

关于中泰中证可转债及可交换债券指数证券投资基金增加侧袋机制并根据《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侧袋机制指引（试行）》、《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《中泰中证可转债及可交换债券指数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可转债及可交换债券指数证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金合同、托管协议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：

本次基金合同针对侧袋机制的修订主要依据《公开募集证券投资基金侧袋机制指引（试行）》相关规定，主要修订内容为增加侧袋机制相关表述，涉及前言、释义、基金份额的申购与赎回、基金份额持有人大会、基金的投资、基金资产估值、基金费用与税收、基金的收益与分配、基金的信息披露等相关章节，同步修订了托管协议，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。

本次针对指数投资相关条款的修订主要根据《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。

除侧袋机制相关条款和指数投资相关条款外，基金管理人还根据本基金成立后新施行的《关于修改部分证券期货规章的决定》、《证券投资基金托管业务管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》等法规规定对基金法律文件相关条款表述进行了调整。

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
全文	<u>指定</u> 媒介、 <u>指定</u> 报刊、 <u>指定</u> 网站	<u>规定</u> 媒介、 <u>规定</u> 报刊、 <u>规定</u> 网站
资料保存时间	<u>15年</u>	<u>20年</u>
全文	<u>具有证券、期货相关业务资格</u> 的会计师	<u>符合《中华人民共和国证券法》规定</u> 的会计师
前言	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。	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侧袋机制指引(试行)》</u> (以下简称“ <u>《侧袋指引》</u> ”)、 <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。
前言	<u>七、本基金合同约定的基金产品资料概要编制、披露与更新</u>	<u>七、当本基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，基金管理人履行相应程序</u>

	<p><u>要求，自《信息披露办法》实施之日起一年后开始执行。</u></p>	<p><u>后，可以启用侧袋机制，具体详见基金合同和招募说明书的有关章节。侧袋机制实施期间，基金管理人将对基金简称进行特殊标识，并不办理侧袋账户的申购赎回。请基金份额持有人仔细阅读相关内容并关注本基金启用侧袋机制时的特定风险。</u></p> <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>
<p>释义</p>	<p>11、《销售办法》：指<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>20、<u>合格境外机构投资者</u>：指符合现行有效的相关法律法规规定可以投资于中国境内证券市场的中国境外的机构投资者</p> <p>21、<u>人民币合格境外机构投资者</u>：指符合现行有效的相关法律法规规定运用来自境外的人民币资金进行境内证券投资的境外机构投资者</p> <p>22、投资人、投资者：指个人投资者、机构投资者、<u>合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者</u>以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称</p> <p>59、<u>指定媒介</u>：指中国证监会<u>指定</u>的用以进行信息披露的全国性报刊及<u>指定</u>互联网网站（包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）等媒介</p>	<p>11、《销售办法》：指<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>22、<u>合格境外投资者</u>：指符合《合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者境内证券期货投资管理办法》（包括其不时修订）及相关法律法规规定使用来自境外的资金进行境内证券期货投资的境外机构投资者，<u>包括合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者</u></p> <p>23、投资人、投资者：指个人投资者、机构投资者、<u>合格境外投资者</u>以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称</p> <p>63、<u>规定媒介</u>：指中国证监会<u>规定</u>的用以进行信息披露的全国性报刊及<u>规定</u>互联网网站（包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）等媒介</p> <p><u>新增条款：15、《侧袋指引》：指中国证监会2020年7月10日颁布、同年8月1日实施的《公开募集证券投资基金侧袋机制指引（试行）》及颁布机关对其不时做出的修订</u></p> <p><u>16、《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</u></p>

		<p><u>数基金指引》及颁布机关对其不时做出的修订</u></p> <p><u>62、侧袋机制：指将基金投资组合中的特定资产从原有账户分离至一个专门账户进行处置清算，目的在于有效隔离并化解风险，确保投资者得到公平对待，属于流动性风险管理工具。侧袋机制实施期间，原有账户称为主袋账户，专门账户称为侧袋账户</u></p> <p><u>63、特定资产：包括（一）无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性的资产；（二）按摊余成本计量且计提资产减值准备仍导致资产价值存在重大不确定性的资产；（三）其他资产价值存在重大不确定性的资产</u></p> <p>其余释义条款序号相应调整。</p>
<p>申 购 和 赎 回</p>	<p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p><u>7、当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，</u>经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受基金申购申请。</p> <p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p><u>6、当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，</u>经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请。</p>	<p>五、申购和赎回的数量限制</p> <p><u>新增条款：5、如启动侧袋机制的，则在侧袋机制实施期间，基金管理人不得办理侧袋账户申购赎回。基金管理人应当依法保障主袋账户份额持有人享有基金合同约定的赎回权利，并根据主袋账户运作情况合理确定申购政策。</u></p> <p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p><u>7、当特定资产占前一估值日基金资产净值50%以上且</u>与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受基金申购申请。</p> <p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p><u>6、当特定资产占前一估值日基金资产净值50%以上且</u>与基金托管人协商确认后，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请。</p> <p><u>十九、实施侧袋机制期间本基金的申购与赎回</u></p> <p><u>当基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，基金管理人经与基金托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制，详见</u></p>

		<p><u>本基金合同第十二部分“基金的投资”第八条“侧袋机制的实施和投资运作安排”。</u></p> <p><u>本基金如启用和实施侧袋机制的,启用侧袋机制当日,基金管理人应以基金份额持有人的原有账户份额为基础,确认基金份额持有人的相应侧袋账户份额。在侧袋机制实施期间,基金管理人不得办理侧袋账户申购赎回。基金管理人依法保障主袋账户份额持有人享有基金合同约定的赎回权利,并根据主袋账户运作情况合理确定申购政策。本基金的申购和赎回安排详见招募说明书或届时发布的相关公告。</u></p>
持有人大会	<p>六、表决</p> <p>基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。</p>	<p>六、表决</p> <p>基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。<u>涉及实施侧袋机制期间的表决权安排,详见本部分第十条“实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定”。</u></p> <p><u>新增条款:十、实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定</u></p> <p><u>若本基金实施侧袋机制,则相关基金份额或表决权的比例指主袋份额持有人和侧袋份额持有人分别持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例,但若相关基金份额持有人大会召集和审议事项不涉及侧袋账户的,则仅指主袋份额持有人持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例:</u></p> <p><u>1、基金份额持有人行使提议权、召集权、提名权所需单独或合计代表相关基金份额10%以上(含10%);</u></p> <p><u>2、现场开会的到会者在权益登记日代表的基金份额不少于本基金在权益登记日相关基金份额的二分之一(含二分之一);</u></p> <p><u>3、通讯开会的直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日相关基金份额的二分之一(含二分之一);</u></p> <p><u>4、在参与基金份额持有人大会投票的基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益</u></p>

		<p><u>登记日相关基金份额的二分之一、召集人在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内就原定审议事项重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上(含三分之一)相关基金份额的持有人参与或授权他人参与基金份额持有人大会投票;</u></p> <p><u>5、现场开会由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的 50%以上(含 50%)选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人;</u></p> <p><u>6、一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上(含二分之一)通过;</u></p> <p><u>7、特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上(含三分之二)通过。</u></p> <p><u>侧袋机制实施期间,基金份额持有人大会审议事项涉及主袋账户和侧袋账户的,应分别由主袋账户、侧袋账户的基金份额持有人进行表决,同一类别账户内的每份基金份额具有平等的表决权。表决事项未涉及侧袋账户的,侧袋账户份额无表决权。</u></p> <p><u>侧袋机制实施期间,关于基金份额持有人大会的相关规定以本节特殊约定内容为准,本节没有规定的适用上文相关约定。</u></p>
基金的投资策略		<p><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></p>
标的指数	<p>1、标的指数</p> <p>本基金的标的指数是中证可转债及可交换债券指数。</p> <p><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</u></p>	<p>1、标的指数</p> <p>本基金的标的指数是中证可转债及可交换债券指数。</p> <p><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</u></p>

	<p><u>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></p> <p><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></p>	<p><u>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></p> <p><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></p>
基金的投资		<p><u>八、侧袋机制的实施和投资运作安排</u></p> <p><u>当基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，根据最大限度保护基金份额持有人利益的原则，基金管理人经与基金托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制，无需召开基金份额持有人大会审议。侧袋机制实施期间，基金的各项投资运作指标和基金业绩指标应当以主袋账户资产为基准。基金管理人原则上应当在侧袋机制启用后 20 个交易日内完成对主袋账户投资组合的调整，因资产流动性受限等中国证监会规定的情形除外。</u></p> <p><u>侧袋机制实施期间，基金合同约定的投资组合比例、投资策略、组合限制、业绩比较基</u></p>

		<p><u>准、风险收益特征等约定仅适用于主袋账户。</u></p> <p><u>侧袋账户的实施条件、实施程序、运作安排、投资安排、特定资产的处置变现和支付等对投资者权益有重大影响的事项详见招募说明书的规定。</u></p>
基金资产估值	<p>七、暂停估值的情形</p> <p><u>3、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商一致的，基金管理人应当暂停估值。</u></p>	<p>七、暂停估值的情形</p> <p><u>3、当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上的，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停估值。</u></p> <p><u>新增条款：十、实施侧袋机制期间的基金资产估值</u></p> <p><u>本基金实施侧袋机制的，应根据本部分的约定对主袋账户资产进行估值并披露主袋账户的基金份额净值和基金份额累计净值，暂停披露侧袋账户的基金净值信息。</u></p>
基金的费用和税收		<p><u>新增条款：四、实施侧袋机制期间的基金费用</u></p> <p><u>本基金实施侧袋机制的，与侧袋账户有关的费用可以从侧袋账户中列支，但应待侧袋账户资产变现后方可列支，有关费用可酌情收取或减免，但不得收取侧袋账户的管理费，详见招募说明书或相关公告。</u></p> <p>其余条款序号相应调整。</p>
基金的收益和分配		<p><u>新增条款：七、实施侧袋机制期间的收益分配</u></p> <p><u>本基金实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配，详见招募说明书的规定。</u></p>
基金的信息披露		<p>(六) 基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告新增条款：<u>基金管理人应当在基金定期报告中披露报告期内特定资产处置进展情况，披露报告期末特定资产可变现净值或净值区间的，应同时注明不作为特定资产最终变现价格的承诺。</u></p> <p>(七) 临时报告</p> <p><u>新增条款：</u></p> <p><u>27、本基金启用侧袋机制、处置特定资产、终止侧袋机制(基金管理人应当在启用侧袋机制和终止侧袋机制后，及时聘请符合《中华人</u></p>

		<p>民共和国证券法》规定的会计师事务所进行审计并披露专项审计意见);</p> <p>(十二)实施侧袋机制期间的信息披露新增条款:</p> <p><u>本基金实施侧袋机制的,相关信息披露义务人应当根据法律法规、本基金合同和招募说明书的规定进行信息披露,详见招募说明书的规定。</u></p>
基金合同终止事由		<p><u>3、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;</u></p>

基金管理人同步对招募说明书、托管协议、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。