

关于银华恒生中国企业指数分级证券投资基金之恒中企 A 份额和恒中企 B 份额基金份额折算的公告

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》、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》和《银华恒生中国企业指数分级证券投资基金基金合同》等的有关规定，银华恒生中国企业指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金管理人银华基金管理股份有限公司（以下简称“基金管理人”）制定了本基金的分级份额终止运作的实施方案。现将恒中企 A 份额和恒中企 B 份额终止运作相关内容公告如下：

一、分级份额终止运作的主要内容

根据《银华恒生中国企业指数分级证券投资基金基金合同》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》等相关规定，基金管理人向深圳证券交易所申请恒中企 A 份额和恒中企 B 份额终止上市，现已获得深圳证券交易所同意（《终止上市通知书》深证上[2020]1117 号）。恒中企 A 份额和恒中企 B 份额的终止上市日为 2021 年 1 月 4 日。

恒中企 A 份额和恒中企 B 份额将折算为银华恒生中企份额，折算完成后投资者可以申请场内赎回银华恒生中企份额或将场内银华恒生中企份额转托管至场外后进行赎回。

二、基金份额的折算

（一）份额折算基准日

本次份额折算基准日为 2020 年 12 月 31 日。

（二）基金份额折算对象

份额折算基准日登记在册的恒中企 A 份额和恒中企 B 份额。

（三）基金份额折算方式

在份额折算基准日日终，以银华恒生中企份额的基金份额净值为基准，恒

中企 A 份额、恒中企 B 份额按照各自的基金份额参考净值折算成银华恒生中企份额的场内份额。原恒中企 A 份额及恒中企 B 份额基金份额持有人所持有的折算后的银华恒生中企份额场内份额数取整计算（最小单位为 1 份），小数点以后的部分舍去并计入基金资产。

份额折算计算公式：

恒中企 A 份额（或恒中企 B 份额）的折算比例 = 份额折算基准日恒中企 A 份额（或恒中企 B 份额）的基金份额参考净值 / 份额折算基准日银华恒生中企份额的基金份额净值

恒中企 A 份额（或恒中企 B 份额）折算后场内银华恒生中企份额数 = 折算前恒中企 A 份额（或恒中企 B 份额）的份额数 × 恒中企 A 份额（或恒中企 B 份额）的折算比例

三、基金份额折算期间的基金业务办理

（一）份额折算基准日（即 2020 年 12 月 31 日），本基金银华恒生中企份额暂停办理申购（含定期定额投资）、赎回、转托管（包括系统内转托管、跨系统转托管，下同）业务，停止办理配对转换业务；当日晚间，基金管理人计算当日基金份额（参考）净值及份额折算比例。

（二）份额折算基准日后的第一个工作日（即 2021 年 1 月 4 日），本基金银华恒生中企份额暂停办理申购（含定期定额投资）、赎回、转托管业务，恒中企 A 份额、恒中企 B 份额终止上市，银华恒生中企份额停牌。当日，本基金登记机构及基金管理人为基金份额持有人办理份额登记确认。

（三）份额折算基准日后的第二个工作日（即 2021 年 1 月 5 日），基金管理人将公告份额折算确认结果，基金份额持有人可以查询其账户内“银华恒生中国企业指数证券投资基金（QDII-LOF）”的基金份额。当日，银华恒生中国企业指数证券投资基金（QDII-LOF）恢复办理申购（含定期定额投资）、赎回、转托管业务，银华恒生中企份额自当日开市起复牌。

四、《银华恒生中国企业指数证券投资基金（QDII-LOF）基金合同》的生效

根据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》等相关规定，经与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致，并报监管部门备案，恒中企 A 份额和恒中企 B 份额终止运作后，《银华恒生中国企业指数分级证券投资基金基金合同》将修订为《银华恒生中国企业指数证券投资基金（QDII-LOF）基金合同》，《银华恒生中国企业指数分级证券投资基金托管协议》将修订为《银华恒生中国企业指数证券投资基金（QDII-LOF）托管协议》，修订内容详见基金管理人 2020 年 12 月 2 日发布的《关于银华恒生中国企业指数分级证券投资基金之恒中企 A 份额和恒中企 B 份额终止运作、终止上市并修改基金合同的公告》。

份额折算基准日次日（2021 年 1 月 1 日）《银华恒生中国企业指数证券投资基金（QDII-LOF）基金合同》生效，《银华恒生中国企业指数分级证券投资基金基金合同》同时失效。

五、重要提示

（一）恒中企 A 份额和恒中企 B 份额基金份额持有人持有的折算后场内银华恒生中企份额取整计算（最小单位为 1 份），不足 1 份的零碎份额的处理方式按照中国证券登记结算有限责任公司的相关规则处理，折算后的基金份额以登记结算机构最终确认的数据为准。由于基金份额数取整计算产生的误差，基金份额持有人将面临其所持基金资产净值减小的风险，对于持有份额数极少的恒中企 A 份额、恒中企 B 份额持有人，将面临持有的基金份额折算后份额数不足一份而被计入基金资产的风险。

（二）折算完成后，银华恒生中国企业指数证券投资基金（QDII-LOF）为完全复制指数的股票型基金，其预期风险和预期收益水平高于货币型基金、债

券型基金。本基金为指数型基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。同时，本基金为境外证券投资基金，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险之外，本基金还面临汇率风险、主要市场风险等海外市场投资所面临的特别投资风险。

（三）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）。

银华基金管理股份有限公司

2020年12月29日