

关于汇添富中证电池主题交易型开放式指数证券投资基金标的指数 纳入北京证券交易所股票并修改招募说明书的公告

根据中证指数有限公司指数定期调整情况，汇添富中证电池主题交易型开放式指数证券投资基金（基金代码：159796；场内简称：电池 50ETF，以下简称“本基金”）标的指数纳入北京证券交易所股票。为更好地满足基金运作需求，汇添富基金管理股份有限公司（以下简称“本公司”）决定自 2024 年 6 月 17 日起根据深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则，相应调整本基金招募说明书中申购赎回清单相关内容，并相应补充北京证券交易所股票的风险提示。

具体修改如下：

汇添富中证电池主题交易型开放式指数证券投资基金招募说明书		
	修订前	修订后
重要提示	新增	本基金投资于北京证券交易所股票，可能面临的风险包括：经营风险（北交所主要服务创新型中小企业，企业多处于成长期，规模可能偏小，应对外部冲击能力较弱等特点，企业上市后的持续创新能力、收入及盈利水平等仍具有较大不确定性；北交所允许未盈利企业上市，可能存在企业上市后仍无法盈利、持续亏损、无法进行利润分配等情况）、股价波动风险（北交所上市企业多聚焦行业细分领域，传统估值方法可能不适用，上市后可能存在股价波动的风险；北交所的制度安排，包括股票发行、交易、投资者适当性等方面与沪深证券交易所的制度规则存在一定差别，包括北交所股票连续竞价股票涨跌幅为 30%，首日无涨跌幅限制等，这些制度上的差异可能导致挂牌股票股价波动较大）、退市风

		<p>险（北交所上市股票可能因触及强制终止上市，或因企业自身原因主动终止上市）、流动性风险（与沪深证券交易所上市公司相比，北交所企业股权相对集中、投资者门槛相较沪深主板市场较高，因此可能导致市场整体流动性弱于沪深证券交易所）、由于存在表决权差异安排可能引发的风险（北交所允许上市公司存在表决权差异安排）等，具体风险请查阅本基金招募说明书的“风险揭示”章节的具体内容。</p>
第十部分 基金份额的 申购与赎回	<p>四、申购与赎回的程序</p> <p>3、申购和赎回的清算交收与登记</p> <p>……</p> <p>对于本基金的申购、赎回业务采用净额结算的方式，其中对于深市组合证券及深市现金替代部分，深市组合证券 T 日日终过户，深市现金替代部分采用净额担保交收；对于沪市组合证券所对应的现金替代部分采用净额担保交收；申赎份额于 T 日日终完成登记和注销；现金差额、现金替代退补款部分采用代收代付方式。</p>	<p>四、申购与赎回的程序</p> <p>3、申购和赎回的清算交收与登记</p> <p>……</p> <p>对于本基金的申购、赎回业务采用净额结算的方式，其中对于深市组合证券及深市现金替代部分，深市组合证券 T 日日终过户，深市现金替代部分采用净额担保交收；对于沪市、京市组合证券所对应的现金替代部分采用净额担保交收；申赎份额于 T 日日终完成登记和注销；现金差额、现金替代退补款部分采用代收代付方式。</p>
第十部分 基金份额的 申购与赎回	<p>七、份额申购赎回清单的内容与格式</p> <p>……</p> <p>2、申赎现金</p> <p>“申赎现金”不属于组合成份证券，是为了便于登记机构的清算交收安排，在申购赎回清单中增加的虚拟证券。“申赎现金”的现金替代标志为“必须”，</p>	<p>七、份额申购赎回清单的内容与格式</p> <p>……</p> <p>2、申赎现金</p> <p>“申赎现金”不属于组合成份证券，是为了便于登记机构的清算交收安排，在申购赎回清单中增加的虚拟证券。“申赎现金”的现金替代标志为“必须”，但含义与组合</p>

	<p>但含义与组合成份证券的必须现金替代不同，“申赎现金”的申购替代金额为最小申购单位所对应的现金替代标志为“必须”的沪市成份证券的必须现金替代与现金替代标志为“允许”的沪市成份证券的申购替代金额之和；赎回替代金额为最小赎回单位所对应的现金替代标志为“必须”的沪市成份证券的必须现金替代与现金替代标志为“允许”的沪市成份证券的赎回替代金额之和。</p>	<p>成份证券的必须现金替代不同，“申赎现金”的申购替代金额为最小申购单位所对应的现金替代标志为“必须”的沪市、京市成份证券的必须现金替代与现金替代标志为“允许”的沪市、京市成份证券的申购替代金额之和；赎回替代金额为最小赎回单位所对应的现金替代标志为“必须”的沪市、京市成份证券的必须现金替代与现金替代标志为“允许”的沪市、京市成份证券的赎回替代金额之和。</p>
<p>第十部分 基金份额的 申购与赎回</p>	<p>4、现金替代相关内容</p> <p>现金替代是指申购、赎回过程中，投资人按基金合同和招募说明书的规定，用于替代组合证券中部分证券的一定数量的现金。</p> <p>现金替代分为3种类型：禁止现金替代（标志为“禁止”）、可以现金替代（标志为“允许”）和必须现金替代（标志为“必须”），其中对于深市成份证券，现金替代的类型可以设为“禁止”、“允许”和“必须”；对于沪市成份证券，现金替代的类型可以设为“允许”和“必须”。</p> <p>.....</p> <p>可以现金替代适用于所有成份证券，对于深市成份证券，可以现金替代是指在申购基金份额时，允许使用现金作为全</p>	<p>4、现金替代相关内容</p> <p>现金替代是指申购、赎回过程中，投资人按基金合同和招募说明书的规定，用于替代组合证券中部分证券的一定数量的现金。</p> <p>现金替代分为3种类型：禁止现金替代（标志为“禁止”）、可以现金替代（标志为“允许”）和必须现金替代（标志为“必须”），其中对于深市成份证券，现金替代的类型可以设为“禁止”、“允许”和“必须”；对于沪市成份证券，现金替代的类型可以设为“允许”和“必须”；对于京市成份证券，现金替代的类型可以设为“允许”和“必须”。</p> <p>.....</p> <p>可以现金替代适用于所有成份证券，对于深市成份证券，可以现金替代是指在申购基金份额时，允许使用现金作为全部或部</p>

	<p>部或部分该成份证券的替代，但在赎回基金份额时，该成份证券不允许使用现金作为替代；对于沪市成份证券，可以现金替代是指在申购赎回基金份额时，该成份证券必须使用现金作为替代，根据基金管理人买卖情况，与投资者进行退款或补款。</p>	<p>分该成份证券的替代，但在赎回基金份额时，该成份证券不允许使用现金作为替代；对于沪市成份证券，可以现金替代是指在申购赎回基金份额时，该成份证券必须使用现金作为替代，根据基金管理人买卖情况，与投资者进行退款或补款；对于京市成份证券，可以现金替代是指在申购赎回基金份额时，该成份证券必须使用现金作为替代，根据基金管理人买卖情况，与投资者进行退款或补款。</p>
<p>第十部分 基金份额的 申购与赎回</p>	<p>新增</p>	<p>(1) 关于可以现金替代 3) 对于京市成份证券 ①适用情形：投资者申购和赎回时的京市成份证券。 ②替代金额：对于可以现金替代的证券，替代金额的计算公式为： 申购替代金额=替代证券数量×该证券参考价格×（1+现金替代溢价比例） 赎回替代金额=替代证券数量×该证券参考价格×（1-现金替代折价比例） 其中，该证券参考价格目前为该证券经除权除息调整的 T-1 日收盘价。如果北京证券交易所参考价格确定原则发生变化，以北京证券交易所通知规定的参考价格为准。 申购时收取现金替代溢价的原因是，对于使用现金替代的京市成份证券，基金管理人将买入该部分证券，实际买入价格加上</p>

		<p>相关交易费用后与申购时的参考价格可能有所差异。为便于操作，基金管理人在申购赎回清单中预先确定现金替代溢价比例，并据此收取替代金额。如果预先收取的金额高于基金购入该部分证券的实际成本，则基金管理人将退还多收取的差额；如果预先收取的金额低于基金购入该部分证券的实际成本，则基金管理人将向投资者收取欠缺的差额。</p> <p>赎回时扣除现金替代折价的原因是，对于使用现金替代的京市成份证券，基金管理人将卖出该部分证券，实际卖出价格扣除相关交易费用后与赎回时的参考价格可能有所差异。为便于操作，基金管理人在申购赎回清单中预先确定现金替代折价比例，并据此支付替代金额。如果预先支付的金额低于基金卖出该部分证券的实际收入，则基金管理人将退还少支付的差额；如果预先支付的金额高于基金卖出该部分证券的实际收入，则基金管理人将向投资者收取多支付的差额。</p> <p>③替代金额的处理程序</p> <p>T 日，基金管理人在申购赎回清单中公布现金替代溢价比例和现金替代折价比例，并据此收取申购替代金额和支付赎回替代金额。</p> <p>基金管理人将自 T 日起在收到申购交易确认后按照“时间优先、实时申报”的原则依次买入申购被替代的部分证券，在收到</p>
--	--	--

		<p>赎回交易确认后按照“时间优先、实时申报”的原则依次卖出赎回被替代的部分证券。T 日未完成的交易，基金管理人在 T 日后被替代的成份证券有正常交易的 2 个交易日（简称为 T+2 日）内完成上述交易。基金管理人有权根据实际情况，按照其他原则交易申购赎回被替代的部分证券。</p> <p>时间优先的原则为：申购赎回方向相同的，先确认成交者优先于后确认成交者。先后顺序按照深圳证券交易所确认申购赎回的时间确定。</p> <p>实时申报的原则为：基金管理人在北京证券交易所连续竞价期间，根据收到的深圳证券交易所申购赎回确认记录，在技术系统允许的情况下实时向北京证券交易所申报被替代证券的交易指令。</p> <p>T 日基金管理人按照“时间优先”的原则依次与申购投资者确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项，即按照申购确认时间顺序，以替代金额与被替代证券的依次实际购入成本（包括买入价格与交易费用）的差额，确定基金应退还申购投资者或申购投资者应补交的款项；按照“时间优先”的原则依次与赎回投资者确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项，即按照赎回确认时间顺序，以替代金额与被替代证券的依次实际卖出收入（卖出价格扣除交易费用）的差额，确定基金应退还赎回投资者或赎回投资者应补交的款项。</p>
--	--	--

		<p>对于 T 日因停牌或流动性不足等原因未购入和未卖出的被替代的部分证券，T 日后基金管理人可以继续继续进行被替代证券的买入和卖出，按照前述原则确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项。</p> <p>T+2 日日终，若已购入全部被替代的证券，则以替代金额与被替代证券的实际购入成本（包括买入价格与交易费用）的差额，确定基金应退还申购投资者或申购投资者应补交的款项；若未能购入全部被替代的证券，则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本（包括买入价格与交易费用）加上按照 T+2 日收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还申购投资者或申购投资者应补交的款项。</p> <p>T+2 日日终，若已卖出全部被替代的证券，则以替代金额与被替代证券的实际卖出收入（卖出价格扣除交易费用）的差额，确定基金应退还赎回投资者或赎回投资者应补交的款项；若未能卖出全部被替代的证券，以替代金额与所卖出的部分被替代证券实际卖出收入（卖出价格扣除交易费用）加上按照 T+2 日收盘价计算的未卖出的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还赎回投资者或赎回投资者应补交的款项。</p> <p>特殊情况：若自 T 日起，北京证券交易所正常交易日已达到 20 日而该证券正常交</p>
--	--	---

		<p>易日低于 2 日，则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本（包括买入价格与交易费用）加上按照最近一次收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还申购投资者或申购投资者应补交的款项，以替代金额与所卖出的部分被替代证券实际卖出收入（卖出价格扣除交易费用）加上按照最近一次收盘价计算的未卖出的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还赎回投资者或赎回投资者应补交的款项。</p> <p>若现金替代日（T 日）后至 T+2 日（在特殊情况下则为 T 日起的第 20 个正常交易日）期间被替代的证券发生除息、送股（转增）、配股等发生的其他权益变动，则进行相应调整。</p> <p>T+2 日后第 1 个工作日内（若在特例情况下，则为 T 日起第 21 个交易日内），基金管理人将应退款和补款的明细数据发送给登记机构，相关款项的清算交收将于 T+2 日后 2 个工作日内（若在特例情况下，则为 T 日起第 22 个交易日内）完成；如遇特殊情况，基金管理人有权延后发送数据并延迟交收相关款项。</p>
<p>第十九部分 风险揭示</p>	<p>新增</p>	<p>22、北京证券交易所股票投资风险</p> <p>本基金投资于北京证券交易所股票，可能面临的风险包括：</p> <p>（1）经营风险</p> <p>北交所主要服务创新型中小企业，企业多</p>

		<p>处于成长期，规模可能偏小，往往具有依赖核心技术人员和供应商、客户集中度高、应对外部冲击能力较弱等特点，企业上市后的持续创新能力、收入及盈利水平等仍具有较大不确定性。</p> <p>北交所设置四套上市标准，其中允许未盈利企业上市。因此可能存在企业向不特定合格投资者公开发行股票并在北交所上市时尚未盈利、有累计未弥补亏损等情形，以及在上市后仍无法盈利、持续亏损、无法进行利润分配等情况。</p> <p>（2）股价波动风险</p> <p>北交所上市企业多聚焦行业细分领域，业绩受外部环境影响大，可比公司较少，传统估值方法可能不适用，上市后可能存在股价波动的风险。</p> <p>北交所是独立于沪深证券交易所之外的全国性证券交易所，其制度规则，包括股票发行、交易、投资者适当性等方面与沪深证券交易所的制度规则存在一定差别，包括北交所股票连续竞价股票涨跌幅为30%，首日无涨跌幅限制等，这些制度上的差异可能导致挂牌股票股价波动较大。</p> <p>（3）退市风险</p> <p>北交所股票可能因触及退市情形被终止上市。因触及交易类情形被终止上市的北交所股票，不进入退市整理期；因触及财务类、规范类及重大违法类情形被终止上市的，进入退市整理期交易15个交易日，且</p>
--	--	--

		<p>首个交易日不设价格涨跌幅限制。股票退市可能会给本基金带来不利影响。</p> <p>(4) 流动性风险</p> <p>与沪深证券交易所上市公司相比，北交所企业股权相对集中、投资者门槛相较沪深主板市场较高，因此可能导致市场整体流动性弱于沪深证券交易所，投资者可能在特定阶段对北交所股票形成一致性预期，因此基金存在持有股票无法正常交易的风险。</p> <p>(5) 由于存在表决权差异安排可能引发的风险</p> <p>北交所允许上市公司存在表决权差异安排。根据此项安排，上市公司可能存在控制权相对集中，以及因每一特别表决权股份拥有的表决权数量大于每一普通股份拥有的表决权数量等情形，而使普通投资者的表决权及对公司日常经营等事务的影响力受到限制。</p>
--	--	--

上述修改事项对原有基金份额持有人的利益无实质性不利影响，并已履行了相应的程序。本公司将按规定在相应更新的招募说明书、基金产品资料概要中对上述内容进行修改。

投资者欲了解上述基金的详细情况，请仔细阅读刊登于本公司网站(www.99fund.com)的上述基金的《基金合同》、《招募说明书》和基金产品资料概要等信息披露文件，还可拨打客户服务热线(400-888-9918)咨询相关信息。

汇添富基金高度重视投资者服务和投资者教育，特此提醒投资者需正确认知基金投资的风险和长期收益，做理性的基金投资人，做明白的基金投资人，享受长期投资的快乐！

特此公告。

汇添富基金管理股份有限公司

2024年6月15日