南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书

基金管理人:南方基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
重要提示

南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金（以下简称“本基金”）由南方沪深300指数证券投资基金（以下简称“标基金”）变更投资范围及其相关事项而来。经于南方沪深300指数证券投资基金变更投资范围及其相关事项的议案》经2013年4月17日南方沪深300指数证券投资基金基金份额持有人大会决议通过，并获中国证监会2013年5月16日证监许可［2013］674号文核准。自2013年5月16日起，由“南方沪深300指数证券投资基金基金合同”修订而成的“南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同”生效，原“南方沪深300指数证券投资基金基金合同”同日起失效。

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做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

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，充分考虑自身的风险承受能力，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、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，个别证券特有的非系统性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的特定风险（详见招募说明书“风险揭示”章节）等等。本基金为南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“南方300ETF”）的联接基金，主要通过投资于南方300ETF来实现对业绩比较基准的紧密跟踪。因此，本基金的业绩表现与沪深300指数及南方300ETF的表现密切相关。同时，本基金为股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

投资者在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出投资决策。基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。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及基金份额上市交易价格波动引致的投资风险，由投资者自行负责。

1、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”）、以及“南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同”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。基金投资人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。基金投资人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。

2、释义

在本招募说明书中除非文义另有所指，下列词语具有以下含义：

本合同、《基金合同》　指“南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同”及对本合同的任何有效的修订和补充

中国　指中华人民共和国（仅为《基金合同》目的不包括香港特别行政区、澳门特别行政区及台湾地区）

法律法规　指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等

《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，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》及颁布机关对其不时做出的修订

《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》　指中国证监会2004年6月29日颁布、同年7月1日实施的并在2012年6月19日发布修订后的《证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

《信息披露办法》指中国证监会2004年6月8日颁布、同年7月1日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

元　指中国法定货币人民币元

基金或本基金　指南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金

招募说明书　指“南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书”，供基金投资者选择并决定是否提出基金申购申请的要约邀请文件，及其定期的更新

托管协议　指基金管理人与基金托管人签订的“南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议”及其任何有效修订和补充

《业务规则》　指《南方基金管理有限公司开放式基金业务规则》

中国证监会　指中国证券监督管理委员会

银行监管机构　指中国人民银行和或中国银行业监督管理委员会

基金管理人　指南方基金管理有限公司

基金托管人　指中国工商银行股份有限公司

基金份额持有人　指根据《基金合同》及相关文件合法取得本基金基金份额的投资者

基金代销机构　指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格，并与基金管理人签订基金销售与服务代理协议，代为办理本基金申购、赎回和其他基金业务的代理机构

销售机构　指基金管理人及基金代销机构

基金销售网点　指基金管理人的直销网点及基金代销机构的代销网点

登记业务　指基金登记、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

登记机构　指南方基金管理有限公司或其委托的其他符合条件的办理基金登记业务的机构

《基金合同》当事人　指受《基金合同》约束，根据《基金合同》享受权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人

个人投资者　指符合法律法规规定的条件可以投资开放式证券投资基金的自然人

机构投资者　指符合法律法规规定可以投资开放式证券投资基金的在中国合法注册登记并存续或经政府有关部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体和其他组织

合格境外机构投资者　指符合现实有效的相关法律法规规定可以投资于中国境内证券市场的中国境外的机构投资者

人民币合格境外机构投资者　指按照《基金管理公司、证券公司人民币合格境外机构投资者境内证券投资试点办法》（包括其不时修订）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

投资者　指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买开放式证券投资基金的其他投资者的总称

基金合同生效日　指“南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同”生效起始日，原“南方沪深300指数证券投资基金基金合同”自同一日起失效

基金存续期　指“南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同”生效后合法存续的不定期之期间

日/天　指公历日

月　指公历月

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

开放日　指销售机构办理本基金份额申购、赎回等业务的工作日

T日　指申购、赎回或办理其他基金业务的申请日

T+n日　指自T日起第n个工作日（不包含T日）

申购　指基金投资者根据基金销售网点规定的手续，向基金管理人购买基金份额的行为

前端收费　指基金投资者在申购基金的同时可以纳申购费用

后端收费　指基金投资者在申购基金时可以先不支付申购手续费用，而在赎回时支付，申购费率随持有基金年限的增加而降低，直至为零

赎回　指基金投资者根据基金销售网点规定的手续，向基金管理人卖出基金份额的行为

巨额赎回　指在单个开放日，本基金的基金份额净赎回申请（赎回申请总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一日本基金总份额的10%时的情形

《登记结算业务实施细则》指《中国证券登记结算有限责任公司关于深圳证券交易所交易型开放式基金登记结算业务实施细则》及其不时修订

交易型开放式指数基金　指深圳证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》定　义的交易型开放式指数基金，即是指经依法募集的，以跟踪特定证券指数为目标的开放式基金，其基金份额用组合证券、现金等基金合同约定的对价进行申购、赎回，并在深圳证券交易所上市交易

标的指数　指中证指数公司编制并发布的沪深300指数及其未来可能发生的变更

目标ETF　指南方基金管理有限公司管理的南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金　（简称沪深300ETF）

ETF联接基金　是指将其绝大部分基金财产投资于目标ETF，紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，采用开放式运作方式的基金，简称联接基金

完全复制法　指一种跟踪指数的操作方法。即完全按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，达到复制指数的目的

基金账户　指基金登记机构给投资者开立的用于记录投资者持有基金管理人管理的开放式基金份额情况的账户

交易账户　指各销售机构为投资者开立的记录投资者通过该销售机构办理基金交易所引起的基金份额的变动及结余情况的账户

转托管　指投资者将其持有的同一基金账户下的基金份额从某一交易账户转入另一交易账户的业务

基金转换　指投资者向基金管理人提出申请将其所持有的基金管理人管理的任一开放式基金（转出基金）的全部或部分基金份额转换为基金管理人管理的任何其他开放式基金（转入基金）的基金份额的行为

定期定额投资计划　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，由销售机构于每期的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

基金收益　指基金投资所得的股票红利、股息、债券利息、票据投资收益、买卖证券差价、银行存款利息以及其他收益和因运用基金财产带来的成本或费用的节约

基金资产总值　指基金所拥有的各类证券及票据价值、银行存款本息和本基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和

基金资产净值　指基金资产总值扣除负债后的净资产值

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货币市场工具

指定媒体　指中国证监会指定的用以进行信息披露的全国性报刊和基金管理人、基金托管人的互联网网站

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的客观事件

3、基金管理人

一、基金管理人概况

名称:南方基金管理有限公司

住所及办公地址:深圳市福田中心区福华一路六号免税商务大厦塔楼31、32、33层整层

成立时间:1998年3月6日

法定代表人:吴万善

注册资本:1.5亿元人民币

电话:（0755）82763888

传真:（0755）82763889

联系人:鲍文革

南方基金管理有限公司是经中国证监会证监基发〔1998〕4号文批准，由南方证券有限公司、厦门国际信托投资公司、广西信托投资公司共同发起设立。2000年，经中国证监会证监基金字〔2000〕78号文批准进行了增资扩股，注册资本达到1亿元人民币。2005年，经中国证监会证监基金字〔2005〕201号文批准进行增资扩股，注册资本达1.5亿元人民币。目前股权结构:华泰证券股份有限公司45%、深圳市投资控股有限公司30%、厦门国际信托有限公司15%及兴业证券股份有限公司10%。

二、主要人员情况

1、董事会成员

吴万善先生，董事，中共党员，工商管理硕士，高级经济师。历任中国人民银行江苏省分行金融管理处科员、中国人民银行南京市分行江宁支行科员；华泰证券证券发行部副经理、总经理助理；江苏省证券登记处总经理；华泰证券副总经理、总裁，现任华泰证券股份有限公司董事长兼党委副书记、南方基金管理有限公司董事长、代总裁。

张海先生，董事，中共党员，博士研究生。历任华泰证券总裁办公室总裁秘书、投资银行一部业务经理、福州办事处副主任、上海总部投资银行业务部副总经理、深圳总部副总经理、深圳彩田路营业部总经理、董事会秘书、总裁助理兼董事会办公室主任；现任华泰证券股份有限公司副总裁、党委委员。

姜健先生，董事，中共党员，硕士研究生。历任南京农业大学教师；华泰证券人事处职员、人事处培训教育科科长、投资银行部股票事务部副经理、投资银行一部副总经理、投资银行二部高级经理、投资银行总部副总经理兼发行部总经理、资产管理总部总经理、投资银行业务总监兼投资银行业务南京总部总经理、总裁助理兼上海总部总经理、公司机构客户服务部总经理。现任华泰证券股份有限公司副总裁、董事会秘书、党委委员。

李真先生，董事，中共党员，材料工程、企业管理双学士，高级工程师。历任机械工业部科技司材料工艺处、科研管理处副主任科员、总工程师秘书、科技与质量监督司行业技术处副处长；深圳亚洲金刚石有限公司副总经理（干部交流）；深圳市投资管理公司董事局秘书处副主任、综合部副部长、部长、总裁助理兼工业一部部长、办公室主任；深圳市通产实业有限公司党委书记、董事长；深圳会展中心管理有限责任公司党委书记、总经理、董事长；现任深圳市投资控股有限公司董事、总经理、党委副书记。

余钢先生，董事，中共党员。毕业于湘潭大学英语专业，高级经济师，中共党员。历任广州军区技术局四处见习学员；广州军区技术局组织处助理翻译、中尉；广州军区情报部副连参谋、正连参谋、副营参谋；深圳市投资管理公司人事部、董办、办公室业务经理；深圳市国资委企业领导人员管理处主任科员；深圳市国资委办公室副主任、党委秘书；深圳市国资委企业领导人员管理处副处长；深圳市地铁有限公司人力资源部部长、党支部书记；深圳市地铁集团有限公司党委委员人力资源部部长、党支部书记（2009-2010年4月兼深圳通公司董事、深圳大学轨道交通学院理事会理事）；2009.09—2009.11深圳市市委中青班培训学习；现任深圳市投资控股有限公司党委副书记、纪委书记、董事。

洪文瑾女士，董事，中共党员，硕士研究生。历任厦门经济特区建设发展公司财务部，厦门建发集团有限公司财务部副经理、厦门建发信托投资公司副总经理、总经理，厦门国际信托投资有限公司总经理，现任厦门国际信托有限公司董事长。

庄园芳女士，董事，工商管理硕士，经济师。历任兴业证券交易业务部总经理助理、负责人，证券投资部副总经理、总经理，投资总监；现任兴业证券股份有限公司副总裁。

高良玉先生，董事，中共党员，经济学硕士，经济师。历任南京农业大学审计处干部、中国人民银行金融管理司主任科员、中国证监会发行部副处长。1998年加入南方基金担任副总经理、总裁，现任南方基金管理有限公司副董事长、南方东英资产管理有限公司（香港）董事会主席。

张磊先生，独立董事，工商管理硕士（MBA）及国际关系硕士，注册金融分析师（CFA），获得美国NASD Series 7 & 65证书。曾工作于耶鲁大学投资基金办公室（Yale Endowment）及美国新生市场投资基金（Emerging Markets Management，LLC），主要从事基金管理及投资研究。历任纽约证券交易所国际董事及中国首席代表；现任HCM投资管理有限公司高级合伙人，United World College of Southeast Asia Foundation校董、耶鲁大学校务委员会成员、国际顾问委员会成员，纽约金融分析师协会会员。

周春生先生，独立董事，博士。历任美国联邦储备委员会经济学家、美国加州大学及香港大学商学院教授、中国证监会规划发展委员会委员（副局级）、中国留美金融学会理事、美国经济学会、美国金融研究会会员，Annals of Economics and Finance 编委，北京大学光华管理学院院长助理、EMBA中心主任、高层管理者培训与发展中心主任、财务金融学教授，香港大学荣誉教授，深圳证券交易所第一、二、三届上市委员会委员；现为长江商学院金融教授、EMBA和高层培训项目学术主任，国家杰出青年基金获得者。

王全洲先生，独立董事，中共党员，大学学历，1997年中国人民大学会计专业研究生班毕业，注册会计师、资产评估师、注册税务师；历任北京市财政局会计处副处长、北京会计公司总经理（征处级）；现任北京兴华会计师事务所董事长、主任会计师。

从培国先生，独立董事，法学硕士。历任北京大学法律系经济法教研室助教、经济师讲师、经济法教研室副主任，美国加州大学洛杉矶校区（UCLA）客座教授、北京大学副教授；现任北京君佑律师事务所合伙人、事务所主任。

米志明先生，独立董事，本科，高级经济师、注册会计师。历任江苏省荣源税务局副局长，扬州市税务局副局长，扬州市财政局副局长、党组书记，扬州市人民政府副秘书长，建设银行扬州市分行行长、党组书记，财政部深圳专员办专员、巡视员。

2、监事会成员

骆新都女士，职工监事，经济学硕士，经济师。历任民政部外事处处长、南方证券有限公司副总裁、南方基金管理有限公司董事长、顾问；现任南方基金管理有限公司监事会主席。

舒本娥女士，监事，本科。历任熊猫电子集团公司财务处财务处长，华泰证券计划资金部副总经理（挂持工作）、稽查监察部副总经理，现任华泰证券股份有限公司计划财务部总经理。

周景民先生，监事，工学硕士、工商管理硕士（MBA），经济师。历任深圳三九企业集团三九贸易公司财务，深圳大鹏证券有限公司投资银行部项目经理、加拿大西蒙弗雷泽大学工商管理学院MBA学生兼助教，广东美的集团战略发展部高级经理，招商局集团中国南山开发（集团）公司研究发展部高级项目经理，深圳市投资控股有限公司投资部高级经理；现任深圳市投资控股有限公司投资部高级主管。

苏荣坚先生，监事，学士学位，高级经济师。历任三明市财政局、财委，厦门信达股份有限公司财务部、厦门国际信托投资公司财务部业务主办、副经理，自营业务部经理；现任厦门国际信托有限公司财务部总监兼财务部总经理。

郑城美先生，监事，中共党员，经济学硕士。历任兴业证券华林营业部客户经理、研究发展中心市场分析师、经纪业务部市场分析师、办公室文秘部经理、南平滨江路营业部副总经理（挂持工作）、计划财务部副总经理、财务部总经理、兴业证券财务总监；现任兴业证券副总裁。

苏民先生，职工监事，博士研究生，工程师。历任安徽国投深圳证券营业部电脑工程师，华夏证券深圳分公司电脑部经理助理，南方基金管理有限公司运作保障部副总监、市场服务部总监、电子商务部总监；现任南方基金管理有限公司风险管理部总监。

3、公司高管人员

吴万善先生，董事，中共党员，工商管理硕士，高级经济师。历任中国人民银行江苏省分行金融管理处科员、中国人民银行南京市分行江宁支行科员；华泰证券证券发行部副经理、总经理助理；江苏省证券登记处总经理；华泰证券副总经理、总裁，现任华泰证券股份有限公司董事长兼党委副书记、南方基金管理有限公司董事长、代总裁。

俞文宏先生，副总裁，中共党员，工商管理硕士，经济师，历任江苏省投资公司业务经理、江苏国际招商公司部门经理、江苏省国际信托投资公司投资银行部总经理、江苏国信高科技创业投资有限公司董事长兼总经理。2003年加入南方基金，现任南方基金管理有限公司副总裁、党委委员。

郑文祥先生，副总裁，工商管理硕士。曾任职于湖北省荆州市农业银行、南方证券公司、国泰君安证券公司。2000年加入南方基金，历任国债投资经理、专户理财部副总监、南方避险增值基金基金经理、总经理助理兼养老金业务部总监，现任南方基金管理有限公司副总裁。

朱运东先生，副总裁，中共党员，经济学学士。曾任职于财政部地方预算司及办公厅、中国经济开发信托投资公司，2002年加入南方基金，历任北京分公司总经理、产品开发部总监、总裁助理、首席市场执行官，现任南方基金管理有限公司副总裁、党委委员。

秦长奎先生，副总裁，中共党员，工商管理硕士。历任南京汽车制造厂经营计划处科员，华泰证券有限责任公司营业部总经理、总裁助理兼基金部总经理、投资银行总部副总经理兼债券部总经理。2005年加入南方基金，曾任督察长兼监察稽核部总监，现任南方基金管理有限公司副总裁、纪委委员、南方东英资产管理有限公司（香港）董事。

杨小松先生，督察长，中共党员，经济学硕士，注册会计师。历任德勤国际会计师行会计专业翻译，光大银行证券部职员，证监会主任科员、副处长、处长（期间曾派往美国NASDAQ工作），局长助理、副局长、副主任。2012年加入南方基金，现任南方基金管理有限公司督察长、党委委员、党委副书记。

4、基金经理

杨德龙先生，北京大学经济学硕士、清华大学工学学士，具有基金从业资格。2006年加入南方基金，担任研究部高级行业研究员、首席策略分析师；2010年8月至2013年4月，任小康ETF及南方小康基金经理；2011年9月至今，任南方上证380ETF及联接基金基金经理；2013年3月至今，任南方策略基金经理；2013年4月至今，任本基金基金经理；2013年4月至今，任南方开元沪深300ETF基金经理。

罗文杰女士，美国南加州大学数学金融硕士、美国加州大学计算机科学硕士，具有中国基金从业资格。曾先后任职于美国Open Link Financial公司、摩根斯坦利公司，从事量化分析工作。2008年9月加入南方基金，在南方基金数量化投资部基金经理助理；2013年4月至今，任南方500基金经理；2013年4月至今，任南方500ETF基金经理；2013年5月至今，任本基金基金经理；2013年5月至今，任南方开元沪深300ETF基金经理；2013年5月至今，任南方策略基金经理。

5、投资决策委员会成员

董事长、代总裁吴万善先生，副总裁邓文祥先生，总裁助理兼投资总监邱国鹭先生，专户投资管理部执行总监蒋峰先生、固定收益部总监李海鹏先生，研究部总监史博先生、投资部执行总监陈键先生。

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

三、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、编制中期和年度基金报告；

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、有关法律、法规和中国证监会规定的其他职责。

四、基金管理人关于遵守法律法规的承诺

1、基金管理人承诺不从事违反《证券法》的行为，并承诺建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止违反《证券法》行为的发生；

2、基金管理人承诺不从事以下违反《基金法》的行为，并承诺建立健全的内部风险控制制度，采取有效措施，防止下列行为的发生：

（1）将基金管理人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牟取利益；

（4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；

（5）依照法律、行政法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他行为。

3、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权益；

（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）除按本公司制度进行基金运作投资外，直接或间接进行其他股票投资；

（9）协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易；

（10）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；

（11）贬损同行，以提高自己；

（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）以不正当手段谋求业务发展；

（14）有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；

（15）其他法律、行政法规禁止的行为。

五、基金管理人关于禁止性行为的承诺

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

1、承销证券；

2、向他人贷款或者提供担保；

3、从事承担无限责任的投资；

4、买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；

5、向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；

6、买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人有其他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；

7、从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

8、依照法律、行政法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

六、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、不能利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者谋取利益；

3、不泄露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、不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

七、基金管理人的内部控制制度

1、内部控制制度概述

为了保证公司规范运作，有效地防范和化解管理风险、经营风险以及操作风险，确保基金财务和公司财务以及其他信息真实、准确、完整，从而最大程度地保护基金份额持有人的利益，本基金管理人建立了科学合理、控制严密、运行高效的内部控制制度。

内部控制制度是指公司为实现内部控制目标而建立的一系列组织机制、管理方法、操作程序与控制措施的总称。内部控制制度由内部控制大纲、基本管理制度、部门业务规章等组成。

公司内部控制大纲是对公司章程规定的内控原则的细化和展开，是对各项基本管理制度的总揽和指导，内部控制大纲明确了内控目标、内控原则、控制环境、内控措施等内容。

基本管理制度包括内部会计控制制度、风险控制制度、投资管理制度、监察稽核制度、基金会计制度、信息披露制度、信息技术管理制度、资料档案管理制度、业绩评估考核制度和紧急应变制度等。

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。

2、内部控制原则

健全性原则。内部控制机制必须覆盖公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员，并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个运作环节。

有效性原则。通过科学的内控手段和方法，建立合理的内控程序，保证内控执行的有效执行。

独立性原则。公司各机构、部门和岗位在职能上应当保持相对独立，公司基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离。

相互制约原则。公司内部部门和岗位的设置必须权责分明、相互制衡，并通过切实可行的措施来实行。

成本效益原则。公司应充分发挥各机构、各部门及各级员工的工作积极性，运用科学化的方法尽量降低经营运作成本，提高经济效益，以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

3、主要内部控制制度

（1）内部会计控制制度

公司依据《中华人民共和国会计法》、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》、《企业财务通则》等国家有关法律、法规制订了基金会计制度、公司财务会计制度、会计工作操作流程和会计岗位职责，并针对各个风险控制点建立严密的会计系统控制。

内部会计控制制度包括凭证制度、复核制度、账务处理程序、基金估值制度和程序、基金财务清算制度和程序、成本控制制度、财务收支审批制度和费用报销管理办法、财产登记保管和实物资产盘点制度、会计档案保管和财务交接制度等。

（2）风险管理控制制度

风险控制制度由风险控制委员会组织各部门制定，风险控制制度由风险控制的机构设置、风险控制的程序、风险控制的具体制度、风险控制制度执行情况的监督等部分组成。

风险控制的具体制度主要包括投资风险管理制度、交易风险管理制度、财务风险控制制度、信息技术系统风险控制制度以及岗位分离制度、防火墙制度、反馈制度、保密制度等程序性风险管理制度。

（3）监察稽核制度

公司设立督察长，负责监督检查基金和公司运作的合法合规情况及公司内部风险控制情况。督察长由总经理提名，董事会聘任，并经全体独立董事同意。

督察长负责组织督导公司监察稽核工作。除应当回避的情况外，督察长享有充分的知情权和独立的调查权。督察长根据履行职责的需要，有权参加或者列席公司董事会以及公司业务、投资决策、风险管理等相关会议，有权调阅公司相关文件、档案。督察长应当定期或者不定期向全体董事报送工作报告，并在董事会及董事会下设的相关专门委员会定期会议上报告基金及公司运作的合法合规情况及公司内部风险控制情况。

公司设立监察稽核部门，具体执行监察稽核工作。公司配备了充足合格的监察稽核人员，明确规定了监察稽核部门及内部各岗位的职责和工作流程。

监察稽核制度包括内部稽核管理办法、内部稽核工作准则等。通过这些制度的建立，检查公司各业务部门和人员遵守有关法律、法规和规章的情况；检查公司各业务部门和人员执行公司内部控制制度、各项管理制度和业务规章的情况。

4、基金托管人

一、基金托管人基本情况

名称:中国工商银行股份有限公司

注册地址:北京市西城区复兴门内大街55号

成立时间:1984年1月1日

法定代表人:姜建清

注册资本:人民币349,018,545,827元

联系电话:010-66105799

联系人:赵会军

二、主要人员情况

截至2013年3月末，中国工商银行资产托管部共有员工163人，平均年龄30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。

三、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控控制体系、规范的管理模式、先进的营运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、金融资产管理机构和企业客户提供安全、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、证券信托、保险资产、社会保障基金、安心账户资金、企业年金基金、QFII资产、QDII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、ESCROW等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至2013年3月，中国工商银行共托管证券投资基金305只，其中封闭式10只，开放式295只。自2003 年以来，本行连续十年获得香港《亚洲货币》、英国《金球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的37项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

四、基金托管人的职责的内容

基金托管人应当履行下列职责：

1、安全保管基金财产；

2、按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户；

3、对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立；

4、保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

5、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、办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

7、对基金财务会计报告、中期和年度基金报告出具意见；

8、复核、审查基金管理人计算的基金资产净值和基金份额申购、赎回价格；

9、按照规定召集基金份额持有人大会；

10、按照规定监督基金管理人的投资运作；

11、法律、法规和基金合同规定的其它职责。

五、基金托管人的内部控制制度

中国工商银行资产托管部自成立以来，各项业务飞速发展，始终保持在资产托管行业的优势地位。这些成绩的取得，是与资产托管部“一手抓业务拓展，一手抓内控建设”的做法是分不开的。资产托管部非常重视改进和加强内部风险管理工作，在积极拓展各项托管业务的同时，把加强风险防范和控制的力度，精心培育内控文化，完善风险控制机制，强化业务项目全过程风险管理作为重要工作来做。继2005、2007、2009、2010、2011年五次顺利通过评估组织内部控制和安全措施是否充分的最权威的SAS70《审计标准第70号》审阅后，2012年中国工商银行资产托管部第六次通过ISAE3402《原SAS70》审阅获得无保留意见的控制及有效性报告，表明独立第三方对我行托管服务在风险管理、内部控制方面的健全性和有效性的全面认可。也正明中国工商银行托管服务的风险控制能力已经与国际大型托管银行接轨，达到国际先进水平。目前，ISAE3402审阅已经成为年度化、常规化的内控工作手段。

（一）内部风险控制目标

保证业务运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，强化和建立守法经营、规范运作的经营思想和经营风格，形成一个运作规范化、管理科学化、监控制度化的内控体系；防范和化解经营风险，保证托管资产的安全完整；维护持有人的权益；保障资产托管业务安全、有效、稳健运行。

（二）内部风险控制组织结构

中国工商银行资产托管业务内部风险控制组织结构由中国工商银行稽核监察部门（内控合规部、内部审计局）、资产托管部内设风险控制处及资产托管部各业务处室共同组成。总行稽核监察部门负责制定全行风险管理政策，对各业务部门风险控制工作进行指导、监督。资产托管部内部设置专门负责稽核监察工作的内部风险控制处，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，对业务的运行独立行使稽核监察职权。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

（三）内部风险控制原则

（1）合法性原则。内控制度应当符合国家法律法规及监管机构的监管要求，并贯穿于托管业务经营管理活动的始终。

（2）完整性原则。托管业务的各项经营管理活动都必须有相应的规范程序和监督制约；监督制约应渗透到托管业务的全过程和各个操作环节，覆盖所有的部门、岗位和人员。

（3）及时性原则。托管业务经营活动必须在发生时能准确及时地记录；按照“内控优先”的原则，新设机构或新增业务品种时，必须做到已建立相关的规章制度。

（4）审慎性原则。各项业务经营活动必须防范风险，审慎经营，保证基金资产和其他委托资产的安全与完整。

（5）有效性原则。内控制度应根据国家政策、法律及经营管理的需要适时修改完善，并保证得到全面落实执行，不得有任何空间、时限及人员的例外。

（6）独立性原则。设立专门履行托管人职责的管理部门；直接操作人员和控制人员必须相对独立，适当分离；内控制度的检查、评价部门必须独立于内控制度的制定和执行部门。

（四）内部风险控制措施实施

（1）严格的隔离制度。资产托管业务与传统业务实行严格分离，建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册，严格的人员行为规范等一系列规章制度，并采取了良好的防火墙隔离制度，能够确保资产独立、环境独立、人员独立、业务制度和管理独立、网络独立。

（2）高层检查。主管行领导与部门高级管理层作为工行托管业务政策和策略的制定者和管理者，要求下级部门及时报告经营管理情况和特别情况，以检查资产托管部在实现内部控制目标方面的进展，并根据检查情况提出内部控制措施，督促职能管理部门改进。

（3）人事控制。资产托管部严格落实岗位责任制，建立“自控防线”、“互控防线”、“监控防线”三道控制防线，健全绩效考核和激励机制，树立“以人为本”的内控文化，增强员工的责任心和荣誉感，培育团队精神和核心竞争力。并通过进行定期、定向的业务与职业道德培训、签订承诺书，使员工树立风险防范与控制理念。

（4）经营控制。资产托管部通过制定计划、编制预算等方法开展各种业务营销活动、处理各项事务，从而有效地控制和配置组织资源，达到资源利用和效益最大化目的。

（5）内部风险管理。资产托管部通过稽核监察、风险评估等方式加强内部风险管理，定期或不定期地对业务运作状况进行检查、监控，指导业务部门进行风险识别、评估，制定并实施风险控制措施，排查风险隐患。

（6）数据安全控制。我们通过业务操作区相对独立、数据和传真加密、数据传输线路的冗余备份、监控设施的运用和保障等措施来保障数据安全。

（7）应急准备与响应。资产托管业务建立专门的灾难恢复中心，制定了基于数据、应用、操作、环境四个层面的完备的灾难恢复方案，并组织员工定期演练。为使演练更加接近实战，资产托管部不断提高演练标准，从最初的按照预订时间演练发展到现在的“随机演练”。从演练结果看，资产托管部完全有能力在发生灾难的情况下两个小时内恢复业务。

（五）资产托管部内部风险控制情况

（1）资产托管部内部设置专职稽核监察部门，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，全