工银瑞信基金管理有限公司关于以通讯方式召开工银瑞信瑞丰定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告

工银瑞信基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）已于2020年10月15日在《证券时报》及基金管理人官网（www.icbccs.com.cn）发布了《工银瑞信基金管理有限公司关于以通讯方式召开工银瑞信瑞丰定期开放纯债债券型发起式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，现发布关于以通讯方式召开工银瑞信瑞丰定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告。

一、会议基本情况

根据《中华人民共和国证券投资基金法》（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《工银瑞信瑞丰定期开放纯债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，本基金管理人决定召开本基金的基金份额持有人大会，审议《关于工银瑞信瑞丰定期开放纯债债券型发起式证券投资基金变更相关事项的议案》。

1、会议召开方式：通讯方式。

2、会议投票表决起止时间：自2020年10月15日起，至2020年11月13日17:00止（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：工银瑞信基金管理有限公司工银瑞信瑞丰定期开放纯债债券型发起式证券投资基金持有人大会投票处

地址：北京市西城区德胜门外大街77号德胜国际中心D座4层

邮政编码：100088

联系电话：400-811-9999

二、会议审议事项

本次持有人大会审议的事项为《关于工银瑞信瑞丰定期开放纯债债券型发起式证券投资基金变更相关事项的议案》（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2020年10月19日，即在2020年10月19日交易时间结束后，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。

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（http://www.icbccs.com.cn/）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（或其他经会议召集人认可的业务预留印章等除外，下同），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，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（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，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或通过本公告规定的电话授权方式授权基金管理人、基金托管人（即中国光大银行股份有限公司）和销售机构投票的，接受有效委托的基金管理人、基金托管人和销售机构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。

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10月15日起，至2020年11月13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（北京市西城区德胜门外大街77号德胜国际中心D座4层），并请在信封表面注明：“工银瑞信瑞丰定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”。

（二）短信投票

为方便基金份额持有人参与本次基金份额持有人大会，自2020年10月15日起，至2020年11月13日17:00止（以基金管理人系统记录时间为准），基金管理人提供以下短信通道供投资者进行投票。

基金管理人通过短信平台向已获取手机号码的个人基金份额持有人发送征集投票短信，基金份额持有人回复短信表明表决意见。

基金份额持有人通过短信投票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暂不开通。

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。

如因上行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，导致上行投票短信无法接收到或逾期接收到，短信投票无效，基金管理人不承担任何责任，基金份额持有人可以选择基金管理人认可的其他投票方式进行投票。

（三）电话投票

为方便基金份额持有人参与本次基金份额持有人大会，基金管理人于会议投票表决起止时间内（自2020年10月15日起，至2020年11月13日17:00止，以系统记录时间为准）在客服电话上增设持有人专用通道，基金份额持有人可拨打并按提示转人工坐席，在人工坐席核实基金份额持有人身份后进行电话投票。

基金管理人、基金托管人和主要销售机构的呼叫中心也将主动与基金份额持有人取得联系，在通话过程中以回答提问方式核实基金份额持有人身份后，由人工坐席根据客户意愿向基金份额持有人征集表决意见。为保护基金份额持有人利益，整个通话过程将录音。

基金份额持有人通过电话投票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暂不开通。

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。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工银瑞信基金管理有限公司的登记为准。

（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可通过纸面、电话等其他法律法规和中国证监会认可的授权方式授权受托人代为行使表决权。

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、复印或登录基金管理人网站（http://www.icbccs.com.cn/）下载等方式获取授权委托书样本。

基金份额持有人无论通过纸面方式授权还是非纸面方式授权，授权形式及程序均应符合本公告的规定。

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（若无具体表决意见则视为授权受托人按照受托人的意见表决），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）对基金管理人、基金托管人或销售机构的纸面授权文件的送达

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。

2、电话授权方式

为方便基金份额持有人参与本次基金份额持有人大会，基金管理人在客服电话上增设持有人专用通道，基金份额持有人可拨打并按提示转人工坐席，在人工坐席核实基金份额持有人身份后进行授权。

基金管理人、基金托管人和主要销售机构的呼叫中心也将主动与基金份额持有人取得联系，在通话过程中以回答提问方式核实基金份额持有人身份后，由人工坐席根据客户意愿向基金份额持有人征集表决意见。为保护基金份额持有人利益，整个通话过程将录音。

基金份额持有人通过电话等其他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暂不开通。

3、授权效力确定规则

（1）如果同一基金份额存在包括有效纸面方式授权和其他非纸面方式有效授权的，以有效的纸面授权为准。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表示了具体表决意见的，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；若最后时间收到的多次纸面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；

（2）如果同一基金份额在只存在有效纸面方式授权时，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；

（3）如果同一基金份额无有效纸面方式授权，但存在有效的其他非纸面方式授权的，以有效的其他非纸面方式的授权为准；

（4）如果同一基金份额以非纸面方式进行多次授权的，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项，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其授权表示一致的，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；

（5）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；

（6）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。

4、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10月15日至2020年11月13日16:30时。将纸面授权委托书寄送或专人送达给基金管理人、基金托管人或销售机构的指定地址的，授权时间以收到时间为准；通过其他非纸面方式授权的，授权时间以系统记录时间为准。

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（中国光大银行股份有限公司）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，表决时间以收到时间为准；通过其他非纸面方式表决的，表决时间以系统记录时间为准。2020年10月15日前及2020年11月13日17:00以后送达收件人的纸面表决票，均为无效表决。非纸面方式的表决起讫时间以本公告为准。

（2）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。

（3）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、多选或字迹无法辨认或意愿无法判断或表决意见空白的，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。

（4）如果同一基金份额以非纸面方式进行多次表决的，以时间在最后的表决为准。

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代表的本基金基金份额占权益登记日基金总份额的50%以上（含50%）；

2、《关于工银瑞信瑞丰定期开放纯债债券型发起式证券投资基金变更相关事项的议案》应当由提交有效表决意见的本基金基金份额持有人(或其受托人)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《工银瑞信瑞丰定期开放纯债债券型发起式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本基金基金份额占权益登记日基金总份额的50%以上（含50%）。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：工银瑞信基金管理有限公司

客服电话：400-811-9999

联系人：胡金平

联系电话：010-66583052

电子邮件：hu.jinping@icbccs.com.cn

传真：010-66583100

网址：http://www.icbccs.com.cn

2、公证机构：北京市方圆公证处

地址：北京市东城区东水井胡同5号北京INN大厦五层A528

联系人：原莹

联系电话：010-85197530

邮政编码：100010

3、见证律师：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) 3135 8666

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工银瑞信基金管理有限公司网站（http://www.icbccs.com.cn）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400-811-9999咨询。

3、本公告的有关内容由工银瑞信基金管理有限公司解释。

附件一：《关于工银瑞信瑞丰定期开放纯债债券型发起式证券投资基金变更相关事项的议案》

附件二：《工银瑞信瑞丰定期开放纯债债券型发起式证券投资基金变更方案说明书》

附件三：授权委托书（样本）

附件四：工银瑞信瑞丰定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金份额持有人大会表决票

工银瑞信基金管理有限公司

2020年10月17日

附件一：

《关于工银瑞信瑞丰定期开放纯债债券型发起式证券投资基金变更相关事项的议案》

工银瑞信瑞丰定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金份额持有人：

根据市场环境变化，为更好地满足投资者需求，保护基金份额持有人的利益，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《工银瑞信瑞丰定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金管理人经与基金托管人中国光大银行股份有限公司协商一致，提议对工银瑞信瑞丰定期开放纯债债券型发起式证券投资基金的投资范围、收益分配次数等进行变更并修订基金合同，同时将本基金更名为“工银瑞信瑞丰半年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金”。《工银瑞信瑞丰定期开放纯债债券型发起式证券投资基金变更方案说明书》见附件二。

为实施工银瑞信瑞丰定期开放纯债债券型发起式证券投资基金的变更方案，提议授权基金管理人办理本次工银瑞信瑞丰定期开放纯债债券型发起式证券投资基金变更的有关具体事宜，并可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《工银瑞信瑞丰定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》进行必要的修改和补充。

以上议案，请予审议。

工银瑞信基金管理有限公司

附件二：

《工银瑞信瑞丰定期开放纯债债券型发起式证券投资基金变更方案说明书》

一、声明

1、为更好地满足投资者的需求，保护基金份额持有人利益，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《工银瑞信瑞丰定期开放纯债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，基金管理人经与基金托管人中国光大银行股份有限公司协商一致，决定以通讯方式召开基金份额持有人大会，审议《关于工银瑞信瑞丰定期开放纯债债券型发起式证券投资基金变更相关事项的议案》。本次工银瑞信瑞丰定期开放纯债债券型发起式证券投资基金变更事宜属于实质性调整，经基金管理人向中国证监会申请，已经中国证监会准予变更注册。

2、本次工银瑞信瑞丰定期开放纯债债券型发起式证券投资基金变更方案需经参加大会的本人直接出具表决意见和授权他人代表出具表决意见的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过，因此变更方案存在无法获得相关基金份额持有人大会表决通过的可能。参加基金份额持有人大会表决的基金份额持有人为权益登记日登记在册的工银瑞信瑞丰定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金份额持有人，本人直接出具表决意见和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须占权益登记日基金总份额的50%以上（含50%）。

3、基金份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会备案。基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效，并在生效后方可执行。法律法规另有规定的，从其规定。中国证监会对本次工银瑞信瑞丰定期开放纯债债券型发起式证券投资基金变更方案所作的任何决定或意见，均不表明其对本次变更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、工银瑞信瑞丰定期开放纯债债券型发起式证券投资基金变更方案要点

工银瑞信瑞丰定期开放纯债债券型发起式证券投资基金变更方案的主要内容如下：

（一）更名

基金名称由“工银瑞信瑞丰定期开放纯债债券型发起式证券投资基金”更名为“工银瑞信瑞丰半年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金”。

（二）投资范围的变更

删除原投资范围内的“可转换债券（含可分离交易可转债的纯债部分）、可交换债券、国债期货”。

变更后的投资范围如下：

“本基金的投资范围包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、次级债、政府支持机构债券、证券公司短期公司债券、资产支持证券、银行存款、同业存单、债券回购等固定收益类金融工具，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。

本基金不投资于股票等权益类资产，亦不可投资可转换债券、可交换债券。

本基金买入信用债的债项评级不得低于AA+，其中短期融资券、超短期融资券等短期信用债的信用评级依照评级机构出具的主体信用评级。

本基金投资组合资产配置比例：债券资产占基金资产的比例不低于80%，但在每次开放期开始前15个工作日、开放期及开放期结束后15个工作日的期间内，基金投资不受上述比例限制；开放期内，本基金所持有现金及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%；在封闭期内，本基金不受该比例的限制。其中，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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，其投资比例遵循届时有效法律法规或相关规定。”

（三）投资策略的变更

删除原投资策略中的国债期货投资策略、可转换债券投资策略和可交换债券投资策略。

变更后的投资策略如下：

“1、封闭期投资策略

（1）利率预期策略与久期管理

本基金将考察市场利率的动态变化及预期变化，对GDP、CPI、PPI、外汇收支及国际市场流动性动态情况等引起利率变化的相关因素进行深入的研究，分析国际与国内宏观经济运行的可能情景，并在此基础上判断包括财政政策以及国内和主要发达国家及地区的货币政策、汇率政策在内的宏观经济政策取向，对市场利率水平和收益率曲线未来的变化趋势做出预测和判断，结合债券市场资金及债券的供求结构及变化趋势，确定固定收益类资产的久期配置。

当预期市场利率水平将上升时，降低组合的久期；预期市场利率将下降时，提高组合的久期。以达到利用市场利率的波动和债券组合久期的调整提高债券组合收益率目的。

本基金根据对收益率曲线形状变动的预期建立或改变组合期限结构。通过预测收益率曲线变动的方向，然后根据收益率曲线形状变动的情景分析，构建组合的期限结构。具体来看，又分为跟踪收益率曲线的骑乘策略和基于收益率曲线变化的子弹策略、杠铃策略及梯式策略。

1）骑乘策略是基于收益率曲线分析对债券组合进行适时调整。当收益率曲线比较陡峭时，即相邻期限利差较大时，可以买入期限位于收益率曲线陡峭处的债券，也即收益率水平相对较高的债券，随着持有期限的延长，债券的剩余期限将会缩短，此时债券的收益率水平将会较投资期初有所下降，通过债券收益率的下滑来获得资本利得收益。

2）子弹策略是使投资组合中债券久期集中于收益率曲线的一点，适用于收益率曲线较陡时；杠铃策略是使投资组合中债券的久期集中在收益率曲线的两端，适用于收益率曲线两头下降较中间下降更多的蝶式变动；梯式策略是使投资组合中的债券久期均匀分别于收益率曲线，适用于收益率曲线水平移动。

（2）类属配置策略

类属配置主要包括资产类别选择、各类资产的适当组合以及对资产组合的管理。本基金将在利率预期分析及其久期配置范围确定的基础上，通过情景分析和历史预测相结合的方法，“自上而下”在债券一级市场和二级市场，银行间市场和交易所市场，银行存款、信用债、政府债券等资产类别之间进行类属配置，进而确定具有最优风险收益特征的资产组合。

（3）信用债投资策略

根据发行人公司所在行业发展以及公司治理、财务状况等信息对债券发行人主体进行评级，在此基础上，进一步结合债券发行具体条款（主要是债券担保状况）对债券进行评级。根据信用债的评级，给予相应的信用风险溢价，与市场上的信用利差进行对比，发掘具备相对价值的个券。

本基金买入信用债的债项评级不得低于AA+，其中短期融资券、超短期融资券等短期信用债的信用评级依照评级机构出具的主体信用评级。

本基金投资AA+的信用债券占基金资产净值的比例不超过80%；投资AAA的信用债券及利率债占基金资产净值的比例不低于20%。

（4）息差策略

本基金可以通过债券回购融入和滚动短期资金作为杠杆，投资于收益率高于融资成本的其它获利机会，从而获得杠杆放大收益。本基金进入银行间同业市场进行债券回购的资金余额不超过基金净资产的40%。

（5）资产支持证券投资策略

资产支持证券主要包括资产抵押贷款支持证券（ABS）、住房抵押贷款支持证券（MBS）等证券品种。本基金将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析，并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型，评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。

2、开放期投资策略

开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种，减小基金净值的波动。”

（四）投资限制的变更

根据投资范围的变更，对应删除涉及可转换债券（含可分离交易可转债的纯债部分）、可交换债券、国债期货的投资限制。

变更后的投资限制如下：

“1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）债券资产占基金资产的比例不低于80%，但在每次开放期开始前15个工作日、开放期及开放期结束后15个工作日的期间内，基金投资不受上述比例限制；

（2）开放期内，本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的5%，在封闭期内，本基金不受该比例的限制；其中，现金类资产不包括结算备付金、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%，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AA以上(含AA)的资产支持证券，若资产支持证券无债项评级，其主体评级或担保主体的评级为AA（含）以上。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）本基金买入信用债的债项评级不得低于AA+，其中短期融资券、超短期融资券等短期信用债的信用评级依照评级机构出具的主体信用评级。本基金投资AA+的信用债券占基金资产净值的比例不超过80%；投资AAA的信用债券及利率债占基金资产净值的比例不低于20%；

（11）本基金投资于资产支持证券和次级债的比例，不得超过基金资产净值的30%；

（12）本基金在封闭期内，基金总资产不得超过基金净资产的200%；在开放期内，基金总资产不得超过基金净资产的140%；

（13）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；

（14）本基金开放期内主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的15%。因证券市场波动、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；

（15）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；

（17）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。

除上述第（2）、（9）、（14）、（15）项另有约定外，因证券市场波动、上市公司合并、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或本基金合同另有约定的除外。

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、投资策略应当符合本基金合同的约定。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。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。”

（五）估值的方法的调整

删除原估值方法中“本基金投资国债期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值日无结算价的，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”的条款。

（六）收益分配次数的变更

将“本基金每年收益分配次数最多为6次”调整变更为“本基金每年收益分配次数最多为12次”。

（七）授权基金管理人修订基金合同、托管协议

除上述主要内容的调整需要修改基金合同以外，基金管理人需要根据现行有效的法律法规要求及变更后的工银瑞信瑞丰半年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金的产品特征修订《工银瑞信瑞丰定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》、《工银瑞信瑞丰定期开放纯债债券型发起式证券投资基金托管协议》的相关内容，基金管理人提请基金份额持有人大会授权基金管理人修订基金合同和托管协议。

（八）变更选择期的相关安排

本次持有人大会决议生效后，工银瑞信瑞丰定期开放纯债债券型发起式证券投资基金将安排不少于20个工作日的变更选择期。

变更选择期期间，工银瑞信瑞丰定期开放纯债债券型发起式证券投资基金的申购、赎回业务及交易业务按照《基金合同》的约定照常办理，不受影响。基金份额持有人在工银瑞信瑞丰定期开放纯债债券型发起式证券投资基金正式实施变更前可选择赎回，对于在变更选择期内未作出选择的基金份额持有人，其持有的工银瑞信瑞丰定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金份额将默认变更为工银瑞信瑞丰半年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金份额。

在变更选择期期间，由于工银瑞信瑞丰定期开放纯债债券型发起式证券投资基金需应对赎回，基金份额持有人同意在变更选择期豁免工银瑞信瑞丰定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金合同中约定的投资组合比例限制等条款。

基金管理人提请基金份额持有人大会授权基金管理人据此落实相关事项，并授权基金管理人可根据实际情况做相应调整，以及根据实际情况可暂停申购、赎回或调整赎回方式等。具体安排详见基金管理人届时发布的相关公告。

（九）《工银瑞信瑞丰半年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》的生效

自本次持有人大会决议生效后，变更选择期结束之日的次日起，《工银瑞信瑞丰半年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》生效，原《工银瑞信瑞丰定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》同日起失效。

综上所述，基金管理人拟提请基金份额持有人大会授权基金管理人按照法律法规的规定及《工银瑞信瑞丰定期开放纯债债券型发起式证券投资基金变更方案说明书》以上变更方案要点修订基金合同并实施变更方案。

（十）发起基金申购份额的安排

发起资金已申购转型前的工银瑞信瑞丰定期开放纯债债券型发起式证券投资基金，发起资金提供方将继续持有该部分基金份额，持有期限自申购确认之日或原《工银瑞信瑞丰定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》生效之日孰晚日起计算不少于3年。

三、基金管理人就方案相关事项的说明

（一）基金的历史沿革

工银瑞信瑞丰半年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金由工银瑞信瑞丰定期开放纯债债券型发起式证券投资基金变更而来，工银瑞信瑞丰定期开放纯债债券型发起式证券投资基金则由工银瑞信瑞丰纯债半年定期开放债券型证券投资基金变更而来。工银瑞信瑞丰纯债半年定期开放债券型证券投资基金经中国证监会2016年3月30日《关于准予工银瑞信瑞丰纯债半年定期开放债券型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2016]633号文）注册募集，基金管理人为工银瑞信基金管理有限公司，基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

工银瑞信瑞丰纯债半年定期开放债券型证券投资基金自2016年4月13日至2016年4月20日进行公开募集，募集结束后基金管理人向中国证监会办理备案手续。经中国证监会书面确认，《工银瑞信瑞丰纯债半年定期开放债券型证券投资基金基金合同》于2016年4月22日起正式生效。

经中国证监会 2017 年12月29日《关于准予工银瑞信瑞丰纯债半年定期开放债券型证券投资基金变更注册的批复》，工银瑞信瑞丰纯债半年定期开放债券型证券投资基金就基金变更事宜进行变更注册。

工银瑞信瑞丰纯债半年定期开放债券型证券投资基金自2018年4月3日至2018年5月2日召开基金份额持有人大会，会议审议通过了《关于工银瑞信瑞丰纯债半年定期开放债券型证券投资基金变更相关事项的议案》，内容包括工银瑞信瑞丰纯债半年定期开放债券型证券投资基金变更为发起式基金以及修订基金合同等，并同意将变更后基金更名为“工银瑞信瑞丰定期开放纯债债券型发起式证券投资基金”，上述基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。

（二）基金变更的可行性

1、法律层面不存在障碍

根据基金合同，“第八部分 基金份额持有人大会 一、召开事由 1、除法律法规、中国证监会另有规定的以外，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：……（4）转换基金运作方式；……（8）变更基金投资目标、范围或策略；……”

本次持有人大会审议的事项须经特别决议通过，以通讯方式召开。在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

（1）召集人按基金合同规定公告会议通知后，在两个工作日内连续公布相关提示性公告；

（2）召集人按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的表决意见；

（3）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不少于权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）；

（4）直接出具表决意见的基金份额持有人或受托代表他人出具表决意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具表决意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与登记机构记录相符。

对于特别决议应当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。

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表决通过的事项，召集人应当自通过之日起五日内报中国证监会备案。

因此，工银瑞信瑞丰定期开放纯债债券型发起式证券投资基金变更的方案符合基金合同和有关法律法规的规定。

2、基金变更不存在技术障碍

工银瑞信瑞丰定期开放纯债债券型发起式证券投资基金变更后，将进行基金份额变更登记。工银瑞信基金管理有限公司已就变更登记有关事项进行了充分准备，技术可行。基金变更不存在技术障碍。

四、基金变更的主要风险及预备措施

（一）变更方案被持有人大会否决的风险 在设计变更方案之前，基金管理人已对部分基金份额持有人进行了走访，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。如有必要，基金管理人将根据基金份额持有人意见，对基金变更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，推迟基金份额持有人大会的召开时间。

（二）基金变更后运作过程中的相关运作风险 基金管理人将提前做好充分的内部沟通及外部沟通，避免基金变更后基金运作过程中出现相关操作风险、管理风险等运作风险。

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