

# 海富通基金管理有限公司关于 以通讯方式召开海富通量化多因子 灵活配置混合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

海富通基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)依据中国证券监督管理委员会证监许可【2017】1276号文准予注册募集的海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)的基金合同于2018年4月23日生效。

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《海富通量化多因子灵活配置混合型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《关于变更注册海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金的议案》。会议具体安排如下:

- 1、会议召开方式:通讯开会方式。
- 2、会议投票表决起止时间:自2021年11月19日起,至2021年12月21日17:00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: 吴晨莺

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: 021-38650821

## 二、会议审议事项

本次持有人大会审议的事项为《关于变更注册海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金的议案》(以下简称“《议案》”),《议案》详见附件一。

上述《议案》的内容说明见附件二及附件三。

## 三、权益登记日

本次大会的权益登记日为2021年11月18日,即在该日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四。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.hftfund.com>)、中国证监会基金电子披露网站(<http://eid.csrc.gov.cn/fund>)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(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);

(3)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;

(4)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。

①个人投资者委托他人投票的,应由受托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(参照附件五)。如受托人为个人,还需提供受托人的身份证件正反面复印件;如受托人为机构,还需提供受托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);

②机构投资者委托他人投票的,应由受托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(参照附件五)。如受托人为个人,还需提供受托人的身份证件正反面复印件;如受托人为机构,还需提供受托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);

③合格境外机构投资者委托他人投票的,应由受托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(参照附件五)。如受托人为个人,还需提供受托人的身份证件正反面复印件;如受托人为机构,还需提供受托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)。

(5)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。

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2021年11月19日起,至2021年12月21日17:00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,并在信封表面注明:“海富通量化多因子灵活配置混合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(中国工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5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。2021年12月21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名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。

#### 六、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);

2、《议案》应当由提交有效表决票的本基金基金份额持有人(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议的事项自基金份额持有人大会表决通过之日起生效。

#### 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《海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定,本次持有人大会的召开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二分之一以上(含二分之一)。根据《中华人民共和国证券投资基金法》,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。

#### 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:上海市浦东新区花园石桥路66号东亚银行金融大厦36层

客服电话:40088-40099

联系人:吴晨莺

联系电话:021-38650821

网址:<http://www.hffund.com>

2、公证机构:上海市东方公证处

地址:上海市凤阳路598号

联系人:林奇

联系电话:021-62154848

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)31358666

4、基金托管人:中国工商银行股份有限公司

#### 九、重要提示

9.基金投资范围中删除中小板、权证、中小企业私募债相关内容并调整相关表述；

10.删除基金合同自动终止条款；

11.根据当时有效的法律法规及中国证监会的要求,相应修订本基金合同所涉及的相关条款内容。

为实施海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金变更事项,拟议授权基金管理人办理本次基金变更的相关具体事宜,包括但不限于根据市场情况确定变更的具体时间和方式。

(基金合同)修改的具体方案和程序可参见附件二;《关于变更注册海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金有关事项的说明》及附件三;《海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金基金合同》修改前后文对照表。

以上议案,请予审议。

海富通基金管理有限公司

2021年11月15日

附件二:关于变更注册海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金有关事项的说明

一、声明

1、海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金的基金合同于2018年4月23日生效,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。由于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《海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)的相关规定,本基金基金管理人经与基金托管人协商一致,拟对海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金变更,在基金投资范围中新增港股通标的股票,并据此对《基金合同》涉及投资范围、投资策略、投资限制等相关事项进行调整,同时,删除中小板、权证、中小企业私募债相关内容并调整相关表述,删除基金合同自动终止条款,并根据当时有效的法律法规及中国证监会的要求,相应修订本基金的托管协议、招募说明书及基金产品资料概要,更新后的《基金合同》、《托管协议》、《招募说明书》及基金产品资料概要届时可详见基金管理人的官网。

2、本次基金份额持有人大会需由出席会议的符合要求的基金份额持有人或其代理人所持有效凭证所代表的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)方可召开,且《关于变更注册海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金的议案》(以下简称“议案”)需经参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二(含三分之二)以上通过,故本次基金份额持有人大会存在未能达到开会条件而召集失败或议案无法获得基金份额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5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。

4、中国证监会对本次修改《基金合同》所作的任何决定或意见,均不表明其对本次修改《基金合同》后本基金的价值或投资者的收益做出实质性判断或保证。

二、基金合同修改要点

1.变更投资范围及投资组合比例

基金的投资范围变更为:“本基金的投资范围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(包含创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、存托凭证、港股通标的股票、债券(包括国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、短期融资券、超短期融资券、中期票据、地方政府债及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、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)、同业存单、货币市场工具、股指期货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。”

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适时合理地调整投资范围。”

基金的投资组合比例变更为:“本基金投资于股票资产及存托凭证占基金资产的比例为0%至95%,投资于港股通标的股票比例占股票投资比例0%~50%,在每个交易日日终,扣除股指期货合约须缴纳的交割保证金后,现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值比例不低于5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。”

2.变更投资策略

基金的投资策略变更为:

“1.资产配置策略

本基金在进行资产配置决策时,将依据量化择时模型,对宏观经济、政策预期、市场情绪、投资者行为等指标进行监控,精确把握市场方向、灵活调整组合仓位

本基金的股票投资组合比例将根据市场整体估值水平评估系统性风险进行调整。具体而言,本基金将采用沪深300指数作为市场代表指数,根据该指数的估值(P/E)自发布以来所处的历史水平位置来调整股票资产比例配置:

(1)当沪深300指数的整体估值水平处于过去十年的后10%分位,本基金将提高股票资产配置比例,股票资产占基金资产的比例为50%-95%,本阶段,市场大部分股票将处于未被充分定价的低估状态,本基金将维持较高的股票资产配置比例,力争获取更多的投资收益。

(2)当沪深300指数的整体估值水平处于过去十年的前10%分位,本基金将降低股票资产配置比例,股票资产占基金资产的比例为40%-45%,通过维持较低的股票资产配置比例,重点防范市场因估值水平过高、盈利能力下滑而造成的系统性风险。

(3)除上述两种情况以外,本基金股票资产占基金资产的比例为40%-85%,本阶段本基金股票资产配置的重点是行业配置和个股选择,寻找估值合理、盈利趋势向好的公司。

2.股票投资策略

(1)多因子模型是一套通用的定量分析框架,在这一框架下,股票收益可分解为一组因子收益及权重的组合。多因子模型致力于寻找持续稳健的超额收益因子,并进而根据因子收益的预测,形成股票超额收益的预测结果。模型的关键在于因子数量的可持续性,即股票的当期因子和下期收益率之间存在序列相关性,该相关性显著且持续稳定;通过一系列量化的方法挑选出这些因子,并赋予相应权重,计算股票在这些因子上的综合得分,精选得分高的股票构建投资组合。

本基金通过量化多因子选股模型进行个股精选,充分考虑价值、成长、流动性、动量等十一个因子,并对其进行动态跟踪形成股票超额收益的预测结果。基于多因子模型对股票收益预期的结果,结合组合风险水平、交易成本、流动性等因素进行投资组合优化,构建风险调整后最优组合。

(2)存托凭证投资策略

本基金投资存托凭证的策略依照上述境内上市交易的股票投资策略执行。

(3)港股通标的股票的投资策略

本基金在港股通投资标的的筛选上,注重对基本面良好、相对A股市场估值合理的股票进行长期投资。股票筛选的方法上,将以基本面研究为基础,辅以量化分析,以更深入、更全面的挖掘优质标的。另外,本基金所投资香港市场股票标的除适用上述股票市场投资策略外,还需关注:

1)香港股票市场与大陆股票市场存在的差异对股票投资价值的影响,比如行业分布、交易制度、市场流动性、投资者结构、市场波动性、涨跌幅限制、估值与盈利回报等方面。

2)港股通每日额度使用情况。

3)人民币与港币间的汇率比率变化。

3.债券投资策略

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。另外,本基金债券投资将适当运用杠杆策略,通过债券回购融入资金,然后买入收益率更高的债券以获得收益。

(1)久期调整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,有效控制基金资产风险。

(2)收益率曲线策略是指在确定组合久期以后,根据收益率曲线的形态特征进行利率期限结构管理,确定组合期限结构分布的方式,合理配置不同期限品种的资产配置比例。

(3)类属配置包括现金、不同类型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,即确定债券、存款、回购以及现金等资产的比例。

4.杠杆策略

杠杆放大操作即以组合现有债券为基础,利用回购等方式融入低成本资金,并购买具有较高收益的债券,以期获取超额收益的操作方式。本基金将对回购利率与债券收益率、存款利率等进行比较,判断是否存在利率套利空间,从而确定是否进行杠杆操作。进行杠杆放大策略时,基金管理人将严格控制信用风险及流动性风险。

5.资产支持证券投资策略

对于资产支持证券,本基金将综合考虑市场利率、发行条款、支持资产的构成和质量等因素,研究资产支持证券的收益和风险匹配情况,在严格控制风险的基础上选择投资对象,追求稳定收益。

6. 股指期货投资策略

本基金股指期货投资将根据风险管理的原则,以套期保值为主要目的。本基金管理人将在充分评估股指期货的流动性及风险收益特征,选择流动性好、交易活跃的股票期货合约进行多头或空头套期保值等策略操作。法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的,本基金将按法律法规的规定执行。

3. 变更业绩比较基准

基金的业绩比较基准变更为:“沪深300指数收益率×60%+恒生指数收益率(按估值汇率折算)×20%+上证国债指数收益率×20%。”

4. 变更风险收益特征

基金的风险收益特征变更为:“本基金为混合型基金,其预期风险及预期收益水平高于债券型基金和货币市场基金,但低于股票型基金,属于中等风险水平的投资品种。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。”

5. 将基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模修改为:“《基金合同》生效后,连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的,基金管理人应当在定期报告中予以披露。连续60个工作日出现前述情形的,基金管理人应当在10个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案,如持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等,并在6个月内召开基金份额持有人大会。”

6. 其他情况

基金管理人根据上述修改内容将同步修改基金合同涉及其他条款,并根据市场情况和业务实际更新估值方法。此外,根据现时有效的法律法规及中国证监会的要求对《海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金基金合同》进行其他必要的修订和补充。

7. 基金合同的具体修改内容可见附件三《〈海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金基金合同〉修改前后文对照表》。

三、变更后《海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的生效

自本基金基金份额持有人大会决议生效之日起,《海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金基金合同》变更生效。

附件三:《海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金基金合同》修改前后文对照表

Table with 2 columns: 变更前 (Before Change) and 变更后 (After Change). The table contains detailed text comparing the original and revised fund contract clauses across various sections like '第一部分 前言', '第二部分 释义', and '第三部分 基金的基本情况'. The changes are highlighted in the original document.

（上接A1版）

Table with 2 columns: 基金份额持有人大会的召集和召开 (Call and convening of the shareholders' meeting) and 基金份额持有人大会的职权 (Powers of the shareholders' meeting). It details the procedures for calling meetings, including notice periods and quorum requirements, and lists the specific powers of the meeting, such as amending the fund contract and electing the board of directors.

Table with 2 columns: 基金份额持有人大会的决议 (Resolutions of the shareholders' meeting) and 基金份额持有人大会的召开程序 (Procedures for convening the shareholders' meeting). It outlines the voting process, including the types of resolutions (ordinary vs. special) and the specific steps for convening a meeting, from proposal to the final meeting minutes.

Table with 2 columns: 基金份额持有人大会的召开程序 (Procedures for convening the shareholders' meeting) and 基金份额持有人大会的召开程序 (Procedures for convening the shareholders' meeting). This section provides a detailed, step-by-step guide to the entire process, from the initial proposal to the final resolution and the distribution of meeting minutes to all participants.

Table with 2 columns: 基金份额持有人大会的召开程序 (Procedures for convening the shareholders' meeting) and 基金份额持有人大会的召开程序 (Procedures for convening the shareholders' meeting). This section continues the detailed procedural guide, covering the final stages of the meeting, including the signing of minutes and the distribution of documents to shareholders.

基金份额持有人若对方案的内容有任何疑问或建议，请通过以下方式联系本基金经理人：
富富通基金管理有限公司
地址：上海市浦东新区世纪大道166号金耀大厦36层
邮编：201102
联系人：吴悦
联系电话：021-38650821

富富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决票

Table for the voting process, including a section for '基金份额持有人大会表决票' (Shareholders' Meeting Voting Slip) with columns for '表决事项' (Resolution Item), '表决意见' (Voting Opinion), and '表决日期' (Voting Date).

附件五：授权委托书(样本)

本人(或本机构)参加由\_\_\_\_\_先生/女士(或本机构)召集召开的富富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会，并作为有权行使所有议案的表决权。表决意见以受托人的表决意见为准。本授权不得被撤销。若在此授权期间内同一议案重新召开富富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会，除本人(或本机构)重新作出授权外，本授权继续有效。

委托人(签字/盖章)：\_\_\_\_\_
受托人(签字/盖章)：\_\_\_\_\_
签署日期：\_\_\_\_\_年\_\_\_\_\_月\_\_\_\_\_日