

太平基金管理有限公司关于旗下部分基金根据指数基金指引修订法律文件有关条款的公告

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运作指引第3号—指数基金指引》等法律法规、各基金基金合同、托管协议、招募说明书及其更新等规定,经与各基金托管人协商一致,并向中国证监会备案,太平基金管理有限公司(以下简称“本公司”)对旗下太平MSCI 香港价值增强指数证券投资基金、太平中债1-3年政策性金融债指数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24日起正式生效。

现将相关事项公告如下:

一、基金合同修改的主要内容

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、“基金的投资”章节

增加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、“基金合同的变更、终止与基金财产的清算”章节

增加标的指数不符合要求、指数编制机构退出等情形下,持有人大会未通过处置方案的清算情形。

5、太平中债1-3年政策性金融债指数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、托管协议、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24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、托管协议、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(www.taipingfund.com.cn)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) 太平基金管理有限公司客户服务电话：400-028-8699/021-61560999

2) 太平基金管理有限公司网站：www.taipingfund.com.cn

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。

太平基金管理有限公司

2021年3月24日

附件：

1、《太平 MSCI 香港价值增强指数证券投资基金基金合同》修订对照表

修改前	修改后
第一部分 前言	
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》”）、《证券基金经营机构参与内地与香港股票市场交易互联互通指引》、《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“《流动性管理规定》”）和其他有关法律法规。	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》”）、《证券基金经营机构参与内地与香港股票市场交易互联互通指引》、《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》（以下简称“《指数基金指引》”）</u> 和其他有关法律法规。
无	<u>九、本基金跟踪 MSCI 香港价值增强指数，存在跟踪误差控制未达约定目标、指数编制机构停止服务、成份股停牌或退市等潜在风险，具体风险详见招募说明书“风险揭示”部分。</u>
第二部分 释义	
无	<u>58、《指数基金指引》：指中国证监会 2021 年 1 月 18 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</u>
第十二部分 基金的投资	
四、投资策略 无	四、投资策略 <u>本基金运作过程中，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，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。</u>
六、业绩比较基准 …… MSCI 香港价值增强指数由 MSCI 进行编制， <u>以港股通标的股票为基础</u> ，在避免“价值陷阱”的前提下，精选出最具价值特征的股票组成成份股，每半年度对指数成份股进行调整。 <u>如果指数发布机构变更或者停止上述标的指</u>	六、业绩比较基准 …… MSCI 香港价值增强指数由 MSCI 进行编制， <u>以港股通标的股票为样本空间，用“固定数量证券”方法构建指数成份组合</u> ，在避免“价值陷阱”的前提下，精选出最具价值特征的股票组成成份股， <u>以反映港股通标的范围内，具有长</u>

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,并同时更换本基金的基金名称与业绩比较基准。若标的指数、业绩比较基准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),则无需召开基金份额持有人大会,基金管理人可在取得基金托管人同意后变更标的指数和业绩比较基准,报中国证监会备案并及时公告。——	<u>期投资价值企业的整体表现,每半年度对指数成份股进行调整。</u> <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或法律法规、监管机构另有规定的情形除外)、指数编制机构退出等情形,基金管理人应当自相关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,并在六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,本基金合同自动终止。</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并实施前,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>
第十九部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算	
二、《基金合同》的终止事由 无	二、《基金合同》的终止事由 <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或法律法规、监管机构另有规定的情形除外)、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>
注:“第二十四部分基金合同内容摘要”涉及上述内容的,一并修改。	

2、《太平中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金基金合同》修订对照表

修改前	修改后
基金合同全文	
指定媒介	规定媒介
具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所	符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所
第一部分 前言	
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	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

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。	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。
七、本基金合同约定的基金产品资料概要编制、披露与更新要求，自《信息披露办法》实施之日起一年后开始执行。	删除
无	<u>七、本基金跟踪太平中债1-3年政策性金融债指数，存在跟踪误差控制未达约定目标、指数编制机构停止服务、成份券停牌或违约等潜在风险，具体风险详见招募说明书“风险揭示”部分。</u>
第二部分 释义	
11、《销售办法》：指中国证监会 2013 年 3 月 15 日颁布、同年 6 月 1 日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订	11、《销售办法》：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
20、合格境外机构投资者：指符合 <u>《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》</u> 及现时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	20、合格境外机构投资者：指符合 <u>《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暂行办法》</u> 及现时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
21、人民币合格境外机构投资者：指按照 <u>《人民币合格境外机构投资者境内证券投资试点办法》</u> 及相关法律法规规定，运用来自境外的人民币资金进行境内证券投资的境外法人	21、人民币合格境外机构投资者：指按照 <u>《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暂行办法》</u> 及相关法律法规规定，运用来自境外的人民币资金进行境内证券投资的境外法人
57、 指定 媒介：指中国证监会 指定 的用以进行信息披露的全国性报刊及指定互联网网站（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	57、 规定 媒介：指 <u>符合</u> 中国证监会 规定条件 的、用以进行信息披露的全国性报刊及指定互联网网站（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
无	<u>61、《指数基金指引》：指中国证监会 2021 年 1 月 18 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</u>
第三部分 基金的基本情况	
四、标的指数 如果指数发布机构变更或者停止上述标的指	四、标的指数 未来若出现标的指数不符合要求（因成份券价

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，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。若标的指数、业绩比较基准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、指数更新等），则无需召开基金份额持有人大会，基金管理人可在取得基金托管人同意后变更标的指数和业绩比较基准，报中国证监会备案并及时公告。	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或法律法规、监管机构另有规定的情形除外）、指数编制机构退出等情形，基金管理人应当自相关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，并在六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，本基金合同自动终止。 <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并实施前，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>
第七部分 基金合同当事人及权利义务	
一、基金管理人 （二）基金管理人的权利与义务 2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于： （16）按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上；	一、基金管理人 （二）基金管理人的权利与义务 2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于： （16）按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 20 年以上；
二、基金托管人 （二）基金托管人的权利与义务 2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于： （11）保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；	二、基金托管人 （二）基金托管人的权利与义务 2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于： （11）保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 20 年以上；
第十二部分 基金的投资	
三、标的指数 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，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。若标的指数、业绩比较基准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、指数更新等），则无需召开基金份额持有人大会，基金管理人可在取得基金托管人同意后变更标的指数和业绩比较基准，报中国证监会备案并及时公告。	三、标的指数 <u>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或法律法规、监管机构另有规定的情形除外）、指数编制机构退出等情形，基金管理人应当自相关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，并在六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，本基金合同自动终止。</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并实施前，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>

四、投资策略 （二）债券投资策略 2、替代性策略 无	四、投资策略 （二）债券投资策略 2、替代性策略 <u>本基金运作过程中，当指数成份证券面临违约风险，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，履行内部决策程序后及时对相关成份证券进行调整。</u>
第十九部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算	
二、《基金合同》的终止事由 无	二、《基金合同》的终止事由 <u>3、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或法律法规、监管机构另有规定的情形除外）、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>
七、基金财产清算账册及文件的保存 基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。	七、基金财产清算账册及文件的保存 基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 20 年以上。
第二十二部分 基金合同的效力	
1、《基金合同》经基金管理人、基金托管人双方加盖公章或合同专用章以及双方法定代表人或授权代表签字（或盖章）并在募集结束后经基金管理人向中国证监会办理基金备案手续，并经中国证监会书面确认后生效。	1、《基金合同》经基金管理人、基金托管人双方加盖公章或合同专用章以及双方法定代表人或授权代表签字（或盖章），<u>经基金管理人向中国证监会办理基金备案手续，并经中国证监会书面确认后生效。</u>
注：“第二十四部分基金合同的内容摘要”涉及上述内容的，一并修改。	