

华夏基金管理有限公司关于调整旗下华夏中证新材料主题 ETF、华夏中证内地低碳经济主题 ETF 申购赎回现金替代相关内容并修订招募说明书的公告

根据华夏中证新材料主题交易型开放式指数证券投资基金、华夏中证内地低碳经济主题交易型开放式指数证券投资基金标的指数成份股的定期调整情况，为更好地满足投资者的投资需求，维护基金份额持有人利益，经与上述基金托管行协商一致，华夏基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）决定自2024年7月1日起对上述基金招募说明书（更新）中涉及申购赎回现金替代的相关内容进行修订，并补充标的指数成份股调整后基金投资北京证券交易所股票的特别投资风险，上述调整及招募说明书（更新）修订内容自2024年7月1日起生效。现将具体情况公告如下：

一、涉及基金

序号	基金名称	基金简称	基金代码	场内简称
1	华夏中证新材料主题交易型开放式指数证券投资基金	华夏中证新材料主题 ETF	516710	新材料 50（扩位简称：新材料 50ETF）
2	华夏中证内地低碳经济主题交易型开放式指数证券投资基金	华夏中证内地低碳经济主题 ETF	159790	碳中和 ETF

二、招募说明书（更新）修订

（一）华夏中证新材料主题 ETF 招募说明书（更新）修订

修订前	修订后
八、基金份额的申购与赎回 （七）申购赎回清单的内容与格式 3、现金替代相关内容 （1）现金替代分为 4 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”）、必须现金替代（标志为“必须”）和退补现金替代（标志为“退补”）。	八、基金份额的申购与赎回 （七）申购赎回清单的内容与格式 3、现金替代相关内容 （1）现金替代分为 4 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”）、必须现金替代（标志为“必须”）和退补现金替代（标志为“退补”）。

<p>退补现金替代适用于深交所上市的成份股，是指在申购赎回基金份额时，该成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>.....</p> <p>(4) 退补现金替代</p> <p>①适用情形：退补现金替代的证券目前仅适用于相应指数中深交所股票。</p> <p>.....</p> <p>实时申报的原则为：基金管理人在深交所连续竞价期间，根据收到的上交所申购赎回确认记录，在技术系统允许的情况下实时向深交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，深圳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>退补现金替代适用于非上交所上市的成份股，是指在申购赎回基金份额时，该成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>.....</p> <p>(4) 退补现金替代</p> <p>①适用情形：退补现金替代的证券目前仅适用于相应指数中非上交所股票。</p> <p>.....</p> <p>实时申报的原则为：基金管理人在相关证券交易所连续竞价期间，根据收到的上交所申购赎回确认记录，在技术系统允许的情况下实时向相关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，相关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>十八、风险揭示</p> <p>增加右侧有关北交所股票投资风险。</p>	<p>十八、风险揭示</p> <p>26、北交所股票投资风险</p> <p>本基金将投资于北交所股票，所面临的特有风险包括但不限于：</p>

①流动性风险

北京证券交易所投资者门槛较高，流动性可能弱于 A 股其他板块，且机构投资者可能在特定阶段对北交所股票形成一致性预期，存在基金持有股票无法正常成交的风险。如果北交所成分券采用代理买卖，则可能因为流动性问题加大代理买卖风险，导致基金管理人无法遵循“时间优先、实时申报”原则进行处理，从而影响投资者的投资损益。

②转板风险

基金所投资北京证券交易所上市的公司为满足证券法和证监会规定的基本上市条件和符合交易所规定的具体上市条件可申请转板上市。交易所需审核并做出是否同意上市的决定。无论上市公司是否转板成功，均可能引起基金净值波动。

③投资集中风险

因北京证券交易所上市的公司大部分为新兴产业公司，其商业模式、盈利风险、业绩波动等特征较为相似，基金难以通过分散投资降低投资风险，若股票价格同向波动，将引起基金净值波动

④经营风险

因北京证券交易所上市的公司大部分为新兴产业公司，其商业模式和盈利能力存在较高的不确定性，可能面临一定的经营风险，给基金净值带来不利影响。

⑤退市风险

北京证券交易所上市的公司后续经营期间如果触及相关法律法规、证监会及交易所等规定的退市情形，可能面临被终止上市的风险，从而可能给基金净值带来不利影响。

⑥股价波动风险

	北交所股票涨跌幅限制比例区间相对较大，存在北交所股票价格波幅较大而导致基金亏损的风险。
--	---

(二) 华夏中证内地低碳经济主题 ETF 招募说明书 (更新) 修订

修订前	修订后
<p>重要提示</p> <p>.....</p> <p>本基金为交易型开放式指数证券投资基金 (ETF), 在深圳证券交易所上市。由于本基金的标的指数组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。本基金采用场内“深市股票实物申赎, 沪非股票现金替代”的申赎模式, 通过深圳证券交易所办理。</p> <p>.....</p>	<p>重要提示</p> <p>.....</p> <p>本基金为交易型开放式指数证券投资基金 (ETF), 在深圳证券交易所上市。由于本基金的标的指数组合证券横跨深圳及非深圳证券交易所, 其申购、赎回流程与组合证券仅在深圳证券交易所上市的ETF产品有所差异。本基金采用场内“深市股票实物申赎, 非深市股票现金替代”的申赎模式, 通过深圳证券交易所办理。</p> <p>.....</p>
<p>九、基金份额的申购与赎回</p> <p>(七) 申购赎回清单的内容与格式</p> <p>.....</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>对于沪市成份证券, 可以设为: “允许”和“必须”。</p> <p>.....</p> <p>当可以现金替代适用于上交所上市的成份股, 是指在申购赎回基金份额时, 该成份</p>	<p>九、基金份额的申购与赎回</p> <p>(七) 申购赎回清单的内容与格式</p> <p>.....</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>对于非深市成份证券, 可以设为: “允许”和“必须”。</p> <p>.....</p> <p>当可以现金替代适用于非深交所上市的成份股, 是指在申购赎回基金份额时, 该成份证券必须</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。

.....

②可以现金替代

可以现金替代的组合证券分为：深市成份证券和~~沪市~~成份证券。

.....

【2】对于~~沪市~~成份证券

i. 适用情形：投资者申购和赎回时的~~沪市~~成份证券。

ii. 替代金额：对于可以现金替代的~~沪市~~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+现金替代溢价比例）

赎回替代金额=替代证券数量×该证券参考价格×（1-现金替代折价比例）

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~~上海证券交易所~~参考价格确定原则发生变化，以~~上海证券交易所~~通知规定的参考价格为准。

.....

iii. 替代金额的处理程序

.....

实时申报的原则为：基金管理人在~~上海证券交易所~~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~~上海证券交易所~~申报被替代证券的交易指令。

.....

特例情况：若自T日起，~~上海证券交易所~~

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。

.....

②可以现金替代

可以现金替代的组合证券分为：深市成份证券和~~非深市~~成份证券。

.....

【2】对于~~非深市~~成份证券

i. 适用情形：投资者申购和赎回时的~~非深市~~成份证券。

ii. 替代金额：对于可以现金替代的~~非深市~~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+现金替代溢价比例）

赎回替代金额=替代证券数量×该证券参考价格×（1-现金替代折价比例）

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~~该证券上市交易所~~参考价格确定原则发生变化，以~~该证券上市交易所~~通知规定的参考价格为准。

.....

iii. 替代金额的处理程序

.....

实时申报的原则为：基金管理人在~~相关证券交易所~~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~~相关证券交易所~~申报被替代证券的交易指令。

.....

特例情况：若自T日起，~~相关证券交易所~~正常交易日已达到20日而该证券正常交易日低于2日，

<p>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>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>十八、风险揭示</p> <p>（一）投资于本基金的主要风险</p> <p>增加右侧有关北交所股票投资风险。</p>	<p>十八、风险揭示</p> <p>（一）投资于本基金的主要风险</p> <p>8、北交所股票投资风险</p> <p><i>本基金将投资于北交所股票，所面临的特有风险包括但不限于：</i></p> <p>①流动性风险</p> <p><i>北京证券交易所投资者门槛较高，流动性可能弱于 A 股其他板块，且机构投资者可能在特定阶段对北交所股票形成一致性预期，存在基金持有股票无法正常成交的风险。如果北交所成分券采用代理买卖，则可能因为流动性问题加大代理买卖风险，导致基金管理人无法遵循“时间优先、实时申报”原则进行处理，从而影响投资者的投资损益。</i></p> <p>②转板风险</p> <p><i>基金所投资北京证券交易所上市的公司满足证券法和证监会规定的基本上市条件和符合交易所规定的具体上市条件可申请转板上市。交易所需审核并做出是否同意上市的决定。无论上市公司是否</i></p>

	<p>转板成功，均可能引起基金净值波动。</p> <p>③投资集中风险</p> <p>因北京证券交易所上市的公司大部分为新兴产业公司，其商业模式、盈利风险、业绩波动等特征较为相似，基金难以通过分散投资降低投资风险，若股票价格同向波动，将引起基金净值波动</p> <p>④经营风险</p> <p>因北京证券交易所上市的公司大部分为新兴产业公司，其商业模式和盈利能力存在较高的不确定性，可能面临一定的经营风险，给基金净值带来不利影响。</p> <p>⑤退市风险</p> <p>北京证券交易所上市的公司后续经营期间如果触及相关法律法规、证监会及交易所等规定的退市情形，可能面临被终止上市的风险，从而可能给基金净值带来不利影响。</p> <p>⑥股价波动风险北交所股票涨跌幅限制比例区间相对较大，存在北交所股票价格波幅较大而导致基金亏损的风险。</p>
<p>十八、风险揭示</p> <p>(二) 投资于本基金的特有风险</p> <p>.....</p> <p>14、沪市成份证券申赎处理规则带来的风险</p> <p>对于“可以现金替代”的沪市成份证券，在申购赎回基金份额时必须使用现金作为替代，采取基金管理人代买代卖模式，可能给投资者申购和赎回带来价格的不确定性。这种价格的不确定性可能影响本基金二级市场的折溢价水平。基金管理人不对“时间优先、实时申报”</p>	<p>十八、风险揭示</p> <p>(二) 投资于本基金的特有风险</p> <p>.....</p> <p>14、非深市成份证券申赎处理规则带来的风险</p> <p>对于“可以现金替代”的非深市成份证券，在申购赎回基金份额时必须使用现金作为替代，采取基金管理人代买代卖模式，可能给投资者申购和赎回带来价格的不确定性。这种价格的不确定性可能影响本基金二级市场的折溢价水平。基金管理人不对“时间优先、实时申报”原则的执行效率和结果做出任何承诺和保证，现金替代退补款的计算以实</p>

原则的执行效率和结果做出任何承诺和保证，现金替代退补款的计算以实际成交价格和基金招募说明书的约定为准。若因技术系统、通讯链路或其他原因导致基金管理人无法遵循“时间优先、实时申报”原则对“可以现金替代”的沪市成份证券进行处理，可能影响投资者的投资损益。

.....

实际成交价格和基金招募说明书的约定为准。若因技术系统、通讯链路或其他原因导致基金管理人无法遵循“时间优先、实时申报”原则对“可以现金替代”的非深市成份证券进行处理，可能影响投资者的投资损益。

15、申购赎回的代理买卖风险

基金管理人可在招募说明书规定的时间内以收到的替代金额代投资者买入或卖出小于等于被替代证券数量的任意数量的被替代证券，实际买入被替代证券的价格可能处于规定时间内较高的位置或处于最高价格，实际卖出被替代证券的价格可能处于规定时间内较低的位置或处于最低价格，基金管理人对此不承担责任。基金管理人有权根据基金投资的需要自主决定不买入或不卖出部分被替代证券，或者不进行任何买入或卖出证券的操作，基金管理人可能不买入或不卖出被替代证券的情形包括但不限于市场流动性不足、技术系统无法实现、申购赎回轧差以及基金管理人认为不应买入或卖出的其他情形。

.....

三、重要提示

本次规则调整和招募说明书（更新）修订已履行了规定的程序，符合相关法律法规及上述基金基金合同的规定。自 2024 年 7 月 1 日起，上述调整及招募说明书（更新）修订内容生效，届时投资者可登录本基金管理人网站（www.ChinaAMC.com）查阅上述基金修订后的招募说明书（更新）。

本公告仅对本次调整申购赎回现金替代的有关事项予以说明，投资者欲了解上述基金的详细情况，请登录本基金管理人网站（www.ChinaAMC.com）仔细阅读上述基金基金合同、招募说明书、产品资料概要等法律文件及其更新。

投资者如有疑问，请登录本基金管理人网站（www.ChinaAMC.com）或拨打本基金管理人客户服务电话（400-818-6666）了解、咨询相关信息。

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基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。投资者在投资基金之前，请仔细阅读有关基金的基金合同、招募说明书、基金产品资料概要等法律文件，全面认识基金的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，在了解产品情况、听取销售机构适当性匹配意见的基础上，理性判断市场，谨慎做出投资决策。基金具体风险评级结果以销售机构提供的评级结果为准。

特此公告

华夏基金管理有限公司
二〇二四年六月二十七日