

长江安盈中短债六个月定期开放债券型 证券投资基金

招募说明书（更新）摘要 2019 年第 1 号

基金管理人：长江证券（上海）资产管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

二〇一九年十二月

重要提示

本基金经 2019 年 4 月 9 日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）下发的《关于准予长江安盈中短债六个月定期开放债券型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2019]664 号文）准予募集注册，本基金的基金合同于 2019 年 9 月 25 日正式生效。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值和市场前景做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

投资有风险，投资人在投资本基金前应认真阅读本基金的招募说明书、基金产品资料概要，全面认识本基金的风险收益特征，充分考虑自身的风险承受能力，并对认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。证券投资基金是一种长期投资工具，其主要功能是分散投资，降低投资单一证券所带来的个别风险。投资人购买本基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构，基金管理人并不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。投资人应当全面了解基金的产品特性，根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和自身的风险承受能力相适应，理性判断市场，并通过基金管理人或基金管理人委托的具有基金销售业务资格的其他机构购买基金。投资人在获得基金投资收益的同时，亦承担基金投资中出现的各类风险，包括：受经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响而形成的市场风险、受基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等影响而产生的管理风险、流动性风险、基金的策略风险、特有风险以及其他风险等。

本基金为债券型基金，其预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金。

本基金投资资产支持证券，资产支持证券具有一定的价格波动风险、流动性风险、信用风险等风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行承担。投资者应当认真阅读基金招募说明书、基金合同、

基金产品资料概要等信息披露文件,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。

基金的过往业绩并不预示其未来表现,基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。

本招募说明书的本次更新为依据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《基金合同》和《托管协议》变更的相关部分所作出的相应修改,前述更新内容截止日为 2019 年 12 月 31 日。本招募说明书所载的其他内容截止日为 2019 年 8 月 6 日。本基金托管人中国农业银行股份有限公司已经复核了本次更新的招募说明书。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《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》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

第一部分 基金管理人

(一) 基金管理人概况

名称：长江证券（上海）资产管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1198 号世纪汇一座 27 层

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 1198 号世纪汇一座 27 层

法定代表人：周纯

设立日期：2014 年 9 月 16 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证券监督管理委员会证监许可[2014]871 号

开展公开募集证券投资基金管理业务批准文号：证监许可[2016]30 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：10 亿元人民币

存续期限：持续经营

联系人：蒋媛媛

联系电话：021-80301221

股权结构：长江证券股份有限公司持有公司 100% 的股权。

(二) 主要人员情况

1、董事会成员

周纯先生，中共党员，硕士。现任长江证券股份有限公司总裁助理、长江证券（上海）资产管理有限公司董事长。曾任长江证券股份有限公司法律合规部合规管理岗、副总经理，质量控制总部总经理。

罗国华先生，中共党员，学士。现任长江证券股份有限公司总裁助理。曾任中国建设银行湖北省分行科员、科长、中国建设银行武汉市新洲区支行副行长，太平人寿上海分公司银行保险部高级经理、湖北分公司副总经理、宁波分公司总经理、银行保险部总经理，长江证券股份有限公司零售客户总部副总经理、总经理、武汉分公司总经理、经纪业务总监。

万励女士，中共党员，硕士。现任长江证券股份有限公司监事会召集人、信用业务部总经理，兼任长江期货股份有限公司监事会主席。曾任长江证券股份有限公司营业部交易柜员、客户经理、交易部负责人，经纪业务总部统计分析岗。运营管理总部业务支持部主管、融资融券部主管，信用业务部副总经理。

黄伟先生，中共党员，硕士。现任长江证券股份有限公司财务总部总经理。

曾任美的集团冰箱事业部总账会计，森萨塔科技有限公司财务主管，长江证券股份有限公司财务分析、财务总部副总经理、财务总部副总经理（主持工作）。

邹伟先生，中共党员，硕士。现任长江证券股份有限公司风险管理部总经理。曾任长江证券股份有限公司经纪业务总部渠道业务管理岗，风险管理部市场风险管理岗、副总经理。

2、监事

杜琦先生，学士。现任长江证券股份有限公司法律合规部副总经理，兼任长江成长资本投资有限公司合规总监。

3、公司高级管理人员

周纯先生，董事长，代行合规负责人。（简历请参见上述董事会成员介绍）

唐吟波女士，总经理，中共党员，硕士。曾任泰阳证券有限责任公司（现方正证券）上海延安西路营业部客户部主管，德邦证券股份有限公司经纪业务总部营销部总经理，齐鲁证券有限公司（现中泰证券）经纪业务总部副总经理、上海甘河路营业部总经理，长江证券（上海）资产管理有限公司副总经理。

范海蓉女士，副总经理，中共党员，硕士。曾任招商证券股份有限公司投资银行部项目经理，上海国际信托有限公司资金信托总部研究员、基金经理助理、资本市场主管、股权信托总部总经理助理、副总经理、总经理。

董来富先生，副总经理、首席风险官，中共党员，硕士。曾任中国建设银行支行信贷负责人、分理处主任、营业部副主任、主任、支行行长，湘财证券股份有限公司合肥长江中路营业部总经理，华融证券股份有限公司信用业务部总经理。

柳祚勇先生，副总经理，中共党员，硕士。历任长江证券股份有限公司研究员、投资经理助理、投资经理，长江证券（上海）资产管理有限公司投资经理、固定收益投资部总经理、固定收益研究部总经理、公司总经理助理。

谷松女士，副总经理，中共党员，硕士。历任长江证券股份有限公司人力资源部业务主管、培训中心副总经理、培训中心总经理、结构金融与场外业务部总经理。

4、拟任基金经理

漆志伟先生，国籍：中国。硕士研究生，具备基金从业资格。曾任华农财产保险股份有限公司投资经理。现任长江收益增强债券型证券投资基金、长江乐享货币市场基金、长江优享货币市场基金、长江乐丰纯债定期开放债券型发起式证

券投资基金、长江乐盈定期开放债券型发起式证券投资基金、长江乐越定期开放债券型发起式证券投资基金、长江乐鑫纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、长江可转债债券型证券投资基金的基金经理。

5、投资决策委员会成员

基金投资决策委员会是公司进行基金投资管理的最高投资决策机构,由总经理唐吟波女士、基金管理部总经理徐婕女士、基金经理漆志伟先生、基金经理曹紫建先生、风险管理部总经理孙婷女士组成。其中唐吟波女士任基金投资决策委员会主任。

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

第二部分 基金托管人

(一) 基金托管人概况

1、基本情况

名称: 中国农业银行股份有限公司(简称中国农业银行)

住所: 北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址: 北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座

法定代表人: 周慕冰

成立日期: 2009 年 1 月 15 日

批准设立机关和批准设立文号: 中国银监会银监复[2009]13 号

基金托管业务批准文号: 中国证监会证监基字[1998]23 号

注册资本: 32,479,411.7 万元人民币

存续期间: 持续经营

联系电话: 010-66060069

传真: 010-68121816

联系人: 贺倩

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分,总行设在北京。经国务院批准,中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于 2009 年 1 月 15 日依法成立。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行网点遍布中国城乡,成为国内网点最多、业务辐射范围最广,服务领域最广,服务对象最多,业务功能齐全的大型国有商业银行之一。在海外,中国农业银行同样通过自己的努力赢得了

良好的信誉，每年位居《财富》世界 500 强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行，中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念，坚持审慎稳健经营、可持续发展，立足县域和城市两大市场，实施差异化竞争策略，着力打造“伴你成长”服务品牌，依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品，致力为广大客户提供优质的金融服务，与广大客户共创价值、共同成长。

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行，经验丰富，服务优质，业绩突出，2004 年被英国《全球托管人》评为中国“最佳托管银行”。2007 年中国农业银行通过了美国 SAS70 内部控制审计，并获得无保留意见的 SAS70 审计报告。自 2010 年起中国农业银行连续通过托管业务国际内控标准（ISAE3402）认证，表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强能力建设，品牌声誉进一步提升，在 2010 年首届“‘金牌理财’TOP10 颁奖盛典”中成绩突出，获“最佳托管银行”奖。2010 年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的“最佳资产托管奖”。2012 年荣获第十届中国财经风云榜“最佳资产托管银行”称号；2013 年至 2017 年连续荣获上海清算所授予的“托管银行优秀奖”和中央国债登记结算有限责任公司授予的“优秀托管机构奖”称号；2015 年、2016 年荣获中国银行业协会授予的“养老金业务最佳发展奖”称号；2018 年荣获中国基金报授予的公募基金 20 年“最佳基金托管银行”奖；2019 年荣获证券时报授予的“2019 年度资产托管银行天玑奖”称号。

中国农业银行证券投资基金托管部于 1998 年 5 月经中国证监会和中国人民银行批准成立，2014 年更名为托管业务部/养老金管理中心，内设综合管理部、业务管理部、客户一部、客户二部、客户三部、客户四部、风险合规部、产品研发与信息技术部、营运一部、营运二部、市场营销部、内控监管部、账户管理部，拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

（二）主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工近 240 名，其中具有高级职称的专家 30 余名，服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强，高级管理层均有 20 年以上金融从业经验和高级技术职称，精通国内外证券市场的运作。

（三）基金托管业务经营情况

截止到 2019 年 6 月 30 日，中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放

式证券投资基金共 473 只。

第三部分 相关服务机构

(一) 基金份额发售机构

1、直销机构

长江证券(上海)资产管理有限公司直销中心:

名称: 长江证券(上海)资产管理有限公司

注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区世纪大道1198号世纪汇一座27层

办公地址: 上海市浦东新区世纪大道1198号世纪汇一座27层

法定代表人: 周纯

联系人: 蒋媛媛

电话: 021-80301221

传真: 021-80301399

客户服务电话: 4001-166-866

网址: www.cjzcg.com

2、其他销售机构:

(1) 中国农业银行股份有限公司

住所: 北京市东城区建国门内大街69号

办公地址: 北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座

法定代表人: 周慕冰

电话: 010-66060069

传真: 010-68121816

客服电话: 95599

网址: www.abchina.com

(2) 上海天天基金销售有限公司

上海天天基金销售有限公司

注册地址: 上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层

办公地址: 上海市徐汇区宛平南路88号东方财富大厦26层

法定代表人: 其实

电话: 021-54509888*8413

传真: 021-50549953

客户服务电话：4001-818-188

网址：www.1234567.com.cn

(3) 上海基煜基金销售有限公司

住所：上海市崇明县长兴镇潘园公路1800号2号楼6153 室（上海泰和经济
发展区）

办公地址：上海市浦东新区银城中路488号太平金融大厦1503室

法定代表人：王翔

电话：021-65370077

传真：021-55085991

客服电话：400-820-5369

网址：www.jiyufund.com.cn

(4) 北京汇成基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村大街11号11层1108号

办公地址：北京市海淀区中关村大街11号11层1108号

法定代表人：王伟刚

传真：010-62680827

客服电话：400-619-9059

网址：www.hcjijin.com

(5) 嘉实财富管理有限公司

住所：上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心办公楼二期53层5312-15单
元

办公地址：北京市朝阳区建国路91号金地中心A座6层

法定代表人：赵学军

电话：010-65215588

传真：010-85712195

客服电话：400-021-8850

网址：www.harvestwm.cn

(6) 北京植信基金销售有限公司

住所：北京市密云县兴盛南路8号院2号楼106-67

办公地址：北京市朝阳区盛世龙源国食苑10号楼

法定代表人：于龙

电话：010-56075718

传真：010-67767615

客服电话：4006-802-123

网址：www.zhixin-inv.com

(7) 深圳前海凯恩斯基金销售有限公司

住所：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市福田区福华路355号岗厦皇庭中心8楼DE

法定代表人：高锋

电话：0755-82880158

传真：0755-83655518

客服电话：4008048688

网址：www.keynesasset.com

(8) 厦门市鑫鼎盛控股有限公司

住所：厦门市思明区鹭江道2号第一广场1501-1504

办公地址：厦门市思明区鹭江道2号第一广场1501-1504

法定代表人：陈洪生

电话：0592-3122757

传真：0592-3122701

客服电话：400-918-0808

网址：www.xds.com.cn

(9) 上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号

办公地址：上海市浦东新区浦东南路1118号9楼

法定代表人：杨文斌

电话：021-20613600

传真：021-68596916

客服电话：400-700-9665

网址：www.ehowbuy.com

(10) 珠海盈米基金销售有限公司

住所：珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔1201-1203室

法定代表人：肖雯

电话：（020）89629099

传真：（020）89629011

客服电话：020-89629066

网址：www.yingmi.cn

（11）中民财富基金销售（上海）有限公司

住所：上海市黄浦区中山南路100号7层05单元

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27层

法定代表人：弭洪军

电话：400-876-5716

传真：021-63353736

客服电话：400-876-5716

网址：www.cmiwm.com

（12）北京虹点基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区工人体育场北路甲2号裙房2层222单元

办公地址：北京市朝阳区工体北路甲2号盈科中心东门2层216

法定代表人：郑毓栋

电话：010-65951887

传真：010-65961887

客服电话：400-618-0707

网址：www.hongdianfund.com

（13）浙江同花顺基金销售有限公司

住所：杭州市文二西路1号903室

办公地址：杭州市余杭区同顺街18号同花顺大楼

法定代表人：吴强

电话：0571-88911818

传真：0571-86800423

客服电话：4008-773-772

网址：www.5ifund.com

（14）上海云湾基金销售有限公司

住所:中国(上海)自由贸易试验区新金桥路27号、明月路1257号1幢1层103-1、103-2办公区

办公地址:中国(上海)自由贸易试验区新金桥路27号、明月路1257号1幢1层103-1、103-2办公区

法定代表人:冯轶明

电话:021-20538888

传真:021-20538999

客服电话:400-820-1515

网址:www.zhengtongfunds.com

基金管理人可以根据情况变化、增加或者减少销售机构,并在基金管理人网站公示。销售机构可以根据情况变化、增加或者减少其销售城市、网点。各销售机构提供的基金销售服务可能有所差异,具体请咨询各销售机构。

(二) 登记机构

名称:长江证券(上海)资产管理有限公司

住所:中国(上海)自由贸易试验区世纪大道1198号世纪汇一座27层

办公地址:上海市浦东新区世纪大道1198号世纪汇一座27层

法定代表人:周纯

联系人:何永生

电话:021-80301382

传真:021-80301399

(三) 出具法律意见书的律师事务所

名称:上海市通力律师事务所

住所:上海市银城中路68号时代金融中心19楼

办公地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼

负责人:俞卫锋

经办律师:黎明、丁媛

电话:021-31358666

传真:021-31358600

联系人:丁媛

(四) 审计基金财产的会计师事务所

名称:中审众环会计师事务所(特殊普通合伙)

注册地址：武汉市武昌区东湖路169号众环大厦

办公地址：武汉市武昌区东湖路169号众环大厦

负责人：石文先

经办注册会计师：刘钧、余宝玉

联系电话：027-85424319

传真：027-85424329

联系人：刘钧

第四部分 基金的名称

长江安盈中短债六个月定期开放债券型证券投资基金

第五部分 基金的类型

债券型证券投资基金

第六部分 基金的投资目标

本基金重点投资于中短债主题证券，在严格控制风险和保持较高流动性的基础上，力求获得超越业绩比较基准的投资回报。

第七部分 基金的投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括债券（国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、中期票据、次级债、地方政府债、短期融资券、超短期融资券、可分离交易可转债的纯债部分）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场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（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产，也不参与一级市场的新股申购或增发，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。

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。

基金的投资组合比例为：本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于中短债主题证券的比例不低于非现金基金资产的 80%，但在每个开放

期前 1 个月、开放期及开放期结束后 1 个月的期间内不受前述投资组合比例的限制；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的比例合计不低于基金资产净值的 5%。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

本基金所指的中短债主题证券是指剩余期限不超过三年的债券资产，主要包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、中期票据、次级债、地方政府债、短期融资券、超短期融资券、可分离交易可转债的纯债部分等金融工具。

当法律法规的相关规定变更时，基金管理人在履行适当程序后可对上述资产配置比例进行适当调整。

第八部分 基金的投资策略

（一）资产配置策略

本基金充分发挥基金管理人的研究优势，将宏观周期研究、行业周期研究、公司研究相结合，在分析和判断宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上，自上而下决定债券组合久期、期限结构、债券类别配置策略，在严谨深入的分析基础上，综合考量各类债券的流动性、供求关系和收益率水平等，深入挖掘价值被低估的标的券种。

（二）债券投资策略

1、利率债券策略

（1）利率预期策略

本基金通过分析国内宏观经济与综合分析货币政策，财政政策，预判出未来利率水平的变化方向，结合债券的期限结构水平，债券的供给，流动性水平，凸度分析制定出具体的利率策略。

（2）久期选择策略

本基金将根据宏观经济发展情况、金融市场运行特点、债券市场供给水平对未来利率走势进行预判，结合本基金的流动性需求及投资比例规定，动态调整组合的久期，有效地控制整体资产风险。

（3）骑乘策略

本基金将通过骑乘操作策略，在严控风险的前提下，力争比持有到期更高的收益。在市场利率期限结构向上倾斜并且相对陡峭时，选择投资并持有债券，伴

随债券剩余期限减少,债券收益率水平较投资初期有所下降,通过债券收益率的下滑,获得资本利得收益。

2、信用债券策略

本基金在基金管理人研发的信用债券评级体系的基础上,考察信用资质变化、供需关系等因素,制定信用债券投资策略。

(1) 基于信用资质变化的策略

本基金根据基金管理人完善的信用风险分析框架,建立内部信用评级体系,根据债务主体的现金流和经营状况客观分析违约风险及合理的信用利差水平,对债券进行独立、客观价值评估。规避信用状况恶化的发债主体,挖掘市场定价偏低的品种。

(2) 基于供给变化的策略

本基金将根据市场债券供给变化,对资产组合做出相应调整。根据市场资金松紧程度和参与主体的交易意愿判断未来债券市场的走向,采取合适的投资策略来获取收益。

(三) 资产支持证券投资策略

资产支持证券的定价受市场利率、发行条款、标的资产的构成及质量、提前偿还率等多种因素影响。本基金在基本面分析和债券市场宏观分析的基础上,对资产支持证券的交易结构风险、信用风险、提前偿还风险和利率风险等进行分析,采取包括收益率曲线策略、信用利差曲线策略、预期利率波动率策略等,在严控风险的前提下提高投资收益。

(四) 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。

第九部分 基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准:中债综合财富(1 年以下)指数收益率*60%+中债综合财富(1-3 年)指数收益率*20%+一年期定期存款利率(税后)*20%

中债综合财富(1 年以下)指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制的中债综合财富细分指数之一。该指数成分券包含除资产支持证券、美元债券、可

转债以外剩余的所有公开发行且上市流通的待偿期限 1 年以下的债券,是一个反映境内人民币债券市场价格走势情况的宽基指数,能较好的反映本基金的投资策略,较为科学、合理的评价本基金的业绩表现。

中债综合财富(1-3 年)指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制的中债综合财富细分指数之一。该指数成分券包含除资产支持证券、美元债券、可转债以外剩余的所有公开发行且上市流通的待偿期限在 1-3 年(含 1 年)的债券,是一个反映境内人民币债券市场价格走势情况的宽基指数,能较好的反映本基金的投资策略,较为科学、合理的评价本基金的业绩表现。

如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩比较基准的指数时,本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则,在与基金托管人协商一致并按照监管部门要求履行适当程序后,变更业绩比较基准并及时公告,而无需召开基金份额持有人大会。

第十部分 基金的风险收益特征

本基金为债券型基金,其预期收益和预期风险高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。

第十一部分 基金费用与税收

(一) 基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费;
- 2、基金托管人的托管费;
- 3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费;
- 5、基金份额持有人大会费用;
- 6、基金的证券交易费用及结算费用;
- 7、基金的银行汇划费用;
- 8、基金的相关账户的开户费用、账户维护费用;
- 9、按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他

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 0.6% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.6\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 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。

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 0.15% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类”中第 3—9 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

(三) 不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项

目。

(四) 基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

基金财产投资的相关税收,由基金份额持有人承担,基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。

第十二部分 对招募说明书更新部分的说明

管理人依据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的有关要求,对本基金招募说明书进行了更新,主要更新内容如下:

1、“重要提示”部分增加了本次招募说明书更新的说明。

2、“重要提示”、“第一部分 绪言”、“第二部分 释义”、“第三部分 基金管理人”、“第五部分 相关服务机构”、“第六部分 基金的募集”、“第八部分 基金份额的申购与赎回”、“第十一部分 基金资产估值”、“第十二部分 基金的收益与分配”、“第十四部分 基金的会计与审计”、“第十五部分 基金的信息披露”、“第十七部分 基金合同的变更、终止和基金财产的清算”、“第十八部分 基金合同的内容摘要”、“第十九部分 托管协议的内容摘要”部分根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及涉及基金合同和托管协议变更的相关内容进行了更新。

长江证券(上海)资产管理有限公司

二〇一九年十二月三十一日