华夏鼎通债券型证券投资基金
001011	华夏希望债券型证券投资基金	006668	华夏中短债债券型证券投资基金
001031	华夏安康信用优选债券型证券投资基金	006665	华夏鼎康债券型证券投资基金
000015	华夏纯债债券型证券投资基金	006776	华夏鼎略债券型证券投资基金
000047	华夏双债增强债券型证券投资基金	007576	华夏鼎琪三个月定期开放债券型发起式证券投资基金
000014	华夏聚利债券型证券投资基金	007282	华夏鼎淳债券型证券投资基金
002552	华夏恒利3个月定期开放债券型证券投资基金	007591	华夏恒益18个月定期开放债券型证券投资基金
001045	华夏可转债增强债券型证券投资基金	007666	华夏鼎泓债券型证券投资基金
003301	华夏鼎融债券型证券投资基金	008349	华夏恒泰64个月定期开放债券型证券投资基金
002459	华夏鼎利债券型发起式证券投资基金	004639	华夏恒慧一年定期开放债券型发起式证券投资基金
003826	华夏鼎汇债券型证券投资基金	009082	华夏鼎佳债券型证券投资基金
004052	华夏鼎智债券型证券投资基金	008266	华夏鼎明债券型证券投资基金
004061	华夏鼎隆债券型证券投资基金	008947	华夏鼎源债券型证券投资基金
004042	华夏鼎茂债券型证券投资基金	008857	华夏鼎航债券型证券投资基金
004063	华夏恒融一年定期开放债券型证券投资基金	009922	华夏鼎富债券型证券投资基金

004979	华夏鼎诺三个月定期开放债券型发起式证券投资基金	002877	华夏大中华信用精选债券型证券投资基金（QDII）
004921	华夏鼎瑞三个月定期开放债券型发起式证券投资基金	001061	华夏海外收益债券型证券投资基金
004923	华夏鼎祥三个月定期开放债券型发起式证券投资基金	000121	华夏永福混合型证券投资基金
004672	华夏短债债券型证券投资基金	005128	华夏永康添福混合型证券投资基金
004637	华夏鼎兴债券型证券投资基金	009445	华夏上海清算所 1-3 年高等级国企中期票据指数证券投资基金
005213	华夏鼎旺三个月定期开放债券型发起式证券投资基金	007186	华夏中债 3-5 年政策性金融债指数证券投资基金
005407	华夏鼎泰六个月定期开放债券型发起式证券投资基金	007165	华夏中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金
005886	华夏鼎沛债券型证券投资基金	005581	华夏上证 3-5 年期中高评级可质押信用债交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金
005364	华夏鼎顺三个月定期开放债券型发起式证券投资基金	001021	亚债中国债券指数基金
005791	华夏鼎福三个月定期开放债券型发起式证券投资基金		

二、基金合同的修订

（一）在“释义”部分新增“侧袋机制”、“特定资产”的释义如下：

“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。”

（二）在“基金份额的申购与赎回”章节增加实施侧袋机制期间基金申购与赎回相关内容如下：

“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。”

（三）在“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，具体内容如下（本部分不同基金的描述可能存在差异，具体

详见各基金基金合同，此处以华夏恒泰64个月定期开放债券型证券投资基金的修订为例)：

“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书面意见或授权他人代表出具书面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。

侧袋机制实施期间，基金份额持有人大会审议事项涉及主袋账户和侧袋账户的，应分别由主袋账户、侧袋账户的基金份额持有人进行表决，同一主侧袋账户内的每份基金份额具有平等的表决权。表决事项未涉及侧袋账户的，侧袋账户份额无表决权。

侧袋机制实施期间，关于基金份额持有人大会的相关规定以本节特殊约定内

容为准，本节没有规定的适用本部分相关约定。”

(四) 在“基金的投资”章节增加侧袋机制的实施和投资运作安排相关内容如下：

“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。”

(五) 对“基金资产估值”章节的修订

1、将“暂停估值的情形”中“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。”修订为“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。”（各基金具体描述详见基金合同）

2、增加实施侧袋机制期间基金资产估值相关内容如下：

“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，暂停披露侧袋账户份额净值。”

(六) 在“基金费用与税收”章节增加实施侧袋机制期间基金费用相关内容如下：

“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。”

(七) 在“基金的收益与分配”章节增加实施侧袋机制期间收益分配相关内容如下：

“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。”

(八) 在“基金的信息披露”章节增加实施侧袋机制期间信息披露相关内容

如下：

“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。”

二、基金招募说明书的修订

除与基金合同一致的修订内容外，本基金管理人还补充修订了如下内容：

（一）在“重要提示”中新增实施侧袋机制有关风险提示如下：

“当基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，基金管理人可能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，基金管理人将对基金简称进行特殊标识，暂停披露侧袋账户份额净值，不办理侧袋账户的申购赎回。侧袋账户对应特定资产的变现时间和最终变现价格都具有不确定性，并且有可能变现价格大幅低于启用侧袋机制时的特定资产的估值，基金份额持有人可能因此面临损失。投资者在投资本基金之前，请仔细阅读相关内容并关注本基金启用侧袋机制时的特定风险。”

（二）新增“侧袋机制”章节，普通开放式基金与定期开放式基金的具体描述，以及单一份额类别与多份额类别的具体描述存在一定差异，此处以华夏恒泰64个月定期开放债券型证券投资基金的修订为例（重要差别在括号中说明，具体详见各基金招募说明书更新）：

“（一）侧袋机制的实施条件和实施程序

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，无需召开基金份额持有人大会。

基金管理人应当在启用侧袋机制当日报中国证监会及公司所在地中国证监会派出机构备案。启用侧袋机制后及时聘请符合《证券法》规定的会计师事务所进行审计并披露专项审计意见。

（二）实施侧袋机制期间基金份额的申购与赎回

1、启用侧袋机制当日，基金登记机构以基金份额持有人的原有账户份额为基础，确认相应侧袋账户的基金份额持有人名册和份额。（如基金包含多类份额类别，则启用侧袋机制当日，基金登记机构以基金份额持有人的原有账户各类别份额为

基础，确认相应侧袋账户的基金份额持有人名册和份额）

2、对于启用侧袋机制当日收到的赎回申请，基金管理人仅办理主袋账户的赎回申请并支付赎回款项。在启用侧袋机制当日收到的申购申请，视为投资者对侧袋机制启用后的主袋账户提交的申购申请。

3、实施侧袋机制期间，不办理侧袋账户份额的申购、赎回、转换等相关业务；同时，基金管理人按照基金合同和招募说明书的约定的政策办理主袋账户份额的赎回，并根据主袋账户运作情况确定是否暂停申购。

4、实施侧袋机制期间，招募说明书中约定的封闭期和开放期安排仅适用主袋份额。（普通开放式基金无此描述）

5、申购赎回的具体事项安排见基金管理人届时的相关公告。

（三）实施侧袋机制期间的基金投资

侧袋机制实施期间，基金的各项投资运作指标和基金业绩指标应当以主袋账户资产为基准。

基金管理人原则上应当在侧袋机制启用后 20 个交易日内完成对主袋账户投资组合的调整，因资产流动性受限等中国证监会规定的情形除外。

（四）实施侧袋机制期间的基金估值

本基金实施侧袋机制的，基金管理人和基金托管人应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，暂停披露侧袋账户份额净值。

（五）实施侧袋机制期间基金的收益分配

本基金实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配。主袋账户份额满足基金合同分红条款的，可对主袋账户份额进行收益分配。

（六）实施侧袋机制期间的基金费用

实施侧袋机制期间，与处置侧袋账户资产相关的费用可从侧袋账户中列支，但应待侧袋账户资产变现后方可列支，且不得收取管理费。

（七）侧袋账户中特定资产的处置清算

特定资产恢复流动性后，基金管理人应当按照基金份额持有人利益最大化原则，采取将特定资产予以处置变现等方式，及时向侧袋账户份额持有人支付对应变现款项。侧袋账户变现款项的支付不受招募说明书约定的基金封闭期的限制。

（普通开放式基金无封闭期描述）

侧袋账户资产全部完成变现并终止侧袋机制后，基金管理人及时聘请符合《证券法》规定的会计师事务所进行审计并披露专项审计意见。

（八）侧袋机制的信息披露

1、临时公告

在启用侧袋机制、处置特定资产、终止侧袋机制以及发生其他可能对投资者利益产生重大影响的事项后基金管理人应及时发布临时公告。

2、基金净值信息

基金管理人应按照招募说明书“基金的信息披露”部分规定的基金净值信息披露方式和频率披露主袋账户份额的基金份额净值和基金份额累计净值。实施侧袋机制期间本基金暂停披露侧袋账户的基金份额净值和基金份额累计净值。

3、定期报告

侧袋机制实施期间，基金定期报告中的基金会计报表仅需针对主袋账户进行编制。侧袋账户相关信息在定期报告中单独进行披露。

（九）法律法规或监管机构、行业协会对侧袋机制另有规定的，从其规定。本招募说明书中关于侧袋机制的内容与届时有效的法律法规、相关规定不一致的，以届时的法律法规、相关规定为准，基金管理人经与基金托管人协商一致并履行适当程序后，在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，可直接对本部分内容进行修改、调整或补充，无需召开基金份额持有人大会审议。”

（三）在“风险揭示”章节新增实施侧袋机制对投资者的影响，具体内容如下：

“侧袋机制属于流动性风险管理工具，是将特定资产分离至专门的侧袋账户进行处置清算，并以处置变现后的款项向基金份额持有人进行支付，目的在于有效隔离并化解风险。但基金启用侧袋机制后，侧袋账户份额将停止披露基金份额净值，并不得办理申购、赎回、转换等业务，仅主袋账户份额正常开放赎回，因此启用侧袋机制时持有基金份额的持有人将在启用侧袋机制后同时持有主袋账户份额和侧袋账户份额，侧袋账户份额不能赎回，侧袋账户对应特定资产的变现时间和最终变现价格都具有不确定性，并且有可能变现价格大幅低于启用侧袋机制时的特定资产的估值，基金份额持有人可能因此面临损失。

对于启用侧袋机制当日收到的赎回申请，基金管理人仅办理主袋账户的赎回

申请并支付赎回款项，当日收到的申购申请，视为投资者对侧袋机制启用后的主袋账户提交的申购申请办理，可能与投资者的预期存在差异，从而影响投资者的投资和资金安排。

实施侧袋机制期间，因本基金不披露侧袋账户份额的净值，即便基金管理人在基金定期报告中披露报告期末特定资产可变现净值或净值区间的，也不作为特定资产最终变现价格的承诺，基金管理人不承担任何保证和承诺的责任。基金管理人将根据主袋账户运作情况合理确定申购政策，因此实施侧袋机制后主袋账户份额存在暂停申购的可能。

启用侧袋机制后，基金管理人计算各项投资运作指标和基金业绩指标时仅需考虑主袋账户资产，因此本基金披露的业绩指标不能反映特定资产的真实价值及变化情况。”

因上述修订导致的序号变化顺序调整。本次修订已履行了规定的程序，符合相关法律法规的规定，修订自2021年4月30日起生效。投资者可登录本基金管理人网站（www.ChinaAMC.com）查阅各基金修订后的基金合同、招募说明书（更新）、产品资料概要等法律文件，也可拨打本基金管理人客户服务电话（400-818-6666）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资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。投资者在投资基金之前，请仔细阅读基金的产品资料概要、招募说明书和基金合同，全面认识基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，在了解产品情况、听取销售机构适当性匹配意见的基础上，理性判断市场，谨慎做出投资决策。基金具体风险评级结果以销售机构提供的评级结果为准。

特此公告

华夏基金管理有限公司
二〇二一年四月二十八日