

B100 信息披露 Disclosure

基金管理人：汇安基金管理有限责任公司
基金托管人：中国农业银行股份有限公司
二零二零年四月
【重要提示】

1. 汇安中短债债券型证券投资基金(以下简称“基金”或“本基金”)由汇安价值精选灵活配置混合型证券投资基金变更注册而来。汇安价值精选灵活配置混合型证券投资基金的募集申请经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)2018年1月3日证监许可[2018]18号文注册。本基金根据2019年3月26日中国证监会《关于准予汇安价值精选灵活配置混合型证券投资基金变更注册的批复》(证监许可[2019]484号)进行募集。本基金合同已于2019年09月17日生效。

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、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,全面认识本基金产品的风险收益特征,充分考虑投资者自身的风险承受能力,并对认购(或申购)基金的意见、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,由投资者自行承担。

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,并承担本基金投资中出现的各类风险,包括:市场风险、信用风险、操作风险、管理风险、合规风险、本基金的特定风险、流动性风险,基金管理人职责终止风险、其他风险等等。

本基金投资资产支持证券,资产支持证券(ABS)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。

5. 本基金为债券型基金,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. 本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、央行票据、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、中期票据,债券回购,银行存款,同业存单等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的其他品种,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:

本基金投资于债券资产比例不低于基金资产的80%,其中投资于中短债型证券的比例不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终本基金持有的现金或者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、存出保证金及应收申购款等。

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,包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、央行票据、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、中期票据。

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会低于初始面值,本基金投资者有可能出现亏损。

9. 基金的投资业绩并不预示其未来表现,基金管理人管理的其他基金的成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。

12. 本招募说明书关于基金产品资料概要的编制、披露及更新等内容,将不晚于2020年9月1日起执行。

13. 根据法规要求,本基金管理人于2020年4月30日对招募说明书“第三部分基金管理人”、“第六部分基金的募集”及“第七部分基金合同生效”的内容进行了更新。

第一部分基金管理人
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: 何斌(代行职务)
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: 赵庆芳
存续期间: 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。22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。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董事长。
戴樱女士,董事。5年证券、基金行业从业经验,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;上海德琦干燥剂有限公司,任公司董事;上海上贝资产管理有限公司合伙人。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金融机构部总经理。
刘强先生,董事。5年证券、基金行业从业经验,美国注册管理会计师(CMA),东北财经大学审计(会计学)专业。历任阿尔卡特别刺公司财务总监,霍尼韦尔深圳公司财务总监,阿特莱斯(中国)财务及信息技术总监,北京国际正阳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。
李海涛先生,独立董事。美国耶鲁大学管理学院金融学博士。曾任密西根大学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。
余剑峰先生,独立董事。2008年毕业于美国宾夕法尼亚大学沃顿商学院,金融学博士,教授职称。曾于2014秋任清华大学五道口金融学院访问教授;2015年至2017年任香港中文大学(深圳)经管学院金融学教授,执行副院长;2008年至2016年明尼苏达大学卡尔森管理学院金融系助理教授、副教授(终身教职)、正教授,Piper Jaffray讲席教授;2016年至今任清华大学五道口金融学院建图讲席教授;2017年至今任清华大学国家金融研究院资产管理研究中心主任;2019年至今任清华大学金融科技研究院副院长。
黄磊先生,独立董事。中国人民大学经济学博士,教授。曾任山东财经大学金融学院院长,曾任山东省政协、山东省政府参事、山东省政协经济组召集人、山东省人大常委、山东省人大财经委员会委员;曾任教育部金融类专业教学指导委员会委员。现任山东财经大学教授委员会主任委员、山东财经大学学术委员会副主任委员、区域金融优化与管理协同创新中心(山东)主任。

2. 基金管理人监事
王丽女士,监事。6年证券、基金从业经验,毕业于中央财经大学会计学学士,2011年6月至2017年6月在北京居然之家投资控股股份有限公司集团总部以及其名下子公司担任财务经理,2017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综合管理部副总监(财务)。
3. 高级管理人员
何斌先生,董事长,代行总经理职务。(简历请参见董事会成员)
郭冬青先生,督察长。21年证券、基金从业经验。南开大学经济学硕士。历任中化集团财务部经理、广发证券投行部高级经理,华安证券投行部副总经理,大商集团副总经理,中航证券董事兼总经理,北京金鼎兴投资有限公司副总经理,2017年11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督察长。
罗强先生,副总经理。(简历请参见董事会成员)
郭兆强先生,副总经理。22年证券、基金从业经验,保荐代表人,北京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,从事投资理财银行业务。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监。
王骏波先生,副总经理。16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,嘉实基金商业业务部主管,兴业证券资产管理有限责任公司市场部执行董事。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监。
4. 本基金拟任基金经理
杨芳,经济学学士,9年证券、基金行业从业经历。曾任任职于华创证券,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2019年12月11日,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2019年10月14日,任汇安嘉纯债债券型证券投资基金基金经理;2018年2月7日至2019年12月11日,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2019年10月14日,任汇安稳裕债券型证券投资基金基金经理;2017年4月28日至至今,任汇安嘉源纯债债券型证券投资基金基金经理;2019年11月20日至至今,任汇安嘉鑫纯债债券型证券投资基金基金经理;2019年11月20日至至今,任汇安鼎利纯债债券型证券投资基金基金经理;2019年9月17日至至今,任汇安中短债债券型证券投资基金基金经理;2019年9月17日至至今,任汇安嘉盛纯债债券型证券投资基金基金经理;2020年3月20日至至今,任汇安裕和纯债债券型证券投资基金基金经理。
黄济宽先生,固定收益投资部高级投资经理。英国纽卡斯尔大学金融学硕士研究生,8年证券、基金行业从业经历,曾任西藏同信证券股份有限公司固定收益业务委员会产品管理总部投资主办人,新沃基金管理有限公司特定客户资产投资部投资经理,华创证券有限责任公司资产管理总部高级投资经理。2019年9月加入汇安基金管理有限责任公司,担任固定收益投资部 高级投资经理一职。2019年11月13日至至今,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;2019年12月11日至至今,任汇安嘉裕纯债债券型证券投资基金基金经理;2020年4月29日至至今,任汇安嘉源纯债债券型证券投资基金基金经理;2020年4月29日至至今,任汇安嘉盛纯债债券型证券投资基金基金经理;2020年4月29日至至今,任汇安裕和纯债债券型证券投资基金基金经理;2020年4月29日至至今,任汇安嘉鑫纯债债券型证券投资基金基金经理。
5. 投资决策委员会成员
何斌先生,董事长,代行总经理职务。(简历请参见董事会成员)
钟歌敏先生,固定收益首席投资官,25年银行、基金行业从业经验,硕士。2005年4月加入嘉实基金,先后任固定收益研究员、投资经理。2008年5月加入建信基金,先后任基金经理、投资部副总监、固定收益首席投资官、公司投资决策委员会委员、曾管理建信稳定增利、双息红利、安心保本等证券投资基金,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,现任固定收益首席投资官,董事总经理。
邹唯先生,首席投资官,20年证券、基金行业从业经历。理科硕士。历任长城证券有限公司研究所行业分析师,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、董事兼总经理。2017年12月1日加入汇安基金管理有限责任公司,现任首席投资官,董事总经理。
仇秉则先生,固定收益首席基金经理。CPA,CPA,中国人民大学经济学学士,14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,现任固定收益研究部副总监一职,从事信用债投资研究工作。
阎星华先生,常务副总经理。(简历请参见高级管理人成员)。
6. 上述人员之间均不存在近亲属关系。

第二部分基金托管人

一、基金托管人概况
本基金托管人为中国农业银行股份有限公司,基本信息如下: 名称: 中国农业银行股份有限公司 注册地址: 上海市中山东路12号 办公地址: 上海市山东路12号 法定代表人: 郭树 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;发放贷款;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;代理收付款项及代收代理保险业务;提供保险服务;外汇存款;外汇贷款;外汇汇款;外汇兑换;国际结算;网上银行汇兑;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: 胡波
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,2006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、内控管理处、业务保障处、总行资产托管运营中心(含合肥中心)五个职能部门。
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、私募基金投资资金托管、私募股权投资托管、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、第七招办主任处长;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产部总经理兼任城北办事处主任;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结构处处长;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工作党委委员,资产托管部总经理。

三、基金托管业务经营情况
截止2019年12月31日,上海浦东发展银行证券投资基金托管规模为6022.97亿元,比去年末增加42.96%。管理证券投资基金共一百八十六只,分为国策与行业精选基金、国泰金龙债券基金、天治财富增长基金、广发小盘成长基金、汇添富货币基金、长信金利趋势基金、嘉实优质企业基金、国联安货币基金、长信利众债券基金(LOF)、博时安丰18个月基金(LOF)、易方达裕丰回报基金、鹏华丰泰定期开放基金、汇添富双利增强债券基金、华富恒丰打债债券基金、汇添富和聚宝货币基金、工银目标收益一年定开债券基金、北信瑞丰宜债货币基金、中海医药健康产业基金、华富国泰民安灵活配置混合基金、安信动态策略灵活配置基金、东方红稳健精选基金、国联安鑫亨混合基金、长安鑫利优选混合基金、工银瑞信生态环境混合基金、天弘新价值混合基金、嘉实目标快线货币基金、鹏华REITs封闭式基金、华富健康文娱基金、金鹰改革红利基金、易方达裕祥回报债券基金、中银瑞利灵活配置混合基金、华夏新活灵活利基金、鑫元汇清货币基金、南方转型驱动灵活配置基金、银华远景债券基金、富安达长盈灵活配置混合型基金、中信建投睿溢混合型证券投资基金、工银瑞信恒享纯债基金、长信利发债券基金、博时景发纯债基金、鑫元得利债券型基金、东方红战略沪港深混合基金、博时富发纯债基金、博时利发纯债基金、银河君信混合基金、兴业一年定开债券基金、工银瑞信国瑞18个月定开债券基金、中信建投裕发纯债基金、招商招信纯债债券基金、中加丰年纯债债券基金、长安泓泽纯债债券基金、银华君耀灵活配置混合基金、广发汇瑞3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、汇安裕汇纯债债券基金、南方宣利定开债券基金、招商兴福灵活配置混合基金、博时鑫瑞灵活配置混合基金、兴业裕华债券基金、易方达瑞源灵活配置混合基金、招商招祥纯债债券基金、易方达瑞福混合基金、中欧骏泰货币基金、招商招华纯债基金、汇安丰融灵活配置混合基金、汇安嘉源纯债债券基金、国泰普安混合基金、汇添富鑫源债券基金、鑫元丰纯债券基金、博时惠鑫混合基金、国泰润利纯债基金、华安丰恒混合基金、景顺长城中债100指数基金、鹏华丰康债券基金、兴业安润货币基金、兴业瑞丰6个月定开债券基金、兴业裕丰债券基金、易方达瑞合混合基金、长安富顺灵活混合基金、万家现金增值货币基金、上银鑫增货币市场基金、易方达瑞盈灵活配置证券投资基金、博时富腾纯债债券型证券投资基金、安信工业4.0主题沪港深精选混合基金、万家天添货币基金、中欧添源债券型证券投资基金、中银证券安弘债券基金、鑫元鑫趋势灵活配置混合基金、泰康年年红纯债一年定期开放债券型基金、广发高端制造股票型发起式基金、永赢永益债券基金、南方安富混合基金、中银证券聚瑞混合基金、太平改革红利精选灵活配置混合基金、富荣富乾债券型证券投资基金、国联安灵活配置混合型证券投资基金、前海开源泉鑫灵活配置混合型证券投资基金、前海开源瑞鑫灵活配置混合型证券投资基金、中海沪港深多策略灵活配置混合型基金基金、中银证券祥瑞混合型证券投资基金、前海开源盛鑫灵活配置混合型证券投资基金、鑫元行业动力灵活配置混合型证券投资基金、兴业3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、富国顺利纯债债券型证券投资基金、华安安浦债券型证券投资基金、南方泽元债券型证券投资基金基金、鹏华淳利定期开放债券型证券投资基金基金、万家鑫悦纯债债券基金、新疆前海联合泓汰纯债债券型证券投资基金、永赢鑫益债券型证券投资基金、中加顺合纯债债券型证券投资基金、中信保诚稳达债券型证券投资基金、中银中债1-5年期农发行债券型证券投资基金、东方红核心优选一年定期开放混合型证券投资基金基金、平安惠睿纯债债券型证券投资基金、华夏鼎通债券型证券投资基金、鑫元元利债券型发起式证券投资基金基金、中融恒利纯债债券型证券投资基金、嘉实致富债券型证券投资基金、永赢消费主题灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信瑞福纯债债券型证券投资基金、广发景智纯债债券型证券投资基金、东兴品牌精选灵活配置混合型证券投资基金基金、广发中债1-3年国开债债券型证券投资基金基金、融通通捷债券型证券投资基金基金、华富恒盛纯债债券型证券投资基金基金、建信中证1000指数增强型发起式证券投资基金基金、汇安嘉泰纯债债券型证券投资基金基金、建信中证1000指数增强型发起式证券投资基金基金、海富通聚丰纯债债券型证券投资基金基金、博时中债1-3年政策性金融债债券型证券投资基金、银河河盈纯债债券型证券投资基金基金、博时宏亚纯债6个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金、南方畅利定期开放债券型发起式证券投资基金基金、中加瑞利纯债债券型证券投资基金基金、华富中证5年恒定久期国开债指数证券投资基金基金、永赢合信债券型证券投资基金基金、嘉实中债1-3年定期开放金融债债券型证券投资基金基金、广发港股通优质增长混合型证券投资基金基金、长安泓泽中短债债券型证券投资基金基金、中海信息产精选混合型证券投资基金基金、

民生加银恒裕债券型证券投资基金、国寿安保尊信信用纯债券型证券投资基金、平安惠泰纯债债券型证券投资基金基金、中信建投和中证债债券型证券投资基金基金、工银瑞信添泰债券型证券投资基金基金、华富安鑫债券型证券投资基金基金、汇添富中债1-3年农发行债券指数证券投资基金基金、南方旭元债券型发起式证券投资基金基金、大成中债3-5年国开债债券指数基金、永赢众利债券型证券投资基金基金、华夏中债3-5年政策性金融债指数证券投资基金基金、中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金基金、新疆前海联合科技先锋混合型证券投资基金基金、银华睿尚稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)、博时颐泽平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)、农银养老目标日期2035三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)、汇添富汇鑫浮动目标市场基金、泰康安欣纯债债券型证券投资基金基金、恒生前海港股通精选混合型证券投资基金基金、鹏华丰鑫债券型证券投资基金基金、中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金、汇添富保鑫靈活配置混合型证券投资基金基金、华富安兴39个月定期开放纯债债券型证券投资基金基金、中融睿享06个月定期开放债券型基金、南方梦元纯债债券型证券投资基金基金、鹏华淳扬债券型证券投资基金基金、华宝宝惠纯债39个月定期开放债券型证券投资基金基金、建信MSCI中国A股指数增强型证券投资基金基金、农银汇理金益债券型证券投资基金基金、博时稳欣39个月定期开放债券型证券投资基金基金、同泰慧择混合型证券投资基金基金、招商中证红利交易型开放式指数证券投资基金基金、嘉实致禄3个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金、永赢久利债券型证券投资基金基金、嘉实安元39个月定期开放纯债债券型证券投资基金基金、交银施罗德裕泰两年定期开放债券型证券投资基金基金、长城鑫鑫两年定期开放债券型证券投资基金基金、建信宏禧一年定期开放债券型证券投资基金基金、鹏扬淳开债券型证券投资基金基金、平安惠合纯债债券型证券投资基金基金、工银瑞信添深100交易型开放式指数证券投资基金基金、鹏华0-5年利率债债券型发起式证券投资基金基金、景顺长城泓利39个月定期开放债券型证券投资基金基金、工银瑞信泰麒三年定期开放债券型证券投资基金基金等。

四、基金托管人的内部控制制度

1. 基金托管人内部控制目标: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相关基金托管人规章制度,形成守法经营、规范运作的经营思想,确保经营业务的健康运行,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. 基金托管人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。总行风险控制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控制工作。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. 内部控制措施及措施:基金托管人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环节组织结构和岗位及人员。内部控制以防范风险、合规经营为出发点,各项业务流程嵌入“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,使内控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范,员工职业道德和合规、业务数据备份和保密等在内的各项业务管理制度;建立严格完善的风险隔离和防范机制,托管资产与托管资产及不同托管资产之间实行独立运作,分别核算;对各项突发事件或故障,建立完备有效的应急预案,定期组织交叉演练,制定重大事项应急预案,并在基金运作办公区域建立安全监控系统,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检查,通过专项/全面审计等手段实施业务自查,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)《证券投资基金销售管理办法》;
- (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

基金托管人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. 监督报告的处理方式

(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管报告等。不定期报告包括提示函、临时报告、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。在规定期限内基金管理人再对基金管理人违规事项进行复查,如果基金管理人对违规事项未予纠正,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。

第三部分相关服务机构

一、基金份额发售机构
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@huanfund.cn
地址:上海市虹口区东大名路501号上海白玉兰广场36层02单元
联系人:于黎明
电话:021-80219027
2.其他销售机构
(1)中国农业银行股份有限公司
法定代表人: 周慕冰
客服电话:96599
网址: http://www.abchina.com/
二、登记机构
名称: 汇安基金管理有限责任公司
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: 何斌(代行职务)
电话: 010-56711600
传真: 010-56711640
联系人: 刚晨升
三、出具法律意见书的律师事务所
名称: 上海源泰律师事务所
注册地址: 上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦1405室
办公地址: 上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦1405室
负责人: 廖海
电话: 021-51150298
传真: 021-51150398
联系人: 刘佳
经办律师: 刘佳、徐等
四、审计基金财产的会计师事务所
名称: 普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
住所: 上海市浦东新区陆家嘴环路1318号普华永道中心11楼
办公地址: 上海市黄浦区湖滨路202号普华永道中心大厦
执行事务合伙人: 李丹
联系电话: 021-23238898
传真电话: 021-23238800
联系人: 沈兆杰
经办注册会计师: 薛竟、沈兆杰

第四部分基金的名称

汇安中短债债券型证券投资基金

第五部分基金的类型

债券型证券投资基金

第六部分基金的投资目标

本基金在严格控制投资组合风险和保持良好流动性的前提下,力争长期内实现超越业绩比较基准的投资回报。

第七部分基金的投资方向

本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、央行票据、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、中期票据,债券回购,银行存款,同业存单等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的其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为: 本基金投资于债券资产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%。每个交易日日终本基金持有的现金或者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、存出保证金及应收申购款等。

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,包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、央行票据、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、中期票据。

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。
第八部分基金的投资策略
(一) 债券投资策略
在进行债券投资时,本基金将会考量利率预期策略、信用债券投资策略等,选择合适时机投资于低估的债券品种,通过积极主动管理,获得超额收益。
1. 利率策略
本基金通过全面研究GDP、物价、就业以及国际收支等主要经济变量,分析宏观经济运行的可能情景,并预测财政政策、货币政策等宏观经济政策取向,分析金融市场资金供求状况变化趋势及结构。在此基础上,预测金融市场利率水平变动趋势,以及金融市场收益率曲线斜率变化趋势。
组合久期是反映利率风险最重要的指标。本基金将根据对市场利率变化趋势的预期,制定出组合的久期目标:预期市场利率水平将上升时,降低组合的久期;预期市场利率将下降时,提高组合的久期。
2. 信用债券投资策略
根据国民经济运行周期阶段,分析企业债券、公司债券等发行人所处行业发展前景、业务发展前景、市场竞争地位、财务状况、管理水平 and 债务水平等因素,评价债券发行人的信用风险,并根据特定债券的发行契约,评价债券的信用级别,确定企业债券、公司债券的信用风险利差。
债券信用风险评价需要重点分析企业财务结构、偿债能力、经营效益等财务信息,同时需要考虑企业的经营环境等外部因素,着重分析企业未来的偿债能力,评估其违约风险水平。
3. 信用策略
信用品种的筛选采取以利率研究和发行人偿债能力研究为核心的分析方法,在对宏观经济、利率走势、发行人经营及财务状况进行分析的基础上,结合信用品种的发行条款,建立信用债备选库,并以此为基础拟定信用品种的投资方法。

(1)宏观环境和行业分析

主要关注宏观经济状况和经济增长速度、宏观经济政策及法律制度对企业信用级别的影响;行业分析主要关注企业所处的行业类型(成长型、周期型、防御型)、产业链结构及行业在产业链中的位置、行业的竞争程度和行业政策对企业信用级别的影响。

(2)发债主体基本面分析

主要包括定性分析和定量分析两个方面:

定性分析主要包括对企业性质和内部治理情况、企业财务管理的风格、企业的盈利模式、企业在产业链中的位置、产品竞争力和核心优势的分析,以及企业的盈利背景、政府对企业的支持、银企关系、企业对国家或地方重要程度等企业的外部支持分析。

定量分析主要包括资本结构分析、现金获取能力分析、盈利能力分析及偿债能力分析四部分,定量分析的重点是选取适当的财务指标并挖掘其中蕴含的深层含义及互动关系,定量地实现企业信用水平的区分和预测。

(二) 资产支持证券投资策略

本基金将分析资产支持证券的资产特征,估计违约率和提前偿付率,并利用收益率曲线和期权定价模型,对资产支持证券进行估值。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资,以降低流动性风险。

第九部分基金业绩比较基准

中债总财富(1-3年)指数收益率*80%+一年定期存款利率(税后)*20%

第十部分基金的风险收益特征

本基金为债券型基金,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。

第十一部分基金的费用概况

一、申购费与赎回费

本基金A类基金份额在申购时收取基金申购费用。C类、E类基金份额不收取申购费用,但从本类别基金资产中计提销售服务费。

本基金A类基金份额对申购设置级差费率,申购费率随申购金额的增加而递减,投资人在一天之内如果有多笔申购,适用费率按单笔分别计算。费率表如下:

申购金额(M)	申购费率
M<100万	0.30%
100万≤M<200万	0.20%
200万≤M<500万	0.10%
M≥500万	按笔收取,1,000元笔

2. 赎回费用

本基金的A类基金份额、C类基金份额、E类基金份额的赎回费率按基金份额持有期限递减,赎回费率见下表:

持有期限(Y)	A、C、E类基金份额赎回费率
Y<7天	15.0%
7天≤Y<30天	0.05%
Y≥30天	0%

本基金的赎回费用由赎回基金份额的各类基金份额持有人承担,在基金份额持有人赎回