

华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下 4 只证券投资基金修改基金合同和托管协议的公告

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参与转融通证券出借业务指引（试行）》等法律法规以及相关基金合同和托管协议的有关规定，经与基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，华泰柏瑞基金管理有限公司（以下简称“本公司”）决定对本公司旗下的 4 只证券投资基金的基金合同和托管协议进行修订。本次修订内容自 2019 年 10 月 16 日起生效。本次修订系因相应的法律法规发生变动而应当进行的必要修改，且对基金份额持有人的利益无实质性不利影响，不需召开基金份额持有人大会。现将有关修订内容进行公告。

为确保本基金参与转融通证券出借业务符合法律、法规的规定，本公司根据《公开募集证券投资基金参与转融通证券出借业务指引（试行）》就基金合同和托管协议的相关内容进行了修订。基金合同和托管协议的具体修订详见附件对照表。

本次修订涉及的 4 只证券投资基金如下：

基金全称

1 华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金

2 华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

3 华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

4 华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金

重要提示

本公司将于公告当日，将修改后的 4 只证券投资基金的《基金合同》、《托管协议》登载于公司网站。

本公司将根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》规定更新的《招募说明书》中对上述内容进行相应修改。

投资者可通过本基金管理人的网站：www.huatai-pb.com 或客户服务电话：400-888-0001、（021）38784638 了解详情。

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。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。基金管理人提醒投资者，投资者投资于基金前应认真阅读基金合同、招募说明书等文件。敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

华泰柏瑞基金管理有限公司

2019 年 10 月 16 日

华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金修改基金合同和托管协议条款的修订对照表

修改前 修改后

华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同

第二部分释义

无 69、转融通证券出借业务：指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司出借证券，中国证券金融股份有限公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务；

第九部分基金合同当事人及权利义务

（二）基金管理人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

.....

（13）在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资及转融通业务；（二）基金管理人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

.....

（13）在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资及转融通证券出借业务；

第十四部分基金的投资

二、投资范围

.....

本基金将根据法律法规的规定，在履行适当程序后参与融资及转融通证券出借业务。

三、投资策略

.....

本基金还可以在条件允许的情况下在履行适当的程序后参与融资及转融通证券出借业务。

二、投资范围

.....

本基金将根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。

三、投资策略

.....

为更好实现投资目标，在加强风险防范并遵守审慎原则的前提下，本基金可根据投资管理需要参与转融通证券出借业务。

四、投资限制

1、组合限制

.....

（19）本基金在任何交易日日终，参与转融通证券出借交易的资产不得超过基金资产净值的50%，证券出借的平均剩余期限不得超过30天，平均剩余期限按照市值加权平均计算；

（20）法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他投资限制。

除上述第（2）、（10）、（13）、（15）项另有约定外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整。但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。四、投资限制

1、组合限制

.....

（19）本基金参与转融通证券出借业务，需遵循下述比例限制：

1) 出借证券资产不得超过基金资产净值的30%，出借期限在10个交易日以上的出借证券应纳入《流动性风险管理规定》所述流动性受限证券的范围；

2) 参与出借业务的单只证券不得超过基金持有该证券总量的30%；

3) 最近6个月内日均基金资产净值不得低于2亿元；

4) 证券出借的平均剩余期限不得超过30天，平均剩余期限按照市值加权平均计算；

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合上述规定的，基金管理人不得新增出借业务；

(20) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他投资限制。

除上述第 2)、(10)、(13)、(15)、(19) 项另有约定外, 因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的, 基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的, 从其规定。

第十六部分基金资产估值

三、估值方法

.....

6、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的, 基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后, 按最能反映公允价值的价格估值。

7、相关法律法规以及监管部门有强制规定的, 从其规定。如有新增事项, 按国家最新规定估值。 三、估值方法

.....

6、基金参与转融通证券出借业务的, 按照相关法律法规和行业协会的相关规定进行估值。

7、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的, 基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后, 按最能反映公允价值的价格估值。

8、相关法律法规以及监管部门有强制规定的, 从其规定。如有新增事项, 按国家最新规定估值。

八、特殊情况的处理

1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 6 项进行估值时, 所造成的误差不作为基金资产估值错误处理;

..... 八、特殊情况的处理

1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 7 项进行估值时, 所造成的误差不作为基金资产估值错误处理;

.....

第二十部分基金的信息披露

(十三) 参与融资交易和转融通证券出借业务的信息披露

基金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和招募说明书(更新)等文件中披露基金参与融资交易和转融通证券出借业务情况, 包括投资策略、业务开展情况、损益情况、风险及其管理情况等。 (十三) 参与融资交易和转融通证券出借业务的信息披露 基金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和招募说明书(更新)等文件中披露基金参与融资交易和转融通证券出借业务情况, 包括投资策略、业务开展情况、损益情况、风险及其管理情况等, 并就转融通证券出借业务在报告期内发生的重大关联交易事项做详细说明。

华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金托管协议

三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

(一)

本基金将根据法律法规的规定, 在履行适当程序后参与融资及转融通证券出借业务。

(一)

本基金将根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。

(二) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定, 对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督:

.....

18. 本基金在任何交易日日终, 参与转融通证券出借交易的资产不得超过基金资产净值的

50%，证券出借的平均剩余期限不得超过 30 天，平均剩余期限按照市值加权平均计算；

19. 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资比例限制。

除上述第 2、10、12 项另有约定外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

（二）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督：

.....

18. 本基金参与转融通证券出借业务，需遵循下述比例限制：

1) 出借证券资产不得超过基金资产净值的 30%，出借期限在 10 个交易日以上的出借证券应纳入《流动性风险管理规定》所述流动性受限证券的范围；

2) 参与出借业务的单只证券不得超过基金持有该证券总量的 30%；

3) 最近 6 个月内日均基金资产净值不得低于 2 亿元；

4) 证券出借的平均剩余期限不得超过 30 天，平均剩余期限按照市值加权平均计算；

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合上述规定的，基金管理人不得新增出借业务；

19. 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资比例限制。

除上述第 2、10、12、18 项另有约定外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内。

八、基金资产净值计算和会计核算

2. 估值方法

.....

（6）如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

（7）相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

2. 估值方法

.....

（6）基金参与转融通证券出借业务的，按照相关法律法规和行业协会的相关规定进行估值。

（7）如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

（8）相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

3. 特殊情形的处理

（1）基金管理人或基金托管人按估值方法的第（6）项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理；

（1）基金管理人或基金托管人按估值方法的第（7）项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理；

注：基金合同内容摘要涉及上述内容的一并修改。

华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

修改基金合同和托管协议条款的修订对照表

修改前 修改后

华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同

第二部分释义

无 71、转融通证券出借业务：指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司出借证券，中国证券金融股份有限公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务

第七部分基金合同当事人及权利义务

(二) 基金管理人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

……

(13) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资、融券及转融通业务；

(二) 基金管理人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

……

(13) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资、融券及转融通证券出借业务；

第十二部分基金的投资

二、投资范围

本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包括中小板、创业板以及其他经中国证监会核准发行的股票）、债券（包括国债、金融债、企业/公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、权证、股指期货、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。 二、投资范围

本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包括中小板、创业板以及其他经中国证监会核准发行的股票）、债券（包括国债、金融债、企业/公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、权证、股指期货、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金可根据法律法规的规定，参与转融通证券出借业务。

三、投资策略

…… 三、投资策略

……

为更好实现投资目标，在加强风险防范并遵守审慎原则的前提下，本基金可根据投资管理需要参与转融通证券出借业务。本基金将在分析市场情况、投资者类型与结构、基金历史申赎情况、出借证券流动性情况等因素的基础上合理确定出借证券的范围、期限和比例。

四、投资限制

1、组合限制

……

(21) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他投资限制。

除上述第(9)、(19)、(20)项外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规另有规定的，从其规定。 四、投资限制

1、组合限制

.....

(21) 本基金参与转融通证券出借业务，需遵循下述比例限制：

- 1) 出借证券资产不得超过基金资产净值的 30%，出借期限在 10 个交易日以上的出借证券应纳入《流动性风险管理规定》所述流动性受限证券的范围；
 - 2) 参与出借业务的单只证券不得超过基金持有该证券总量的 30%；
 - 3) 最近 6 个月内日均基金资产净值不得低于 2 亿元；
 - 4) 证券出借的平均剩余期限不得超过 30 天，平均剩余期限按照市值加权平均计算；
- 因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合上述规定的，基金管理人不得新增出借业务；

(22) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他投资限制。

除上述第 (9)、(19)、(20)、(21) 项外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规另有规定的，从其规定。

八、基金的融资融券及转融通业务

本基金可以根据届时有效的有关法律法规和政策的规定进行融资融券及转融通业务。无第十四部分基金资产估值

三、估值方法

.....

6、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

7、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。三、估值方法

.....

6、基金参与转融通证券出借业务的，按照相关法律法规和行业协会的相关规定进行估值。

7、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

8、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

八、特殊情况的处理

1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 6 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理；

..... 八、特殊情况的处理

1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 7 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理；

.....

第十八部分基金的信息披露

.....

(十三) 参与转融通证券出借业务的信息披露

本基金参与转融通证券出借业务的，基金管理人应当在基金定期报告等文件中披露基金参与出借业务的情况，并就报告期内发生的重大关联交易事项做详细说明。

华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议

三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，建立相关的技术系统，对基金管理人的投资运作进行监督。主要包括以下方面：

1、对基金的投资范围、投资对象进行监督。基金管理人应将拟投资的股票库、债券库等各投资品种的具体范围提供给基金托管人。基金管理人可以根据实际情况的变化，对各投资品种的具体范围予以更新和调整，并及时通知基金托管人。基金托管人根据上述投资范围对基金的投资进行监督；

本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包括中小板、创业板以及其他经中国证监会核准发行的股票）、债券（包括国债、金融债、企业/公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、权证、股指期货、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金投资标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 95%，且不低于基金非现金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。（一）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，建立相关的技术系统，对基金管理人的投资运作进行监督。主要包括以下方面：

1、对基金的投资范围、投资对象进行监督。基金管理人应将拟投资的股票库、债券库等各投资品种的具体范围提供给基金托管人。基金管理人可以根据实际情况的变化，对各投资品种的具体范围予以更新和调整，并及时通知基金托管人。基金托管人根据上述投资范围对基金的投资进行监督；

本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包括中小板、创业板以及其他经中国证监会核准发行的股票）、债券（包括国债、金融债、企业/公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、权证、股指期货、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金可根据法律法规的规定，参与转融通证券出借业务。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金投资标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 95%，且不低于基金非现金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。

2、对基金投融资比例进行监督；

.....

（21）法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他投资限制。

除上述第（9）、（19）、（20）项外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规另有规定的，从其规定。 2、对基金投融资比例进行监督；

.....

（21）本基金参与转融通证券出借业务，需遵循下述比例限制：

1) 出借证券资产不得超过基金资产净值的 30%，出借期限在 10 个交易日以上的出借证券应纳入《流动性风险管理规定》所述流动性受限证券的范围；

2) 参与出借业务的单只证券不得超过基金持有该证券总量的 30%；

3) 最近 6 个月内日均基金资产净值不得低于 2 亿元；

4) 证券出借的平均剩余期限不得超过 30 天, 平均剩余期限按照市值加权平均计算; 因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合上述规定的, 基金管理人不得新增出借业务;

(22) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他投资限制。

除上述第 (9)、(19)、(20)、(21) 项外, 因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的, 基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规另有规定的, 从其规定。

注: 基金合同内容摘要涉及上述内容的一并修改。

华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

修改基金合同和托管协议条款的修订对照表

修改前 修改后

华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同

第二部分释义

无 58、转融通证券出借业务: 指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司出借证券, 中国证券金融股份有限公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务

第七部分基金合同当事人及权利义务

(二) 基金管理人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定, 基金管理人的权利包括但不限于:

.....

(13) 在法律法规允许的前提下, 为基金的利益依法为基金进行融资、融券及转融通业务;

(二) 基金管理人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定, 基金管理人的权利包括但不限于:

.....

(13) 在法律法规允许的前提下, 为基金的利益依法为基金进行融资、融券及转融通证券出借业务;

第十二部分基金的投资

二、投资范围

本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具, 包括目标 ETF、标的指数成份股及备选成份股、非成份股、债券 (包括国债、金融债、企业/公司债、次级债、可转换债券 (含分离交易可转债)、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、权证、股指期货、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具 (但须符合中国证监会的相关规定)。

二、投资范围
本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具, 包括目标 ETF、标的指数成份股及备选成份股、非成份股、债券 (包括国债、金融债、企业/公司债、次级债、可转换债券 (含分离交易可转债)、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、权证、股指期货、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具 (但须符合中国证监会的相关规定)。

本基金可根据法律法规的规定, 参与转融通证券出借业务。

三、投资策略

..... 三、投资策略

.....

为更好实现投资目标, 在加强风险防范并遵守审慎原则的前提下, 本基金可根据投资管理需要参与转融通证券出借业务。本基金将在分析市场情况、投资者类型与结构、基金历史申赎

情况、出借证券流动性情况等的基础上合理确定出借证券的范围、期限和比例。

四、投资限制

1、组合限制

.....

(20) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他投资限制。

除上述第(2)、(10)、(18)、(19)项外,因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的,基金管理人应当在10个交易日内进行调整。法律法规另有规定的,从其规定。

1、组合限制

.....

(20) 本基金参与转融通证券出借业务,需遵循下述比例限制:

1) 出借证券资产不得超过基金资产净值的30%,出借期限在10个交易日以上的出借证券应纳入《流动性风险管理规定》所述流动性受限证券的范围;

2) 参与出借业务的单只证券不得超过基金持有该证券总量的50%;

3) 最近6个月内日均基金资产净值不得低于2亿元;

4) 证券出借的平均剩余期限不得超过30天,平均剩余期限按照市值加权平均计算;

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合上述规定的,基金管理人不得新增出借业务;

(21) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他投资限制。

除上述第(2)、(10)、(18)、(19)、(20)项外,因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的,基金管理人应当在10个交易日内进行调整。法律法规另有规定的,从其规定。

七、基金的融资融券及转融通业务

本基金可以根据届时有效的有关法律法规和政策的规定进行融资融券及转融通业务。无第十四部分基金资产估值

三、估值方法

.....

7、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的,基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的价格估值。

8、相关法律法规以及监管部门有强制规定的,从其规定。如有新增事项,按国家最新规定估值。

.....

7、基金参与转融通证券出借业务的,按照相关法律法规和行业协会的相关规定进行估值。

8、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的,基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的价格估值。

9、相关法律法规以及监管部门有强制规定的,从其规定。如有新增事项,按国家最新规定估值。

八、特殊情况的处理

1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第7项进行估值时,所造成的误差不作为基金资产估值错误处理;

..... 八、特殊情况的处理

1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第8项进行估值时,所造成的误差不作为基金资产估值错误处理;

.....

第十八部分基金的信息披露

.....

(十) 参与转融通证券出借业务的信息披露

本基金参与转融通证券出借业务的，基金管理人应当在基金定期报告等文件中披露基金参与出借业务的情况，并就报告期内发生的重大关联交易事项做详细说明。

华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议

三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，建立相关的技术系统，对基金管理人的投资运作进行监督。主要包括以下方面：

1、对基金的投资范围、投资对象进行监督。基金管理人应将拟投资的股票库、债券库等各投资品种的具体范围提供给基金托管人。基金管理人可以根据实际情况的变化，对各投资品种的具体范围予以更新和调整，并通知基金托管人。基金托管人根据上述投资范围对基金的投资进行监督；

本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具，包括目标 ETF、标的指数成份股及备选成份股、非成份股、债券（包括国债、金融债、企业/公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、权证、股指期货、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

正常情况下，本基金资产中投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%；扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。股指期货以套期保值为目的，权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。（一）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，建立相关的技术系统，对基金管理人的投资运作进行监督。主要包括以下方面：

1、对基金的投资范围、投资对象进行监督。基金管理人应将拟投资的股票库、债券库等各投资品种的具体范围提供给基金托管人。基金管理人可以根据实际情况的变化，对各投资品种的具体范围予以更新和调整，并通知基金托管人。基金托管人根据上述投资范围对基金的投资进行监督；

本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具，包括目标 ETF、标的指数成份股及备选成份股、非成份股、债券（包括国债、金融债、企业/公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、权证、股指期货、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金可根据法律法规的规定，参与转融通证券出借业务。

正常情况下，本基金资产中投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%；扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。股指期货以套期保值为目的，权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

2、对基金投融资比例进行监督；

.....

(20) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他投资限制。

除上述第（2）、（10）、（18）、（19）项外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规另有规定的，从其规定。 2、对基金投融资比

例进行监督；

.....

(20) 本基金参与转融通证券出借业务，需遵循下述比例限制：

- 1) 出借证券资产不得超过基金资产净值的 30%，出借期限在 10 个交易日以上的出借证券应纳入《流动性风险管理规定》所述流动性受限证券的范围；
 - 2) 参与出借业务的单只证券不得超过基金持有该证券总量的 50%；
 - 3) 最近 6 个月内日均基金资产净值不得低于 2 亿元；
 - 4) 证券出借的平均剩余期限不得超过 30 天，平均剩余期限按照市值加权平均计算；
- 因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合上述规定的，基金管理人不得新增出借业务；

(21) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他投资限制。

除上述第 (2)、(10)、(18)、(19)、(20) 项外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规另有规定的，从其规定。

注：基金合同内容摘要涉及上述内容的一并修改。

华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金

修改基金合同和托管协议条款的修订对照表

修改前 修改后

华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金基金合同

第二部分释义

无 69、转融通证券出借业务：指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司出借证券，中国证券金融股份有限公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务

第七部分基金合同当事人及权利义务

(二) 基金管理人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

.....

(13) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资及转融通业务； (二) 基金管理人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

.....

(13) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资及转融通证券出借业务；

第十二部分基金的投资

(三) 投资策略

.....

本基金还可以参与融资及转融通证券出借业务。本基金参与融资业务，将综合考虑融资成本、保证金比例、冲抵保证金证券折算率、信用资质等条件，选择合适的交易对手方。同时，在保障基金投资组合充足流动性以及有效控制融资杠杆风险的前提下，确定融资比例。本基金可根据风险管理的原则，参与转融通证券出借交易。转融通证券出借策略按照分散化投资原则，分批、分期进行转融通证券出借交易，以分散风险。 (三) 投资策略

.....

本基金还可以参与融资及转融通证券出借业务。本基金参与融资业务，将综合考虑融资成本、保证金比例、冲抵保证金证券折算率、信用资质等条件，选择合适的交易对手方。同时，在

保障基金投资组合充足流动性以及有效控制融资杠杆风险的前提下，确定融资比例。为更好实现投资目标，在加强风险防范并遵守审慎原则的前提下，本基金可根据投资管理需要参与转融通证券出借业务。本基金将在分析市场情况、投资者类型与结构、基金历史申赎情况、出借证券流动性情况等因素的基础上合理确定出借证券的范围、期限和比例。

四、投资限制

1、组合限制

.....

(18) 本基金在任何交易日日终，参与转融通证券出借交易的资产不得超过基金资产净值的 50%，证券出借的平均剩余期限不得超过 30 天，平均剩余期限按照市值加权平均计算；

(19) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他投资限制。

除上述第 (2)、(10)、(12)、(14) 项另有约定外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

四、投资限制

1、组合限制

.....

(18) 本基金参与转融通证券出借业务，需遵循下述比例限制：

1) 出借证券资产不得超过基金资产净值的 30%，出借期限在 10 个交易日以上的出借证券应纳入《流动性风险管理规定》所述流动性受限证券的范围；

2) 参与出借业务的单只证券不得超过基金持有该证券总量的 30%；

3) 最近 6 个月内日均基金资产净值不得低于 2 亿元；

4) 证券出借的平均剩余期限不得超过 30 天，平均剩余期限按照市值加权平均计算；

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合上述规定的，基金管理人不得新增出借业务；

(19) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他投资限制。

除上述第 (2)、(10)、(12)、(14)、(18) 项另有约定外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

第十四部分基金资产估值

三、估值方法

.....

6、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

7、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

三、估值方法

.....

6、基金参与转融通证券出借业务的，按照相关法律法规和行业协会的相关规定进行估值。

7、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

8、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

八、特殊情况的处理

1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 6 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理；

…… 八、特殊情况的处理

1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 7 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理；

……

第十八部分基金的信息披露

……

（十三）参与融资交易和转融通证券出借业务的信息披露

基金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露基金参与融资交易和转融通证券出借业务情况，包括投资策略、业务开展情况、损益情况、风险及其管理情况等。……

（十三）参与融资交易和转融通证券出借业务的信息披露

基金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露基金参与融资交易和转融通证券出借业务情况，包括投资策略、业务开展情况、损益情况、风险及其管理情况等，并就转融通证券出借业务在报告期内发生的重大关联交易事项做详细说明。

华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金托管协议

三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

（二）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督：

……

17. 本基金在任何交易日日终，参与转融通证券出借交易的资产不得超过基金资产净值的 50%，证券出借的平均剩余期限不得超过 30 天，平均剩余期限按照市值加权平均计算；

18. 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资比例限制。

除上述第 2、10、12 项另有约定外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。（二）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督：

……

17. 本基金参与转融通证券出借业务，需遵循下述比例限制：

1) 出借证券资产不得超过基金资产净值的 30%，出借期限在 10 个交易日以上的出借证券应纳入《流动性风险管理规定》所述流动性受限证券的范围；

2) 参与出借业务的单只证券不得超过基金持有该证券总量的 30%；

3) 最近 6 个月内日均基金资产净值不得低于 2 亿元；

4) 证券出借的平均剩余期限不得超过 30 天，平均剩余期限按照市值加权平均计算；

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合上述规定的，基金管理人不得新增出借业务；

18. 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资比例限制。

除上述第 2、10、12、17 项另有约定外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中

国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

八、基金资产净值计算和会计核算

(二) 基金资产估值方法和特殊情形的处理

2. 估值方法

.....

(6) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

(7) 相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

(二) 基金资产估值方法和特殊情形的处理

2. 估值方法

.....

(6) 基金参与转融通证券出借业务的，按照相关法律法规和行业协会的相关规定进行估值。

(7) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

(8) 相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

3. 特殊情形的处理

(1) 基金管理人或基金托管人按估值方法的第(6)项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理；

3. 特殊情形的处理

(1) 基金管理人或基金托管人按估值方法的第(7)项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理；

注：基金合同内容摘要涉及上述内容的一并修改。