

华夏基金管理有限公司关于修订
华夏中证细分食品饮料产业主题交易型开放式指数证券投资基金
基金合同的公告

根据《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指引第3号-指数基金指引》等法律法规和华夏中证细分食品饮料产业主题交易型开放式指数证券投资基金（基金代码：515170，场内简称：食品饮料，扩位证券简称：食品饮料ETF，以下简称“本基金”）基金合同的规定，经协商基金托管人中国银行股份有限公司同意，并报中国证监会备案，华夏基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）决定对本基金基金合同、招募说明书等法律文件进行修订。本次修订将自2021年3月16日起生效。现将主要修订内容公告如下：

一、在基金合同“第一部分 前言”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、将基金合同“第三部分 基金的基本情况 八、标的指数”内容修订为：

“本基金标的指数为中证细分食品饮料产业主题指数。

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、在本基金招募说明书“重要提示”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。”

四、将本基金招募说明书“十、基金的投资 （五）标的指数”内容修订为：

“1、本基金的标的指数为中证细分食品饮料产业主题指数。

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。

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及时对相关成份券进行调整。

法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

2、中证细分食品饮料产业主题指数

指数编制方案请参见本招募说明书附件，投资者可通过以下路径查询指数信息：<http://www.csindex.com.cn/zh-CN/indices/index-detail/000815>”。

五、在本基金招募说明书“十七、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如下：

“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，从而可能面临标的指数变更的风险。

.....

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。”

六、在本基金招募说明书中增加“**附件三：标的指数编制方案**”。具体见本基金招募说明书。

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（更新）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本基金基金合同的规定。本次修订自2021年3月16日起生效，投资者可登录基金管理人网站（www.ChinaAMC.com）查阅本基金修订后的基金合同、招募说明书及产品资料概要等。投资者可登录本基金管理人网站（www.ChinaAMC.com）

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。

特此公告

华夏基金管理有限公司

二〇二一年三月十一日