

# 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

北京证券交易所（以下简称“北交所”）上市的股票是国内依法发行上市的股票。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》等法律法规规定和基金合同的约定，银华基金管理股份有限公司（以下简称“本公司”）补充增加旗下部分基金可投资于北交所上市的股票。

同时，根据指数定期调整情况，部分基金标的指数纳入北交所股票。为更好地满足基金运作需求，本公司决定自 2024 年 12 月 13 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，并在风险揭示章节补充基金投资北交所股票的风险。

本次调整适用基金：

基金代码	基金名称	场内简称
563180	银华中证高股息策略交易型开放式指数证券投资基金	高股息(扩位简称： 高股息 ETF)
159555	银华中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金	2000 增强 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 12 月 13 日起生效。

投资人可以登录基金管理人网站（[www.yhfund.com.cn](http://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](http://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12月13日

附件：

1、“银华中证高股息策略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
重要提示		增加以下内容： 本基金可根据投资策略需要或市场环境变化，选择将部分基金资产投资于北京证券交易所（以下简称“北交所”）股票或选择不将基金资产投资于北交所股票，基金资产并非必然投资于北交所股票。基金资产投资于北交所股票的特定风险包括但不限于上市公司经营风险、市场风险、股价大幅波动风险、流动性风险、转板风险、退市风险、系统性风险、集中度风险、政策风险和监管规则变化风险等。具体详见本招募说明书中“风险揭示”章节。
九、基金的申购与赎回	（四）申购与赎回的程序 3、申购和赎回的清算交收与登记 …… 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	（四）申购与赎回的程序 3、申购和赎回的清算交收与登记 …… 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

	<p>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><u>份股的现金替代、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>.....</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>(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>(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>.....</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>(4) 退补现金替代</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。</p> <p>.....</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</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</u>上海证券交易所股票。</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</u><u>需要自主决定不买入部分被替代</u><u>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>上海证券交易所连续竞价期间，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</u>上海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</u>上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</p>
--	--	---

	<p>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>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>
<p>十八、风险揭示</p>		<p>增加以下内容：</p> <p>（四）本基金的特定风险</p> <p>27、投资于北交所股票的风险</p> <p>（1）上市公司经营风险</p> <p>北交所上市企业主要为创新成长型</p>

	<p>企业，普遍具有规模小、对技术依赖性强、技术迭代快、议价能力不强等特点，或尚处于初步发展阶段，业务收入、现金流及盈利水平等具有较大不确定性。该类企业抗市场风险和行业风险能力较弱，存在较大经营风险，由此可能对基金净值造成不利影响。</p> <p>（2）股价大幅波动风险</p> <p>相较于沪/深证券交易所，北交所竞价交易设置了更宽的涨跌幅限制，股票上市交易首日不设涨跌幅限制，其后涨跌幅限制为 30%，股价大幅波动的风险可能大于 A 股其他板块，由此可能导致基金净值较大幅度的波动。</p> <p>（3）流动性风险</p> <p>北交所股票投资门槛较高，二级市场上个人投资者参与度相对较低，机构投资者持有个股大量流通盘将导致个股流动性较差，若机构投资者在特定阶段对个股形成一致预期，由此可能导致基金面临无法及时变现及其他相关流动性风险。</p> <p>（4）转板风险</p> <p>北交所上市公司在满足相关法律法规和证监会规定的基本上市条件并符合交易所规定的具体上市条件的，可申请转板上市。无论北交所上市公司是否转板成功，均可能引起基金净</p>
--	---

	<p>值波动。</p> <p>(5) 退市风险</p> <p>北交所上市公司后续经营期间如果触及相关法律法规、证监会及交易所等规定的退市情形,可能面临被终止上市的风险,从而可能给基金净值带来不利影响。</p> <p>(6) 系统性风险</p> <p>因北交所上市公司大部分为新兴产业公司,其商业模式、盈利风险、业绩波动等特征较为相似,基金难以通过分散投资降低投资风险,若股票价格同向波动,将引起基金净值波动。同时,北交所上市公司平移自新三板精选层,从历史来看整体估值受政策阶段性影响较大,所以北交所个股估值相关性较高,政策空窗期或市场表现不佳时,系统性风险将更为显著。</p> <p>(7) 集中度风险</p> <p>北交所为新设交易所,初期可投资标的的较少,投资者容易集中投资于少量个股,市场可能存在高集中度状况。</p> <p>(8) 政策风险</p> <p>国家对高新技术、专精特新企业扶持力度及重视程度的变化会对北交所上市公司带来较大影响,国际经济形势变化对专精特新产业及北交所个股也会带来政策影响。</p> <p>(9) 监管规则变化的风险</p>
--	---

		北交所相关法律、行政法规、部门规章、规范性文件和交易所业务规则，可能根据市场情况进行修订和完善，或者补充制定新的法律法规和业务规则，可能对基金投资运作产生影响，或导致基金投资运作相应调整变化。
--	--	--

2、“银华中证 2000 增强策略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
重要提示		增加以下内容： 本基金可根据投资策略需要或市场环境变化，选择将部分基金资产投资于北京证券交易所（以下简称“北交所”）股票或选择不将基金资产投资于北交所股票，基金资产并非必然投资于北交所股票。基金资产投资于北交所股票的特有风险包括但不限于上市公司经营风险、市场风险、股价大幅波动风险、流动性风险、转板风险、退市风险、系统性风险、集中度风险、政策风险和监管规则变化风险等。具体详见本招募说明书中“风险揭示”章节。
十、基金份额的申购与赎回	（七）申购赎回清单的内容与格式 4、现金替代相关内容 （1）现金替代分为 3 种类型： .....	（七）申购赎回清单的内容与格式 4、现金替代相关内容 （1）现金替代分为 3 种类型： .....

	<p>对于沪市证券，可以设为：“允许”和“必须”。</p> <p>.....</p> <p>当适用于上海证券交易所上市的证券时，“可以现金替代”是指在投资人申购、赎回基金份额时，该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) 对于沪市证券</p> <p>①适用情形：投资者申购和赎回时的沪市证券。登记结构机构对设置可以现金替代的沪市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证券，替代金额的计算公式为：</p> <p>.....</p>	<p>对于非深市证券，可以设为：“允许”和“必须”。</p> <p>.....</p> <p>当适用于非深圳证券交易所上市的证券时，“可以现金替代”是指在投资人申购、赎回基金份额时，该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：深市成份证券和非深市证券。</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) 对于非深市证券</p> <p>①适用情形：投资者申购和赎回时的非深市证券。登记结构机构对设置可以现金替代的非深市证券全部用现</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>上海</u>证券交易所参考价格确定原则发生变化，以<u>上海</u>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>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>上海</u>证券交易所连续竞价期间，根据收到的<u>深圳</u>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>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>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</p>	<p>金替代。</p> <p>②替代金额：对于可以现金替代的<u>非深市</u>证券，替代金额的计算公式为： .....</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</u><u>应</u>证券交易所参考价格确定原则发生变化，以<u>对</u><u>应</u>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>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</u><u>要自主决定不买入部分被替代证券，</u><u>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>非深圳</u>证券交易所连续竞价期间，根据收到的<u>深圳</u>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</p>
--	--	--

	<p>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，确定基金应退还赎回投资者或赎回投资者应补交的款项。</p>	<p>时向<u>非深圳</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>非深圳</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>
<p>十九、风险揭示</p>		<p>增加以下内容：</p> <p>（四）本基金的特定风险</p> <p>29、投资于北交所股票的风险</p> <p>（1）上市公司经营风险</p> <p>北交所上市企业主要为创新成长型企业，普遍具有规模小、对技术依赖性强、技术迭代快、议价能力不强等特点，或尚处于初步发展阶段，业务收入、现金流及盈利水平等具有较大不确定性。该类企业抗市场风险和行业风险能力较弱，存在较大经营风</p>

	<p>险,由此可能对基金净值造成不利影响。</p> <p>(2) 股价大幅波动风险</p> <p>相较于沪/深证券交易所,北交所竞价交易设置了更宽的涨跌幅限制,股票上市交易首日不设涨跌幅限制,其后涨跌幅限制为 30%,股价大幅波动的风险可能大于 A 股其他板块,由此可能导致基金净值较大幅度的波动。</p> <p>(3) 流动性风险</p> <p>北交所股票投资门槛较高,二级市场上个人投资者参与度相对较低,机构投资者持有个股大量流通盘将导致个股流动性较差,若机构投资者在特定阶段对个股形成一致预期,由此可能导致基金面临无法及时变现及其他相关流动性风险。</p> <p>(4) 转板风险</p> <p>北交所上市公司在满足相关法律法规和证监会规定的基本上市条件并符合交易所规定的具体上市条件的,可申请转板上市。无论北交所上市公司是否转板成功,均可能引起基金净值波动。</p> <p>(5) 退市风险</p> <p>北交所上市公司后续经营期间如果触及相关法律法规、证监会及交易所等规定的退市情形,可能面临被终止上市的风险,从而可能给基金净值带</p>
--	--

	<p>来不利影响。</p> <p>(6) 系统性风险</p> <p>因北交所上市公司大部分为新兴产业公司，其商业模式、盈利风险、业绩波动等特征较为相似，基金难以通过分散投资降低投资风险，若股票价格同向波动，将引起基金净值波动。同时，北交所上市公司平移自新三板精选层，从历史来看整体估值受政策阶段性影响较大，所以北交所个股估值相关性较高，政策空窗期或市场表现不佳时，系统性风险将更为显著。</p> <p>(7) 集中度风险</p> <p>北交所为新设交易所，初期可投资标的的较少，投资者容易集中投资于少量个股，市场可能存在高集中度状况。</p> <p>(8) 政策风险</p> <p>国家对高新技术、专精特新企业扶持力度及重视程度的变化会对北交所上市公司带来较大影响，国际经济形势变化对专精特新产业及北交所个股也会带来政策影响。</p> <p>(9) 监管规则变化的风险</p> <p>北交所相关法律、行政法规、部门规章、规范性文件和交易所业务规则，可能根据市场情况进行修订和完善，或者补充制定新的法律法规和业务规则，可能对基金投资运作产生影响，或导致基金投资运作相应调整变</p>
--	--

		化。
--	--	----