华宝兴业基金管理有限公司关于以通讯方式召开华宝兴业中证短融50指数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

华宝兴业基金管理有限公司于 2014 年 3 月 24 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站（www.fsfund.com）发布了《华宝兴业基金管理有限公司关于以通讯方式召开华宝兴业中证短融 50 指数债券型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》。为了使本次基金份额持有人大会顺利召开，根据基金合同的相关规定，现发布本次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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》和《华宝兴业中证短融 50 指数债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，华宝兴业中证短融 50 指数债券型证券投资基金（以下简称“本基金”或“短融 50 基金”）的基金管理人华宝兴业基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）经与本基金的基金托管人中国银行股份有限公司协商一致，决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会。会议具体安排如下：

1、会议召开方式：通讯方式

2、会议投票表决起止时间：2014 年 4 月 14 日起，至 2014 年 4 月 25 日 17:00 止（以基金管理人收到表决票的时间为准）

3、会议通讯表决票的寄达地点

收件人：华宝兴业基金管理有限公司

地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼

邮政编码：200120

联系人：于帅

联系电话：400-700-5588，021-38924558

传真：021-38505777-904

通过专人送交、邮寄送达的，请在信封背面注明：“华宝兴业中证短融 50 指数债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”。

基金份额持有人也可将填妥的表决票和所需的相关文件按上述传真号码以传真方式发送至基金管理人。

二、会议审议事项

本次持有人会议审议事项为《关于华宝兴业中证短融 50 指数债券型证券投资基金转型有关事项的议案》（见附件一）。

三、权益登记日

本次大会的权益登记日为 2014 年 4 月 11 日，即该日下午交易时间结束后，在华宝兴业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会议的表决权。

四、表决票的填写和寄交方式

（一）本次会议表决票见附件二。基金份额持有人可通过登陆基金管理人网站下载（www.fsfund.com）或从报纸上剪裁、复印表决票。

（二）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，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有效身份证件正反面复印件，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、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（详见附件三）。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（详见附件三）。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和填妥的授权委托书原件（详见附件三）。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）。

（三）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 2014 年 4 月 14 日起，至 2014 年 4 月 25 日 17:00 以前（以基金管理人收到表决票的时间为准）通过专人送交、邮寄送达至以下地址或按以下传真号码以传真的方式送达至下述收件人：

收件人：华宝兴业基金管理有限公司

地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼

邮政编码：200120

联系人：于帅

联系电话：400-700-5588，021-38924558

传真：021-38505777-904

（四）投资者如有任何疑问，可致电本基金管理人客户服务电话 400-700-5588 或 021-38924558 咨询。

五、会议召开的条件和表决票数要求

本次会议召开的条件为：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基金份额占权益登记日基金总份额的 50%以上（含 50%）。

本会议表决的票数要求为：基金份额持有人所持每份基金份额享有一票表决权，不足一份的基金份额不具有表决权。本次议案按一般决议处理，即：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%）通过方为有效。

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定的事项自在中国证监会完成备案手续之日起生效。法律法规另有规定的，从其规定。

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（中国银行股份有限公司）授权代表的监督下在表决截止日的第二个工作日进行计票，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，所提供文件符合本会议通知规定，且在截止时间之前送达基金管理人的，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，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，或未能在截止时间之前送达基金管理人的，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：

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：专人送达的以实际递交时间为准，邮寄的以基金管理人收到的时间为准，传真的以基金管理人传真接收到的时间为准。

七、二次召集基金份额持有人大会及二次授权

根据《基金法》及《华宝兴业中证短融 50 指数债券型证券投资基金基金合同》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基金份额占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够成功召开，根据 2013 年 6 月 1 日生效的新修订的《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。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。

八、本次大会相关机构

1、召集人：华宝兴业基金管理有限公司

联系地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼

联系人：于帅

联系电话：021-38505888

传真：021-38505777-904

客户服务电话：400-700-5588.021-38924558

网址：www.fsfund.com

2、监督人：中国银行股份有限公司

联系地址：北京西城区复兴门内大街 1 号

联系人：王永民

联系电话：010-66594977

客户服务电话：95566

网址：www.boc.cn

3、公证机关：上海东方公证处

联系地址：上海市风阳路 660 号

联系人：林奇

联系电话：021-62154848

邮政编码：200041

4、见证律师事务所：上海通力律师事务所

联系电话：021-31358666

联系人：孙睿

见证律师：黎明、孙睿

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，提前寄出表决票。

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 400-700-5588 或 021-38924558 咨询。

3、基金管理人将在发布本公告后 2 个工作日内连续公布相关提示性公告，就持有人大会相关情况做必要说明，请予以留意。

4、本基金份额持有人大会召开期间，本基金日常申赎赎回业务照常进行，投资者可以按照本基金招募说明书的相关规定办理申购赎回。

5、本公告的有关内容由华宝兴业基金管理有限公司负责解释。

华宝兴业基金管理有限公司

2014 年 3 月 25 日

附件一：《关于华宝兴业中证短融 50 指数债券型证券投资基金转型有关事项的议案》

附件二：《华宝兴业中证短融 50 指数债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决票》

附件三：《授权委托书》

附件四：《华宝兴业中证短融 50 指数债券型证券投资基金转型方案说明书》

附件一：《关于华宝兴业中证短融 50 指数债券型证券投资基金转型有关事项的议案》

华宝兴业中证短融 50 指数债券型证券投资基金基金份额持有人：

鉴于华宝兴业中证短融 50 指数债券型证券投资基金（以下简称“短融 50 基金”）市场需求的变化，为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》、《证券投资基金运作管理办法》和《华宝兴业中证短融 50 指数债券型证券投资基金基金合同》有关规定，经基金管理人《华宝兴业基金管理有限公司》与基金托管人《中国银行股份有限公司》协商一致，提议召开本基金的基金份额持有人大会，对短融 50 基金实施转型。转型方案说明见附件四《华宝兴业中证短融 50 指数债券型证券投资基金转型方案说明书》。

同时，为实施短融 50 基金转型方案，提议本基金的基金份额持有人授权基金管理人办理本次基金转型的有关具体事宜，并根据持有人大会决议以及转型后基金运作的特点及现时有效的法律法规，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《华宝兴业中证短融 50 指数债券型证券投资基金基金合同》进行修改和补充。

以上议案，请予审议。

华宝兴业基金管理有限公司

2014 年 3 月 24 日

附件二：《华宝兴业中证短融 50 指数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名称：

证件号码（身份证件号/营业执照注册号）：

基金账户号：

表决事项：《关于华宝兴业中证短融 50 指数债券型证券投资基金转型有关事项的议案》

表决结果：

□同意	□反对	□弃权
机构基金份额持有人/代理人签章栏		个人基金份额持有人/代理人签字栏
单位公章：		签字：
日期：		日期：

说明：

1、请就表决内容表示“同意”、“反对”或“弃权”，并在□内画“√”；表决意见代表基金份额持有人所持全部基金份额的表决意见。“基金账户号”处空白、多填、错填、无法识别等情况的，将被默认为代表持有人所持有的本基金所有份额。

2、如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。

3、基金份额持有人可通过登陆基金管理人网站下载（www.fsfund.com）或从报纸上剪裁、复印本表决票。

附件三：《授权委托书》

兹委托 先生/女士/ 机构代表本人/本机构参加投票截止日为 2014 年 4 月 25 日的以通讯方式召开的华宝兴业中证短融 50 指数债券型证券投资基金基金份额持有人大会，并代为全权行使对所有议案的表决权。表决意见以受托人的表决意见为准。若华宝兴业中证短融 50 指数债券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。

委托人姓名/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）：

基金账户号：

受托人姓名/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： 年 月 日

附注：（1）本授权委托书中“委托人证件号码”，仅指基金份额持有人在开立基金账户时所使用的证件号码。（2）此授权委托书剪报、复印或按以上格式或内容自制在填写完整并签字盖章后均为有效。

附件四：《华宝兴业中证短融 50 指数债券型证券投资基金转型方案说明书》

华宝兴业中证短融 50 指数债券型证券投资基金（以下简称“本基金”或“短融 50 基金”）于 2012 年 6 月 12 日成立，华宝兴业基金管理有限公司为本基金的管理人，中国银行股份有限公司为本基金的托管人。

鉴于市场需求的变化，为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》、《证券投资基金运作管理办法》和《华宝兴业中证短融 50 指数债券型证券投资基金基金合同》（简称“基金合同”）等有关规定，基金管理人经与基金托管人中国银行股份有限公司协商一致，决定召开基金份额持有人大会，讨论关于短融 50 基金转型有关事项的议案。

本次短融 50 基金转型方案应当经参加大会的短融 50 基金基金份额持有人（或其代理人）所持表决权的 50%以上（含 50%）通过方为有效，故本转型方案存在无法获得相关持有人大会表决通过的可能。

持有人大会表决通过的事项需报中国证监会备案，自完成备案手续之日起生效。法律法规另有规定的，从其规定。中国证监会对本次短融 50 基金转型方案所作的任何决定或意见，均不表明其对本次转型方案、本基金的价值或者投资者的收益做出实质性判断或保证。

一、短融 50 基金转型方案要点

（一）更名

基金名称由“华宝兴业中证短融 50 指数债券型证券投资基金”更名为“华宝兴业活期通货币市场基金”。

（二）变更基金类别

基金类别由“债券型基金”变更为“货币市场基金”。

（三）调整基金的投资

1.投资目标

由“本基金通过指数化投资，实现对标的指数的有效跟踪，谋求基金资产的长期增值。”

变更为：

“保持本金的安全性和基金财产的流动性，追求高于比较基准的稳定收益。”

2.投资范围

由“本基金的投资范围包括中证短融 50 债券指数的成份券及其备选成份券、债券回购以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具（后简称合中国证监会相关规定）。本基金不投资股票或其他权益类资产。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。

本基金的投资比例为：中证短融 50 债券指数成份券及其备选成份券的投资比例不低于基金资产的 90%，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%，其它金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。”

变更为：

“本基金的投资范围包括：

1.现金；

2.通知存款；

3.短期融资券；

4.剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券；

5.1 年以内（含 1 年）的银行定期存款、大额存单；

6.期限在 1 年以内（含 1 年）的债券回购；

7.剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的资产支持证券；

8.期限在 1 年以内（含 1 年）的中央银行票据（以下简称“央行票据”）；

9. 剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的期票据；

10.中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

未来若法律法规或监管机构允许基金投资同业存单的，本基金可参与同业存单的投资，不需召开基金份额持有人大会，具体投资比例限制按届时有效的法律法规和监管机构的规定执行。

如法律法规或监管机构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。”

3.标的指数

删除标的指数部分内容：

“本基金债券资产跟踪的标的指数为中证短融 50 指数（指数代码：H11070）。

中证短融 50 指数是由中证指数有限公司开发的首只短期限成份类信用债券指数。该指数从银行间市场挑选 50 只流动性强、规模大的短期融资券组成样本，具有良好的市场代表性和可投资性，进一步推进了我国债券市场产品创新，为债券投资者提供了新的投资标的。”

4.投资策略

由“本基金为以中证短融 50 指数成份券为基础的被动式指数基金，采用最优复制法，综合考虑跟踪效果、操作风险、投资可行性等因素构建投资组合，并根据基金资产规模、日常申赎赎回情况、市场流动性以及银行间债券市场交易特性等情况，对投资组合进行优化调整，以力争对标的指数的有效跟踪。

在正常情况下，本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。如因指数编制规则或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

1、资产配置策略

本基金将以不低于基金资产的 90%的资产投资于中证短融 50 指数成份券和备选券。本基金采用最优复制法进行指数化投资，基金管理人将以中证短融 50 指数成份券为基础，综合考虑跟踪效果、操作风险、投资可行性等因素构建投资组合，并根据基金资产规模、日常申赎赎回情况、市场流动性以及银行间债券市场交易特性等情况，对投资组合进行替代优化调整，以力争对标的指数的有效跟踪，实现对跟踪误差的有效控制。

2、债券投资策略

（1）债券投资组合的构建

本基金的债券投资组合由标的指数的成份券和备选券构建组成。构建原则如下：

① 投资标的以配置标的指数成份券为目标；

② 当遇到成份券流动性不足、法律法规禁止本基金投资于相关券种、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市场因素及预期标的指数成份券即将调整或其他影响指数复制的因素时，本基金可以根据具体情况，对个券权重和券种进行适当调整，以期跟踪误差保持在合理范围内。当基金规模过小时，根据银行间债券市场交易特性，基金可能只能购买部分成份券；当基金规模过大时，受到市场流动性和个券发行量等影响，基金将从备选库中挑选替代券以满足跟踪需求。

（2）债券投资组合的调整

① 定期调整

本基金所构建的指数化投资组合将定期根据所跟踪的中证短融 50 指数对其成份券的调整而进行相应调整。

② 不定期调整

当本基金日常的申购赎回资金量无法按照标的指数构成交易成份券，或当成份券遇到流动性不足、法规限制等情况时，基金管理人将基于久期、信用等级、期限分布匹配的基础上，综合考虑替代券流动性、交易规模等因素，对债券投资组合进行动态调整，以期有效跟踪标的指数。

（3）备选库的选择和构建

单只成份券的替代券须首先在其他成份券中进行选择。本基金会在指数成份券库内无法找到合适替代券情况下，综合考虑以下原则在成份券库外寻找选择替代券，构建备选库：

① 信用评级相似；

② 剩余期限匹配；

③ 流动性强。

（4）债券投资组合的优化

为了更好地进行指数跟踪，在债券投资组合整体构建过程中，我们通过久期匹配，信用等级匹配、期限分布匹配等方法进行整体优化调整。具体如下：

① 久期匹配

是指以投资组合久期与标的指数久期相匹配为目标，从而使得在收益率曲线平行移动的情况下，债券投资组合和标的指数走势一致。

② 信用等级匹配

是指以投资组合各信用等级权重与标的指数权重相一致为目标，力争基金组合各信用等级债券权重与标的指数分布相匹配，减少信用等级错配的跟踪误差。

③ 期限分布匹配

是指以投资组合各个期限段权重与标的指数分布相匹配为目标，减少期限利差变动造成的跟踪误差。”

变更为：

“本基金通过对短期金融工具的积极稳健投资，在保持本金安全与资产充分流动性的前提下，追求稳定的现金收益。主要投资策略如下：

1.久期策略

基于对宏观经济环境的深入研究，预期未来市场利率的变化趋势，结合基金未来现金流的分析，确定投资组合平均剩余期限，把握买卖时机。如果预测未来利率将上升，则可以通过缩短组合平均剩余期限的办法规避利率风险，相反，如果预测未来利率下降，则延长组合平均剩余期限，赚取利率下降带来的超额回报。本基金的平均剩余期限控制在 120 天以内。

2.收益率曲线策略

收益率曲线策略是根据收益曲线的非平行移动调整资产组合，将预期到的变动资本化。其中有三种方式可以选择：子弹策略是将偿还期限高度集中于收益率曲线上的某一点；哑铃策略是将偿还期限集中于曲线的两端，即重点投资于期限较短的债券和期限较长的债券，弱化中期债的投资；而梯形策略是当收益率曲线的凸起部分均匀分布时，集中投资于这几个凸起部分所在年期的债券。

3.类属配置策略

类属配置策略主要实现两个目标：一是通过类属配置满足基金流动性需求，二是通过类属配置获得投资收益。本基金将根据各品种（国债、金融债、央行票据、债券回购、短期融资券、现金等）的市场规模、交易活跃程度、相对收益、信用等级、平均到期期限等重要指标来确定各类资产的配置比例。再通过评估各类资产的流动性和收益性利差，确定不同期限类别资产的具体资产配置比例。

4.套利策略

由于市场环境差异、交易市场分割、市场参与者差异，以及资金供求失衡导致的中短期利率异常差异，使得债券现券市场上存在着套利机会。无风险套利主要包括银行间市场、交易所市场的跨市场套利和同一交易市场中不同品种的跨品种套利。基金管理人将在保证基金的安全性和流动性的前提下，适当参与市场的套利，捕捉和把握无风险套利机会，进行跨市场、跨品种操作，以期获得安全的超额收益。

5.逆回购策略

基金管理人将密切关注短期资金需求激增的机会，通过逆回购的方式融出资金以分享短期资金拆借利率陡升的投资机会。

6.现金流管理策略

本基金作为现金管理工具，必须具备较高的流动性。投资运作中本基金将采用均衡分布、滚动投资、优化期限配置等方法，加强流动性管理。基金管理人将密切关注基金的申购赎回情况、季节性资金流动情况和日历效应等因素，对投资组合的现金比例进行结构化管理。同时，也会通过回购的滚动操作和债券品种的期限结构搭配，动态调整并有效分配基金的现金流，保持本基金的充分流动性。”

5. 投资限制

由“1.禁止用本基金财产从事以下行为

（1）承销证券；

（2）向他人贷款或者提供担保；

（3）从事承担无限责任的投资；

（4）买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；

（5）向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；

（6）买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；

（7）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

（8）依照法律、行政法规有关法律法规规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

2.基金投资组合比例限制

（1）本基金的投资比例为：中证短融 50 债券指数成份券及其备选成份券的投资比例不低于基金资产的 90%，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%，其它金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定；

（2）本基金与基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券总和，不超过该证券的 10%，但本基金跟踪标的指数的指数化投资部分不计入本项限制；

（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%；本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

（4）法律法规和基金合同规定的其他限制。

3.若将来法律法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更，致使本款前述约定的投资禁止行为和投资组合比例限制被修改或取消，基金管理人在依法履行相应 程序后，本基金可相应调整禁止行为和投资限制规定。”

变更为：“1.组合限制

基金的投资组合将遵循以下限制：

（1）本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天；

（2）本基金与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%；

（3）华泰联行仅限于有证券投资基金托管资格、证券投资基金销售业务资格以及合格境外机构投资者托管人资格的商业银行。本基金投资于定期存款的比例不得超过基金资产净值的 30%，根据协议可提前支取且没有利息损失的银行存款，可不受此限制；

（4）本基金存放在具有基金托管资格的同一商业银行的存款，不得超过基金资产净值的 30%；存放在不具有基金托管资格的同一商业银行的存款，不得超过基金资产净值的 5%；

（5）在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不展期；

（6）投资于同一公司发行的短期企业债券和短期融资券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；

（7）除发生巨额赎回情形外，本基金债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的 20%；

（8）本基金持有的剩余期限不超过 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券的摊余成本总计不得超过当日基金资产净值的 20%。本基金不得投资于以定期存款利率为基准利率的浮动利率债券；

（9）买断式回购融入基础债券的剩余期限不得超过 397 天；

（10）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%；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%；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%；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%；

（11）本基金应投资于信用级别评级为 AAA 以上（含 AAA）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；

（12）本基金投资的短期融资券的信用评级应不低于以下标准：

A.国内信用评级机构评定的 A-1 级或相当于 A-1 级的短期信用级别；

B.根据有关规定予以豁免信用评级的短期融资券，其发行人最近 3 年的信用评级和跟踪评级应具备下列条件之一：

A 国内信用评级机构评定的 AAA 级或相当于 AAA 级的长期信用级别；

B 国际信用评级机构评定的低于中国主权评级一个级别的信用级别。同一发行人同时具有国内信用评级和国际信用评级的，以国内信用级别为准。本基金持有的短期融资券信用等级下降、不再符合投资标准的，基金管理人应在评级报告发布之日起 20 个交易日内对其予以全部减持；

（13）法律法规或中国证监会规定的其他比例限制。

法律法规或监管部门变更或取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制或以变更后的规定为准。

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，除第（7）、（11）、（12）另有约定项外，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。对于第（7）项，基金管理人应当在 5 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。

2.本基金不得投资于以下金融工具：

（1）股票、权证；

（2）可转换债券；

（3）剩余期限超过 397 天的债券；

（4）信用等级在 AAA 级以下的企业债券；

（5）以定期存款利率为基准利率的浮动利率债券；

（6）华泰联行同债券市场或证券交易所交易的资产支持证券；

（7）中国证监会、中国人民银行禁止投资的其他金融工具。

法律法规或监管部门取消上述限制，基金管理人履行适当程序后，本基金不受上述规定的限制。

3.禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

（1）承销证券；

（2）违反规定向他人贷款或者提供担保；

（3）从事承担无限责任的投资；

（4）买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；

（5）向其基金管理人、基金托管人出资；

（6）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

（7）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

法律、行政法规或监管部门取消上述限制，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。”

6.业绩比较基准

由“95%×中证短融 50 指数收益率 + 5%×银行活期存款（税后）收益率”

变更为：“人民币活期存款利率（税后）”。

7. 风险收益特征

由“本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金和股票型基金，高于货币市场基金。”

变更为：“本基金为货币市场基金，是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。”

（四）对基金份额进行分类

本基金根据投资人持有基金份额的时间，分别设置“A 类、T 类两类基金份额，每类基金份额按照不同的费率计提销售服务费用。

本基金“A 类基金份额开放申购和赎回业务，T 类基金份额不开放申购业务，只开放赎回业务。

1. 本基金根据投资人持有基金份额的时间，确定持有基金份额所适用的份额类别以及其销售服务费：

项目	A类基金份额	T类基金份额
单笔基金份额的持有时间（N 为持有时间）：	N<90 日	N≥90 日
销售服务费率（年费率）	0.25%	0.01%

2. 本基金“A 类基金份额自申购确认之日起，该笔基金份额在单个基金账户的持有时间达到 90 日时，该账户持有的该笔基金份额由“A 类基金份额自动升级为“T 类基金份额。满足升级条件的当日若为非工作日，则升级日期顺延至下一工作日。

3. T 类基金份额不作降级处理。

4. 短融 50 基金转型完成后，原短融 50 基金基金份额持有人持有的基金份额将直接转为华宝兴业活期通货币市场基金的“T 类基金份额。

（五）对基金费用进行了调整

1. 基金管理人的管理费

由“基金管理人的基金管理费按基金资产净值的 0.5%年费率计提。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 0.5%年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.5%÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。”

变更为：

“基金管理人的基金管理费按基金资产净值的 0.33%年费率计提。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 0.33%年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.33%÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。”

（六）调整基金收益分配原则

由“1.基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式，基金份额持有人可自行选择收益分配方式；基金份额持有人事先未做出选择的，默认的分红方式为现金红利；选择红利再投资的，现金红利则按除息日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；

2、每一基金份额享有同等分配权；

3、基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值，基金收益分配基准日即期末可供分配利润计算截止日；

4、在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年至多 12 次；每次基金收益分配比例不得低于期末可供分配利润的 10%。基金的收益分配比例以期末可供分配利润为基准计算，期末可供分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数为准。基金合同生效不满三个月，收益可不分配；

5、基金红利发放日距离收益分配基准日的时间不超过 15 个工作日；

6、投资者的现金红利和分红再投资形成的基金份额均保留到小数点后第 2 位，小数点后第 3 位开始舍去，舍去部分归基金资产；

7、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。”

变更为：“本基金收益分配应遵循下列原则：

1.本基金同一类别内的每份基金份额享有同等分配权；

2.本基金收益分配方式为红利再投资，免收再投资的费用；

3. 每日分配，按月支付”。本基金根据每日基金收益情况，以每万份基金已实现收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，每月集中支付。投资人当日收益分配的计算保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位按去尾原则处理（因去尾形成的余额自动合并入下一日收益中进行分配）；

4.本基金根据每日收益情况，将当日收益全部分配，若当日已实现收益大于零时，为投资人记正收益；若当日已实现收益小于零时，为投资人记负收益；若当日已实现收益等于零时，当日投资人不记收益；

5.本基金每日进行收益计算并分配时，每月累计收益支付方式只采用红利再投资（即红利转基金份额）方式，投资人可通过赎回基金份额获得现金收益；若投资人在每月累计收益支付时，其累计收益为正值，则为投资人增加相应的基金份额，其累计收益为负值，则缩减投资人基金份额。若投资人赎回基金份额时，其对应收益将立即结清；若收益为负值，则从投资人赎回基金款中扣除；

6.当日申购的基金份额自下一工作日起，享有基金的收益分配权益；当日赎回的基金份额自下一工作日起，不享有基金的收益分配权益；

7.法律法规或监管机构另有规定的从其规定。”

在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

（七）增加存续条件

增加存续条件：基金合同生效后，连续 60 个工作日基金资产净值低于 1 亿元，经与基金托管人协商一致，基金管理人可以终止基金合同，不需召开基金份额持有人大会。”

（八）授权基金管理人修订基金合同等法律文件

首先，由于短融 50 基金拟进行上述转型，基金名称、投资目标、投资范围、投资策略、业绩比较基准、风险收益特征、份额分类及费率结构等内容发生相应变更，基金管理人需根据持有人大会决议以及转型后基金运作的特点相应修订《华宝兴业中证短融 50 指数债券型基金基金合同》的相关内容。

其次，基金管理人拟将基金名称变更为“华宝兴业活期通货币市场基金”，并将《华宝兴业中证短融 50 指数债券型证券投资基金基金合同》变更为《华宝兴业活期通货币市场基金基金合同》。

第三，由于《中华人民共和国基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的修订，基金管理人需要根据现行有效的法律法规相应修订《华宝兴业中证短融 50 指数债券型基金基金合同》的相关内容。

综上所述，拟请持有人大会授权基金管理人根据上述事项修订基金合同的内容，并在经基金托管人审核同意后，报中国证监会备案。

（九）短融 50 基金份额折算

自基金份额持有人大会决议生效日起五个工作日内，本基金基金管理人将对短融 50 基金进行份额折算，基金份额折算方案如下：

1. 折算前短融 50 基金基金份额净值的计算

折算前短融 50 基金基金份额净值=折算基准日闭市后的基金资产净值/折算前基金份额的余额数量

其中，基金资产净值为基金资产总值减去负债后的价值。

折算前短融 50 基金基金份额净值的计算保留到小数点后 8 位，小数点后第 9 位四舍五入，由此产生的计算误差归入基金资产，并由基金管理人通知基金托管人对账务进行调整。

2. 基金份额折算公式

短融 50 基金基金份额折算为本基金份额的份额数=折算基准日登记在册的原华宝兴业短融 50 基金份额的份额数×NAV/1.00

其中，

NAV 为折算前短融 50 基金基金份额净值；

由短融 50 基金基金份额折算为的本基金份额的份额数，保留到小数点后 2 位，采用循环进位的方法分配因小数点运算引起的剩余份额。

3. 暂停申购、赎回等业务

为确保短融 50 基金转型期间严格执行相关《基金合同》的规定，从而保证转型前后各基金份额持有人的利益，本基金于份额折算日前一个工作日起暂停日常申购（含定期定额投资）、赎回、转换（含转出、转入）等业务，直至份额折算日之后的第二个工作日起重新开放日常赎回业务，在基金合同生效日起不超过三个月内开放日常申购（含定期定额投资）及转换（含转出、转入）业务，基金管理人将在申购开放日前按照《信息披露办法》有关规定在指定媒体上公告。

4. 基金份额折算结果的公告

基金份额折算完成后，基金管理人应按照《信息披露办法》在至少一家指定媒体和基金管理人网站公告基金份额折算结果，并报中国证监会备案。

（十）华宝兴业活期通货币市场基金基金合同的生效

自短融 50 基金份额折算日