

## 华泰柏瑞基金管理有限公司

### 关于华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金调整申赎结算模式并修改基金合同的公告

为更好地满足投资者需求,根据上海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,华泰柏瑞基金管理有限公司(以下简称“本公司”)经与基金托管人中国银行股份有限公司协商一致,并报中国证监会备案,决定自2020年1月20日起对旗下华泰柏瑞中证500交易型开放式指数证券投资基金(场内简称“ETF500”,交易代码“512510”,以下简称“本基金”)的申赎结算模式进行调整,并对本基金的基金合同作相应修改。调整后,投资者当日申购的基金份额,同日可以卖出,但不得赎回;当日买入的基金份额,同日可以赎回,但不得卖出;当日赎回的证券,同日可以卖出,但不得用于申购基金份额;当日买入的证券,同日可以用于申购基金份额,但不得卖出。

本次修订对原有基金份额持有人的利益无实质性不利影响,无需召开基金份额持有人大会。本基金基金合同的修改详见附件修订对照表。

本公司将于公告当日,将修订后的基金合同登载于本公司网站和中国证监会基金电子披露网站,并将按规定在相应更新招募说明书中对上述内容进行修改。

投资者可通过本基金管理人的网站:[www.huatai-pb.com](http://www.huatai-pb.com) 或拨打本基金管理人的客户服务电话:400-888-0001、(021) 38784638 了解详情。

风险提示: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。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。基金管理人提醒投资者,投资者投资于基金前应认真阅读基金合同、招募说明书等文件。敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

华泰柏瑞基金管理有限公司

2020年1月15日

附件：《华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金修改基金合同条款的修订对照表》

修改前	修改后
第一部分 前言和释义	
<p>41、《业务规则》：指上海证券交易所发布实施的《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》，中国证券登记结算有限责任公司发布实施的《中国证券登记结算有限责任公司关于上海证券交易型开放式基金登记结算业务实施细则》及销售机构业务规则等相关业务规则和实施细则</p>	<p>41、《业务规则》：指上海证券交易所发布实施的《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》，中国证券登记结算有限责任公司发布实施的《中国证券登记结算有限责任公司关于交易所交易型开放式<b>证券投资</b>基金登记结算业务实施细则》及销售机构业务规则等相关业务规则和实施细则</p>
第七部分 基金份额的申购与赎回	
<p>2、申购和赎回申请的确认</p> <p>基金投资者申购、赎回申请在受理当日进行确认。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，或本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>投资者申购的基金份额当日可卖出，<del>当日未卖出的基金份额在份额交收成功之前不得卖出和赎回</del>；投资者赎回获得的股票当日可卖出。</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<del>《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》、《中国证券登记结算有限责任公司关于上海证券交易所交易型开放式基金登记结算业务实施细则》</del>和参与各方相关协议的有关规定。</p> <p>投资者 T 日申购成功后，登记机构在 T 日收市后办理上交所上市的成份股交收与<del>申购当日卖出</del>基金份额的交收登记以及现金替代的清算；在 T+1 日办理现金替代的交收与<del>申购当日未卖出</del>基金份额的交收登记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。<del>现金替代交收失败的，该笔申购当日未卖出基金份额交收失败。</del></p> <p>投资者 T 日赎回成功后，登记机构在 T 日收市后办理上交所上市的成份股交收与基金份额的注销以及现金替代的清算；在 T+1 日办理上</p>	<p>2、申购和赎回申请的确认</p> <p>基金投资者申购、赎回申请在受理当日进行确认。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，或本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>投资者申购的基金份额当日<b>起</b>可卖出，投资者赎回获得的股票当日<b>起</b>可卖出。</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<b>相关业务规则</b>和参与各方相关协议<b>及其不时修订</b>的有关规定。</p> <p>投资者 T 日申购成功后，登记机构在 T 日收市后办理上交所上市的成份股交收与基金份额的交收登记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券商、基金管理人和基金托管人。</p> <p>投资者 T 日赎回成功后，登记机构在 T 日收市后办理上交所上市的成份股交收与基金份额的注销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券商、基金管理人和基金托管人。</p> <p>如果登记机构和基金管理人在清算交收时发现不能正常履约的情形，则依据<b>相关业务规则</b>和参与各方相关协议<b>及其不时修订</b>的有关规定进行处理。</p> <p>登记机构和基金管理人可在法律法规允许的范</p>

<p>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。<del>基金管理人</del>不迟于 T+3 日办理赎回的深交所上市的成份股现金替代的交付。</p> <p>如果登记机构和基金管理人在清算交收时发现不能正常履约的情形，则依据 <del>《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》、《中国证券登记结算有限责任公司关于上海证券交易所交易型开放式基金登记结算业务实施细则》</del>和参与各方相关协议的有关规定进行处理。登记机构和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，对申购和赎回的程序进行调整，并最迟于开始实施前 3 个工作日在按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上予以公告。</p>	<p>围内，在不影响基金份额持有人实质利益的前提下，对申购和赎回的程序进行调整，并最迟于开始实施前 3 个工作日在按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上予以公告。</p>
--	---