关于银华恒生中国企业指数分级证券投资基金
办理定期份额折算业务的公告

根据《银华恒生中国企业指数分级证券投资基金基金合同》（简称“基金合同”），及深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定，银华恒生中国企业指数分级证券投资基金（简称“本基金”）将以 2019 年 12 月 2 日为基准日办理定期份额折算业务。相关事项公告如下：

一、基金份额折算基准日

根据基金合同的规定，定期份额折算基准日为每个会计年度 12 月第一个工作日。本次定期份额折算的基准日为 2019 年 12 月 2 日。

二、基金份额折算对象

基金份额折算基准日交易结束后登记在册的恒中企 A 份额(场内简称：恒中企 A，代码：150175)、银华恒生中企份额（场内简称：恒生中企，代码：161831）。

三、基金份额折算方式

恒中企 A 份额和恒中企 B 份额按照基金合同“四、基金份额的分类与净值计算规则”进行净值计算，对恒中企 A 份额的应得收益进行定期份额折算，每 2 份银华恒生中企份额将按 1 份恒中企 A 份额获得约定应得收益的新增折算份额。

在基金份额折算前与折算后，恒中企 A 份额和恒中企 B 份额的份额配比保持 1:1 的比例。

对于恒中企 A 份额期末的约定应得收益，即恒中企 A 份额每个定期份额折算期间期末即 11 月 30 日份额净值超出本金 1.0000 元部分，将折算为场内银华恒生中企份额分配给恒中企 A 份额持有人。银华恒生中企份额持有人持有的每 2 份银华恒生中企份额将按 1 份恒中企 A 份额获得新增银华恒生中企份额的分配。持有场外银华恒生中企份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外银华恒生中企份额的分配；持有场内银华恒生中企份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内银华恒生中企份额的分配。经过上述份额折算，恒中企 A 份额和银华恒生中企份额的基金份额净值将相应调整。

每个会计年度 12 月第一个工作日为基金份额折算基准日，本基金将对恒中企 A 份额和银华恒生中企份额进行应得收益的定期份额折算。

cninf 巨潮资讯
www.cninfo.com.cn

每个会计年度 12 月第一个工作日进行恒中企 A 份额上一定期份额折算期间应得收益的定期份额折算时，以下公式中每份恒中企 A 份额期末资产净值等于当个定期份额折算期间期末 11 月 30 日的每份恒中企 A 份额资产净值。

有关计算公式如下：

1、恒中企 A 份额

定期份额折算后恒中企 A 份额的份额数=定期份额折算前恒中企 A 份额的份额数

$$NAV_{\text{银华恒生中企份额}}^{\text{后}} = \frac{\text{折算前银华恒生中企份额的资产净值-}\left(\text{每份恒中企A份额期末资产净值-1.0000}\right)\times 0.5\times NUM_{\text{银华恒生中企份额}}^{\text{前}}}{NUM_{\text{银华恒生中企份额}}^{\text{前}}}$$

恒中企 A 份额持有人新增的场内银华恒生中企份额的份额数=

$$NUM_{\text{恒中企A份额}}^{\text{前}} \times \frac{\left(\text{每份恒中企A份额期末资产净值-1.0000}\right)}{NAV_{\text{银华恒生中企份额}}^{\text{后}}}$$

【恒中企 A 份额持有人新增的场内银华恒生中企份额的折算比例 $= \frac{\left(\text{每份恒中企A份额期末资产净值-1.0000}\right)}{NAV_{\text{银华恒生中企份额}}^{\text{后}}}$】

其中：

$NAV_{\text{银华恒生中企份额}}^{\text{后}}$：定期份额折算后银华恒生中企份额净值

$NUM_{\text{银华恒生中企份额}}^{\text{前}}$：定期份额折算前银华恒生中企份额的份额数

$NUM_{\text{恒中企A份额}}^{\text{前}}$：定期份额折算前恒中企 A 份额的份额数

恒中企 A 份额新增份额折算成银华恒生中企份额的场内份额取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金财产。

2、恒中企 B 份额

每个会计年度 12 月份的定期份额折算不改变恒中企 B 份额净值及其份额数。

3、银华恒生中企份额

$$NAV_{\text{银华恒生中企份额}}^{\text{后}} = \frac{\text{折算前银华恒生中企份额的资产净值-}\left(\text{每份恒中企A份额期末资产净值-1.0000}\right)\times 0.5\times NUM_{\text{银华恒生中企份额}}^{\text{前}}}{NUM_{\text{银华恒生中企份额}}^{\text{前}}}$$

cninf 巨潮资讯
www.cninfo.com.cn

银华恒生中企份额持有人新增的银华恒生中企份额=

$$NUM^{前}_{银华恒生中企份额} \times \frac{(每份恒中企A份额期末资产净值-1.0000)}{NAV^{后}_{银华恒生中企份额}} \times 0.5$$

【银华恒生中企份额持有人新增的银华恒生中企份额的折算比例

$$= \frac{(每份恒中企A份额期末资产净值-1.0000)}{NAV^{后}_{银华恒生中企份额}} \times 0.5】$$

定期份额折算后银华恒生中企份额的份额数=定期份额折算前银华恒生中企份额的份额数+银华恒生中企份额持有人新增的银华恒生中企份额的份额数

其中：

$NAV^{后}_{银华恒生中企份额}$：定期份额折算后银华恒生中企份额净值

$NUM^{前}_{银华恒生中企份额}$：定期份额折算前银华恒生中企份额的份额数

银华恒生中企份额的场外份额经折算后的份额数采用截位法保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产；银华恒生中企份额的场内份额经折算后的份额数取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金财产。

4、举例

假设本基金成立后某个会计年度 12 月第一个工作日为定期份额折算基准日，恒中企 A 份额、恒中企 B 份额、银华恒生中企场外份额及银华恒生中企场内份额的规模依次为 5 亿份、5 亿份、10 亿份和 10 亿份，恒中企 A 份额期末份额净值为 1.0700 元，定期份额折算后银华恒生中企份额净值为 0.9930 元，则，

折算后：

恒中企 A 份额持有人新增的场内银华恒生中企份额的折算比例=（1.0700-1.0000）/0.9930=0.070493454；

银华恒生中企份额持有人新增的银华恒生中企份额的折算比例=0.5×(1.0700-1.0000)/0.9930=0.035246727。

本基金折算后，恒中企 A 份额 5 亿份，同时，新增的场内银华恒生中企份额数=500,000,000×0.070493454=35,246,727 份；

恒中企 B 份额 5 亿份；

银华恒生中企场外份额数=1,000,000,000+1,000,000,000×0.035246727=1,035,246,727.00 份；

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

银华恒生中企场内份额数=1,000,000,000+1,000,000,000×0.035246727=1,035,246,727 份。

四、基金份额折算期间的基金业务办理

（一）定期份额折算基准日（即 2019 年 12 月 2 日），本基金暂停办理申购（含定期定额投资，下同）、赎回、转托管及配对转换业务；恒生中企、恒中企 A、恒中企 B 交易正常。当日晚间，基金管理人计算当日基金份额净值及份额折算比例。恒中企 B 在整个定期份额折算期间交易正常进行。

（二）定期份额折算基准日后的第一个工作日（即 2019 年 12 月 3 日），本基金暂停办理申购、赎回、转托管及配对转换业务,恒生中企、恒中企 A 暂停交易。当日，本基金注册登记人及基金管理人为持有人办理份额登记确认。

（三）定期份额折算基准日后的第二个工作日（即 2019 年 12 月 4 日），基金管理人将公告份额折算确认结果，持有人可以查询其账户内的基金份额。当日，本基金恢复办理申购（即在非直销机构单日单个基金账户累计申购（含定期定额投资）本基金的合计金额不超过 1000 元，若超过 1000 元，本基金管理人有权部分或全部拒绝对本基金的申购申请）、赎回、转托管（自 2019 年 3 月 1 日（含当日）起通过直销机构申购（含定期定额投资）恒生中企份额的跨系统转托管（场外转场内）业务将继续暂停）及配对转换业务，恒生中企、恒中企 A 于当日开市恢复交易。

五、重要提示

（一）根据《深圳证券交易所证券投资基金交易和申购赎回实施细则》，2019 年 12 月 4 日恒生中企即时行情显示的前收盘价为 2019 年 12 月 3 日的恒生中企的份额净值（四舍五入至 0.001 元）；2019 年 12 月 4 日恒中企 A 即时行情显示的前收盘价为 2019 年 12 月 3 日的恒中企 A 的份额净值（四舍五入至 0.001 元）。由于恒生中企、恒中企 A 折算前可能存在折溢价交易情形，折算前的收盘价扣除本次定期份额折算的折算期间的约定应得收益后与 2019 年 12 月 4 日的前收盘价可能有一定差异，2019 年 12 月 4 日当日可能出现交易价格波动的情形。敬请投资者注意投资风险。

（二）本基金恒中企 A 份额期末的约定应得收益将折算为场内银华恒生中企份额分配给恒中企 A 份额的持有人，而银华恒生中企份额为跟踪恒生中国企业指

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

数的基础份额，其份额净值将随市场涨跌而变化，因此恒中企 A 份额持有人预期收益的实现存在一定的不确定性，其可能会承担因市场下跌而遭受损失的风险。

（三）由于恒中企 A 份额经折算产生的新增场内银华恒生中企份额数和场内银华恒生中企份额经折算后的份额数将取整计算（最小单位为 1 份），舍去部分计入基金财产，持有极小数量恒中企 A 份额或场内银华恒生中企份额的持有人存在无法获得新增场内银华恒生中企份额的可能性。

（四）本基金管理人于 2019 年 2 月 26 日发布了《银华恒生中国企业指数分级证券投资基金暂停大额申购（含定期定额投资）业务的公告》，2019 年 3 月 1 日发布了《银华恒生中国企业指数分级证券投资基金恢复直销机构大额申购（含定期定额投资）业务并暂停直销机构跨系统转托管（场外转场内）业务的公告》。根据上述公告，本基金自 2019 年 12 月 4 日（含当日）起恢复办理本基金之恒生中企份额在直销机构申购（含定期定额投资）、赎回业务，自 2019 年 3 月 1 日（含当日）起通过直销机构申购（含定期定额投资）恒生中企份额的跨系统转托管（场外转场内）业务将继续暂停。本基金自 2019 年 12 月 4 日（含当日）起继续暂停通过非直销机构进行的单日单个基金账户累计 1000 元以上的大额申购（含定期定额投资）业务。通过非直销机构单日单个基金账户累计申购（含定期定额投资）本基金的合计金额不超过 1000 元，若超过 1000 元，本基金管理人有权部分或全部拒绝对本基金的申购申请。如单日某基金账户单笔申购本基金的金额超过 1000 元，本基金有权确认该笔申购失败；如单日某基金账户多笔累计申购本基金的金额超过 1000 元，本基金将按申购金额大小排序，逐笔累加至符合不超过 1000 元限额的申请确认成功，对于其余申购申请，本基金管理人有权确认失败。针对单笔申购业务申请，仅有确认和不予确认两种处理方式，不存在对单笔申请的部分确认。详见相关公告。

（五）投资者若希望了解基金定期份额折算业务详情，请登陆本公司网站：www.yhfund.com.cn 或者拨打本公司客服电话：400－678－3333(免长途话费)。

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，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。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

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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。

特此公告。

银华基金管理股份有限公司

2019 年 11 月 27 日

cninf 巨潮资讯
www.cninfo.com.cn