

**上银基金管理有限公司关于上银中债 1-3 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《上银中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金基金合同》的约定，经与上银中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金（基金代码：009560，以下简称“本基金”）基金托管人南京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，上银基金管理有限公司（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 31 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、“第一部分 前言”章节

“前言”章节第一条第 2 款增加：“《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》”）”。

“前言”章节第三条增加：“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、成份券停牌或违约等潜在风险，详见本基金招募说明书”。

2、“第二部分 释义”章节

“释义”章节增加：“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”。

3、“第三部分 基金的基本情况”章节

将“基金的基本情况”章节第四条最后一段内容调整为：“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。

本基金运作过程中，当指数成份券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，履行内部决策程序后及时对相关成份券进行调整”。

4、“第十二部分 基金的投资”章节

将“基金的投资”章节第三条以及第六条最后一段内容调整为：“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。

本基金运作过程中，当指数成份券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，履行内部决策程序后及时对相关成份券进行调整”。

5、“第十九部分 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”章节第二条中增加：“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”。

6、“第二十四部分 基金合同内容摘要”对上述修改内容一并进行修改。

二、重要提示

1、修改后的基金合同自2021年3月31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基金合同的约定。修改后的基金合同全文将与本公告同日登载于基金管理人网站（www.boscam.com.cn）及中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）。根据修改的基金合同，基金管理人将更新本基金的招募说明书和基金产品资料概要相关内容，并揭示风险。

2、投资者可以通过基金管理人网站（www.boscam.com.cn）或客户服务电话（021-60231999）咨询有关详情。

三、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。基金投资有风险，投资者在做出投资决策之前，请认真阅读基金合同、招募说明书（更新）和基金产品资料概要（更新）等法律文件，充分认识基金的风险收益特征和产品特性，认真考虑基金存在的各项风险因素，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等因素充分考虑自身的风险承受能力，在了解产品情况及销售适当性意见的基础上，理性判断并谨慎做出投资决策。本基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。

特此公告。

上银基金管理有限公司

二〇二一年三月三十一日