

# 中融基金管理有限公司关于旗下部分公募基金 增加侧袋机制并根据《公开募集证券投资基金运作指 引第3号——指数基金指引》修订基金合同部分条款 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》、《公开募集证券投资基金侧袋机制指引（试行）》及《公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引》等法律法规及相关公募基金基金合同的规定，经与基金托管人协商一致，并报中国证券监督管理委员会备案，中融基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”或“本公司”）决定对旗下部分公募基金的基金合同进行修订。现将相关事项公告如下：

## 一、本次修订涉及基金

本次修订涉及基金管理人旗下 10 只公募基金，详情如下表：

序号	基金代码	基金全称	修订内容	修订文件
1	003081	中融上海清算所银行间1-3年中高等级信用债指数发起式证券投资基金	1、增加侧袋机制 2、根据《公开募集证券投资基金运作指引第3号	基金合同 托管协议 招募说明书 基金产品资料概要
2	003083	中融上海清算所银行间1-3年高等级信用债指数发起式证券投资基金		
3	009529	中融中债1-5年国开行债券指数证券投资基金		
4	168203	中融国证钢铁行业指数型证券投资基金		
5	168204	中融中证煤炭指数型证券投资		

		资基金	——指数基金指引》进行的修订	
6	168205	中融中证银行指数证券投资基金（LOF）		
7	006743	中融央视财经 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金		
8	007885	中融中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金		
9	159965	中融央视财经 50 交易型开放式指数证券投资基金		
10	515550	中融中证 500 交易型开放式指数证券投资基金	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》进行的修订	基金合同 招募说明书 基金产品资料概要

## 二、本次修订涉及的主要内容

### （一）增加侧袋机制

相关公募基金基金合同的主要修订包括如下内容：

- （1）释义部分增加“侧袋机制”、“特定资产”的释义内容；
- （2）基金份额的申购与赎回部分增加“实施侧袋机制期间本基金的申购与赎回”的相关内容；
- （3）基金份额持有人大会部分增加“实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定”的相关内容；
- （4）基金的投资部分增加“侧袋机制的实施和投资运作安排”的相关内容；
- （5）基金资产估值部分修改暂停估值的情形，并增加“实施侧袋机制期间的基金资产估值”的相关内容；
- （6）基金费用与税收部分增加“实施侧袋机制期间的基金费用”的相关内容；

(7) 基金的收益与分配部分增加“实施侧袋机制期间的收益分配”的相关内容；

(8) 基金的信息披露部分增加“实施侧袋机制期间的信息披露”的相关内容。

相关产品托管协议、招募说明书（更新）及基金产品资料概要（更新）涉及的上述相关内容也已进行相应修改，并在招募说明书（更新）及基金产品资料概要（更新）中增加启动侧袋机制的风险揭示内容。

## **（二）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》进行的修订**

相关公募基金基金合同修订的主要内容包括：

### **1、补充法律依据**

在基金合同“前言”部分“订立本基金合同的目的、依据和原则”中增加：“《公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引》（以下简称‘《指数基金指引》’）”。

### **2、补充风险提示**

(1) 对于股票指数基金，在基金合同“前言”部分增加“本基金为指数基金，投资者投资于本基金面临跟踪误差控制未达约定目标、指数编制机构停止服务、成份股停牌或退市等潜在风险，详见本基金招募说明书”。

(2) 对于债券指数基金，在基金合同“前言”部分增加“本基金为指数基金，投资者投资于本基金面临跟踪误差控制未达约

定目标、指数编制机构停止服务、成份券违约等潜在风险，详见本基金招募说明书”。

3、在“释义”部分增加“《指数基金指引》：指中国证监会2021年1月18日颁布、同年2月1日实施的《公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引》及颁布机关对其不时做出的修订”

#### 4、修改标的指数变更程序

(1) 对于股票指数基金，在“基金的投资”部分增加“未来若出现标的指数不符合要求（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或法律法规、监管机构另有规定的情形除外）、指数编制机构退出等情形，基金管理人应当自相关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，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的，本基金合同自动终止。

自指数编制机构停止标的指数的编制及发布至解决方案确定并实施前，基金管理人应按照指数编制机构提供的最近一个交易日的指数信息遵循基金份额持有人利益优先原则维持基金投资运作。

尽管有前述约定，若标的指数变更对基金投资无实质性不利影响（包括但不限于编制机构变更、指数更名等）且在不损害基

金份额持有人利益的前提下，基金管理人可在取得基金托管人同意后变更标的指数，业绩比较基准也将相应变更，而无需召开基金份额持有人大会审议，报中国证监会备案并及时公告”。

(2) 对于债券指数基金，在“基金的投资”部分增加“未来若出现标的指数不符合要求（因成份券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或法律法规、监管机构另有规定的情形除外）、指数编制机构退出等情形，基金管理人应当自相关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，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的，本基金合同自动终止。

自指数编制机构停止标的指数的编制及发布至解决方案确定并实施前，基金管理人应按照指数编制机构提供的最近一个交易日的指数信息遵循基金份额持有人利益优先原则维持基金投资运作。

尽管有前述约定，若标的指数变更对基金投资无实质性不利影响（包括但不限于编制机构变更、指数更名等）且在不损害基金份额持有人利益的前提下，基金管理人可在取得基金托管人同意后变更标的指数，业绩比较基准也将相应变更，而无需召开基金份额持有人大会审议，报中国证监会备案并及时公告”。

(3) 同时删除基金合同中原有的标的指数变更条款：以“中

融上海清算所银行间 1-3 年高等级信用债指数发起式证券投资基金”的基金合同修改为例，在“基金的投资”部分删除“如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是指数编制单位变更或停止标的指数的编制、发布或授权，或市场上出现更加适合用于本基金的业绩比较基准的指数时，本基金可以在与基金托管人协商同意后变更标的指数、业绩比较基准并及时公告。若变更标的指数、业绩比较基准涉及本基金投资范围或投资策略等实质性变更，则基金管理人应就变更标的指数、业绩比较基准召开基金份额持有人大会，并报中国证监会备案且在指定媒介公告。若变更标的指数、业绩比较基准对基金投资范围和投资策略等无实质性影响（包括但不限于指数编制单位变更、指数更名等事项），本基金可以在与本基金托管人协商同意后变更标的指数、业绩比较基准并及时公告，而无需基金份额持有人大会审议。”

此条款仅以“中融上海清算所银行间 1-3 年高等级信用债指数发起式证券投资基金”的基金合同修改示例，其他各基金基金合同中相应条款表述及修订位置可能存在差异，具体请以相关公募基金披露的修订后的基金合同内容为准。

## 5、增加基金合同终止事由

(1) 对于股票指数基金，在“基金合同的变更、终止与基金财产的清算”部分“基金合同的终止事由”中增加：“出现标的指数不符合要求（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或法律法规、监管机构另有规定的情形除外)、指数编制机构退出等情形,基金管理人召集基金份额持有人大会对解决方案进行表决,基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的”。

(2) 对于债券指数基金,在“基金合同的变更、终止与基金财产的清算”部分“基金合同的终止事由”中增加“出现标的指数不符合要求(因成份券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或法律法规、监管机构另有规定的情形除外)、指数编制机构退出等情形,基金管理人召集基金份额持有人大会对解决方案进行表决,基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的”。

相关公募基金招募说明书涉及上述内容的一并更新,并在更新的招募说明书中列明有关指数的编制方法以及可供投资者免费查询指数信息的途径,同时更新了相关风险揭示条款。

### **三、重要提示**

1、本次上述公募基金基金合同的修订系因相应的法律法规发生变动而进行的,且基金管理人已履行了规定的程序,符合法律法规及基金合同的规定。

2、本次上述公募基金修订后的基金合同自 2021 年 3 月 30 日起生效,相关公募基金托管协议、招募说明书(更新)及基金产品资料概要(更新)中的相关内容已同步修改。

3、本次修订后的基金合同、托管协议和招募说明书(更新)

及产品资料概要（更新）于 2021 年 3 月 30 日在本公司网站（[www.zrfunds.com.cn](http://www.zrfunds.com.cn)）和中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）披露，供投资者查阅。如有疑问可拨打本公司客服电话（400-160-6000，010-56517299）咨询。

#### 四、风险提示

本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，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。请充分了解本基金的风险收益特征，审慎做出投资决定。

中融基金管理有限公司

2021 年 3 月 30 日