交银施罗德多策略回报灵活配置混合型证券投资基金招募说明书

基金管理人:交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
二〇一五年五月

基金招募说明书自基金合同生效日起,每6个月更新一次,并于每6个月结束之日后的45日内公告,更新内容截至每6个月的最后1日。

【重要提示】

交银施罗德多策略回报灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经2015年5月11日中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可【2015】873号文准予募集注册。

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。基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产,但不保证投资本基金一定盈利,也不保证基金份额持有人的最低收益;因基金价格可升可跌,亦不保证基金份额持有人能全数取回其原本投资。

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,需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,对投资本基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资人根据所持有份额享受基金的收益,但同时也需承担相应的投资风险。投资本基金可能遇到的风险包括:因受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响而引起的市场风险;基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险;由于基金投资者连续大量赎回基金产生的流动性风险;交易对手违约风险;投资股指期货的特定风险;连续六十个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或基金资产净值低于5000万元情形时基金管理人将依基金合同约定提前终止基金合同的风险;投资本基金特有的其他风险等等。

本基金是一只混合型基金,其风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金,低于股票型基金。属于承担较高风险、预期收益较高的证券投资基金品种。

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等信息披露文件。基金的过往业绩并不代表未来表现。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。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。

一、绪言

《交银施罗德多策略回报灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》(以下简称“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》”)和其他相关法律法规的规定以及《交银施罗德多策略回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》(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,并经中国证监会注册。基金合同是约定基金合同当事人之间权利、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:指交银施罗德多策略回报灵活配置混合型证券投资基金
2、基金管理人或本基金管理人:指交银施罗德基金管理有限公司
3、基金托管人或本基金托管人:指中国农业银行股份有限公司
4、基金合同或《基金合同》:指《交银施罗德多策略回报灵活配置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
5、托管协议:指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《交银施罗德多策略回报灵活配置混合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、招募说明书或《招募说明书》或本招募说明书:指《交银施罗德多策略回报灵活配置混合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《交银施罗德多策略回报灵活配置混合型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,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》及其后颁布机关对其不时做出的修订
10、《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
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》及相关法律法规规定,运用来自境外的人民币资金进行中国境内证券投资的境外机构投资者
20、投资人或投资者: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、转托管及定期定额投资等业务
23、销售机构:指交银施罗德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,办理基金销售业务的机构
24、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
25、登记机构:指办理登记业务的机构。基金的登记机构为交银施罗德基金管理有限公司或接受交银施罗德基金管理有限公司委托办理登记业务的机构
26、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
27、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变动及结余情况的账户
28、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
29、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
30、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
31、存续期:指基金合同生效至终止之间的不定期期限
32、工作日:指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日
33、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
34、T+n日:指自T日起第n个工作日(不包含T日)
35、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
36、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
37、《业务规则》:指《中国证券登记结算有限责任公司开放式证券投资基金及证券公司集合资产管理计划份额登记及资金结算业务指南》及其后修订,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
38、认购:指在基金募集期内,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
39、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
40、赎回:指基金合同生效后,基金份额持有人按基金合同和招募说明书规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为
41、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
42、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
43、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,由指定的销售机构在投资人指定银行账户内自动完成扣款并于每期约定的申购日受理基金申购申请的一种投资方式
44、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%的情形
45、元:指人民币元
46、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
47、基金资产总值:指基金拥有的各类有价证券、股指期货合约、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和
48、基金资产净值:指基金资产总值减去基金负债后的价值
49、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
50、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
51、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
52、不可抗力:指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

三、基金管理人

(一)基金管理人概况

名称:交银施罗德基金管理有限公司
住所:上海市浦东新区银城中路188号交通银行大楼二层(裙)
办公地址:上海浦东新区世纪大道8号国金中心二期21-22楼
邮政编码:200120
法定代表人:阮红(代任)
成立时间:2005年8月4日
注册资本:2亿元人民币
存续期间:持续经营
联系人:陈超
电话:(021)61055050
传真:(021)61055034

交银施罗德基金管理有限公司(以下简称“公司”)经中国证监会证监基金字[2005]128号文批准设立。公司股权结构如下:

股东名称	股权比例
交通银行股份有限公司(以下使用全称或其简称“交通银行”)	65%
施罗德投资管理有限公司	30%
中国国际海运集装箱(集团)股份有限公司	5%

(二)主要成员情况

1、基金管理人董事会成员

于亚利女士,董事,硕士学历。现任交通银行执行董事、副行长。历任交通银行郑州分行财务会计处处长、郑州分行副行长,交通银行财务会计部副总经理、总经理,交通银行预算财务部总经理、交通银行首席财务官。

阮红女士,董事,总经理,代任董事长,博士学历,高级经济师,兼任交银施罗德资产管理有限公司董事长。历任交通银行办公室综合处副处长兼宣传处副处长、办公室综合处处长、交通银行海外机构管理部副总经理、总经理、交通银行上海分行副行长、交通银行资产托管部总经理、交通银行投资管理部总经理。

雷贤达先生,董事长,学士学历,加拿大证券学院和香港证券学院荣誉院士。历任巴克莱基金管理有限公司基金经理、施罗德投资管理(香港)有限公司执行董事、交银施罗德基金管理有限公司总经理。曾任中国证监会开放式基金海外专家评审委员会委员。

吴伟先生,董事,博士学历。现任交通银行首席财务官、交通银行投资银行业务中心总裁,交通银行资产负债管理部总经理。历任交通银行总行财会部财务处主管、副处长、预算财务部副总经理、总经理、交通银行沈阳分行行长、交通银行预算财务部总经理。

孟方德先生,董事,硕士学历。现任施罗德投资管理有限公司亚太区总裁。历任施罗德投资管理有限公司分析师、投资经理,施罗德投资管理(新加坡)有限公司副董事长,施罗德投资管理国际有限公司执行董事,施罗德投资管理(卢森堡)有限公司总经理,施罗德投资管理(日本)有限公司总经理,施罗德投资管理有限公司英国区总经理及销售总监、全球渠道销售业务总监。

谢丹阳先生,独立董事,博士学历。现任武汉大学经济与管理学院院长、香港科技大学经济系教授。历任蒙特利尔大学经济系助理教授,国际货币基金经济学家和高级经济学家,香港科技大学助理教授、副教授、教授、系主任、瑞安经管中心主任。

袁志刚先生,独立董事,博士学历。现任复旦大学经济学院教授。历任复旦大学经济学院副教授、教授、经济系系主任、经济学院院长。

周林先生,独立董事,博士学历。现任上海交通大学安泰经济与管理学院院长、教授。历任复旦大学管理科学系助教,美国耶鲁大学经济系助理教授、副教授,美国杜克大学经济系副教授,香港城市大学经济与金融系教授,美国亚利桑那州立大学凯瑞商学院经济系冠名教授,上海交通大学上海高级金融学院常务副院长、教授。

2、基金管理人监事会成员

杜静先生,监事长,硕士学位,高级经济师。历任中国农业银行潜江支行办公室副主任;交通银行武汉分行信贷处副处长、信贷处处长兼授信催理处主任、国外业务处处长;交通银行市场营销部业务代理处处长;交通银行宜昌分行党委书记、行长;交通银行福建省分行党委书记、行长;交通银行华中授信审批中心总经理。

裴关淑仪女士,监事,CFA、CIPM、FRM,工商管理、资讯管理双硕士。现任交银施罗德基金管理有限公司助理总经理、交银施罗德资产管理(香港)有限公司总经理。曾任职荷兰银行、渣打银行(香港)有限公司、MIDAS-KAPITI INTERNATIONAL LIMITED,施罗德投资管理(香港)有限公司资讯科技部主管、中国事务联席董事、交银施罗德基金管理有限公司监察稽核及风险管理总监。

陈超女士,监事,硕士学历。现任交银施罗德基金管理有限公司董事会秘书。历任交通银行股份有限公司资产托管部内控综合员,交银施罗德基金管理有限公司董事会秘书、合规审计部总经理、监察稽核部总经理、董事会监事会办公室总经理。

3、公司高管人员

阮红女士,总经理,代任董事长。简历同上。

许珊燕女士,副总经理,硕士学历,高级经济师,兼任交银施罗德资产管理有限公司董事。历任湖南大学(原湖南财经学院)金融学院讲师,湘财证券有限责任公司国债部副经理、基金管理总部总经理,湘财荷银基金管理有限公司副总经理。

夏华龙先生,副总经理,博士学历。历任中国地质大学经济管理系教师、经济学院教研室副主任、主任、经济学院副院长;交通银行资产托管部副处长、处长、高级经理、副总经理;云南省曲靖市市委常委、副市长(挂职)。

谢卫先生,副总经理,经济学博士,高级经济师。历任中央财经大学金融系教员;中国社会科学院财经所助理研究员;中国电力信托投资公司基金部副经理;中国人保信托投资公司证券部副总经理、总经理、北京证券营业部总经理、证券总部副总经理兼北方部总经理,富国基金管理有限公司副总经理。

苏奋先生,督察长,纽约城市大学工商管理硕士。历任交通银行广州分行市场营销部总经理助理、副总经理,交通银行纽约分行信贷管理部经理、公司金融部经理、信用风险管理办公室负责人,交通银行投资管理部投资并购高级经理,交银施罗德基金管理有限公司综合管理部总监。

乔宏军先生,副总经理,博士学历,高级经济师。历任交通银行资金部副处长、副高级经理、高级经理;交通银行金融市场部高级经理、总经理助理、副总经理;交通银行金融市场业务中心副总裁。

4、本基金基金经理

项廷锋先生,上海交通大学管理学博士,16年基金从业经验。1999年至2007年任职于华安基金管理有限公司,先后担任研究员、固定收益投资经理和基金经理。其中2003年12月30日至2007年5月15日担任华安现金富利投资基金基金经理。2007年加入交银施罗德基金管理有限公司,曾任固定收益部总经理,现任投资总监。2012年6月20日起担任交银施罗德荣安保本混合型证券投资基金基金经理至今,2013年4月24日起担任交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金基金经理至今,2013年9月4日至2014年12月18日担任交银施罗德定期支付双息平衡混合型证券投资基金基金经理,2013年12月25日起担任交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金基金经理至今,2014年6月3日起担任交银施罗德双利债券证券投资基金基金经理至今,2014年8月4日起担任交银施罗德双利债券证券投资基金基金经理至今,2015年5月15日起担任交银施罗德新回报混合型证券投资基金基金经理至今。

5、投资决策委员会成员

委员:阮红(总经理、代任董事长)
项廷锋(投资总监、基金经理)
管华雨(权益投资总监、基金经理)
王少成(权益投资总监、基金经理)
上述人员之间不存在近亲属关系。

(三)基金管理人的职责

1、依法募集资金,办理或者委托经中国证监会认定的其他机构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、按照规定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)基金管理人的承诺

1、基金管理人承诺不从事违反《中华人民共和国证券法》的行为,并承诺建立健全内部控制制度,采取有效措施,防止违反《中华人民共和国证券法》行为的发生;
2、基金管理人承诺不从事违反《基金法》的行为,并承诺建立健全内部风险控制制度,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)侵占、挪用基金财产;
(6)法律、行政法规和中国证监会禁止的其他行为。
3、基金管理人承诺严格遵守基金合同,并承诺建立健全内部控制制度,采取有效措施,防止违反基金合同行为的发生;
4、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;
5、基金管理人承诺不从事其他法规规定禁止从事的行为。

(五)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、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,或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动;
4、不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

(六)基金管理人的内部控制制度

1、风险管理的原则

(1)全面性原则
公司风险管理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。
(2)独立性原则
公司设立独立的风险管理部,风险管理部保持高度的独立性和权威性,负责对公司各部门风险控制工作进行监督和检查。
(3)相互制约原则
公司及各部门在内部组织结构的设计上要形成一种相互制约的机制,建立不同岗位之间的制衡体系。
(4)定性和定量相结合原则
建立完备的风险管理指标体系,使风险管理更具客观性和操作性。
2、风险管理和内部风险控制体系结构

公司的风险管理体系结构是一个分工明确、相互牵制的组织结构,由最高管理层对风险管理负最终责任,各个业务部门负责本部门的风险评估和监控,风险管理部负责监察公司的风险管理措施的执行。具体而言,包括如下组成部分:

(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)监事会
是公司常设的监事机构,对股东会负责。监事会对公司财务、公司董事、总经理及其他高级管理人员进行监督。
(3)合规审核及风险管理委员会
作为董事会下的专业委员会之一,对公司内部控制制度、监察稽核制度进行检查评估;审查公司财务,对公司内部管理制度、投资决策程序和运作流程进行合规性审议;对公司资产与基金资产的经营进行评估。
(4)风险控制委员会
作为总经理下设的专业委员会之一,风险控制委员会负责拟定公司风险管理战略及政策,制定灾难复原计划及紧急情况处理制度,确保公司风险控制符合标准,就潜在风险与相关部门协调,审阅公司审计报告及监察情况。
(5)督察长
独立行使督察权利;直接对董事会负责;就内部控制制度和执行情况独立地履行检查、评价、报告、建议职能;定期和不定期地向董事会报告公司内部控制执行情况。
(6)风险管理部
风险管理部负责制定公司风险管理政策和防范及控制措施,组织执行,并为每一个部门的风险管理系统的发展提供协助,汇总公司业务所有的风险信息,独立识别、评估各类风险,提出风险控制建议,使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标。
(7)监察稽核部
监察稽核部负责设计及实施公司合规审计计划,检查公司各项业务的合规情况及监督公司内部规章制度的执行情况,定期向监管机构及公司管理层进行汇报。
(8)法务部
法务部负责公司的法律事务及协调实施信息披露事务,依法维护公司合法权益,评判并处理公司运营中发生的法律及信息披露相关问题,及时向公司管理层及全体员工传达法规及监管要求。
(9)业务部门
风险管理是每一个业务部门首要的责任。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。
3、风险管理和内部风险控制的措施

(1)建立内控体系,完善内控制度
公司建立、健全了内控体系,通过高管人员关于内控的明确分工,确保各项业务活动有恰当的组织和授权,确保监察活动独立,并得到高管人员的支持,同时置备操作手册,并定期更新。
(2)建立相互分离、相互制衡的内控机制
建立、健全了各项制度,做到基金经理分开,投资决策分开,基金交易集中,形成不同部门、不同岗位之间的制衡机制,从制度上减少和防范风险。
(3)建立、健全岗位责任制
建立、健全了岗位责任制,使每个员工都明确自己的任务、职责,并及时将各自工作领域中的风险隐患上报,以防范和减少风险。
(4)建立风险分类、识别、评估、报告、提示程序
建立了风险评估机制,通过适合的程序,确认和评估与公司运作有关的风险;公司建立了自下而上的风险报告程序,对风险隐患进行层层汇报,使各个层次的人员及时掌握风险状况,从而以最快速度作出决策。
(5)建立有效的内部监控系统
建立了足够、有效的内部监控系统,如电脑预警系统、投资监控系统,对可能出现的各种风险进行全面和实时的监控。
(6)使用数量化的风险管理手段
采取数量化、技术化的风险控制手段,建立数量化的风险管理模型,用以提示指数趋势、行业及个股的风险,以便公司及时采取有效的措施,对风险进行分散、控制和规避,尽可能地减少损失。
(7)提供足够的培训
制定了完整的培训计划,为所有员工提供足够和适当的培训,使员工明确其职责所在,控制风险。

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:刘士余
成立日期:2009年1月15日
批准设立机关和批准设立文号:中国银行业监督管理委员会银监复[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:010-66060069
传真:010-68121816
联系人:林葛

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,中国农业银行同样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“伟你成长”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《全球托管人》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“最佳资产托管奖”。

中国农业银行证券投资基金托管部于1998年5月经中国证监会和中国人民银行批准成立,2004年9月更名为托管业务部,内设养老金管理中心、技术保障处、营运中心、委托资产托管处、保险资产托管处、证券投资基金托管处、境外资产托管处、综合管理处、风险管理处,拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

2、主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工140余名,其中高级会计师、高级经济师、高级工程师、律师等专家10余名,服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强,高级管理层均有20年以上金融从业经验和高级技术职称,精通国内外证券市场的运作。

3、基金托管业务经营情况

截止2015年3月31日,中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共254只,包括富国天源平衡混合型证券投资基金、华夏平稳增长混合型证券投资基金、大成积极成长股票型证券投资基金、大成景阳领先股票型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金、长盛同德主题增长股票型证券投资基金、博时内需增长灵活配置混合型证券投资基金、汉盛证券投资基金、裕隆证券投资基金、景福证券投资基金、鸿阳证券投资基金、丰和价值证券投资基金、久嘉证券投资基金、长盛成长价值证券投资基金、宝盈鸿利收益证券投资基金、大成价值增长证券投资基金、大成债券投资基金、银河稳健证券投资基金、银河收益证券投资基金、长盛中信全债指数增强型债券投资基金、长信利息收益开放式证券投资基金、长盛动态精选证券投资基金、景顺长城内需增长开放式证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、长信银利精选开放式证券投资基金、富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金、鹏华货币市场证券投资基金、中海分红增利混合型证券投资基金、国泰货币市场证券投资基金、新华优选分红混合型证券投资基金、交银施罗德精选股票证券投资基金、泰达宏利货币市场基金、交银施罗德货币市场证券投资基金、景顺长城资源垄断股票型证券投资基金、大成沪深300指数证券投资基金、信诚四季红混合型证券投资基金、富国天时货币市场基金、富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金、益民货币市场基金、长城安心回报混合型证券投资基金、中邮核心优选股票型证券投资基金、景顺长城内需增长贰号股票型证券投资基金、交银施罗德成长股票证券投资基金、长盛中证100指数证券投资基金、泰达宏利首选企业股票型证券投资基金、东吴价值成长双动力股票型证券投资基金、鹏华动力增长混合型证券投资基金、宝盈策略增长股票型证券投资基金、国泰金牛创新成长股票型证券投资基金、益民创新优势混合型证券投资基金、中邮核心成长股票型证券投资基金、华夏复兴股票型证券投资基金、富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金、长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金、富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金、申万巴黎竞争优势股票型证券投资基金、新华优选成长股票型证券投资基金、金元惠理成长动力灵活配置混合型证券投资基金、天治稳健双盈债券型证券投资基金、中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、长信利丰债券型证券投资基金、云惠理丰利债券型证券投资基金、交银施罗德先锋股票证券投资基金、东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、银华内需精选股票型证券投资基金(LOF)、大成行业轮动股票型证券投资基金、交银施罗德上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金联接基金、上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金、富兰克林国海沪深300指数增强型证券投资基金、南方中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)、景顺长城能源基建股票型证券投资基金、中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金、长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金、富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金、中万巴黎竞争优势股票型证券投资基金、新华优选成长股票型证券投资基金、金元惠理成长动力灵活配置混合型证券投资基金、长信利丰债券型证券投资基金、交银施罗德先锋股票证券投资基金、东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、银华内需精选股票型证券投资基金(LOF)、大成行业轮动股票型证券投资基金、交银施罗德上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金联接基金、上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金、富兰克林国海沪深300指数增强型证券投资基金、南方中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)、景顺长城能源基建股票型证券投资基金、中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金、招商信用添利债券型证券投资基金、易方达消费行业股票型证券投资基金、富国汇利分级债券型证券投资基金、大成景丰分级债券型证券投资基金、兴全沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)、工银瑞信深证红利交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信深证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金、富国可转换债券证券投资基金、大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金、泰达宏利领先中小盘股票型证券投资基金、交银施罗德信用添利债券证券投资基金(LOF)、东吴中证新兴产业指数证券投资基金、工银瑞信四季收益债券型证券投资基金、招商安瑞进取债券型证券投资基金、汇添富社会责任股票型证券投资基金、工银瑞信消费服务行业股票型证券投资基金、易方达黄金主题证券投资基金(LOF)、中邮中小盘灵活配置混合型证券投资基金、浙商聚潮产业成长股票型证券投资基金、嘉实领先成长股票型证券投资基金、广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金、广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金联接基金、南方保本混合型证券投资基金、交银施罗德先进制造股票证券投资基金、上投摩根新兴动力股票型证券投资基金、富兰克林国海策略回报灵活配置混合型证券投资基金、金元惠理保本混合型证券投资基金、招商安达保本混合型证券投资基金、深证300价值交易型开放式指数证券投资基金、南方中国中小盘股票指数证券投资基金(LOF)、交银施罗德深证300价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金、富国中证500指数增强型证券投资基金(LOF)、长信内需成长股票型证券投资基金、大成中证内地消费主题指数证券投资基金、中海消费主题精选股票型证券投资基金、长盛同瑞中证200指数分级证券投资基金、景顺长城核心竞争力股票型证券投资基金、汇添富信用债债券型证券投资基金、光大保德信行业轮动股票型证券投资基金、富兰克林国海亚洲(除日本)机会股票型证券投资基金、汇添富逆向投资股票型证券投资基金、大成新锐产业股票型证券投资基金、申万菱信中小板指数分级证券投资基金、广发消费品精选股票型证券投资基金、鹏华金刚保本混合型证券投资基金、汇添富理财14天债券型证券投资基金、嘉实全球房地产证券投资基金、金元惠理新经济主题股票型证券投资基金、东吴保本混合型证券投资基金、建新社会责任股票型证券投资基金、嘉实理财宝7天债券型证券投资基金、富兰克林国海恒久信用债券型证券投资基金、大成月添利理财债券型证券投资基金、安信目标收益债券型证券投资基金、富国7天理财宝债券型证券投资基金、交银施罗德理财21天债券型证券投资基金、易方达中债新综合指数发起式证券投资基金(LOF)、工银瑞信信用纯债债券型证券投资基金、大成现金增利货币市场基金、景顺长城支柱产业股票型证券投资基金、易方达月月利理财债券型证券投资基金、摩根士丹利华鑫量化配置股票型证券投资基金、东方央视财经50指数增强型证券投资基金、交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金、鹏华理财21天债券型证券投资基金、国泰民安增利债券型证券投资基金、万家14天理财债券型证券投资基金、华安纯债债券型发起式证券投资基金、金元惠理惠利保本混合型证券投资基金、南方中证500交易型开放式指数证券投资基金、招商双债增强分级债券型证券投资基金、景顺长城品质投资股票型证券投资基金、中海可转换债券债券型证券投资基金、融通标普中国可转债指数增强型证券投资基金、大成现金宝场内实时申赎货币市场基金、交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金、国泰中国企业境外高收益债券型证券投资基金、富兰克林国海焦点驱动灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城沪深300等权重交易型开放式指数证券投资基金、广发聚源定期开放债券型证券投资基金、大成景安短融债券型证券投资基金、嘉实研究阿尔法股票型证券投资基金、新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金、富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金、汇添富高息债债券型证券投资基金、东方利群混合型发起式证券投资基金、南方稳利一年定期开放债券型证券投资基金、景顺长城四季金利纯债债券型证券投资基金、华夏永福养老理财混合型证券投资基金、嘉实丰益信用定期开放债券型证券投资基金、国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金、交银施罗德定期支付双息平衡混合型证券投资基金、光大保德信现金宝货币市场基金、易方达投资级信用债债券型证券投资基金、广发趋势优选灵活配置混合型证券投资基金、华润元大保本混合型证券投资基金、长盛双月红一年期定期开放债券型证券投资基金、富国国有企业债债券型证券投资基金、富安达信用主题轮动纯债债券型发起式证券投资基金、景顺长城沪深300指数增强型证券投资基金、中邮定期开放债券型证券投资基金、安信永利信用定期开放债券型证券投资基金、工银瑞信自定义一年期债券型证券投资基金、工银瑞信增利分级债券型证券投资基金、富国天益债券型证券投资基金、长盛同庆一年定期开放债券型证券投资基金、工银瑞信战略转型主题股票型证券投资基金、天弘云端生活优选灵活配置混合型证券投资基金、安信消费医药主题股票型证券投资基金、国泰深证TMT50指数分级证券投资基金。

(二)基金托管人的内部风险控制制度说明

1、内控控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定,守法经营、规范运作、严格监察,确保业务的稳健运行,保证基金财产的安全完整,确保有关信息的真实、准确、完整、及时,保护基金份额持有人的合法权益。

2、内控控制组织结构

风险管理委员会总体负责中国农业银行的风险管理与内部控制工作,对托管业务风险管理和内部控制工作进行监督和评价。托管业务部专门设置了风险管理处,配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作,独立行使监督稽核职权。

3、内控控制制度及措施

具备系统、完善的制度控制体系,建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程,可以保证托管业务的规范操作和顺利进行;业务人员具备从业资格;业务管理实行严格的复核、审核、检查制度,授权工作实行集中控制,业务印章按规程保管、存放、使用,账户资料严格保管,制约机制严格有效;业务操作区专门设置,封闭管理,