

华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金标的指数纳入北京证
券交易所股票并修订招募说明书的公告

根据中证指数有限公司相关指数成份股的定期调整情况，华泰柏瑞基金管理有限公司（以下简称“本公司”）旗下部分基金标的指数纳入北京证券交易所股票。根据相关法律法规、基金合同等有关规定，本公司决定自2025年6月16日起对旗下部分基金的招募说明书进行修改，此次修订主要涉及更新标的指数简介、调整申购与赎回章节中现金替代的相关内容，明确了北京证券交易所上市成份证券现金替代相关规则，并相应补充基金投资北京证券交易所股票的相关风险提示等内容。

现将相关事项公告如下：

一、涉及基金

序号	基金代码	基金全称	基金简称	场内简称	扩位证券简称
1	563300	华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金	中证 2000	中证 2000	中证 2000ETF
2	A 类：019870 C 类：019871	华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	华 泰 柏 瑞 中 证 2000ETF 发起式联接 A/C	/	/
3	A 类：019923 C 类：019924	华泰柏瑞中证 2000 指数增强型证券投资基金	华泰柏瑞中证 2000 指数增强 A/C	/	/
4	159738	华泰柏瑞中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金	云计算 ETF 华泰柏瑞	云 计 算 E T F 华泰柏瑞	/
5	A 类：019330 C 类：019331	华泰柏瑞中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	华泰柏瑞中证沪港深云计算产业 ETF 发起式联接 A/C	/	/
6	516780	华泰柏瑞中证稀土产业交易型开放式指数证券投资基金	稀土 ETF	稀土 ETF	稀土 ETF
7	563390	华泰柏瑞中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金	现金流 ETF 全指	现金基金	现金流 ETF 全指

二、具体修订情况说明

本次上述基金的招募说明书主要修订所涉及的具体章节详见下表，主要修订内容详见附件《招募说明书修改对照表》。

序号	基金全称	招募说明书（更新）
1	华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金	重要提示 基金份额的申购与赎回 基金的投资 基金的风险揭示
2	华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	重要提示 基金的投资 基金的风险揭示
3	华泰柏瑞中证 2000 指数增强型证券投资基金	重要提示 基金的投资 基金的风险揭示
4	华泰柏瑞中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金	重要提示 基金份额的申购与赎回 基金的投资 基金的风险揭示
5	华泰柏瑞中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	重要提示 基金的投资 基金的风险揭示
6	华泰柏瑞中证稀土产业交易型开放式指数证券投资基金	重要提示 基金份额的申购与赎回 基金的风险揭示
7	华泰柏瑞中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金	重要提示 基金份额的申购与赎回 基金的风险揭示

三、其他需要提示的事项

本次修订自2025年6月16日起生效。本次修订对基金份额持有人利益无实质性不利影响，也不涉及基金合同当事人权利义务关系发生重大变化，无需召开基金份额持有人大会。

本公司将于公告当日，将更新的招募说明书登载于公司网站。基金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公告。

本公告仅对上述基金标的指数纳入北京证券交易所股票并修订招募说明书的有关事项予以说明。投资者欲了解上述基金的详细情况，请仔细阅读基金合同、招募说明书（更新）、基金产品资料概要（更新）及相关法律文件。

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上述基金表现的保证。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

2025 年 6 月 16 日

附件：招募说明书修改对照表

1、华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金

招募说明书	
修改前	修改后
重要提示	重要提示
本基金是跟踪中证 2000 指数的交易型开放式基金，投资本基金可能遇到的风险包括：标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险、标的指数波动的风险、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险、跟踪误差控制未达约定目标的风险、成份股停牌的风险、标的指数变更的风险、指数编制机构停止服务的风险、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险、退市风险、投资者申购失败的风险、投资者赎回失败的风险、退补现金替代方式的风险、基金份额赎回对价的变现风险、第三方机构服务的风险、管理风险与操作风险、技术风险、流动性风险、资产支持证券的投资风险、股指期货的投资风险、存托凭证的投资风险、融资及转融通业务的风险、基金合同自动终止的风险、本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险、不可抗力等等。	本基金是跟踪中证 2000 指数的交易型开放式基金，投资本基金可能遇到的风险包括：标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险、标的指数波动的风险、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险、跟踪误差控制未达约定目标的风险、成份股停牌的风险、标的指数变更的风险、指数编制机构停止服务的风险、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险、退市风险、投资者申购失败的风险、投资者赎回失败的风险、退补现金替代方式的风险、基金份额赎回对价的变现风险、第三方机构服务的风险、管理风险与操作风险、技术风险、流动性风险、资产支持证券的投资风险、股指期货的投资风险、存托凭证的投资风险、北交所股票的投资风险、融资及转融通业务的风险、基金合同自动终止的风险、本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险、不可抗力等等。 本基金可投资北京证券交易所（以下简称“北交所”）股票，将承担因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于中小企业经营风险、股价大幅波动风险、企业退市风险、流动性风险、转板风险、投资集中风险、监管规则变化风险等。
十、基金份额的申购与赎回	十、基金份额的申购与赎回
（七）申购赎回清单的内容与格式 3、现金替代相关内容 （1）..... 退补现金替代适用于深交所上市的成份股，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。 （4）退补现金替代 ①适用情形：退补现金替代的证券目前仅适用于中证 2000 指数中深交所股票。 ③替代金额的处理程序 实时申报的原则为：基金管理人在深交所连续竞价期间，根据收到的上交所申购赎回确认记录，在技术系统允许的情况下实时向深交所申报被替代证券的交易指令。 特例情况：若自 T 日起，深圳证券交易所正常交易日已达到 20 日而该证券正常交易日低于 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.....	（七）申购赎回清单的内容与格式 3、现金替代相关内容 （1）..... 退补现金替代适用于非上交所上市的成份股，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。 （4）退补现金替代 ①适用情形：退补现金替代的证券目前仅适用于中证 2000 指数中非上交所股票。 ③替代金额的处理程序 实时申报的原则为：基金管理人在深交所、北交所连续竞价期间，根据收到的上交所申购赎回确认记录，在技术系统允许的情况下实时向深交所、北交所申报被替代证券的交易指令。 特例情况：若自 T 日起，深圳证券交易所、北京证券交易所正常交易日已达到 20 日而该证券正常交易日低于 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.....
十一、基金的投资	十一、基金的投资
（五）标的指数 本基金的标的指数为中证 2000 指数。 中证 2000 指数从沪深市场中选取市值规模较小且流动性较好的 2000 只证券作为指数样本。中证 2000 与沪深 300、中证 500 和中证 1000 指数共同构成中证规模指数系列，反映沪深市场不同市值规模上市公司证券的整体表现。	（五）标的指数 本基金的标的指数为中证 2000 指数。
十九、基金的风险揭示	十九、基金的风险揭示

(十八) 流动性风险 (1) 拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估 本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具, 主要投资对象是中证 2000 指数的成份股及备选成份股 (均含存托凭证), 投资标的指数成份股及备选成份股 (均含存托凭证) 的比例不低于基金资产净值的 90%, 且不低于非现金基金资产的 80%。 中证 2000 指数从沪深市场中选取市值规模较小且流动性较好的 2000 只证券作为指数样本。中证 2000 与沪深 300、中证 500 和中证 1000 指数共同构成中证规模指数系列, 反映沪深市场不同市值规模上市公司证券的整体表现。综合评估在正常市场环境下, 本基金的流动性良好。	(十八) 流动性风险 (1) 拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估 本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具, 主要投资对象是中证 2000 指数的成份股及备选成份股 (均含存托凭证), 投资标的指数成份股及备选成份股 (均含存托凭证) 的比例不低于基金资产净值的 90%, 且不低于非现金基金资产的 80%。 综合评估在正常市场环境下, 本基金的流动性良好。
	(二十二) 北交所股票的投资风险 本基金可投资于北交所股票, 所面临的特有风险包括但不限于: (1) 中小企业经营风险 因北交所上市的公司大部分为新兴产业公司, 其商业模式和盈利能力存在较高的不确定性, 可能面临一定的经营风险, 进而给基金净值带来不利影响。 (2) 股价大幅波动风险 北交所证券发行、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, 包括北交所竞价交易设置了更宽的涨跌幅限制 (上市后的首日不设涨跌幅限制, 其后涨跌幅限制为 30%), 可能导致较大的股票价格波动。 (3) 企业退市风险 北交所上市公司后续经营期间如果触及相关法律法规、证监会及交易所等规定的退市情形, 可能面临被终止上市的风险, 从而可能给基金净值带来不利影响。 (4) 流动性风险 北交所投资门槛较高, 初期参与的主体可能较少; 此外, 由于北交所上市企业规模小, 部分企业股权较为集中, 由此可能导致整体流动性相对较弱, 若投资者在特定阶段对个券形成一致预期, 由此可能导致基金面临无法及时变现及其他相关流动性风险。 (5) 转板风险 北交所上市公司在满足证券法和中国证监会规定的基本上市条件并符合交易所规定的具体上市条件的, 可申请转板上市。无论北交所上市公司是否转板成功, 均可能引起基金净值波动。 其他风险包括但不限于投资集中风险、监管规则变化风险等。

2、华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金

招募说明书	
修改前	修改后
重要提示	重要提示
本基金为华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金 (以下简称“华泰柏瑞中证 2000ETF”或“目标 ETF”) 的联接基金……投资本基金可能遇到的主要风险包括: 本基金特有风险, 主要包括指数下跌风险、目标 ETF 的风险、标的指数的风险、跟踪偏离风险、跟踪误差控制未达约定目标的风险、成份股停牌的风险、指数编制机构停止服务的风险、股指期货的投资风险、股票期权的投资风险、资产支持证券的投资风险、存托凭证的投资风险、融资及转融通证券出借业务的风险、基金合同自动终止的风险; 投资组合的风险, 主要包括系统性风险、非系统性风险和流动性风险等; 管理风险; 投资合规性风险; 本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评	本基金为华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金 (以下简称“华泰柏瑞中证 2000ETF”或“目标 ETF”) 的联接基金……投资本基金可能遇到的主要风险包括: 本基金特有风险, 主要包括指数下跌风险、目标 ETF 的风险、标的指数的风险、跟踪偏离风险、跟踪误差控制未达约定目标的风险、成份股停牌的风险、指数编制机构停止服务的风险、股指期货的投资风险、股票期权的投资风险、资产支持证券的投资风险、存托凭证的投资风险、融资及转融通证券出借业务的风险、基金合同自动终止的风险、北交所股票的投资风险; 投资组合的风险, 主要包括系统性风险、非系统性风险和流动性风险等; 管理风险; 投资合规性风险; 本基金法律文件风险收益特征表

价可能不一致的风险；以及其他风险。	述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险；以及其他风险。 <u>本基金可投资北京证券交易所（以下简称“北交所”）股票，将承担因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于中小企业经营风险、股价大幅波动风险、企业退市风险、流动性风险、转板风险、投资集中风险、监管规则变化风险等。</u>
九、基金的投资	九、基金的投资
（七）业绩比较基准 中证 2000 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5% <u>中证 2000 指数从沪深市场中选取市值规模较小且流动性较好的 2000 只证券作为指数样本。中证 2000 与沪深 300、中证 500 和中证 1000 指数共同构成中证规模指数系列，反映沪深市场不同市值规模上市公司证券的整体表现。</u>	（七）业绩比较基准 中证 2000 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
十八、基金的风险揭示	十八、基金的风险揭示
（一）本基金特有风险	（一）本基金特有风险 <u>14、北交所股票的投资风险</u> <u>本基金可投资于北交所股票，所面临的特有风险包括但不限于：</u> <u>（1）中小企业经营风险</u> <u>因北交所上市的公司大部分为新兴产业公司，其商业模式和盈利能力存在较高的不确定性，可能面临一定的经营风险，进而给基金净值带来不利影响。</u> <u>（2）股价大幅波动风险</u> <u>北交所证券发行、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，包括北交所竞价交易设置了更宽的涨跌幅限制（上市后的首日不设涨跌幅限制，其后涨跌幅限制为 30%），可能导致较大的股票价格波动。</u> <u>（3）企业退市风险</u> <u>北交所上市公司后续经营期间如果触及相关法律法规、证监会及交易所等规定的退市情形，可能面临被终止上市的风险，从而可能给基金净值带来不利影响。</u> <u>（4）流动性风险</u> <u>北交所投资门槛较高，初期参与的主体可能较少；此外，由于北交所上市企业规模小，部分企业股权较为集中，由此可能导致整体流动性相对较弱，若投资者在特定阶段对个券形成一致预期，由此可能导致基金面临无法及时变现及其他相关流动性风险。</u> <u>（5）转板风险</u> <u>北交所上市公司在满足证券法和中国证监会规定的基本上市条件并符合交易所规定的具体上市条件的，可申请转板上市。无论北交所上市公司是否转板成功，均可能引起基金净值波动。</u> <u>其他风险包括但不限于投资集中风险、监管规则变化风险等。</u>
（二）投资组合的风险 3、流动性风险 （2）拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估 本基金主要投资于华泰柏瑞中证 2000ETF，比例不低于基金资产净值的 90%。 <u>中证 2000 指数从沪深市场中选取市值规模较小且流动性较好的 2000 只证券作为指数样本。中证 2000 与沪深 300、中证 500 和中证 1000 指数共同构成中证规模指数系列，反映沪深市场不同市值规模上市公司证券的整体表现。</u>	（二）投资组合的风险 3、流动性风险 （2）拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估 本基金主要投资于华泰柏瑞中证 2000ETF，比例不低于基金资产净值的 90%。.....

3、华泰柏瑞中证 2000 指数增强型证券投资基金

招募说明书	
修改前	修改后
重要提示	重要提示
本基金的标的指数为中证 2000 指数。指数编制方案简介如下： 中证 2000 指数由中证指数有限公司编制并发布，从沪深市场中选取市值规模较小且流动性较好的 2000 只证券作为指数样本。中证 2000 与沪深 300、中证 500 和中证 1000 指数共同构成中证规模指数系列，反映沪深市场不同市值规模上市公司证券的整体表现。 （1）样本空间 同中证全指指数的样本空间	本基金的标的指数为中证 2000 指数。指数编制方案简介如下： （1）样本空间 同中证全指指数的样本空间
	本基金可投资北京证券交易所（以下简称“北交所”）股票，将承担因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于中小企业经营风险、股价大幅波动风险、企业退市风险、流动性风险、转板风险、投资集中风险、监管规则变化风险等。
九、基金的投资	九、基金的投资
（七）标的指数和业绩比较基准 本基金的标的指数：中证 2000 指数。 本基金的业绩比较基准：中证 2000 指数收益率×95%+人民币活期存款税后利率×5%。 中证 2000 指数由中证指数有限公司编制并发布，从沪深市场中选取市值规模较小且流动性较好的 2000 只证券作为指数样本。中证 2000 与沪深 300、中证 500 和中证 1000 指数共同构成中证规模指数系列，反映沪深市场不同市值规模上市公司证券的整体表现。	（七）标的指数和业绩比较基准 本基金的标的指数：中证 2000 指数。 本基金的业绩比较基准：中证 2000 指数收益率×95%+人民币活期存款税后利率×5%。
十八、基金的风险揭示	十八、基金的风险揭示
	8、北交所股票的投资风险 本基金可投资于北交所股票，所面临的特有风险包括但不限于： （1）中小企业经营风险 因北交所上市的公司大部分为新兴产业公司，其商业模式和盈利能力存在较高的不确定性，可能面临一定的经营风险，进而给基金净值带来不利影响。 （2）股价大幅波动风险 北交所所在证券发行、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，包括北交所竞价交易设置了更宽的涨跌幅限制（上市后的首日不设涨跌幅限制，其后涨跌幅限制为 30%），可能导致较大的股票价格波动。 （3）企业退市风险 北交所上市公司后续经营期间如果触及相关法律法规、证监会及交易所等规定的退市情形，可能面临被终止上市的风险，从而可能给基金净值带来不利影响。 （4）流动性风险 北交所投资门槛较高，初期参与的主体可能较少；此外，由于北交所上市企业规模小，部分企业股权较为集中，由此可能导致整体流动性相对较弱，若投资者在特定阶段对个券形成一致预期，由此可能导致基金面临无法及时变现及其他相关流动性风险。 （5）转板风险 北交所上市公司在满足证券法和中国证监会规定的基本上市条件并符合交易所规定的具体上市条件的，可申请转板上市。无论北交所上市公司是否转板成功，均可能引起基金净值波动。 其他风险包括但不限于投资集中风险、监管规则变化风

	险等。
--	-----

4、华泰柏瑞中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金

招募说明书	
修改前	修改后
重要提示	重要提示
本基金是跟踪中证沪港深云计算产业指数的交易型开放式基金，投资本基金可能遇到的风险包括：标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险、标的指数波动的风险、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险、跟踪误差控制未达约定目标的风险、指数编制机构停止服务的风险、成份股停牌的风险、标的指数变更的风险、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险、退市风险、投资者申购和赎回失败的风险、第三方机构服务的风险、管理风险与操作风险、技术风险、流动性风险不可抗力等等。	本基金是跟踪中证沪港深云计算产业指数的交易型开放式基金，投资本基金可能遇到的风险包括：标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险、标的指数波动的风险、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险、跟踪误差控制未达约定目标的风险、指数编制机构停止服务的风险、成份股停牌的风险、标的指数变更的风险、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险、退市风险、投资者申购和赎回失败的风险、第三方机构服务的风险、管理风险与操作风险、技术风险、流动性风险、<u>北交所股票的投资风险</u>、不可抗力等等。
	本基金可投资北京证券交易所（以下简称“北交所”）股票，将承担因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于中小企业经营风险、股价大幅波动风险、企业退市风险、流动性风险、转板风险、投资集中风险、监管规则变化风险等。
基金合同生效后，本基金的申购赎回采用“深市股票实物替代，沪市股票和港股通标的股票现金替代”模式，申购对价、赎回对价包括组合证券、现金替代、现金差额和/或其他对价。本基金通过深圳证券交易所办理申购赎回的，投资者的申购、赎回申请在 T 日确认，申购所得 ETF 份额 T 日可竞价卖出，T+1 日可赎回；赎回所得的组合证券 T 日可竞价卖出。	基金合同生效后，本基金的申购赎回采用“深市股票实物替代，沪市、<u>京市</u>股票和港股通标的股票现金替代”模式，申购对价、赎回对价包括组合证券、现金替代、现金差额和/或其他对价。本基金通过深圳证券交易所办理申购赎回的，投资者的申购、赎回申请在 T 日确认，申购所得 ETF 份额 T 日可竞价卖出，T+1 日可赎回；赎回所得的组合证券 T 日可竞价卖出。
指数的选择方法如下： （1）对样本空间内的<u>沪深</u>市场证券，按照过去一年日均成交金额由高到低排名，剔除排名后 20%的证券；对样本空间内的香港市场证券，剔除过去一年日均成交金额不足 3000 万港元的证券； （2）在剩余待选样本中，选取业务涉及提供基础设施即服务（IaaS）、平台即服务（PaaS）、软件即服务（SaaS）以及为云计算提供服务器、存储等硬件设备的上市公司证券作为待选样本； （3）在上述待选样本中，按照过去一年日均总市值由高到低排名，选取排名前 50 名的证券作为指数样本，不足 50 只时全部纳入；若同一家公司的<u>沪深</u>市场样本和香港市场样本同时入选，则仅纳入该公司的<u>沪深</u>市场样本。	指数的选择方法如下： （1）对样本空间内的<u>内地</u>市场证券，按照过去一年日均成交金额由高到低 排名，剔除排名后 20%的证券；对样本空间内的香港市场证券，剔除过去一年日均成交金额不足 3000 万港元的证券； （2）在剩余待选样本中，选取业务涉及提供基础设施即服务（IaaS）、平台即服务（PaaS）、软件即服务（SaaS）以及为云计算提供服务器、存储等硬件设备的上市公司证券作为待选样本； （3）在上述待选样本中，按照过去一年日均总市值由高到低排名，选取排名前 50 名的证券作为指数样本，不足 50 只时全部纳入；若同一家公司的<u>内地</u>市场样本和香港市场样本同时入选，则仅纳入该公司的<u>内地</u>市场样本。
十、基金份额的申购与赎回	十、基金份额的申购与赎回
（四）申购与赎回的程序	（四）申购与赎回的程序
3、申购和赎回的清算交收与登记 投资者 T 日申购成功后，登记机构在 T 日收市后为投资者办理基金份额的登记与深交所上市成份股的交收、现金替代（包括沪市股票、深市股票及港股通成份股涉及到的现金替代）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 日收市后为投资者办理基金份额的注销与深交所上市的成份股的交收、<u>深交所和上交所</u>上市的成份股现金替代的清算；在 T+1 日办理深交所<u>和</u>上交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。……	3、申购和赎回的清算交收与登记 投资者 T 日申购成功后，登记机构在 T 日收市后为投资者办理基金份额的登记与深交所上市成份股的交收、现金替代（包括沪市股票、深市股票、<u>京市股票</u>及港股通成份股涉及到的现金替代）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 日收市后为投资者办理基金份额的注销与深交所上市的成份股的交收，<u>深交所、上交所和北交所</u>上市的成份股现金替代的清算；在 T+1 日办理深交所、<u>上交所、北交所</u>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。……

（七）申购赎回清单的内容与格式	（七）申购赎回清单的内容与格式
2、申赎现金相关内容 ……“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”的非深市成份证券的必须现金替代与现金替代标志为“允许”的非深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。	2、申赎现金相关内容 ……“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”的非深市成份证券的必须现金替代与现金替代标志为“允许”的非深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<u>和京市</u>成份证券的必须现金替代与现金替代标志为“允许”的沪市<u>和京市</u>成份证券的赎回替代金额之和。
4、现金替代相关内容 （1）…… 可以现金替代适用于所有成份证券。……对于标志为可以现金替代的上海证券交易所上市的和港股通的成份股，申购赎回基金份额时，必须使用现金作为替代…… …… （2）可以现金替代 2）对于非深市成份证券 A、关于上海证券交易所成份券可以现金替代的情形： ①适用情形：适用于本基金成份券中上海证券交易所上市的股票。登记结算机构对设置可以现金替代的沪市成份证券全部用现金替代。 ②替代金额： …… 如果上海证券交易所对上述计算方式另有规定的，以上海证券交易所最新规定为准。 …… ③替代金额的处理程序 实时申报的原则为：基金管理人在上海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上海证券交易所申报被替代证券的交易指令。 …… 特例情况：若自 T 日起，上海证券交易所正常交易日已达到 20 日而该证券正常交易日低于 2 日…… B、关于港股通成份券可以现金替代的情形 未来如港股通的交易、结算规则发生改变，或深圳证券交易所、上海证券交易所、登记机构的 ETF 申购赎回交易结算规则发生改变，或基金管理人与基金托管人之间的结算相关安排发生改变，基金管理人可对可以现金替代处理规则进行调整，并按规定公告。	4、现金替代相关内容 （1）…… 可以现金替代适用于所有成份证券。……对于标志为可以现金替代的上海证券交易所上市的<u>成份股、北京证券交易所上市的成份股</u>和港股通的成份股，申购赎回基金份额时，必须使用现金作为替代…… …… （2）可以现金替代 2）对于非深市成份证券 A、关于上海证券交易所、<u>北京证券交易所</u>成份券可以现金替代的情形： ①适用情形：适用于本基金成份券中上海证券交易所、<u>北京证券交易所</u>上市的股票。登记结算机构对设置可以现金替代的沪市<u>和京市</u>成份证券全部用现金替代。 ②替代金额： …… 如果上海证券交易所、<u>北京证券交易所</u>对上述计算方式另有规定的，以上海证券交易所、<u>北京证券交易所</u>最新规定为准。 …… ③替代金额的处理程序 实时申报的原则为：基金管理人在上海证券交易所、<u>北京证券交易所</u>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上海证券交易所、<u>北京证券交易所</u>申报被替代证券的交易指令。 …… 特例情况：若自 T 日起，上海证券交易所、<u>北京证券交易所</u>正常交易日已达到 20 日而该证券正常交易日低于 2 日…… B、关于港股通成份券可以现金替代的情形 未来如港股通的交易、结算规则发生改变，或深圳证券交易所、上海证券交易所、<u>北京证券交易所</u>、登记机构的 ETF 申购赎回交易结算规则发生改变，或基金管理人与基金托管人之间的结算相关安排发生改变，基金管理人可对可以现金替代处理规则进行调整，并按规定公告。
7、申购、赎回清单的格式 说明： 1、此表仅为示例。 2、现金替代折价比例字段仅适用于现金替代标志为“允许”的沪市成份证券。	7、申购、赎回清单的格式 说明： 1、此表仅为示例。 2、现金替代折价比例字段仅适用于现金替代标志为“允许”的沪市、<u>京市</u>成份证券。
十一、基金的投资	十一、基金的投资
（五）标的指数 本基金的标的指数为中证沪港深云计算产业指数。 中证沪港深云计算产业指数由中证指数有限公司编制并发布，该指数的样本空间由中证全指样本股及中证港股通中国内地企业综合指数样本股构成。 中证沪港深云计算产业指数由最具代表性的 50 家沪港深云计算产业上市企业股票组成，反映沪港深云计算产业层次的运行情况。	（五）标的指数 本基金的标的指数为中证沪港深云计算产业指数。
十九、基金的风险揭示	十九、基金的风险揭示

(十六) 流动性风险 (1) 拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估 中证沪港深云计算产业指数由中证指数有限公司编制并发布，该指数的样本空间由中证全指样本股及中证港股通中国内地企业综合指数样本股构成。中证沪港深云计算产业指数由最具代表性的 50 家沪港深云计算产业上市企业股票组成，反映沪港深云计算产业层次的运行情况。综合评估在正常市场环境下，本基金的流动性良好。	(十六) 流动性风险 综合评估在正常市场环境下，本基金的流动性良好。
	<u>(二十二) 投资于北交所股票的风险</u> <u>本基金可投资于北交所股票，所面临的特有风险包括但不限于：</u> <u>(1) 中小企业经营风险</u> <u>因北交所上市的公司大部分为新兴产业公司，其商业模式和盈利能力存在较高的不确定性，可能面临一定的经营风险，进而给基金净值带来不利影响。</u> <u>(2) 股价大幅波动风险</u> <u>北交所在证券发行、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，包括北交所竞价交易设置了更宽的涨跌幅限制（上市后的首日不设涨跌幅限制，其后涨跌幅限制为 30%），可能导致较大的股票价格波动。</u> <u>(3) 企业退市风险</u> <u>北交所上市公司后续经营期间如果触及相关法律法规、证监会及交易所等规定的退市情形，可能面临被终止上市的风险，从而可能给基金净值带来不利影响。</u> <u>(4) 流动性风险</u> <u>北交所投资门槛较高，初期参与的主体可能较少；此外，由于北交所上市企业规模小，部分企业股权较为集中，由此可能导致整体流动性相对较弱，若投资者在特定阶段对个券形成一致预期，由此可能导致基金面临无法及时变现及其他相关流动性风险。</u> <u>(5) 转板风险</u> <u>北交所上市公司在满足证券法和中国证监会规定的基本上市条件并符合交易所规定的具体上市条件的，可申请转板上市。无论北交所上市公司是否转板成功，均可能引起基金净值波动。</u> <u>其他风险包括但不限于投资集中风险、监管规则变化风险等。</u>

5、华泰柏瑞中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金

招募说明书	
修改前	修改后
重要提示	重要提示
指数的选样方法如下： (1) 对样本空间内的沪深市场证券，按照过去一年日均成交金额由高到低排名，剔除排名后 20%的证券；对样本空间内的香港市场证券，剔除过去一年日均成交金额不足 3000 万港元的证券； (2) 在剩余待选样本中，选取业务涉及提供基础设施即服务（IaaS）、平台即服务（PaaS）、软件即服务（SaaS）以及为云计算提供服务器、存储等硬件设备的上市公司证券作为待选样本； (3) 在上述待选样本中，按照过去一年日均总市值由高到低排名，选取排名前 50 名的证券作为指数样本，不足 50 只时全部纳入；若同一家公司的沪深市场样本和香港市场样本同时入选，则仅纳入该公司的沪深市场样本。 投资本基金可能遇到的主要风险包括：本基金特有风	指数的选样方法如下： (1) 对样本空间内的内地市场证券，按照过去一年日均成交金额由高到低 排名，剔除排名后 20%的证券；对样本空间内的香港市场证券，剔除过去一年日均成交金额不足 3000 万港元的证券； (2) 在剩余待选样本中，选取业务涉及提供基础设施即服务（IaaS）、平台即服务（PaaS）、软件即服务（SaaS）以及为云计算提供服务器、存储等硬件设备的上市公司证券作为待选样本； (3) 在上述待选样本中，按照过去一年日均总市值由高到低排名，选取排名前 50 名的证券作为指数样本，不足 50 只时全部纳入；若同一家公司的内地市场样本和香港市场样本同时入选，则仅纳入该公司的内地市场样本。 投资本基金可能遇到的主要风险包括：本基金特有

险，主要包括指数下跌风险、目标 ETF 的风险、标的指数的风险、跟踪偏离风险、跟踪误差控制未达约定目标的风险、成份股停牌的风险、指数编制机构停止服务的风险、股指期货的投资风险、股票期权的投资风险、资产支持证券的投资风险、存托凭证的投资风险、融资及转融通证券出借业务的风险、港股通标的股票的投资风险、基金合同自动终止的风险；投资组合的风险，主要包括系统性风险、非系统性风险和流动性风险等；管理风险；投资合规性风险；本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金评价可能不一致的风险；以及其他风险。	风险，主要包括指数下跌风险、目标 ETF 的风险、标的指数的风险、跟踪偏离风险、跟踪误差控制未达约定目标的风险、成份股停牌的风险、指数编制机构停止服务的风险、股指期货的投资风险、股票期权的投资风险、资产支持证券的投资风险、存托凭证的投资风险、融资及转融通证券出借业务的风险、港股通标的股票的投资风险、基金合同自动终止的风险、北交所股票的投资风险；投资组合的风险，主要包括系统性风险、非系统性风险和流动性风险等；管理风险；投资合规性风险；本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金评价可能不一致的风险；以及其他风险。
	本基金可投资北京证券交易所（以下简称“北交所”）股票，将承担因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于中小企业经营风险、股价大幅波动风险、企业退市风险、流动性风险、转板风险、投资集中风险、监管规则变化风险等。
九 基金的投资	九 基金的投资
（七）业绩比较基准 $\text{中证沪港深云计算产业指数收益率} \times 95\% + \text{银行活期存款利率（税后）} \times 5\%$ 中证沪港深云计算产业指数由中证指数有限公司编制并发布，该指数的样本空间由中证全指指数样本股及中证港股通综合指数样本股构成。中证沪港深云计算产业指数从沪港深三地市场中选取 50 只业务涉及提供云计算服务以及为云计算提供硬件设备的上市公司证券作为指数样本，以反映沪港深三地市场云计算产业上市公司证券的整体表现。	（七）业绩比较基准 $\text{中证沪港深云计算产业指数收益率} \times 95\% + \text{银行活期存款利率（税后）} \times 5\%$
十八 基金的风险揭示	十八 基金的风险揭示
（一）本基金特有风险	（一）本基金特有风险 15、北交所股票的投资风险 本基金可投资于北交所股票，所面临的特有风险包括但不限于： （1）中小企业经营风险 因北交所上市的公司大部分为新兴产业公司，其商业模式和盈利能力存在较高的不确定性，可能面临一定的经营风险，进而给基金净值带来不利影响。 （2）股价大幅波动风险 北交所所在证券发行、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，包括北交所竞价交易设置了更宽的涨跌幅限制（上市后的首日不设涨跌幅限制，其后涨跌幅限制为 30%），可能导致较大的股票价格波动。 （3）企业退市风险 北交所上市公司后续经营期间如果触及相关法律法规、证监会及交易所等规定的退市情形，可能面临被终止上市的风险，从而可能给基金净值带来不利影响。 （4）流动性风险 北交所投资门槛较高，初期参与的主体可能较少；此外，由于北交所上市企业规模小，部分企业股权较为集中，由此可能导致整体流动性相对较弱，若投资者在特定阶段对个券形成一致预期，由此可能导致基金面临无法及时变现及其他相关流动性风险。 （5）转板风险 北交所上市公司在满足证券法和中国证监会规定的基本上市条件并符合交易所规定的具体上市条件的，可申请转板上市。无论北交所上市公司是否转板成功，均可能引起基金净值波动。 其他风险包括但不限于投资集中风险、监管规则变化风险等。
（二）投资组合的风险 3、流动性风险 （2）拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估	（二）投资组合的风险 3、流动性风险 （2）拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估

本基金主要投资于华泰柏瑞中证沪港深云计算产业ETF，比例不低于基金资产净值的90%。 中证沪港深云计算产业指数从沪港深三地市场中选取50只业务涉及提供云计算服务以及为云计算提供硬件设备的上市公司证券作为指数样本，以反映沪港深三地市场云计算产业上市公司证券的整体表现。	本基金主要投资于华泰柏瑞中证沪港深云计算产业ETF，比例不低于基金资产净值的90%。
--	--

6、华泰柏瑞中证稀土产业交易型开放式指数证券投资基金

招募说明书	
修改前	修改后
重要提示	重要提示
本基金的标的指数为中证稀土产业指数，指数编制方案简介如下： 1、样本空间 同中证全指指数的样本空间，由同时满足以下条件的非ST、*ST沪深A股和红筹企业发行的存托凭证组成： （1）科创板证券：上市时间超过一年。 （2）其他证券：上市时间超过一个季度，除非该证券自上市以来日均总市值排在前30位。 2、选样方法	本基金的标的指数为中证稀土产业指数，指数编制方案简介如下： 1、样本空间 同中证全指指数的样本空间 2、选样方法
本基金是跟踪中证稀土产业指数的交易型开放式基金，投资本基金可能遇到的风险包括：标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险、标的指数波动的风险、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险、标的指数变更的风险、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、参考IOPV决策和IOPV计算错误的风险、退市风险、投资者申购失败的风险、投资者赎回失败的风险、退补现金替代方式的风险、基金份额赎回对价的变现风险、第三方机构服务的风险、管理风险与操作风险、技术风险、流动性风险、资产支持证券的投资风险、股指期货的投资风险、融资及转融通业务的风险、不可抗力等等。……	本基金是跟踪中证稀土产业指数的交易型开放式基金，投资本基金可能遇到的风险包括：标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险、标的指数波动的风险、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险、标的指数变更的风险、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、参考IOPV决策和IOPV计算错误的风险、退市风险、投资者申购失败的风险、投资者赎回失败的风险、退补现金替代方式的风险、基金份额赎回对价的变现风险、第三方机构服务的风险、管理风险与操作风险、技术风险、流动性风险、资产支持证券的投资风险、股指期货的投资风险、融资及转融通业务的风险、北交所股票的投资风险、不可抗力等等。……
	本基金可投资北京证券交易所（以下简称“北交所”）股票，将承担因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于中小企业经营风险、股价大幅波动风险、企业退市风险、流动性风险、转板风险、投资集中风险、监管规则变化风险等。
十、基金份额的申购与赎回	十、基金份额的申购与赎回
（七）申购赎回清单的内容与格式 3、现金替代相关内容 （1）…… 退补现金替代适用于深交所上市的成份股，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。 …… （4）退补现金替代 ①适用情形：退补现金替代的证券目前仅适用于中证稀土产业指数中深交所股票。 …… ③替代金额的处理程序 实时申报的原则为：基金管理人在深交所连续竞价期间，根据收到的上交所申购赎回确认记录，在技术系统允许的情况下实时向深交所申报被替代证券的交易指令。 …… 特例情况：若自T日起，深圳证券交易所正常交易日已达到20日而该证券正常交易日低于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	（七）申购赎回清单的内容与格式 3、现金替代相关内容 （1）…… 退补现金替代适用于非上交所上市的成份股，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。 …… （4）退补现金替代 ①适用情形：退补现金替代的证券目前仅适用于中证稀土产业指数中非上交所股票。 …… ③替代金额的处理程序 实时申报的原则为：基金管理人在深交所、北交所连续竞价期间，根据收到的上交所申购赎回确认记录，在技术系统允许的情况下实时向深交所、北交所申报被替代证券的交易指令。 …… 特例情况：若自T日起，深圳证券交易所、北京证券交易所正常交易日已达到20日而该证券正常交易日低于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

的款项……	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……
十九、基金的风险揭示	十九、基金的风险揭示
	(二十四) 北交所股票的投资风险 本基金可投资于北交所股票, 所面临的特有风险包括但不限于: (1) 中小企业经营风险 因北交所上市的公司大部分为新兴产业公司, 其商业模式和盈利能力存在较高的不确定性, 可能面临一定的经营风险, 进而给基金净值带来不利影响。 (2) 股价大幅波动风险 北交所所在证券发行、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, 包括北交所竞价交易设置了更宽的涨跌幅限制(上市后的首日不设涨跌幅限制, 其后涨跌幅限制为 30%), 可能导致较大的股票价格波动。 (3) 企业退市风险 北交所上市公司后续经营期间如果触及相关法律法规、证监会及交易所等规定的退市情形, 可能面临被终止上市的风险, 从而可能给基金净值带来不利影响。 (4) 流动性风险 北交所投资门槛较高, 初期参与的主体可能较少; 此外, 由于北交所上市企业规模小, 部分企业股权较为集中, 由此可能导致整体流动性相对较弱, 若投资者在特定阶段对个券形成一致预期, 由此可能导致基金面临无法及时变现及其他相关流动性风险。 (5) 转板风险 北交所上市公司在满足证券法和中国证监会规定的基本上市条件并符合交易所规定的具体上市条件的, 可申请转板上市。无论北交所上市公司是否转板成功, 均可能引起基金净值波动。 其他风险包括但不限于投资集中风险、监管规则变化风险等。

7、华泰柏瑞中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金

招募说明书	
修改前	修改后
重要提示	重要提示
本基金是跟踪中证全指自由现金流指数的交易型开放式基金, 投资本基金可能遇到的风险包括: 标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险、标的指数波动的风险、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险、跟踪误差控制未达约定目标的风险、成份股停牌的风险、标的指数变更的风险、指数编制机构停止服务的风险、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险、退市风险、投资者申购失败的风险、投资者赎回失败的风险、退补现金替代方式的风险、基金份额赎回对价的变现风险、第三方机构服务的风险、管理风险与操作风险、技术风险、流动性风险、资产支持证券的投资风险、股指期货的投资风险、股票期权的投资风险、国债期货的投资风险、存托凭证的投资风险、融资及转融通证券出借业务的风险、本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险、不可抗力等等。具体见招募说明书中“基金的风险揭示”章节。	本基金是跟踪中证全指自由现金流指数的交易型开放式基金, 投资本基金可能遇到的风险包括: 标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险、标的指数波动的风险、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险、跟踪误差控制未达约定目标的风险、成份股停牌的风险、标的指数变更的风险、指数编制机构停止服务的风险、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险、退市风险、投资者申购失败的风险、投资者赎回失败的风险、退补现金替代方式的风险、基金份额赎回对价的变现风险、第三方机构服务的风险、管理风险与操作风险、技术风险、流动性风险、资产支持证券的投资风险、股指期货的投资风险、股票期权的投资风险、国债期货的投资风险、存托凭证的投资风险、北交所股票的投资风险、融资及转融通证券出借业务的风险、本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险、不可抗力等等。具体见招募说明书中“基金的风险揭示”章节。
	本基金可投资北京证券交易所(以下简称“北交所”)股票, 将承担因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险, 包括但不限于中小企业经营风险、股价大幅波动风险、企业退市风险、流动性风险、转板风险、投资集中风险、监管规则变化风险等。
十、基金份额的申购与赎回	十、基金份额的申购与赎回

(七) 申购赎回清单的内容与格式 3、现金替代相关内容 (1) 退补现金替代适用于<u>深交所</u>上市的成份股，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。 (4) 退补现金替代 ①适用情形:退补现金替代的证券目前仅适用于中证全指自由现金流指数中<u>深交所</u>股票。 ③替代金额的处理程序 实时申报的原则为:基金管理人在深交所连续竞价期间，根据收到的上交所申购赎回确认记录，在技术系统允许的情况下实时向深交所申报被替代证券的交易指令。 特例情况:若自 T 日起，深圳证券交易所正常交易日已达到 20 日而该证券正常交易日低于 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.....	(七) 申购赎回清单的内容与格式 3、现金替代相关内容 (1) 退补现金替代适用于<u>非上交所</u>上市的成份股，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。 (4) 退补现金替代 ①适用情形:退补现金替代的证券目前仅适用于中证全指自由现金流指数中<u>非上交所</u>股票。 ③替代金额的处理程序 实时申报的原则为:基金管理人在深交所、<u>北交所</u>连续竞价期间，根据收到的上交所申购赎回确认记录，在技术系统允许的情况下实时向深交所、<u>北交所</u>申报被替代证券的交易指令。 特例情况:若自 T 日起，深圳证券交易所、<u>北京证券交易所</u>正常交易日已达到 20 日而该证券正常交易日低于 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.....
十八、基金的风险揭示	十八、基金的风险揭示
	<u>(二十四) 北交所股票的投资风险</u> <u>本基金可投资于北交所股票，所面临的特有风险包括但不限于:</u> <u>(1) 中小企业经营风险</u> <u>因北交所上市的公司大部分为新兴产业公司，其商业模式和盈利能力存在较高的不确定性，可能面临一定的经营风险，进而给基金净值带来不利影响。</u> <u>(2) 股价大幅波动风险</u> <u>北交所在证券发行、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，包括北交所竞价交易设置了更宽的涨跌幅限制（上市后的首日不设涨跌幅限制，其后涨跌幅限制为 30%），可能导致较大的股票价格波动。</u> <u>(3) 企业退市风险</u> <u>北交所上市公司后续经营期间如果触及相关法律法规、证监会及交易所等规定的退市情形，可能面临被终止上市的风险，从而可能给基金净值带来不利影响。</u> <u>(4) 流动性风险</u> <u>北交所投资门槛较高，初期参与的主体可能较少；此外，由于北交所上市企业规模小，部分企业股权较为集中，由此可能导致整体流动性相对较弱，若投资者在特定阶段对个券形成一致预期，由此可能导致基金面临无法及时变现及其他相关流动性风险。</u> <u>(5) 转板风险</u> <u>北交所上市公司在满足证券法和中国证监会规定的基本上市条件并符合交易所规定的具体上市条件的，可申请转板上市。无论北交所上市公司是否转板成功，均可能引起基金净值波动。</u> <u>其他风险包括但不限于投资集中风险、监管规则变化风险等。</u>