

## 华夏基金管理有限公司

### 关于根据《公开募集证券投资基金运作指引第3号-指数基金指引》

### 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运作指引第3号-指数基金指引》等法律法规及各基金基金合同、招募说明书及其更新等规定，经与各基金托管人协商一致，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67只公募指数证券投资基金的基金合同、招募说明书等法律文件进行修订。本次修订将自2021年3月31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

基金代码	基金名称	基金代码	基金名称
513330	华夏恒生互联网科技业交易型开放式指数证券投资基金（QDII）	006246	华夏中小企业板交易型开放式指数基金发起式联接基金
008916	华夏中证浙江国资创新发展交易型开放式指数证券投资基金联接基金	006248	华夏创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金
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	512770	战略新兴成指交易型开放式指数证券投资基金
588000	华夏上证科创板50成份交易型开放式指数证券投资基金	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
515760	华夏中证浙江国资创新发展交易型开放式指数证券投资基金	511280	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
008585	华夏中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	159957	华夏创业板交易型开放式指数证券投资基金
008887	华夏国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	501050	华夏沪港通上证50AH优选指数证券投资基金（LOF）
008199	华夏粤港澳大湾区创新100交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	001052	华夏中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金
007992	华夏中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	512500	华夏中证500交易型开放式指数证券投资基金
007994	华夏中证500指数增强型证券投资基金	001051	华夏上证50交易型开放式指数证券投资基金联接基金
159983	华夏粤港澳大湾区创新100交易型开	000975	华夏MSCI中国A股国际通交易型开放式指数

	放式指数证券投资基金		证券投资基金联接基金
515030	华夏中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金	512990	华夏MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金
159995	华夏国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金	001015	华夏沪深300指数增强型证券投资基金
008086	华夏中证5G通信主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	513300	华夏纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金(QDII)
515070	华夏中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金	000948	华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金
008298	华夏中证银行交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	513660	华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金
008088	华夏中证全指房地产交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	510630	上证主要消费交易型开放式指数发起式证券投资基金
515060	华夏中证全指房地产交易型开放式指数证券投资基金	510650	上证金融地产交易型开放式指数发起式证券投资基金
515020	华夏中证银行交易型开放式指数证券投资基金	510660	上证医药卫生交易型开放式指数发起式证券投资基金
515010	华夏中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金	510330	华夏沪深300交易型开放式指数证券投资基金
515050	华夏中证5G通信主题交易型开放式指数证券投资基金	000071	恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金
007505	华夏中证AH经济蓝筹股票指数发起式证券投资基金	159920	恒生交易型开放式指数证券投资基金
007186	华夏中债3-5年政策性金融债指数证券投资基金	001021	亚债中国债券指数基金
007472	华夏创业板低波蓝筹交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	000051	华夏沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金
007474	华夏创业板动量成长交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	159902	中小企业板交易型开放式指数基金
159967	华夏创业板动量成长交易型开放式指数证券投资基金	510050	上证50交易型开放式指数证券投资基金
159966	华夏创业板低波蓝筹交易型开放式指数证券投资基金	159850	华夏恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金(QDII)
513520	华夏野村日经225交易型开放式指数证券投资基金(QDII)	516000	华夏中证大数据产业交易型开放式指数证券投资基金
006909	战略新兴成指交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	159869	华夏中证动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金
007165	华夏中债1-3年政策性金融债指数证券投资基金	516500	华夏中证生物科技主题交易型开放式指数证券投资基金
159962	华夏中证四川国企改革交易型开放式指数证券投资基金	159845	华夏中证1000交易型开放式指数证券投资基金
006560	华夏中证四川国企改革交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	011612	华夏上证科创板50成份交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金

006196	华夏中证央企结构调整交易型开放式指数证券投资基金联接基金	516850	华夏中证新能源交易型开放式指数证券投资基金
512950	华夏中证央企结构调整交易型开放式指数证券投资基金		

## 二、对基金合同和招募说明书的修订

(一) 在基金合同“前言”章节中增加有关风险提示内容如下：

**“本基金可能出现跟踪误差控制未达约定目标、指数编制机构停止服务、成份券停牌或违约等风险，具体见本基金招募说明书。”**

(二) 对基金合同“基金的基本情况”和/或“基金的投资”章节中有关标的指数发生特定情形时的处置安排进行修订，各基金基金合同中该部分内容列示章节可能存在差异，具体修订详见各基金基金合同。有关标的指数发生特定情形时的处置安排修订如下：

**“未来若出现标的指数不符合法律法规及监管的要求（因成份股价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外）、指数编制机构退出等情形，基金管理人应当自该情形发生之日起十个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如更换基金标的指数、转换运作方式、与其他基金合并、或者终止基金合同等，并在 6 个月内召集基金份额持有人大会进行表决。**

**在指数停止编制发布至解决方案确定期间，基金管理人应按照最近一个交易日的指数信息维持基金投资运作。**

**法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。”**

(三) 对于采取抽样复制策略进行投资的指数证券投资基金，在基金合同“基金的投资”章节中增加有关投资比例限制如下：

**“本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；但本基金跟踪标的指数的指数化投资部分不计入本项限制；**

**本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；但本基金跟踪标的指数的指数化投资部分不计入本项限制。”**

(四) 基金管理人已根据基金合同修订内容相应修改了各基金招募说明书或其更新，并在招募说明书或其更新中新增了如下内容：

1、在“基金的投资”章节中**新增列明了有关指数信息的查询途径**，并在招募说明书全文后**新增标的指数编制方案的附件**。具体详见各基金招募说明书（更

新)。

2、在“风险揭示”中**新增基金跟踪误差控制未达约定目标、指数编制机构停止服务、成份券停牌或违约的风险揭示内容**，各基金具体修订详见其招募说明书（更新）。此处以华夏中证生物科技主题交易型开放式指数证券投资基金修订为例：

### “3、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险

以下因素可能使基金投资组合的收益率与标的指数的收益率发生偏离，**也可能使基金的跟踪误差控制未达约定目标：**

（1）由于标的指数调整成份股或变更编制方法，使基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度与跟踪误差。

（2）由于标的指数成份股发生配股、增发等行为导致成份股在标的指数中的权重发生变化，使基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度和跟踪误差。

（3）成份股派发现金红利、新股市值配售收益将导致基金收益率超过标的指数收益率，产生正的跟踪偏离度。

（4）由于成份股停牌、摘牌或流动性差等原因使基金无法及时调整投资组合或承担冲击成本而产生跟踪偏离度和跟踪误差。

（5）由于基金投资过程中的证券交易成本，以及基金管理费和托管费的存在，使基金投资组合与标的指数产生跟踪偏离度与跟踪误差。

（6）在基金指数化投资过程中，基金管理人的管理能力，例如跟踪指数的水平、技术手段、买入卖出的时机选择等，都会对基金的收益产生影响，从而影响基金对标的指数的跟踪程度。

（7）其他因素产生的偏离。如因受到最低买入股数的限制，基金投资组合中个别股票的持有比例与标的指数中该股票的权重可能不完全相同；因缺乏卖空、对冲机制及其他工具造成的指数跟踪成本较大；因基金申购与赎回带来的现金变动；因指数发布机构指数编制错误等，由此产生跟踪偏离度与跟踪误差。

### 4、指数编制机构停止服务的风险

本基金的标的指数编制机构可能停止该指数的服务，从而会对基金投资运作造成不利影响。此外，根据基金合同的约定，出现指数发布机构变更或停止指数发布等情形，基金可能变更标的指数等，从而可能面临标的指数变更等的风险。

……

## 6、成份券停牌或违约的风险

本基金的标的指数成份券可能出现停牌或违约，从而使基金的部分资产无法变现或出现大幅折价，存在对基金净值产生冲击的风险。此外，根据相关规定，本基金运作过程中，当指数成份券发生明显负面事件面临退市或违约风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人将按照持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后可对相关成份券进行调整，从而可能产生跟踪偏离、跟踪误差控制未达约定目标的风险。”

基金管理人可在不涉及基金合同当事人权利义务关系变化或对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，根据现时有效的法律法规对基金合同、招募说明书等进行其他修订或必要补充。本次修订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，符合相关法律法规及各基金基金合同的规定。本次修订自2021年3月31日起生效，投资者可登录基金管理人网站（[www.ChinaAMC.com](http://www.ChinaAMC.com)）查阅各基金修订后的基金合同、招募说明书（更新）及产品资料概要等。投资者可登录本基金管理人网站（[www.ChinaAMC.com](http://www.ChinaAMC.com)）或拨打本基金管理人客户服务电话（400-818-6666）了解、咨询相关信息。

### 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  
二〇二一年三月二十九日