

关于中泰中证 500 指数增强型证券投资基金根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号-指数基金指引》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》等法律法规及《中泰中证 500 指数增强型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报监管机构备案，中泰证券（上海）资产管理有限公司（以下简称“基金管理人”）决定对旗下中泰中证 500 指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金合同进行修订并同步对招募说明书和基金产品资料概要进行更新。现将相关事宜公告如下：

本次修订主要根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》相关规定，对本基金基金合同的前言、释义、基金投资、基金合同终止等条款进行修改，并对基金招募说明书、基金产品资料概要相关内容进行了更新。

基金合同主要修订内容对照表详见附件。

本次修订对基金份额持有人利益无实质性不利影响，并已履行了适当的程序，符合相关法律法规的规定，无需召开基金份额持有人大会，修订内容自 2021 年 4 月 16 日起生效。

投资者可通过基金管理人网站（<https://www.ztzqzg.com/>）查阅修订、更新后的基金合同、招募说明书等法律文件，或拨打客服热线 400-821-0808 咨询有关详情。

风险提示：

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。投资有风险，基金的过往业绩并不预示其未来表现，基金管理人管理的各只基金的业绩不构成对基金管理人管理的其他基金业绩表现的保证。投资者投资基金时应认真阅读相关基金的基金合同、招募说明书等法律文件。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，请投资者根据自身的风险承受能力选择适合自己的基金产品。

特此公告。

中泰证券（上海）资产管理有限公司

2021 年 4 月 16 日

附件：基金合同主要修订内容对照表

	修订前	修订后
前言	<p>2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》、《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》”）、<u>《证券投资基金销售管理办法》</u>（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>2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国<u>民法典</u>》、《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》”）、<u>《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》</u>（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》”）、<u>《公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引》</u>（以下简称《<u>指数基金指引</u>》）和其他有关法律、法规。</p>
前言		<p><u>八、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、成份股停牌等潜在风险，详见本基金招募说明书。</u></p>
释义	<p>11、<u>《销售办法》</u>：指中国证监会2013年3月15日颁布、同年6月1日实施的<u>《证券投资基金销售管理办法》</u>及颁布机关对其不时做出的修订</p> <p>58、标的指数：指中证500指数<u>及其未来可能发生的变更</u></p>	<p>11、<u>《销售办法》</u>：指中国证监会2020年8月28日颁布、同年10月1日实施的<u>《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》</u>及颁布机关对其不时做出的修订</p> <p>16、<u>《指数基金指引》</u>：指中国证监会2021年1月22日颁布、同年2月1日实施的<u>《公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引》</u>及颁布机关对其不时做出的修订</p>

		59、标的指数;指中证 500 指数 其余释义条款序号相应调整。
基 本 情 况	标的指数 本基金的标的指数为中证 500 指数 <u>及为未来可能发生的变更。</u>	标的指数 本基金的标的指数为中证 500 指数。
基 金 的 投 资 策 略		<u>当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。</u>
标 的 指 数	1、标的指数 本基金的标的指数是中证 500 指数。 <u>如果标的指数被停止编制及发布，或标的指数由其他指数替代（单纯更名除外），或由于指数编制方法等重大变更导致标的指数不宜继续作为标的指数，或证券市场上有代表性更强、更适合投资的指数推出，本基金管理人可以依据审慎性原则和维护基金份额持有人合法权益的原则，经与基金托管人协商一致，在履行适当程序后，依法变更本基金的标的指数和投资对象，并依据市场代表性、流动性、与原指数的相关性等诸多因素选择确定新的标的指数。</u> <u>由于上述原因变更标的指数，若标的指数变更涉及本系列基金投资范围或投资策略的实质性变更，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，并在规定媒介上公告。若标的指数变更对基金投资无实质性影响（包括但不限于编制机构变更、指数更名等），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，并在规定媒介上公告。</u>	1、标的指数 本基金的标的指数是中证 500 指数。 <u>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。</u> <u>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。</u>

《基金合同》的终止事由		<p>3、出现标的指数不符合要求 <u>(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；</u></p>
-------------	--	--

基金管理人同步对招募说明书、基金产品资料概要涉及到上述修订的内容进行了相应修订与更新。