

易方达基金管理有限公司关于易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金调整申赎结算模式及申购现金替代保证金、赎回替代金额相关业务规则并修订法律文件的公告

根据 2021 年 7 月 9 日修订发布的《中国证券登记结算有限责任公司上海分公司交易型开放式基金登记结算业务指南》的有关规定，易方达基金管理有限公司（以下简称“本公司”）决定自 2021 年 7 月 26 日起调整易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”，基金代码：510900，场内简称及扩位证券简称：H 股 ETF）的申赎结算模式及申购现金替代保证金、赎回替代金额相关业务规则，并相应修订基金法律文件。现将相关事项公告如下：

一、调整申赎结算模式业务规则

本公司对本基金申赎结算模式相关业务规则进行调整，调整后：

1、基金申购业务采用实时逐笔全额结算（Real Time Gross Settlement，简称 RTGS）模式；赎回业务涉及的现金替代采用代收代付处理；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处理；

2、投资者申购、赎回申请在受理当日进行确认。投资者当日申购的基金份额，清算交收完成后方可卖出和赎回，即 T 日申购的基金份额且日间完成 RTGS（实时逐笔全额结算）交收的，T 日可卖出和赎回，而 T 日申购的基金份额且日终完成逐笔全额非担保交收的，T+1 日方可卖出和赎回。

根据调整后的申赎结算模式相关业务规则，本公司经与基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，对本基金的基金合同及托管协议进行修订，修订后的基金合同及托管协议于 2021 年 7 月 21 日在本公司网站（www.efunds.com.cn）及中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）发布，修订内容自 2021 年 7 月 26 日起生效，具体修订内容详见附件《易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金基金合同、托管协议修订对照表》。

上述修订系因申赎结算模式相关业务规则发生变动而进行的修改，基金管理人已履行了规定的程序，符合相关法律法规规定及基金合同约定。

二、申购现金替代保证金、赎回替代金额相关业务规则的调整方案

调整前，对于 T 日申购申请，T+2 日日终，基金管理人根据所购入的被替代证券的实际单位购入成本和被替代证券的 T+2 日收盘价计算被替代证券的单位结算成本，在此基础上根据替代证券数量和申购现金替代保证金确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项。T+2 日后的第 2 个上海证券交易所和香港证券交易所共同交易日，基金管理人将应退款或补款与相关申购赎回代理券商办理交收。若发生特殊情况，基金管理人可以对交收日期进行相应调整。

对于 T 日赎回申请，T+2 日日终，基金管理人根据所卖出的被替代证券的实际单位卖出金额和被替代证券的 T+2 日收盘价计算被替代证券的单位结算金额，在此基础上根据替代证券数量确定赎回替代金额。T+2 日后的第 4 个上海证券交易所和香港证券交易所共同交易日内，基金管理人将应支付的赎回替代金额与相关申购赎回代理券商办理交收。若发生特殊情况，基金管理人可以对交收日期进行相应调整。

调整后，对于 T 日申购申请，T+1 日日终，基金管理人根据所购入的被替代证券的实际单位购入成本和被替代证券的 T+1 日收盘价计算被替代证券的单位结算成本，在此基础上根据替代证券数量和申购现金替代保证金确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项。T+1 日后的第 3 个上海证券交易所和香港证券交易所共同交易日内，基金管理人将应退款或补款与相关申购赎回代理券商办理交收。若交收期间出现非港股通交收日或其它特殊情况，基金管理人可以对交收日期进行相应调整。

对于 T 日赎回申请，T+1 日日终，基金管理人根据所卖出的被替代证券的实际单位卖出金额和被替代证券的 T+1 日收盘价计算被替代证券的单位结算金额，在此基础上根据替代证券数量确定赎回替代金额。T+1 日后的第 4 个上海证券交易所和香港证券交易所共同交易日内，基金管理人将应支付的赎回替代金额与相关申购赎回代理券商办理交收。若交收期间出现非港股通交收日或其它特殊情况，基金管理人可以对交收日期进行相应调整。

即调整后申购现金替代保证金、赎回替代金额的处理如下：

1、申购现金替代保证金的处理程序

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，并据此收取申购现金替代保证金。

对于确认成功的 T 日申购申请，基金管理人可以通过在香港市场交易或港股通等方式代投资者买入相关证券。T+1 日日终，基金管理人根据所购入的被替代证券的实际单位购入成本（包括买入价格与相关费用，折算为人民币，折算汇率采用汇率公允价，汇率公允价包括中国外汇交易中心收盘价、与基金托管人商定的其他公允价格等）和被替代证券的 T+1 日收盘价（折算为人民币，折算汇率采用汇率公允价，汇率公允价包括中国外汇交易中心收盘价、与基金托管人商定的其他公允价格等；被替代证券 T+1 日在证券交易所无交易的，取最近交易日的收盘价）计算被替代证券的单位结算成本，在此基础上根据替代证券数量和申购现金替代保证金确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项，若 T 日后至 T+1 日期间发生除息、送股（转增）、配股等重要权益变动，则进行相应调整。T+1 日后的第 3 个上海证券交易所和香港证券交易所共同交易日内，基金管理人将应退款或补款与相关申购赎回代理券商办理交收。若交收期间出现非港股通交收日或其它特殊情况，基金管理人可以对交收日期进行相应调整。

2、赎回替代金额的处理程序

对于确认成功的 T 日赎回申请，基金管理人可以通过在香港市场交易或港股通等方式代投资者卖出相关证券。T+1 日日终，基金管理人根据所卖出的被替代证券的实际单位卖出金额（扣除相关费用，折算为人民币，折算汇率采用汇率公允价，汇率公允价包括中国外汇交易中心收盘价、与基金托管人商定的其他公允价格等）和被替代证券的 T+1 日收盘价（折算为人民币，折算汇率采用汇率公允价，汇率公允价包括中国外汇交易中心收盘价、与基金托管人商定的其他公允价格等；被替代证券 T+1 日在证券交易所无交易的，取最近交易日的收盘价）计算被替代证券的单位结算金额，在此基础上根据替代证券数量确定赎回替代金额，若 T 日后至 T+1 日期间发生除息、送股（转增）、配股等重要权益变动，则进行相应调整。T+1 日后的第 4 个上海证券交易所和香港证券交易所共同交易日内，基金管理人将应支付的赎回替代金额与相关申购赎回代理券商办理交收。若交收期间出现非港股通交收日或其它特殊情况，基金管理人可以对交收日期进行相应调整。

上述调整自 2021 年 7 月 26 日起生效，本公司根据调整后业务规则更新了本基金招募说明书相关内容，更新后的招募说明书于 2021 年 7 月 21 日在本公司网

站（www.efunds.com.cn）及中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）发布。

三、申购赎回业务安排

为保障基金平稳运作，**本基金将于 2021 年 7 月 23 日暂停申购和赎回业务，场内仍正常交易。自 2021 年 7 月 26 日起，本基金恢复申购和赎回业务。**请投资者提前做好相关安排并关注基金二级市场交易价格波动风险及折溢价风险。

四、重要提示

1、本公告仅对本基金调整申赎结算模式及申购现金替代保证金、赎回替代金额相关业务规则的有关事项予以说明。投资者欲了解本基金的详细情况，请仔细阅读基金合同、更新的招募说明书等基金法律文件。

投资者一旦申购或赎回本基金，即表示对基金申购赎回所涉及的基金份额的证券变更登记方式以及申购赎回所涉及现金替代、现金差额等相关的交收方式及业务规则已经认可。投资者在申购赎回代办证券公司办理本基金申购、赎回业务前，应全面了解相关业务规则及可能产生的风险。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

2、投资者可通过以下途径咨询有关详情：

客户服务电话：400-881-8088

网址：www.efunds.com.cn

3、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。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。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，全面认识基金产品的风险收益特征，在了解产品情况及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。

附件：《易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金基金合同、托管协议修订对照表》

易方达基金管理有限公司

2021 年 7 月 21 日

附件：《易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金基金合同、托管协议修订对照表》

《易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金基金合同》		
章节	修订前	修订后
二、释义	登记结算业务 《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指数基金登记结算业务实施细则》定义的基金份额的登记、托管和结算业务	登记结算业务 《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证券投资基金登记结算业务实施细则》及其不时修订以及相关业务规则定义的基金份额的登记、托管和结算业务
八、基金份额的申购、赎回	（三）申购与赎回的原则 （4）申购、赎回应遵守《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》的规定。 （四）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、赎回申请由登记结算机构在 T+1 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，则赎回申请失败。 3、日常申购和赎回的清算交收与登记 本基金申购赎回过程中涉及的现金和基金份额交收适用《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指数基金登记结算业务实施细则》。 投资者 T 日申购成功后，登记结算机构在 T+1 日收市后为投资者办理基金份额与现金替代等的交收以及现金差额等的清算，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。基金管理人于申购赎回代理券商在 T+2 日办理现金差额的交收。 投资者 T 日赎回成功后，登记结算机构在 T+1 日收市后为投资者办理基金份额的交收以及现金差额等的清算，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。基金管理人于申购赎回代理券商在	（三）申购与赎回的原则 （4）申购、赎回应遵守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 and 规定。 （四）申购与赎回的程序 2、申购与赎回申请的确认 本基金申购申请、赎回申请的确认根据登记结算机构的相关规定办理，具体见本基金招募说明书。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，则赎回申请失败。 3、日常申购和赎回的清算交收与登记 本基金申购赎回过程中涉及的基金份额、现金替代、现金差额及其他对价的清算交收适用上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司相关业务规则和参与各方相关协议及其不时修订的有关规定，详见本基金招募说明书及其更新。 赎回现金替代款将自有效赎回申请之日起 10 个工作日内划往基金份额持有人账户。外汇局相关规定有变更或本基金境外投资主要市场的交易清算规则有变更时，赎回现金替代款支付时间将相应调整。当基金境外投资主要市场休市或暂停交易时，赎回现金替代款支付时间顺延。 如果登记结算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，则依据上海证券交易所、中国证券登记结算有限责

	T+2 日办理现金差额的交收。赎回现金替代款将自有效赎回申请之日起 10 个工作日内划往基金份额持有人账户。外汇局相关规定有变更或本基金境外投资主要市场的交易清算规则有变更时，赎回现金替代款支付时间将相应调整。当基金境外投资主要市场休市或暂停交易时，赎回现金替代款支付时间顺延。 如果登记结算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关于上海证券交易所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。若发生特殊情况，基金管理人可以对交收日期进行相应调整。	任公司相关业务规则和参与各方相关协议及其不时修订的有关规定进行处理。若发生特殊情况，基金管理人可以对交收日期进行相应调整。
《易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金托管协议》		
章节	修订前	修订后
八、交易及清算交收安排	（三）申购、赎回的资金清算和数据传递的时间、程序 T 日的申购赎回发生的证券交收由证券登记结算公司在 T+1 日收市后完成，基金托管人应在 T+1 日日终核对登记结算公司发送的证券及资金余额。申购赎回发生的现金差额于 T+2 日交收，基金托管人根据登记公司的结算通知办理资金的划拨。申购现金替代款的退款、补款和赎回现金替代款的退款由基金管理人根据《招募说明书》办理。	（三）申购、赎回的资金清算和数据传递的时间、程序 本基金申购赎回过程中涉及的基金份额、现金替代、现金差额及其他对价的清算交收适用上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司相关业务规则和参与各方相关协议及其不时修订的有关规定，详见本基金招募说明书及其更新。如遇特殊情况，双方协商处理。