前海开源中证大农业指数分级证券投资基金招募说明书

基金管理人:前海开源基金管理有限公司
基金托管人:中国银河证券股份有限公司

重要提示

本基金经2015年4月20日中国证券监督管理委员会下发的证监许可[2015]669号文注册募集。

基金管理人保证本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注册,但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作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。

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,投资人在投资本基金前,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,理性判断市场,并承担基金投资中出现的各类风险,包括但不限于:市场风险、管理风险、操作风险、流动性风险、信用风险、本基金特有风险(包括作为指数基金的风险、作为上市基金的风险和作为分级基金存在的风险、本金潜在损失风险、极端情形下的损失风险)及其他风险等。

投资者可以通过场内、场外两种方式认购、申购本基金,且各类基金份额均不承诺本金安全。对于场外方式,投资者通过基金管理人的直销柜台、基金管理人的网上交易系统(目前仅对个人投资者开通)和代销机构认购、申购本基金的单笔最低限额为人民币1,000 元(含认购费、申购费);对于场内方式,投资者通过深圳证券交易所会员单位认购、申购本基金的每笔最低份额为50,000份,超过50,000份的应为1,000份的整数倍,且每笔认购最大不超过99,999,000份。投资者场外认购、申购的全部份额将确认为前海开源中证大农业份额;场内认购、申购的份额将按照1:1的比例确认为前海开源中证大农业A份额与前海开源中证大农业B份额,投资者场外认购、申购的基金份额源过跨系统转托管至场内后,可按照上述比例分拆成前海开源中证大农业A份额与前海开源中证大农业B份额。前海开源中证大农业A份额作为稳健收益类份额,极端损失情况下,前海开源中证大农业A份额的基金份额持有人可能会面临无法取得约定应得收益甚至损失本金的风险。

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表现的保证。

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,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金管理人提醒投资人基金投资的"买者自负"原则,在投资人作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资人自行承担。投资有风险,投资人在投资本基金前应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同。

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》)、《公开募集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》)等有关法律法规的规定,以及《前海开源中证大农业指数分级证券投资基金基金合同》(以下简称基金合同)的约定编写。

本招募说明书阐述了前海开源中证大农业指数分级证券投资基金(以下简称"本基金"或"基金")的投资目标、策略、风险、费率等与投资人投资决策有关的必要事项,投资人在做出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

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中请募集的。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,并经中国证监会注册。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、基金或本基金:指前海开源中证大农业指数分级证券投资基金
2、基金管理人:指前海开源基金管理有限公司
3、基金托管人:指中国银河证券股份有限公司
4、《基金合同》或本基金合同:指《前海开源中证大农业指数分级证券投资基金基金合同》及对该合同的任何有效的修订和补充
5、托管协议:指基金管理人与基金托管人签订的《前海开源中证大农业指数分级证券投资基金托管协议》及其任何有效修订和补充
6、招募说明书:指《前海开源中证大农业指数分级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《前海开源中证大农业指数分级证券投资基金基金份额发售公告》
8、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
9、《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,并经2012年12月28日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订,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》及颁布机构对其不时做出的修订
10、《销售办法》:指中国证监会2013年2月17日修订通过并于2013年6月1日起施行的《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
11、《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日起实施的《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
12、《运作办法》:指中国证监会2014年7月7日颁布、同年8月8日起实施的《公开募集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
13、中国证监会:指中国证券监督管理委员会
14、银行业监督管理机构:指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会
15、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
16、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
17、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
18、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
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》(包括其不时修订)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
20、投资人: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证券投资基金的其他投资人,统称为"投资人"或"投资者"
21、基金份额:指前海开源中证大农业份额、前海开源中证大农业A份额和/或前海开源中证大农业B份额
22、前海开源中证大农业份额:指前海开源中证大农业指数分级证券投资基金之基础份额
23、前海开源中证大农业A份额:指前海开源中证大农业指数分级证券投资基金之A份额,固定风险且预期收益相对较低的稳健收益类份额
24、前海开源中证大农业B份额:指前海开源中证大农业指数分级证券投资基金之B份额,固高风险且预期收益相对较高的积极收益类份额
25、标的指数:指中证大农业指数
26、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,按其持有的基金份额不同,可区分为前海开源中证大农业份额持有人、前海开源中证大农业A份额持有人及前海开源中证大农业B份额持有人
27、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
28、销售机构:指前海开源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协议,代为办理基金销售业务的机构
29、场外:指通过深圳证券交易所交易系统的销售机构利用其位自有或其他交易系统办理本基金基金份额的认购、申购和赎回的场所。通过该等场所办理基金份额的认购、申购和赎回也称为场外认购、场外申购和场外赎回
30、场内:指通过具有相应业务资格的深圳证券交易所会员单位利用深圳证券交易所交易系统办理本基金基金份额的认购、申购、赎回和上市交易的场所。通过该等场所办理基金份额的认购、申购、赎回也称为场内认购、场内申购、场内赎回
31、登记业务:指基金登记、存管、过户、清算和结算业务,具体内容包括投入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
32、登记机构:指办理登记业务的机构。基金的登记机构为前海开源基金管理有限公司或接受前海开源基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构
33、基金注册登记机构:前海开源基金管理有限公司或其委托的其他符合条件的本基金注册登记业务的机构,本基金的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司
34、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本系统
35、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本系统
36、基金账户:指基金注册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
37、基金交易账户: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
38、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
39、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
40、基金募集期:指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
41、存续期:指基金合同生效至终止之间的不定期期限
42、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
43、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
44、T+n日:指自T日起第n个工作日(不包含T日)
45、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
46、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
47、《业务规则》:指深圳证券交易所发布实施的《上市开放式基金业务规则》、《深圳证券交易所证券投资基金交易和申购赎回实施细则》、《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》及对其不时做出的修订,中国证券登记结算有限责任公司发布实施的《中国证券登记结算有限责任公司上市开放式基金登记结算业务实施细则》及对其不时做出的修订,以及销售机构业务规则等相关业务规则和实施细则,中国证券登记结算有限公司开放式基金业务规则》,是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金登记方面的业务规则,由基金管理人和投资人共同遵守
48、认购:指在基金募集期内,投资人申请购买基金份额的行为
49、发售:指在本基金募集期内,销售机构向投资者销售本基金份额的行为
50、上市交易:指基金投资者通过深圳证券交易所会员单位以集中竞价的方式买卖基金份额的行为
51、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
52、赎回:指基金合同生效后,基金份额持有人按基金合同规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为
53、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(包括前海开源中证大农业A份额、前海开源中证大农业B份额和前海开源中证大农业份额)的10%
54、配对转换:指前海开源中证大农业份额与前海开源中证大农业A份额、前海开源中证大农业B份额之间的转换,包括基金份额的分拆和合并
55、分拆:指基金份额持有人将其持有的前海开源中证大农业份额按照2份前海开源中证大农业份额对应1份前海开源中证大农业A份额与1份前海开源中证大农业B份额的比例进行转换的行为
56、合并:指基金份额持有人将其持有的前海开源中证大农业A份额与前海开源中证大农业B份额按照1份前海开源中证大农业A份额与1份前海开源中证大农业B份额对应2份前海开源中证大农业份额的比例进行转换的行为
57、折算:指在基金份额持有人所持基金资产净值不变的前提下,由基金管理人按照一定比例调整前海开源中证大农业份额净值、前海开源中证大农业A份额参考净值和/或前海开源中证大农业B份额参考净值,使得基金份额持有人所持基金份额相应变化的行为,包括定期折算和不定期折算
58、定期折算:指基金管理人按一定的周期进行的基金份额折算
59、不定期折算:指当前海开源中证大农业份额净值、前海开源中证大农业A份额参考净值和/或前海开源中证大农业B份额参考净值满足一定的条件时,基金管理人进行的基金份额折算
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、跨系统转托管:指基金份额持有人将持有的前海开源中证大农业份额在注册登记系统和证券登记结算系统之间进行转托管的行为
63、基金转换:指基金份额持有人按照本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
64、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基金申购申请的一种投资方式
65、元:指中国法定货币人民币元
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:指基金资产总值扣除负债后的净资产值
69、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份额净值的过程
70、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
71、基金份额参考净值:指在基础份额净值计算日的基础上,根据《基金合同》给定的计算公式得到的基金各类份额估算价值,按基金份额的不同,可区分为前海开源中证大农业A份额参考净值、前海开源中证大农业B份额参考净值。基金份额参考净值是对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
72、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
73、指定媒介: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介
74、不可抗力:指本合同当事人不能预见、不能避免、不能克服的客观事件。

三、基金管理人

(一)基金管理人概况
(一)基金管理人简况
1、名称:前海开源基金管理有限公司
2、住所:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)
3、设立日期:2013年1月23日
4、法定代表人:王兆华
5、批准设立机关及批准设立文号:中国证监会证监许可[2012]1751号
6、组织形式:有限责任公司
7、办公地址:深圳市福田区深南大道7006号万科富春东方大厦22楼
8、电话:0755-83601888 传真:0755-83181169
9、联系人:曾季平
10、注册资本:人民币2.0亿元
11、存续期限:持续经营
12、股权结构:开源证券股份有限公司出资14,北京中电金融投资管理有限公司出资14,北京长和世纪资产管理有限公司出资14,深圳市和合投信资产管理合伙企业(有限合伙)出资14%。
(二)主要人员情况
1、基金管理人董事会成员
王兆华先生,董事长,本科学历,国籍:中国。历任中国人民银行西安市分行职员,中国工商银行西安市开发区支行副行长、分行信贷处处长、华夏证券西安营业部总经理、华夏证券济南管理总部党委书记兼总经理、华夏证券总裁助理兼重庆分公司党委书记、总经理,华夏证券总裁助理,开源证券董事长兼总经理,现任开源证券总经理、前海开源基金管理有限公司董事长。
蔡颖女士,董事,公司总经理,硕士研究生,国籍:中国。历任南方证券广州分公司营业部电脑部主管、经纪业务部主管、电子商务部副经理,南方基金管理有限公司广州代表处首席代表、南方区域总部高级经理,鹏华基金管理有限公司华南营销中心(广州)副总经理、广州分公司总经理,现任前海开源基金管理有限公司董事会董事、公司总经理、投资决策委员会主席、风险控制委员会主席,前海开源资产管理(深圳)有限公司董事长。
刘新华,董事,高级经济师,博士后,国籍:中国。历任广东证券研究中心负责人、泰阳证券研究中心负责人、广东省广业资产经营公司规划部副部长、华夏基金管理有限公司机构产品部副总监(主持工作)、广东金海资产管理有限公司总经理。
范疇,董事,本科学历,国籍:中国。曾任职中国建设银行武汉分行、华安保险北京分公司、交通银行天津分行、北京长和世纪资产管理有限公司投资总监。
向松祚,独立董事,教授,高级经济师,国籍:中国。著名经济学家、国际金融战略专家,中国人民大学博士,美国哥伦比亚大学国际关系学院国际事务硕士,美国剑桥大学经济系和塔丁管理学院访问学者。现任中国农业银行首席经济学家、中国人民大学财政金融学院教授、国际货币研究所理事兼副所长、美国约翰霍普金斯大学应用经济研究所高级顾问、国际货币金融机构官方论坛(OMFIF)顾问委员会副主席、世界经济论坛(World Economic Forum)国际货币体系改革分论坛咨询顾问。
申晓娥,独立董事,博士,教授,博士生导师,中国注册会计师(非执业会员),国家税务总局特邀监察员(2003-2010),国籍:中国。历任西安交通大学助教、讲师、副教授,北京师范大学副教授、教授。
姚树洁,独立董事,教授,国籍:英国。英国诺丁汉大学当代中国学学院院长、教授,西安交通大学特聘讲座教授、重庆大学、华南师范大学、华南农业大学、中央农业学校、渭南师范学院等大学的特聘教授,海南大学经济管理学院荣誉院长;英国皇家经济学会会员、英国中国经济协会会员、英国比较经济学协会会员、美国经济协会会员;全英专业团体联合会副主席;《经济研究》、《西安交通大学学报社科版》、《当代中国》(英文)等科学杂志的编委。曾任华南热带农业大学助理教授,英国牛津大学研究员,英国杜茨罗斯大学教授、主任,英国伦敦米德尔塞克思大学教授、系主任。
2、基金管理人监事会成员
孔令国先生,监事会主席,工商管理硕士,国籍:中国。曾任中信证券股份有限公司交易与衍生品部研究员、投资经理助理,现任前海开源基金管理有限公司专户投资部副总监。
李东尊先生,监事,美国注册金融分析师(CFA),工学硕士,工商管理硕士,国籍:中国。历任美国前沿(FORE)基金管理有限公司高级经理,中信证券股份有限公司交易与衍生产品业务部副总裁、投资经理助理,现任前海开源基金管理有限公司董事总经理、联席投资总监,前海开源可转债债券型发起式证券投资基金基金经理、前海开源中证军工指数型证券投资基金基金经理。
任福利先生,监事,大学本科学历,国籍:中国。曾任职中国建设银行辽宁省分行、泰达宏利基金管理有限公司基金运营部、万江福邦基金管理有限公司基金运营部,现任前海开源基金管理有限公司基金事务部总监。
张宁玲,监事,会计师,国籍:中国。历任武汉大学财务部副部长。
刘纯斌,监事,经济学硕士,中国注册会计师,经济师,律师,国籍:中国。历任交通银行深圳分行大信大厦支行行长,深圳市明星康桥投资发展有限公司董事长兼总经理,中诚国际(香港)有限公司副总裁,广东省龙门茶排铅锌矿有限公司财务总监,深圳中金投资管理有限公司财务总监。
3、高级管理人员情况
王兆华先生,董事长,本科学历,国籍:中国。历任中国人民银行西安市分行职员,中国工商银行西安市开发区支行副行长、分行信贷处处长、华夏证券西安营业部总经理、华夏证券济南管理总部党委书记兼总经理、华夏证券总裁助理兼重庆分公司党委书记、总经理,华夏证券总裁助理,开源证券董事长兼总经理,现任开源证券总经理、前海开源基金管理有限公司董事长。
蔡颖女士,公司总经理,硕士研究生,国籍:中国。历任南方证券广州分公司营业部电脑部主管、经纪业务部主管、电子商务部副经理,南方基金管理有限公司广州代表处首席代表、南方区域总部高级经理,鹏华基金管理有限公司华南营销中心(广州)副总经理、广州分公司总经理,现任前海开源基金管理有限公司董事会董事、公司总经理、投资决策委员会主席、风险控制委员会主席,前海开源资产管理(深圳)有限公司董事长。
李志祥先生,首席运营官,本科学历,经济师,国籍:中国。历任湖北省黄冈市体改委副科长,深圳市农产品股份有限公司秘书科科长,大鹏证券有限责任公司业务秘书,南方基金管理有限公司高级经理、前海开源基金管理有限公司督察长,现任前海开源基金管理有限公司首席运营官、董事会秘书、前海开源资产管理(深圳)有限公司董事。
傅成斌先生,督察长,硕士研究生,国籍:中国。历任中国建设银行深圳分行科技部软件开发工程师,南方基金管理有限公司信息技术部总监助理,监察稽核部副总监、执行总监。现任前海开源基金管理有限公司督察长。
4、本基金拟任基金经理
孙亚超先生,金融数学博士后。历任爱建证券研究所创新发展部经理、高级研究员;光大证券理财产品部量化产品系列负责人;齐鲁证券机构部创新业务研究总监。现任前海开源基金管理有限公司执行投资总监(ED)、前海开源中证大农业指数增强型证券投资基金基金经理、前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金基金经理。
5、投资决策委员会成员情况
蔡颖女士,总经理,硕士研究生,国籍:中国。历任南方证券广州分公司营业部电脑部主管、经纪业务部主管、电子商务部副经理,南方基金管理有限公司广州代表处首席代表、南方区域总部高级经理,鹏华基金管理有限公司华南营销中心(广州)副总经理、广州分公司总经理,现任前海开源基金管理有限公司董事会董事、公司总经理,投资决策委员会主席,风险控制委员会主席,前海开源资产管理(深圳)有限公司董事长。
王厚琼先生,工程学士,国籍:中国。历任南方证券武汉分公司证券部副经理,南方证券有限公司资产管理部副处长,南方基金管理有限公司交易管理部主管、交易管理部总监助理兼中央交易室主管、交易管理部副总监兼中央交易室主管。现任前海开源基金管理有限公司董事总经理、投资决策委员会执行主席。
侯燕姝女士,工程硕士、管理学硕士,国籍:中国。历任泰信基金管理有限公司研究部高级研究员、基金经理助理、基金经理助理、基金经理;益民基金管理有限公司投资总监、基金经理。现任前海开源基金管理有限公司董事总经理、联席投资总监。
刘磊女士,经济学硕士,国籍:中国。历任长盛基金管理有限公司债券高级交易员、基金经理助理、长盛货币市场基金基金经理、长盛全债指数增强型债券投资基金基金经理、长盛积极配置债券投资基金基金经理,现任前海开源基金管理有限公司董事总经理、联席投资总监、前海开源普远稳健增利混合型证券投资基金基金经理。
丁敦先生,经济学博士,国籍:中国。历任中国建设银行浙江省分行国际业务部本外币交易员、经济师,国泰君安证券股份有限公司企业融资部业务经理、高级经理、长盛基金管理有限公司行业研究员、机构理财部组合经理助理,基金司路、长盛同智基金经理。现任前海开源基金管理有限公司董事总经理、联席投资总监、前海开源大海洋战略经济灵活配置混合型证券投资基金基金经理、前海开源新经济灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
罗大林先生,工商管理硕士,国籍:中国。历任长盛基金管理有限公司行业研究员、基金经理助理、专户部投资经理,中信证券股份有限公司自营部高级投资经理。现任前海开源基金管理有限公司董事总经理。
付柏端先生,硕士,国籍:中国。历任华宝兴业基金管理有限公司分析师;农银汇理基金管理有限公司行业研究员、基金经理助理、基金经理。2009年4月至2014年4月担任农银汇理基金管理公司农银平衡双利基金经理。现任前海开源基金管理有限公司董事总经理、联席投资总监。
李东骞先生,美国注册金融分析师(CFA),工学硕士,工商管理硕士,国籍:中国。历任美国前沿(FORE)基金管理有限公司高级经理,中信证券股份有限公司交易与衍生产品业务部副总裁、投资经理助理,现任前海开源基金管理有限公司董事总经理、联席投资总监、前海开源可转债债券型发起式证券投资基金基金经理、前海开源中证军工指数型证券投资基金基金经理。
曲扬先生,博士研究生,国籍:中国。历任南方基金管理有限公司研究员、基金经理助理,南方金球精选基金经理,2009年11月至2013年1月在南方基金香港子公司担任投资经理助理、投资经理。现任前海开源基金管理有限公司执行投资总监、前海开源优势蓝筹股票型证券投资基金基金经理、前海开源国家比较优势灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
徐立平先生,工商管理硕士,国籍:中国。历任泰信基金管理有限公司行业研究员,中邮创业基金管理有限公司研究员、基金经理助理。现任前海开源基金管理有限公司执行投资总监、前海开源中国成长灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
薛小波先生,流体力学硕士,国籍:中国。历任中信证券机械行业和军工行业首席分析师、高级副总裁。现任前海开源基金管理有限公司执行投资总监、前海开源中证军工指数型证券投资基金、前海开源大安全核心精选灵活配置混合型证券投资基金、前海开源高端装备制造灵活配置混合型证券投资基金、前海开源工业革命40灵活配置混合型证券投资基金、前海开源中航军工指数分级证券投资基金基金经理、前海开源一带一路主题精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
邱杰先生,经济学硕士,国籍:中国。历任南方基金管理有限公司研究部行业研究员、中小盘股票研究员、制造业组组长;建信基金管理有限公司研究员。现任前海开源基金管理有限公司执行投资总监、研究负责人,前海开源股息率100强等权重股票型证券投资基金基金经理。
王鹏女士,会计学硕士,注册会计师,国籍:中国。历任南方基金管理有限公司商业、贸易、旅游行业研究员、房地产行业首席研究员。现任前海开源基金管理有限公司执行投资总监、前海开源沪深300指数型证券投资基金基金经理、前海开源中证军工指数型证券投资基金基金经理、前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理。
孙亚超先生,金融数学博士后,国籍:中国。历任爱建证券研究所创新发展部经理、高级研究员;光大证券理财产品部量化产品系列负责人;齐鲁证券机构部创新业务研究总监。现任前海开源基金管理有限公司执行投资总监(ED)、前海开源中证大农业指数增强型证券投资基金基金经理。
谢屹先生,金融与经济数学、工程物理学硕士,国籍:德国。历任汇丰银行(德国)股票研究所及投资银行部分析师、高级分析师、副总裁。现任前海开源基金管理有限公司执行投资总监。
陈晓晨女士,工商管理硕士,国籍:中国。历任工银瑞信基金管理有限公司交易员、中信证券股份有限公司交易与衍生品部交易员、投资经理助理,前海开源基金管理有限公司交易部总监,现任前海开源基金管理有限公司投资副总监、前海开源沪深300指数型证券投资基金基金经理。
6、上述人员之间均不存在近亲属关系。
(三)基金管理人的职责
1、依法募集基金,办理或者委托经国务院证券监督管理机构认定的其他机构代为办理基金的募集、申购、赎回、配对转换和登记事宜;
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、基金份额净值、基金份额参考净值,确定前海开源中证大农业份额申购、赎回的价格;
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、基金管理人承诺不从事违反《证券法》、《基金法》、《销售办法》、《运作办法》、《信息披露办法》等法律法规的行为,并承诺建立健全内部控制制度,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)不公平地对待公司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)侵占、挪用基金财产;
(6)泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动;
(7)玩忽职守,不按照规定履行职责;
(8)法律法规以及中国证监会禁止的其他行为。
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)违反法律法规、基金合同或托管协议;
(3)故意损害基金份额持有人或基金合同其他当事人的合法权益;
(4)在向中国证监会报送的资料中弄虚作假;
(5)挪用、侵吞、隐匿或毁坏重要文件;
(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)违反证券交易所业务规则,利用对敲、倒仓等非法手段操纵市场价格,扰乱市场秩序;
(9)贬损同行,以提高自己;
(10)在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分;
(11)以不正当手段谋求业务发展;
(12)有悖社会公德、损害证券投资基金业人员形象;
(13)其他法律、行政法规禁止的行为。
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)不得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)不从事证券基金交易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、内部控制的总体目标
(1)保证公司经营运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则,自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营理念。
(2)防范和化解经营风险,提高经营管理效益,确保经营业务的稳健运行和受托资产的安全完整,实现公司的持续、稳定、健康发展。
(3)确保基金、公司财务和其他信息真实、准确、完整、及时。
(4)促进公司全体员工恪守职业操守,正直诚信,履洁自律,勤勉尽责。
2、制订内部控制制度应当遵循以下原则:
(1)健全性原则。内部控制应当包括公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员,并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个环节。
(2)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,维护内控制度的有效执行。
(3)独立性原则。公司各机构、部门和岗位职责应当保持相对独立,公司基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离。
(4)相互制约原则。公司内部部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡。
(5)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,以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。
(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。
3、内部控制体系
(1)内部控制制度体系
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:第一个层面是公司的内部控制大纲,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。
(2)内控控制组织架构
1)董事会
负责制定公司的风险管理政策,对风险管理负完全的和最终的责任。
2)监察及风险控制委员会
作为董事会下的专业委员会之一,监察及风险控制委员会负责批准公司风险管理系统文件,即负责确保每一个部门都有合适的系统来识别、评定和监控该部门的风险,负责批准每一个部门的风险级别。负责解决重大的突发的风险。
3)督察长
独立行使督察权利,直接对董事会负责;按季向监察及风险控制委员会提交风险管理报告和风险管理建议。
4)监察稽核部
监察稽核部负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察,并为每一个部门的风险管理系统的发展提供协助,使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标。负责建立和完善公司投资风险管理制度与流程,组织实施公司投资风险管理与绩效分析工作,确保公司各类投资风险得到良好监督与控制。
5)业务部门
风险管理是每一个业务部门最首要的责任。部门经理对本部门的风险负全部责任,负责履行公司的风险管理程序,负责本部门的风险管理系统的开发、执行和维护,用于识别、监控和降低风险。
4、内部控制措施
(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、客观和可操作性,为公司决策提供支持。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合理的决策程序;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
建立集中交易制度,投资指令通过交易部完成;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;交易部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履行检查、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