

银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金标的指数纳入北京证券交易所股票并修订招募说明书的公告

根据相关指数定期调整情况，银华基金旗下部分基金标的指数纳入北京证券交易所股票。为更好地满足基金运作需求，银华基金管理股份有限公司（以下简称“本公司”）决定自2024年6月21日起根据上海证券交易所、深圳证券交易所、北京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则，相应调整部分基金招募说明书中申购与赎回章节相关内容。

本次调整适用基金：

基金代码	基金名称	场内简称
562300	银华中证内地低碳经济主题交易型开放式指数证券投资基金	低碳ETF
159855	银华中证影视主题交易型开放式指数证券投资基金	影视ETF
159990	银华巨潮小盘价值交易型开放式指数证券投资基金	小盘价值ETF

具体修订内容详见附件“《招募说明书》修订内容对照表”，修订后的《招募说明书》自2024年6月21日起生效。

投资人可以登录基金管理人网站（www.yhfund.com.cn）查阅修订后的招募说明书全文或拨打客户服务电话（400-678-3333）咨询相关信息，本次修订不涉及上述基金的基金合同及托管协议。

本公告的解释权归银华基金管理股份有限公司。

重要提示

1、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。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。

2、投资者欲了解上述基金的详细情况，可登陆基金管理人网站（www.yhfund.com.cn）查询或者拨打基金管理人的客户服务电话

(400-678-3333) 垂询相关事宜。

特此公告。

附件：《招募说明书》修订内容对照表

银华基金管理股份有限公司

2024年6月21日

附件：

1、“银华中证内地低碳经济主题交易型开放式指数证券投资基金”《招募说明书》修订内容对照表

章节	原表述	修改后
九、基金的申购与赎回	<p>(四) 申购与赎回的程序</p> <p>3、申购和赎回的清算交收与登记</p> <p>.....</p> <p>本基金申购赎回过程中涉及的基金份额、组合证券、现金替代、现金差额及其他对价的清算交收适用相关业务规则和参与各方相关协议的有关规定。对于本基金的申购、赎回业务采用净额结算的方式，即基金份额、上海证券交易所上市的成份股的现金替代、深圳证券交易所上市的成份股的现金替代采用净额结算的方式，申购赎回业务涉及的现金差额和现金替代退补款采用代收代付。</p> <p>.....</p>	<p>(四) 申购与赎回的程序</p> <p>3、申购和赎回的清算交收与登记</p> <p>.....</p> <p>本基金申购赎回过程中涉及的基金份额、组合证券、现金替代、现金差额及其他对价的清算交收适用相关业务规则和参与各方相关协议的有关规定。对于本基金的申购、赎回业务采用净额结算的方式，即基金份额、上海证券交易所上市的成份股的现金替代、深圳证券交易所上市的成份股的现金替代、<u>北京证券交易所上市的成份股的现金替代</u>采用净额结算的方式，申购赎回业务涉及的现金差额和现金替代退补款采用代收代付。</p> <p>.....</p>
	<p>(七) 申购赎回清单的内容与格式</p> <p>4、申购赎回清单现金替代相关内容</p> <p>(1) 现金替代的类型</p> <p>.....</p> <p>退补现金替代适用于深圳证券交易所上市的成份股，是指在投资人申购、赎回基金份额时，该成份证券必须使</p>	<p>(七) 申购赎回清单的内容与格式</p> <p>4、申购赎回清单现金替代相关内容</p> <p>(1) 现金替代的类型</p> <p>.....</p> <p>退补现金替代适用于<u>非上海</u>证券交易所上市的成份股，是指在投资人申购、赎回基金份额时，该成份证券必</p>

	<p>用现金作为替代，根据基金管理人买卖情况，与投资人进行退款或补款。</p> <p>(2) 可以现金替代</p> <p>③替代金额的处理程序</p> <p>在 T 日后被替代的成份证券有正常交易的 2 个交易日（简称为 T+2 日）内，基金管理人将以收到的替代金额买入被替代的部分证券。</p> <p>(4) 退补现金替代</p> <p>①适用情形：退补现金替代的证券目前仅适用于标的指数成份证券中深圳证券交易所。</p> <p>③替代金额的处理程序</p> <p>基金管理人将自 T 日起在收到申购交易确认后按照“时间优先、实时申报”的原则依次买入申购被替代的部分证券，在收到赎回交易确认后按照“时间优先、实时申报”的原则依次卖出赎回被替代的部分证券。T 日未完成的交易，基金管理人在 T 日后被替代的成份证券有正常交易的 2 个交易日（简称为 T+2 日）内完成上述交易。</p> <p>实时申报的原则为：基金管理人在深圳证券交易所连续竞价期间，根据收</p>	<p>须使用现金作为替代，根据基金管理人买卖情况，与投资人进行退款或补款。</p> <p>(2) 可以现金替代</p> <p>③替代金额的处理程序</p> <p>在 T 日后被替代的成份证券有正常交易的 2 个交易日（简称为 T+2 日）内，基金管理人将以收到的替代金额买入被替代的部分证券。<u>基金管理人有权根据基金投资的需要自主决定不买入部分被替代证券，或者不进行任何买入证券的操作。</u></p> <p>(4) 退补现金替代</p> <p>①适用情形：退补现金替代的证券目前仅适用于标的指数成份证券中<u>非上海证券交易所股票</u>。</p> <p>③替代金额的处理程序</p> <p>基金管理人将自 T 日起在收到申购交易确认后按照“时间优先、实时申报”的原则依次买入申购被替代的部分证券，在收到赎回交易确认后按照“时间优先、实时申报”的原则依次卖出赎回被替代的部分证券。T 日未完成的交易，基金管理人在 T 日后被替代的成份证券有正常交易的 2 个</p>
--	---	--

	<p>到的上海证券交易所申购赎回确认记录，在技术系统允许的情况下实时向深圳证券交易所申报被替代证券的交易指令。</p> <p>.....</p> <p>特例情况：若自 T 日起，深圳证券交易所正常交易日已达到 20 日而该证券正常交易日低于 2 日，则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本（包括买入价格与交易费用）加上按照最近一次收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还申购投资人或申购投资人应补交的款项，以替代金额与所卖出的部分被替代证券实际卖出收入（卖出价格扣除交易费用）加上按照最近一次收盘价计算的未卖出的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还赎回投资人或赎回投资人应补交的款项。</p> <p>.....</p>	<p>交易日（简称为 T+2 日）内完成上述交易。<u>基金管理人有权根据基金投资的需要自主决定不买入部分被替代证券，或者不进行任何买入证券的操作。</u></p> <p>.....</p> <p>实时申报的原则为：<u>基金管理人在非上海证券交易所连续竞价期间</u>，根据收到的上海证券交易所申购赎回确认记录，在技术系统允许的情况下实时向<u>非上海</u>证券交易所申报被替代证券的交易指令。</p> <p>.....</p> <p>特例情况：若自 T 日起，<u>非上海</u>证券交易所正常交易日已达到 20 日而该证券正常交易日低于 2 日，则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本（包括买入价格与交易费用）加上按照最近一次收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还申购投资人或申购投资人应补交的款项，以替代金额与所卖出的部分被替代证券实际卖出收入（卖出价格扣除交易费用）加上按照最近一次收盘价计算的未卖出的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还赎回投资人或赎回投资人应补交的款项。</p> <p>.....</p>
--	--	--

	<p>(十三) 联接基金的特殊申购</p> <p>.....</p> <p>在本基金开放日常申购赎回后, 联接基金可按照管理人公布的申购赎回清单特殊申购本基金基金份额, 对于申购赎回清单中的深市成份股, 联接基金可以采用实物方式或“深市退补”的现金替代方式进行申购, 除此之外的其它方面比照普通的场内申购。</p> <p>.....</p>	<p>(十三) 联接基金的特殊申购</p> <p>.....</p> <p>在本基金开放日常申购赎回后, 联接基金可按照管理人公布的申购赎回清单特殊申购本基金基金份额, 对于申购赎回清单中的深市、<u>京市</u>成份股, 联接基金可以采用实物方式或“<u>深市或京市退补</u>”的现金替代方式进行申购, 除此之外的其它方面比照普通的场内申购。</p> <p>.....</p>
--	--	--

2、“银华中证影视主题交易型开放式指数证券投资基金”、“银华巨潮小盘价值交易型开放式指数证券投资基金”《招募说明书》修订内容对照表

章节	原表述	修改后
十、基金份额的申购与赎回	<p>(七) 申购赎回清单的内容与格式</p> <p>4、现金替代相关内容</p> <p>(1) 现金替代分为 3 种类型:</p> <p>.....</p> <p>对于沪市成份证券, 可以设为:“允许”和“必须”。</p> <p>.....</p> <p>当适用于上交所上市的成份股时,“可以现金替代”是指在申购赎回基金份额时, 该成份证券必须使用现金作为替代, 根据基金管理人买卖情况, 与投资者进行退款或补款。</p>	<p>(七) 申购赎回清单的内容与格式</p> <p>4、现金替代相关内容</p> <p>(1) 现金替代分为 3 种类型:</p> <p>.....</p> <p>对于<u>非深市</u>成份证券, 可以设为:“允许”和“必须”。</p> <p>.....</p> <p>当适用于<u>非深交所</u>上市的成份股时,“可以现金替代”是指在申购赎回基金份额时, 该成份证券必须使用现金作为替代, 根据基金管理人买卖情况, 与投资者进行退款或补款。</p>

	<p>.....</p> <p>(2) 可以现金替代</p> <p>可以现金替代的组合证券分为：深市成份证券和沪市成份证券。</p> <p>1) 对于深市成份证券</p> <p>.....</p> <p>③替代金额的处理程序</p> <p>.....</p> <p>在 T 日后被替代的成份证券有正常交易的 2 个交易日（简称为 T+2 日）内，基金管理人将以收到的替代金额买入被替代的部分证券。</p> <p>.....</p> <p>2) 对于沪市成份证券</p> <p>①适用情形：投资者申购和赎回时的沪市成份证券。登记结构机构对设置可以现金替代的沪市成份证券全部用现金替代。</p> <p>②替代金额：对于可以现金替代的沪市成份证券，替代金额的计算公式为：</p> <p>.....</p> <p>其中，“该证券参考价格”为该证券经除权调整的 T-1 日收盘价。如果上海证券交易所参考价格确定原则发生变化，以上海证券交易所通知规定的参考价格为准。</p> <p>.....</p> <p>③替代金额的处理程序</p> <p>.....</p>	<p>.....</p> <p>(2) 可以现金替代</p> <p>可以现金替代的组合证券分为：深市成份证券和<u>非深市成份证券</u>。</p> <p>1) 对于深市成份证券</p> <p>.....</p> <p>③替代金额的处理程序</p> <p>.....</p> <p>在 T 日后被替代的成份证券有正常交易的 2 个交易日（简称为 T+2 日）内，基金管理人将以收到的替代金额买入被替代的部分证券。<u>基金管理人有权根据基金投资的需要自主决定不买入部分被替代证券，或者不进行任何买入证券的操作。</u></p> <p>.....</p> <p>2) 对于<u>非深市成份证券</u></p> <p>①适用情形：投资者申购和赎回时的<u>非深市成份证券</u>。登记结构机构对设置可以现金替代的<u>非深市成份证券</u>全部用现金替代。</p> <p>②替代金额：对于可以现金替代的<u>非深市成份证券</u>，替代金额的计算公式为：</p> <p>.....</p> <p>其中，“该证券参考价格”为该证券经除权调整的 T-1 日收盘价。如果<u>对应</u>证券交易所参考价格确定原则发生变化，以<u>对应</u>证券交易所通知规定</p>
--	---	--

	<p>基金管理人将自 T 日起在收到申购交易确认后按照“时间优先、实时申报”的原则依次买入申购被替代的部分证券，在收到赎回交易确认后按照“时间优先、实时申报”的原则依次卖出赎回被替代的部分证券。T 日未完成的交易，基金管理人在 T 日后被替代的成份证券有正常交易的 2 个交易日（简称为 T+2 日）内完成上述交易。</p> <p>……</p> <p>实时申报的原则为：基金管理人在<u>上</u>交所连续竞价期间，根据收到的深交所申购赎回确认记录，在技术系统允许的情况下实时向<u>上</u>交所申报被替代证券的交易指令。</p> <p>……</p> <p>特例情况：若自 T 日起，<u>上</u>海证券交易所正常交易日已达到 20 日而该证券正常交易日低于 2 日，则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本（包括买入价格与交易费用）加上按照最近一次收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还申购投资者或申购投资者应补交的款项，以替代金额与所卖出的部分被替代证券实际卖出收入（卖出价格扣除交易费用）加上按照最近一次收盘价计算的未卖出的部分被替代证券价值的差额，确定基金应</p>	<p>的参考价格为准。</p> <p>……</p> <p>③替代金额的处理程序</p> <p>……</p> <p>基金管理人将自 T 日起在收到申购交易确认后按照“时间优先、实时申报”的原则依次买入申购被替代的部分证券，在收到赎回交易确认后按照“时间优先、实时申报”的原则依次卖出赎回被替代的部分证券。T 日未完成的交易，基金管理人在 T 日后被替代的成份证券有正常交易的 2 个交易日（简称为 T+2 日）内完成上述交易。<u>基金管理人有权根据基金投资的需要自主决定不买入部分被替代证券，或者不进行任何买入证券的操作。</u></p> <p>……</p> <p>实时申报的原则为：基金管理人在<u>非</u>深交所连续竞价期间，根据收到的深交所申购赎回确认记录，在技术系统允许的情况下实时向<u>非</u>深交所申报被替代证券的交易指令。</p> <p>……</p> <p>特例情况：若自 T 日起，<u>非</u>深圳证券交易所正常交易日已达到 20 日而该证券正常交易日低于 2 日，则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本（包括买入价格与交易费</p>
--	--	---

	<p>退还赎回投资者或赎回投资者应补交的款项。</p>	<p>用)加上按照最近一次收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额,确定基金应退还申购投资者或申购投资者应补交的款项,以替代金额与所卖出的部分被替代证券实际卖出收入(卖出价格扣除交易费用)加上按照最近一次收盘价计算的未卖出的部分被替代证券价值的差额,确定基金应退还赎回投资者或赎回投资者应补交的款项。</p>
--	-----------------------------	--