中银基金管理有限公司关于以通讯方式召开
中银量化价值混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告

一、会议基本情况

中银基金管理有限公司(以下简称"基金管理人")依据中国证监会证监许可[2017]941号文准予募集注册的中银量化价值混合型证券投资基金(以下简称"本基金")于2017年11月24日成立。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称"《基金法》")、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称"《运作办法》")等法律法规的规定和《中银量化价值混合型证券投资基金基金合同》(以下简称"《基金合同》"或"基金合同")的有关约定,本基金管理人决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会,审议《关于中银量化价值混合型证券投资基金转型的议案》。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2024年2月22日起,至2024年3月11日17:00止(纸质表决票通过专人送交、邮寄送达本公告规定的收件人的,投票表决时间以表决票收件人收到表决票时间为准;通过其他非纸质方式表决的,表决时间以本基金管理人指定系统记录时间或基金管理人指定短信平台收到表决时间为准)。

3、纸质表决票将送达至本基金管理人,具体地址和联系方式如下:

收件人:中银基金管理有限公司中银量化价值混合型证券投资基金基金份额持有人大会投票处

地址:上海市浦东新区银城中路200号中银大厦10层

邮政编码:200120

联系人:曹卿

联系电话:021-38834788/400-888-5566

邮箱:ClientService@bocim.com

传真:021-50960970

请在信封表面注明:"中银量化价值混合型证券投资基金基金份额持有人大会投票专用"。

4、短信投票形式表决票的提交(仅适用于个人投资者)

短信投票形式的会议通讯表决票按本公告规定的方式回复至基金管理人指定的短信平台。

5、电话投票形式表决票的提交(仅适用于个人投资者)

电话投票形式的会议通讯表决票提交按本公告规定的电话投票方式进行。

6、网络投票形式表决票的提交(仅适用于个人投资者)

网络投票形式的会议通讯表决票按本公告规定的方式提交至基金管理人指定的系统。

二、会议审议事项

本次持有人大会审议的事项为《关于中银量化价值混合型证券投资基金转型的议案》(以下简称"《议案》"),《议案》详见附件一。

上述议案的内容说明见《关于中银量化价值混合型证券投资基金转型的议案的说明》,详见附件二。

三、权益登记日

本次大会的权益登记日为2024年2月21日,即在2024年2月21日交易所下午交易时间结束后,在登记机构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并投票表决。

四、投票方式

(一)纸质表决票的填写和寄交方式

1、本次会议表决票见附件四。基金份额持有人可通过剪报、复印或登录基金管理人网站(www.bocim.com)下载并打印等方式获取表决票。

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,并提供本人身份证明文件复印件;

(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相关的业务专用章(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事业单位法人登记证书、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机构公章(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明文件复印件,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)基金份额持有人可根据本公告"五、授权"的规定授权其他个人或机构代其在本次基金份额持有人大会上投票。受托人接受基金份额持有人纸面方式授权代理投票的,应由受托人在表决票上签字或盖章,并提供授权委托书原件以及本公告"五、授权"的"(一)纸面方式授权"中的"3、授权方式"中所规定的基金份额持有人以及受托人的身份证明文件复印件或机构主体资格证明文件复印件;受托人接受基金份额持有人录音电话授权方式授权代理投票的,应依据本公告"五、授权"的"(二)录音电话方式授权"中的规定进行录音电话授权,并由受托人在表决票上签字或签章;但下述第(4)项另有规定的除外;

(4)基金份额持有人使用基金管理人邮寄的专用授权委托征集信函授权基金管理人投票的,接受有效委托的基金管理人应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。

以上各项中的公章、业务专用章、批文、开户证明及登记证书等,以基金管理人的认可为准。

3、基金份额持有人或其受托人需将填妥的表决票和所需的相关文件于会议投票表决起止时间内(自2024年2月22日起,至2024年3月11日17:00止,以本基金管理人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的办公地址(上海市浦东新区银城中路200号中银大厦10层),并请在信封表面注明:"中银量化价值混合型证券投资基金基金份额持有人大会投票专用"。

(二)短信投票(仅适用于个人基金份额持有人)

为方便基金份额持有人参与本次基金份额持有人大会投票,自2024年2月22日0:00起,至2024年3月11日17:00以前(以基金管理人指定短信平台收到表决时间为准),基金管理人提供短信通道供个人投资者参与本次大会投票。

1、短信表决意见内容为"身份证件号码+同意、反对、弃权","同意、反对、弃权"中有且只有一种表决意见。请个人投资者务必按照上述格式要求回复短信,短信表决的效力认定详见本公告"六、计票"中"4、表决票效力的认定"相关约定。

2、基金管理人或基金管理人委托的销售机构将会发送征集投票的提示短信给在基金管理人或基金管理人委托的销售机构处预留手机号码的基金份额持有人,以便于基金份额持有人使用短信通道参与表决。若基金份额持有人原预留手机号码已变更或已不再实际使用的,可选择其他方式进行投票。

3、如因短信通道或通讯故障等不可抗力或非基金管理人人为因素,导致上述投票短信无法及时送达基金份额持有人或本基金管理人无法及时收回投票的,基金管理人不承担短信投票失效的责任,基金份额持有人在截止日前可以选择其他投票方式进行投票。

4、如果基金份额持有人短信回复的内容不完整或有其他不符合要求的情况,基金管理人可以自行选择通过电话回访确认,基金份额持有人可以通过电话授权基金管理人进行投票。在此情况下,由基金管理人客户服务中心与基金份额持有人取得联系,在通话过程中核实基金份额持有人身份后,由人工坐席根据基金份额持有人意愿进行授权记录(录音),从而完成授权。基金份额持有人在授权基金管理人进行投票时,应明确表明具体表决意见。为保护基金份额持有人利益,上述所有通话过程将被录音。

5、短信投票方式仅适用于个人投资者,对机构投资者暂不开通。

(三)电话投票(仅适用于个人基金份额持有人)

为方便基金份额持有人参与大会投票,自2024年2月22日起,至2024年3月11日17:00以前(以基金管理人指定系统记录时间为准),基金份额持有人可拨打本基金管理人客服电话(021-38834788/400-888-5566)并按提示转人工坐席参与本次持有人大会的投票。本基金管理人也将主动与预留联系方式的基金份额持有人取得联系。通话过程中将以回答提问方式核实基金份额持有人身份,身份核实后由人工坐席根据客户意愿进行投票记录从而完成持有人大会的投票。为保护基金份额持有人利益,整个通话过程将被录音。

电话投票方式仅适用于个人投资者,对机构投资者暂不开通。

(四)网络投票(仅适用于个人基金份额持有人)

1、网络投票的方式

为方便基金份额持有人参与本次大会投票,自2024年2月22日0:00起,至2024年3月11日17:00以前(以基金管理人指定系统记录时间为准),基金份额持有人可以通过基金管理人提供的互联网通道进行投票。

2、基金份额持有人可以通过如下方式进行网络投票:

(1)自行登录基金管理人的官方网站(www.bocim.com)、官方微信服务号(微信公众号:中银基金)投票通道参与本次投票。本次持有人大会网络投票链接为:https://weixin.bocim.com/tp1.html。

(2)基金管理人或基金管理人委托的销售机构将通过短信平台向基金份额持有人发送关于本次持有人大会网络投票的短信,基金份额持有人可以通过点击短信中的网页链接进入网络投票页面参与本次投票。

3、基金份额持有人进行网络投票的,应使用开户证件号码、基金账号及登录密码登录网络投票系统,在核实基金份额持有人的身份后根据页面提示进行操作。

4、网络投票方式仅适用于个人投资者,对机构投资者暂不开通。

5、网络投票形式表决票的提交

网络投票形式的会议通讯表决票按本公告规定的方式在基金管理人指定的投票页面进行提交,并届时由召集人(即基金管理人)根据基金合同的约定与其他形式的表决票一并进行统计。

(五)其它投票方式

基金管理人有权根据实际需要,增加或调整中银量化价值混合型证券投资基金基金份额持有人大会的投票方式并在规定媒介上公告。

五、授权

为便于基金份额持有人有尽可能多的机会参与本次基金份额持有人大会,使基金份额持有人在本次基金份额持有人大会上充分表达其意志,基金份额持有人除可以直接投票外,还可以授权他人代其在基金份额持有人大会上投票。

基金份额持有人通过纸面方式授权的,授权委托书的样本请见本公告附件三。基金份额持有人可通过剪报、复印或登录中银基金网站(http://www.bocim.com)下载等方式获取授权委托书样本。

基金份额持有人通过非纸面方式授权的,授权形式及程序应符合本公告的规定。

(一)纸面方式授权

根据法律法规的规定及《基金合同》的约定,基金份额持有人授权他人在基金份额持有人大会上表决需符合以下规则:

1、委托人

本基金的基金份额持有人可委托他人代理行使本次基金份额持有人大会的表决权。投资者在申购本基金的同时也可以签署授权委托书,待申购申请确认后,授权委托书自动生效。

基金份额持有人授权他人行使表决权的票数按该基金份额持有人在权益登记日所持有的基金份额数计算,一份基金份额代表一票表决权。基金份额持有人在权益登记日未持有本基金基金份额的,授权无效。

基金份额持有人在权益登记日是否持有基金份额以及所持有的基金份额的数额以登记机构的登记为准。

2、受托人

基金份额持有人可以委托本基金的基金管理人、基金托管人、销售机构以及其他符合法律规定的机构和个人,代为行使本次基金份额持有人大会上的表决权。

为使基金份额持有人的权利得到有效行使,建议基金份额持有人委托本基金的基金管理人,或基金托管人为受托人。基金管理人可发布临时公告向基金份额持有人建议增加的受托人名单。

3、授权方式

授权委托书的样本请见本公告附件三。基金份额持有人可通过剪报、复印或登录基金管理人网站(www.bocim.com)下载并打印等方式获取授权委托书样本。

(1)基金份额持有人进行授权所需提供的文件

①个人基金份额持有人委托他人投票的,受托人应提供由委托人填妥并签署的授权委托书原件(授权委托书的格式可参考附件三的样本),并提供基金份额持有人的个人身份证明文件复印件。如受托人为个人,还需提供受托人的身份证明文件复印件;如受托人为机构,还需提供该受托人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事业单位法人登记证书、有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等)。如果个人基金份额持有人使用其收到的基金管理人邮寄的专用授权委托征集信函授权时,无需提供身份证明文件复印件,在专用回邮信函上填写个人姓名、身份证明文件号码和具体表决意见,并回寄给基金管理人,该授权委托书即视为有效授权。

②机构基金份额持有人委托他人投票的,受托人应提供由委托人填妥的授权委托书原件(授权委托书的格式可参考附件三的样本),并在授权委托书上加盖该机构公章,并提供该机构基金份额持有人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事业单位法人登记证书、有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等)。如受托人为个人,还需提供受托人的身份证明文件复印件;如受托人为机构,还需提供该受托人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事业单位法人登记证书、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明文件复印件;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事业单位法人登记证书、有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等)。

以上各项中的公章、批文、开户证明及登记证书等,以基金管理人的认可为准。

(2)对基金管理人、基金托管人或销售机构的授权文件的送达。基金份额持有人通过纸面方式对基金管理人、基金托管人或销售机构进行授权的,可通过邮寄授权文件或在基金管理人、基金托管人或销售机构柜台办理授权事宜。

基金份额持有人也可将其填妥的授权委托书和所需的相关文件送交基金管理人、基金托管人或销售机构营业机构。

基金份额持有人也可在授权截止时间前至基金管理人、基金托管人或销售机构的柜台办理授权,填写授权委托书,并提交基金份额持有人身份证明文件。投资者通过直销柜台及指定销售机构网点柜台办理基金交易业务时,直销柜台及指定销售机构网点柜台将为投资者提供纸面方式授权的服务。为保护投资者利益,投资者在交易时,不论投资者是否授权或选择何种授权方式,均不影响交易的进行。

(二)录音电话方式授权

在以下三种情形下,个人基金份额持有人可以采用录音电话方式授权:

1、基金份额持有人拨打基金管理人的客户服务电话(021-38834788/4008885566),并授权基金管理人进行投票。

2、对于选择短信投票的基金份额持有人,其短信回复的内容不完整或有其他不符合要求的情况下,基金管理人可以选择通过电话回访确认,基金份额持有人可以通过电话授权基金管理人进行投票。

基金管理人的客户服务中心在核实基金份额持有人身份后征集基金份额持有人的授权并对征集过程进行电话录音。基金份额持有人通过电话授权委托基金管理人参与大会并进行投票时,请基金份额持有人明确具体表决意见。

录音电话征集授权的方式仅适用于个人基金份额持有人,对机构基金份额持有人不适用。通过基金管理人客户服务电话授权的,受托人仅可为基金管理人。

(三)短信授权

为方便基金份额持有人参与大会,基金管理人可通过短信平台向预留手机号码的个人基金份额持有人发送征集授权短信,基金份额持有人根据征集授权短信的提示以回复短信表明授权意见。

基金份额持有人原预留手机号码已变更或已不再实际使用的,可选择其他方式进行授权。

短信授权的方式仅适用于个人基金份额持有人,对机构基金份额持有人不适用。向基金管理人短信平台回复授权意见的,受托人仅可为基金管理人。

(四)授权效力确定规则

1、同一基金份额存在有效的纸面授权和有效的其他方式授权的,以有效的纸面授权为准。

2、如果同一基金份额存在多次有效纸面授权的,以最后一次有效纸面授权为准。不能确定最后一次纸面授权的,如最后时间收到的授权委托有多次,以表示具体表决意见的授权为准;最后时间收到的多次授权均表示了具体表决意见,若授权表示一致,以一致的授权表示为准;若多次授权同一代理人但授权表示不一致,视为委托人授权受托人选择其中一种授权表示行使表决权;若授权不同代理人且授权表示不一致的,视为授权无效,不计入有效票;最后时间收到的多次授权均未表示具体表决意见的,视为委托人授权受托人按照受托人意志行使表决权。

3、同一基金份额只存在纸面方式授权以外的有效的其他方式授权时,以有效的该种授权方式为准。多次以纸面授权以外的其他方式授权的,以时间在最后的授权为准。如最后时间收到的授权委托有多次,不能确定最后一次授权的,按以下原则处理:若多次授权的授权表示一致的,按照该相同的授权表示计票;若多次授权同一代理人但授权表示不一致的,视为委托人授权代理人投弃权票;若授权不同代理人且授权表示不一致的,视为授权无效,不计入有效票。

4、如果委托人签署的授权委托书没有表示具体表决意见的,视为委托人授权受托人按照受托人意志行使表决权;如委托人在授权委托表示中表达多种表决意见的,视为委托人授权受托人选择其中一种授权表示行使表决权。

5、如委托人既进行委托授权,又送达了有效表决票,则以有效表决票为准。

6、本基金的个人基金份额持有人可通过纸面授权、录音电话授权、短信授权方式授权受托人代为行使表决权。本基金的机构基金份额持有人仅可通过纸面授权方式授权受托人代为行使表决权。

(五)对指定受托人的授权开始时间及截止时间

基金管理人、基金托管人或销售机构接受基金份额持有人授权的开始及截止时间为2024年2月22日至2024年3月11日17:00时。将授权委托书寄送或专人送达基金管理人、基金托管人或销售机构等指定受托人的指定地址或系统的,授权时间以基金管理人、基金托管人或销售机构等指定受托人收到授权委托书的时间为准。

六、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督员在基金托管人(兴业银行股份有限公司)授权代表的监督下在表决截止日期后2个工作日内进行计票,并由公证机关对其计票过程予以公证。

2、基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

3、纸面表决票通过专人送交、邮寄送达本公告规定的收件人的,表决时间以收到时间为准;通过其他非纸面方式表决的,表决时间以本基金管理人指定系统记录时间或基金管理人指定短信平台收到表决时间为准。2024年2月22日前及2024年3月11日17:00以后送达收件人的,为无效表决,不视为已参与本次基金份额持有人大会表决,亦不计入参与本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数之内。

4、表决票效力的认定

(1)纸面表决票的效力认定

1)表决票填写完整清晰,所提供文件符合本公告规定,且在截止时间之前送达本公告规定的收件人的,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、或字迹无法辨认或意愿无法判断或表决意见空白,但其他各项符合本公告规定的,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受托人经有效授权的证明文件的,或未能在截止时间之前送达本公告规定的收件人的,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。

(2)短信表决的效力认定

基金份额持有人通过短信表决方式投票,未使用预留手机号码回复的,视为无效。若使用预留手机号码回复的,需在表决短信里明确选择同意、反对或是弃权的一种,仅提供身份证件号码,但表决意见未选、多选或选择形式不符合要求且未根据本公告进行电话授权的视为弃权。

表决短信里仅有表决意见而未提供身份证件号码、提供的身份证件号码有误或有其他不符合要求的情况且未根据本公告进行电话授权的,为无效表决票。如表决短信里仅有表决意见而未提供身份证件号码、提供的身份证件号码有误或有其他不符合要求的情况,基金管理人可以选择通过电话回访的方式核实持有人的身份、核实表决意见以及授权基金管理人投票事宜,电话回访应当录音。电话回访时能够核实身份并且可以明确授权事项以及有明确表决意见的为有效表决票;能够核实身份但授权不明确或未发表明确表决意见的,视为弃权表决票,计入有效表决票;无法核实身份的为无效表决票。

(3)电话表决的效力认定

在会议投票表决规定期间内拨打客服热线进行电话表决或在会议投票表决规定期间内由基金管理人主动与预留联系方式的基金份额持有人电话联系,该等通话内容形成录音资料,录音内容完整涵盖基金份额持有人身份确认及对所有议案进行的明确表决意见,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。能够核实身份但授权不明确或未发表明确表决意见的,视为弃权表决票,计入有效表决票;无法核实身份的为无效表决票。

(4)网络投票表决的效力认定

基金份额持有人进行网络投票的,应使用开户证件号码、基金账号及登录密码登录网络投票系统,以核实基金份额持有人的身份,否则表决票无效;如基金份额持有人遗忘基金账号,可通过致电基金管理人客户服务中心(021-38834788/400-888-5566)或通过购买本基金基金份额的销售机构进行查询。

(5)重复投票的效力认定

1)如果同一基金份额存在包括有效纸面方式表决和其他非纸面方式有效表决的,以有效的纸面表决为准。其中,如果同一基金份额重复提交纸面表决票的,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:专人送交的以实际递交时间为准,邮寄的以本公告规定的收件人收到的时间为准。

2)如果同一基金份额只存在纸面方式表决以外的有效的其他方式表决时,以有效的该种表决方式为准;多次以其他方式表决的,以时间在最后的表决为准,先送达的表决视为被撤回;最后时间收到的表决有多次,表决相同的,按照该相同的表决计票的;表决不一致的,视为弃权。

5、基金管理人有权根据实际需要增加或调整本基金基金份额持有人大会的投票方式并在规定媒介上公告。新增或调整后的投票方式(如有)的计票以届时管理人公告为准。

七、决议生效条件

1、本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的二分之一(含二分之一);

2、《议案》应当由提交有效表决票的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;

3、本基金份额持有人大会表决通过的事项,将由本基金管理人在自通过之日起5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基金份额持有人大会表决通过之日起生效。法律法规另有规定的,从其规定。

八、二次召集基金份额持有人大会及二次授权

根据《基金法》及《基金合同》的规定,本次基金份额持有人大会需要本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的二分之一以上(含二分之一)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够成功召开,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。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作出授权,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。

九、本次大会相关机构

1、召集人:中银基金管理有限公司

联系人:曹卿

联系电话:021-38834788/400-888-5566

联系地址:上海市浦东新区银城中路200号中银大厦10楼

网址:www.bocim.com

2、监督人:兴业银行股份有限公司

3、公证机构:上海市东方公证处

联系人:林奇

联系电话:021-62154848

4、见证律师:上海市通力律师事务所

十、重要提示

1、请基金份额持有人在邮寄表决票时,充分考虑邮寄在途时间,提前寄出表决票。

2、上述基金份额持有人大会有关公告可通过中银基金管理有限公司网站(www.bocim.com)及中国证监会基金电子披露网站(http://eid.csrc.gov.cn/fund)查阅,投资者如有任何疑问,可致电021-38834788/400-888-5566咨询。

3、本公告的有关内容由中银基金管理有限公司负责解释。

附件一:《关于中银量化价值混合型证券投资基金转型的议案》

附件二:《关于中银量化价值混合型证券投资基金转型的议案的说明》

附件三:《授权委托书(样本)》

附件四:《中银量化价值混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决票》

附件五:《中银沪深300指数增强型证券投资基金基金合同(草案)》

中银基金管理有限公司

2024年2月8日

附件一:

关于中银量化价值混合型证券投资基金转型的议案

中银量化价值混合型证券投资基金基金份额持有人:

为更好地满足基金份额持有人投资需求,根据《基金法》、《运作办法》和《基金合同》的有关规定,本基金管理人经与基金托管人兴业银行股份有限公司协商一致,提议对《中银量化价值混合型证券投资基金基金合同》的内容进行修改,主要内容包括修改基金名称、基金的类别、投资目标、投资范围、投资比例、投资策略、投资限制、业绩比较基准、风险收益特征、估值方法、信息披露、基金费用、增加标的指数等以及据此修订基金合同,并将"中银量化价值混合型证券投资基金"更名为"中银沪深300指数增强型证券投资基金"。

为实施本基金转型方案,提议授权基金管理人根据基金份额持有人大会决议对《基金合同》等法律文件进行修改,并办理本次转型的相关具体事宜。

具体方案和程序可参见《关于中银量化价值混合型证券投资基金转型的议案的说明》。

以上议案,请予审议。

中银基金管理有限公司

2024年2月8日

附件二:

关于中银量化价值混合型证券投资基金转型的议案的说明

一、声明

为更好地满足基金份额持有人投资需求,根据《基金法》、《运作办法》和《基金合同》有关规定,经基金管理人与基金托管人兴业银行股份有限公司(以下简称"兴业银行")协商一致,提议对《中银量化价值混合型证券投资基金基金合同》的内容进行修改,主要内容包括修改基金名称、基金的类别、投资目标、投资范围、投资比例、投资策略、投资限制、业绩比较基准、风险收益特征、估值方法、信息披露、基金费用、增加标的指数等以及据此修订基金合同,并将"中银量化价值混合型证券投资基金"更名为"中银沪深300指数增强型证券投资基金"。

本次中银量化价值混合型证券投资基金转型有关事项需经参加持有人大会表决的本基金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,存在无法获得基金份额持有人大会表决通过的可能。

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,且自本次基金份额持有人大会表决通过之日起生效。法律法规另有规定的,从其规定。中国证监会对本次中银量化价值混合型证券投资基金转型有关事项所作的任何决定或意见,均不表明其对本次本基金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、方案要点

(一)变更基金名称

基金名称由"中银量化价值混合型证券投资基金"变更为"中银沪深300指数增强型证券投资基金"。

(二)变更基金类别

基金类别由"混合型证券投资基金"变更为"股票型证券投资基金"。

(三)增加标的指数

中银沪深300指数增强型证券投资基金以"沪深300指数"作为标的指数。标的指数许可使用费由基金管理人承担,不从基金财产中列支。

(四)变更投资目标

变更前,中银量化价值混合型证券投资基金的投资目标为:"本基金通过量化投资模型精选个股,在严格控制风险的前提下,追求基金资产的长期稳定增值,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。"

变更后,中银沪深300指数增强型证券投资基金的投资目标为:"本基金为股票指数增强型基金,在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上,追求实现超越业绩比较基准的投资回报,谋求基金资产的长期增值。"

(五)变更投资范围

变更前,中银量化价值混合型证券投资基金的投资范围为:"本基金的投资对象是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、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、存托凭证、国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、可转换公司债券、可分离交易可转债、可交换债券、中小企业私募债券、中期票据、短期融资券、超级短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货、国债期货、权证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。"

变更后,中银沪深300指数增强型证券投资基金的投资范围为:"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(含主板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票、存托凭证)、港股通标的股票、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券(含分离交易可转债)及其他经中国证监会允许投资的债券)、股指期货、国债期货、股票期权、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包含协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场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相关规定)。

本基金还可根据法律法规参与融资及转融通证券出借业务。"

(六)变更投资比例

变更前,中银量化价值混合型证券投资基金的投资比例为:"本基金股票及存托凭证投资占基金资产的比例范围为60%-95%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债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%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。股指期货、国债期货的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。"

变更后,中银沪深300指数增强型证券投资基金的投资比例为:"本基金投资于股票的资产不低于基金资产的80%,投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的80%。其中,投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的50%。每个交易日日终在扣除国债期货、股指期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后,本基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。"

(七)变更投资策略

变更前,中银量化价值混合型证券投资基金的投资策略为:

"本基金建立数量化投资策略投资模型,将投资思想通过具体指标、参数的确定体现在模型中,在投资过程中充分发挥数量化投资纪律严格、投资视野宽阔、风险水平可控等优势,切实贯彻自上而下的资产配置和自下而上的个股精选的投资策略,以保证在控制风险的前提下实现收益最大化。

本基金的投资策略包括两部分:自上而下的资产配置策略,判断股票市场和债券市场的走势,以指导本基金的大类资产配置;自下而上投资标的研究,借助量化模型选取低估值同时成长性较好的上市公司股票。

(一)大类资产配置策略

本基金采用"自上而下"的资产配置方法确定各类资产的配置比例。首先,本基金基于宏观经济情况及证券市场整体走势的前瞻性研究,通过研判股票市场和债券市场相对投资收益的周期性特征开展战略资产配置。其次,本基金将从资金与流动性、市场交易特征和市场结构特征等层面开展战术资产配置,在对证券市场当期的系统性风险及各类资产的预期风险收益进行充分分析的基础上,合理调整股票资产、债券资产和其他金融工具的投资权重,以达到控制风险、增加收益的目的。

(二)股票投资策略

本基金采用"自下而上"的数量化选股策略,在纪律化模型约束下,紧密跟踪策略,严格控制运作风险,并根据市场变化趋势,定期对模型进行调整,以改进模型的有效性,从而取得较高的收益。

本基金基于大量历史数据的实证检验构建量化模型,将超额收益的来源归纳为成长因子、价值因子、动量因子、基本面因子、规模因子和流动性因子等。本基金将依据经济周期、行业周期、市场状态以及投资者情绪等多个层面,定期检验各类因子的有效性以及因子之间的关联度,采用定量的模式挑选有效的因子集合作为量化模型的因子,并依据投资目标,权衡风险与收益特征,构建定量选股模型。模型的使用以及因子的判定方法随着市场的变化根据不同的测试环境以及不同的测试结果进行动态的更新。本基金利用量化模型选取最具投资价值的个股进入本基金的股票投资组合。

本基金还将考察对行业及板块有影响的政策制度、对个股有影响的潜在事件等内容,从而对股票投资组合进行优化,在控制风险的前提下追求收益最大化。

(三)存托凭证投资策略

本基金投资存托凭证的策略依照上述境内上市交易的股票投资策略执行。

(四)债券投资策略

在大类资产配置的基础上,本基金将依托基金管理人固定收益团队的研究成果,综合分析市场利率和信用利差的变动趋势,采取久期调整、收益率曲线配置和券种配置等积极投资策略。力争做到保证基金资产的流动性把握债券市场投资机会,实施积极主动的组合管理,精选个券,控制风险,提高基金资产的使用效率和投资收益。

1、久期管理

本基金将在对国内宏观经济要素变化趋势进行分析和判断的基础上,通过有效控制风险,基于对利率水平的预测和混合型基金中债券投资相对被动的特点,进行以"目标久期"为中心的资产配置,以收益性和安全性为导向配置债券组合。

2、期限结构配置

由于期限不同,债券对市场利率的敏感程度也不同,本基金将结合对收益率曲线变化的预测,采取下面的几种策略进行期限结构配置:首先采取主动型策略,直接进行期限结构配置,通过分析和情景测试,确定长期、中期、短期三种债券的投资比例。然后与数量化方法相结合,结合对利率走势、收益率曲线的变化情况的判断,适时采用不同投资组合中债券的期限结构配置。

3、确定类属配置

收益率利差策略是债券资产在类属间的主要配置策略。本基金在充分考虑不同类型债券流动性、税收以及信用风险等因素基础上,进行类属的配置,优化组合收益。

4、个债选择

本基金在综合考虑上述配置原则基础上,通过对个体券种的价值分析,重点考察各券种的收益率、流动性、信用等级,选择相应的最优投资对象。本基金还将采取积极主动的策略,针对市场定价失误和回购套利机会等,在确定存在超额收益的情况下,积极把握市场机会。本基金在已有组合基础上,根据对未来市场预期的变化,持续运用上述策略对债券组合进行动态调整。

5、中小企业私募债券投资策略

中小企业私募债券本质上为公司债,只是发行主体扩展到未上市的中小型企业,扩大了基金进行债券投资的范围。由于中小企业私募债券发行主体为非上市中小企业,企业管理体制和治理结构弱于普通上市公司,信息披露情况相对滞后,对企业偿债能力的评估难度高于普通上市公司,且定向发行方式限制了合格投资者的数量,会导致一定的流动性风险。因此本基金中小企业私募债券的投资将重点关注信用风险和流动性风险。本基金采取自下而上的方法建立适合中小企业私募债券的信用评级体系,对个券进行信用分析,在信用风险可控的前提下,追求合理回报。本基金根据内部的信用分析方法对可选的中小企业私募债券品种进行筛选过滤,重点分析发行主体的公司背景、竞争地位、治理结构、盈利能力、偿债能力、现金流水平等诸多因素,给予不同因素不同权重,采用数量化方法对主体所发行债券进行打分和投资价值评估,选择发行主体资质优良,估值合理且流通相对充分的品种进行适度投资。

(五)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)衍生品投资策略

在法律法规允许的范围内,本基金可基于谨慎原则运用股指期货、国债期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理,以套期保值为目的,对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险,提高投资效率。

1、股指期货投资策略

本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时,将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究,并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征,通过资产配置、品种选择,谨慎进行投资,以降低投资组合的整体风险。

2、国债期货投资策略

国债期货作为利率衍生品的一种,有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。基金管理人将按照相关法律法规的规定,根据风险管理的原则,以套期保值为目的,结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系,对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控,在最大限度保证基金资产安全的基础上,力求实现基金资产的长期稳定增值。

3、权证投资策略

本基金将因为上市公司进行股权分置改革、或增发配售等原因被动获得权证,或者本基金在进行套利交易、避险交易等情形下将主动投资权证。本基金进行权证投资时,将在对权证标的证券进行基本面研究及估值的基础上,结合隐含波动率、剩余期限、标的证券价格走势等参数,运用数量化期权定价模型,确定其合理内在价值,从而构建套利交易或避险交易组合,力求取得最优的风险调整收益。"

变更后,中银沪深300指数增强型证券投资基金的投资策略为:

"本基金为指数增强型基金,以沪深300指数为标的指数,基金股票投资方面主要采用指数增强量化投资策略。力争控制本基金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不超过0.5%,年跟踪误差不超过7.75%,以实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围,基金管理人将采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

指数成份股发生明显负面事件面临退市风险,且指数编制机构暂未作出调整的,基金管理人将按照基金份额持有人利益优先的原则,综合考虑成份股的退市风险、其在指数中的权重以及对跟踪误差的影响,据此制定成份股替代策略,通过提请召开临时投资决策委员会,及时对投资组合进行相应调整。

(一)资产配置策略

本基金为股票指数增强型证券投资基金,为实现有效跟踪标的指数并力争超越标的指数的投资目标,投资于股票的资产不低于基金资产的80%,投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的80%。其中,投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的50%;每个交易日日终在扣除国债期货、股指期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后,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%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

(二)股票投资策略

本基金为指数增强型基金,以沪深300指数为标的指数,股票投资方面主要采用指数增强量化投资策略,力争在控制跟踪误差的基础上获取超越标的指数的投资收益。指数增强量化投资策略主要运用不断迭代的量化模型预测股票超额回报,在力争有效控制组合风险的基础上构建和优化投资组合,其中股票选择以指数成份股及备选成份股为主,同时适当投资于非成份股。

本基金在追求超额收益的同时,需要控制跟踪偏离过大的风险。基金将根据投资组合相对标的指数的暴露度等因素的分析,对组合跟踪效果进行预估,及时调整投资组合,力求将跟踪误差控制在目标范围内。

(三)存托凭证投资策略

本基金投资存托凭证的策略依照上述境内上市交易的股票投资策略执行。

(四)债券投资策略

在大类资产配置的基础上,本基金将依托基金管理人固定收益团队的研究成果,综合分析市场利率和信用利差的变动趋势,采取久期调整、收益率曲线配置和券种配置等积极投资策略。力争做到保证基金资产的流动性把握债券市场投资机会,实施积极主动的组合管理,精选个券,控制风险,提高基金资产的使用效率和投资收益。

(五)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)衍生品投资策略

为了更好地实现投资目标,基金还有权投资于股指期货、股票期权、国债期货和其他经中国证监会允许的衍生工具。

基金参与股指期货交易,应当根据风险管理的原则,以套期保值为目的。在此基础上,主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约,以提高投资效率,从而更好地跟踪标的指数。

基金参与股票期权交易,应当按照风险管理的原则,以套期保值为主要目的。基金管理人将根据审慎原则,建立期权交易决策部门或小组,授权特定的管理人员负责期权的投资审批事项,以防范期权投资的风险。

基金参与国债期货交易,应当根据风险管理的原则,以套期保值为目的。基金管理人将充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征,在风险可控的前提下,适度参与国债期货投资。

(七)融资、转融通证券出借业务投资策略

为了更好地实现投资目标,在综合考虑预期风险、收益、流动性等因素的基础上,本基金可参与融资业务。

为了更好地实现投资目标,在加强风险防范并遵守审慎原则的前提下,本基金可根据投资管理需要参与转融通证券出借业务。本基金将在分析市场情况、投资者类型与结构、基金历史申购赎回情况、出借证券流动性情况等因素的基础上,合理确定出借证券的范围、期限和比例。"

(八)变更投资限制

变更前,中银量化价值混合型证券投资基金的投资限制为:

"1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制:

(1)本基金股票及存托凭证投资占基金资产的比例范围为60%-95%;

(2)本基金每个交易日日终在扣除股指期货和国债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%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;

(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)本基金的基金资产总值不得超过基金资产净值的140%;

(16)本基金投资股指期货或国债期货,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%;在任何交易日日终,持有的买入国债期货合约和股指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;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%;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个交易日基金资产净值的20%;基金所持有的股票市值、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;

(17)本基金在任何交易日日终,持有的买入国债期货合约价值,不得超过基金资产净值的15%;持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的30%;本基金在任何交易日内交易(不包括平仓)的国债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30%;基金所持有的债券(不含到期日在一年以内的政府债券)市值和买入、卖出国债期货合约价值,合计(轧差计算)应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定;

(18)本基金持有单只中小企业私募债券,其市值不得超过本基金资产净值的10%;

(19)本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的15%;本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的30%;

(20)本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%,因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;

(21)本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的,可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致;

(22)本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行;

(23)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。

除第(2)、(12)、(20)、(21)条之外,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。

如果法律法规或监管部门对上述投资组合比例限制进行变更的,以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,在履行适当程序后本基金投资不再受相关限制,不需要经过基金份额持有人大会审议。"

变更后,中银沪深300指数增强型证券投资基金的投资限制为:

"1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制:

(1)本基金股票资产投资比例不低于基金资产的80%,投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的80%;其中,投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的50%;

(2)本基金每个交易日日终在扣除国债期货、股指期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后,本基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;

(3)本基金持有一家公司发行的证券(同一家公司在内地和香港市场同时上市的A+H股合并计算),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(同一家公司在内地和香港市场同时上市的A+H股合并计算),不超过该证券的10%,完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的基金品种可以不受此条款规定的比例限制;

(5)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%;

(6)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%;

(7)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%;

(8)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%;

(9)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;

(10)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;

(11)本基金的基金资产总值不得超过基金资产净值的140%;

(12)本基金若投资股指期货,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%;在任何交易日日终,持有的买入国债期货合约和股指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)、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等;在任何交易日日终,持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%;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个交易日基金资产净值的20%;基金所持有的股票市值、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;

(13)本基金若投资国债期货,在任何交易日日终,持有的买入国债期货合约价值,不得超过基金资产净值的15%;在任何交易日日终,持有的买入国债期货合约和股指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)、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等;在任何交易日日终,持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的30%;本基金在任何交易日内交易(不包括平仓)的国债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30%;基金所持有的债券(不含到期日在一年以内的政府债券)市值和买入、卖出国债期货合约价值,合计(轧差计算)应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定;

(14)本基金若投资股票期权,因未平仓的股票期权合约支付和收取的权利金总额不得超过基金资产净值的10%;开仓卖出认购股票期权的,应持有足额标的证券;开仓卖出认沽股票期权的,应持有合约行权所需的全额现金或交易所规则认可的可冲抵期权保证金的现金等价物;未平仓的股票期权合约面值不得超过基金资产净值的20%。其中,合约面值按照行权价乘以合约乘数计算;基金投资股票期权符合基金合同约定的比例限制(如股票仓位、个股占比等)、投资目标和风险收益特征;

(15)本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的15%;本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的30%;完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合可不受前述比例限制;

(16)本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%,因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;

(17)本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的,可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致;

(18)本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行;

(19)本基金参与转融通证券出借业务,应当遵守以下交易限制:

1)参与转融通证券出借业务的资产不得超过基金资产净值的30%,其中出借期限在10个交易日以上的出借证券应纳入《流动性风险管理规定》所述流动性受限证券的范围;

2)参与转融通证券出借业务的单只证券不得超过基金持有该证券总量的50%;

3)最近6个月内日均基金资产净值不低于2亿元;

4)证券出借的平均剩余期限不得超过30天,平均剩余期限按照市值加权平均计算;

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不符合前述第(19)所规定比例限制的,基金管理人不得新增转融通证券出借业务;

(20)本基金参与融资业务后,在任何交易日日终,持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的95%;

(21)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。

除第(2)、(9)、(16)、(17)、(19)条之外,因证券、期货市场波动、证券发行人合并、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制、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。

如果法律法规或监管部门对上述投资组合比例限制进行变更的,基金管理人在履行适当程序后,以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,在履行适当程序后本基金投资不再受相关限制。"

(九)变更业绩比较基准

由"沪深300指数收益率×80%+中债综合指数收益率×20%。"变更为"沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。"

(十)变更风险收益特征

由"本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金,但低于股票型基金,属于中等风险水平的投资品种。"变更为"本基金为股票型指数增强基金,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。本基金可投资港股通标的股票,将面临需承担汇率风险、境外市场风险以及港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。"

(十一)变更估值方法

变更前,中银量化价值混合型证券投资基金的估值方法为:

"1、证券交易所上市的有价证券的估值

(1)交易所上市的有价证券(包括股票、权证等),以其估值日在证券交易所挂牌的市价(收盘价)估值;估值日无交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,以最近交易日的市价(收盘价)估值;如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价格;

(2)交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(本基金合同另有规定的除外),选取估值日第三方估值机构提供的相应品种对应的估值净价估值;

(3)交易所上市交易的可转换债券按估值日收盘全价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值;估值日没有交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化,按最近交易日债券收盘全价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价格;

(4)交易所上市不存在活跃市场的有价证券,采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值。

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理:

(1)送股、转增股、配股和公开增发的新股,按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值;该日无交易的,以最近一日的市价(收盘价)估值;

(2)首次公开发行未上市的股票、债券,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值;

(3)对银行间市场未上市,且第三方估值机构未提供估值价格的债券,按成本估值;

(4)首次公开发行有明确锁定期的股票,同一股票在交易所上市后,按交易所上市的同一股票的估值方法估值;非公开发行有明确锁定期的股票,按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3、全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种,采用估值技术确定公允价值。

4、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的,按债券所处的市场分别估值。

5、当发生大额申购或赎回情形时,可以采用摆动定价机制,以确保基金估值的公平性。

6、中小企业私募债券,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值。

7、股指期货合约一般以估值当日结算价进行估值,估值当日无结算价的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化的,采用最近交易日结算价估值。当日结算价及结算规则以《中国金融期货交易所结算细则》为准。

8、国债期货合约以估值日的结算价估值。估值当日无结算价的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化的,采用最近交易日结算价估值。如法律法规今后另有规定的,从其规定。

9、本基金投资存托凭证的估值核算,依照境内上市交易的股票执行。

10、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的,基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的价格估值。

11、相关法律法规以及监管部门有强制规定的,从其规定。如有新增事项,按国家最新规定估值。"

变更后,中银沪深300指数增强型证券投资基金的估值方法为下述内容,同上增加估值原则:

"三、估值原则

基金管理人在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时,应符合《企业会计准则》、监管部门有关规定。

(一)对存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种,在估值日有报价的,除会计准则规定的例外情况外,应将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量。估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的,应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的,应对报价进行调整,确定公允价值。

与上述投资品种相同,但具有不同特征的,应以相同资产或负债的公允价值为基础,并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等,如果该限制是针对资产持有者的,那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外,基金管理人不应考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(二)对不存在活跃市场的投资品种,应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时,应优先使用可观察输入值,只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下,才可以使用不可观察输入值。

(三)如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件,使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在0.25%以上的,应对估值进行调整并确定公允价值。

四、估值方法

1、证券交易所上市的有价证券的估值

(1)交易所上市的有价证券(包括股票等),以其估值日在证券交易所挂牌的市价(收盘价)估值;估值日无交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,以最近交易日的市价(收盘价)估值;如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价格;

(2)对在交易所市场上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种(另有规定的除外),选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值;

对在交易所市场上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种(本基金合同另有规定的除外),建议选取第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价。

(3)交易所上市交易的可转换债券以每日收盘价作为估值全价;

(4)交易所上市不存在活跃市场的有价证券,采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券,采用估值技术确定公允价值,如成本能够近似体现公允价值,基金管理人亦可采用,但将持续评估上述做法的适当性,并在情况发生改变时做出适当调整,确保估值结果的公允性。

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理:

(1)送股、转增股、配股和公开增发的新股,按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值;该日无交易的,以最近一日的市价(收盘价)估值;

(2)首次公开发行未上市的股票,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值;

(3)发行时明确一定期限限售期的股票(包括但不限于非公开发行有明确锁定期的股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等,不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票)按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3、全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种,以第三方估值机构提供的价格数据估值;对银行间市场未上市,且第三方估值机构未提供估值价格的债券,按成本估值。

4、同一股票或债券同时在两个或两个以上市场交易的,按股票或债券所处的市场分别估值。

5、股指期货合约以估值当日结算价进行估值,估值当日无结算价的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化的,采用最近交易日结算价估值。如法律法规今后另有规定的,从其规定。

6、国债期货合约以估值日的结算价估值。估值当日无结算价的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化的,采用最近交易日结算价估值。如法律法规今后另有规定的,从其规定。

7、股票期权合约,一般以股票期权当日结算价进行估值,估值当日无结算价的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化的,采用最近交易日结算价估值。

8、在基金估值日,港股通投资的股票按其在香港联合交易所的收盘价估值;估值日无交易的,以最近交易日的收盘价估值。

在基金估值日,港股通投资持有外币证券资产估值涉及到港币对人民币汇率的,可参考当日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价,或其他可以反映公允价值的汇率进行估值。

若本基金现行估值汇率不再发布或发生重大变更,或市场上出现更为公允、更适合本基金的估值汇率时,基金管理人与基金托管人协商一致后可根据实际情况调整本基金的估值汇率,无需召开基金份额持有人大会。

9、本基金投资存托凭证的估值核算,依照境内上市交易的股票执行。

10、本基金参与融资和转融通证券出借业务的,按照相关法律法规和行业协会的相关规定进行估值。

11、当发生大额申购或赎回情形时,可以采用摆动定价机制,以确保基金估值的公平性。

12、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的,基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的价格估值。

13、相关法律法规以及监管部门有强制规定的,从其规定。如有新增事项,按国家最新规定估值。"

(十二)变更基金费用

1、基金管理费由"按前一日基金资产净值的1.20%年费率计提"变更为"按前一日基金资产净值的0.80%年费率计提"。

2、基金托管费由"按前一日基金资产净值的0.20%的年费率计提"变更为"按前一日基金资产净值的0.15%的年费率计提"。

(十三)修改基金合同终止条款

由"《基金合同》生效后,连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元的,基金管理人应当在定期报告中予以披露;连续60个工作日出现前述情形的,基金管理人应当终止《基金合同》,并按照《基金合同》的约定程序进行清算,不需要召开基金份额持有人大会。

法律法规另有规定时,从其规定。"

变更为"《基金合同》生效后,连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的,基金管理人应当在定期报告中予以披露;连续50个工作日出现前述情形的,基金管理人应当按照《基金合同》的约定程序进行清算并终止《基金合同》,不需要召开基金份额持有人大会。

法律法规或中国证监会另有规定时,从其规定。"

(十四)删除基金的收益与分配中的以下限制:"基金红利发放日距离收益分配基准日(即可供分配利润计算截止日)的时间不得超过15个工作日。"

(十五)调整对持续持有C类基金份额期限长于7日(含)但少于30日的投资人收取的赎回费率:由0.75%变更为0.50%。

(十六)增加侧袋机制相关内容

(十七)删除与基金发售、认购和募集备案有关的内容及表述,根据此次变更注册事项新增"基金的历史沿革"及"基金的存续"章节。

(十八)其他修订

除上述内容的调整需要修改《基金合同》以外,基金管理人根据法律法规更新、基金实际运作情况、基金管理人和基金托管人信息更新、转型后的基金特点对基金合同的其他相关内容进行必要修订。

基金管理人将根据修订的基金合同相应修订基金的托管协议和招募说明书等法律文件。

(十九)基金合同的具体修改内容详见附件五:《中银沪深300指数增强型证券投资基金基金合同(草案)》。

三、基金管理人就方案相关事项的说明

1、本基金的基本情况

本基金经2017年6月16日中国证监会证监许可[2017]941号文准予募集注册,基金托管人为兴业银行股份有限公司。

本基金自2017年10月23日至2017年11月17日止进行公开募集,募集结束后基金管理人向中国证监会办理基金合同生效备案手续。经中国证监会书面确认,《基金合同》于2017年11月24日生效。

2、基金管理人将严格保证基金合同及托管协议修订的合法合规

基金管理人将严格按照基金份额持有人大会决议修订基金合同及托管协议。修订后的基金合同及托管协议由基金管理人进行公告和报中国证监会备案。

3、关于本次基金份额持有人大会费用的说明

根据《基金合同》的规定,本次基金份额持有人大会费用以及律师费等相关费用可从基金财产列支。

四、转型方案的可行性

1、法律可行性

在《基金法》第八十三条到第八十六条对基金份额持有人大会的召集人、召开形式以及其相关事宜都作了规定与说明,这为基金份额持有人大会的召开流程提供了法律依据。

本次基金份额持有人大会决议属于特别决议,经参加大会的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,决议即可生效。

因此,本基金转型有关事项不存在法律方面的障碍。

2、技术可行性

为了保障本基金基金份额持有人大会的顺利召开,基金管理人成立了工作小组,筹备、执行基金份额持有人大会相关事宜。基金管理人与基金托管人、律师事务所、公证机关、投资者进行了充分沟通,保证基金份额持有人大会可以顺利召开。

本次基金份额持有人大会决议生效并公告后,本基金将公告修订后的《基金合同》及《托管协议》,并在法律法规规定的时间内更新《招募说明书》。

本基金的基金管理人、基金托管人已就本基金转型有关事项进行了充分沟通和细致准备,技术可行。

因此,转型方案不存在运营技术层面的障碍。

五、转型方案的主要风险及预备措施

本次转型方案的主要风险是议案被持有人大会否决的风险。

在提议并确定具体方案之前,基金管理人已同基金份额持有人进行了沟通,认真听取了基金份额持有人意见,拟定议案综合考虑了基金份额持有人的要求。议案公告后,基金管理人还将再次征询基金份额持有人意见。如有必要,基金管理人将根据持有人意见,对方案进行适当的修订,并重新公告。基金管理人可在必要情况下,预留出足够的时间,以做二次召开或推迟基金份额持有人大会的召开的充分准备。

如果方案未获得基金份额持有人大会批准,基金管理人计划在规定时间内,按照有关规定重新向基金份额持有人大会提交议案。

六、基金管理人联系方式

基金份额持有人若对本方案的内容有任何意见和建议,请通过以下方式联系:

基金管理人:中银基金管理有限公司

客服电话:021-38834788/400-888-5566

公司网站:www.bocim.com

附件三:

授权委托书(样本)

本人(或本机构)持有了中银量化价值混合型证券投资基金(以下简称"本基金")的基金份额,就中银基金管理有限公司官网(www.bocim.com)、中国证监会基金电子披露网站(http://eid.csrc.gov.cn/fund)及规定报刊上公布的《中银基金管理有限公司关于以通讯方式召开中银量化价值混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》所述需基金份额持有人大会审议的事项,本人(或本机构)的意见为(请在意见栏下方划"√"):

审议事项	同意	反对	弃权
关于中银量化价值混合型证券投资基金转型的议案			

本人(或本机构)特此授权__________代表本人(或本机构)参加审议上述事项的基金份额持有人大会,并按照上述意见行使表决权。本人(或本机构)同意受托人转授权,转授权仅限一次。

上述授权有效期自签署日起至审议上述事项的基金份额持有人大会会议结束之日止。若中银量化价值混合型证券投资基金重新召开审议相同议案的持有人大会的,本授权继续有效。

委托人(签字/盖章):

委托人证件号码(填写):

委托人基金账户号(填写):

受托人(签字/盖章):

受托人身份证件号或营业执照号:

以上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,委托人所持基金份额数以持有人大会权益登记日为准。基金账户空白、多填、错填、无法识别等情况的,将被默认代表此基金份额持有人所持有的本基金所有份额。

签署日期: 年 月 日

授权委托书填写注意事项:

1. 本授权委托书仅为样本供基金份额持有人参考使用。基金份额持有人也可以自行制作符合法律规定及《基金合同》要求的授权委托书。

2.基金份额持有人可以委托本基金的基金管理人、基金托管人、销售机构以及其他符合法律规定的机构和个人,代为行使本次基金份额持有人大会上的表决权。

3.如委托人未在授权委托书中明确表示其表决意见的,视为委托人授权受托人按照受托人的意志行使表决权;如委托人在授权委托表示中表达多种表决意见的,视为委托人授权受托人选择其中一种授权表示行使表决权。

4.本授权委托书(样本)中"委托人证件号码",指基金份额持有人认购或申购本基金时的证件号码或该证件号码的更新。

5.如本次持有人大会权益登记日,投资者未持有本基金的基金份额,则其授权无效。

附件四:

中银量化价值混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决票

基金份额持有人姓名或名称:			
证件号码(身份证件号/营业执照号/其他):			
基金账户号:			
审议事项	同意	反对	弃权
关于中银量化价值混合型证券投资基金转型的议案			
基金份额持有人(或受托人)签名或盖章: 年 月 日			
说明: 请以打"√"方式在审议事项后注明表决意见。持有人必须选择一种且只能选择一种表决意见。表决意见代表基金份额持有人本基金账户下全部基金份额的表决意见。基金账户空白、多填、错填、无法识别等情况的,将被默认代表此基金份额持有人所持有的本基金所有份额。表决意见未选、多选或字迹无法辨认或意愿无法判断或表决意见空白的表决票均视为投票人放弃表决权利,委托人本基金账户下全部基金份额的表决结果均计为"弃权"。签名或盖章部分填写不完整、不清晰的表决票计为无效表决票。			

附件五:《中银沪深300指数增强型证券投资基金基金合同(草案)》

第一部分 前言

一、订立本基金合同的目的、依据和原则

1、订立本基金合同的目的是保护投资人合法权益,明确基金合同当事人的权利义务,规范基金运作。

2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国民法典》、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称"《基金法》")、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称"《运作办法》")、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》(以下简称"《销售办法》")、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称"《信息披露办法》")、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称"《流动性风险管理规定》")、《公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引》(以下简称"《指数基金指引》")和其他有关法律法规。

3、订立本基金合同的原则是平等自愿、诚实信用、充分保护投资人合法权益。

二、基金合同是规定基金合同当事人之间权利义务关系的基本法律文件,其他与基金相关的涉及基

(下转B087版)