

银华基金管理股份有限公司

关于以通讯方式召开银华沪深 300 指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告

银华基金管理股份有限公司（以下简称“基金管理人”或“本公司”）已于 2020 年 9 月 25 日在规定媒介发布了《银华基金管理股份有限公司关于以通讯方式召开银华沪深 300 指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的公告》，于 2020 年 9 月 28 日发布了《银华基金管理股份有限公司关于以通讯方式召开银华沪深 300 指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告》。为了使本次基金份额持有人大会顺利召开，现发布关于以通讯方式召开银华沪深 300 指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告。

一、召开会议基本情况

根据市场环境变化，为更好地满足投资者需求，保护基金份额持有人的利益，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》和《银华沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，银华沪深 300 指数分级证券投资基金（基金代码：银华 300 份额为 161811，银华 300A 为份额为 150167，银华 300B 份额为 150168，以下简称“本基金”）的基金管理人经与本基金的基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致，决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会（以下简称“大会”）审议本基金转型方案等相关事宜，将本基金转型为“银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）”，会议的具体安排如下：

1、会议召开方式：通讯方式。

2、会议投票表决起止时间：自权益登记日即 2020 年 10 月 21 日 15:00 起，至 2020 年 10 月 27 日 17:00 止（投票表决时间以本次大会召集人指定的表决票收件人收到表决票时间为准）。

二、会议审议事项

本次会议审议事项为《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》（见附件一）。上述议案的说明及基金合同的详细修订内容详见《银华沪深 300 指数分级证券投资基金转型方案说明书》（见附件四）。

三、基金份额持有人大会的权益登记日

本次大会的权益登记日为 2020 年 10 月 21 日，即该日交易时间结束后在本基金登记机构登记在册的本基金基金份额持有人或其授权的代理人均有权参加本次基金份额持有人大会并投票表决。

四、投票方式

（一）纸质投票

1、本次会议表决票见附件二。基金份额持有人可采取从相关报纸上剪裁、复印附件二或登录基金管理人网站（<http://www.yhfund.com.cn>）、中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）下载并打印等方式填制表决票。

2、基金份额持有人应当按照表决票的要求填写相关内容，其中：

（1）个人投资者自行投票的，需在表决票上签字，并提供本人有效身份证明文件（包括使用的身份证或其他能够表明其身份且基金管理人认可的有效证件或证明）正反面复印件；

（2）机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本单位公章或经授权的业务公章或基金管理人认可的其他印章（以下合称“公章”），并提供加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）；

合格境外机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本单位公章（如有）或由授权代表在表决票上签字（如无公章），并提供该授权代表的有效身份证明文件（包括使用的身份证或其他能够表明其身份且基金管理人认可的有效证件或证

明)正反面复印件,该合格境外机构投资者所签署的授权委托书或者证明该授权代表有权代表该合格境外机构投资者签署表决票的其他证明文件,以及该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件,以及取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件;

(3) 以上各项中的公章、批文、开户证明及登记证书,以基金管理人认可的为准。

3、基金份额持有人或其代理人需将填妥的表决票和所需的相关文件自权益登记日即 2020 年 10 月 21 日 15:00 起,至 2020 年 10 月 27 日 17:00 止(投票表决时间以本次大会召集人指定的表决票收件人收到表决票时间为准)通过专人送交或邮寄的方式送达至本次大会召集人指定的表决票收件人办公地址,并在信封表面注明:“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专用”。

基金管理人指定的表决票收件人及其联系方式如下:

公司名称:银华基金管理股份有限公司

地址:北京市东城区东长安街 1 号东方广场 C2 座 10 层银华基金管理股份有限公司客户服务中心

邮政编码:100738

收件人:董彦杰

联系电话:010-58163073

(二) 电话投票

为方便基金份额持有人参与大会投票,自 2020 年 10 月 21 日 15:00 起,至 2020 年 10 月 27 日 17:00 以前的工作日(以基金管理人指定系统记录时间为准),基金份额持有人可拨打基金管理人客服电话(400-678-3333)并按提示转人工座席参与本次基金份额持有人大会的投票。基金管理人也将主动与预留联系方式的基金份额持有人取得联系。通话过程中将以回答提问方式核实基金份额持有人身份,身份核实后由人工座席根据客户意愿进行投票记录从而完成本次基金份额持有人大会的投票。为保护基金份额持有人利益,整个通话过程将被录音。

基金份额持有人通过电话表决的方式仅适用于个人投资者,对机构投资者暂不开通。

五、授权

为便于基金份额持有人在本次大会上充分表达其意愿，基金份额持有人除可以在投票期间自行投票外，还可以授权他人代其在本基金持有人大会上投票。根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，基金份额持有人授权他人在本次基金持有人大会上表决需符合以下规则：

（一）委托人

本基金的基金份额持有人自本公告发布之日起可委托他人代理行使本次基金持有人大会的表决权。本基金的基金份额持有人授权他人行使表决权的票数按该基金份额持有人在权益登记日所持有的基金份额数计算，一份基金份额代表一票表决权。

个人投资者委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供被代理的个人投资者有效身份证明文件（包括使用的身份证或其他能够表明其身份且基金管理人认可的有效证件或证明）正反面复印件，以及填妥的授权委托书原件（可参照附件三）。如代理人为个人，还需提供代理人的有效身份证明文件（包括使用的身份证或其他能够表明其身份且基金管理人认可的有效证件或证明）正反面复印件；如代理人为机构，还需提供代理人的加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。

机构投资者委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供机构投资者的加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等），以及填妥的授权委托书原件（可参照附件三）。如代理人为个人，还需提供代理人的有效身份证明文件（包括使用的身份证或其他能够表明其身份且基金管理人认可的有效证件或证明）正反面复印件；如代理人为机构，还需提供代理人的加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。合格境外机构投资者委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件，以及取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件，以及填妥的授权委托书原件（可参照附件

三)。如代理人为个人，还需提供代理人的有效身份证明文件（包括使用的身份证或其他能够表明其身份且基金管理人认可的有效证件或证明）正反面复印件；如代理人为机构，还需提供代理人的加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。

以上各项中的公章、批文、开户证明及登记证书，以基金管理人认可的为准。

（二）受托人

基金份额持有人可以委托本基金的基金管理人、基金托管人、销售机构以及其他符合法律规定的机构和个人，代为行使本次基金份额持有人大会上的表决权。

受托人为个人的，还需提供受托人的身份证明文件（包括使用的身份证或其他能够表明其身份且基金管理人认可的有效证件或证明）正反面复印件；受托人为机构的，还需提供该受托人加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。如受托人为基金管理人、基金托管人或代销机构的，无需提供受托人的企业法人营业执照复印件。

（三）授权方式

1、纸面授权

本基金的基金份额持有人可通过法律法规认可的授权方式授权受托人代为行使表决权。基金份额持有人通过纸面方式授权的，授权委托书的样本请见本公告附件三。基金份额持有人可通过剪报、复印或登录基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）下载等方式获取授权委托书样本。

2、电话授权

为方便基金份额持有人参与大会投票，投票期间持有人可以通过电话授权的方式授权基金管理人代为投票。（1）基金管理人在客服电话上增设持有人专用通道，基金份额持有人可拨打基金管理人客服电话（400-678-3333）并按提示转人工服务，客服人员核对客户身份后进行授权记录从而完成授权。（2）基金管理

人的呼叫中心也将主动与基金份额持有人取得联系，在通话过程中以回答提问方式核实持有人身份后，由人工座席根据客户意愿进行授权记录从而完成授权。上述通话过程将被录音，电话授权方式仅适用于个人投资者，不适用于机构投资者。

3、授权效力确定规则

(1) 如果同一基金份额存在包括有效纸面方式授权和其他非纸面方式有效授权的，以有效的纸面授权为准。多次以有效纸面方式授权的，以最后一次纸面授权为准。不能确定最后一次纸面授权的，如最后时间收到的授权委托有多次，以表示具体表决意见的纸面授权为准；最后时间收到的多次纸面授权均未表示具体表决意见的，若授权表示一致，以一致的授权表示为准；若授权表示不一致，视为委托人授权受托人选择其中一种授权表示行使表决权；

(2) 如果同一基金份额在只存在有效纸面方式授权时，委托人签署的授权委托书没有表示具体表决意见的，视为委托人授权受托人按照受托人意志行使表决权；

(3) 如果同一基金份额无有效纸面方式授权，但存在有效的其他非纸面方式授权的，以有效的其他非纸面方式的授权为准；

(4) 如果同一基金份额以非纸面方式进行多次授权的，以时间在最后的授权为准。如最后时间收到的授权委托有多项，以表示具体表决意见的授权为准；最后时间收到的多次授权其授权表示一致的，以一致的授权表示为准；若授权表示不一致，视为委托人授权受托人选择其中一种授权表示行使表决权；

(5) 如委托人未在授权委托表示中明确其表决意见的，视为委托人授权受托人按照受托人的意志行使表决权；如委托人在授权委托表示中表达多种表决意见的，视为委托人授权受托人选择其中一种授权表示行使表决权。

六、计票

1、本次通讯会议的计票时间为 2020 年 10 月 28 日，计票方式为：由基金管理人授权的两名监督员在基金托管人（中国建设银行股份有限公司）授权代表的监督下在表决截止日期后第 2 个工作日进行计票，并由公证机关对其计票过程及结果予以公证。

2、基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授

权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的每一基金份额在其对应的份额级别内拥有平等的投票权，即银华 300 份额、银华 300A 份额、银华 300B 份额的基金份额持有人所持每份基金份额在其对应份额级别内享有平等的投票权。

3、如果同一基金份额存在包括有效纸面方式表决和其他非纸面方式有效表决的，以有效的纸面表决为准。

4、纸面表决票效力的认定如下：

（1）表决票填写完整清晰，所提供文件符合本公告规定，且在规定时间内送达基金管理人的，为有效表决票；有效表决票按表决意见计入相应的表决结果，其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的各类基金份额总数。

（2）如表决票上的表决意见未选、多选、无法辨认、表决意见空白、字迹模糊不清、相互矛盾或意愿无法判断，但其他各项符合会议通知规定的，视为弃权表决，计入有效表决票，并按“弃权”计入对应的表决结果，其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的各类基金份额总数。

（3）如表决票上的签字或盖章部分填写不完整、不清晰的，或未能提供有效证明基金份额持有人身份或代理人经有效授权的证明文件的，或未能在规定时间之内送达基金管理人的，均为无效表决票；无效表决票不计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

（4）基金份额持有人重复提交表决票的，如各表决票表决意见相同，则视为同一表决票；如各表决票表决意见不相同，则按如下原则处理：

①送达时间不是同一天的，以最后送达的填写有效的表决票为准，先送达的表决票视为被撤回；

②送达时间为同一天的，如果能判断收到时间先后的，以最后送达的填写有效的表决票为准，先送达的表决票视为被撤回；若无法判断收到时间先后的，则视为在同一表决票上做出了不同表决意见，计入弃权表决票；

③送达时间按如下原则确定：专人送达的以实际递交时间为准，邮寄的以基金管理人收到的时间为准。

5、如果同一基金份额以非纸面方式进行多次表决的，以时间在最后的表决为准。

七、决议生效条件

1、本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的，基金份额持有人所持有的银华 300 份额、银华 300A 份额、银华 300B 份额各自的基金份额不小于在权益登记日各自基金总份额的 50%（含 50%）；

2、《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》应当由提交有效表决票的银华 300 份额、银华 300A 份额、银华 300B 份额的各自基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方为有效；

3、本次基金份额持有人大会决议通过的事项，基金管理人自通过之日起 5 日内报中国证监会备案，本次基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效，并自生效之日起依照《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的有关规定在规定媒介上公告。法律法规另有规定的，从其规定。

八、持有人大会未成功召开或议案未通过安排

如本次基金份额持有人大会未成功召开或议案未通过，基金管理人将根据中国人民银行、中国银行保险监督管理委员会、中国证券监督管理委员会、国家外汇管理局联合发布的《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》的要求，于 2020 年底完成对本基金的整改，取消分级运作机制，将银华 300A 份额、银华 300B 份额全部转换为银华 300 份额。届时，基金管理人将相应变更基金名称、修改基金合同并就取消分级运作的安排进行公告。敬请投资者合理安排投资计划。

九、本次大会相关机构

1、召集人：银华基金管理股份有限公司

联系人：董恩彤

联系电话：400—678—3333

传真：010-58163027

网址：<http://www.yhfund.com.cn>

2、监督人：中国建设银行股份有限公司

3、公证机构：北京市方圆公证处

联系电话：010-85197506

4、见证律师事务所：上海市通力律师事务所

联系电话：021-31358666

十、重要提示

1、请基金份额持有人在提交表决票时，充分考虑邮寄在途时间，确保表决票于表决截止时间前送达。

2、本次基金份额持有人大会有关公告可通过基金管理人网站查阅，投资者如有任何疑问，可致电基金管理人客户服务电话 400-678-3333 咨询。

3、如本次基金份额持有人大会未成功召开或议案未通过，基金管理人将根据中国人民银行、中国银行保险监督管理委员会、中国证券监督管理委员会、国家外汇管理局联合发布的《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》的要求，于 2020 年底完成对本基金的整改，取消分级运作机制，将银华 300A 份额、银华 300B 份额全部转换为银华 300 份额。届时，基金管理人将相应变更基金名称、修改基金合同并就取消分级运作的安排进行公告。敬请投资者合理安排投资计划。

4、根据相关法律法规以及深圳证券交易所业务规则要求，本基金银华 300A 份额、银华 300B 份额将自基金份额持有人大会计票之日（2020 年 10 月 28 日）开市起停牌，并于基金份额持有人大会结果公告发布日 10:30 复牌（如基金份额持有人大会结果公告发布日为非交易日，则发布日后首个交易日开市时复牌）。

5、本次基金份额持有人大会决议生效后，本基金将相应安排转型选择期，以更好地满足投资者的退出需求。具体安排详见基金管理人届时发布的相关公告。

6、本公告的有关内容由银华基金管理股份有限公司负责解释。

银华基金管理股份有限公司

2020 年 9 月 29 日

附件一：《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》

附件二：《银华沪深 300 指数分级证券投资基金基金份额持有人大会通讯表决票》

附件三：《授权委托书》

附件四：《银华沪深 300 指数分级证券投资基金转型方案说明书》

附件一：

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

银华沪深 300 指数分级证券投资基金基金份额持有人：

根据市场环境变化，为保护基金份额持有人的利益，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《银华沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）有关规定，银华基金管理股份有限公司（以下简称“基金管理人”）经与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致，决定以通讯方式召开银华沪深 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，审议本基金转型为银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）并据此修改基金合同等法律文件的相关事项。基金合同具体修改内容及修改后基金合同的生效事宜详见附件四《银华沪深 300 指数分级证券投资基金转型方案说明书》。

为实施本次会议议案，提议授权基金管理人根据基金份额持有人大会决议对《基金合同》进行修改，办理本次基金转型的相关事宜，包括但不限于根据现时有效的法律法规的要求、《银华沪深 300 指数分级证券投资基金转型方案说明书》和转型后开放式基金的特征，对《银华沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同》等法律文件进行修改和补充；提议授权基金管理人在转型实施前，制订有关基金转型正式实施的日期、转型方案实施安排并提前公告，并在转型实施完成后，就转型结果及修改后的基金合同生效事宜发布公告。

以上提案，请予审议。

银华基金管理股份有限公司

2020 年 9 月 29 日

附件二：

**银华沪深 300 指数分级证券投资基金
基金份额持有人大会通讯表决票**

基金份额持有人姓名/名称：			
基金份额持有人证件号码（身份证件号/营业执照注册号）：			
基金份额持有人证券/基金账户号：			
受托人（代理人）姓名/名称：			
受托人（代理人）证件号码（身份证件号/营业执照注册号）：			
审议事项	同意	反对	弃权
《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/受托人（代理人）签名或盖章			
日期：2020 年__月__日			
说明：1、请就审议事项表示“同意”、“反对”或“弃权”，并在相应栏内画“√”，同一议案只能表示一项意见。2、“证券/基金账户号”，仅指持有本基金份额的证券账户卡卡号或基金账户号，同一基金份额持有人拥有多个此类账户且需要按照不同账户持有基金份额分别行使表决权的，应当分别填写证券/基金账户号；其他情况可不必填写。此处空白、多填、错填、无法识别等情况的，将被默认为代表此基金份额持有人所持有的本基金所有份额（包括银华 300 份额、银华 300A 份额、银华 300B 份额）。3、如表决票上的表决意见未选、多选、无法辨认、表决意见空白、字迹模糊不清、相互矛盾或意愿无法判断，但其他各项符合会议通知规定的，视为弃权表决，计入有效表决票，并按“弃权”计入对应的表决结果，其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的各类基金份额总数。4、如表决票上的签字或盖章部分填写不完整、不清晰的，或未能提供有效证明基金份额持有人身份或代理人经有效授权的证明文件的，或未能在规定时间			

之内送达基金管理人的，均为无效表决票；无效表决票不计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。5、本表决票可从基金管理人网站（<http://www.yhfund.com.cn>）、中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）下载、从报纸上剪裁、复印或按此格式打印。

附件三：

授权委托书

兹全权委托 先生 / 女士或 单位代表本人(或本机构) 参加投票截止日为 2020 年 10 月 27 日的以通讯方式召开的银华沪深 300 指数分级证券投资基金基金份额持有人大会，并代为全权行使所有议案的表决权。表决意见以受托人的表决意见为准。

委托人姓名或名称（签字/盖章）：

委托人证件号码（身份证件号/营业执照注册号）：

委托人证券/基金账户号：

受托人（代理人）姓名或名称（签字/盖章）：

受托人证件号码（身份证件号/营业执照注册号）：

委托日期：2020 年 月 日

附注：

1、此授权委托书可从报纸上剪裁、复印或按以上格式自制，在填写完整并签字盖章后均为有效。

2、“委托人证券/基金账户号”，仅指持有本基金份额的证券账户卡卡号或基金账户号，同一基金份额持有人拥有多个此类账户且需要按照不同账户持有基金份额分别行使表决权的，应当分别填写证券/基金账户号；其他情况可不必填写。此处空白、多填、错填、无法识别等情况的，将被默认为代表此基金份额持有人所持有的本基金所有份额（包括银华 300 份额、银华 300A 份额、银华 300B 份额）参会和进行投票。

3、受托人的表决意见代表委托人本基金账户下全部基金份额（包括银华 300 份额、银华 300A 份额、银华 300B 份额）的表决意见。

附件四：

银华沪深 300 指数分级证券投资基金转型方案说明书

一、声明

1、为维护基金份额持有人利益，提高产品的市场竞争力，根据《中华人民共和国基金法》、《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《银华沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”），经与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致，决定以通讯方式召开基金份额持有人大会，审议《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》。

2、本次参加基金份额持有人大会表决的基金份额持有人为权益登记日登记在册的银华沪深 300 指数分级证券投资基金基金份额持有人，本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的，基金份额持有人所持有的银华 300 份额、银华 300A 份额、银华 300B 份额各自的基金份额不小于在权益登记日各自基金总份额的 50%（含 50%）。《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》须经参加大会的银华 300 份额、银华 300A 份额、银华 300B 份额的各自基金份额持有人或其代理人各自所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过，因此针对上述审议事项存在无法获得相关基金份额持有人大会表决通过的可能。

如本次基金份额持有人大会未成功召开或议案未通过，基金管理人将根据中国人民银行、中国银行保险监督管理委员会、中国证券监督管理委员会、国家外汇管理局联合发布的《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》的要求，于 2020 年底完成对本基金的整改，取消分级运作机制，将银华 300A 份额、银华 300B 份额全部转换为银华 300 份额。届时，基金管理人将相应变更基金名称、修改基金合同并就取消分级运作的安排进行公告。敬请投资者合理安排投资计划。

3、本次基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效，并须报中国证监会备案。中国证监会对本次银华沪深 300 指数分级证券投资基金基金份额持有人大会决议的备案，均不表明其对转型后的银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）的投资价值或投资者的收益做出实质性判断或保证。

二、转型方案要点

银华沪深 300 指数分级证券投资基金转型为银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）方案的主要内容如下：

（一）基金名称的变更

基金名称由“银华沪深 300 指数分级证券投资基金”变更为“银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）”。

（二）投资目标的变更

1、修改前，本基金的投资目标为：“本基金运用指数化投资方法，通过严格的投资流程约束和数量化风险管理手段，追求跟踪误差最小化，力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。”

2、修改后，本基金的投资目标为：“本基金通过严格的投资流程约束和数量化风险管理手段，紧密跟踪标的指数，追求跟踪误差和跟踪偏离度最小化。”

（三）投资范围的变更

1、修改前，本基金的投资范围为：“本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括沪深 300 指数的成份股、备选成份股、新股（含首次公开发行和增发）、债券、债券回购、股指期货以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例为 85%—100%，投资于股票的资产不低于基金资产的 85%，投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金资产的 90%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或中国证监会以后允许基金投资其他金融工具，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。”

2、修改后，基金的投资范围为：“本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板以及其他经中国证监会允许基金投资的股票）、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、中期票据、短期融资券、可转换债券、可交换债券等）、货币市场工具（含同业存单）、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款、活期存款及其他银行存

款)、股指期货、股票期权、资产支持证券、现金及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

在条件许可的情况下，基金管理人可在不改变本基金既有投资目标、策略和风险收益特征并在控制风险的前提下，根据相关法律法规，参与融资及转融通证券出借业务，以提高投资效率及进行风险管理。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金在履行适当程序后可将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：本基金股票资产占基金资产的比例不低于 90%，投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终，在扣除股指期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。”

（四）投资策略的变更

1、修改前，本基金的投资策略为：“本基金采用最优化抽样复制标的指数。最优化抽样依托银华量化投资平台，使用组合优化方法创建投资组合，从而实现对标的指数的紧密跟踪。

1. 资产配置策略

本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例为 85%—100%，投资于股票的资产不低于基金资产的 85%，投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金资产的 90%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

2. 最优化目标组合的构建

（1）股票预筛选

本基金股票筛选范围为沪深 300 指数的成份股及备选股。

（2）最优化抽样

结合指数的特点，综合考虑跟踪效果、操作风险、交易成本等因素，使用组

合优化方法进行最优化抽样，得到目标组合。

（3）调整频率

本基金采用最优化抽样复制方法跟踪标的指数，基金所构建的目标组合将根据标的指数成分股及其权重进行实时调整。同时，本基金还将根据法律法规和基金合同中的投资比例限制、申购赎回变动情况、股票增发因素等变化，对股票投资组合进行实时调整，从而实现对标的指数的紧密跟踪。

①定期调整

本基金构建的目标组合为根据最优化抽样方法得到的最优化抽样组合，将每半年根据上述最优化抽样复制方法对目标组合进行定期调整。

②不定期调整

根据沪深 300 指数编制规则，因指数成份股新股发行、增发、送配等股权变动需要进行成份股权重调整。本基金将紧密跟踪标的指数和最优化目标组合之间的差异，如果由于标的指数自身的较大变化或者其他原因引起的较大幅度的偏差时，需要及时根据最优化抽样复制方法调整目标组合。

3. 其他金融工具投资策略

本基金基于流动性管理的需要，可以少量投资于新股、期限在一年期以下的国家债券、央行票据和政策性金融债以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，目的是保证基金资产的流动性，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。

（4）投资绩效评估

本基金日均跟踪偏离度的绝对值力争不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施将跟踪误差控制在限定的范围之内。

3. 股指期货投资策略

本基金管理人对股指期货的运用将进行充分的论证。本基金在股指期货投资中主要遵循有效管理投资策略，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要通过对现货和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货定价模型寻求其合理估值水平，采用流动性好、交易活跃的期货合约，达到有效跟踪标的指数的目的。特别是在运用股指期货做套期保值的过程中，降低由于大额申购赎回导致仓位大幅

变动引起的跟踪误差。”

2、修改后，基金的投资策略为：“本基金采用最优化抽样复制标的指数。最优化抽样依托银华量化投资平台，使用组合优化方法创建投资组合，从而实现对标指数的紧密跟踪。

1. 资产配置策略

本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例为 90%—100%，投资于股票的资产不低于基金资产的 90%，投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金资产的 80%；每个交易日日终，在扣除股指期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应持有不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

2. 最优化目标组合的构建

（1）最优化抽样

结合指数的特点，综合考虑跟踪效果、操作风险、交易成本等因素，使用组合优化方法进行最优化抽样，得到目标组合。

（2）调整频率

本基金采用最优化抽样复制方法跟踪标的指数，基金所构建的目标组合将根据标的指数成份股及其权重进行实时调整。同时，本基金还将根据法律法规和基金合同中的投资比例限制、申购赎回变动情况、股票增发因素等变化，对股票投资组合进行实时调整，从而实现对标指数的紧密跟踪。

①定期调整

本基金构建的目标组合为根据最优化抽样方法得到的最优化抽样组合，将每半年根据上述最优化抽样复制方法对目标组合进行定期调整。

②不定期调整

根据沪深 300 指数编制规则，因指数成份股新股发行、增发、送配等股权变动需要进行成份股权重调整。本基金将紧密跟踪标的指数和最优化目标组合之间的差异，力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。如果由于标的指数自身的较大变化或者其他原因引起的较大幅度的偏差时，需要及时根据最优化抽样复制方法调整

目标组合。

3、债券投资策略

本基金进行债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，使基金资产得到更加合理有效的利用，从而提高投资组合收益。本基金将以市场利率趋势研判为主，基于对宏观经济环境的深入研究和基金未来现金流的分析，在保证流动性和风险可控的前提下，灵活运用目标久期策略、收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略、个券选择策略、信用策略等积极投资策略，自上而下地管理组合的久期，灵活地调整组合的券种搭配，同时精选个券，以增强组合的持有期收益。

4、股指期货投资策略

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，有选择地投资于流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金在进行股指期货投资时，首先将基于对证券市场总体行情的判断和组合风险收益的分析确定投资时机，并根据风险资产投资（或拟投资）的总体规模和风险系数决定股指期货的投资比例；其次，本基金将在综合考虑证券市场和期货市场运行趋势以及股指期货流动性、收益性、风险特征和估值水平的基础上进行投资品种选择，以对冲风险资产组合的系统性风险和流动性风险。

同时，当指数期货大幅贴水时，可采用多头套期保值策略，即卖出部分股票持仓并买入指数期货的期货替代现货策略。持有至基差收敛，赚取期货与现货指数的价差，增强指数。

5、股票期权投资策略

本基金将按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的参与股票期权交易。本基金将结合投资目标、比例限制、风险收益特征以及法律法规的相关限定和要求，确定参与股票期权交易的投资时机和投资比例。

6、资产支持证券的投资策略

本基金将深入分析资产支持证券的市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等基本因素，估计资产违约风险和提前偿付风险，并根据资产证券化的收益结构安排，模拟资产支持证券的本金偿还和利息收益的现金流过程，辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型，评估其内在价值。

7、融资及转融通投资策略

为更好的实现投资目标，在加强风险防范并遵守审慎性原则的前提下，本基金可根据投资管理的需要参与融资及转融通证券出借业务。本基金将在分析市场情况、投资者类型与结构、基金历史申赎情况及出借证券流动性情况等因素的基础上，合理确定出借证券的范围、证券出借平均剩余期限和出借证券在基金资产中的占比。”

（五）投资限制的变更

1、修改前，本基金的投资限制为：

“（1）基金财产参与股票发行申购，所申报的金额不得超过本基金的总资产，所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

（2）本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例为 85%—100%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

（3）投资于股票的资产不低于基金资产的 85%，投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金资产的 90%；

（4）本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；

（5）本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%；

其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

（6）本基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；

本基金管理人应当按照中国金融期货交易所要求的内容、格式与时限向交易所报告所交易和持有的卖出期货合约情况、交易目的及对应的证券资产情况等；

（7）本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；

（8）本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；

(9) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计，不得超过基金资产净值的 15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

(10) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；

(11) 法律法规、基金合同规定的其他比例限制。

基金的投资组合应在基金合同生效之日起 3 个月内达到规定的标准。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

如果法律法规对上述投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

除上述 (2)、(9)、(10) 项以外，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。”

2、修改后，基金的投资限制为：

“ (1) 本基金投资于股票资产占基金资产的比例不低于 90%，投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%；

(2) 每个交易日日终，在扣除股指期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；

(3) 本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%，本基金跟踪标的指数的指数化投资部分不计入本项限制；

(4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%，本基金跟踪标的指数的指数化投资部分不计入本项限制；

(5) 基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；完全按照有关指数的构成比

例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合可不受前述比例限制；

（6）本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；

（7）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%，中国证监会规定的特殊品种除外；

（8）本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；

（9）本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

（10）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合该比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

（11）本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上（含 BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

（12）本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；

（13）基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

（14）本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%，本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

（15）本基金的基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

（16）本基金参与股指期货交易，需遵守下列投资比例限制：

1）本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；

2）在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不

得超过基金资产净值的 95%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

3) 本基金在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；

4) 本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；

5) 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；

(17) 本基金参与融资的，每个交易日日终，本基金持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；

(18) 本基金参与转融通证券出借业务的，应当符合下列要求：

1) 参与转融通证券出借业务的资产，不得超过基金资产净值的 30%，其中，出借期限在 10 个交易日以上的出借证券，纳入《流动性风险管理规定》所述流动性受限证券的范围；

2) 参与转融通证券出借业务的单只证券不得超过基金持有该证券总量的 50%；

3) 最近 6 个月内基金日均资产净值不得低于 2 亿元；

4) 证券出借的平均剩余期限不得超过 30 天，平均剩余期限按照市值加权平均计算；

(19) 因未平仓的股票期权合约支付和收取的权利金总额不得超过基金资产净值的 10%；开仓卖出认购期权的，应持有足额标的证券；开仓卖出认沽期权的，应持有合约行权所需的全额现金或交易所规则认可的可冲抵股票期权保证金的现金等价物；未平仓的股票期权合约面值不得超过基金资产净值的 20%。其中，合约面值按照行权价乘以合约乘数计算；基金投资股票期权符合基金合同约定的比例限制（如股票仓位、个股占比等）、投资目标和风险收益特征；

(20) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他投资限制。

除上述第（2）、（10）、（11）、（12）、（18）项外，因证券市场及期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形

除外。法律法规另有规定的，从其规定。因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合上述第（18）条规定的，基金管理人不得新增出借业务。法律法规另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

如果法律法规对上述投资组合比例限制进行变更的，基金管理人在履行适当程序后，可相应调整投资比例限制规定。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。”

（六）风险收益特征的变更

1、修改前，本基金的风险收益特征为：“本基金为复制指数的股票型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。从本基金所分拆的两类基金份额来看，银华 300A 份额具有低风险、收益相对稳定的特征；银华 300B 份额具有高风险、高预期收益的特征。”

2、修改后，本基金的风险收益特征为：“本基金属于股票指数型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金和债券型基金。

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。”

（七）基金收益分配原则的变更

1、修改前，本基金的收益分配原则为：“在存续期内，本基金（包括银华 300 份额、银华 300A 份额、银华 300B 份额）不进行收益分配。”

2、修改后，基金的收益分配原则为：

“（1）本基金在符合有关基金分红条件的前提下可进行收益分配，每次收益分配比例等具体分红方案见基金管理人根据基金运作情况届时不定期发布的相关分红公告；

（2）本基金场外收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，登记在基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额，投资人可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若基金份额持有人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。红利再投资方式免收再投资的费用；

本基金场内收益分配方式参照深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；

(3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 每一基金份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可在法律法规允许的前提下，与基金托管人协商一致后，酌情调整以上基金收益分配原则和支付方式，并于变更实施日前在规定媒介上公告，且不需召开基金份额持有人大会。”

(八) 申购和赎回的费用的变更

1、根据基金转型方案，本基金的申购费率调整如下：

(1) 修改前，本基金的申购费用为：

具体费率如下表所示：

申购费	申购金额 (M，含申购费)	申购费率
	M<50 万元	1.2%
	50 万元≤M<100 万元	0.6%
	100 万元≤M<500 万元	0.1%
	M≥500 万元	固定按笔收取，1000 元/笔

(2) 修改后，基金的申购费用为：

本基金申购费在投资人申购基金份额时收取。申购费用由申购本基金基金份额的投资人承担，主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用，不列入基金财产。投资人在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。

本基金所适用的申购费率如下所示：

申购费率	申购金额 (M，含申购费)	申购费率
------	------------------	------

	M<100 万元	1.20%
	100 万元≤M<200 万元	0.80%
	200 万元≤M<500 万元	0.50%
	M≥500 万元	按笔收取, 1,000 元/笔

2、根据基金转型方案, 本基金的赎回费率调整如下:

(1) 修改前, 本基金的赎回费用为:

本基金对通过直销机构及网上直销交易系统赎回的养老金客户与除此之外的其他投资人实施差别的赎回费率。

养老金客户指基本养老基金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金, 包括全国社会保障基金、可以投资基金的地方社会保障基金、企业年金单一计划以及集合计划。如将来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型, 基金管理人将发布临时公告将其纳入养老金客户范围, 并按规定向中国证监会备案。非养老金客户指除养老金客户外的其他投资人。

具体费率如下表所示:

	持有期限 (Y)	费率	特定赎回费率
场外赎回费	Y<7 天	1.50%	1.50%
	7 天≤Y<1 年	0.5%	0.125%
	1 年≤Y<2 年	0.2%	0.05%
	Y≥2 年	0	0%
	持有期限 (Y)	费率	
场内赎回费	Y<7 天	1.50%	
	Y≥7 天	0.5%	

注: 1 年指 365 天, 2 年指 730 天。

(2) 修改后, 基金的赎回费用为:

本基金的赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担, 赎回费用在基金份额持有人赎回基金份额时收取。

本基金基金份额赎回费率按持有期限的长短分档, 具体如下:

赎回费率	持有期限 (Y)	赎回费率
------	----------	------

(场外)	$N < 7$ 日	1.50%
	$7 \text{ 日} \leq N < 30 \text{ 日}$	0.75%
	$30 \text{ 日} \leq N < 180 \text{ 日}$	0.50%
	$N \geq 180 \text{ 日}$	0%
赎回费率 (场内)	持有期限 (Y)	赎回费率
	$Y < 7 \text{ 日}$	1.50%
	$Y \geq 7 \text{ 日}$	0.50%

场外赎回费中对持续持有期少于 7 天的投资人所收取的 1.50% 的赎回费将全额计入基金财产；对持续持有期大于等于 7 天但少于 30 天的投资人收取的赎回费，将全额计入基金财产；对持续持有期大于等于 30 天但少于 90 天的投资人收取的赎回费，将赎回费总额的 75% 计入基金财产；对持续持有期大于等于 90 天但少于 180 天的投资人收取的赎回费，将赎回费总额的 50% 计入基金财产。未计入基金财产的部分用于支付注册登记费等相关手续费。

对于持续持有期少于 7 日的投资人本基金的场内赎回费率为 1.50%，赎回费将全额计入基金财产；其余持有期限的投资人收取固定的场内赎回费率 0.50%，场内赎回费总额的 25% 将计入基金财产，其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

(九) 取消分级运作、配对转换和折算机制

银华沪深 300 指数分级证券投资基金转型为银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）后，取消分级运作机制。在基金份额持有人大会审议通过后且前述转型正式实施后，银华 300 份额、银华 300A 份额、银华 300B 份额将根据转型方案的约定全部转换为银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）基金份额，因而也不再设置基金份额的分级、配对转换和折算等机制。

(十) 向深圳证券交易所申请银华沪深 300 指数分级证券投资基金的银华 300A 份额、银华 300B 份额的终止上市交易

银华沪深 300 指数分级证券投资基金目前上市交易的基金份额为银华 300A 份额以及银华 300B 份额，在本次基金份额持有人大会决议生效后，基金管理人将按照深圳证券交易所的业务规则申请办理银华沪深 300 指数分级证券投资基金的银华 300A 份额、银华 300B 份额的终止上市等相关业务。本基金转型后，银

华 300A 份额以及银华 300B 份额全部转换为银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）基金份额。

（十一）变更后的基金份额的上市交易

《银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）基金合同》生效后，在符合法律法规和深圳证券交易所规定的上市条件的情况下，基金管理人可以根据有关规定，申请基金份额在深圳证券交易所上市交易。

（十二）转型选择期的相关安排

本次基金份额持有人大会决议生效后，将在银华沪深 300 指数分级证券投资基金将在转型正式实施前安排不少于 20 个交易日的选择期以供基金份额持有人做出选择，具体时间安排详见基金管理人届时发布的相关公告。

选择期期间，银华沪深 300 指数分级证券投资基金之基础份额（即“银华 300 份额”）的申购、赎回业务正常办理。银华沪深 300 指数分级证券投资基金之稳健收益类份额（即“银华 300A 份额”）、银华沪深 300 指数分级证券投资基金之积极收益类份额（即“银华 300B 份额”）的交易、配对转换中场内合并业务照常办理，配对转换中场内分拆业务暂停办理。原基金份额持有人可以选择卖出银华 300A 份额、银华 300B 份额或者赎回银华 300 份额。对于选择期内未作出选择的基金份额持有人，其持有的银华 300 份额、银华 300A 份额、银华 300B 份额将在份额转换基准日依据各自份额的基金份额（参考）净值进行折算，最终将转换为银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）基金份额。

本基金的基金份额持有人在转型选择期内选择赎回银华 300 份额的，对于持续持有期不少于 7 日的投资者不收取赎回费用，对于持续持有期少于 7 日的投资者收取 1.5% 的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产。其中，银华 300A 和银华 300B 份额合并为银华 300 份额后赎回的，银华 300 份额的持续持有期计算以登记机构的相关规则处理。

在选择期期间，由于银华 300 份额需应对赎回等情况，基金管理人将提请基金份额持有人大会审议在选择期内豁免银华沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同中约定的投资组合比例等限制，并授权基金管理人据此落实相关事项及可根据实际情况做相应调整，以及根据实际情况可暂停申购、赎回或调整赎回方式等。具体安排详见基金管理人届时发布的相关公告。

《银华沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同》约定，在银华 300A 份额、

银华 300 份额存续期内的每个会计年度 12 月第一个工作日进行基金的定期份额折算。但如果本次基金的定期份额折算将发生在选择期，基金管理人有权选择不进行定期份额折算，并提前在规定媒介上发布相关公告。

（十三）基金份额的转换业务

转型选择期届满的下一个工作日为份额转换基准日。同日，银华 300A 份额、银华 300B 份额终止上市。银华 300 份额、银华 300A 份额、银华 300B 份额将于份额转换基准日进行转换，最终将转换为基金份额净值为 1.0000 元的银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）基金份额。

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 300 份额、银华 300A 份额、银华 300B 份额将转换为银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）的场内份额，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 份额将转换为银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）的场外份额。

银华 300A 份额（或银华 300B 份额）转换为银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）的场内基金份额数截位取整计算（最小单位为 1 份），舍去部分计入基金财产。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资产净值减小的风险，对于持有份额数较少的银华 300A 份额、银华 300B 份额持有人，将面临持有的基金份额转换后份额数不足 1 份而被计入基金财产的风险。

由银华 300 份额的场内份额或银华 300 份额的场外份额转换的银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）的份额数=银华 300 份额的场内份额或银华 300 份额的场外份额数×份额转换基准日每份银华 300 份额的参考资产净值÷1.0000

由银华 300A 份额转换的银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）的份额数=银华 300A 份额的场内份额数×份额转换基准日每份银华 300A 份额的参考资产净值÷1.0000

由银华 300B 份额转换的银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）的份额数=银华 300B 份额的场内份额数×份额转换基准日每份银华 300B 份额的参考资产净值÷1.0000

基金份额转换后，银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）的基金份额净值为 1.0000 元。银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）的场内份额数截位取整计算（最小单位为 1 份），舍去部分计入基金财产。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资产净值减小的风险。经基金份额转换后，银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）的场外份额数采用截位法保留到小数点后两位，舍去部分计入基金财产。

（十四）银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）基金合同的生效及后续安排

自份额转换基准日次日起，银华沪深 300 指数分级证券投资基金正式转型为银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）。《银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）基金合同》生效，《银华沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同》同日失效。

银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）办理申购赎回、上市交易业务以及其销售机构等具体事项将另行公告。

（十五）其他修改

除上述主要内容的调整需要修改基金合同以外，考虑到自《银华沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同》生效以来，《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其配套准则等法律法规陆续颁布和实施，基金管理人需要根据现行有效的法律法规要求及变更后的银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）的产品特征修订基金合同的相关内容。

（十六）授权基金管理人办理本次基金转型和基金合同修改的有关具体事宜

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定，基金管理人提请基金份额持有人大会授权基金管理人办理本次基金转型的有关具体事宜，包括但不限于根据《银华沪深 300 指数分级证券投资基金转型方案说明书》对《基金合同》等法律文件进行修改和补充，同时基金管理人在转型实施前，将根据基金份额持有人大会的授权，制订有关基金转型正式实施的日期、转型实施前的申购、赎回安排等事项的转型实施安排规则并提前公告。

三、基金管理人就转型方案相关事项的说明

（一）银华沪深 300 指数分级证券投资基金的历史沿革

银华沪深 300 指数分级证券投资基金系于 2014 年 1 月 7 日由银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）转型而成。银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）于

2009年8月17日获中国证监会证监许可【2009】793号文核准募集。基金管理人为银华基金管理股份有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

基金管理人于2009年10月14日获得中国证监会书面确认，《银华沪深300指数证券投资基金（LOF）基金合同》生效。2013年10月14日至2013年11月14日，基金管理人以通讯方式召开银华沪深300指数证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会，大会审议了银华沪深300指数证券投资基金（LOF）采用分级运作的议案，内容包括银华沪深300指数证券投资基金（LOF）采用分级运作、基金更名和修订基金合同等。经2013年12月11日中国证监会基金部函[2013]1061号《关于银华沪深300指数证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会决议备案的回函》备案，该次基金份额持有人大会决议生效。自上述决议生效后，基金管理人向深圳证券交易所申请办理银华沪深300指数证券投资基金（LOF）的终止上市。根据上述生效的基金份额持有人大会决议，自银华沪深300指数证券投资基金（LOF）终止上市之日起《银华沪深300指数证券投资基金（LOF）基金合同》失效且《银华沪深300指数分级证券投资基金基金合同》生效，同时“银华沪深300指数证券投资基金（LOF）”更名为“银华沪深300指数分级证券投资基金”。

（二）基金转型的可行性

1、法律可行性

按照《基金合同》的要求，基金份额持有人大会决议的特别决议，须经出席会议的银华300份额、银华300A份额、银华300B份额的各自基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方为有效。涉及更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式、终止基金合同必须以特别决议通过方为有效。

因此，本基金转型不存在法律方面的障碍。

2、技术运作可行性

本次基金转型不涉及基金管理人、基金托管人和登记机构的变更，技术上可以保障基金份额持有人大会顺利召开和基金份额持有人大会决议顺利执行。

为实现基金转型的平稳过渡，基金管理人与登记机构已就基金变更有关的会计处理、注册登记、系统准备等方面进行了深入研究，已经做好了基金转型的相

关准备。

四、基金转型的主要风险及防范措施

（一）基金转型方案被基金份额持有人大会否决的风险

为防范基金转型方案被基金份额持有人大会否决的风险，基金管理人已提前向部分基金份额持有人征询意见。如有必要，基金管理人将根据基金份额持有人意见，在履行相关程序后进行适当修订，并重新公告。基金管理人可在必要情况下，推迟基金份额持有人大会的召开时间。

如本次基金份额持有人大会未成功召开或议案未通过，基金管理人将根据中国人民银行、中国银行保险监督管理委员会、中国证券监督管理委员会、国家外汇管理局联合发布的《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》的要求，于 2020 年底完成对本基金的整改，取消分级运作机制，将银华 300A 份额、银华 300B 份额全部转换为银华 300 份额。届时，基金管理人将相应变更基金名称、修改基金合同并就取消分级运作的安排进行公告。敬请投资者合理安排投资计划。

（二）防范基金转型后运作过程中的相关运作风险

基金管理人将提前做好充分的内部沟通及外部沟通，避免基金转型后运作过程中出现相关操作风险、管理风险等运作风险。

（三）基金变更后风险等级变化的风险

由于基金变更后投资范围、运作方式等发生较大变化，影响基金的风险收益特征，变更注册前银华 300A 份额具有低风险、收益相对稳定的特征；银华 300B 份额具有高风险、高预期收益的特征，变更注册后银华 300A 份额和银华 300B 份额均转换为银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）份额，为指数型基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。

同时不同的销售机构采用的风险评价方法不同，因此存在基金变更前后风险等级不一致的可能。提示投资人关注。