

汇安鼎利纯债债券型证券投资基金招募说明书(更新)摘要

2020年5月

基金管理人:汇安基金管理有限责任公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
二零二〇年五月

【重要提示】

1、本基金根据2018年9月6日中国证监会管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于准予汇安鼎利纯债债券型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2018]1423号)进行募集。本基金合同于2019年3月20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,也不表示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)基金的意愿、时机、数量及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,基金营运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价格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项风险,包括:因政策、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、个别特征特别的非系统性风险、基金管理人在基金管理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进行的债券。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。当发行体信用质量恶化时,资产流动性所限,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(ABS)是一种债券性质的金融工具,其向投

截至2018年12月,中国工商银行资产托管部共有员工202人,平均年龄33岁,95%以上员工拥有大学本科以上学历,高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

3.基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者,中国工商银行自1998年在国内首家提供托管服务以来,秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨,依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、先进的运营系统和专业的服务团队,严格履行资产托管人职责,为境内外广大投资者、金融监管机构和企业客户提升安全、高效、专业的托管服务,展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线,拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、基本养老保险、企业年金基金、QFII资产、ODI资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII专户资产、ESCRW等门类齐全的托管产品体系,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)基金的意愿、时机、数量及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,基金营运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价格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项风险,包括:因政策、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、个别特征特别的非系统性风险、基金管理人在基金管理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进行的债券。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。当发行体信用质量恶化时,资产流动性所限,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(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,资产支持证券不对某一经营实体的盈利承担责任,而是对基础资产池所产生的现金流量和剩余权益的受偿权,是一种以资产收益为支撑的证券,所面临的风险主要包括交易结构风险、各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风险等。

本基金拟投资避险证券,避险证券投资说明书由上市公司证券发行管理办法规定的可交

易证券,不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券,已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。本基金可能由于持有流受限证券而面临流动性风险以及流受限期间证券价格大幅下跌的风险。

5.本基金为偏债型基金,避险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.本基金的资产范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市交易的债券,包括(国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府机构债券、地方政府债券、中小企业私募债、可分离交易可转债中的纯债部分),资产支持证券、回购交易(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具、国债期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但需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,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),可分离债券。

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:本基金对债券的投资比例不低于基金资产的90%,每个交易日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券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。

8.本基金的最低募集金额为人民币1亿元。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,基金投资者可能因此出现亏损。

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一级份额不得超过基金份额总额的50%,但在基金运作过程中因基金份额赎回等形式导致超过前述50%比例的除外。

12.根据法规要求,本基金管理人于2020年4月28日对招募说明书“第三部分基金管理人”中“二、主要成员情况”的“4.本基金基金经理”的内容进行了更新,其余所载内容截止日至2020年2月29日,有关财务数据和净值表现截止日至2019年12月31日(财务数据未经审计)。本招募说明书已经基金托管人复核。

一、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

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13层

法定代表人:何剑(代行职务)

成立时间:2016年4月26日

注册资本:1亿元人民币

存续期限:持续经营

联系人:赵庆玲

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

何进先生,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,先后就职于北京银监局,北京京都会计师事务所,中国证监会监督委员会基金监管部,曾担任国泰基金管理公司副经理,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公司董事长。

戴霞女士,董事,5年证券、基金行业从业经验。2004年毕业子上海对外贸易学院,国际贸易专业学士学位。曾就职于上海贝斯阿尔卡特股份有限公司,任采购经理助理、上海樱干干燥剂有限公司,任公司董事;上海贝斯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公司,任公司董事;上海贝斯资产管理有限公司金融机部门经理。

刘强先生,董事,3年证券、基金行业从业经验,美国注册会计师(CPA),东北财经大学会计学学士,2015年至2016年任香港恒生大学工商管理学院金融系讲师,2016年4月加入汇安基金管理有限公司,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博士,曾任山西潞安矿业集团有限公司金融学院教授、校长江商学院金融学访问学者,现任长江商学院院长及杰出讲师。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,教授授课,曾任5年证券、基金行业从业经验,美国注册会计师(CPA),东北财经大学金融学院教授、长江商学院金融学访问学者,现任长江商学院院长及杰出讲师。余剑峰先生,独立董事。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研究员。

黄磊先生,独立董事。中国人大经济学博士,教授。曾任山东省政府、山东省政协常委、山东省人大常委会、山东省人大常委、山东省人大财经委委员;曾任教育部分管高校党委委员。现任山东财经大学教授、校长助理。王春生,独立董事。2008年毕业于山西农业大学,现任职山西农业大学经济管理学院教授、副校长。

郭兆强先生,副经理。23年证券、基金行业从业经验,保荐代表人。北京大学光华管理学院工商管理硕士,曾任山西证券投行综合管理、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公司副经理。

胡俊先生,副经理。2016年证券、基金行业从业经验。中国科学院大学金融学硕士,教授。2014年秋就职于清华大学五道口金融学院访问教授,2015年至2016年任香港恒生大学(深圳)学院金融学教授,执行教授;2016年至2017年明尼苏达大学卡尔森管理学院金融学助理教授,副教授;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研究员。

陈晓先生,副经理。2016年证券、基金行业从业经验。2016年4月加入汇安基金管理有限公司,任公司董事;2017年11月加入汇安基金管理有限公司,任公司董事。

2.基金管理人监事

王丽英女士,监事,4年证券、基金行业从业经验,毕业于中央财经大学会计学士,2011年6月至2017年6月在本公司就任公司监事职位并以其名下公司子司担任财务

经理。2017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综合管理部副总监(财务)。

3.高级管理人员

何进先生,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,基金行业经验。南开大学经济学硕士。历任中石化集团财务部经理、广发证券投资银行高级经理、华安证券投行部副总经理、大商集团副总经理,中航证券董事总经理。北京京信投资有限公司副总经理。2017年11月加入汇安基金管理有限公司,任公司监事,现任汇安基金管理有限公司监事。

朱剑敏先生,董事,督察长。2016年证券、基金行业从业经验,保荐代表人。北京大学光华管理学院工商管理硕士,曾任山西证券投行综合管理、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。

王俊波先生,副经理。2016年证券、基金行业从业经验。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公司副经理。

刘俊波先生,副经理。2016年证券、基金行业从业经验。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公司副经理。

4.本基金拟任基金经理

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、基金行业从业经验,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经理

总部投资主办人,新基金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。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,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,任汇安短债债券型证券投资基金基金经理,2020年4月29日至至今,任汇安中短债债券型证券投资基金基金经理,2020年4月29日至至今,任汇安中短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,任汇安裕和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

(简历请参见董事会成员)。

钟敬棣先生,固定收益投资部经理。25年银行、基金行业从业经验。理科硕士。2005年4月加入嘉实基金,先后担任固定收益研究员、投资经理。2009年5月加入建信基金,先后担任基金经理、投资副总监、固定收益首席投资官、公司投资决策委员会委员,曾管理建信稳健增利、双息红利、安心保本等债券型基金,多次被评为金牛基金。2018年5月加入汇安基金管理有限公司,任固定收益部总监(财务)。

邹剑先生,首席投资官。20年证券、基金行业从业经验。理科硕士。历任长证证券投资分析师、中信基金基金经理,嘉实基金管理有限公司公司策略组组长,中信基金公司基金经理,主题策略组组长,中信基金公司基金经理助理,中信基金公司基金经理,2017年12月加入汇安基金管理有限公司,任首席投资官,董事总经理。

仇秉则先生,固定收益研究总监。CFA,CPA,中山大学经济学学士,14年证券、基金行业从业经验,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,任固定收益研究总监,从事信用债投资研究工作。

窦星华先生,常务副总经理。(简历请参见高级管理人员)。

6.上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

1.基本情况

名称:中国工商银行股份有限公司

住所:北京市西城区复兴门内大街55号

法定代表人:陈四清

注册资本:人民币34,932,123.46万元

联系电话:010-66105799

联系人:郭明

2.主要人员情况

截至2018年12月,中国工商银行资产托管部共有员工202人,平均年龄33岁,95%以上员工拥有大学本科以上学历,高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

3.基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者,中国工商银行自1998年在国内首家提供托管服务以来,秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨,依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、先进的运营系统和专业的服务团队,严格履行资产托管人职责,为境内外广大投资者、金融监管机构和企业客户提升安全、高效、专业的托管服务,展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线,拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、基本养老保险、企业年金基金、QFII资产、ODI资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII专户资产、ESCRW等门类齐全的托管产品体系,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)基金的意愿、时机、数量及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,基金营运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价格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项风险,包括:因政策、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、个别特征特别的非系统性风险、基金管理人在基金管理过程中产生的基金管理风险、本基金的特定风险等。

5.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进行的债券。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。当发行体信用质量恶化时,资产流动性所限,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。

6.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,资产支持证券不对某一经营实体的盈利承担责任,而是对基础资产池所产生的现金流量和剩余权益的受偿权,是一种以资产收益为支撑的证券,所面临的风险主要包括交易结构风险、各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风险等。

7.本基金拟投资避险证券,避险证券投资说明书由上市公司证券发行管理办法规定的可交

易证券,不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券,已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。本基金可能由于持有流受限证券而面临流动性风险以及流受限期间证券价格大幅下跌的风险。

8.本基金为偏债型基金,避险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。

9.本基金的最低募集金额为人民币1亿元。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,基金投资者可能因此出现亏损。

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一级份额不得超过基金份额总额的50%,但在基金运作过程中因基金份额赎回等形式导致超过前述50%比例的除外。

12.根据法规要求,本基金管理人于2020年4月28日对招募说明书“第三部分基金管理人”中“二、主要成员情况”的“4.本基金基金经理”的内容进行了更新,其余所载内容截止日至2020年2月29日,有关财务数据和净值表现截止日至2019年12月31日(财务数据未经审计)。本招募说明书已经基金托管人复核。

联系人:沈兆杰
经办注册会计师:薛亮、沈兆杰