汇安嘉鑫纯债债券型证券投资基金招募说明书

二零一八年十一月

基金管理人:汇安基金管理有限责任公司
基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司

【重要提示】

1、本基金根据2018年11月1日中国证监会证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于准予汇安嘉鑫纯债债券型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2018]1774号)进行募集。

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

3、投资有风险,投资者认购(或申购)基金份额时应认真阅读基金合同、本招募说明书等信息披露文件,自主判断基金的投资价值,全面认识本基金产品的风险收益特征,应充分考虑投资者自身的风险承受能力,并对认购(或申购)基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则,在投资者作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化导致的投资风险,由投资者自行负担。

4、本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动,投资者在投资本基金前,应全面了解本基金的产品特性,理性判断市场,并承担基金投资中出现的各类风险,包括:因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险、本基金的特定风险等。

本基金投资中小企业私募债,中小企业私募债是根据相关法律法规由非上市中小企业采用非公开方式发行的债券。由于不能公开交易,一般情况下,交易不活跃,潜在较大流动性风险。当发债主体信用质量恶化时,受市场流动性所限,本基金可能无法卖出所持有的中小企业私募债,由此可能给基金净值带来更大的负面影响和损失。

本基金投资资产支持证券,资产支持证券是一种债券性质的金融工具,其向投资者支付的本息来自于基础资产池产生的现金流或剩余权益。与股票和一般债券不同,资产支持证券不是对某一经营实体的利益要求权,而是对基础资产池所产生的现金流和剩余权益的要求权,是一种以资产信用为支持的证券,所面临的风险主要包括交易结构风险、各种原因导致的基础资产池现金流与对应证券现金流不匹配产生的信用风险、市场交易不活跃导致的流动性风险等。

本基金投资国债期货,可能面临市场风险、基差风险、流动性风险等。市场风险是因期货市场价格波动使所持有的期货合约价值发生变化的风险。基差风险是期货市场的特有风险之一,是指由于期货与现货间的价差的波动,影响套期保值或套利效果,使之发生意外损益的风险。流动性风险可分为两类:一类为流通量风险,是指期货合约无法及时以所希望的价格建立或了结头寸的风险,此类风险往往是由市场缺乏广度或深度导致的;另一类为资金量风险,是指资金量无法满足保证金要求,使得所持有的头寸面临被强制平仓的风险。

5、本基金为债券型基金,属证券投资基金中的较低风险品种,其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金和混合型基金,高于货币市场基金。

6、本基金主要投资于债券(包括国内依法发行上市的国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、地方政府债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、中小企业私募债)、债券回购、资产支持证券、同业存单、银行存款、国债期货,以及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

本基金不投资于股票、权证等资产,可转债仅投资可分离交易可转债的纯债部分。

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。

7、基金的投资组合比例为:本基金对债券的投资比例不低于基金资产的80%,每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后, 现金或到期日在一年以内的政府债券的投资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。

如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。

8、本基金初始募集面值为人民币1.00元。在市场波动因素影响下,本基金份额净值可能低于初始面值,本基金投资者有可能出现亏损。

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

10、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。

11、本基金单一投资者持有基金份额数不得超过基金份额总数的50%,但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动超过前述50%比例的除外。

第一部分 绪言

《汇安嘉鑫纯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”)依照《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》”)、《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以及《汇安嘉鑫纯债债券型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)编写。

本招募说明书阐述了汇安嘉鑫纯债债券型证券投资基金的投资目标、策略、风险、费率等与投资人投资决策有关的必要事项,投资人在作出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

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。

汇安嘉鑫纯债债券型证券投资基金(以下简称“基金”或“本基金”)是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息,或对本招募说明书作任何解释或者说明。

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。如本招募说明书内容与基金合同有冲突或不一致之处,均以基金合同为准。基金投资者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。基金投资者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以下含义:

1、基金或本基金:指汇安嘉鑫纯债债券型证券投资基金

2、基金管理人:指汇安基金管理有限责任公司

3、基金托管人:指上海浦东发展银行股份有限公司

4、基金合同或本基金合同:指《汇安嘉鑫纯债债券型证券投资基金基金合同》及对本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《汇安嘉鑫纯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:指《汇安嘉鑫纯债债券型证券投资基金招募说明书》及其定期的更新

7、基金份额发售公告:指《汇安嘉鑫纯债债券型证券投资基金基金份额发售公告》

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2003年10月28日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过,2012年12月28日经第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订, 根据2015年4月24日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修正,自2013年6月1日起实施的《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》:指中国证监会2013年3月15日颁布、同年6月1日实施的《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2004年6月8日颁布、同年7月1日实施的《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》:指中国证监会2014年7月7日颁布、同年8月8日实施的《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注册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办法》(包括其不时修订) 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》(包括其不时修订)及相关法律法规规定运用来自境外的人民币资金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

21、投资人:指个人投资者、机构投资者和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,发售基金份额,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:指汇安基金管理有限责任公司以及符合《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。基金的登记机构为汇安基金管理有限责任公司或接受汇安基金管理有限责任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基金认购、申购、赎回、转换、定期定额投资及转托管等业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户

29、基金合同生效日:指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件,基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕,并获得中国证监会书面确认的日期

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、基金募集期:指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间,最长不得超过三个月

32、存续期:指基金合同生效至终止之间的不定期期限

33、工作日:指上海证券交易所、深圳证券交易所及相关金融期货交易所的正常交易日

34、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

35、T+n日:指自T日起第n个工作日(不包含T日),n为自然数

36、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

37、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

38、《业务规则》:指《汇安基金管理有限责任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

39、认购:指在基金募集期内,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

40、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

41、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

42、基金转换:指基金份额持有人按照本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

43、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份额销售机构的操作

44、定期定额投资计划:指投资人通过有关销售机构提出申请,约定每期扣款日、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

45、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%

46、元:指人民币元

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、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

53、摆动定价机制:指当本基金份额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,确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待

54、指定媒介:指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网网站及其他媒介

55、不可抗力:指本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

56、中国:指中华人民共和国。就本基金合同而言,不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区

第三部分 基金管理人

一、基金管理人概况

名称:汇安基金管理有限责任公司(简称“汇安基金”)

住所:上海市虹口区欧阳路218弄1号2楼215室

办公地址:北京市东城区东直门南大街5号中青旅大厦13层

法定代表人:秦军

成立时间:2016年4月25日

注册资本:1亿元人民币

存续期间:持续经营

联系人:田云梦

存续期限:持续经营

联系电话:(010)56711600

汇安基金管理有限责任公司(以下简称“公司”)经中国证监会证监许可[2016]860号文批准设立。

二、主要成员情况

1、基金管理人董事会成员

何斌先生,董事长。20年证券、基金行业从业经验。东北财经大学国民经济计划学学士。先后就职于北京市财政局、北京京都会计师事务所、中国证券监督管理委员会基金监管部,曾任国泰基金管理公司副总经理、建信基金管理有限责任公司督察长、副总经理。现任汇安基金管理有限责任公司董事长。

秦军先生,董事,总经理。18年证券、基金行业从业经验。清华大学MBA。曾任中国航空工业规划设计研究院监理部总经理助理,中合资产管理有限责任公司北京分公司总经理,嘉实基金管理有限公司总经理助理,华安基金管理有限公司副总经理,现任汇安基金管理有限责任公司总经理。

赵毅先生,董事。1992年毕业于东北财经大学工业经济专业,1999年获该校经济学硕士学位,中欧国际工商学院EMBA毕业。自1997年以来先后创办大连生威粮食集团有限公司、辽宁中稻股份有限公司、沈阳生威投资有限公司。现任大连生威控股有限公司董事长兼总经理。

盛希泰先生,独立董事。南开大学会计系研究生,北京大学EMBA,清华大学五道口金融学院EMBA,北京交通大学管理学博士,05-15三届全国青联常委兼金融界别秘书长,中央国家机关青联副主席,全国大学生创新创业联盟联席理事长,中国青年创新创业联盟副会长,中国基金业协会天使专委会会员,湖畔大学保荐人,南开大学校友总会副理事长、南开北京校友会会长、南开允能商学院理事长,现任清华校友种子基金管理合伙人,阳光保险独立董事、首创股份独立董事。

李海涛先生,独立董事。1998年获得美国耶鲁大学管理学院金融学博士学位。曾任密歇根大学Ross商学院金融学教授、长江商学院金融学访问学者。现任长江商学院副院长及杰出院长讲习教授。

陈伟莉女士,独立董事。1984年获西南政法大学法律专业法学学士学位,2006年获得新加坡南洋理工大学工商管理专业EMBA。现任北京金诚同达律师事务所高级合伙人。

2、基金管理人监事

戴樱女士,监事。2004年毕业于上海对外贸易学院,国际贸易专业学士学位。曾就职于上海贝尔阿尔卡特股份有限公司,任采购部经理助理;上海樱琦干燥剂有限公司,任公司董事;上海上贝资产管理有限公司合伙人。现任汇安基金管理有限责任公司监事。

3、高级管理人员

何斌先生,董事长。(简历请参见董事会成员)

秦军先生,总经理。(简历请参见董事会成员)

孙运英女士,督察长。11年证券、基金从业经验。中国人民大学国际经济法法学硕士,芝加哥肯特法学院国际比较法硕士,中国人民大学经济学博士。历任建信基金管理有限责任公司监察稽核部副总监、泰达宏利基金管理有限公司法律部副总经理、工银瑞信基金管理有限公司法律合规部副总监,2016年7月加入汇安基金管理有限责任公司任首席风控官。现任汇安基金管理有限责任公司督察长。

刘强先生,副总经理。美国注册管理会计师(CMA),东北财经大学审计学学士。历任阿尔卡特深圳公司财务总监,霍尼韦尔深圳公司财务总监,阿特维斯(中国)财务及信息技术总监,北京刚正国际投资有限公司副总经理。2016年4月加入汇安基金管理有限责任公司。现任汇安基金管理有限责任公司副总经理。

郭兆强先生,副总经理。20年证券、基金从业经验,保荐代表人。北京大学光华管理学院工商管理硕士。曾任山西证券投行部综合经理、中德证券高级副总裁,东北证券北京分公司深圳市场部副总经理,从事投资银行业务。2016年4月加入汇安基金管理有限责任公司。现任汇安基金管理有限责任公司副总经理。

窦星华先生,副总经理。12年证券、基金从业经验,CFA。英国杜伦大学金融学硕士。历任标准普尔信息服务(北京)有限公司指数分析师,交银施罗德基金管理有限公司产品经理,华安基金管理有限公司产品高级设计经理及总经理助理,盛世景资产管理股份有限公司产品总监。2016年7月加入汇安基金管理有限责任公司任产品及创新业务部总经理。现任汇安基金管理有限责任公司副总经理。

王俊波先生,副总经理。13年证券、基金从业经验。中国人民大学金融学硕士。历任中国平安产险营销策划经理,嘉实基金券商业务部主管,兴业证券资产管理有限公司市场部执行总监。2016年7月加入汇安基金管理有限责任公司。现任汇安基金管理有限责任公司副总经理。

4、本基金拟任基金经理

杨芳女士,经济学学士,7年证券、基金行业从业经历。曾任职于华创证券,2016年7月起加入汇安基金管理有限责任公司,任固定收益投资部高级经理一职。2017年4月14日至今,任汇安嘉裕纯债债券型证券投资基金基金经理;2017年4月28日至今,任汇安嘉汇纯债债券型证券投资基金、汇安嘉源纯债债券型证券投资基金基金经理;2018年2月7日至今,任汇安裕华纯债定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理;2018年3月27日至今,任汇安稳裕债券型证券投资基金基金经理;2018年11月7日至今,任汇安短债债券型证券投资基金基金经理。

5、投资决策委员会成员

秦军先生,总经理;(简历请参见董事会成员)

钟敏棣先生,固定收益首席投资官。23年银行、基金行业从业经验。CFA,硕士。2005年4月加入嘉实基金,从事债券研究及投资组合管理工作。2008年5月加入建信基金,曾管理建信收益增强、安心保本、稳定增利、双息红利四只债券型基金,多次被评为金牛基金。2018年5月加入汇安基金管理有限责任公司,担任固定收益首席投资官,固定收益投资部总经理,董事总经理。

邹唯先生,首席投资官。18年证券、基金行业从业经验。理科硕士。历任长城证券有限公司研究部行业分析师,嘉实基金管理有限公司行业分析师、基金经理、主题策略组组长,中信产业基金融投资部董事总经理,嘉实基金管理有限公司基金经理、主题策略组组长、董事总经理。2017年12月1日加入汇安基金管理有限责任公司,担任首席投资官,董事总经理。

仇秉则先生,固定收益研究部总监。CFA,CPA,中山大学经济学学士,12年证券、基金行业从业经历,曾任普华永道中天会计师事务所审计经理,嘉实基金管理有限公司固定收益部高级信用分析师。2016年6月加入汇安基金管理有限责任公司,担任固定收益研究部总监一职,从事信用债投资研究工作。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

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发售、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、编制基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告;

7、计算并公告基金资产净值和基金份额净值,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、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;

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、法律法规和中国证监会规定的其他职责。

四、基金管理人的承诺

1、基金管理人承诺不从事违反《中华人民共和国证券法》的行为,并承诺建立健全内部控制制度,采取有效措施,防止违反《中华人民共和国证券法》行为的发生;

2、基金管理人承诺不从事违反《中华人民共和国基金法》的行为,并承诺建立健全内部风险控制制度,采取有效措施,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)法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他行为。

3、基金管理人承诺严格遵守基金合同,并承诺建立健全内部控制制度,采取有效措施,防止违反基金合同行为的发生;

4、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;

5、基金管理人承诺不从事其他法规规定禁止从事的行为。

五、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、不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

六、基金管理人的内部控制制度

1、风险管理的原则

(1)健全性原则:风险管理应当覆盖公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员,并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个经营环节;

(2)有效性原则:通过科学的风险管理手段和方法,建立合理的风险管理程序,维护风险管理制度的有效执行;

(3)独立性原则:公司必须在精简的基础上设立能充分满足公司风险管理需要的机构、部门和岗位,并保持其相对独立性;基金财产、公司固有财产和其他资产的管理和运作应当严格分离;基金投资研究、决策、执行、清算和评估等部门和岗位,应当在物理上和制度上适当隔离;

(4)相互制约原则:内部部门和岗位的设置必须权责分明、相互牵制,并通过切实可行的相互制衡措施来消除风险管理中的盲点;

(5)成本效益原则:公司运用科学化的经营管理办法降低运作成本,提高经济效益,力争以合理的控制成本达到最佳的风险管理效果。

2、风险管理和内部风险控制体系结构

公司建立董事会领导下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险管理体系,包括董事会下设的风险控制委员会、督察长、风险管理委员会、监察稽核部、风险管理部以及各个业务部门。具体而言,包括如下组成部分:

(1)董事会

董事会负责公司整体风险的预防和控制,审核、监督公司风险管理制度的有效执行。

(2)风险控制委员会

1)向董事会建议风险定义和风险评估标准,审阅管理层提交的风险管理报告、督察长提交的监察稽核报告;

2)对公司存在的风险隐患和可能出现的风险问题进行研究、提出指导性建议;

3)对重大突发性风险事件的处理提出指导性建议;

4)提议聘请、更换外部审计机构,并就外部审计机构的资质和工作情况进行评议;

5)协助董事会审查公司内控制度、重大项目和审计重大交易;

6)董事会授权的其他事宜。

(3)督察长

1)出席或列席公司相关会议并行使相应表决权;

2)对公司的基金运作、专户运作、内部管理、系统实施和合法合规情况进行内部监察稽核,并定期出具独立的监察稽核报告,并将报告上报董事会和中国证监会;

3)如发现公司及基金运作中违反任何法律法规规定,立即告知公司总经理和相关业务人员,提出处理意见和整改意见,并监督整改措施的制定和落实;公司总经理对存在问题不整改或者整改未达到要求的,督察长应当向公司董事会、中国证监会及相关派出机构报告;

4)享有充分的知情权和独立的调查权。督察长根据履行职责的需要,有权参加或者列席公司董事会以及公司业务、投资决策、风险管理等相关会议,有权调阅公司相关档案;

5)定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况,并在董事会及董事会下设的相关专门委员会定期会议上报告基金及公司运作的合法合规情况及公司内部风险控制情况, 以及需要立即报告的重大事项;

6)对公司推出新产品、开展新业务的合法合规性问题提出意见;

7)指导、督促公司妥善处理投资人的重大投诉,保护投资人的合法权益;

8)严格遵守保密制度,对在履行职责中掌握的非公开信息负有保密义务,不得违反法律法规及公司规定向其他机构、人员泄露非公开信息,或者利用非公开信息为自己或者他人进行证券投资活动。

(4)监察稽核部

1)执行风险控制委员会制订的合规管理政策及管控措施;

2)倡导、培育公司合规文化;

3)监督、检查法律法规、公司制度和流程的执行情况;

4)参与公司新产品的开发设计,对潜在合规及法律风险进行分析,并提出控制建议;

5)对公司信息披露程序及披露文档的合法合规性进行审查;

6)对基金运作和公司内部管理进行日常监察与稽核;

7)检查公司内部控制制度的执行情况,并就内控的合规性、合理性、完备性和有效性等方面存在的问题提出意见和建议;

8)调查公司内部的违规案件,协助督察长处理相关事宜;

9)有权提议聘请独立第三方专业机构对公司财务状况和基金运作状况进行审计;

10)协助配合监管部门的监督和检查;

11)监督和检查员工遵纪守法情况和职业操守情况,负责员工的离任审计;

12)负责公司的有关法律事务;

13)完成督察长要求的其他工作。

(5)风险管理部

1)执行风险管理委员会制订的风险管理政策和管控措施;

2)监控投资合规运作,对基金及特定客户资产管理计划投资活动进行独立动态监控;

3)监控投资风险,对基金及特定客户资产管理计划投资活动进行事前、事中、事后风险控制;

4)对基金资产、组合资产进行风险定量分析;

5)对公司管理的各投资组合的公平交易情况进行监控和定期分析;

6)制订投资管理业绩的评价体系,定期评估投资组合的绩效,抄送投资决策委员会、专户投资决策委员会,作为评价基金经理、投资经理业绩的重要参考依据;

7)其他风险管理相关事务。

(6)业务部门

公司各业务部门应根据具体情况制定本部门的作业流程及风险管理制度, 对风险来源和产生原因进行有效识别和分析,并对风险的严重性、发生的可能性及其影响进行测定和管理,将风险控制在最小范围内。

3、风险管理和内部风险控制的措施

(1)为保障风险管理制度的持续性和有效性,公司内部必须形成良好的控制环境,建立持续的风险管理检验制度和独立的风险管理报告制度。

(2)控制环境是与风险管理制度相关的各种因素相互作用的综合效果及其对业务、员工的影响。良好的控制环境可为其他风险管理制度要素提供规则和架构,主要包括各项风险管理制度对各项业务的牵制力,公司管理层、员工对风险管理制度的重视程度。公司致力于从公司文化、组织结构、管理制度等方面营造良好的控制环境。

(3)公司致力于营造一个浓厚的风险文化氛围,使得风险管理意识能在公司内部广泛分享,并能扩展到公司所有员工,确保内控机制的建立、完善和各项管理制度的执行。

(4)风险管理检验制度是公司根据市场环境、金融工具、技术应用、法律法规的变化和发展情况,不断测试和调整风险管理制度,以确保风险管理制度持续运作并充分有效的制度。

(5)风险管理报告制度是指风险管理部及时将公司整体风险状况向公司总经理和董事会报告的制度。公司应具备完善的信息系统确保报告程序的有效性,以保证总经理、督察长和董事会及时可靠地取得准确详细的信息。

(6)风险管理部应定时检查和指导各部门的风险管理工作,形成风险管理报告书与建议书,上报公司决策层,并坚持重点管理的原则,对相关投资部门、运营部等重要的业务部门和人员进行重点监督与防范。

(7)公司各级人员均应认真履行工作职责,准确、及时地反映情况,对风险管理工作不力或隐瞒不报、上报虚假情况,给公司造成巨大风险和损失的,依公司规定追究其责任。

(8)对因风险管理工作出色,防止了某些重大风险的发生,为公司挽回了重大损失,业绩特别突出的人员,公司应予以表彰和奖励。

(9)对于各项规章制度完善、风险防范工作积极主动并卓有成效的部门,公司应给予适当表彰与奖励。

(10) 对于部门制度不完备、工作程序不合理或管理混乱而造成较大风险并给公司带来损失的,应追究直接责任人及部门负责人的责任。

第四部分 基金托管人

(一)基金托管人概况

本基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司,基本信息如下:

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

(下转A18版)

汇安嘉鑫纯债债券型证券投资基金基金份额发售公告

基金管理人:汇安基金管理有限责任公司
基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司
发售日期:2018年11月16日至2019年2月15日

重要提示

1. 汇安嘉鑫纯债债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)的募集已获中国证监会证监许可[2018]1774号文注册。

2.本基金是债券型证券投资基金,基金运作方式为契约型开放式。

3. 本基金的管理人和登记机构为汇安基金管理有限责任公司(以下简称“本公司”),基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

4.本基金自2018年11月16日至2019年2月15日(不含周六、周日及法定节假日)通过销售机构向投资者公开发售,基金管理人可根据募集情况适当延长或缩短本基金的募集期限并及时公告。

5. 符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、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者。

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。

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注册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。

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办法》(包括其不时修订) 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。

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》(包括其不时修订) 及相关法律法规规定运用来自境外的人民币资金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。

6. 本基金不设募集规模上限。

7. 本基金的销售机构为直销机构及其他销售机构。直销机构为汇安基金管理有限责任公司直销中心。本公告中如无特别说明,销售机构即指本公司的直销机构和其他销售机构。具体销售机构名单详见本公告“七、本次募集有关当事人或中介机构”项下“(三)销售机构”章节。

8. 投资者欲认购本基金,需开立本基金管理人的开放式基金账户。若已经在本公司开立开放式基金账户的,则不需要再次办理开户手续。募集期内本公司通过直销机构为投资者办理开户和认购手续。开户和认购申请可同时办理。

9. 首次单笔最低申购金额为人民币1.00元,追加申购单笔最低金额为人民币1.00元。各销售机构在不低于上述规定的前提下, 可根据自己的情况调整首次最低认购金额和追加最低认购金额限制,具体以销售机构公布的为准。

10. 如本基金单个投资人累计认购的基金份额数超过基金总份额的50%,基金管理人可以采取比例确认等方式对该投资人的认购申请进行限制。基金管理人接受某笔或者某些认购申请有可能导致投资者变相规避前述50%比例要求的,基金管理人有权拒绝该等全部或者部分认购申请。投资人认购的基金份额数以基金合同生效后登记机构的确认为准。

11. 募集期内,投资者可以多次认购本基金。认购申请一经销售机构受理,即不得撤销。

12. 销售机构(包括本公司直销机构和其他销售机构)受理申请并不表示对该申请已经成功的确认,而仅代表销售机构确实收到了认购申请。申请是否有效应以登记机构的确认登记为准。投资者可在基金合同生效后到各销售机构查询最终成交确认情况和认购的份额。

13. 本公告仅对本基金募集的有关事项和规定予以说明。投资者欲了解本基金的详细情况,请详细阅读2018年11月14日刊登在中国证监会指定信息披露媒介上的《汇安嘉鑫纯债债券型证券投资基金招募说明书》。本基金的基金合同、招募说明书及本公告将同时发布在本公司网站(www.huianfund.cn),投资者亦可通过本公司网站了解基金募集相关事宜。

14. 开户、认购等事项的详细情况请向销售机构咨询。请拨打本公司的客户服务电话(010-56711690)咨询相关事宜。

15. 基金管理人可综合各种情况对募集安排做适当调整。

16. 风险提示

本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动,投资者在投资本基金前,应全面了解本基金的产品特性,理性判断市场,并承担基金投资中出现的各类风险,包括:因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险、本基金的特定风险等。本基金为债券型基金,属证券投资基金中的较低风险品种,其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金和混合型基金,高于货币市场基金。

基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则,在投资人作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资人自行负担。投资者在进行投资决策前,请仔细阅读本基金的招募说明书及基金合同等信息披露文件,在对自己的资金状况、投资期限、收益预期和风险承受能力做出客观合理的评估后,再作出是否投资的决定。投资者应确保在投资本基金后,即使出现短期的亏损也不会给自己的正常生活带来很大的影响。

基金管理人按照基金合同的约定,依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产,在风险控制的基础上力求为基金投资者争取最大的投资收益,但不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。基金管理人管理的其他基金的业绩不构成对本基金业绩表现的保证。请投资者正确认识和对待本基金未来可能的收益和风险。

一、本次募集基本情况

(一)基金名称

基金名称:汇安嘉鑫纯债债券型证券投资基金

基金简称:汇安嘉鑫纯债债券

基金代码:006625

(二)基金类型

债券型证券投资基金。

(三)基金的运作方式

契约型开放式。

(四)存续期限

不定期。

(五)基金份额初始面值

基金份额初始面值为1.00元人民币。

(六)募集规模

本基金不设募集规模上限。基金募集份额总额不少于2亿份,基金募集金额不少于2亿元。

(七)募集对象

符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、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者。

(八)募集方式

1、直销机构

汇安基金管理有限责任公司直销中心

传真:021-80219047

邮箱:DS@huianfund.cn

北京办公地址:北京市东城区东直门南大街5号中青旅大厦13层

联系人:田云梦

电话:010-56711624

上海办公地址:上海市虹口区东大名路501白玉兰大厦36楼02、03单元

(下转A18版)

汇安基金管理有限责任公司汇安嘉鑫纯债债券型证券投资基金基金合同摘要

基金管理人:汇安基金管理有限责任公司
**基金托管人:上海浦东发展银行股