

# 泰达宏利基金管理有限公司关于旗下部分基金根据 《公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引》修订法律文件有关条款的公告

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》、各基金基金合同、招募说明书及其更新等规定，经与各基金托管人协商一致，并报中国证券监督管理委员会备案，泰达宏利基金管理有限公司（以下简称“本公司”）对旗下泰达宏利沪深300指数增强型证券投资基金、泰达宏利中证500指数增强型证券投资基金（LOF）、泰达宏利中证主要消费红利指数型证券投资基金、泰达宏利中证申万绩优策略指数增强型证券投资基金相关法律文件进行修改，本次修订系因相应的法律法规发生变动而进行的修改，对基金份额持有人利益无实质性不利影响，无需召开份额持有人大会，修订将自2021年3月27日起正式生效。

现将相关事项公告如下：

## 一、基金合同修改的内容

### 1、“前言”章节

增加《公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引》相关表述，并增加指数基金特有风险的提示。

### 2、“释义”章节

增加《指数基金指引》相关释义。

### 3、“基金的基本情况”章节

增加标的指数以及标的指数不符合要求、指数编制机构退出等情形的处置方案。

### 4、“基金的投资”章节

增加当指数成份股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情形下的策略调整。

5、泰达宏利中证申万绩优策略指数增强型证券投资基金相关法律文件根据最新的法律法规规定更新了部分条款表述。

6、关于各基金基金合同的修订内容请详见本公告附件对照表。

二、招募说明书、基金产品资料概要涉及到上述相关内容也已进行相应修订和更新。

### 三、重要提示

1、修改后的基金合同自 2021 年 3 月 27 日起生效，基金管理人已履行了规定程序，符合相关法律法规的规定及各基金基金合同的约定。修改后的各基金基金合同、招募说明书（更新）、基金产品资料概要（更新）全文将与本公告同日登载于基金管理人网站（<http://www.mfcteda.com/>）及中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）。

2、投资者可以通过以下途径咨询有关详情：

- 1) 泰达宏利基金管理有限公司客户服务电话：4006988888
- 2) 泰达宏利基金管理有限公司网站：<http://www.mfcteda.com/>

### 四、风险提示

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。投资人投资基金时应认真阅读相关基金的基金合同、招募说明书（更新）、产品资料概要（更新）等文件。投资有风险，敬请投资人选择适合自身风险承受能力的投资品种进行投资。

特此公告。

泰达宏利基金管理有限公司

2021 年 3 月 27 日

附件：

1、《泰达宏利沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》修订对照表

章节	修改前的《基金合同》条款	修改后的《基金合同》条款
第一部分 前言	<p>一、订立本基金合同的目的、依据和原则</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>一、订立本基金合同的目的、依据和原则</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》”）、《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“《指数基金指引》”）和其他有关法律法规。</p>
第一部分 前言		<p>七、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、成份股停牌或违约等潜在风险，具体风险详见招募说明书。</p>
第二部分 释义		<p>13、《指数基金指引》：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</p> <p>57、指数编制机构：指中证指数有限公司</p>
第三部分 基金的		<p>四、标的指数</p>

<p><b>基本情况</b></p>		<p>沪深 300 指数。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
<p><b>第十二部分基金的投资</b></p>	<p>三、投资策略</p> <p>③特殊情形下的调整</p>	<p>三、投资策略</p> <p>③特殊情形下的调整</p> <p>当指数成份股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，基金管理人将按照基金份额持有人利益优先的原则，综合考虑成份股的退市或违约风险、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。</p>
<p><b>第十二部分基金的投资</b></p>	<p>五、业绩比较基准</p> <p>如果今后法律法规发生变化，或指数编制单位停止编制该指数、更改指数名称，或有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩</p>	<p>五、业绩比较基准</p> <p>如果今后法律法规发生变化，或指数编制机构停止编制该指数、更改指数名称，或有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩</p>

	<p>比较基准推出，本基金管理人经与基金托管人协商一致，本基金可以在履行适当的程序后变更业绩比较基准并及时公告。</p> <p>如本基金调整标的指数的，本基金的业绩比较基准相应调整。变更标的指数涉及本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，并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），不需召开基金份额持有人大会通过，但应及时通知本基金托管人并报中国证监会，并在履行必要手续后，在中国证监会指定的媒介上公告，并在更新的招募说明书中列示。</p>	<p>比较基准推出，本基金管理人经与基金托管人协商一致，本基金可以在履行适当的程序后变更业绩比较基准并及时公告。</p> <p>如本基金调整标的指数的，本基金的业绩比较基准相应调整。变更标的指数涉及本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，并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无实质性影响（包括但不限于指数编制机构变更、指数更名等事项），不需召开基金份额持有人大会通过，但应及时通知本基金托管人并报中国证监会，并在履行必要手续后，在中国证监会指定的媒介上公告，并在更新的招募说明书中列示。</p>
--	---	---

2、《泰达宏利中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同》修订对照表

章节	修改前的《基金合同》条款	修改后的《基金合同》条款
<p><b>第一部分 前言</b></p>	<p>一、订立《泰达宏利中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同》（以下简称“本基金合同”）的目的、依据和原则</p> <p>2、订立本基金合同的依据</p> <p>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》”）、《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》”）</p>	<p>一、订立《泰达宏利中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同》（以下简称“本基金合同”）的目的、依据和原则</p> <p>2、订立本基金合同的依据</p> <p>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》”）、《公开募集证券投资</p>

	露办法》)、《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》”)及其他法律法规的有关规定。	基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、《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运作指引第3号——指数基金指引》(以下简称“《指数基金指引》”)及其他法律法规的有关规定。
<b>第一部分 前言</b>		七、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、成份股停牌或违约等潜在风险,具体风险详见招募说明书。
<b>第二部分 释义</b>		15、《指数基金指引》: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 60、指数编制机构:指中证指数有限公司
<b>第三部分 基金的基本情况</b>	五、标的指数	五、标的指数 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

		<p>决。</p> <p>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。</p>
第十二部分基金的投资	<p>三、投资策略</p> <p>③特殊情形下的调整</p>	<p>三、投资策略</p> <p>③特殊情形下的调整</p> <p>当指数成份股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，基金管理人将按照基金份额持有人利益优先的原则，综合考虑成份股的退市或违约风险、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。</p>
第十二部分基金的投资	<p>五、业绩比较基准</p> <p>如果今后法律法规发生变化，或指数编制单位停止编制该指数、更改指数名称，或有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，本基金管理人经与基金托管人协商一致，本基金可以在履行适当的程序后变更业绩比较基准并及时公告。</p> <p>如本基金调整标的指数的，本基金的业绩比较基准相应调整。变更标的指数涉及本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，并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无实质性影响（包括</p>	<p>五、业绩比较基准</p> <p>如果今后法律法规发生变化，或指数编制机构停止编制该指数、更改指数名称，或有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，本基金管理人经与基金托管人协商一致，本基金可以在履行适当的程序后变更业绩比较基准并及时公告。</p> <p>如本基金调整标的指数的，本基金的业绩比较基准相应调整。变更标的指数涉及本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，并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无实质性影响（包</p>

	<p>但不限于指数编制单位变更、指数更名等事项), 本基金管理人经与基金托管人协商一致, 本基金可以在履行适当程序后变更业绩比较基准并及时公告。</p>	<p>包括但不限于指数编制机构变更、指数更名等事项), 本基金管理人经与基金托管人协商一致, 本基金可以在履行适当程序后变更业绩比较基准并及时公告。</p>
--	--	--

3、《泰达宏利中证主要消费红利指数型证券投资基金基金合同》修订对照表

章节	修改前的《基金合同》条款	修改后的《基金合同》条款
<p><b>第一部分 前言</b></p>	<p>一、订立本基金合同的目的、依据和原则 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>一、订立本基金合同的目的、依据和原则 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》”)、《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“《指数基金指引》”)和其他有关法律法规。</p>
<p><b>第一部分 前言</b></p>		<p>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、成份股停牌或违约等潜在风险, 具体风险详见招募说明书。</p>
<p><b>第二部分 释义</b></p>		<p>14、《指数基金指引》: 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</p>



		做出的修订 62、指数编制机构：指中证指数有限公司
<b>第三部分 基金的基本情况</b>	四、标的指数	四、标的指数 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。 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>基金份额的申购与赎回</b>	七、拒绝或暂停申购的情形 8、指数编制单位或指数发布机构因异常情况使指数数据无法正常计算、计算错误或发布异常时。	七、拒绝或暂停申购的情形 8、指数编制机构因异常情况使指数数据无法正常计算、计算错误或发布异常时。
<b>第十二部分基金的投资</b>	三、投资策略 2、成份股、备选成份股投资策略	三、投资策略 2、成份股、备选成份股投资策略 当指数成份股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，基金管理人将按照基金份额持有人利益优先的原则，综合考虑成份股的退市或违约风险、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>第十二部分基金的投资</b>	<p>五、业绩比较基准</p> <p>如果指数发布机构变更或者停止上述指数的编制及发布，或者上述指数由其他指数代替，或由于指数编制方法等重大变更导致上述指数不宜继续作为本基金的标的指数，或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，在按照监管部门要求履行适当程序后变更本基金的标的指数，并同时更换本基金的基金名称与业绩比较基准。基金管理人应在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在中国证监会指定媒介上刊登公告。</p>	<p>五、业绩比较基准</p> <p>如果指数编制机构变更或者停止上述指数的编制及发布，或者上述指数由其他指数代替，或由于指数编制方法等重大变更导致上述指数不宜继续作为本基金的标的指数，或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，在按照监管部门要求履行适当程序后变更本基金的标的指数，并同时更换本基金的基金名称与业绩比较基准。基金管理人应在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在中国证监会指定媒介上刊登公告。</p>

4、《泰达宏利中证申万绩优策略指数增强型证券投资基金基金合同》修订对照表

章节	修改前的《基金合同》条款	修改后的《基金合同》条款
<b>第一部分 前言</b>	<p>一、订立本基金合同的目的、依据和原则</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</p>	<p>一、订立本基金合同的目的、依据和原则</p> <p>2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国民法典》、《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》”)、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》(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</p>

	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。	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运作指引第3号——指数基金指引》(以下简称“《指数基金指引》”)和其他有关法律法规。
<b>第一部分 前言</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、成份股停牌或违约等潜在风险,具体风险详见招募说明书。
<b>第二部分 释义</b>		14、《指数基金指引》: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 62、指数编制机构:指中证指数有限公司、上海申银万国证券研究所有限公司
<b>第三部分 基金的基本情况</b>	四、标的指数	四、标的指数 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。 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>第六部分 基金份额的申购与赎回</b>	七、拒绝或暂停申购的情形  9、指数编制单位或指数发布机构因异常情况使指数数据无法正常计算、计算错误或发布异常时。	七、拒绝或暂停申购的情形  9、指数编制机构因异常情况使指数数据无法正常计算、计算错误或发布异常时。
<b>第十二部分 基金的投资</b>	三、投资策略  ③特殊情形下的调整	三、投资策略  ③特殊情形下的调整  当指数成份股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，基金管理人将按照基金份额持有人利益优先的原则，综合考虑成份股的退市或违约风险、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>第十二部分 基金的投资</b>	五、业绩比较基准  如果指数发布机构变更或者停止上述指数的编制及发布，或者上述指数由其他指数代替，或由于指数编制方法等重大变更导致上述指数不宜继续作为本基金的标的指数，或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，在按照监管部门要求履行适当程序后变更本基金的标的指数，并同时更换本基金的基金名称与业绩比较基准。基金管理人应在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在中国证监会指定媒介上刊登	五、业绩比较基准  如果指数编制机构变更或者停止上述指数的编制及发布，或者上述指数由其他指数代替，或由于指数编制方法等重大变更导致上述指数不宜继续作为本基金的标的指数，或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，在按照监管部门要求履行适当程序后变更本基金的标的指数，并同时更换本基金的基金名称与业绩比较基准。基金管理人应在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在中国证监会规定媒介上

	公告。	刊登公告。
--	-----	-------

注：以上四只基金的基金合同内容摘要涉及上述内容的，一并修改。