

财通基金管理有限公司关于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法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《存托凭证发行与交易管理办法（试行）》等法律法规及基金合同、招募说明书及其更新等规定，经与各基金托管人协商一致，财通基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）对旗下 21 只拟参与存托凭证投资的公募基金修订基金合同等法律文件，包括增加投资存托凭证的风险揭示、明确投资范围包含存托凭证、增加存托凭证的投资策略、投资比例限制、估值方法等，并在基金招募说明书（更新）、基金产品资料概要中增加投资存托凭证的风险揭示。根据法律法规的规定及基金合同的约定，本次修订对现有基金份额持有人利益无实质不利影响，可由基金管理人与各基金托管人协商一致作出，不需召开基金份额持有人大会。修订将自 2020 年 12 月 17 日起正式生效。现将主要修订情况公告如下：

一、修订基金范围

序号 代码 基金全称

- 1 720001 财通价值动量混合型证券投资基金
- 2 000042 中证财通中国可持续发展 100(ECPIESG)指数增强型证券投资基金
- 3 000017 财通可持续发展主题混合型证券投资基金
- 4 001480 财通成长优选混合型证券投资基金
- 5 501001 财通多策略精选混合型证券投资基金(LOF)
- 6 501015 财通多策略升级混合型证券投资基金(LOF)
- 7 501026 财通多策略福享混合型证券投资基金(LOF)
- 8 501028 财通多策略福瑞混合型发起式证券投资基金(LOF)
- 9 501046 财通多策略福鑫定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金
- 10 501055 财通多策略福佑定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金
- 11 006502 财通集成电路产业股票型证券投资基金
- 12 005850 财通量化价值优选灵活配置混合型证券投资基金
- 13 501085 财通科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金
- 14 009062 财通智慧成长混合型证券投资基金
- 15 008983 财通科技创新混合型证券投资基金
- 16 009970 财通内需增长 12 个月定期开放混合型证券投资基金
- 17 501032 财通福盛多策略混合型发起式证券投资基金(LOF)
- 18 005851 财通新视野灵活配置混合型证券投资基金
- 19 006157 财通量化核心优选混合型证券投资基金
- 20 006522 财通新兴蓝筹混合型证券投资基金
- 21 006967 财通行业龙头精选混合型证券投资基金

二、基金合同及招募说明书（更新）的修订

（一）在基金合同“前言”部分增加投资存托凭证的风险揭示

“本基金的投资范围包括存托凭证，面临存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险、与存托凭证发行机制相关的风险等。”

（二）对“基金的投资”部分的修订

1、明确“投资范围”中包含存托凭证。以财通智慧成长混合型证券投资基金为例，将“投资范围”修订为：

“本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板

及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、内地与香港股票市场交易互联互通机制试点允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、债券（含国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、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、政府支持债券、地方政府债、可转换债券（含分离交易的可转债）、可交换债券及其他中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人将在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：本基金股票（含存托凭证）投资占基金资产的比例为 60%-95%（其中投资于港股通标的股票的比例不得超过股票资产的 50%），投资于智慧成长主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的 80%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。”

2、在“投资策略”部分增加存托凭证投资策略描述如下：

“存托凭证投资策略

本基金将根据投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。”

3、在“投资限制”中增加存托凭证投资限制描述，以财通智慧成长混合型证券投资基金为例，将“投资限制”相应调整如下：

“基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）本基金股票（含存托凭证）投资占基金资产的比例为 60%-95%（其中投资于港股通标的股票的比例不得超过股票资产的 50%），投资于智慧成长主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的 80%；

.....

（17）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；

.....”

（三）在“基金资产估值”部分的“估值方法”中增加存托凭证估值方法描述

“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。”

（四）在基金招募说明书（更新）的“重要提示”和“风险揭示”部分增加投资存托凭证的风险揭示

1、在“重要提示”部分增加投资存托凭证的风险揭示描述如下：

“本基金的投资范围包括存托凭证，面临存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险、与存托凭证发行机制相关的风险等。”

2、在“风险揭示”部分增加投资存托凭证的风险揭示描述如下：

“投资存托凭证的风险

（1）存托凭证市场价格大幅波动的风险

存托凭证的交易框架中涉及发行人、存托人、托管人等多个法律主体，其交易结构及原理与股票相比更为复杂。存托凭证属于市场创新产品，中国境内资本市场尚无先例，其未来的交易活跃程度、价格决定机制、投资者关注度等均存在较大的不确定性。因此，存托凭证的交易价格可能存在大幅波动的风险。

（2）存托凭证持有人与境外基础证券持有人的权益存在差异可能引发的风险

存托凭证由存托人签发、以境外证券为基础在中国境内发行，代表境外基础证券权益。存托凭证持有人实际享有的权益与境外基础证券持有人的权益虽然基本相当，但不能等同于直接持有境外基础证券。

（3）存托凭证存续期间的风险

存托凭证存续期间，存托凭证项目内容可能发生重大、实质变化，包括但不限于存托凭证与基础证券转换比例发生调整、红筹公司和存托人可能对存托协议作出修改、更换存托人、更换托管人、存托凭证主动退市等。部分变化可能仅以事先通知的方式，即对其投资者生效。存托凭证的投资者可能无法对此行使表决

权。

存托凭证存续期间，对应的基础证券等财产可能出现被质押、挪用、司法冻结、强制执行等情形，存托凭证的投资者可能失去应有权利的风险。

（4）退市风险

存托凭证退市的，可能面临存托人无法根据存托协议的约定卖出基础证券，存托凭证无法转到境内其他市场进行公开交易或者转让，存托人无法继续按照存托协议的约定为投资者提供相应服务的风险。

（5）其他风险

存托凭证还存在其他风险，包括但不限于存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等方面的特殊安排可能引发的风险；因多地上市造成存托凭证价格差异以及波动的风险；存托凭证持有人权益被摊薄的风险；已在境外上市的基础证券发行人，在持续信息披露监管方面与境内可能存在差异的风险；境内外法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险等。”

三、托管协议的修订

各基金托管协议中涉及上述相关内容的条款也均进行了相关修订。

因上述修订导致的序号变化顺序调整。

本次修订系根据《存托凭证发行与交易管理办法（试行）》而做出，对基金份额持有人利益无实质性不利影响，并已履行了规定的程序，符合相关法律法规的规定和各基金基金合同的约定。投资者可登录基金管理人网站（www.ctfund.com）查阅各基金修订后的基金合同、托管协议、招募说明书（更新）及基金产品资料概要等法律文件。

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。

财通基金管理有限公司

二〇二〇年十二月十七日