汇添富丰润中短债债券型证券投资基金招募说明书

基金管理人:汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人:兴业银行股份有限公司
重要提示

本基金经中国证券监督管理委员会2018年11月30日证监许可【2018】1997号文注册募集。

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。

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。

投资有风险,投资者根据所持有份额享受基金的收益,但同时也要承担相应的投资风险。投资者拟认购(或申购)基金时应认真阅读本招募说明书、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,全面认识本基金产品的风险收益特征,并承担基金投资中出现的各类风险,包括:因整体政治、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,由于基金投资者连续大量赎回基金产生的流动性风险,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,等等。本基金可投资中小企业私募债券,中小企业私募债券属于高风险的债券投资品种,其流动性风险和信用风险均高于一般债券品种,会影响组合的风险特征。中小企业私募债券的流动性风险在于该类债券采取非公开方式发行和交易,由于不公开资料,外部评级机构一般不对这类债券进行外部评级,可能会降低市场对该类债券的认可度,从而影响该类债券的市场流动性。中小企业私募债券的信用风险在于该类债券发行主体的资产规模较小、经营的波动性较大,同时,各类材料(包括募集说明书、审计报告)不公开发布,也大大提高了分析并跟踪发债主体信用基本面的难度。

本基金为债券型基金,其预期风险及预期收益水平高于货币市场基金,低于混合型基金及股票型基金。

投资者应充分考虑自身的风险承受能力,并对于认购(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引致的投资风险,由投资者自行负责。

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。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或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达到或者超过50%的除外。法律法规或监管机构另有规定的,从其规定。

第一部分 绪言

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》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及其他有关法律法规以及《汇添富丰润中短债债券型证券投资基金基金合同》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。本基金投资者自依基金合同取得基金份额,即成为本基金基金份额持有人和基金合同当事人,其持有本基金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。基金投资者欲了解本基金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:指汇添富丰润中短债债券型证券投资基金
2、基金管理人:指汇添富基金管理股份有限公司
3、基金托管人:指兴业银行股份有限公司
4、基金合同:指《汇添富丰润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《汇添富丰润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《汇添富丰润中短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《汇添富丰润中短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作出的修订
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》(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、投资人、投资者: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
21、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
22、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
23、销售机构:指汇添富基金管理股份有限公司以及符合《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代理协议,代为办理基金销售业务的机构
24、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
25、登记机构:指办理登记业务的机构。基金的登记机构为汇添富基金管理股份有限公司或接受汇添富基金管理股份有限公司委托代为办理登记业务的机构
26、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
27、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
28、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
29、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
30、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
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《汇添富基金管理股份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、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
39、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
40、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
41、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
42、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
43、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
44、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%
45、元:指人民币元
46、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
47、基金资产总值:指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和
48、基金资产净值:指基金资产总值减去基金负债后的价值
49、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
50、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
51、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以及法律法规或中国证监会规定的其他流动性受限资产,如未来法律法规变动,基金管理人在履行适当程序后,可对前述流动性受限资产范围进行调整
52、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,如未来法律法规变动,基金管理人在履行适当程序后,可对前述摆动定价机制的定义进行调整
53、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
54、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、基金管理人简况
名称:汇添富基金管理股份有限公司
住所:上海市黄浦区北京东路666号H区(东座)6楼H686室
办公地址:上海市富城路99号震旦国际大楼20楼
法定代表人:李文
成立时间:2005年2月3日
批准设立机关:中国证监会
批准设立文号:证监基金字[2005]5号
注册资本:人民币132,724,224元
联系人:李鹏
联系电话:(021)28932888
股东名称及其出资比例:

股东名称	股权比例
东方证券股份有限公司	35.412%
上海菁聚金投资管理合伙企业(有限合伙)	24.656%
上海上投资产管理有限公司	19.966%
东航金控有限责任公司	19.966%
合计	100%

二、主要人员情况
1、董事会成员
李文先生,2015年4月16日担任董事长。国籍:中国,1967 年出生,厦门大学会计学博士。现任汇添富基金管理股份有限公司董事长。历任中国人民银行厦门市分行稽核处科长,中国人民银行杏林支行、国家外汇管理局杏林支局副行长、副局长,中国人民银行厦门市中心支行银行监管一处、二处副处长,东方证券有限责任公司资金财务管理总部副总经理,稽核总部总经理,东方证券股份有限公司资金财务管理总部总经理,汇添富基金管理股份有限公司督察长。

林福杰先生,2018年3月21日担任董事。国籍:中国,1971年出生,上海交通大学工商管理硕士。现任东航金控有限责任公司总经理、党委副书记、东航集团财务有限责任公司董事长。曾任东航期货有限责任公司部门经理,东航集团财务有限责任公司副总经理,国泰人寿保险有限责任公司副总经理,东航金控有限责任公司党委书记、副总经理。

程峰先生,2016年11月20日担任董事。国籍:中国,1971 年出生,上海交通大学工商管理硕士。现任上海报业集团副总经理,上海上报资产管理有限公司董事长,上海文化产权交易所股份有限公司董事长,上海瑞力投资基金管理有限公司董事长。历任上海市对外经济贸易委员会团委副书记、书记,上海机械进出口(集团)有限公司副总裁,上海市对外经济贸易委员会技术进口处副处长,上海市对外经济贸易委员会科技发展与技术贸易处副处长、处长,上海国际集团有限公司办公室、信息中心主任,上海国际集团有限公司行政管理总部总经理,上海国际集团金融服务有限公司党委副书记、总经理,上海国际集团金融服务有限公司党委书记、董事长、总经理,上海国际集团金融服务有限公司党委书记、董事长,上海国有资产经营有限公司党委书记、董事长。

张晖先生,2015年4月16日担任董事,总经理。国籍:中国,1971年出生,上海财经大学数量经济学硕士。现任汇添富基金管理股份有限公司总经理,汇添富资本管理有限公司董事长。历任申银万国证券研究所高级分析师,富国基金管理有限公司高级分析师、研究主管和基金经理,汇添富基金管理股份有限公司副总经理、投资总监、投资决策委员会副主席,曾担任中国证券监督管理委员会第十届和第十一届发行审核委员会委员。

韦杰夫(Jeffrey R. Williams)先生,2007年3月2日担任独立董事。国籍:美国,1953年出生,哈佛大学商学院工商管理硕士,哈佛大学肯尼迪政府学院艾什民主治理与创新中心高级研究学者。现任美国中华医学基金会理事。历任美国花旗银行香港分行副总裁、深圳分行行长,美国运通银行台湾分行副总裁,台湾美国运通国际股份有限公司副总裁,渣打银行台湾分行总裁,深圳发展银行行长,哈佛上海中心董事总经理。

林志军先生,2015年4月16日担任独立董事。国籍:中国香港,1955年出生,厦门大学经济学博士,加拿大Saskatchewan大学工商管理学硕士。现任澳门科技大学副校长兼商学院院长、教授、博导,历任福建省科学技术委员计划财务处会计,五大国际会计师事务所Touche Ross International(现为德勤)加拿大多伦多分所审计员,厦门大学会计师事务所副主任会计师,厦门大学经济学院讲师、副教授,伊利诺大学(University of Illinois)国际会计教育与研究中心访问学者,美国斯坦福大学(Stanford University)经济系访问学者,加拿大Lethbridge大学管理学院会计学讲师、副教授(tenured),香港大学商学院访问教授,香港浸会大学商学院会计与法律系教授,博导,系主任。

杨燕青女士,2011年12月19日担任独立董事,国籍:中国,1971年出生,复旦大学经济学博士。现任《第一财经日报》副总编辑,第一财经研究院院长,国家金融与发展实验室特邀高级研究员,上海政协委员,《第一财经日报》创始编委之一,第一财经频道高端对话节目《经济学人》等栏目创始人和主持人,《波士堂》等栏目资深评论员。2002-2003年期间受邀成为约翰-霍普金斯大学访问学者。

2、监事会成员
任瑞良先生,2004年10月20日担任监事,2015年6月30日担任监事会主席。国籍:中国,1963年出生,大学学历,会计师、非执业注册会计师职称。现任上海报业集团上海上报资产管理有限公司副总经理。历任文汇新民联合报业集团财务中心财务主管,文汇新民联合报业集团文新投资公司财务主管、总经理助理、副总经理等。

王如富先生,2015年9月8日担任监事。国籍:中国,1973年出生,硕士研究生,注册会计师。现任东方证券股份有限公司董事会秘书兼董事会办公室主任。历任申银万国证券计划统筹总部综合计划部专员、发展协调办公室专员,金信证券规划发展总部总经理助理、秘书处副主任(主持工作),东方证券研究所证券市场战略资深研究员、董事会办公室资深主管、主任助理、副主任。

毛海东先生,2015年6月30日担任监事,国籍:中国,1978年出生,国际金融学硕士。现任东航金控有限责任公司总经理助理兼财富管理中心总经理。曾任职于东航期货有限责任公司,东航集团财务有限责任公司。

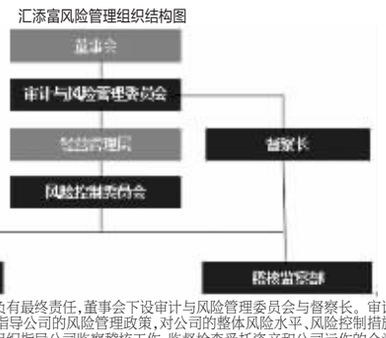
王静女士,2008年2月23日担任职工监事,国籍:中国,1977年出生,中加商学院工商管理硕士。现任汇添富基金管理股份有限公司互联网金融部总监。曾任职于中国东方航空集团公司宣传部,东航金控有限责任公司研究发展部。

林旋女士,2008年2月23日担任职工监事,国籍:中国,1977年出生,华东政法学院法学硕士。现任汇添富基金管理股份有限公司董事会办公室副总监,汇添富资本管理有限公司监事。曾任职于东方证券股份有限公司办公室。

陈杰先生,2013年8月8日担任职工监事,国籍:中国,1979年出生,北京大学理学博士。现任汇添富基金管理股份有限公司综合办公室副总监。曾任职于罗兰贝格管理咨询有限公司,泰科电子(上海)有限公司能源事业部。

3、高管人员
李文先生,董事长。(简历请参见上述董事会成员介绍)
张晖先生,2015年6月25日担任总经理。(简历请参见上述董事会成员介绍)
雷继明先生,2012年3月7日担任副总经理。国籍:中国,1971年出生,工商管理硕士,历任中国民族国际信托投资公司网上交易部副总经理,中国民族证券有限责任公司营业部总经理、经纪业务总监、总裁助理。2011年12月加盟汇添富基金管理股份有限公司,现任公司副总经理。
娄焱女士,2013年1月7日担任副总经理。国籍:中国,1971年出生,金融经济学硕士。曾在赛格国际信托投资股份有限公司、华夏证券股份有限公司、嘉实基金管理有限公司、招商基金管理有限公司、华夏基金管理有限公司以及富达基金北京与上海代表处工作,负责投资银行、证券投资研究,以及基金产品策划、机构理财等管理工作。2011年4月加入汇添富基金管理股份有限公司,现任公司副总经理。
袁建军先生,2015年8月5日担任副总经理。国籍:中国,1972年出生,金融学硕士。历任华夏证券股份有限公司研究所行业二部副经理,汇添富基金管理股份有限公司基金经理、专户投资总监、总经理助理,并于2014年至2015年期间担任中国证券监督管理委员会第十六届主板发行审核委员会专职委员。2005年4月加入汇添富基金管理股份有限公司,现任汇添富基金管理股份有限公司副总经理、投资决策委员会主席。
李骁先生,2017年3月3日担任副总经理。国籍:中国,1969出生,武汉大学金融学硕士。历任厦门建行计算机处副处长,厦门建行信用卡部副处长、处长,厦门建行信息技术部处长,建总行北京开发中心负责人,建总行信息技术管理部副总经理,建总行信息技术管理部副总经理兼北京研发中心主任,建总行信息技术管理部资深专员(副总经理级)。2016年9月加入汇添富基金管理股份有限公司,现任汇添富基金管理股份有限公司副总经理、首席技术官。
李鹏先生,2015年6月25日担任督察长。国籍:中国,1978年出生,上海财经大学经济学博士,历任上海证监局主任科员、副处长,上海农商银行同业金融部副总经理,汇添富基金管理股份有限公司稽核监察总监。2015年3月加入汇添富基金管理股份有限公司,现任汇添富基金管理股份有限公司督察长。
4、基金经理
蒋文玲女士,国籍:中国,上海财经大学经济学硕士。12年证券从业经历。2006年5月加入汇添富基金,曾任汇添富基金债券交易员、债券风控研究员。2012年11月30日至2014年1月7日任浦银安盛基金货币市场基金的基金经理。2014年1月加入汇添富基金,历任金融工程部高级经理、固定收益基金经理助理。2014年4月8日至今任汇添富多元收益债券基金的基金经理助理,2015年3月10日至今任汇添富现金宝货币基金、汇添富理财14天债券基金、汇添富优选回报混合基金(原理财21天债券基金)的基金经理,2016年6月7日至今任汇添富货币基金、汇添富添富通货币基金、汇添富理财30天债券基金、汇添富理财60天债券基金、汇添富实业债债券基金的基金经理,2017年4月20日至今任汇添富鑫益定开债基金的基金经理,2017年5月15日至今任汇添富年年益定开混合基金的基金经理,2017年6月23日至今任汇添富鑫汇定开债券基金的基金经理。2018年8月2日至今任汇添富新睿精选灵活配置混合型证券投资基金、汇添富睿丰混合型证券投资基金的基金经理。
徐光先生,国籍:中国,美国伊利诺伊理工学院金融学硕士,6年证券从业经历。。2012年12月加入汇添富基金管理股份有限公司,历任债券交易员、高级债券交易员。2018年8月起任汇添富鑫泽定期开放债券型发起式证券投资基金、汇添富季季红定期开放债券型证券投资基金的基金经理。
5、投资决策委员会
主席:袁建军先生(副总经理)
成员:韩贤旺先生(首席经济学家)、王栩(权益投资总监)、陆文磊(总经理助理,固定收益投资总监)、劳杰男(研究副总监)
6、上述人员之间不存在近亲属关系。
三、基金管理人的职责
根据《基金法》、《运作办法》及其他法律、法规的规定,基金管理人应履行以下职责:
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、编制基金季度、半年度和年度报告;
7、计算并公告基金资产净值,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、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、法律、行政法规、中国证监会和基金合同规定的其他职责。
四、基金管理人和基金经理的承诺
1、本基金管理人承诺严格遵守现行有效的相关法律、行政法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定,建立健全内部控制制度,采取有效措施,防止违反现行有效的有关法律、行政法规、规章、基金合同和中国证监会有关规定的行为发生。
2、本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,建立健全的内部控制制度,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、行政法规和中国证监会规定禁止的其他行为。
3、本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利益;
(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,不按照规定履行职责;
(7)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;
(8)违反证券交易场所业务规则,利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格,扰乱市场秩序;
(9)贬损同行,以抬高自己;
(10)以不正当手段谋求业务发展;
(11)有悖社会公德,损害证券投资基金人员形象;
(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)法律、行政法规以及中国证监会规定禁止的行为。
4、基金经理承诺
(1)依照有关法律、行政法规和基金合同的规定,本着谨慎勤勉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代理人、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、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、基金管理人的风险管理体系
本基金管理人将经营管理中的主要风险划分为投资风险、合规风险、营运风险和道德风险四大类,其中,投资风险主要包括市场风险、信用风险、流动性风险等。针对上述各类风险,基金管理人建立了一套完整的风险管理体系。
1、风险管理原则
基金管理人风险管理体系的构建遵循以下六项基本原则:
(1)营造良好的风险管理文化和内部控制环境,使风险意识贯穿到每位员工、各个岗位和经营管理的各个环节。
(2)建立完善的风险管理组织体系,切实保证风险管理部门的独立性和权威性,使其有效地发挥职能作用。
(3)确保风险管理制度的严肃性,保证风险管理制度在投资管理和经营活动过程中得到切实有效的执行。
(4)运用合理有效的风险指标和模型,实现风险事前配置和预警、事中实时监控、事后评估和反馈的全程嵌入式投资风险管理模式。
(5)建立和推进员工职业守则教育和专业培训体系,确保员工具备良好的职业操守和充分的职责胜任能力。
(6)建立风险事件学习机制,认真剖析各类风险事件,汲取经验和教训,不断完善风险管理体系。
2、风险管理组织架构
本基金管理人建立了董事会、经营管理层、风险管理部门、各职能部门四级风险管理组织架构,并明确了相应的风险管理职能。

汇添富风险管理组织结构图



(1)董事会对公司风险管理负有最终责任,董事会下设审计与风险管理委员会与督察长。审计与风险管理委员会主要负责审核和指导公司的风险管理政策,对公司的整体风险水平、风险控制措施的实施情况进行评价。督察长负责组织指导公司监察稽核工作,监督检查受托资产和公司运作的合法合规情况及公司内部风险控制情况。
(2)经营管理层负责风险管理政策、风险控制措施的制定和落实,经营管理层下设风险控制委员会。风险控制委员会主要负责审议风险管理制度和流程,处置重大风险事件,促进风险管理文化的形成。
(3)稽核监察部是风险管理的职能部门。稽核监察部负责投资组合市场风险、信用风险、流动性风险、合规风险、营运风险、道德风险等的管理。
(4)各职能部门负责从经营管理的各业务环节上贯彻落实风险管理措施,执行风险识别、风险测量、风险控制、风险评价和风险报告等风险管理程序,并持续完善相应的内部控制制度和流程。
3、风险管理内容
本基金管理人的风险管理包括风险识别、风险测量、风险控制、风险评价、风险报告等内容。
(1)风险识别是指对现实以及潜在的各种风险加以判断、归类和鉴定风险性质的过程。
(2)风险测量是指估计和预测风险发生的概率和可能造成的损失,并根据这两个因素的结合来衡量风险大小的程度。
(3)风险控制是指采取相应的措施,监控和防止各种风险的发生,实现以合理的成本在最大限度内防范风险和减轻损失。
(4)风险评价是指分析风险识别、风险测量和风险控制的执行情况和运行效果的过程。
(5)风险报告是指将风险事件及处置、风险评价情况以一定程序进行报告的过程。
六、基金管理人的内部控制制度
内部控制是指基金管理人为防范和化解风险,保证经营运作符合基金管理人发展规划,在充分考虑内外部环境的基础上,通过建立组织机制、运用管理方法、实施控制程序与控制措施而形成的系统。
基金管理人结合自身具体情况,建立了科学合理、控制严密、运行高效的内部控制体系,并制定了科学完善的内部控制制度。
1、内部控制目标
(1)保证基金管理人经营运作遵守国家法律法规和行业监管规则,自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营理念。
(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,实现持续、稳定、健康发展。
(3)确保基金管理人和基金财务及其他信息的真实、准确、及时、完整。
2、内部控制原则
(1)健全性原则。内部控制机制覆盖基金管理人的各项业务、各个部门和各级人员,并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个环节。
(2)有效性原则。通过科学的内部控制手段和方法,建立合理的内部控制程序,维护内部控制的有效执行。
(3)独立性原则。基金管理人各机构、部门和岗位职责保持相对独立,基金资产、固有财产、其他资产的运作相互分离。
(4)相互制约原则。基金管理人内部部门和岗位的设置权责分明、相互制衡。
(5)成本效益原则。基金管理人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、内部控制内容
基金管理人的内部控制要求建立:不相容职务相分离的机制、完善的岗位责任制、规范的岗位管理措施、完整的信息资料保全系统、严格的授权控制、有效的风险防范系统和快速反应机制等。
基金管理人遵守国家有关法律法规,遵循合法合规性原则、全面性原则、审慎性原则和适时性原则,制订了系统完善的内部控制制度。内部控制的内容包括投资管理业务控制、信息披露控制、信息技术系统控制、会计系统控制以及内部稽核控制等。
(1)投资管理业务控制
基金管理人通过规范投资业务流程,分层次强化投资风险控制。公司根据投资管理业务不同阶段的性质和特点,制定了完善的管理规章、操作流程和岗位手册,明确揭示不同业务可能存在的风险,分别采取不同措施进行控制。
针对投资研究业务,基金管理人制定了《汇添富基金管理股份有限公司投资研究部制度》,对研究工作的业务流程、研究报告质量评价,研究与投资的交流渠道等都做了明确的规定;对于投资决策业务,基金管理人制定了《汇添富基金管理股份有限公司投资管理制度》,保证投资决策严格遵守法律法规的有关规定,符合基金合同所规定的要求,同时设立了汇添富投资风险评估与管理制度以及投资管理业绩评价体系;对于基金交易业务,基金管理人将实行集中交易与防火墙制度,建立交易监测系统、预警系统和交易反馈系统,完善相关的安全设施,交易流程将严格按照“审核—执行—反馈—复核—存档”的程序进行,防止不正当关联交易损害基金份额持有人利益。

(下转A18版)

汇添富丰润中短债债券型证券投资基金份额发售公告

重要提示

汇添富丰润中短债债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)已获中国证监会证监许可【2018】1997号文注册募集。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、市场前景和收益作出实质性判断或保证。

本基金的基金类型为债券型证券投资基金,运作方式为契约型开放式。

1、本基金的基金管理人为汇添富基金管理股份有限公司(以下简称“本公司”),基金托管人为兴业银行股份有限公司(以下简称“兴业银行”),登记机构为汇添富基金管理股份有限公司。

2、本基金募集期限自2018年12月10日起至2018年12月20日。本基金认购将通过本公司的直销中心和网上直销系统(trade.99fund.com)公开发售。

3、本基金发售对象为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。

4、本基金自基金份额发售之日起3个月内,在基金募集份额总额不少于2亿份,基金募集金额不少于2亿元人民币且基金认购人数不少于200人的条件下,基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售,并在10日内聘请法定验资机构验资,自收到验资报告之日起10日内,向中国证监会办理基金备案手续。

投资者购买本基金应使用汇添富基金管理股份有限公司基金账户。若投资者已经开立汇添富基金管理股份有限公司基金账户,则无须再另行开立基金账户,直接以此基金账户办理认购申请即可。未开立基金账户的投资者可以到本公司直销中心办理开立基金账户的手续。本公司同时开通网上开户功能,详细情况请登录公司网上直销系统(trade.99fund.com)查询。

5、投资者的开户和认购申请可同时办理,一次完成,但若开户无效,认购申请也同时无效。

6、在募集期内,投资者通过基金管理人直销中心首次认购本基金基金份额的最低金额为人民币50000元(含认购费);通过基金管理人网上直销系统(trade.99fund.com)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)。超过最低认购金额的部分不设认购金额级差。投资者在募集期内可多次认购基金份额,其认购金额按照单笔认购金额对应的费率为基准进行计算。认购申请一经销售机构受理,不可以撤销。

募集期间的单个投资者的累计认购金额不设上限。但如本基金单个投资人累计认购的基金份额数达到或者超过基金总份额的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。

7、本基金的有效认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有,其中利息转份额的数额以登记机构的记录为准。

8、销售网点(指本公司的直销中心)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受了认购申请,申请的成功确认应以基金登记机构的确认结果为准。投资者可以在本基金合同生效后到原认购网点打印认购成交确认凭证或查询认购成交确认信息。

9、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,请详细阅读刊登在2018年12月7日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上的《汇添富丰润中短债债券型证券投资基金基金合同摘要》、《汇添富丰润中短债债券型证券投资基金招募说明书》。

10、本基金的基金合同、招募说明书、基金托管协议及本公告将同时发布在本公司网站(www.99fund.com)。投资者亦可通过本公司网站了解基金募集相关事宜。

11、投资者所在地若未开设销售网点,请拨打本公司的客户服务热线电话(400-888-9918)垂询认购事宜。

12、本公司可综合各种情况对募集安排做适当调整。

13、风险提示

证券投资基金(以下简称“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。基金不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具,投资者购买基金,既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益,也可能承担基金投资所带来的损失。

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、技术风险和合规风险等。巨额赎回风险是开放式基金所特有的一种风险,即当单个交易日基金的净赎回申请超过基金总份额的百分之十时,投资者将可能无法及时赎回持有的全部基金份额。

基金分为股票型基金、混合型基金、债券型基金、货币市场基金等不同类型,投资者投资不同类型的基金将获得不同的收益预期,也将承担不同程度的风险。一般来说,基金的收益预期越高,投资者承担的风险也越大。本基金为债券型基金,属于证券投资基金中较低预期风险、较低预期收益的品种,其预期风险及预期收益水平高于货币市场基金,低于混合型基金及股票型基金。

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,投资者根据所持有的基金份额享受基金收益,同时承担相应的投资风险。投资者在投资本基金前,需充分了解本基金的产品特性,并承担基金投资中出现的各类风险,包括:因整体政治、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,由于基金投资者连续大量赎回基金产生的流动性风险,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,等等。

本基金投资中小企业私募债券,本基金投资中小企业私募债券属于高风险的债券投资品种,其流动性风险和信用风险均高于一般债券品种,会影响组合的风险特征。中小企业私募债券的流动性风险在于该类债券采取非公开方式发行和交易,由于不公开资料,外部评级机构一般不对这类债券进行外部评级,可能会降低市场对该类债券的认可度,