

---

**长安泓沅中短债债券型证券投资基金  
招募说明书（更新）**

**基金管理人：长安基金管理有限公司**

**基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司**

## 重要提示

1、长安泓沅中短债债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）由长安鑫垚主题轮动混合型证券投资基金转型而来，长安鑫垚主题轮动混合型证券投资基金经中国证监会2017年6月26日证监许可〔2017〕1048号文准予注册，并经中国证监会2019年4月2日证监许可〔2019〕558号文准予变更注册为本基金。

2、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，但中国证监会对长安鑫垚主题轮动混合型证券投资基金的变更注册，并不表明其对本基金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。

3、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。本基金投资于证券市场，基金份额净值会因为证券市场波动等因素产生波动。投资有风险，投资人在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性并认真阅读本招募说明书、基金合同、基金产品资料概要等信息披露文件，根据自身的投资目的、风险承受能力、投资期限、投资经验、资产状况等，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。

4、基金在投资运作过程中可能面临各种风险，既包括市场风险，也包括基金自身的管理风险、估值风险、流动性风险以及技术风险和本基金的特定风险和其他风险等。

5、本基金为债券型基金，预期风险和预期收益低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。

6、投资者应通过本基金管理人或指定的销售机构购买基金。

7、当基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，基金管理人履行相应程序后，可以启用侧袋机制，具体详见基金合同和本招募说明书的有关章节。侧袋机制实施期间，基金管理人将对基金简称进行特殊标识，暂停披露侧袋账户份额净值，不办理侧袋账户的申购赎回。侧袋账户对应特定资产的变现时间和最终变现价格具有不确定性，并且有可能变现价格大幅低于启用侧袋机制时的特定资产的估值，基金份额持有人可能因此面临损失。投资者在投资本基金之前，请仔细阅读相关内容并关注本基金启用侧袋机制时的特定风险。

8、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财产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。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并不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资者注意基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。投资人应当认真阅读招募说明书、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。

9、本基金约定的基金产品资料概要编制、披露与更新要求，将不晚于2020年9月1日起执行。

10、本招募说明书所载内容截止日为2022年10月31日，有关财务数据和净值表现截止日为2022年6月30日。财务数据未经审计。

## 目 录

第一部分	绪言.....	1
第二部分	释义.....	2
第三部分	基金管理人.....	6
第四部分	基金托管人.....	13
第五部分	相关服务机构.....	17
第六部分	基金的历史沿革.....	32
第七部分	基金的存续.....	33
第八部分	基金份额的申购与赎回.....	34
第九部分	基金的投资.....	45
第十部分	基金的业绩.....	54
第十一部分	基金的财产.....	58
第十二部分	基金资产的估值.....	59
第十三部分	基金的收益与分配.....	65
第十四部分	基金的费用与税收.....	67
第十五部分	基金的会计与审计.....	70
第十六部分	基金的信息披露.....	71
第十七部分	侧袋机制.....	77
第十八部分	风险揭示.....	81
第十九部分	基金合同的变更、终止与基金财产的清算.....	86
第二十部分	基金合同的内容摘要.....	88
第二十一部分	托管协议的内容摘要.....	103
第二十二部分	对基金份额持有人的服务.....	118
第二十三部分	其他应披露的事项.....	120
第二十四部分	招募说明书的存放及查阅方式.....	128
第二十五部分	备查文件.....	129

## 第一部分 绪言

《长安泓沣中短债债券型证券投资基金招募说明书》（以下简称“招募说明书”或“本招募说明书”）依据《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》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）和其他有关法律法规的规定，以及《长安泓沣中短债债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）编写。

本基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。

本基金是由长安鑫垚主题轮动混合型证券投资基金转型而来。本招募说明书由本基金管理人解释。本基金管理人没有委托或授权其他任何人提供未在本招募说明书中载明的信息，或对本招募说明书做出任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写，并经中国证监会注册。基金合同是约定基金合同当事人之间权利、义务的法律文件。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《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。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》。

## 第二部分 释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

- 1、基金或本基金：指长安泓沣中短债债券型证券投资基金
- 2、基金管理人：指长安基金管理有限公司
- 3、基金托管人：指上海浦东发展银行股份有限公司
- 4、基金合同：指《长安泓沣中短债债券型证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充
- 5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《长安泓沣中短债债券型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
- 6、招募说明书或本招募说明书：指《长安泓沣中短债债券型证券投资基金招募说明书》及其更新
- 7、基金产品资料概要：指《长安泓沣中短债债券型证券投资基金基金产品资料概要》及其更新
- 8、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等
- 9、《基金法》：指《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 10、《销售办法》：指《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 11、《信息披露办法》：指中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 12、《运作办法》：指《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 13、《流动性风险管理规定》：指中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订
- 14、中国证监会：指中国证券监督管理委员会
- 15、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行保险监督管理委员会
- 16、基金合同当事人：指受基金合同约束，根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人
- 17、个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人
- 18、机构投资者：指依法可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法登记并

存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织

19、合格境外机构投资者：指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》及相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者

20、人民币合格境外机构投资者：指按照《人民币合格境外机构投资者境内证券投资试点办法》及相关法律法规规定，运用来自境外的人民币资金进行境内证券投资的境外法人

21、投资人、投资者：指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称

22、基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人

23、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务

24、销售机构：指基金管理人以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务协议，办理基金销售业务的机构

25、登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户等

26、登记机构：指办理登记业务的机构。基金的登记机构为长安基金管理有限公司或接受长安基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构

27、基金账户：指登记机构为投资人开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户

28、基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构办理申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务而引起基金份额变动及结余情况的账户

29、基金合同生效日：指《长安泓沅中短债债券型证券投资基金基金合同》生效日，原《长安鑫垚主题轮动混合型证券投资基金基金合同》自同一起失效

30、基金合同终止日：指基金合同规定的基金合同终止事由出现后，基金财产清算完毕，清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期

31、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

32、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

33、T日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的开放日

34、T+n日：指自T日起第n个工作日（不包含T日）

35、开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

36、开放时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

37、《业务规则》：指《长安基金管理有限公司开放式基金业务规则》，是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金登记方面的业务规则，由基金管理人和投资人共同遵守

38、申购：指基金合同生效后，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

39、赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同和招募说明书规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为

40、基金转换：指基金份额持有人按照基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件，申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金基金份额的行为

41、转托管：指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更所持基金销售机构的操作

42、定期定额投资计划：指投资人通过有关销售机构提出申请，约定每期申购日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及受理基金申购申请的一种投资方式

43、巨额赎回：指本基金单个开放日，基金净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一开放日基金总份额的 10%

44、元：指人民币元

45、A 类基金份额：指在投资人申购基金时收取前端申购费，而不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额类别

46、C 类基金份额、E 类基金份额：指在投资人申购基金时不收取前后端申购费，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额类别

47、基金收益：指基金投资所得债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约

48、基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收款项及其他资产的价值总和

49、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

50、基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数

51、基金资产估值：指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份



## 额净值的过程

52、销售服务费：指从基金财产中计提的，用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务的费用

53、流动性受限资产：指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等

54、摆动定价机制：指当开放式基金遭遇大额申购赎回时，通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资人的合法权益不受损害并得到公平对待

55、基金转型：指对包括“长安鑫垚主题轮动混合型证券投资基金”更名为“长安泓沣中短债债券型证券投资基金”，调整基金的投资、运作、费用等相关内容并修订基金合同等一系列事项的统称

56、侧袋机制：指将基金投资组合中的特定资产从原有账户分离至一个专门账户进行处置清算，目的在于有效隔离并化解风险，确保投资者得到公平对待，属于流动性风险管理工具。侧袋机制实施期间，原有账户称为主袋账户，专门账户称为侧袋账户

57、特定资产：包括：（1）无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性的资产；（2）按摊余成本计量且计提资产减值准备仍导致资产价值存在重大不确定性的资产；（3）其他资产价值存在重大不确定性的资产

58、指定媒介：指中国证监会指定的用以进行信息披露的全国性报刊及指定互联网网站（包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）等媒介

59、不可抗力：指基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

## 第三部分 基金管理人

### 一、基金管理人情况

名称：长安基金管理有限公司

住所：上海市虹口区丰镇路 806 号 3 幢 371 室

办公地址：上海市浦东新区芳甸路 1088 号紫竹国际大厦 16 层

法定代表人：崔晓健

成立日期：2011 年 9 月 5 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监许可〔2011〕1351 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：2.7 亿元人民币

存续期限：持续经营

联系人：吴昱

联系电话：021-20329866

股权结构：

股东名称	股权比例
长安国际信托股份有限公司	29.63%
杭州景林投资管理合伙企业（有限合伙）	25.93%
上海恒嘉美联发展有限公司	24.44%
五星控股集团有限公司	13.33%
兵器装备集团财务有限责任公司	6.67%
合计	100%

### 二、主要人员情况

#### 1、董事会成员

崔晓健先生，董事，管理学博士。曾任北京工商大学管理工程系教师，国家轻工业部政策法规司、质量标准司主任科员，中国证监会期货部、稽查部主任科员、副处长、处长，中国证监会深圳稽查局局长助理，中国证监会稽查一局副局长、行政处罚委员会副主任委员、网络信息办公室负责人，全国中小企业股份转让系统公司党委委员、纪委书记等职，现任长安基金管理有限公司董事长，长安财富资产管理有限公司董事。

黄海涛先生，董事，工商管理硕士。曾任商洛邮政局副局长、陕西邮政储汇局局长助理、副局长、中国邮政储蓄银行陕西分行副行长、中邮证券有限责任公司总经理等职，现任长安国际信托股份有限公司副总裁兼资本市场一部总经理，西安财金合作发展基金投资管理有限

公司董事。

高斌先生，董事，硕士。曾任中国证监会市场监管部主任科员、副处长、处长，中国证监会驻深圳证券交易所督察员，中国证券登记结算公司总经理助理、党委委员、常务副总经理，期间兼任中国证券登记结算公司上海分公司总经理。现任上海景林投资发展有限公司总裁。

谭卫东先生，董事，本科学历。曾任职于中国建设银行攀枝花市分行风险管理部，曾任深圳发展银行成都分行对公信贷管理部副主管、平安银行成都分行风险管理部总经理和辽宁振兴银行股份有限公司风险管理部总经理等职，现任长安国际信托股份有限公司资产监控部总经理、长安盛世（北京）资产管理有限公司董事长、长安咸通（西安）资产管理有限公司董事长、长安新生（深圳）金融投资有限公司董事。

范欢欢女士，董事，管理学学士。曾任上海景林投资发展有限公司市场营销部产品经理、投资研究部研究助理、总裁办投后管理等岗位，现任上海景林投资发展有限公司总裁办高级经理。

汪钦先生，董事，经济学博士。曾就职于中国人民银行河南省分行教育处、海南港澳国际信托投资有限公司证券部，历任三亚东方实业股份有限公司副总经理，国信证券股份有限公司研究所所长，长城基金管理有限公司总经理助理、副总经理，宝盈基金管理有限公司总经理和中创前海资本有限公司总经理等职，现任长安基金管理有限公司总经理、兼任长安财富资产管理有限公司董事长。

田高良先生，独立董事，管理学博士。曾任西安秦川机械厂厂部办公室经济秘书，陕西财经学院会计系讲师，西安交通大学会计学院财务管理系讲师、副教授，现任西安交通大学管理学院副院长、教授。

张伟先生，独立董事，经济学博士。曾任中国人民银行研究生部教研部实习研究员、副主任兼助理研究员，行政部副主任兼副研究员等职，现任清华大学五道口金融学院校友办主任兼副研究员，东兴证券独立董事。

成善栋先生，独立董事，工商管理学硕士。曾任职于中国人民银行上海市分行，曾任工商银行上海市分行办公室科员、科长，上海巴黎国际银行信贷部总经理，工商银行上海市分行办公室副主任、办公室主任、管理信息部总经理、副行长，长信基金管理有限责任公司董事长等职。

## 2、监事会成员

孔舰先生，监事，经济学博士。曾任中国核工业集团原子能研究院资产经营处项目经理，兵器装备集团财务有限责任公司战略研究部战略研究员、行业研究员，现任兵器装备集团财务有限责任公司战略研究部副总经理。

吴缨女士，职工监事，上海财经大学金融学研究生，理学学士。曾任江西电力职大助教，亚龙湾开发股份有限公司董事会秘书兼资金证券部经理，海南欣龙无纺股份有限公司董事会

秘书，上海君创财经顾问有限公司副总经理，上海鼎立实业投资有限公司副总经理等职。现任长安基金管理有限公司综合管理部总监。

### 3、高级管理人员

崔晓健先生，董事长，简历同上。

汪钦先生，总经理，简历同上。

李永波先生，督察长，法学学士、民商法学硕士。曾任上海源泰律师事务所律师，上海市通力律师事务所律师，上海市律师协会基金业务委员会委员，长安基金管理有限公司监察稽核部副总经理、监察稽核部总经理等职，现任长安基金管理有限公司督察长、党支部书记、兼任长安财富资产管理有限公司董事。

王健先生，副总经理，工商管理博士。曾任长信基金管理有限责任公司市场开发部总监，金元比联基金管理有限公司渠道销售部总监，长安基金管理有限公司市场总监等职。

徐小勇先生，副总经理，工商管理硕士。曾就职于中国建设银行总行信托投资公司，中国信达信托投资公司，中国银河证券有限责任公司；曾任银河基金管理有限公司研究员、基金经理，华泰证券（上海）资产管理有限公司权益部负责人，长安基金管理有限公司总经理助理等职。现任长安基金管理有限公司副总经理、投资总监、基金经理。

马成先生，副总经理，经济学硕士。曾任泰信基金管理有限公司理财顾问部高级经理、投资管理部经理助理、交易室交易主管、基金经理，申万证券资产管理总部高级投资经理，人保资产管理有限公司公募基金事业部（筹）固定收益负责人，中航信托股份有限公司资产管理部副总经理，长安基金管理有限公司总经理助理等职。

闫世新先生，首席信息官，大专。曾就职于江苏维维集团、上海信息产业有限公司、深圳奥尊信息技术有限公司、华安基金管理有限公司从事信息技术工作；曾任东吴基金管理有限公司信息技术部总经理助理、长安基金管理有限公司信息技术部总经理助理、副总经理等职。

### 4、本基金基金经理

孟楠女士，法律硕士。曾任东证融汇证券资产管理有限公司（原东北证券股份有限公司上海分公司）投研助理、投资经理助理及投资主办等职。现任长安基金管理有限公司固定收益部基金经理。

杨严女士，经济学博士。曾任招商银行杭州分行出口结算员，民生通惠资产管理有限公司信用研究员，德邦基金管理有限公司债券研究员、基金经理等职。现任长安基金管理有限公司固定收益部基金经理。

### 5、固定收益投资决策委员会成员

马成先生，简历同上。

刘学通，管理学硕士。曾任山东省信用评级有限公司分析师，上海新世纪资信评估投资服务有限公司项目经理，中国人保资产管理有限公司信用评估部高级经理，中航信托股份有

限公司资产管理部高级研究员，长安基金管理有限公司高级债券研究员、投资经理等职。现任长安基金管理有限公司固定收益部基金经理。

孟楠女士，简历同上。

杨严女士，简历同上。

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

### 三、基金管理人的职责

1、依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的申购、赎回和登记事宜；

2、办理基金备案手续；

3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；

4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；

5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

6、编制基金季度报告、中期报告和年度报告；

7、计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回价格；

8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；

9、按照规定召集基金份额持有人大会；

10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

11、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

12、有关法律法规、中国证监会规定的其他职责。

### 四、基金管理人的承诺

1、基金管理人将遵守《中华人民共和国证券法》、《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》、《流动性风险管理规定》等法律法规的相关规定，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违法违规行的发生。

2、基金管理人承诺防止下列行为的发生：

（1）将基金管理人固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；

（2）不公平地对待其管理的不同基金财产；

（3）利用基金财产或职务之便为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；

（4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；

（5）侵占、挪用基金财产；

（6）泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

（7）玩忽职守，不按照规定履行职责；

（8）法律、行政法规有关规定和中国证监会规定禁止的其他行为。

3、基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律

法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下活动：

- （1）越权或违规经营；
- （2）违反基金合同或托管协议；
- （3）故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法权益；
- （4）在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；
- （5）拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
- （6）玩忽职守、滥用职权；
- （7）违反现行有效的有关法律、法规、基金合同和中国证监会的有关规定，泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
- （8）除按基金管理人制度进行基金运作投资外，直接或间接进行其他股票投资；
- （9）协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易；
- （10）违反证券交易所业务规则，利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；
- （11）贬损同行，以抬高自己；
- （12）在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；
- （13）以不正当手段谋求业务发展；
- （14）有悖社会公德，损害证券投资基金从业人员形象；
- （15）其他法律、行政法规和中国证监会禁止的行为。

#### 4、基金经理承诺

- （1）依照有关法律法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；
- （2）不利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者牟取利益；
- （3）不泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
- （4）不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

### 五、基金管理人的内部控制制度

#### 1、内部控制的目标

- （1）保证公司经营运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规定，坚持基金份额持有人利益最大化原则，自觉形成守法经营、规范运作的意识和理念；
- （2）防范和化解经营风险，提高经营管理效益，确保经营业务的稳健运行和受托资产的安全完整，实现公司的持续、稳定、健康发展；
- （3）确保基金、公司财务和其它信息真实、准确、完整和及时披露；
- （4）确保投资管理活动中公平对待不同投资组合，保护投资者合法权益。

## 2、内部控制的原则

（1）健全性原则。内部控制包括公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员，并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个环节；

（2）有效性原则。通过科学的内控手段和方法，建立合理的内控程序，维护内控制度的有效执行；

（3）独立性原则。公司各机构、部门和岗位职责保持相对独立，公司基金资产、自有资产、其它资产的运作严格分离；

（4）相互制约原则。公司各机构、部门和岗位的设置权责分明、相互制衡；

（5）成本效益原则。公司运用科学化的经营管理方法降低运作成本，提高经济效益，以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

## 3、制订内部控制制度的原则

（1）合法合规性原则。公司内控制度符合国家法律法规、规章和各项规定，必须把国家的法律法规、规章和各项政策体现到内控制度中；

（2）全面性原则。内部控制制度涵盖公司经营管理的各个环节，不得留有制度上的空白或漏洞；

（3）审慎性原则。公司内部的核心是风险控制，制定内部控制制度以审慎经营、防范和化解风险为出发点；

（4）适时性原则。公司内部控制制度必须随着有关法律法规的调整和公司经营战略、经营方针、经营理念等内外部环境的变化及时地进行修改或完善。

## 4、内部控制的制度体系

公司内部控制的制度体系由内部控制大纲、基本管理制度和部门业务规章三个层次的制度系列构成，这三个不同层次的内部管理制度既相互独立又互相联系，在公司章程的指引和约束下构成了公司总体的内部控制的制度体系。

内部控制大纲是对公司章程的原则规定的细化和展开，同时又是对公司各项基本管理制度的总揽和原则指导。

基本管理制度是依据内部控制大纲对各项业务活动和公司管理的基本规范，涵盖公司各项业务及管理活动的各个方面，为部门管理制度和业务工作手册的制定提供了依据。基本管理制度主要包括风险控制制度、投资管理制度、基金运营制度、信息披露制度、监察稽核制度、信息技术管理制度、公司财务制度、行政管理制度、人力资源管理制度和反洗钱制度等。

部门业务规章则直接对员工日常工作进行约束和指导。

三层内部控制制度体系在不同的控制层次上，对公司经营管理活动的决策、执行和监督进行规范，将公司在经营管理活动中可能发生的风险，根据不同的决策层和执行层的权利与责任进行分解，并对决策和执行过程中的风险点和风险因素，通过相应的内部控制制度予以防范和控制，实现公司的合法合规运行，强化公司的内部风险控制，从而维护公司股东和基

金份额持有人的利益。

#### 5、内部控制的监控防线

公司依据自身经营特点设立顺序递进、权责统一、严密有效的三道监控防线：

（1）建立以各岗位目标责任制为基础的第一道监控防线。明确各岗位职责，并制定详细的岗位说明和业务流程，各岗位人员上岗前必须声明已知悉并承诺遵守，在授权范围内承担岗位责任；

（2）建立相关部门、相关岗位之间相互监督制衡的第二道监控防线。公司建立重要业务处理凭据传递和信息沟通制度，相关部门和岗位之间相互监督制衡；

（3）建立以督察长和监察稽核部对各岗位、各部门、各机构、各项业务全面实施监督反馈的第三道监控防线。督察长、监察稽核部独立于其它部门和业务活动，并对内部控制制度的执行情况实行严格的检查和反馈。

#### 6、基金管理人关于内部控制制度的声明

基金管理人确知建立内部控制系统、维持其有效性以及有效执行内部控制制度是公司董事会及管理层的责任，董事会承担最终责任；基金管理人特别声明以上关于风险管理和内部控制的披露真实、准确，并承诺根据市场的变化和基金管理人的发展不断完善风险管理和内部控制制度。



## 第四部分 基金托管人

### 一、基金托管人情况

#### （一）基本情况

名称：上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市中山东一路 12 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：郑杨

成立时间：1992 年 10 月 19 日

经营范围：经中国人民银行和中国银行业监督管理委员会批准，公司主营业务主要包括：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱业务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外币兑换；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代客外汇买卖；资信调查、咨询、见证业务；离岸银行业务；证券投资基金托管业务；全国社会保障基金托管业务；经中国人民银行和中国银行业监督管理委员会批准经营的其他业务。

组织形式：股份有限公司

注册资本：293.52 亿元人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基金字[2003]105 号

联系人：朱萍

联系电话：(021) 61618888

上海浦东发展银行自 2003 年开展资产托管业务，是较早开展银行资产托管服务的股份制商业银行之一。经过二十年来的稳健经营和业务开拓，各项业务发展一直保持较快增长，各项经营指标在股份制商业银行中处于较好水平。

上海浦东发展银行总行于 2003 年设立基金托管部，2005 年更名为资产托管部，2013 年更名为资产托管与养老金业务部，2016 年进行组织架构优化调整，并更名为资产托管部，目前下设证券托管处、客户资产托管处、养老金业务处、内控管理处、业务保障处、总行资产托管运营中心（含合肥分中心）六个职能处室。

目前，上海浦东发展银行已拥有客户资金托管、资金信托保管、证券投资基金托管、全球资产托管、保险资金托管、基金专户理财托管、证券公司客户资产托管、期货公司客户资产托管、私募证券投资基金托管、私募股权托管、银行理财产品托管、企业年金托管等多项托管产品，形成完备的产品体系，可满足多领域客户、境内外市场的资产托管需求。

## （二）主要人员情况

郑杨，男，1966年出生，研究生学历，博士学位，高级经济师。曾任国家经贸委经济法规司调研处副处长；中国机电设备招标中心开发处处长、第七招标业务处处长；国家外汇管理局资本项目司副司长；中国人民银行上海分行党委委员、副行长、国家外汇管理局上海市分局副局长；中国人民银行上海总部党委委员、副主任兼外汇管理部主任；上海市金融工作党委副书记、市金融办主任；上海市金融工作党委书记、市金融办主任；上海市金融工作党委书记、市地方金融监管局（市金融工作局）局长。现任上海浦东发展银行党委书记、董事长。

潘卫东，男，1966年出生，硕士研究生，高级经济师。曾任宁波证券公司业务一部副经理；上海浦东发展银行宁波分行资财部总经理兼任北仑办事处主任、宁波分行副行长；上海浦东发展银行产品开发部总经理；上海浦东发展银行昆明分行行长、党组书记；上海市金融服务办公室挂职并任金融机构处处长；上海国际集团党委委员、总经理助理，上海国际集团党委委员、副总经理，上海国际信托有限公司党委书记、董事长；上海浦东发展银行党委委员、执行董事、副行长、财务总监。现任上海浦东发展银行党委副书记、副董事长、行长，上海国际信托有限公司董事长。

孔建，男，1968年出生，博士研究生。历任工商银行山东省分行资金营运处副处长，上海浦东发展银行济南分行信管处总经理，上海浦东发展银行济南分行行长助理、副行长、党委书记、行长。现任上海浦东发展银行总行金融市场业务党委委员，资产托管部总经理。

## （三）基金托管业务经营情况

截止2022年9月30日，上海浦东发展银行证券投资基金托管规模为12,812.81亿元，比去年末增加0.27%。托管证券投资基金共三百七十九只支。

## （四）基金托管人的内部控制制度

1、本行内部控制目标为：确保经营活动中严格遵守国家有关法律法规、监管部门监管规则和本行规章制度，形成守法经营、规范运作的经营思想。确保经营业务的稳健运行，保证基金资产的安全和完整，确保业务活动信息的真实、准确、完整，保护基金份额持有人的合法权益。

2、本行内部控制组织架构为：总行法律合规部是全行内部控制的牵头管理部门，指导业务部门建立并维护资产托管业务的内部控制体系。总行风险监控部是全行操作风险的牵头管理部门。指导业务部门开展资产托管业务的操作风险管控工作。总行资产托管部下设内控管理处。内控管理处是全行托管业务条线的内部控制具体管理实施机构，并配备专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，独立行使监督稽核职责。

3、内部控制制度及措施：本行已建立完善的内部控制制度。内控制度贯穿资产托管业务的决策、执行、监督全过程，渗透到各业务流程和各操作环节，覆盖到从事资产托管各级组织结构、岗位及人员。内部控制以防范风险、合规经营为出发点，各项业务流程体现“内

控优先”要求。

具体内控措施包括：培育员工树立内控优先、制度先行、全员化风险控制的风险管理理念，营造浓厚的内控文化氛围，使风险意识贯穿到组织架构、业务岗位、人员的各个环节。制定权责清晰的业务授权管理制度、明确岗位职责和各项操作规程、员工职业道德规范、业务数据备份和保密等在内的各项业务管理制度；建立严格完善的资产隔离和资产保管制度，托管资产与托管人资产及不同托管资产之间实行独立运作、分别核算；对各类突发事件或故障，建立完备有效的应急方案，定期组织灾备演练，建立重大事项报告制度；在基金运作办公区域建立健全安全监控系统，利用录音、录像等技术手段实现风险控制；定期对业务情况进行自查、内部稽核等措施进行监控，通过专项/全面审计等措施实施业务监控，排查风险隐患。

#### （五）托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

##### 1、监督依据

托管人严格按照有关政策法规、以及基金合同、托管协议等进行监督。监督依据具体包括：

- （1）《中华人民共和国证券法》；
- （2）《中华人民共和国证券投资基金法》；
- （3）《公开募集证券投资基金运作管理办法》；
- （4）《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》
- （5）《基金合同》、《基金托管协议》；
- （6）法律、法规、政策的其他规定。

##### 2、监督内容

我行根据基金合同及托管协议约定，对基金合同生效之后所托管基金的投资范围、投资比例、投资限制等进行严格监督，及时提示基金管理人违规风险。

##### 3、监督方法

（1）资产托管部设置核算监督岗位，配备相应的业务人员，在授权范围内独立行使对基金管理人投资交易行为的监督职责，规范基金运作，维护基金投资人的合法权益，不受任何外界力量的干预；

（2）在日常运作中，凡可量化的监督指标，由核算监督岗通过托管业务的自动处理程序进行监督，实现系统的自动跟踪和预警；

（3）对非量化指标、投资指令、管理人提供的各种报表和报告等，采取人工监督的方法。

##### 4、监督结果的处理方式

（1）基金托管人对基金管理人的投资运作监督结果，采取定期和不定期报告形式向基金管理人和中国证监会报告。定期报告包括基金监控周报等。不定期报告包括提示函、临时

日报、其他临时报告等；

（2）若基金托管人发现基金管理人违规违法操作，以电话、邮件、书面提示函的方式通知基金管理人，指明违规事项，明确纠正期限。在规定期限内基金托管人再对基金管理人违规事项进行复查，如果基金管理人未予纠正，基金托管人将报告中国证监会。如果发现基金管理人投资运作有重大违规行为时，基金托管人应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正；

（3）针对中国证监会、中国人民银行对基金投资运作监督情况的检查，应及时提供有关情况和资料。

## 第五部分 相关服务机构

### 一、基金份额销售机构

#### 1、直销机构

名称：长安基金管理有限公司

注册地址：上海市虹口区丰镇路 806 号 3 幢 371 室

办公地址：上海市浦东新区芳甸路 1088 号紫竹国际大厦 16 楼

法定代表人：崔晓健

电话：021-20329866

传真：021-20329899

联系人：吴昱

客户服务电话：400-820-9688

网上交易平台：[www.changanfunds.com](http://www.changanfunds.com)

投资人可以通过直销机构网上交易系统办理本基金的开户、申购及赎回等业务，具体交易细则请参阅直销机构网站公告。

#### 2、其他销售机构

##### (1)交通银行股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号

法定代表人：任德奇

客户服务电话：95559

公司网址：[www.bankcomm.com](http://www.bankcomm.com)

##### (2)上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：郑杨

客户服务电话：95528

公司网址：[www.spdb.com.cn](http://www.spdb.com.cn)

##### (3)兴业银行股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 154 号

法定代表人：高建平

客服电话：95561

公司网址：[www.cib.com.cn](http://www.cib.com.cn)

##### (4)宁波银行股份有限公司

注册地址：浙江省宁波市鄞州区宁东路 345 号

法定代表人：陆华裕

客户服务电话：95574

网址：[www.nbc.com.cn](http://www.nbc.com.cn)

(5)和讯信息科技有限公司

住所：北京市朝阳区大街 22 号泛利大厦 10 层

法定代表人：章知方

客服电话：400-920-0022

公司网址：[www.hexun.com](http://www.hexun.com)

(6)河南和信证券投资顾问股份有限公司

注册地址：郑州市郑东新区金水东路南、农业路西 1 号楼美盛中心 24 层 2405

法定代表人：石磊

客服电话：0371-61777558

公司网址：[www.hexinsec.com](http://www.hexinsec.com)

(7)诺亚正行基金销售有限公司

注册地址：上海市金山区廊下镇漕廊公路 7650 号 205 室

办公地址：中国上海杨浦区秦皇岛路 32 号 C 栋

法定代表人：汪静波

客服电话：400-821-5399

公司网址：[www.noah-fund.com](http://www.noah-fund.com)

(8)深圳众禄基金销售有限公司

注册地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

办公地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

法定代表人：薛峰

客服电话：400-6788-887

公司网址：[www.zlfund.cn](http://www.zlfund.cn) 及 [www.jjmmw.com](http://www.jjmmw.com)

(9)上海天天基金销售有限公司

办公地址：上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 9 楼

法定代表人：其实

客服电话：400-181-8188

公司网址：[www.1234567.com.cn](http://www.1234567.com.cn)

(10)上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室

办公地址：上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 9 楼

法定代表人：杨文斌

客服电话：400-700-9665

公司网址：[www.ehowbuy.com](http://www.ehowbuy.com)

(11)蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

注册地址：杭州市余杭区仓前街道海曙路东 2 号

法定代表人：祖国明

客服电话：400-076-6123

公司网址：[www.fund123.cn](http://www.fund123.cn)

(12)上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址：上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层

法定代表人：张跃伟

公司网址：[www.erichfund.com](http://www.erichfund.com)

(13)北京展恒基金销售有限公司

注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号

办公地址：北京市朝阳区德胜门外华严北里 2 号民建大厦 6 层

法定代表人：闫振杰

客服电话：400-888-6661

公司网址：[www.myfund.com](http://www.myfund.com)

(14)上海利得基金销售有限公司

注册地址：上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室

办公地址：上海市浦东新区东方路 989 号中达广场 201 室

法定代表人：李兴春

客服电话：400-005-6355

公司网址：<http://leadfund.com.cn/>

(15)北京钱景财富投资管理有限公司

注册地址：北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012

办公地址：北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012

法定代表人：赵荣春

客服热线：400-678-5095

公司网址：[www.niuji.net](http://www.niuji.net)

(16)上海联泰基金销售有限公司

注册地址：上海自由贸易实验区富特北路 277 号 3 层 310 室

法定代表人：尹彬彬

客服电话：4000-466-788

公司网址：[www.66zichan.com](http://www.66zichan.com)

(17)上海汇付金融服务有限公司

注册地址：上海市黄浦区中山南路 100 号 19 层

法定代表人：冯修敏

客服电话：400-820-2819

公司网站：www.chinapnr.com

(18)上海基煜基金销售有限公司

注册地址：上海市崇明县长兴镇路潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室

法定代表人：王翔

客服电话：021-65370077

公司网址：www.jiyufund.com.cn

(19)上海中正达广基金销售有限公司

注册地址：上海市龙兰路 277 号 1 号楼 1203、1204 室

法定代表人：黄欣

客服电话：400-6767-523

公司网址：www.zzwealth.cn

(20)上海陆金所基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

法定代表人：陈祎彬

客服电话：400-821-9031

公司网址：www.lufunds.com

(21)珠海盈米基金销售有限公司

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际大厦南塔 12 楼

法定代表人：肖雯

客服电话：020-89629066

公司网址：www.yingmi.cn

(22)上海爱建财富管理有限公司

注册地址：上海市黄浦区西藏中路 336 号 1806-13 室

法定代表人：蒋明康

客服电话：021-64396600

公司网址：www.ajcf.com.cn

(23)深圳市金斧子基金销售有限公司

注册地址：深圳市南山区智慧广场第 A 栋 11 层 1101-02

法定代表人：赖任军



客服电话：400-9500-888

公司网址：www.jfzinv.com

(24)中信期货有限公司

注册地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305室、  
14层

法定代表人：张皓

客服电话：400-990-8826

公司网址：www.citicsf.com

(25)国泰君安证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区商城路618号

办公地址：上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼

法定代表人：贺青

客服电话：400-888-8666

公司网址：www.gtja.com

(26)中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街188号

法定代表人：王常青

客服电话：400-888-8108

公司网址：www.csc108.com

(27)广发证券股份有限公司

注册地址：广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼（4301-4316房）

办公地址：广东省广州天河区天河北路大都会广场5、18、19、36、38、39、41、42、43、44  
楼

法定代表人：孙树明

客服电话：95575

公司网址：www.gf.com.cn

(28)中信证券股份有限公司

注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦A层

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦

法定代表人：张佑君

客服电话：95558

公司网址：www.cs.ecitic.com

(29)安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 34 层、28 层 A02 单元

办公地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层

法定代表人：黄炎勋

客服电话：400-800-1001

公司网址：www.essence.com.cn

(30)西南证券股份有限公司

注册地址：重庆市江北区桥北苑 8 号

办公地址：重庆市江北区桥北苑 8 号西南证券大厦

法定代表人：廖庆轩

客服电话：400-809-6096

公司网址：www.swsc.com.cn

(31)中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区苗岭路 29 号澳柯玛大厦 15 层(1507-1510 室)

办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 20 层

法定代表人：冯恩新

客服电话：0532-96577

公司网址：sd.citics.com。

(32)信达证券股份有限公司

住所：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

办公地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人：祝瑞敏

客服电话：400-800-8899

公司网址：www.cindasc.com

(33)光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：刘秋明

客服电话：95525

公司网址：www.ebscn.com

(34)浙商证券股份有限公司

注册地址：浙江省杭州市江干区五星路 201 号

法定代表人：吴承根

客服电话：95345

公司网址：www.stocke.com.cn

(35)东海证券股份有限公司

注册地址：常州市延陵西路 23 号投资广场 18 层

法定代表人：钱俊文

客服电话：95531

公司网址：www.longone.com.cn

(36)中泰证券股份有限公司

注册地址：济南市经七路 86 号

办公地址：济南市经七路 86 号 23 层

法定代表人：李峰

客户电话：95538

公司网址：www.qlzq.com.cn

(37)上海华信证券有限责任公司

注册地址：上海浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 9 楼

法定代表人：陈灿辉

客服热线：400-820-5999

公司网址：www.shhxzq.com

(38)国金证券股份有限公司

注册地址：成都市青羊区东城根上街 95 号

办公地址：成都市青羊区东城根上街 95 号

法定代表人：冉云

客服电话：400-160-0109

公司网址：www.gjq.com.cn

(39)天风证券股份有限公司

注册地址：湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路 2 号高科大厦四楼

办公地址：中国武汉市武昌区中南路 99 号保利广场 A 座 37 楼

法定代表人：余磊

客服电话：400-800-5000

公司网址：www.tfzq.com

(40)南京苏宁基金销售有限公司

注册地址：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

法定代表人：王锋

客服电话：025-66996699

公司网址：www.suning.com

(41)上海万得基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座

法定代表人：黄祎

客服电话：400-799-1888

公司网址：[www.520fund.com.cn](http://www.520fund.com.cn)

(42)上海凯石财富基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区西藏南路 765 号 602-115 室

法定代表人：陈继武

客服电话：4006-433-389

公司网址：[www.lingxianfund.com](http://www.lingxianfund.com)

(43)奕丰基金销售有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室

法定代表人：TEO WEE HOWE

客服电话：400-684-0500

网站：[www.ifastps.com.cn](http://www.ifastps.com.cn)

(44)天津万家财富资产管理有限公司

注册地址：天津自贸区（中心商务区）迎宾大道 1988 号滨海浙商大厦公寓 2-2413 室

法定代表人：戴晓云

客服电话：010-59013825

公司网址：[www.wanjiawealth.com](http://www.wanjiawealth.com)

(45)上海证券有限责任公司

注册地址：上海市黄浦区四川中路 213 号 7 楼

法定代表人：何伟

客服电话：021-962518

公司网址：[www.962518.com](http://www.962518.com)

(46)华鑫证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01（b）单元

法定代表人：俞洋

客服电话：400-109-9918

网站：[www.cfsc.com.cn](http://www.cfsc.com.cn)

(47)深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006#

法定代表人：洪弘

客服电话：400-166-1188

公司网站：<http://8.jrj.com.cn>

(48)浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903 室

办公地址：浙江省杭州市翠柏路 7 号杭州电子商务产业园 2 号楼 2 楼

法定代表人：吴强

客服电话：4008-773-772

公司网址：[www.5ifund.com](http://www.5ifund.com)

(49)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

法定代表人：王伟刚

客服电话：400-619-9059

公司网址：[www.fundzone.cn](http://www.fundzone.cn)

(50)北京雪球基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区创远路 34 号院 6 号楼 15 层 1501 室

法定代表人：李楠

客服电话：400-159-9288

公司网址：[www.danjuanapp.com](http://www.danjuanapp.com)

(51)海通证券股份有限公司

注册地址：上海市淮海中路 98 号

办公地址：上海市广东路 689 号

法定代表人：周杰

客服电话：95553

公司网址：[www.htsec.com](http://www.htsec.com)

(52)平安证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼

办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼

法定代表人：何之江

客服电话：95511-8

公司网址：[www.pingan.com](http://www.pingan.com)

(53)华安证券股份有限公司

注册地址：安徽省合肥市长江中路 357 号

办公地址：安徽省合肥市阜南路 166 号润安大厦 A 座

法定代表人：章宏韬

客服电话：400-809-6518

公司网址：[www.hazq.com](http://www.hazq.com)

(54)华瑞保险销售有限公司

注册地址：上海市嘉定区南翔镇众仁路 399 号运通星财富广场 1 号楼 B 座 13、14 层

法定代表人：路昊

客服电话：400-111-5818

公司网址：www.huaruisales.com

(55)东方财富证券股份有限公司

注册地址：西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城 10 栋楼

法定代表人：戴彦

客服电话：95357

公司网址：www.18.cn

(56)中信证券华南股份有限公司

注册地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层

法定代表人：胡伏云

客服电话：95396

公司网址：www.gzs.com.cn

(57)海银基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 8 号 402 室

办公地址：上海市浦东新区银城中路 8 号 4 楼

客服电话：400-808-1016

法定代表人：巩巧丽

公司网址：www.fundhaiyin.com

(58)华金证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 759 号 30 层

法定代表人：宋卫东

客服电话：4008211357

公司网址：www.huajinsec.com

(59)招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 38-45 层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 38-45 层

法定代表人：霍达

客服电话：95565

公司网址：www.newone.com.cn

(60)中证金牛（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市丰台区东管头 1 号 2 号楼 2-45 室

客服电话：4008-909-998

法定代表人：钱昊旻

公司网址：www.jnlc.com

(61)泰诚财富基金销售（大连）有限公司

注册地址：辽宁省大连市沙河口区星海中路3号

法定代表人：李春光

客服电话：400-0411-001

公司网址：www.taichengcaifu.com

(62)上海大智慧基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路428号1号楼1102单元

法定代表人：申健

客服电话：021-20292031

公司网址：www.wg.com.cn

(63)上海陆享基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区临港新片区环湖西二路888号1幢1区14032

室

法定代表人：粟旭

客服电话：021-53398816

公司网址：www.luxxfund.com

(64)上海挖财基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5楼04室

法定代表人：吕柳霞

客服电话：021-50810673

公司网址：www.wacaijijin.com

(65)洪泰财富（青岛）基金销售有限责任公司

注册地址：山东省青岛市崂山区香港东路195号9号楼701室

法定代表人：李赛

客服电话：400-8189-598

公司网址：www.hongtaiwealth.com

(66)喜鹊财富基金销售有限公司

注册地址：西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦1513室

法定代表人：王舰正

客服电话：400 699 7719

网址：www.xiquefund.com

(67)和耕传承基金销售有限公司

注册地址：河南自贸试验区郑州片区（郑东）东风南路东康宁街北6号楼5楼503

办公地址：河南自贸试验区郑州片区（郑东）东风南路东康宁街北6号楼5楼503

法定代表人：温丽燕

客服电话：400-0555-671

网址：[www.hgccpb.com](http://www.hgccpb.com)

(68)江苏汇林保大基金销售有限公司

注册地址：南京市高淳区经济开发区古檀大道47号

法定代表人：吴言林

客服电话：025-6604 6166

网址：[www.huilinbd.com](http://www.huilinbd.com)

(69)泛华普益基金销售有限公司

注册地址：成都市成华区建设路9号高地中心1101室

法定代表人：于海锋

客服电话：400-080-3388

网址：[www.puyifund.com](http://www.puyifund.com)

(70)京东肯特瑞基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区西三旗建材城中路12号17号平房157

法定代表人：李骏

客服电话：95118

公司网址：[fund.jd.com](http://fund.jd.com)

(71)玄元保险代理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区张杨路707号1105室

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区张杨路707号1105室

法定代表人：马永谱

客服电话：400-080-8208

公司网站：[www.licaimofang.com](http://www.licaimofang.com)

(72)大连网金基金销售有限公司

注册地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路22号诺德大厦2层202室

办公地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路22号诺德大厦2层202室

法定代表人：樊怀东

客服电话：4000-899-100

公司网站：[www.yibaijin.com](http://www.yibaijin.com)

(73)通华财富(上海)基金销售有限公司



注册地址：上海虹口区同丰路 667 弄 107 号 201 室

办公地址：上海市浦东新区金沪路 55 号通华科技大厦

法定代表人：沈丹义

客服电话：400-101-9301

公司网址：www.yibaijin.com

(74)浦领基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区望京东园四区 2 号楼 10 层 1001 号 04 室

法定代表人：张昱

客服电话：400-012-5899

公司网址：www.zscffund.com

(75)泰信财富基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国路甲 92 号-4 至 24 层内 10 层 1012

法定代表人：张虎

客服电话：400-004-8821

公司网址：www.taixincf.com

(76)北京中植基金销售有限公司

注册地址：北京市北京经济技术开发区宏达北路 10 号五层 5122 室

法定代表人：武建华

客服电话：400-8180-888

公司网址：www.zzfund.com

(77)阳光人寿保险股份有限公司

注册地址：海南省三亚市迎宾路 360-1 号三亚阳光金融广场 16 层

法定代表人：李科

客户电话：95510

公司网址：fund.sinosig.com

(78)五矿证券有限公司

注册地址：深圳市南山区粤海街道海珠社区滨海大道 3165 号五矿金融大厦 2401

法定代表人：黄海洲

客服电话：40018-40028

公司网址：www.wkzq.com.cn

(79)北京坤元基金销售有限公司

注册地址：北京市石景山区古城大街特钢公司十一区（首特创业基地 A 座）八层 816

号

法人：杜福胜

客服电话：4006498989

官网：[www.kunyuangfund.com](http://www.kunyuangfund.com)

(80)华宝证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区浦电路 370 号 2、3、4 层

法定代表人：刘加海

客服电话：4008209898

公司网址：[www.cnhbstock.com](http://www.cnhbstock.com)

基金管理人可根据有关法律法规的要求，变更或增减其他符合要求的机构销售本基金，并在基金管理人网站公示。

## 二、登记机构

名称：长安基金管理有限公司

注册地址：上海市虹口区丰镇路 806 号 3 幢 371 室

办公地址：上海市浦东新区芳甸路 1088 号紫竹国际大厦 16 楼

法定代表人：崔晓健

联系电话：021-20329771

传真：021-20329741

联系人：欧鹏

## 三、出具法律意见书的律师事务所

### （一）基金募集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

注册地址：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

联系电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：陆奇

经办律师：安冬、陆奇

### （二）基金新增 E 类份额出具法律意见书的律师事务所

名称：上海源泰律师事务所

住所：上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 楼

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 楼

负责人：廖海

联系电话：021-51150298

传真：021-51150398

联系人：刘佳

经办律师：黄丽华、刘佳

#### **四、审计基金财产的会计师事务所**

名称：毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）

注册地址：北京市东长安街1号东方广场东2座8层

办公地址：上海市南京西路1266号恒隆广场1期50楼

法定代表人：邹俊

电话：021-22122888

传真：021-62881889

联系人：黄小熠

经办注册会计师：黄小熠、蔡晓晓

## 第六部分 基金的历史沿革

长安泓沣中短债债券型证券投资基金由长安鑫垚主题轮动混合型证券投资基金转型而来。

长安鑫垚主题轮动混合型证券投资基金经中国证监会 2017 年 6 月 26 日证监许可（2017）1048 号文注册，基金管理人为长安基金管理有限公司，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

长安鑫垚主题轮动混合型证券投资基金自 2017 年 7 月 26 日至 2017 年 8 月 4 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，《长安鑫垚主题轮动混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 8 月 9 日生效。

长安鑫垚主题轮动混合型证券投资基金经中国证监会 2019 年 4 月 2 日证监许可（2019）558 号文准予变更注册。

2019 年 4 月 8 日至 2019 年 5 月 7 日，长安鑫垚主题轮动混合型证券投资基金基金份额持有人大会以通讯方式召开，会议审议并通过了《关于长安鑫垚主题轮动混合型证券投资基金转型有关事项的议案》，内容包括变更基金名称、基金的类别、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模、投资目标、投资范围、投资策略、投资比例限制、业绩比较基准、估值方法、基金费用等事项。基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。

自 2019 年 5 月 10 日起，《长安鑫垚主题轮动混合型证券投资基金基金合同》失效且《长安泓沣中短债债券型证券投资基金基金合同》同时生效，长安鑫垚主题轮动混合型证券投资基金正式转型为长安泓沣中短债债券型证券投资基金。

## 第七部分 基金的存续

### 一、基金份额的变更登记

《基金合同》生效后，本基金登记机构将进行本基金基金份额的更名以及必要的信息变更。

### 二、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

《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，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式，与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。

法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。

## 第八部分 基金份额的申购与赎回

### 一、申购和赎回场所

本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。具体的销售机构将由基金管理人在招募说明书或基金管理人网站列明。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并在基金管理人网站公示。

若基金管理人或其指定的销售机构开通电话、传真或网上等交易方式，投资人可以通过上述方式进行申购与赎回，具体参见各销售机构的相关公告。投资人应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。

### 二、申购和赎回的开放日及时间

#### 1、开放日及开放时间

投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

基金合同生效后，若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

#### 2、申购、赎回业务办理时间

在确定申购开始与赎回开始时间后，基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告申购与赎回的开始时间。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接受的，其基金份额申购、赎回价格为下一开放日该类别基金份额申购、赎回的价格。

### 三、申购与赎回的原则

1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的该类别基金份额净值为基准进行计算；

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；

4、赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人申购的先后次序进行顺序赎回；

5、办理申购、赎回业务时，应当遵循基金份额持有人利益优先原则，确保投资者的合

法权益不受损害并得到公平对待。

基金管理人可在法律法规允许的情况下，对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规  
则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

#### 四、申购与赎回的程序

##### 1、申购和赎回的申请方式

投资人必须根据销售机构规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回  
的申请。

##### 2、申购和赎回的款项支付

投资人申购基金份额时，必须全额交付申购款项，投资人全额交付申购款项，申购成立；  
基金登记机构确认基金份额时，申购生效。若资金在规定时间内未全额到账则申购不成立，  
申购款项将退回投资人账户，基金管理人、基金托管人和销售机构等不承担由此产生的利息  
等任何损失。

基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；基金登记机构确认赎回时，赎回生效。

基金份额持有人赎回申请生效后，基金管理人将在 T+7 日（包括该日）内支付赎回款  
项。在发生巨额赎回或基金合同载明的其他延缓支付赎回款项的情形时，款项的支付办法参  
照基金合同和本招募说明书有关条款处理。遇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，则赎回款项划付时间相应延迟。

##### 3、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请  
日（T 日），在正常情况下，本基金登记机构在 T+1 日内对该交易的有效性进行确认。T 日  
提交的有效申请，投资人应在 T+2 日后（包括该日）及时到销售机构或以销售机构规定的  
其他方式查询申请的确认情况。若申购不成功或无效，则申购款项本金退还给投资人。

销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构已经接收  
到申请。申购、赎回申请的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况，投资人  
应及时查询并妥善行使合法权利，否则，由此产生的投资人任何损失由投资人自行承担。

在法律法规允许的范围内，本基金登记机构、基金管理人可根据相关业务规则，对上述  
业务办理时间进行调整，本基金管理人必须在调整实施日前按照《信息披露办法》的有关规  
定在指定媒介上公告。

#### 五、申购和赎回的数量限制

## 1、申购金额的限制

（1）投资人通过基金管理人网上交易平台（目前仅针对个人投资者）和除基金管理人之外的其他销售机构首次申购本基金份额，首次申购和追加申购单笔最低金额均为 10 元人民币（含申购费），其他销售机构可根据自己的情况调整首次申购金额和追加申购最低金额限制。投资人在基金管理人直销中心（网上交易平台除外）首次申购本基金份额，最低金额为 10,000 元人民币（含申购费），追加申购每笔最低金额 1,000 元人民币（含申购费）。本基金直销中心单笔申购最低金额可由基金管理人酌情调整。

投资者将分配的收益选择红利再投资方式转购基金份额或采用定期定额投资计划时，不受最低申购金额的限制。

除基金管理人之外的销售机构的投资人欲转入基金管理人的直销中心进行交易要受直销中心最低金额的限制。

（2）投资人可多次申购，本基金目前对单个投资人累计持有的基金份额不设上限限制，但单个投资人持有基金份额的比例不得达到或超过基金份额总数的 50%（在基金运作过程中因基金份额赎回等因素导致其持有基金份额的比例被动达到或超过 50%的情形除外，在基金变更注册前持有基金份额的比例达到或超过基金份额总数 50%的单个投资人，不得再申购本基金，直至其持有基金份额的比例低于基金份额总数的 50%）。未来基金管理人可以规定单个投资人累计持有的基金份额数量限制，具体规定见定期更新的招募说明书或相关公告。法律法规、中国证监会另有规定的除外。

（3）当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。

基金管理人基于投资运作和风险控制的需要，可采取上述措施对基金规模予以控制。具体请参见相关公告。

## 2、赎回份额的限制

基金份额持有人可将其持有的全部或部分基金份额赎回，基金份额持有人在销售机构赎回时，每笔赎回申请不得少于 10.00 份基金份额；基金份额持有人赎回时或赎回后将导致在销售机构保留的基金份额余额不足 10.00 份的，需一并全部赎回。各销售机构对赎回限额有其他规定的，以各销售机构的业务规则为准。

3、基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额等数量限制。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。



## 六、申购和赎回的费率及其用途

1、本基金 A 类基金份额的申购费用由申购 A 类基金份额的投资人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用。投资人申购本基金 A 类基金份额时支付申购费用，申购费率按照申购金额递减，申购本基金 C 类和 E 类基金份额不需要支付申购费用，而是从该类别基金资产中计提销售服务费。投资者有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。

本基金 A 类基金份额的申购费率具体如下：

申购金额（M）	申购费率
M < 100 万元	0.40%
100 万 ≤ M < 300 万元	0.20%
300 万 ≤ M < 500 万元	0.10%
M ≥ 500 万元	1000 元/笔

2、本基金在投资者赎回基金份额时对赎回基金份额收取赎回费。本基金各类基金份额的赎回费用由赎回各类基金份额的基金份额持有人承担，基金份额持有人可将其持有的全部或部分基金份额赎回。

对于各类基金份额的赎回费全额计入基金财产。

本基金赎回费用按基金份额持有人持有该部分基金份额的时间分段设定。

本基金 A 类和 C 类基金份额按照相同的赎回费率收取赎回费用：

持有时间（Y）	赎回费率
Y < 7 日	1.50%
7 日 ≤ Y < 30 日	0.10%
Y ≥ 30 日	0%

本基金 E 类基金份额的赎回费率如下：

持有时间（Y）	赎回费率
Y < 7 日	1.50%
Y ≥ 7 日	0%

3、基金管理人可以在法律法规、基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

4、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保

基金估值的公平性。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。

5、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，定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管机构要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金申购费率、赎回费率。

## 七、申购份额与赎回金额的计算

### 1、本基金申购份额的计算

#### (1) A类基金份额的申购

A类基金份额的申购金额包括申购费用和净申购金额，其中：

1) 当申购费用适用比例费率时，申购份额的计算方法如下：

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} / (1 + \text{申购费率})$$

$$\text{申购费用} = \text{申购金额} - \text{净申购金额}$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{T日A类基金份额净值}$$

2) 当申购费用为固定金额时，申购份额的计算方法如下：

$$\text{申购费用} = \text{固定金额}$$

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} - \text{申购费用}$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{T日A类基金份额净值}$$

上述计算结果均按舍去尾数方法，保留到小数点后2位，由此产生的收益由基金财产享有。

例：某投资人投资50,000元申购本基金的A类基金份额，对应的申购费率为0.40%，假设申购当日A类基金份额的基金份额净值为1.0585元，则其可得到的申购份额为：

$$\text{净申购金额} = 50,000 / (1 + 0.40\%) = 49,800.79 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 50,000 - 49,800.79 = 199.21 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 49,800.79 / 1.0585 = 47,048.45 \text{ 份}$$

即：投资人投资50,000元申购本基金的A类基金份额，假设申购当日A类基金份额的基金份额净值为1.0585元，则可得到47,048.45份A类基金份额。

#### (2) C类、E类基金份额的申购

C类、E类基金份额不收取申购费，申购份额的计算方法如下：

$$\text{申购份额} = \text{申购金额} / \text{T日C类或E类基金份额净值}$$

申购份额的计算保留到小数点后2位，小数点2位以后的部分舍去，由此误差产生的收

益由基金财产享有。

例：某投资者申购 C 类或 E 类基金份额 50,000 元，假设申购当日 C 类或 E 类基金份额的基金份额净值为 1.0585 元，则可申购的 C 类或 E 类基金份额为：

$$\text{申购份额} = 50,000 / 1.0585 = 47,236.65 \text{ 份}$$

即：投资人投资 50,000 元申购本基金的 C 类或 E 类基金份额，假设申购当日 C 类或 E 类基金份额的基金份额净值为 1.0585 元，则可得到 47,236.65 份 C 类或 E 类基金份额。

## 2、本基金赎回金额的计算

本基金各类基金份额赎回金额的计算方法一样，均采用“份额赎回”方式，赎回价格以 T 日各类基金份额的基金份额净值为基准进行计算，赎回金额的计算方法如下：

$$\text{赎回总金额} = \text{赎回份额} \times \text{T 日某类基金份额净值}$$

$$\text{赎回费用} = \text{赎回总金额} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{净赎回金额} = \text{赎回总金额} - \text{赎回费用}$$

上述计算结果均按舍去尾数方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益由基金财产享有。

例：某基金份额持有人持有 10,000 份 A 类基金份额，持有 20 日后决定全部赎回，对应的赎回费率为 0.10%，假设赎回当日 A 类基金份额的基金份额净值是 1.3567 元，则可得到的净赎回金额为：

$$\text{赎回总金额} = 10,000 \times 1.3567 = 13,567.00 \text{ 元}$$

$$\text{赎回费用} = 13,567.00 \times 0.10\% = 13.56 \text{ 元}$$

$$\text{净赎回金额} = 13,567.00 - 13.56 = 13,553.44 \text{ 元}$$

即：基金份额持有人持有 10,000 份 A 类基金份额 20 日后全部赎回，假设赎回当日 A 类基金份额的基金份额净值是 1.3567 元，则可得到的净赎回金额为 13,553.44 元。

例：某基金份额持有人持有 10,000 份 C 类基金份额 30 日后（已超过 30 日）决定全部赎回，对应的赎回费率为 0%，假设赎回当日 C 类基金份额的基金份额净值是 1.3567 元，则可得到的净赎回金额为：

$$\text{赎回总金额} = 10,000 \times 1.3567 = 13,567.00 \text{ 元}$$

$$\text{赎回费用} = 13,567.00 \times 0\% = 0 \text{ 元}$$

$$\text{净赎回金额} = 13,567.00 - 0 = 13,567.00 \text{ 元}$$

即：基金份额持有人持有 10,000 份 C 类基金份额 30 日后全部赎回，假设赎回当日 C 类基金份额的基金份额净值是 1.3567 元，则可得到的净赎回金额为 13,567.00 元。

例：某基金份额持有人持有 10,000 份 E 类基金份额 7 日后（已超过 7 日）决定全部赎回，对应的赎回费率为 0%，假设赎回当日 E 类基金份额的基金份额净值是 1.3567 元，则可得到的净赎回金额为：

赎回总金额=10,000×1.3567=13,567.00 元

赎回费用=13,567.00×0%=0 元

净赎回金额=13,567.00-0=13,567.00 元

即：基金份额持有人持有 10,000 份 E 类基金份额 7 日后全部赎回，假设赎回当日 E 类基金份额的基金份额净值是 1.3567 元，则可得到的净赎回金额为 13,567.00 元。

### 3、本基金基金份额净值的计算

本基金各类基金份额分别计算和公告基金份额净值，本基金各类基金份额净值的计算，均保留到小数点后第 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产享有或承担。T 日各类基金份额的基金份额净值在当天收市后计算，并不晚于每个开放日的次日公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

## 八、拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

- 1、因不可抗力导致基金无法正常运作。
- 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况。
- 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。
- 4、接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。
- 5、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或超过 50%，或者变相规避 50%集中度的情形。
- 6、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或发生其他损害现有基金份额持有人利益的情形。
- 7、基金管理人、基金托管人、基金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、基金登记系统或基金会计系统无法正常运行。
- 8、本基金总规模、单日净申购比例、单一投资者单日或单笔申购金额达到基金管理人所设定的上限的。
- 9、当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上的，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受基金申购申请。
- 10、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第 1、2、3、6、7、9、10 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上公告。如果投资人的申购申请全部或部分被拒绝的，被拒绝的申购款项（不含利息）将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

### 九、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受基金份额持有人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

- 1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。
- 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时。
- 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。
- 4、发生继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时，基金管理人可暂停接受基金份额持有人的赎回申请。
- 5、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。
- 6、当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上的，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受基金赎回申请或延缓支付赎回款项。
- 7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付。若出现上述第 5 项所述情形，按基金合同和招募说明书的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

### 十、巨额赎回的情形及处理方式

#### 1、巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过前一开放日的基金总份额的 10%，即认为是发生了巨额赎回。

#### 2、巨额赎回的处理方式

当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。

（1）全额赎回：当基金管理人认为有能力支付基金份额持有人的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

（2）部分延期赎回：当基金管理人认为支付基金份额持有人的赎回申请有困难或认为因支付基金份额持有人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的 10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，基金份额持有人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日对应类别基金份额的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如基金份额持有人在提交赎回申请时未作明确选择，基金份额持有人未能赎回部分作自动延期赎回处理。部分延期赎回不受单笔赎回最低份额的限制。

（3）如发生单个开放日内单个基金份额持有人申请赎回的基金份额超过前一开放日基金总份额的 40%时，本基金管理人对该单个基金份额持有人持有的超过 40%的赎回申请可以实施延期办理。对该单个基金份额持有人不超过 40%的赎回申请，与当日其他赎回申请一起，按上述（1）、（2）方式处理。对于未能赎回部分，基金份额持有人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日对应类别基金份额的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。如基金份额持有人在提交赎回申请时未作明确选择，基金份额持有人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

（4）暂停赎回：连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当在指定媒介上进行公告。

### 3、巨额赎回的公告

当发生上述巨额赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个工作日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，并在 2 日内在指定媒介公告。

### 十一、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

1、发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人应当在规定期限内指定媒介公告。

2、如发生暂停的时间为1日，基金管理人应于重新开放日，在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近1个工作日各类基金份额的基金份额净值。

3、如发生暂停的时间超过1日，基金管理人可以根据暂停申购或赎回的时间，依照《信息披露办法》的有关规定，最迟于重新开放日在指定媒介上刊登重新开放申购或赎回的公告，并公布最近1个工作日各类基金份额的基金份额净值；也可以根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间，届时不再另行发布重新开放的公告。

## 十二、基金转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换业务，基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及基金合同的规定制定并公告，并提前告知基金托管人与相关机构。

## 十三、基金份额的转让

在法律法规允许且条件具备的情况下，基金管理人可受理基金份额持有人通过中国证监会认可的交易场所或者交易方式进行份额转让的申请并由登记机构办理基金份额的过户登记。基金管理人拟受理基金份额转让业务的，将提前公告，基金份额持有人应根据基金管理人公告的业务规则办理基金份额转让业务。

## 十四、基金的非交易过户

基金的非交易过户是指基金登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行等情形而产生的非交易过户以及登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资人。

继承是指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承；捐赠指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体；司法强制执行是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人或其他组织。办理非交易过户必须提供基金登记机构要求提供的相关资料，对于符合条件的非交易过户申请按基金登记机构的规定办理，并按基金登记机构规定的标准收费。

## 十五、基金的转托管

基金份额持有人可办理已持有基金份额在不同销售机构之间的转托管，基金销售机构可以按照规定标准收取转托管费。

## 十六、定期定额投资计划

基金管理人可以为投资人办理定期定额投资计划，具体规则由基金管理人另行规定。投

资人在办理定期定额投资计划时可自行约定每期扣款金额，每期扣款金额必须不低于基金管理人在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。

### **十七、基金份额的冻结、解冻和质押**

基金登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻，以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益一并冻结，被冻结部分份额仍然参与收益分配。法律法规或监管机构另有规定的除外。

如相关法律法规允许基金管理人办理基金份额的质押业务或其他基金业务，基金管理人将制定和实施相应的业务规则。

### **十八、实施侧袋机制期间本基金的申购与赎回**

本基金实施侧袋机制的，本基金的申购和赎回安排详见本招募说明书“侧袋机制”部分的约定或相关公告。



## 第九部分 基金的投资

### 一、投资目标

在严格控制风险和保持良好流动性的前提下，重点投资中短债主题证券，力争获得超越业绩比较基准的投资收益，实现基金资产的长期稳健增值。

### 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，包括债券（含国债、央行票据、地方政府债券、金融债券、企业债券、公司债券、短期融资券、超短期融资券、中期票据、次级债、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相关规定）。

本基金不投资于股票、权证等资产，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。

本基金的投资组合比例为：债券资产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%；持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例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。其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

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、地方政府债券、金融债券、企业债券、公司债券、短期融资券、超短期融资券、中期票据、次级债、可分离交易可转债的纯债部分等金融工具。

如法律法规或中国证监会变更投资品种的比例限制的，基金管理人可依据相关规定履行适当程序后调整本基金的投资比例规定。

### 三、投资策略

本基金在充分考虑基金资产的安全性、收益性、流动性及严格控制风险的前提下，通过对国内外宏观经济态势、经济政策、利率走势、收益率曲线变化趋势和信用风险变化等因素的综合分析和持续跟踪，灵活运用类属配置策略、久期策略、期限结构策略、信用债券策略、资产支持证券投资策略、回购套利策略等多种投资策略，构建并调整投资组合，力争获得超越业绩比较基准的投资收益。

### 1、类属配置策略

类属配置策略即决定资金在不同类属债券间的配置。

本基金将根据对经济周期和市场环境的把握，基于对财政政策、货币政策的深入分析及对宏观经济发展的持续跟踪，结合市场上主要的债券配置机构的资金情况，并根据不同类型债券的风险来源、收益率水平、利息支付方式、利息税务处理、附加选择权价值、类属资产收益差异、市场偏好及流动性等因素，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、信用债券、利率债券等资产类别之间进行类属配置，确定具有最优风险收益特征的资产组合。

### 2、久期策略

久期策略主要指确定债券组合的久期水平。

本基金将全面、深入研究影响利率变化的宏观因素，如经济增长率、通货膨胀、国际收支等的变化，进而判断经济政策的基调和走向，结合债券市场资金供给结构、流动性充裕情况以及投资人避险情绪等的变化，判断和预测未来利率的可能走势，在一定范围内适当调整投资组合的久期水平。当预期市场利率水平下降时，适当提高组合久期，以增强投资组合收益；当预期市场利率水平上升时，适当降低组合久期，以规避债券市场下跌带来的风险。

### 3、期限结构策略

期限结构策略指通过预测收益率曲线的形状和变化趋势，对不同期限的债券进行合理配置。

本基金将分析同一类属债券的收益率曲线形态和期限结构变动，在给定组合久期以及其他组合约束条件的情形下，确定最优的期限结构。本基金期限结构调整的策略包括子弹策略、哑铃策略和梯形策略。当预期收益率曲线变陡时，采用子弹策略；当预期收益率曲线变平时，采用哑铃策略；当预期收益率曲线不变或平行移动时，采用梯形策略。

### 4、信用债券策略

信用债券收益率等于基准收益率加信用利差，信用利差收益主要受两方面影响，一是该信用债券对应信用水平的市场平均信用利差曲线走势；二是该信用债券本身的信用变化。基于上述两方面因素，本基金采用以下投资策略：

基于信用利差曲线变化的策略：一是分析经济周期和相关市场变化对信用利差曲线的影响，二是分析信用债券市场容量、结构、流动性等变化趋势对信用利差曲线的影响，综合各种因素，分析信用利差曲线整体及分行业走势，确定信用债券总的投资比例及分行业的投资比例。

基于信用债券信用变化的策略：发行人信用发生变化后，本基金将采用变化后的债券信用级别所对应的信用利差曲线对信用债券定价。影响信用债券信用风险的因素包括行业风险、公司风险、现金流风险、资产负债风险和其他风险等。

#### 5、资产支持证券投资策略

本基金将通过分析市场利率、发行条款、资产池结构及其资产池所处行业的景气变化、违约率、提前偿还率等影响资产支持证券内在价值的相关要素，并综合运用久期管理、收益率曲线变动分析、收益率利差分析和期权定价模型等方法，在严格控制风险的前提下，通过信用研究和流动性管理，选择经风险调整后相对价值较高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

#### 6、回购套利策略

本基金将在考虑债券投资的风险收益情况以及回购成本等因素的情况下，在风险可控及法律法规允许的范围内，通过债券回购融入和滚动短期资金，投资于收益率高于融资成本的债券等其他金融工具，获得杠杆放大收益。

### 四、投资限制

#### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）本基金债券资产的投资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%；

（2）本基金保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；

（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%；

（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 BBB 以上（含 BBB）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；

（10）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%；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；

（11）本基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

（12）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%；因证券市场波动、证券停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合该比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

（13）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；

（14）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）、（12）、（13）项另有约定外，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，但中国证监会规定的特殊情形除外。

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基金合同生效之日起开始。

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，基金管理人在履行适当程序后，则本基金的上述限制相应变更或取消。

## 2、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）向其基金管理人、基金托管人出资；
- （5）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；
- （6）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有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，或者从事其他重大关联交

易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

法律、行政法规或监管机构取消上述限制，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。

## 五、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：中债总财富（1-3年）指数收益率 $\times 80\%$ +一年期定期存款利率（税后） $\times 20\%$ 。

中债总财富（1-3年）指数由中央国债登记结算有限责任公司编制发布。该指数成份券由剩余期限1-3年的记账式国债、央行票据和政策性银行债组成，是一个综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场中短期债券指数。该指数对中短期债券价格变动趋势有较强的代表性，能较好的反映本基金的投资策略，能够较为客观地反映本基金的风险收益特征。

一年期定期存款利率是指中国人民银行公布的金融机构一年期人民币存款基准利率，可以作为衡量剩余期限在1年以下的债券、同业存单及银行存款等资产收益的基准。

本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%，其中投资于剩余期限不超过三年的中短债主题证券的比例不低于非现金基金资产的80%，中债总财富（1-3年）指数收益率 $\times 80\%$ 可以比较客观地衡量剩余期限在1-3年债券资产的投资绩效，一年期定期存款利率（税后） $\times 20\%$ 可以较客观地衡量剩余期限在1年以下的债券、同业存单及银行存款等资产的投资绩效，因此中债总财富（1-3年）指数收益率 $\times 80\%$ +一年期定期存款利率（税后） $\times 20\%$ 作为本基金的业绩比较基准能够较为客观地衡量本基金的投资绩效。

如果今后法律法规发生变化，或未来市场发生变化导致此业绩比较基准不再适用，或有其他代表性更强、更科学客观的业绩比较基准适用于本基金，或上述指数停止编制时，基金管理人可根据本基金的投资策略或投资范围，经和基金托管人协商一致后，可以在报中国证监会备案后变更或调整本业绩比较基准并及时公告，无需召开基金份额持有人大会。

## 六、风险收益特征

本基金为债券型基金，预期风险和预期收益低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。

## 七、基金管理人代表基金行使债权人权利的处理原则及方法

- 1、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人权利，保护基金份额持有人的利益；
- 2、不谋求对上市公司的控股；
- 3、有利于基金财产的安全与增值；
- 4、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

## 八、侧袋机制的实施和投资运作安排

当基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，根据最大限度保护基金份额持有人利益的原则，基金管理人经与基金托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制，无需召开基金份额持有人大会审议。

侧袋机制实施期间，本部分约定的投资组合比例、投资策略、组合限制、业绩比较基准、风险收益特征等约定仅适用于主袋账户。

侧袋账户的实施条件、实施程序、运作安排、投资安排、特定资产的处置变现和支付等对投资者权益有重大影响的事项详见本招募说明书“侧袋机制”部分的约定。

## 九、基金投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本报告期数据截至 2022 年 06 月 30 日止。财务数据未经审计。

### 1、期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	69,634,210.02	92.16
	其中：债券	69,634,210.02	92.16
	资产支持证券	-	-

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	1,800,000.00	2.38
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	3,589,309.91	4.75
8	其他各项资产	531,831.54	0.70
9	合计	75,555,351.47	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

3、报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

4、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

5、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	16,260,596.67	22.79
2	央行票据	-	-
3	金融债券	9,252,419.72	12.97
	其中：政策性金融债	9,252,419.72	12.97
4	企业债券	14,973,376.32	20.99
5	企业短期融资券	29,147,817.31	40.86
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	69,634,210.02	97.61

6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	010303	03 国债(3)	70,280	7,162,841.33	10.04
2	019664	21 国债 16	50,000	5,082,310.96	7.12
3	200303	20 进出 03	50,000	5,030,767.12	7.05
4	018008	国开 1802	40,000	4,221,652.60	5.92
5	019674	22 国债 09	40,000	4,015,444.38	5.63

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细  
本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细  
本基金本报告期末未持有贵金属。

9、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细  
本基金本报告期末未持有权证。

10、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未进行股指期货交易。

11、本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未进行股指期货交易。

12、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

12.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未进行国债期货交易。

13、报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细



本基金本报告期内未进行国债期货交易。

#### 14、投资组合报告附注

14.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

14.2 报告期内，本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

#### 15、期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	11,495.03
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	520,336.51
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	531,831.54

#### 16、期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 17、期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末持有股票。

#### 18、投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，本报告中涉及比例计算的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## 第十部分 基金的业绩

本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财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金合同生效日为2019年5月10日,基金业绩截止日为2022年6月30日。

### 1、基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

长安泓沅中短债A

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2019年5月10日-2019年12月31日	7.09%	0.15%	2.42%	0.02%	4.67%	0.13%
2020年度	1.31%	0.07%	2.37%	0.06%	-1.06%	0.01%
2021年度	4.47%	0.03%	3.26%	0.02%	1.21%	0.01%
2022年1月1日-2022年6月30日	2.02%	0.03%	1.33%	0.03%	0.69%	0.00%
自基金合同生效起至2022年6月30日	15.63%	0.08%	9.71%	0.04%	5.92%	0.04%

(1) 本基金由“长安鑫垚主题轮动混合型证券投资基金”转型而来,基金合同于2019年5月10日生效,上表报告期间的起始日为2019年5月10日。截止本报告期末本基金合同生效已满一年。

(2) 本基金业绩比较基准为:中债总财富(1-3年)指数收益率×80%+一年期定期存款利率(税后)×20%。

长安泓沅中短债C

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2019年5月10日-2019年12月31日	7.00%	0.15%	2.42%	0.02%	4.58%	0.13%
2020年度	1.15%	0.07%	2.37%	0.06%	-1.22%	0.01%

2021 年度	4.30%	0.03%	3.26%	0.02%	1.04%	0.01%
2022 年 1 月 1 日-2022 年 6 月 30 日	1.94%	0.03%	1.33%	0.03%	0.61%	0.00%
自基金合同生效起至 2022 年 6 月 30 日	15.08%	0.08%	9.71%	0.04%	5.37%	0.04%

（1）本基金由“长安鑫垚主题轮动混合型证券投资基金”转型而来，基金合同于2019年5月10日生效，上表报告期间的起始日为2019年5月10日。截止本报告期末本基金合同生效已满一年。

（2）本基金业绩比较基准为：中债总财富（1-3年）指数收益率×80%+一年期定期存款利率（税后）×20%。

#### 长安泓沣中短债E

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2021 年 12 月 20 日-2021 年 12 月 31 日	0.14%	0.01%	0.19%	0.02%	-0.05%	-0.01%
2022 年 1 月 1 日-2022 年 6 月 30 日	1.95%	0.03%	1.33%	0.03%	0.62%	0.00%
自基金合同生效起至 2022 年 6 月 30 日	2.09%	0.03%	1.52%	0.03%	0.57%	0.00%

（1）本基金由“长安鑫垚主题轮动混合型证券投资基金”转型而来，基金合同于2019年5月10日生效，截止本报告期末本基金运作时间已满一年。

（2）长安泓沣中短债债券型证券投资基金于2021年12月17日公告新增E类份额，实际首笔E类份额申购申请于2021年12月20日确认，上表报告期间的起始日为2021年12月20日。

（3）本基金业绩比较基准为：中债总财富（1-3年）指数收益率×80%+一年期定期存款利率（税后）×20%。

## 2、自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

长安泓沅中短债债券A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2019年05月10日-2022年06月30日)



(1) 本基金由“长安鑫垚主题轮动混合型证券投资基金”转型而来，基金合同于2019年5月10日生效，截止本报告期末本基金运作时间已满一年。

(2) 根据基金合同的规定，自基金合同生效日起6个月内基金各项资产配置比例需符合基金合同要求。本基金在建仓期结束后，各项资产配置比例已符合基金合同有关投资比例的约定。图示日期为2019年05月10日至2022年06月30日。

长安泓沅中短债债券C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2019年05月10日-2022年06月30日)



(1) 本基金由“长安鑫垚主题轮动混合型证券投资基金”转型而来，基金合同于2019年5

月10日生效，截止本报告期末本基金运作时间已满一年。

（2）根据基金合同的规定，自基金合同生效日起6个月内基金各项资产配置比例需符合基金合同要求。本基金在建仓期结束后，各项资产配置比例已符合基金合同有关投资比例的约定。图示日期为2019年05月10日至2022年06月30日。



（1）本基金由“长安鑫垚主题轮动混合型证券投资基金”转型而来，基金合同于2019年05月10日生效，截止本报告期末本基金运作时间已满一年。

（2）长安泓沣中短债债券型证券投资基金于2021年12月17日公告新增E类份额，实际首笔E类份额申购申请于2021年12月20日确认，图示日期为2021年12月20日至2022年6月30日。

## 第十一部分 基金的财产

### 一、基金资产总值

基金资产总值是指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息和基金应收款项以及其他资产的价值总和。

### 二、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

### 三、基金财产的账户

基金托管人根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立资金账户、证券账户以及投资所需的其他专用账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

### 四、基金财产的保管和处分

本基金财产独立于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人、基金登记机构和基金销售机构以其自有的财产承担其自身的法律责任，其债权人不得对本基金财产行使请求冻结、扣押或其他权利。除依法律法规和《基金合同》的规定处分外，基金财产不得被处分。

基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算财产。基金管理人管理运作基金财产所产生的债权，不得与其固有资产产生的债务相互抵销；基金管理人管理运作不同基金的基金财产所产生的债权债务不得相互抵销。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

## 第十二部分 基金资产的估值

### 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

基金所拥有的债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

### 三、估值原则

基金管理人在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，应符合《企业会计准则》、监管部门有关规定。

1、对存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种，在估值日有报价的，除会计准则规定的例外情况外，应将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量。估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种形同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

2、对不存在活跃市场的投资品种，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

3、如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上的，应对估值进行调整并确定公允价值。

### 四、估值方法

#### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

（1）交易所上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值，具体估值机构由基金管理人与基金托管人另行协

商约定；

（2）交易所上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价进行估值；

（3）交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所市场挂牌转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值；

（4）对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为估值日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表估值日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整以确认估值日的公允价值；对于不存在活跃市场或市场活动很少的情况下，应采用估值技术确定其公允价值。

2、首次公开发行未上市的债券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

3、对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对于含投资人回售权的固定收益品种，回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异，未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，按成本估值。

4、同一证券同时在两个或两个以上市场交易的，按证券所处的市场分别估值。

5、同业存单，按估值日第三方估值机构提供的估值净价估值；选定的第三方估值机构未提供估值价格的，按成本估值。

6、当发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。

7、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

8、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基



金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意見，按照基金管理人对基金净值的计算结果对外予以公布。

## 五、估值程序

1、各类基金份额净值是按照每个工作日闭市后，该类基金份额的基金资产净值除以当日该类基金份额的余额数量计算，精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入。基金管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人应于每个估值日计算基金资产净值及各类基金份额的基金份额净值，并按规定公告。

2、基金管理人应每个估值日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个估值日对基金资产估值后，将各类基金份额的基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人按约定对外公布。

## 六、估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当任一类基金份额净值小数点后 4 位以内（含第 4 位）发生估值错误时，视为该类基金份额净值错误。

基金合同的当事人应按照以下约定处理：

### 1、估值错误类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或登记机构、或销售机构、或投资人自身的过错造成估值错误，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该估值错误遭受损失当事人（“受损方”）的直接损失按下述“估值错误处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

上述估值错误的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等。

### 2、估值错误处理原则

（1）估值错误已发生，但尚未给当事人造成损失时，估值错误责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正估值错误发生的费用由估值错误责任方承担；由于估值错误责任方未及时更正已产生的估值错误，给当事人造成损失的，由估值错误责任方对直接损失承担赔偿责任；若估值错误责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则其应当承担相应赔偿责任。估值错误责任方应对更正的情况向有关当事人进行确

认，确保估值错误已得到更正。

（2）估值错误的责任方对有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对估值错误的有关直接当事人负责，不对第三方负责。

（3）因估值错误而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但估值错误责任方仍应对估值错误负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失（“受损方”），则估值错误责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给估值错误责任方。

（4）估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

（5）按法律法规规定的其他原则处理估值错误。

### 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

（1）查明估值错误发生的原因，列明所有的当事人，并根据估值错误发生的原因确定估值错误的责任方；

（2）根据估值错误处理原则或当事人协商的方法对因估值错误造成的损失进行评估；

（3）根据估值错误处理原则或当事人协商的方法由估值错误的责任方进行更正和赔偿损失；

（4）根据估值错误处理的方法，需要修改基金登记机构交易数据的，由基金登记机构进行更正，并就估值错误的更正向有关当事人进行确认。

### 4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

（1）基金份额净值计算出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

（2）错误偏差达到该类基金份额净值的 0.25%时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到该类基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当公告，并报中国证监会备案。

（3）当基金份额净值计算差错给基金和基金份额持有人造成损失需要进行赔偿时，基金管理人和基金托管人应根据实际情况界定双方承担的责任，经确认后按以下条款进行赔偿：

1) 本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，与本基金有关的会计问题，如经双方

在平等基础上充分讨论后，尚不能达成一致时，按基金管理人的建议执行，由此给基金份额持有人和基金财产造成的直接损失，由基金管理人负责赔付。

2) 若基金管理人计算的基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告，而且基金托管人未对计算过程提出疑义或要求基金管理人书面说明的，在基金份额净值出错且造成投资者直接损失的，应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金，就实际向投资者或基金支付的赔偿金额，基金管理人与基金托管人按照过错程度各自承担相应的责任。

3) 如基金管理人和基金托管人对基金份额净值的计算结果，虽然多次重新计算和核对或对基金管理人采用的估值方法，尚不能达成一致时，为避免不能按时公布基金份额净值的情形，以基金管理人的计算结果对外公布，由此给基金份额持有人和基金造成的直接损失，由基金管理人负责赔付。

4) 由于基金管理人提供的信息错误（包括但不限于基金申购或赎回金额等），进而导致基金份额净值计算错误而引起的基金份额持有人和基金财产的损失，由基金管理人负责赔付。

(4) 基金管理人和基金托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差，以基金管理人计算结果为准。

(5) 前述内容如法律法规或监管机构另有规定的，从其规定处理。如果行业另有通行做法，基金管理人和基金托管人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则进行协商。

## 七、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；
- 2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；
- 3、当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上的，基金管理人经与基金托管人协商一致；
- 4、法律法规规定、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

## 八、基金净值的确认

用于基金信息披露的基金资产净值和各类基金份额的基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金资产净值和各类基金份额的基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对基金净值按约定予以公布。

## 九、特殊情况的处理

- 1、基金管理人或基金托管人按上述“三、估值方法”的第 7 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、由于不可抗力原因，或由于证券交易所、登记结算公司等发送的数据错误等原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

#### **十、实施侧袋机制期间的基金资产估值**

本基金实施侧袋机制的，应根据本部分的约定对主袋账户资产进行估值并按规定披露主袋账户的基金净值信息，暂停披露侧袋账户的份额净值。

## 第十三部分 基金的收益与分配

### 一、基金利润的构成

基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额，基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

### 二、基金可供分配利润

基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

### 三、基金收益分配原则

1、由于基金费用的不同，不同类别的基金份额在收益分配数额方面可能有所不同，基金管理人可对各类基金份额分别制定收益分配方案，同一类别内的每一基金份额享有同等分配权；

2、在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，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，基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若基金份额持有人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。若基金份额持有人选择红利再投资方式进行收益分配，收益的计算以权益登记日当日收市后计算的各类基金份额净值为基准转为相应类别的基金份额进行再投资，红利再投资形式的基金份额保留到小数点后第2位，小数点2位以后的部分舍去，由此产生的收益由基金财产享有；

4、基金收益分配后各类基金份额净值均不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

5、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

在符合法律法规及基金合同约定并对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人在履行适当程序后，可对基金收益分配原则和支付方式进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

### 四、收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

### 五、收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，在 2 日内在指定媒介公告。

#### **六、基金收益分配中发生的费用**

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为相应类别的基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。

#### **七、实施侧袋机制期间的收益分配**

本基金实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配，详见本招募说明书“侧袋机制”部分的约定。

## 第十四部分 基金的费用与税收

### 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、C类、E类基金份额的销售服务费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、基金的账户开户费用、账户维护费用；
- 10、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0.40%年费率计提。基金管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人与基金托管人核对一致后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前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、公休假等，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0.10%的年费率计提。基金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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人与基金托管人核

对一致后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前3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。

### 3、C类、E类基金份额的销售服务费

基金销售服务费可用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类、E类基金份额销售服务费年费率均为0.15%，按前一日C类或E类基金份额的基金资产净值的0.15%年费率计提。销售服务费计算方法如下：

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

H为每日该类基金份额应计提的销售服务费

E为前一日该类基金份额基金资产净值

销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人与基金托管人核对一致后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前3个工作日内从基金财产中支付给登记机构，再由登记机构分别支付给各个销售机构。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4—10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、实施侧袋机制期间的基金费用

本基金实施侧袋机制的，与侧袋账户有关的费用可以从侧袋账户中列支，但应待侧袋账户资产变现后方可列支，有关费用可酌情收取或减免，但不得收取管理费，详见本招募说明书“侧袋机制”部分的约定或相关公告。

### 五、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。

## 第十五部分 基金的会计与审计

### 一、基金会计政策

- 1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；
- 2、基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日；如果《基金合同》生效少于2个月，可以并入下一个会计年度披露；
- 3、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；
- 4、会计制度执行国家有关会计制度；
- 5、本基金独立建账、独立核算；
- 6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；
- 7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

### 二、基金的年度审计

- 1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。
- 2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意。
- 3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。更换会计师事务所需在2日内在指定媒介公告。

## 第十六部分 基金的信息披露

一、本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《流动性风险管理规定》、《基金合同》及其他有关规定。相关法律法规关于信息披露的规定发生变化时，本基金从其最新规定。

### 二、信息披露义务人

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律、行政法规和中国证监会规定的自然人、法人和非法人组织。

本基金信息披露义务人应当以保护基金份额持有人利益为根本出发点，按照法律、行政法规和中国证监会的规定披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性、完整性、及时性、简明性和易得性。

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的全国性报刊（以下简称“指定报刊”）及指定互联网网站（以下简称“指定网站”）等媒介披露，并保证基金投资者能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

### 三、本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

- 1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；
- 2、对证券投资业绩进行预测；
- 3、违规承诺收益或者承担损失；
- 4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金销售机构；
- 5、登载任何自然人、法人和非法人组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；
- 6、法律法规和中国证监会规定禁止的其他行为。

四、本基金公开披露的信息应采用中文文本。同时采用外文文本的，基金信息披露义务人应保证不同文本的内容一致。不同文本之间发生歧义的，以中文文本为准。

本基金公开披露的基金信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

### 五、公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

（一）基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议、基金产品资料概要

1、《基金合同》是界定基金合同当事人的各项权利、义务关系，明确基金份额持有人大会召开的规则及具体程序，说明基金产品的特性等涉及基金投资者重大利益的事项的法律文

件。

2、基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。《基金合同》生效后，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书并登载在指定网站上；基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书。

3、基金托管协议是界定基金托管人和基金管理人在基金财产保管及基金运作监督等活动中的权利、义务关系的法律文件。

4、基金产品资料概要是基金招募说明书的摘要文件，用于向投资者提供简明的基金概要信息。《基金合同》生效后，基金产品资料概要的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金产品资料概要，并登载在指定网站及基金销售机构网站或营业网点；基金产品资料概要其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金产品资料概要。

## （二）基金净值信息

《基金合同》生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和各类基金份额的基金份额净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在不晚于每个工作日的次日，通过指定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露该工作日各类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在指定网站披露半年度和年度最后一日各类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值。

## （三）基金份额申购、赎回价格

基金管理人应当在《基金合同》、招募说明书等信息披露文件上载明基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资者能够在基金销售机构网站或营业网点查阅或者复制前述信息资料。

## （四）基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告

基金管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成基金年度报告，将年度报告登载在指定网站上，并将年度报告提示性公告登载在指定报刊上。基金年度报告的财务会计报告应当经过具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计。

基金管理人应当在上半年结束之日起两个月内，编制完成基金中期报告，将中期报告登

载在指定网站上，并将中期报告提示性公告登载在指定报刊上。

基金管理人应当在季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，将季度报告登载在指定网站上，并将季度报告提示性公告登载在指定报刊上。

基金管理人应当在基金年度报告和中期报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。

如报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额 20% 的情形，为保障其他投资者的权益，基金管理人至少应当在定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有基金份额及占比、报告期内持有基金份额变化情况及本基金的特定风险，中国证监会认定的特殊情形除外。

《基金合同》生效不足 2 个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、中期报告或者年度报告。

#### （五）临时报告

本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，并登载在指定报刊和指定网站上。

前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件：

- 1、基金份额持有人大会的召开及决定的事项；
- 2、基金合同终止、基金清算；
- 3、转换基金运作方式、基金合并；
- 4、更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所；
- 5、基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；
- 6、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- 7、基金管理公司变更持有百分之五以上股权的股东、变更公司的实际控制人；
- 8、基金管理人高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；
- 9、基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十，基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十；
- 10、涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或仲裁；
- 11、基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处

罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；

12、基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有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，或者从事其他重大关联交易事项，但中国证监会另有规定的情形除外；

13、基金收益分配事项；

14、管理费、托管费、销售服务费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；

15、任一类基金份额净值估值错误达该类基金份额净值百分之零点五；

16、本基金开始办理申购、赎回；

17、本基金发生巨额赎回并延期办理；

18、本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；

19、本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；

20、本基金推出新业务或服务；

21、调整基金份额类别设置；

22、发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；

23、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；

24、基金信息披露义务人认为可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的其他事项；

25、中国证监会规定和《基金合同》约定的其他事项。

#### （六）澄清公告

在《基金合同》存续期限内，任何公共媒介中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动，以及可能损害基金份额持有人权益的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告中国证监会。

#### （七）清算报告

基金合同终止的，基金管理人应当依法组织基金财产清算小组对基金财产进行清算并作出清算报告。清算报告应当经过具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计，并由律师事务所出具法律意见书。基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

（八）基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。

（九）投资资产支持证券的相关公告

基金管理人应在基金年度报告及中期报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期内所有的资产支持证券明细。

基金管理人应在基金季度报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期末按市值占基金净资产比例大小排序的前 10 名资产支持证券明细。

（十）实施侧袋机制期间的信息披露

本基金实施侧袋机制的，相关信息披露义务人应当根据法律法规、基金合同和招募说明书的规定进行信息披露，详见本招募说明书“侧袋机制”部分的约定或相关公告。

（十一）中国证监会规定的其他信息。

## 六、信息披露事务管理

基金管理人、基金托管人应当建立健全信息披露管理制度，指定专门部门及高级管理人员负责管理信息披露事务。

基金信息披露义务人公开披露基金信息，应当符合中国证监会相关基金信息披露内容与格式准则等法规的规定。

基金托管人应当按照相关法律、行政法规、中国证监会的规定和《基金合同》的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、各类基金份额的基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告、更新的招募说明书、基金产品资料概要、基金清算报告等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人进行书面或电子确认。

基金管理人、基金托管人应当在指定报刊中选择一家报刊披露本基金信息。基金管理人、基金托管人应当向中国证监会基金电子披露网站报送拟披露的基金信息，并保证相关报送信息的真实、准确、完整、及时。

基金管理人、基金托管人除依法在指定媒介上披露信息外，还可以根据需要在其他公共媒介披露信息，但是其他公共媒介不得早于指定媒介披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

为基金信息披露义务人公开披露的基金信息出具审计报告、法律意见书的专业机构，应当制作工作底稿，并将相关档案至少保存到《基金合同》终止后十年。

## 七、信息披露文件的存放与查阅

依法必须披露的信息发布后，基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于公司办公场所，供社会公众查阅、复制。

#### **八、暂停或延迟信息披露的情形**

当出现下述情况时，基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露基金相关信息：

- 1、不可抗力；
- 2、发生暂停估值的情形；
- 3、法律法规、基金合同或中国证监会规定的情况。



## 第十七部分 侧袋机制

### 一、侧袋机制的实施条件、实施程序和特定资产范围

当基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，根据最大限度保护基金份额持有人利益的原则，基金管理人经与基金托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制，无需召开基金份额持有人大会。基金管理人应当在启用侧袋机制当日报中国证监会及公司所在地中国证监会派出机构备案。

特定资产包括：（1）无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性的资产；（2）按摊余成本计量且计提资产减值准备仍导致资产价值存在重大不确定性的资产；（3）其他资产价值存在重大不确定性的资产。

### 二、侧袋机制实施期间的基金运作安排

#### （一）基金份额的申购与赎回

##### 1、侧袋账户

侧袋机制实施期间，基金管理人不得办理侧袋账户的申购、赎回和转换等相关业务。基金份额持有人申请申购、赎回或转换侧袋账户基金份额的，该申购、赎回或转换申请将被拒绝。

##### 2、主袋账户

基金管理人将依法保障主袋账户份额持有人享有基金合同约定的赎回权利，并根据主袋账户运作情况合理确定申购事项，具体事项届时将由基金管理人在相关公告中规定。

本招募说明书“基金份额的申购与赎回”部分的申购、赎回约定适用于主袋账户份额。巨额赎回按照单个开放日内主袋账户份额净赎回申请超过前一开放日主袋账户总份额的10%认定。

3、当特定资产占前一估值日基金资产净值50%以上的，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停基金估值，并暂停接受基金申购、赎回申请或延缓支付赎回款项。

对于启用侧袋机制当日收到的赎回申请，基金管理人仅办理主袋账户的赎回申请并支付赎回款项。在启用侧袋机制当日收到的申购申请，视为投资者对侧袋机制启用后的主袋账户提交的申购申请。

#### （二）基金份额的登记

侧袋机制实施期间，基金管理人应对侧袋账户份额实行独立管理，主袋账户沿用原基金代码，侧袋账户使用独立的基金代码。侧袋账户份额的名称以“基金简称+侧袋标识S+侧袋账户建立日期”格式设定，同时主袋账户份额的名称增加大写字母M标识作为后缀。基金

所有侧袋账户注销后，将取消主袋账户份额名称中的 M 标识。

启用侧袋机制当日，基金管理人和基金登记机构应以基金份额持有人的原有账户份额为基础，确认相应侧袋账户持有人名册和份额。

侧袋账户资产完全清算后，基金管理人将注销侧袋账户。

### （三）基金的投资及业绩

侧袋机制实施期间，本基金的各项投资运作指标和基金业绩指标应当以主袋账户资产为基准。基金管理人不得在侧袋账户中进行除特定资产处置变现以外的其他投资操作。

基金管理人、相关服务机构在展示基金业绩时，应当就前述情况进行充分的解释说明，避免引起投资者误解。

基金管理人原则上应当在侧袋机制启用后 20 个交易日内完成对主袋账户投资组合的调整，但因资产流动性受限等中国证监会规定的情形除外。

### （四）基金的估值

侧袋机制启用当日，基金管理人以完成日终估值后的基金净资产为基数对主袋账户和侧袋账户的资产进行分割，与特定资产可明确对应的资产类科目余额、除应交税费外的负债类科目余额一并纳入侧袋账户。基金管理人应将特定资产作为一个整体，不能仅分割其公允价值无法确定的部分。

侧袋机制实施期间，基金管理人将对侧袋账户单独设置账套，实行独立核算。如果本基金同时存在多个侧袋账户，不同侧袋账户分开进行核算。侧袋账户的会计核算应符合《企业会计准则》的相关要求。

### （五）基金的费用

本基金实施侧袋机制的，与侧袋账户有关的费用可以从侧袋账户中列支，但应待侧袋账户资产变现后方可列支，有关费用可酌情收取或减免，但不得收取管理费，其他费用详见届时发布的相关公告。

主袋账户的基金管理费、基金托管费和销售服务费等费用按主袋账户基金资产净值作为基数计提。

### （六）基金的收益分配

侧袋机制实施期间，在主袋账户份额满足基金合同收益分配条件的情形下，基金管理人可对主袋账户份额进行收益分配。侧袋账户不进行收益分配。

### （七）基金的信息披露

#### 1、基金净值信息

侧袋机制实施期间，基金管理人应按照招募说明书“基金的信息披露”部分规定的基金净值信息披露方式和频率披露主袋账户份额的基金份额净值和基金份额累计净值；应暂停披露侧袋账户的基金份额净值和基金份额累计净值。

## 2、定期报告

侧袋机制实施期间，基金定期报告中的基金会计报表仅需针对主袋账户进行编制。侧袋账户相关信息在定期报告中单独进行披露，包括但不限于：

- （1）侧袋账户的基金代码、基金名称、侧袋账户成立日期等基本信息；
- （2）侧袋账户的初始资产、初始负债；
- （3）特定资产的名称、代码、发行人等基本信息；
- （4）报告期内的特定资产处置进展情况、与处置特定资产相关的费用情况及其他与特定资产状况相关的信息；
- （5）可根据特定资产处置进展情况披露特定资产的可变现净值或净值参考区间，该净值或净值区间并不代表特定资产最终的变现价格，不作为基金管理人对特定资产最终变现价格的承诺；
- （6）可能对投资者利益存在重大影响的其他情况及相关风险提示。

## 3、临时报告

基金管理人在启用侧袋机制、处置特定资产、终止侧袋机制以及发生其他可能对投资者利益产生重大影响的事项后，应及时发布临时公告。

启用侧袋机制的临时公告内容应当包括启用原因及程序、特定资产流动性和估值情况、对投资者申购赎回的影响、风险提示等重要信息。

处置特定资产的临时公告内容应当包括特定资产处置价格和时间、向侧袋账户份额持有人支付的款项、相关费用发生情况等重要信息。侧袋机制实施期间，若侧袋账户资产无法一次性完成处置变现，基金管理人在每次处置变现后均应按规定及时发布临时公告。

### （八）特定资产处置清算

特定资产恢复流动性后，基金管理人应当按照基金份额持有人利益最大化原则，采取将特定资产予以处置变现等方式，及时向侧袋账户份额持有人支付对应款项。无论侧袋账户资产是否全部完成变现，基金管理人都应及时向侧袋账户份额持有人支付已变现部分对应的款项。

### （九）侧袋的审计

基金管理人应当在启用侧袋机制和终止侧袋机制后，及时聘请符合《证券法》规定的会

计师事务所进行审计并披露专项审计意见，具体如下：

基金管理人应当在启用侧袋机制时，就特定资产认定的相关事宜取得符合《证券法》规定的会计师事务所的专业意见。

基金管理人应当在启用侧袋机制后五个工作日内，聘请于侧袋机制启用日发表意见的会计师事务所针对侧袋机制启用日本基金持有的特定资产情况出具专项审计意见，内容应包含侧袋账户的初始资产、份额、净资产等信息。

会计师事务所对基金年度报告进行审计时，应对报告期间基金侧袋机制运行相关的会计核算和年报披露，执行适当程序并发表审计意见。

当侧袋账户资产全部完成变现后，基金管理人应参照基金清算报告的相关要求，聘请符合《证券法》规定的会计师事务所对侧袋账户进行审计并披露专项审计意见。

**三、本部分关于侧袋机制的相关规定，凡是直接引用法律法规或监管规则的部分，如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人经与基金托管人协商一致并履行适当程序后，在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。**

## 第十八部分 风险揭示

### 一、市场风险

本基金为证券投资基金，证券市场的变化将影响到基金的业绩。因此，宏观和微观经济因素、国家政策、市场变动、行业的变化、投资人风险收益偏好和市场流动程度等影响证券市场的各种因素将影响到本基金业绩，从而产生市场风险，这种风险主要包括：

#### 1、经济周期风险

随着经济运行的周期性变化，国家经济、微观经济、行业及发债主体的盈利水平也可能呈周期性变化，从而影响到证券市场及行业的走势。

#### 2、政策风险

因国家的各项政策，如财政政策、货币政策、产业政策、区域发展政策等发生变化，导致证券市场波动而影响基金投资收益，产生风险。

#### 3、利率风险

利率的波动会导致证券价格和收益率的波动；同时，利率直接影响着债券的价格和收益率，从而影响着企业的融资成本和利润。本基金投资于债券，其收益水平可能会受到利率变化的影响。

#### 4、杠杆风险

本基金可以通过债券回购放大杠杆，进行杠杆操作将会放大组合收益波动，对组合业绩稳定性有较大影响，同时杠杆成本波动也会影响组合收益率水平，在市场下行或杠杆成本异常上升时，有可能导致基金财产收益的超预期下降风险。

#### 5、再投资风险

再投资获得的收益又被称为利息的利息，这一收益取决于再投资时的市场利率水平和再投资的策略。未来市场利率的变化可能会引起再投资收益的不确定性并可能影响到基金投资策略的顺利实施。

#### 6、购买力风险

如果发生通货膨胀，基金投资于证券所获得的收益可能会被通货膨胀抵消，从而影响基金资产的保值增值。

#### 7、证券发行人经营风险

证券发行人的经营状况受多种因素的影响，如经营决策、技术变革、新产品研发、竞争加剧等风险。如果基金所投资的证券发行人基本面或发展前景产生变化，可能导致其所发行

的证券价格下跌，或者可分配利润降低，使基金预期收益产生波动。虽然基金可以通过分散化投资来减少这种非系统性风险，但不能完全规避。

## 二、信用风险

信用风险是指发行人是否能够实现发行时的承诺，按时足额还本付息的风险，或者交易对手未能按时履约的风险。包括：

1、债务人违约风险：本基金主要投资于债券市场，如遇发债主体信用状况恶化，信用评级下降，会导致债券价格下降进而影响基金财产收益水平。严重的，甚至出现到期不能履行合约进行兑付，将给本基金带来损失。

2、交易对手方违约风险：当固定收益证券交易对手违约时，将直接导致基金资产的损失，或导致本基金不能及时抓住市场机会，对投资收益产生影响。

## 三、操作风险

操作风险是指基金运作过程中，因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致的风险，例如，越权违规交易、会计部门欺诈、交易错误、IT 系统故障等风险。

## 四、流动性风险

流动性风险是指因证券市场交易量不足，导致证券不能迅速、低成本地变现的风险。流动性风险还包括基金出现巨额赎回，致使没有足够的现金应付赎回支付所引致的风险。

### 1、基金申购、赎回安排

本基金申购、赎回安排的具体规则请参见本基金基金合同“第六部分 基金份额的申购与赎回”和本招募说明书“第八部分 基金份额的申购与赎回”。

### 2、拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估

本基金的投资市场主要为证券交易所、全国银行间债券市场等流动性较好的规范型交易场所，主要投资对象为具有良好流动性的金融工具（包括债券和货币市场工具等）。本基金基于分散投资的原则在行业和个券方面未有高集中度的特征，综合评估在正常市场环境下本基金的流动性风险适中。

### 3、巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

基金出现巨额赎回情形下，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况或巨额赎回份额占比情况决定全额赎回或部分延期赎回。同时，当基金出现巨额赎回时，如本基金单个基金份额持有人在单个开放日申请赎回基金份额超过基金总份额一定比例以上的部分，基金管理人可以对其实施延期赎回。

#### 4、实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响

在市场大幅波动、流动性枯竭等极端情况下发生无法应对投资者巨额赎回的情形时，基金管理人将以保障投资者合法权益为前提，严格按照法律法规及基金合同的规定，谨慎选取延期办理巨额赎回申请、暂停接受赎回申请、延缓支付赎回款项、收取短期赎回费、摆动定价、暂停基金估值、实施侧袋机制等流动性风险管理工具作为辅助措施。

对于各类流动性风险管理工具的使用，基金管理人将依照严格审批、审慎决策的原则，及时有效地对风险进行监测和评估，使用前经过内部审批程序并与基金托管人协商一致。

在实际运用各类流动性风险管理工具时，可能导致投资人的赎回申请无法得到及时确认、赎回款项无法得到及时支付等情形，基金管理人将严格依照法律法规及基金合同的约定进行操作，全面保障投资者的合法权益。

#### 5、实施侧袋机制对投资者的影响

侧袋机制的相关约定见本招募说明书“第十七部分 侧袋机制”。

侧袋机制是一种流动性风险管理工具，是将特定资产分离至专门的侧袋账户进行处置清算，并以处置变现后的款项向基金份额持有人进行支付，目的在于有效隔离并化解风险，但基金启用侧袋机制后，侧袋账户份额将停止披露份额净值，并不得办理申购、赎回和转换，仅主袋账户份额正常开放赎回，因此启用侧袋机制时持有基金份额的持有人将在启用侧袋机制后同时拥有主袋账户份额和侧袋账户份额，侧袋账户份额不能赎回，其对应特定资产的变现时间和最终变现价格都具有不确定性，最终变现价格有可能大幅低于启用侧袋机制时的特定资产的估值，基金份额持有人可能面临损失。

对于启用侧袋机制当日收到的赎回申请，基金管理人仅办理主袋账户的赎回申请并支付赎回款项，当日收到的申购申请，视为投资者对侧袋机制启用后的主袋账户提交的申购申请办理，可能与投资者的预期存在差异，从而影响投资者的投资和资金安排。

实施侧袋机制期间，基金管理人计算各项投资运作指标和基金业绩指标时以主袋账户资产为基准，不反映侧袋账户特定资产的真实价值及变化情况。本基金不披露侧袋账户的份额净值，即便基金管理人在基金定期报告中披露报告期末特定资产可变现净值或净值区间的，也不作为特定资产最终变现价格的承诺，对于特定资产的公允价值和最终变现价格，基金管理人不承担任何保证和承诺的责任。

基金管理人将根据主袋账户运作情况合理确定申购政策，因此实施侧袋机制后主袋账户份额存在暂停申购的可能。

启用侧袋机制后，基金管理人计算各项投资运作指标和基金业绩指标时仅需考虑主袋账

户资产，基金业绩指标应当以主袋账户资产为基准，因此本基金披露的业绩指标不能反映侧袋账户特定资产的真实价值及变化情况。

## 五、管理风险

本基金可能因为基金管理人的管理水平、手段和技术等因素，而影响基金收益水平。这种风险可能表现在基金整体的投资组合管理上，例如资产配置、类属配置不能达到预期收益目标；也可能表现在个券个股的选择不能符合本基金的投资风格和投资目标等。

## 六、估值风险

本基金采用的估值方法有可能不能充分反映和揭示利率风险，或经济环境发生重大变化时，在一定时期内可能高估或低估基金资产净值。基金管理人和基金托管人将共同协商，参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，使调整后的基金资产净值更公允地反映基金资产价值。

## 七、合规风险

合规风险指基金管理或运作过程中，违反国家法律、法规的规定，或者违反《基金合同》有关规定的风险。

## 八、本基金的特定风险

本基金的投资范围包括资产支持证券，资产支持证券是一种债券性质的金融工具，风险主要包括资产风险及证券化风险。资产风险来源于资产本身，包括价格波动风险、流动性风险等；证券化风险主要包括信用评级风险、法律风险等。

## 九、其他风险

### 1、技术风险

当计算机、通讯系统、交易网络等技术保障系统或信息网络支持出现异常情况，可能导致基金日常的申购赎回无法按正常时限完成、注册登记系统瘫痪、核算系统无法按正常时限显示产生净值、基金的投资交易指令无法及时传输等风险。

### 2、大额申购/赎回风险

本基金是开放式基金，基金规模将随着投资人对基金的申购与赎回而不断变化，若是由于投资人的连续大量申购而导致基金管理人在短期内被迫持有大量现金；或由于投资人的连续大量赎回而导致基金管理人被迫抛售所持有的证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响。

### 3、申购申请全部或部分确认失败的风险

如基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例



达到或超过 50%，或者变相规避 50%集中度的情形，基金管理人有权拒绝该等全部或部分申购申请。

#### 4、延期或暂停赎回风险

因为市场剧烈波动或其他原因而连续出现巨额赎回，并导致基金管理人的现金支付出现困难，基金份额持有人在赎回基金份额时可能会遇到部分延期赎回或暂停赎回等风险。

#### 5、不可抗力风险

战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金资产有遭受损失的风险，以及证券市场、基金管理人及基金销售机构可能因不可抗力无法正常工作，从而产生影响基金的申购和赎回按正常时限完成的风险。

## 第十九部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### 一、《基金合同》的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于法律法规规定和基金合同约定可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议生效后2个工作日内在指定媒介公告。

### 二、《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《基金合同》应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在6个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- 3、《基金合同》约定的其他情形；
- 4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

### 三、基金财产的清算

1、基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起30个工作日内成立基金财产清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金财产清算。

2、在基金财产清算小组接管基金之前，基金管理人和基金托管人应按照《基金合同》和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

3、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

4、基金财产清算小组职责：基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

#### 5、基金财产清算程序：

- (1) 基金财产清算小组成立后，由基金财产清算小组统一接管基金；
- (2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认；

- (3) 对基金财产进行估值和变现；
  - (4) 制作清算报告；
  - (5) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
  - (6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；
  - (7) 对基金剩余财产进行分配。
- 6、基金财产清算的期限为 6 个月，但因本基金所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的，清算期限相应顺延。

#### **四、清算费用**

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金剩余财产中支付。

#### **五、基金财产清算剩余资产的分配**

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按各类基金份额持有人持有的该类基金份额比例进行分配。

#### **六、基金财产清算的公告**

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

#### **七、基金财产清算账册及文件的保存**

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上，法律法规另有规定的从其规定。

## 第二十部分 基金合同的内容摘要

### 一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

#### （一）基金份额持有人的权利与义务

基金投资者持有本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受，基金投资者自依据《基金合同》取得基金份额，即成为本基金份额持有人和《基金合同》的当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为《基金合同》当事人并不以在《基金合同》上书面签章或签字为必要条件。

除法律法规另有规定或基金合同另有约定外，同一类别每份基金份额具有同等的合法权益。

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：

- （1）分享基金财产收益；
- （2）参与分配清算后的剩余基金财产；
- （3）依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；
- （4）按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集基金份额持有人大会；
- （5）出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- （6）查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- （7）监督基金管理人的投资运作；
- （8）对基金管理人、基金托管人、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；
- （9）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：

- （1）认真阅读并遵守《基金合同》、招募说明书、基金产品资料概要等信息披露文件；
- （2）了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，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；
- （3）关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；
- （4）交纳基金申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；

- (5) 在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任；
- (6) 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；
- (7) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- (8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；
- (9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## （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：

- (1) 依法募集资金；
- (2) 自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；
- (3) 依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- (4) 销售基金份额；
- (5) 按照规定召集基金份额持有人大会；
- (6) 依据《基金合同》及有关法律、法规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- (7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- (8) 选择、更换为本基金提供销售、销售支付、份额登记、估值、投资顾问、法律、会计等服务的基金服务机构并决定相关费率，对基金服务机构的相关行为进行监督和处理；
- (9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；
- (10) 依据《基金合同》及有关法律、法规规定决定基金收益的分配方案；
- (11) 在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购、赎回与转换申请；
- (12) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使相关权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
- (13) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资；
- (14) 以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- (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；

（16）在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金申购、赎回、转换、定期定额投资和非交易过户等业务规则；

（17）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

（1）依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的申购、赎回和登记事宜；

（2）办理基金备案手续；

（3）自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；

（4）配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

（5）建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；

（6）除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

（7）依法接受基金托管人的监督；

（8）采取适当合理的措施使计算基金份额申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回的价格；

（9）进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

（10）编制基金季度报告、中期报告和年度报告；

（11）严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

（12）保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；

（13）按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；

（14）按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

（15）依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

（16）按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上；

（17）确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的前提下得到有关资料的复印件；

（18）组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

（19）面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

（20）因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

（21）监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

（22）当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；

（23）以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；

（24）执行生效的基金份额持有人大会的决议；

（25）建立并保存基金份额持有人名册；

（26）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

### （三）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：

（1）自《基金合同》生效之日起，依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产；

（2）依《基金合同》约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他费用；

（3）监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人违反《基金合同》及国家法律法规行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

（4）根据相关市场规则，为基金开设资金账户、证券账户等投资所需的其他账户，为基金办理证券交易资金清算；

- (5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；
  - (6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；
  - (7) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。
- 2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：
- (1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；
  - (2) 设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；
  - (3) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；
  - (4) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；
  - (5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；
  - (6) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户等投资所需的其他账户，按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
  - (7) 保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；
  - (8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、各类基金份额申购、赎回价格；
  - (9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
  - (10) 对基金财务会计报告、季度报告、中期报告和年度报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行；如果基金管理人未执行《基金合同》规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；
  - (11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；
  - (12) 从基金管理人或委托的登记机构处接受并保存基金份额持有人名册；
  - (13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
  - (14) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；
  - (15) 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，召集基金份额持有人大会或配合基金管理人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
  - (16) 按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；



- （17）参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- （18）面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行监管机构，并通知基金管理人；
- （19）因违反《基金合同》导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- （20）按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿；
- （21）执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- （22）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## 二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。除法律法规另有规定或基金合同另有约定外，基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

本基金基金份额持有人大会不设日常机构。

### （一）召开事由

1、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，但法律法规或中国证监会另有规定或基金合同另有约定的除外：

- （1）终止《基金合同》；
- （2）更换基金管理人；
- （3）更换基金托管人；
- （4）转换基金运作方式；
- （5）调整基金管理人、基金托管人的报酬标准或调高销售服务费；
- （6）变更基金类别；
- （7）本基金与其他基金的合并；
- （8）变更基金投资目标、范围或策略；
- （9）变更基金份额持有人大会程序；
- （10）基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
- （11）单独或合计持有本基金总份额 10% 以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；

(12) 对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

(13) 法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

2、在法律法规规定和《基金合同》约定的范围内且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

(1) 法律法规要求增加的基金费用的收取；

(2) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整基金份额类别设置或申购费率，或调低赎回费率、销售服务费率或变更收费方式，或对基金份额分类办法及规则进行调整；

(3) 因相应的法律法规、登记机构的相关业务规则发生变动而应当对《基金合同》进行修改；

(4) 对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生重大变化；

(5) 基金管理人、销售机构、登记机构在法律法规规定或中国证监会允许的范围内调整有关基金申购、赎回、转换、定期定额、非交易过户、转托管等业务的规则；

(6) 本基金推出新业务或服务；

(7) 按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

(二) 会议召集人及召集方式

1、除法律法规规定或《基金合同》另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。

3、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当由基金托管人自行召集，并自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

4、代表基金份额 10% 以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表

基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

5、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

6、基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

（三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1、召开基金份额持有人大会，召集人至少应于会议召开前 30 日，在指定媒介发布召开基金份额持有人大会的通知。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

- （1）会议召开的时间、地点和会议形式；
- （2）会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；
- （3）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；
- （4）授权委托证明的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；
- （5）会务常设联系人姓名及联系电话；
- （6）出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- （7）召集人需要通知的其他事项。

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、表决意见寄交的截止时间和收取方式。

3、如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。

（四）基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式或法律法规、监管机构允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托证明委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或基金托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

（1）亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符；

（2）经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，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二分之一（含二分之一）。若到会者在权益登记日代表的有效的基金份额少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内，就原定审议事项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到会者在权益登记日代表的有效的基金份额应不少于本基金在权益登记日基金总份额的三分之一（含三分之一）。

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式或大会公告载明的其他方式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式或大会公告载明的其他方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

（1）会议召集人按《基金合同》约定公布会议通知后，在2个工作日内连续公布相关提示性公告；

（2）召集人按基金合同约定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下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；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取表决意见的，不影响表决效力；

（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，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）；若本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内，就原定审议事项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）基金份额的持有人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见；

（4）上述第（3）项中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及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并与基金登记机构记录相符。

3、在法律法规和监管机构允许的情况下，本基金的基金份额持有人亦可采用其他非书面方式授权其代理人出席基金份额持有人大会，授权方式可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式，具体方式在会议通知中列明。

4、在会议召开方式上，本基金亦可采用其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合的方式召开基金份额持有人大会，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。基金份额持有人可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式进行表决，具体方式在会议通知中列明。

#### （五）议事内容与程序

##### 1、议事内容及提案权

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项，如《基金合同》的重大修改、决定终止《基金合同》、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、法律法规及《基金合同》规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开前及时公告。

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

##### 2、议事程序

###### （1）现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

会议召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名（或单位名称）、身份证明文件号码、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）和联系方式等事项。

## （2）通讯开会

在通讯开会的情况下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期后 2 个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。

## （六）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1、一般决议，一般决议须经参加大会的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）通过方为有效；除下列第 2 项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

2、特别决议，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）通过方可做出。除基金合同另有约定外，转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》、本基金与其他基金合并以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

## （七）计票

### 1、现场开会

（1）如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份

额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力。

（2）监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。

（3）如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有怀疑，可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点，重新清点以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。

（4）计票过程应由公证机关予以公证，基金管理人或基金托管人拒不出席大会的，不影响计票的效力。

## 2、通讯开会

在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

### （八）生效与公告

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

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决议自生效之日起2个工作日内在指定媒介上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决议。生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。

### （九）实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定

若本基金实施侧袋机制，则相关基金份额或表决权的比例指主袋份额持有人和侧袋份额持有人分别持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例，但若相关基金份额持有人大会召集和审议事项不涉及侧袋账户的，则仅指主袋份额持有人持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例：

1、基金份额持有人行使提议权、召集权、提名权所需单独或合计代表相关基金份额10%以上（含10%）；

2、现场开会的到会者在权益登记日代表的基金份额不少于本基金在权益登记日相关基

金份额的二分之一（含二分之一）；

3、通讯开会的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持有的基金份额不小于在权益登记日相关基金份额的二分之一（含二分之一）；

4、在参与基金份额持有人大会投票的基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日相关基金份额的二分之一、召集人在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内就原定审议事项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）相关基金份额的持有人参与或授权他人参与基金份额持有人大会投票；

5、现场开会由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的50%以上（含50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人；

6、一般决议须经参加大会的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；

7、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。

侧袋机制实施期间，基金份额持有人大会审议事项涉及主袋账户和侧袋账户的，应分别由主袋账户、侧袋账户的基金份额持有人进行表决，同一类别内的每份基金份额具有平等的表决权。表决事项未涉及侧袋账户的，侧袋账户份额无表决权。

侧袋机制实施期间，关于基金份额持有人大会的相关规定以本节特殊约定内容为准，本节未规定的适用上文相关约定。

（十）本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规的部分，如将来法律法规修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

### **三、基金合同的变更、终止与基金财产的清算方式**

#### **（一）《基金合同》的变更**

1、变更基金合同涉及法律法规规定或本基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于法律法规规定和基金合同约定可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行，自决议生效后2个工作日内在指定媒介公告。



（二）《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《基金合同》应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- 3、《基金合同》约定的其他情形；
- 4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

（三）基金财产的清算

1、基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起 30 个工作日内成立基金财产清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金财产清算。

2、在基金财产清算小组接管基金之前，基金管理人和基金托管人应按照《基金合同》和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

3、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

4、基金财产清算小组职责：基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

5、基金财产清算程序：

- （1）基金财产清算小组成立后，由基金财产清算小组统一接管基金；
- （2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- （3）对基金财产进行估值和变现；
- （4）制作清算报告；
- （5）聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- （6）将清算报告报中国证监会备案并公告；
- （7）对基金剩余财产进行分配。

6、基金财产清算的期限为 6 个月，但因本基金所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的，清算期限相应顺延。

（四）清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金剩余财产中支付。

#### （五）基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按各类基金份额持有人持有的该类基金份额比例进行分配。

#### （六）基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

#### （七）基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上，法律法规另有规定的从其规定。

### 四、争议解决方式

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，应提交上海国际经济贸易仲裁委员会（上海国际仲裁中心），根据该会届时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点在上海市，仲裁裁决是终局性的并对相关各方均有约束力。除非仲裁裁决另有规定，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，基金合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

《基金合同》适用中华人民共和国法律（为本基金合同之目的，在此不包括香港、澳门特别行政区和台湾地区法律）并从其解释。

### 五、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

《基金合同》可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、销售机构的办公场所和营业场所查阅。

## 第二十一部分 托管协议的内容摘要

### 一、基金托管协议当事人

#### 1、基金管理人

名称：长安基金管理有限公司

住所：上海市虹口区丰镇路 806 号 3 幢 371 室

法定代表人：崔晓健

成立时间：2011 年 9 月 5 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监许可（2011）1351 号

注册资本：2.7 亿元人民币

组织形式：有限责任公司

存续期间：持续经营

联系电话：021-20329688

#### 2、基金托管人

名称：上海浦东发展银行股份有限公司

住所：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：郑杨

成立日期：1992 年 10 月 19 日

基金托管业务资格批准机关：中国证监会

基金托管业务资格文号：证监基金字（2003）105 号

组织形式：股份有限公司（上市）

注册资本：293.52 亿元人民币

经营期限：持续经营

### 二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

#### （一）基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权

1.基金托管人根据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定，对下述基金投资范围、投资对象进行监督。

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（含国债、央行票据、地方政府债券、金融债券、企业债券、公司债券、短期融资券、超短期融资券、中期票据、次级债、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相关规定）。

本基金不投资于股票、权证等资产，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。

本基金不得投资于相关法律法规、部门规章及《基金合同》禁止投资的投资工具。

2.基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投融资比例进行监督：

（1）按法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金的投资资产配置比例为：

本基金的投资组合比例为：债券资产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%；持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例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、应收申购款等。其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

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、地方政府债券、金融债券、企业债券、公司债券、短期融资券、超短期融资券、中期票据、次级债、可分离交易可转债的纯债部分等金融工具。

如法律法规或中国证监会变更投资品种的比例限制的，基金管理人可依据相关规定履行适当程序后调整本基金的投资比例规定。

（2）根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金投资组合遵循以下投资限制：

1）本基金债券资产的投资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%；

2）本基金保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；

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%；

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 **BBB** 以上（含 **BBB**）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；

10) 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%；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；

11) 本基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

12) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%；因证券市场波动、证券停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合该比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

13) 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的投资范围保持一致；

14) 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。

基金托管人对上述指标的监督义务，仅限于监督由基金管理人管理且由基金托管人托管的全部公募基金是否符合上述比例限制。《基金法》及其他有关法律法规或监管部门取消或变更上述限制的，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，基金不受上述限制或按变更后的规定执行。

除投资资产配置外，基金托管人对基金投资的监督和检查自本托管协议生效之日起开始。

### （3）法律法规允许的基金投资比例调整期限

除上述第 2)、9)、12)、13) 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，但中国证监会规定的特殊情形除外。

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变更或取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金的上述限制相应变更或取消。

基金管理人应在出现可预见资产规模大幅变动的情况下，至少提前 2 个工作日正式向基金托管人发函说明基金可能的变动规模和公司应对措施，便于基金托管人实施交易监督。

3.基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投资禁止行为进行监督：

根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金禁止从事下列行为：

- （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）向其基金管理人、基金托管人出资；
- （5）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；
- （6）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先的原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

法律、行政法规或监管部门取消上述禁止性规定，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。

#### 4.侧袋机制的实施和投资运作安排

当基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，根据最大限度保护基金份额持有人利益的原则，基金管理人经与基金托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制，无需召开基金份额持有人大会审议。

侧袋机制实施期间，本部分约定的投资组合比例、投资策略等约定仅适用于主袋账户。

侧袋账户的实施条件、实施程序、运作安排、投资安排、特定资产的处置变现和支付等对投资者权益有重大影响的事项详见招募说明书的规定。

5.基金托管人依据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。

- （1）基金托管人按以下方式对基金管理人参与银行间市场交易的交易对手的资信风险

控制措施进行监督。

基金管理人向基金托管人提供其银行间债券市场交易的交易对手库，交易对手库由银行间交易会员中财务状况较好、实力雄厚、信用等级高的交易对手组成。基金管理人可以根据实际情况的变化，及时对交易对手库予以更新和调整，并及时书面通知基金托管人。基金托管人据以对基金银行间债券市场交易的交易对手是否符合上述名单进行监督。

（2）基金托管人对银行间交易市场的交易方式的控制按如下约定进行监督。

基金管理人应按照审慎的风险控制原则，对银行间交易对手的资信状况进行评估，控制交易对手的资信风险，确定与各类交易对手所适用的交易结算方式，在具体的交易中，应尽力争取对基金有利的交易方式。由于交易对手资信风险引起的损失，基金托管人不承担赔偿责任。

6.基金托管人对基金管理人选择存款银行进行监督。

基金如投资银行存款，基金管理人应根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，事先确定符合条件的所有存款银行的名单，并及时提供给基金托管人，基金管理人可以根据实际情况的变化，及时对存款银行的名单予以更新和调整，并通知基金托管人。基金托管人据此对基金投资银行存款的交易对手是否符合上述名单进行监督。

基金管理人负责对存款银行的资信控制，并对投资银行存款的信用风险（包括但不限于存款银行的信用等级、存款银行的支付能力等）进行评估。对于基金投资的银行存款，由于存款银行发生信用风险事件而造成损失时，先由基金管理人负责赔偿，之后有权要求相关责任人进行赔偿。

7.基金托管人对基金投资中期票据的监督责任仅限于依据本协议第二条第（一）款第2项对投资比例和投资限制进行事后监督；除此外，无其它监督责任。如发现异常情况，应及时以书面形式通知基金管理人。基金管理人应积极配合和协助基金托管人进行监督和核查。基金因投资中期票据导致的信用风险、流动性风险，基金托管人不承担任何责任。如因基金管理人原因导致基金出现损失的，基金托管人不承担任何责任。

基金管理人管理的基金在投资中期票据前，基金管理人须根据法律、法规、监管部门的规定，制定严格的关于投资中期票据的风险控制制度和流动性风险处置预案，管理人在此承诺将严格执行该风险控制制度和流动性风险处置预案。

（二）基金托管人应根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金资产净值计算、各类基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查。

（三）基金托管人发现基金管理人的投资运作及其他运作违反《基金法》、《基金合同》、基金托管协议等有关规定时，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应在下一个工作日及时核对，并以书面形式向基金托管人发出回函，进行解释或举证。

在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

基金管理人应积极配合和协助基金托管人依照法律法规、《基金合同》和本托管协议对基金业务的监督和核查，对基金托管人发出的书面提示，必须在规定时间内答复基金托管人并改正，或就基金托管人的疑义进行解释或举证，对基金托管人按照法律法规、《基金合同》和本托管协议的要求需向中国证监会报送基金监督报告的，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

若基金托管人发现基金管理人发出但未执行的投资指令或依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反《基金合同》约定的，应当立即通知基金管理人，并报告中国证监会。基金管理人的上述违规失信行为给基金财产或基金份额持有人造成的损失，由基金管理人承担。

对于必须于估值完成后方可获知的监控指标或依据交易程序已经成交的投资指令，基金托管人发现该投资指令违反法律法规或者违反《基金合同》约定的，应当立即通知基金管理人，并报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

基金管理人无正当理由，拒绝、阻挠基金托管人根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍基金托管人进行有效监督，情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的，基金托管人应报告中国证监会。

### **三、基金管理人**对**基金托管人**的业务核查

基金管理人**对基金托管人履行托管职责情况进行核查**，核查事项包括但不限于基金托管人是否安全保管基金财产、是否分别开设基金财产的资金账户、证券账户等投资所需账户、是否复核基金管理人计算的基金资产净值和各类基金份额净值、是否根据基金管理人指令办理清算交收、进行相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、无故未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、《基金合同》、本托管协议及其他有关规定时，基金管理人应及时以书面形式通知基金托管人限期纠



正，基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式向基金管理人发出回函。在限期内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人应报告中国证监会。基金管理人发现基金托管人有重大违规行为，应立即报告中国证监会和银行业监督管理机构，同时通知基金托管人限期纠正。

基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复基金管理人并改正。

基金托管人无正当理由，拒绝、阻挠基金管理人根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍基金管理人进行有效监督，情节严重或经基金管理人提出警告仍不改正的，基金管理人应报告中国证监会。

#### **四、基金财产的保管**

##### **（一）基金财产保管的原则**

- 1.基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。
- 2.基金托管人应按本协议规定安全保管托管财产。未经基金管理人的指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何财产（基金托管人主动扣收的汇划费除外）。基金托管人不对处于自身实际控制之外的账户及财产承担责任。
- 3.基金托管人按照规定为托管的基金财产开设资金账户、证券账户以及投资所需的其他账户。
- 4.基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，与基金托管人的其他业务和其他基金的托管业务实行严格的独立核算，分账管理，确保基金财产的完整与独立。
- 5.对于因基金认（申）购、基金投资过程中产生的应收财产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金财产没有到达基金托管人处的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失，基金托管人对此不承担责任。

##### **（二）基金资产托管专户的开立和管理**

基金托管人以基金的名义在其营业机构开设资产托管专户，并根据基金管理人合法合规的有效指令办理资金收付。基金管理人应根据法律法规及托管行的相关要求，提供开户所需的资料并提供其他必要协助。本基金的资产托管专户的预留印鉴的印章由基金托管人保管和使用。

本基金的一切货币收支活动，均需通过基金托管人或基金的资产托管专户进行。基金的

资产托管专户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。除因本基金业务需要，基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立其他任何银行账户；亦不得使用以基金名义开立的银行账户进行本基金业务以外的活动。

资产托管专户的管理应符合《人民币银行结算账户管理办法》、《现金管理暂行条例》、《人民币利率管理规定》、《利率管理暂行规定》、《支付结算办法》以及银行业监督管理机构的其他有关规定。

### （三）基金证券账户与证券交易资金账户的开设和管理

基金托管人以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限公司上海分公司/深圳分公司开立专门的证券账户。

基金证券账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借和未经对方同意擅自转让本基金的任何证券账户；亦不得使用本基金的任何证券账户进行本基金业务以外的活动。

基金证券账户的开立由基金托管人负责，管理和运用由基金管理人负责。

基金托管人保管证券账户卡原件。

基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司开立结算备付金账户，基金托管人代表所托管的基金完成与中国证券登记结算有限责任公司的一级法人清算工作，基金管理人应予以积极协助。结算备付金、结算互保基金、交收价差资金等的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定和基金托管人为履行结算参与人的义务所制定的业务规则执行。

### （四）银行间市场债券托管和资金结算专户的开立和管理及市场准入备案

《基金合同》生效后，在符合监管机构要求的情况下，基金管理人负责以基金的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表基金进行交易；基金托管人根据中国人民银行、中央国债登记结算有限责任公司、银行间市场清算所股份有限公司的有关规定，以本基金的名义分别在中央国债登记结算有限责任公司、银行间市场清算所股份有限公司开立债券托管账户和资金结算账户，并代表基金进行银行间市场债券交易的结算。基金管理人和基金托管人应共同负责完成银行间债券市场准入备案。

### （五）其他账户的开设和管理

1.因业务发展而需要开立的其它账户，可以根据《基金合同》或有关法律法规的规定，经基金管理人和基金托管人协商一致后，由基金托管人负责为基金开立。新账户按有关规则使用并管理。

2.法律、法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

（六）基金投资银行存款账户的开立和管理

基金投资银行定期存款应由基金管理人与存款银行总行或其授权分行签订总体合作协议，并将资金存放于存款银行总行或其授权分行指定的分支机构。

存款账户必须以基金名义开立，账户名称为基金名称，存款账户开户文件上加盖预留印鉴及基金管理人公章。

本基金投资银行存款时，基金管理人应当与存款银行签订具体存款协议，明确存款的类型、期限、利率、金额、账号、对账方式、支取方式、账户管理等细则。

为防范特殊情况下的流动性风险，定期存款协议中应当约定提前支取条款。

基金所投资定期存款存续期间，基金管理人、基金托管人应当与存款银行建立定期对账机制，确保基金银行存款业务账目及核对的真实、准确。

（七）基金财产投资的有关实物证券、银行定期存款存单等有价凭证的保管

基金财产投资的有关实物证券由基金托管人存放于基金托管人的保管库；其中实物证券也可存入中央国债登记结算有限责任公司或中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司或票据营业中心的代保管库。实物证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。属于基金托管人实际有效控制下的实物证券在基金托管人保管期间的损坏、灭失，由此产生的责任应由基金托管人承担。基金托管人对基金托管人以外机构实际控制或保管的实物证券、银行定期存款存单对应的财产不承担保管责任。

（八）与基金财产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同的原件分别应由基金托管人、基金管理人保管。除本协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时应当保证基金一方持有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人在合同签署后 5 个工作日内通过专人送达、邮寄等安全方式将合同原件送达基金托管人处。合同原件应存放于基金管理人和基金托管人各自文件保管部门 15 年以上。

## 五、基金资产净值计算和会计复核

（一）基金资产净值的计算、复核与完成的时间及程序

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。各类基金份额净值是按照每个工作日闭市后，该类基金份额的基金资产净值除以当日该类基金份额的余额数量计算。各类基金份额净值的计算保留到小数点后第 4 位，第 5 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

每个估值日，基金管理人应对基金资产估值。估值原则应符合《基金合同》、《证券投资

基金会计核算办法》及其他法律、法规的规定。用于基金信息披露的基金净值和各类基金份额的基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金资产净值和各类基金份额的基金份额净值并以双方认可的方式发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核后以双方认可的方式发送给基金管理人，由基金管理人对外公布。

根据《基金法》，基金管理人计算并公告基金净值信息，基金托管人复核、审查基金管理人计算的基金净值信息。本基金的会计责任方是基金管理人，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对基金净值的计算结果对外予以公布。法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

## （二）基金资产估值方法

### 1、估值对象

基金所拥有的债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

### 2、估值方法

本基金的估值方法为：

#### （1）证券交易所上市的有价证券的估值

1）交易所上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值，具体估值机构由基金管理人与基金托管人另行协商约定；

2）交易所上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价进行估值；

3）交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所市场挂牌转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值；

4）对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为估值日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表估值日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整以确认估值日的公允价值；对于不存在活跃市场或市场活动很少的情况下，应采用估值技术确定其公允价值。

（2）首次公开发行未上市的债券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

（3）对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品

种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对于含投资人回售权的固定收益品种，回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异，未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，按成本估值。

（4）同一证券同时在两个或两个以上市场交易的，按证券所处的市场分别估值。

（5）同业存单，按估值日第三方估值机构提供的估值净价估值；选定的第三方估值机构未提供估值价格的，按成本估值。

（6）当发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。

（7）如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

（8）相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

### （三）估值差错

1.当任一类基金份额净值小数点后4位以内（含第4位）发生差错时，视为该类基金份额净值错误；基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；错误偏差达到该类基金份额净值的0.25%时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到该类基金份额净值的0.5%时，基金管理人应当公告，并报中国证监会备案；当发生净值计算错误时，由基金管理人负责处理，由此给基金份额持有人和基金造成损失的，应由基金管理人先行赔付，基金管理人按差错情形，有权向其他当事人追偿。

2.当基金份额净值计算差错给基金和基金份额持有人造成损失需要进行赔偿时，基金管理人和基金托管人应根据实际情况界定双方承担的责任，经确认后按以下条款进行赔偿：

（1）本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，与本基金有关的会计问题，如经双方在平等基础上充分讨论后，尚不能达成一致时，按基金管理人的建议执行，由此给基金份额持有人和基金财产造成的直接损失，由基金管理人负责赔付。

（2）若基金管理人计算的基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告，而且基金托管人未对计算过程提出疑义或要求基金管理人书面说明的，在基金份额净值出错且造成投资者直接损失的，应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金，就实际向投资者或基金

支付的赔偿金额，基金管理人与基金托管人按照过错程度各自承担相应的责任。

（3）如基金管理人和基金托管人对各类基金份额净值的计算结果，虽然多次重新计算和核对或对基金管理人采用的估值方法，尚不能达成一致时，为避免不能按时公布基金份额净值的情形，以基金管理人的计算结果对外公布，由此给基金份额持有人和基金造成的直接损失，由基金管理人负责赔付。

（4）由于基金管理人提供的信息错误（包括但不限于基金申购或赎回金额等），进而导致基金份额净值计算错误而引起的基金份额持有人和基金财产的损失，由基金管理人负责赔付。

3.基金管理人或基金托管人按上述“（二）基金资产估值方法”的“2.估值方法”的第（7）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。

4.由于不可抗力原因，或由于证券交易所、登记结算公司等发送的数据错误等原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

5.基金管理人和基金托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差，以基金管理人计算结果为准。

6.前述内容如法律法规或监管机构另有规定的，从其规定处理。如果行业另有通行做法，基金管理人和基金托管人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则进行协商。

#### （四）暂停估值的情形

- 1.基金投资所涉及的证券市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 2.因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；
3. 当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上的，基金管理人经与基金托管人协商一致的；
- 4.法律法规规定、中国证监会和《基金合同》认定的其他情形。

#### （五）基金账册的建立

基金管理人和基金托管人在《基金合同》生效后，应按照相关各方约定的同一记账方法和会计处理原则，分别独立地设置、登录和保管本基金的全套账册，对相关各方各自的账册定期进行核对，互相监督，以保证基金资产的安全。若双方对会计处理方法存在分歧，应以基金管理人的处理方法为准。

经对账发现相关各方的账目存在不符的，基金管理人和基金托管人必须及时查明原因并

纠正，保证相关各方平行登录的账册记录完全相符。若当日核对不符，暂时无法查找到错账的原因而影响到基金净值的计算和公告的，以基金管理人的账册为准。

#### （六）基金财务报表与报告的编制和复核

基金财务报表由基金管理人和基金托管人每月分别独立编制。月度报表的编制，应于每月终了后 5 个工作日内完成。

《基金合同》生效后，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书并登载在指定网站上；基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书。

基金管理人在季度结束之日起 15 个工作日内完成季度报告编制并公告；在上半年结束之日起两个月内完成中期报告编制并公告；在每年结束之日起三个月内完成年度报告编制并公告。

基金管理人在每月结束之日起 5 个工作日内完成月度报告，在月度报告完成当日，对报告加盖清算登记部门章后，以传真方式将有关报告提供基金托管人复核；基金托管人在 3 个工作日内进行复核，并将复核结果及时书面通知基金管理人。

基金管理人在每个季度结束之日起 10 个工作日内完成季度报告，在季度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人在收到后 7 个工作日内进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在上半年结束之日起 30 日内完成中期报告，在中期报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人在收到后 30 日内进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在年度结束之日起 45 日内完成年度报告，在年度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人在收到后 45 日内复核，并将复核结果书面通知基金管理人。

基金托管人在复核过程中，发现相关各方的报表存在不符时，基金管理人和基金托管人应共同查明原因，进行调整，调整以相关各方认可的账务处理方式为准。核对无误后，基金托管人在基金管理人提供的报告上加盖印鉴或者出具加盖托管业务部门业务章的复核意见书，相关各方各自留存一份。如果基金管理人与基金托管人不能于应当发布公告之日之前就相关报表达成一致，基金管理人有权按照其编制的报表对外发布公告，基金托管人有权就相关情况报证监会备案。

基金托管人在对财务会计报告、中期报告或年度报告复核完毕后，需盖章确认或出具相应的复核确认书，以备有权机构对相关文件审核时提示。

#### （七）实施侧袋机制期间的基金资产估值

本基金实施侧袋机制的，应根据本部分的约定对主袋账户资产进行估值并按规定披露主袋账户的基金净值信息，暂停披露侧袋账户的份额净值。

## 六、基金份额持有人名册的登记和保管

基金管理人妥善保管的基金份额持有人名册，包括《基金合同》生效日、《基金合同》终止日、基金份额持有人大会权益登记日、每年 6 月 30 日、12 月 31 日的基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容必须包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册由基金登记机构根据基金管理人的指令编制和保管，基金管理人应按照目前相关规则保管基金份额持有人名册。保管方式可以采用电子或文档的形式。保管期限为 15 年。

在基金托管人编制中期报告和年度报告前，基金管理人应将每年 6 月 30 日、12 月 31 日的基金持有人名册送交基金托管人，文件方式可以采用电子或文档的形式并且保证其真实性、准确、完整。基金托管人应妥善保管，不得将持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途。

## 七、争议解决方式

（一）本协议适用中华人民共和国法律（为本托管协议之目的，在此不包括香港、澳门特别行政区和台湾地区法律），并从其解释。

（二）相关各方当事人同意，因本托管协议而产生的或与本托管协议有关的一切争议，除经友好协商可以解决的，应提交上海国际经济贸易仲裁委员会（上海国际仲裁中心），根据该会届时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点在上海市，仲裁裁决是终局性的并对相关各方均有约束力。除非仲裁裁决另有规定，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，托管协议当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行《基金合同》和本托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

## 八、托管协议的变更与终止

### （一）托管协议的变更程序

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议的内容进行变更。变更后的托管协议，其内容不得与《基金合同》的规定有任何冲突，并需经基金管理人、基金托管人加盖公章或合同专用章以及双方法定代表人或授权代理人签字（或盖章）确认。基金托管协议的变更报中国证监会备案。

### （二）基金托管协议终止出现的情形

发生以下情况，本托管协议终止：



- 1.《基金合同》终止；
- 2.基金托管人解散、依法被撤销、破产或有其他基金托管人接管基金资产；
- 3.基金管理人解散、依法被撤销、破产或有其他基金管理人接管基金管理权；
- 4.发生法律法规或《基金合同》规定的终止事项。

## 第二十二部分 对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务。基金管理人有权根据基金份额持有人的需要和市场的变化，增加或变更服务项目及内容。主要服务内容如下：

### 一、公开信息披露服务

- 1、披露基金管理人信息；
- 2、披露基金信息；
- 3、其他信息的披露。

### 二、交易对账单寄送服务

一般情况下，基金管理人根据客户定制需求通过书面或电子形式向投资人提供定期或不定期对账单。基金管理人提供的对账单邮寄服务原则上采取邮政平信邮寄方式，基金管理人不对邮寄材料的送达做出承诺和保证；也不对因邮寄资料出现遗漏、泄露而导致的任何直接或间接损害承担任何赔偿责任。

### 三、客户服务中心电话服务

基金管理人客户服务中心自动语音系统提供 7×24 小时交易情况、基金账户余额、基金产品与服务等信息查询。人工座席每个交易日 9:00-11:30, 13:00-17:00 为投资人提供服务，投资人可以通过该热线获得业务咨询，信息查询，服务投诉，信息定制，资料修改等专项服务。

客户服务热线：400-820-9688，021-20329688

传真电话：021-20329899

### 四、网络在线服务

通过本基金管理人网站的留言板和客户服务信箱，投资人可以实现在线咨询、投诉、建议和寻求各种帮助。

基金管理人网站提供基金公告、投资资讯、理财刊物、基金常识等各种信息，同时提供网上交易、基金账户查询、交易明细查询、修改查询密码等服务。

基金管理人网址：[www.changanfunds.com](http://www.changanfunds.com)

电子信箱：[service@changanfunds.com](mailto:service@changanfunds.com)

### 五、资讯定制服务

基金管理人为投资人提供各类资讯服务，包括基金净值、交易确认、基金管理人最新公告、市场资讯，旗下基金信息等。投资人可以通过基金管理人网站、客户服务热线提交定制申请，基金管理人通过手机短信和 E-MAIL 方式发送定制信息。

除了上述信息之外，基金管理人也会不定期向留有手机和 E-MAIL 地址的客户发送节日及生日问候、产品推广等信息。

### 六、客户投诉处理

基金份额持有人可以通过基金管理人提供的客户服务热线、书信、电子邮件、传真等渠道对基金管理人和销售机构所提供的服务进行投诉。

基金份额持有人还可以通过销售机构的服务电话对该销售机构所提供的服务进行投诉。

对于工作日期间受理的投诉，以“及时回复”为处理原则，对于不能及时回复的投诉，基金管理人承诺将充分与投资人做好沟通，协商确定回复时间。

#### **七、定期定额投资计划**

基金管理人利用直销机构或销售机构为投资人提供定期定额投资服务。通过定期定额投资计划，投资人可以通过固定的渠道、定期定额申购基金份额。

**八、如本招募说明书存在任何您/贵机构无法理解的内容，请通过上述方式联系基金管理人。请确保投资前，您/贵机构已经全面理解了本招募说明书。**

## 第二十三部分 其他应披露的事项

以下信息披露事项已通过指定媒介进行公开披露：

1、2019年5月10日，长安泓沅中短债债券型证券投资基金基金合同及摘要、长安泓沅中短债债券型证券投资基金招募说明书、长安泓沅中短债债券型证券投资基金托管协议、关于长安鑫垚主题轮动混合型证券投资基金转型为长安泓沅中短债债券型证券投资基金的公告。

2、2019年5月13日，关于长安泓沅中短债债券型证券投资基金恢复申购、定期定额投资以及转换转入业务的公告。

3、2019年5月14日，关于旗下基金在西藏东方财富证券股份有限公司开通申购、赎回、基金转换业务并参与费率优惠活动的公告。

4、2019年5月21日，关于旗下基金在华瑞保险销售有限公司开通申购、赎回业务并参与费率优惠活动的公告。

5、2019年5月24日，关于旗下基金在上海大智慧基金销售有限公司开通申购、赎回、定期定额投资业务并参与费率优惠活动的公告。

6、2019年6月28日，关于旗下基金在中信证券股份有限公司等代销机构开通申购、赎回、基金转换业务以及定期定额投资业务并参与费率优惠活动的公告。

7、2019年6月30日，关于旗下基金2019年6月30日基金资产净值、基金份额净值及基金份额累计净值的公告。

8、2019年7月6日，关于长安泓源纯债债券型证券投资基金增聘基金经理的公告。

9、2019年7月18日，长安泓源纯债债券型证券投资基金2019年第二季度报告。

10、2019年8月14日，关于旗下基金在南京苏宁基金销售有限公司开通申购、赎回、基金转换和定期定额投资业务并参与费率优惠活动的公告。

11、2019年8月27日，长安泓沅中短债债券型证券投资基金2019年半年度报告及摘要。

12、2019年9月6日，关于旗下基金在海银基金销售有限公司开通申购、赎回、基金转换和定期定额投资业务并参与费率优惠活动的公告。

13、2019年9月12日，长安基金关于提醒投资者更新、完善身份信息的公告。

14、2019年9月25日，关于旗下基金在北京恒天明泽基金销售有限公司开通申购、赎回、基金转换业务以及定期定额投资业务并参与费率优惠活动的公告。

15、2019年9月27日，关于旗下基金在中证金牛（北京）投资咨询有限公司开通申购、赎回、基金转换业务以及定期定额投资业务并参与费率优惠活动的公告。

16、2019年10月17日，关于旗下基金在浙江同花顺基金销售有限公司开通申购、赎回、基金转换业务以及定期定额投资业务并参与费率优惠活动的公告。

17、2019年10月23日，004907\_长安泓沅中短债债券型证券投资基金2019年第三季度报告。

18、2019年11月5日，关于长安泓沅中短债债券型证券投资基金根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修改基金合同、托管协议的公告、长安泓沅中短债债券型证券投资基金基金合同、长安泓沅中短债债券型证券投资基金托管协议、长安泓沅中短债债券型证券投资基金招募说明书及摘要。

19、2019年11月22日，关于旗下基金在上海陆享基金销售有限公司开通申购、赎回以及定期定额投资业务并参与费率优惠活动的公告。

20、2019年12月31日，关于旗下基金2019年12月31日基金份额净值及基金份额累计净值的公告。

21、2020年1月2日，关于旗下基金参加交通银行股份有限公司手机银行申购和定期定额投资手续费率优惠活动的公告。

22、2020年1月18日，004907\_长安泓沅中短债债券型证券投资基金2019年第四季度报告。

23、2020年3月13日，关于旗下基金在安信证券股份有限公司开通申购、赎回、基金转换业务以及定期定额投资业务并参与费率优惠活动的公告。

24、2020年3月31日，004907\_长安泓沅中短债债券型证券投资基金2019年年度报告。

25、2020年4月2日，关于旗下基金在上海挖财基金销售有限公司开通申购、赎回、基金转换业务以及定期定额投资业务并参与费率优惠活动的公告。

26、2020年4月9日，关于暂停泰诚财富基金销售（大连）有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告。

27、2020年4月22日，004907\_长安泓沅中短债债券型证券投资基金2020年第一季度报告。

28、2020年4月27日，关于旗下基金在洪泰财富（青岛）基金销售有限责任公司开通申购、赎回、基金转换业务以及定期定额投资业务并参与费率优惠活动的公告。

29、2020年4月28日，关于旗下基金在中信证券华南股份有限公司参与费率优惠活动的公告。

30、2020年5月8日，关于旗下基金在喜鹊财富基金销售有限公司开通申购、赎回、基金转换业务以及定期定额投资业务并参与费率优惠活动的公告。

31、2020年5月12日，长安基金管理有限公司副总经理徐小勇任职公告。

32、2020年5月20日，关于长安泓沅中短债债券型证券投资基金基金经理变更的公告。

33、2020年5月27日，关于旗下基金在和耕传承基金销售有限公司开通申购、赎回、基金转换业务以及定期定额投资业务并参与费率优惠活动的公告。

34、2020年5月28日，长安基金管理有限公司关于包商银行转让相关业务的提示性公

告。

35、2020年6月30日，关于旗下基金2020年6月30日基金份额净值及基金份额累计净值的公告。

36、2020年7月14日，关于旗下基金在上海大智慧基金销售有限公司开通基金转换业务的公告。

37、2020年7月21日，004907\_长安泓沅中短债债券型证券投资基金2020年第二季度报告。

38、2020年8月27日，长安泓沅中短债债券型证券投资基金2020年资料概要更新（20200827）。

39、2020年8月31日，004907\_长安泓沅中短债债券型证券投资基金2020年中期报告。

40、2020年10月17日，长安基金管理有限公司关于董事长万跃楠代为履行公司总经理职务的公告以及长安基金管理有限公司关于提醒投资者更新、完善身份信息的公告。

41、2020年10月22日，关于旗下基金在泛华普益基金销售有限公司开通申购、赎回、基金转换业务以及定期定额投资业务并参与费率优惠活动的公告。

42、2020年10月28日，004907\_长安泓沅中短债债券型证券投资基金2020年第三季度报告。

43、2020年10月29日，关于旗下基金在北京恒天明泽基金销售有限公司参与费率优惠活动的公告。

44、2020年11月3日，长安泓沅中短债债券型证券投资基金招募说明书20201103。

45、2020年11月9日，关于旗下基金在玄元保险代理有限公司开通申购、赎回、基金转换业务以及定期定额投资业务并参与费率优惠活动的公告。

46、2020年11月10日，关于旗下基金在大连网金基金销售有限公司开通申购、赎回、基金转换业务以及定期定额投资业务并参与费率优惠活动的公告。

47、2020年11月27日，长安基金管理有限公司副总经理马成任职公告。

48、2020年12月9日，关于旗下基金在江苏汇林保大基金销售有限公司开通申购、赎回、基金转换业务以及定期定额投资业务并参与费率优惠活动的公告。

49、2020年12月31日，关于旗下基金2020年12月31日基金份额净值及基金份额累计净值的公告。

50、2021年1月16日，长安基金管理有限公司总经理汪钦任职公告。

51、2021年1月22日，004907\_长安泓沅中短债债券型证券投资基金2020年第四季度报告、关于旗下基金在浦领基金销售有限公司开通申购、赎回、基金转换业务以及定期定额投资业务并参与费率优惠活动的公告。

52、2021年1月30日，长安基金管理有限公司首席信息官任职公告。

53、2021年2月3日，关于旗下基金在通华财富（上海）基金销售有限公司开通申购、

赎回、基金转换业务以及定期定额投资业务并参与费率优惠活动的公告。

54、2021年3月19日，关于旗下基金在东方财富证券股份有限公司开通申购、赎回、基金转换业务以及定期定额投资业务并参与费率优惠活动的公告。

55、2021年3月31日，004907\_长安泓沅中短债债券型证券投资基金2020年年度报告。

56、2021年4月22日，004907\_长安泓沅中短债债券型证券投资基金2021年第一季度报告。

57、2021年4月29日，长安基金管理有限公司董事长变更公告。

58、2021年5月6日，长安基金管理有限公司关于旗下17只公募基金增加侧袋机制并相应修改法律文件的公告。

59、2021年5月6日，长安泓沅中短债债券型证券投资基金基金合同20210506。

60、2021年5月6日，长安泓沅中短债债券型证券投资基金托管协议20210506。

61、2021年5月6日，长安泓沅中短债债券型证券投资基金招募说明书更新20210506。

62、2021年5月6日，长安泓沅中短债债券型证券投资基金基金产品资料概要更新20210506。

63、2021年5月14日，长安基金管理有限公司关于提醒投资者更新、完善身份信息信息的公告。

64、2021年5月14日，关于旗下基金在宁波银行股份有限公司开通申购、赎回、基金转换业务以及定期定额投资业务并参与费率优惠活动的公告。

65、2021年5月31日，关于旗下基金在上海中正达广基金销售有限公司开通认购、申购、赎回、基金转换业务以及定期定额投资业务并参与费率优惠活动的公告。

66、2021年6月30日，关于旗下基金2021年6月30日基金份额净值及基金份额累计净值的公告20210630。

67、2021年7月20日，长安基金管理有限公司关于直销平台相关业务费率优惠的公告。

68、2021年7月21日，004907\_长安泓沅中短债债券型证券投资基金2021年第2季度报告。

69、2021年7月30日，关于旗下基金在上海浦东发展银行股份有限公司参与费率优惠活动的公告。

70、2021年8月27日，长安泓沅中短债债券型证券投资基金基金产品资料概要更新20210827。

71、2021年8月31日，004907\_长安泓沅中短债债券型证券投资基金2021年中期报告。

72、2021年9月24日，长安基金管理有限公司关于直销平台相关业务费率优惠的公告。

73、2021年10月13日，关于增加泰信财富基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告。

74、2021年10月27日，004907\_长安泓沅中短债债券型证券投资基金2021年第三季

度报告。

75、2021年11月3日，长安泓沅中短债债券型证券投资基金招募说明书 20211103。

76、2021年11月17日，004907\_长安泓沅中短债债券型证券投资基金基金产品资料概要更新 20211117。

77、2021年11月17日，长安泓沅中短债债券型证券投资基金招募说明书 20211117。

78、2021年11月17日，长安泓沅中短债债券型证券投资基金托管协议 20211117。

79、2021年11月17日，长安泓沅中短债债券型证券投资基金基金合同 20211117。

80、2021年11月17日，长安基金管理有限公司关于长安泓沅中短债债券型证券投资基金增设 E 类基金份额并修改基金合同、托管协议的公告 20211117。

81、2021年12月16日，关于长安泓沅中短债债券型证券投资基金自 2021 年 12 月 17 日起增设 E 类基金份额，并暂停销售 C 类基金份额的公告。

82、2021年12月31日，关于旗下基金 2021 年 12 月 31 日基金份额净值及基金份额累计净值的公告。

83、2022 年 1 月 1 日，关于旗下公募基金和资产管理计划执行新金融工具相关会计准则的公告。

84、2022 年 1 月 6 日，长安基金管理有限公司关于直销平台相关业务费率优惠的公告。

85、2022 年 1 月 22 日，004907\_长安泓沅中短债债券型证券投资基金 2021 年第四季度报告。

86、2022 年 2 月 28 日，长安基金管理有限公司关于新增东北证券股份有限公司为旗下部分基金代销机构的公告。

87、2022 年 3 月 31 日，004907\_长安泓沅中短债债券型证券投资基金 2021 年年度报告。

88、2022 年 4 月 15 日，长安泓沅中短债债券型证券投资基金暂停大额申购、定期定额投资以及转换转入业务的公告。

89、2022 年 4 月 19 日，关于长安泓沅中短债债券型证券投资基金的分红公告。

90、2022 年 4 月 22 日，004907\_长安泓沅中短债债券型证券投资基金 2022 年第一季度报告。

91、2022 年 4 月 22 日，关于长安泓沅中短债债券型证券投资基金恢复大额申购、定期定额投资以及转换转入业务的公告。

92、2022 年 4 月 30 日，关于终止北京植信基金销售有限公司、北京唐鼎耀华基金销售有限公司与北京晟视天下基金销售有限公司办理旗下基金销售业务的提示性公告。

93、2022 年 6 月 27 日，长安基金管理有限公司关于增加阳光人寿保险股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告。

94、2022 年 6 月 30 日，关于旗下基金 2022 年 6 月 30 日基金份额净值及基金份额累计净值的公告。



95、2022年7月11日，关于旗下基金在上海利得基金销售有限公司参与费率优惠活动的公告。

96、2022年7月12日，长安基金管理有限公司关于暂停喜鹊财富基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告。

97、2022年7月20日，长安基金管理有限公司关于提醒投资者更新、完善身份信息的公告。

98、2022年7月20日，长安基金管理有限公司关于新增五矿证券有限公司为旗下基金销售机构的公告。

99、2022年7月21日，004907\_长安泓沅中短债债券型证券投资基金 2022年第二季度报告。

100、2022年7月22日，关于增加珠海盈米基金销售有限公司为长安泓沅中短债债券型证券投资基金的销售机构并参与费率优惠活动的公告。

101、2022年8月18日，关于新增北京中植基金销售有限公司为长安泓沅中短债债券型证券投资基金的销售机构并参与费率优惠活动的公告。

102、2022年8月26日，004907\_长安泓沅中短债债券型证券投资基金基金产品资料概要更新。

103、2022年8月31日，004907\_长安泓沅中短债债券型证券投资基金 2022年中期报告。

104、2021年11月3日，长安泓沅中短债债券型证券投资基金招募说明书。

105、2021年11月17日，004907\_长安泓沅中短债债券型证券投资基金基金产品资料概要更新。

106、2021年11月17日，长安泓沅中短债债券型证券投资基金招募说明书。

107、2021年11月17日，长安泓沅中短债债券型证券投资基金托管协议。

108、2021年11月17日，长安泓沅中短债债券型证券投资基金基金合同。

109、2021年11月17日，长安基金管理有限公司关于长安泓沅中短债债券型证券投资基金增设E类基金份额并修改基金合同、托管协议的公告。

110、2021年12月16日，关于长安泓沅中短债债券型证券投资基金自2021年12月17日起增设E类基金份额，并暂停销售C类基金份额的公告。

111、2021年12月31日，关于旗下基金2021年12月31日基金份额净值及基金份额累计净值的公告。

112、2022年1月1日，关于旗下公募基金和资产管理计划执行新金融工具相关会计准则的公告。

113、2022年1月6日，长安基金管理有限公司关于直销平台相关业务费率优惠的公告。

114、2022年1月22日，004907\_长安泓沅中短债债券型证券投资基金 2021年第四季

度报告。

115、2022年2月28日，长安基金管理有限公司关于新增东北证券股份有限公司为旗下部分基金代销机构的公告。

116、2022年3月31日，004907\_长安泓沅中短债债券型证券投资基金2021年年度报告。

117、2022年4月15日，长安泓沅中短债债券型证券投资基金暂停大额申购、定期定额投资以及转换转入业务的公告。

118、2022年4月19日，关于长安泓沅中短债债券型证券投资基金的分红公告。

119、2022年4月22日，004907\_长安泓沅中短债债券型证券投资基金2022年第一季度报告。

120、2022年4月22日，关于长安泓沅中短债债券型证券投资基金恢复大额申购、定期定额投资以及转换转入业务的公告。

121、2022年4月30日，关于终止北京植信基金销售有限公司、北京唐鼎耀华基金销售有限公司与北京晟视天下基金销售有限公司办理旗下基金销售业务的提示性公告。

122、2022年6月27日，长安基金管理有限公司关于增加阳光人寿保险股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告。

123、2022年6月30日，关于旗下基金2022年6月30日基金份额净值及基金份额累计净值的公告。

124、2022年7月11日，关于旗下基金在上海利得基金销售有限公司参与费率优惠活动的公告。

125、2022年7月12日，长安基金管理有限公司关于暂停喜鹊财富基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告。

126、2022年7月20日，长安基金管理有限公司关于提醒投资者更新、完善身份信息的公告。

127、2022年7月20日，长安基金管理有限公司关于新增五矿证券有限公司为旗下基金销售机构的公告。

128、2022年7月21日，004907\_长安泓沅中短债债券型证券投资基金2022年第二季度报告。

129、2022年7月22日，关于增加珠海盈米基金销售有限公司为长安泓沅中短债债券型证券投资基金的销售机构并参与费率优惠活动的公告。

130、2022年8月18日，关于新增北京中植基金销售有限公司为长安泓沅中短债债券型证券投资基金的销售机构并参与费率优惠活动的公告。

131、2022年8月26日，004907\_长安泓沅中短债债券型证券投资基金基金产品资料概要更新。

132、2022年8月31日，004907\_长安泓沅中短债债券型证券投资基金2022年中期报告。

133、2022年9月1日，长安基金管理有限公司关于增加北京坤元基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告。

134、2022年9月15日，长安基金管理有限公司关于增加华宝证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告。

135、2022年9月19日，长安基金管理有限公司关于新增招商证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构并参与费率优惠活动的公告。

136、2022年9月28日，长安泓沅中短债债券型证券投资基金2022年国庆节假期前两日暂停大额申购、定期定额投资以及转换转入业务的公告。

137、2022年10月1日，长安基金管理有限公司关于终止乾道基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告。

138、2022年10月19日，关于新增海通证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构并参与费率优惠活动的公告。

139、2022年10月24日，关于长安泓沅中短债债券型证券投资基金增聘基金经理的公告。

140、2022年10月26日，004907\_长安泓沅中短债债券型证券投资基金2022年第三季度报告。

141、2022年10月27日，长安泓沅中短债债券型证券投资基金招募说明书更新、长安泓沅中短债债券型证券投资基金基金产品资料概要更新。

142、2022年10月31日，长安基金管理有限公司关于旗下基金在上海凯石财富基金销售有限公司参与费率优惠活动的公告。

## **第二十四部分 招募说明书的存放及查阅方式**

本招募说明书存放在基金管理人、基金托管人的办公场所，投资人可在办公时间免费查阅。投资人在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。投资人还可以直接登录基金管理人网站上进行查阅和下载。

基金管理人和基金托管人应保证文本的内容与所公告的内容完全一致。投资人按上述方式所获得的文件及其复印件，基金管理人和基金托管人应保证与所公告的内容完全一致。

## 第二十五部分 备查文件

- （一）中国证监会准予长安鑫垚主题轮动混合型证券投资基金变更注册的文件
- （二）《长安泓沅中短债债券型证券投资基金基金合同》
- （三）《长安泓沅中短债债券型证券投资基金托管协议》
- （四）关于申请长安鑫垚主题轮动混合型证券投资基金变更注册为长安泓沅中短债债券型证券投资基金的法律意见
- （五）基金管理人业务资格批件、营业执照
- （六）基金托管人业务资格批件、营业执照
- （七）中国证监会要求的其他文件

基金托管人业务资格批件和营业执照存放在基金托管人处；基金合同、托管协议及其余备查文件存放在基金管理人处。投资人可在办公时间到存放地点免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

长安基金管理有限公司

2022年11月3日