

华泰柏瑞基金管理有限公司

关于华泰柏瑞上证180指数型证券投资基金变更为华泰柏瑞上证180交易型开放式指数证券投资基金联接基金并修订基金合同和托管协议的公告

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”）旗下的华泰柏瑞上证180指数型证券投资基金（以下简称“华泰柏瑞上证180指数”）于2025年1月21日成立。

《华泰柏瑞上证180指数型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）约定：“若基金管理人注册并成立追踪同一标的指数的交易型开放式指数基金（ETF），在不改变本基金投资目标的前提下，本基金可变更为该ETF的联接基金。该联接基金将其绝大部分基金财产投资于跟踪同一标的指数的ETF，紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。该联接基金具体投资范围及比例等将依据届时有效的法律法规或监管机构要求确定。以上变更需经基金管理人和基金托管人协商一致后修改基金合同，但不需召开基金份额持有人大会审议。”

本公司旗下华泰柏瑞上证180交易型开放式指数证券投资基金（基金简称“180指数”，扩位简称“上证180指数ETF”，基金代码“530300”）已于2024年12月30日成立，并于2025年1月10日起在上海证券交易所上市交易。为更好地满足广大投资者的投资理财需求，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》的相关规定和基金合同的相关约定，本公司经与基金托管人中国农业银行股份有限公司协商一致，决定于2025年1月23日起，将华泰柏瑞上证180指数变更为华泰柏瑞上证180交易型开放式指数证券投资基金联接基金（以下简称“华泰柏瑞上证180ETF联接”），并根据上述事项及法律法规和基金实际运作情况相应修订基金合同、《华泰柏瑞上证180指数型证券投资基金托管协议》（以下简称“托管协议”）等法律文件相关条款。

现将具体事宜告知如下：

一、基金变更

自2025年1月23日起，华泰柏瑞上证180指数型证券投资基金变更为华泰柏瑞上证180交易型开放式指数证券投资基金联接基金，基金简称变更为华泰柏瑞上证180ETF联接，各类基金份额代码不变，登记机构仍然为华泰柏瑞基金管理有限公司。具体基金信息如下：

华泰柏瑞上证180指数变更为华泰柏瑞上证180ETF联接当日，基金份额简称调整如下：

- 1、原华泰柏瑞上证180指数A类基金份额简称“华泰柏瑞上证180指数A”变更为“华

泰柏瑞上证180ETF联接A”，基金代码“023179”不变。

2、原华泰柏瑞上证180指数C类基金份额简称“华泰柏瑞上证180指数C”变更为“华泰柏瑞上证180ETF联接C”，基金代码“023180”不变。

3、原华泰柏瑞上证180指数I类基金份额简称“华泰柏瑞上证180指数I”变更为“华泰柏瑞上证180ETF联接I”，基金代码“023181”不变。

自变更之日起，投资者持有的华泰柏瑞上证180指数A类份额将变更为华泰柏瑞上证180ETF联接A类份额，投资者持有的华泰柏瑞上证180指数C类份额将变更为华泰柏瑞上证180ETF联接C类份额，投资者持有的华泰柏瑞上证180指数I类份额将变更为华泰柏瑞上证180ETF联接I类份额。

前述基金变更不影响各类基金份额净值的计算。基金变更后，华泰柏瑞上证180ETF联接A类基金份额的申购费率及赎回费率、华泰柏瑞上证180ETF联接C类、I类基金份额的销售费率及赎回费率保持不变。对于本次变更前基金份额持有人持有的华泰柏瑞上证180指数基金份额，变更后其原基金份额持有期将计入华泰柏瑞上证180ETF联接对应基金份额的持有期。

二、法律文件修订

本次基金合同修订系根据基金合同约定变更为联接基金而作出，属于基金合同约定的不需召开基金份额持有人大会的事项，并根据法律法规及基金的实际运作对相关条款进行必要的调整和修改，根据基金合同的约定可由基金管理人和基金托管人协商后修改，无需召开基金份额持有人大会。本公司已就修订内容履行了规定的程序，符合相关法律法规及基金合同的规定。基金合同和托管协议的具体修订内容详见附件《华泰柏瑞上证180指数型证券投资基金变更为华泰柏瑞上证180交易型开放式指数证券投资基金联接基金修订基金合同和托管协议的修订对照表》。

修订后的《华泰柏瑞上证180交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》和《华泰柏瑞上证180交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》自2025年1月23日起生效。《华泰柏瑞上证180指数型证券投资基金基金合同》和《华泰柏瑞上证180指数型证券投资基金托管协议》同日失效。

重要提示：

本公司将于公告当日，将修改后的《华泰柏瑞上证180交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》、《华泰柏瑞上证180交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》登载于公司网站，并在根据《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、基金产品资料概要中对上述内容进行相应修改。

投资者可通过本公司客户服务中心或网站咨询有关详情。

本公司客户服务电话：400-888-0001、(021) 38784638

本公司网站：www.huatai-pb.com

本公告仅对华泰柏瑞上证180指数变更为华泰柏瑞上证180ETF联接事项予以说明。投资者欲了解华泰柏瑞上证180ETF联接的详细情况，请仔细阅读《华泰柏瑞上证180交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》、《华泰柏瑞上证180交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》（更新）、《华泰柏瑞上证180交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金产品资料概要》（更新）及相关法律文件。

风险提示：

基金的过往业绩并不预示其未来表现，基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对华泰柏瑞上证180ETF联接表现的保证。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。销售机构根据法规要求对投资者类别、风险承受能力和基金的风险等级进行划分，并提出适当性匹配意见。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在投资人作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行承担。投资者在投资基金前应认真阅读基金合同、招募说明书（更新）和基金产品资料概要（更新）等基金法律文件，全面认识基金的风险收益特征，在了解基金情况及听取销售机构适当性意见的基础上，根据自身的风险承受能力、投资期限和投资目标，对基金投资作出独立决策，选择合适的基金产品。

特此公告。

华泰柏瑞基金管理有限公司

二〇二五年一月二十二日

华泰柏瑞上证 180 指数型证券投资基金变更为华泰柏瑞上证 180 交易型开放式指数证券投资基金联接基金修订基金合同和托管协议的修订对照表

一、基金合同对照表

章节	修订前	修订后
封面	华泰柏瑞上证180指数型证券投资基金基金合同	华泰柏瑞上证 180 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同(本基金由华泰柏瑞上证 180 指数型证券投资基金变更而来)
全文	华泰柏瑞上证180指数型证券投资基金	华泰柏瑞上证 180 交易型开放式指数证券投资基金联接基金
第一部分 前言	<p>三、华泰柏瑞上证 180 指数型证券投资基金由基金管理人依照《基金法》、<u>基金合同</u>及其他有关规定募集,并经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)注册。</p> <p>中国证监会对本基金募集的注册,并不表明其对本基金的投资价值和市场前景做出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。</p>	<p>三、<u>华泰柏瑞上证 180 交易型开放式指数证券投资基金联接基金</u> (以下简称“本基金”)由华泰柏瑞<u>上证 180 指数型证券投资基金变更而来</u>。华泰柏瑞上证 180 指数型证券投资基金由基金管理人依照《基金法》、<u>《华泰柏瑞上证 180 指数型证券投资基金基金合同》</u>及其他有关规定募集,并经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)注册。</p> <p>中国证监会对<u>华泰柏瑞上证 180 指数型证券投资基金</u>募集的注册,并不表明其对本基金的投资价值和市场前景做出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。</p>
第二部分 释义	<p>1、基金或本基金：<u>指华泰柏瑞上证 180 指数型证券投资基金</u></p> <p>8、基金份额发售公告：指《华泰柏瑞上证180指数型证券投资基金基金份额发售公告》</p> <p>30、基金合同生效日：指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期</p> <p>32、基金募集期：指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不得超过3个月</p> <p>40、认购：指在基金募集期内，</p>	<p>1、基金或本基金：<u>指华泰柏瑞上证 180 交易型开放式指数证券投资基金联接基金，由华泰柏瑞上证 180 指数型证券投资基金变更而来</u></p> <p><u>15、联接基金：指将绝大多数基金财产投资于跟踪同一标的指数的目标 ETF，紧密跟踪业绩比较基准表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，采用开放式运作的基金</u></p> <p><u>16、目标 ETF：指华泰柏瑞上证 180 交易型开放式指数证券投资基金，简称为“华泰柏瑞上证 180ETF”</u></p> <p><u>31、基金合同生效日：指《华泰柏瑞上证 180 交易型开放式指数证</u></p>

	<p>投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为</p> <p>48、基金收益：指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约</p> <p>49、基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收款项及其他资产的价值总和</p> <p>55、基金份额类别：指本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购基金份额时收取认购、申购费用而不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资者认购、申购基金份额时不收取认购、申购费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类、I 类基金份额</p>	<p><u>券投资基金联接基金基金合同》生效日，原《华泰柏瑞上证 180 指数型证券投资基金基金合同》自同日起失效</u></p> <p>47、基金收益：指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、<u>投资目标 ETF 份额</u>所得收益、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约</p> <p>48、基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、<u>目标 ETF 份额、</u>银行存款本息、基金应收款项及其他资产的价值总和</p> <p>54、基金份额类别：指本基金根据申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者申购基金份额时收取申购费用而不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资者申购基金份额时不收取申购费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类、I 类基金份额</p>
第三部分 基金的基本情况	<p>二、基金的类别</p> <p>股票型证券投资基金、指数基金</p>	<p>二、基金的类别</p> <p>指数基金、<u>联接基金</u></p>
	<p>五、基金的最低募集份额总额及金额</p> <p>本基金募集份额总数不低于 2 亿份，募集金额总额不低于 2 亿元。</p>	无
	<p>六、基金份额初始发售面值和认购费用</p> <p>本基金基金份额初始发售面值为人民币 1.00 元。</p> <p>本基金 A 类基金份额的认购费率按招募说明书的规定执行；C 类、I 类基金份额不收取认购费。</p>	无
	<p>九、基金份额类别</p> <p>本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购基金份额时收取认购、申购费用而不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投</p>	<p><u>六、基金份额类别</u></p> <p>本基金根据申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者申购基金份额时收取申购费用而不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资者申购基金份额时</p>

	<p>投资者认购、申购基金份额时不收取认购、申购费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类、I 类基金份额。</p> <p>本基金 A 类、C 类、I 类基金份额分别设置基金代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额、C 类基金份额和 I 类基金份额将分别计算基金份额净值和基金份额累计净值并单独公告。</p> <p>投资者可自行选择认购、申购的基金份额类别。</p> <p>有关基金份额类别的具体设置、费率水平等由基金管理人确定，并在招募说明书中公告。</p>	<p>不收取申购费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类、I 类基金份额。</p> <p>本基金 A 类、C 类、I 类基金份额分别设置基金代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额、C 类基金份额和 I 类基金份额将分别计算基金份额净值和基金份额累计净值并单独公告。</p> <p>投资者可自行选择申购的基金份额类别。</p> <p>有关基金份额类别的具体设置、费率水平等由基金管理人确定，并在招募说明书中公告。</p>
<p>八、标的指数 上证 180 指数。</p>		<p><u>七、目标 ETF 及其标的指数</u> <u>本基金目标 ETF 为华泰柏瑞上证 180 交易型开放式指数证券投资基金，其标的指数为上证 180 指数。</u></p>
<p>无</p>		<p><u>八、本基金与目标 ETF 的联系与区别</u></p> <p><u>本基金为华泰柏瑞上证 180ETF 的联接基金，二者既有联系也有区别：(1) 在基金的投资方法方面，华泰柏瑞上证 180ETF 主要采取完全复制法，直接投资于标的指数的成份股与备选成份股；而本基金则采取间接的方法，通过将绝大部分基金财产投资于华泰柏瑞上证 180ETF 以实现对业绩比较基准的紧密跟踪。(2) 在交易方式方面，投资者既可以像股票一样在交易所市场买卖华泰柏瑞上证 180ETF，也可以按照最小申购、赎回单位和申购赎回清单的要求进行申购与赎回；而本基金则与普通的开放式基金一样，通过基金管理人及代销机构按未知价法进行基金的申购与赎回。</u></p> <p><u>本基金与华泰柏瑞上证 180ETF 业绩表现可能出现差异。可能引发差异的因素主要包括：(1) 法规对投资比例的要求。华泰柏瑞上证 180ETF 作为一种特殊的基金品种，可将全部或接近全部的基金资</u></p>

		<p>产,用于跟踪标的指数的表现;而本基金作为普通的开放式基金,仍需将不低于基金资产净值 5%的资产投资于现金(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。(2)申购赎回的影响。华泰柏瑞上证 180ETF 采取按照最小申购、赎回单位和申购、赎回清单要求进行申赎的方式,申购赎回对基金净值影响较小;而本基金申赎采取未知价法进行申赎的方式,大额申赎可能会对基金净值产生一定影响。</p>
	<p>十、若基金管理人注册并成立追踪同一标的指数的交易型开放式指数基金(ETF),在不改变本基金投资目标的前提下,本基金可变更为该 ETF 的联接基金。该联接基金将其绝大部分基金财产投资于跟踪同一标的指数的 ETF,紧密跟踪标的指数表现,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。该联接基金具体投资范围及比例等将依据届时有效的法律法规或监管机构要求确定。以上变更需经基金管理人和基金托管人协商一致后修改基金合同,但不需召开基金份额持有人大会审议。</p>	<p>无</p>
<p>第四部分 基金的历史沿革</p>	<p>第四部分 基金份额的发售 一、基金份额的发售时间、发售方式、发售对象 1、发售时间 自基金份额发售之日起最长不得超过 3 个月,具体发售时间见基金份额发售公告。 2、发售方式 通过各销售机构的基金销售网点公开发售,各销售机构的具体名单见基金份额发售公告以及基金管理人网站。 3、发售对象 符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者、合格境外投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基</p>	<p>第四部分 基金的历史沿革 华泰柏瑞上证 180 交易型开放式指数证券投资基金联接基金由华泰柏瑞上证 180 指数型证券投资基金变更而来。 华泰柏瑞上证 180 指数型证券投资基金根据 2024 年 12 月 31 日中国证券监督管理委员会《关于准予华泰柏瑞上证 180 指数型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2024]1953 号)注册募集,基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。《华泰柏瑞上证 180 指数型证券投资基金基金合同》于 2025 年 1 月 21 日正式生效。 根据《华泰柏瑞上证 180 指数型</p>

	<p>金的其他投资人。</p> <p>二、基金份额的认购</p> <p>1、认购费用</p> <p>本基金 A 类基金份额的认购费率在遵守相关法律法规的情况下，由基金管理人决定，并在招募说明书中列示，基金认购费用不列入基金财产。本基金 C 类、I 类基金份额不收取认购费。</p> <p>2、募集期利息的处理方式</p> <p>有效认购款项在募集期间产生的利息将折算为相应类别基金份额归基金份额持有人所有，其中利息转份额的具体数额以登记机构的记录为准。</p> <p>3、基金认购份额的计算</p> <p>基金认购份额具体的计算方法在招募说明书中列示。</p> <p>4、认购份额余额的处理方式</p> <p>认购份额的计算保留到小数点后 2 位，小数点 2 位以后的部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。</p> <p>5、认购申请的确认</p> <p>销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购的确认以登记机构的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法权利。</p> <p>三、基金份额认购金额的限制</p> <p>1、投资人认购时，需按销售机构规定的方式全额缴款。</p> <p>2、基金管理人可以对每个基金交易账户的单笔最低认购金额进行限制，具体限制请参看招募说明书或相关公告。</p> <p>3、基金管理人可以对募集期间的单个投资人的累计认购金额进行限制，具体限制和处理方法请参看招募说明书或相关公告。</p> <p>4、投资者在募集期内可以多次认购基金份额，A 类基金份额的认购</p>	<p>证券投资基金基金合同》的约定， <u>“若基金管理人注册并成立追踪同一标的指数的交易型开放式指数基金（ETF），在不改变本基金投资目标的前提下，本基金可变更为该 ETF 的联接基金。该联接基金将其绝大部分基金财产投资于跟踪同一标的指数的 ETF，紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。该联接基金具体投资范围及比例等将依据届时有效的法律法规或监管机构要求确定。以上变更需经基金管理人和基金托管人协商一致后修改基金合同，但不需召开基金份额持有人大会审议。”</u>故华泰柏瑞上证 180 指数型证券投资基金变更为华泰柏瑞上证 180 交易型开放式指数证券投资基金联接基金无需召开基金份额持有人大会，<u>可经基金管理人和基金托管人协商一致后修改基金合同。</u> <u>经基金管理人与基金托管人协商一致，决定将华泰柏瑞上证 180 指数型证券投资基金变更为华泰柏瑞上证 180 交易型开放式指数证券投资基金联接基金，并根据法律法规及基金的实际运作对相关条款进行必要的调整和修改，据此修订《华泰柏瑞上证 180 指数型证券投资基金基金合同》。自 2025 年 1 月 23 日起，《华泰柏瑞上证 180 指数型证券投资基金基金合同》失效，《华泰柏瑞上证 180 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》生效，本基金基金合同当事人将按照《华泰柏瑞上证 180 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》享有权利并承担义务。</u></p>
--	---	--

	<p>费按每笔 A 类基金份额的认购申请单独计算, 但已受理的认购申请不允许撤销。</p> <p>5、如本基金单个投资者累计认购的基金份额数达到或者超过基金总份额的 50%, 基金管理人可以采取比例确认等方式对该投资者的认购申请进行限制。基金管理人接受某笔或者某些认购申请有可能导致投资者变相规避前述 50% 比例要求的, 基金管理人有权拒绝该等全部或者部分认购申请。投资者认购的基金份额数以基金合同生效后登记机构的确认为准。</p>	
<p>第五部分 基金的存续</p>	<p>第五部分 基金备案</p> <p>一、基金备案的条件</p> <p>本基金自基金份额发售之日起 3 个月内, 在基金募集份额总额不少于 2 亿份, 基金募集金额不少于 2 亿元人民币且基金认购人数不少于 200 人的条件下, 基金募集期届满或基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售, 并在 10 日内聘请法定验资机构验资, 自收到验资报告之日起 10 日内, 向中国证监会办理基金备案手续。</p> <p>基金募集达到基金备案条件的, 自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起, 基金合同生效; 否则基金合同不生效。基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对基金合同生效事宜予以公告。基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户, 在基金募集行为结束前, 任何人不得动用。</p> <p>二、基金合同不能生效时募集资金的处理方式</p> <p>如果募集期限届满, 未满足基金备案条件, 基金管理人应当承担下列责任:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用; 2、在基金募集期限届满后 30 日 	<p>第五部分 基金的存续</p> <p>基金合同生效后, 连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的, 基金管理人应当在定期报告中予以披露; 连续 60 个工作日出现前述情形的, 基金管理人应当在 10 个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案, 如持续运作、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。</p> <p>若届时的法律法规或中国证监会规定发生变化, 上述规定将取消、更改或补充时, 则本基金可以参照届时有效的法律法规或中国证监会规定执行。</p>

	<p>内返还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息；</p> <p>3、如基金募集失败，基金管理人、基金托管人及销售机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和销售机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。</p> <p>三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模</p> <p>基金合同生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当在 10 个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、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。</p> <p>若届时的法律法规或中国证监会规定发生变化，上述规定将取消、更改或补充时，则本基金可以参照届时有效的法律法规或中国证监会规定执行。</p>	
<p>第六部分 基金份额的 申购与赎回</p>	<p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：</p> <p>7、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过 50%，或者变相规避 50%集中度的情形。</p> <p>.....</p> <p>发生上述第 1、2、3、5、6、8、9 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当根据有关规定在规定媒介上刊登暂停申购公告。</p> <p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p>发生上述第 1、2、3、5、6、7 项情形之一且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时，基金管理</p>	<p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：</p> <p><u>4、所投资的目标 ETF 暂停估值，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。</u></p> <p><u>5、所投资的目标 ETF 暂停申购、暂停上市或二级市场交易停牌。</u></p> <p>.....</p> <p>发生上述除第 6 项以外的暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当根据有关规定在规定媒介上刊登暂停申购公告。</p> <p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p><u>4、所投资的目标 ETF 暂停估值，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。</u></p>

	<p>人应按规定报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付。若出现上述第4项所述情形，按基金合同的相关条款处理。</p>	<p>5、所投资的目标 ETF 暂停赎回、暂停上市或二级市场交易停牌。</p> <p>……</p> <p>发生上述除第6项以外的情形之一且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时，基金管理人应按规定报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付。若出现上述第6项所述情形，按基金合同的相关条款处理。</p>
<p>第七部分 基金合同当事人及权利义务</p>	<p>一、基金管理人</p> <p>(二) 基金管理人的权利与义务</p> <p>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：</p> <p>(12) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；</p> <p>(16) 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管和定期定额投资等业务规则；</p> <p>2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：</p> <p>(1) 依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；</p> <p>(5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；</p> <p>(8) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基</p>	<p>一、基金管理人</p> <p>(二) 基金管理人的权利与义务</p> <p>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：</p> <p>(12) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；代表基金份额持有人的利益行使因基金财产投资于目标 ETF 所产生的权利；</p> <p>(16) 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金申购、赎回、转换、非交易过户、转托管和定期定额投资等业务规则；</p> <p>2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：</p> <p>(1) 依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的申购、赎回和登记事宜；</p> <p>(5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券、基金投资；</p> <p>(8) 采取适当合理的措施使计算基金份额申购、赎回和注销价格的</p>

	<p>金净值信息，确定基金份额申购、赎回的价格；</p> <p>(24)基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，基金合同不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后30日内退还基金认购人；</p>	<p>方法符合基金合同等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回的价格；</p>
	<p>三、基金份额持有人</p> <p>1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：</p> <p>(5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；</p> <p>2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：</p> <p>(4) 交纳基金认购、申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用；</p>	<p>三、基金份额持有人</p> <p>1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：</p> <p>(5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；<u>出席或者委派代表出席目标ETF基金份额持有人大会，对目标ETF基金份额持有人大会审议事项行使表决权；</u></p> <p>2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：</p> <p>(4) 交纳基金申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用；</p>
<p>第八部分 基金份额持有人大会</p>	<p>一、召开事由</p> <p>1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会，但法律法规、中国证监会另有规定的除外：</p> <p>无</p> <p>2、在法律法规规定和《基金合同》约定的范围内且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：</p> <p>(5) 经中国证监会允许，基金管理人、销售机构、登记机构在法律法规规定的范围内调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务的规则；</p>	<p>一、召开事由</p> <p>1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会，但法律法规、中国证监会另有规定的除外：</p> <p><u>(11)基金管理人代表本基金的基金份额持有人提议召开或召集目标ETF基金份额持有人大会；</u></p> <p>2、在法律法规规定和《基金合同》约定的范围内且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：</p> <p>(5) 经中国证监会允许，基金管理人、销售机构、登记机构在法律法规规定的范围内调整有关基金申购、赎回、转换、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务的规则；</p> <p><u>(6)由于目标ETF交易方式变更、终止上市或基金合同终止而变</u></p>

		更为直接投资该标的指数的指数基金；
	无	<p><u>九、本基金与目标 ETF 在基金份额持有人大会的联系</u></p> <p><u>鉴于本基金是目标 ETF 的联接基金，本基金与目标 ETF 之间在基金份额持有人大会方面存在一定的联系。</u></p> <p><u>本基金的基金份额持有人可以凭所持有的本基金份额出席或者委派代表出席目标 ETF 的基金份额持有人大会并参与表决。计算参会份额和计票时，其参会份额数和票数按目标 ETF 基金份额持有人大会的权益登记日本基金所持有的目标 ETF 份额乘以该基金份额持有人所持有的本基金份额占本基金总份额的比例折算，计算结果按照四舍五入的方法，保留到整数位。</u></p> <p><u>本基金的基金管理人不应以本基金的名义代表本基金的全体基金份额持有人以目标 ETF 的基金份额持有人的身份行使表决权，但可接受本基金的特定基金份额持有人的委托以本基金的基金份额持有人代理人的身份出席目标 ETF 的基金份额持有人大会并参与表决。</u></p> <p><u>本基金的基金管理人代表本基金的基金份额持有人提议召开或召集目标 ETF 基金份额持有人大会的，须先遵照本基金基金合同的约定召开本基金的基金份额持有人大会，本基金的基金份额持有人大会决定提议召开或召集目标 ETF 基金份额持有人大会的，由本基金基金管理人代表本基金的基金份额持有人提议召开或召集目标 ETF 基金份额持有人大会。</u></p>
第十二部分 基金的投资	<p>二、投资范围</p> <p>本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股及备选成份股（均含存托凭证）、非成份股（包括主板、创业板、科创板及其他中国证监会核准或注册上市</p>	<p>二、投资范围</p> <p>本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具，包括<u>目标 ETF</u>、标的指数成份股及备选成份股（均含存托凭证）、非成份股（包括主板、创业板、科创板及其他中国证监会核准</p>

	<p>的股票)、存托凭证、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、衍生品(包括股指期货、股票期权等)、债券回购、银行存款、货币市场工具(含同业存单)、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。在符合法律法规规定的情况下,本基金可以参与融资和转融通证券出借业务。</p> <p>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。</p> <p>本基金投资于标的指数成份股及备选成份股(均含存托凭证)的资产不低於非现金资产的80%,投资于股票资产(含存托凭证)不低於基金资产净值的90%;每个交易日日终在扣除股指期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低於基金资产净值的5%,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</p>	<p>或注册上市的股票)、存托凭证、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、衍生品(包括股指期货、股票期权等)、债券回购、银行存款、货币市场工具(含同业存单)、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。在符合法律法规规定的情况下,本基金可以参与融资和转融通证券出借业务。</p> <p>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。</p> <p>本基金资产中投资于目标ETF的比例不低於基金资产净值的90%;每个交易日日终在扣除股指期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低於基金资产净值的5%,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</p>
	<p>三、投资策略</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>为实现紧密跟踪标的指数的投资目标,本基金投资于标的指数成份股及备选成份股(均含存托凭证)的资产不低於非现金资产的80%,投资于股票资产(含存托凭证)不低於基金资产净值的90%。其余资产可投资于非成份股、存托凭证、债券、资产支持证券、债券回购、银行存款、股指期货、股票期权、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,但需符合中国证监会的相关规定。</p> <p>在正常市场情况下,本基金与业</p>	<p>三、投资策略</p> <p>在正常市场情况下,本基金与业绩比较基准的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年跟踪误差不超过4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围,基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>为实现紧密跟踪标的指数的投资目标,本基金资产中投资于目标ETF的比例不低於基金资产净值的90%。其余资产可投资于标的指数成份股及备选成份股(均含存托凭</p>

<p>绩比较基准的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。</p> <p>2、股票（含存托凭证）投资策略</p> <p>本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股（含存托凭证）组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股（含存托凭证）及其权重的变动进行相应调整；当标的指数进行定期调整、指数样本空间或者编制规则变更时，本基金将根据标的指数的编制规则及调整公告，及时进行投资组合的优化调整。</p> <p>但在因特殊情况（如流动性不足）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。</p> <p>特殊情况包括但不限于以下情形：（1）法律法规的限制；（2）标的指数成份股（含存托凭证）流动性严重不足；（3）标的指数的成份股票（含存托凭证）长期停牌；（4）其他合理原因导致本基金管理人对标的指数的跟踪构成严重制约等。</p> <p>本基金在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素的基础上，根据审慎原则合理参与存托凭证的投资，以更好地跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。</p> <p>3、衍生品投资策略</p> <p>（1）股指期货投资策略</p> <p>本基金在股指期货投资中主要遵循有效管理投资策略，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对现货和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货定价模型寻求其合理估值水平，与现货资产进行匹</p>	<p>证）、非成份股（含存托凭证）、债券、资产支持证券、债券回购、银行存款、股指期货、股票期权、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，但需符合中国证监会的相关规定。</p> <p>2、目标 ETF 投资策略</p> <p>本基金为华泰柏瑞上证180ETF 的联接基金。华泰柏瑞上证180ETF 是采用完全复制法实现对上证 180 指数紧密跟踪的全被动指数基金，本基金主要通过投资于华泰柏瑞上证 180ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪。</p> <p>在投资运作过程中，本基金将在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上，决定采用一级市场申购赎回的方式或二级市场买卖的方式对目标 ETF 进行投资。</p> <p>3、成份股、备选成份股投资策略</p> <p>根据投资者申购、赎回的现金流情况，本基金将综合目标 ETF 的流动性、折溢价率、标的指数成份股流动性等因素分析，对投资组合进行监控和调整，也可以通过买入标的指数成份股、备选成份股紧密跟踪标的指数。</p> <p>4、存托凭证投资策略</p> <p>本基金在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素的基础上，根据审慎原则合理参与存托凭证的投资，以更好地跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。</p> <p>5、衍生品投资策略</p> <p>（1）股指期货投资策略</p> <p>本基金在股指期货投资中主要遵循有效管理投资策略，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对现货和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货定价模型寻求其合理估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略</p>
--	---

	<p>配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。</p> <p>本基金管理人对于股指期货的运用将进行充分的论证，运用股指期货的情形主要包括：对冲系统性风险；对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险；利用金融衍生品的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本，达到有效跟踪标的指数的目的。</p>	<p>进行套期保值操作。</p> <p>本基金管理人对于股指期货的运用将进行充分的论证，运用股指期货的情形主要包括：对冲系统性风险；对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险；利用金融衍生品的杠杆作用，降低股票和目标 ETF 仓位频繁调整的交易成本，达到有效跟踪标的指数的目的。</p>
	<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>基金的投资组合应遵循以下限制：</p> <p>(1) 本基金投资于标的指数成份股及备选成份股（均含存托凭证）的资产不低于非现金资产的 80%，投资于股票资产（含存托凭证）不低于基金资产净值的 90%；</p> <p>(10) 本基金参与股指期货投资，需遵循下述比例限制：</p> <p>1) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；</p> <p>2) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%；其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；</p> <p>3) 本基金在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；</p> <p>4) 本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；</p> <p>5) 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；</p> <p>除上述第(2)、(7)、(13)、(14)、</p>	<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>基金的投资组合应遵循以下限制：</p> <p><u>(1) 本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%；</u></p> <p>(10) 本基金参与股指期货投资，需遵循下述比例限制：</p> <p>1) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；</p> <p>2) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%；其中，有价证券指股票、目标 ETF、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；</p> <p>3) 本基金在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票和目标 ETF 总市值的 20%；</p> <p>4) 本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；</p> <p>5) 本基金所持有的股票市值、目标 ETF 和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票、目标 ETF 投资比例的有关约定；</p> <p>除上述第(1)、(2)、(7)、(13)、</p>

	<p>(15) 项外, 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。</p> <p>2、禁止行为</p> <p>为维护基金份额持有人的合法权益, 基金财产不得用于下列投资或者活动:</p> <p>.....</p> <p>-(4) 买卖其他基金份额, 但是中国证监会另有规定的除外;</p>	<p>(14)、(15) 项外, 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、<u>目标 ETF 暂停申购、赎回、暂停上市或二级市场交易停牌</u>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。<u>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、目标 ETF 暂停申购、赎回、暂停上市或二级市场交易停牌等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述第 (1) 项规定的比例的, 基金管理人应当在 20 个交易日内进行调整。</u>法律法规另有规定的, 从其规定。</p> <p>2、禁止行为</p> <p>为维护基金份额持有人的合法权益, 基金财产不得用于下列投资或者活动:</p> <p>.....</p> <p>无</p>
	<p>五、标的指数和业绩比较基准 本基金的标的指数: 上证 180 指数。</p> <p>.....</p> <p>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。</p>	<p>五、业绩比较基准</p> <p>.....</p> <p><u>除基金合同另有约定外</u>, 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。</p>
	<p>六、风险收益特征</p> <p><u>本基金属于股票型基金中的指</u></p>	<p>六、风险收益特征</p> <p><u>本基金为华泰柏瑞上证</u></p>

	<p>数型基金，采用完全复制的被动式投资策略，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。一方面，相对于混合型基金、债券型基金与货币市场基金而言，其风险和收益较高；另一方面，相对于采用抽样复制的指数型基金而言，其风险和收益特征将更能与标的指数保持基本一致。</p>	<p><u>180ETF 的联接基金，主要投资于目标 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪。因此，本基金的业绩表现与上证 180 指数的表现密切相关。本基金的风险与收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。</u></p>
	<p>七、基金管理人代表基金行使股东或债权人权利的处理原则及方法</p> <p>1、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东或债权人权利，保护基金份额持有人的利益；</p>	<p>七、基金管理人代表基金行使相关权利的处理原则及方法</p> <p>1、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使相关权利，保护基金份额持有人的利益；</p>
	<p>无</p>	<p>八、目标 ETF 的变更</p> <p><u>目标 ETF 出现下述情形之一的，本基金将由投资于目标 ETF 的联接基金变更为直接投资该标的指数的指数基金，无需召开基金份额持有人大会审议；若届时本基金管理人已有以该指数作为标的指数的指数基金，则本基金将本着维护投资者合法权益的原则，履行适当的程序后选取其他合适的指数作为标的指数或与其合并。相应地，本基金基金合同中将去掉关于目标 ETF 的表述部分，或将变更标的指数，届时将由基金管理人另行公告。</u></p> <p><u>1、目标 ETF 交易方式变更；</u></p> <p><u>2、目标 ETF 终止上市；</u></p> <p><u>3、目标 ETF 基金合同终止。</u></p> <p><u>若目标 ETF 变更标的指数，本基金将在履行适当程序后相应变更标的指数且继续投资于该目标 ETF。目标 ETF 召开基金份额持有人大会审议变更目标 ETF 标的指数事项的，本基金的基金份额持有人可出席目标 ETF 基金份额持有人大会并进行表决，目标 ETF 基金份额持有人大会审议通过变更标的指数事项的，则本基金可不召开基金份额持有人大会相应变更标的指数，并仍为该目标 ETF 的联接基金。</u></p>

第十三部分 基金的财产	<p>一、基金资产总值</p> <p>基金资产总值是指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息和基金应收款项以及其他资产的价值总和。</p>	<p>一、基金资产总值</p> <p>基金资产总值是指基金拥有的各类有价证券、<u>目标 ETF 份额</u>、银行存款本息和基金应收款项以及其他资产的价值总和。</p>
第十四部分 基金资产估值	<p>二、估值对象</p> <p>基金所拥有的股票、存托凭证、债券、资产支持证券、股指期货合约、股票期权合约、银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。</p>	<p>二、估值对象</p> <p>基金所拥有的<u>目标 ETF</u>、股票、存托凭证、债券、资产支持证券、股指期货合约、股票期权合约、银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。</p>
	<p>四、估值方法</p> <p>……</p> <p>无</p>	<p>四、估值方法</p> <p>……</p> <p><u>7、目标 ETF 采用估值日该基金基金份额净值估值；若估值日为非证券交易所营业日，以该基金最近估值日的基金份额净值估值。</u></p>
	<p>七、暂停估值的情形</p> <p>……</p> <p>无</p>	<p>七、暂停估值的情形</p> <p>……</p> <p><u>3、基金所投资的目标 ETF 发生暂停估值、暂停公告基金份额净值的情形；</u></p>
	<p>十、特殊情况的处理</p> <p>1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 10 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；</p>	<p>十、特殊情况的处理</p> <p>1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 <u>11</u> 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；</p>
第十五部分 基金费用与 税收	<p>一、基金费用的种类</p> <p>7、基金的投资标的的交易费用；</p>	<p>一、基金费用的种类</p> <p>7、基金的投资标的的交易费用(<u>包括但不限于目标 ETF 的交易费用、申购赎回费用等</u>)；</p>
	<p>二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式</p> <p>1、基金管理人的管理费</p> <p><u>本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.15% 年费率计提。管理费的计算方法如下：—</u></p> $H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$ <p>H 为每日应计提的基金管理费</p> <p><u>E 为前一日基金资产净值</u></p> <p>2、基金托管人的托管费</p> <p><u>本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.05% 年费率计提。托管费的计算方法如下：—</u></p>	<p>二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式</p> <p>1、基金管理人的管理费</p> <p><u>本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费。基金管理费按前一日基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分(若为负数,则取 0)的 0.15% 年费率计提。管理费的计算方法如下：—</u></p> $H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$ <p>H 为每日应计提的基金管理费</p> <p><u>E 为前一日基金资产净值扣除</u></p>

	<p>$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$ H 为每日应计提的基金托管费 E 为前一日基金资产净值</p> <p>三、不列入基金费用的项目 下列费用不列入基金费用： 1、标的指数许可使用费。标的指数许可使用费由基金管理人承担，不得从基金财产中列支； 4、基金合同生效前的相关费用；</p>	<p><u>基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后的剩余部分；若为负数，则 E 取 0</u></p> <p>2、基金托管人的托管费 本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取托管费。基金托管费按前一日基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分（若为负数，则取 0）的 0.05% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：</p> <p>$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$ H 为每日应计提的基金托管费 E 为前一日基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后的剩余部分；若为负数，则 E 取 0</p> <p>三、不列入基金费用的项目 下列费用不列入基金费用： 3、基金合同生效前的相关费用根据《华泰柏瑞上证 180 指数型证券投资基金基金合同》的约定执行；</p>
第十七部分 基金的会计与审计	<p>一、基金会计政策 2、基金的会计年度为公历年度的 1 月 1 日至 12 月 31 日；基金首次募集的会计年度按如下原则：如果基金合同生效少于 2 个月，可以并入下一个会计年度披露；</p>	<p>一、基金会计政策 2、基金的会计年度为公历年度的 1 月 1 日至 12 月 31 日；</p>
第十八部分 基金的信息披露	<p>五、公开披露的基金信息 公开披露的基金信息包括： （一）基金招募说明书、基金产品资料概要、基金合同、基金托管协议、基金份额发售公告 2、基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。 4、基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告。 基金募集申请经中国证监会注</p>	<p>五、公开披露的基金信息 公开披露的基金信息包括： （一）基金招募说明书、基金产品资料概要、基金合同、基金托管协议 2、基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。 无 （四）基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告</p>

	<p>册后，基金管理人在基金份额发售的3日前，将基金份额发售公告、基金招募说明书提示性公告和基金合同提示性公告登载在规定报刊上，将基金份额发售公告、基金招募说明书、基金产品资料概要、基金合同和基金托管协议登载在规定网站上，其中基金产品资料概要还应当登载在基金销售机构网站或营业网点；基金托管人应当同时将《基金合同》、基金托管协议登载在规定网站上。</p> <p>（二）基金合同生效公告</p> <p>基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日（若遇法定节假日规定报刊休刊，则顺延至法定节假日后首个出报日。下同）在规定报刊和规定网站上登载基金合同生效公告。</p> <p>（五）基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告</p> <p>.....</p> <p>基金合同生效不足两个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、中期报告或者年度报告。</p> <p>（六）临时报告</p> <p>.....</p> <p>8、基金募集期延长或提前结束募集；</p> <p>13、基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易事项，中国证监会另有规定的情形除外；</p> <p>25、本基金变更标的指数；</p>	<p>.....</p> <p>无</p> <p><u>（五）临时报告</u></p> <p>.....</p> <p><u>12、基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易事项，投资于目标ETF导致的重大关联交易事项及中国证监会另有规定的情形除外；</u></p> <p><u>24、目标ETF变更或标的指数变更；</u></p>
第十九部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算	<p>三、基金财产的清算</p> <p>5、基金财产清算的期限为6个月，但因本基金所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的，清算期限相应顺延。</p>	<p>三、基金财产的清算</p> <p>5、基金财产清算的期限为6个月，但因本基金所持<u>基金</u>、证券的流动性受到限制而不能及时变现的，清算期限相应顺延。</p>
第二十二部分 基金合	<p>基金合同是约定基金合同当事人之间权利义务关系的法律文件。</p>	<p>基金合同是约定基金合同当事人之间权利义务关系的法律文件。</p>

同的效力	1、 基金合同经基金管理人、基金托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签字或盖章并在募集结束后经基金管理人向中国证监会办理基金备案手续，并经中国证监会书面确认后生效。	1、 <u>《华泰柏瑞上证 180 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》</u> 经基金管理人、基金托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签字或盖章，自 2025 年 1 月 23 日起生效，原 <u>《华泰柏瑞上证 180 指数型证券投资基金基金合同》</u> 同日失效。
------	--	--

注：基金合同内容摘要涉及上述内容的一并修改。

二、托管协议对照表

章节	修订前	修订后
封面	华泰柏瑞上证 180 指数型证券投资基金托管协议	华泰柏瑞上证 180 交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议(本基金由华泰柏瑞上证 180 指数型证券投资基金变更而来)
全文	华泰柏瑞上证 180 指数型证券投资基金	华泰柏瑞上证 180 交易型开放式指数证券投资基金联接基金
序言	鉴于华泰柏瑞基金管理有限公司系一家依照中国法律合法成立并有效存续的有限责任公司，按照相关法律法规的规定具备担任基金管理人的资格和能力， 拟募集发行华泰柏瑞上证 180 指数型证券投资基金；	鉴于华泰柏瑞基金管理有限公司系一家依照中国法律合法成立并有效存续的有限责任公司，按照相关法律法规的规定具备担任基金管理人的资格和能力；
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	<p>(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，对基金投资范围、投资对象进行监督。基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应按照基金托管人要求的格式提供投资品种池和交易对手库，以便基金托管人运用相关技术系统，对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。</p> <p>本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股及备选成份股（均含存托凭证）、非成份股（包括主板、创业板、科创板及其他中国证监会核准或注册上市的股票）、存托凭证、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、</p>	<p>(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，对基金投资范围、投资对象进行监督。基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应按照基金托管人要求的格式提供投资品种池和交易对手库，以便基金托管人运用相关技术系统，对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。</p> <p>本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具，包括<u>目标 ETF</u>、标的指数成份股及备选成份股（均含存托凭证）、非成份股（包括主板、创业板、科创板及其他中国证监会核准或注册上市的股票）、存托凭证、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的</p>

	<p>政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、衍生品(包括股指期货、股票期权等)、债券回购、银行存款、货币市场工具(含同业存单)、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。在符合法律法规规定的情况下,本基金可以参与融资和转融通证券出借业务。</p> <p>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。</p> <p>本基金投资于标的指数成份股及备选成份股(均含存托凭证)的资产不低於非现金资产的80%,投资于股票资产(含存托凭证)不低於基金资产净值的90%;每个交易日日终在扣除股指期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低於基金资产净值的5%,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</p>	<p>的次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、衍生品(包括股指期货、股票期权等)、债券回购、银行存款、货币市场工具(含同业存单)、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。在符合法律法规规定的情况下,本基金可以参与融资和转融通证券出借业务。</p> <p>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。</p> <p>本基金资产中投资于目标ETF的比例不低於基金资产净值的90%;每个交易日日终在扣除股指期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低於基金资产净值的5%,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</p>
	<p>(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:</p> <p>(1)本基金投资于标的指数成份股及备选成份股(均含存托凭证)的资产不低於非现金资产的80%,投资于股票资产(含存托凭证)不低於基金资产净值的90%;</p> <p>(10)本基金参与股指期货投资,需遵循下述比例限制:</p> <p>1)本基金在任何交易日日终,持有的买入股指期货合约价值,不得超过基金资产净值的10%;</p> <p>2)本基金在任何交易日日终,持有的买入股指期货合约价值与有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的100%;其中,有价证券指股票、</p>	<p>(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:</p> <p>(1)本基金投资于目标ETF的比例不低於基金资产净值的90%;</p> <p>(10)本基金参与股指期货投资,需遵循下述比例限制:</p> <p>1)本基金在任何交易日日终,持有的买入股指期货合约价值,不得超过基金资产净值的10%;</p> <p>2)本基金在任何交易日日终,持有的买入股指期货合约价值与有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的100%;其中,有价证券指股票、目标ETF、债券(不含到期日在一年以内的政府债券)、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式</p>

	<p>债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；</p> <p>3) 本基金在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；</p> <p>4) 本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；</p> <p>5) 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；</p> <p>除上述第（2）、（7）、（13）、（14）、（15）项外，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。</p>	<p>回购) 等；</p> <p>3) 本基金在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票和<u>目标 ETF</u> 总市值的 20%；</p> <p>4) 本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；</p> <p>5) 本基金所持有的股票市值、<u>目标 ETF</u> 和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票、<u>目标 ETF</u> 投资比例的有关约定；</p> <p>除上述第<u>（1）、（2）、（7）、（13）、（14）、（15）</u>项外，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、<u>目标 ETF 暂停申购、赎回、暂停上市或二级市场交易停牌</u>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。<u>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、目标 ETF 暂停申购、赎回、暂停上市或二级市场交易停牌等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述第（1）项规定的比例的，基金管理人应当在 20 个交易日内进行调整。</u>法律法规另有规定的，从其规定。</p>
五、基金财产的保管	<p>（二）基金募集期间及募集资金的验资</p> <p>1、基金募集期间的资金应存于基金管理人在具有托管资格的商业银行开设的基金认购专户。该账户由基金管理人开立并管理。</p> <p>2、基金募集期满或基金管理人决定停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等</p>	无

	<p>有关规定后，基金管理人应将属于基金财产的全部资金划入基金托管人开立的基金托管资金账户，同时在规定时间内，聘请符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所进行验资，出具验资报告。出具的验资报告由参加验资的2名或2名以上中国注册会计师签字方为有效。</p> <p>3、若基金募集期限届满，未能达到基金合同生效的条件，由基金管理人按规定办理退款等事宜，基金托管人应提供充分协助。</p>	
<p>八、基金资产净值计算和会计核算</p>	<p>(二)基金资产估值方法和特殊情形的处理</p> <p>1、估值对象</p> <p>基金所拥有的股票、存托凭证、债券、资产支持证券、股指期货合约、股票期权合约、银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。</p> <p>2、估值方法</p> <p>……</p> <p>无</p> <p>3、特殊情形的处理</p> <p>(1)基金管理人或基金托管人按估值方法的第(10)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；</p>	<p>(二)基金资产估值方法和特殊情形的处理</p> <p>1、估值对象</p> <p>基金所拥有的目标ETF、股票、存托凭证、债券、资产支持证券、股指期货合约、股票期权合约、银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。</p> <p>2、估值方法</p> <p>……</p> <p><u>(7)目标ETF采用估值日该基金基金份额净值估值；若估值日为非证券交易所营业日，以该基金最近估值日的基金份额净值估值。</u></p> <p>3、特殊情形的处理</p> <p>(1)基金管理人或基金托管人按估值方法的第(11)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；</p>
	<p>(四)暂停估值的情形</p> <p>……</p> <p>无</p>	<p>(四)暂停估值的情形</p> <p>……</p> <p><u>3、基金所投资的目标ETF发生暂停估值、暂停公告基金份额净值的情形；</u></p>
	<p>(七)基金财务报表与报告的编制和复核</p> <p>1、财务报表与报告的编制</p> <p>基金管理人应当及时编制并对外提供真实、完整的基金财务会计报表与报告。月度报表的编制，基金管理人应于每月终了后5个工作日内完成。《基金合同》生效后，基金招募说</p>	<p>(七)基金财务报表与报告的编制和复核</p> <p>1、财务报表与报告的编制</p> <p>基金管理人应当及时编制并对外提供真实、完整的基金财务会计报表与报告。月度报表的编制，基金管理人应于每月终了后5个工作日内完成。《基金合同》生效后，基金招</p>

	<p>明书的信息发生重大变更的,基金管理人应当在三个工作日内,更新基金招募说明书并登载在《信息披露办法》规定的互联网网站(以下简称“规定网站”)上;基金招募说明书其他信息发生变更的,基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的,基金管理人不再更新基金招募说明书。季度报告应在每个季度结束之日起15个工作日内编制完毕并予以公告;中期报告在上半年结束之日起两个月内编制完毕并予以公告;年度报告在每年结束之日起三个月内编制完毕并予以公告。基金合同生效不足2个月的,基金管理人可以不编制当期季度报告、中期报告或者年度报告。</p>	<p>募说明书的信息发生重大变更的,基金管理人应当在三个工作日内,更新基金招募说明书并登载在《信息披露办法》规定的互联网网站(以下简称“规定网站”)上;基金招募说明书其他信息发生变更的,基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的,基金管理人不再更新基金招募说明书。季度报告应在每个季度结束之日起15个工作日内编制完毕并予以公告;中期报告在上半年结束之日起两个月内编制完毕并予以公告;年度报告在每年结束之日起三个月内编制完毕并予以公告。</p>
十、基金信息披露	<p>(二) 信息披露的内容</p> <p>基金的信息披露主要包括基金招募说明书、基金产品资料概要、基金合同、基金托管协议、基金份额发售公告、基金合同生效公告、基金净值信息、基金份额申购、赎回价格、基金定期报告(包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告)、临时报告、澄清公告、基金份额持有人大会决议、清算报告、参与融资及转融通证券出借业务的信息披露、投资股指期货的信息披露、投资股票期权的信息披露、投资资产支持证券的信息披露、实施侧袋机制期间的信息披露和中国证监会规定的其他信息。基金年度报告中的财务会计报告需经符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计后,方可披露。</p>	<p>(二) 信息披露的内容</p> <p>基金的信息披露主要包括基金招募说明书、基金产品资料概要、基金合同、基金托管协议、基金净值信息、基金份额申购、赎回价格、基金定期报告(包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告)、临时报告、澄清公告、基金份额持有人大会决议、清算报告、参与融资及转融通证券出借业务的信息披露、投资股指期货的信息披露、投资股票期权的信息披露、投资资产支持证券的信息披露、实施侧袋机制期间的信息披露和中国证监会规定的其他信息。基金年度报告中的财务会计报告需经符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计后,方可披露。</p>
十一、基金费用	<p>(一) 基金管理费的计提比例和计提方法</p> <p>本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.15%年费率计提。管理费的计算方法如下:</p> $H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$ <p>H为每日应计提的基金管理费 E为前一日的基金资产净值</p>	<p>(一) 基金管理费的计提比例和计提方法</p> <p><u>本基金基金财产中投资于目标ETF的部分不收取管理费。基金管理费按前一日基金资产净值扣除基金财产中目标ETF份额所对应资产净值后剩余部分(若为负数,则取0)的0.15%年费率计提。管理费的计算方法如下:</u></p> $H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$

		<p>H 为每日应计提的基金管理费</p> <p><u>E 为前一日基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后的剩余部分；若为负数，则 E 取 0</u></p>
	<p>(二) 基金托管费的计提比例和计提方法</p> <p>本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.05% 年费率计提。托管费的计算方法如下：—</p> <p>$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$</p> <p>H 为每日应计提的基金托管费</p> <p><u>E 为前一日的基金资产净值</u></p>	<p>(二) 基金托管费的计提比例和计提方法</p> <p>本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取托管费。基金托管费按前一日基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分(若为负数, 则取 0) 的 0.05% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：—</p> <p>$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$</p> <p>H 为每日应计提的基金托管费</p> <p><u>E 为前一日基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后的剩余部分；若为负数，则 E 取 0</u></p>
	<p>(四)《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费、基金份额持有人大会费用、基金的投资标的的交易费用、基金的银行汇划费用、基金的开户费用、账户维护费用等有关法律法规、《基金合同》规定的费用，可以列入当期基金费用。</p>	<p>(四)《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费、基金份额持有人大会费用、基金的投资标的的交易费用(包括但不限于目标 ETF 的交易费用、申购赎回费用等)、基金的银行汇划费用、基金的开户费用、账户维护费用等有关法律法规、《基金合同》规定的费用，可以列入当期基金费用。</p>
	<p>(五) 不列入基金费用的项目</p> <p>1、标的指数许可使用费。标的指数许可使用费由基金管理人承担，不得从基金财产中列支；—</p> <p>4、基金合同生效前的相关费用；</p>	<p>(五) 不列入基金费用的项目</p> <p>3、基金合同生效前的相关费用根据《华泰柏瑞上证 180 指数型证券投资基金基金合同》的约定执行；</p>
十五、禁止行为	<p>(十一) 基金财产用于下列投资或者活动：</p> <p>……</p> <p>4、买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；—</p>	<p>(十一) 基金财产用于下列投资或者活动：</p> <p>……</p> <p>无</p>
十六、托管协议的变更、终止与	<p>(三) 基金财产的清算</p> <p>2、基金财产清算程序</p> <p>……</p>	<p>(三) 基金财产的清算</p> <p>2、基金财产清算程序</p> <p>……</p>

基金财产的清算	基金财产清算的期限为6个月，但因本基金所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的，清算期限相应顺延。	基金财产清算的期限为6个月，但因本基金所持 基金 、证券的流动性受到限制而不能及时变现的，清算期限相应顺延。
十九、托管协议的效力	<p>双方对托管协议的效力约定如下：</p> <p>(一) 基金管理人在向中国证监会申请发售基金份额时提交的托管协议草案，应经托管协议当事人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签字(或盖章)，协议当事人双方根据中国证监会的意见修改托管协议草案。托管协议以中国证监会注册的文本为正式文本。</p>	<p>双方对托管协议的效力约定如下：</p> <p>(一) 托管协议应经托管协议当事人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签字(或盖章)，协议当事人双方根据中国证监会的意见修改托管协议草案。托管协议以中国证监会注册的文本为正式文本。</p>