# 平安大华策略先锋混合型证券投资基金招募说明书

**基金管理人:平安大华基金管理有限公司**
**基金托管人:中国银行股份有限公司**

**【重要提示】**

平安大华策略先锋混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)于2012年2月27日经中国证券监督管理委员会证监许可【2012】248号文核准募集。

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》经中国证监会核准,但中国证监会对本基金募集的核准,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

投资有风险,投资者认购(或申购)基金时应认真阅读本招募说明书。

基金管理人依照格尽职守、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。

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,请认真阅读基金合同、本招募说明书,全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,对认购(或申购)基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资者在获得基金投资收益的同时,亦承担基金投资中出现的各类风险,投资本基金可能遇到的风险包括:政府政策变化等因素带来的行业风险以及行业股票整体表现可能较差的风险,基金投资回报可能低于业绩比较基准的风险,证券市场整体环境引发的系统性风险,个别证券特有的非系统性风险,大量赎回或暴跌导致的流动性风险,基金投资过程中产生的操作风险,因交收违约和投资债券引发的信用风险,以及本基金投资策略所特有的风险,等等。本基金为混合型基金,其预期风险和收益水平高于债券型基金及货币市场基金,低于股票型基金。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引致的投资风险,由投资者自行负责。

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并不构成对本基金业绩表现的保证。

## 一、绪言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称《基金法》)、《证券投资基金运作管理办法》(以下简称《运作办法》)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称《销售办法》)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称《信息披露办法》)、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第5号《招募说明书的内容与格式》》等有关法律法规以及《平安大华策略先锋混合型证券投资基金基金合同》(编写。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息,或对本招募说明书作任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资者自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

## 二、释义

本《招募说明书》中除非文意另有所指,下列词语有如下含义:

| | |
|---|---|
| 基金或本基金: | 指平安大华策略先锋混合型证券投资基金; |
| 基金合同: | 指《平安大华策略先锋混合型证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充; |
| 招募说明书: | 指《平安大华策略先锋混合型证券投资基金招募说明书》及其定期更新; |
| 发售公告: | 指《平安大华策略先锋混合型证券投资基金基金份额发售公告》 |
| 托管协议 | 指《平安大华策略先锋混合型证券投资基金托管协议》及其任何有效修订和补充; |
| 中国证监会: | 指中国证券监督管理委员会; |
| 中国银监会: | 指中国银行业监督管理委员会; |
| 《基金法》: | 指2003年10月28日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过的自2004年6月1日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及不时做出的修订; |
| 《销售办法》: | 指中国证监会2011年6月9日颁布、同年10月1日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订; |
| 《运作办法》: | 指2004年6月29日中国证监会公布并于2004年7月1日起实施的《证券投资基金运作管理办法》及不时做出的修订; |
| 《信息披露办法》: | 指中国证监会2004年6月8日颁布并于2004年7月1日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及不时作出的修订; |
| 元: | 指人民币元; |
| 基金管理人: | 指平安大华基金管理有限公司; |
| 基金托管人: | 指中国银行股份有限公司; |
| 注册登记业务: | 指本基金登记、存管、清算和交收业务,具体内容包括投资者基金账户管理、基金份额注册登记、清算及基金交易确认、发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等; |
| 注册登记机构: | 指办理本基金注册登记业务的机构。本基金的注册登记机构为平安大华基金管理有限公司或接受平安大华基金管理有限公司委托代为办理本基金注册登记业务的机构; |
| 投资者: | 指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者; |
| 个人投资者: | 指依据中华人民共和国有关法律法规可以投资于证券投资基金的自然人; |
| 机构投资者: | 指在中国境内合法注册登记或经有权政府部门批准设立的有效存续并依法可以投资于证券投资基金的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织; |
| 合格境外机构投资者: | 指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理办法》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; |
| 基金份额持有人大会: | 指按照基金合同第九部分之规定召集、召开并由基金份额持有人或其合法的代理人进行表决的会议; |
| 基金募集期: | 指基金合同和招募说明书中载明,并经中国证监会核准的基金份额募集期限,自基金份额发售之日起最长不超过3个月; |
| 基金合同生效日: | 指募集结束,基金募集的基金份额总额、募集金额和基金份额持有人人数符合相关法律法规和基金合同规定的,基金管理人依据《基金法》向中国证监会办理备案手续后,中国证监会的书面确认之日; |
| 存续期: | 指基金合同生效至终止之间的不定期期限; |
| 工作日: | 指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日; |
| 认购: | 指在基金募集期内,投资者按照基金合同的规定申请购买本基金基金份额的行为; |
| 申购: | 指在基金合同生效后的存续期间,投资者申请购买本基金基金份额的行为; |
| 赎回: | 指在基金合同生效后的存续期间,基金份额持有人按基金合同规定的条件要求基金管理人购回本基金基金份额的行为; |
| 巨额赎回: | 指在单个开放日,本基金的基金份额净赎回申请(赎回申请总份额扣除申购总份额后的余额)与净转出申请(转出申请总份额扣除转入申请总份额后的余额)之和超过上一日基金总份额的10%; |
| 基金转换: | 指基金份额持有人按基金管理人规定的条件,申请将其持有的基金管理人管理的某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金的基金份额的行为; |
| 定期定额投资: | 指投资者通过有关销售机构提出申请,约定每期扣款日、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者指定银行账户内自动完成扣款及基金申购申请的一种投资方式。 |
| 转托管: | 指基金份额持有人将其基金账户内的某一基金的基金份额从一个销售机构托管到另一销售机构的行为; |
| 指令: | 指基金管理人在运用基金财产进行投资时,向基金托管人发出的资金划拨及实物券调拨等指令; |
| 代销机构: | 指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件,取得基金代销业务资格并接受基金管理人委托,代为办理基金认购、申购、赎回和其他基金业务的机构; |
| 销售机构: | 指基金管理人及本基金代销机构; |
| 基金销售网点: | 指基金管理人的直销中心及基金代销机构的代销网点; |
| 指定媒体: | 指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊和互联网网站或其它媒体; |
| 基金账户: | 指注册登记机构为基金投资者开立的记录其持有的由该注册登记机构办理注册登记的基金份额余额及其变动情况的账户; |
| 交易账户: | 指销售机构为投资者开立的记录其持有的由该注册登记机构办理认购、申购、赎回、转换及转托管等业务而引起的基金份额的变动及结余情况的账户; |
| 开放日: | 指为投资者办理基金申购、赎回等业务的工作日; |
| T 日: | 指投资者向销售机构提出申购、赎回或其他业务申请的开放日; |
| T+n日: | 指T日后(不包括T日)第n个工作日,n指自然数; |
| 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、银行存款利息以及其他合法收入; |
| 基金资产总值: | 指基金持有的各类有价证券、银行存款本息、应收款项以及以其他资产等形式存在的基金资产的价值总和; |
| 基金资产净值: | 指基金资产总值减去基金负债后的价值; |
| 基金份额净值 | 指以计算日基金资产净值除以计算日基金份额余额所得的单位基金份额的价值; |
| 基金资产估值: | 指计算、评估基金资产和负债的价值,以确定基金资产净值和基金份额净值的过程; |
| 货币市场工具: | 指现金;一年以内(含一年)的银行定期存款、大额存单;剩余期限在三百九十七天以内(含三百九十七天)的债券;期限在一年以内(含一年)的债券回购;期限在一年以内(含一年)的中央银行票据;中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的金融工具; |
| 法律法规: | 指中华人民共和国现行有效的法律、行政法规、司法解释、地方法规、地方规章、部门规章及其他规范性文件以及对于该等法律法规的不时修改和补充; |
| 不可抗力: | 指本基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服,且在本基金合同由基金管理人、基金托管人签署之日后发生的,使本基金合同当事人无法全部或部分履行本基金合同的任何事件。 |

## 三、基金管理人

(一)基金管理人基本情况

1、基金管理人:平安大华基金管理有限公司
注册地址:深圳市福田区大中华国际交易广场第八层
办公地址:深圳市福田区大中华国际交易广场第八层
批准设立机关:中国证券监督管理委员会
批准设立文号:中国证监会 证监许可【2010】1917号
法定代表人:杨秀丽
成立日期:2011年1月7日
组织形式:有限责任公司(中外合资)
注册资本:人民币30000万元
存续期间:持续经营
联系人:滕大江
联系电话:0755-22623179

2、股东名称、股权结构及持股比例:

| 股东名称 | 出资额(万元) | 出资比例 |
|---|---|---|
| 平安信托有限责任公司 | 18,210 | 60.7% |
| 新加坡大华资产管理有限公司 | 7,500 | 25% |
| 三亚盈湾旅业有限公司 | 4,290 | 14.3% |
| 合计 | 30,000 | 100% |

基金管理人无任何受处罚记录。

(二)主要人员情况

1、董事、监事及高级管理人员

①董事会成员

杨秀丽女士,董事长,硕士,高级经济师。曾任平安保险公司办公室主任;平安保险公司办公室、董事会秘书处主任、秘书长;平安保险公司总经理室总经理助理、副总经理;平安证券有限责任公司董事长兼总经理;中国平安保险(集团)股份有限公司副总经理。

李克难先生,董事,博士,1960年生。曾任湖南大学教师;湖南省政府经济研究信息中心经济预测处副处长、副研究员;湖南省政府研究室宏观经济处正处级研究员;湖南省委省政府经济发展战略研究小组成员;湖南证券公司副总裁兼研发中心总经理、副总裁兼北京管理总部总经理;湖南省银基金管理公司总经理;信达澳银基金管理公司总经理。

陈敬达先生,董事,硕士,1948年生,新加坡。曾任香港罗兵咸会计师事务所审计师;新鸿基证券有限公司执行董事;DBS唯高达香港有限公司执行董事;平安证券有限责任公司副总经理;平安证券有限责任公司副董事长/副总经理;平安证券有限责任公司董事长;中国平安保险(集团)执行委员会执行顾问。

王世荣先生,董事,学士,1950年生,新加坡。曾任大华银行有限公司金融机构(银行)部业务高级经理;新加坡贴现公司(大华银行的子公司)总经理;大华银行有限公司政府证券及债券部第一副总裁;大华银行有限公司黄金及期货部和外汇资金服务部高级副总裁;大华银行有限公司国际银行业务执行副总裁;大华银行有限公司环球金融与投资管理业务高级执行副总裁。

姚波先生,董事,硕士,1971年生。现任平安保险(集团)股份有限公司总经理助理、总精算师兼业划精算部总经理。历任R.J.Michalski Inc(美国)、Guardian Life Inc.co(美国)、Swiss Re(美国)精算师助理、精算师,平安保险(集团)股份有限公司副总精算师、副总经理、财务副总监、企划精算部总经理、总经理助理、总精算师兼业划精算部总经理等职务。

高鹏先生,董事,学士,1977年生。曾任新疆伊犁人民广播电台节目部副主任、平安人寿保险公司新疆分公司总经理秘书、营业区主管、中心支公司负责人、营销管理部主管、中国平安保险(集团)股份有限公司科室主任、员工服务部/人才绩效管理部/薪酬规划管理部副总经理(住持工作)。

张文杰先生,董事,学士,1964年生。现任大华资产管理有限公司执行董事及首席执行长,新加坡投资管理协会执行委员会委员。历任新加坡政府投资公司(特别投资部门)首席投资员,大华资产管理有限公司组合经理,国际股票和全球科技团队主管。

曹勇先生,独立董事,博士,1954年生,新加坡。曾任中国社会科学院经济研究所发展研究室副主任;澳大利亚工业研究院研究员;新加坡南洋理工大学,南洋商学院讲师,南洋理工大学,亚洲商业与经济研究中心,中国经济研究部研究主任;南洋理工大学,南洋商学院,曾任经济学硕士项目副主任;南洋理工大学,亚洲商业与经济研究中心主任;南洋理工大学,南洋商学院副院长;南洋理工大学,南洋商学院副教授。现任南京大学特聘教授;瑞丰生物科技(新加坡上市企业)独立董事。

刘茂山先生,独立董事,学士,1935年生。曾任中央人民政府林业部干部学校干部;中央林业部人事司干部;南开大学经济学系经济教研室主任兼支部书记;南开大学金融学系副主任、主任;南开大学风险管理与保险学系系主任;中国平安保险集团博士后工作站指导专家。

邓学定先生,独立董事,硕士,1963年生。曾任江西财经大学会计系教师;深圳市财政局会计处公务员;深圳市注册会计师协会秘书长;深圳天健信德会计师事务所合伙人。

黄士林先生,独立董事,学士,1954年生。现任广东圣天平律师事务所主任律师,中国人民大学律师学院副理事长,兼职教授。历任国家劳动人事部政策研究室法规处副处长,深圳法学研究服务中心主任。

②监事会成员

叶素兰女士,监事会主席,学士,香港。曾任纽约计算机开发公司电脑顾问;香港快速系统服务公司高级系统分析师;美国国际数据公司(IIA)管理信息系统助理总监;澳大利亚Westpac银行项目经理;美国国际数据公司(IIA)管理信息系统助理总监;香港Jardine CMG寿险公司高级主管;香港保诚保险公司IT主管;友邦保险(IIA)运营、IT总监;中国平安人寿保险股份有限公司总经理助理兼运营中心总经理。现任中国平安保险(集团)股份有限公司公司总经理助理兼首席稽核执行官;平安大华基金管理有限公司监事会主席。

蔡德发先生,监事,学士,1953年生,新加坡。曾任新加坡外交部经济与区域司务员;美国花旗银行新加坡业务当任参谋长;华联银行有限公司高级副总裁兼主管(业务运作部);华联银行有限公司执行副总裁(业务运作部);大华银行有限公司执行副总裁(业务运作部);大华银行有限公司执行副总裁(服务管道及业务运作部)。现任大华银行有限公司执行副总裁兼首席业务运作长官(环球金融与投资管理部)。

滕大江先生,监事,学士,1972年生。曾任广深铁路电务有限公司研发工程师;平安证券公司八卦三路营业部电脑部经理;平安证券风险管理部风险监控室;平安证券风险管理部风险评估室。现任平安大华基金公司监察稽核部IT财务稽核岗。

③公司高管

李克难先生,总经理,博士,1960年生。曾任湖南大学教师;湖南省政府经济研究信息中心经济预测处副处长、副研究员;湖南省政府研究室宏观经济处正处级研究员;湖南省委省政府经济发展战略研究小组成员;湖南证券公司副总裁兼研发中心总经理、副总裁兼北京管理总部总经理;湖南省银基金管理公司总经理;信达澳银基金管理公司总经理。现任平安大华基金管理有限公司总经理。

罗春风先生,副总经理,硕士,高级经济师,1966年生。曾任平安保险集团办公室总经理助理、平安人寿广州分公司副总经理、平安人寿总公司人事行政部/培训部总经理、平安保险集团品牌宣传部总经理、平安人寿北京分公司总经理。现任平安大华基金管理有限公司副总经理。

林婉文女士,副总经理,学士,新加坡。曾任新加坡大华银行集团内部顾问,电子渠道负责人,投资服务部门产品销售主管,大华资产管理公司大中华区业务开发主管,高级董事。现任平安大华基金管理有限公司副总经理。

④督察长

肖宇鹏先生,督察长,学士,1970年生。曾任中国证监会江西证监局主任科员及中国证监会上海专员办证券公司风险处置一处副处长。现任平安大华基金管理有限公司督察长。

2、基金经理

颜正华先生,复旦大学经济学硕士;上海交通大学工学学士。曾任国海证券证券投资部投资策划部经理,江南证券研究所策略研究中心经理,深圳中兴通讯股份有限公司产品事业部信息策划组组长。曾任华夏基金管理有限公司股票投资部策略分析师,基金经理助理,华夏回报证券投资基金、华夏回报二号证券投资基金基金经理。现任平安大华基金管理有限公司证券投资部经理。

③投资决策委员会成员。

本公司投资决策委员会成员包括:总经理李克难先生,副总经理罗春风先生,投资研究部总经理颜正华先生,宏观策略分析师焦巍先生。

李克难先生,总经理,博士,1960年生。曾任湖南大学教师;湖南省政府经济研究信息中心经济预测处副处长、副研究员;湖南省政府研究室宏观经济处正处级研究员;湖南省委省政府经济发展战略研究小组成员;湖南证券公司副总裁兼研发中心总经理、副总裁兼北京管理总部总经理;湖南省银基金管理公司总经理;信达澳银基金管理公司总经理。现任平安大华基金管理有限公司总经理。

颜正华先生,投资研究部总经理,硕士,1974年生。曾任国海证券证券投资部投资策划部经理,江南证券研究所策略研究中心经理,深圳中兴通讯股份有限公司产品事业部信息策划组组长。曾任华夏基金管理有限公司股票投资部策略分析师,基金经理助理,华夏回报证券投资基金、华夏回报二号证券投资基金基金经理。现任平安大华基金管理有限公司投资研究部总经理。

孙健先生,投资经理,硕士,1975年生。曾任湘财证券有限责任公司资产管理总部投资经理,中国太平人寿保险有限公司投资部、太平资产管理有限公司组合投资经理,摩根士丹利华鑫货币市场基金基金经理,银华货币市场证券投资基金、银华信用债券型证券投资基金基金经理。现任平安大华基金管理有限公司投资经理。

焦巍先生,宏观策略分析师,博士,1973年生。曾任中国银行海南分行科员,湘财证券海口营业部咨询师,湘财合丰基金管理公司研究部银行及房地产行业研究员,汉唐证券资金管理中心首席交易员。现任平安大华基金管理有限公司宏观策略分析师。

4、上述人员之间不存在近亲属关系。

(二)基金管理人的职责

1、依法募集基金,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、转换和登记事宜;

2、办理基金备案手续;

3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账,进行证券投资;

4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案,及时向基金份额持有人分配收益;

5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;

6、编制季度、半年度和年度基金报告;

7、计算并公告基金资产净值,确定基金份额申购、赎回价格;

8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项;

9、召集基金份额持有人大会;

10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料;

11、以基金管理人名义,代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为;

12、中国证监会规定的其他职责。

(四)基金管理人的承诺

1、本基金管理人承诺严格遵守现行有效的相关法律法规、基金合同和中国证监会的有关规定,建立健全内部控制制度,采取有效措施,防止违反现行有效的有关法律法规、基金合同和中国证监会有关规定的行为,还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施;

2、本基金管理人承诺严格遵守《证券法》、《基金法》及有关法律法规,建立健全内部控制制度,采取有效措施,防止下列行为发生:

①将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资;

②不公平地对待其管理的不同基金财产;

③利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人谋取利益;

④向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失;

⑤法律法规或中国证监会禁止的其他行为。

3、本基金管理人承诺加强人员管理,强化职业操守,督促和约束员工遵守国家有关法律法规及行业规范,诚实信用、勤勉尽责,不从事以下活动:

①越权或违规经营;

②违反基金合同或托管协议;

③故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法利益;

④在向中国证监会报送的资料中弄虚作假;

⑤拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管;

⑥玩忽职守、滥用职权;

⑦泄露投行有效的有关法律法规、基金合同和中国证监会的有关规定,泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密,尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息;

⑧违反证券交易场所业务规则,利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格,扰乱市场秩序;

⑨贬损同行,以抬高自己;

⑩以不正当手段谋求业务发展;

⑪有悖社会公德,损害证券投资基金人员形象;

⑫在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分;

⑬其他法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。

4、基金经理承诺

①依照有关法律法规和基金合同的规定,本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益;

②不利用职务之便为自己及其代理人、受雇人或任何第三人谋取利益;

③不违反现行有效的有关法律法规、基金合同和中国证监会的有关规定,泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密,尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息;

④不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

(五)基金管理人的内部控制制度

为保证公司规范化运作,有效地防范和化解经营风险,促进公司诚信、合法、有效经营,保障基金份额持有人利益,维护公司及公司股东的合法权益,本基金管理人建立了科学、严密、高效的内部控制体系。

1、公司内部控制的总体目标

①保证公司经营管理活动的合法合规性;

②保证基金份额持有人的合法权益不受侵犯;

③实现公司稳健、持续发展,维护股东权益;

④促进公司全体员工恪守职业操守,正直诚信,廉洁自律,勤勉尽责;

⑤保护公司最重要的资本:公司声誉。

2、公司内部控制遵循的原则

①全面性原则:内部控制必须覆盖公司的所有部门和岗位,渗透各项业务过程和业务环节,并普遍适用于公司每一位职员;

②审慎性原则:内部控制的核心是有效防范各种风险,公司组织体系的构成、内部管理制度的建立都要以防范风险、审慎经营为出发点;

③相互制约原则:公司设置的各部门、各岗位权责分明、相互制衡。

④独立性原则:公司根据业务的需要设立相对独立的机构、部门和岗位;公司内部部门和岗位的设置必须权责分明;

⑤有效性原则:各种内部管理制度具有高度的权威性,应是所有员工严格遵守的行动指南;执行内部管理制度不能有任何例外,任何人不得拥有超越制度或违反规章的权力;

⑥适时性原则:内部控制应具有前瞻性,并且必须随着公司经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律法规、政策制度等外部环境的改变及时进行相应的修改和完善;

⑦成本效益原则:公司运用科学化的经营管理方法降低运作成本,提高经济效益,力争以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果;

⑧防火墙原则:公司基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离,基金投资研究、决策、执行、清算、评估等部门和岗位,应当在物理上和制度上适当隔离。

3、内部控制的制度体系

公司制定了合理、完备、有效并易于执行的制度体系。公司制度体系由不同层面的制度构成。按照其效力大小分为四个层面:第一个层面是公司内部控制大纲,它是公司制定各项规章制度的纲要和总揽;第二个层面是公司基本管理制度,包括风险控制制度、投资管理制度、基金会计制度、信息披露制度、监察稽核制度、信息技术管理制度、公司财务制度、资料档案制度、业绩评估考核制度和紧急应变制度;第三个层面是部门业务规章,是在基本管理制度的基础上,对各部门的主要职责、岗位设置、岗位责任、操作守则等的具体说明;第四个层面是业务操作手册,是各项具体业务和管理工作的运行办法,是对业务各个细节、流程进行的描述和约束。它们的制订、修改、实施、废止应该遵循相应的程序,每一层面的内容不得与其以上层面的内容相违背。公司重视对制度的持续检验,结合业务的发展、法规及监管环境的变化以及公司风险控制的要求,不断检讨和增强公司制度的完备性、有效性。

4、关于授权、研究、投资、交易等方面的控制点

①授权制度

公司的授权制度贯穿于整个公司活动。股东会、董事会、监事会和管理层必须充分履行各自的职权,健全公司逐级授权制度,确保公司各项规章制度的贯彻执行;各项经济经营业务和管理程序必须遵从管理层制定的操作规程,经办人员的每一项工作必须是在业务授权范围内进行。公司重大业务的授权必须采取书面形式,授权书应当明确授权内容和时效。公司授权要适当、对已获授权的部门和人员应建立有效的评价和反馈机制,对已不适用的授权应及时修改或取消授权。

②公司研究业务

研究工作应保持独立、客观,不受任何部门及个人的不正当影响;建立严密的研究工作业务流程,形成科学、有效的研究方法;建立投资产品备选库制度,研究部门根据投资产品的特征,在充分研究的基础上建立和维护备选库。建立研究与投资的业务交流制度,保持畅通的交流渠道;建立研究报告质量评价体系,不断提高研究水平。

③基金投资业务

基金投资应确立科学的投资理念,根据决策的风险防范原则和效率性原则制定公司的决策程序;在进行投资时应有明确的投资授权制度,并应建立与所授权限相应的约束制度和考核制度。建立严格的投资禁止和投资限制制度,保证基金投资的合法合规性。建立投资风险评估与管理制度,将重点投资限制在规定的风险权限额度内;对于投资结果建立科学的投资管理业绩评价体系。

④交易业务

建立集中交易室和集中交易制度,投资指令通过集中交易室完成;应建立交易监测系统、预警系统和交易反馈系统,完善相关的安全设施;集中交易室应对交易指令进行审核,建立公平的交易分配制度,确保各基金利益的公平;交易记录应完善,并及时进行反馈、核对和存档保管;同时应建立科学的投资交易绩效评价体系。

⑤基金会计核算

公司根据法律法规及业务的要求建立会计制度,并根据风险控制点建立严密的会计系统,对于不同基金、不同客户独立建账,独立核算;公司通过复核制度、凭证制度、合理的估值方法和估值程序等会计措施真实、完整、及时地记载每一笔业务并正确进行会计核算和业务核算。同时还建立会计档案保管制度,确保档案真实完整。

⑥信息披露

公司建立了完善的信息披露制度,保证公开披露的信息真实、准确、完整。公司设立了信息披露负责人,并建立了相应的程序进行信息的收集、组织、审核和发布工作,以此加强对信息的审查核对,使所公布的信息符合法律法规的规定,同时加强对信息披露的检查和评价,对存在的问题及时提出改进办法。

⑦监察稽核

公司设立督察长,经董事会聘任,报中国证监会核准。根据公司监察稽核工作的需要和董事会授权,督察长可以列席公司相关会议,调阅公司相关档案,就内部控制制度的执行情况独立地展行检查、评价、报告、建议职能。督察长定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况,董事会对督察长的报告进行审议。

公司设立监察稽核部开展监察稽核工作,并保证监察稽核部的独立性和权威性。公司明确了监察稽核部及内部各岗位的具体职责,严格制订了专业任职条件、操作程序和组织纪律。

监察稽核部强化内部检查制度,通过定期或不定期检查内部控制制度的执行情况,促使公司各项经营管理活动的规范运行。

公司董事会和管理层充分重视和支持监察稽核工作,对违反法律法规和公司内部控制制度的,追究有关部门和人员的责任。

5、基金管理人关于内部控制制度声明书

①本公司承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确;

②本公司承诺根据市场变化和公司业务发展不断完善内部控制制度。

## 四、基金托管人

(一)基本情况

名称:中国银行股份有限公司(简称“中国银行”)
住所及办公地址:北京市西城区复兴门内大街1号
首次注册登记日期:1983年10月31日
变更注册登记日期:2004年8月26日
注册资本:人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整
法定代表人:肖 钢
基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字【1998】24 号
托管及投资者服务部总经理:李爱华
托管部门信息披露联系人:唐州徽
电话:010-66594855
传真:010-66594942
发展概况:

1912 年2 月,经孙中山先生批准,中国银行正式成立。从1912 年至1949 年,中国银行先后履行中央银行、国际汇兑银行和外贸专业银行职能,坚持以服务社会民众、振兴民族金融为己任,稳健经营,锐意进取,各项业务取得了长足发展。新中国成立后,中国银行长期作为国家外汇专业银行,成为我国对外开放的重要窗口和对外筹资的主要渠道。1994 年,中国银行改为国有独资商业银行。2003 年,中国银行启动股份制改造。2004 年8 月,中国银行股份有限公司挂牌成立。2006 年6 月、7 月,先后在香港联交所和上海证券交易所成功挂牌上市,成为国内首家在境内外资本市场上发行上市的商业银行。

中国银行是中国国际化和多元化程度最高的银行,在中国内地、香港澳门台湾及31个国家和地区为客户提供全面的金融服务,主要经营商业银行业务,包括公司金融业务、个人金融业务和金融市场业务,并通过全资子公司中银国际开展投资银行业务,通过全资子公司中银集团保险及中银保险经营保险业务,通过全资子公司中银集团投资从事直接投资和投资管理业务,通过控股中银基金管理有限公司从事基金管理业务,通过中银航空租赁私人有限公司经营飞机租赁业务。

在近百年的发展历程中,中国银行始终秉承追求卓越的精神、稳健经营的理念、客户至上的宗旨、诚信为本的传统和严谨细致的作风,得到了业界和客户的广泛认可和赞誉,树立了卓越的品牌形象。2010年度,中国银行被Global Finance(《环球金融》)评为2010年度中国最佳公司贷款银行和最佳外汇交易银行,被Euromoney(《欧洲货币》)评为2010 年度房地产业“中国最佳商业银行”,被英国《金融时报》评为最佳私人银行奖,被The Asset(《财资》)评为中国最佳资金融资银行,被Finance Asia(《金融亚洲》)评为中国最佳私人银行、中国最佳资金融资银行,被《21世纪经济报道》评为亚洲最佳全球化服务银行、最佳企业公民、年度中资优秀私人银行品牌。面对新的历史机遇,中国银行将积极推进创新发展、转型发展、跨境发展,向着国际一流银行的战略目标不断迈进。

(二)基金托管部门及主要人员情况

中国银行于1998年设立基金托管部,为进一步树立以投资者为中心的服务理念,中国银行于2005年3月23日正式将基金托管部更名为托管及投资者服务部,下设覆盖集合类产品、机构类产品、全球托管产品、投资分析及监督服务、风险管理与内控、核算估值、信息技术、资金和证券交收等各层面的多个团队,现有员工120余人。另外,中国银行在重点分行已开展托管业务。

目前,中国银行拥有证券投资基金、一对多专户、一对一专户、社保基金、保险资产、QFII资产、QDII资产、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、信托资产、年金资产、理财产品、海外人民币基金、私募基金等门类齐全的托管产品体系。在国内,中国银行等先开展绩效评估、风险管理等增值服务,为各类客户提供个性化的托管服务。2010年末中国银行在中国内地托管的资产突破万亿元,居同业前列。

(三)证券投资基金托管情况

截至2011年12月末,中国银行已托管长盛创新先锋混合、长盛同盛封闭、长盛同智优势混合(LOF)、大成2020生命周期混合、大成蓝筹稳健混合、大成优选封闭、大成景宏封闭、工银大盘蓝筹股票、工银核心价值股票、国泰沪深300指数、国泰金鹰保本混合、国泰金鹏蓝筹混合、国泰区位优势股票、国投瑞银稳定增利债券、海富通股票、海富通货币、海富通精选贰号混合、海富通收益增长混合、海富通中证100指数(LOF)、华宝兴业大盘精选股票、华宝兴业动力组合股票、华宝兴业先进成长股票、华夏策略混合、华夏大盘精选混合、华夏回报混合、华夏回报二号混合、华夏行业股票(LOF)、嘉实超短债债券、嘉实成长收益混合、嘉实服务增值行业混合、嘉实沪深300指数(LOF)、嘉实货币、嘉实稳健混合、嘉实研究精选股票、嘉实增长混合、嘉实债券、嘉实主题混合、嘉实回报混合、嘉实价值优势股票型、金鹰成份优选股票、金鹰行业优势股票、银河成长股票、易方达平稳增长混合、易方达策略成长混合、易方达策略成长二号混合、易方达积极成长混合、易方达货币、易方达稳健收益债券、易方达深证100ETF、易方达中小盘股票、易方达深证100ETF联接、万家180指数、万家稳健增利债券、银华优势企业混合、银华优质增长股票、银华领先策略股票、景顺长城动力平衡混合、景顺长城优选股票、景顺长城货币、景顺长城鼎益股票(LOF)、泰信天天收益货币、泰信优质生活股票、泰信蓝筹精选股票、泰信债券增强收益、招商先锋混合、泰达宏利精选股票、泰达宏利集利债券、泰达宏利中证财富大盘指数、华泰柏瑞盛世中国股票、华泰柏瑞积极成长混合、华泰柏瑞价值增长股票、华泰柏瑞货币、华泰柏瑞量化现行股票型、南方高增长股票(LOF)、国富潜力组合股票、国富强化收益债券、国富成长动力股票、宝盈核心优势混合、招商行业领先股票、东方核心动力股票、华安行业轮动股票型、摩根士丹利华鑫强收益债券型、诺德中小盘股票型、民生加银稳健成长股票型、博时宏观回报债券型、易方达岁丰添利债券型、富兰克林国海中小盘股票型、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金联接、上证中小盘交易型开放式指数、华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接、长城中小盘成长股票型、易方达医疗保健行业股票型、景顺长城稳定收益债券型、上证180金融交易型开放式指数、国泰上证180金融交易型开放式指数证券投资基金联接、诺德优选30股票型、泰达宏利聚利分级债券型、国联安优选行业股票型、长盛同鑫保本混合型、金鹰中证技术领先指数增强型、泰信中证200指数、大成内需增长股票型、银华永祥保本混合型、招商深圳电子信息传媒产业(TMT)50交易型开放式指数、招商深证TMT50交易型开放式指数证券投资基金联接、嘉实深证基本面120交易型开放式指数证券投资基金联接、深证基本面120交易型开放式指数、上证180成长交易型开放式指数、上证180成长交易型开放式指数证券投资基金联接、易方达资源行业股票型、华安深证300指数、嘉实信用债券型、华安大华行业先锋股票型、华泰柏瑞信用增利债券型、泰信中小盘精选股票型、海富通国策导向股票型、中邮上证380指数增强型、泰达宏利中证500指数分级、长盛同裕信用增利债券型、银华中证内地资源主题指数分级、平安大华深证300指数增强型、嘉实安心货币市场、嘉实海外中国股票(QDII)、银华全球优选(QDII-FOF)、长盛环球景气(行业主盘精选股票型QDII)、华泰柏瑞亚洲领导企业股票型(QDII)、信诚金砖四国积极配置(QDII)、海富通大中华精选股票型(QDII)、招商标普金砖四国指数(LOF-QDII)、华宝兴业成熟市场动量优选(QDII)、大成标普500等权重指数(QDII)、长信标普100等权重指数(QDII)、博时抗通胀增强回报(QDII)、华安大中华升级股票型(QDII)、信诚全球商品主题(QDII)、工银瑞信中国机会全球配置股票型(QDII)等137只证券投资基金,覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金,满足了不同客户多元化的投资理财需求,基金托管规模位居同业前列。

(四)托管业务的内部控制制度

中国银行开办各类基金托管业务均获得相应的授权,并在辖内实行业务授权管理和从业人员核准资格管理。中国银行自1998年开办托管业务以来严格按照相关法律法规的规定以及监管部门的监管要求,以控制和防范基金托管业务风险为主线,制定并逐步完善了包括托管业务授权管理制度、业务操作规程、员工职业道德规范、保密守则等在内的各项业务管理制度,将风险控制落实到每个工作环节;在敏感部位建立了安全保密区和隔离墙,安装了录音监听