

关于银华沪深 300 指数分级证券投资基金

基金份额转换结果的公告

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》、《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的有关规定，以及《银华沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同》的约定，银华沪深 300 指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）基金份额持有人大会已于 2020 年 10 月 21 日至 2020 年 10 月 27 日以通讯方式召开，会议审议通过了《关于银华沪深 300 指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》。基金份额持有人大会决议已于 2020 年 10 月 28 日表决通过之日起生效。银华基金管理股份有限公司（以下简称“本基金管理人”）于 2020 年 10 月 29 日发布了《关于银华沪深 300 指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告》。

根据《关于银华沪深 300 指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告》及《关于银华沪深 300 指数分级证券投资基金实施转型的提示性公告》（以下简称“《转型提示性公告》”），本基金的转型选择期为 2020 年 10 月 30 日至 2020 年 11 月 26 日。本基金的转型选择期结束后，本基金管理人根据《转型提示性公告》实施基金转型，本基金的份额转换基准日为 2020 年 11 月 27 日。本基金管理人自本基金的份额转换基准日开始办理本基金的基金份额转换，并于 2020 年 11 月 30 日完成了本基金的基金份额转换工作，银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）的基金合同于 2020 年 11 月 30 日生效。在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记系统登记在册的银华沪深 300 指数分级证券投资基金之基础份额（以下简称“银华 300 份额”，基金代码：161811）、银华沪深 300 指数分级证券投资基金之稳健收益类份额（以下简称“银华 300A 份额”，基金代码：150167）、银华沪深 300 指数分级证券投资基金之积极收益类份额（以下简称“银华 300B 份额”，基金代码：150168）转换为银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）场内份额，在中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统登记在册的银华 300 份额转换为银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）的场外份额。现将转换结果公告如下：

一、基金份额转换结果

（一）银华 300A 份额和银华 300B 份额转换为银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）场内份额，份额数取整计算（最小单位为 1 份），小数点以后的部分舍去并计入基金财产。份额转换比例按截位法精确到小数点后第 9 位，小数点后第 9 位以后的部分舍去。具体结果如下表所示：

转换前基金份额名称	转换前基金份额数量（份）	转换比例	转换后基金份额名称	转换后基金份额数量（份）
银华 300A 份额	12,221,997.00	1.049860037	银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）场内份额	12,831,386.00 （注 1）
银华 300B 份额	12,221,997.00	1.564784038	银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）场内份额	19,124,785.00 （注 2）

注 1：此转换后基金份额数量指银华 300A 份额转换为银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）场内份额的份额数量。

注 2：此转换后基金份额数量指银华 300B 份额转换为银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）场内份额的份额数量。

注 3：由于本基金本次份额转换的份额转换基准日为 2020 年 11 月 27 日（周五），且银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）的基金合同生效日为 2020 年 11 月 30 日（周一），因此银华 300A 份额办理份额转换的参考净值包含周末两日银华 300A 份额应享有的约定收益。

（二）银华 300 份额的场内份额、场外份额分别转换为银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）场内份额、场外份额。其中，银华 300 份额场内份额经转换后的份额数取整计算（最小单位为 1 份），小数点以后的部分舍去并计入基金财产；银华 300 份额场外份额经转换后的份额数按截位法保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分舍去并计入基金财产；份额转换比例按截位法精确到小数点后第 9 位，小数点后第 9 位以后的部分舍去。具体结果如下表所示：

转换前基金份额名称	转换前基金份额数量（份）	转换比例	转换后基金份额名称	转换后基金份额数量（份）
银华 300 份额场外份额	65,165,266.79	1.307322037	银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）场外份额	85,191,989.32 （注 4）
银华 300 份额场内份额	8,363,590.00	1.307322037	银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）场内份额	10,933,905.00 （注 5）

注 4：此转换后基金份额数量指银华 300 份额场外份额转换为银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）场外份额的份额数量。

注 5：此转换后基金份额数量指银华 300 份额场内份额转换为银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）场内份额的份额数量。

注 6：待中国证券登记结算有限责任公司完成基金份额变更登记后，基金份额持有人可查询经登记机构确认的转换后的基金份额。转换完成后，基金份额持有人持有的基金份额数将按照转换规则相应增加或减少。由于基金份额数取整或截位计算产生的误差，基金份额持有人将面临所持基金份额数量减少的风险，其中对于持有份额数较少的银华 300A 份额、银华 300B 份额、银华 300 份额场内份额的持有人，将面临所持有的基金份额转换后份额数不足一份而被计入基金财产的风险。

二、重要提示

（一）本次转型前本基金基金份额的分级设置决定了不同份额类别具有不同的风险收益特征，其中银华 300A 份额具有低风险、低预期收益的特征，银华 300B 份额具有高风险、高预期收益的特征。转型后的银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）预期风险和预期收益水平高于债券型基金和货币市场基金，且不再设置风险收益特征不同的两类子份额。

转型后，由于基金运作方式、投资范围等发生较大变化，影响基金的风险收益特征。转型后，原银华 300A 份额持有人所持有的基金份额的预期风险水平可能提高，原银华 300B 份额持有人所持有的基金份额的预期风险水平可能降低。因此存在基金转型前后产品风险等级不一致的可能。同时，不同销售机构采用的产品风险等级评价方法不同。

（二）本次基金转型完成后，按照如下规则确定基金份额持有人所持有基金份额的持有期限，进而据以确定其在赎回时应适用的赎回费率：

1、原持有银华 300 份额的持有期计入持有银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）基金份额的持有期限。

2、原持有银华 300A 份额、银华 300B 份额并继续持有转型后的银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）的投资者，原持有银华 300A 份额、银华 300B 份额的持有期不计入持有银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）基金份额的持有期限，其持有期以登记机构的确认结果为准。

（三）本基金管理人自 2020 年 12 月 1 日起，开始办理银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）的申购、赎回、定期定额投资、转托管等业务，详情敬请投

投资者查阅本基金管理人于 2020 年 11 月 24 日发布的《关于银华沪深 300 指数分级证券投资基金办理基金份额转换业务期间暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告》。

（四）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，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。本基金管理人所管理的其他基金的业绩并不构成本基金业绩表现的保证。投资者投资于本基金管理人管理的基金时应认真阅读基金合同、托管协议、招募说明书等文件及相关公告，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。投资有风险，决策须谨慎。

（五）本公告解释权归本基金管理人。

三、咨询方式

投资者如有任何疑问，请登陆本基金管理人网站（www.yhfund.com.cn）或者拨打本基金管理人客服电话（400－678－3333（免长途话费）或 010-85186558）。

特此公告。

银华基金管理股份有限公司

2020 年 12 月 1 日