招商可转债分级债券型证券投资基金招募说明书

基金管理人:招商基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
重要提示

招商可转债分级债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会2013年11月7日《关于核准招商可转债分级债券型证券投资基金募集的批复》(证监许可【2013】1420号文)核准公开募集。

招商基金管理有限公司(以下称“本基金管理人”或“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备案,但中国证监会对本基金募集的备案,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。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。当投资人赎回时,所得或会高于或低于投资人先前所支付的金额。如对本招募说明书有任何疑问,应寻求独立及专业的财务意见。

本基金的基金份额包括招商可转债分级债券型证券投资基金之基础份额(简称“招商可转债份额”)、招商可转债分级债券型证券投资基金之优先类份额(简称“招商转债A份额”)与招商可转债分级债券型证券投资基金之进取类份额(简称“招商转债B份额”)。

本基金通过场外和场内进行募集。基金发售结束后,本基金将按投资者在场内认购的全部招商可转债份额按照7:3的比例自动分离为预期收益与风险不同的两种份额类别,即招商转债A份额和招商转债B份额。

根据招商转债A份额和招商转债B份额的基金份额比例,招商转债A份额在场内基金初始总份额中的份额占比为70%,招商转债B份额在场内基金初始总份额中的份额占比为30%,且两类基金份额的基金资产合并运作。

从基金整体运作来看,本基金属于中低风险品种,预期收益和风险高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。从两类份额来看,招商转债A份额持有人为约定收益率,表现出风险较低、收益相对稳定的特点,其预期收益和预期风险要低于普通的债券型基金份额。招商转债B份额获得剩余收益,带有适当的杠杆效应,表现出风险较高,收益较高的特点,其预期收益和预期风险要高于普通纯债型基金。

本基金场外通过代销机构认购首次单笔最低认购金额为1000元人民币(含认购费,下同),追加认购的单笔最低金额为1000元人民币;本基金场外通过基金管理人直销机构认购,单个基金账户的首次最低认购金额为50万元人民币,追加认购单笔最低金额为1000元人民币。本基金通过具有基金代销资格的深圳证券交易所会员单位进行场内认购的单笔最低认购份额为50,000份,超过50,000份的须是1,000份的整数倍,且每笔认购最大不得超过99,999,000份。

招商可转债分级债券申购的最低申购金额为人民币1000元(含申购费);场内申购的最低申购金额为人民币50,000元,同时申购金额必须是整数金额;如日后本基金进行收益分配,投资者当期分配的基金收益转购基金份额时,不受此最低申购金额的限制。

投资有风险,过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人所管理的其它基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。投资人在认购(或申购)本基金时应认真阅读本招募说明书。

基金招募说明书自基金合同生效日起,每六个月更新一次,并于每六个月结束之日后的45日内公告,更新内容截至每六个月的最后一日。

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》”)等相关法律法规和《招商可转债分级债券型证券投资基金合同》(以下简称“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,并经中国证监会备案。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。

二、释义

在本招募说明书中,除非文意另有所指,下列词语或简称具有如下含义:

1、基金法本基金:指招商可转债分级债券型证券投资基金

2、基金管理人:指招商基金管理有限公司

3、基金托管人:指中国农业银行股份有限公司

4、基金合同:指《招商可转债分级债券型证券投资基金基金合同》及对该基金合同的任何有效修订和补充

5、托管协议:指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《招商可转债分级债券型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充

6、招募说明书:指《招商可转债分级债券型证券投资基金招募说明书》及其定期的更新

7、基金份额发售公告:指《招商可转债分级债券型证券投资基金基金份额发售公告》

8、上市交易公告书:指《招商可转债分级债券型证券投资基金之招商转债A份额与招商转债B份额上市交易公告书》

9、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

10、《基金法》:指2012年12月28日经第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议通过,自2013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

11、《销售办法》:指中国证监会2013年3月15日颁布、同年6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

12、《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

13、《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《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

14、中国证监会:指中国证券监督管理委员会

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

16、基金合同当事人:指受基金合同约束,根据基金合同享有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

17、个人投资者:指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人

18、机构投资者:指依法可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织

19、合格境外机构投资者:指符合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

20、投资人:指个人投资者、机构投资者和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证券投资基金的其他投资人的合称

21、基金份额持有人:指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人

22、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、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务

23、销售机构:指招商基金管理有限公司以及符合《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

24、销售场所:场外销售场所和场内销售场所,分别简称“场外”和“场内”

25、场外:指以交易所开放式基金交易系统以外的方式、通过销售机构办理基金销售业务的场所

26、场内:指以交易所开放式基金交易系统的方式、通过场内会员单位办理基金销售业务的场所

27、登记业务:指基金登记、存管、过户、清算和结算业务,具体内容包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户等

28、登记机构:指办理登记业务的机构。基金的登记机构为招商基金管理有限公司或接受招商基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构

29、注册登记系统:指中国证券登记结算有限责任公司开放式基金注册登记系统,通过场外销售机构认购、申购的基金份额登记在注册登记系统

30、证券登记结算系统:指中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记结算系统,通过场内会员单位认购、申购或买入的基金份额登记在证券登记结算系统

31、基金账户:指登记机构为投资人开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户

32、基金交易账户:指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构买卖基金的基金份额变动及结余情况的账户

33、深圳证券账户:指在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开设的深圳证券交易所人民币普通股票账户或证券投资基金账户

34、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

35、基金合同终止日:指基金合同规定的基金合同终止事由出现后,基金财产清算完毕,清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期

36、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

37、存续期:指基金合同生效至终止之间的不定期期限

38、基金份额分级:本基金的基金份额包括基础份额及分级份额。基础份额简称“招商可转债份额”,分为场外基础份额和场内基础份额。分级份额包括两类,优先类基金份额(简称“招商转债A份额”)和进取类基金份额(简称“招商转债B份额”)。招商转债A份额与招商转债B份额的基金份额配比始终保持7∶3的比例不变

39、招商可转债份额:指招商可转债分级债券型证券投资基金之基础份额

40、招商转债A份额:指本基金分级份额按基金合同约定规则所分离的优先类基金份额

41、招商转债B份额:指本基金分级份额按基金合同约定规则所分离的进取类基金份额

42、约定年基准收益率:招商转债A份额约定年基准收益率为“中国人民银行公布并执行的金融机构三年期存款基准利率(税后)+利差”,其中,金融机构三年期存款基准利率将根据中国人民银行公布并执行的利率进行动态调整。在基金合同生效日当日,基金管理人将根据届时金融机构三年期存款基准利率设定招商转债A的首次年基准收益率;在本基金成立后每周期性定期份额折算日的次日,基金管理人将根据该日中国人民银行公布并执行的三年期银行定期存款基准利率重新设定招商转债A的年基准收益率。利差取值范围从0.5%至2%,基金管理人在每周期性定期份额折算日的次日,公告此运作期适用利差值

43、日/天:指公历日

44、月:指公历月

45、工作日:指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

46、T日:指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的开放日

47、T+n日:指自T日起第n个工作日(不包含T日)

48、开放日:指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

49、开放时间:指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

50、发售:在本基金募集期内,销售机构向投资者销售本基金份额的行为

51、认购:指在基金募集期内,投资人申请购买基金份额的行为

52、申购:指基金合同生效后,投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

53、赎回:指基金合同生效后,基金份额持有人按基金合同约定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为

54、份额配对转换:指根据基金合同的约定,本基金的招商可转债份额与招商转债A份额、招商转债B份额之间的配对转换,包括分拆与合并两个方面

55、分拆:指根据基金合同的约定,基金份额持有人将其持有的每10份招商可转债份额申请转换成7份招商转债A份额与3份招商转债B份额的行为

56、合并:指根据基金合同的约定,基金份额持有人将其持有的每7份招商转债A份额与3份招商转债B份额进行配对申请转换成10份招商可转债份额的行为

57、会员单位:指具有基金代销业务资格的深圳证券交易所会员单位

58、上市交易:指基金合同生效后投资人通过场内会员单位以集中竞价的方式买卖招商转债A份额与招商转债B份额的行为

59、基金转换:指基金份额持有人按照基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件,申请将其持有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基金份额的行为

60、转托管:指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更所持基金份额销售机构的操作

61、系统内转托管:指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构(网点)之间或证券登记结算系统内不同会员单位(交易单元)之间进行转托管的行为

62、跨系统转登记:指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统间进行转登记的行为

63、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约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

64、巨额赎回:指本基金单个开放日,基金净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过上一开放日基金总份额的10%

65、元:指人民币元

66、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、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

67、基金资产总值:指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和

68、基金资产净值:指基金资产总值减去基金负债后的价值

69、基金份额净值:指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数

70、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

71、虚拟清算:指假定T日为本基金在分级运作期内的提前终止日,本基金按照基金合同约定的份额收益分配和资产分配规则进行资产分配从而计算得到T日本基金两级基金份额的估算价值

72、基金份额参考净值:指在T日基金资产净值计算的基础上,采用“虚拟清算”原则计算得到T日本基金两级基金份额的估算价值。基金份额参考净值是对两类基金份额价值的一个估算,并不代表基金份额持有人可获得的实际价值

73、运作期:基金合同生效日起每三年为一个运作期。每一运作期届满后则进入下一个为期三年的运作期。每一运作期到期日如为非工作日,则运作期到期日顺延到下一个工作日

74、周期性份额折算:每个基金运作期结束的年份,本基金在该年度的12月15日(遇节假日顺延)对登记在册的所有招商可转债份额、招商转债A份额、招商转债B份额进行折算

75、年度份额折算:在运作期内的每个会计年度(基金合同生效不足六个月的除外),如不发生周期性份额折算,则该年的12月15日(遇节假日顺延),本基金将进行招商转债A份额和招商可转债份额的定期份额折算

76、指定媒体:指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网网站及其他媒体

77、不可抗力:指本合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

三、基金管理人

(一)基金管理人概况

名称:招商基金管理有限公司

注册地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦28楼

设立日期:2002年12月27日

注册资本:人民币21亿元

法定代表人:张光华

办公地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦28楼

电话:(0755)83196351

传真:(0755)83076974

联系人:曾倩

招商基金管理有限公司于2002年12月27日经中国证监会证监基金字[2002]100号文批准设立,是中国第一家中外合资基金管理公司。公司由招商证券股份有限公司、ING Asset Management B.V.(荷兰投资)、中国电力财务有限公司、中国华能财务有限责任公司、中远财务有限责任公司共同投资组建。经公司股东会通过并经中国证监会批准,公司的注册资本金已经由人民币一亿元(RMB100,000,000元)增加为人民币二亿一千万元(RMB210,000,000元)。

2007年5月,经公司股东会通过并经中国证监会批复同意,招商银行股份有限公司受让中国电力财务有限公司、中国华能财务有限责任公司、中远财务有限责任公司及招商证券股份有限公司分别持有的公司10%、10%、10%及34%的股权;公司外资股东ING Asset Management B.V.(荷兰投资)受让招商证券股份有限公司持有的公司33%的股权。上述股权转让完成后,招商基金管理有限公司的股东及股权结构为:招商银行股份有限公司持有公司全部股权的34%,招商证券股份有限公司持有公司全部股权的33%,ING Asset Management B.V.(荷兰投资)持有公司全部股权的33%。

2013年8月,经公司股东会审议通过,并经中国证监会证监许可[2013]1074号文批复同意,荷兰投资公司(ING Asset Management B.V.)将其持有的招商基金管理有限公司21.6%股权转让给招商银行股份有限公司、11.7%股权转让给招商证券股份有限公司。上述股权转让完成后,招商基金管理有限公司的股东及股权结构为:招商银行股份有限公司持有全部股权的55%,招商证券股份有限公司持有全部股权的45%。

公司主要股东招商银行股份有限公司成立于1987年4月8日,总行设在深圳,业务以中国市场为主。招商银行于2002年4月9日在上海证券交易所上市(股票代码:600036)。2006年9月22日,招商银行在香港联合交易所上市(股份代号:3968)。

招商证券股份有限公司是百年招商局旗下金融企业,经过多年创业发展,已成为拥有证券市场业务全牌照的一流券商。2009年11月,招商证券在上海证券交易所上市(代码600999)。

公司本着“长期、稳健、优良、专业”的经营理念,力争成为客户推崇、股东满意、员工热爱,并具有国际竞争力的专业化的资产管理公司。

(二)主要人员情况

1、基金管理人董事、监事及高级管理人员介绍:

张光华,男,博士。历任国家外汇管理局计划处处长,中国人民银行海南省分行副行长、党委委员,中国人民银行广州分行副行长、党委副书记,广东发展银行行长、党委副书记,2007年4月起于招商银行任职,曾任副行长等职务,现任招商银行副董事长、党委副书记。现任公司董事长。

邓晓力,女,毕业于美国纽约州立大学,获经济学博士学位。2001年加入招商证券,期间于2004年1月至2005年9月被中国证监会借调至南方证券行政接管组工作,参与南方证券的清算;在加入招商证券前,曾在美国纽约花旗银行从事风险管理工作。现任招商证券股份有限公司副总裁,分管风险管理、公司财务、清算及培训工作;中国证券业协会财务与风险控制委员会副主任。现任公司副董事长。

许小松,男,经济学博士。历任深圳证券交易所综合研究所副所长,南方基金管理有限公司首席经济学家、副总经理,国联安基金管理有限公司总经理,2011年加入招商基金管理有限公司,现任公司总经理、董事,兼任招商财富资产管理有限公司董事长、招商资产管理(香港)有限公司董事长。

李俊江,男,经济学博士,教授,博士生导师。历任古林大学经济学院副院长、德国不莱梅大学客座教授、美国印第安纳大学经济系高级访问学者。现任吉林大学经济学院院长、金融学院院长、社会科学学部学术委员会主任、美国研究所所长。兼任中国世界经济学会副秘书长、中国美国经济学会副秘书长、教育部经济学专业教学指导委员会委员、中共吉林省委决策咨询委员会委员、吉林省政府决策咨询委员会委员等。现任公司独立董事。

王莉,女,高级经济师。毕业于中国人民解放军外国语学院,历任中国人民解放军昆明军区三局战士、助理研究员;国务院科技干部局二处干部;中信公司财务部国际金融处干部、银行部资金处副处长;中信银行(原中信实业银行)资本市场部总经理,行长助理、副行长等职。现任中国证券监督管理委员会证券市场监督部主任。现任公司独立董事。

蔡廷基,男,毕业于香港理工学院(现为香港理工大学)会计系。历任香港毕马威会计师事务所审计部副经理、经理,毕马威会计师事务所上海办事处执行合伙人,毕马威华振会计师事务所上海首席合伙人,毕马威华振会计师事务所华东华西区首席合伙人。现为香港会计师公会资深会员、上海市静安区政协委员、上海市静安区归国华侨联合会名誉副主席。兼任中国石化上海石油化工股份有限公司等三家香港上市公司的非执行独立董事。现任公司独立董事。

孙谦,男,新加坡籍,经济学博士。1980年至1991年先后就读于北京大学、复旦大学、William Paterson College 和Arizona State University并获得学士、工商管理硕士和经济学博士学位。曾任新加坡南洋理工大学商学院副教授、厦门大学任财务管理与会计研究院院长及特聘教授、上海证券交易所高级访问金融专家。现任复旦大学管理学院特聘教授和财务金融系主任。兼任上海证券交易所、中国金融期货交易所和上海期货交易所博士后工作站导师,科技部复旦科技园中小型科技企业创新孵化器资平台项目负责人。现任公司独立董事。

张卫华,女,1981年07月——1988年8月,曾在江苏省连云港市汽车运输公司财务部门任职;1983年11月——1988年08月,任中国银行连云港分行外汇会计部主任;1988年08月——1994年11月,历任招商银行总行国际部、会计部主任、证券业务部总经理助理;1994年11月——2006年02月,历任招银证券、国通证券及招商证券股份有限公司总裁助理兼稽核审计部总经理;2006年03月——2009年04月,任招商证券股份有限公司稽核监察总审计师;2009年04月起任招商证券股份有限公司合规总监。现任公司监事会主席。

周松,男,武汉大学世界经济本科专业、硕士学历。1997年2月加入招商银行,1997年2月至2006年6月历任招商银行总行计划资金部经理、总经理助理、副总经理,2006年6月至2007年7月任招商银行总行计划财务部副总经理,2007年7月至2008年11月任招商银行武汉分行副行长,2008年11月至2010年6月担任招商银行总行计划财务部副总经理(主持工作),2010年6月起任招商银行总行计划财务部总经理。2012年9月起任招商银行总行业务监监兼总行计划财务部总经理。现任公司监事。

江勇,男,对外经贸大学经济学硕士。1984年北京师范大学任教;1996年国际商报的国经营导刊副主编;2003年中国金融家主编助理;2005年钱经杂志主编;2008年加入招商基金,现任市场部总监、公司监事。

庄永甫,男,清华大学工学硕士。1996年加入中国人民银行深圳市中心支行科技处;1997年加入招商银行总行电脑部;2002年起参与招商基金管理有限公司筹备,公司成立后曾任信息技术部高级经理、副总监,现任信息技术部总监、公司监事。

王晓东,女,上海财经大学经济学硕士。曾任南方证券有限公司深南中路营业部总经理,深圳特区证券总经理助理、巨田基金管理有限公司(现摩根士丹利华鑫基金)副总经理、华林证券有限责任公司总裁,2007年加入招商证券股份有限公司,2007年9月至2010年3月任招商基金管理有限公司监事长,现任招商基金管理有限公司副总经理,兼任招商财富资产管理有限公司董事,招商资产管理(香港)有限公司董事。

吕一凡,男,中国国籍,经济学硕士。曾任深圳证券交易所综合研究所高级研究员。2000年进入南方基金管理有限公司工作,先后从事研究、产品设计、基金投资等工作,曾任基金开元、基金隆元(南方隆元)、南方高增长基金基金经理,全国社保投资组合投资经理,2013年加入招商基金管理有限公司,现任副总经理兼投资总监、投资决策委员会主席,招商先锋证券投资基金、招商瑞丰灵活配置混合型发起式证券投资基金及招商丰盛稳定增长灵活配置混合型证券投资基金基金经理,兼任招商资产管理(香港)有限公司董事。

张国强,男,经济学硕士。曾任中信证券股份有限公司研究咨询部分析师、债券销售交易部经理,产品设计主管、总监;中信基金管理有限责任公司投资管理部总监、基金经理。2009年加入招商基金管理有限公司,现任副总经理兼固定收益投资部负责人,兼任招商财富资产管理有限公司执行董事,招商资产管理(香港)有限公司董事。

欧志明,男,华中科技大学经济学及法学双学士、投资经济硕士;2002年加入广发证券深圳业务总部任机构客户经理;2003年4月至2004年7月于广发证券总部任风险控制岗从事风险管理工作;2004年7月加入招商基金管理有限公司,曾任法律合规部高级经理、副总监、总监,现任公司督察长兼董事会秘书,兼任招商财富资产管理有限公司监事。

2、本基金基金经理小组

孙海波,男,中国国籍,经济学硕士。曾任职于南开大学计算中心及泰康人寿保险股份有限公司;1999年加入光大证券股份有限公司,曾任职于投行部、债券投资部及自营部;2004年起先后任职于万家基金管理有限公司(原天同基金)及中信基金管理有限公司(现华夏基金)的投资管理部,均从事证券投资相关工作;2007年加入中国中投证券有限责任公司,担任证券投资部副经理,全面负责公司证券投资业务;2012年加入招商基金管理有限公司固定收益投资部,曾任招商理财7天债券型证券投资基金基金经理(管理时间:2012年12月7日至2014年3月11日),现任招商安心收益债券型证券投资基金基金经理(管理时间:2012年8月30日至今),招商安盈保本混合型证券投资基金基金经理(管理时间:2012年12月6日至今),招商安达保本混合型证券投资基金基金经理(管理时间:2013年10月19日至今)。

3、投资决策委员会成员:

公司的投资决策委员会由如下成员组成:副总经理兼投资总监、投资决策委员会主席吕一凡、副总经理兼固定收益投资部负责人张国强、总经理助理兼投资管理一部负责人袁野、总经理助理兼全球量化投资部负责人吴武泽、总经理助理兼投资管理二部负责人杨静、基金经理陈玉辉、交易部总监路明。

4、上述人员之间均不存在近亲属关系。

(三)基金管理人职责

根据《基金法》,基金管理人必须履行以下职责:

1、依法募集基金,办理或者委托经国务院证券监督管理机构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、赎回及转换价格;

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、国务院证券监督管理机构规定的其他职责。

(四)基金管理人的承诺

1、本基金管理人承诺不得从事违反《证券法》、《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露管理办法》等法律法规及规章的行为,并承诺建立基金的内部控制制度,采取有效措施,防止违法行为的发生。

2、基金管理人的禁止行为:

(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,由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他行为。

3、基金管理人禁止利用基金财产从事以下投资或活动:

(1)承销证券,但依照证券法规或监管部门另有规定的除外;

(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)向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券;

(6)买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、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,由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

上述禁止行为中的(1)-(6)项为引用当时有效的相关法律法规或监管部门的有关禁止性规定,如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定,本基金在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

4、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)除为公司进行基金投资外,直接或间接进行其他股票交易;

(9)协助、授受委托或以其它任何形式为其它组织或个人进行证券交易;

(10)其他法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。

5、本基金管理人承诺履行诚信义务,如实披露法规要求的披露内容。

6、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、其代理人、代表人、受雇人或任何第三人谋取利益;

(3)不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)不协助、授受委托或以其它任何形式为其它组织或个人进行证券交易。

(五)内部控制制度

1、内部控制的原则

健全性原则、有效性原则、独立性原则、相互制约原则、成本效益原则。

2、内部控制的组织体系

公司的内部控制组织体系是一个权责分明、分工明确的组织结构,以实现对公司从决策层到管理层和操作层的全面监督和控制。具体而言,包括如下组成部分:

监事会:监事会依照公司法和公司章程对公司经营管理活动、董事和公司管理层的行为行使监督权。

董事会风险控制委员会:风险控制委员会作为董事会下设的专门委员会之一,负责决定公司各项重要的内部控制制度并检查其合法性、合理性和有效性,负责决定公司风险管理战略和政策并检查其执行情况,审查公司关联交易和检查公司的内部审计和业务稽查情况等。

督察长: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,并负责组织指导公司监察稽核工作。督察长发现基金和公司存在重大风险或隐患,或发生督察长依法认为需要报告的其他情形以及中国证监会规定的其他情形时,应当及时向公司董事会和中国证监会报告。

风险管理委员会:风险管理委员会是总经理办公会下设的负责风险管理的专业委员会,主要负责对公司经营管理中的重大问题和重大事项进行风险评估并作出决策,并针对公司经营管理活动中发生的重大突发性事件和重大危机情况,实施危机处理机制。

监察稽核部门:监察稽核部门负责对公司内部控制制度和风险管理政策的执行情况进行合规性监督检查,向公司风险管理委员会和总经理报告。

各业务部门:风险控制是每一个业务部门和员工最首要的责任。各部门的主管在权限范围内,对其负责的业务进行检查监督和风险控制。员工根据国家法律法规、公司规章制度、道德规范和行为准则、自己的岗位职责进行自律。

3、内部控制制度概述

(1)内控制度概述

公司内部控制度由内部控制大纲、公司基本制度、部门管理办法和业务管理办法组成。

其中,公司内控大纲包括《内部控制大纲》和《法规遵循政策(风险管理制度)》,它们是各项基本管理制度的纲要和总揽,是对公司章程规定的内控原则的细化和展开。

公司基本制度包括投资管理制度、基金会计核算制度、信息披露制度、监察稽核制度、公司财务制度、资料档案管理制度、业绩评估考核制度、人力资源管理制度和危机处理制度等。部门管理办法在公司基本制度基础上,对各部门的主要职责、岗位设置、岗位责任进行了规范。业务管理办法对公司各项业务的操作进行了规范。

(2)风险控制制度

内部风险控制制度由一系列的具体制度构成,具体包括内部控制大纲、法规遵循政策、岗位分离制度、业务隔离制度、标准化作业流程制度、集中交易制度、权限管理制度、信息披露制度、监察稽核制度等。

(3)监察稽核制度

公司设立相对独立的内部控制组织体系和监察稽核部门。监察稽核部门的职责是依据国家的有关法律法规、公司内部控制制度在所赋予的权限内按照所规定的程序和适当的方法对监察稽核对象进行公正客观的检查和评价,包括调查评价公司内控制度的健全性、合理性和有效性、检查公司执行国家法律法规和公司规章制度的情况、进行日常风险控制的监控工作、执行公司内部定期不定期的内部审计、调查公司内部的违法案件等。

4、内部控制的五个要素

内部控制的基本要素包括控制环境、风险评估、控制活动、信息沟通、内部监控。

(1)控制环境

公司致力于树立内控优先和风险控制的理念,培养全体员工的风险防范意识,营造一个浓厚的风险控制的文化氛围和环境,使全体员工及时了解相关的法律法规、管理层的经营思想、公司的规章制度并自觉遵循,使风险意识贯穿到公司各个部门、各个岗位和各个业务环节。

(2)风险评估

公司对组织结构、业务流程、经营运作活动进行分析,发现风险,并将风险进行分类,找出风险分布点,并对风险进行分析和评估,找出引致风险产生的原因,采取定性定量的手段分析考量风险的高低和危害程度。落实责任人,并不断完善相关的风险防范措施。

(3)控制活动

公司控制活动主要包括组织结构控制、操作控制和会计控制等。

(4)组织结构控制

各部门的设置体现部门之间职责有分工,但部门之间又相互合作与制衡的原则。基金投资管理、基金运作、市场营销部等业务部门有明确的授权分工,各部门的操作相互独立、相互牵制并且有独立的报告系统,形成了权责分明、严密有效的三道监控防线:

①以各岗位目标责任制为基础的第一道监控防线:各部门内部工作岗位合理分工、职责明确,并有相应的岗位说明书和岗位责任制,对不相容的职务、岗位分离设置,使不同的岗位之间形成一种相互检查、相互制约的关系,以减少舞弊或差错发生的风险。

②各相关部门、相关岗位之间相互监督和牵制的第二道监控防线:公司在相关部门、相关岗位之间建立标准化的业务操作流程、重要业务处理凭据传递和信息沟通制度,后续部门及岗位对前一部门及岗位负有监督和检查的责任。

③以督察长、监察稽核部门对各岗位、各部门、各机构、各项业务全面实施监督反馈的第三道监控防线。

2)操作控制

公司设定了一系列的操作控制的制度手段,如标准化业务流程、业务、岗位和空间隔离制度、授权分责制度、集中交易制度、保密制度、信息披露制度、档案资料保全制度、客户投诉处理制度等,控制日常运作和经营中的风险。

3)会计控制

公司确保基金资产与公司自有财产完全分开,分帐管理,独立核算;公司会计核算与基金会计核算在业务规范、人员岗位和办公区域上进行严格区分。公司对所管理的不同基金以及本基金下分别设立账户,分帐管理,以确保每只基金和基金资产的完整和独立。

(4)信息沟通

即指及时地实现信息的流动,如自下而上的报告系统和自上而下的反馈。

公司建立了内部办公自动化信息系统与业务汇报体系,通过建立有效的信息交流渠道,保证公司员工及各级管理人员可以充分了解与其职责相关的信息,保证信息及时传递到适当的人员进行处理。

公司制定管理和业务报告制度,包括定期报告制度和不定期报告制度。定期报告制度按照每日、每月、每年度等不同的时间频次进行报告。

1)执行体系报告路线:各业务人员向部门负责人报告;部门负责人向分管领导、总经理报告;

2)监督体系报告路线:公司员工、各部门负责人向监察稽核部门报告,监察稽核部门向总经理、督察长分别报告;

3)督察长定期出具监察报告,报送董事会及其下设的风险控制委员会和中国证监会;如发现重大违规行为,应立即向董事会和中国证监会报告。

(5)内部监控

督察长和监察稽核部门人员负责日常监督工作,促使公司员工积极参与和遵循内部控制制度,保证制度有效地实施。公司监事会、董事会风险控制委员会、督察长、风险管理委员会、监察稽核部门对内部控制制度持续地进行检验,检验其是否符合规定要求并加以充实和改善,及时反映政策法规、市场环境、技术等因素的变化趋势,保证内控制度的有效性。

四、基金托管人

(一)基金托管人情况

1、基本情况

名称:中国农业银行股份有限公司(简称中国农业银行)

住所:北京市东城区建国门内大街69号

办公地址:北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座

法定代表人:蒋超良

成立日期:2009年1月15日

批准设立机关和批准设立文号:中国银监会银监复【2009】13号

基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字[1998]23号

注册资本:32,479,411.7万元人民币

存续期间:持续经营

联系电话:010-68121510

传真:010-68121816

联系人:李芳菲

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分,总行设在北京。经国务院批准,中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于2009年1月15日依法成立。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行网点遍布中国城乡,成为国内网点最多、业务辐射范围最广,服务领域最广,服务对象最多、业务功能齐全的大型国有商业银行之一。在海外,中国农业银行将通过自己的努力赢得了良好的信誉,每年位居《财富》世界500强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行,中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念,坚持审慎稳健经营,可持续发展,立足县域和城市两大市场,实施差异化竞争策略,着力打造“伴你成长”服务品牌,依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品,致力为广大客户提供优质的金融服务,与广大客户共创价值、共同成长。

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行,经验丰富,服务优质、业绩突出,2004年被英国《金球托管人》评为中国“最佳托管银行”,2007年中国农业银行通过了美国SAS70内部控制审计,并获得无保留意见的SAS70审计报告,表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强能力建设,品牌声誉进一步提升,在2010年首届“‘金牌理财’TOP10颁奖盛典”中成绩突出,获“最佳托管银行”奖。2010年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的“最