永赢基金管理有限公司永赢量化混合型发起式证券投资基金招募说明书

基金管理人:永赢基金管理有限公司
基金托管人:中信证券股份有限公司
二〇一五年七月
重要提示

永赢量化混合型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)于2015年6月17日获中国证券监督管理委员会证监许可(2015)1273号文准予注册募集。

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申请的注册,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。

证券投资基金(以下简称“基金”)是一种长期投资工具,其主要功能是分散投资,降低投资单一证券所带来的个别风险。基金投资不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具,投资者购买基金,既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益,也可能承担基金投资所带来的损失。

本基金为混合型证券投资基金,通过灵活应用多种绝对收益策略,对冲市场系统性风险,因此除面临普通混合型基金风险外还包括本基金所特有的风险。首先,本基金的市场中性投资策略是否能对冲市场系统性风险具有不确定性;其次,本基金的主要投资工具股指期货还可能引发的基差风险、杠杆风险、对手方风险、盯市结算风险等。此外,在本基金开放申购、赎回业务前,基金份额持有人还面临不能赎回基金份额的风险。

基金分为股票基金、混合基金、债券基金、货币市场基金等不同类型,投资者投资不同类型的基金将获得不同的收益预期,也将承担不同程度的风险。一般来说,基金的收益预期越高,投资者承担的风险也越大。

投资者购买本基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构,基金管理人不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。投资者应当认真阅读基金合同、招募说明书等基金法律文件,了解基金的风险收益特征,根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和自身的风险承受能力相适应,理性判断市场,谨慎做出投资决策,并通过基金管理人或基金管理人委托的具有基金代销业务资格的其他机构购买基金。

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,但不保证投资本基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。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。

第一部分 绪 言

《永赢量化混合型发起式证券投资基金招募说明书》(以下简称“招募说明书”或“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》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)及其他有关规定以及《永赢量化混合型发起式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。

第二部分 释义

本招募说明书中除非文意另有所指,下列词语具有如下含义:

1、基金或本基金:指永赢量化混合型发起式证券投资基金
2、基金管理人:指永赢基金管理有限公司
3、基金托管人:指中信证券股份有限公司
4、基金合同或本基金合同:指《永赢量化混合型发起式证券投资基金基金合同》及对本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《永赢量化混合型发起式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《永赢量化混合型发起式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《永赢量化混合型发起式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
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、投资人:指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和发起资金提供方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
20、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
21、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
22、销售机构:指永赢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
23、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
24、登记机构:指办理登记业务的机构。基金的登记机构为永赢基金管理有限公司或接受永赢基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构
25、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
26、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、转换及转托管业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户
27、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
28、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
29、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
30、存续期:指基金合同生效至终止之间的不定期期限
31、工作日:指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日
32、对应日:指某一特定日期在后续日历年度中的对应日期,如该日历年度中不存在对应日期或为非工作日的,则顺延至下一工作日
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《永赢基金管理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
38、认购:指在基金募集期内,投资人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
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
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%
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、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、权益类:指股票、股票型证券投资基金、权证、股指期货等权益类资产
52、有价证券:指股票、证券投资基金、债券、资产支持证券、权证等衍生品种的金融工具总称
53、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
54、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。包括但不限于地震、台风、水灾、火灾、战争、瘟疫、社会动乱、非一方过错情况下的电力和通讯故障、系统故障、设备故障、网络黑客攻击以及证监会、交易所、证券业协会、基金业协会规定的其他情形。
55、发起式基金:指符合《运作办法》及中国证监会发布的《关于增设发起式基金审核通道有关问题的通知》中相关条件募集、且募集资金中发起资金不少于规定金额的开放式基金
56、发起资金:指用于认购发起式基金且来源于基金管理人的股东资金、基金管理人固有资金、基金管理人高级管理人员或基金经理(指基金管理人员工中依法具有基金经理资格者,包括但可能不限于本基金的基金经理,下同)等人员的资金
57、发起资金提供方:以发起资金认购本基金且承诺以发起资金认购的基金份额持有期限不少于三年的基金管理人的股东、基金管理人、基金管理人高级管理人员或基金经理等人员

第三部分 基金管理人

(一)基金管理人概况
名称:永赢基金管理有限公司
住所:浙江省宁波市江东区中山东路466号
办公地址:上海市浦东新区世纪大道210号二十一世纪大厦27楼
设立日期:2013年11月7日
法定代表人:罗维开
联系电话:(021)5169 0188
传真:(021)5169 0177
联系人:周良子
永赢基金管理有限公司是经中国证监会证监基金字[2013]1280号文件批准,于2013年11月7日成立的合资基金管理公司,初始注册资本为人民币1.5亿元,经工商变更登记,公司于2014年8月21日公告注册资本增加至人民币2亿元。
目前,公司的股权结构调整为:
宁波银行股份有限公司出资人民币135,000,000元,占公司注册资本的67.5%;
利安资金管理公司(Lion Global Investors Limited)出资人民币20,000,000元,占公司注册资本的10%;
宋宜农出资人民币9,990,000元,占公司注册资本的4.995%;
赵楠出资人民币6,010,000元,占公司注册资本的3.005%;
田中申出资人民币5,550,000元,占公司注册资本的2.775%;
赵鹏出资人民币5,500,000元,占公司注册资本的2.750%;
李峻出资人民币3,300,000元,占公司注册资本的1.650%;
徐蕾青出资人民币3,300,000元,占公司注册资本的1.650%;
毛慧出资人民币3,000,000元,占公司注册资本的1.500%;
祁洁萍出资人民币1,000,000元,占公司注册资本的0.500%;
宋聿飞出资人民币700,000元,占公司注册资本的0.350%;
钟菊秀出资人民币700,000元,占公司注册资本的0.350%;
陈晟出资人民币700,000元,占公司注册资本的0.350%;
韩聪出资人民币600,000元,占公司注册资本的0.300%;
陈遥出资人民币500,000元,占公司注册资本的0.250%;
周良子出资人民币450,000元,占公司注册资本的0.225%;
狄泽出资人民币450,000元,占公司注册资本的0.225%;
解天骁出资人民币450,000元,占公司注册资本的0.225%;
委灵灵出资人民币300,000元,占公司注册资本的0.150%;
洪幼叶出资人民币300,000元,占公司注册资本的0.150%;
徐一出资人民币300,000元,占公司注册资本的0.150%;
孟祥宝出资人民币300,000元,占公司注册资本的0.150%;
周华睿出资人民币300,000元,占公司注册资本的0.150%;
张振出资人民币200,000元,占公司注册资本的0.100%;
蔡霖出资人民币200,000元,占公司注册资本的0.100%;
陈恬出资人民币200,000元,占公司注册资本的0.100%;
刘颖出资人民币200,000元,占公司注册资本的0.100%;
余帅出资人民币200,000元,占公司注册资本的0.100%;
沈星琦出资人民币100,000元,占公司注册资本的0.050%;
华阳出资人民币200,000元,占公司注册资本的0.100%。
基金管理人无任何受处罚记录。
(二)主要人员情况
1、基金管理人董事会成员
罗维开先生,董事长,硕士,经济师。近20年金融业从业经验,曾任宁波银行股份有限公司天源支行业务科科长、天源支行副行长、财务会计部总经理、行长助理、副行长;现任宁波银行副行长。
陈友良先生,董事,硕士,马来西亚籍。曾任职新加坡华侨银行集团风险部风险分析师;巴克莱资本操作风险管理部经理;新加坡华侨银行集团风险部业务经理;新加坡华侨银行集团主席办公室主席特别助理;新加坡华侨银行集团资金部副总裁;新加坡华侨银行集团风险部资产负债管理总经理。现任华侨银行(中国)有限公司风险管理部首席风险官。
宋宜农先生,董事,硕士。近20年金融业从业经验,曾任长盛基金管理有限公司市场发展部总监;光大保德信基金管理有限公司首席市场营销官;景顺长城基金管理有限公司副总经理兼市场总监;方正富邦基金管理有限公司总经理。现任永赢基金管理有限公司总经理,兼永赢资产管理有限公司董事、总经理。
赵楠先生,董事,硕士。16年证券基金研究投资经验,曾任中信基金管理有限公司研究总监、投委会委员;中信建投证券公司自营部执行总经理;方正富邦基金管理有限公司投资总监。现任永赢基金管理有限公司副总经理,兼永赢资产管理有限公司副总经理。
徐英女士,独立董事,学士。曾任海南汇通国际信托投资公司副总裁、董事长;长城证券有限责任公司总裁;景顺长城基金管理有限公司董事长。现任新华资产管理有限公司副董事长。
陈忠阳先生,独立董事,博士,教授。曾任人民大学计划经济系团总支书记,现任教于人民大学财政金融学院。
商海粟先生,独立董事,学士。曾在光大国信旅游公司、北京金融街物业管理公司任职。现任北京市世联新纪元律师事务所合伙人律师,主要从事公司、不动产相关法律事务。
2、监事会成员
陈辰先生,监事,硕士。曾任职于中国工商银行上海市分行机构业务部;金盛人寿保险有限公司投资部主任;招商银行资产托管部经理;深圳发展银行资产托管部总经理助理。现任宁波银行资产托管部总经理。
徐蕾青先生,监事,硕士。11年相关行业从业经验,曾任景顺长城基金管理有限公司IT经理;方正富邦基金管理有限公司信息技术总监。现任永赢基金管理有限公司信息技术总监,兼永赢资产管理有限公司副总经理。
毛慧女士,监事,学士。曾任职于申万菱信基金管理有限公司、源泰律师事务所。现任永赢基金管理有限公司监察稽核总监,兼永赢资产管理有限公司执行监事、法律合规与风险管理部负责人。
3、管理层成员
宋宜农先生,总经理,相关介绍见董事会成员部分内容。
赵鹏先生,督察长,硕士。18年金融行业从业经历。曾任深圳市南山基金管理有限公司董事会秘书兼法律事务经理;汉唐证券有限责任公司法律顾问;景顺长城基金管理有限公司律师兼信息披露负责人;渤海产业投资基金管理有限公司执行董事。现任永赢基金管理有限公司督察长。
赵楠先生,副总经理,相关介绍见董事会成员部分内容。
田中申先生,副总经理,硕士。12年金融行业从业经验,曾任中信证券股份有限公司财务会计;中信基金管理有限公司基金会计;天弘基金管理有限公司基金运营部总经理兼公司财务部总经理;方正富邦基金管理有限公司职工监事、基金运营部总监。现任永赢基金管理有限公司副总经理,兼永赢资产管理有限公司董事、副总经理。
4、本基金基金经理张大木先生。美国Villanova 大学计算机研究生。13 年证券从业经验。曾任美国沃顿商学院高级数据分析师,美国巴克莱国际资产管理公司(BGI)投资分析员,博时基金管理有限公司量化分析师,投资经理,现任永赢基金管理有限公司量化投资总监。
5、投资决策委员会成员
投资决策委员会由下述执行委员组成:公司总经理宋宜农先生、分管投资的副总经理赵楠先生、量化投资总监张大木先生、固定收益投资副总监祁洁萍女士等。
督察长、监察稽核部总监、交易总监、研究人员可列席,不具有投票权。
分管投资的副总经理为主任委员,负责召集、协调并主持会议。
议案通过需经2/3以上委员同意,主任委员有一票否决权。
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、赎回和注册登记事宜;
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、编制季度报告、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、法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他职责。
(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,防止违反有关法律法规、基金合同和中国证监会有关规定的行为发生。
2、基金管理人承诺严格遵守《中华人民共和国证券法》、《基金法》及相关法律法规,建立健全的内部控制制度,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)不公平地对待本基金管理人管理的不同基金财产;
(3)利用基金财产或者职务之便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,不得将基金资产用于以下投资或活动:
(1)承销证券;
(2)违反规定向他人贷款或者提供担保;
(3)从事承担无限责任的投资;
(4)向其基金管理人、基金托管人出资;
(5)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;
(6)依照法律法规有关规定,由中国证监会规定禁止的其他活动。
法律法规或监管部门调整上述禁止行为的,本基金不受上述限制。
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)不违反现行有效的有关法律法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定,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)不协助、接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;
(5)不从事损害基金资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
基金管理人根据全面性原则、有效性原则、相互制约原则、防火墙原则和成本收益原则建立了一套比较完整的内部控制体系。该内部控制体系由一系列业务管理制度及相应的业务处理、控制程序组成,具体包括控制环境、风险评估、控制活动、信息沟通、内部监控等要素。
1、控制环境
良好的控制环境包括科学的公司治理、有效的监督管理、合理的组织结构和有力的控制文化。
(1)公司引入了独立董事制度,目前有独立董事3 名。董事会下设资格审查与薪酬委员会、审计及风险管理委员会等专业委员会,其中审计及风险管理委员会负责评价与完善公司内部控制体系。公司管理层设立了投资决策委员会、风险控制委员会、IT 治理委员会、产品委员会、估值委员会等专业委员会。
(2)公司各部门之间有明确的授权分工,既互相合作,又互相核对和制衡,形成了合理的组织结构。
(3)公司坚持稳健经营和规范运作,重视员工的职业道德的培养,制定和颁布了《内部合规控制手册》,并进行持续教育。
2、风险评估
公司各层面和各业务部门在确定各自的目标后,对影响目标实现的风险因素进行分析。对于不可控风险,风险评估的目的是决定是否承担该风险或减少相关业务;对于可控风险,风险评估的目的是分析如何通过制度安排来控制风险程度。风险评估还包括各业务部门对日常工作中新出现的风险进行再评估并完善相应的制度,以及新业务设计过程中评估相关风险并制定风险控制制度。
3、控制活动
公司对投资、会计、技术系统和人力资源等主要业务制定了严格的控制制度。在业务管理制度上,做到了业务操作流程的科学、合理和标准化,并要求完整的记录、保存和严格的检查、复核;在岗位责任制度上,内部岗位分工合理、职责明确,不相容的职务、岗位分离设置,相互检查、相互制约。
(1)投资控制制度
①投资决策与执行相分离。投资管理决策职能和交易执行职能严格隔离,实行集中交易制度,建立和完善公平的交易分配制度,确保各投资组合享有公平的交易执行机会。
②投资授权控制。建立明确的投资决策授权制度,防止越权决策。投资决策委员会负责制定投资原则并审定资产配置比例;基金经理在投资决策委员会确定的范围内,负责确定与实施投资策略、建立和调整投资组合并下达投资指令,对于超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序;交易部负责交易执行。
③警示性控制。按照法规或公司规定设置各类资产投资比例的预警线,交易系统在投资比例达到接近限制比例前的某一数值时自动预警。
④禁止性控制。根据法律、法规和公司相关规定,基金禁止投资受限制的证券并禁止从事受限制的行为。交易系统通过预先的设定,对上述禁止进行自动提示和限制。
⑤多重监控和反馈。交易部对投资行为进行一线监控;监察稽核部进行事中及事后的监控。在监控中如发现异常情况将及时反馈并督促调整。
(2)会计控制制度
①建立了基金会计的工作制度及相应的操作和控制规程,确保会计业务有章可循。
②按照相互制约原则, 建立了基金会计业务的复核制度以及与托管人相关业务的相互核查监督制度。
③为了防范基金会计在资金头寸管理上出现透支风险,制定了资金头寸管理制度。
④制定了完善的档案保管和财务报表制度。
(3)技术系统控制制度
为保证技术系统的安全稳定运行,公司对硬件设备的安全运行、数据传输与网络安全管理、软硬件的维护、数据的备份、信息技术人员操作管理、危机处理等方面都制定了完善的制度。
(4)人力资源管理制度
公司建立了涵盖科学的招聘解聘、培训、考核、薪酬等内容的人事管理制度,确保人力资源的有效管理。
(5)监察制度
公司设立了监察稽核部,负责公司的法律事务和监察工作。监察制度包括违规行为的调查程序和处理制度,以及对员工行为的监察。
(6)反洗钱制度
公司设立了反洗钱工作小组作为反洗钱工作的专门机构,指定专门人员负责反洗钱和反恐融资合规管理工作;各相关部门设立了反洗钱岗位,配备反洗钱负责人员。除建立健全反洗钱组织体系外,公司还制定了《反洗钱内部控制制度》及相关业务操作规程,确保依法切实履行金融机构反洗钱义务。
4、信息沟通
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,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,信息及时送交适当的人员进行处理。目前公司业务均已做到了办公自动化,不同的人员根据其业务性质及层级具有不同的权限。
5、内部监控
公司设立了独立于各业务部门的监察稽核部,通过定期或不定期检查,评价公司内部控制制度合理性、完备性和有效性,监督公司各项内部控制制度的执行情况,确保公司各项经营管理活动的有效运行。
6、基金管理人关于内部控制的声明
(1)本公司确知建立、实施和维持内部控制制度是本公司董事会及管理层的责任。
(2)上述关于内部控制的披露真实、准确。
(3)本公司承诺将根据市场环境的变化及公司的发展不断完善内部控制制度。

第四部分 基金托管人

(一)基金托管人简况
名称:中信证券股份有限公司
住所:广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座
办公地址:北京市朝阳区亮马桥路48号
法定代表人:王东明
联系电话:(010)60838888
联系人:吴俊文
成立时间:1995年10月25日
批准设立机关和批准设立文号:国家工商总局,100000000018305
组织形式:股份有限公司(上市)
注册资本:人民币壹佰壹拾亿壹仟陆佰玖拾万捌仟肆佰元整
存续期间:无限期
基金托管资格批文及文号:《关于核准中信证券股份有限公司证券投资基金托管资格的批复》(证监许可[2014]1044号)
中信证券股份有限公司(以下简称“中信证券”)成立于1995年10月25日,前身是中信证券有限责任公司。中信证券于2003年1月6日在上海证券交易所挂牌上市,并于2011年10月6日在香港联交所上市交易。截至2014年9月30日,中信证券总股本为人民币11,016,908,400.00元,第一大股东为中国中信有限公司(持股比例为20.30%)。在证券公司分类评审中,中信证券连续七年获得目前中国证券行业最高级别A类AA级。
目前,中信证券拥有主要全资子公司6家,分别为中信证券(浙江)有限责任公司、中信证券(山东)有限责任公司、中信证券国际有限公司、中信期货有限公司、金石投资有限公司、中信证券投资有限公司;拥有主要控股子公司1家, 即,华夏基金管理有限公司。根据中国证监会核发的经营业务许可证,公司经营范围包括:证券经纪,证券投资咨询,与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问,证券承销与保荐,证券自营,证券资产管理,融资融券,证券投资基金代销,证券投资基金托管,为期货公司提供中间介绍业务,代销金融产品。中信证券秉承创新和专业化的经营理念,在各项业务领域保持行业的领先地位。
(二)主要人员情况
2014年中信证券设立托管部,管理并具体承办基金托管业务。托管部下设产品、估值核算、业务结算、监督稽核、综合等服务。部门员工均具备证券投资基金从业资格,并具有多年金融从业经历,核心业务岗人员均已具备2年以上托管业务相关从业经验。
吴俊文女士,中信证券托管部总经理;西安电子科技大学计算机及应用学学士,2000年6月至2014年6月,担任中信证券清算部执行总经理,主要负责经纪业务、资产管理业务以及自营投资业务的业务运营管理工作,2014年7月起任中信证券托管部总经理。
(三)基金托管业务经营情况
中信证券于2014年10月经中国证监会核准获批证券投资基金托管资格。中信证券自取得证券投资基金托管资格以来,秉承“忠于所托,信于所管”的宗旨,严格遵守国家的有关法律法规和监管机构的有关规定,依靠科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的运营系统和专业的服务团队,切实履行资产托管人职责,为投资者提供安全、高效、专业的托管服务。
(四)基金托管人的内部控制制度
1、内部控制目标
中信证券保证托管业务运行严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则,建立守法经营、规范运作的经营思想和经营风格,形成运作流程化、管理科学化、监控制度化的内控体系;防范和化解经营风险,确保托管资产的安全完整,维护基金份额持有人的合法权益,保障托管业务安全、有效、稳健运行。
2、内部控制原则
(一)合法合规原则: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;
(二)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,覆盖所有的岗位和人员;
(三)有效性原则:建立对内控制度及其执行的监督、评价、反馈和完善机制,保证内控制度有效执行;
(四)审慎性原则:托管业务各项业务活动必须防范风险,审慎经营,保证基金资产的安全与完整;
(五)预防性原则:必须树立“预防为主”的管理理念,控制风险发生的源头,防患于未然,尽量避免业务操作中各种问题的产生;
(六)及时性原则:内部控制制度的制定应当具有前瞻性,并且随着托管部经营战略、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进行及时的修改或完善,发现问题,要及时处理,堵塞漏洞;
(七)独立性原则:托管人托管的基金资产、托管人的自有资产、托管人托管的其他资产应当分离;直接操作人员和控制人员应相对独立,适当分离;内控制度的检查、评价小组必须独立于内控制度的制定和执行小组;
(八)相互制约原则:托管部的内部机构和岗位设置应当权责分明、相互制衡;
3、内部控制制度及措施
根据《证券投资基金法》、《证券投资基金托管业务管理办法》、《非银行金融机构开展证券投资基金托管业务暂行规定》等法律法规的规定,中信证券制定了一整套严密、高效的证券投资基金托管业务的规章制度,确保基金托管业务运行的规范、安全以及高效。
主要制度包括《中信证券证券投资基金托管业务管理办法》、《中信证券证券投资基金托管业务内部控制和风险管理办法》、《中信证券证券投资基金托管业务信息披露管理办法》、《中信证券证券投资基金托管业务保密工作管理办法》、《中信证券股份有限公司证券投资基金托管业务会计核算业务管理办法》、《中信证券股份有限公司证券投资基金托管业务清算管理办法》、《中信证券股份有限公司证券投资基金托管业务投资监督管理办法》、《中信证券股份有限公司证券投资基金托管业务资产保管管理办法》、《中信证券基金托管业务从业人员管理办法》、《中信证券证券投资基金托管业务档案管理办法》等,并根据市场变化和基金业务的发展不断加以完善。通过这些规章制度的建立和实施,做到业务分工合理、业务运行和操作流程化、技术系统完整独立、核心业务相互隔离以及有关信息披露由专人负责,以便勤勉尽责的履行托管义务。
托管业务内部控制的内容主要涉及托管项目、资产保管、资金清算、会计核算和资产估值、投资监督、信息技术系统等重要业务环节的内部控制。基金托管人通过对基金托管业务各环节风险的事前揭示、事中控制和事后稽核的动态管理过程来实施内部风险控制。同时为了保证和验证内部控制的有效性、完整性,中信证券定期聘请具有证券业务资格的专业会计师事务所,针对基金托管业务的内部控制制度建设与实施情况,开展相关审查与评估,出具评估报告。
托管业务内部控制的主要措施包括:不相容职务分离控制、授权审批控制、财产保护控制、会计系统控制、预算控制、运营分析控制和绩效考评控制等。
(五)基金托管人对基金管理人运作基金的监督方法与程序
1、监督方法
基金托管人依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定,监督所托管基金的投资运作。严格按照现行法律法规以及基金合同规定,对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督,并定期编写基金投资运作监督报告,报送中国证监会。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中,对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。
2、监督流程
(1)每工作日按时通过监控系统,对各基金投资运作比例等控制指标进行例行监控,发现投资比例超标等异常情况,向基金管理人发出书面通知,与基金管理人进行情况核实,督促其纠正,并根据具体情况及时报告中国证监会。
(2)收到基金管理人的投资指令后,对涉及各基金的投资范围、投资对象及交易对手等内容进行合法合规性监督。
(3)根据基金投资运作监督情况,定期编写基金投资运作监督报告,对各基金投资运作的合法合规性、投资独立性和风格显著性等方面进行评价,报送中国证监会。
(4)通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易,电话或书面要求管理人进行解释或举证,并及时报告中国证监会。

第五部分 相关服务机构

一、直销机构
永赢基金管理有限公司
住所:浙江省宁波市江东区中山东路466号
办公地址:上海市浦东新区世纪大道210号二十一世纪大厦27楼
法定代表人:罗维开
联系电话:(021)5169 0103
传真:(021)5169 0178
联系人:吴亦弓
网址:www.maxwealthfund.com
二、代销机构
1、中信证券股份有限公司
住所:广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座
办公地址:北京市朝阳区亮马桥路48号
法定代表人:王东明
客户服务电话:95548
传真:010-60833799
联系人:李濂
联系电话:010-60838693
网址:www.cs.ecitic.com
2、基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择其他符合要求的机构代理销售本基金,并及时公告。
三、登记机构
永赢基金管理有限公司
住所:浙江省宁波市江东区中山东路466号
办公地址:上海市浦东新区世纪大道210号二十一世纪大厦27楼
法定代表人:罗维开
联系电话:(021)5169 0103
传真:(021)5169 0178
联系人:吴亦弓
四、出具法律意见书的律师事务所
名称:远闻(上海)律师事务所
注册地址:上海市浦东大道720号国际航运金融大厦8楼B座
办公地址:上海市浦东大道720号国际航运金融大厦8楼B座
负责人:奚正辉
电话:021-5036 6376
传真:021-5036 6733
经办律师:屠鏖 孙赏
五、审计基金财产的会计师事务所
名称:安永华明会计师事务所
住所:北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼(东三办公楼)16层
办公地址:上海市世纪大道100号环球金融中心50楼
执行事务合伙人:吴港平
电话:(021)2228 8888
传真:(021)2228 0000
联系人:边卓群
经办注册会计师:边卓群、蒋燕华

(下转A18版)

永赢基金管理有限公司永赢量化混合型发起式证券投资基金份额发售公告

基金管理人:永赢基金管理有限公司
基金托管人:中信证券股份有限公司
二〇一五年七月
重要提示

1. 永赢量化混合型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)的募集已于2015年6月17日获中国证监会证监许可(2015)1273号文注册。中国证监会对本基金的注册并不代表中国证监会对本基金的价值和收益作出实质性判断、推荐或者保证,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。
2. 本基金为契约型、开放式、混合型发起式证券投资基金。
3. 本基金的基金管理人和注册登记机构为永赢基金管理有限公司(以下简称“本公司”或“永赢基金”),基金托管人为中信证券股份有限公司(以下简称“中信证券”)。
4. 本基金的发售期为2015 年7月27日至2015 年8月26日。本基金通过本公司的直销机构(本公司直销柜台和网上交易)及其他基金销售机构的销售网点公开发售。基金管理人可根据募集情况适当延长或缩短本基金的募集期限并及时公告,但整个募集期限自基金份额发售之日起不超过三个月。
5. 本基金的基金代码为:001565。本基金的募集规模下限为1000万元。本基金为发起式基金,在基金募集时,发起资金认购本基金的金额不低于1000万元,且发起份额的持有期限不低于三年。
6. 本基金的发售对象为符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和发起资金提供方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。
7. 投资者购买本基金基金份额,需开立永赢基金基金账户。已经开立过本公司基金账户的投资者,可以直接认购本基金而无须另行开立基金账户。募集期内本公司直销机构和其他基金销售机构下属销售网点为投资者办理开立基金账户的手续。
8. 投资者需开立“基金账户”和“交易账户”才能办理本基金的认购手续。投资者可在不同销