

# 华泰柏瑞基金管理有限公司关于以通讯方式召开华泰柏瑞丰汇债券型证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告

华泰柏瑞基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）已于2018年11月24日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及华泰柏瑞基金管理有限公司网站（<http://www.huatai-pb.com>）发布了《华泰柏瑞基金管理有限公司关于以通讯方式召开华泰柏瑞丰汇债券型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》，2018年11月26日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及华泰柏瑞基金管理有限公司网站（<http://www.huatai-pb.com>）发布了《华泰柏瑞基金管理有限公司关于以通讯方式召开华泰柏瑞丰汇债券型证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告》。为了使本次基金份额持有人大会顺利召开，现发布关于以通讯方式召开华泰柏瑞丰汇债券型证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告。

1、会议召开方式：通讯方式。

2、议投票表决起止时间：自2018年11月24日起，至2018年12月24日17:00止（以表决票收件人收到表决票时间为准）。

3、会议计票日：2018年12月26日。

4、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：华泰柏瑞基金管理有限公司客户服务部

地址：上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼17层客户服务部

邮政编码：200135

联系电话：400-888-0001

二、会议审议事项

本次持有人大会审议的事项为《关于华泰柏瑞丰汇债券型证券投资基金修改投资范围、调整管理费率、托管费率和收益分配原则等有关事项的议案》（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2018年11月26日，即在2018年11月26日交易时间结束后，在华泰柏瑞基金管理有限公司登记在册的本基金全体基金份额持有人均享有本次基金份额持有人大会的表决权。

四、投票方式

1、本次会议仅接受纸质投票，表决票样本见附件三。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.huatai-pb.com>）下载等方式获取表决票。

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（或基金管理人认可的相关的业务专用章，下文所称“公章”亦同），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件、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和证券账户卡复印件，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（三）授权方式 1、纸面方式授权”中所规定的基金份额持有人以及受托人的身份证明文件或机构主体资格证明文件。

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2018年11月24日起，至2018年12月24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（上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼17层客户服务部），并建议在信封表面注明：“华泰柏瑞丰汇债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”。

## 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自本公告发布之日起可委托他人代理行使本次基金份额持有人大会的表决权。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在华泰柏瑞基金管理有限责任公司登记在册为准。

### （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其他新增的受托人名单。

### （三）授权方式

本基金的基金份额持有人仅可通过纸面方式授权受托人代为行使表决权。

基金份额持有人向他人授权的，授权委托书的样本请见本公告附件二。基金份额持有人可通过剪报、复印或登录基金管理人网站（<http://www.huatai-pb.com>）下载等方式获取授权委托书样本。

## 1、纸面方式授权

### （1）基金份额持有人进行纸面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二的样本），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）。

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二的样本），并在授权委托书上加盖该机构公章，并提供该机构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）。

### （2）纸面授权文件的送达

纸面授权文件应与表决票一同于会议投票表决起止时间内通过专人送交或邮寄的方式送达至本公告规定的

地址，基金份额持有人也可在授权截止时间前至基金管理人的柜台办理授权，填写授权委托书，并提交基金份额持有人身份证明文件，或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营业机构。投资者通过直销柜台办理基金交易业务时，直销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。

## 2、授权效力确定规则

(1) 如果同一基金份额多次以有效纸面方式授权的，以最后一次纸面授权为准。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纸面授权为准；最后时间收到的多次纸面授权均为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) 如委托人未在授权委托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；

(3) 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。

## 3、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2018年11月24日至2018年12月24日17时。将纸面授权委托书寄送或专人送达给基金管理人指定地址的，授权时间和有效性判断均以收到时间为准。

## 六、计票

1、本次通讯会议的计票方式为：由本基金管理人聘请的公证处的公证员进行计票。

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，表决时间以收到时间为准。2018年11月24日前及2018年12月24日17:00以后送达收件人的纸面表决票，均为无效表决。

(2) 纸面表决票的效力认定

①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如纸面表决票上的表决意见未选、多选、模糊不清或相互矛盾，但其他各项符合会议通知规定的，视为弃权表决，但计入有效表决票；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：

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或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权益登记日基金总份额的50%以上（含50%）；

2、《关于华泰柏瑞丰汇债券型证券投资基金修改投资范围、调整管理费率、托管费率和收益分配原则等有关事项的议案》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二分之一以上（含二分之一）通过；

3、本次基金份额持有人大会决议通过的事项，本基金管理人自生效之日起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表决通过之日起生效。

#### 八、二次召集基金份额持有人大会及二次授权

根据《基金法》和《基金合同》的规定，本次持有人大会需要到会者在权益登记日持有的有效的基金份额，不少于本基金在权益登记日基金总份额的50%以上（含50%）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《基金法》的规定，本基金管理人可在本次公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内就同一议案重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会，应当有代表三分之一以上（含三分之一）基金份额的基金份额持有人或其代理人参加，方可召开。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：华泰柏瑞基金管理有限公司

客服电话：400-888-0001

联系人：汪莹白

联系电话：（021）38601630

电子邮件：rainbow.wang@huatai-pb.com

传真：（021）50103016

网址：<http://www.huatai-pb.com>

2、公证机构：上海市东方公证处

地址：上海市静安区凤阳路660号

联系人：林奇

联系电话：021-62154848

3、律师事务所：上海源泰律师事务所

注册及办公地址：上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦1405室

联系电话：（021）51150298

联系人：刘佳、范佳斐

#### 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华泰柏瑞基金管理有限公司网站（<http://www.huatai-pb.com>）查阅，投资者如有任何疑问，可致电400-888-0001咨询。

3、本公告的有关内容由华泰柏瑞基金管理有限公司解释。

附件一：《关于华泰柏瑞丰汇债券型证券投资基金修改投资范围、调整管理费率、托管费率和收益分配原则等有关事项的议案》

附件二：授权委托书（样本）

附件三：华泰柏瑞丰汇债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决票

附件四：《关于华泰柏瑞丰汇债券型证券投资基金修改投资范围、调整管理费率、托管费率和收益分配原则等有关事项的说明》

华泰柏瑞基金管理有限公司

2018年11月27日

附件一：

《关于华泰柏瑞丰汇债券型证券投资基金修改投资范围、调整管理费率、托管费率和收益分配原则等有关事项的议案》

华泰柏瑞丰汇债券型证券投资基金基金份额持有人：

为保护基金份额持有人利益，提高基金资产的运作效率与基金产品的市场竞争力，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》等法律法规的规定和《华泰柏瑞丰汇债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关约定，经与华泰柏瑞丰汇债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金托管人中国银行股份有限公司协商一致，提议对华泰柏瑞丰汇债券型证券投资基金按照《关于华泰柏瑞丰汇债券型证券投资基金修改投资范围、调整管理费率、托管费率和收益分配原则等有关事项的说明》（附件四）的方案，修改本基金的投资范围、调整本基金的管理费率、托管费率和收益分配原则等事项。

本议案如获得基金份额持有人大会审议通过，基金管理人将根据基金份额持有人大会决议办理本次《基金合同》修改的有关具体事宜，本基金的招募说明书及托管协议也将进行必要的修改或补充。

以上提案，请予审议。

华泰柏瑞基金管理有限公司

2018年11月27日

附件二：

#### 授权委托书

本人（或本机构）持有了华泰柏瑞丰汇债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金份额，就华泰柏瑞基金管理有限公司2018年11月24日在指定媒介公布的《华泰柏瑞基金管理有限公司关于以通讯方式召开华泰柏瑞丰汇债券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

《关于华泰柏瑞丰汇债券型证券投资基金修改投资范围、调整管理费率、托管费率和收益分配原则等有关事项的议案》

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。若本基金重新召开审议相同议案的基金份额持有人大会的，则本授权继续有效。

委托人（签字/盖章）：\_\_\_\_\_

委托人证件号码（填写）：\_\_\_\_\_

委托人基金账户卡号（填写）：\_\_\_\_\_

以上表决意见代表委托人本证券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《华泰柏瑞丰汇债券型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. 授权委托书效力根据大会公告认定。
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。

附件三：

华泰柏瑞丰汇债券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/营业执照号或统一社会信用代码）：

基金账户号

审议事项 同意 反对 弃权

《关于华泰柏瑞丰汇债券型证券投资基金修改投资范围、调整管理费率、托管费率和收益分配原则等有关事项的议案》

基金份额持有人（或受托人）签名或盖章：

年 月 日

说明：

- 1、请以打“√”方式在审议事项后注明表决意见。
- 2、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。
- 3、纸面表决票的效力认定以大会公告为准。
- 4、基金账户号不填写但不影响持有人身份认定的，不影响表决票效力。

附件四：

《关于华泰柏瑞丰汇债券型证券投资基金修改投资范围、调整管理费率、托管费率和收益分配原则等有关事项的说明》

一、声明

1、华泰柏瑞丰汇债券型证券投资基金成立于2014年12月11日，为了更好地保护基金份额持有人利益，提高基金资产的运作效率与基金产品的市场竞争力，华泰柏瑞基金管理有限公司（以下简称“本公司”）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《华泰柏瑞丰汇债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关约定，经与华泰柏瑞丰汇债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金托管人中国银行股份有限公司协商一致，决定召开本基金的基金份额持有人大会，拟修改本基金的投资范围、调整本基金的管理费率、托管费率和收益分配原则等事项。

（1）关于修改本基金投资范围的说明。

关于在投资范围中增加国债期货这一投资品种。目前国债期货流动性已逐步提升，利率债的相对投资价值凸显。国债期货作为利率市场化进程中推出的品种将提高债券市场（特别是利率品）定价效率，增强市场流动性，引导资源优化配置，有利于风险管理工具的多样化，为金融机构提供更多的避险工具和资产配置方式，促进银行间和交易所市场的互联互通，推动利率市场化进程以及金融创新发展。2013年9月5日，证监会发布《公开募集证券投资基金参与国债期货交易指引》，规定基金参与国债期货交易必须以套期保值为目的。因此，为维护基金份额持有人利益，使本基金的风格特征更加鲜明，在投资范围中增加国债期货更加有利于投资者把握配置需求。

关于在投资范围中增加同业存单这一投资品种。2013年12月8日，央行宣布推行新的货币市场工具——同业存单，以进一步放开固定存款利率和推动利率市场化。公开发行的同业存单可以进行交易流通，并可以作为回购交易的标的物；定向发行的同业存单只能在该只同业存单初始投资人范围内流通转让。同业存单的推出可以与同业拆借市场形成互补，帮助金融机构融通中长期资本，通过丰富二级市场期限较长的产品来倒推远端曲线的形成，为下一步利率市场化做准备。因此，在本基金投资范围中增加同业存单更有利于投资者把握配置需求。

关于在投资范围中删除一级市场新股申购或增发新股的投资品种。基于最新证监会针对债基投资权益类资产的相关表述要求，结合本基金目前的实际投资运作情况，拟将投资范围表述修订为“本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、地方政府债、政府支持机构债、政府支持债券、资产支持证

券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、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）、货币市场工具、同业存单、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）。

本基金不投资股票资产，但可持有因可转债转股所形成的股票、持有股票所派发的权证、可分离债券产生的权证。”

（2）关于调整本基金的管理费率和托管费率的说明。本次持有人大会拟将本基金的管理费率，由原来的0.70%调整为0.30%，将本基金的托管费率，由原来的0.2%调整为0.1%，并对本基金法律文件的相应内容进行修订。

（3）关于更新基金收益与分配章节的相关条款的说明。根据2015年5月22日颁布的证监会公告[2015]14号，《证券投资基金收益分配条款的审核指引》中原有的条款（基金合同及招募说明书中需要约定每年基金收益分配的最多次数和每次收益分配的最低比例）已废止，因此在收益分配原则中删除了每年基金收益分配的分配次数和最低分配比例的相关表述。

2、本次基金合同修改方案须经参加本次持有人大会的本基金基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过，存在无法获得持有人大会表决通过的可能。

3、基金份额持有人大会决议通过的事项，本基金管理人自通过之日起五日内报中国证监会备案，基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。基金份额持有人大会决议自生效之日起2个工作日内在指定媒介上公告。

## 二、基金合同修改内容

本基金基金合同的修订详情如下：

修改前 修改后

### 第六部分 基金份额的申购与赎回

#### 四、申购与赎回的程序

##### 2、申购和赎回的款项支付

.....

遇证券交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其它非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程时，赎回款项顺延至下一个工作日划出。四、申购与赎回的程序

##### 2、申购和赎回的款项支付

.....

遇证券、期货交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其它非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程时，赎回款项顺延至下一个工作日划出。

#### 六、申购和赎回的价格、费用及其用途

7、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划。针对基金投资者定期和不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，基金管理人可以适当调低基金的销售费率。六、申购和赎回的价格、费用及其用途

7、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划。针对基金投资者定期和不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，对存量份额持有人无实质不利影响下，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金的销售费率。

#### 七、拒绝或暂停申购的情形

3、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

#### 八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

3、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

6、基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构的技术故障等异常情况导致基金销售系统、基金注册

登记系统或基金会计系统无法正常运行。七、拒绝或暂停申购的情形

3、证券、期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

3、证券、期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

## 第七部分 基金合同当事人及权利义务

### 一、基金管理人

#### (二) 基金管理人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

(15) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；

### 二、基金托管人

#### (二) 基金托管人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：

(4) 根据相关市场规则，为基金开设证券账户、为基金办理证券交易资金清算； 一、基金管理人

#### (二) 基金管理人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

(15) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券、期货经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；

### 二、基金托管人

#### (二) 基金托管人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：

(4) 根据相关市场规则，为基金开设证券账户、为基金办理证券、期货交易资金清算；

## 第十二部分 基金的投资

### 二、投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括固定收益类金融工具、股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票）、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）。

其中，固定收益类金融工具包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、地方政府债、政府支持机构债、政府支持债券、资产支持证券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、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）、货币市场工具等。

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。

本基金不直接在二级市场买入股票、权证等权益类资产，但可参与一级市场新股申购或增发新股，并持有因参与新股申购或增发所形成的股票以及因可转债转股所形成的股票、持有股票所派发的权证、可分离债券产生的权证以及法律法规或中国证监会允许投资的其他非固定收益类品种。因上述原因持有的股票和权证等资产，基金将在其可交易之日起的6个月内卖出。 二、投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、地方政府债、政府支持机构债、政府支持债券、资产支持证券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、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）、货币市场工具、同业存单、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）。

本基金不投资股票资产，但可持有因可转债转股所形成的股票、持有股票所派发的权证、可分离债券产生的权证。

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。



本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，股票等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%，现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，股票等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

### 三、投资策略

#### 3、新股认购策略：

本基金将深入研究上市公司新股的基本面因素、收益率、中签率以及股票市场整体估值水平，发掘新股的内在价值，综合考虑基金资产的周转率、成本费用率和市场资金的供需关系，从而制定相应的新股申购策略。

### 三、投资策略

#### 4、国债期货投资策略：

为有效控制债券投资的系统性风险，本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目的，适度运用国债期货，提高投资组合的运作效率。

在国债期货投资时，本基金将首先分析国债期货各合约价格与最便宜可交割券的关系，选择定价合理的国债期货合约。其次，考虑国债期货各合约的流动性情况，最终确定与现货组合的合适匹配，以达到风险管理的目标。

### 四、投资限制

#### 1、组合限制

(3) 现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；

#### 1、组合限制

(3) 本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；

.....

(13) 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%；

(14) 本基金在任何交易日日终，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%；

(15) 本基金所持有的债券（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）应当符合本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80% 的规定；

(16) 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%；

除上述第（3）、（11）、（16）、（17）项外，因证券市场波动、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。法律法规另有规定的，从其规定。除上述第（3）、（11）、（20）、（21）项外，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。法律法规另有规定的，从其规定。

### 五、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：中债综合指数。

本基金的业绩比较基准为：中债综合指数收益率。

### 六、风险收益特征

本基金属于债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金、股票型基金，高于货币市场基金。

## 六、风险收益特征

本基金属于债券型基金，其风险和预期收益率低于混合型基金、股票型基金，高于货币市场基金。

## 第十四部分 基金资产估值

### 一、估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券交易场所的交易日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非交易日。

### 二、估值对象

基金所拥有的股票、权证、债券、银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

一、估值日  
本基金的估值日为本基金相关的证券、期货交易场所的交易日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非交易日。

### 二、估值对象

基金所拥有的股票、国债期货、权证、债券、银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

### 三、估值方法

无 三、估值方法

5、国债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。

## 六、暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时； 六、暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

## 八、特殊情况的处理

1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 5 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

2、由于不可抗力，或证券交易所、登记机构及存款银行发送的数据错误…… 八、特殊情况的处理

1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 6 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

2、由于不可抗力，或证券交易所、期货交易所、登记机构及存款银行发送的数据错误……

## 第十五部分 基金费用与税收

### 一、基金费用的种类

7、基金的证券交易费用； 一、基金费用的种类

7、基金的证券、期货交易费用；

### 二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.70%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.70\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

#### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值 二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.30%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

## 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

## 第十六部分 基金的收益与分配

### 三、基金收益分配原则

1、本基金各基金份额类别在费用收取上不同，其对应的可分配收益可能有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等收益分配权；

2、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 70%，若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；

3、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为同一类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

### 三、基金收益分配原则

1、本基金各基金份额类别在费用收取上不同，其对应的可分配收益可能有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等收益分配权；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为同一类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

## 第十八部分 基金的信息披露

### 五、公开披露的基金信息

#### 无 五、公开披露的基金信息

#### (十) 投资国债期货信息披露

基金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露国债期货交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示国债期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标。

### 八、暂停或延迟披露基金信息的情形

1、基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

八、暂停或延迟披露基金信息的情形

1、基金投资所涉及的证券、期货交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

基金合同摘要中涉及上述内容的一并调整。  
本基金的托管协议涉及上述内容的将一并修订。此外，本公司将在下次更新的《招募说明书》中，对上述内容进行相应修改。修订后的《基金合同》、《托管协议》等文件将在本公司官网上披露。投资者可以登录本公司网站（<http://www.huatai-pb.com/>）查阅修订后的基金合同、托管协议全文或拨打客户服务电话（400-888-0001）咨询相关信息。

华泰柏瑞基金管理有限公司

二〇一八年十一月二十七日