

华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金根据《公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引》修改基金合同和托管协议的公告

根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》和《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“《指数指引》”）等法律法规的规定和基金合同的约定，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”或“基金管理人”）决定自2021年3月31日起，对旗下部分基金的基金合同、托管协议和招募说明书等法律文件进行修订，现将有关情况说明如下：

一、本次修订涉及的基金

序号	基金全称
1	上证红利交易型开放式指数证券投资基金
2	上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金
3	华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金
4	华泰柏瑞沪深300交易型开放式指数证券投资基金
5	华泰柏瑞沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金
6	华泰柏瑞中证500交易型开放式指数证券投资基金
7	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
8	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
9	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联接基金
10	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
11	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联接基金
12	华泰柏瑞中证科技100交易型开放式指数证券投资基金
13	华泰柏瑞中证科技100交易型开放式指数证券投资基金联接基金
14	华泰柏瑞上证科创板50成份交易型开放式指数证券投资基金
15	华泰柏瑞上证科创板50成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金
16	华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金
17	华泰柏瑞中证港股通50交易型开放式指数证券投资基金

18	华泰柏瑞中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金
19	华泰柏瑞中证智能汽车主题交易型开放式指数证券投资基金
20	华泰柏瑞中证动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金
21	华泰柏瑞中证稀土产业交易型开放式指数证券投资基金
22	华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金

二、基金合同、托管协议和招募说明书的主要修订内容

以华泰柏瑞中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金为例，基金合同、托管协议和招募说明书主要修订内容如下：

（一）基金合同“前言”章节

1、增加有关法律依据，描述如下：

“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》”)、《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》”)、《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》”)和其他有关法律法规。”

2、增加有关风险提示内容，描述如下：

“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、成份券停牌等潜在风险，详见本基金招募说明书。”

（二）基金合同“释义”章节增加相关释义，描述如下：

“《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”

（三）基金合同“基金的投资”章节的“五、标的指数”修订为：

“本基金的标的指数为中证港股通 50 指数。”

中证港股通 50 指数由中证指数有限公司编制并发布，中证港股通 50 指数选取港股通范围内的最大 50 家公司作为样本股，采用自由流通市值加权计算，以反映港股通范围内大市值股票的整体状况和走势。

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。

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。”

（四）托管协议涉及上述内容的一并修订。

（五）招募说明书“重要提示”部分

1、增加标的指数编制方案简介和查询途径，描述如下：

“本基金的标的指数为中证港股通 50 指数。指数编制方案简介如下：

1、样本空间

同中证港股通综合指数的样本空间，由港股通范围内的证券组成。

2、选样方法

对样本空间内证券，按照过去一年日均总市值由高到低排名，选取排名前 50 的证券作为指数样本。

有关标的指数具体编制方案及成份股信息详见中证指数有限公司网站，网址：www.csindex.com.cn。”

2、增加有关风险提示，描述如下：

“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、成份券停牌等潜在风险，详见本基金招募说明书中“基金的风险揭示”章节。”

(六) 招募说明书“基金的投资”章节的“五、标的指数”修订为：

“本基金的标的指数为中证港股通 50 指数。

中证港股通 50 指数由中证指数有限公司编制并发布，中证港股通 50 指数选取港股通范围内的最大 50 家公司作为样本股，采用自由流通市值加权计算，以反映港股通范围内大市值股票的整体状况和走势。

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。

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。”

(七) 招募说明书“基金的风险揭示”章节增加基金跟踪误差控制未达约定目标、成份股停牌、指数编制机构停止服务的风险揭示，描述如下：

“(四) 跟踪误差控制未达约定目标的风险

本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.2% 以内，年化跟踪误差控制在 2% 以内，但因标的指数编制规则调整或其他因素可能导致跟踪误差超过上述范围，本基金净值表现与指数价格走势可能发生较大偏离。

(五) 成份股停牌的风险

标的指数成份股可能因各种原因临时或长期停牌，发生成份股停牌时可能面临如下风险：

- 1) 基金可能因无法及时调整投资组合而导致跟踪偏离度和跟踪误差扩大；
- 2) 停牌成份股可能因其权重占比、市场复牌预期、现金替代标识等因素影响本基金二级市场价格的折溢价水平；

3) 若成份股停牌时间较长，在约定时间内仍未能及时买入或卖出的，则该部分款项将按照约定方式进行结算（具体见招募说明书“十、基金份额的申购与赎回”之“（七）申购赎回清单的内容与格式”相关约定），由此可能影响投资者的投资损益并使基金产生跟踪偏离度和跟踪误差；

4) 在极端情况下，标的指数成份股可能大面积停牌，基金可能无法及时卖出成份股以获取足额的符合要求的赎回对价，由此基金管理人可能在申购赎回清单中设置较低的赎回份额上限或者采取暂停赎回的措施，投资者将面临无法赎回全部或部分 ETF 份额的风险。

.....

（七）指数编制机构停止服务的风险

本基金的标的指数由指数编制机构发布并管理和维护，未来指数编制机构可能由于各种原因停止对指数的管理和维护，本基金将根据基金合同的约定，并召集基金份额持有人大会进行表决。投资人将面临更换基金标的指数、转换运作方式，与其他基金合并、或者终止基金合同等风险。

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，该期间由于标的指数不再更新等原因可能导致指数表现与相关市场表现存在差异，影响投资收益。”

重要提示：

1、上述基金基金合同和托管协议的修订已经履行了规定的程序，符合相关法律法规及基金合同的规定，无需召开基金份额持有人大会。

2、本公司于本公告日在网站上同时公布经修改后的基金合同、托管协议；招募说明书、产品资料概要涉及前述内容的，将一并修改，并依照《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的有关规定在规定媒介上公告。

3、投资者可以登陆华泰柏瑞基金管理有限公司网站（www.huatai-pb.com）查阅相关公告，也可拨打基金管理人客户服务电话（400-888-0001，（021）38784638）了解相关信息。

风险提示:

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。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。投资有风险，投资者在投资基金之前，请仔细阅读基金的招募说明书和基金合同，全面认识基金的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，在了解产品情况、听取销售机构适当性匹配意见的基础上，理性判断市场，谨慎做出投资决策。基金具体风险评级结果以销售机构提供的评级结果为准。

特此公告。

华泰柏瑞基金管理有限公司

2021年3月27日