

# 关于国金基金管理有限公司旗下指数型证券投资基金 修改基金合同的公告

根据 2021 年 2 月 1 日起施行的《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“《指数指引》”），国金基金管理有限公司（以下简称“本公司”或“基金管理人”）经与相关基金的基金托管人协商一致，并报监管机构备案，对旗下管理的如下指数型证券投资基金的基金合同相关条款进行修改：

序号	基金名称
1	国金沪深 300 指数增强证券投资基金
2	国金标普中国 A 股低波红利指数增强证券投资基金（LOF）
3	国金上证 50 指数增强证券投资基金（LOF）

本次修改是根据法律法规的要求对基金合同进行的修改，对原有基金份额持有人的利益未形成实质性影响，因此不需召开基金份额持有人大会，修改后的基金合同自 2021 年 3 月 31 日起生效，具体修改内容详见本公告附件《国金基金管理有限公司旗下指数型证券投资基金基金合同的修改说明》。

本基金管理人经与相关基金的基金托管人协商一致，在对上述证券投资基金的基金合同进行修订的同时，也将对基金托管协议的相关条款进行相应修订。上述证券投资基金的基金合同和托管协议本次修订的内容，将在基金更新的招募说明书中作相应调整。

投资者可访问本公司网站 ([www.gfund.com](http://www.gfund.com)) 或拨打客户服务电话 (4000-2000-18) 咨询相关情况。

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。投资者投资基金前应认真阅读基金合同、招募说明书，投资与自身风险承受能力相适应的基金。敬请投资者留意投资风险。

特此公告。

附件：《国金基金管理有限公司旗下指数型证券投资基金基金合同的修改说明》

国金基金管理有限公司  
二〇二一年三月三十日

附件：《国金基金管理有限公司旗下指数型证券投资基金基金合同的修改说明》

**国金沪深 300 指数增强证券投资基金修订对照表**

修订前	修订后
<p>第一部分 前言</p> <p>2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》（以下简称“《合同法》”）、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）和其他有关法律、法规。</p>	<p>第一部分 前言</p> <p>2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法<b>民法典</b>》（以下简称“《<b>合同法民法典</b>》”）、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）、《<b>公开募集</b>证券投资基金销售<b>机构监督</b>管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《<b>公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引</b>》（以下简称“《<b>指数基金指引</b>》”）和其他有关法律、法规。</p>
<p>第一部分 前言</p>	<p>第一部分 前言</p> <p>五、……</p> <p><b>六、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、成份券停牌等潜在风险，详见本基金招募说明书。</b></p>
<p>第二部分 释义</p> <p>10、《销售办法》：指中国证监会 2013 年 3 月 15 日颁布、同年 6 月 1 日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订</p>	<p>第二部分 释义</p> <p>10、《销售办法》：<b>中国证监会 2020 年 8 月 28 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订</b></p> <p>14、《<b>指数基金指引</b>》：指中国证监会 2021 年 1 月 22 日颁布、同年 2 月 1 日实施的《<b>公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引</b>》及颁布机关对其不时做出的<b>修订</b></p>
<p>第十二部分 基金的投资</p> <p>三、投资策略</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>（1）标的指数</p> <p>本基金标的指数沪深 300 指数是由中证指数有限公司编制，沪深证券交易所授权，可以反映中国 A 股市场的指数。它的样本选自沪深两个证券市场 300 只股票，具备市场</p>	<p>第十二部分 基金的投资</p> <p>三、投资策略</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>（1）标的指数</p> <p>本基金标的指数沪深 300 指数是由中证指数有限公司编制，沪深证券交易所授权，可以反映中国 A 股市场的指数。它的样本选自沪深两个证券市场 300 只股票，具备市场覆盖</p>

<p>覆盖度广、代表性强流动指数编制方法透明等特点，能够反映中国 A 股市场整体状况和发展趋势。</p>	<p>度广、代表性强流动指数编制方法透明等特点，能够反映中国 A 股市场整体状况和发展趋势。</p> <p><b>指数成份股发生明显负面事件面临退市风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人将按照基金份额持有人利益优先的原则，综合考虑成份股的退市风险、其在指数中的权重以及对跟踪误差的影响，据此制定成份股替代策略，并对投资组合进行相应调整。</b></p>
<p>第十二部分 基金的投资 六、业绩比较基准</p> <p>.....</p> <p>如果今后本基金所跟踪的标的指数的指数编制单位变更或停止标的指数的编制、发布或授权，或标的指数由其他指数替代、或由于指数编制方法的重大变更等事项导致沪深 300 指数不宜继续作为标的指数，或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出，基金管理人认为有必要作相应调整时，本基金管理人在履行适当程序后，经与基金托管人协商一致，适当调整业绩比较基准并及时公告。其中，若变更标的指数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召开基金份额持有人大会，报中国证监会备案且在指定媒介公告。若变更标的指数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、标的指数更名等事项)，则无需召开基金份额持有人大会，基金管理人应与基金托管人协商一致后，报中国证监会备案并及时公告。标的指数发生变更的，本基金业绩比较基准也相应变更。</p>	<p>第十二部分 基金的投资 六、业绩比较基准</p> <p>.....</p> <p><b>如果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，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，本基金合同终止。</b></p> <p><b>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期间，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。</b></p>
<p>第十九部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算</p> <p>二、基金合同的终止事由</p> <p>有下列情形之一的，基金合同应当终止：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、基金份额持有人大会决定终止的；</li> <li>2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；</li> <li>3、基金合同约定的其他情形；</li> <li>4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。</li> </ol>	<p>第十九部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算</p> <p>二、基金合同的终止事由</p> <p>有下列情形之一的，基金合同应当终止：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、基金份额持有人大会决定终止的；</li> <li>2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；</li> <li>3、<b>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的情形除外)、指数</b></li> </ol>

	<p>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；</p> <p>4、基金合同约定的其他情形；</p> <p>5、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。</p>
--	--

国金上证 50 指数增强证券投资基金修订对照表

修订前	修订后
<p>第一部分 前言</p> <p>2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》（以下简称“《合同法》”）、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）和其他有关法律法规。</p>	<p>第一部分 前言</p> <p>2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国民法典》（以下简称“《民法典》”）、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）、《公开募集证券投资基金销售<b>机构监督</b>管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集证券投资基金<b>运作指引第 3 号——指数基金指引</b>》（以下简称“《<b>指数基金指引</b>》”）和其他有关法律法规。</p>
<p>第一部分 前言</p>	<p>第一部分 前言</p> <p>五、……</p> <p><b>六、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、成份券停牌等潜在风险，详见本基金招募说明书。</b></p>
<p>第二部分 释义</p> <p>11、《销售办法》：指中国证监会 2013 年 3 月 15 日颁布、同年 6 月 1 日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订</p>	<p>第二部分 释义</p> <p>11、《销售办法》： <b>中国证监会 2020 年 8 月 28 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订</b></p> <p>15、《<b>指数基金指引</b>》：指中国证监会 2021 年 1 月 22 日颁布、同年 2 月 1 日实施的《<b>公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引</b>》及颁布机关对其不时做出的修订</p>
<p>第八部分 基金合同当事人及权利义务</p>	<p>第八部分 基金合同当事人及权利义务</p>

<p>二、基金托管人 (一) 基金托管人简况 法定代表人: 洪崎 存续期间: 持续经营</p>	<p>二、基金托管人 (一) 基金托管人简况 法定代表人: 高迎欣 存续期间: 1996年02月07日至长期</p>
<p>第十三部分 基金的投资 三、投资策略 2、股票投资策略 (2) 指数化投资策略 本基金将运用指数化的投资方法, 通过控制对各成份股在标的指数中权重的偏离, 实现跟踪误差控制目标, 达到对标的指数的跟踪目标。</p>	<p>第十三部分 基金的投资 三、投资策略 2、股票投资策略 (2) 指数化投资策略 本基金将运用指数化的投资方法, 通过控制对各成份股在标的指数中权重的偏离, 实现跟踪误差控制目标, 达到对标的指数的跟踪目标。 <b>指数成份股发生明显负面事件面临退市风险, 且指数编制机构暂未作出调整的, 基金管理人将按照基金份额持有人利益优先的原则, 综合考虑成份股的退市风险、其在指数中的权重以及对跟踪误差的影响, 据此制定成份股替代策略, 并对投资组合进行相应调整。</b></p>
<p>第十三部分 基金的投资 六、标的指数与业绩比较基准 …… 如果今后本基金所跟踪的标的指数的指数编制单位变更或停止标的指数的编制、发布或授权, 或标的指数由其他指数替代, 或由于指数编制方法的重大变更等事项导致上证 50 指数不宜继续作为标的指数, 或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出, 基金管理人认为有必要作相应调整时, 本基金管理人在履行适当程序后, 经与基金托管人协商一致, 可变更标的指数并及时公告。其中, 若变更标的指数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召开基金份额持有人大会, 报中国证监会备案且在指定媒介公告。若变更标的指数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、标的指数更名等事项), 则无需召开基金份额持有人大会, 基金管理人应与基金托管人协商一致后, 报中国证监会备案并及时公告。 标的指数发生变更的, 本基金业绩比较基准也相应变更。</p>	<p>第十三部分 基金的投资 六、标的指数与业绩比较基准 …… <b>如果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, 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期间, 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。</b></p>

<p>第二十部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算</p> <p>二、基金合同的终止事由</p> <p>有下列情形之一的，基金合同应当终止：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、基金份额持有人大会决定终止的；</li> <li>2、基金管理人、基金托管人职责终止，在6个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；</li> <li>3、基金合同约定的其他情形；</li> <li>4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。</li> </ol>	<p>第二十部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算</p> <p>二、基金合同的终止事由</p> <p>有下列情形之一的，基金合同应当终止：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、基金份额持有人大会决定终止的；</li> <li>2、基金管理人、基金托管人职责终止，在6个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；</li> <li>3、<b>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；</b></li> <li>4、基金合同约定的其他情形；</li> <li>5、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。</li> </ol>
--	--

国金标普中国 A 股低波红利指数增强证券投资基金（LOF）基金合同修订对照表

修订前	修订后
<p>第一部分 前言</p> <p>2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》（以下简称“《合同法》”）、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）和其他有关法律法规。</p>	<p>第一部分 前言</p> <p>2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法<b>民法典</b>》（以下简称“《<b>合同法民法典</b>》”）、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《<b>公开募集</b>证券投资基金销售<b>机构监督</b>管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）、《<b>公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引</b>》（以下简称“《<b>指数基金指引</b>》”）和其他有关法律法规。</p>
<p>第一部分 前言</p>	<p>第一部分 前言</p> <p>五、.....</p> <p><b>六、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、成份券停牌等潜在风险，详见本基金招募说明书。</b></p>

<p>第二部分 释义</p> <p>12、《销售办法》：<del>指中国证监会 2013 年 3 月 15 日颁布、同年 6 月 1 日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订</del></p>	<p>第二部分 释义</p> <p>12、《销售办法》：<b>指中国证监会 2020 年 8 月 28 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订</b></p> <p>16、《指数基金指引》：<b>指中国证监会 2021 年 1 月 22 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</b></p>
<p>第十三部分 基金的投资</p> <p>三、投资策略</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>(1) 指数化投资策略</p> <p>本基金将运用指数化的投资方法，通过研究标的指数成份股的构成及其权重确定本基金投资组合的基本构成和大致占比，并通过控制投资组合中成份股对标的指数权重的偏离，控制跟踪误差，从而达成对标的指数的跟踪目标。</p>	<p>第十三部分 基金的投资</p> <p>三、投资策略</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>(1) 指数化投资策略</p> <p>本基金将运用指数化的投资方法，通过研究标的指数成份股的构成及其权重确定本基金投资组合的基本构成和大致占比，并通过控制投资组合中成份股对标的指数权重的偏离，控制跟踪误差，从而达成对标的指数的跟踪目标。</p> <p><b>指数成份股发生明显负面事件面临退市风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人将按照基金份额持有人利益优先的原则，综合考虑成份股的退市风险、其在指数中的权重以及对跟踪误差的影响，据此制定成份股替代策略，并对投资组合进行相应调整。</b></p>
<p>第十三部分 基金的投资</p> <p>六、业绩比较基准</p> <p>2、业绩比较基准</p> <p>.....</p> <p>如果指数编制单位变更或停止标的指数的编制、发布或授权，或标的指数由其他指数替代、或由于指数编制方法的重大的变更等事项导致本基金管理人认为标的指数不宜继续作为跟踪标的，或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时，本基金管理人可以依据维护投资人合法权益的原则，在履行适当程序后变更本基金的标的指数、业绩比较基准和基金名称。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)，则无需召开基金份额持有人大会，基金管理人应与基金</p>	<p>第十三部分 基金的投资</p> <p>六、业绩比较基准</p> <p>2、业绩比较基准</p> <p>.....</p> <p><b>如果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，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，本基金合同终止。</b></p> <p><b>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期间，基金管理人应按照</b></p>

<p>托管人协商一致后,报中国证监会备案并及时公告。若变更业绩比较基准、标的指数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业绩比较基准、标的指数召开基金份额持有人大会,并报中国证监会备案。</p>	<p><i>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。</i></p>
<p>第二十部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算</p> <p>二、基金合同的终止事由</p> <p>有下列情形之一的,经履行相关程序后,基金合同应当终止:</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、基金份额持有人大会决定终止的;</li> <li>2、基金管理人、基金托管人职责终止,在6个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的;</li> <li>3、基金合同约定的其他情形;</li> <li>4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。</li> </ol>	<p>第二十部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算</p> <p>二、基金合同的终止事由</p> <p>有下列情形之一的,经履行相关程序后,基金合同应当终止:</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、基金份额持有人大会决定终止的;</li> <li>2、基金管理人、基金托管人职责终止,在6个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的;</li> <li>3、<i>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;</i></li> <li>4、基金合同约定的其他情形;</li> <li>5、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。</li> </ol>