

# 华泰紫金中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金 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》修改基金合同部分条款的公告

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》及《华泰紫金中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金基金合同》的约定，经与华泰紫金中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金(以下简称“本基金”，基金代码: 008964)基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司协商一致，并报中国证券监督管理委员会备案，华泰证券(上海)资产管理有限公司(以下简称“基金管理人”)决定对本基金的基金合同进行修改。本次修改将自 2021 年 3 月 30 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

“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》（以下简称‘《指数基金指引》’）”以及“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、成份券违约等潜在风险，详见本基金招募说明书。”

### 2、“释义”章节

“释义”章节增加：“《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”。

### 3、“基金的投资”章节

(1)“基金的投资”章节中的“三、投资标的指数”中增加：“未来若出现标的指数不符合要求(因成份券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。”

并删除“如果指数发布机构变更或者停止上述标的指数编制及发布，或者上述标的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，通过适当的程序变更本基金的标的指数。其中，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（包括但不限于编制机构变更、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托管人协商一致后，报中国证监会备案并及时公告。”

(2)“基金的投资”章节中的“六、业绩比较基准”中增加“若基金标的指数发生变更，基金业绩比较基准随之变更，由基金管理人根据标的指数变更情形履行对应适当程序，并在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在中国证监会规定媒介上刊登公告。”

并删除“如果指数发布机构变更或者停止上述标的指数编制及发布，或者上述标的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业绩比较基准，或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的业绩比较基准推出时，本基金管理人可以在与基金托管人协商一致并按照监管部门要求履行适当程序后变更业绩比较基准并及时公告，而无需召开基金份额持有人大会。”

#### 4、“基金合同的变更、终止与基金财产的清算”章节

“基金合同的变更、终止与基金财产的清算”章节的“二、《基金合同》的终止事由”中增加：“出现标的指数不符合要求（因成份券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；”

## 二、修订内容的生效

上述修订自 2021 年 3 月 30 日起生效。本基金招募说明书、基金产品资料概要将做相应修改。

本基金管理人将于公告当日将修改后的本基金基金合同登载于规定网站，并在本基金最新一期更新的招募说明书中对上述相关内容进行相应修订。

## 三、重要提示

1、投资者欲了解本基金的详细情况，请登录本基金管理人网站（[htamc.htsc.com.cn](http://htamc.htsc.com.cn)）及中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）查询修改后的本基金的基金合同及招募说明书（更新）。

2、本次基金合同的修改系因相应法律法规发生变动而进行的修改，无需召开基金份额持有人大会。

3、本公告的解释权归华泰证券（上海）资产管理有限公司。

本基金管理人可以在法律法规和本基金合同规定范围内调整上述有关内容。如有疑问，投资者可访问本基金管理人网站（[htamc.htsc.com.cn](http://htamc.htsc.com.cn)）或拨打全国免长途话费的客户服务电话（4008895597/95597）咨询相关情况。

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财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。本基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，敬请投资者认真阅读基金的相关法律文件，并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。

华泰证券（上海）资产管理有限公司

2021年3月30日