

前海开源中证500等权重交易型开放式指数证券投资基金招募说明书更新的公告

近期，上海证券交易所拟发布实施《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则（2020年修订）》、中国证券登记结算有限责任公司拟发布实施《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》。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》、《前海开源中证500等权重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，前海开源基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”或“本公司”）拟更新前海开源中证500等权重交易型开放式指数证券投资基金（基金代码：515590，场内简称：500ETF5W）（以下简称“本基金”）《前海开源中证500等权重交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》（以下简称“《招募说明书》”）的相关内容，本次更新招募说明书更新“重要提示”、“释义”、“申购和赎回申请的确认”、“申购和赎回的清算交收与登记”及“申购赎回清单的格式”等相关内容，截止日为2020年1月14日，实施日为2020年1月20日。具体更新内容如下：

一、对“重要提示”有关内容进行修订，具体如下：

原表述为：“投资人申购的基金份额当日可卖出，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；即在目前结算规则下，T日申购的基金份额当日可卖出，T日申购当日未卖出的基金份额，T+1日不得卖出和赎回，T+1日交收成功后T+2日可卖出和赎回。因此为投资人办理申购业务的代理券商若发生交收违约，将导致投资人不能及时、足额获得申购当日未卖出的基金份额，投资人的利益可能受到影响。”

更新为：“投资人申购的基金份额当日起可卖出，投资人赎回获得的股票当日起可卖出。”

增加表述：“本次更新招募说明书更新“重要提示”、“释义”、“申购和赎回申请的确认”、“申购和赎回的清算交收与登记”及“申购赎回清单的格式”等相关内容，截止日为2020年1月14日，实施日为2020年1月20日。”

二、对“二、释义”有关内容进行修订，具体如下：

原表述为：“39、《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》（包括其不时修订）、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证券投资基金登记结算业务实施细则》（包括其不时修订）及上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司、基金管理人及基金销售机构发布的其他相关规则 and 规定”

更新为：“39、《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（2020年修订）》（包括其不时修订）、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基金登记结算业务实施细则》（包括其不时修订）及上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司、基金管理人及基金销售机构发布的其他相关规则 and 规定”

三、对“十、基金份额的申购和赎回”中“（四）申购与赎回的程序”的第2款“申购和赎回申请的确认”有关内容进行修订，具体如下：

原表述为：“投资人申购的基金份额当日可卖出，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；即在目前结算规则下，T日申购的基金份额当日可卖出，T日申购当日未卖出的基金份额，T+1日不得卖出和赎回，T+1日交收成功后T+2日可卖出和赎回。投资人赎回获得的股票当日可卖出。”

更新为：“投资人申购的基金份额当日起可卖出，投资人赎回获得的股票当日起可卖出。”

四、对“十、基金份额的申购和赎回”中“（四）申购与赎回的程序”的第3款“申购和赎回的清算交收与登记”有关内容进行修订，具体如下：

原表述为：“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《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》和参与各方相关协议的有关规定。

投资人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申购当日卖出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申购当日未卖出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。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。

投资人 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 日办理上交所上市的成份股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。基金管理人不迟于 T+3 日办理赎回的深交所上市的成份股现金替代的交付。在发生流动性严重不足等特殊情况下，本基金的现金替代及现金差额的交收可以延后。

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《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》和参与各方相关协议的有关规定进行处理。”

更新为：“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《业务规则》和参与各方相关协议的有关规定。

投资人 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。

投资人 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。在发生流动性严重不足等特殊情况下，本基金的现金替代及现金差额的交收可以延后。

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《业务规则》和参与各方相关协议的有关规定进行处理。”

五、对“十、基金份额的申购和赎回”中“（七）申购赎回清单的内容与格式”的第 6 款“申购赎回清单的格式”有关内容进行修订，具体如下：

增加表述“如上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司修改或更新申购赎回清单的格式并适用于本基金的，则基金管理人将按照修改或更新申购赎回清单的格式公布申购赎回清单。”

重要提示

1、《招募说明书》的修订属于依据上交所和登记机构的规则调整而做出的调整，符合相关法律法规及《基金合同》的规定，无需召开持有人大会。

2、基金管理人承诺本着诚实信用、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。投资人投资本基金前应认真阅读本基金的基金合同、招募说明书。敬请投资人注意投资风险。

3、本基金管理人可以在法律法规和《基金合同》规定范围内调整上述有关内容。投资人可登录基金管理人网站（www.qhkyfund.com）或中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）查阅修订后的《招募说明书》全文或拨打客户服务电话（4001-666-998）咨询相关事宜。

特此公告。

前海开源基金管理有限公司

二〇二〇年一月十五日