中银基金管理有限公司关于以通讯方式召开中银稳健添利债券型发起式证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告

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[2012]1680 号文准予募集注册的中银稳健添利债券型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)于 2013 年 2 月 4 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》等法律法规的规定和《中银稳健添利债券型发起式证券投资基金基金合同》(以下简称“《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《关于中银稳健添利债券型发起式证券投资基金修改收益分配条款的议案》。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 2020 年 8 月 14 日起,至 2020 年 9 月 7 日 17:00 止(投票表决时间以表决票收件人收到表决票时间为准)。

3、通讯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稳健添利债券型发起式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 45 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:“中银稳健添利债券型发起式证券投资基金基金份额持有人大会投票专用”。

二、会议审议事项

本次持有人大会审议的事项为《关于中银稳健添利债券型发起式证券投资基金修改收益分配条款的议案》(以下简称“《议案》”)、《议案》详见附件一。

上述议案的内容说明见《关于中银稳健添利债券型发起式证券投资基金修改收益分配条款议案的说明》,详见附件二。

三、权益登记日

本次大会的权益登记日为 2020 年 8 月 13 日,即在 2020 年 8 月 13 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

1、本次持有人大会的表决方式仅限于书面纸质表决。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,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。

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 2020 年 8 月 14 日起,至 2020 年 9 月 7 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 45 层),并请在信封表面注明:“中银稳健添利债券型发起式证券投资基金基金份额持有人大会投票专用”。

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。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:

(一)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。

(二)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。

(三)授权方式

本基金的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。

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下载并打印(www.bocim.com)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。

(四)授权效力确定规则

(1)如果同一基金份额存在多次有效授权的,以最后一次授权为准。不能确定最后一次授权的,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未表示具体表决意见的,若授权表示一致,以一致的授权表示为准;若授权表示不一致,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;

(2)基金份额持有人以非纸面方式进行授权的,为无效授权;

(3)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;

(4)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。

(五)对基金管理人的授权开始时间及截止时间

基金管理人接受基金份额持有人授权的开始及截止时间为 2020 年 8 月 14 日至 2020 年 9 月 7 日 16:30 时。授权时间以基金管理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票人在基金托管人(招商银行股份有限公司)授权代表的监督下在表决截止日期后第 2 个工作日进行计票,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、表决票效力的认定如下:

(1)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。2020 年 8 月 14 日前及 2020 年 9 月 7 日 17:00 以后送达收件人的表决票,均为无效表决。

(2)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、模糊不清、相互矛盾或无法辨认,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。

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:

i.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;

ii.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;

iii.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,邮寄的以本公告规定的收件人收到的时间为准。

七、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持有的基金份额占在权益登记日基金总份额的 50%以上;

2、《关于中银稳健添利债券型发起式证券投资基金修改收益分配条款的议案》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 50%以上(含本数)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占权益登记日基金总份额的 50%以上方可举行。根据《基金法》,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 26 楼

网址:www.bocim.com

2、监督人:招商银行股份有限公司

3、公证机构:上海市静安公证处

联系人:陈思清

联系电话:021-32170132

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)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:《关于中银稳健添利债券型发起式证券投资基金修改收益分配条款的议案》

附件二:《关于中银稳健添利债券型发起式证券投资基金修改收益分配条款议案的说明》

附件三:《授权委托书(样本)》

附件四:《中银稳健添利债券型发起式证券投资基金基金份额持有人大会表决票》

中银基金管理有限公司

2020 年 8 月 10 日

附件一:

关于中银稳健添利债券型发起式证券投资基金

修改收益分配条款的议案

中银稳健添利债券型发起式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《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《中银稳健添利债券型发起式证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)的有关规定,本基金管理人经与基金托管人招商银行股份有限公司协商一致,提议:

1、“在符合有关基金分红条件的前提下,本基金收益每年最多分配 12 次,某一类基金份额的每份基金份额每次本基金收益分配比例不低于收益分配基准日该类基金份额的每份基金份额可供分配利润的 60%”修改为“在符合有关基金分红条件的前提下,基金管理人可以根据实际情况进行收益分配,具体分配方案以公告为准,若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配”;

2、根据前述变更修订《基金合同》和其他法律文件。

修改收益分配条款的具体方案和程序可参见《关于中银稳健添利债券型发起式证券投资基金修改收益分配条款议案的说明》。

以上提案,请予审议。

中银基金管理有限公司

2020 年 8 月 7 日

附件二:

关于中银稳健添利债券型发起式证券投资基金

修改收益分配条款议案的说明

一、声明

为更好地满足基金份额持有人投资需求,根据《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《中银稳健添利债券型发起式证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)有关规定,经基金管理人与基金托管人招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)协商一致,审议变更:1、“在符合有关基金分红条件的前提下,本基金收益每年最多分配 12 次,某一类基金份额的每份基金份额每次本基金收益分配比例不低于收益分配基准日该类基金份额的每份基金份额可供分配利润的 60%”修改为“在符合有关基金分红条件的前提下,基金管理人可以根据实际情况进行收益分配,具体分配方案以公告为准,若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配”;2、根据前述变更修订《基金合同》和其他法律文件。

本次中银稳健添利债券型发起式证券投资基金修改收益分配条款方案需经参加持有人大会表决的中银稳健添利债券型发起式证券投资基金的基金份额持有人或其代理人所持表决权的 50%以上(含本数)通过方为有效,存在无法获得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稳健添利债券型发起式证券投资基金修改收益分配条款方案所作的任何决定或意见,均不表明其对本次修改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。

具体方案如下:

一、方案要点

1、修改收益分配条款

为更好地满足基金份额持有人投资需求,“在符合有关基金分红条件的前提下,本基金收益每年最多分配 12 次,某一类基金份额的每份基金份额每次基金收益分配比例不低于收益分配基准日该类基金份额的每份基金份额可供分配利润的 60%”修改为“在符合有关基金分红条件的前提下,基金管理人可以根据实际情况进行收益分配,具体分配方案以公告为准,若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配”。

2、授权基金管理人修订基金合同、托管协议、招募说明书

基金管理人提请基金份额持有人大会授权根据上述变更修改基金合同、托管协议、招募说明书。

3、基金份额持有人大会决议生效

本次基金份额持有人大会决议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。

基金管理人将自决议生效之日起依照《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的有关规定在规定媒介上公告。

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,基金管理人完成基金合同内容修订并经基金托管人审核同意后,将报中国证监会备案。

二、基金管理人就方案相关事项的说明

1、中银稳健添利债券型发起式证券投资基金基本情况

中银稳健添利债券型发起式证券投资基金遵照《中华人民共和国证券投资基金法》于 2013 年 2 月 4 日成立,基金托管人为招商银行股份有限公司,基金募集规模达 1,793,459,044.66 份基金份额,已顺利运作至今。

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《中银稳健添利债券型发起式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律师费等相关费用可以基金资产列支。

三、修改收益分配条款的可行性

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一般决议,经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的 50%以上(含 50%)通过,决议即可生效。

因此,修改收益分配条款不存在法律方面的障碍。

2、技术可行性

为了保障中银稳健添利债券型发起式证券投资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《中银稳健添利债券型发起式证券投资基金基金合同》及《中银稳健添利债券型发起式证券投资基金托管协议》,并在法律法规规定的时间内更新《中银稳健添利债券型发起式证券投资基金招募说明书》。

本基金的基金管理人、基金托管人已就修改收益分配条款事项进行了充分沟通和细致准备,技术可行。

因此,修改收益分配条款不存在运营技术层面的障碍。

四、修改收益分配条款的主要风险及预备措施

本次修改收益分配条款的主要风险是议案被持有人大会否决的风险。

在提议修改收益分配条款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,对修改收益分配条款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。

如果修改收益分配条款方案未获得持有人大会批准,基金管理人计划在规定时间内,按照有关规定重新向持有人大会提交修改收益分配条款的议案。

五、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:《中银稳健添利债券型发起式证券投资基金基金合同》具体修改内容

修改前:

基金合同 十六、基金的收益与分配

(三)收益分配原则

本基金收益分配应遵循下列原则:

1.本基金的同一类别的每一基金份额享有同等收益分配权;

2.基金收益分配后基金份额净值不能低于面值,即基金收益分配基准日的某一类基金份额净值减去该类份额每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;

3.在符合有关基金分红条件的前提下,本基金收益每年最多分配 12 次,某一类基金份额的每份基金份额每次基金收益分配比例不低于收益分配基准日该类基金份额的每份基金份额可供分配利润的 60%;

修改后:

基金合同 十六、基金的收益与分配

(三)收益分配原则

本基金收益分配应遵循下列原则:

1.本基金的同一类别的每一基金份额享有同等收益分配权;

2.基金收益分配后基金份额净值不能低于面值,即基金收益分配基准日的某一类基金份额净值减去该类份额每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;

3.在符合有关基金分红条件的前提下,本基金收益可以根据实际情况进行收益分配,具体分配方案以公告为准,若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配;

基金合同摘要部分涉及以上内容的一并进行修订。

附件三:

授权委托书(样本)

本人(或本机构)持有了中银稳健添利债券型发起式证券投资基金(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)及 2020 年 8 月 7 日在《证券日报》公布的《中银基金管理有限公司关于以通讯方式召开中银稳健添利债券型发起式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
关于中银稳健添利债券型发起式证券投资基金修改收益分配条款的议案			

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。若中银稳健添利债券型发起式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。

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《中银稳健添利债券型发起式证券投资基金基金合同》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表示中明确其表决意见的,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:

中银稳健添利债券型发起式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
关于中银稳健添利债券型发起式证券投资基金修改收益分配条款的议案			
基金份额持有人(或受托人)签名或盖章: 2020 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。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。

(上接C69版)

电话:0755-23999888

传真:0755-23999833

联系人:蔡海峰

(三)出具法律意见书的律师事务所和经办律师

名称:上海市通力律师事务所

住所:上海市浦东新区银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址:上海市浦东新区银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人:俞卫锋

经办律师:安东、陈颖华

电话:021-31358666

传真:021-31358600

联系人:陈颖华

(四)审计基金财产的会计师事务所和经办注册会计师

名称:毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)

住所:北京市东城区东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层

办公地址:北京市东城区东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层

执行事务合伙人:邹俊

经办注册会计师:蒙友明、王磊

电话:010-85085000 0755-25471000

传真:010-85085111 0755-82668930

联系人:蔡正轩

四、基金的名称

民生加银创新成长混合型证券投资基金

五、基金的类型

混合型证券投资基金

六、基金的投资目标

在有效控制风险的前提下,通过精选科技创新、消费升级等具备阶段性成长机会,并具有良好公司治理结构、独特核心竞争优势的优质上市公司,谋求基金资产的稳健增值,力争为投资者创造高于业绩比较基准的投资回报。

七、基金的投资方向

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、创业板以及其他经中国证监会批准发行上市的股票)、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许买卖的香港联合交易所上市股票(以下简称“港股通标的股票”)、债券(包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换公司债券、央行票据、中期票据、短期融资券(含超短期融资券)、中小企业私募债等)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、现金、权证、股指期货、国债期货等以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具(但需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,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为:股票资产的比例为基金资产的 50%-95%,其中投资于港股通标的股票不超过股票资产的 50%,投资于本基金界定的创新成长范围内股票不低于非现金基金资产的 80%。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的 5%的现金或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。

如法律法规或中国证监会允许,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。

八、基金的投资策略

本基金通过对宏观经济、财政政策、货币政策、市场利率以及各行业等方面的深入、系统、科学的研究,采用“自上而下”和“自下而上”相结合的投资策略,在严格控制风险和保持充足流动性的基础上,动态调整资产配置比例,力求最大限度降低投资组合的波动性,力争获取持续稳定的绝对收益。

1、大类资产配置策略

本基金主要对国内外宏观经济环境、货币财政政策形势、证券市场走势等进行综合分析,采用定量和定性相结合的研究方法,确定本基金在股票、债券等各类资产的投资比例。

2、股票投资策略

(1)创新成长主题的界定

我国经济已由高速增长阶段转向高质量发展阶段,正处在转变发展方式、优化经济结构、转换增长动力的攻关期,着力加快建设实体经济、科技创新等,在经济结构调整、产业升级的大背景下,科技创新、先进制造、消费升级等领域必将涌现大量的投资机会。本基金定义的创新成长指:具备新技术、新市场需求、新商业模式等新兴要素的成长性产业,相关的行业包括:

(1)科技创新领域:计算机、电子、通信、医药生物等;(2)先进制造领域:国防军工、机械设备等;(3)消费升级领域:传媒、休闲服务、食品饮料、家用电器等。

(2)A 股投资策略

本基金充分发挥基金管理人的研究优势,通过对宏观经济、政策走向、市场利率以及行业发展等进行全面、深入、系统、科学的研究,积极主动构建投资组合,并在实际运行过程中将不断进行修正,优化股票投资组合。具体来说,本基金股票投资采用“自下而上”的个股精选策略,精选科技创新、消费升级等具备阶段性成长机会,并具有良好的公司治理结构、独特核心竞争优势的优质上市公司。以研究部的基本面研究和个股挖掘为依据,主要考虑的方面包括上市公司治理结构、核心竞争优势、议价能力、市场占有率、成长性、盈利能力、运营效率、财务结构、现金流情况等公司基本面因素,对上市公司的投资价值进行综合评价,精选具有较高投资价值的上市公司构建投资组合。并根据市场的变化,灵活调整投资组合,从而提高组合收益,降低组合波动。

(3)港股通标的股票投资策略

本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场,不使用合格境内机构投资者(QDII)境外投资额度进行境外投资。本基金优先将创新成长主题界定的行业中基本面健康、业绩向上弹性较大、具有估值优势的港股纳入本基金的股票投资组合。

3、债券投资策略

本基金的债券投资策略主要包括债券投资组合策略和个券选择策略。

(1)债券投资组合策略

本基金的投资组合策略采用自上而下进行分析,从宏观经济和货币政策等方面,判断未来的利率走势,从而确定债券资产的配置策略;同时,在日常的操作中综合运用久期管理、收益率曲线形变预测等组合管理手段进行债券日常管理。

1)久期管理

本基金通过宏观经济及政策形势分析,对未来利率走势进行判断,在充分保证流动性的前提下,确定债券组合久期以及可以调整的范围。

2)收益率曲线形变预测

收益率曲线形状的变化将直接影响本基金债券组合的收益情况。本基金将根据宏观面、货币政策面等综合因素,对收益率曲线变化进行预测,在保证债券流动性的前提下,适时采用子弹、杠铃或梯形策略构造组合。

(2)个券选择策略

在个券选择上,本基金重点考虑个券的流动性,包括是否可以进行质押融资回购等要素,还将根据对未来利率走势的判断,综合运用收益率曲线估值、信用风险分析等方法来评估个券的投资价值。此外,对于可转换债券等内嵌期权的债券,还将通过运用金融工程的方法对期权价值进行判断,最终确定其投资策略。

本基金将重点关注具有以下一项或者多项特征的债券:

1)信用等级高、流动性好;

2)资信状况良好、未来信用评级趋于稳定或有明显改善的企业发行的债券;

3)在剩余期限和信用等级等因素基本一致的前提下,运用收益率曲线模型或其他相关估值模型进行估值后,市场交易价格被低估的债券;

4)公司基本面良好,具备良好的成长空间与潜力,转股溢价率合理、有一定下行保护的可转债。

4、中小企业私募债券投资策略

本基金将适时跟踪和分析中小企业私募债券发债主体的财务状况以及营业模式对偿债能力的影响,做好风险控制,并综合考虑信用基本面、债券收益率和流动性等要素,根据债券市场的收益率数据,对单个债券进行估值分析,选择具有良好投资价值的私募债券品种进行投资。尽量选择有担保或其他内外部增信措施来提高偿债能力控制风险的私募债券,从而降低本基金的风险。

5、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,本着谨慎原则,参与股指期货的投资,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。

6、国债期货投资策略

本基金在进行国债期货投资时,将根据风险管理原则,以套期保值为目的,采用流动性好、交易活跃的期货合约,通过对债券交易市场和期货市场运行趋势的研究,结合国债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国债期货的收益性、流动性及风险性特征,运用国债期货对冲系统风险、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。

7、权证投资策略

本基金将在严格控制风险的前提下,进行权证投资。基金管理人将通过对权证标的证券基本面的研究,在采用量化模型分析其合理定价的基础上,追求在风险可控的前提下实现稳健的超额收益。

8、资产支持证券投资策略

在有效控制风险的前提下,本基金对资产支持证券从以下方面综合定价,选择低估的品种进行投资。主要包括信用因素、流动性因素、利率因素、税收因素和提前还款因素。

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率×60%+ 恒生综合指数收益率×10%+ 中债综合指数收益率×30%

沪深 300 指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权,由中证指数有限公司编制的包含上海、深圳两个证券交易所流动性好,规模最大的 300 只 A 股为样本的成分股指数,是目前中国证券市场中市值覆盖率高、代表性强、流动性好,同时公信力较好的股票指数。恒生综合指数是由恒生指数服务有限公司编制,涵盖香港联合交易所主板上市股份总市值约 95%,是反映香港股市价幅趋势最有影响的一种股价指数。中债综合指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制的具有代表性的债券市场指数。根据本基金的投资范围和投资比例,选用上述业绩比较基准能够客观、合理地反映本基金的风险收益特征。

如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或市场上出现更加适用于本基金的业绩比较基准时,本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则,根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整。调整业绩比较基准应经基金托管人同意,并报中国证监会备案。基金管理人应在调整实施前在指定媒介上予以公告,而无需召开基金份额持有人大会审议。

十、基金的风险收益特征

本基金是混合型证券投资基金,预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金,但低于股票型基金。本基金将投资港股通标的股票,需承担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、基金的投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定复核了本投资组合报告内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、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。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本投资组合报告截至时间为 2020 年 03 月 31 日,本报告中所列财务数据未经审计。

1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	77,406,142.28	76.31
	其中:股票	77,406,142.28	76.31
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	23,713,038.10	23.38
8	其他资产	311,391.34	0.31
9	合计	101,430,571.72	100.00

2 报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	25,126,529.00	26.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	19,147.31	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	10,090,505.90	10.45
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	29,276,300.00	30.33
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	17,552.98	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	3,487,200.00	3.61
S	综合	-	-
	合计	68,017,235.19	70.46

2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例(%)
日常消费品	4,699,159.10	4.87
通讯服务	4,689,747.99	4.86
合计	9,388,907.09