

银华基金管理股份有限公司关于修订旗下部分公募基金基金合同的公告

为更好地满足广大投资者的理财需求,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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《存托凭证发行与交易管理办法(试行)》、《公开募集证券投资基金侧袋机制指引(试行)》等法律法规及基金合同等规定,经与各基金托管人协商一致,并向中国证监会备案,银华基金管理股份有限公司(以下简称“本基金管理人”)决定自2021年2月26日起,在旗下部分基金的投资范围中增加存托凭证,部分

基金增加侧袋机制,并对基金合同及托管协议的相应条款进行修订。

一、增加可参与存托凭证投资的相关内容

本基金管理人旗下2只公募基金增加可参与存托凭证投资并修订基金合同等法律文件,包括明确投资范围包含存托凭证,增加存托凭证的投资策略、投资比例限制、估值方法等,并相应修订托管协议。本次修订对基金份额持有人利益无实质性不利影响,并已履行了规定的程序,符合相关法律法规的规定。现将修订情况说明如下:

(一)本次增加可参与存托凭证投资的基金

产品代码	产品名称
180003	银华-道琼斯88精选基金
005771	银华可转债债券型证券投资基金

(二)对基金合同修订的内容

以银华可转债债券型证券投资基金为例加以说明。

1.对“前言”部分的修订

增加如下内容:“七、本基金的投资范围包括存托凭证,若投资可能面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险,以及与创新企业、境外发行人、中国存托凭证发行机制以及交易机制等相关的风险。”

2.对“基金的投资”部分的修订

(1)明确“投资范围”中包含存托凭证,将“投资范围”修订为:“

本基金投资于依法发行上市交易的股票(包括中小板、创业板、存托凭证以及其他中国证监会允许基金投资的股票)、可转换债券(含可分离交易可转债)、可交换债券、国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、次级债、政府支持机构债券、资产支持证券、银行存款、同业存单、债券回购、国债期货、权证等,以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)……”

(2)在投资策略部分增加存托凭证投资策略,表述如下:“对于存托凭证投资,本基金将在深入研究的基础上,通过定性分析和定量分析相结合的方式,精选出具有比较优势的存托凭证。”

(3)在“投资限制”中增加存托凭证投资限制,表述如下:“本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行,与境内上市交易的股票合并计算;”

3.在“基金资产估值”部分的“估值方法”中增加存托凭证估值方法,表述如下:“本基金投资存托凭证的估值核算,依照境内上市交易的股票执行”。

(三)托管协议中相关内容一并予以修改。

二、增加侧袋机制

本基金管理人旗下19只公募基金增加侧袋机制并修订基金合同等法律文件,包括增加相关释义,说明实施侧袋机制期间申购与赎回、基金份额持有人大会的特殊约定,说明侧袋机制的实施和投资运作安排,明确了实施侧袋机制期间的基金资产估值、基金费用、收益分配、信息披露,并相应修订托管协议。本次修订对基金份额持有人利益无实质性不利影响,并已履行了规定的程序,符合相关法律法规的规定。现将修订情况说明如下:

(一)本次增加侧袋机制的基金

产品代码	产品名称
A:006496 C:006497	银华安盈短债债券型证券投资基金
180003	银华-道琼斯88精选基金
A:000194 C:006837	银华信用四季红债券型证券投资基金
A:161823 C:161824	银华永兴纯债债券型发起式证券投资基金(LOF)
003497	银华添泽定期开放债券型证券投资基金
A:006907 C:006908	银华安鑫短债债券型证券投资基金
008677	银华中债1-3年国开行债券指数证券投资基金
002491	银华添益定期开放债券型证券投资基金
161820	银华纯债信用主题债券型证券投资基金(LOF)
A:000286 C:010986 H:960042	银华信用季季红债券型证券投资基金
005771	银华可转债债券型证券投资基金
005500	银华岁盈定期开放债券型证券投资基金
004087	银华添润定期开放债券型证券投资基金
006645	银华安丰中短期政策性金融债债券型证券投资基金
006415	银华中短期政策性金融债定期开放债券型证券投资基金
007206	银华丰华三个月定期开放债券型发起式证券投资基金
008002	银华稳晟30个月定期开放债券型证券投资基金
005529	银华茂定定期开放债券型证券投资基金
009541	银华中债1-3年农发行债券指数证券投资基金

(二)对基金合同修订的内容

以银华可转债债券型证券投资基金为例加以说明。

1.对“释义”部分的修订

在“释义”部分增加如下两个释义:

“60、侧袋机制:指将基金投资组合中的特定资产从原有账户分离至一个专门账户进行处置清算,目的在于有效隔离并化解风险,确保投资者得到公平对待,属于流动性风险管理工具。侧袋机制实施期间,原有账户称为主袋账户,专门账户称为侧袋账户。”

“61、特定资产:包括:(一)无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性的资产;(二)按摊余成本计量且计提资产减值准备仍导致资产价值存在重大不确定性的资产;(三)其他资产价值存在重大不确定性的资产”。

2.对“基金份额的申购与赎回”部分的修订

增加如下条款:

“十七、实施侧袋机制期间本基金的申购与赎回

本基金实施侧袋机制的,本基金的申购和赎回安排详见招募说明书或相关公告。”

3.对“基金份额持有人大会”部分的修订

增加如下条款:

“九、实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定

若本基金实施侧袋机制,则相关基金份额或表决权的比例指主袋份额持有人和侧袋份额持有人分别持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例,但若相关基金份额持有人大会召集和审议事项不涉及侧袋账户的,则仅指主袋份额持有人持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例:

1、基金份额持有人行使提议权、召集权、提名权所需单独或合计代表相关基金份额10%以上(含10%);

2、现场开会的到会者在权益登记日代表的基金份额不少于本基金在权益登记日相关基金份额的二分之一(含二分之一);

3、通讯开会的直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日相关基金份额的二分之一(含二分之一);

4、在参与基金份额持有人大会投票的基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日相关基金份额的二分之一、召集人在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内就原定审议事项重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上(含三分之一)相关基金份额的持有人参与或授权他人参与基金份额持有人大会投票;

5、现场开会由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的50%以上(含50%)选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人;

6、一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上(含二分之一)通过;

7、特别决议应当经参加大会的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。

同一主侧袋账户内的每份基金份额具有平等的表决权。”

4.对“基金的投资”部分的修订

增加如下条款:

“八、侧袋机制的实施和投资运作安排

当基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时,根据最大限度保护基金份额持有人利益的原则,基金管理人经与基金托管人协商一致,并咨询会计师事务所意见后,可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制。

侧袋机制实施期间,本部分约定的投资组合比例、投资策略、组合限制、业绩比较基准、风险收益特征等约定仅适用于主袋账户。

侧袋账户的实施条件、实施程序、运作安排、投资安排、特定资产的处置变现和支付等对投资者权益有重大影响的事项详见招募说明书的规定。”

5.对“基金资产估值”部分的修订

“六、暂停估值的情形”第3项“当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时,经与基金托管人协商确认后,基金管理人应当暂停估值”修订为:“当特定资产占前一估值日基金资产净值50%以上的,经与基金托管人协商确认后,基金管理人应当暂停估值”;同时,增加如下条款:

“九、实施侧袋机制期间的基金资产估值

本基金实施侧袋机制的,应根据本部分的约定对主袋账户资产进行估值并披露主袋账户的净值信息,暂停披露侧袋账户净值。”

6.对“基金费用与税收”部分的修订

增加如下条款:

“五、实施侧袋机制期间的基金费用

本基金实施侧袋机制的,与侧袋账户有关的费用可以从侧袋账户中列支,但应待侧袋账户资产变现后方可列支,有关费用可酌情收取或减免,但不得收取管理费,详见招募说明书的规定。”

7.对“基金的收益与分配”部分的修订

增加如下条款:

“七、实施侧袋机制期间的收益分配

本基金实施侧袋机制的,侧袋账户不进行收益分配,详见招募说明书的规定。”

8.对“基金的信息披露”部分的修订

增加如下条款:

“(十四)实施侧袋机制期间的信息披露

本基金实施侧袋机制的,相关信息披露义务人应当根据法律法规、基金合同和招募说明书的规定进行信息披露,详见招募说明书的规定。”

(三)托管协议中相关内容一并予以修改。

投资者可登录本基金管理人网站(www.yhfund.com.cn)查阅修订后的基金合同、托管协议等法律文件,也可拨打本基金管理人客户服务电话(400-678-3333(免长途话费)或010-85186558)了解相关信息。

本公告解释权归本基金管理人。

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。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。本基金管理人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。

银华基金管理股份有限公司

二〇二一年二月二十六日