

# 银华基金管理有限公司关于以通讯方式召开银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金基金份额持有人大会的公告

## 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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金基金合同》的有关规定，银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金（基金代码：000062）的基金管理人银华基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”或“本公司”）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：自权益登记日即 2016 年 3 月 28 日 15:00 起，至 2016 年 4 月 15 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：北京市西城区西直门外大街 1 号西环广场塔 3 办公楼 12 层 1216 室

邮政编码：100044

联系人：孟必珍、李乐

联系电话：010-58073515

010-58073582

请在信封表面注明：“银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”。

## 二、会议审议事项

本次会议审议事项为《关于银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金转型有关事项的议案》（见附件一）。

上述议案的内容说明见《银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金转型方案说明书》（见附件四）。

## 三、基金份额持有人大会的权益登记日

本次大会的权益登记日为 2016 年 3 月 28 日，即该日交易时间结束后在本基金注册登记机构登记在册的本基金全体基金份额持有人或其授权的代理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

本次持有人大会的表决方式仅限于书面纸质表决。

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

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，并提供本人在注册登记机关预留的有效身份证明文件（包括但不限于身份证、军官证、士兵证、文职证、警官证、户口本和中国护照等）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或经授权的业务公章或基金管理人认可的其他印章（以下合称“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正反面复印件或者护照或其他身份证明文件的复印件，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，并提供被代理的个人投资者身份证件正反面复印件，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，并提供被代理的基金份额持有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），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）。

(5) 以上各项中的公章、批文、开户证明及登记证书，以基金管理人认可的为准。

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权益登记日即 2016 年 3 月 28 日 15:00 起，至 2016 年 4 月 15 日 17:00 止（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：“银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金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办法如下：

公证机构：北京市方正公证处

地址：北京市西城区西直门外大街1号西环广场塔3办公楼12层1216室

邮政编码：100044

联系人：孟必珍、李乐

联系电话：010-58073515

010-58073582

## 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、无法辨认、空白、字迹模糊不清、相互矛盾或意愿无法判断，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，如果能判断收到时间先后的，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；若无法判断收到时间先后的，则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；

2、《关于银华中证成长股债恒定组合30/70指数证券投资基金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%以上通过；

3、本次基金份额持有人大会决议通过的事项在履行必要手续和相关程序之后生效，并须报中国证监会备案。

## 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》的规定，本次持有人大会需要本人直接出具有效表决意见或授权他人代表出具有效表决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 日生效的新修订的《中华人民共和国证券投资基金法》，本基金管理人可在规定时间内就同一议案重新召集基金份额持有人大会，但权益登记日仍为 2016 年 3 月 28 日。

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作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作出授权,则以最新方式或最新授权为准,详细说明见基金管理人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：董恩彤

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、公证机构：北京市方正公证处

联系人：孟必珍、李乐

联系电话：010-58073515

010-58073582

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

2016 年 2 月 23 日

附件一：《关于银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金转型有关事项的议案》

附件二：《银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金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：《银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金转型方案说明书》

附件一：

## 关于银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金转型有关事项的议案

**银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金基金份额持有人：**

为提高基金资产的运作效率，保护基金份额持有人利益，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》和《银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金基金合同》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，提议对银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金（以下简称“银华成长股债 30/70 指数”）实施转型。《银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金转型方案说明书》见附件四。

为实施银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金转型方案，提议授权基金管理人办理本次银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资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《银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金基金合同》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

2016 年 2 月 23 日

附件二：

**银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金**  
**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
《关于银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金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：2016 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、表决意见未填、多填、字迹无法辨认或意愿无法判断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（ <a href="http://www.yhfund.com.cn">http://www.yhfund.com.cn</a> ）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 2016 年 4 月 15 日的以通讯方式召开的银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金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中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金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：2016 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、受托人的表决意见代表委托人本基金账户下全部基金份额的表决意见。

附件四：

## 银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金转型方案说明书

### 一、声明

1、为维护基金份额持有人利益，提高产品的市场竞争力，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》和《银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金基金合同》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，审议关于银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金（以下简称“银华成长股债 30/70 指数”）转型有关事项的议案。

2、本次银华成长股债 30/70 指数转型方案需经参加基金份额持有人大会表决的基金份额持有人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。参加基金份额持有人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中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金基金份额持有人，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在权益登记日基金总份额的 50%以上。

3、基金份额持有人大会表决通过的事项在履行必要手续和相关程序之后生效，并须报中国证监会备案。中国证监会对本次银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金基金份额持有人大会决议的备案，均不表明其对本次转型方案或本基金的投资价值或投资者的收益做出实质性判断或保证。

### 二、银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金转型方案要点

银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金转型方案的主要内容如下：

#### （一）更名

基金名称由“银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金”变更为“银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金”。同时，《银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金基金合同》将变更为《银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。

#### （二）修改投资目标

**原有表述：**本基金力争对中证银华成长股债恒定组合 30/70 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 0.35%以内，年跟踪误差控制在 4%以内。

#### **拟修改为：**

综合使用多种量化策略指导资产配置和选股，在严格控制投资组合风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的中长期稳健增值。

#### （三）修改投资范围

#### **原有表述：**

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括中证银华成长股债恒定组合 30/70 指数的成份证券及其备选成份证券(包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票)、新股(首次公开发行

或增发)、债券回购、权证及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

如法律法规或中国证监会以后允许基金投资的其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围,并且无需召开基金份额持有人大会。

基金的投资组合比例为:本基金投资于中证银华成长股债恒定组合 30/70 指数成份证券及其备选成份证券的组合比例不低于基金资产净值的 90%;投资于权证的比例不得超过基金资产净值的 3%;本基金所持有的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

#### **拟修改为:**

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板股票、创业板股票及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、金融债券、企业债券、公司债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、地方政府债券、可转换公司债券及分离交易可转债、可交换债券以及其他中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、现金、权证、股指期货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)。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,本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,其投资比例遵循届时有效的法律法规和相关规定。

本基金投资组合比例为:股票投资占基金资产的比例为 0%-95%;权证投资占基金资产净值的比例为 0%-3%;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,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%。

如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。

待基金投资其他品种的相关规定颁布后,基金管理人可以在不改变本基金既有投资策略和风险收益特征并在控制风险的前提下,经与基金托管人协商一致后,参与该类业务,以提高投资效率及进行风险管理。届时,基金投资其他品种的风险控制原则、具体参与比例限制、费用收支、信息披露、估值方法及其他相关事项,将按照中国证监会的规定及其他相关法律法规的要求执行。

#### **(四) 修改投资限制**

##### **投资限制部分原有表述:**

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) 本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的 3%;
- (2) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证,不得超过该权证的 10%;
- (3) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%;
- (4) 本基金投资于中证银华成长股债恒定组合 30/70 指数成份证券及其备选成份证券的组合比例不低于基金资产的 90%;本基金所持有的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%;
- (5) 基金财产参与股票发行申购,本基金所申报的金额不超过本基金的总资产,本基金所申报的股票

数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

(6) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；

(7) 相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

如果法律法规对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，本基金在履行适当程序后，可相应调整投资比例限制规定，不需经基金份额持有人大会审议。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金在履行适当程序后，投资不再受相关限制。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 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。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

#### **拟修改为：**

基金的投资组合应遵循以下限制：

(1) 本基金股票投资占基金资产的比例为 0% - 95%；

(2) 本基金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，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券；

(3) 本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；

(4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；

(5) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

(6) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

(7) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；

(8) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；

(9) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

(10) 本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；

(11) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

(12) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上（含 BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

(13) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

(14) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

(15) 当本基金持有股指期货时，遵循以下中国证监会规定的投资限制：

1) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；

2) 本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净

值的 95%；其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

3) 本基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；

本基金管理人应当按照中国金融期货交易所要求的内容、格式与时限向交易所报告所交易和持有的卖出期货合约情况、交易目的及对应的证券资产情况等；

4) 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）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；

5) 本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；

(16) 本基金的基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

(17) 本基金投资流通受限证券，基金管理人应根据中国证监会相关规定，与基金托管人在基金托管协议中明确基金投资流通受限证券的比例，根据比例进行投资。基金管理人应制定严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险；

(18) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 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。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或以变更后的规定为准。

## **（五）修改投资策略**

### **原有表述：**

本基金原则上采用完全复制法，按照成份证券在标的指数中的组成及其基准权重构建投资组合，以拟合、跟踪标的指数的收益表现，并根据标的指数成份证券及其权重的变动而进行相应调整。

考虑到标的指数由中证 500 指数和中证 50 债券指数复合而成，对于基金的权益类资产部分，若因特殊情况（如市场流动性不足、个别成份股被限制投资、法律法规禁止或限制投资等）导致基金的股票投资组合无法获得足够数量的股票时，基金可能不能按照成份股权重持有成份股，基金管理人将采用合理方法替代等指数投资技术适当调整基金投资组合，并可在条件允许的情况下，辅以金融衍生工具进行投资管理，以有效控制基金的跟踪误差，追求尽可能贴近标的指数的表现。

基金的固定收益类资产部分可采用最优复制法，以标的指数的成份债券构成为基础，综合考虑跟踪效果、操作风险等因素构建债券投资组合，并根据本基金资产规模、日常申购赎回情况、市场流动性以及银行间和交易所债券交易特性及交易惯例等情况，进行取整和替代优化，以保证对标的指数的有效跟踪。

## 1. 资产配置策略

本基金主要按照标的指数的成份证券组成及其权重构建基金投资组合,并根据标的指数成份证券及其权重的变动而进行相应调整。

为保证标的指数内权益类资产占 30%，固定收益类资产占 70%的目标资产配置比例水平，标的指数在编制过程中引入了阈值调整机制，即当中证 500 指数与中证 50 债券指数的资产比例偏离目标资产配置比例的幅度达到±5%的上、下限时，中证指数公司将对标指数的资产配置比例进行调整，使得标的指数中，中证 500 指数和中证 50 债券指数的比例能够回复到权益类资产占 30%，固定收益类资产占 70%的目标资产配置比例水平。

## 2. 股票投资组合构建

### (1) 组合构建原则

本基金原则上通过完全复制指数的方法，根据标的指数成份证券中成份股票组成及其基准权重构建股票投资组合。

### (2) 组合构建方法

本基金原则上采用完全复制法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建股票投资组合。当预期成份股发生调整，成份股发生配股、增发、分红等行为，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响，导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以根据市场情况，采取合理措施，在合理期限内进行适当的处理和调整。

### (3) 组合调整

本基金所构建的股票投资组合原则上根据标的指数成份股票组成及其权重的变动而进行相应调整。同时，本基金还将根据法律法规和基金合同中的投资比例限制、申购赎回变动情况、股票增发因素等变化，对股票投资组合进行实时调整。

#### ① 定期调整

根据标的指数的调整规则和对于备选股票的预期，对股票投资组合及时进行调整。

#### ② 临时调整

A. 当上市公司发生增发、配股等影响成份股在指数中权重的行为时，本基金将根据各成份股的权重变化及时调整股票投资组合；

B. 根据本基金的申购和赎回情况，对股票投资组合进行调整；

C. 根据法律、法规的规定，成份股在标的指数中的权重因其它原因发生相应变化的，本基金将做相应调整，以保持基金资产中该成份股的权重同指数一致。

## 3. 债券投资组合构建

### (1) 组合构建方法

本基金在建仓期内，将按照标的指数中各成份债券构成，并综合考虑本基金资产规模、市场流动性和交易成本等因素对其逐步买入。当遇到成份券流动性不足、价格严重偏离合理估值、单只成份券交易量不符合市场交易惯例等其他市场因素及预期标的指数的成份券即将调整或其他影响指数复制的因素时，本基金可以根据市场情况，结合经验判断，对个券权重和券种进行适当调整，以期在规定的风险承受限

度之内，尽量缩小跟踪误差。

当基金规模过小时，根据债券市场成交惯例，基金可能只能购买部分成份券；当基金规模过大时，受到市场流动性和法规限制等影响，基金将从备选成份券中挑选替代债券或替代组合满足跟踪需求。

## (2) 债券投资组合的调整

### ① 定期调整

本基金所构建的债券投资组合部分将定期根据所跟踪标的指数成份债券构成及其权重的变动对债券投资组合进行相应调整。

### ② 不定期调整

1) 当成份券发行量变动，本基金将根据标的指数的新构成进行相应调整；

2) 本基金处理日常申购赎回时，资金量可能无法按照标的指数构成交易相应成份券。本基金将综合考虑交易规模、交易惯例和成份券（或备选成份券）的流动性等因素，对债券投资组合进行动态调整；

3) 若成份券遇到退市、流动性不足、法规限制或组合优化需要等情况，基金管理人将综合考虑跟踪误差最小化和投资者利益，决定部分持有现金或买入相关的替代性组合。

4) 本基金将以一定仓位参与一级市场申购、回购套利交易、个券套利交易和放大交易，以期减小基金运作的有关费用对指数跟踪的影响。

### (3) 替代组合构建方法

由于定期和不定期的调整需求，基金管理人可构建替代组合。构建替代组合的方法如下：

① 按照与被替代债券久期、信用评级相似和交易市场相同的原则，选择标的指数成份券和备选成份券作为备选库；

② 采用备选库中各债券过去较长一段时间的历史数据，分析其与被替代债券的相关性，选择正相关度较高的债券进一步考察；

③ 考察备选券的流动性，综合流动性和相关度两个指标挑选替代券，并使得替代组合与被替代债券的跟踪误差最小化。

### (4) 债券投资组合的优化

为更好地跟踪标的指数走势，我们将采取适当方法对债券投资组合进行整体优化调整，如“久期盯住”、“比例盯住”等。

#### 1) 久期盯住

“久期盯住”策略是指投资组合久期与标的指数久期一致为目标，即满足：

$$\text{Duration}_{\text{index}} = \sum_{i=1}^{50} w_i \times \text{Duration}_{\text{bond}i}$$

#### 拟修改为：

本基金在投资的过程中，将量化策略贯彻到资产配置和选股中。

#### 1、资产配置策略

在大类资产配置过程中，本基金密切关注反映宏观经济走向的相关数据，包括货币供应量、流动性、先导行业景气度、库存周期、PMI、工业生产增速、

通胀水平等。在此基础上，本基金运用量化模型对上述各项指标的时间序列与股票市场指数时间序列的领先、滞后关系进行检验，选出其中关系显著、稳定且符合经济学、金融学原理的指标，作为能较好判断股市预期表现的指标。

此外，本基金还将通过量化的手段，对表征市场情绪和资金流向的诸多指标的时间序列与股票市场指数的时间序列的领先、滞后关系进行检验。这些指标包括基金平均仓位、期指高频数据、股票账户活跃度、分析师多空情绪等。

在综合考虑上述两方面因素的基础上，本基金将对权益类资产、固定收益类资产和现金等各类金融资产的配置比例进行实时动态的调整，力求实现投资组合动态管理最优化。

## 2、股票投资策略

本基金在股票投资过程中，运用量化模型和多种量化选股策略进行信息采集和处理，从而提高对于上市公司盈利变化、成长性变化、特殊事件等投资信息利用的效率，提高投资收益率。

### 1) 价值成长策略

通过量化模型抓取上市公司发布的财务公告数据，按照反映估值水平的指标和反映成长性的指标分别对股票进行排序，选出同时在估值和成长性两方面都表现较好的股票，并构建组合。

### 2) 超跌反转策略

本基金将通过量化模型对在过去一段时间区间内跌幅靠前的股票进行排序，选取公司财务基本面指标表现较好的股票，力图选出基本面稳定但股价超跌的股票进行投资，等待其估值的修复。

### 3) 盈利惊喜策略

通过量化模型关注上市公司最新的财报数据，将业绩增速超过过往财报期平均业绩增速的百分比幅度进行排序，选取其中排序靠前的股票，从而选出业绩增长超预期的股票进行投资。

### 4) 分析师精选策略

优秀的基本面分析师对股票的推荐通常与股票的上涨有较强相关性，一方面来源于优秀分析师对股票的深入研究和挖掘，另一方面来源于分析师的市场影响力。本基金通过量化的方式将卖方分析师的长期模拟组合业绩进行排名，将排名靠前的分析师当前所推荐的股票予以汇总，按照股票当前同时被多少位分析师推荐进行排序，选取同时被最多分析师推荐的股票，在进行风险调整后来构建投资组合。

### 5) 事件驱动策略

个股的突发性事件如股权激励、高管增减持、定向增发、高送转、纳入调出重要指数等都将会带来股票的短期交易性机会。量化的投资方法可以通过对全市场发生重大事件的股票进行快速扫描分析，找到那些预期被正面事件驱动上涨的股票构建组合。

## 3、固定收益类品种投资策略

本基金固定收益类投资的主要目的是风险防御及现金替代性管理。固定收益类品种投资将坚持安全性、流动性和收益性作为资产配置原则，采取久期调整策略、类属配置策略、收益率曲线配置策略，以兼顾投资组合的安全性、收益性与流动性。

## 4、股指期货投资策略

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的

股指期货合约。通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

#### 5、资产支持证券投资策略

本基金管理人通过考量宏观经济形势、提前偿还率、违约率、资产池结构以及资产池资产所在行业景气情况等因素，预判资产池未来现金流变动；研究标的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券平均久期及收益率曲线的影响，同时密切关注流动性变化对标的证券收益率的影响，在严格控制信用风险暴露程度的前提下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益较高的品种进行投资。

#### (六) 修改业绩比较基准

原有表述：

中证银华成长股债恒定组合 30/70 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%

拟修改为：

中证 800 指数收益率×50%+中国债券总指数收益率×50%

#### (七) 调整费率

原来管理费年费率为 0.6%，托管费年费率为 0.2%，标的指数许可使用费年费率为 0.015%。

原来的申购费率和赎回费率如下表：

普通客户适用 申购费率	申购金额 (M, 含申购费)	申购费率
	M<50 万元	1.0%
	50 万元≤M<100 万元	0.8%
	100 万元≤M<200 万元	0.6%
	200 万元≤M<500 万元	0.4%
普通客户适用 赎回费率	M≥500 万元	按笔收取，1000 元/笔
	持有期限 (Y)	赎回费率
	Y<1 年	0.5%
	1 年≤Y<2 年	0.25%
直销养老金客 户适用申购费 率	Y≥2 年	0
	申购金额 (M, 含申购费)	申购费率
	M<50 万元	0.3%
	50 万元≤M<100 万元	0.24%
	100 万元≤M<200 万元	0.18%
直销养老金客 户适用赎回费	200 万元≤M<500 万元	0.12%
	M≥500 万元	按笔收取，1000 元/笔
直销养老金客 户适用赎回费	持有期限 (Y)	赎回费率
	Y<1 年	0.125%

率	1年 $\leq$ Y $<$ 2年	0.0625%
	Y $\geq$ 2年	0

拟修改为：

管理费年费率调整为 1.5%，托管费年费率调整为 0.25%，删除“标的指数许可使用费”。

申购费率和赎回费率调整后如下表：

普通客户适用 申购费率	申购金额 (M, 含申购费)	申购费率
	M $<$ 50 万元	1.50%
	50 万元 $\leq$ M $<$ 100 万元	1.20%
	100 万元 $\leq$ M $<$ 200 万元	1.00%
	200 万元 $\leq$ M $<$ 500 万元	0.60%
	M $\geq$ 500 万元	按笔收取, 1000 元/笔
直销养老金客 户适用申购费 率	申购金额 (M, 含申购费)	申购费率
	M $<$ 50 万元	0.45%
	50 万元 $\leq$ M $<$ 100 万元	0.36%
	100 万元 $\leq$ M $<$ 200 万元	0.30%
	200 万元 $\leq$ M $<$ 500 万元	0.18%
	M $\geq$ 500 万元	按笔收取, 1000 元/笔
赎回费率	持有期限 (Y)	赎回费率
	Y $<$ 7 天	1.50%
	7 天 $\leq$ Y $<$ 30 天	0.75%
	30 天 $\leq$ Y $<$ 1 年	0.50%
	1 年 $\leq$ Y $<$ 2 年	0.25%
	Y $\geq$ 2 年	0%

注：3 个月指 90 天，6 个月指 180 天，1 年指 365 天，2 年指 730 天

本基金对通过直销机构及网上直销交易系统认购、申购的养老金客户与除此之外的其他投资人实施差别的认购、申购费率。

养老金客户指基本养老保险与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老金，包括全国社会保障基金、可以投资基金的地方社会保障基金、企业年金单一计划以及集合计划。如将来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型，基金管理人将发布临时公告将其纳入养老金客户范围，并按规定向中国证监会备案。非养老金客户指除养老金客户外的其他投资人。

本基金的赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，赎回费用在基金份额持有人赎回本基金份额时收取。

对持续持有期少于 30 日的投资人收取的赎回费，将全额计入基金财产；对持续持有期大于等于 30 日但少于 3 个月的投资人收取的赎回费，将赎回费总额的 75% 计入基金财产；对持续持有期大于等于 3 个月但少于 6 个月的投资人收取的赎回费，将赎回费总额的 50% 计入基金财产；对持续持有期大于等于 6 个月的投资人，将赎回费总额的 25% 归入基金财产。未计入基金财产的部分用于支付注册登记费等相关手续费。

#### (八) 授权基金管理人修订基金合同

除上述内容的调整需要修改基金合同以外，考虑到自《银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金基金合同》生效以来，《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及其配套准则等法律法规陆续颁布和实施，基金管理人需要根据现行有效的法律法规要求及转型后的银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金的产品特征修订《银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金基金合同》的相关内容。

综上所述，基金管理人拟提请基金份额持有人大会授权基金管理人按照现行有效的法律法规的规定及转型后的银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金的产品特性相应修订《基金合同》的内容。

### **（九）银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同的生效**

自本次基金份额持有人大会决议生效并公告之日起，由《银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金基金合同》修订而成的《银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效，原《银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金基金合同》同日起失效。

综上所述，拟请基金份额持有人大会授权基金管理人针对上述事项修订基金合同内容。

## **三、基金管理人就方案相关事项的说明**

### **（一）银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金基本情况**

银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金遵照《中华人民共和国证券投资基金法》于 2013 年 1 月 5 日获中国证监会证监许可【2013】9 号文核准募集，基金管理人为银华基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。基金管理人于 2013 年 5 月 22 日获得中国证监会关于本基金备案手续的书面确认，《银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金基金合同》自该日起生效。

### **（二）银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金召开持有人大会的必要性**

从合规的角度来看，根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条，“基金合同生效后，连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续六十个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。”银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金已经出现连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情况，银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金需要转型。

银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金基金资产规模偏小，不利于基金管理人投资管理。为了维护基金份额持有人利益，基金管理人在对投资者需求进行调研的基础上，计划将银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金转型为银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金，故银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金需要转型。

因此，银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金的转型，将有利于帮助投资者参与资本市场，分享中国资本市场成长果实，为投资者提供更多样化、更细分的理财产品。

### **（三）关于本次基金份额持有人大会费用的说明**

根据《银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金基金合同》的规定，本次基金份额持有人大会费用以及会计师费、律师费等相关费用可从基金资产列支。

#### **四、基金转型的主要风险及预备措施**

##### **（一）转型方案被基金份额持有人大会否决的风险**

转型方案存在被基金份额持有人大会否决的风险。为防范此风险，自转型方案说明书公告之日起，基金管理人将提前向基金份额持有人征询意见。如有必要，基金管理人将根据基金份额持有人意见，对基金转型方案进行适当的修订，并按《银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金基金合同》的有关规定重新公告。

如果转型方案未获得基金份额持有人大会批准，基金管理人计划在不少于 60 日的时间间隔后，按照有关规定重新向基金份额持有人大会提交转型方案议案。

##### **（二）预防基金转型后基金运作过程中的相关运作风险**

基金管理人将提前做好充分的内部沟通及外部沟通，避免基金转型后基金运作过程中出现相关操作风险、管理风险等运作风险。

#### **五、反馈及联系方式**

投资者若对本方案的内容有任何意见或建议，欢迎及时反馈给本基金管理人。本基金管理人将根据投资者的反馈意见，进一步完善本方案。

联系人：银华基金管理有限公司客服中心

联系电话：400-678-3333

传真：010-58163027

电子信箱：yhjj@yhfund.com.cn

网站：<http://www.yhfund.com.cn>