

# 华安基金管理有限公司关于旗下部分基金调整北京证券交易所上市成份证券现金替代业务规则并修改招募说明书的公告

根据法律法规、基金合同、相关业务规则有关规定，经与基金托管人协商一致，华安基金管理有限公司（以下简称“本公司”）决定对旗下部分基金招募说明书进行修订，修订主要涉及调整基金份额的申购、赎回章节中现金替代的相关内容，明确北京证券交易所上市成份证券现金替代相关规则，相应补充基金投资北京证券交易所股票的相关风险提示。

现将相关事项公告如下：

## 一、涉及修订的基金

| 基金代码   | 基金名称                      |
|--------|---------------------------|
| 159039 | 华安国证机器人产业交易型开放式指数证券投资基金   |
| 516270 | 华安中证内地新能源主题交易型开放式指数证券投资基金 |
| 516660 | 华安中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金   |
| 512420 | 华安中证工程机械主题交易型开放式指数证券投资基金  |

## 二、招募说明书修订内容

本次修订主要内容详见附件。

本次修订涉及的相关规则自 2026 年 9 月 28 日起生效。本次修订招募说明书符合有关法律法规的规定，且基金管理人已履行规定程序。

## 三、重要提示

1、本公告仅对上述基金调整可以现金替代业务处理规则的有关事项予以说明。投资者欲了解基金的详细情况，请仔细阅读基金合同、更新的招募说明书等基金法律文件。

2、投资者可通过以下途径咨询有关详情：

客户服务电话：40088-50099

网址：www.huaan.com.cn

## 3、风险提示

本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。请充分了解基金的风险收益特征，审慎做出投资决定。

华安基金管理有限公司

2026 年 9 月 24 日

附件：招募说明书主要修订内容前后对照表

一、华安国证机器人产业交易型开放式指数证券投资基金

| 章节              | 修订前                                                                                                                                                                                                                                                            | 修订后                                                                                                                                                                                                                                                             |
|-----------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 重要提示            | .....                                                                                                                                                                                                                                                          | <p>.....</p> <p>本基金可能投资于北京证券交易所股票，将面临中小企业经营风险、股价大幅波动风险、退市风险、转板风险、流动性风险、投资集中风险、监管规则变化的风险等，详见本基金招募说明书“风险揭示”章节的内容。</p> <p>.....</p>                                                                                                                                |
| 第十部分 基金份额的申购与赎回 | <p>七、申购、赎回清单的内容与格式</p> <p>4、现金替代相关内容</p> <p>（1）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”）。</p> <p>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”。</p> <p>对于<b>沪市</b>成份证券，可以设为：“允许”和“必须”。</p> <p>.....</p> <p>可以现金替代适用于<b>沪市</b>成份证券时，是指在申购赎回基金份额时，该成份</p> | <p>七、申购、赎回清单的内容与格式</p> <p>4、现金替代相关内容</p> <p>（1）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”）。</p> <p>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”。</p> <p>对于<b>非深市</b>成份证券，可以设为：“允许”和“必须”。</p> <p>.....</p> <p>可以现金替代适用于<b>非深市</b>成份证券时，是指在申购赎回基金份额时，该成</p> |

|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p>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>（2）可以现金替代</p> <p>可以现金替代的组合证券分为：深市成份证券和<b>沪市</b>成份证券。</p> <p>2）对于<b>沪市</b>成份证券</p> <p>①适用情形：投资者申购和赎回时的<b>沪市</b>成份证券。登记机构对设置可以现金替代的<b>沪市</b>成份证券全部用现金替代。</p> <p>②替代金额：对于可以现金替代的<b>沪市</b>成份证券，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+申购现金替代保证金率）<br/>赎回替代金额=替代证券数量×该证券参考价格×（1-赎回现金替代保证金率）。</p> <p>其中，“该证券参考价格”为该证券经除权调整的 T-1 日收盘价。如果<b>上海</b>证券交易所参考价格确定原则发生变化，以<b>上海</b>证券交易所通知规定的参考价格为准。</p> <p>.....</p> <p>③替代金额的处理程序</p> <p>.....</p> | <p>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>（2）可以现金替代</p> <p>可以现金替代的组合证券分为：深市成份证券和<b>非深市</b>成份证券。</p> <p>2）对于<b>非深市</b>成份证券</p> <p>①适用情形：投资者申购和赎回时的<b>非深市</b>成份证券。登记机构对设置可以现金替代的<b>非深市</b>成份证券全部用现金替代。</p> <p>②替代金额：对于可以现金替代的<b>非深市</b>成份证券，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+申购现金替代保证金率）<br/>赎回替代金额=替代证券数量×该证券参考价格×（1-赎回现金替代保证金率）。</p> <p>其中，“该证券参考价格”为该证券经除权调整的 T-1 日收盘价。如果<b>相关</b>证券交易所参考价格确定原则发生变化，以<b>相关</b>证券交易所通知规定的参考价格为准。</p> <p>.....</p> <p>③替代金额的处理程序</p> |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|               |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
|---------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|               | <p>实时申报的原则为：基金管理人在<b>上海</b>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<b>上海</b>证券交易所申报被替代证券的交易指令。</p> <p>.....</p> <p>特例情况：若自 T 日起，<b>上海</b>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，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>.....</p> <p>实时申报的原则为：基金管理人在<b>相关</b>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<b>相关</b>证券交易所申报被替代证券的交易指令。</p> <p>.....</p> <p>特例情况：若自 T 日起，<b>相关</b>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，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> |
| 第十八部分<br>风险揭示 | <p>二、本基金特有的风险</p> <p>.....</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 | <p>二、本基金特有的风险</p> <p>.....</p> <p><b>21、北京证券交易所股票的投资风险</b></p> <p>北京证券交易所主要服务于创新型中小企业，在发行、上市、交易、退市等方面的规则与其他交易场所存在差异，本基金面临与之相关的特有风险。</p>                                                                                                                                                                                                                                                     |

|  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
|--|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  | <p>（1）中小企业经营风险</p> <p>北京证券交易所上市企业为创新型中小企业，该类企业往往具有规模小、对技术依赖高、迭代快、议价能力不强等特点，抗市场风险和行业风险能力较弱，存在因产品、经营模式、相关政策变化而出现经营失败的风险；另一方面，部分中小企业可能尚处于初步发展阶段，业务收入、现金流及盈利水平等具有较大不确定性，或面临较大波动，个股投资风险加大。因此，本基金在追求北京证券交易所上市企业带来收益的同时，面临北京证券交易所上市中小企业不确定性更大、无法盈利甚至可能导致较大亏损的风险。</p> <p>（2）股价大幅波动风险</p> <p>北京证券交易所在证券发行、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，包括北京证券交易所竞价交易较沪深证券交易所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。</p> <p>（3）退市风险</p> <p>根据北京证券交易所退市制度，上市企业退市情形较多，一旦所投资的北京证券交易所上市企业进入退市流程，有可能退入新三板创新层或基础层挂牌交易，或转入退市公司板块，本基金可能无法及时将该企业调出投资组合，</p> |
|--|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
|--|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  | <p>从而面临退出难度较大、流动性变差、变现成本较高以及股价大幅波动的风险，可能对基金净值造成不利影响。</p> <p>（4）转板风险</p> <p>根据北京证券交易所转板制度，符合条件的北京证券交易所上市公司可以申请转板至上交所科创板或深交所创业板。一旦上市公司完成转板，将面临被调出标的指数成份股的风险。</p> <p>（5）流动性风险</p> <p>北京证券交易所投资门槛较高，初期参与的主体可能较少；此外，由于北京证券交易所上市企业规模小，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。</p> <p>（5）投资集中风险</p> <p>北京证券交易所上市公司主要属于创新型中小企业，其商业模式、盈利、风险和业绩波动等特征较为相似，因此基金难以通过分散投资来降低风险，若股票价格同向波动，将引起基金净值较大波动。</p> <p>（6）监管规则变化的风险</p> <p>北京证券交易所相关法律、行政法规、部门规章、规范性文件和交易所业务</p> |
|--|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|  |  |                                                                                                                                                                                                             |
|--|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  | <p>规则，可能根据市场情况进行修改完善，或者补充制定新的法律法规和业务规则，可能对基金投资运作产生影响，或导致本基金投资运作相应调整变化。</p> <p>综上，本基金主要投资于北京证券交易所股票，当上述股票表现不佳时，本基金的净值将会受到较大影响甚至产生亏损。投资者投资于本基金前，须充分认知和了解北京证券交易所上市股票的特点和发行、上市、交易、退市等制度和规则，在理性判断的基础上做出投资选择。</p> |
|--|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

## 二、华安中证内地新能源主题交易型开放式指数证券投资基金

| 章节           | 修订前                                                                                                                                                                                                                             | 修订后                                                                                                                                                                                         |
|--------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 重要提示         | .....                                                                                                                                                                                                                           | <p>.....</p> <p>本基金可能投资于北京证券交易所股票，将面临中小企业经营风险、股价大幅波动风险、退市风险、转板风险、流动性风险、投资集中风险、监管规则变化的风险等，详见本基金招募说明书“风险揭示”章节的内容。</p> <p>.....</p>                                                            |
| 十、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>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、<b>上海证券交易所上市的成份股的现金替代、深圳证券交易所上市的成份股的现金替代</b>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。</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>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，基金份额与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。</p> |
| 十九、风险揭示      | <p>二、本基金特有的风险</p> <p>.....</p>                                                                                                                                                                                                  | <p>二、本基金特有的风险</p> <p>.....</p>                                                                                                                                                              |

|   |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
|---|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 示 | <p><b>22、北京证券交易所股票的投资风险</b></p> <p>北京证券交易所主要服务于创新型中小企业，在发行、上市、交易、退市等方面的规则与其他交易场所存在差异，本基金面临与之相关的特有风险。</p> <p><b>（1）中小企业经营风险</b></p> <p>北京证券交易所上市企业为创新型中小企业，该类企业往往具有规模小、对技术依赖高、迭代快、议价能力不强等特点，抗市场风险和行业风险能力较弱，存在因产品、经营模式、相关政策变化而出现经营失败的风险；另一方面，部分中小企业可能尚处于初步发展阶段，业务收入、现金流及盈利水平等具有较大不确定性，或面临较大波动，个股投资风险加大。因此，本基金在追求北京证券交易所上市企业带来收益的同时，面临北京证券交易所上市中小企业不确定性更大、无法盈利甚至可能导致较大亏损的风险。</p> <p><b>（2）股价大幅波动风险</b></p> <p>北京证券交易所在证券发行、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，包括北京证券交易所竞价交易较沪深证券交易所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。</p> <p><b>（3）退市风险</b></p> |
|---|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
|--|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  | <p>根据北京证券交易所退市制度，上市企业退市情形较多，一旦所投资的北京证券交易所上市企业进入退市流程，有可能退入新三板创新层或基础层挂牌交易，或转入退市公司板块，本基金可能无法及时将该企业调出投资组合，从而面临退出难度较大、流动性变差、变现成本较高以及股价大幅波动的风险，可能对基金净值造成不利影响。</p> <p>（4）转板风险</p> <p>根据北京证券交易所转板制度，符合条件的北京证券交易所上市公司可以申请转板至上交所科创板或深交所创业板。一旦上市公司完成转板，将面临被调出标的指数成份股的风险。</p> <p>（5）流动性风险</p> <p>北京证券交易所投资门槛较高，初期参与的主体可能较少；此外，由于北京证券交易所上市企业规模小，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。</p> <p>（5）投资集中风险</p> <p>北京证券交易所上市公司主要属于创新型中小企业，其商业模式、盈利、风险和业绩波动等特征较为相似，因此基金难以通过分散投资来降低风险，若</p> |
|--|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
|--|--|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  | <p>股票价格同向波动，将引起基金净值较大波动。</p> <p>（6）监管规则变化的风险</p> <p>北京证券交易所相关法律、行政法规、部门规章、规范性文件和交易所业务规则，可能根据市场情况进行修改完善，或者补充制定新的法律法规和业务规则，可能对基金投资运作产生影响，或导致本基金投资运作相应调整变化。</p> <p>综上，本基金主要投资于北京证券交易所股票，当上述股票表现不佳时，本基金的净值将会受到较大影响甚至产生亏损。投资者投资于本基金前，须充分认知和了解北京证券交易所上市股票的特点和发行、上市、交易、退市等制度和规则，在理性判断的基础上做出投资选择。</p> |
|--|--|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

三、华安中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金

| 章节           | 修订前                                                                                                                                                                                                                             | 修订后                                                                                                                                                                                         |
|--------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 重要提示         | .....                                                                                                                                                                                                                           | <p>.....</p> <p>本基金可能投资于北京证券交易所股票，将面临中小企业经营风险、股价大幅波动风险、退市风险、转板风险、流动性风险、投资集中风险、监管规则变化的风险等，详见本基金招募说明书“风险揭示”章节的内容。</p> <p>.....</p>                                                            |
| 十、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>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、<b>上海证券交易所上市的成分股的现金替代、深圳证券交易所上市的成分股的现金替代</b>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。</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>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，基金份额与成分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。</p> |
| 十九、风险揭示      | <p>二、本基金特有的风险</p> <p>.....</p>                                                                                                                                                                                                  | <p>二、本基金特有的风险</p> <p>.....</p>                                                                                                                                                              |

|   |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
|---|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 示 | <p><b>22、北京证券交易所股票的投资风险</b></p> <p>北京证券交易所主要服务于创新型中小企业，在发行、上市、交易、退市等方面的规则与其他交易场所存在差异，本基金面临与之相关的特有风险。</p> <p><b>（1）中小企业经营风险</b></p> <p>北京证券交易所上市企业为创新型中小企业，该类企业往往具有规模小、对技术依赖高、迭代快、议价能力不强等特点，抗市场风险和行业风险能力较弱，存在因产品、经营模式、相关政策变化而出现经营失败的风险；另一方面，部分中小企业可能尚处于初步发展阶段，业务收入、现金流及盈利水平等具有较大不确定性，或面临较大波动，个股投资风险加大。因此，本基金在追求北京证券交易所上市企业带来收益的同时，面临北京证券交易所上市中小企业不确定性更大、无法盈利甚至可能导致较大亏损的风险。</p> <p><b>（2）股价大幅波动风险</b></p> <p>北京证券交易所在证券发行、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，包括北京证券交易所竞价交易较沪深证券交易所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。</p> <p><b>（3）退市风险</b></p> |
|---|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
|--|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  | <p>根据北京证券交易所退市制度，上市企业退市情形较多，一旦所投资的北京证券交易所上市企业进入退市流程，有可能退入新三板创新层或基础层挂牌交易，或转入退市公司板块，本基金可能无法及时将该企业调出投资组合，从而面临退出难度较大、流动性变差、变现成本较高以及股价大幅波动的风险，可能对基金净值造成不利影响。</p> <p>（4）转板风险</p> <p>根据北京证券交易所转板制度，符合条件的北京证券交易所上市公司可以申请转板至上交所科创板或深交所创业板。一旦上市公司完成转板，将面临被调出标的指数成份股的风险。</p> <p>（5）流动性风险</p> <p>北京证券交易所投资门槛较高，初期参与的主体可能较少；此外，由于北京证券交易所上市企业规模小，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。</p> <p>（5）投资集中风险</p> <p>北京证券交易所上市公司主要属于创新型中小企业，其商业模式、盈利、风险和业绩波动等特征较为相似，因此基金难以通过分散投资来降低风险，若</p> |
|--|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
|--|--|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  | <p>股票价格同向波动，将引起基金净值较大波动。</p> <p>（6）监管规则变化的风险</p> <p>北京证券交易所相关法律、行政法规、部门规章、规范性文件和交易所业务规则，可能根据市场情况进行修改完善，或者补充制定新的法律法规和业务规则，可能对基金投资运作产生影响，或导致本基金投资运作相应调整变化。</p> <p>综上，本基金主要投资于北京证券交易所股票，当上述股票表现不佳时，本基金的净值将会受到较大影响甚至产生亏损。投资者投资于本基金前，须充分认知和了解北京证券交易所上市股票的特点和发行、上市、交易、退市等制度和规则，在理性判断的基础上做出投资选择。</p> |
|--|--|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

四、华安中证工程机械主题交易型开放式指数证券投资基金

| 章节            | 修订前                            | 修订后                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
|---------------|--------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 重要提示          | .....                          | <p>.....</p> <p>本基金可能投资于北京证券交易所股票，将面临中小企业经营风险、股价大幅波动风险、退市风险、转板风险、流动性风险、投资集中风险、监管规则变化的风险等，详见本基金招募说明书“风险揭示”章节的内容。</p> <p>.....</p>                                                                                                                                                                       |
| 第十八部分<br>风险揭示 | <p>二、本基金特有的风险</p> <p>.....</p> | <p>二、本基金特有的风险</p> <p>.....</p> <p><b>23、北京证券交易所股票的投资风险</b></p> <p>北京证券交易所主要服务于创新型中小企业，在发行、上市、交易、退市等方面的规则与其他交易场所存在差异，本基金面临与之相关的特有风险。</p> <p>（1）中小企业经营风险</p> <p>北京证券交易所上市企业为创新型中小企业，该类企业往往具有规模小、对技术依赖高、迭代快、议价能力不强等特点，抗市场风险和行业风险能力较弱，存在因产品、经营模式、相关政策变化而出现经营失败的风险；另一方面，部分中小企业可能尚处于初步发展阶段，业务收入、现金流及盈利水平</p> |

|  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
|--|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  | <p>等具有较大不确定性，或面临较大波动，个股投资风险加大。因此，本基金在追求北京证券交易所上市企业带来收益的同时，面临北京证券交易所上市中小企业不确定性更大、无法盈利甚至可能导致较大亏损的风险。</p> <p>（2）股价大幅波动风险</p> <p>北京证券交易所在证券发行、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，包括北京证券交易所竞价交易较沪深证券交易所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。</p> <p>（3）退市风险</p> <p>根据北京证券交易所退市制度，上市企业退市情形较多，一旦所投资的北京证券交易所上市企业进入退市流程，有可能退入新三板创新层或基础层挂牌交易，或转入退市公司板块，本基金可能无法及时将该企业调出投资组合，从而面临退出难度较大、流动性变差、变现成本较高以及股价大幅波动的风险，可能对基金净值造成不利影响。</p> <p>（4）转板风险</p> <p>根据北京证券交易所转板制度，符合条件的北京证券交易所上市公司可以申请转板至上交所科创板或深交所创业板。一旦上市公司完成转板，将面临被</p> |
|--|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
|--|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  | <p>调出标的指数成份股的风险。</p> <p>（5）流动性风险</p> <p>北京证券交易所投资门槛较高，初期参与的主体可能较少；此外，由于北京证券交易所上市企业规模小，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。</p> <p>（5）投资集中风险</p> <p>北京证券交易所上市公司主要属于创新型中小企业，其商业模式、盈利、风险和业绩波动等特征较为相似，因此基金难以通过分散投资来降低风险，若股票价格同向波动，将引起基金净值较大波动。</p> <p>（6）监管规则变化的风险</p> <p>北京证券交易所相关法律、行政法规、部门规章、规范性文件和交易所业务规则，可能根据市场情况进行修改完善，或者补充制定新的法律法规和业务规则，可能对基金投资运作产生影响，或导致本基金投资运作相应调整变化。</p> <p>综上，本基金主要投资于北京证券交易所股票，当上述股票表现不佳时，本基金的净值将会受到较大影响甚至产生亏损。投资者投资于本基金前，须充分认知和了解北京证券交易所上市股票的特点和发行、上市、交易、退市等</p> |
|--|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|  |  |                        |
|--|--|------------------------|
|  |  | 制度和规则，在理性判断的基础上做出投资选择。 |
|--|--|------------------------|