

华泰柏瑞基金管理有限公司关于修订上证红利交易型开放式指数证 券投资基金基金合同的公告

为满足投资运作的需要，并在不损害现有基金份额持有人利益的前提下，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》以及《上证红利交易型开放式指数证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，经与基金托管人协商一致，并向中国证监会备案，华泰柏瑞基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”或“本公司”）拟对旗下上证红利交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）的《基金合同》关于基金份额折算及收益分配的相关条款进行修订。

本次《基金合同》修订内容如下：

1、“二、释义”中：

“基金累计报酬率：指收益评价日基金份额净值与基金份额折算日基金份额净值之比减去 100%；

标的指数同期累计报酬率：指收益评价日标的指数收盘值与基金份额折算日标的指数收盘值之比减去 100%；”

拟修改为：

“基金累计报酬率：指收益评价日基金份额净值（如上市后基金份额发生折算，则采用剔除上市后折算因素的基金份额净值）与上市前基金份额折算日基金份额净值之比减去 100%；

标的指数同期累计报酬率：指收益评价日标的指数收盘值与上市前基金份额折算日标的指数收盘值之比减去 100%；”

2、“六、基金份额折算与变更登记”中“（二）基金份额折算的原则”条款：

“基金份额折算由基金管理人办理，并由登记结算机构进行基金份额的变更登记。折算后的基金份额净值与折算日标的指数收盘值的千分之一基本一致。

基金份额折算后，本基金的基金份额总额与基金份额持有人持有的基金份额数额将发生调整，但调整后的基金份额持有人持有的基金份额占基金份额总额的比例不发生变化。基金份额折算对基金份额持有人的权益无实质性影响。基金份额折算后，基金份额持有人将按照折算后的基金份额享有权利并承担义务。

如果基金份额折算过程中发生不可抗力，基金管理人可延迟办理基金份额折算。”

拟修改为：

“基金份额折算由基金管理人办理，并由登记结算机构进行基金份额的变更登记。

基金份额折算后，本基金的基金份额总额与基金份额持有人持有的基金份额数额将发生调整，但调整后的基金份额持有人持有的基金份额占基金份额总额的比例不发生变化。基金份额折算对基金份额持有人的权益无实质性影响。基金份额折算后，基金份额持有人将按照折算后的基金份额享有权利并承担义务。

如果基金份额折算过程中发生不可抗力或遇特殊情况无法办理，基金管理人可延迟办理基金份额折算。”

3、“六、基金份额折算与变更登记”中“（三）基金份额折算的方法”条款：

“对基金份额折算后的基金份额持有人持有的基金份额采取四舍五入的方法保留到整数位，由此产生的误差归入基金资产。基金份额折算的具体方法由招募说明书规定。

基金份额折算的具体方法在份额折算公告中列示。”

拟修改为：

“基金份额折算的具体方法在份额折算公告中列示。”

4、“二十、基金收益与分配”中“（三）收益分配原则”条款：

“4、基金收益分配比例的确定原则：根据上证红利指数成份股当季分红实际情况，尽量做到每季均匀分红，并使收益分配后基金份额净值尽可能贴近标的指数的千分之一。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使还原后基金份额净值低于面值。”

拟修改为：

“4、基金收益分配比例的确定原则：根据上证红利指数成份股当季分红实际情况，尽量做到每季均匀分红并使收益分配后基金累计报酬率尽可能贴近标的指数同期累计报酬率。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使还原后基金份额净值低于面值。”

5、“二十、基金收益与分配”中“（四）基金收益分配数额的确定原则”条款：

“1、在收益评价日，基金管理人计算基金累计报酬率、标的指数同期累计报酬率。

基金累计报酬率为收益评价日基金份额净值与基金份额折算日基金份额净值之比减去1乘以100%；标的指数同期累计报酬率为收益评价日标的指数收盘价与基金份额折算日标的指数收盘价之比减去1乘以100%。

基金管理人将以此计算截至收益评价日基金超过标的指数的收益率=基金累计报酬率

一标的指数同期累计报酬率

当超额收益率超过 1%时，基金管理人有权进行收益分配。”

拟修改为：

“1、在收益评价日，基金管理人计算基金累计报酬率、标的指数同期累计报酬率。

基金累计报酬率为收益评价日基金份额净值（如上市后基金份额发生折算，则采用剔除上市后折算因素的基金份额净值）与上市前基金份额折算日基金份额净值之比减去 1 乘以 100%；标的指数同期累计报酬率为收益评价日标的指数收盘价与上市前基金份额折算日标的指数收盘价之比减去 1 乘以 100%。

剔除上市后折算因素的基金份额净值 =

$$\frac{\text{基金资产净值}}{\text{基金份额总额}} \times \prod_i \text{上市后第} i \text{次基金份额折算比例}$$

注： \prod_i 为联乘符号。当基金份额折算比例为 N 时，表示每一份基金份额折算为 N 份。

基金管理人将以此计算截至收益评价日基金超过标的指数的收益率=基金累计报酬率-标的指数同期累计报酬率

当超额收益率超过 1%时，基金管理人有权进行收益分配。”

本次修订对原有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变化，不需召开基金份额持有人大会，并已报中国证监会备案。

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 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。

本公告对本基金修改《基金合同》有关事项予以说明。投资者欲了解基金的信息情况，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。

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（更新）、基金产品资料概要（更新）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

二〇二二年三月二十九日