

华宝基金管理有限公司关于华宝中证医疗指数分级 证券投资基金修改基金合同的公告

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运作管理办法》的相关规定和《华宝中证医疗指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）、《华宝中证医疗指数分级证券投资基金招募说明书》（以下简称“招募说明书”）的相关约定，经与基金托管人中国银行股份有限公司（以下简称“基金托管人”）协商一致，并报中国证监会备案，华宝基金管理有限公司（以下简称“本公司”）决定自2020年7月6日起，修改基金合同等法律文件相关条款。现将具体事宜公告如下：

一、华宝医疗 A 份额和华宝医疗 B 份额的基金份额参考净值计算

招募说明书“重要提示”中明确“基金管理人并不承诺或保证华宝医疗 A 份额的基金份额持有人的本金及约定应得收益，如在基金存续期内本基金资产出现极端损失情况下，华宝医疗 A 份额的基金份额持有人可能面临无法取得约定应得收益甚至损失本金的风险”。

基金合同中关于“华宝医疗 A 份额与华宝医疗 B 份额的基金份额参考净值计算规则”约定了“本基金在优先确保华宝医疗 A 份额的本金及其约定应得收益后，将剩余基金净资产计为华宝医疗 B 份额的净资产”。

根据上述条款，分配给华宝医疗 B 份额的净资产最低为 0，且在基金存续期内本基金资产出现极端损失情况下，华宝医疗 A 份额的基金份额持有人可能面临无法取得约定应得收益甚至损失本金的风险。为更好地反映基金合同约定的本意，避免歧义，华宝医疗 A 份额和华宝医疗 B 份额的基金份额参考净值计算修改如下：

“2、华宝医疗 A 份额和华宝医疗 B 份额的基金份额参考净值计算

设 T 日为基金份额参考净值计算日，华宝医疗 A 份额与华宝医疗 B 份额的基金份额参考净值为：

$$NAV_A = \min\{2 \times NAV_{\text{医疗}}, 1 + R \times \frac{t}{N}\}$$

$$NAV_B = \max\{0, 2 \times NAV_{\text{医疗}} - NAV_A\}$$

其中，N 为当年实际天数； $t = \min\{\text{自基金合同生效日至 T 日之间的自然日，自最近一次基金份额折算基准日次日至 T 日之间的自然日}\}$ ； NAV_A 为 T 日华宝医疗 A 份额的基金份额参考净值； NAV_B 为 T 日华宝医疗 B 份额的基金份额参考净值；R 为华宝医疗 A 份额的约定年

基准收益率。”

二、重要提示

1、本基金基金合同的修订对本基金原有基金份额持有人的利益无实质性不利影响，根据基金合同的约定可由基金管理人和基金托管人协商后修改，无需召开基金份额持有人大会。本公司已就修订内容履行了规定的程序，符合相关法律法规及基金合同的规定。

2、本公司于公告当日在网站上同时公布经修改后的基金合同、托管协议及招募说明书。

3、本公告仅对本基金基金合同修改的有关事项予以说明。投资者欲了解本基金的详细情况，可登录本公司网站(www.fsfund.com)查阅本基金基金合同、招募说明书等法律文件，以及相关业务公告。

4、投资者可访问本公司网站(www.fsfund.com)或拨打公司客户服务电话(021-38924558、4007005588、4008205050)咨询相关情况。

特此公告。

华宝基金管理有限公司
2020年7月4日

附件：《华宝中证医疗指数分级证券投资基金基金合同》修改如下：

原基金合同涉及修改章节	原基金合同表述	修订后表述
第四部分基金份额的分级与净值计算规则	<p>2、华宝医疗 A 份额和华宝医疗 B 份额的基金份额参考净值计算</p> <p>设 T 日为基金份额参考净值计算日，华宝医疗 A 份额与华宝医疗 B 份额的基金份额参考净值为：</p> $NAV_A = 1 + R \times \frac{t}{N}$ $NAV_B = 2 \times NAV_{\text{医疗}} - NAV_A$ <p>其中，N 为当年实际天数；t=min{自基金合同生效日至 T 日之间的自然日，自最近</p>	<p>2、华宝医疗 A 份额和华宝医疗 B 份额的基金份额参考净值计算</p> <p>设 T 日为基金份额参考净值计算日，华宝医疗 A 份额与华宝医疗 B 份额的基金份额参考净值为：</p> $NAV_A = \min\{2 \times NAV_{\text{医疗}}, 1 + R \times \frac{t}{N}\}$ $NAV_B = \max\{0, 2 \times NAV_{\text{医疗}} - NAV_A\}$ <p>其中，N 为当年实际天数；t=min{自基金合同生效日至 T 日之间的自然日，自最近</p>

一次基金份额折算基准日次日至 T 日之间的自然日}; NAV_A 为 T 日华宝医疗 A 份额的基金份额参考净值; NAV_B 为 T 日华宝医疗 B 份额的基金份额参考净值; R 为华宝医疗 A 份额的约定年基准收益率。

一次基金份额折算基准日次日至 T 日之间的自然日}; NAV_A 为 T 日华宝医疗 A 份额的基金份额参考净值; NAV_B 为 T 日华宝医疗 B 份额的基金份额参考净值; R 为华宝医疗 A 份额的约定年基准收益率。