

华夏基金管理有限公司关于修订旗下深圳证券交易所交易型开放式证券投资基金基金合同、招募说明书的公告

深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司将自2019年10月21日起对在深交所上市的交易型开放式证券投资基金（以下简称“深交所ETF”）的交易结算模式进行优化调整，并已发布了相关实施细则。基于此，经与基金托管人协商一致并向中国证监会备案，华夏基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）对旗下深交所ETF的基金合同、招募说明书中申购赎回的确认以及清算交收等内容进行了相应修订。现将主要修订情况公告如下：

一、基金范围

基金名称	场内简称	基金代码
中小企业板交易型开放式指数基金	中小板	159902
恒生交易型开放式指数证券投资基金	恒生 ETF	159920
华夏创业板交易型开放式指数证券投资基金	创业板 HX	159957
华夏饲料豆粕期货交易型开放式证券投资基金	豆粕 ETF	159985
华夏创业板低波蓝筹交易型开放式指数证券投资基金	创蓝筹	159966
华夏创业板动量成长交易型开放式指数证券投资基金	创成长	159967
华夏中证四川国企改革交易型开放式指数证券投资基金	四川国改	159962

二、基金合同、招募说明书修订情况

本次基金合同及招募说明书修订内容主要为“基金份额的申购与赎回”章节中申购与赎回的确认及清算交收相关内容。以下为各基金基金合同或招募说明书具体修订内容，其中华夏创业板低波蓝筹交易型开放式指数证券投资基金和华夏创业板动量成长交易型开放式指数证券投资基金仅涉及招募说明书修订。（如基金合同与招募说明书修订一致，仅列示基金合同修订）

（一）中小企业板交易型开放式指数基金基金合同修订

章节	标题	修订前	修订后
全文		《中国证券登记结算有限责任公司关于深圳证券交易所上市的	《中国证券登记结算有限责任公司关于深圳证券交易所交易型

		交易型开放式指数基金登记结算业务实施细则》	开放式证券投资基金登记结算业务实施细则》
七、基金份额的申购与赎回	(五)场内申购赎回的程序 3.申购和赎回的清算交收与登记	<p>.....</p> <p>投资者 T 日申购、赎回成功后，中国结算深圳分公司在 T 日收市后为投资者办理组合证券的清算交收以及基金份额、现金替代的清算，在 T+1 日办理基金份额、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，并将结果发送给场内申购赎回代理机构、基金管理人、基金托管人。如果中国结算深圳分公司在清算交收时发现不能正常履约的情形，则依据《中国证券登记结算有限责任公司关于深圳证券交易所上市的交易型开放式指数基金登记结算业务实施细则》的有关规定进行处理。</p>	<p>.....</p> <p>投资者 T 日申购、赎回成功后，中国结算深圳分公司在 T 日收市后为投资者办理组合证券和基金份额的清算交收以及现金替代的清算，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，并将结果发送给场内申购赎回代理机构、基金管理人、基金托管人。如果中国结算深圳分公司在清算交收时发现不能正常履约的情形，则依据《中国证券登记结算有限责任公司关于深圳证券交易所交易型开放式证券投资基金登记结算业务实施细则》的有关规定进行处理。</p>

	
--	--	-------	-------

(二) 恒生交易型开放式指数证券投资基金基金合同修订

章节	标题	修订前	修订后
七、基金份额的申购与赎回	(五) 申购与赎回的程序 2、申购与赎回申请的确认	基金投资者 T 日的申购申请在当日进行确认, <i>T 日的赎回申请在 T+1 日进行确认。</i> 如投资者未能提供符合要求的申购对价, 则申购申请失败。如投资者持有的符合要求的基金份额不足或未能根据申购赎回清单要求准备足额的预估现金, 则赎回申请失败。	基金投资者 T 日的申购申请在当日进行确认, <i>T 日的赎回申请在当日进行确认。</i> 如投资者未能提供符合要求的申购对价, 则申购申请失败。如投资者持有的符合要求的基金份额不足或未能根据申购赎回清单要求准备足额的预估现金, 则赎回申请失败。
	(五) 申购与赎回的程序 3、申购与赎回的清算交收 (2) 赎回的清算交收投资者 T 日赎回申请受理后, <i>登记结算机构在 T 日收市后为投资者办理基金份额的清算, 在 T+1 日办理基金份额的交收。</i> 基金管理人在 T+2 日办理现金差额的清算, 在 T+3 日办理现金差额的交收。赎回替代金额的清算交收由基 (2) 赎回的清算交收投资者 T 日赎回申请受理后, <i>登记结算机构在 T 日收市后为投资者办理基金份额的清算交收。</i> 基金管理人在 T+2 日办理现金差额的清算, 在 T+3 日办理现金差额的交收。赎回替代金额的清算交收由基金管理和申购赎回代理机

		<p>金管理人和申购赎回代理机构协商处理。</p> <p>正常情况下，该款项的清算交收于 T+7 日（指开放日）内办理。</p> <p>但如果出现基金投资市场交易清算规则发生较大变化、基金赎回数额较大或组合证券内的部分证券因停牌、流动性不足等原因导致无法足额卖出，或国家外汇管理相关规定的限制等情况，则赎回款项的清算交收可延迟办理。</p> <p>.....</p>	<p>构协商处理。正常情况下，该款项的清算交收于 T+7 日（指开放日）内办理。但如果出现基金投资市场交易清算规则发生较大变化、基金赎回数额较大或组合证券内的部分证券因停牌、流动性不足等原因导致无法足额卖出，或国家外汇管理相关规定的限制等情况，则赎回款项的清算交收可延迟办理。</p> <p>.....</p>
--	--	---	---

(三) 华夏创业板交易型开放式指数证券投资基金基金合同修订

章节	标题	修订前	修订后
第七部分 基金份额的申购与赎回	四、申购与赎回的程序 1、场内申购与赎回的程序 (3) 申购和赎回的清算交收与登记	<p>.....</p> <p>投资者 T 日申购、赎回成功后，中国结算深圳分公司在 T 日收市后为投资者办理组合证券的清算交收以及基金份额、现金替代的清算，在 T+1 日办理基金份额、现金替代的交收以及现金</p>	<p>.....</p> <p>投资者 T 日申购、赎回成功后，中国结算深圳分公司在 T 日收市后为投资者办理组合证券和基金份额的清算交收以及现金替代的清算，在 T+1 日办理现金替代的交收以及现金差额的清</p>

		<p>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机构、基金管理人和基金托管人。如果中国结算深圳分公司在清算交收时发现不能正常履约的情形，则依据《中国证券登记结算有限责任公司关于深圳证券交易所交易型开放式基金登记结算业务实施细则》的有关规定进行处理。</p> <p>.....</p>	<p>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机构、基金管理人和基金托管人。如果中国结算深圳分公司在清算交收时发现不能正常履约的情形，则依据《中国证券登记结算有限责任公司关于深圳证券交易所交易型开放式基金登记结算业务实施细则》的有关规定进行处理。</p> <p>.....</p>
--	--	--	--

(四)华夏饲料豆粕期货交易型开放式证券投资基金基金合同修订及招募说明书修订

1、基金合同修订

章节	标题	修订前	修订后
第八部分 基金份额的申购与赎回	四、申购与赎回的程序 2、申购和赎回申请的确认	<p>投资者 T 日的申购申请在当日进行确认，<i>T 日的赎回申请在 T+1 日进行确认。</i>相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司对基金申购和赎回规则等相关规</p>	<p>投资者 T 日的申购申请在当日进行确认，<i>T 日的赎回申请在当日进行确认。</i>相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司对基金申购和赎回规则等相关规</p>

		定内容进行调整的，基金合同从其规定，并按照新规定执行，且此项修改无须召开基金份额持有人大会。如投资者未能提供符合要求的申购对价，则申购申请失败。如投资者持有的符合要求的基金份额不足或未能根据要求准备足额的现金，或基金投资组合内不具备足额的符合要求的赎回对价，则赎回申请失败。	定内容进行调整的，基金合同从其规定，并按照新规定执行，且此项修改无须召开基金份额持有人大会。如投资者未能提供符合要求的申购对价，则申购申请失败。如投资者持有的符合要求的基金份额不足或未能根据要求准备足额的现金，或基金投资组合内不具备足额的符合要求的赎回对价，则赎回申请失败。
--	--	--	--

2、招募说明书修订

章节	标题	修订前	修订后
十、基金份额的申购与赎回	(五) 申购和赎回的程序 2、申购和赎回申请的确认	投资者 T 日的申购申请在当日进行确认, <i>T 日的赎回申请在 T+1 日进行确认。</i> 相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司对基金申购和赎回规则等相关规定内容进行调整的，	投资者 T 日的申购申请在当日进行确认, <i>T 日的赎回申请在当日进行确认。</i> 相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司对基金申购和赎回规则等相关规定内容进行调整的，

		<p>基金合同从其规定，并按照新规定执行，且此项修改无须召开基金份额持有人大会。如投资者未能提供符合要求的申购对价，则申购申请失败。如投资者持有的符合要求的基金份额不足或未能根据要求准备足额的现金，或基金投资组合内不具备足额的符合要求的赎回对价，则赎回申请失败。</p> <p>.....</p>	<p>基金合同从其规定，并按照新规定执行，且此项修改无须召开基金份额持有人大会。如投资者未能提供符合要求的申购对价，则申购申请失败。如投资者持有的符合要求的基金份额不足或未能根据要求准备足额的现金，或基金投资组合内不具备足额的符合要求的赎回对价，则赎回申请失败。</p> <p>.....</p>
	<p>(五) 申购和赎回的程序 3、申购和赎回的清算交收 (2) 赎回的清算交收</p>	<p>投资者 T 日赎回申请受理后，登记结算机构在 T 日收市后为投资者办理基金份额的清算，在 T+1 日办理基金份额的交收。基金管理人通过登记结算机构在 T+1 日办理现金差额的清算，在 T+2 日办理现金差额的交收。</p> <p>.....</p>	<p>投资者 T 日赎回申请受理后，登记结算机构在 T 日收市后为投资者办理基金份额的清算交收。基金管理人通过登记结算机构在 T+1 日办理现金差额的清算，在 T+2 日办理现金差额的交收。</p> <p>.....</p>

(五) 华夏创业板低波蓝筹交易型开放式指数证券投资基金招募说明书修订

章节	标题	修订前	修订后
九、基金份额的申购与赎回	(五) 申购和赎回的程序 3、申购和赎回的清算交收与登记	<p>.....</p> <p>投资者 T 日申购、赎回成功后，登记机构在 T 日收市后为投资者办理组合证券的清算交收以及基金份额、现金替代的清算，在 T+1 日办理基金份额、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机构、基金管理人、基金托管人。如果登记机构在清算交收时发现不能正常履约的情形，则依据中国证券登记结算有限责任公司及相关证券交易所最新的规则和参与各方相关协议的有关规定进行处理。</p>	<p>.....</p> <p>投资者 T 日申购、赎回成功后，登记机构在 T 日收市后为投资者办理组合证券和基金份额的清算交收以及现金替代的清算，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机构、基金管理人和基金托管人。如果登记机构在清算交收时发现不能正常履约的情形，则依据中国证券登记结算有限责任公司及相关证券交易所最新的规则和参与各方相关协议的有关规定进行处理。</p>

(六) 华夏创业板动量成长交易型开放式指数证券投资基金招募说明书修订

章节	标题	修订前	修订后
九、基金份额的申购与赎回	(五) 申购和赎回的程序 3、申购和赎回的清算交收与登记	<p>.....</p> <p>投资者 T 日申购、赎回成功后，登记机构</p>	<p>.....</p> <p>投资者 T 日申购、赎回成功后，登记机构</p>

		<p>在T日收市后为投资者办理组合证券的清算交收以及基金份额、现金替代的清算，在T+1日办理基金份额、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机构、基金管理人、基金托管人和基金托管人。如果登记机构在清算交收时发现不能正常履约的情形，则依据中国证券登记结算有限责任公司及相关证券交易所最新的规则和参与各方相关协议的有关规定进行处理。</p>	<p>在T日收市后为投资者办理组合证券和基金份额的清算交收以及现金替代的清算，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机构、基金管理人和基金托管人。如果登记机构在清算交收时发现不能正常履约的情形，则依据中国证券登记结算有限责任公司及相关证券交易所最新的规则和参与各方相关协议的有关规定进行处理。</p>
--	--	--	---

(七)华夏中证四川国企改革交易型开放式指数证券投资基金基金合同及招募说明书修订

1、基金合同修订

章节	标题	修订前	修订后
第七部分 基金份额的申购与赎回		区分实物申购赎回和现金申购赎回两种方式。	删除现金申购赎回方式，保留实物申购赎回方式。
	第一段	本基金将采用实物申购赎回和现金申购赎回	删除左侧内容。

		回两种方式。其中，实物申购赎回通过中国证券登记结算有限责任公司办理，现金申购赎回通过深圳证券交易所办理。	
	七、其他业务	七、其他业务 3、基金管理人可在法律法规允许的范围内，在不影响基金份额持有人实质利益的前提下，根据市场情况对 上述 申购和赎回的安排进行补充和调整，基金管理人应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。	七 三、其他业务 3、基金管理人可在法律法规允许的范围内，在不影响基金份额持有人实质利益的前提下，根据市场情况对申购和赎回的 方式 、 安排等 进行补充和调整，基金管理人应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

2、招募说明书修订

章节	标题	修订前	修订后
重要提示	 本基金为交易型开放式指数证券投资基金（ETF），将在深圳证券交易所上市。由于本基金的标的指数组 本基金为交易型开放式指数证券投资基金（ETF），将在深圳证券交易所上市。由于本基金的标的指数组

	<p>合证券横跨深圳及上海两个证券交易所，其申购、赎回流程与组合证券仅在深圳或上海证券交易所上市的 ETF 产品有所差异。本基金拟采用实物申购赎回和现金申购赎回两种方式。其中，实物申购赎回通过中国证券登记结算有限责任公司办理，<i>现金申购赎回通过深圳证券交易所办理。</i>实物申购赎回方式中投资者的申购、赎回申请在 T+1 日确认，申购所得 ETF 份额及赎回所得组合证券在 T+2 日可用。如投资者需要通过申购赎回代理券商参与本基金的申购、赎回，则应同时持有并使用深圳 A 股账户与上海 A 股账户，且该两个账户的证件号码及名称属于同一投资者所有，同时用以申购、赎回</p>	<p>合证券横跨深圳及上海两个证券交易所，其申购、赎回流程与组合证券仅在深圳或上海证券交易所上市的 ETF 产品有所差异。本基金目前采用场外实物申购赎回方式，通过中国证券登记结算有限责任公司办理。场外实物申购赎回方式中投资者的申购、赎回申请在 T+1 日确认，申购所得 ETF 份额及赎回所得组合证券在 T+2 日可用。如投资者需要通过申购赎回代理券商参与本基金的申购、赎回，则应同时持有并使用深圳 A 股账户与上海 A 股账户，且该两个账户的证件号码及名称属于同一投资者所有，同时用以申购、赎回的深圳证券交易所股票的托管证券公司和上海 A 股账户的指定交易证券公司应为同一</p>
--	---	--

	<p>的深圳证券交易所股票的托管证券公司和上海 A 股账户的指定交易证券公司应为同一申购赎回代理券商。现金申赎方式中，只有现金申赎参与人可以参与本基金的现金申购赎回。现金申购赎回模式目前只能进行现金申购，暂不开通现金赎回业务。</p> <p>登记结算机构根据深圳证券交易所现金申购成交数据进行实时逐笔清算，并将清算结果发送参与人。对于日间勾单确认的交易，进行实时交收；对于日间未完成实时逐笔全额交收的现金申购，日末进行 T+0 逐笔全额非担保批量交收。T 日现金申购的 ETF 份额且日间完成实时交收的，T 日可以赎回，T 日可以竞价方式卖出；T 日现金申购的 ETF</p>	<p>申购赎回代理券商。</p> <p>未来，本基金管理人将根据市场和产品运行情况，适时增加场内申购赎回业务，场内申购赎回采用“部分实物、部分现金”的模式。</p> <p>……</p>
--	--	--

		<p>份额且日未完成逐笔全额非担保交收的，T+1日可以赎回，T+1日可以卖出。</p> <p>.....</p>	
九、基金份额的申购与赎回		区分实物申购赎回和现金申购赎回两种方式。	删除现金申购赎回方式，保留实物申购赎回方式。
	第一段	本基金将采用实物申购赎回和现金申购赎回两种方式。其中，实物申购赎回通过中国证券登记结算有限责任公司办理，现金申购赎回通过深圳证券交易所办理。	删除左侧内容。
	(七) 其他业务	<p>(七) 其他业务</p> <p>.....</p> <p>3、基金管理人可在法律法规允许的范围内，在不影响基金份额持有人实质利益的前提下，根据市场情况对上述申购和赎回的安排进行补充和调整，基金管理人应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公</p>	<p>(十四) 其他业务</p> <p>.....</p> <p>3、基金管理人可在法律法规允许的范围内，在不影响基金份额持有人实质利益的前提下，根据市场情况对申购和赎回的方式、安排等进行补充和调整，基金管理人应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介</p>

		告。	上公告。
十六、基金的信息披露	(五) 公开披露的基金信息 基金份额申购赎回清单公告	在开始办理基金份额申购或者赎回之后, 基金管理人将在每个开放日通过网站或其他媒介公告当日的实物 和现金 申购赎回清单。	在开始办理基金份额申购或者赎回之后, 基金管理人将在每个开放日通过网站或其他媒介公告当日的实物申购赎回清单。
十七、风险揭示	(二) 投资于本基金的特定风险 9、投资者申购失败的风险	如现金申赎参与人在提交现金申购申请时, 未能根据现金申购赎回清单的要求备足现金替代或预估现金差额, 则现金申购申请失败; 如果现金申赎参与人或申购赎回代理券商应付资金不足或出现违约, 现金申赎参与人的申购申请也可能失败。	删除左侧内容。

本次修订对基金份额持有人利益无实质性不利影响, 且已履行了规定的程序, 符合相关法律法规的规定, 修订自 2019 年 10 月 21 日起生效。届时投资者可登录基金管理人网站(www.ChinaAMC.com)查阅修订后的基金合同及招募说明书。

特此公告

华夏基金管理有限公司
二〇一九年十月十六日