银华基金管理有限公司 关于召开银华沪深300指数证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会的第二次提示性公告

银华基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”或“本公司”）已于2013年10月14日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、深圳证券交易所网站（http://www.szse.cn）及银华基金管理有限公司网站（http://www.yhfund.com.cn）发布了《银华沪深300指数证券投资基金（LOF）以通讯方式召开基金份额持有人大会公告》。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的第二次提示性公告。

一、召开会议基本情况

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》和《银华沪深300指数证券投资基金（LOF）基金合同》（以下简称《基金合同》）的有关规定，银华沪深300指数证券投资基金（LOF）的基金管理人银华基金管理有限公司决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，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2013年10月14日起，至2013年11月14日17:00止（投票表决时间以本基金管理人委托的公证机关收到表决票时间为准）。

3、会议通讯表决票的寄达地点：

公证机构：北京市方正公证处

地址：北京市西城区阜成门外大街7号国投大厦三层

邮政编码：100037

联系人：孟必珍、李乐

联系电话：010-68096212　58073582

请在信封表面注明：“银华沪深300指数证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会表决专用”。

二、会议审议事项

关于银华沪深300指数证券投资基金（LOF）转型有关事项的议案（见附件一）。

三、基金份额持有人的权益登记日

本次大会的权益登记日为2013年10月21日，即在2013年10月21日深圳证券交易所交易结束后，在中国证券登记结算有限责任公司登记在册的本基金全体基金份额持有人均有权参加本次基金份额持有人大会。

四、表决票的填写和寄交方式

1、本次会议表决票见附件二。基金份额持有人可从相关报纸上剪裁、复印附件二或登陆本基金管理人网站（http://www.yhfund.com.cn）下载并打印表决票。

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，并提供本人身份证件（包括使用的身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明）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，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身份证件（包括使用的身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明）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）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，并提供个人投资者身份证件（包括使用的身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明）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，还需提供代理人的身份证件（包括使用的身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明）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）；

（4）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（参照附件三）。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件（包括使用的身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明）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。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件（包括使用的身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明）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）。

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2013年10月14日起，至2013年11月14日17:00以前（送达时间以公证机关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基金管理人委托的公证机关办公地址，并请在信封表面注明：“银华沪深300指数证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会表决专用”。

本基金管理人委托的公证机关办公地址及联系方式如下：

公证机关：北京市方正公证处

地址：北京市西城区阜成门外大街7号国投大厦三层

邮政编码：100037

联系人：孟必珍、李乐

联系电话：010-68096212　58073582

五、计票

1、本次通讯会议的计票方式为：由本基金管理人授权的两名监票人在基金托管人（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、基金份额持有人所持每份基金份额享有一票表决权。

3、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，且在规定时间之内送达公证机关的，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基金份额总数。

（2）如表决票上的表决意见未选、多选或无法辨认、表决意见模糊不清或相互矛盾，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公证机关的，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，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，邮寄的以公证机关收到的时间为准。

六、决议生效条件

1、本人直接出具书面意见和授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额占在权益登记日基金总份额的50%以上（含50%）；

2、关于银华沪深300指数证券投资基金（LOF）转型有关事项的议案应当由提交有效表决票的基金份额持有人和其代理人所持表决权的50%以上（含50%）通过；

3、本次基金份额持有人大会决议通过的事项，本基金管理人自通过之日起五日内报中国证监会备案，基金份额持有人大会决定的事项自在中国证监会完成备案手续之日起生效。法律法规另有规定的，从其规定。

七、二次召集基金份额持有人大会及二次授权

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及《基金合同》的规定，本次持有人大会需要本人直接出具书面意见和授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额达到权益登记日基金总份额的50%以上方可举行。如果本次基金份额持有人大会不符合前述要求而不能成功召开，根据2013年6月1日生效的《中华人民共和国证券投资基金法》，基金管理人可在规定的时间内就同一议案重新召集基金份额持有人大会。重新召开基金份额持有人大会时，除非授权文件另有载明，本次基金份额持有人大会授权期间基金份额持有人做出的各类授权依然有效，但如果授权方式发生变化或者基金份额持有人重新做出授权，则以最新方式或最新授权为准，详细说明见届时发布的重新召集基金份额持有人大会的通知。

八、本次大会相关机构

1、召集人：银华基金管理有限公司

联系人：田宁

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、公证机关：北京市方正公证处

联系人：孟必珍、李乐

联系电话：010-68096212　58073582

4、见证律师事务所：上海市通力律师事务所

联系人：黎明、孙睿

联系电话：021-31358666

九、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本基金管理人网站查阅，投资者如有任何疑问，可致电本基金管理人客户服务电话400—678—3333咨询。

3、本公告发布之日（2013年10月14日）本基金从开市起至10:30停牌1小时，之后复牌。基金管理人将向深圳证券交易所申请本基金自2013年11月14日开始持续停牌。基金管理人将于基金份额持有人大会决议生效公告后向深圳证券交易所申请复牌。本基金的持续停牌不会对本基金的场内外正常申赎造成影响，投资人可以按照本基金招募说明书的相关规定办理申购赎回。

4、基金管理人将在基金份额持有人大会召开前发布提示性公告，就持有人大会相关情况做必要说明，请予以留意。

5、本通知的有关内容由银华基金管理有限公司负责解释。

银华基金管理有限公司

2013年10月16日

附件一：《关于银华沪深300指数证券投资基金（LOF）转型有关事项的议案》

附件二：《银华沪深300指数证券投资基金（LOF）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指数证券投资基金（LOF）转型方案说明书》

附件一：

关于银华沪深300指数证券投资基金（LOF）转型有关事项的议案

银华沪深300指数证券投资基金（LOF）基金份额持有人：

鉴于近年兴起的分级基金可以满足投资人的多种需求，同时考虑到充分发挥沪深300指数代表大盘走势的特性，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》和《银华沪深300指数证券投资基金（LOF）基金合同》有关规定，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，提议对银华沪深300指数证券投资基金（LOF）（以下简称“银华沪深300指数基金”）实施转型。《银华沪深300指数证券投资基金（LOF）转型方案说明书》见附件四。

为实施银华沪深300指数基金转型方案，提议授权基金管理人办理本次银华沪深300指数基金转型的有关具体事宜，并可在不涉及基金合同当事人权利义务关系变化或对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下对《银华沪深300指数证券投资基金（LOF）基金合同》进行必要的修改和补充。

以上议案，请予审议。

基金管理人：银华基金管理有限公司

2013年10月14日

附件二：

银华沪深300指数证券投资基金（LOF）

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指数证券投资基金（LOF）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：____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/基金账户卡号”，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，应当填写证券/基金账户卡号；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。3、表决意见未选、多选或无法辨认、模糊不清或互相矛盾的表决票均视为投票人放弃表决权利，其所持全部基金份额的表决结果均计为“弃权”。4、本表决票可从本基金管理人网站（http://www.yhfund.com.cn）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2013年11月14日的以通讯方式召开的银华沪深300指数证券投资基金（LOF）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。

若在法定时间内就同一议案重新召开银华沪深300指数证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会，除本人（或本机构）重新作出授权外，本次基金份额持有人大会授权期间本人（或本机构）做出的各类授权依然有效。

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：____年　月　日

附注：1、此授权委托书可剪报、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、“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，应当填写证券/基金账户卡号；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。

附件四：

银华沪深300指数证券投资基金（LOF）转型方案说明书

一、声明

1、鉴于近年兴起的分级基金可以满足投资人的多种需求，同时考虑到充分发挥沪深300指数代表大盘走势的特性，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》和《银华沪深300指数证券投资基金（LOF）基金合同》有关规定，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基金份额持有人大会，审议关于银华沪深300指数证券投资基金（LOF）（以下简称“银华沪深300指数基金”）转型有关事项的议案。

2、本次银华沪深300指数基金转型方案需经本人直接出具书面意见和授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所持表决权的50%以上（含50%）通过，因此转型方案存在无法获得相关基金份额持有人大会表决通过的可能。参加基金份额持有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指数基金份额持有人，本人直接出具书面意见和授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额须占权益登记日基金总份额的50%以上（含50%）。

3、基金份额持有人大会表决通过的事项须报中国证监会备案，自在中国证监会完成备案手续之日起生效。法律法规另有规定的，从其规定。中国证监会对本次银华沪深300指数基金转型方案所作的任何决定或意见，均不表明其对本次转型方案或本基金的价值或投资者的收益做出实质性判断或保证。

二、银华沪深300指数基金转型方案要点

银华沪深300指数基金转型方案的主要内容如下：

（一）更名

基金名称由“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）调整基金份额结构

银华沪深300指数证券投资基金（LOF）为一只普通开放式指数基金，转型为银华沪深300指数分级证券投资基金（以下简称“银华沪深300指数分级基金”）后，其在不改变开放式运作的前提下，将在原有一类基金份额的基础上，增加两类份额，即改造后基金份额包括银华沪深300指数分级证券投资基金之基础份额（即“银华300分份额”）、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分份额”）与银华沪深300指数分级证券投资基金之积极收益类份额（即“银华300B分份额”）。其中，银华300A分份额、银华300B分份额的基金份额配比保持1∶1的比例不变。具体规则如下：

1、基金份额的自动分离与分拆规则

自《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”）生效之日起，基金管理人将暂停申购、赎回、转托管等相关业务直至银华沪深300指数分级基金开放日常申购、赎回。

基金管理人将在基金合同生效日的前一工作日进行分级运作起始折算，在基金合同生效日进行分级运作自动分拆。

分级运作起始折算是指在分级运作起始折算日（即银华沪深300指数分级基金基金合同生效日的前一工作日），将投资人持有的银华300份额，以折算前的基金份额净值为基础，折算成基金份额净值为1.00元的银华300份额的行为，银华300份额数按折算比例相应调整。

分级运作自动分拆是指在分级运作自动分拆日（即在银华沪深300指数分级基金基金合同生效日），将分级运作自动分拆日登记在册的场内的银华300份额以1:1的比例自动分拆为银华300A份额和银华300B份额。

自动分拆规则以中国证券登记结算有限责任公司相关业务规则为准。自动分拆以后投资人持有银华300A份额和银华300B份额的份额数以中国证券登记结算有限责任公司的记录为准。

基金合同生效日后，银华300份额保留原有的基金代码，只可以进行场内与场外的申购和赎回，但不上市交易。银华300A份额与银华300B份额交易代码不同，只可在深圳证券交易所上市交易，不可单独进行申购或赎回。

投资人可在场内申购和赎回银华300份额，并可选择将其场内日常申购的银华300份额按1:1的比例分拆成银华300A份额和银华300B份额。投资人可按1:1的配比将其持有的银华300A份额和银华300B份额申请合并为银华300份额后赎回。

投资人可在场外申购和赎回银华300份额。场外申购的银华300份额不进行分拆，但基金合同另有规定的除外。投资人可将其持有的场外银华300份额跨系统转托管至场内并申请将其分拆成银华300A份额和银华300B份额后上市交易。投资人可按1:1的配比将其持有的银华300A份额和银华300B份额合并为银华300份额后赎回。

无论是定期份额折算，还是不定期份额折算（有关银华沪深300指数分级基金的定期份额折算和不定期份额折算详见下文说明），其所产生的银华300份额不进行自动分拆。投资人可选择将上述折算产生的银华300份额按1:1的比例分拆为银华300A份额和银华300B份额。

2、银华300A份额和银华300B份额的参考净值计算规则

根据银华300A份额和银华300B份额的风险和收益特性不同，银华沪深300指数分级基金份额所分拆的两类基金份额银华300A份额和银华300B份额具有不同的参考净值计算规则。

在银华沪深300指数分级基金存续期内，银华沪深300指数分级基金将在每个工作日按基金合同约定的净值计算规则对银华300A份额和银华300B份额分别进行参考净值计算，银华300A份额为低风险且预期收益相对稳定的基金份额，银华沪深300指数分级基金净资产优先确保银华300A份额的本金及银华300A份额累计约定应得收益；银华300B份额为高风险且预期收益相对较高的基金份额，银华沪深300指数分级基金在优先确保银华300A份额的本金及累计约定应得收益后，将剩余净资产计为银华300B份额的净资产。

在银华沪深300指数分级基金存续期内，银华300A份额和银华300B份额的参考净值计算规则如下：

（1）银华300A份额约定年基准收益率为“同期银行人民币一年期定期存款利率+3.5%”，同期银行人民币一年期定期存款利率以计算日所在定期折算期间首日中国人民银行执行的金融机构人民币一年期存款基准利率为准。基金合同生效日所在年度的年基准收益率为“基金合同生效日中国人民银行执行的金融机构人民币一年期存款基准利率+3.5%”。年基准收益均以1.00元为基准进行计算；

（2）银华沪深300指数分级基金每个工作日对银华300A份额和银华300B份额进行参考净值计算。在进行银华300A份额和银华300B份额各自的参考净值计算时，银华沪深300指数分级基金净资产优先确保银华300A份额的本金及银华300A份额累计约定应得收益，之后的剩余净资产计为银华300B份额的净资产。银华300A份额累计约定应得收益按依据银华300A份额约定年基准收益率计算的每日收益率和截至计算日银华300A份额应计收益的天数确定；

（3）每2份银华300份额所代表的资产净值等于1份银华300A份额和1份银华300B份额的资产净值之和；

（4）在银华沪深300指数分级基金基金合同生效日所在定期折算期间内，若未发生基金合同规定的不定期份额折算，则银华300A份额在净值计算日应计收益的天数按自基金合同生效日至净值计算日的实际天数计算；若发生基金合同规定的不定期份额折算，则银华300A份额在净值计算日应计收益的天数应按照当前定期折算期间内最近一次不定期份额折算基准日的次日至净值计算日的实际天数计算。

在银华沪深300指数分级基金存续的某一完整定期折算期间内，若未发生基金合同规定的不定期份额折算且已发生基金合同规定的定期份额折算，则银华300A份额在净值计算日应计收益的天数按自该定期折算期间首日至净值计算日的实际天数计算。若未发生基金合同规定的不定期份额折算且未发生基金合同规定的定期份额折算，则银华300A份额在净值计算日应计收益的天数应按照上一定期折算期间内最近一次不定期份额折算基准日的次日至净值计算日的实际天数计算；若发生基金合同规定的不定期份额折算，则银华300A份额在净值计算日应计收益的天数应按照当前定期折算期间内最近一次不定期份额折算基准日的次日至净值计算日的实际天数计算。

基金管理人并不承诺或保证银华300A份额的基金份额持有人的约定应得收益，如在某一定期折算期间内银华沪深300指数分级基金资产出现极端损失情况下，银华300A份额的基金份额持有人可能会面临无法取得约定应得收益甚至损失本金的风险。

3、银华沪深300指数分级基金基金份额净值的计算

银华沪深300指数分级基金作为分级基金，按照银华300A份额和银华300B份额的参考净值计算规则依据以下公式分别计算并公告T日银华300份额的基金份额净值、银华300A份额和银华300B份额的基金份额参考净值：

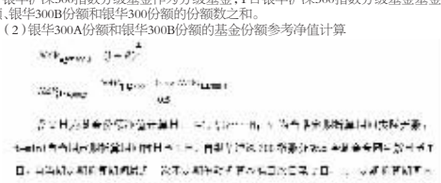
（1）银华300份额的基金份额净值计算

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

T日银华300份额的基金份额净值＝T日闭市后的基金资产净值／T日银华沪深300指数分级基金基金份额的总数

银华沪深300指数分级基金作为分级基金，T日银华沪深300指数分级基金基金份额的总数为银华300A份额、银华300B份额和银华300份额的份额数之和。

（2）银华300A份额和银华300B份额的基金份额参考净值计算



银华300份额的基金份额净值的计算、银华300A份额和银华300B份额的基金份额参考净值的计算，均保留到小数点后3位，小数点后第4位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

T日的基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日公告。如遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

4、银华沪深300指数分级基金的申购与赎回

银华沪深300指数分级基金的银华300A份额、银华300B份额不接受投资人的申购与赎回；银华沪深300指数分级基金基金合同生效后，投资人可通过场内或场外两种方式对银华300份额进行申购与赎回。

场内银华300份额可以直接申请场内赎回但不在深圳证券交易所上市交易，但可按1:1比例申请分拆为银华300A份额和银华300B份额在深圳证券交易所上市交易。

银华300A份额和银华300B份额在深圳证券交易所上市交易，不能直接申请场内赎回，但可按1:1比例申请合并为银华300份额后再申请场内赎回。

5、配对转换

（1）份额配对转换是指银华沪深300指数分级基金的场内银华300份额与银华300A份额、银华300B份额之间的配对转换，包括以下两种方式的配对转换：

1）分拆

分拆指基金份额持有人将其持有的每两份场内银华300份额申请转换成一份银华300A份额与一份银华300B份额的行为。

2）合并

合并指基金份额持有人将其持有的每一份银华300A份额与一份银华300B份额申请转换成两份场内银华300份额的行为。

（2）份额配对转换的业务办理机构

份额配对转换的业务办理机构见中国证券登记结算有限责任公司网站上相关信息披露。

基金投资人应当在份额配对转换业务办理机构的营业场所或按其提供的其他方式办理份额配对转换。深圳证券交易所、基金登记机构或基金管理人可根据情况变更或增减份额配对转换的业务办理机构，并予以公告。

（3）份额配对转换的业务办理时间

份额配对转换自银华300A份额、银华300B份额上市交易后不超过6个月的时间内开始办理，基金管理人应在开始办理份额配对转换的具体日期前依照《信息披露办法》的有关规定在至少一家指定媒体公告。

份额配对转换的业务办理日为深圳证券交易所交易日（基金管理人公告暂停份额配对转换时除外），具体的业务办理时间见招募说明书或基金管理人届时发布的相关公告。

若深圳证券交易所交易时间更改或实际情况需要，基金管理人可对份额配对转换业务的办理时间进行调整并公告。

（4）份额配对转换的原则

1）份额配对转换以份额申请。

2）申请分拆为银华300A份额和银华300B份额的场内银华300份额必须是偶数。

3）申请合并为银华300份额的银华300A份额与银华300B份额必须同时配对申请，且基金份额数必须同为整数且相等。

4）银华300份额的场外份额如需申请进行分拆，须跨系统转托管为银华300份额的场内份额后方可进行。

5）份额配对转换应遵循届时相关机构发布的相关业务规则。

基金管理人、基金登记机构或深圳证券交易所可视情况对上述规定作出调整，并在正式实施前依照《信息披露办法》的有关规定在至少一家指定媒体公告。

（5）份额配对转换的程序

份额配对转换的程序遵循届时相关机构发布的最新业务规则，具体见相关业务公告。

（6）暂停份额配对转换的情形

1）深圳证券交易所、基金登记机构、份额配对转换业务办理机构因异常情况无法办理份额配对转换业务。

2）法律法规、深圳证券交易所规定或经中国证监会认定的其他情形。

发生前述情形的，基金管理人应当在至少一家指定媒体刊登暂停份额配对转换业务的公告。

在暂停份额配对转换的情况消除时，基金管理人应及时恢复份额配对转换业务的办理，并依照有关规定在至少一家指定媒体上公告。

（7）份额配对转换的业务办理费用

投资人申请办理份额配对转换业务时，份额配对转换业务办理机构可酌情收取一定的佣金，具体见相关业务办理机构公告。

（三）增加基金份额折算

1、定期份额折算

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，银华沪深300指数分级基金将按照以下规则进行基金的定期份额折算。第一个定期折算期间指基金合同生效日至基金合同生效日之后最近一个11月30日，第二个及之后的定期折算期间指每个会计年度的12月1日至下一会计年度的11月30日。

（1）基金份额折算基准日

每个会计年度12月第一个工作日。

（2）基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的银华300A份额、银华300份额。

（3）基金份额折算频率

每年折算一次。

（4）基金份额折算方式

银华300A份额和银华300B份额按照银华沪深300指数分级基金基金合同“五、基金份额的分类与净值计算规则”进行净值计算，对银华300A份额的应得收益进行定期份额折算，每2份银华300份额将按1份银华300A份额获得约定应得收益的新增折算份额。

在基金份额折算前与折算后，银华300A份额和银华300B份额的份额配比保持1:1的比例。

对于银华300A份额期末的约定应得收益，即银华300A份额每个定期折算期间期末即11月30日份额净值超出1.000元部分，将折算为场内银华300份额分配给银华300A份额持有人。银华300份额持有人持有的每2份银华300份额将按1份银华300A份额获得新增银华300份额的分配。持有场外银华300份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外银华300份额的分配；持有场内银华300份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内银华300份额的分配。经过上述份额折算，银华300A份额和银华300份额的基金份额净值将相应调整。

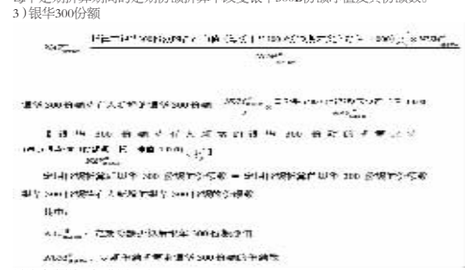
每个会计年度12月第一个工作日为基金份额折算基准日，银华沪深300指数分级基金将对银华300A份额和银华300份额进行定期份额折算，在份额折算期间的份额净值计算保留小数位数以份额折算相关公告为准。

每个会计年度12月第一个工作日进行银华300A份额上一定期折算期间累计约定应得收益的定期份额折算时，有关计算公式如下：

2）银华300B份额

每个定期折算期间的定期份额折算不改变银华300B份额净值及其份额数。

3）银华300份额



具体内容详见招募说明书。

（5）基金份额折算期间的基金业务办理

为保证基金份额折算期间银华沪深300指数分级基金的平稳运作，基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停银华300A份额与银华300B份额的上市交易和银华300份额的申购或赎回等相关业务，具体见基金管理人届时发布的相关公告。

（6）基金份额折算结果的公告

基金份额折算结束后，基金管理人应按照《信息披露办法》在至少一家指定媒体和基金管理人网站公告，并报中国证监会备案。

（7）特殊情形的处理

若在某一会计年度11月最后一个工作日发生基金合同约定的银华沪深300指数分级基金不定期份额折算的情形时，基金管理人本着维护基金份额持有人利益的原则，根据具体情况选择按照定期份额折算的规则或者不定期份额折算的规则进行份额折算。

若基金合同生效日为某年12月1日之后，则该会计年度不进行定期份额折算。

2、不定期份额折算

除以上定期份额折算外，银华沪深300指数分级基金还将在以下两种情况进行份额折算，即：当银华300份额的基金份额净值达到1.500元及以上；当银华300B份额的基金份额参考净值达到0.250元及以下，在份额折算期间的份额净值计算保留小数位以份额折算相关公告为准。

（1）当银华300份额的基金份额净值达到1.500元及以上，银华沪深300指数分级基金将按照以下规则进行份额折算。

1）基金份额折算基准日

银华300份额的基金份额净值达到1.500元及以上，基金管理人可根据市场情况确定折算基准日。

2）基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的银华300A份额、银华300B份额和银华300份额。

3）基金份额折算频率

不定期。

4）基金份额折算方式

当银华300份额的基金份额净值达到1.500元及以上后，银华沪深300指数分级基金将分别对银华300A份额、银华300B份额和银华300份额进行份额折算，份额折算后银华沪深300指数分级基金将确保银华300A份额和银华300B份额的比例为1:1，份额折算后银华300A份额、银华300B份额的基金份额参考净值和银华300份额的基金份额净值均调整为1元。

当银华300份额的份额净值达到1.500元及以上后，银华300A份额、银华300B份额、银华300份额三类份额将按照如下公式进行份额折算：

①银华300A份额

份额折算原则：

i份额折算前银华300A份额的份额数与份额折算后银华300A份额的份额数相等；

ii银华300A份额持有人份额折算后获得新增的份额数，即超出1元以上的资产净值部分全部折算为场内银华300份额。

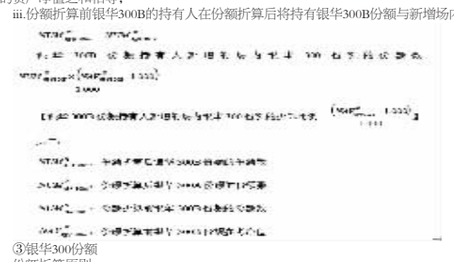
②银华300B份额

份额折算原则：

i.份额折算后银华300B份额与银华300A份额的份额数保持1:1配比；

ii.份额折算前银华300B份额的资产净值与份额折算后银华300B份额的资产净值及新增场内银华300份额的资产净值之和相等；

iii.份额折算前银华300B的持有人在份额折算后将持有银华300B份额与新增场内银华300份额。



③银华300份额

份额折算原则：

场外银华300份额持有人份额折算后获得新增场外银华300份额，场内银华300份额持有人份额折算后获得新增场内银华300份额。

具体内容详见招募说明书。

5）基金份额折算期间的基金业务办理

为保证基金份额折算期间银华沪深300指数分级基金的平稳运作，基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停银华300A份额与银华300B份额的上市交易和银华300份额的申购或赎回等相关业务，具体见基金管理人届时发布的相关公告。

6）基金份额折算结果的公告

基金份额折算结束后，基金管理人应按照《信息披露办法》在至少一家指定媒体和基金管理人网站公告，并报中国证监会备案。

（2）当银华300B份额的基金份额参考净值达到0.250元及以下，银华沪深300指数分级基金将按照以下规则进行份额折算。

1）基金份额折算基准日

银华300B份额的基金份额参考净值达到0.250元及以下，基金管理人可根据市场情况确定折算基准日。

2）基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的银华300A份额、银华300B份额、银华300份额。

3）基金份额折算频率

不定期。

4）基金份额折算方式

当银华300B份额的基金份额参考净值达到0.250元及以下后，银华沪深300指数分级基金将分别对银华300A份额、银华300B份额和银华300份额进行份额折算，份额折算后银华沪深300指数分级基金将确保银华300A份额和银华300B份额的比例为1:1，份额折算后银华300份额的基金份额净值、银华300A份额和银华300B份额的基金份额参考净值均调整为1元。

当银华300B份额参考净值达到0.250元及以下后，银华300A份额、银华300B份额、银华300份额三类份额将按照如下公式进行份额折算。

①银华300B份额

份额折算原则：

份额折算前银华300B份额的资产净值与份额折算后银华300B份额的资产净值相等。

②银华300A份额

份额折算原则：

i.份额折算前后银华300A份额与银华300B份额的份额数始终保持1:1配比；

ii.份额折算前银华300A份额的资产净值与份额折算后银华300A份额的资产净值及新增场内银华300份额的资产净值之和相等；

iii.份额折算前银华300A的持有人在份额折算后将持有银华300A份额与新增场内银华300份额。

③银华300份额：

份额折算原则：

份额折算前银华300份额的资产净值与份额折算后银华300份额的资产净值相等。

具体内容详见招募说明书。

5）基金份额折算期间的基金业务办理

为保证基金份额折算期间银华沪深300指数分级基金的平稳运作，基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停银华300A份额与银华300B份额的上市交易和银华300份额的申购或赎回等相关业务，具体见基金管理人届时发布的相关公告。

6）基金份额折算结果的公告

基金份额折算结束后，基金管理人应按照《信息披露办法》在至少一家指定媒体和基金管理人网站公告，并报中国证监会备案。

（四）授权基金管理人向深圳证券交易所申请终止原银华沪深300指数基金的上市交易，此后申请银华沪深300指数分级证券投资基金之银华300A份额及银华300B份额上市交易

原银华沪深300指数基金终止上市后，银华沪深300指数基金份额终止上市交易。在银华沪深300指数分级基金成立后，基金管理人将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之银华300A份额和银华300B份额上市，此后基金份额持有人可使用原深圳证券账户进行银华300A份额和银华300B份额的二级市场交易或者进行银华沪深300指数分级证券投资基金份额的申购和赎回。

（五）调整基金的投资范围和投资策略

1、投资范围

银华沪深300指数基金的投资范围为：“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（首次公开发行或增发）、现金和到期日在一年以内的政府债券等。本基金投资于沪深300指数成份股及备选成份股的组合比例不低于基金资产净值的90%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。在保证流动性的前提下，如果法律法规允许，在履行适当程序后则本基金的股票组合投资比例可以提高到基金资产净值的100%。”

银华沪深300指数分级基金的投资范围拟调整为：“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。”

2、投资策略

由于在投资范围里增加了股指期货投资品种，与此相对应的投资策略部分拟增加有关股指期货投资策略。

本基金管理人对股指期货的运用将进行充分的论证。银华沪深300指数分级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。

（六）调整收益分配原则

原收益分配原则如下：

“1.本基金的每份基金份额享有同等分配权；

2.收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金注册登记机构可将投资人的现金红利按红利再投日的基金份额净值自动转为基金份额；

3.本基金收益每年最多分配6次，