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2017年12月1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2017年12月1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H股A份额(场内简称:H股A,代码:150175)、银华H股份额(场内简称:H股分级,代码:161831)。

三、基金份额折算方式

H股A份额和H股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H股A份额的应得收益进行定期份额折算,每2份银华H股份额将按1份H股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,H股A份额和H股B份额的份额配比保持1:1的比例。

对于H股A份额期末的约定应得收益,即H股A份额每个定期折算

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H股份额分配给H股A份额持有人。银华H股份额持有人持有的每2份银华H股份额将按1份H股A份额获得新增银华H股份额的分配。持有场外银华H股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H股份额的分配;持有场内银华H股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H股份额的分配。经过上述份额折算,H股A份额和银华H股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H股A份额和银华H股份额进行应得收益的定期份额折算。

每个会计年度12月第一个工作日进行银华H股份额上一定期折算期间末资产净值等于当期定期折算期末11月30日的H股A份额每份资产净值。

有关计算公式如下:

1、H股A份额

定期份额折算后H股A份额的份额数=定期份额折算前H股A份额的份额数

$$NAV^{H}_{H股A份额} = \frac{[H股A份额期末资产净值-(H股A份额期末份额数\times 1.000)]\times 0.5\times NAV^{H}_{H股A份额}}{NAV^{H}_{H股A份额}}$$

H股A份额持有人新增的场内银华H股份额的份额数=

$$NAV^{H}_{H股A份额}\times\frac{(H股A份额期末资产净值-1.000)}{NAV^{H}_{H股A份额}}$$

【H股A份额持有人新增的场内银华H股份额的折算比例=$\frac{[H股A份额期末资产净值-(H股A份额期末份额数\times 1.000)]\times 0.5\times NAV^{H}_{H股A份额}}{NAV^{H}_{H股A份额}}$】

其中:

$NAV^{H}_{H股A份额}$:定期份额折算后银华H股份额净值

$NAV^{H}_{H股A份额}$:定期份额折算前银华H股份额的份额数

$NAV^{H}_{H股A份额}$:定期份额折算前H股A份额的份额数

H股A份额新增份额折算成银华H股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、H股B份额

每个会计年度12月份的定期份额折算不改变H股B份额净值及其份额数。

3、银华H股份额

$$NAV^{H}_{银华H股份额} = \frac{[H股份额期末资产净值-(H股份额期末份额数\times 1.000)]\times 0.5\times NAV^{H}_{银华H股份额}}{NAV^{H}_{银华H股份额}}$$

银华H股份额持有人新增的银华H股份额=

$$NAV^{H}_{银华H股份额}\times\frac{(H股份额期末资产净值-1.000)}{NAV^{H}_{银华H股份额}}$$

【银华H股份额持有人新增的银华H股份额的折算比例=$\frac{[H股份额期末资产净值-(H股份额期末份额数\times 1.000)]\times 0.5\times NAV^{H}_{银华H股份额}}{NAV^{H}_{银华H股份额}}$】

定期份额折算后银华H股份额的份额数=定期份额折算前银华H股份额的份额数+银华H股份额持有人新增的银华H股份额的份额数

其中:

$NAV^{H}_{银华H股份额}$:定期份额折算后银华H股份额净值

$NAV^{H}_{银华H股份额}$:定期份额折算前银华H股份额的份额数

银华H股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H股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月份的第一个工作日为定期份额折算基准日,H股A份额、H股B份额、银华H股场外份额及银华H股场内份额的规模依次为5亿份、5亿份、10亿份和10亿份,H股A份额期末份额净值为1.0700元,定期份额折算后银华H股份额净值为0.9930元,则,

折算后:

H股A份额持有人新增的场内银华H股份额的折算比例=(1.0700-1.0000)/0.9930=0.070493454;

银华H股份额持有人新增的银华H股份额的折算比例=0.5×(1.0700-1.0000)/0.9930=0.035246727。

本基金折算后,H股A份额5亿份,同时,新增的场内银华H股份额数=500,000,000×0.070493454=35,246,727份;

H股B份额5亿份;

银华H股场外份额数=1,000,000,000+1,000,000,000×0.035246727=1,035,246,727.00份;

银华H股场内份额数=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2017年12月1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;H股分级、H股A、H股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。H股B在整个定期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2017年12月4日),本基金暂停办理申购、赎回、转托管及配对转换业务,H股分级、H股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2017年12月5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、赎回、转托管及配对转换业务,H股分级、H股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》,2017年12月5日H股分级即时行情显示的前收盘价为2017年12月4日的H股分级的份额净值(四舍五入至0.001元);2017年12月5日H股A即时行情显示的前收盘价为2017年12月4日的H股A的份额净值(四舍五入至0.001元)。由于H股分级、H股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折算的折算期间的约定应得收益后与2017年12月5日的前收盘价可能有一定差异,2017年12月5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H股A份额期末的约定应得收益将折算为场内银华H股份额分配给H股A份额的持有人,而银华H股份额为跟踪恒生中国企业指数的基础份额,其份额净值将随市场涨跌而变化,因此H股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H股A份额经折算产生的新增场内银华H股份额数和场内银华H股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H股A份额或场内银华H股份额的持有人存在无法获得新增场内银华H股份额的可能性。

(四)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
2017年11月28日

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期间暂停及恢复申购、赎回及定期定额投资业务的公告

公告送出日期:2017年11月28日

1 公告基本信息

基金名称	银华恒生中国企业指数分级证券投资基金	
基金简称	银华恒生国企指数分级	
场内简称	H股分级	
基金主代码	161831	
基金管理人名称	银华基金管理股份有限公司	
公告依据	《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金信息披露管理办法》等法律法规以及《银华恒生中国企业指数分级证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)和《银华恒生中国企业指数分级证券投资基金招募说明书》(以下简称“招募说明书”)	
暂停相关业务的起始日及原因说明	暂停申购起始日	2017年12月1日
	暂停赎回起始日	2017年12月1日
	暂停定期定额投资起始日	2017年12月1日
	暂停申购、赎回及定期定额投资的原因说明	按照基金合同约定每个会计年度12月第一个工作日为基金定期折算基准日。本基金将以2017年12月1日为基准日对本基金银华H股份额及银华H股A份额办理定期份额折算业务,为保证折算期间本基金的平稳运作,本基金管理人决定于2017年12月1日以及2017年12月4日暂停本基金银华H股份额的申购、赎回及定期定额投资业务。
恢复相关业务的日期及原因说明	恢复申购日	2017年12月5日
	恢复赎回日	2017年12月5日
	恢复定期定额投资日	2017年12月5日
	恢复申购、赎回及定期定额投资的原因说明	本基金定期份额折算业务将于2017年12月4日办理完毕,因此本基金管理人决定于2017年12月5日起恢复本基金银华H股份额的申购、赎回及定期定额投资业务。
下属分级基金的基金简称	H股分级	H股A	H股B
下属分级基金的交易代码	161831	150175	150176
该分级基金是否暂停\恢复申购、赎回、定期定额投资	是	-	-

2 其他需要提示的事项

1、根据本基金基金合同的相关规定,本基金银华H股份额可以进行场内与场外的申购和赎回,也可上市交易;下属分级份额中H股A份额与H股B份额只可在深圳证券交易所上市交易,不可单独进行申购或赎回。

2、本公告仅对本基金办理定期份额折算业务期间银华H股份额暂停申购、赎回及定投业务的情况进行说明,投资者若希望了解本基金定期份额折算业务的详细情况,请参阅本基金基金合同、招募说明书及本基金管理人发布的相关公告,或者拨打本公司客服电话:400-678-3333(免长途话费)。

3、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
2017年11月28日

关于银华沪深300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《银华沪深300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,银华沪深300指数分级证券投资基金(简称“本基金”)将以2017年12月1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2017年12月1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银华300份额(场内简称:300分级,代码:161811)、银华300A份额(场内简称:银华300A,代码:150167)。

三、基金份额折算方式

银华300A份额和银华300B份额按照基金合同“五、基金份额的分类与净值计算规则”进行净值计算,对银华300A份额的应得收益进行定期份额折算,每2份银华300份额将按1份银华300A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,银华300A份额和银华300B份额的份额配比保持1:1的比例。

对于银华300A份额期末的约定应得收益,即银华300A份额每个定期折算期间期末即11月30日份额净值超出本金1.000元部分,将折算为场内银华300份额分配给银华300A份额持有人。银华300份额持有人持有的每2份银华300份额将按1份银华300A份额获得新增银华300份额的分配。持有场外银华300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300份额的分配;持有场内银华300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300份额的分配。经过上述份额折算,银华300A份额和银华300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,本基金将对银华300A份额和银华300份额进行应得收益的定期份额折算。

每个会计年度12月第一个工作日进行银华300A份额上一定期折算期间累计约定应得收益的定期份额折算时,有关计算公式如下:

$$NAV^{A}_{银华300A份额}=(1-R)\times$$

以下公式中每份银华300A份额期末资产净值等于上一定期折算期间11月30日的银华300A份额的基金份额参考净值。

1、银华300A份额

定期份额折算后银华300A份额的份额数=定期份额折算前银华300A份额的份额数

$$NAV^{A}_{银华300A份额}=\frac{[银华300A份额期末资产净值-(银华300A份额期末份额数\times 1.000)]\times 0.5\times NAV^{A}_{银华300A份额}}{NAV^{A}_{银华300A份额}}$$

银华300A份额持有人新增的场内银华300份额的份额数=

$$\frac{NAV^{A}_{银华300A份额}\times(银华300A份额期末资产净值-1.000)}{NAV^{A}_{银华300A份额}}$$

【银华300A份额持有人新增的场内银华300份额的折算比例=$\frac{(银华300A份额期末资产净值-1.000)}{NAV^{A}_{银华300A份额}}$】

其中:

$NAV^{A}_{银华300A份额}$:定期份额折算后银华300份额净值

$NAV^{A}_{银华300A份额}$:定期份额折算前银华300份额的份额数

$NAV^{A}_{银华300A份额}$:定期份额折算前银华300A份额的份额数

银华300A份额新增份额折算成银华300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、银华300B份额

每个定期折算期间的定期份额折算不改变银华300B份额净值及其份额数。

3、银华300份额

$$NAV^{A}_{银华300份额}=\frac{[银华300份额期末资产净值-(银华300份额期末份额数\times 1.000)]\times 0.5\times NAV^{A}_{银华300份额}}{NAV^{A}_{银华300份额}}$$

银华300份额持有人新增的银华300份额=

$$\frac{NAV^{A}_{银华300份额}\times(银华300份额期末资产净值-1.000)}{NAV^{A}_{银华300份额}}$$

【银华300份额持有人新增的银华300份额的折算比例=$\frac{[银华300份额期末资产净值-(银华300份额期末份额数\times 1.000)]\times 0.5\times NAV^{A}_{银华300份额}}{NAV^{A}_{银华300份额}}$】

定期份额折算后银华300份额的份额数=定期份额折算前银华300份额的份额数+银华300份额持有人新增的银华300份额的份额数

其中:

$NAV^{A}_{银华300份额}$:定期份额折算后银华300份额净值

$NAV^{A}_{银华300份额}$:定期份额折算前银华300份额的份额数

银华300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300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月份的第一个工作日为定期份额折算基准日,银华300A份额、银华300B份额、银华300场外份额及银华300场内份额的规模依次为5亿份、5亿份、10亿份和10亿份,银华300A份额期末份额净值为1.065000000元,定期份额折算后银华300份额净值为0.994000000元,则,

折算后:

银华300A份额持有人新增的场内银华300份额的折算比例=(1.065000000-1.000)/0.994000000=0.065392354;

银华300份额持有人新增的银华300份额的折算比例=0.5*(1.065000000-1.000)/0.994000000=0.032696177。

本基金折算后,银华300A份额5亿份,同时,新增的场内银华300份额数=500,000,000×0.065392354=32,696,177份;

银华300B份额5亿份;

银华300场外份额数=1,000,000,000+1,000,000,000×0.032696177=1,032,696,177.00份;

银华300场内份额数=1,000,000,000+1,000,000,000×0.032696177=1,032,696,177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2017年12月1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;银华300A、银华300B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。银华300B在整个定期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2017年12月4日),本基金暂停办理申购、赎回、转托管及配对转换业务,银华300A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2017年12月5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、赎回、转托管及配对转换业务,银华300A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》,2017年12月5日银华300A即时行情显示的前收盘价为2017年12月4日的银华300A的份额净值(四舍五入至0.001元)。由于银华300A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折算的折算期间的约定收益后与2017年12月5日的前收盘价可能有一定差异,2017年12月5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)本基金银华300A份额期末的约定应得收益将折算为场内银华300份额分配给银华300A份额的持有人,而银华300份额为跟踪沪深300指数的基础份额,其份额净值将随市场涨跌而变化,因此银华300A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)由于银华300A份额经折算产生的新增场内银华300份额数和场内银华300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,持有极小数量银华300A份额或场内银华300份额的持有人存在无法获得新增场内银华300份额的可能性。

(四)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
2017年11月28日

关于银华中证800等权重指数增强分级证券投资基金办理定期份额折算业务的公告

根据《银华中证800等权重指数增强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,银华中证800等权重指数增强分级证券投资基金(简称“本基金”)将以2017年12月1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2017年12月1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银华800份额(场内简称:800分级,代码:161825)、中证800A份额(场内简称:中证800A,代码:150138)。

三、基金份额折算方式

中证800A份额和中证800B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,对中证800A份额的应得收益进行定期份额折算,每2份银华800份额将按1份中证800A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,中证800A份额和中证800B份额的份额配比保持1:1的比例。

对于中证800A份额期末的约定应得收益,即中证800A份额每个定期折算期间期末即11月30日份额净值超出本金1.000元部分,将折算为场内银华800份额分配给中证800A份额持有人。银华800份额持有人持有的每2份银华800份额将按1份中证800A份额获得新增银华800份额的分配。持有场外银华800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800份额的分配;持有场内银华800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800份额的分配。经过上述份额折算,中证800A份额和银华800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,本基金将对中证800A份额和银华800份额进行应得收益的定期份额折算。

每个会计年度12月第一个工作日进行中证800A份额上一定期折算期间应得收益的定期份额折算时,以下公式中每份中证800A份额期末资产净值等于当期定期折算期末11月30日的中证800A份额参考资产净值。

有关计算公式如下:

1、中证800A份额

定期份额折算后中证800A份额的份额数=定期份额折算前中证800A份额的份额数

$$NAV^{A}_{中证800A份额}=\frac{[中证800A份额期末资产净值-(期末份额数\times 1.000)]\times 0.5\times NAV^{A}_{中证800A份额}}{NAV^{A}_{中证800A份额}}$$

中证800A份额持有人新增的场内银华800份额的份额数=

$$\frac{NAV^{A}_{中证800A份额}\times(中证800A份额期末资产净值-1.000)}{NAV^{A}_{中证800A份额}}$$

【中证800A份额持有人新增的场内银华800份额的折算比例=$\frac{[中证800A份额期末资产净值-(期末份额数\times 1.000)]\times 0.5\times NAV^{A}_{中证800A份额}}{NAV^{A}_{中证800A份额}}$】

其中:

$NAV^{A}_{银华800份额}$:定期份额折算后银华800份额净值

$NAV^{A}_{银华800份额}$:定期份额折算前银华800份额的份额数

$NAV^{A}_{中证800A份额}$:定期份额折算前中证800A份额的份额数

中证800A份额新增份额折算成银华800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、中证800B份额

每个会计年度12月份的定期份额折算不改变中证800B份额净值及其份额数。

3、银华800份额

$$NAV^{A}_{银华800份额}=\frac{[银华800份额期末资产净值-(银华800份额期末份额数\times 1.000)]\times 0.5\times NAV^{A}_{银华800份额}}{NAV^{A}_{银华800份额}}$$

银华800份额持有人新增的银华800份额=

$$\frac{NAV^{A}_{银华800份额}\times(银华800份额期末资产净值-1.000)}{NAV^{A}_{银华800份额}}$$

【银华800份额持有人新增的银华800份额的折算比例=$\frac{[银华800份额期末资产净值-(期末份额数\times 1.000)]\times 0.5\times NAV^{A}_{银华800份额}}{NAV^{A}_{银华800份额}}$】

定期份额折算后银华800份额的份额数=定期份额折算前银华800份额的份额数+银华800份额持有人新增的银华800份额的份额数

其中:

$NAV^{A}_{银华800份额}$:定期份额折算后银华800份额净值

$NAV^{A}_{银华800份额}$:定期份额折算前银华800份额的份额数

银华800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800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月份的第一个工作日为定期份额折算基准日,中证800A份额、中证800B份额、银华800场外份额及银华800场内份额的规模依次为5亿份、5亿份、10亿份和10亿份,中证800A份额期末份额净值为1.070元,定期份额折算后银华800份额净值为0.993元,则,

折算后:

中证800A份额持有人新增的场内银华800份额的折算比例=(1.070-1)/0.993=0.070493454;

银华800份额持有人新增的银华800份额的折算比例=0.5*(1.070-1)/0.993=0.035246727。

本基金折算后,中证800A份额5亿份,同时,新增的场内银华800份额数=500,000,000×0.070493454=35,246,727份;

中证800B份额5亿份;

银华800场外份额数=1,000,000,000+1,000,000,000×0.035246727=1,035,246,727.00份;

银华800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2017年12月1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;中证800A、中证800B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。中证800B在整个定期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2017年12月4日),本基金暂停办理申购、赎回、转托管及配对转换业务,中证800A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2017年12月5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、赎回、转托管及配对转换业务,中证800A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》,2017年12月5日中证800A即时行情显示的前收盘价为2017年12月4日的中证800A的份额净值(四舍五入至0.001元)。由于中证800A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折算的折算期间的约定收益后与2017年12月5日的前收盘价可能有一定差异,2017年12月5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)本基金中证800A份额期末的约定应得收益将折算为场内银华800份额分配给中证800A份额的持有人,而银华800份额为跟踪中证800等权重指数的基础份额,其份额净值将随市场涨跌而变化,因此中证800A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)由于中证800A份额经折算产生的新增场内银华800份额数和场内银华800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,持有极小数量中证800A份额或场内银华800份额的持有人存在无法获得新增场内银华800份额的可能性。

(四)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
2017年11月28日

关于银华中证转债指数增强分级证券投资基金办理定期份额折算业务的公告

根据《银华中证转债指数增强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,银华中证转债指数增强分级证券投资基金(简称“本基金”)将以2017年12月1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2017年12月1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银华转债份额(场内简称:中证转债,代码:161826)、转债A级份额(场内简称:转债A级,代码:150143)。

三、基金份额折算方式

转债A级份额和转债B级份额按照基金合同“四、基金份额的分类与净值计算规则”进行净值计算,对转债A级份额的应得收益进行定期份额折算,每10份银华转债份额将按7份转债A级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,转债A级份额和转债B级份额的份额配比保持7:3的比例。

对于转债A级份额期末的约定应得收益,即转债A级份额每个定期折算期间期末即11月30日份额净值超出本金1.000元部分,将折算为场内银华转债份额分配给转债A级份额持有人。银华转债份额持有人持有的每10份银华转债份额将按7份转债A级份额获得新增银华转债份额的分配。持有场外银华转债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转债份额的分配;持有场内银华转债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转债份额的分配。经过上述份额折算,转债A级份额和银华转债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,本基金将对转债A级份额和银华转债份额进行应得收益的定期份额折算。

每个会计年度12月第一个工作日进行转债A级份额上一定期折算期间应得收益的定期份额折算时,以下公式中每份转债A级份额期末资产净值等于当期定期折算期末11月30日的每份转债A级份额参考资产净值。

有关计算公式如下:

1、转债A级份额

定期份额折算后转债A级份额的份额数=定期份额折算前转债A级份额的份额数

$$NAV^{A}_{转债A级份额}=\frac{[转债A级份额期末资产净值-(期末份额数\times 1.000)]\times 0.5\times NAV^{A}_{转债A级份额}}{NAV^{A}_{转债A级份额}}$$

转债A级份额持有人新增的场内银华转债份额的份额数=

$$\frac{(转债A级份额期末资产净值-1.000)}{NAV^{A}_{转债A级份额}}$$

【转债A级份额持有人新增的场内银华转债份额的折算比例=$\frac{[转债A级份额期末资产净值-(期末份额数\times 1.000)]\times 0.5\times NAV^{A}_{转债A级份额}}{NAV^{A}_{转债A级份额}}$】

其中:

$NAV^{A}_{银华转债份额}$:定期份额折算后银华转债份额净值

$NAV^{A}_{银华转债份额}$:定期份额折算前银华转债份额的份额数

$NAV^{A}_{转债A级份额}$:定期份额折算前转债A级份额的份额数

转债A级份额新增份额折算成银华转债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、转债B级份额

每个会计年度12月份的定期份额折算不改变转债B级份额净值及其份额数。

3、银华转债份额

定期份额折算后银华转债份额持有人持有的银华转债份额的份额数=定期份额折算前银华转债份额的份额数+银华转债份额持有人新增的银华转债份额的份额数

$$NAV^{A}_{银华转债份额}=\frac{[银华转债份额期末资产净值-(期末份额数\times 1.000)]\times 0.5\times NAV^{A}_{银华转债份额}}{NAV^{A}_{银华转债份额}}$$

银华转债份额持有人新增的银华转债份额=

$$\frac{(银华转债份额期末资产净值-1.000)}{NAV^{A}_{银华转债份额}}$$

【银华转债份额持有人新增的银华转债份额的折算比例=

其中:

$NAV^{A}_{银华转债份额}$:定期份额折算后银华转债份额净值

$NAV^{A}_{银华转债份额}$:定期份额折算前银华转债份额的份额数

银华转债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;银华转债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

例一、假设本基金成立后某年12月第一个工作日为定期份额折算基准日,转债A级份额、转债B级份额、银华转债场外份额及银华转债场内份额的规模依次为7亿份、3亿份、10亿份和10亿份,转债A级份额期末份额净值为1.045元,定期份额折算后银华转债份额净值为0.993元,则,

折算后:

转债A级份额持有人新增的场内银华转债份额的折算比例=(1.045-1)/0.993=0.04531722;

银华转债份额持有人新增的银华转债份额的折算比例=0.7*(1.045-1)/0.993=0.03172205。

本基金折算后,转债A级份额7亿份,同时,新增的场内银华转债份额数=700,000,000×0.04531722=31,722,054份;

转债B级份额3亿份;

银华转债场外份额数=1,000,000,000+1,000,000,000×0.03172205=1,03,172,205.00份;

银华转债场内份额数=1,000,000,000+1,000,000,000×0.03172205=1,03,172,205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2017年12月1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;转债A级、转债B级交易正常。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。转债B级在整个定期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2017年12月4日),本基金暂停办理申购、赎回、转托管及配对转换业务,转债A级、转债B级交易正常。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2017年12月5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、赎回、转托管及配对转换业务,转债A级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》,2017年12月5日转债A级即时行情显示的前收盘价为2017年12月4日的转债A级的份额净值(四舍五入至0.001元)。由于转债A级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折算的折算期间的约定收益后与2017年12月5日的前收盘价可能有一定差异,2017年12月5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)本基金转债A级份额期末的约定应得收益将折算为场内银华转债份额分配给转债A级份额的持有人,而银华转债份额为跟踪中证转债指数的基础份额,其份额净值将随市场涨跌而变化,因此转债A级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)由于转债A级份额经折算产生的新增场内银华转债份额数和场内银华转债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,持有极小数量转债A级份额或场内银华转债份额的持有人存在无法获得新增场内银华转债份额的可能性。

(四)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
2017年11月28日

关于银华中证转债指数增强分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告

根据《银华中证转债指数增强分级证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)中关于不定期份额折算的相关约定,当银华中证转债指数增强分级证券投资基金(以下简称“本基金”)之“转债B级”份额(积极收益类份额,场内简称:转债B级,基金代码:150144)的基金份额净值达到0.450元及以下时,本基金之“银华转债”份额(基础份额,场内简称:中证转债,基金代码:161826)、“转债A级”份额(稳健收益类份额,场内简称:转债A级,基金代码:150143)及“转债B级”份额将进行下阈值不定期份额折算。

由于近期证券市场波动较大,截至2017年11月27日,转债B级份额的基金份额净值接近基金合同约定的下阈值不定期份额折算阈值,因此本基金管理人敬请投资人密切关注转债B级份额近期的基金份额净值波动情况,并警惕可能出现的风险。

针对下阈值不定期份额折算所带来的风险,本基金管理人特别提示如下:

一、转债A级份额、转债B级份额目前可能存在折溢价交易情形,在下阈值不定期份额折算发生后,转债A级份额、转债B级份额的折溢价率可能发生较大变化。特提请参与转债A级份额、转债B级份额二级市场交易的投资人注意折溢价变化可能带来的风险。

二、根据基金份额的分类与净值计算规则,本基金优先满足转债A级份额的本金及累计约定应得收益后,将剩余净资产计为转债B级份额的净资产。基金管理人并不承诺或保证转债A级份额的基金份额持有人的本金安全和约定应得收益。在出现极端损失的情况下,转债B级份额的净资产可能归零,转债A级份额的基金份额持有人可能会面临无法取得约定应得收益甚至损失本金的风险。

如果转债B级份额的净资产在下阈值不定期份额折算基准日归零,依据下阈值不定期份额折算的份额折算原则和计算公式,转债B级份额持有人在折算后所持有的转债B级份额数量也将归零。

三、本基金转债B级份额具有高风险、高预期收益的特征。如本基金触发下阈值不定期份额折算,转债B级份额的杠杆倍数将由目前的约6倍降低为初始的3.33倍,相应地,转债B级份额的份额净值随母基金份额净值涨跌而增长或者下降的幅度也会大幅减小。

四、按照基金合同的约定,当某交易日转债B级份额的基金份额净值达到0.450元及以下时,触发下阈值不定期份额折算,该交易日即为折算触发日。由于折算基准日为折算触发日的下一个工作日,折算基准日的市场波动可能造成银华转债份额净值波动,导致转债B级份额净值相应波动,从而使得折算基准日的转债B级份额净值与折算触发日转债B级份额净值以及折算阈值0.450元均存在一定的差异。

五、本基金转债A级份额具有低风险、预期收益相对稳定的特征,但在下阈值不定期份额折算发生后,原转债A级份额持有人所持有基金份额的风险收益特征将发生变化,由原来的单一的低风险收益特征转债A级份额,变为同时包括低风险收益特征转债A级份额与较低风险收益特征银华转债份额,因此原转债A级份额持有人预期收益实现的不确定性将会增加。

本基金管理人的其他重要提示:

一、根据深圳证券交易所的相