

关于中泰中证 500 指数增强型证券投资基金投资范围增加存托凭证 并相应修订法律文件的公告

根据《中华人民共和国证券法》、《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》、《存托凭证发行与交易管理办法（试行）》等法律法规及基金合同、招募说明书的约定，经与基金托管人协商一致，并向中国证监会备案，中泰证券（上海）资产管理有限公司（以下简称“管理人”）决定在旗下中泰中证 500 指数增强型证券投资基金的投资范围中增加存托凭证并相应修订基金合同等法律文件。本次修订内容包括明确投资范围包含存托凭证，增加存托凭证的投资策略、投资比例限制、估值方法，并提示相关投资风险等。

具体修订内容请见附件《中泰中证 500 指数增强型证券投资基金投资范围增加存托凭证并修改法律文件对照表》。

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 2020 年 12 月 9 日起生效。

投资者可通过本基金管理人网站（<https://www.ztzqzg.com/>）查阅修订、更新后的基金合同、托管协议、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

2020 年 12 月 9 日

**附件：中泰中证 500 指数增强型证券投资基金投资范围增加存托凭证
并修改法律文件对照表**

中泰中证 500 指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”）于 2019 年 12 月 11 日成立，现处于正常存续期。为更好服务投资者，管理人拟在本基金投资范围中增加存托凭证，并对本基金法律文件进行修改。

一、本基金《基金合同》核心要素修改如下：

修 改 部分	合同原条款	合同修改后条款
前言		新增条款：七、本基金的投资范围包括存托凭证，如果投资，可能面临存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与创新企业发行人、境外发行人、存托凭证发行机制和交易机制等相关的风险。
投 资 范围	本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股及其备选成份股、其他依法发行上市的股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票）、债券……	本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股及其备选成份股、其他依法发行上市的股票（含中小板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准发行的股票）、债券……
投 资 策略		新增条款：本基金可通过优选存托凭证，增强基金收益。本基金投资存托凭证，将根据法律法规和监管机构的要求，制定存托凭证投资策略，关注发行人有关信息披露情况，关注发行人基本面情况、市场估值等因素，通过定性分析和定量分析相结合的办法，参与存托凭证的投资，谨慎决定存托凭证的权重配置和标

		的选择。
投资限制		新增条款：本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行，与境内上市交易的股票合并计算；
估值条款		新增条款：3、本基金投资存托凭证的估值核算，依照境内上市交易的股票执行。

除核心条款修订外，管理人还根据本基金成立后新施行的《证券投资基金托管业务管理办法》等法规修订对基金法律文件相关条款表述进行调整。

二、本基金《招募说明书》除依照合同相应内容进行修改外，还需增加风险揭示条款。

《招募说明书》第十七部分风险揭示章节一一五、基金特定风险增加以下表述：

“存托凭证的风险

投资存托凭证，存托凭证是指由存托人签发、以境外证券为基础在中国境内发行、代表境外基础证券权益的证券。本基金投资存托凭证，除与其他仅投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与存托凭证发行机制相关的风险，包括存托凭证持有人与境外基础证券发行人的股东在法律地位、享有权利等方面存在差异可能引发的风险；存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等方面的特殊安排可能引发的风险；存托协议自动约束存托凭证持有人的风险；因多地上市造成存托凭证价格差异以及波动的风险；存托凭证持有人权益被摊薄的风险；存托凭证退市的风险；已在境外上市的基础证券发行人，在持续信息披露监管方面与境内可能存在差异的风险；境内外法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险。”

三、本基金《托管协议》中涉及相关内容依照《基金合同》中相关章节进行修改。

中泰证券（上海）资产管理有限公司

2020年12月9日