

华夏基金管理有限公司关于华夏沪深 300 指数证券投资基金 修订基金合同部分条款的公告

华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金已经中国证监会 2012 年 12 月 10 日证监许可[2012]1653 号文核准募集。根据《华夏沪深 300 指数证券投资基金基金合同》(以下简称“原基金合同”)“未来,如果基金管理人推出沪深 300ETF,在不改变本基金投资目标的前提下,本基金转为沪深 300ETF 的联接基金”的有关约定,经与基金托管人协商一致,华夏基金管理有限公司(以下简称“本公司”)决定自华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效之日起将华夏沪深 300 指数证券投资基金转为华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金,并将根据法律法规及基金合同的有关规定对原基金合同中基金名称、基金投资范围及投资策略、管理费与托管费、目标 ETF 估值、基金份额持有人行使目标 ETF 基金份额持有人大会表决权等内容进行修订和补充。现将有关修订内容公告如下:

一、对原基金合同全文的修订

将“华夏沪深 300 指数证券投资基金”修订为“华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金”,将《华夏沪深 300 指数证券投资基金基金合同》修订为《华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》。

二、对原基金合同“一、前言和释义”的修订

1、增加“目标 ETF”释义,释义内容为“另一获中国证监会核准的交易型开放式指数证券投资基金(简称 ETF),该 ETF 和本基金所跟踪的标的指数相同,并且,该 ETF 的投资目标和本基金的投资目标类似,本基金主要投资于该 ETF 以求达到投资目标。本基金以华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金为目标 ETF。”。

2、增加“ETF 联接基金”释义,释义内容为“是指将绝大多数基金财产投资于跟踪同一标的指数的目标 ETF,紧密跟踪标的指数表现,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化,采用开放式运作方式的基金,简称联接基金”。

3、在“本合同、《基金合同》”释义中增加“本基金合同的“三、基金份额的发售”、“四、基金备案”以及其他与基金募集、基金合同生效等相关的内容仅适用于原华夏沪深 300 指数证券投资基金,对变更后的华夏沪深 300 交易型开放

式指数证券投资基金联接基金不适用”描述。

三、对原基金合同“二、基金的基本情况”的修订

1、将“(五)标的指数”修订为“本基金的标的指数为目标ETF的标的指数，即沪深300指数。未来如果目标ETF的标的指数发生变更，本基金不变更目标ETF的，则本基金的标的指数将随之变更，不需另行召开持有人大会”。

2、在“二、基金的基本情况”最后增加“(九)本基金与目标ETF的联系与区别”，该部分内容为：

“本基金为华夏沪深300ETF的联接基金。本基金主要投资于华夏沪深300ETF以求达到投资目标，华夏沪深300ETF的标的指数和本基金的标的指数一致，投资目标相似。

在投资方法上，本基金为目标ETF的联接基金，主要通过投资于目标ETF来跟踪标的指数；本基金的目标ETF主要采用复制法来跟踪标的指数。

在交易方式上，本基金投资者目前只能通过场外销售机构以现金的方式申购、赎回；本基金的目标ETF属于交易型开放式指数证券投资基金，目标ETF的投资者可以在二级市场上买卖ETF，也可以根据申购赎回清单按照申购、赎回对价通过申购赎回代理机构申购、赎回ETF。

本基金与目标ETF业绩表现可能出现差异，可能引发差异的因素主要包括：

1、法律法规对投资比例的要求。本基金作为普通的开放式基金，需将不低于基金资产净值5%的资产投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券；目标ETF不受上述投资比例的限制。

2、申购赎回的影响。本基金申赎采取现金方式，大额申赎可能会对基金净值产生一定影响；目标ETF根据申购赎回清单按照申购、赎回对价办理申购、赎回业务，申购赎回对基金净值的影响较小”。

四、对原基金合同“五、基金份额的申购与赎回”的修订

1、在“(九)拒绝或暂停申购的情形及处理方式”中增加“4、本基金的目标ETF暂停估值”和“5、本基金的目标ETF暂停申购或二级市场交易停牌，且基金管理人认为有必要暂停本基金申购的”。

2、在“(十)暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式”中增加“4、本基金的目标ETF暂停估值”和“5、本基金的目标ETF暂停赎回或二级市场交

易停牌，且基金管理人认为有必要暂停本基金赎回的”。

五、对原基金合同“七、基金份额持有人大会”的修订

在“（八）生效与公告”段落后增加“（九）关于本基金所持目标 ETF 份额行使表决权的方式”，该部分内容为：

“鉴于本基金是目标 ETF 的联接基金，本基金的基金份额持有人可以凭所持有的本基金份额行使与目标 ETF 相关的持有人权利，如目标 ETF 持有人大会召集权、参加目标 ETF 持有人大会的表决权。计算参会份额和计票时，本基金基金份额持有人的参会份额数和票数按权益登记日本基金所持有的目标 ETF 的基金份额、该持有人所持有的本基金份额占本基金总份额的比例折算。本基金持有人，如经基金管理人确认其单独或合计持有的联接基金份额所对应的目标 ETF 份额不少于目标 ETF 总份额的 10% 的，可对目标 ETF 行使基金份额持有人大会的召集权。

如目标 ETF 召开基金份额持有人大会，本基金的基金份额持有人有权亲自出席/出具书面表决意见或以代理投票授权委托书委派代表出席/出具书面表决意见，并有权按照所持有的本基金基金份额对应的目标 ETF 份额参与投票表决。

本基金的基金管理人不应以本基金的名义代表本基金的全体基金份额持有人以目标 ETF 的基金份额持有人的身份行使表决权，但可接受本基金的基金份额持有人的委托以本基金的基金份额持有人代理人的身份出席目标 ETF 的基金份额持有人大会并参与表决”。

六、对原基金合同“十一、基金的投资”的修订

1、将“（二）投资范围”修订为：

“本基金主要投资于目标 ETF 基金份额、标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，基金还可投资于非成份股、债券、权证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。法律法规或监管机构允许基金投资其他品种的（如股票指数期货等金融产品），基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

正常情况下，本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%（已申购但尚未确认的目标 ETF 份额可计入在内）。基金持有现金以及到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%”。

2、将“(四) 投资策略”修订为：

“本基金主要通过交易所买卖或申购赎回的方式投资于目标 ETF 的份额。根据投资者申购、赎回的现金流情况，本基金将综合目标 ETF 的流动性、折溢价率、标的指数成份股流动性等因素分析，对投资组合进行监控和调整，密切跟踪标的指数。基金也可以通过买入标的指数成份股来跟踪标的指数。基金还可适度参与目标 ETF 基金份额交易和申购、赎回之间的套利，以增强基金收益。在目标 ETF 上市之前，本基金可以股票和现金特殊申购目标 ETF 基金份额。

如法律法规或中国证监会允许，本基金还将投资于期权、期货以及其他与标的指数或标的指数成份股相关的金融产品，投资目标是更紧密地跟踪标的指数。基金拟投资于新的金融产品的，需将有关投资方案通知基金托管人，并在报中国证监会备案后公告。

未来，随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等，基金还将积极寻求其他投资机会，履行适当程序后更新和丰富基金投资策略。

本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。”

3、将“(七) 投资限制”最后一段修订为“由于证券市场波动、上市公司合并、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、目标 ETF 暂停申购赎回、目标 ETF 未上市或二级市场交易停牌等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例不在限制之内，但基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，以达到标准。但法律法规、基金合同另有规定的从其规定”。

4、在“十一、基金的投资”最后增加“(十一)目标 ETF 发生相关变更情形的处理方式”，该部分内容为：

“目标 ETF 出现下述情形之一的，本基金可在履行适当程序后由投资于目标 ETF 的联接基金变更为直接投资该标的指数的指数基金；若届时本基金管理人已有以该指数作为标的指数的指数基金，则本基金将本着维护投资者合法权益的原则，履行适当的程序后可选取其他合适的指数作为标的指数。相应地，基金合同中删除关于目标 ETF 的表述部分，或将变更标的指数，届时将由基金管理人另行公告。

- 1、目标 ETF 交易方式发生重大变更致使本基金的投资策略难以实现；
- 2、目标 ETF 终止上市；
- 3、目标 ETF 基金合同终止；
- 4、目标 ETF 与其他基金进行合并；
- 5、目标 ETF 的基金管理人发生变更；
- 6、中国证监会规定的其他情形”。

七、对原基金合同“十三、基金资产估值”的修订

1、在“(五) 估值方法”中增加“1、目标 ETF 估值方法”，该部分内容为：“本基金投资的目标 ETF 按照估值日目标 ETF 的基金份额净值估值。如果基金管理人认为按上述基金份额净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协商后，按最能反映其公允价值的价格估值”。

2、在“(七) 暂停估值的情形”中增加“3、本基金所投资的目标 ETF 暂停估值或暂停公告基金份额净值的”描述。

八、对原基金合同“十四、基金费用与税收”的修订

1、将“(二) 基金费用计提方法、计提标准和支付方式 1、基金管理人的管理费”中管理费计提方法、计提标准修订为：

“本基金的管理费按前一日基金资产净值扣除基金资产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分的 0.5% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值扣除基金资产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分，若为负数，则 E 取 0”。

2、将“(二) 基金费用计提方法、计提标准和支付方式 2、基金托管人的托管费”中托管费计提方法、计提标准修订为：

“本基金的托管费按前一日基金资产净值扣除基金资产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分的 0.1% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值扣除基金资产中目标 ETF 份额所对应资产净值

后剩余部分，若为负数，则 E 取 0”。

此外，本次修订还涉及部分对基金份额持有人利益无实质性不利影响且已在招募说明书中更新的内容，现补充说明如下：

1、将原基金合同“六、基金合同当事人及权利义务”“(一)基金管理人 1、基金管理人简况”中“法定代表人”修订为“王东明”，将“注册资本”修订为“2.38 亿元”。

2、将原基金合同“五、基金份额的申购与赎回”“(十三)基金的转换”第 1 句修订为“投资者可以依照基金管理人的有关规定选择在本基金和基金管理人管理的其他基金之间进行基金转换”。

3、将原基金合同“五、基金份额的申购与赎回”“(十四)转托管”修订为“基金份额持有人可以办理其基金份额在不同交易账户间的转托管手续，基金销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。具体办理方法参照基金管理人及销售机构的业务规则”。

4、删除“(十七)基金的冻结与解冻”中“在国家有权机关作出决定之前，被冻结部分产生的权益先行一并冻结。被冻结部分份额仍然参与收益分配与支付”描述。

上述修订自华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效之日起生效。本公司根据修订的基金合同对《华夏沪深 300 指数证券投资基金托管协议》进行了相应修订，并将根据修订的基金合同对招募说明书等文件进行更新。为方便投资者，本公司将修订后的《华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》、《华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》在公司网站（www.ChinaAMC.com）披露，投资者可登录本公司网站进行查询。

特此公告

华夏基金管理有限公司
二〇一二年十二月二十一日