

# 关于恒生交易型开放式指数证券投资基金 申购赎回有关事项的提示性公告

根据华夏基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）于2017年7月29日发布的《关于恒生交易型开放式指数证券投资基金申购赎回有关事项的公告》，自2017年9月1日起，基金管理人决定对恒生交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）申购、赎回替代金额的有关处理规则进行调整，投资者在本基金的申购赎回代办证券公司办理本基金申购、赎回业务时，基金管理人将暂不再于T日（即申购或赎回申请受理当日，下同）在香港市场买入或卖出可以现金替代的组合证券。基金管理人将根据上述调整修订本基金招募说明书相关内容。为便于投资者提前进行相关业务安排，现将具体事宜提示如下：

## 一、调整后业务处理规则

### （一）申购替代金额的处理规则

T日，基金管理人根据申购赎回清单收取替代金额。T+2日（指香港交易所交易日）日终，依据替代金额与经T+2日（指香港交易所交易日）最新汇率调整的证券T+2日（指香港交易所交易日）收盘价的差额，确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项；没有T+2日（指香港交易所交易日）收盘价的证券，依据替代金额与经T+2日（指香港交易所交易日）最新汇率调整的证券最近收盘价的差额，确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项。

### （二）赎回对应替代金额的处理规则

T+2日（指香港交易所交易日）日终，依据经T+2日（指香港交易所交易日）最新汇率调整的证券T+2日（指香港交易所交易日）收盘价，确定基金应支付的替代金额；没有T+2日（指香港交易所交易日）收盘价的证券，依据经T+2日（指香港交易所交易日）最新汇率调整的证券最近收盘价，确定基金应支付的替代金额。

在此期间若该部分可以现金替代证券发生除息、送股（转增）、配股等重要权益变动，则进行相应调整。如遇证券长期停牌、流动性不足等特殊情况，可参照证券的估值价格对结算价格进行调整，如果基金管理人认为该证券复牌后的价格可能存在较大波动，且可能对基金资产净值产生较大影响，为了更好地维护持有人利益，该证券对应的现金替代退补款或现金替代款的清算交收可在其复牌后按照实际交易成本办理。

## 二、对招募说明书（更新）“十、基金份额的申购与赎回（八）申购赎回清单的内容与格式”的修订

（一）在“4、现金替代相关内容（2）可以现金替代”第2点、第4点中有关T日买入、卖出证券内容后增加“基金管理人暂不再于T日买入、卖出证券”的描述，具体如下：

### “②申购替代金额的处理程序

T日，基金管理人根据申购赎回清单收取替代金额。T日基金管理人将买入证券。T日日终，基金管理人已买入的证券，依据替代金额与经最新汇率调整的证券的实际买入成本的差额，确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项（根据基金管理人于2017年7月29日发布的《关于恒生交易型开放式指数证券投资基金申购赎回有关事项的公告》，基金管理人自2017年9月1日起暂不再于T日买入、卖出证券）；未买入的证券，T+2日（指香港交易所交易日）日终，依据替代金额与经最新汇率调整的证券T+2日（指香港交易所交易日）收盘价的差额，确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项；未买入且没有T+2日（指香港交易所交易日）收盘价的证券，依据替代金额与经最新汇率调整的证券最近收盘价的差额，确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项。在此期间若该部分证券发生除息、送股（转增）、配股等重要权益变动，则进行相应调整。正常情况下，T+5日（指开放日）内，基金管理人将应退款和补款的明细及汇总数据发送给登记结算机构，登记结算机构办理现金替代多退少补资金的清算，并将结果发送给相关申购赎回代理机构和基金托管人，相关款项的交收于数据发送后的第1个工作日内完成。如遇证券长期停牌、

流动性不足等特殊情况，可参照证券的估值价格对结算价格进行调整，如果基金管理人认为该证券复牌后的价格可能存在较大波动，且可能对基金资产净值产生较大影响，为了更好的维护持有人利益，该证券对应的现金替代退补款的清算交收可在其复牌后按照实际交易成本办理。在此期间若该证券发生除息、送股（转增）、配股等重要权益变动，则进行相应调整。上述汇率目前采用汇率公允价。汇率公允价包括中国外汇交易中心最新收盘价、与基金托管人商定的其他公允价格（如：中国人民银行或国家外汇管理局或中国外汇交易中心正式对外发文后公布的北京时间 16:30 的人民币兑主要外汇当日收盘价，如上述机构未正式发文规定公布上述收盘价，则为中国人民银行或其授权机构最新公布的人民币汇率中间价）等。”

#### “④赎回对应的替代金额的处理程序

T 日基金管理人将卖出证券。T 日日终，基金管理人已卖出的证券，依据最新汇率调整的证券的实际卖出价值确定基金应支付的替代金额（根据基金管理人于 2017 年 7 月 29 日发布的《关于恒生交易型开放式指数证券投资基金申购赎回有关事项的公告》，

基金管理人自 2017 年 9 月 1 日起暂不再于 T 日买入、卖出证券）；未卖出的证券，T+2 日（指香港交易所交易日）日终，依据经最新汇率调整的证券 T+2 日（指香港交易所交易日）收盘价，确定基金应支付的替代金额；未卖出且没有 T+2 日（指香港交易所交易日）收盘价的证券，依据经最新汇率调整的证券最近收盘价，确定基金应支付的替代金额。在此期间若该部分证券发生除息、送股（转增）、配股等重要权益变动，则进行相应调整。正常情况下，T+5 日（指开放日）内，基金管理人将应支付的替代金额的明细及汇总数据发送给登记结算机构，登记结算机构办理现金替代资金的清算，并将结果发送给相关申购赎回代理机构和基金托管人，相关款项的交收于数据发送后的第 1 个工作日内完成。如遇证券长期停牌、流动性不足等特殊情况，可参照证券的估值价格，对结算价格进行调整，如果基金管理人认为该证券复牌后的价格可能存在较大波动，且可能对基金资产净值产生较大影响，为了更好的维护持有人利益，该证券对应的现金替代款的清算交收可在其复牌后按照实际交易成本办理。在此期间若该证券发生除息、送股（转增）、配股等重要权益变动，则进行相应调整。上述汇率目前采用汇率公允价。汇率公允价包括中国外汇交易中心最新收盘价、与基金托管人商定的其他公允价格（如：中国人民银行或国家外汇管理局或中国外汇交易中心正式对外发文后公布的北京时间 16:30 的人民币兑主要外汇当日收盘价，如上述机构未正式发文规定公布上述收盘价，则为中国人民银行或其授权机构最新公布的人民币汇率中间价）等。”

（二）删除“4、现金替代相关内容（2）可以现金替代”中第 5 点关于 T 日买入、卖出证券的特别提示，修订为以下描述：

“⑤基金管理人可以根据具体情况，调整上述②和④的申购、赎回替代金额的处理程序、规则等，并在招募说明书更新及其他公告中披露。”

### 三、申购赎回代办证券公司

截至目前，本基金申购赎回代办证券公司包括：中信证券、国信证券、招商证券、国泰君安证券、申万宏源证券、光大证券、中金公司、海通证券、中国银河证券、华泰证券、中信建投证券、兴业证券、中信证券（山东）、东吴证券、信达证券、东方证券、长城证券、高华证券、中泰证券、广发证券、联讯证券。自 2017 年 9 月 1 日起，投资者在上述证券公司及本基金新增申购赎回代办证券公司办理本基金的申购、赎回业务时，均按照“一、调整后业务处理规则”及修订后的招募说明书中相关规定进行业务处理。未来如基金管理人再次调整上述申购、赎回业务处理规则，基金管理人将另行公告，敬请投资者留意。

### 四、特别提请投资者关注事项

（一）原在中信证券、国信证券、招商证券、国泰君安证券、申万宏源证券、光大证券、中金公司、海通证券办理本基金申购、赎回的投资者，自 2017 年 9 月 1 日起，如仍在上述机构办理本基金的申购、赎回业务，基金管理人将暂不再于 T 日在香港市场买入或卖出证券，具体业务办理将按照“一、调整后业务处理规则”及修订后的招募说明书的相关规定进行。未来如基金管理人再次调整上述申购、赎回业务处理规则，基金管理人将另行公告，敬请投资者留意。

（二）本基金目前采用现金申购赎回，投资者的申购、赎回价格依据招募说明书（更新）约定的原则确定，可能受组合证券的价格、汇率等因素影响，与申请当日的基金份额净值或有不同，投资者须承担其中的相

关费用及汇率波动等风险。

（三）投资者在申购赎回代办证券公司办理本基金申购、赎回业务前，应全面了解相关业务规则及可能产生的风险。本基金各申购赎回代办证券公司的具体业务办理流程、需要提交的文件等不尽相同，请投资者在办理业务前咨询办理业务的申购赎回代办证券公司。如申购赎回代办证券公司的上述业务处理规则与本公司调整后的不同，以本公司的业务处理规则为准。

如有疑问，请登录本公司网站（[www.ChinaAMC.com](http://www.ChinaAMC.com)）或拨打本公司客户服务电话（400-818-6666）获取相关信息。

特此公告

华夏基金管理有限公司

二〇一七年八月二十六日