

## 招商基金管理有限公司

### 关于修订招商中证白酒指数证券投资基金基金合同的公告

为更好地满足投资者需求，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参与转融通证券出借业务指引（试行）》的规定和招商中证白酒指数证券投资基金基金合同的约定，经与基金托管人协商一致，并向中国证监会备案，招商基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）决定对旗下招商中证白酒指数证券投资基金（以下简称“本基金”）基金合同进行修订，具体包括：在释义、投资范围、投资策略、投资限制、估值方法及信息披露等章节中调整或增加了转融通证券出借业务相关内容，具体修订情况详见附件。基金管理人对本基金托管协议涉及的上述相关内容进行了相应修订。根据相关法律法规及基金合同，本次修改无需召开基金份额持有人大会。

本基金基金合同和托管协议的修订自公告之日起生效，投资者可访问本公司网站（[www.cmfcchina.com](http://www.cmfcchina.com)）查阅修订后的基金合同、托管协议。基金招募说明书、基金产品资料概要将根据基金合同、托管协议的内容进行相应修改，并按规定更新。

#### 风险提示：

1、本基金可参与转融通证券出借业务，面临的风险包括但不限于：（1）流动性风险：面临大额赎回时，可能因证券出借原因发生无法及时变现支付赎回款项的风险；（2）信用风险：证券出借对手方可能无法及时归还证券、无法支付相应权益补偿及借券费用的风险；（3）市场风险：证券出借后可能面临出借期间无法及时处置证券的市场风险。

2、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，基金管理人并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。投资有风险，敬请投资者在投资基金前认真阅读基金合同、招募说明书和基金产品资料概要等基金法律文件，全面认识基金产品的风险收益特征，在了解产品情况及听取销售机构适当性意见的基础上，根据自身的风险承受能力、投资期限和投资目标，对基金投资作出独立决策，选择合适的基金产品。敬请投资者在购买基金前认真考虑、谨慎决策。

特此公告。

附件：《招商中证白酒指数证券投资基金基金合同修订前后文对照表》

招商基金管理有限公司

2021年2月9日

附件：

招商中证白酒指数证券投资基金基金合同修订前后文对照表

章节	原文条款	修改后条款
第二部分 释义	无	62、转融通证券出借业务：指本基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司出借证券，中国证券金融股份有限公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务
第十四部分 基金的投资 二、投资范围	…… 无	…… 本基金将根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。
第十四部分 基金的投资 四、投资策略	…… 无	…… 本基金将在充分考虑风险和收益特征的基础上，审慎参与融资及转融通证券出借业务。本基金将基于对市场行情和组合风险收益的分析，确定投资时机、标的证券以及投资比例。若相关融资及转融通证券出借业务法律法规发生变化，本基金将从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。
第十四部分 基金的投资 六、投资限制	15、本基金不得违反基金合同关于投资范围和投资比例的约定； 16、法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他比例	15、本基金参与转融通证券出借业务，出借证券资产不得超过基金资产净值的 30%，出借期限在 10 个交易日以上的出借证券应纳入《流动性规定》所述流动性受限证券的范围；参与出借

<p>(二) 投资组合限制</p>	<p>限制。 除上述第 5、12、13、14 项外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。</p>	<p>业务的单只证券不得超过本基金持有该证券总量的 50%；最近 6 个月内日均基金资产净值不得低于 2 亿元；证券出借的平均剩余期限不得超过 30 天，平均剩余期限按照市值加权平均计算；因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合本条上述规定的，基金管理人不得新增出借业务；</p> <p>16、基金参与融资业务后，在任何交易日日终，持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；</p> <p>17、本基金不得违反基金合同关于投资范围和投资比例的约定；</p> <p>18、法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他比例限制。</p> <p>除上述第 5、12、13、14、15 项外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。</p>
<p>第十四部分 基金的投资</p>	<p>十、基金的融资融券、转融通业务 本基金可以根据届时有效的</p>	<p>删除</p>

十、基金的融资融券、转融通业务	有关法律法规和规定的规定进行融资融券、转融通业务。	
第十六部分 基金资产估值 三、估值方法	8、如有确凿证据表明按上述方法进行估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商定后，按最能反映公允价值的价格估值。 9、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。	8、本基金参与转融通证券出借业务，按照相关法律法规和行业协会的相关规定进行估值。 9、如有确凿证据表明按上述方法进行估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商定后，按最能反映公允价值的价格估值。 10、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。
第十六部分 基金资产估值 八、特殊情况的处理	1、基金管理人或基金托管人按“估值方法”的第8项进行估值时，所造成的误差不得作为基金资产估值错误处理。	1、基金管理人或基金托管人按“估值方法”的第9项进行估值时，所造成的误差不得作为基金资产估值错误处理。
第二十部分 基金的信息披露 五、公开披露的基金信息	(十) 中国证监会规定的其他信息。	(十) 参与融资和转融通证券出借业务的信息披露 本基金参与融资和转融通证券出借业务的，基金管理人应当在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露参与融资和转融通证券出借业务情况，包括投资策略、业务开展情况、损益情

		<p>况、风险及其管理情况等，并就转融通证券出借业务在报告期内发生的重大关联交易事项做详细说明。</p> <p>(十一) 中国证监会规定的其他信息。</p>
--	--	--