长江可转债债券型证券投资基金招募说明书

基金管理人:长江证券(上海)资产管理有限公司
基金托管人:上海银行股份有限公司
二〇一八年十一月

重要提示

本基金经2018年8月8日中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)下发的《关于准予长江可转债债券型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2018]1277号文)准予募集注册。

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

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

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

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

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

第一部分 绪言

《长江可转债债券型证券投资基金招募说明书》(以下简称“本招募说明书”或“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》”)、《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》”)及其他有关法律法规以及《长江可转债债券型证券投资基金基金合同》编写。基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。

本基金根据本招募说明书所载明的资料申请募集。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。基金合同的当事人包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和基金合同的当事人,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:指长江可转债债券型证券投资基金
2、基金管理人:指长江证券(上海)资产管理有限公司
3、基金托管人:指上海银行股份有限公司
4、基金合同:指《长江可转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《长江可转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《长江可转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《长江可转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,自2013年6月1日起实施,并经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《全国人民代表大会常务委员会关于修改(中华人民共和国港口法)等七部法律的决定》修改的《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》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、合格境外机构投资者、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,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:指长江证券(上海)资产管理有限公司以及符合《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。基金的登记机构为长江证券(上海)资产管理有限公司或接受长江证券(上海)资产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、用于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认购、申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资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3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)
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《长江证券(上海)资产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
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、基金份额的类别:本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别
43、A类基金份额:本基金在投资者认购/申购基金时收取认购费、申购费的,不收取销售服务费的,称为A类基金份额
44、C类基金份额:本基金在投资者认购/申购基金时不收取认购费、申购费,而是从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为C类基金份额
45、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
46、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
47、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、申购金额及扣款方式,由销售机构于每期约定申购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
48、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%
49、元:指人民币元
50、基金收益:指基金投资所得红利、股息、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
51、基金资产总值:指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收款及其他资产的价值总和
52、基金资产净值:指基金资产总值减去基金负债后的价值
53、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
54、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
55、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
56、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,确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待
57、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
58、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)基金管理人概况
名称:长江证券(上海)资产管理有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区世纪大道1198号世纪汇一座27层
办公地址:上海市浦东新区世纪大道1198号世纪汇一座27层
法定代表人:罗国举
设立日期:2014年9月16日
批准设立机关及批准设立文号:中国证券监督管理委员会证监许可[2014]871号
开展公开募集证券投资基金管理业务批准文号:证监许可[2016]30号
组织形式:有限责任公司
注册资本:10亿元人民币
存续期限:持续经营
联系人:蒋媛媛
联系电话:021-80301221
股权结构:长江证券股份有限公司持有公司100%的股权。

(二)主要人员情况
1、董事会成员
周纯先生,硕士。现任长江证券股份有限公司总裁助理、长江证券(上海)资产管理有限公司董事长。曾任长江证券股份有限公司法律合规部合规管理岗、副总经理,质量控制总部总经理。
刘元瑞先生,中共党员,硕士。现任长江证券股份有限公司总裁;曾任长江证券股份有限公司研究所分析师、副总经理、总经理,长江证券股份有限公司副总裁。
邓晖先生,中共党员,硕士。现任长江证券股份有限公司副董事长、党委副书记;曾任湖北省邮政储汇局职工,湖北证券公司深圳营业部副总经理、武汉汉口营业部总经理、公司总裁助理兼上海总部总经理,公司副总裁兼经纪事业部总经理,长江证券有限责任公司董事、副总裁,湘财证券有限公司副总裁,德邦证券有限责任公司副总裁、总裁兼德邦期货有限公司董事长,齐鲁证券有限公司党委委员、副总裁、总裁,长江证券股份有限公司监事长,长江证券(上海)资产管理有限公司董事长,长江成长资本投资有限公司董事长,长江证券股份有限公司总裁。
胡曹元先生,中共党员,硕士。现任长江证券股份有限公司副总裁;曾任华中理工大学讲师,中国教育科研计算网华中网络中心NIC部主任,大鹏证券有限责任公司信息技术部开发部经理、首席助理总经理、副总经理、总经理,大鹏网络有限责任公司副总经理、董事,大鹏证券有限责任公司信息技术部总经理,长江证券有限责任公司信息技术中心总经理、信息技术总部主管,长江证券股份有限公司营运管理总部主管、信息技术总部总经理、执行副总裁。
2、监事
石应刚先生,中共党员,硕士。现任长江证券股份有限公司稽核监察部总经理。曾任武汉证券公司上海业务部交易员、营业部经理,武汉证券交易中心上市稽核部经理、办公室主任,长江证券股份有限公司办公室、董秘室总经理。
3、公司高级管理人员
周纯先生,董事长。(简历请参见上述董事会成员介绍)
唐吟波女士,总经理,中共党员,硕士。曾任泰阳证券有限责任公司(现方正证券)上海延安西路营业部客户部主管,德邦证券股份有限公司经纪业务总部营销部总经理,齐鲁证券有限公司(现中泰证券)经纪业务总部副总经理、上海甘河路营业部总经理,长江证券(上海)资产管理有限公司副总经理。
刘泉先生,副总经理,合规负责人、董事会秘书,中共党员,硕士。曾任职于中国平安保险集团股份有限公司、中国证监会上海监管局,曾任柏瑞爱建资产管理(上海)有限公司合规负责人。
范海蓉女士,副总经理,中共党员,硕士。曾任招商证券股份有限公司投资银行部项目经理,上海国际信托有限公司资金信托总部研究员、基金经理助理、资本市场主管、股权信托总部总经理助理、副总经理、总经理。
董来富先生,副总经理,首席风险官,中共党员,硕士。曾任中国建设银行支行信贷负责人、分理处主任、营业部副主任、主任、支行行长,湘财证券股份有限公司合肥长江中路营业部总经理,华融证券股份有限公司信用业务部总经理。
4、拟任基金经理
漆志伟先生,国籍:中国。硕士研究生,具备基金从业资格。曾任华农财产保险股份有限公司固定收益投资经理。现任长江收益增强债券型证券投资基金、长江乐享货币市场基金、长江优享货币市场基金、长江乐丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、长江乐盈定期开放债券型发起式证券投资基金、长江乐越定期开放债券型发起式证券投资基金、长江乐鑫纯债定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。
5、投资决策委员会成员
基金投资决策委员会是公司进行基金投资管理的最高投资决策机构,由总经理唐吟波女士(兼任基金管理部总经理)、权益研究部总经理徐婕女士、基金经理漆志伟先生、基金经理曾丹华先生、基金经理曹繁建先生、风险管理部副总经理孙婷女士组成。其中唐吟波女士任基金投资决策委员会主任。
6、上述人员之间不存在近亲属关系。

(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、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认购、申购和赎回价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定,按有关规定计算并公告基金资产净值,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、编制季度、半年度和年度基金报告;
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条件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、基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件,《基金合同》不能生效,基金管理人承担全部募集费用,将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后30日内退还基金认购人;
25、执行生效的基金份额持有人大会的决议;
26、建立并保存基金份额持有人名册;
27、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。

(四)基金管理人关于遵守法律法规的承诺
1、基金管理人承诺遵守《基金法》及其他相关法律法规的规定,建立健全的内部控制制度,采取有效措施,防止违反《基金法》及其他相关法律法规行为的发生。
2、基金管理人承诺严格遵守《中华人民共和国证券法》、《基金法》及有关法律法规,建立健全内部控制制度,采取有效措施,防止下列行为发生:
(1)将其固有财产或者他人财产混同于基金资产从事证券投资;
(2)不公平地对待其管理的不同基金资产;
(3)利用基金资产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)法律法规或中国证监会规定禁止的其他行为。

(五)基金管理人关于禁止性行为的承诺
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、买卖其他基金份额,但是中国证监会另有规定的除外;
5、向其基金管理人、基金托管人出资;
6、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;
7、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,应当符合本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。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。

如法律、行政法规或监管部门取消或变更上述禁止性规定,基金管理人在履行适当程序后,本基金可不受上述规定的限制或以变更后的规定为准,不需经基金份额持有人大会审议。

(六)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及其他第人、受雇人或任何第三人谋取利益;
3、不违反现行有效的有关法律法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定,泄漏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、不从事损害基金资产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

(七)基金管理人的内部控制制度
1、内部控制原则
健全性原则:内部控制覆盖各个部门和各级岗位,并渗透到各项业务过程,涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个环节。
有效性原则:通过科学的内部控制手段和方法,建立合理适用的内部控制程序,并适时调整和不断完善,维护内部控制制度的有效执行。
独立性原则:公司各机构、部门和岗位的职责保持相对独立,公司基金/资产管理计划资产、自有资产、其他资产的运作分离。
相互制约原则:公司部门和岗位的设置应权责分明、相互制衡。
成本效益原则:公司运用科学化的经营管理方法降低业务运作成本,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。
防火墙原则:公司投资、交易、研究、评估、销售等业务环节,适当分离,以达到防范风险的目的,对因业务需要知悉内部信息的人员,制定严格的批准程序和监督措施。
2、内部控制制度
为了保证公司规范运作,有效地防范和化解管理风险、经营风险以及操作风险,确保基金财务和公司财务以及其他信息真实、准确、完整,从而最大程度地保护基金份额持有人的利益,本基金管理人建立了科学合理、控制严密、运行高效的内部控制制度。
内部控制制度是指公司为实现内部控制目标而建立的一系列组织机制、管理方法、操作程序与控制措施的总称。内部控制制度由内部控制大纲、基本管理制度、部门业务规章等组成。
公司内部控制大纲是对公司章程规定的内控原则的细化和展开,是对各项基本管理制度的总揽和指导,内部控制大纲明确了内控目标、内控原则、控制环境、内控措施等内容。
基本管理制度包括《投资管理制度》、《证券投资基金投资绩效管理办法》、《内部控制大纲》、《合规管理制度》、《全面风险管理基本制度》、《证券投资基金稽核监察制度》、《证券投资基金会计制度》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《信息技术管理制度》和《证券投资基金应急处理管理办法》等。
部门业务规章是在基本管理制度的基础上,对各部门的主要职责、岗位设置、岗位责任、操作守则等的具体说明。
3、基金管理人关于内部控制制度的声明书
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基金管理人董事会及管理层的责任,董事会承担最终责任;本基金管理人特别声明以上关于内部控制制度和风险管理的披露真实、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)基金托管人概况
名称:上海银行股份有限公司(以下简称“上海银行”)
住所:中国(上海)自由贸易试验区银城中路168号
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区银城中路168号
法定代表人:金煜
成立时间:1996年1月30日
组织形式:股份有限公司(中外合资、上市)
注册资本:人民币78.05785亿元
存续期间:持续经营
基金托管业务批准文号:中国证监会 证监许可[2009]814号
托管部门联系人:闻怡
电话:021-68475888
传真:021-68476936

上海银行成立于1996年1月30日,是一家由国有股份、中资法人股份、外资股份及个人股份共同组成的股份制商业银行,总行位于上海,是上海证券交易所主板上市公司,股票代码601229。

上海银行以“精品银行”为战略愿景,以“精诚至上,信义立行”为核心价值观,近年来通过推进专业化经营和精细化管理,着力在中小企业、财富管理和养老金融、金融市场、跨境金融、在线金融等领域培育和塑造经营特色,不断增强可持续发展能力。

上海银行目前在上海、北京、深圳、天津、成都、宁波、南京、杭州、苏州、无锡、绍兴、南通、常州、盐城等城市设立分支机构,形成长三角、环渤海、珠三角和中西部重点城市的布局框架;发起设立四家村镇银行、上银基金管理有限公司、上海尚诚消费金融股份有限公司,设立上海银行(香港)有限公司,并与全球120多个国家和地区近1500多家境内外银行及其分支机构建立了代理行关系。

上海银行自成立以来市场影响力不断提升,截至2017年末,总资产18077.67亿元;实现净利润153.28亿元,同比增长7.13%。在英国《银行家》2017年公布的“全球前1000家银行”排名中,按一级资本和总资产计算,上海银行分别位列全球银行业第85位和89位;多次被《亚洲银行家》杂志评为“中国最佳城市零售银行”。

(二)主要人员情况
上海银行总行下设资产托管部,是从事资产托管业务的职能部门,内设产品管理部、托管运作部(下设托管运作团队和运行保障团队)、稽核监督部,平均年龄30岁左右,100%员工拥有大学本科以上学历,业务岗位人员均具有基金从业资格。

(三)基金托管业务经营情况
上海银行于2009年8月18日获得中国证监会、中国银监会核准开办证券投资基金托管业务,批准文号:中国证监会证监许可[2009]814号。
截至2017年12月31日,上海银行已托管29只证券投资基金,分别为天治成长精选混合型证券投资基金、浦银安盛稳健增利债券型证券投资基金(LOF)、中证财通中国可持续发展100(ECPI ESG)指数增强型证券投资基金、鹏华双债增利债券型证券投资基金、浦银安盛季季添利定期开放债券型证券投资基金、鹏华双债保利债券型证券投资基金、鹏华丰信分级债券型证券投资基金、前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金、万家现金宝货币市场证券投资基金、中银安心回报半年定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛月月盈安心养老定期支付债券型证券投资基金、申万菱信中证申万传媒行业投资指数分级证券投资基金、华安添颐养老混合型发起式证券投资基金、万家瑞丰灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞兴灵活配置混合型证券投资基金、博时裕荣纯债债券型证券投资基金、浙商惠盈纯债债券型证券投资基金、兴业福益债券型证券投资基金、大成慧成货币市场证券投资基金、嘉实稳瑞纯债债券型证券投资基金、嘉实稳祥纯债债券型证券投资基金、博时裕弘纯债债券型证券投资基金、鹏华兴益定期开放灵活配置混合型基金、博时悦楚纯债债券型证券投资基金、华泰柏瑞爱利灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞富灵活配置混合型证券投资基金、博时富海纯债债券型证券投资基金、博时盈海纯债债券型证券投资基金和博时鑫和纯债债券型证券投资基金,托管基金的资产净值合计363.65亿元。

(四)基金托管人的内部控制制度
1、内部控制目标
严格遵守国家有关法律法规、行业监管规章和本行有关规定,守法经营、规范运作、严格监察,确保业务的稳健运行,保证基金资产的安全完整,确保有关信息的真实、准确、完整、及时,保护基金份额持有人的合法权益。
2、内部控制组织结构
上海银行基金托管业务内部风险控制组织结构是由总行风险管理部门和资产托管部共同组成。托管业务风险控制纳入全行的风险管理体系;资产托管部配备专职人员负责托管业务内控稽核工作,各业务部室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。
3、内部控制的原则
(1)全面性原则:监督制约必须渗透到托管业务的全过程和各个操作环节,覆盖到资产托管部所有的部室、岗位和人员。
(2)独立性原则:资产托管部内设独立的稽核监督团队,保持高度的独立性和权威性,负责对托管业务风险控制工作进行指导和监督。
(3)相互制约原则:各业务部室在内部组织结构上形成相互制约,建立不同岗位之间的制衡体系。
(4)审慎性原则:内控与风险管理必须以防范风险、审慎经营为前提,保证托管资产的安全与完整;托管业务经营管理必须按照“内控优先”的原则,在新设机构或新增业务时,做到先期完成相关制度建设。
(5)有效性原则:内部控制体系应与所处的环境相适应,以合理的成本实现内控目标,内部制度的制订应当具有前瞻性,并应当根据国家政策、法律及经营管理的需要,适时进行相应修改和完善;内部控制应当具有高度的权威性,任何人不得拥有不受内部控制约束的权力,内部控制存在的问题应当能够得到及时反馈和纠正。
4、内部控制制度及措施
(1)建立明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度。
(2)建立托管业务前后台分离,不同岗位相互牵制的管理结构。
(3)专门的稽核监督人员组织各业务部室进行风险识别、评估,制定并实施风险控制措施。
(4)托管业务操作间实施门禁管理和音像监控。
(5)定期开展业务与职业道德培训,使员工树立风险防范与控制理念,并签订承诺书。
(6)制定完备的应急预案,并组织员工定期演练;建立异地灾备,保证业务连续不中断。
(五)基金托管人对基金管理人的托管业务进行监督的方法和程序
基金托管人负有对基金管理人的投资运作行使监督权的职责。根据《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定,托管人对基金的投资对象和范围、投资组合比例、投资限制、费用的计提和支付方式、基金会计核算、基金资产估值和基金净值的计算、收益分配、申购赎回以及其他有关基金投资和运作的事项,对基金管理人进行业务监督、核查。
基金托管人发现基金管理人有违反法律法规和基金合同的行为,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及时核对并以书面形式对基金托管人发出回函。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。
基金托管人发现基金管理人有重大违规行为,立即报告中国证监会,同时,通知基金管理人限期纠正,并将纠正结果报告中国证监会。
基金托管人发现基金管理人的指令违反法律、行政法规和其他有关规定,或者违反基金合同约定的,应当拒绝执行,立即通知基金管理人,并及时向中国证监会报告。
基金托管人发现基金管理人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,并及时向中国证监会报告。

第五部分 相关服务机构

(一)基金份额发售机构
1、直销机构
长江证券(上海)资产管理有限公司直销中心:
名称:长江证券(上海)资产管理有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区世纪大道1198号世纪汇一座27层
办公地址:上海市浦东新区世纪大道1198号世纪汇一座27层

(下转A10版)

长江证券(上海)资产管理有限公司长江可转债债券型证券投资基金基金份额发售公告

基金管理人:长江证券(上海)资产管理有限公司
基金托管人:上海银行股份有限公司
二〇一八年十一月

【重要提示】

1. 长江可转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2018年8月8日证监许可[2018]1277号文注册。中国证监会对本基金的注册并不代表中国证监会对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。
2. 本基金类别为债券型证券投资基金,运作方式为契约型开放式。
基金名称:长江可转债债券型证券投资基金
基金简称:长江可转债债券
基金代码:A类份额:006618 C类份额:006619
3. 本基金的管理人和登记机构均为长江证券(上海)资产管理有限公司(以下简称“基金管理人”或“管理人”),基金托管人为上海银行股份有限公司。
4. 本基金自2018年11月21日至2018年12月20日通过基金管理人指定的销售机构公开发售。本基金募集期限自基金份额发售之日起最长不得超过3个月,基金管理人可根据基金销售情况在募集期限内适当延长或缩短基金发售时间,并及时公告。
5. 本基金的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、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。
6. 本基金不设募集规模上限。
7. 本基金的销售机构包括基金管理人直销中心和基金管理人委托的其他销售机构。基金管理人直销中心包括基金管理人的直销柜台和网上直销系统;基金管理人委托的其他销售机构详见“八、(三)份额发售机构”。各销售机构的办理地点、办理日期、办理时间和办理程序等事项参照各销售机构的具体规定。
8. 投资人欲购买本基金,需开立基金管理人基金账户。基金募集期内基金管理人直销中心和基金管理人委托的其他销售机构的销售网点同时为投资人办理基金账户开立手续。投资人在办理基金账户开户手续时可同时办理认购申请,但认购申请的确认须以开户确认成功为前提条件。一个投资人只能开立和使用一个基金账户;已经开立基金管理人基金账户的投资人无须重复开户。
投资者应保证用于认购的资金来源合法,投资者应有权自行支配,不存在任何法律上、合约上或其他方面的障碍,投资者不得使用贷款、发行债券等筹集的非自有资金投资本基金。投资者已提交的身份证件或身份证明文件如已过有效期,请及时办理相关更新手续,以免影响认购。投资人不得非法利用他人账户或资金进行认购,也不得违规融资或帮助他人违规进行认购。
9.投资人通过销售机构认购本基金基金份额单笔最低金额为人民币10元(含认购费),追加认购单笔最低金额为1元;通过基金管理人的直销中心(仅限直销柜台)首次认购本基金基金份额的最低金额为人民币50,000 元(含认购费),追加认购单笔最低金额为1,000元,不设级差限制;通过基金管理人网上直销系统首次认购本基金基金份额的最低金额为人民币1,000元(含认购费),追加认购单笔最低金额为1,000元,不设级差限制。各销售机构对最低认购金额及交易级差有其他规定的,以各销售机构的业务规定为准。基金管理人可根据市场情况,调整认购金额的数量限制并提前公告。
本基金募集期间单个基金份额持有人最高累计认购的基金份额不得超过基金总份额的50%。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。
10.基金销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功,而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购的确认以登记机构的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况,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。
11.投资人在募集期内可以多次认购基金份额,认购费按每笔认购申请单独计算。认购一经受理不得撤销。
12.本公告仅对本基金募集的有关事项和规定予以说明。投资人欲了解本基金的详细情况,请详细阅读2018年11月17日刊登在《中国证券报》和《证券时报》的《长江可转债债券型证券投资基金招募说明书》(以下简称“招募说明书”)。本基金的招募说明书、基金合同、托管协议及本公告将同时在基金管理人网站(www.cjzcgl.com)以及基金托管人上海银行股份有限公司网站发布。投资人可通过基金管理人网站下载基金业务申请表格或了解本基金募集相关事宜。
14.投资者如有疑问,可拨打基金管理人客户服务电话4001-166-866进行咨询。
15.本公告中的单位“元”均指人民币元。
16.基金管理人可综合各种情况对发售安排做适当调整。基金管理人拥有对本基金份额发售公告的最终解释权。
17.风险提示
投资有风险,投资人认购基金时应认真阅读本基金的招募说明书,全面认识本基金的风险收益特征,充分考虑自身的风险承受能力,并对认购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。证券投资基金是一种长期投资工具,其主要功能是分散投资,降低投资单一证券所带来的个别风险。投资人购买本基金并不等于将资金作为存款存放在银行