

华宝基金管理有限公司关于 华宝中证军工交易型开放式指数证券投资基金 修改基金合同等法律文件的公告

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》、《基金参与融资融券及转融通证券出借业务指引》、《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)》等法律法规的规定和《华宝中证军工交易型开放式指数证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)的相关约定,经与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致,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2022年9月22日起,对华宝中证军工交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)的基金合同等法律文件进行修改,增加参与转融通证券出借业务和融资业务的相关条款。现将具体事宜公告如下:

一、修改内容要点

在释义、基金合同当事人及权利义务、基金的投资、基金资产估值及基金的信息披露等章节中调整或增加了本基金可根据法律法规的规定参与转融通证券出借业务和融资业务的相关条款。

二、基金合同修订对照表

章节	原表述	修订后表述
第二部分 释义		新增: 72、转融通证券出借业务:指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
第九部分 基金合同当事人及权利义务	一、基金管理人 (一) 基金管理人简况 法定代表人: XIAOYI HELEN HUANG(黄小薏) (二) 基金管理人的权利与义务 1、根据《基金法》、《运作办法》	一、基金管理人 (一) 基金管理人简况 法定代表人: 黄孔威 (二) 基金管理人的权利与义务 1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基

	<p>及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：</p> <p>(13)在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资、融券；</p>	<p>基金管理人的权利包括但不限于：</p> <p>(13) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资、融券及转融通证券出借业务；</p>
<p>第十四部分 基金的投资</p>	<p>二、投资范围</p> <p>.....</p> <p>三、投资策略</p> <p>.....</p> <p>五、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>.....</p>	<p>二、投资范围</p> <p>.....</p> <p>新增：</p> <p>本基金可根据法律法规的规定参与转融通证券出借业务和融资业务。</p> <p>三、投资策略</p> <p>.....</p> <p>新增：</p> <p>6、转融通证券出借投资策略</p> <p>为更好地实现投资目标，在加强风险防范并遵守审慎原则的前提下，本基金可根据投资管理的需要，参与转融通证券出借业务。本基金将在分析市场环境、投资者类型与结构、基金历史申赎情况、出借证券流动性情况等因素的基础上，合理确定出借证券的范围、期限和比例。</p> <p>7、融资投资策略</p> <p>本基金在参与融资业务时，将通过对市场环境、利率水平、基金规模以及基金申购赎回情况等因素的研究和判断，决定融资规模。本基金管理人将充分考虑融资业务的收益性、流动性及风险性特征，谨慎进行投资，提高基金的投资收益。</p> <p>五、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>.....</p> <p>新增：</p> <p>(15) 本基金参与融资的，每个交易日日终，本基金持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过</p>

	<p>基金资产净值的95%；</p> <p>(16) 本基金参与转融通证券出借业务的，应当符合下列要求：</p> <p>1) 参与转融通证券出借业务的资产不得超过基金资产净值的30%，其中出借期限在10个交易日以上的出借证券纳入《流动性规定》所述流动性受限证券的范围；</p> <p>2) 参与转融通证券出借业务的单只证券不得超过基金持有该证券总量的30%；</p> <p>3) 最近6个月内日均基金资产净值不得低于2亿元；</p> <p>4) 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；</p> <p>.....</p> <p>除上述第(10)、(12)、(13)项外，因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制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，但中国证监会规定的特殊情形除外。</p>	<p>基金资产净值的95%；</p> <p>(16) 本基金参与转融通证券出借业务的，应当符合下列要求：</p> <p>1) 参与转融通证券出借业务的资产不得超过基金资产净值的30%，其中出借期限在10个交易日以上的出借证券纳入《流动性规定》所述流动性受限证券的范围；</p> <p>2) 参与转融通证券出借业务的单只证券不得超过基金持有该证券总量的30%；</p> <p>3) 最近6个月内日均基金资产净值不得低于2亿元；</p> <p>4) 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；</p> <p>.....</p> <p>除上述第(10)、(12)、(13)、(16)项外，因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制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，但中国证监会规定的特殊情形除外。因证券市场波动、上市公司合并、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上述第(16)项规定的，基金管理人不得新增出借业务。</p> <p>删除：</p> <p>九、基金的融资融券及转融通业务</p> <p>本基金可以根据届时有效的有效法律法规和政策的规定进行融资融券及转融通业务。</p>
<p>第十六部分 基金资产估值</p>	<p>三、估值方法</p> <p>.....</p>	<p>三、估值方法</p> <p>.....</p> <p>新增：</p> <p>(7) 基金参与融资和转融通证券出借业务的，按照相关法律法规和行业协定的相关规定进行估值。</p>

	<p>八、特殊情况的处理</p> <p>1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第7项进行估值时,所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。</p>	<p>八、特殊情况的处理</p> <p>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,所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。</p>
<p>第二十部分 基金的信息披露</p>	<p>五、公开披露的基金信息</p> <p>公开披露的基金信息包括:</p> <p>.....</p>	<p>五、公开披露的基金信息</p> <p>公开披露的基金信息包括:</p> <p>.....</p> <p>新增:</p> <p>(十四) 基金参与融资和转融通证券出借业务的信息披露</p> <p>本基金参与融资业务的,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情况,包括投资策略、业务开展情况、损益情况、风险及其管理情况等。</p> <p>本基金参与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)等文件中披露参与转融通证券出借业务的情况,包括投资策略、业务开展情况、损益情况、风险及其管理情况等,并就报告期内本基金参与转融通证券出借业务发生的重大关联交易事项做详细说明。</p>

三、重要提示

1、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,无需召开基金份额持有人大会。

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;招募说明书及基金产品资料概要涉及前述内容的将一并修改,并依照《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的有关规定在规定媒介上公告。

3、本公告仅对本基金增加参与转融通证券出借业务和融资业务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、基金产品资料概要等法律文件,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(400-700-5588、400-820-5050)咨询相关情况。

特此公告。

华宝基金管理有限公司

2022年9月22日