

# 银华沪深 300 价值交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告

## 重要提示

1、银华沪深 300 价值交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）的募集已于 2022 年 9 月 23 日获中国证券监督管理委员会证监许可【2022】2243 号文准予注册。

中国

证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）对本基金募集的注册并不代表其对本基金的风险和收益作出实质性判断、推荐或者保证，也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会

监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

2、本基金是交易型开放式证券投资基金，基金类别为股票型证券投资基金。

3、本基金的基金管理人为银华基金管理股份有限公司（以下简称“本公司”、“基金管理人”或“本基金管理人”），基金托管人为中国建设银行股份有限公司，登记机构为中国

证券登记结算有限责任公司。

4、本基金的募集对象为符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者、合格境外投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。

5、投资者可选择网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购三种方式。网上现金认购是指投资人通过具有基金销售业务资格的上海证券交易所会员在上海证券交易所网上系统以现金进行认购。网下现金认购是指投资人通过基金管理人和/或其指定的发售代理机构以现金进行认购。网下股票认购是指投资人通过基金管理人和/或其指定的发售代理机构以股票进行认购。投资人可以通过基金管理人及其指定的发售代理机构办理本基金的网下现金认购和网下股票认购。

6、本基金自 2022 年 12 月 19 日至 2022 年 12 月 23 日通过本公司的直销中心和发售代理机构公开发售。其中，通过基金管理人和/或其指定的发售代理机构进行网下现金认购和网下

股票认购的日期均为 2022 年 12 月 19 日至 2022 年 12 月 23 日，网上现金认购的日期为 2022 年

12 月 21 日至 2022 年 12 月 23 日。基金管理人可根据募集情况，在符合相关法律法规的情况

下，在募集期限内调整本基金的发售时间（包括一种或多种发售方式的发售时间），并及时

公告。本基金的募集期限自基金份额发售之日起不超过 3 个月。

## 7、认购开户

（1）投资人认购本基金时需具有上海证券交易所 A 股账户（以下简称“上海 A 股账户”）或上海证券交易所证券投资基金账户（以下简称“上海证券交易所证券投资基金账户”）。尚无上海 A 股账户或上海证券交易所证券投资基金账户的投资者，需在认购前到中国证劵登记结算有限责任公司上海分公司的开户代理机构办理上海 A 股账户或上海证券交易所证券投资基金账户的开户手续。有关开设上海 A 股账户和上海证券交易所证券投资基金账户的具体程序和办法，请到各

开户网点详细咨询有关规定。

(2) 如投资人需新开立上海 A 股账户或上海证券投资基金账户，则应注意：

1) 上海证券投资基金账户只能进行基金份额的现金认购和二级市场交易。如投资人需要使用沪深 300 价值指数成份股或备选成份股中的上海证券交易所上市股票参与网下股票认购或基金份额的申购、赎回，则应开立上海证券交易所 A 股账户；如投资人需要使用沪

深 300 价值指数成份股或备选成份股中的深圳证券交易所上市股票参与网下股票认购，则还应开立深圳证券交易所 A 股账户，且该两个账户的证件号码及名称应保持一致。

2) 开户当日无法办理指定交易，建议投资人在进行认购前至少 2 个工作日办理开户手续。

(3) 如投资人已开立上海 A 股账户或上海证券投资基金账户，则应注意：

1) 如投资人未办理指定交易或指定交易在不办理本基金发售业务的证券公司，需要指定交易或转指定交易在可办理本基金发售业务的证券公司。

2) 当日办理指定交易或转指定交易的投资人当日无法进行认购，建议投资人在进行认购前至少 1 个工作日办理指定交易或转指定交易手续。

(4) 账户使用注意事项

1) 如投资人需要参与网下现金认购或网上现金认购，应使用上海 A 股账户或上海证券投资基金账户；上海证券投资基金账户只能进行本基金基金份额的网上现金认购、网下现金认购和二级市场交易。

2) 如投资人以上海证券交易所上市交易的本基金标的指数成份股或备选成份股进行网下股票认购的，应开立并使用上海 A 股账户。

3) 如投资人以深圳证券交易所上市交易的本基金标的指数成份股或备选成份股进行网下股票认购的，除了持有上海 A 股账户或上海证券投资基金账户外，还应持有深圳证券交易所 A 股账户（以下简称“深圳 A 股账户”），且该两个账户的证件号码及名称属于同一

投资人所有，并注意投资人用以认购基金份额的托管证券公司和深圳 A 股账户指定交易证券公司应为同一发售代理机构。

4) 已购买过由银华基金管理股份有限公司担任登记机构的基金的投资者，其持有的银华基金管理股份有限公司开放式基金账户不能用于认购本基金。

8、本基金认购费率或认购佣金比率不高于 0.80%。

9、本基金管理人决定本基金在募集期内最终确认的有效认购总金额不超过 60 亿元人民币（不包括募集期利息）。若本基金达到募集规模上限，本基金将采取“全程比例确认”

的方式对募集规模进行限制，具体办法参见基金管理人届时发布的相关公告。

基金合同生效后不受此募集规模的限制。

10、投资人办理网上现金认购，单一账户每笔认购份额需为 1,000 份或其整数倍，并须遵循销售机构的相关规定。

投资人通过发售代理机构办理网下现金认购的，每笔认购份额须为 1,000 份或其整数倍并须遵循销售机构的相关规定；投资人通过基金管理人办理网下现金认购的，每笔认购份额须在 10 万份以上（含 10 万份），超过部分须为 1 万份的整数倍。投资人通过基金管理人

及其指定的发售代理机构进行网下股票认购，单只股票最低认购申报股数为 1,000 股，超过 1,000 股的部分须为 100 股的整数倍。

投资人可以多次认购，但需符合法律法规、业务规则以及本基金发售规模控制方案的

规定。

11、网上现金认购可多次申报，申报一经确认，认购资金即被冻结。网下现金认购申请提交后在销售机构规定的时间之后不得撤销。网下股票认购申请提交后，认购一经确认不得撤销。

12、投资者不得非法利用他人账户或资金进行认购，也不得违规融资或帮助他人进行认购。

13、投资者应保证用于认购的资金、股票来源合法，投资者应有权自行支配，不存在任何法律上、合约上的瑕疵或其它障碍。

14、基金销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购申请的确认以登记机构或基金管理人的确认结果为准。对于认购

申请及认购份额的确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法权利。否则，由于投资人过

错而产生的投资人任何损失由投资人自行承担。

基金投资人在募集期内可多次认购，认购一经受理不得撤销。

15、在本基金认购期内，投资人的认购款项只能存入专用账户，网下股票认购所募集的股票予以冻结，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。

16、本基金《基金合同》生效后，符合基金上市交易条件的，基金管理人可依据《上海证券交易所证券投资基金上市规则》，向上海证券交易所申请基金份额上市交易。上市交易的有关事项将另行公告。

17、本公告仅对本基金募集的有关事项和规定予以说明。投资人若欲了解本基金的详细情况，请阅读本公司于2022年12月9日在《中国证券报》上刊登的《银华沪深300价值交

易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告》及《银华沪深300价值交易型开放式指数证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告》。《银华沪深300价值交易型开放式指

数证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”或“基金合同”）、《银华沪

深300价值交易型开放式指数证券投资基金托管协议》、《银华沪深300价值交易型开放式指数证

券投资基金招募说明书》、《银华沪深300价值交易型开放式指数证券投资基金基金产品资

料概要》及本公告将同时发布在本公司网站（<http://www.yhfund.com.cn>）和中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）上，投资人亦可通过本公司网站和中国证监会基金电子披露网站了解本基金募集相关事宜，并可通过本公司网站下载有关申请表格。

18、销售机构销售本基金的城市名称、网点名称、联系方式以及开户和认购等具体事项请详见各销售机构的相关业务公告。

在募集期间，除本公告所列的销售机构外，本基金还有可能变更、增减销售机构，如变更、增减销售机构，本公司将在公司网站上公示，请留意近期本公司网站的公示及各销售机

构的公告，或拨打本公司及各销售机构的客户服务电话咨询。

19、投资人可拨打本公司的客户服务电话400-678-3333或010-85186558或其他销售机构的客户服务电话咨询认购事宜。

20、基金管理人可综合考虑各种情况，在法律法规允许的范围内，对本基金募集安排做适当调整并及时公告。

21、基金募集期结束后，基金管理人确定本基金的申购赎回代理券商名单，经上海证券交易所等有关部门认可后，在基金管理人网站公示。本基金上市后，指定交易未在申购赎回

代理券商的基金份额只能进行二级市场买卖，如投资人需进行上述份额的赎回交易，须指定交易或转指定交易到本基金的申购赎回代理券商。

## 22、风险提示

证券投资基金（以下简称“基金”）是一种长期投资工具，其主要功能是分散投资，降低投资单一证券所带来的个别风险。基金不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具，投资人购买基金，既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益，也可能承

担基金投资所带来的损失。

基金分为股票型证券投资基金、混合型证券投资基金、债券型证券投资基金、货币市场基金、基金中基金等不同类型，投资人投资不同类型的基金将获得不同的收益预期，也将承

担不同程度的风险。一般来说，基金的收益预期越高，投资人承担的风险也越大。本基金属

于股票型基金，预期风险与预期收益水平高于债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

本基金按照基金份额发售面值 1.00 元发售，在市场波动等因素的影响下，基金份额净值可能低于基金份额发售面值。

本基金主要投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资人在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断

市场，对投资本基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策，并承担基金投资中出现

的各类风险，包括市场风险、基金运作风险、本基金的特定风险、流动性风险及其他风险等。

本基金为交易型开放式基金，特定风险包括：指数化投资的风险、标的指数波动的风险、基

金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险、基金交易价格与基金份额净值发生偏离的风险、参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险、基金份额赎回对价的变现风险、退市风险、投

资人申购失败的风险、投资人赎回失败的风险、套利风险、申购赎回清单差错风险、二级市场

流动性风险、第三方机构服务的风险、申购赎回方式下退补现金替代方式的风险、投资

指期货的风险、投资资产支持证券的风险、投资股票期权风险、参与融资交易的风险、参与

转融通证券出借业务的风险、投资存托凭证的风险、参与债券回购的风险、终止基金合同风

险、跟踪误差控制未达约定目标的风险、标的指数不符合要求或指数编制机构停止服务的

风险、成份股停牌风险及标的指数变更的风险等。具体风险烦请查阅招募说明书的“风险揭示”章节的具体内容。

因本基金不再符合证券交易所上市条件被终止上市，或本基金基金合同生效后，如出现连续 50 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元的情形，本基金将终止基金合同并进行基金财产清算，且无需召开基金份额持有人大会审议。故基金份额持有人可能面临基金合同终止的风险。

若出现标的指数不符合要求（因成份股价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外）、指数编制机构退出等情形，基金管理人召集基金份额持有人大会对解决方案进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的，本基金将终止基金合同并进行基金财产清算。故基金份额持有人可能面临基金合同终止的风险。

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。

本基金的投资范围包括债券回购，债券回购为提升基金组合收益提供了可能，但也存在一定的风险。若本基金参与债券回购，如发生债券回购交收违约，质押券可能面临被处

置的风险，因处置价格、数量、时间等的不确定，可能会给基金资产造成损失。

投资有风险，投资人在进行投资决策前，请仔细阅读招募说明书、基金合同、基金产品资料概要等信息披露文件，了解本基金的风险收益特征，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资人的风险承受能力相适应。

基金管理人承诺以恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。当投资人赎回时，所得可能会高于或低于投资人先

前所支付的金额。投资人应当认真阅读基金合同、基金招募说明书、基金产品资料概要等信

息披露文件，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。投资者应

当认真阅读并完全理解基金合同第二十二部分规定的免责条款、第二十三部分规定的争议处理方式。本基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。基金管理人所管理

的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资人基金投资的“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

投资人自行承担。

投资人应当通过基金管理人或具有基金销售业务资格的其他机构认购、申购和赎回基金份额，基金销售机构名单详见招募说明书、本基金的基金份额发售公告以及基金管理人网站公示相关披露。

23、本基金管理人拥有对本基金份额发售公告的最终解释权。

一、基金认购的基本情况

（一）基金名称、简称及代码

基金名称：银华沪深 300 价值交易型开放式指数证券投资基金

场内简称：300 价值 A

扩位简称：沪深 300 价值 ETF

基金认购代码：562323

证券代码：562320

(二) 基金类别

股票型证券投资基金

(三) 基金的运作方式

交易型开放式

(四) 基金存续期间

不定期

(五) 基金份额发售面值和认购价格

本基金基金份额发售面值为人民币 1.00 元。

本基金认购价格为人民币 1.00 元/份。

(六) 投资目标

本基金采用被动指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

在正常市场情况下，本基金力争实现日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。

(七) 发售对象

符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者、合格境外投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。

(八) 基金份额发售机构

1、发售协调人

华泰证券股份有限公司

注册地址：南京市江东中路 228 号

办公地址：北京市西城区丰盛胡同 28 号太平洋保险大厦 A 座 8 层

法定代表人：张伟

联系人：郭力铭

联系电话：(010) 57615957

客户服务电话：95597

传真：(010) 57617065

网址：www.htsc.com.cn

2、网下现金及网下股票发售直销机构

银华基金管理股份有限公司北京直销中心

地址 北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城 C2 办公楼 15 层

电话 010-58162950 传真 010-58162951

联系人 展璐

3、网下现金发售代理机构

投资人可通过以下发售代理机构办理网下现金认购业务（排序不分先后）：

中信建投证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中信证券华南股份有限公司、中信证券（山东）有限责任公司、华泰证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、中国银河

证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中泰证券股份有限公司

若未来拟指定其他销售机构办理本基金的网下现金认购的，具体见基金管理人届时公告。

4、网上现金发售代理机构

网上现金发售通过具有基金销售业务资格的上海证券交易所会员单位办理，具体名单可在上海证券交易所网站查询。

本基金募集期结束前获得基金销售业务资格的上海证券交易所会员可通过上海证券交易所网上系统办理本基金的网上现金认购业务。

#### 5、网下股票发售代理机构

投资人可通过以下发售代理机构办理网下股票认购业务（排序不分先后）：

西南证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中信证券华南股份有限公司、中信证券（山东）有限责任公司、华泰证券股份有限公司、招商证券

股份有限公司、太平洋证券股份有限公司、中泰证券股份有限公司

6、基金管理人可根据《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销售机构监督管理办法》和《基金合同》等的规定，调整发售代理机构并在基金管理人网站公示。

#### （九）募集时间安排与基金合同生效

1、本基金的募集期为自基金份额开始发售之日起到基金份额发售结束之日止的时间段，最长不超过3个月。

2、本基金自2022年12月19日至2022年12月23日通过本公司的直销中心和发售代理机构

公开发售。投资者可选择网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购三种方式。其中，

通过基金管理人及其指定的发售代理机构进行网下现金认购和网下股票认购的日期均为2022年12月19日至2022年12月23日，网上现金认购的日期为2022年12月21日至2022年

12月23日。基金管理人可根据募集情况，在符合相关法律法规的情况下，在募集期限内调整

基金发售时间（包括一种或多种发售方式的发售时间），并及时公告。本基金的募集期限不

超过3个月。在发售期内，本基金向个人投资者和机构投资者同时发售。

3、基金募集期满，本基金符合法律法规规定的基金备案条件的，基金管理人应按照规定在办理基金验资和备案手续后公告基金合同生效。基金募集期间募集的资金应当存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用；募集的股票由登记机构予以冻结，股票

在冻结期间的权益归投资人所有。通过基金管理人进行网下现金认购的有效认购款项在募集期间产生的利息，将折算为基金份额归投资人所有，网下现金认购的利息和具体利息折算份额数量以基金管理人的记录为准，利息折算的份额保留至整数位，小数部分舍去，舍去

部分计入基金财产。网上现金认购和通过发售代理机构进行网下现金认购的有效认购资金在登记机构清算交收后至划入基金托管专户前产生的利息遵循登记机构相关规则处理，计入基金财产，不折算为投资人基金份额。投资人以股票认购的，按照交易所和登记机构的规

则和流程办理股票的冻结，该股票自认购日至登记机构进行股票过户前的冻结期间所产生的权益归属依据相关规则办理。

4、基金募集期满后，本基金仍未达到基金备案条件，则基金合同不能生效，本基金管理

人将承担全部募集费用。 在基金募集期限届满后 30 日内退还投资人已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息（税后）。 对于基金募集期间网下股票认购所募集的股票，应予以解冻，基金管理人不承担相关股票冻结期间交易价格波动的责任。

## 二、基金认购方式与费率

### 1、认购方式

本基金认购采用份额认购的方式。

### 2、认购费率

本基金的认购采用份额认购的原则。 认购费用或认购佣金由认购基金份额的投资人承担，认购费用或认购佣金比率不超过 0.80%，认购费率如下表所示：

认购费率

认购份额（S） 认购费率

$S < 50$  万份 0.80%

$50$  万份  $\leq S < 100$  万份 0.40%

$S \geq 100$  万份 按笔收取，1000 元/笔

基金管理人办理网下现金认购和网下股票认购时可以按照不高于上表所示费率收取认购费用，在发售机构允许的条件下，投资人可选择以现金或基金份额的方式支付相关认购费用。 发售代理机构办理网上现金认购、网下现金认购、网下股票认购时可参照上述费率

结构收取一定的佣金。 认购费用用于本基金的市场推广、销售、注册登记等募集期间发生的各项费用，不列入基金资产。 投资人在一天之内如果有多笔网下现金认购，适用费率按单笔

分别计算。

### 3、认购费用计算公式和收取方式

（1）通过发售代理机构进行网上现金认购的投资人，认购以基金份额申请，认购佣金、认购金额的计算公式为：

认购佣金 = 认购价格  $\times$  认购份额  $\times$  佣金比率

（若适用固定费用，认购佣金 = 固定费用）

认购金额 = 认购价格  $\times$  认购份额  $\times$  （1 + 佣金比率）

（若适用固定费用，认购金额 = 认购价格  $\times$  认购份额 + 固定费用）

认购佣金由发售代理机构向投资人收取，投资人需以现金方式交纳认购佣金。

网上现金认购的有效认购资金在登记机构清算交收后至划入基金托管专户前产生的利息遵循登记机构相关规则处理，计入基金财产，不折算为投资人基金份额。

例 1：某投资人通过某发售代理机构以网上现金认购方式认购 1,000 份本基金，假设该发售代理机构确认的佣金比率为 0.80%，则投资人需支付的认购佣金和需准备的认购金额计算如下：

认购佣金 =  $1.00 \times 1,000 \times 0.80\% = 8.00$  元

认购金额 =  $1.00 \times 1,000 \times (1 + 0.80\%) = 1,008.00$  元

即投资人需准备 1,008.00 元资金，方可认购到 1,000 份本基金基金份额。

（2）通过基金管理人进行网下现金认购的投资人，认购以基金份额申请，认购费用和认购金额的计算公式为：

认购费用 = 认购价格  $\times$  认购份额  $\times$  认购费率

(若适用固定费用, 认购费用=固定费用)

认购金额=认购价格×认购份额×(1+认购费率)

(若适用固定费用, 认购金额=认购价格×认购份额+固定费用)

净认购份额=认购份额+认购金额产生的利息/认购价格

认购费用由基金管理人向投资人收取, 投资人需以现金方式交纳认购费用。

通过基金管理人进行网下现金认购的有效认购资金在募集期间产生的利息, 将折算为基金份额归投资人所有, 网下现金认购的利息和具体份额以基金管理人的记录为准。利息折算的份额保留至整数位, 小数部分舍去, 舍去部分计入基金财产。

例 2: 某投资人通过基金管理人以网下现金认购方式认购 100,000 份本基金, 认购费率为 0.80%, 假设认购资金募集期间产生的利息为 2.00 元, 则需准备的认购资金金额及募集期

间利息折算的份额计算如下:

认购费用=1.00×100,000×0.80%=800 元

认购金额=1.00×100,000×(1+0.80%)=100,800 元

利息折算份额=2.00/1.00=2 份

即投资人需准备 100,800 元资金, 方可认购到 100,000 份本基金基金份额, 加上募集期间利息折算的份额后一共可以得到 100,002 份基金份额。

(3) 通过发售代理机构进行网下现金认购的认购金额的计算同通过发售代理机构进行网上现金认购的认购金额的计算。

通过发售代理机构进行网下现金认购的有效认购资金在登记机构清算交收后至划入基金托管专户前产生的利息遵循登记机构相关规则处理, 计入基金财产, 不折算为投资人基金份额。

(4) 网下股票认购

网下股票认购以单只股票股数申报。投资人通过基金管理人和/或其指定的发售代理机构进行网下股票认购, 单只股票最低认购申报股数为 1,000 股, 超过 1,000 股的部分须为

100 股的整数倍。投资人可以多次提交认购申请, 但需符合法律法规、业务规则以及本基金

发售规模控制方案的规定。

认购份额的计算公式:

认购份额=

$\frac{Y}{Y+Y}$

$\frac{Y}{Y+Y}$  其中“第 i 只股票在网下股票认购期最后一日的均价”和“有效认购数量”由基金管理

人确认, 具体规定见本基金招募说明书。

认购佣金由销售机构在投资人认购确认时收取, 在销售机构允许的条件下, 投资人可选择以现金或基金份额的方式支付认购佣金。

如投资人选择以现金方式支付认购佣金, 则其需支付的认购佣金如下:

认购佣金=认购价格×认购份额×佣金比率

如投资人选择以基金份额支付佣金, 则其需支付的认购佣金和可得到的基金份额如下:

认购佣金=认购价格×认购份额/(1+佣金比率)×佣金比率

净认购份额=认购份额-认购佣金/1.00

以基金份额方式支付的认购佣金的计算保留到整数位, 小数点后面部分舍去, 舍去部

分计入基金财产。

例 3：某投资人持有指数成份股中股票 A 和股票 B 各 20,000 股和 40,000 股，至某发售机构认购本基金，选择以基金份额的方式交纳认购费用。假设 T 日股票 A 和股票 B 的均价分别为

16.50 元和 8.50 元，基金管理人确认的有效认购数量为 20,000 股股票 A 和 40,000 股股票 B，

发售代理机构确认的佣金比例为 0.80%，则其可得到的基金份额和需支付的认购佣金如下：

认购份额 =  $(20,000 \times 16.50) / 1.00 + (40,000 \times 8.50) / 1.00 = 670,000$  份

认购佣金 =  $670,000 \times 1.00 / (1 + 0.80\%) \times 0.80\% = 5,317$  份

净认购份额 =  $670,000 - 5,317 = 664,683$  份

即投资人可认购到的净认购份额为 664,683 份，并需支付 5,317 份的认购佣金。

例 4：某投资人持有指数成份股中股票 A 和股票 B 各 10,000 股和 20,000 股，至某发售机构认购本基金，选择以现金支付认购佣金。假设 T 日股票 A 和股票 B 的均价分别为 16.50 元和

3.50 元，基金管理人确认的有效认购数量为 10,000 股股票 A 和 20,000 股股票 B，发售代理机构确认的佣金比例为 0.80%，则其可得到的基金份额和需支付的认购佣金如下：

认购份额 =  $(10,000 \times 16.50) / 1.00 + (20,000 \times 3.50) / 1.00 = 235,000$  份

认购佣金 =  $235,000 \times 1.00 \times 0.80\% = 1880$  元

即投资人可认购到 235,000 份本基金基金份额，并需另行支付 1880 元的认购佣金。

### 三、投资人开户

1、投资人认购本基金时需具有上海证券交易所 A 股账户（以下简称“上海 A 股账户”）或上海证券交易所证券投资基金账户（以下简称“上海证券投资基金账户”）。

尚无上海 A 股账户或上海证券投资基金账户的投资者，需在认购前到中国结算有限公司上海分公司的开户代理机构办理上海 A 股账户或上海证券投资基金账户的开户手续。有关开设上海 A 股账户和上海证券投资基金账户的具体程序和办法，请到各

开户网点详细咨询有关规定。

开户当日无法办理指定交易，建议投资人在进行认购前至少 2 个工作日办理开户手续。

2、如投资人已开立上海 A 股账户或上海证券投资基金账户，则应注意：

（1）如投资人未办理指定交易或指定交易在不办理本基金发售业务的证券公司，需要指定交易或转指定交易在可办理本基金发售业务的证券公司。

（2）当日办理指定交易或转指定交易的投资人当日无法进行认购，建议投资人在进行认购前至少 1 个工作日办理指定交易或转指定交易手续。

3、账户使用注意事项

（1）如投资人需要参与网下现金认购或网上现金认购，应使用上海 A 股账户或上海证券投资基金账户；上海证券投资基金账户只能进行本基金基金份额的网上现金认购、网下现金认购和二级市场交易。

（2）如投资人以上海证券交易所上市交易的本基金标的指数成份股或备选成份股进行网下股票认购的，应开立并使用上海 A 股账户。

（3）如投资人以深圳证券交易所上市交易的本基金标的指数成份股或备选成份股进行网下股票认购的，除了持有上海 A 股账户或上海证券投资基金账户外，还应持有深圳证券交易所 A 股账户（以下简称“深圳 A 股账户”），且该两个账户的证件号码及名称属于同

一投资人所有，并注意投资人用以认购基金份额的托管证券公司和深圳 A 股账户指定交易证券公司应为同一发售代理机构。

(4) 已购买过由银华基金管理股份有限公司担任登记机构的基金的投资者，其持有的银华基金管理股份有限公司开放式基金账户不能用于认购本基金。

#### 四、网上现金认购的程序

##### 1、认购时间

2022 年 12 月 21 日至 2022 年 12 月 23 日（周六、周日和节假日不受理），上午 9: 30—11:

30 和下午 13: 00—15: 00。如上海证券交易所对网上现金认购时间做出调整，基金管理人将

相应调整并及时公告。

##### 2、认购限额

网上现金认购以基金份额申请。单一账户每笔认购份额需为 1,000 份或其整数倍并须遵循销售机构的相关规定。投资人可以多次认购，但需符合法律法规、业务规则以及本基金

发售规模控制方案的规定。

##### 3、认购手续

(1) 在发售代理机构开立上海证券交易所 A 股账户或上海证券投资基金账户办理指定交易。

(2) 在认购前向资金账户中存入足够的认购资金。

(3) 投资人可通过填写认购委托单、电话委托、磁卡委托、网上委托等方式申报认购委托，可多次申报，申报一经确认，认购资金即被冻结。

#### 五、网下现金认购的程序

##### 1、认购时间

2022 年 12 月 19 日至 2022 年 12 月 23 日（周六、周日和节假日不受理），9: 30—16: 30，具

体业务办理时间由基金管理人及其指定的发售代理机构确定。

##### 2、认购限额

网下现金认购以基金份额申请。投资人通过发售代理机构办理网下现金认购的，每笔认购份额须为 1,000 份或其整数倍并须遵循销售机构的相关规定；投资人通过基金管理人办理网下现金认购的，每笔认购份额须在 10 万份以上（含 10 万份），超过部分须为 1 万份的

整数倍。投资人可以多次认购，但需符合法律法规、业务规则以及本基金发售规模控制方案

的规定。

##### 3、认购手续

投资人在认购本基金时，需按销售机构的规定，到销售网点办理相关认购手续，并备足认购资金。网下现金认购申请提交后在销售机构规定的时间之后不得撤销。

###### (1) 直销机构认购手续

1) 投资人须先开立上海 A 股账户或上海证券投资基金账户，然后向本公司直销网点提供下列资料办理基金的认购手续：

A、个人投资者提供身份证件原件及复印件；

B、机构投资者提供加盖单位公章的营业执照复印件及副本原件，事业法人、社会团体或其他组织提供给民政部门或主管部门颁发的注册登记证书原件及加盖单位公章的复印

件：业务经办人有效身份证件原件及复印件以及基金业务授权委托书；

C、上海证券交易所 A 股账户卡或上海证券投资基金账户卡（原件和复印件）；

D、个人投资者签署《基金投资人风险承受能力调查问卷》，机构投资者签署《基金投资人风险承受能力调查问卷（机构版）》；

E、投资人填写认购委托单，机构投资者还须加盖预留印鉴；

F、盖银行受理章的汇款凭证回单原件及复印件。

2) 在认购当日 16: 30 之前，将足额认购资金通过银行转账汇入本公司指定的任一直销专户：

直销专户一：中国建设银行

账户名称：银华基金管理股份有限公司

开户银行：中国建设银行北京建国支行

银行账号：11001042500059261889

直销专户二：中国工商银行

账户名称：银华基金管理股份有限公司

开户银行：中国工商银行北京东长安街支行

银行账号：0200053429027302269

直销专户三：兴业银行

账户名称：银华基金管理股份有限公司

开户银行：兴业银行股份有限公司北京分行营业部

银行账号：321010100100258802

在办理认购业务时，需要按照《直销业务办理指南》的要求提供划款凭证，并且建议在“汇款用途”中注明款项的用途。

3) 注意事项：

A、投资人在认购时不能使用银华基金管理股份有限公司基金账户，而需使用上海证券交易所 A 股账户卡或上海证券投资基金账户卡。

B、若个人投资者的认购资金在认购申请当日下午 16: 30 之前未到达本公司指定的直销资金专户，则当日提交的申请顺延受理。申请受理日期（即有效申请日）以资金实际到账日为准。

C、投资人若未按上述规定划付款项，造成认购无效的，银华基金管理股份有限公司及直销网点清算账户的开户银行不承担任何责任。

（2）发售代理机构认购手续

具体认购手续以各发售代理机构的规定为准。

## 六、网下股票认购

### 1、认购时间

2022 年 12 月 19 日至 2022 年 12 月 23 日（周六、周日和节假日不受理），上午 9: 30—11:

30 和下午 1: 00—3: 00，具体业务办理时间由基金管理人及其指定的发售代理机构确定。

若

未来拟指定其他销售机构办理本基金的网下股票认购的，具体机构及规则见基金管理人届时公告。

### 2、认购限额

网下股票认购以单只股票股数申报。投资人通过基金管理人及其指定的发售代理机构进行网下股票认购，单只股票最低认购申报股数为 1,000 股，超过 1,000 股的部分须为 100

股的整数倍。 投资人应以 A 股账户认购。 用于认购的股票必须是符合要求的本基金标的指数成份股和已公告的备选成份股（具体名单见本基金份额发售公告“十一、网下股票认购清单”）。 投资人可以多次提交认购申请，但需符合法律法规、业务规则以及本基金发售规模控制方案的规定。

### 3、认购手续：

投资人在认购本基金时，需按销售机构的规定，到销售网点办理认购手续，并备足认购股票。 网下股票认购申请一经确认不得撤销。

#### （1）直销机构

1) 机构投资者在本公司直销机构办理网下股票认购所需资料如下：

A、填妥并加盖单位公章及法定代表人章或交易预留印鉴的《直销申购认购申请表》；

（此申请表电子版与纸质盖章版均需提供）

B、上海证券交易所 A 股账户卡或深圳证券交易所 A 股账户卡复印件；

C、加盖公章和法定代表人章的基金业务授权委托书；

D、经办人有效身份证件复印件（复印件上需加盖公章）；

E、加盖单位公章的营业执照复印件；（未换发三证合一营业执照的需同时提供加盖单位公章的组织机构代码证和税务登记证复印件）

F、加盖单位公章的股票份额承诺书；

G、公司要求提供的其他有关材料；

2) 如投资人以上海证券交易所上市交易的本基金成份股或备选成份股进行网下股票认购的，应开立并使用上海 A 股账户；如投资人以深圳证券交易所股票进行网下股票认购的，除了持有上海 A 股账户或上海证券投资基金账户外，还应持有深圳证券交易所 A 股

账户，且该两个账户的证件号码及名称属于同一投资人所有，并注意投资人认购基金份额的托管证券公司和深圳 A 股账户指定交易证券公司应为同一发售代理机构。

3) 在上海 A 股账户或深圳 A 股账户中具备足够的符合要求的沪深 300 价值指数成份股和已公告的备选成份股，具体名单见本发售公告“十一、网下股票认购清单”。

4) 投资者填写认购委托单。 登记机构将在募集结束后办理用以认购的股票冻结业务，届时如投资者用以认购的股票的可数量不足，则投资者的该笔股票认购申请无效。

#### （2）代销机构

1) 如投资人以上海证券交易所上市交易的本基金成份股或备选成份股进行网下股票认购的，应开立并使用上海 A 股账户；如投资人以深圳证券交易所股票进行网下股票认购的，除了持有上海 A 股账户或上海证券投资基金账户外，还应持有深圳证券交易所 A 股

账户，且该两个账户的证件号码及名称属于同一投资人所有，并注意投资人认购基金份额的托管证券公司和深圳 A 股账户指定交易证券公司应为同一发售代理机构。

2) 在上海 A 股账户或深圳 A 股账户中具备足够的符合要求的沪深 300 价值指数成份股和已公告的备选成份股，具体名单见本发售公告“十一、网下股票认购清单”。

3) 投资人填写认购委托单。 申报一经确认不得撤销，认购股票即被冻结。

具体认购手续以各发售机构的规定为准。

4、特别提示：投资人应根据法律法规及证券交易所相关规定进行股票认购，并及时履行因股票认购导致的股份减持所涉及的信息披露等义务。

### 七、清算与交割

1、基金募集期间募集的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用；募集的股票由登记机构予以冻结，股票在冻结期间的权益归投资人所有。通过基金管理人进行网下现金认购的有效认购款项在募集期间产生的利息，将折算为基金份额归投资人所有，网下现金认购的利息和具体利息折算份额数量以基金管理人的记录为准，利息折算的份额保留至整数位，小数部分舍去，舍去部分计入基金财产。网上现金认购和通过发售代理

机构进行网下现金认购的有效认购资金在登记机构清算交收后至划入基金托管专户前产生的利息遵循登记机构相关规则处理，计入基金财产，不折算为投资人基金份额。投资人以

股票认购的，按照交易所和登记机构的规则和流程办理股票的冻结，该股票自认购日至登记机构进行股票过户前的冻结期间所产生的权益归属依据相关规则办理。

2、本基金基金份额持有人权益登记由登记机构在基金募集结束后完成。

#### 八、基金的验资

基金募集期届满或基金管理人依据法律法规及招募说明书决定停止基金发售的，基金管理人应在 10 日内聘请法定验资机构进行认购款项的验资。

#### 九、《基金合同》的生效

本基金自基金份额发售之日起 3 个月内，在基金募集份额总额不少于 2 亿份，基金募集金额（含网下股票认购所募集的股票市值）不少于 2 亿元人民币，且基金认购人数不少于 200 人的条件下，基金募集期届满或基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售，并在 10 日内聘请法定验资机构验资，自收到验资报告之日起 10 日内，向中国证

监会办理基金备案手续。

基金募集达到基金备案条件的，自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起，基金合同生效；否则基金合同不生效。基金管理人在收到中国证监会确

认文件的次日对基金合同生效事宜予以公告。

基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户，网下股票认购所募集的股票予以冻结，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。

#### 十、本次认购当事人及中介机构

##### （一）基金管理人

名称 银华基金管理股份有限公司

住所 深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 19 层

办公地址 北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城 C2 办公楼 15 层

法定代表人 王珠林 设立日期 2001 年 5 月 28 日

批准设立机关 中国证监会 批准设立文号 中国证监会证监基金字[2001]7 号

组织形式 股份有限公司 注册资本 2.222 亿元人民币

存续期间 持续经营 联系人 兰健

电话 010-58163000 传真 010-58163090

银华基金管理有限公司成立于 2001 年 5 月 28 日，是经中国证监会批准（证监基金字[2001]7 号文）设立的全国性资产管理公司。公司注册资本为 2.222 亿元人民币，公司的股权

结构为西南证券股份有限公司（出资比例 44.10%）、第一创业证券股份有限公司（出资比例 26.10%）、东北证券股份有限公司（出资比例 18.90%）、山西海鑫实业有限公司（出资比

例 0.90%)、珠海银华聚义投资合伙企业(有限合伙)(出资比例 3.57%)、珠海银华致信投资合伙企业(有限合伙)(出资比例 3.20%) 及珠海银华汇玥投资合伙企业(有限合伙)

(出资比例 3.22%)。公司的主要业务是基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。

公司注册地为广东省深圳市。银华基金管理有限公司的法定名称已于 2016 年 8

月 9 日起变更为“银华基金管理股份有限公司”。

## (二) 基金托管人

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：田国立

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

联系人：李申

联系电话：(021)60637102

## (三) 销售机构

### 1、发售协调人

华泰证券股份有限公司

注册地址：南京市江东中路 228 号

办公地址：北京市西城区丰盛胡同 28 号太平洋保险大厦 A 座 8 层

法定代表人：张伟

联系人：郭力铭

联系电话：(010) 57615957

客户服务电话：95597

传真：(010) 57617065

网址：www.htsc.com.cn

### 2、网下现金发售直销机构和发售代理机构

本基金网下现金发售直销机构和发售代理机构详见本公告“一、基金认购的基本情况”之“(八)基金份额发售机构”。

### 3、网上现金发售代理机构

本基金网上现金发售代理机构详见本发售公告“一、基金认购的基本情况”之“(八)基金份额发售机构”。

### 4、网下股票发售直销机构和发售代理机构

本基金网下股票发售直销机构和发售代理机构详见本公告“一、基金认购的基本情况”之“(八)基金份额发售机构”。

## (四) 登记机构

名称 中国证券登记结算有限责任公司

住所及办公地址 北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人 于文强 联系人 赵亦清  
电话 010-50938782 传真 010-50938991

(五) 出具法律意见书的律师事务所  
名称 上海市通力律师事务所  
住所及办公地址 上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼  
负责人 韩炯 联系人 陈颖华  
电话 021-31358666 传真 021-31358600  
经办律师 黎明、陈颖华

(六) 会计师事务所及经办注册会计师  
名称 普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)  
住所及办公地址 上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场二座普华永道中心 11 楼  
法定代表人 李丹 联系人 周祎  
电话 021-23238888 传真 021-23238800  
经办注册会计师 薛竞、周祎

#### 十一、网下股票认购清单

本基金募集期间，网下股票认购名单如下表所示。基金管理人可根据网下股票认购日前 3 个月个股的交易量、价格波动及其他异常情况，决定是否对个股认购规模进行限制，并

在网下股票认购日前公告限制认购规模的个股名单。对于在网下股票认购期间价格波动异常或认购申报数量异常的个股，基金管理人可不经公告，全部或部分拒绝该股票的认购申报。在本基金募集期结束前网下股票认购清单可根据标的指数成份股变动相应调整，具体见基金管理人届时的公告。

股票代码	股票简称	股票代码	股票简称	股票代码	股票简称
600188	兖矿能源	601988	中国银行	600015	华夏银行
600900	长江电力	601288	农业银行	601336	新华保险
600332	白云山	601898	中煤能源	000425	徐工机械
600028	中国石化	601117	中国化学	002601	龙佰集团
600346	恒力石化	601919	中远海控	601216	君正集团
601390	中国中铁	600018	上港集团	601669	中国电建
601618	中国中冶	600383	金地集团	000001	平安银行
600837	海通证券	600019	宝钢股份	000002	万科 A
600104	上汽集团	600016	民生银行	000069	华侨城 A
002202	金风科技	000338	潍柴动力	000157	中联重科
601818	光大银行	601998	中信银行	000725	京东方 A
600795	国电电力	601600	中国铝业	601800	中国交建
600061	国投资本	600000	浦发银行	601225	陕西煤业
600030	中信证券	601166	兴业银行	002736	国信证券
600585	海螺水泥	601601	中国太保	601985	中国核电
600036	招商银行	600999	招商证券	601211	国泰君安
000776	广发证券	601009	南京银行	601155	新城控股
600089	特变电工	600606	绿地控股	001979	招商蛇口
600050	中国联通	600741	华域汽车	600919	江苏银行
000651	格力电器	600886	国投电力	600926	杭州银行
000708	中信特钢	601857	中国石油	601229	上海银行

600048 保利发展 601186 中国铁建 601881 中国银河  
601398 工商银行 601318 中国平安 600025 华能水电  
002064 华峰化学 601006 大秦铁路 601838 成都银行  
601088 中国神华 601377 兴业证券 601138 工业富联  
601766 中国中车 000800 一汽解放 601319 中国人保  
601668 中国建筑 601328 交通银行 003816 中国广核  
601688 华泰证券 601169 北京银行 601658 邮储银行  
601628 中国人寿 000877 天山股份 601728 中国电信  
000100 TCL 科技 000895 双汇发展 600941 中国移动  
银华基金管理股份有限公司  
2022 年 12 月 9 日