银华恒生中国企业指数分级证券投资基金之银华H股A份额和银华H股B份额上市交易公告书

基金管理人：银华基金管理有限公司
基金托管人：中国建设银行股份有限公司
注册登记人：中国证券登记结算有限责任公司

上市地点：深圳证券交易所
上市日期：2014年5月12日
公告日期：2014年5月7日

一、重要声明与提示

《银华恒生中国企业指数分级证券投资基金之银华H股A份额和银华H股B份额上市交易公告书》（以下简称 "本公告书"）依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称"《基金法》"）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号<上市交易公告书的内容与格式>》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，银华恒生中国企业指数分级证券投资基金（以下简称"本基金"）管理人的董事会及董事保证本公告书所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

本基金托管人保证本公告书中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、深圳证券交易所对银华恒生中国企业指数分级证券投资基金之银华H股A与银华H股B基金份额上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。

凡本公告书未涉及的有关内容，请投资者详细查阅刊登在2014年3月6日《上海证券报》的《银华恒生中国企业指数分级证券投资基金招募说明书》(以下简称招募说明书)。本基金招募说明书同时发布在本公司网站（www.yhfund.com.cn）。

二、基金概览

1、基金名称：银华恒生中国企业指数分级证券投资基金

2、基金类型：股票型

3、基金运作方式：契约型开放式

4、本基金的基金份额包括银华恒生中国企业指数分级证券投资基金之基础份额（简称 "银华恒生国企指数分级（QDII）"，场内简称"银华H股"）、银华恒生中国企业指数分级证券投资基金之稳健收益类份额（简称"银华H股A"）与银华恒生中国企业指数分级证券投资基金之积极收益类份额（简称"银华H股B"）。其中，银华H股A份额、银华H股B份额的基金份额配比始终保持1：1的比例不变。

5、本基金的存续期限为不定期。

6、本基金通过场外、场内两种方式公开发售。基金发售结束后，场外认购的全部基金份额将确认为银华H股份额；场内认购的全部基金份额按照1：1的比例自动分离为预期收益与风险不同的两种份额类别，即银华H股A份额和银华H股B份额。

《基金合同》生效后，银华H股份额设置单独的基金代码，只可以进行场内与场外的申购和赎回，但不上市交易。银华H股A份额和银华H股B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。

7、银华H股的申购与赎回：投资者可通过场外或场内两种方式对银华H股份额进行申购与赎回。银华H股份额场外申购和赎回业务的场所为基金管理人直销机构和场外代销机构。投资者需使用中国证券登记结算有限责任公司开放式基金账户办理银华H股份额场外申购、赎回业务。银华H股份额场内申购和赎回业务的场所为具有基金代销业务资格且符合深圳证券交易所风险控制要求的深圳证券交易所会员单位。投资者需使用深圳证券账户，通过深圳证券交易所交易系统办理银华H股份额场内申购、赎回业务。银华H股A与银华H股B将不接受投资者的申购与赎回。

8、份额配对转换：份额配对转换是指本基金的银华H股份额与银华H股A份额、银华H股B份额之间的配对转换，包括分拆和合并两个方面。分拆指基金份额持有人将其持有的每两份银华H股份额的场内份额申请转换成一份银华H股A份额与一份银华H股B份额的行为。合并指基金份额持有人将其持有的每一份银华H股A份额与一份银华H股B份额申请转换成两份银华H股份额的场内份额的行为。份额配对转换业务将于2014年5月12日开始办理。

9、定期份额折算

在银华H股A份额、银华H股份额存续期内的每个会计年度12月的第一个工作日，基金管理人将根据《基金合同》的规定对本基金的银华H股A份额、银华H股份额进行定期份额折算。对于银华H股A份额期末的约定应得收益，即银华H股A份额每个定期折算期间期末即11月30日份额净值超出1.0000元部分，将折算为场内银华H股份额分配给银华H股A份额持有人。银华H股份额持有人持有的每2份银华H股份额将按1份银华H股A份额获得新增银华H股份额的分配。持有场外银华H股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H股份额的分配；持有场内银华H股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H股份额的分配。经过上述份额折算，银华H股A份额和银华H股份额的基金份额净值将相应调整。有关定期份额折算的具体规定请见本基金招募说明书以及相关公告。

10、不定期份额折算

当银华H股份额的基金份额净值达到1.5000元后，本基金将分别对银华H股A份额、银华H股B份额和银华H股份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保银华H股A份额和银华H股B份额的比例为1:1，份额折算后银华H股A份额、银华H股B份额和银华H股份额的基金份额净值均调整为1元。有关不定期份额折算的具体规定请见本基金招募说明书以及相关公告。

11、基金份额总额：截至2014年5月5日，本基金的基金份额总额为303,487,507.99份，其中，银华H股为148,976,673.99份，银华H股A为77,255,417份，银华H股B为77,255,417份。

12、基金份额净值：截至2014年5月5日，银华H股的基金份额净值为1.0001元，银华H股A的基金份额净值为1.0047元，银华H股B的基金份额净值为0.9956元。

13、本次上市交易的基金份额简称：银华H股A、银华H股B。

14、本次上市交易的基金份额总额：银华H股A为77,255,417份；银华H股B为77,255,417份。

15、本次上市交易的基金份额交易代码：银华H股A为150175；银华H股B为150176

16、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所

17、上市交易日期：2014年5月12日

18、基金管理人：银华基金管理有限公司

19、基金托管人：中国建设银行股份有限公司

20、本次上市交易的基金份额注册登记机构：中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司

三、基金份额的募集与上市交易

（一）上市前基金募集情况

1、本基金募集申请的核准机构和核准文号：中国证券监督管理委员会证监许可[2013]1433号

2、基金运作方式：契约型开放式

3、基金合同期限：不定期

4、本基金发售日期：2014年3月10日至2014年4月2日

5、发售价格：1.00元人民币

6、份额发售方式：本基金通过场外、场内两种方式公开发售

7、发售机构

（1）本基金场外认购的销售机构：

本基金通过场外发售的销售机构包括直销机构和代销机构。其中直销机构包括本公司北京直销中心以及本公司深圳直销中心。代销机构包括中国建设银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、财富证券有限责任公司、长城证券有限责任公司、长江证券股份有限公司、第一创业证券股份有限公司、东莞证券有限责任公司、东海证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、广州证券有限责任公司、恒泰证券股份有限公司、宏源证券股份有限公司、华安证券股份有限公司、金元证券股份有限公司、平安证券有限责任公司、厦门证券有限公司、上海证券有限责任公司、申银万国证券股份有限公司、太平洋证券股份有限公司、万联证券有限责任公司、西南证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、中航证券有限公司、中山证券有限责任公司、中信证券（浙江）有限责任公司、渤海证券股份有限公司、大同证券经纪有限责任公司、东北证券股份有限公司、国都证券有限责任公司、华龙证券有限责任公司、华融证券股份有限公司、江海证券有限公司、联讯证券有限责任公司、齐鲁证券有限公司、瑞银证券有限责任公司、山西证券股份有限公司、天相投资顾问有限公司、西部证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中天证券有限责任公司、中信建投证券股份有限公司、中信万通证券有限责任公司、中信证券股份有限公司、中原证券股份有限公司（以上排名不分先后）。

（2）本基金场内认购的销售机构：

本基金通过场内发售的机构为具有基金代销资格的深圳证券交易所会员单位，具体名单可在深交所网站查询。

8、验资机构名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

9、募集资金总额及入账情况

此次募集扣除认购费后的有效净认购金额(不含利息)为人民币303,404,391.57元，确认份额（不含利息转份额）303,404,391.57份，利息结转份额83,116.42份，总确认份额为303,487,507.99份。

上述有效净认购资金及认购款项在募集期间产生的利息已于2014年4月9日全额划入本基金托管人中国建设银行股份有限公司开立的托管专户。

本基金通过场外、场内两种方式公开发售，按照每份基金份额1.00元计算，本基金募集期间含本息共募集303,487,507.99份基金份额，其中场外认购的基金份额为148,976,673.99份；场内认购的基金份额为154,510,834.00份。

10、基金备案情况

本基金已于2014年4月9日验资完毕，当日向中国证监会提交了验资报告，办理基金备案手续，并于2014年4月9日获书面确认，本基金《基金合同》自该日起正式生效。

11、基金合同生效日：2014年4月9日

12、基金合同生效日的基金份额总额：303,487,507.99份

（二）银华H股的日常申购、赎回情况

银华H股份额将于2014年5月12日开放日常申购、赎回，具体业务办理规则请投资者参阅2014年5月7日刊登在《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》上的《银华恒生中国企业指数分级证券投资基金开放日常申购、赎回及定期定额投资业务的公告》。

（三）银华H股A与银华H股B上市交易的主要内容

1、本基金的银华H股A与银华H股B上市交易的核准机构和核准文号：深圳证券交易所深证上[2014]156号

2、上市交易日期：2014年5月12日

3、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所。投资者在深圳证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金交易。

4、上市交易份额简称：银华H股A、银华H股B

5、交易代码：银华H股A为150175、银华H股B为150176

6、本次上市交易份额：银华H股A为77,255,417份、银华H股B为77,255,417份

7、基金资产净值的披露：用于基金信息披露的基金资产净值和银华H股、银华H股A与银华H股B的基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人于每个工作日交易结束后将经过基金托管人复核的银华H股、银华H股A与银华H股B的基金份额净值传给深交所，深交所于次日通过行情系统揭示。

8.未上市交易份额的流通规定：未上市交易的银华H股份额托管在场外，基金份额持有人将其办理跨系统转托管至场内（证券登记结算系统）后，选择将银华H股分拆为银华H股A与银华H股B后，方可上市流通。

（四）份额配对转换业务安排：银华基金管理有限公司(以下简称"本公司")决定自2014年5月12日起，开通银华恒生中国企业指数分级证券投资基金的份额配对转换业务，即银华H股与银华H股A、银华H股B之间的配对转换，包括"分拆"和"合并"两个方面。"合并"或"分拆"每笔申请的份额数必须是偶数，投资者在业务办理机构提交的每笔申请份额不得低于2份。本公司可根据市场情况调整"合并"或"分拆"每笔申报份额的最低数量限制，并在调整生效前依照有关规定进行公告。

中国证券登记结算有限责任公司会对具备基金份额配对转换业务办理资格的证券公司名单进行更新，投资者可登陆中国证券登记结算有限责任公司网站（www.chinaclear.cn）查询最新名单，本公司对该名单的更新不再另行公告。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人情况

（一）基金份额持有情况

截至2014年5月5日，银华H股份额持有人户数为1513户，平均每户持有的基金份额为98,464.42份；银华H股A为715户，平均每户持有的基金份额为108,049份；银华H股B为715户，平均每户持有的基金份额为108,049份。

机构投资者持有的本次上市交易的银华H股A与银华H股B的基金份额分别为24,472,069份和24,472,066份，分别占本次银华H股A与银华H股B上市交易基金份额比例为31.6768%和31.6768%；个人投资者持有的本次上市交易的银华H股A与银华H股B的基金份额分别为52,783,348份和52,783,351份，分别占本次银华H股A与银华H股B上市交易基金份额比例为68.3232%和68.3232%。

截至2014年5月5日，本公司从业人员持有的银华H股基金份额数为747,745.27份，占基金总份额比例为0.2464%；本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为0；本基金基金经理持有本基金份额总量的数量区间为0。

（二）基金份额前十名持有人情况

本次上市交易的银华H股A、银华H股B前十名持有人情况

序号	持有人名称	持有银华H股A份额	占银华H股A份额比(%)	持有银华H股B份额	占银华H股B份额比(%)
1	山东省国际信托有限公司—以太9号证券投资集合资金信托计划	5,900,344	7.64	5,900,344	7.64
2	中航证券有限公司	4,000,233	5.18	4,000,233	5.18
3	西南证券股份有限公司	4,000,233	5.18	4,000,233	5.18
4	广发证券—中信银行—广发金管家睿福1号集合资产管理计划	4,000,232	5.18	4,000,232	5.18
5	都邦财产保险股份有限公司—传统保险产品	2,500,681	3.24	2,500,680	3.24
6	徐正荣	2,500,388	3.24	2,500,389	3.24
7	中信证券股份有限公司	2,500,146	3.24	2,500,145	3.24
8	袁沛华	2,500,145	3.24	2,500,146	3.24
9	傅林萍	1,600,311	2.07	1,600,311	2.07
10	卢颖怡	1,000,136	1.29	1,000,136	1.29
合计		30,502,849	39.48	30,502,849	39.48

注：以上信息依据中国证券登记结算有限公司深圳分公司提供的持有人信息编制。由于四舍五入的原因，占场内总份额比例分项之和与合计可能有尾差。

五、基金主要当事人简介

（一）基金管理人

1、基本信息

名称：银华基金管理有限公司

法定代表人：王珠林

总经理：王立新

设立日期：2001年5月28日

注册资本：2亿元人民币

注册地址：广东省深圳市深南大道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

设立批准文号：中国证监会证监基金字[2001]7号

工商登记注册的法人营业执照文号：440301103790705

经营范围：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

存续期间：持续经营

股东及其出资比例：

持股单位	占总股本比例
西南证券股份有限公司	49%
第一创业证券有限责任公司	29%
东北证券股份有限公司	21%
山西海鑫实业股份有限公司	1%
合计	100%

联系人：刘晓雅

电话：010-85186558

传真：010-58163027

2、经营概况

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）设立的全国性基金管理公司，注册资本为2亿元人民币。

截至2014年3月31日，本基金管理人共管理三十六只基金，公募基金管理资产规模约650.98亿元。本基金管理人管理的三十六只证券投资基金如下：银华核心价值优选股票型证券投资基金、银华优质增长股票型证券投资基金、银华富裕主题股票型证券投资基金、银华领先策略股票型证券投资基金、银华内需精选股票型证券投资基金（LOF）、银华消费主题分级股票型证券投资基金、银华中小盘精选股票型证券投资基金、银华—道琼斯88精选证券投资基金、银华深证100指数分级证券投资基金、银华中证等权重90指数分级证券投资基金、银华中证800等权重指数增强分级证券投资基金、银华沪深300指数分级证券投资基金、银华永利债券型证券投资基金、银华中证内地资源主题指数分级证券投资基金、上证50等权重交易型开放式指数证券投资基金、银华上证50等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金、银华优势企业证券投资基金、银华保本增值证券投资基金、银华和谐主题灵活配置混合型证券投资基金、银华成长先锋混合型证券投资基金、银华永祥保本混合型证券投资基金、银华中证成长股债恒定组合30/70指数证券投资基金、银华增强收益债券型证券投资基金、银华信用债券型证券投资基金（LOF）、银华信用双利债券型证券投资基金、银华永泰积极债券型证券投资基金、银华纯债信用主题债券型证券投资基金（LOF）、银华中证中票50指数债券型证券投资基金（LOF）、银华永兴纯债分级债券型发起式证券投资基金、银华信用四季红债券型证券投资基金、银华信用季季红债券型证券投资基金、银华中证转债指数增强分级证券投资基金、银华货币市场证券投资基金、银华交易型货币市场基金、银华全球核心优选证券投资基金、银华抗通胀主题证券投资基金(LOF)。此外，本基金管理人于2014年3月10日——4月2日发售了本基金，本基金基金合同于2014年4月9日生效，实际募集规模为3.03亿元。

公司治理结构完善，经营运作规范，能够切实维护基金投资人的利益。公司董事会下设"风险控制委员会"和"薪酬与提名委员会"2个专业委员会，有针对性地研究公司在经营管理和基金运作中的相关情况，制定相应的政策，并充分发挥独立董事的职能，切实加强对公司运作的监督。

公司监事会由4位监事组成，主要负责检查公司的财务以及对公司董事、高级管理人员的行为进行监督。

公司具体经营管理由总经理负责，公司根据经营运作需要设置投资管理部、量化投资部、研究部、市场营销部、高端客户部、国际合作与产品开发部、境外投资部、特定资产管理部、交易管理部、固定收益部、养老金业务部、运作保障部、信息技术部、公司办公室、人力资源部、行政财务部、深圳管理部、监察稽核部、战略发展部等19个职能部门，并设有北京分公司。此外，公司还设有A股基金投资决策委员会、境外投资决策委员会、特定资产投资决策委员会3个投资决策委员会，分别负责指导基金及其他投资组合的运作，确定基本的投资策略。

各部门主要职能如下：

投资管理部：根据A股基金投资决策委员会制定的原则进行投资。

量化投资部：基金的投资管理（包括指数基金、ETF及主动量化基金的管理）、数量化投资策略和模型研究与开发、量化产品的设计和创新、为其他部门提供金融工程支持。

研究部：负责宏观、策略、行业和公司研究。

市场营销部：负责营销策划、客户服务、市场推广、基金销售、销售渠道管理等工作。

高端客户部：特定客户资产管理业务（包括特定多个客户资产管理业务）产品营销、公募基金的高端客户直销、公司大客户服务、协助公司新业务的策划及营销等工作。

国际合作与产品开发部：负责开展对外合作及新产品的开发工作。

境外投资部：负责公司QDII产品的投资管理，并协助QDII产品的设计、发行等工作。

特定资产管理部：负责特定客户资产管理业务，包括特定多个客户资产管理业务；协助组织特定客户资产管理业务的产品设计和市场营销工作；企业年金基金投资管理；理财产品投资顾问；社保基金产品投资管理；QFII投资顾问。

交易管理部：负责公司所有产品的交易管理工作。

固定收益部：负责固定收益产品的投资、研究。

养老金业务部：负责企业年金业务的市场开发、客户维护和产品推广；负责全国社保基金和地方社保基金等养老金业务的市场开发、客户维护和产品推广。

运作保障部：负责公司基金的注册登记、资金清算、会计核算、估值。

信息技术部：负责公司电脑信息技术的开发、维护及基金后台运作支持工作。

公司办公室：负责公司董事会相关工作，负责文档、印鉴管理，公司品牌建设、市场调研以及其他行政工作。

人力资源部：负责公司人力资源管理工作。

行政财务部：负责公司财务管理、会计核算，行政、后勤等相关工作。

深圳管理部：负责公司财务管理、会计核算、税务报送，与主管机关及相关单位的联络沟通，以及其他行政工作等。

监察稽核部：负责揭示、控制公司各项业务风险，对公司管理和基金运作合法合规性进行全方位的监察稽核，督促公司内部管理制度的执行，处理日常法律事务、信息披露事务。

战略发展部：通过宏观市场环境、政策、竞争对手、公司现状等进行分析，制定公司的战略规划，以作为业务发展方向的指引；推动并跟踪战略计划的实施，确保战略计划的落地。

北京分公司：负责所辖区域内的行政管理。

信息披露负责人及咨询电话：凌宇翔；010-58163096。

截至2014年4月18日，公司共有员工316人，其中178人具有硕士以上学历，9人具有博士以上学历。公司主要业务部门人员大部分具有基金从业资格。

3、本基金基金经理

乐育涛先生，硕士学位。曾就职于WorldCo金融服务公司，主要从事自营证券投资工作；曾就职于Binocular资产管理公司，从事股指期货交易策略研究工作；并曾就职于Evalueserve咨询公司，任职投资研究部主管。2007年4月加盟银华基金管理有限公司，曾担任银华全球核心优选证券投资基金基金经理助理职务。2011年5月11日起任"银华全球核心优选证券投资基金"基金经理。

（二）基金托管人

1、基本情况

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：王洪章

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：田青

联系电话：(010) 67595096

2、基金托管部门及主要人员情况

中国建设银行总行设投资托管业务部，下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII托管处、养老金托管处、清算处、核算处、监督稽核处等9个职能处室，在上海设有投资托管服务上海备份中心，共有员工220余人。自2007年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

杨新丰，投资托管业务部总经理，曾就职于中国建设银行江苏省分行、广东省分行、中国建设银行总行会计部、营运管理部，长期从事计划财务、会计结算、营运管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

纪伟，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部，长期从事大客户的客户管理及服务工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张军红，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行总行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室，长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

郑绍平，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行投资部、委托代理部，长期从事客户服务、信贷业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行会计部，长期从事托管业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

（三）基金验资机构

名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

注册地址：中国北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼16层

办公地址：中国北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼16层

法定代表人：葛明

经办注册会计师：李慧民、王珊珊

电话：010-58153280；010-58152145

传真：010-85188298

六、基金合同摘要

（一）基金合同当事人及其权利、义务

1、基金管理人

（1）基金管理人简况

名称：银华基金管理有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦19层

法定代表人：王珠林

设立日期：2001年5月28日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字［2001］7号

组织形式：有限责任公司

注册资本：贰亿元人民币

存续期限：持续经营

联系电话：400-678-3333

（2）基金管理人的权利与义务

1）根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

自本基金合同生效之日起，依照有关法律法规和本基金合同的规定独立运用基金财产；

依照基金合同获得基金管理费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；

发售基金份额；

依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

在符合有关法律法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则，在法律法规和本基金合同规定的范围内决定和调整基金的除调高托管费率和管理费率之外的相关费率结构和收费方式；

根据有关规定，选择、更换或撤消境外投资顾问、证券经纪代理商以及证券登记机构，并对其行为进行必要的监督；

根据本基金合同及有关规定监督基金托管人，对于基金托管人违反了本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；

在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回申请；

在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资、融券；

自行担任或选择、更换登记机构，获取基金份额持有人名册，并对登记机构的代理行为进行必要的监督和检查；

选择、更换代销机构，并依据销售代理协议和有关法律法规，对其行为进行必要的监督和检查；

选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；

在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

依法召集基金份额持有人大会；

法律法规和基金合同规定的其他权利。

2）根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

办理基金备案手续；

自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，基于谨慎的原则，控制基金资产的流动性风险，保证基金资产正常运作；

配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

确保管理人或其委托的境外投资顾问发送的交易数据符合《基金法》、《试行办法》、基金合同及其他有关规定，并保证该数据真实、准确、完整，因数据原因造成基金财产或其他当事人的财产损失，由基金管理人承担赔偿责任；

委托境外投资顾问进行境外证券投资的，境外投资顾问应符合《试行办法》规定的有关条件；

承担受信责任，在挑选、委托投资顾问过程中，履行尽职调查义务；

严格遵守境内有关法律法规、基金合同的规定，始终将基金份额持有人的利益置于首位，以合理的依据提出投资建议，寻求基金的最佳交易执行，公平客观对待所有客户，始终按照基金的投资目标、策略、政策、指引和限制实施投资决定，充分披露一切涉及利益冲突的重要事实，尊重客户信息的机密性。

建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；

确保基金投资于中国证监会规定的金融产品或工具；严格按照《基金法》、《试行办法》、基金合同及有关法律法规有关投资范围和比例限制的规定，确定清晰、可执行的投资范围和投资比例，并在规定时间内，对超范围、超比例的投资进行调整，并承担相应的责任；

确保基金管理人向基金托管人发送的基金认购、申购和赎回数据符合《基金法》、《试行办法》、基金合同及其他有关规定，并保证该数据的真实、准确和完整；

委托境外证券服务机构代理买卖证券的，应当严格履行受信责任，并按照有关规定对投资交易的流程、信息披露、记录保存进行管理。

与境外证券服务机构之间的证券交易和研究服务安排，应当严格按照《试行办法》第三十条规定的原则进行；

进行境外证券投资，应当遵守当地监管机构、交易所的有关法律法规规定。

如需在托管人选择的机构之外保管、登记基金财产，应严格审查，保证基金财产的安全，以及相关资产收益准确、按时归入基金财产；

除依据《基金法》、《试行办法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

依法接受基金托管人的监督；

计算并公告基金资产净值，确定银华H股份额申购、赎回价格；

采取适当合理的措施使计算银华H股份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定；

按规定受理申购和赎回申请，严格控制基金投资产品的流动性风险，确保及时、足额支付赎回款项；

进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

编制季度、半年度和年度基金报告；

严格按照《基金法》、《信息披露办法》、《试行办法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、投资意向等，除《基金法》、《试行办法》和基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；

按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

依据《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料15年以上；

以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

授权投资顾问负责投资决策的，应当在协议中明确投资顾问由于本身差错、疏忽、未履行职责等原因而导致财产受损时应当承担相应责任；

因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料；

面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

执行生效的基金份额持有人大会决议；

不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；

依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利，不谋求对上市公司的控股和直接管理；

法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

2、基金托管人

（1）基金托管人简况

名称：中国建设银行股份有限公司

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：王洪章

成立时间：2004年9月17日

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币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

（2）基金托管人的权利与义务

1）根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：

依基金合同约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；

选择、更换负责境外资产托管业务的境外托管人；

监督基金管理人对本基金的投资运作；

自本基金合同生效之日起，依法保管基金资产；

在基金管理人更换时，提名新任基金管理人；

根据本基金合同及有关规定监督基金管理人，对于基金管理人违反本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金资产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；

依法召集基金份额持有人大会；

按规定取得基金份额持有人名册资料；

法律法规和基金合同规定的其他权利。

2）根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：

设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；

对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立；

除依据《基金法》、《试行办法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益；

保护基金份额持有人利益，按照规定对基金日常投资行为和资金汇出入情况实施监督，如发现投资指令或资金汇出入违法、违规，应及时向中国证监会、国家外汇局报告；

安全保管存放于基金托管人处的基金财产，准时将公司行为信息通知基金管理人，确保基金及时收取所有应得收入；

按照规定监督基金管理人的投资运作，确保基金按照有关法律法规和基金合同约定的投资目标和限制进行管理；

按照有关法律法规和基金合同的约定执行基金管理人、境外投资顾问的指令，及时办理清算、交割事宜；

确保基金的份额净值按照有关法律法规和基金合同规定的方法进行计算；

确保基金按照有关法律法规和基金合同的规定进行申购、认购、赎回等日常交易；

确保基金根据有关法律法规和基金合同确定并实施收益分配方案；

按照有关法律法规和基金合同的规定，基金托管人对由基金托管人或其委托的境外托管人实际有效控制的证券承担安全保管责任；

每月结束后7个工作日内，向中国证监会和国家外汇局报告基金境外投资情况，并按相关规定进行国际收支申报；

安全保管可以承担保管责任的基金资产，开设或委托开设资金账户和证券账户；

办理基金的有关结汇、售汇、收汇、付汇和人民币资金结算业务；

保存基金的资金汇出、汇入、兑换、收汇、付汇、资金往来、委托及成交记录等相关资料，其保存的时间应当不少于20年；

保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

保守基金商业秘密，除《基金法》、《试行办法》、基金合同及其他法律法规另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；

对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人有未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料15年以上；

办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

复核、审查基金管理人计算的基金资产净值和银华H股份额申购、赎回价格；

按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；

按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金管理人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

因违反基金合同导致基金财产损失，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

选择的境外托管人，应符合《试行办法》第十九条的规定；

对基金的境外财产，可授权境外托管人代为履行其承担的受托人职责。境外托管人在履行职责过程中，因本身过错、疏忽等原因而导致基金财产受损的，托管人应当承担相应责任。

基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金向基金管理人追偿；

参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行业监督管理机构，并通知基金管理人；

执行生效的基金份额持有人大会决议；

不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；

保存与基金托管人职责相关的基金份额持有人名册；

法律法规、中国证监会和国家外汇局根据审慎监管原则规定的其他职责以及基金合同规定的其他义务。

3、基金份额持有人

基金投资者持有本基金基金份额的行为即视为对基金合同的承认和接受，基金投资者自依据基金合同取得的基金份额，即成为本基金份额持有人和基金合同的当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为基金合同当事人并不以在基金合同上书面签章或签字为必要条件。

银华H股份额、银华H股A份额、银华H股B份额持有人持有的每一份基金份额按基金合同约定仅在其份额类别内拥有同等的权益。

（1）根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：

1)分享基金财产收益；

2)参与分配清算后的剩余基金财产；

3)依法申请赎回或转让其持有的基金份额；

4)按照规定要求召开基金份额持有人大会；

5)出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；

6)查阅或者复制公开披露的基金信息资料；

7)监督基金管理人的投资运作；

8)对基金管理人、基金托管人、基金份额发售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；

9)法律法规和基金合同规定的其他权利。

每份基金份额具有同等的合法权益。

（2）根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：

1)遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；

2)遵守基金管理人、基金托管人、代销机构和登记机构关于开放式基金业务的相关规则及规定；

3)交纳基金认购、申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用；

4)在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；

5)不从事任何有损基金及其他基金份额持有人合法权益的活动；

6)执行生效的基金份额持有人大会决议；

7)返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人及基金管理人的代理人、基金托管人、代销机构、其他基金份额持有人处获得的不当得利；

8)法律法规和基金合同规定的其他义务。

（二）基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

1、基金份额持有人大会由基金份额持有人或基金份额持有人的合法授权代表共同组成。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。

2、会议召集人及召集方式

（1）除法律法规或本基金合同另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。基金管理人未按规定召集或者不能召集时，由基金托管人召集。

（2）基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当自行召集。

（3）单独或合计持有银华H股份额、银华H股A份额、银华H股B份额各自份额10%以上（含10%）的基金份额持有人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开；基金管理人决定不召集，单独或合计持有银华H股份额、银华H股A份额、银华H股B份额各自份额10%以上（含10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开。

（4）单独或合计持有银华H股份额、银华H股A份额、银华H股B份额各自份额10%以上（含10%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计持有银华H股份额、银华H股A份额、银华H股B份额各自份额10%以上（含10%）的基金份额持有人有权自行召集基金份额持有人大会，但应当至少提前30日向中国证监会备案。

（5）基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

3、召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

（1）基金份额持有人大会的召集人(以下简称"召集人")负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。召开基金份额持有人大会，召集人必须于会议召开日前30天在指定媒体公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容：

1）会议召开的时间、地点和会议形式；

2）会议拟审议的主要事项；

3)会议形式；

4)议事程序；

5)有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人权益登记日；

6)代理投票的授权委托书的内容要求(包括但不限于代理人身份、代理权限和代理有效期限等)、送达时间和地点；

7)表决方式；

8)会务常设联系人姓名、电话；

9)出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；

10)召集人需要通知的其他事项。

（2）采用通讯开会方式并进行表决的情况下，由召集人决定通讯方式和书面表决方式，并在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。

（3）如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

4、基金份额持有人出席会议的方式

(1)会议方式

1)基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会、通讯方式开会及法律法规、中国证监会允许的其他方式开会。

2)现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委托书委派其代理人出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席，如基金管理人或基金托管人拒不派代表出席的，不影响表决效力。

3)通讯方式开会指按照本基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。

4)在法律法规或监管机构允许的情况下，经会议通知载明，本基金亦可采用其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合的方式召开基金份额持有人大会，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行，或者采用网络、电话或其他方式授权他人代为出席会议并表决。

5)会议的召开方式由召集人确定，但决定转换基金运作方式、基金管理人更换或基金托管人更换、提前终止基金合同的事宜必须以现场开会方式召开基金份额持有人大会。

(2)召开基金份额持有人大会的条件

1)现场开会方式

在同时符合以下条件时，现场会议方可举行：

①对到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示，全部有效凭证对应的银华H股份额、银华H股A份额、银华H股B份额各自的基金份额占权益登记日各自基金总份额的50%以上(含50%，下同)；

②到会的基金份额持有人身份证明及持有基金份额的凭证、代理人身份证明、委托人持有基金份额的凭证及授权委托代理手续完备，到会者出具的相关文件符合有关法律法规和基金合同及会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的注册登记资料相符。

2)通讯开会方式

在同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

①召集人按本基金合同规定公布会议通知后，在2个工作日内连续公布相关提示性公告；

②召集人按基金合同规定通知基金托管人或/和基金管理人(分别或共同称为"监督人")到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；

③召集人在监督人和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取和统计基金份额持有人的书面表决意见，如基金管理人或基金托管人经通知拒不到场监督的，不影响表决效力；

④本人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代表的银华H股份额、银华H股A份额、银华H股B份额各自的基金份额占权益登记日各自基金总份额的50%以上；

⑤直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人提交的持有基金份额的凭证、授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与登记机构记录相符。

5、议事内容与程序

（1）议事内容及提案权

1)议事内容为本基金合同规定的召开基金份额持有人大会事由所涉及的内容。

2)基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日单独或合计持有银华H股份额、银华H股A份额、银华H股B份额各自份额10%以上（含10%）的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前就召开事由向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案；也可以在会议通知发出后向大会召集人提交临时提案。

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开前及时公告。

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

3)对于基金份额持有人提交的提案，大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

关联性。大会召集人对于基金份额持有人提案涉及事项与基金有直接关系，并且不超出法律法规和基金合同规定的基金份额持有人大会职权范围的，应提交大会审议；对于不符合上述要求的，不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决，应当在该次基金份额持有人大会上进行解释和说明。

程序性。大会召集人可以对基金份额持有人的提案涉及的程序性问题做出决定。如将其提案进行分拆或合并表决，需征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会做出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

4)单独或合并持有权益登记日银华H股份额、银华H股A份额、银华H股B份额各自份额10％以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于6个月。法律法规另有规定的除外。

（2）议事程序

1)现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照规定程序宣布会议议事程序及注意事项，确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，形成大会决议。

大会由召集人授权代表主持。基金管理人为召集人的，其授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权代表主持；如果基金管理人和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的银华H股份额、银华H股A份额、银华H股B份额各自基金份额持有人和代理人以所代表的基金份额50%以上多数选举产生一名代表作为该次基金份额持有人大会的主持人。

召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名(或单位名称)、身份证件号码、持有或代表有表决权的基金份额数量、委托人姓名(或单位名称)等事项。

2)通讯开会

在通讯表决开会的方式下，首先由召集人提前30日公布提案，在所通知的表决截止日期后第2个工作日在公证机关及监督人的监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。如监督人经通知但拒绝到场监督，则在公证机关监督下形成的决议有效。

6、表决

(1)银华H股份额、银华H股A份额、银华H股B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表决权。

(2)基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1)一般决议

一般决议须经出席会议的银华H股份额、银华H股A份额、银华H股B份额的各自基金份额持有人(或其代理人)所持表决权的50%以上通过方为有效，除下列2)所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过；

2)特别决议

特别决议须经出席会议的银华H股份额、银华H股A份额、银华H股B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、提前终止基金合同等重大事项必须以特别决议通过方为有效。

(3)基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会核准或者备案，并予以公告。

(4)采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

(5)基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

(6)基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

7、计票

(1)现场开会

1)如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集，则基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举两名基金份额持有人代表与基金管理人、基金托管人授权的一名监督员共同担任监票人；但如果基金管理人和基金托管人的授权代表未出席，则大会主持人可自行选举三名基金份额持有人代表担任监票人。

2)监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点，由大会主持人当场公布计票结果。

3)如大会主持人对于提交的表决结果有异议，可以对投票数进行重新清点；如大会主持人未进行重新清点，而出席大会的基金份额持有人或代理人对大会主持人宣布的表决结果有异议，其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点，大会主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

(2)通讯开会

在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监票人在监督人派出的授权代表的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证；如监督人经通知但拒绝到场监督，则大会召集人可自行授权3名监票人进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。

（三）基金收益分配原则、执行方式

1、基金利润的构成

基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额，基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

2、基金可供分配利润

基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

3、基金收益分配原则

在存续期内，本基金（包括银华H股份额、银华H股A份额、银华H股B份额）不进行收益分配。

（四）与基金财产管理、运用有关费用的提取、支付方式与比例

1、基金费用的种类

(1)基金管理人的管理费，含境外投资顾问收取的费用；

(2)基金托管人的托管费，含境外托管代理行收取的费用；

(3)基金合同生效后的指数许可使用费；

(4)基金财产拨划支付的银行费用；

(5)基金合同生效后的基金信息披露费用；

(6)基金份额持有人大会费用；

(7)基金合同生效后与基金有关的会计师费、律师费和诉讼费、仲裁费等法律费用；

(8)基金的证券交易费用；

(9)证券账户开户费用；

(10)基金上市初费和上市月费；

(11)外汇兑换交易的相关费用；

(12)依法可以在基金财产中列支的其他费用。

2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

（1）基金管理人的管理费

自基金合同生效之日起，本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.00%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×1.00%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

（2）基金托管人的托管费

自基金合同生效之日起，本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.28%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.28%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

（3）基金合同生效后的标的指数许可使用费

本基金按照基金管理人与标的指数许可方所签订的指数使用许可协议中所规定的指数许可使用费计提方法计提指数许可使用费。其中，基金合同生效前的许可使用固定费是为获取使用指数开发基金的权利而支付的费用，不列入基金费用；基金合同生效后的指数许可使用费从基金财产中列支，按每季金额在25,000港币与参考下列公式逐日累计计算的金额中孰高者计。

计算方法如下：

在每个自然日：

H＝E×A÷当年实际天数

H为每个自然日应计提的指数使用费，币种为人民币

A等于0.04%，为"恒生中国企业指数"指数许可使用费的费率

E为前一自然日基金资产净值

指数使用费每日计提，按季支付。由基金管理人向基金托管人发送指数使用费划付指令，经基金托管人复核后于次季度首日起15个自然日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，由基金管理人根据指数使用许可协议所规定的方式支付给标的指数许可方。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

如果指数许可使用费的计算方法和费率等发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算指数使用费。基金管理人应及时按照《信息披露管理办法》的规定在指定媒体进行公告。

4.其他基金费用，由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

（五）基金财产的投资方向和投资限制

1、投资目标

本基金力争对恒生中国企业指数进行有效跟踪，并力争将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控制在0.5%以内，年跟踪误差控制在5%以内，以实现基金资产的长期增值。

2、投资范围

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股、备选股、在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的跟踪同一标的指数的ETF、以及在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的其他股票、固定收益类证券、现金、短期金融工具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的相关规定）。如果法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入本基金的投资范围。

本基金投资于标的指数成份股、备选股、在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的跟踪同一标的指数的ETF的投资比例不低于基金资产的85%，其中，本基金投资于标的指数成份股、备选股的投资比例不低于非现金基金资产的80%；权证市值不超过基金资产净值的3%；现金及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

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（不需召开基金份额持有人大会），可以将其纳入投资范围。

3、投资限制

（1）组合限制

本基金在投资策略上兼顾投资原则以及开放式基金的固有特点，通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。基金的投资组合将遵循以下限制：

1）本基金投资于标的指数成份股、备选股、在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的跟踪同一标的指数的ETF的投资比例不低于基金资产的85%，其中，本基金投资于标的指数成份股、备选股的投资比例不低于非现金基金资产的80%；权证市值不超过基金资产净值的3%；现金及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

2）本基金持有同一家银行的存款不得超过基金净值的20%。银行应当是中资商业银行在境外设立的分行或在最近一个会计年度达到中国证监会认可的信用评级机构评级的境外银行，但在基金托管账户的存款不受此限制。

3）本基金持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不得超过基金资产净值的10%，其中持有任一国家或地区市场的证券资产不得超过基金资产净值的3%。

4）本基金持有非流动性资产市值不得超过基金净值的10%。

前项非流动性资产是指法律或基金合同规定的流通受限证券以及中国证监会认定的其他资产。

5）本基金持有境外基金的市值合计不得超过基金净值的10%，但持有货币市场基金不受此限制。

6）本基金管理人管理的全部基金持有任何一只境外基金，不得超过该境外基金总份额的20%。

7）除应付赎回、交易清算等临时用途以外，借入现金。该临时用途借入现金的比例不得超过基金资产净值的10%。

8）法律法规和基金合同规定的其他限制。

基金管理人应当在基金合同生效后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。若基金超过上述2）-7）项投资比例限制，应当在超过比例后30个工作日内采用合理的商业措施减仓以符合投资比例限制要求。法律法规另有规定的，从其规定。

（2）禁止行为

除中国证监会另有规定外，基金不得有下列行为：

1）购买不动产。

2）购买房地产抵押按揭。

3）购买贵重金属或代表贵重金属的凭证。

4）购买实物商品。

5）除应付赎回、交易清算等临时用途以外，借入现金。该临时用途借入现金的比例不得超过基金资产净值的10%。

6）利用融资购买证券，但投资金融衍生品除外。

7）参与未持有基础资产的卖空交易。

8）从事证券承销业务。

9）不公平对待不同客户或不同投资组合。

10）除法律法规规定以外，向任何第三方泄露客户资料。

11）中国证监会禁止的其他行为。

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（不需召开基金份额持有人大会），则本基金投资不再受相关限制。

（3）金融衍生品投资限制

本基金投资衍生品应当仅限于投资组合避险或有效管理，不得用于投机或放大交易，同时应当严格遵守下列规定：

1）本基金的金融衍生品全部敞口不得高于基金资产净值的100%；

2）本基金投资期货支付的初始保证金、投资期权支付或收取的期权费、投资柜台交易衍生品支付的初始费用的总额不得高于基金资产净值的10%；

3）本基金投资于远期合约、互换等柜台交易金融衍生品，应当符合以下要求：

①所有参与交易的对手方（中资商业银行除外）应当具有不低于中国证监会认可的信用评级机构评级；

②交易对手方应当至少每个工作日对交易进行估值，并且基金可在任何时候以公允价值终止交易；

③任一交易对手方的市值计价敞口不得超过基金资产净值的20%。

4）基金管理人应当在本基金会计年度结束后60个工作日内向中国证监会提交包括衍生品头寸及风险分析年度报告。

（4）本基金可以参与证券借贷交易，并且应当遵守下列规定：

（5）基金不得直接投资与实物商品相关的衍生品。

1）所有参与交易的对手方（中资商业银行除外）应当具有中国证监会认可的信用评级机构评级；

2）应当采取市值计价制度进行调整以确保担保物市值不低于已借出证券市值的102%；

3）借方应当在交易期内及时向本基金支付已借出证券产生的所有股息、利息和分红。一旦借方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留和处置担保物以满足索赔需要；

4）除中国证监会另有规定外，担保物可以是以下金融工具或品种：

①现金；

②存款证明；

③商业票据；

④政府债券；

⑤中资商业银行或由不低于中国证监会认可的信用评级机构评级的境外金融机构（作为交易对手方或其关联方的除外）出具的不可撤销信用证。

5）本基金有权在任何时候终止证券借贷交易并在正常市场惯例的合理期限内要求归还任一或所有已借出的证券；

6）基金管理人应当对基金参与证券借贷交易中发生的任何损失负相应责任。

（5）基金可以根据正常市场惯例参与正回购交易、逆回购交易，并且应当遵守下列规定：

1）所有参与正回购交易的对手方（中资商业银行除外）应当具有中国证监会认可的信用评级机构信用评级；

2）参与正回购交易，应当采取市值计价制度对卖出收益进行调整以确保现金不低于已售出证券市值的102%。一旦买方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留或处置卖出收益以满足索赔需要；

3）买方应当在正回购交易期内及时向本基金支付售出证券产生的所有股息、利息和分红；

4）参与逆回购交易，应当对购入证券采取市值计价制度进行调整以确保已购入证券市值不低于支付现金的102%。一旦卖方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留或处置已购入证券以满足索赔需要；

5）基金管理人应当对基金参与证券正回购交易、逆回购交易中发生的任何损失负相应责任。

（6）基金参与证券借贷交易、正回购交易，所有已借出而未归还证券总市值或所有已售出而未回购证券总市值均不得超过基金总资产的50%。前项比例限制计算，基金因参与证券借贷交易、正回购交易而持有的担保物、现金不得计入基金总资产。

（六）基金资产净值的计算方法和公告方式

基金资产净值是指基金资产总值减去负债（含各项有关税收）后的金额。

本基金的基金合同生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人将至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值；

在开始办理基金份额申购或者赎回之后，基金管理人将在每个开放日后的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日的银华H股份额净值和基金份额累计净值，以及银华H股A份额和银华H股B份额的份额净值；

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定媒体上。

（七）基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

1、本基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同经中国证监会核准后将终止：

（1）基金份额持有人大会决定终止的；

（2）基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人的职务，而在6个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务；

（3）基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金托管人的职务，而在6个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务；

（4）中国证监会规定的其他情况。

2、基金财产的清算

（1）基金财产清算组

1)基金合同终止时，成立基金财产清算组，基金财产清算组在中国证监会的监督下进行基金清算。

2)基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

3)基金财产清算组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算组可以依法进行必要的民事活动。

（2）基金财产清算程序

基金合同终止，应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。基金财产清算程序主要包括：

1)基金合同终止后，发布基金财产清算公告；

2)基金合同终止时，由基金财产清算组统一接管基金财产；

3)对基金财产进行清理和确认；

4)对基金财产进行估价和变现；

5)聘请律师事务所出具法律意见书；

6)聘请会计师事务所对清算报告进行审计；

7)将基金财产清算结果报告中国证监会；

8)参加与基金财产有关的民事诉讼；

9)公布基金财产清算结果；

10)对基金剩余财产进行分配。

（3）清算费用

清算费用是指基金财产清算组在进行基金财产清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算组优先从基金财产中支付。

（4）基金财产按下列顺序清偿：

1)支付清算费用；

2)交纳所欠税款；

3)清偿基金债务；

4)按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款1)—3)项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

（5）基金财产清算的公告

基金财产清算公告于基金合同终止并报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算组公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算结果经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，由基金财产清算组报中国证监会备案并公告。

（6）基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。

（八）争议的处理和适用的法律

对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或与基金合同有关的争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，基金合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

本基金合同受中华人民共和国法律管辖。

（九）基金合同存放地和投资人取得基金合同的方式

基金合同、托管协议、招募说明书或更新后的招募说明书、基金份额发售公告、基金合同生效公告、临时公告、年度报告、半年度报告、季度报告和基金份额净值公告等文本文件在编制完成后，将存放于基金管理人所在地、基金托管人所在地、有关销售机构及其网点，供公众查阅。投资者在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

投资者也可在基金管理人指定的网站上进行查阅。本基金的信息披露事项将在指定媒体上公告。

七、基金财务状况

本基金募集期间发生的信息披露费、会计师费、律师费及其他费用由基金管理人承担，不从基金财产列支，其他各基金销售机构根据本基金招募说明书设定的费率或佣金比例收取认购费。

本基金认购后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

银华恒生中国企业指数分级证券投资基金2014年5月5日资产负债表（未经审计）如下：

银华恒生中国企业指数分级证券投资基金	
2014年5月5日资产负债表	
(除特别注明外，金额单位为人民币元)	
资产	
银行存款	133,249,603.80
结算备付金	–
存出保证金	–
交易性金融资产	–
其中：股票投资	–
债券投资	–
资产支持证券投资	–
衍生金融资产	–
买入返售金融资产	160,000,000.00
应收证券清算款	10,008,759.72
应收股利	–
应收利息	512,808.71
应收申购款	
其他资产	78,514.87
资产总计	303,849,687.10
负债及所有者权益	
负债	
应付证券清算款	–
应付管理人报酬	216,152.62
应付托管费	60,522.75
应付交易费用	–
应付税费	–
应付赎回款	–
其他负债	43,028.71
负债合计	319,704.08
所有者权益	
实收基金	303,487,507.99
未分配利润	42,475.03
所有者权益合计	303,529,983.02
负债及所有者权益总计	303,849,687.10
截至2014年5月5日，银华H股的基金份额净值为 1.0001元，银华H股A的基金份额净值为1.0047元，银华H股B的基金份额净值为0.9956元。	

（下转B11版）

银华基金管理有限公司关于银华恒生中国企业指数分级证券投资基金开通跨系统转托管业务的公告

银华恒生中国企业指数分级证券投资基金（基金代码：161831，以下简称"本基金"）基金合同已于2014年4月9日正式生效。银华基金管理有限公司（以下简称"本基金管理人"）将于2014年5月12日起开始办理本基金的申购和赎回业务，具体业务办理时间请参见《银华恒生中国企业指数分级证券投资基金开放日常申购、赎回及定期定额投资业务的公告》。

为了保证基金份额持有人的利益，根据《银华恒生中国企业指数分级证券投资基金基金合同》的约定，经本基金管理人向深圳证券交易所提出申请，将自2014年5月12日开通办理本基金之基础类份额银华H股份额（场内简称："银华H股"，基金代码：161831）的跨系统转托管业务。

在本基金的募集期，投资者通过场内、场外两种方式进行了认购。通过场外认购本基金的投资者自2014年5月12日起可以通过认购本基金的销售机构办理本基金银华H股份额的跨系统转托管业务，将基金份额转至具有基金代销业务资格的深圳证券交易所会员单位。本基金银华H股份额在开放日常申购业务后，投资者可以通过申购本基金的销售机构办理本基金银华H股份额的跨系统转托管业务。

持有场内银华H股份额的投资者自2014年5月12日起可以通过具有基金代销资格的深圳证券交易所会员单位办理跨系统转托管业务，将基金份额转至场外销售机构或本基金管理人直销机构。

跨系统转托管的具体业务按照中国证券登记结算有限责任公司的相关规定办理。

其他重要提示：

1、场外认购/申购的银华H股份额只有在成功办理跨系统转托管业务后方能申请分拆为银华H股A份额与银华H股B份额。分拆后的银华H股A份额与银华H股B份额方可在深圳证券交易所上市交易。本基金管理人于2014年5月7日同期披露《银华恒生中国企业指数分级证券投资基金之银华H股A份额和银华H股B份额上市交易公告书》，本基金之银华H股A份额和银华H股B份额将自2014年5月12日起开始在深圳证券交易所上市交易。敬请场外认购本基金的投资者根据自身情况办理跨系统转托管业务。

2、如有疑问，请拨打客户服务热线：010-85186558，400-678-3333或登陆本基金管理人网站http://www.yhfund.com.cn获取相关信息。

风险提示：本公司承诺以诚实信用、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。敬请投资者留意投资风险。

特此公告。

银华基金管理有限公司
2014年5月7日

银华恒生中国企业指数分级证券投资基金开放日常申购、赎回及定期定额投资业务的公告

公告送出日期：2014年5月7日

1公告基本信息

基金名称	银华恒生中国企业指数分级证券投资基金		
基金简称	银华恒生国企指数分级（QDII）		
场内基金简称	银华H股		
基金主代码	161831		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2014年4月9日		
基金管理人名称	银华基金管理有限公司		
基金托管人名称	中国建设银行股份有限公司		
基金注册登记机构名称	中国证券登记结算有限责任公司		
公告依据	《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》等法律法规以及《银华恒生中国企业指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称"《基金合同》"）、《银华恒生中国企业指数分级证券投资基金招募说明书》（以下简称"《招募说明书》"）		
申购起始日	2014年5月12日		
赎回起始日	2014年5月12日		
定期定额投资起始日	2014年5月12日		
下属分级基金的基金简称	银华H股A	银华H股B	银华H股
下属分级基金的交易代码	150175	150176	161831
该分级基金是否开放申购、赎回、定期定额投资	否	否	是

2 日常申购、赎回、定期定额投资业务的办理时间

银华恒生中国企业指数分级证券投资基金（以下简称"本基金"）的日常申购、赎回、定期定额投资等基金业务具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所和香港交易所的共同交易日，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本《基金合同》的规定公告暂停申购、赎回、定期定额投资业务时除外。场内业务办理时间为深圳证券交易所交易日交易时间，场外业务办理时间以各销售机构的规定为准。

基金合同生效后，若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

3 日常申购业务

3.1 申购金额限制

投资者办理银华H股份额场外申购时，通过本基金代销机构的代销网点及本基金管理人网上直销交易系统（包括网上交易系统、手机交易系统及电话交易系统，下同）进行申购，投资者以金额申请，每个基金账户首笔申购的最低金额为人民币1,000元（含申购费），每笔追加申购的最低金额为人民币1,000元。直销机构的直销中心仅对机构投资者办理基金业务，基金管理人直销机构的直销中心或各代销机构对最低申购限额及交易级差有其他规定的，以其业务规定为准。

（下转B11版）