申万菱信基金管理有限公司
申万菱信量化驱动混合型证券投资基金招募说明书

基金管理人:申万菱信基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
二〇一八年一月

本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,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

重要提示

申万菱信量化驱动混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)由申万菱信基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”或“本基金管理人”或“本公司”)依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》、《申万菱信量化驱动混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关规定募集,并经中国证监会2017年7月31日证监许可【2017】1406号文注册募集。

本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投资价值、市场前景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。

本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本基金财产,但不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。

本基金投资于证券、期货市场,基金净值会因为证券、期货市场波动等因素产生波动,投资者在投资本基金前,需充分了解本基金的产品特性,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,由于基金投资者连续大量赎回基金产生的流动性风险,基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险,本基金的特有风险等。

基金管理人建议投资人根据自身的风险收益偏好,选择适合自己的基金产品,并且中长期持有。

投资有风险,投资者在进行投资决策前,请仔细阅读本基金的招募说明书及基金合同等信息披露文件,自主判断基金的投资价值,自主做出投资决策,自行承担投资风险。投资者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。本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金,低于股票型基金,属于中高预期收益和中高预期风险水平的投资品种。

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。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。

本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的50%,但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过50%的情形除外。

第一部分 绪言

《申万菱信量化驱动混合型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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及其他相关法律法规及《申万菱信量化驱动混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)编写。

本基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假内容、误导性陈述或重大遗漏,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。

本招募说明书由本基金管理人根据基金合同编写,并经中国证监会注册,主要向投资者披露本基金及与本基金相关事项的信息,是投资者据以选择及决定是否投资于本基金的要约邀请文件。基金合同是规定基金合同当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资者自依据基金合同取得基金份额,即成为本基金份额持有人和基金合同的当事人,其持有本基金基金份额的行为即视为对基金合同的承认和接受。投资者按照法律法规和基金合同的规定享有权利、承担义务。本基金投资者欲了解本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

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:指申万菱信量化驱动混合型证券投资基金
2、基金管理人:指申万菱信基金管理有限公司
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《申万菱信量化驱动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《申万菱信量化驱动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、招募说明书或本招募说明书:指《申万菱信量化驱动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《申万菱信量化驱动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、通知等以及颁布机关对其不时做出的修订
9、《基金法》:指2012年12月28日第十一届全国人大常委会第30次会议修订,自2013年6月1日起实施,并经2015年4月24日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修改的《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、《流动性管理规定》:指2017年8月31日颁布、同年10月1日起实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》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:指符合现时有效的相关法律法规规定可投资于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、基金份额持有人大会:指按照基金合同第八部分之规定召集、召开并由基金份额持有人或其合法的代理人进行表决的会议
21、投资人、投资者: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
22、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
23、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
24、销售机构:指申万菱信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
25、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
26、登记机构:指办理登记业务的机构。基金的登记机构为申万菱信基金管理有限公司或接受申万菱信基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构
27、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
28、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基金交易业务引起的基金份额变动及结余情况的账户
29、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
30、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
31、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
32、存续期:指基金合同生效至终止之间的不定期期限
33、工作日:指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日
34、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
35、T+n日:指自T日起第n个工作日(不包含T日),n为自然数
36、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
37、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
38、《业务规则》:指《申万菱信基金管理有限公司开放式基金业务规则》,是由申万菱信基金管理有限公司制定并不时修订的,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
39、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
40、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
41、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
42、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
43、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
44、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受理基金申购申请的一种投资方式
45、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)超过上一工作日基金总份额的10%
46、元:指人民币元
47、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、证券持有期间的公允价值变动、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
48、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
49、基金资产净值:指基金资产总值减去基金负债后的价值
50、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
51、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
52、流动性受限资产:指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产,包括但不限于到期日在10个交易日以上的逆回购与银行定期存款(含协议约定有条件提前支取的银行存款)、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等
53、7个工作日可变现资产:包括可在交易所、银行间市场正常交易的股票、债券、非金融企业债务融资工具及回收存单,7个工作日内到期或可支取的逆回购、银行存款,7个工作日内能够确认收到的各类应收款项等
54、摆动定价机制:指当本基金遭遇大额申购赎回时,通过调整基金申购赎回价格的方式,将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者,从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响,确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待
55、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
56、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

第三部分 基金管理人

一、基金管理人概况
名称:申万菱信基金管理有限公司
注册地址:上海市中山南路100号11层
办公地址:上海市中山南路100号11层
法定代表人:刘郎
设立日期:2004年1月15日
批准设立机关及批准设立文号:中国证监会证监基金字【2003】144号文
组织形式:有限责任公司
注册资本:壹亿伍仟万元人民币
联系电话:021-23261188
联系人:牛锐
股权结构:申万宏源证券有限公司持有67%的股权,三菱UFJ信托银行株式会社持有33%的股权
二、主要人员情况
1、董事会成员
刘郎先生,董事长,硕士研究生,副教授。曾任湖南邵阳学院助教,东南大学系副主任、副教授。1994年起从事金融相关工作,历任泰阳证券有限责任公司党委副书记、总裁、董事,万联证券有限责任公司总裁、董事,广州城市职业学院商学院主任,大通证券股份有限公司党委委员、副总经理,申银万国证券股份有限公司副总经理,申万宏源证券有限公司副总经理。现任申万菱信基金管理有限公司董事长,兼任申万菱信(上海)资产管理有限公司董事长。
朱敏杰先生,董事,硕士研究生,经济师。1988年起从事证券相关工作,先后任职于万国证券公司,申银万国证券股份有限公司,现任申万宏源证券有限公司副总经理。
张克均先生,董事,硕士研究生。1990年起从事金融相关工作,曾任职于兴业银行厦门分行、申银万国证券股份有限公司,现任申万宏源证券有限公司总经理助理。
铃木晃先生,董事,日本籍,大学学历。1982年4月至今在三菱UFJ信托银行株式会社(原三菱信托银行)任职,历任投资商品开发部副部长、部长、执行官,管理受托财产部门常务执行官、副部门长,现任受托财产副部门长、资产管理事业部副事业长。
川上丰先生,董事,日本籍,大学学历。1990年4月至今在三菱UFJ信托银行株式会社(原三菱信托银行)任职,曾任投资企划部科长、海外资产管理事业部科长、次长、副部长等。现任三菱UFJ信托银行株式会社海外资产管理部部长。
来肖贤先生,董事,硕士研究生。曾任申银万国证券股份有限公司国际业务总部投资分析师、部门副经理等。2004年加入申万菱信基金管理有限公司,曾任监察稽核总部副总监、公司督察长、公司副总经理,现任公司总经理,兼任申万菱信(上海)资产管理有限公司董事。
白虹女士,独立董事,硕士研究生。曾任职于中国工商银行总行、韩国釜山分行、万事达卡国际组织、FEXCO国际商务等,2012年起任跨界创新平台(COIN)创始人兼CEO。
阎小平先生,独立董事,硕士研究生,高级经济师。1969年开始工作,1984年进入金融行业,曾先后任职于中国工商银行总行、工商银行北京市分行等。2009年1月起退休。
张军建先生,独立董事,博士研究生,教授。曾在四川外国语大学、日本长崎县立大学、日本千叶大学、早稻田大学任教;此后曾任职于日本菱南开发株式会社。2001年至今在中南大学任法学院教授,中日经济法研究所所长,中南大学信托与信托法研究中心主任;中国银行法学研究会常务理事;中美法律交流基金会信托法委员会副主席。
2、监事会成员
徐志斌先生,监事会主席,硕士研究生。曾任高盛集团环球控制部高级分析师、项目经理、团队经理,高盛集团运营风险管理部欧洲区负责人、总监、执行董事,高盛集团市场风险管理部执行董事,中国建银投资有限责任公司风险管理部业务总监、高级业务总监、负责人,宏源证券股份有限公司副总经理,申万宏源证券有限公司副总经理、首席风险官,现任申万宏源证券有限公司党委委员、副总经理,兼任申银万国投资有限公司董事长、申银万国创新投资有限公司董事长。
杉崎千雄先生,监事,日本籍,大学学历。1988年4月至今任职于三菱UFJ信托银行株式会社(原三菱信托银行),历任投资企划部次长等职务,2014年4月起任受托财产企划部副部长。
牛锐女士,职工监事,博士研究生,曾任职于申银万国证券股份有限公司、中国证监会上海监管局、中金公司、国泰基金等公司。2013年加入申万菱信基金管理有限公司,现任监察稽核部总监。
葛菲斐女士,职工监事,大学本科学历,2006年加入申万菱信基金管理有限公司,曾任职于行政管理总部,主要从事行政管理、人力资源相关工作,曾任人力资源总部总监助理,现任人力资源部负责人,兼任申万菱信(上海)资产管理有限公司监事。
3、高级管理人员
刘郎先生,相关介绍见董事会成员部分。
来肖贤先生,相关介绍见董事会成员部分。
王伟先生,博士研究生。曾任职于申银万国证券股份有限公司。2003年加入申万巴黎基金管理有限公司筹备组,后正式加入申万菱信基金管理有限公司,历任市场部副总监、总监,首席市场官,现任公司副总经理,兼任申万菱信(上海)资产管理有限公司监事。
张少华先生,硕士研究生。曾任职于申银万国证券股份有限公司。2003年1月加入申万巴黎基金筹备组,后正式加入申万菱信基金管理有限公司,历任风险管理总部高级风险分析师、总监,基金投资管理总部基金经理、副总监,投资管理总部总监、基金经理,现任公司副总经理。
张丽红女士,硕士研究生。曾任职于中国工商银行股份有限公司,申银证券股份有限公司,申银万国证券股份有限公司。2004年加入申万菱信基金管理有限公司,历任财务管理总部总监,首席财务官兼财务管理总部总监,现任公司副总经理。
王菲萍女士,硕士研究生。曾在申银万国证券股份有限公司总裁办任法律顾问等职务。2004年加入申万菱信基金管理有限公司,曾任监察稽核总部总监,现任公司督察长。
4、拟任基金经理
金昉毅先生,博士研究生。曾任职于中央财经大学中国金融发展研究院,2011年1月加入申万菱信基金管理有限公司,历任高级研究员、基金经理助理、投资管理总部总监助理,申万菱信沪深300价值指数证券投资基金基金经理,现任量化投资部负责人,申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)、申万菱信沪深300指数增强型证券投资基金、申万菱信量化成长混合型证券投资基金、申万菱信价值优享混合型证券投资基金、申万菱信价值优利混合型证券投资基金、申万菱信价值优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
5、投资决策委员会委员名单
投资决策委员会由以下人员组成:总经理、公司分管投资的副总经理、权益研究部负责人、权益投资部负责人、量化投资部负责人、固定收益投资部负责人、指数与创新投资部负责人等。
公司总经理为本委员会主席,分管投资的副总经理为本委员会召集人,权益研究部负责人为本委员会秘书,负责协调统筹本委员会的各项事宜。
公司董事长、督察长、监察稽核部负责人、风险管理部负责人作为非执行委员,有权列席本委员会的任何会议。非执行委员不参与投票表决。
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)依法募集资金,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)自基金合同生效之日起,以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产;
(4)配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策,以专业化的经营方式管理和运作基金财产;
(5)建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度,保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立,对所管理的不同基金分别管理,分别记账,进行证券投资;
(6)除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外,不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益,不得委托第三人运作基金财产;
(7)依法接受基金托管人的监督;
(8)采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定,按有关规定计算并公告基金资产净值,确定基金份额申购、赎回的价格;
(9)进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;
(10)编制季度、半年度和年度基金报告;
(11)严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定,履行信息披露及报告义务;
(12)保守基金商业秘密,不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外,在基金信息公开披露前应予保密,不向他人泄露;
(13)按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基金收益;
(14)按规定受理申购与赎回申请,及时、足额支付赎回款项;
(15)依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会;
(16)按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料15年以上;
(17)确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出,并且保证投资者能够按照基金合同规定的时间和方式,随时查阅到与基金有关的公开资料,并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件;
(18)组织并参加基金财产清算小组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;
(19)面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时,及时报告中国证监会并通知基金托管人;
(20)因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时,应当承担赔偿责任,其赔偿等各个环节。
(2)有效性原则:本基金管理人内控体系注重于建立不同层次的风险控制和监察程序,同时各业务部门和岗位均设立并遵循合理的管理制度和有效率的工作流程。本基金管理人内部控制体系的建立在各项业务的运行过程中将发挥事前防范风险、事中监控和事后稽核的作用。
(3)独立性原则:本基金管理人各机构、部门和岗位职责应当保持相对独立,公司旗下基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离。设立独立于各业务和管理部门的风险管理部对各部门、岗位进行流程监控和风险管理。此外,更具独立性的督察长和监察稽核部,对各部门的业务开展进行合规监察,并代表董事会对公司的运营进行独立的稽核。
(4)相互制约原则:公司内部部门和岗位的设置权责分明、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,通过合理的成本控制达到最佳的内部控制效果。
3、风险管理及内部风险控制的组织结构
为满足业务发展中风险控制的要求,本公司建立了董事会、经营管理层、内部风险控制部门、各职能部门的四级风险管理及内部风险控制组织结构,并明确了相应的风险管理职能。
(1)董事会对有效的风险管理承担最终责任,董事会下设风险控制委员会与督察长。风险控制委员会负责监督和核实公司作出的与其所管理的基金有关的重大投资决策是否符合该基金的一般投资政策;检查和监督公司存在或潜在的各种风险以及公司遵守法律的情况。督察长负责独立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,依法向中国证监会和公司董事会报告。
(2)经营管理层对有效的风险管理承担直接责任,经营管理层下设风险管理委员会,负责指导、协调和监督各职能部门和各业务单元开展风险管理工作,审核公司的风险控制制度和风险管理流程,确保对公司整体风险进行风险评估的识别、监控与管理,对公司存在的风险隐患或出现的风险问题进行研究、提出解决方法,组织实施风险应对方案等。
(3)监察稽核部和风险管理部是公司内部风险控制部门,负责对投资组合市场风险、流动性风险、信用风险、合规风险、操作风险、声誉风险、子公司管控风险等的风险管理进行独立评估、监控、检查和报告。
(4)各职能部门负责执行风险管理的基本制度流程,具体制定、组织实施并持续完善本部门业务相关的风险管理制度和相关应对措施、控制流程、监控指标等,将风险管理的原则与要求贯穿业务开展的全过程并对其风险管理的有效性负责。
六、基金管理人内部控制要素
1、内部控制环境
(1)内部控制环境包括经营理念和内控文化、公司治理结构、组织结构、员工道德素质等内容;
(2)本基金管理人致力于营造一个强调内控和风险管理的文化氛围;
(3)本基金管理人按现代企业制度的要求,建立了符合公司发展需要的组织结构和运行机制,充分发挥独立董事、监事会对公司管理层和经营活动的监督,通过在董事会、监事会层面建立专业化、民主、透明的决策程序和管理、议事规则,防止不正当的关联交易、利益输送和公司内部人控制的现象并确保基金份额持有人的利益不受侵犯;
(4)本基金管理人建立了科学的聘用、培训、评估考核、晋升、淘汰等人力资源管理制度,建立了健全的激励与约束机制,确保公司职员具备和保持良好的职业操守和专业素养;
(5)本基金管理人建立了贯穿于公司整体的、层次明晰、权责统一、监管明确的四层内部控制防线,包括:
第一层:员工的自律与岗位之间的相互制衡与监督;
第二层:严格的授权管理及等级监督制度;
第三层:独立于各部门、服务于公司高级管理层的由风险管理部对各业务部门实施的日常常规风险检查;
第四层:服务于董事会的独立的合规监察与稽核;
(6)本基金管理人建立了重要业务处理凭据传递和信息沟通制度,有关部门和岗位之间相互监督、相互制衡。
2、风险评估
(1)风险评估,包括风险鉴别和风险测算两大部分,是风险控制管理的前提;
(2)风险鉴别指公司需要确认并了解它所面临风险的特征;
(3)风险测算则在风险鉴别的基础上进一步对风险可能产生的损失作出较为科学和准确的估测;
(4)风险管理委员会需要从风险损失的领域进行划分,确认某项风险将导致公司承担相应法律责任、社会和公众责任、经济损失或是在以上三个领域的任何组合损失;
(5)各部门应负责落实其相关的风险控制措施;
(6)风险管理部需要在预期风险损失发生的情景下,评估风险对各方面产生的冲击效应。
3、控制活动
(1)严格的流程控制是公司进行有效的内部控制的基础。
(1)本基金管理人各项业务操作均应严格遵守公司制定的相应流程,主要的基本业务流程包括:销售和基金募集管理流程、客户开户和注册登记管理流程、客户服务与客户关系处理流程、投资决策管理流程、投资交易管理流程、基金清算与基金会计管理流程、产品开发流程、信息披露管理流程、信息技术管理与操作流程、紧急应变程序、绩效评估与考核程序、授权管理程序、风险控制流程和监察稽核程序等;
2)在主要基本业务流程体系的基础上,各部门结合基本业务流程和其部门、岗位的职责进一步制定具体的、涵盖操作细节的操作流程;在销售、注册登记、投资、交易、基金清算及授权管理等重要操作流程设计与执行中应产生和保留详细的书面记录;
3)风险管理部在日常业务运行过程中对操作流程的遵守情况进行全面监督和记录;
4)各部门主管负责对本部门的流程运作进行实时监控以保证本部门的工作严格遵守相关业务流程;
5)监察稽核部以定期稽核的方式检查各业务部门对相关流程运作与遵守情况,并对该流程的合理性、可操作性以及得到遵守的实际状况进行评估;
(2)严格的分级授权是公司内部控制的基本方式;
(3)建立完善的资产分离制度,基金资产与公司资产、不同基金的资产和其他委托资产实行独立运作,分别核算;
(4)严格执行岗位分离制度,明确制定了岗位职责;
(5)建立科学的业绩评估和考核体系,定期对各项业务开展作出综合评价并对各部门和岗位人员的业绩进行评估、考核;
(6)制定切实有效的紧急应变预案,建立危机处理的机制,明确危机处理的程序。
4、信息沟通
(1)建立公司内部的信息沟通渠道,保障信息的及时、准确的传递,并且维护渠道的畅通;
(2)建立清晰的报告系统;
(3)如果遇到紧急情况无法联络上级主管,可以越级汇报。
5、内部监控
本基金管理人建立了有效的内部监控体系,设置督察长和独立的监察稽核部,对公司内控制度的执行情况进行持续的监督,保证内控制度落实。
(1)设督察长,对董事会负责,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开展工作;
(2)设独立于公司运营管理部门的监察稽核部,监察稽核部通过定期稽核计划以及不定期的抽查稽核实现对公司的内部风险监控;
(3)设独立于各业务部门的风险管理部,该部门的工作主要对公司管理层负责;
(4)各部门主管负责本部门对于内控制度的执行和监督;在具体的业务运营中,授权管理、岗位间相互监督与相互制衡以及业务流程中跨部门之间的相互校验与会签制度的执行将赋予各岗位具体的监督职能;
(5)督察长、风险管理部和投资总监有权对整个投资交易过程实施全程跟踪的在线监控;信息技术部在信息技术方面对这项实时监控提供充分的技术支持。监控者根据其授权范围和监控领域对于投资交易过程中的控制参数进行预设置;
(6)各部门在发现任何有违反内控原则的行为时,应立即根据报告流程逐级上报,遇到紧急情况可以越级上报;
(7)对于员工个人违反法律法规和有关规定,视其给公司造成的损失及影响程度进行处理。对各项规定制度完善、风险防范工作积极主动并卓有成效的部门,公司给予适当表彰与鼓励。由于部门制度不合适或管理不完善而造成较大风险并给公司带来损失的,公司将追究部门主要负责人的责任。
七、基金管理人内部控制制度声明
1、本基金管理人承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确;
2、本基金管理人承诺根据市场变化和基金管理人发展不断完善内部合规控制。

第四部分 基金托管人

一、基金托管人基本情况
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:周慕冰
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:010-66060069
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“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《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。自2010年起中国农业银行连续通过托管业务国际内控标准(ISAE3402)认证,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”。2012年荣获第十届中国财经风云榜“最佳资产托管银行”称号;2013年至2016年连续荣获上海清算所授予的“托管银行优秀奖”和中央国债登记结算有限责任公司授予的“优秀托管机构奖”称号;2015年、2016年荣获中国银行业协会授予的“养老金业务最佳发展奖”称号。
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,2014年更名为托管业务部/养老金管理中心,内设综合管理部、业务管理部、客户一部、客户二部、客户三部、客户四部、风险合规部、产品研发与信息技术部、营运一部、营运二部、市场营销部、内控监管部、账户管理部,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近140名,其中具有高级职称的专家30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
截止到2017年9月30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415只。
二、基金托管人的内部风险控制制度说明
1、内部控制目标
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、内部控制组织结构
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、内部控制制度及措施
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,实施音像监控;业务信息由专职信息披露人负责,防止泄密;业务实现自动化操作,防止人为事故的发生,技术系统完整、独立。
三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序
基金托管人通过参数设置将《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议规定的投资比例和禁止投资品种输入监控系统,每日登录监控系统监督基金管理人的投资运作,并通过基金资金账户、基金管理人的投资指令等监督基金管理人的其他行为。
当基金出现异常交易行为时,基金托管人应当针对不同情况进行以下方式的处理:
1、电话提示。对媒体和舆论反映集中的问题,电话提示基金管理人;
2、书面警示。对本基金投资比例接近超标、资金头寸不足等问题,以书面方式对基金管理人进行提示;
3、书面报告。对投资比例超标、清算资金透支以及其他涉嫌违规交易等行为,书面提示有关基金管理人并报中国证监会。

第五部分 相关服务机构

一、基金份额发售机构
1、直销机构
名称:申万菱信基金管理有限公司直销中心
注册地址:上海市中山南路100号11层
办公地址:上海市中山南路100号11层
法定代表人:刘郎
电话:021-23261188
传真:021-23261199
联系人:陈继红
客户服务电话:400 880 8588(免长途话费)或86-21-962299
网址:www.swsmu.com
电子邮件:service@swsmu.com
2、其他销售机构
(1)名称:中国农业银行股份有限公司
注册地址:北京市东城区建国门内大街69号
法定代表人:周慕冰
客户服务电话:95599
网址:www.abchina.com
(2)名称:上海农村商业银行股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区银城中路8号中融碧玉蓝天15-20、22-27层
法定代表人:冀光照
客服电话:021-96 2999/4006 962 999
联系人:李晨
传真:021-50105124
网址:www.srcb.com
(3)名称:中信建投证券股份有限公司
注册地址:北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址:北京市朝阳门内大街188号
法定代表人:王常青
联系人:权唐
开放式基金咨询电话:400-8888-108
开放式基金业务传真:010-65182261
公司网站:www.csc108.com
(4)名称:中信证券股份有限公司
注册地址: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号中信证券大厦
法定代表人:王东明
电话:010-60838888
传真:010-60833739
联系人:顾凌
网址:www.cs.ecitic.com
(5)名称:中国银河证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
法定代表人:陈有安
客户服务热线:4008888888
传真:010-66568292
联系人:邓颜
公司网址:www.chinastock.com.cn
(6)名称:海通证券股份有限公司
注册地址:上海市淮海中路98号
办公地址:上海市广东路689号
法定代表人:王开国
联系人:金芸、李笑鸣
客户服务电话:400-8888-001(全国),021-95553,或拨打各城市营业网点咨询电话
公司网站:www.htsec.com
(7)名称:申万宏源证券有限公司
注册地址:上海市徐汇区长乐路989号45层
办公地址:上海市徐汇区长乐路989号45层
法定代表人:李梅
联系人:黄莹
电话:021-33389888
传真:021-33388224
客服电话:95523或4008895523
电话委托:021-962505
公司网址:www.swhysc.com
(8)名称:长江证券股份有限公司
注册地址:武汉市新华路特8号长江证券大厦
法定代表人:崔少华
联系人:奚博宇
传真:027-85481900
客户服务电话:95579或4008-888-999
网址:www.95579.com
(9)名称:安信证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
办公地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
深圳市福田区深南大道2008号中国凤凰大厦1栋9层
法定代表人:王连志
传真:0755-82558365
联系人:陈剑虹
统一客服电话:4008001001
公司网站地址:www.essence.com.cn
(10)名称:中信证券(山东)有限责任公司
注册地址:青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼20层
办公地址:青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼20层
法定代表人:杨宝林
客户服务电话:95548
网址:www.zxwt.com.cn
(11)名称:东吴证券股份有限公司
住所:苏州工业园区星