

# 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第一次提示性公告

长安基金管理有限公司决定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，并已于 2019 年 4 月 8 日在《中国证券报》及基金管理人网站（[www.changanfunds.com](http://www.changanfunds.com)）发布了《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》。为使本次基金份额持有人大会顺利

召开，现发布本次基金份额持有人大会的第一次提示性公告。

## 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”。 2

## 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》。

## 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受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；

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。

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）

（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）；

（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；

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。

2、授权委托书原件；

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。

3、个人基金份额持有人（委托人）的身份证件复印件（正反面），3

参会人类型 所需寄送材料

机构基金份额持有人（委托人）的 营业执照复印件（加盖公章）；

（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）；

（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）。

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）

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、4 月 9 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](http://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](http://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 5

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，或未能在规定时间之内送达指定

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 6

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

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。

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](http://www.changanfunds.com)

电子邮件：[service@changanfunds.com](mailto:service@changanfunds.com)

（二）基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司 7

（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：吴晓焯

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下一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沅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、关于长安鑫珏主题轮动混合型证券投资基金转型有关事项的议案
- 2、长安鑫珏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、关于长安鑫珏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

二〇一九年四月九日 8

附件 1:

关于长安鑫珏主题轮动混合型证券投资基金转型有关事项的议案

长安鑫珏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《长安鑫珏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,长安鑫珏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“长安泓沅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:《关于长安鑫珏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,特提议授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  
二〇一九年四月九日 9

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:

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](http://www.changanfunds.com)下载并打印，在填写完整并签

字盖章后均为有效。） 10

附件 3：

授权委托书

本人（或本机构）持有长安鑫珏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](http://www.changanfunds.com)）及《中国证券报》上

公布的关于召开长安鑫珏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）参加长安鑫珏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個人，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。 12

#### 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“长安泓沅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

13  
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 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基

金  
资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 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

14

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 15

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评级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，16 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 17

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）《长安泓沅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《长安泓沅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“长安泓沅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 20

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《长安泓沅中短债债券型证券投资基金基金合同》修改前后对照表 21

附件：

《长安鑫垚主题轮动混合型证券投资基金基金合同》与《长安泓沅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

《长安泓沅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 长安泓沅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。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。

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。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、长安泓沅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金合同》及其他有关规定募集。

中国证监会对长安鑫垚主题轮动混合型证券投资基金的注册及变更注册，并不表明其对本基金的投资价值和市场前景做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，但不保证投资于本基金一定盈利，也不保证最低收益。

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。

## 第一部分

### 前言

四、单一投资者持有本基金基金份额数不得达到或超过基金总份额的 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超过 50%的除外。

## 第二部分

### 释义

7、基金份额发售公告：指《长安鑫垚主题轮动混合型证券投资基金基金份额发售公告》

## 第二部分

### 释义

15、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会

14、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

第二部分 19、合格境外机构投资者：指符合相关法律 18、合格境外机构投资者：指符合《合格境外 22

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

《长安泓沚中短债债券型证券投资基金基金合同》内容

释义 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  
机构投资者境内证券投资管理辦法》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

## 第二部分

## 释义

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》（包括颁布机关对其不时做出的修订）及相关法律法规规定，运用来自境外的人民币资金进行境内证券投资的境外法人

19、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进行境内证券投资的境外法人

## 第二部分

### 释义

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

22、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，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

## 第二部分

### 释义

24、销售机构：指基金管理人以及符合《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

23、销售机构：指基金管理人以及符合《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

## 第二部分

### 释义

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

28、基金合同生效日：指《长安泓沣中短债债券型证券投资基金基金合同》生效日，原《长安鑫垚主题轮动混合型证券投资基金基金合同》自同一起失效

## 第二部分

### 释义

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

## 第二部分

### 释义

**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规定申请购买基金份额的行为

## 第二部分

### 释义

**44、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

**41、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

## 第二部分

### 释义

**47、A类基金份额：**指在投资人认购/申购基金时收取前端认购/申购费，而不计提销售服务费的基金份额类别

**44、A类基金份额：**指在投资人申购基金时收取前端申购费，而不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额类别

## 第二部分

### 释义

**48、C类基金份额：**指不收取前后端认购费/申购费，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额类别

**45、C类基金份额：**指在投资人申购基金时不收取前后端申购费，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额类别

**第二部分 49、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、

**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 23 章节 《长安鑫珪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

释义 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

法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约

第二部分

释义

增加如下内容：

51、销售服务费：指从基金财产中计提的，用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务的费用

第二部分

释义

55、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

53、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，确保投资人的合法权益不受损害并得到公平对待

第二部分

释义

增加如下内容：

54、基金转型：指对包括“长安鑫垚主题轮动混合型证券投资基金”更名为“长安泓沅中短债债券型证券投资基金”，调整基金的投资、运作、费用等相关内容并修订基金合同等一系列事项的统称

第三部分

基金的基本

情况

二、基金的

类别

混合型证券投资基金 债券型证券投资基金

第三部分

基金的基本

情况

四、基金的

投资目标

在严格控制风险和保持流动性的前提下，把

握中国经济和资本市场发展过程中各种投资主题的投资机会，力争实现基金资产的长期稳健增值。

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。

### 第三部分 基金的基本情况

五、基金的最低募集份额总额  
本基金的最低募集份额总额为 2 亿份。

### 第三部分 基金的基本情况

六、基金份额发售面值和认购费用

本基金基金份额发售面值为人民币 1.00 元。

本基金A类基金份额的认购费率按招募说明书的规定执行。C类基金份额不收取认购费。

五、基金份额初始面值

本基金基金份额初始面值为人民币 1.00 元。

第四部分 第四部分 基金份额的发售 第四部分 基金的历史沿革 24  
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

基金份额的

发售

第四部分

基金的历史

沿革

删除“基金份额的发售”全部内容。增加如下内容：

长安泓沣中短债债券型证券投资基金由长安鑫垚主题轮动混合型证券投资基金转型而来。

长安鑫垚主题轮动混合型证券投资基金经中国证监会 2017 年 6 月 26 日证监许可（2017）1048 号文注册，基金管理人为长安基金管理有限公司，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

长安鑫垚主题轮动混合型证券投资基金自 2017 年 7 月 26 日至 2017 年 8 月 4 日进行公开募集，募集结束后基金管理人向中国证监会办理备案手续。经中国证监会书面确认，《长安鑫垚主题

轮动混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 8 月 9 日生效。

长安泓沅中短债债券型证券投资基金经中国证监会 2019 年 XX 月 XX 日证监许可（2019）XXXX 号文准予变更注册。

2019 年 XX 月 XX 日至 2019 年 XX 月 XX 日，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以通讯方式召开，会议审议并通过了《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》，内容包括变更基金名称、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、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、基金费用等事项。基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。

自 2019 年 XX 月 XX 日起，《长安鑫垚主题轮动混合型证券投资基金基金合同》失效且《长安泓沅中短债债券型证券投资基金基金合同》同时生效，长安鑫垚主题轮动混合型证券投资基金正式转型为长安泓沅中短债债券型证券投资基金。

## 第五部分

### 基金备案

第五部分 基金备案 第五部分 基金的存续

### 第五部分

#### 基金的存续

##### 一、基金备案的条件

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

##### 一、基金份额的变更登记

《基金合同》生效后，本基金登记机构将进行本基金基金份额的更名以及必要的信息变更。 25

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

《长安泓沅中短债债券型证券投资基金

基金合同》内容

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，基金募集期届满或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。

基金募集达到基金备案条件的，自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会

书面确认之日起，《基金合同》生效；否则《基金合同》不生效。基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对《基金合同》生效事宜予以公告。基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。

## 二、基金合同不能生效时募集资金的处理方式

如果募集期限届满，未满足基金备案条件，基金管理人应当承担下列责任：

- 1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；
- 2、在基金募集期限届满后 30 日内退还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息。其中，银行同期活期存款利息指按照同期中国人民银行公布并执行的金融机构人民币活期存款基准利率计算的利息；
- 3、如基金募集失败，基金管理人、基金托管人及销售机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和销售机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。

## 第五部分

### 基金的存续

## 三、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 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5,000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，本基金将依据基金合同第十九部分的约定进行基金财产清算并终止，无需召开基金份额持有人大会，同时基金管理人应履行相关的监管报告和信息披露程序。

## 二、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 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 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。



## 第六部分 2、申购、赎回开始日及业务办理时间 2、申购、赎回业务办理时间 26

### 章节 《长安鑫珏主题轮动混合型证券投资基金基金合同》内容

#### 《长安泓沅中短债债券型证券投资基金

#### 基金合同》内容

#### 基金份额的

#### 申购与赎回

#### 二、申购和

#### 赎回的开放

#### 日及时间

基金管理人自基金合同生效之日起不超过 3 个月开始办理申购，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。

基金管理人自基金合同生效之日起不超过 3 个月开始办理赎回，具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。

#### 第六部分

#### 基金份额的

#### 申购与赎回

#### 二、申购和

#### 赎回的开放

#### 日及时间

#### 2、申购、赎

#### 回业务办理

#### 时间

在确定申购开始与赎回开始时间后，基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

在确定申购开始与赎回开始时间后，基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告申购与赎回的开始时间。

#### 第六部分

#### 基金份额的

#### 申购与赎回

#### 三、申购与

#### 赎回的原则

增加如下内容：

5、办理申购、赎回业务时，应当遵循基金份额持有人利益优先原则，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待。

#### 第六部分

#### 基金份额的

## 申购与赎回

### 四、申购与赎回的程序

#### 2、申购和赎回的款项支付

基金份额持有人提交赎回申请，赎回成立；基金登记机构确认赎回时，赎回生效。基金份额持有人赎回申请生效后，基金管理人将在T+7日（包括该日）内支付赎回款项。在发生巨额赎回或基金合同载明的其他暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形时，款项的支付办法参照本基金合同有关条款处理。……

基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；基金登记机构确认赎回时，赎回生效。基金份额持有人赎回申请生效后，基金管理人将在T+7日（包括该日）内支付赎回款项。在发生巨额赎回或基金合同载明的其他延缓支付赎回款项的情形时，款项的支付办法参照本基金合同有关条款处理。……

## 第六部分

### 基金份额的

#### 申购与赎回

### 四、申购与

#### 赎回的程序

#### 3、申购和赎回

#### 申请的确

#### 认

基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当日作为申购或赎回申请日（T日），在正常情况下，本基金登记机构在T+1日内对该交易的有效性进行确认。……

基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日（T日），在正常情况下，本基金登记机构在T+1日内对该交易的有效性进行确认。……

## 第六部分

### 基金份额的

4、当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应

4、当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采 27  
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

《长安泓沅中短债债券型证券投资基金

基金合同》内容

申购与赎回

五、申购和

赎回的数量

限制

当采取设定单一投资者申购金额上限、基金规模上限、基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益，具体请参见相关公告。

取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。

基金管理人基于投资运作和风险控制的需要，可采取上述措施对基金规模予以控制。具体请参见相关公告。

第六部分

基金份额的

申购与赎回

六、申购和

赎回的价

格、费用及

其用途

1、申购、赎回价格以申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算。……T日两类基金份额的基金份额净值在当日收市后计算，并在T+1日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

1、申购、赎回价格以申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算。……T日两类基金份额的基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日内公告。遇特殊情况，经履行适当程序，可以适当延迟计算或公告。

第六部分

基金份额的

申购与赎回

六、申购和

赎回的价

格、费用及

其用途

5、本基金赎回费用由赎回基金份额的基金份

额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用归入基金财产的比例详见招募说明书，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。其中，对持续持有期少于 7 日的基金份额持有人收取不低于 1.5% 的赎回费，并将上述赎回费用全额计入基金财产。

5、本基金赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用归入基金财产的比例依照相关法律法规设定，具体见招募说明书的规定，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。其中，对持续持有期少于 7 日的基金份额持有人收取不低于 1.5% 的赎回费，并全额计入基金财产。

#### 第六部分

##### 基金份额的

##### 申购与赎回

#### 六、申购和

##### 赎回的价

##### 格、费用及

##### 其用途

增加如下内容：

7、当本基金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。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。

#### 第六部分

##### 基金份额的

##### 申购与赎回

#### 六、申购和

##### 赎回的价

##### 格、费用及

##### 其用途

8、本基金暂不采用摆动定价机制。基金管理人可结合基金实际运作情况，根据相关法律法规规定在履行适当程序后增加摆动定价机制。

#### 第六部分

##### 基金份额的

##### 申购与赎回

#### 七、拒绝或

4、基金管理人接受某笔或某些申购申请可能

会影响或损害现有基金份额持有人利益或对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时。

4、接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。

28

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

《长安泓沅中短债债券型证券投资基金基金合同》内容

暂停申购的情形

第六部分

基金份额的

申购与赎回

七、拒绝或

暂停申购的

情形

5、基金管理人接受某笔或某些申购申请可能导致单一投资者持有基金份额数达到或超过基金总份额的 50%，或者可能导致投资者变相规避前述 50%比例要求的情形。

5、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或超过 50%，或者变相规避 50%集中度的情形。

第六部分

基金份额的

申购与赎回

八、暂停赎

回或延缓支

付赎回款项

的情形

4、接受某笔或某些赎回申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。

4、发生继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时，基金管理人可暂停接受基金份额持有人的赎回申请。

第六部分

基金份额的

申购与赎回

八、暂停赎

回或延缓支

付赎回款项

的情形

发生上述情形之一且基金管理人决定暂停接受基金份额持有人的赎回申请或延缓支付赎回款项时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；……

发生上述情形之一且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；……

## 第六部分

### 基金份额的

#### 申购与赎回

#### 九、巨额赎回的情形及

#### 处理方式

#### 2、巨额赎回

#### 的处理方式

#### （2）部分延期赎回：……

对于当日赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，基金份额持有人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。……

（2）部分延期赎回：……对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，基金份额持有人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。……

## 第六部分

### 基金份额的

#### 申购与赎回

#### 九、巨额赎回的情形及

#### 处理方式

#### （4）当基金出现巨额赎回且单个基金份额持

有人当日赎回申请超过上一开放日基金总份额 40%的，基金管理人可以对该单个基金份额持有人超过 40%的赎回申请实施延期赎回。……

（3）如发生单个开放日内单个基金份额持有人申请赎回的基金份额超过前一开放日基金总份额的 40%时，本基金管理人对该单个基金份额持有人持有的超过 40%的赎回申请可以实施延期办理。……

## 第六部分

### 基金份额的

#### 申购与赎回

2、如发生暂停的时间为 1 日，基金管理人应于重新开放日，在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近 1 个开放

2、如发生暂停的时间为 1 日，基金管理人应于重新开放日，在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近 1 个工作日各类 29

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

《长安泓沅中短债债券型证券投资基金

基金合同》内容

#### 十、暂停申

#### 购或赎回的

#### 公告和重新

#### 开放申购或

#### 赎回的公告

日各类基金份额的基金份额净值。 基金份额的基金份额净值。

## 第六部分

### 基金份额的

#### 申购与赎回

#### 十五、定期

#### 定额投资计

#### 划

基金管理人可以为投资人办理定期定额投资计划，具体规则由基金管理人另行规定。投资人在办理定期定额投资计划时可自行约定每期申购金额，每期申购金额必须不低于基金管理人在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。

基金管理人可以为投资人办理定期定额投资计划，具体规则由基金管理人另行规定。投资人在办理定期定额投资计划时可自行约定每期扣款金额，每期扣款金额必须不低于基金管理人在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。

## 第七部分

### 基金合同当

#### 事人及权利

#### 义务

#### 一、基金管

#### 理人

##### (二) 基金

管理人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

增加如下内容：

(9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；

第七部分

基金合同当事人及权利义务

一、基金管理人

(二) 基金管理人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及

(14) 选择、更换证券经纪商、期货经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；

(15) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；

30

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

《长安泓沅中短债债券型证券投资基金基金合同》内容

其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

第七部分

基金合同当



事人及权利  
义务

一、基金管  
理人

(二)基金  
管理人的权  
利与义务

2、根据《基  
金法》、《运  
作办法》及  
其他有关规  
定，基金管  
理人的义务  
包括但不限  
于：

(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；

(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申购、  
赎回和登记事宜；

第七部分

基金合同当  
事人及权利  
义务

一、基金管  
理人

(二)基金  
管理人的权  
利与义务

2、根据《基  
金法》、《运  
作办法》及  
其他有关规  
定，基金管  
理人的义务  
包括但不限  
于：

(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；

## 第七部分

### 基金合同当

(3) 监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人违反《基金合同》及国

(3) 监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人违反《基金合同》及国家法 31 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

《长安泓沅中短债债券型证券投资基金基金合同》内容

事人及权利

义务

二、基金托

管人

(二) 基金

托管人的权

利与义务

1、根据《基

金法》、《运

作办法》及

其他有关规定，基金托

管人的权利

包括但不限

于：

家法律法规行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资人的利益；

律法规行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

第七部分

基金合同当

事人及权利

义务

二、基金托

管人

(二) 基金

托管人的权

利与义务

1、根据《基

金法》、《运

作办法》及

其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：

(4) 根据相关市场规则，为基金开设资金账户、证券账户、期货账户等投资所需的其他账户，为基金办理证券、期货交易资金清算；

(4) 根据相关市场规则，为基金开设资金账户、证券账户等投资所需的其他账户，为基金办理证券交易资金清算；

## 第七部分

基金合同当事人及权利义务

二、基金托管人

(二) 基金托管人的权

(6) 按规定开设基金财产的资金账户、证券账户、期货账户等投资所需的其他账户，按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

(6) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户等投资所需的其他账户，按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜； 32

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

《长安泓沅中短债债券型证券投资基金基金合同》内容

利与义务

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：

## 第七部分

基金合同当事人及权利义务

### 三、基金份额持有人

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：

(3) 依法申请赎回或转让其持有的基金份额；

(3) 依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；

### 第七部分

#### 基金合同当事人及权利义务

### 三、基金份额持有人

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：

(4) 缴纳基金认购、申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；

(4) 交纳基金申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；

### 第八部分

#### 基金份额持有人大会

##### 一、召开事

2、以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

2、在法律法规规定和《基金合同》约定的范围内且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大 33

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  
由

会：

第八部分

基金份额持

有人大会

一、召开事

由

2、在法律法

规规定和

《基金合

同》约定的

范围内且对

基金份额持

有人利益无

实质性不利

影响的前提

下，以下情

况可由基金

管理人和基

金托管人协

商后修改，

不需召开基

金份额持有

人大会：

(2) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内且对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，调整基金份额类别设置或申购费率，或调低赎回费率、销售服务费率或变更收费方式，或对基金份额分类办法及规则进行调整；

(2) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整基金份额类别设置或申购费率，或调低赎回费率、销售服务费率或变更收费方式，或对基金份额分类办法及规则进行调整；

第八部分

基金份额持

有人大会

一、召开事

由

2、在法律法

规规定和

《基金合同》约定的范围内且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，以下情况可由基金管理人和基

(5) 在不违反法律法规规定和《基金合同》约定且对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人、销售机构、登记机构在法律法规规定或中国证监会允许的范围内调整有关基金认购、申购、赎回、转换、定期定额、非交易过户、转托管等业务的规则；

(6) 在不违反法律法规规定和《基金合同》约定且对现有基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，本基金推出新业务或服务；

(5) 基金管理人、销售机构、登记机构在法律法规规定或中国证监会允许的范围内调整有关基金申购、赎回、转换、定期定额、非交易过户、转托管等业务的规则；

(6) 本基金推出新业务或服务； 34

章节 《长安鑫珏主题轮动混合型证券投资基金基金合同》内容

《长安泓沅中短债债券型证券投资基金基金合同》内容

基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会；

第八部分 基金份额持有人大会

一、召开事由

3、基金合同生效后，连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，本基金合同将根据基金合同的约定进行基金财产清算并终

止，无需召开基金份额持有人大会，同时基金管理人应履行相关的监管报告和信息披露程序。

## 第八部分 基金份额持 有人大会 四、基金份 额持有人出 席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式以及法律法规或监管机构允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式或法律法规、监管机构允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

## 第八部分 基金份额持 有人大会 四、基金份 额持有人出 席会议的方式

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式或大会公告载明的其他方式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式或大会公告载明的其他方式进行表决。

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式或大会公告载明的其他方式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式或大会公告载明的其他方式进行表决。

## 第九部分 基金管理 人、基金托 管人的更换 条件和程序 二、基金管 理人和基金 托管人的更 换程序

(一) 基金  
管理人的更  
换程序

2、决议：基金份额持有人大会在基金管理人  
职责终止后 6 个月内对被提名的基金管理人  
形成决议，该决议需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（含三分  
之二）表决通过，并自表决通过之日起生效；

2、决议：基金份额持有人大会在基金管理人职  
责终止后 6 个月内对被提名的基金管理人形成  
决议，该决议需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（含三分之二）表  
决通过，决议自表决通过之日起生效；

第九部分  
基金管理

6、交接：基金管理人职责终止的，基金管理  
人应妥善保管基金管理业务资料，及时向临

6、交接：基金管理人职责终止的，基金管理  
人应妥善保管基金管理业务资料，及时向临时基 35  
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

《长安泓沅中短债债券型证券投资基金  
基金合同》内容

人、基金托  
管人的更换  
条件和程序  
二、基金管  
理人和基金  
托管人的更  
换程序

(一) 基金  
管理人的更  
换程序

时基金管理人或者新任基金管理人办理基金  
管理业务的移交手续，临时基金管理人或者  
新任基金管理人应及时接收。临时基金管理  
人或者新任基金管理人应与基金托管人核对  
基金资产总值和基金资产净值；

基金管理人或新任基金管理人办理基金管理业务  
的移交手续，临时基金管理人或新任基金管理  
人应及时接收。临时基金管理人或新任基金管  
理人应与基金托管人核对基金资产总值和基金  
资产净值；

第九部分



基金管理  
人、基金托  
管人的更换  
条件和程序  
二、基金管  
理人和基金  
托管人的更  
换程序

(二) 基金  
托管人的更  
换程序

2、决议：基金份额持有人大会在基金托管人职责终止后 6 个月内对被提名的基金托管人形成决议，该决议需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（含三分之二）表决通过，并自表决通过之日起生效；

2、决议：基金份额持有人大会在基金托管人职责终止后 6 个月内对被提名的基金托管人形成决议，该决议需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（含三分之二）表决通过，决议自表决通过之日起生效；

第九部分

基金管理  
人、基金托  
管人的更换  
条件和程序  
二、基金管  
理人和基金  
托管人的更  
换程序

(二) 基金  
托管人的更  
换程序

6、交接：基金托管人职责终止的，应当妥善保管基金财产和基金托管业务资料，及时办理基金财产和基金托管业务的移交手续，临时基金托管人或者新任基金托管人应当及时接收。临时基金托管人或者新任基金托管人应与基金管理人核对基金资产总值和基金资产净值；

6、交接：基金托管人职责终止的，应当妥善保管基金财产和基金托管业务资料，及时办理基金财产和基金托管业务的移交手续，临时基金托管人或新任基金托管人应当及时接收。临时

基金托管人或新任基金托管人应与基金管理人核对基金资产总值和基金资产净值；

## 第九部分

### 基金管理

#### 人、基金托

#### 管人的更换

#### 条件和程序

(三) 基金管理人与基金托管人同时更换的条件和程序。

(三) 基金管理人与基金托管人同时更换的条件和程序

第十二部分 在严格控制风险和保持流动性的前提下，把 在严格控制风险和保持良好流动性的前提下， 36

章节 《长安鑫珏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

### 基金的投资

#### 一、投资目

#### 标

把握中国经济和资本市场发展过程中各种投资主题的投资机会，力争实现基金资产的长期稳健增值。

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。

## 第十二部分

### 基金的投资

#### 二、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，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、衍生工具（包括权证、股指期货、国债期货等）、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换公司债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、中小企业私募债等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单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。

## 第十二部分

### 基金的投资

#### 二、投资范围

##### 围

本基金的投资组合比例为:股票投资占基金资产的比例为 50%-95%;每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后,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、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。

## 第十二部分

### 基金的投资

#### 三、投资策略

##### 略

本基金采用主题投资策略,将综合运用定量和定性的分析方法,针对中国经济和资本市场发展等进行前瞻性的分析,挖掘长期性或阶段性的投资主题,精选投资主题下的受益

个股，实现基金资产的长期稳定增值。

本基金投资策略包括三个大的方面，即大类资产配置策略、股票投资策略和债券投资策略。

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。

## 第十二部分

### 基金的投资

#### 三、投资策

##### （一）大类资产配置策略

本基金的大类资产配置主要根据美林投资时钟模型，综合分析宏观经济、国家政策、资

37

章节 《长安鑫珏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

略 本市场等影响证券市场的重要因素，评估各类资产的收益和风险，从而确定基金资产在股票、债券及货币市场工具等类别资产的配置比例范围，并动态跟踪各类证券风险收益特征的相对变化动态，调整具体配置比例，以平衡投资组合的风险和收益。

##### （二）股票投资策略

本基金将从主题挖掘、主题配置、组合构建和择机退出等四个步骤构建并调整投资组合，更好把握具有较大影响的投资主题的投资机会。

#### 1、主题挖掘

从投资机会的驱动或触发因素看，投资主题可分为宏观性主题、事件性主题、制度性主题和产业性主题等。宏观性主题的驱动因素来源于促进经济长期发展趋势或短期变化及结构性变化的宏观因素，事件性主题的驱动因素来自于某些会提升相关企业资产价值、盈利或估值水平的确定性事件，制度性主题的驱动因素来源于制度性变革所促发的红利

性投资机会，产业性主题的驱动因素来自于政策扶持或者产业升级的驱动作用所引发的行业性投资机会。

基金管理人将从宏观经济、政策制度、技术进步、人口结构、社会文化和确定性事件等多角度出发，动态分析影响经济发展和企业盈利的关键性因素，前瞻性挖掘在中国经济、社会和资本市场发展过程中不断涌现出的有较大影响力的投资主题。

## 2、主题配置

在主题挖掘的基础上，基金管理人将从主题驱动因素的可持续性、主题的生命周期、主题的催化因素、主题的持续时间、主题的退出风险、主题的市场容量、主题的估值水平以及不同主题间的相关性等因素，筛选出投资机会相对较大、安全边际较高的投资主题，并确定每个投资主题的配置权重。

同时，本基金将动态跟踪上述因素的变化，适时加入新的投资主题，剔除投资收益已兑现或风险较大的投资主题，并调整投资主题的配置权重，把握投资主题轮动所带来的投

38 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

《长安泓沅中短债债券型证券投资基金基金合同》内容

投资机会。

主题配置中，本基金管理人将重点分析投资主题所处的生命周期阶段。投资主题的生命周期是指投资主题对经济和资本市场的影响持续期。根据投资主题对经济和资本市场影响力的强弱，可以将投资主题的发展阶段分为主题萌芽阶段、主题形成阶段、主题实现阶段及主题衰退或证伪阶段等四个阶段。在主题萌芽阶段，市场对投资主题的关注度较低，股票往往被低估；主题形成阶段，投资主题得到市场广泛认同，出现了实质性的主题催化因素，市场对投资主题反应热烈；主题实现阶段，市场对投资主题的各项预期逐步实现，股票价格此时往往出现高估；主题衰退或证伪阶段，投资主题已经不具备投资价值，或者主题被证伪。主题的萌芽阶段和形成阶段是比较好的投资介入时机，而主题的实现阶段是实现投资收益的较好阶段。通过判断主题的生命周期进行主题配置，可以

更好把握投资主题的投资机会，规避投资风险。

### 3、组合构建

在主题挖掘和主题配置的基础上，本基金将选择公司的主营业务收入与所选投资主题的相关程度高、辨识度高、股票筹码分散、流动性好、历史上受到主题刺激弹性较大的上市公司，构建股票投资组合。

### 4、择机退出

本基金将密切跟踪投资主体驱动因素的强弱变化，确认主题的生命周期阶段，并结合个股的流通市值、机构持仓、换手率、成交量、收益率等技术指标，选择合适时点退出相关主题的投资。

## 第十二部分

### 基金的投资

#### 三、投资策略

##### 略

#### （三）债券投资策略

##### 1、普通债券投资策略

本基金将通过分析宏观经济发展趋势、利率变动趋势及市场信用环境变化方向和长期利率的发展趋势，综合考虑不同债券品种的收益率水平、流动性、税赋特点、信用风险等因素，采取久期策略、收益率曲线策略、息差策略、骑乘策略、类别选择策略、个券选

##### 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

39 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

《长安泓洋中短债债券型证券投资基金基金合同》内容  
择策略、回购套利策略等多种策略，精选安全边际较高的个券进行投资，同时根据宏观经济、货币政策和流动性等情况的变化，调整组合利率债和信用债的投资比例、组合的久期等，以获取债券市场的长期稳健收益。

##### 2、可转债投资策略

本基金在综合分析可转债的股性特征、债性特征、流动性等因素的基础上，选择安全边际较高、发行条款相对优惠、流动性良好以及基础股票基本面良好的品种进行投资。

### 3、中小企业私募债投资策略

本基金将根据审慎原则，密切跟踪中小企业私募债的信用风险变化和流动性情况，通过对中小企业私募债进行信用评级控制，通过对投资单只中小企业私募债的比例限制，严格控制风险，并充分考虑单只中小企业私募债对基金资产流动性造成的影响，通过信用研究和流动性管理后，决定投资品种。

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。 《长安鑫珏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

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评级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。

## 第十二部分 基金的投资 三、投资策略 略

### （四）衍生品投资策略

#### 1、股指期货投资策略

本基金将在风险可控的前提下，本着谨慎原则，以套期保值为主要目的，适度参与股指期货投资。本基金管理人将根据持有的股票投资组合状况，通过对现货和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货定价模型对其估值水平合理性的评估，并通过与现货资产进行匹配，选择合适的投资时机。

#### 2、国债期货投资策略

本基金主要利用国债期货管理债券组合的久期、流动性和风险水平。基金管理人将根据法律法规的规定，以套期保值为主要目的，结合对宏观经济运行情况和政策趋势的分析，预测债券市场变动趋势。基金管理人通过对国债期货的流动性、波动水平、风险收益特征、国债期货和现货基差、套期保值的有效性等指标进行持续跟踪，通过多头或空



头套期保值等策略进行套期保值操作。

### 3、权证投资策略

本基金将充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征，通过资产配置、品种与类属选择，谨慎进行投资，追求较稳定的当期收益。

## 第十二部分

### 基金的投资

#### 三、投资策略

##### 略

#### (五)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，选择经风险调整后相对价值较高的品种进行投资。

#### 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 41  
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

#### 《长安泓沅中短债债券型证券投资基金

#### 基金合同》内容

值较高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

## 第十二部分

### 基金的投资

#### 三、投资策略

##### 略

增加如下内容：

#### 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。

## 第十二部分

### 基金的投资

#### 四、投资限制

##### 制

##### 1、组合限制

(1) 本基金股票投资占基金资产的比例为50%-95%;

(2) 任何交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后, 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、应收申购款等;

(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;

## 第十二部分

### 基金的投资

#### 四、投资限制

##### 制

##### 1、组合限制

(5) 本基金持有的全部权证, 其市值不得超过基金资产净值的3%;

(6) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证, 不得超过该权证的10%;

(7) 本基金在任何交易日买入权证的总金额, 不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%;

## 第十二部分

### 基金的投资

#### 四、投资限制

##### 制

##### 1、组合限制

(13) 基金财产参与股票发行申购, 本基金所申报的金额不超过本基金的总资产, 本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;

## 第十二部分

### 基金的投资

#### 四、投资限制

制

#### 1、组合限制

(14) 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%；债券回购最长期限为 1 年，到期后不得展期；

(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；

### 第十二部分

#### 基金的投资

#### 四、投资限

制

#### 1、组合限制

(16) 本基金若参与股指期货、国债期货交易，应当符合下列限制：

1) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；本基金在任何交易日日终，持有的买入

42

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

《长安泓沅中短债债券型证券投资基金基金合同》内容

国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的 15%；

2) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货和国债期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

3) 本基金在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；本基金在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%；

本基金的基金管理人将按照中国金融期货交易所要求的内容、格式与时限向交易所报告所交易和持有的卖出期货合约情况、交易目的及对应的证券资产情况等。

4) 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符

合基金合同关于股票投资比例的有关规定；  
本基金所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定；

5) 本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 30%；

## 第十二部分

### 基金的投资

#### 四、投资限制

##### 制

##### 1、组合限制

(17) 本基金持有单只中小企业私募债券，其市值不得超过基金资产净值的 10%；

## 第十二部分

### 基金的投资

#### 四、投资限制

##### 制

##### 1、组合限制

(18) 本基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放式基金）持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过

##### 43

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

《长安泓沅中短债债券型证券投资基金基金合同》内容

该上市公司可流通股票的 30%；

## 第十二部分

### 基金的投资

#### 四、投资限制

##### 制

##### 1、组合限制

(19) 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、上市公司股票停牌、基金规

模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合上述比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

（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；

## 第十二部分

### 基金的投资

#### 四、投资限制

##### 制

##### 1、组合限制

（20）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的投资范围保持一致；

（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；

## 第十二部分

### 基金的投资

#### 四、投资限制

##### 制

##### 1、组合限制

除上述第（2）、（12）、（19）、（20）项外，因证券/期货市场波动、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 个工作日内进行调整。法律法规另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

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 个工作日内进行调整，但中国证监会规

定的特殊情形除外。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

## 第十二部分

### 基金的投资

#### 四、投资限制

##### 制

#### 2、禁止投资

(1) 承销证券

(2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；

.....

(6) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

法律、行政法规或监管机构取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

#### 3、关联交易

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

#### 2、禁止投资

(1) 承销证券

(2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；

.....

(6) 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。.....

法律、行政法规或监管机构取消上述限制，如 44 章节 《长安鑫珪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

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。……适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

## 第十二部分 基金的投资 五、业绩比较基准

沪深 300 指数收益率\*60%+中债综合指数收益率\*40%。

沪深 300 指数是由沪深A股中规模大、流动性好的最具代表性的 300 只股票组成，于 2005 年 4 月 8 日正式发布，以综合反映沪深A股市场整体表现。沪深 300 指数对A股市场总体走势具有较强代表性，适合作为本基金股票部分的业绩比较基准。中债综合指数是综合反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央票及短期融资券等整体走势的跨市场债券指数。中债综合指数能够反映债券市场总体走势，适合作为本基金固定收益部分的业绩比较基准。因此，以“沪深 300 指数收益率\*60%+中债综合指数收益率\*40%”为本基金业绩比较基准能够较好反应本基金的产品特性及风险收益特征。

本基金的业绩比较基准为：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%。

中债总财富（1-3 年）指数由中央国债登记结算有限责任公司编制发布。该指数成份券由剩余期限 1-3 年的记账式国债、央行票据和政策性银行债组成，是一个综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场中短期债券指数。该指数对中短期债券价格变动趋势有较强的代表性，能较好的反映本基金的投资策略，能够较为客观地反映本基金的风险收益特征。

一年期定期存款利率是指中国人民银行公布的金融机构一年期人民币存款基准利率，可以作为衡量剩余期限在 1 年以下的债券、同业存单及银行存款等资产收益的基准。

本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于剩余期限不超过三年的中

短债主题证券的比例不低于非现金基金资产的80%,中债总财富(1-3年)指数收益率×80%可以比较客观地衡量剩余期限在1-3年债券资产的投资绩效,一年期定期存款利率(税后)×20%可以较客观地衡量剩余期限在1年以下的债券、同业存单及银行存款等资产的投资绩效,因此中债总财富(1-3年)指数收益率×80%+一年期定期存款利率(税后)×20%作为本基金的业绩比较基准能够较为客观地衡量本基金的投资绩效。

## 第十二部分

### 基金的投资

#### 六、风险收

##### 益特征

本基金为混合型基金,其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金,但低于股票型基金,属于较高预期风险、较高预期收益的投资品种。

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。

## 第十二部分

### 基金的投资

#### 七、基金管理人代表基金行使相关权利的处理原则及方法

##### 七、基金管理人代表基金行使债权人权利的处理原则及方法

## 第十二部分

### 基金的投资

#### 七、基金管

##### 理人代表基

1、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使相关权利,保护基金份额持有人的利益;

1、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人权利,保护基金份额持有人的利益; 45

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

《长安泓沅中短债债券型证券投资基金基金合同》内容

金行使债权

人权利的处

理原则及方

法



第十二部分  
基金的投资  
七、基金管理人代表基金行使债权人权利的处理原则及方法

- 3、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；
- 2、不谋求对上市公司的控股；

第十三部分  
基金的财产  
三、基金财产的账户

基金托管人根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立资金账户、证券账户、期货账户以及投资所需的其他专用账户。……

基金托管人根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立资金账户、证券账户以及投资所需的其他专用账户。……

第十三部分  
基金的财产  
四、基金财产的保管和处分

基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算财产。基金管理人管理运作基金财产所产生的债权，不得与其固有资产产生的债务相互抵销；基金管理人管理运作不同基金的基金财产所产生的债权债务不得相互抵销。

基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算财产。基金管理人管理运作基金财产所产生的债权，不得与其固有资产产生的债务相互抵销；基金管理人管理运作不同基金的基金财产所产生的债权债务不得相互抵销。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

第十四部分  
基金资产估值

## 二、估值对象

基金所拥有的股票、权证、债券、股指期货合约、国债期货合约和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

基金所拥有的债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

## 第十四部分

### 基金资产估值

#### 值

增加如下内容：

### 三、估值原则

基金管理人在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，应符合《企业会计准则》、监管部门有关规定。

1、对存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种，在估值日有报价的，除会计准则规定的例外情况外，应将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量。估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价 46

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

《长安泓沅中短债债券型证券投资基金基金合同》内容

确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种形同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

2、对不存在活跃市场的投资品种，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

3、如经济环境发生重大变化或证券发行人发生

影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25%以上的，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 第十四部分

#### 基金资产估

#### 值

#### 三、估值方法

##### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

(1) 交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

#### 四、估值方法

##### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

#### 第十四部分

#### 基金资产估

#### 值

#### 四、估值方

#### 法

##### 1、证券交易

##### 所上市的有

(2) 交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（基金合同另有规定的除外），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；

(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 47

章节 《长安鑫珏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

价证券的估  
值

应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价进行估值；

第十四部分  
基金资产估

值

四、估值方  
法

1、证券交易

所上市的有  
价证券的估  
值

(3) 交易所上市交易的可转换债券，按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

第十四部分  
基金资产估

值

四、估值方  
法

1、证券交易

所上市的有  
价证券的估  
值

(4) 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。交易所挂牌转让的资产支持证券、中小企业私募债，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) 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；

第十四部分  
基金资产估

值

#### 四、估值方法

##### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

(1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

(2) 首次公开发行未上市的股票和权证，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) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值；

#### 第十四部分 基金资产估值

##### 四、估值方法

(4) 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，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，对市场报价进行调整以确认估值日的公允价值；对于不存在市场活动或

(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

48  
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

《长安泓沅中短债债券型证券投资基金基金合同》内容

##### 1、证券交易所上市的有

## 价证券的估 值

市场活动很少的情况下，采用估值技术确定其公允价值。

活动很少的情况下，应采用估值技术确定其公允价值。

### 第十四部分

#### 基金资产估

##### 值

#### 四、估值方

##### 法

增加如下内容：

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。

### 第十四部分

#### 基金资产估

##### 值

#### 四、估值方

##### 法

3、全国银行间市场交易的固定收益品种，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。对全国银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，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。

### 第十四部分

#### 基金资产估

##### 值

#### 四、估值方

##### 法

6、因持有股票而享有的配股权，采用估值技术确定公允价值。

7、股指期货合约、国债期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

#### 第十四部分

#### 基金资产估

#### 值

#### 四、估值方

#### 法

增加如下内容：

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。

#### 第十四部分

#### 基金资产估

#### 值

#### 四、估值程序

1、各类基金份额净值是按照每个工作日闭市后，该类基金份额的基金资产净值除以当日该类基金份额的余额数量计算，精确到0.0001元，小数点后第5位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

#### 五、估值程序

1、各类基金份额净值是按照每个工作日闭市后，该类基金份额的基金资产净值除以当日该类基金份额的余额数量计算，精确到0.0001元，小数点后第5位四舍五入。基金管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家另有规定的，从其规定。

#### 第十四部分 六、暂停估值的情形 七、暂停估值的情形 49

章节 《长安鑫珏主题轮动混合型证券投资基金基金合同》内容

《长安泓沅中短债债券型证券投资基金

基金合同》内容

#### 基金资产估

值 3、当前一估值日占基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性

时，基金管理人经与基金托管人协商一致的；

3、当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术

仍导致公允价值存在重大不确定性时，基金管理人经与基金托管人协商一致的；

#### 第十四部分

##### 基金资产估

##### 值

#### 八、特殊情况的处理

2、由于不可抗力原因，或由于证券交易所、期货交易所、登记结算公司等发送的数据错误等原因，基金管理人、基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，……

#### 九、特殊情况的处理

2、由于不可抗力原因，或由于证券交易所、登记结算公司等发送的数据错误等原因，基金管理人、基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，……

#### 第十五部分

##### 基金费用与

##### 税收

#### 二、基金费

##### 用计提方

##### 法、计提标

##### 准和支付方

##### 式

#### 1、基金管理

##### 人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.00%年费率计提。基金管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.40%年费率计提。基金管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

#### 第十五部分

##### 基金费用与

##### 税收

#### 四、基金税

##### 收

本基金运作过程中涉及各纳税主体，其纳



税义务按国家税收法律、法规执行。

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。基金财产投资的相关税收，由基金份额持有人承担，基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。

## 第十六部分

### 基金的收益

#### 与分配

### 五、收益分

#### 配方案的确定、公告与

#### 实施

基金红利发放日距离收益分配基准日（即可

供分配利润计算截止日）的时间不得超过 15

个工作日。

## 第十七部分

### 基金的会计

#### 与审计

### 一、基金会

#### 计政策

2、基金的会计年度为公历年度的 1 月 1 日至

12 月 31 日；基金首次募集的会计年度按如

下原则：如果《基金合同》生效少于 2 个月，

可以并入下一个会计年度披露；

2、基金的会计年度为公历年度的 1 月 1 日至 12

月 31 日；如果《基金合同》生效少于 2 个月，

可以并入下一个会计年度披露；

## 第十八部分

### 基金的信息

一、本基金的信息披露应符合《基金法》、《运

作办法》、《信息披露办法》、《基金合同》及

一、本基金的信息披露应符合《基金法》、《运

作办法》、《信息披露办法》、《流动性风险管理 50

章节 《长安鑫珏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

披露 其他有关规定。相关法律法规关于信息披露

的规定发生变化时，本基金从其最新规定。

规定》、《基金合同》及其他有关规定。相关法

律法规关于信息披露的规定发生变化时，本基

金从其最新规定。

## 第十八部分

### 基金的信息

#### 披露

#### 五、公开披

#### 露的基金信

#### 息

##### （一）基金

##### 招募说明

##### 书、《基金合

##### 同》、基金托

##### 管协议

基金募集申请经中国证监会注册后，基金管理人在基金份额发售的 3 日前，将基金招募说明书、《基金合同》摘要登载在指定媒介上；基金管理人、基金托管人应当将《基金合同》、基金托管协议登载在网站上。

## 第十八部分

### 基金的信息

#### 披露

#### 五、公开披

#### 露的基金信

#### 息

##### （二）基金份额发售公告

基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告，并在披露招募说明书的当日登载于指定媒介上。

##### （三）《基金合同》生效公告

基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日在指定媒介上登载《基金合同》生效公告。

## 第十八部分

### 基金的信息

#### 披露

#### 五、公开披

#### 露的基金信

#### 息

##### （六）基金定期报告，包括基金年度报告、

##### 基金半年度报告和基金季度报告

在本基金持续运作过程中，基金管理人应当

在基金年度报告和半年度报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。

如报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额 20% 的情形，为保障其他投资者的权益，基金管理人应当在基金季度报告、半年度报告、年度报告等基金定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有基金份额及占比、报告期内持有基金份额变化情况及本基金的特定风险，中国证监会认定的特殊情形除外。

（四）基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告

基金管理人应当在基金年度报告和半年度报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。

如报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额 20% 的情形，为保障其他投资者的权益，基金管理人至少应当在定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有基金份额及占比、报告期内持有基金份额变化情况及本基金的特定风险，中国证监会认定的特殊情形除外。

第十八部分

基金的信息

披露

（七）临时报告

7、基金募集期延长；

（五）临时报告

51

章节 《长安鑫珏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

五、公开披

露的基金信

息

第十八部分

基金的信息

披露

五、公开披

露的基金信

息

（五）临时

报告

增加如下内容：

28、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；

第十八部分

基金的信息

披露

五、公开披

露的基金信

息

（十）投资股指期货和国债期货的相关公告

基金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露股指期货和国债期货的交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示股指期货和国债期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标等。

（十一）投资非公开发行股票的相关公告

基金管理人在本基金投资非公开发行股票后 2 个交易日内，在中国证监会指定媒介披露所投资非公开发行股票的名称、数量、总成本、账面价值，以及总成本和账面价值占基金资产净值的比例、锁定期等信息。

第十八部分

基金的信息

披露

五、公开披

露的基金信

息

（十三）投资中小企业私募债的相关公告

基金管理人应当在基金投资中小企业私募债后 2 个交易日内，在中国证监会指定媒介披露所投资中小企业私募债的名称、数量、期限、收益率等信息。基金管理人应当在基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露中小企业私募债的投资情况。

第十九部分

基金合同的

变更、终止

与基金财产

的清算

## 一、《基金合

1、变更基金合同涉及法律法规规定或基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

1、变更基金合同涉及法律法规规定或本基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于法律法规规定和基金合同约定可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。 52

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

同》的变更 2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议须报中国证监会备案，自表决通过之日起生效，并自决议生效后 2 个工作日内在指定媒介公告。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行，自决议生效后 2 个工作日内在指定媒介公告。

第十九部分

基金合同的

变更、终止

与基金财产

的清算

二、《基金合

同》的终止

事由

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止： 有下列情形之一的，经履行相关程序后，

《基

金合同》应当终止：

第十九部分

基金合同的

变更、终止

与基金财产

的清算

二、《基金合

同》的终止

事由

3、基金合同生效后，连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或基金资产净值低于 5000 万元情形的；

## 第十九部分 基金合同的 变更、终止 与基金财产 的清算

### 三、基金财 产的清算

6、基金财产清算的期限为 6 个月，因本基金所持证券流动性受到限制、结算保证金相关规定等客观因素而不能及时变现的，清算期限可相应延长。

6、基金财产清算的期限为 6 个月，但因本基金所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的，清算期限相应顺延。

## 第二十二部 分 基金合 同的效力

1、《基金合同》经基金管理人、基金托管人双方盖章（或合同专用章）以及双方法定代表人或授权代表签字或盖章后成立，并在募集结束后经基金管理人向中国证监会办理基金备案手续，并经中国证监会书面确认后生效。

1、《基金合同》由《长安鑫垚主题轮动混合型证券投资基金基金合同》修订而成。《基金合同》经基金管理人、基金托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签章，报经中国证监会注册，且经 2019 年 XX 月 XX 日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通过，自 2019 年 XX 月 XX 日起，《基金合同》生效，原《长安鑫垚主题轮动混合型证券投资基金基金合同》自同一日起失效。