海富通基金管理有限公司关于以通讯方式召开海富通双福债券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

海富通双福债券型证券投资基金（原名海富通双福分级债券型证券投资基金，以下简称“本基金”）经中国证监会注册予以注册（证监许可【2013】93号文）准予注册，经中国证监会备案，在获利息资本化部分计提完毕后，本基金转入普通债券型证券投资基金基金合同，于2014年5月6日生效。基金管理人为海富通基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。2018年6月7日，基金管理人披露《海富通双福分级债券型证券投资基金分级份额终止运作后基金名称变更及海富通双福分级债券型证券投资基金份额转换结果的公告》，自此海富通双福分级债券型证券投资基金转换为海富通双福债券型证券投资基金。

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》等法律法规的规定和《海富通双福分级债券型证券投资基金基金合同》（适用转型后的条款，以下简称“《基金合同》”）的有关约定，本基金管理人决定召开本基金的基金份额持有人大会，审议《关于变更注册海富通双福债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》。

1、会议召开方式：通讯方式。

2、会议投票表决起止时间：自2019年6月4日起，至2019年7月1日17:30止（投票表决时间以基金管理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：周方婧

地址：上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路66号东亚银行金融大厦36层

邮政编码：200120

联系电话：021-38650835

二、会议审议事项

本次会议有人会议审议的事项为《关于变更注册海富通双福债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》（以下简称“《议案》”，《议案》详见附件一）。

三、权益登记日

本次大会的权益登记日为2019年6月3日，图在2019年6月3日上海及深圳证券交易所交易结束后，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。

四、纸质表决票的填写和寄交方式

1、本次会议表决票见附件三。基金份额持有人可通过剪报、复印或登陆基金管理人网站（http://www.htfund.com）下载并打印等方式获取表决票。

2、基金份额持有人当按照表决票上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，并提供本人身份证件正反复印件；

（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基金管理人认可的相关业务专用章（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或其他单位证明文件或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、社会团体法人登记证书、民办非企业单位登记证书复印件等）；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件（正反面）、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（如适用）；合格境外机构投资者所加盖的企业法人营业执照、商业登记证或者其他有效法律登记证明复印件，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。

（4）个人投资者委托他人投票的，应出具授权人在表决票上签字或盖章，并提供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（参照附件四）。如授托人为个人：还需提供授托人的身份证件正反面复印件；如授托人为个人以外的加盖公章的企业法人营业执照复印件或其他单位证明文件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）。

2.机构投资者委托他人投票的，应出具授权人在表决票上签字或盖章，并提供该名合格境外机构投资者的证明文件的复印件，以及填妥的授权委托书原件（参照附件四）。如授托人为个人：还需提供授托人的身份证件正反面复印件；如授托人为个人以外的加盖公章的企业法人营业执照复印件或其他单位证明文件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）以上各项中的公章、批文、开户证明及登记证书，以基金管理人的认可为准。

3、基金份额持有人或其授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2019年6月4日起，至2019年7月1日17:30止，送达时间以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，并请在信封表面注明：“海富通双福债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”。

五、计票

1.本次通讯会议的计票方式为：由基金管理人授权的两名监督员在基金托管人（中国银行股份有限公司）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）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，表决时间以基金管理人收到表决票时间为准。2019年7月1日17:30以后送达收件人的纸面表决票，均为无效表决。

4.本次通讯会议的计票方式为：由基金管理人授权的两名监督员在基金托管人（中国银行股份有限公司）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。

5.表决票效力认定如下：

（1）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，表决时间以基金管理人收到表决票时间为准。2019年7月1日17:30以后送达收件人的纸面表决票，均为无效表决。

（2）纸面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。有效表决票表决意见未填写、填写不完整或填写错误的，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）纸面表决票上的表决意见未选、多选或无法辨认，模糊不清或相互矛盾，但其他各项符合会议通知规定的，视为有权表决，计入有效表决票并予“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。

（4）纸面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委托人经有效授权代理人资格的证明文件的，视为无效表决票。无效表决票计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

（5）基金份额持有人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，则以最后送达的纸面表决票为准。

七、表决票的送达

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.送达时间相同的情况下，以通讯方式召开的基金份额持有人大会表决票，以收件人收到的时间为准。

八、决议生效条件

1.本人直接出具表决票的，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.委托他人代表表决票的，基金份额持有人所持有的基金份额的二分之一以上（含二分之一）通过为有效；

3.本基金份额持有人合计所持有份额基金份额不足权益登记日基金总份额的二分之一的，则本次大会无法召开，本基金管理人将在大会召开日后2个工作日内进行计票，并在公证机关对其计票过程予以公证。

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》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本基金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），方能召开本次基金份额持有人大会。若召开本次基金份额持有人大会不能达到上述要求，则可在原通知时间、地点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的，出具书面意见的基金份额持有人所持有的基金份额应当不少于召开该次基金份额持有人大会所需的基金份额总数的三分之一以上通过。基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效。

八、本次大会相关机构

1.召集人：海富通基金管理有限公司

地址：上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路66号东亚银行金融大厦36层

客服电话：400808-40009

联系人：吴晨雪

联系电话：021-33158261

2.基金托管人：中国银行股份有限公司

九、温馨提示

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的影响，提前寄出表决票。

2.关于本次议案（详见附件一）的说明详见附件二《关于变更注册海富通双福债券型证券投资基金基金合同有关事项的说明》。

3.根据《基金合同》的规定，本次基金份额持有人大会费用以及公证费、律师费等相关费用可从基金资产列支。

4.若本次基金份额持有人大会审议的变更注册事项获表决通过并生效，则本基金将正式变更为海富通可转债优选债券型证券投资基金，基金份额持有人持有的份额基金份额将自动转换为海富通可转债优选债券型证券投资基金基金份额，以“为海富通可转债优选债券型证券投资基金基金份额，在本次基金份额持有人大会表决通过的日期，以基金管理人公告的基金份额持有人大会决议生效日期为准。

2.机构投资者委托他人投票的，应出具授权人在表决票上签字或盖章，并提供该名合格境外机构投资者的证明文件的复印件，以及填妥的授权委托书原件（参照附件四）。如授托人为个人：还需提供授托人的身份证件正反面复印件；如授托人为个人以外的加盖公章的企业法人营业执照复印件或其他单位证明文件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）。

（2）机构投资者委托他人投票的，应出具授权人在表决票上签字或盖章，并提供该名合格境外机构投资者的证明文件的复印件，以及填妥的授权委托书原件（参照附件四）。如授托人为个人：还需提供授托人的身份证件正反面复印件；如授托人为个人以外的加盖公章的企业法人营业执照复印件或其他单位证明文件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）。

（3）以上各项中的公章、批文、开户证明及登记证书，以基金管理人的认可为准。

4.基金份额持有人或其授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2019年6月4日起，至2019年7月1日17:30止，送达时间以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，并请在信封表面注明：“海富通双福债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”。

五、计票

1.本次通讯会议的计票方式为：由基金管理人授权的两名监督员在基金托管人（中国银行股份有限公司）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）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，表决时间以基金管理人收到表决票时间为准。2019年7月1日17:30以后送达收件人的纸面表决票，均为无效表决。

（2）纸面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。有效表决票表决意见未填写、填写不完整或填写错误的，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）纸面表决票上的表决意见未选、多选或无法辨认，模糊不清或相互矛盾，但其他各项符合会议通知规定的，视为有权表决，计入有效表决票并予“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。

（4）纸面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委托人经有效授权代理人资格的证明文件的，视为无效表决票。无效表决票计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

（5）基金份额持有人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，则以最后送达的纸面表决票为准。

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.送达时间相同的情况下，以通讯方式召开的基金份额持有人大会表决票，以收件人收到的时间为准。

六、决议生效条件

1.本人直接出具表决票的，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.委托他人代表表决票的，基金份额持有人所持有的基金份额的二分之一以上（含二分之一）通过为有效；

3.本基金份额持有人合计所持有份基金份额不足权益登记日基金总份额的二分之一的，则本次大会无法召开，本基金管理人将在大会召开日后2个工作日内进行计票，并在公证机关对其计票过程予以公证。

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》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本基金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），方能召开本次基金份额持有人大会。若召开本次基金份额持有人大会不能达到上述要求，则可在原通知时间、地点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的，出具书面意见的基金份额持有人所持有的基金份额应当不少于召开该次基金份额持有人大会所需的基金份额总数的三分之一以上通过。基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效。

八、本次大会相关机构

1.召集人：海富通基金管理有限公司

地址：上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路66号东亚银行金融大厦36层

客服电话：400808-40009

联系人：林奇

联系电话：021-62154948

3.见证机构：上海市通力律师事务所

注册及办公地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

联系电话：021-31358666

4.基金托管人：中国银行股份有限公司

九、温馨提示

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的影响，提前寄出表决票。

2.关于本次议案（详见附件一）的说明详见附件二《关于变更注册海富通双福债券型证券投资基金基金合同有关事项的说明》。

3.根据《基金合同》的规定，本次基金份额持有人大会费用以及公证费、律师费等相关费用可从基金资产列支。

4.若本次基金份额持有人大会审议的变更注册事项获表决通过并生效，则本基金将正式变更为海富通可转债优选债券型证券投资基金，基金份额持有人持有的份额基金份额将自动转换为海富通可转债优选债券型证券投资基金基金份额。若本次基金份额持有人大会未能成功召开，或者本次会议议案未能通过，基金管理人可根据法律法规及《基金合同》在规定时间内就变更注册基金份额持有人持有的份额基金份额持有人提交新的议案，届时基金管理人将重新发布有关基金份额持有人大会的公告。

5、上述基金份额持有人大会有关公告可通过海富通基金管理有限公司网站（http://www.htfund.com）查阅，投资者如有任何疑问，可致电400808-40009咨询。

6.本公告的有关内容由海富通基金管理有限公司解释。

特此公告。

海富通基金管理有限公司

2019年5月30日

附件一：《关于变更注册海富通双福债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》

附件二：《关于变更注册海富通双福债券型证券投资基金基金合同有关事项的说明》

附件三：《海富通双福债券型证券投资基金基金份额持有人大会纸质表决票》

附件四：《授权委托书》（样本）

附件一：关于变更注册海富通双福债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案

海富通双福债券型证券投资基金基金份额持有人大会：

（一）变更后基金的投资目标

本基金以可转换债券为主要投资对象，在严格控制风险的基础上，通过积极主动的管理，力争获取超越业绩比较基准的投资收益。

（二）变更后的投资范围及投资组合比例

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、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证、债券（包括国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、中期票据、地方政府债、政府债、中小企业私募债券、可转换债券、可分离交易可转换债券、可交换债券、短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、国债期货以及法律规定的证券期货品种以及基金管理人根据有关法律法规、证监会和基金管理人的投资决策程序，在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，并可依据届时有效的法律规定进行调整，届时无需召开基金份额持有人大会。

本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%，投资于可转换债券、可分离交易可转换债券的比例合计不低于非现金基金资产的80%。股票、权证资产的投资比例合计不超过基金资产的20%。每个交易日日终在扣除国债期货合约交易保证金后，现金（不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于5%。基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值不超过基金资产净值的10%。

法律法规或监管机构日后允许本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，并可依据届时有效的法律法规或监管机构的规定进行调整。

三、投资策略

1.资产配置策略

本基金为债券型基金，对债券资产的投资比例不低于基金资产的80%，投资于可转换债券、可分离交易可转换债券的比例合计不低于非现金基金资产的80%。在此约束下，本基金通过对宏观经济趋势、金融货币政策、供求因素、估值因素、市场行为因素等进行评估分析，对固定收益类资产的预期收益进行动态跟踪，从而决定其配置比例。

2.可转换债券投资策略

由于可转换债券兼具债性和股性，本基金将根据对宏观经济、证券市场、上市公司基本面等因素进行综合分析，在债券价值、股票价值、期权价值等多维度分析的基础上，对可转换债券的投资价值进行动态跟踪，从而决定其配置比例。

（1）个券精选策略

本基金将对可转换债券对应的标的股票进行全方位研究，采用定性分析（行业地位、竞争优势、治理结构、市场开拓、创新能力等）与定量分析（DPB、DFCF、DBCD、DCP、DDM、NAVP等）相结合的方式，挑选出成长性好且估值合理的标的股票。此外，本基金还将结合研究分析可转债自身的信用评估、市场情况等因素，综合考虑债券的重要条款，以期获取较高的投资收益。

（2）条款价值发现策略

可转债一般均设有一些特殊条款，包括修正转股价条款、回售条款、赎回条款等，这些条款在特定环境下对可转债价值有着较大的影响。本基金将深入研究可转换债券上市公司的基本面情况和未来发展战略，把握各项条款给可转债带来的可能的投资机会。

（3）套利策略

按照条款设计，可转换债券可根据事先约定的转股价格转换为发行人的股票，因此可转换债券和正股之间存在套利空间。当可转换债券的转股溢价率为负时，可转换债券价格低于可出售股票转换的价差收益；反之，以股票的同时卖出可转换债券也可以获取反向套利价差。在目前交易运作中，本基金将密切关注可转换债券的股票之间价格的波动情况，捕机实施套利策略，以期强本基金的收益。

（4）可分离交易可转换债券投资策略

可分离交易可转换债券通过将可转换债券的权益部分剥离出来，形成一张纯债券和一张权证的组合，其中纯债部分和权证部分分别进行交易。对于可分离交易可转换债券的投资比例，本基金将根据对宏观经济趋势、金融货币政策、供求因素、估值因素、市场行为因素等进行评估分析，对固定收益类资产和货币资产的预期收益进行动态跟踪，从而决定其配置比例。

（5）可交换债券投资策略

可交换债券与可转换债券的区别在于换股期间用于交换的股票并非自身新发的股票，而是发行人持有的其他上市公司股票。可交换债券同样具有股性和债性，其中债性与可转换债券相同，因此持有可交换债券至到期以获取票面利息收益，以及在换股期内根据市场情况，对可交换债券的股票进行交换，以期获取较高的投资收益。本基金将通过对目标公司股票的基础研究，在长期、中期和短期债券间进行动态调整，在保持组合一定流动性的同时，以以从长、中、短期债券的个券收定价收益。

（5）类债配置包括现金、不可类似固定收益品种之间的配置。在确定组合久期和期限结构分布的基础上，根据各品种的流动性、收益性以及信用风险等确定各子类资产的配置权重，因确定债券、存款、回购以及现金等资产的比例，类债配置主要根据各类资产的相对投资价值确定，特别关注国内宏观经济、存款、回购以及现金等资产的比例，类债配置主要根据各类资产的相对投资价值确定，特别关注国内宏观经济、利率走势、流动性状况、盈利能力、现金流、经营稳定性等关键因素，进而预测国内市场利率变化趋势，决定投资策略。

（6）骑乘策略

在债券组合的具体构造和调整上，本基金综合运用久期调整、收益率曲线策略、类属配置等组合管理手段进行日常管理。

（7）久期管理策略是根据对宏观经济环境、利率水平预期等因素，确定组合的整体久期，有效控制基金产品风险。当预测利率上升时，适当缩短投资组合的目标久期，预测利率水平降低时，适当延长投资组合的目标久期。

（2）收益率曲线策略是指在保证组合久期以后，根据收益率曲线的形态特征进行利率期限结构管理，确定组合期限结构的分布。在长期、中期和短期债券间进行动态调整，在保持组合一定流动性的同时，以以从长、中、短期债券的个券收定价收益。

（3）类属配置包括现金、不可类似固定收益品种之间的配置。在确定组合久期和期限结构分布的基础上，根据各品种的流动性、收益性以及信用风险等确定各子类资产的配置权重，因确定债券、存款、回购以及现金等资产的比例，类属配置主要根据各类资产的相对投资价值确定，特别关注国内宏观经济、存款、回购以及现金等资产的比例，类属配置主要根据各类资产的相对投资价值确定，特别关注国内宏观经济、利率走势、流动性状况、盈利能力、现金流、经营稳定性等关键因素，进而预测国内市场利率变化趋势，决定投资策略。

（4）骑乘策略

骑乘策略是指在保证组合久期以后，根据收益率曲线的形态特征进行利率期限结构管理，确定组合期限结构的分布。在长期、中期和短期债券间进行动态调整，在保持组合一定流动性的同时，以以从长、中、短期债券的个券收定价收益。

（5）信用债投资策略

在信用债的具体构造和调整上，本基金综合运用久期调整、收益率曲线策略、类属配置等组合管理手段进行日常管理。

（6）股票投资策略

本基金投资债券资产的比例不低于基金资产的80%，投资于可转换债券、可分离交易可转换债券的比例合计不低于非现金基金资产的80%。股票、权证资产的投资比例合计不超过基金资产的20%。

（7）久期管理策略

根据市场环境变化情况，在保证组合流动性的前提下，以期获取较高的投资收益为目标，适当延长投资组合的目标久期。

（8）信用债投资策略

本基金将根据宏观经济、利率水平预期等因素，确定组合的整体久期，有效控制基金产品风险。当预测利率上升时，适当缩短投资组合的目标久期，预测利率水平降低时，适当延长投资组合的目标久期。

（9）资产支持证券投资策略

本基金将根据宏观经济、利率水平预期等因素，确定组合的整体久期，有效控制基金产品风险。当预测利率上升时，适当缩短投资组合的目标久期，预测利率水平降低时，适当延长投资组合的目标久期。

（10）中小企业私募债券投资策略

本基金将根据宏观经济、利率水平预期等因素，确定组合的整体久期，有效控制基金产品风险。当预测利率上升时，适当缩短投资组合的目标久期，预测利率水平降低时，适当延长投资组合的目标久期。

（11）股指期货投资策略

本基金将根据宏观经济、利率水平预期等因素，确定组合的整体久期，有效控制基金产品风险。当预测利率上升时，适当缩短投资组合的目标久期，预测利率水平降低时，适当延长投资组合的目标久期。

（12）国债期货投资策略

本基金将根据宏观经济、利率水平预期等因素，确定组合的整体久期，有效控制基金产品风险。当预测利率上升时，适当缩短投资组合的目标久期，预测利率水平降低时，适当延长投资组合的目标久期。

（13）其他品种投资策略

本基金将根据宏观经济、利率水平预期等因素，确定组合的整体久期，有效控制基金产品风险。当预测利率上升时，适当缩短投资组合的目标久期，预测利率水平降低时，适当延长投资组合的目标久期。

（14）资产支持证券投资策略

本基金将根据宏观经济、利率水平预期等因素，确定组合的整体久期，有效控制基金产品风险。当预测利率上升时，适当缩短投资组合的目标久期，预测利率水平降低时，适当延长投资组合的目标久期。

（15）股指期货投资策略

本基金将根据宏观经济、利率水平预期等因素，确定组合的整体久期，有效控制基金产品风险。当预测利率上升时，适当缩短投资组合的目标久期，预测利率水平降低时，适当延长投资组合的目标久期。

（16）国债期货投资策略

本基金将根据宏观经济、利率水平预期等因素，确定组合的整体久期，有效控制基金产品风险。当预测利率上升时，适当缩短投资组合的目标久期，预测利率水平降低时，适当延长投资组合的目标久期。

（17）其他品种投资策略

本基金将根据宏观经济、利率水平预期等因素，确定组合的整体久期，有效控制基金产品风险。当预测利率上升时，适当缩短投资组合的目标久期，预测利率水平降低时，适当延长投资组合的目标久期。

（18）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过本基金资产净值的15%；因证券市场波动、上市公司股东大会决议等因素导致被动持有流动性受限资产的市值合计不超过本基金资产净值的20%。

（19）本基金将根据流动性受限资产的预期流动性、变现价值、不持与其国有资产产生的债务关系相互抵消；基金管理人管理运作不同基金的流动性受限资产的债权债务不得相互抵消；基金管理人管理运作不同基金的流动性受限资产所产生的债权债务不得相互抵消。

（20）本基金将根据流动性受限资产的市值合计不超过本基金资产净值的15%；因证券市场波动、上市公司股东大会决议等因素导致被动持有流动性受限资产的市值合计超过本基金资产净值的15%的，本基金管理人将采取合理措施，以期在合理时间内使其比例不超过本基金资产净值的15%。

（21）本基金将根据流动性受限资产的预期流动性、变现价值、不持与其国有资产产生的债务关系相互抵消；基金管理人管理运作不同基金的流动性受限资产的债权债务不得相互抵消。

（22）当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；

（23）以基金管理人名义代表基金的资产进行投资时，应当以基金管理人名义开立证券账户、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、国债期货以及法律规定的证券期货品种以及基金管理人根据有关法律法规或中国证监会允许券商证券自营业务的证券品种进行投资；

（24）执行生效的基金份额持有人大会的决议；

（25）建立并保存基金份额持有人名册；

（26）以基金管理人名义代表基金参加证券交易所、证券登记结算机构、期货交易所、银行业同业拆借市场、银行间债券市场、银行间外汇市场、证券投资基金行业协会、证券期货业协会等证券期货市场自律性组织的活动；

（27）监督基金管理人的投资运作；

（28）对基金管理人、基金托管人、基金服务机构恶意其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；

（29）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

（1）认真阅读并遵守《基金合同》、招募说明书等信息披露文件；

（2）了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，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；

（3）关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；

（4）缴纳基金申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；

（5）在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损的责任；

（6）不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；

（7）执行生效的基金份额持有人大会的决议决定；

（8）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

第八部分 基金份额持有人大会

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人有权亲自出席基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

本基金份额持有人大会不设日常机构。

一、召开事由

1.当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

（1）终止《基金合同》；基金合同另有约定的除外；

（2）更换基金管理人；

（3）更换基金托管人；

（4）转换基金运作方式；

（5）调整基金管理人、基金托管人的报酬标准；

（6）变更基金类别；

（7）本基金与其他基金的合并；

（8）变更基金份额持有人权益的事项、范围或期限；

（9）变更基金份额持有人大会程序；

（10）基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；

（11）单独或合计持有本基金总份额10%以上（含10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会的；

（12）对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

（13）法律法规、《基金合同》或中国证监会认定的其他需召开基金份额持有人大会的事项。

2.召集人及召集方式

1.除法律法规规定或《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。

2.基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。

3.基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的事项时，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，并书面向基金托管人提出书面回复。基金管理人应当自决定召集之日起5个工作日内发出召集大会的通知。基金管理人决定不召集的，应当在出具书面决定之日起10日内决定是否召集，并书面向基金托管人提出书面回复。基金管理人应当自决定召集之日起5个工作日内发出召集大会的通知。

4.代表基金份额10%以上（含10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，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，并书面向发起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5个工作日内发出召集大会的通知。基金托管人决定不召集的，应当在出具书面决定之日起10日内决定是否召集，并书面向发起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5个工作日内发出召集大会的通知。

5.基金份额持有人大会召集人决定召集的，应当自出具书面决定之日起5个工作日内发出召集大会的通知。

6.基金份额持有人大会召集人决定不召集的，不得利用基金资产为自己及任何第三人谋取利益，不得损害其他基金份额持有人的合法权益。

3.基金份额持有人提议召开基金份额持有人大会的，应当按照下列规定办理：

（1）提议召集基金份额持有人大会的书面提议应当写明议题、理由、议案、召集人姓名或名称、提议人所持有基金份额的证明文件、提议人的有效联系方式和联系人等事项，并保证提议内容符合法律、法规和《基金合同》的有关规定。

（2）基金份额持有人提议召开基金份额持有人大会的，应当在提议前30天内将书面提议递交基金管理人。基金管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集大会，并书面向提议人提出书面回复。

（3）基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起5个工作日内发出召集大会的通知。

（4）基金管理人决定不召集的，提议人有权向基金托管人提出召集大会的书面提议。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，并书面向提议人提出书面回复。基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起5个工作日内发出召集大会的通知。

（5）基金托管人决定不召集的，提议人有权向基金管理人提出召集大会的书面提议。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，并书面向提议人提出书面回复。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起5个工作日内发出召集大会的通知。

（6）基金管理人、基金托管人决定不召集的，提议人有权自行召集基金份额持有人大会，并报中国证监会备案。

（7）基金份额持有人提议召开基金份额持有人大会的，其所持有的基金份额应当不少于召开该次基金份额持有人大会所需的基金份额总数的三分之一以上。

（8）基金份额持有人自行召集基金份额持有人大会的，其所持有的基金份额应当不少于召开该次基金份额持有人大会所需的基金份额总数的二分之一（含二分之一）。

（9）基金份额持有人提议召开基金份额持有人大会的，其所持有的基金份额应当不少于召开该次基金份额持有人大会所需的基金份额总数的二分之一（含二分之一）。

（10）基金份额持有人自行召集基金份额持有人大会的，其所持有的基金份额应当不少于召开该次基金份额持有人大会所需的基金份额总数的二分之一（含二分之一）。

（11）基金份额持有人提议召开基金份额持有人大会的，其所持有的基金份额应当不少于召开该次基金份额持有人大会所需的基金份额总数的二分之一（含二分之一）。

（12）基金份额持有人自行召集基金份额持有人大会的，其所持有的基金份额应当不少于召开该次基金份额持有人大会所需的基金份额总数的二分之一（含二分之一）。

（13）基金份额持有人提议召开基金份额持有人大会的，其所持有的基金份额应当不少于召开该次基金份额持有人大会所需的基金份额总数的二分之一（含二分之一）。

（14）基金份额持有人自行召集基金份额持有人大会的，其所持有的基金份额应当不少于召开该次基金份额持有人大会所需的基金份额总数的二分之一（含二分之一）。

（15）基金份额持有人提议召开基金份额持有人大会的，其所持有的基金份额应当不少于召开该次基金份额持有人大会所需的基金份额总数的二分之一（含二分之一）。

（16）基金份额持有人自行召集基金份额持有人大会的，其所持有的基金份额应当不少于召开该次基金份额持有人大会所需的基金份额总数的二分之一（含二分之一）。

（17）基金份额持有人提议召开基金份额持有人大会的，其所持有的基金份额应当不少于召开该次基金份额持有人大会所需的基金份额总数的二分之一（含二分之一）。

（18）基金份额持有人自行召集基金份额持有人大会的，其所持有的基金份额应当不少于召开该次基金份额持有人大会所需的基金份额总数的二分之一（含二分之一）。

（19）基金份额持有人提议召开基金份额持有人大会的，其所持有的基金份额应当不少于召开该次基金份额持有人大会所需的基金份额总数的二分之一（含二分之一）。

（20）基金份额持有人自行召集基金份额持有人大会的，其所持有的基金份额应当不少于召开该次基金份额持有人大会所需的基金份额总数的二分之一（含二分之一）。

（21）基金份额持有人提议召开基金份额持有人大会的，其所持有的基金份额应当不少于召开该次基金份额持有人大会所需的基金份额总数的二分之一（含二分之一）。

（22）基金份额持有人自行召集基金份额持有人大会的，其所持有的基金份额应当不少于召开该次基金份额持有人大会所需的基金份额总数的二分之一（含二分之一）。

（23）基金份额持有人提议召开基金份额持有人大会的，其所持有的基金份额应当不少于召开该次基金份额持有人大会所需的基金份额总数的二分之一（含二分之一）。

（24）基金份额持有人自行召集基金份额持有人大会的，其所持有的基金份额应当不少于召开该次基金份额持有人大会所需的基金份额总数的二分之一（含二分之一）。

（25）基金份额持有人提议召开基金份额持有人大会的，其所持有的基金份额应当不少于召开该次基金份额持有人大会所需的基金份额总数的二分之一（含二分之一）。

（26）基金份额持有人自行召集基金份额持有人大会的，其所持有的基金份额应当不少于召开该次基金份额持有人大会所需的基金份额总数的二分之一（含二分之一）。

（27）基金份额持有人提议召开基金份额持有人大会的，其所持有的基金份额应当不少于召开该次基金份额持有人大会所需的基金份额总数的二分之一（含二分之一）。

（28）基金份额持有人自行召集基金份额持有人大会的，其所持有的基金份额应当不少于召开该次基金份额持有人大会所需的基金份额总数的二分之一（含二分之一）。

（29）基金份额持有人提议召开基金份额持有人大会的，其所持有的基金份额应当不少于召开该次基金份额持有人大会所需的基金份额总数的二分之一（含二分之一）。

（30）基金份额持有人自行召集基金份额持有人大会的，其所持有的基金份额应当不少于召开该次基金份额持有人大会所需的基金份额总数的二分之一（含二分之一）。

（31）基金份额持有人提议召开基金份额持有人大会的，其所持有的基金份额应当不少于召开该次基金份额持有人大会所需的基金份额总数的二分之一（含二分之一）。

（32）基金份额持有人自行召集基金份额持有人大会的，其所持有的基金份额应当不少于召开该次基金份额持有人大会所需的基金份额总数的二分之一（含二分之一）。

（33）基金份额持有人提议召开基金份额持有人大会的，其所持有的基金份额应当不少于召开该次基金份额持有人大会所需的基金份额总数的二分之一（含二分之一）。

（34）基金份额持有人自行召集基金份额持有人大会的，其所持有的基金份额应当不少于召开该次基金份额持有人大会所需的基金份额总数的二分之一（含二分之一）。

（35）基金份额持有人提议召开基金份额持有人大会的，其所持有的基金份额应当不少于召开该次基金份额持有人大会所需的基金份额总数的二分之一（含二分之一）。

（36）基金份额持有人自行召集基金份额持有人大会的，其所持有的基金份额应当不少于召开该次基金份额持有人大会所需的基金份额总数的二分之一（含二分之一）。

（37）基金份额持有人提议召开基金份额持有人大会的，其所持有的基金份额应当不少于召开该次基金份额持有人大会所需的基金份额总数的二分之一（含二分之一）。

（38）基金份额持有人自行召集基金份额持有人大会的，其所持有的基金份额应当不少于召开该次基金份额持有人大会所需的基金份额总数的二分之一（含二分之一）。

（39）基金份额持有人提议召开基金份额持有人大会的，其所持有的基金份额应当不少于召开该次基金份额持有人大会所需的基金份额总数的二分之一（含二分之一）。

（40）基金份额持有人自行召集基金份额持有人大会的，其所持有的基金份额应当不少于召开该次基金份额持有