

华泰柏瑞基金管理有限公司

关于华泰柏瑞南方东英恒生科技指数交易型开放式指数证券投资基金（QDII）申购赎回现金替代有关处理程序的提示性公告

为更好地服务投资者，满足投资者的投资需求，根据上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的有关业务规则，以及华泰柏瑞南方东英恒生科技指数交易型开放式指数证券投资基金（QDII）（证券简称：恒生科技；扩位证券简称：恒生科技 ETF；交易代码：513130；以下简称“本基金”）基金合同、招募说明书（更新）的相关规定，在投资香港市场时，本基金可通过合格境内机构投资者（QDII）境外证券投资额度或内地与香港股票市场交易互联互通机制进行投资。现将具体情况提示如下：

一、基金管理人代理申赎投资者买券卖券的风险

因涉及香港市场证券的买卖，在投资者申购、赎回本基金时，本基金组合证券需以现金形式进行替代，并由基金管理人按照招募说明书（更新）的约定在投资人申购或赎回时代投资人买入或卖出证券，投资者需承受买入组合证券的结算成本和卖出组合证券的结算金额的不确定性（含汇率波动风险）。

本基金可通过合格境内机构投资者（QDII）境外证券投资额度或内地与香港股票市场交易互联互通机制进行投资。当基金管理人使用内地与香港股票市场交易互联互通机制代理申赎投资者买卖组合证券时，相比使用合格境内机构投资者（QDII）额度在香港联合交易所买卖证券所适用汇率以及相应费用水平有所不同，可能导致在两种方式下被替代证券的实际购入成本或实际卖出金额不同，进而增加投资者承受买入组合证券的结算成本和卖出组合证券的结算金额不确定性的风险。

此外，由于组合证券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，而这种价格的不确定性可能影响本基金二级市场价格的折溢价水平。投资者在赎回基金份额时，基金投资组合变现可能受到市场变化、标的 ETF 停牌或流动性不足等因素影响，导致投资者收到的赎回对价可能延期交收或赎回对价的金额出现较大波动的风险。

二、申购及赎回替代金额的处理程序

1、申购替代金额的处理程序

T 日，基金管理人根据申购赎回清单收取申购的替代金额。

对于确认成功的 T 日申购申请，在 T+1 日（指上海证券交易所和香港交易所共同交易日）内，基金管理人以收到的申购替代金额代投资者买入被替代证券（买入方式包括但不限于二级市场买入、一级市场申购等）。基金管理人有权在 T+1 日（指上海证券交易所和香港交易所共同交易日）内任意时刻以收到的申购替代金额代投资者买入小于等于被替代证券数量的任意数量的被替代证券。基金管理人有权根据基金投资的需要自主决定不买入部分被替代证券，或者不进行任何买入证券的操作。在 T+1 日（指上海证券交易所和香港交易所共同交易日）日终，基金管理人已买入的证券，依据申购的替代金额与被替代证券的实际买入成本（包括买入价格与相关交易费用，需用汇率公允价折算为人民币）的差额，确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项；未买入的证券，依据申购的替代金额与被替代证券 T+1 日（指上海证券交易所和香港交易所共同交易日）收盘价（需用汇率公允价折算为人民币，当日在证券交易所无交易的，取最近交易日的收盘价，当日无收盘价的，取最后成交价）的差额，确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项。

在此期间若该部分证券发生除息、送股（转增）、配股等重要权益变动，则进行相应调整。正常情况下，T+3 日（指上海证券交易所与香港交易所的共同交易日）内，基金管理人将应退款或补款与相关申购赎回代理机构办理交收。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。

如遇证券长期停牌、流动性不足等特殊情况，可参照证券的估值价格对结算价格进行调整，如果基金管理人认为该证券复牌后的价格可能存在较大波动，且可能对基金资产净值产生较大影响，为了更好的维护持有人利益，该证券对应的现金替代退补款的清算交收可在其复牌后按照实际交易成本办理。在此期间若该证券发生除息、送股（转增）、配股等重要权益变动，则进行相应调整。上述汇率目前采用汇率公允价。汇率公允价包括中国人民银行或其授权机构最新公布的人民币汇率中间价、中国外汇交易中心最新收盘价、与基金托管人商定的其他公允价格（如：中国人民银行或国家外汇管理局或中国外汇交易中心正式对外发文

后公布的人民币兑主要外汇当日收盘价)等。

2、赎回对应的替代金额的处理程序

对于确认成功的 T 日赎回申请,在 T+1 日(指上海证券交易所和香港交易所共同交易日)内,基金管理人根据赎回申请代投资者卖出被替代证券(卖出方式包括但不限于二级市场卖出、一级市场赎回等)。基金管理人有权在 T+1 日(指上海证券交易所和香港交易所共同交易日)内任意时刻代投资者卖出小于等于被替代证券数量的任意数量的被替代证券。基金管理人有权根据基金投资的需要自主决定不卖出部分被替代证券,或者不进行任何卖出证券的操作。

在 T+1 日(指上海证券交易所和香港交易所共同交易日)日终,基金管理人已卖出的证券,按照被替代证券的实际卖出金额(扣除相关费用,需用汇率公允价折算为人民币)确定基金应支付的替代金额;未卖出的证券,按照被替代证券 T+1 日(指上海证券交易所和香港交易所共同交易日)收盘价(需用汇率公允价折算为人民币,当日在证券交易所无交易的,取最近交易日的收盘价,当日无收盘价的,取最后成交价)确定基金应支付给投资者的替代金额。

在此期间若该部分证券发生除息、送股(转增)、配股等重要权益变动,则进行相应调整。正常情况下,T+7 日(指上海证券交易所与香港交易所的共同交易日)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机构办理交收。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。

如遇证券长期停牌、流动性不足等特殊情况,可参照证券的估值价格对结算价格进行调整,如果基金管理人认为该证券复牌后的价格可能存在较大波动,且可能对基金资产净值产生较大影响,为了更好的维护持有人利益,该证券对应的现金替代退补款的清算交收可在其复牌后按照实际交易成本办理。在此期间若该证券发生除息、送股(转增)、配股等重要权益变动,则进行相应调整。上述汇率目前采用汇率公允价。汇率公允价包括中国人民银行或其授权机构最新公布的人民币汇率中间价、中国外汇交易中心最新收盘价、与基金托管人商定的其他公允价格(如:中国人民银行或国家外汇管理局或中国外汇交易中心正式对外发文后公布的人民币兑主要外汇当日收盘价)等。

3、对于 T 日的申购赎回申请,基金管理人有权进行轧差处理,针对净申购,买入净申购份额对应被替代证券,针对净赎回,卖出净赎回份额对应被替代证券,基金管理人有权买入或者卖出不等于轧差处理后的上述被替代证券数量的任意

数量的被替代证券，在 T+1 日（指上海证券交易所和香港交易所共同交易日）日终，所有申购赎回对应的被替代证券均按照轧差处理后买入或者卖出的交易金额（买入价格加上相关费用或者卖出价格扣除相关费用，需用汇率公允价折算为人民币），确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项。

上述汇率目前采用汇率公允价。汇率公允价包括中国人民银行或其授权机构最新公布的人民币汇率中间价、中国外汇交易中心最新收盘价、与基金托管人商定的其他公允价格（如：中国人民银行或国家外汇管理局或中国外汇交易中心正式对外发文后公布的人民币兑主要外汇当日收盘价）等。

三、参考 IOPV 决策和 IOPV 可能计算错误的提示

基金管理人在每一交易日开始前公告当日的申购、赎回清单，基金管理人或基金管理人委托的指数服务机构在开市后根据申购赎回清单、人民币汇率和组合证券内各只证券的实时成交数据，计算基金份额参考净值（IOPV），并将计算结果向上海证券交易所发送，由上海证券交易所对外发布，仅供投资者交易、申购、赎回基金份额时参考。

基金份额参考净值计算公式为：

基金份额参考净值 = （申购赎回清单中必须现金替代的替代金额 + 申购赎回清单中退补现金替代成份证券的数量、最新成交价以及汇率公允价的乘积之和 + 申购赎回清单中的预估现金部分） / 最小申购赎回单位对应的基金份额。

汇率公允价包括中证指数有限公司在发布和计算境外指数产品中采用的实时汇率价格、中国人民银行或其授权机构最新公布的人民币汇率中间价、基金管理人或基金托管人商定的其他公允价格等。

基金管理人可以调整基金份额参考净值计算公式，存在相关计算方式变动带来的风险。

自公告之日起，在本基金基金份额参考净值（IOPV）计算中涉及的汇率为中证指数有限公司在发布和计算境外指数产品中采用的实时汇率价格。

IOPV 与实时的基金份额净值可能存在差异，IOPV 计算可能出现错误，投资者若参考 IOPV 进行投资决策可能导致损失，需投资者自行承担。

四、重要提示

1、本基金的招募说明书将根据本公告的内容进行相应修改，并按规定更新。

2、投资者投资于本基金前请认真阅读证券交易所和登记结算机构关于 ETF 的相关业务规则及其不时的更新，确保具备相关知识、清楚了解相关规则流程。

3、投资者在申购赎回代理券商办理本基金申购、赎回业务前，应全面了解相关业务规则及可能产生的风险。本基金各申购赎回代理券商的具体业务办理流程、需要提交的文件等不尽相同，请投资者在办理业务前咨询办理业务的申购赎回代理券商。

4、风险提示：

本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，但不保证本基金一定盈利，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。

本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，全面认识基金的风险收益特征，本基金管理人建议投资者根据自身的风险收益偏好，选择适合自己的基金产品，并且中长期持有。

投资者如有任何问题，请拨打本公司的客户服务电话（400-888-0001[免长途费用]或 021-38784638）或各销售机构咨询电话咨询。

特此公告。

华泰柏瑞基金管理有限公司

2025 年 4 月 9 日