

**关于调整华夏基金-中证 500 指数增强智胜 1 号集合资产管理计划
资产管理合同条款的公告**

资产委托人、资产管理人和资产托管人已签署《华夏基金-中证 500 指数增强智胜 1 号集合资产管理计划资产管理合同》(下称“资产管理合同”),华夏基金-中证 500 指数增强智胜 1 号集合资产管理计划于 2024 年 1 月 5 日成立。根据中国证券投资基金业协会备案要求,针对投资资产类别划分、穿透计算比例以及自有资金参与等事项,现就合同条款调整情况公告如下:

一、将原合同“五、资产管理计划的基本情况”“(四)资产管理计划的投资目标、主要投资方向、投资比例和限制、产品风险等级”“2、主要投资方向”、“十一、资产管理计划的投资”“(二)投资范围及比例”“1.投资范围”、“十七、越权交易的界定”“(三)资产托管人对资产管理人投资运作的监督”“1、对投资范围的监督”项下内容调整为:

“本计划主要投资于法律法规和监管机构允许投资的以下资产:

(1) 国内依法发行上市的股票(包括二级市场交易、新股申购、定向增发等交易方式,包括主板、创业板、科创板、北交所上市及其他经中国证监会核准上市或同意注册的股票),以及港股通范围内的股票;股票型基金、混合型基金。

(2) 同业存单、银行存款(含协议存款及定期存款等)、国债、地方政府债、央行票据、政策性金融债、金融债、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、非公开定向债务融资工具、可转换债券(含分离交易可转换债券)、可交换债券等债券品种;债券型基金。

(3) 国债期货、股指期货。

(4) 现金、货币市场基金、债券正回购、逆回购等。

(5) 法律法规或监管机构允许投资的其他金融工具。”

二、将原合同“五、资产管理计划的基本情况”“(四)资产管理计划的投资目标、主要投资方向、投资比例和限制、产品风险等级”“3、投资比例和限制”第(1)条、“十一、资产管理计划的投资”“(二)投资范围及比例”“2.投资比例及限制”第(1)条、“十七、越权交易的界定”“(三)资产托管人对资产管理人投资运作的监督”“2、对投资比例和限制的监督”第(1)条项下内容调整为:

“(1) 本计划投资于权益类资产、固定收益类资产、期货和衍生品类资产中任一类资产的投资比例均低于本计划总资产的 80%。本计划投资于资产管理产品的,大类

资产配置比例应当按照穿透原则合并计算；本计划应当按照所投资资产管理产品披露投资组合的频率，及时更新计算本资产管理计划所投资资产的金额或比例。”

三、将原合同“八、资产管理计划的参与、退出与转让”中“(十二) 资产管理人及其子公司自有资金参与和退出”及其项下内容调整为：

“(十二) 证券期货经营机构及其子公司自有资金参与和退出

证券期货经营机构及其子公司以自有资金（下称“自有资金”）参与其自身或者其子公司管理的单个集合资产管理计划（下称“该集合资产管理计划”）的，证券期货经营机构及其子公司自有资金参与份额与资产委托人所持的份额享有同等权益、承担同等风险。

证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与该集合资产管理计划的份额合计不得超过资产管理计划总份额的 50%。因资产管理计划规模变动等客观因素导致前述比例被动超标的，应当依照法律法规及本合同的约定及时完成调整。

证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与、退出该集合资产管理计划的，应当提前 5 个工作日告知资产委托人和资产托管人，并取得其同意，且持有期限不得少于 6 个月，因资产管理计划规模变动等客观因素导致自有资金参与比例被动超标，自有资金根据法律法规要求退出的情形除外，但资产管理人事后应当通过公告等方式及时告知资产委托人和资产托管人。

证券期货经营机构及其子公司以自有资金在该集合资产管理计划开放期参与、退出本计划的，资产管理人通过公告、邮件或征询意见函等方式就自有资金参与、退出事宜向资产委托人、资产托管人征询意见。资产委托人、资产托管人应及时关注资产管理人网站公告、邮件或征询意见函发送情况。资产委托人、资产托管人在公告、邮件或征询意见函等规定期限内未回复意见的，视同资产委托人、资产托管人同意。证券期货经营机构及其子公司以自有资金在初始募集期参与该集合资产管理计划的，资产委托人、资产托管人签署本资产管理合同即视为同意该参与事项。

法律法规、监管机构及自律组织另有规定的，从其规定。”

特此公告。

