

华宝基金管理有限公司关于旗下部分交易型开放式指数证券投资 基金交易结算模式调整并相应修改招募说明书的公告

根据上海证券交易所于 2020 年 1 月 7 日公告的《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则（2020 年修订）》（以下简称“《实施细则》”）及《华宝中证科技龙头交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《华宝中证银行交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《华宝中证军工交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，自 2020 年 1 月 20 日起，华宝基金管理有限公司（以下简称“本公司”）将调整前述基金的交易结算模式，并相应修改前述基金的招募说明书相关条款。

具体修改如下：

一、《招募说明书》相关条款的变更

1、《招募说明书》“【重要提示】”中如下内容进行修改，由：

“在目前结算规则下，投资者申购的基金份额当日可卖出，当日未卖出的基金份额在份额交收成功之前不得卖出和赎回；即 T 日申购的基金份额当日可卖出，T 日申购当日未卖出的基金份额，T+1 日不得卖出和赎回，T+1 日交收成功后 T+2 日可卖出和赎回。对于赎回，投资者获得的股票可在当日卖出。因此为投资者办理申购业务的代理券商若发生交收违约，将导致投资者不能及时、足额获得申购当日未卖出的基金份额，或不能及时、足额获得赎回当日获得的股票，投资者的利益可能受到影响。”

修改为：

“在目前结算规则下，投资者申购的基金份额当日起可卖出，投资者赎回获得的股票当日起可卖出。”

2、《招募说明书》“二、释义”中“《业务规则》”的释义，由：

“48、《业务规则》：指上海证券交易所发布实施的《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》、中国证券登记结算有限责任公司发布实施的《中国证券登记结算有限责任公司关于上海证券交易所交易型开放式基金登记结算业务实施细则》及中国证券登记结算有限责任公司、上海证券交易所发布的其他相关规则 and 规定”

修改为：

“48、《业务规则》：指上海证券交易所发布实施的《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则（2020年修订）》、中国证券登记结算有限责任公司发布实施的《中国证券登记结算有限责任公司关于交易所交易型开放式证券投资基金登记结算业务实施细则》及中国证券登记结算有限责任公司、上海证券交易所发布的其他相关规则 and 规定”

3、《招募说明书》“基金份额的申购与赎回”之“（四）申购和赎回的程序”的“2、申购和赎回申请的确认”中如下内容进行修改，由：

“投资者申购的基金份额当日可卖出，当日未卖出的基金份额在份额交收成功之前不得卖出和赎回；即在目前结算规则下，T日申购的基金份额当日可卖出，T日申购当日未卖出的基金份额，T+1日不得卖出和赎回，T+1日交收成功后T+2日可卖出和赎回。投资者赎回获得的股票当日可卖出。”

修改为：

“投资者申购的基金份额当日起可卖出，投资者赎回获得的股票当日起可卖出。”

4、《招募说明书》“基金份额的申购与赎回”之“（四）申购和赎回的程序”的“3、申购和赎回的清算交收与登记”中如下内容进行修改，由：

“本基金申购赎回过程中涉及的基金份额、组合证券、现金替代、现金差额及其他对价的清算交收适用《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》、《中国证券登记结算有限责任公司关于上海证券交易所交易型开放式基金登记结算业务实施细则》和参与各方相关协议的有关规定，对于本基金的申购业务采用净额结算、代收代付和逐笔全额结算相结合的方式，其中上海证券交易所上市的成份股的现金替代、申购并当日卖出的基金份额及对应的深交所上市的成份股的现金替代采用净额结算，申购当日未卖出的基金份额及对应的深

交所上市的成份股的现金替代采用逐笔全额结算。对于本基金的赎回业务采用净额结算和代收代付相结合的方式，其中上海证券交易所上市的成份股的现金替代采用净额结算，深交所上市的成份股的现金替代采用代收代付；本基金上述申购赎回业务涉及的现金差额和现金替代退补款采用代收代付。

投资者T日申购成功后，登记机构在T日收市后办理上海证券交易所上市的成份股交收与申购当日卖出基金份额的交收登记以及现金替代的清算；在T+1日办理现金替代的交收与申购当日未卖出基金份额的交收登记以及现金差额的清算；在T+2日办理现金差额的交收，并将结果发送给申购赎回代理券商、基金管理人和基金托管人。现金替代交收失败的，该笔申购当日未卖出基金份额交收失败。基金管理人不迟于T+3日办理申购的深交所上市的成份股现金替代退补款的交收。

投资者T日赎回成功后，登记机构在T日收市后办理上海证券交易所上市的成份股交收与基金份额的注销以及现金替代的清算；在T+1日办理上海证券交易所上市的成份股现金替代的交收以及现金差额的清算；在T+2日办理现金差额的交收，并将结果发送给申购赎回代理券商、基金管理人和基金托管人。基金管理人不迟于T+3日办理赎回的深交所上市的成份股现金替代的交付。

如果登记机构和基金管理人在清算交收时发现不能正常履约的情形，则依据《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》、《中国证券登记结算有限责任公司关于上海证券交易所交易型开放式基金登记结算业务实施细则》和参与各方相关协议的有关规定进行处理。”

修改为：

“本基金申购赎回过程中涉及的基金份额、组合证券、现金替代、现金差额及其他对价的清算交收适用相关业务规则和参与各方相关协议的有关规定。对于本基金的申购、赎回业务采用净额结算的方式，基金份额、上交所上市的成份股的现金替代、深交所上市的成份股的现金替代采用净额结算的方式，申购赎回业务涉及的现金差额和现金替代退补款采用代收代付。

投资者T日申购成功后，登记机构在T日收市后办理上交所上市的成份股交收与基金份额的交收登记以及现金替代的清算；在T+1日办理现金替代的交收以及现金差额的清算；在T+2日办理现金差额的交收，并将结果发送给申购赎回代理券商、基金管理人和基金托管人。

投资者T日赎回成功后，登记机构在T日收市后办理上交所上市的成份股交收与基金份额的注销以及现金替代的清算；在T+1日办理现金替代的交收以及现金差额的清算；在T+2日办理现金差额的交收，并将结果发送给申购赎回代理券商、基金管理人和基金托管人。

如果登记机构和基金管理人在清算交收时发现不能正常履约的情形，则依据《业务规则》

和参与各方相关协议的有关规定进行处理。”

二、重要提示

1、本公告仅对前述基金根据《实施细则》调整交易结算模式，并相应修改《招募说明书》的事项进行说明。上述变更属于因相应的法律法规、上海证券交易所或者登记机构的相关业务规则发生变动而对《招募说明书》进行修改，对基金份额持有人利益无实质性不利影响，无需经基金份额持有人大会表决，本公司已就相关事项履行了规定的程序，《招募说明书》的修改自2020年1月20日起生效。

2、投资者可登陆本公司网站（www.fsfund.com）或拨打客户服务电话（400-700-5588、021-38924558）获取相关信息。

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。投资者投资本公司旗下基金前应认真阅读基金的《基金合同》和《招募说明书》。敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

华宝基金管理有限公司

2020年1月15日