

长安泓泽纯债债券型证券投资基金

2020 年第 3 季度报告

2020 年 09 月 30 日

基金管理人:长安基金管理有限公司

基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期:2020 年 10 月 28 日

目录

| | |
|---|----|
| §1 重要提示..... | 3 |
| §2 基金产品概况..... | 3 |
| §3 主要财务指标和基金净值表现..... | 6 |
| 3.1 主要财务指标..... | 6 |
| 3.2 基金净值表现..... | 7 |
| §4 管理人报告..... | 9 |
| 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介..... | 9 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明..... | 9 |
| 4.3 公平交易专项说明..... | 9 |
| 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析..... | 10 |
| 4.5 报告期内基金的业绩表现..... | 10 |
| 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明..... | 10 |
| §5 投资组合报告..... | 10 |
| 5.1 报告期末基金资产组合情况..... | 10 |
| 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合..... | 11 |
| 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细..... | 11 |
| 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 11 |
| 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细..... | 12 |
| 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细..... | 12 |
| 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细..... | 12 |
| 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细..... | 12 |
| 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明..... | 12 |
| 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 12 |
| 5.11 投资组合报告附注..... | 12 |
| §6 开放式基金份额变动..... | 13 |
| §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况..... | 13 |
| 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况..... | 14 |
| 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细..... | 14 |
| §8 影响投资者决策的其他重要信息..... | 14 |
| 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况..... | 14 |
| 8.2 影响投资者决策的其他重要信息..... | 14 |
| §9 备查文件目录..... | 15 |
| 9.1 备查文件目录..... | 15 |
| 9.2 存放地点..... | 15 |
| 9.3 查阅方式..... | 15 |

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2020年10月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2020年07月01日起至2020年09月30日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 长安泓泽纯债债券 |
| 基金主代码 | 003731 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2016年11月16日 |
| 报告期末基金份额总额 | 205,102,273.83份 |
| 投资目标 | 在严格控制风险的前提下，通过积极主动的投资管理，追求超越业绩比较基准的投资回报和长期稳健增值。 |
| 投资策略 | <p>1、 久期策略</p> <p>久期是衡量债券价格变动对利率变动敏感性最重要和最主要的指标，也是影响组合收益率的重要因素。久期越长，债券价格对利率的变动就越敏感，债券价格的波动就越大。久期策略主要指综合各类经济和市场情况，确定债券组合的久期水平。</p> <p>2、 类属配置策略</p> <p>类属配置策略即决定资金在不同类型债券间的分配，本基金类属配置策略包括两个层面：决定利率债和信用债的配置侧重和大概比例及细分类别债券的配置比例。</p> <p>本基金将根据对经济周期和市场环境的把握，基于</p> |

对财政政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济的持续跟踪，结合市场上主要的债券配置机构资金的情况，深入分析利率债和信用债的相对投资价值，确定利率债和信用债的配置侧重和大概比例，并根据市场的变化趋势，及时进行调整。

3、 期限结构策略

在对影响利率和信用风险变化的宏观和市场因素分析的基础上，本基金通过预测同一类型债券收益率曲线的形状和变化趋势，在久期策略和类属配置策略的基础上，确定债券组合最优的期限结构。具体来看，期限结构策略可细分为跟踪收益率曲线的骑乘策略和基于收益率曲线变化的子弹策略、杠铃策略及梯式策略。

骑乘策略是当收益率曲线比较陡峭时，买入期限位于收益率曲线陡峭处的债券，通过债券收益率的下滑，获得资本利得收益。

子弹策略是在收益率曲线较陡时，使投资组合中债券的久期集中于收益率曲线的一点；杠铃策略是在收益率曲线可能呈现两头下降较中间下降更多的蝶式变动时，使投资组合中债券的久期集中在收益率曲线的两端；梯式策略是在收益率曲线水平移动时，使投资组合中的债券久期均匀分布于收益率曲线上。

4、 信用债券投资策略

信用债券面临着债券本息无法按时兑付或无法部分或全部兑付的信用风险，同时信用风险带来了信用溢价，使信用债券的收益率高于同期限的利率债，因此信用债券成为决定债券组合收益率和风险水平的重要券种。

本基金拟通过承担适度的信用风险获取信用溢价收益以提升组合的收益率并控制组合的风险，信用债券投资策略包括个券精选、行业配置和动态调整三个层面。通过定性和定量分析，精选信用评级较高、信用风险小、收益率相对较高的个券，再通过筛选行业并在不同行业中分散配置以分散信用债券的风险，最后密切跟踪个券和发债主体的情况，对于经营或信用可能恶化的个券，及时卖出。

定性分析主要包括对企业性质和内部治理情况、财务管理的风格、企业的盈利模式、企业在产业链中的位置和地位、产品竞争力和企业核心优势等企业内部因素分析，以及企业的股东背景、政府对企业的支持、银企关系、企业对国家或地方的重要程度等外部支持因素分析。定量分析主要包括资本结构分析、现金获取能力分析、盈利能力分析和偿债能力分析等。同时，关注个券的债券条款和特征，包括其信用评级、收益率（到期收益率、票面利率、利息支付方式和利息税务处理）、剩余期限、久期、凸性、流动性（发行总量、流通量、上市时间）等指标。综合上述因素决定是否将个券纳入备选债券库。

5、 资产支持证券投资策略

本基金将深入研究资产支持证券的市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率水平等基本因素，并且结合债券市场宏观分析的结果，评估资产支持证券的信用风险、利率风险、流动性风险和提前偿付风险，辅以量化模型分析，评估其内在价值进行投资。

6、 证券公司短期公司债券投资策略

本基金将根据审慎原则，密切跟踪发行主体的资产负债率和现金流等基本因素以及债券的信用评级、收益率和投资人数及流动性情况，重点投资具有较好流动性和具有较高相对投资价值的品种，力求在控制风险的前提下提高投资收益。

7、 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。同时，本基金持续跟踪所投债券发债主体的经营情况和财务指标等，分析评估发债主体未来的偿债能力，对中小企业私募债的信用风险进行评估并及时作出反应。

| | | |
|-----------------|--|---------------|
| | <p>8、 国债期货投资策略</p> <p>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，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。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。</p> <p>9、 回购套利策略</p> <p>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。</p> | |
| 业绩比较基准 | 中国债券综合全价指数的收益率。 | |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金，但低于股票型基金和混合型基金，属于较低风险的投资品种。 | |
| 基金管理人 | 长安基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 上海浦东发展银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 长安泓泽纯债债券A | 长安泓泽纯债债券C |
| 下属分级基金的交易代码 | 003731 | 003732 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 204, 516, 415. 81份 | 585, 858. 02份 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期(2020年07月01日 - 2020年09月30日) | |
|-----------------|--------------------------------|--------------|
| | 长安泓泽纯债债券A | 长安泓泽纯债债券C |
| 1. 本期已实现收益 | 3, 550, 935. 09 | 12, 582. 46 |
| 2. 本期利润 | 1, 727, 338. 27 | 3, 933. 31 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0. 0084 | 0. 0054 |
| 4. 期末基金资产净值 | 229, 374, 118. 13 | 639, 603. 12 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1. 1215 | 1. 0917 |

- 1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
- 2、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
- 3、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

长安泓泽纯债债券A净值表现

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月 | 0.75% | 0.05% | -1.48% | 0.08% | 2.23% | -0.03% |
| 过去六个月 | 1.11% | 0.07% | -2.50% | 0.10% | 3.61% | -0.03% |
| 过去一年 | 4.14% | 0.07% | -0.09% | 0.09% | 4.23% | -0.02% |
| 过去三年 | 14.71% | 0.05% | 4.21% | 0.07% | 10.50% | -0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | 17.82% | 0.10% | -0.15% | 0.08% | 17.97% | 0.02% |

本基金整体业绩比较基准为：中国债券综合全价指数的收益率。

长安泓泽纯债债券C净值表现

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月 | 0.73% | 0.05% | -1.48% | 0.08% | 2.21% | -0.03% |
| 过去六个月 | 1.06% | 0.07% | -2.50% | 0.10% | 3.56% | -0.03% |
| 过去一年 | 4.04% | 0.07% | -0.09% | 0.09% | 4.13% | -0.02% |
| 过去三年 | 15.02% | 0.05% | 4.21% | 0.07% | 10.81% | -0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | 14.73% | 0.08% | -0.15% | 0.08% | 14.88% | 0.00% |

本基金整体业绩比较基准为：中国债券综合全价指数的收益率。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

长安泓泽纯债债券A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



本基金基金合同生效日为 2016 年 11 月 16 日，按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月为建仓期，截止到建仓期结束时，本基金的各项投资组合比例已符合基金合同的相关规定。基金合同生效日至报告期期末，本基金运作时间已满一年，图示日期为 2016 年 11 月 16 日至 2020 年 09 月 30 日。

长安泓泽纯债债券C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



本基金基金合同生效日为 2016 年 11 月 16 日，按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月为建仓期，截止到建仓期结束时，本基金的各项投资组合比例已符合基金合同的相关规定。基金合同生效日至报告期期末，本基金运作时间已满一年，图示日期为 2016 年 11 月 16 日至 2020 年 09 月 30 日。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|----------|-------------|------|--------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 刘兴旺 | 本基金的基金经理 | 2019-09-17 | - | 14 年 | 曾任申银万国证券股份有限公司固定收益总部研究员、华宝兴业基金管理有限公司固定收益部基金经理助理、泰信基金管理有限公司基金经理、国投瑞银基金管理有限公司基金经理、国联证券资产管理部副总经理兼固收业务总监、长安基金管理有限公司投资经理等职，现任长安基金管理有限公司固收总监、基金经理。 |

- 1、任职日期和离任日期均指公司做出决定后正式对外公告之日；
- 2、证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金运作管理办法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人树立价值投资理念，设置合理的组织架构和科学的投资决策体系，确保投资、研究、交易各个环节的独立性。同时，建立健全公司适用的投资对象备选库和

交易对手备选库，共享研究成果，在确保投资组合间的信息隔离与保密的情况下，保证建立信息公开、资源共享的公平投资管理环境。

公司建立了专门的公平交易制度，并在交易系统中采用公平交易模块，保证公平交易的严格执行。对异常交易的监控包括事前、事中和事后三个环节，并经过严格的报告和审批程序，防范和控制异常交易。

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《长安基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度债券市场呈下跌熊市走势，收益率震荡走高。来之两拨冲击，第一波是7月上旬权益单边走强大类资产转换，第二波是8月中下旬以来的特别国债以及专项债的供给压力。收益率先扬后抑，牛熊转换迅速。受此影响，净值大幅波动，这其中既有市场波动的原因，也有规模急剧变动带来的冲击。个人对央行货币政策微调估计不足，对规模的前后急剧波动估计也不够充分，导致规模、净值波动较大。

目前市场对货币政策预期较为一致，对市场偏中性。但年内利率债供给高峰已过，叠加美国大选带来的可能的政策扰动，利率债有交易机会，但趋势性机会仍需等待。若基于目前央行公开市场利率测算，货币市场利率定位偏高，有一定的压缩空间，但中长远端预计高位震荡。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末长安泓泽纯债债券A基金份额净值为1.1215元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.75%，同期业绩比较基准收益率为-1.48%；截至报告期末长安泓泽纯债债券C基金份额净值为1.0917元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.73%，同期业绩比较基准收益率为-1.48%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金从2020年07月22日至2020年09月30日连续51个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人的情形，未出现基金资产净值低于五千万元情形。基金管理人已持续关注并拟采取适当的措施。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|----|-------|------------------|
|----|----|-------|------------------|

| | | | |
|---|-------------------|----------------|--------|
| 1 | 权益投资 | - | - |
| | 其中：股票 | - | - |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 210,329,102.40 | 91.31 |
| | 其中：债券 | 210,329,102.40 | 91.31 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | 14,200,000.00 | 6.16 |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 1,885,890.90 | 0.82 |
| 8 | 其他资产 | 3,929,158.07 | 1.71 |
| 9 | 合计 | 230,344,151.37 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|---------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | 78,417,694.50 | 34.09 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 24,986,366.80 | 10.86 |
| | 其中：政策性金融债 | 24,986,366.80 | 10.86 |
| 4 | 企业债券 | 96,820,041.10 | 42.09 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | 10,105,000.00 | 4.39 |

| | | | |
|----|-----------|----------------|-------|
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 210,329,102.40 | 91.44 |

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|---------|-----------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 010303 | 03国债(3) | 720,420 | 73,187,467.80 | 31.82 |
| 2 | 200201 | 20国开01 | 200,000 | 19,988,000.00 | 8.69 |
| 3 | 1880179 | 18桃源经开债01 | 200,000 | 19,952,000.00 | 8.67 |
| 4 | 1780347 | 17安顺交投债 | 200,000 | 19,246,000.00 | 8.37 |
| 5 | 127634 | 17安顺债 | 200,000 | 15,978,000.00 | 6.95 |

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未进行股指期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未进行国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2 报告期内本基金投资前十名股票中不存在超出合同规定备选股票库之外的情况。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 7,359.58 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 3,921,798.49 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 3,929,158.07 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期内本基金投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| | 长安泓泽纯债债券A | 长安泓泽纯债债券C |
|-------------------------------|----------------|--------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 204,812,959.96 | 1,089,313.31 |
| 报告期期间基金总申购份额 | - | - |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 296,544.15 | 503,455.29 |
| 报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列) | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 204,516,415.81 | 585,858.02 |

总申购份额包含红利再投、转换入份额，总赎回份额包含转换出份额。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | 报告期末持有基金情况 | | |
|-------|----------------|------------------------|----------------|------|------------|----------------|--------|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 |
| 机构 | 01 | 20200701-20200930 | 114,816,882.17 | 0.00 | 0.00 | 114,816,882.17 | 55.98% |
| | 02 | 20200701-20200930 | 89,575,048.64 | 0.00 | 0.00 | 89,575,048.64 | 43.67% |

产品特有风险

本基金由于存在上述单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况，存在以下特有风险：

(1) 当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对重大事项进行投票表决时可能拥有较大话语权；

(2) 在极端情况下，当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于5000万元，进而可能导致本基金终止或与其他基金合并或转型为另外的基金，其他基金份额持有人丧失继续投资本基金的机会；

(3) 当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，更容易触发巨额赎回条款，基金份额持有人将无法及时赎回所持有的全部基金份额；

(4) 当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，基金为支付赎回款项而卖出所持有的证券，可能造成证券价格波动，导致本基金的收益水平发生波动。同时，巨额赎回、份额净值小数保留位数是采用四舍五入、管理费及托管费等费用是按前一日资产计提，会导致基金份额净值出现大幅波动；

(5) 当某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金规模的 50%时，本基金管理人将不再接受该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。在其他基金份额持有人赎回基金份额导致某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金规模 50%的情况下，该基金份额持有人将面临所提出的对本基金基金份额的申购及转换转入申请被拒绝的风险。

如果投资人某笔申购或转换转入申请导致其持有本基金基金份额达到或超过本基金规模的50%，

该笔申购或转换转入申请可能被确认失败。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

截至2020年10月21日日终，本基金已连续60个工作日出现基金份额持有人数量不满200人的情形。根据《基金合同》的约定，本基金将依法进入基金财产清算程序，且无需召开基金份额持有人大会审议。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》《公开募集证券投资基金运作管理办法》《长安泓泽纯债债券型证券投资基金基金合同》（以下简称《基金合同》）的有关规定，长安泓泽纯债债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）已出现了基金合同应当终止的事由，长安基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）应当在上述事由出现后按照约定程序终止《基金合同》，并依法对基金财产进行清算，本次事项无需召开基金份

额持有人大会审议。本基金最后运作日为2020年10月22日，自2020年10月23日起进入清算程序。

自2020年10月23日起，本基金进入基金财产清算程序，停止办理申购、赎回、基金转换和定期定额投资等业务并且之后不再恢复，投资者将无法提交赎回申请，只能按照基金合同中关于基金财产清算的相关规定获得所分配的基金财产清算剩余财产。

敬请投资者关注本基金基金财产清算的后续相关公告。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、长安泓泽纯债债券型证券投资基金基金合同；
- 3、长安泓泽纯债债券型证券投资基金托管协议；
- 4、长安泓泽纯债债券型证券投资基金招募说明书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内披露的各项公告。

9.2 存放地点

上海市浦东芳甸路1088号紫竹大厦16楼

9.3 查阅方式

投资者可到基金管理人、基金托管人的办公场所或基金管理人网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本管理人。

咨询电话：400-820-9688

公司网址：www.changanfunds.com。

长安基金管理有限公司

2020年10月28日