# 长安基金管理有限公司
# 关于以通讯方式召开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的公告

一、召开会议基本情况

长安鑫垚主题轮动混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）根据中国证券监督管理委员会证监许可（2017）1048号文注册募集，成立于2017年8月9日。

根据《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》等法律法规的规定及《长安鑫垚主题轮动混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关约定，长安基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）经与基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“上海浦东发展银行”）协商一致，决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，审议本基金转型为“长安泓沣中短债债券型证券投资基金”，并对基金合同进行修改的有关事宜。会议具体安排如下：

（一）会议召开方式：通讯方式。

（二）投票表决起止时间：自2019年4月8日起，至2019年5月7日17:00点止。投票表决时间以基金管理人收到表决票的时间为准。

基金份额持有人或其代理人（受托人）需将填妥的表决票和所需的相关文件（具体见下文四、不同参会人所需寄送的材料）于2019年4月8日至2019年5月7日17:00点期间（以基金管理人收到表决票时间为准），通过专人送交或邮寄的方式送达至下述指定地址。

（三）表决票及相关文件的送达/寄达地址

基金份额持有人或其代理人（受托人）需将填妥的表决票和所要求的相关文件通过专人送交或邮寄的方式送达至以下地址的下述收件人：

基金管理人名称：长安基金管理有限公司

地址：上海市浦东新区芳甸路1088号紫竹国际大厦16楼（201204）

联系人：王婧一

联系电话：021-2032 9736

请在信封表面注明“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表决专用”。

二、会议审议事项

《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》（以下简称“《议案》”），详见附件1。

上述议案的内容说明请参见附件4：《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说明》。

三、基金份额持有人的权益登记日

本次大会的权益登记日为2019年4月11日，即2019年4月11日当日交易时间结束后在本基金登记机构登记在册的本基金全体基金份额持有人均有权参与本次基金份额持有人大会。

四、不同参会人所需寄送的材料

根据基金份额持有人是直接出具表决意见还是委托代理人出具表决意见，参会人可以分为直接出具表决意见的基金份额持有人和委托代表基金份额持有人出具表决意见的代理人（受托人），两类参会人参与投票表决所需寄送的材料见下表：

| 参会人类型 | 所需寄送材料 |
|---|---|
| 直接出具表决意见的基金份额持有人 | 1、表决票原件：<br>表决票的填写及要求见下文“五、表决票的填写”，表决票样本见附件2。<br>2、个人基金份额持有人的有效身份证件复印件（正反面），机构基金份额持有人的营业执照复印件（加盖公章）<br>（1）身份证件或营业执照等有效证件仅指基金份额持有人认购、申购本基金时所使用的相应证件。同一基金份额持有人如使用不同证件开立多个基金账户，需要按不同账户分开行使表决权，并分别提供各账户对应的相关证件复印件（加盖公章）；<br>（2）事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书等的复印件（加盖公章）。 |
| 受托代表基金份额持有人出具表决意见的代理人（受托人） | 1、表决票原件：<br>表决票的填写及要求见下文“五、表决票的填写”，表决票样本见附件2。<br>2、授权委托书原件：<br>授权委托书的办理见下文“六、授权”，授权委托书样本见附件3。<br>3、个人基金份额持有人（委托人）的身份证件复印件（正反面），机构基金份额持有人（委托人）的营业执照复印件（加盖公章）；<br>（1）身份证件或营业执照等有效证件仅指基金份额持有人认购、申购本基金时所使用的相应证件。同一基金份额持有人如若使用不同证件开立多个基金账户，需要按不同账户分开行使表决权，并分别提供各账户对应的相关证件复印件（加盖公章）；<br>（2）事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书等的复印件（加盖公章）。<br>4、个人代理人（受托人）的有效身份证件复印件（正反面），机构代理人（受托人）的营业执照复印件（加盖公章）<br>事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书等的复印件（加盖公章）。 |

以上各项及本公告正文全文中的公章、批文、开户证明及登记证书等，以基金管理人的认可为准。

五、表决票的填写

（一）本次大会仅接受纸质投票，表决票样式见附件2。

1、参会人可从2019年4月8日《中国证券报》上剪裁、复印表决票；

2、参会人也可登录本基金管理人网站（www.changanfunds.com）下载并打印表决票。

（二）参会人应当按照要求填写表决票相关内容

1、表决票须按照表决票上的要求填写，完整、清晰，否则可能影响表决票的效力；

2、个人参会人投票的，需在表决票上签字；机构参会人投票的，需在表决票上加盖本单位公章或经授权的业务公章（以下合称“公章”）。

六、授权

为便于基金份额持有人参加本次大会，除直接投票外，基金份额持有人还可以委托代理人代其行使表决权。根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，基金份额持有人委托代理人在基金份额持有人大会上表决的，需符合以下规则：

（一）委托人

本基金的基金份额持有人可按下述“（三）授权方式”列明的方式授权委托他人代理行使本次基金份额持有人大会的表决权。

基金份额持有人授权委托他人代理行使表决权的票数按该基金份额持有人在权益登记日所持有的基金份额数计算，每一份基金份额享有一票表决权，如基金份额持有人在权益登记日未持有本基金基金份额，则授权无效。基金份额持有人在权益登记日是否持有本基金基金份额以及所持有的基金份额数额以本基金登记机构的数据为准。

（二）代理人（受托人）

基金份额持有人可以授权委托本基金的基金管理人以及其他符合法律法规规定的机构或个人，代理行使本次基金份额持有人大会的表决权。为保证基金份额持有人有效行使权利，建议基金份额持有人选择本基金的基金管理人为代理人（受托人）。

本基金管理人可以根据有关情况向基金份额持有人建议增加代理人（受托人）名单，并另行公告。

（三）授权方式

本基金的基金份额持有人可通过纸质、短信以及法律法规和中国证监会认可的其他方式进行授权，授权方式及程序应符合以下规定：

1、纸质授权

（1）基金份额持有人通过纸质方式授权的，需填写授权委托书（授权委托书样式见附件3）。

基金份额持有人可通过剪报、复印或登录本基金管理人网站（www.changanfunds.com）下载等方式获取授权委托书。

（2）基金份额持有人需根据授权委托书的要求完整、准确、清晰填写授权委托书。

（3）委托人和代理人（受托人）需在授权委托书指定位置签章。

（4）基金份额持有人也可在会议召开前到本基金管理人柜台办理授权，填写授权委托书，并提交身份证明文件。具体地址及联系方式如下：

基金管理人名称：长安基金管理有限公司

地址：上海市浦东新区芳甸路1088号紫竹国际大厦16楼（201204）

联系人：王婧一

联系电话：021-2032 9736

2、短信授权（仅适用于个人基金份额持有人）

为方便个人基金份额持有人参与大会，本基金管理人可以通过短信平台向预留有效手机号码的个人基金份额持有人发送授权征集短信，基金份额持有人可回复短信表明授权意见。短信授权的代理人（受托人）仅为本基金基金管理人。

（四）授权效力确定规则

1、直接表决优先规则

如果基金份额持有人进行了授权委托，后又送达了有效表决票的，则以自身有效表决票为准，授权委托无效。

2、纸质优先规则

如果同一基金份额持有人通过纸质及其他多种方式进行了有效授权，不论授权时间先后，均以有效的纸质授权为准。

3、最后授权优先规则

如果同一基金份额持有人在不同时间多次通过同一种方式或纸质以外的其他不同方式进行有效授权，无论授权意见是否相同，均以最后一次授权为准。

（五）授权时间的确定

如基金份额持有人通过纸质方式进行授权，授权时间以本基金管理人收到授权委托书的时间为准。如基金份额持有人通过非纸质方式进行授权，授权时间以系统记录时间为准。

如果授权时间相同但授权意见不一致，视为委托人授权代理人（受托人）选择一种表决意见进行表决。

（六）授权截止时间

本基金管理人接受基金份额持有人授权的截止时间为2019年5月7日17:00。

七、计票

（一）本次通讯会议的计票方式为：本公告通知的表决截止日后第一个工作日，即2019年5月8日，由本基金管理人授权的两名监督员在基金托管人上海浦东发展银行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。如基金托管人经通知但拒绝派代表到场监督，不影响计票和表决结果。

（二）基金份额持有人所持每一份基金份额享有一票表决权。

（三）表决票效力的认定如下：

1、表决票填写完整、清晰，所提供文件符合本公告规定，且在规定时间之内送达指定联系地址的，为有效表决票；有效表决票按表决意见计入相应的表决结果，其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

2、如表决票上的表决意见未选、多选或无法辨认、涂抹、表决意见模糊不清或相互矛盾，但其他各项符合本公告规定的，视为弃权表决，计入有效表决票；并按“弃权”计入对应的表决结果，其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

3、如表决票上的签字或盖章部分填写不完整、不清晰的，或未能提供有效证明基金份额持有人身份或代理人（受托人）经有效授权的证明文件的，或未能在截止时间之前送达指定联系地址的，均为无效表决票；无效表决票不计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

4、基金份额持有人重复提交表决票的，如各表决票表决意见相同，则视为同一表决票；如各表决票表决意见不相同，则按如下原则处理：

（1）送达时间不是同一天的，以最后送达的填写有效的表决票为准，先送达的表决票视为被撤回；

（2）送达时间为同一天的，视为在同一表决票上做出了不同表决意见，计入弃权表决票，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；

（3）送达时间按如下原则确定：专人送达的以实际递交时间为准，快递或邮寄的以基金管理人指定收件人收到的时间为准。

八、决议生效条件

（一）本人直接出具书面表决意见和授权他人代表出具书面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）；

（二）《议案》应当由提交有效表决票的基金份额持有人或其代理人（受托人）所持表决权的三分之二以上（含三分之二）同意，则视为表决通过，形成的大会决议有效；

（三）本次基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。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。

基金份额持有人大会的决议，本基金管理人自决议生效之日起5日内报中国证监会备案，自决议生效之日起2个工作日内在指定媒介上公告。

九、二次召集基金份额持有人大会及二次授权

根据《基金法》的规定，本次基金份额持有人大会需要有效表决票所代表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）方可举行。如果本次基金份额持有人大会不符合前述要求而不能够成功召开，基金管理人可在本次公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内就同一议案重新召集基金份额持有人大会，但权益登记日仍为2019年4月11日。

重新召开基金份额持有人大会时，除非授权文件另有载明，本次基金份额持有人大会授权期间基金份额持有人做出的各类授权依然有效，但如果授权方式发生变化或者基金份额持有人重新做出授权，则以最新方式或最新授权为准，详细说明见届时发布的重新召集基金份额持有人大会的通知。

十、本次大会相关机构

（一）召集人、基金管理人：长安基金管理有限公司

基金份额持有人大会专线/客服电话：400 820 9688

联系人：吴昱

传真：021-5059 8018

网址：www.changanfunds.com

电子邮件：service@changanfunds.com

（二）基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

（三）公证机关：上海市东方公证处

地址：上海市凤阳路660号

联系人：吴晓烨

联系电话：021-6215 4848

（四）见证律师事务所：上海市通力律师事务所

十一、重要提示

（一）请基金份额持有人或代理人（受托人）在邮寄表决票时，充分考虑邮寄在途时间，提前寄出表决票，确保表决票于表决截止时间前送达。

（二）基金管理人将在发布本公告后2个工作日内连续发布相关提示性公告，就本次基金份额持有人大会相关情况做必要说明，请予以留意。

（三）若本次基金份额持有人大会审议的转型事项获表决通过并生效，则本基金基金合同将按照决议内容进行修订，本基金基金份额将转型为长安泓沣中短债债券型证券投资基金基金份额。

（四）基金份额持有人或代理人（受托人）可通过本基金管理人网站或拨打本基金管理人客户服务电话（400-820-9688）了解本次基金份额持有人大会相关事宜。

（五）如本次基金份额持有人大会不能成功召集，根据《基金法》的有关规定，本基金可能会重新召集基金份额持有人大会。

（六）本公告的内容由本基金基金管理人负责解释。

特此公告。

附件：

1、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

2、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表决票

3、授权委托书

4、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说明

长安基金管理有限公司

二〇一九年四月八日

**附件1：**

**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**

长安鑫垚主题轮动混合型证券投资基金基金份额持有人：

为顺应市场环境的变化，更好满足投资者需求，维护基金份额持有人利益，根据《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》和《长安鑫垚主题轮动混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，长安鑫垚主题轮动混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金管理人长安基金管理有限公司与基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司协商一致，决定召开本基金的基金份额持有人大会，审议本基金转型为“长安泓沣中短债债券型证券投资基金”，并修改《基金合同》的有关事项，包括修改基金名称、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、基金的投资目标、投资范围、投资策略、投资比例限制、业绩比较基准、估值方法、基金费用等条款，具体修改内容详见附件4：《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说明》。

为实施本基金的转型，特提议投权基金管理人办理本次基金转型及《基金合同》修改的相关具体事宜，包括但不限于根据市场情况确定转型的具体时间和方式，根据现实有效的法律法规的规定和《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说明》对《基金合同》进行必要的修改和补充，并相应更新托管协议、招募说明书；提议授权基金管理人在转型实施日前制订有关基金转型实施前的申购赎回安排等事项的转型实施安排规则并提前公告。

以上议案，请予审议。

长安基金管理有限公司

二〇一九年四月八日

**附件2：**

**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表决票**

| | | | |
|---|---|---|---|
| 基金份额持有人姓名或名称： | | | |
| 基金份额持有人证件号码：（身份证件号/营业执照号） | | | |
| 基金账户号： | | | |
| 代理人（受托人）姓名或名称： | | | |
| 代理人（受托人）证件号码：（身份证件号/营业执照号） | | | |
| 审议事项 | 同意 | 反对 | 弃权 |
| 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 | | | |
| 基金份额持有人/代理人（受托人）签名或盖章：<br>年 月 日 | | | |

说明：

1、请以打“√”方式在审议事项后注明表决意见；必须选择一种且只能选择一种表决意见；

2、表决票填写完整、清晰，所提供文件符合本公告规定，且在截止时间之前送达指定联系地址的，为有效表决票；如表决票上的表决意见未选、多选或无法辨认、涂抹、表决意见模糊不清或相互矛盾，但其他各项符合会议通知规定的，视为弃权表决，计入有效表决票，并按“弃权”计入对应的表决结果，其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数；如表决票上的签字或盖章部分填写不完整、不清晰的，或未能提供有效证明基金份额持有人身份或受托人经有效授权的证明文件的，或未能在截止时间之前送达指定联系地址的，均为无效表决票；

3、表决票中“证件号码”，仅指基金份额持有人认购、申购本基金时所使用的证件号码或该证件号码的更新；

4、表决票中“基金账户号”，仅指持有本基金基金份额的基金账户号，同一基金份额持有人拥有多个此类账户且需要按照不同账户持有基金份额分别授权的，应当填写基金账户号；其他情况可不必填写。此处出现不填、多填、错填、无法识别等情况的，将被默认为代表此基金份额持有人所持有的本基金所有基金份额。

（本表决票可剪报、复印或登录本基金管理人网站www.changanfunds.com下载并打印，在填写完整并签字盖章后均为有效。）

**附件3：**

**授权委托书**

本人（或本机构）持有长安鑫垚主题轮动混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金份额，就长安基金管理有限公司官网（www.changanfunds.com）及《中国证券报》上公布的关于召开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转型有关事项的公告所述需基金份额持有人大会审议的事项，本人/本机构的意见为（请在意见栏下方划“√”）：

| 同意 | 反对 | 弃权 |
|---|---|---|
| | | |

本人（或本机构）特此委托 先生／女士或 （机构）代表本人（或本机构）参加长安鑫垚主题轮动混合型证券投资基金的基金份额持有人大会，并按照上述意见行使表决权。本人/本机构同意代理人（受托人）转授权，转授权仅限一次。

上述授权有效期自签署日起至审议上述事项的基金份额持有人大会会议结束之日止。若本基金重新召开审议相同议案的基金份额持有人大会的，以最多两次重新召开基金份额持有人大会为限，本授权继续有效。

委托人（签字/盖章）：

委托人证件号码：

委托人基金账户号：

代理人（受托人）（签字/盖章）：

代理人（受托人）证件号码：

委托日期： 年 月 日

授权委托书填写注意事项：

1、此授权委托书剪报、复印或按以上格式自制，在填写完整并签字盖章后均为有效。

2、基金份额持有人可以委托本基金的基金管理人、基金托管人以及其他符合法律规定的机构和个人，代为行使本次基金份额持有人大会的表决权。

3、如委托人未在授权委托书中明确其表决意见的，视为委托人授权代理人（受托人）按照代理人（受托人）的意志行使表决权；如委托人在授权委托书中表达多种表决意见的，视为委托人授权代理人（受托人）选择其中一种行使表决权。

4、本授权委托书中“委托人证件号码”，指委托人认购或申购本基金时的证件号码或该证件号码的更新。

5、“基金账户号”，仅指持有本基金基金份额的基金账户号，同一基金份额持有人拥有多个此类账户且需要按照不同账户持有基金份额分别授权的，应当填写基金账户号；其他情况可不必填写。此处不填、多填、错填、无法识别等情况的，将被默认为代表此基金份额持有人所持有的本基金所有基金份额。

6、委托人权益登记日未持有本基金基金份额的，则其授权无效。

7、代理人（受托人）的表决意见代表委托人本基金账户下全部基金份额的表决意见。

**附件4：**

**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说明**

一、声明

（一）长安鑫垚主题轮动混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）基金合同于2017年8月9日生效。为顺应市场环境的变化，更好满足投资者需求，维护基金份额持有人利益，根据《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》和《长安鑫垚主题轮动混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）等有关规定，本基金管理人长安基金管理有限公司经与基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司协商一致，决定召开基金份额持有人大会，审议《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》。

（二）本基金本次转型事项属对原注册事项的实质性调整，经基金管理人向中国证监会申请，中国证监会已准予变更注册。

中国证监会对本基金本次变更注册所作的任何决定或意见，均不表明其对本基金或变更注册后基金的投资价值、市场前景或者投资人的收益等作出实质性判断或者保证。

（三）基金份额持有人大会的决议，本基金管理人自通过之日起5日内报中国证监会备案，基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。

（四）本基金本次转型事项须经参加本次基金份额持有人大会的基金份额持有人或其代理人（受托人）所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过，存在无法获得基金份额持有人大会表决通过的可能。

二、本基金本次转型的主要方案要点

（一）变更基金名称

基金名称由“长安鑫垚主题轮动混合型证券投资基金”变更为“长安泓沣中短债债券型证券投资基金”。

（二）变更后基金的基本情况

1、基金的类别：债券型

2、基金的运作方式：契约型开放式

3、基金的投资目标：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。

4、基金存续期限：不定期

（三）变更后基金的“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。

（四）变更后基金的“投资范围、投资策略、投资限制、业绩比较基准、风险收益特征”等投资相关条款

1、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。

2、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。

3、投资限制

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本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。

4、业绩比较基准

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%

5、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。

（五）变更后基金的“基金资产估值方法”

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。

（六）变更后基金的费率水平

1、基金管理费率：0.40%

2、申购费率：

申购本基金C类基金份额不需要支付申购费用。本基金A类基金份额的申购费率如下：

| 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 |

3、赎回费率：

本基金A类基金份额和C类基金份额按照相同的赎回费率收取赎回费用。

赎回费率如下：

| 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% |

（七）授权基金管理人修改基金合同

除上述主要内容的调整需要修改基金合同以外，基金管理人需要根据现行有效的法律法规要求及变更后的长安泓沣中短债债券型证券投资基金的产品特征修订基金合同的相关内容，基金管理人提请基金份额持有人大会授权基金管理人修订基金合同。

（八）《长安泓沣中短债债券型证券投资基金基金合同》的生效

根据基金份额持有人大会的决议，基金管理人将决定《长安泓沣中短债债券型证券投资基金基金合同》的生效日，具体时间详见基金管理人届时发布的相关公告。

综上所述，基金管理人拟提请基金份额持有人大会，授权基金管理人按照现行有效的法律法规的规定及《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》的方案要点修订基金合同并实施转型。

三、基金转型的可行性

（一）法律可行性

《基金法》第四十七条规定，“基金份额持有人大会由全体基金份额持有人组成，行使下列职权：……（二）决定修改基金合同的重要内容……”。

《基金法》第八十六条规定，“……基金份额持有人大会就审议事项作出决定，应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的二分之一以上通过；但是，转换基金的运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、提前终止基金合同、与其他基金合并，应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上通过。基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报国务院证券监督管理机构备案，并予以公告。”

《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十八条规定，“……基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效。……”

本次基金份额持有人大会决议属于特别决议，经参加大会的基金份额持有人和代理人（受托人）所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过，决议即可生效。

因此，本基金转型不存在法律方面的障碍。

（二）技术可行性

本基金转型为“长安泓沣中短债债券型证券投资基金”后，在技术系统、投资运作上与基金管理人管理的其他同类型基金无明显差异，因此不存在技术障碍。

四、基金转型的主要风险及预备措施

（一）基金份额持有人大会未达到召开条件或议案被否决的风险

该风险是指参会人所代表的基金份额不到权益登记日基金总份额的二分之一而导致基金份额持有人大会未达到召开条件，或者议案未经参加大会的基金份额持有人或其代理人（受托人）所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过而导致议案被否决。

为防范该风险，在确定具体方案前，基金管理人已与主要基金份额持有人进行了沟通，认真听取了基金份额持有人意见。议案公告后，基金管理人将再次征询基金份额持有人意见，如有必要，基金管理人将根据基金份额持有人意见，对方案进行适当修订并重新公告。基金管理人可在必要情况下预留足够时间，以做二次召开或推迟召开基金份额持有人大会的充分准备。

如果本议案未获得基金份额持有人大会通过，基金管理人计划在规定时间内，按照有关规定重新召集基金份额持有人大会审议本议案。

（二）基金转型前后遭遇大规模赎回的流动性风险

在召开会议通知公告后，基金份额持有人可能选择赎回其持有的基金份额。为应对基金转型可能引发的大规模赎回，本基金将尽可能提前做好流动性安排，保持投资组合的流动性，降低净值波动率。

（三）预防基金合同修改后基金运作过程中的相关运作风险

基金管理人将提前做好流程、系统和人员等各项准备，避免基金合同修改后基金运作过程中出现相关操作风险、管理风险等运作风险。

附件：《长安鑫垚主题轮动混合型证券投资基金基金合同》与《长安泓沣中短债债券型证券投资基金基金合同》修改前后对照表

**附件：**

**《长安鑫垚主题轮动混合型证券投资基金基金合同》与《长安泓沣中短债债券型证券投资基金基金合同》修改前后对照表**

| 章节 | 《长安鑫垚主题轮动混合型证券投资基金基金合同》内容 | 《长安泓沣中短债债券型证券投资基金基金合同》内容 |
|---|---|---|
| 全文 | 长安鑫垚主题轮动混合型证券投资基金 | 长安泓沣中短债债券型证券投资基金 |
| 全文 | 认购 | |
| 全文 | 期货 | |
| 第一部分 前言 | 三、长安鑫垚主题轮动混合型证券投资基金由基金管理人依照《基金法》、基金合同及其他有关规定募集，并经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）注册。<br>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。<br>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，但不保证投资于本基金一定盈利，也不保证最低收益。<br>投资人应当认真阅读基金合同、基金招募说明书等信息披露文件，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。 | 三、长安泓沣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，并经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）准予变更注册。长安鑫垚主题轮动混合型证券投资基金经中国证监会注册，由基金管理人依照《基金法》、《长安鑫垚主题轮动混合型证券投资基金基