国泰基金管理有限公司国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金招募说明书

基金管理人:国泰基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
重要提示

国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)由国泰鑫保本混合型证券投资基金保本期到期变更而来。

国泰鑫保本混合型证券投资基金经中国证监会《关于准予国泰鑫保本混合型证券投资基金注册的批复》(证监许可【2015】2559号)注册,于2015年12月14日至2015年12月28日公开募集,募集结束后基金管理人向中国证监会办理备案手续。经中国证监会书面确认,《国泰鑫保本混合型证券投资基金基金合同》于2015年12月30日生效。

国泰鑫保本混合型证券投资基金保本期一般每3年为一个周期(当某一保本期触发目标收益致该保本期提前到期时除外),依据《国泰鑫保本混合型证券投资基金基金合同》的约定,国泰鑫保本混合型证券投资基金第一个保本期到期后,未能符合保本基金存续条件,国泰鑫保本混合型证券投资基金变更为“国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金”。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书报中国证监会备案,中国证监会对国泰鑫保本混合型证券投资基金募集的注册及保本期到期变更为本基金的备案,并不表明其对本基金的投资价值、市场前景和收益做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。投资人根据所持有的基金份额享受基金的收益,但同时也需承担相应的投资风险。基金投资中的风险包括:因经济、政治、社会等环境因素的变化对证券价格产生影响而形成的系统性风险,个别行业或个别证券特有的非系统性风险,流动性风险,基金管理人在基金管理运作过程中产生的运作管理风险,本基金的特定风险以及由某些不可抗力因素造成的其他风险等。

本基金为混合型基金,其预期风险、预期收益高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金。

本基金可投资中小企业私募债,中小企业私募债由于发行人自身特点,存在一定的违约风险。同时单只债券发行规模较小,且只能通过两大交易所特定渠道进行转让交易,存在流动性风险。本基金可投资产支持证券,存在与基础资产相关的风险、与资产支持证券相关的风险、与专项计划管理相关的风险和其他风险。

《基金合同》生效后,连续60个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5,000万元情形的,本基金将按照基金合同的约定进入清算程序并终止,无需召开基金份额持有人大会审议。投资人将面临基金合同可能终止的不确定性风险。

投资有风险,投资人申购本基金时应认真阅读基金合同、本招募说明书等信息披露文件。

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也不构成对本基金业绩表现的保证。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导致的投资风险,由投资人自行负担。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。

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资产,但不保证投资于本基金一定盈利,也不保证最低收益。

投资人应当认真阅读基金合同、基金招募说明书等信息披露文件,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。

第一部分 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》”)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称“《流动性风险管理规定》”)和其他有关法律法规的规定以及《国泰鑫策略价值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。本基金由国泰鑫保本混合型证券投资基金保本期到期变更而来。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,并按中国证监会备案。基金合同是规定基金合同当事人之间权利、义务的基本法律文件,如本招募说明书内容与基金合同有冲突或不一致之处,均以基金合同为准。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。

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:指国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金,由国泰鑫保本混合型证券投资基金保本期到期变更而来

2、基金管理人:指国泰基金管理有限公司

3、基金托管人:指中国银行股份有限公司

4、基金合同:指《国泰鑫策略价值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《国泰鑫策略价值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、招募说明书或本招募说明书:指《国泰鑫策略价值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、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

8、《基金法》:指《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

9、《销售办法》:指《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

10、《信息披露办法》:指《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

11、《运作办法》:指《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

12、《流动性风险管理规定》:指中国证监会2017年8月31日颁布、同年10月1日实施的《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

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/或中国银行保险监督管理委员会

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:指符合现行有效的相关法律法规规定可以投资于中国境内证券市场的中国境外的机构投资者

19、人民币合格境外机构投资者:指符合现行有效的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,销售基金份额,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:指基金管理人以及符合《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、注册登记业务:指基金注册登记、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、基金份额注册登记、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、注册登记机构:指办理注册登记业务的机构。基金的注册登记机构为国泰基金管理有限公司或接受国泰基金管理有限公司委托代为办理注册登记业务的机构

26、基金账户:指注册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申购、赎回、转换、转托管等业务导致基金的基金份额变动及结余情况的账户

28、基金合同生效日:指《国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效日,原《国泰鑫保本混合型证券投资基金基金合同》自同一日起失效

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、存续期:指《国泰鑫保本混合型证券投资基金基金合同》生效日至《国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同》终止日之间的不定期期限

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、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

33、T+n日:指自T日起第n个工作日(不包含T日)

34、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

35、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

36、《业务规则》:指《国泰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注册登记方面的业务规则,由基金管理人和投资人共同遵守

37、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

38、赎回:指基金合同生效后,基金份额持有人根据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

39、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

40、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

41、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申购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

42、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%

43、元:指人民币元

44、基金收益:指基金投资所得红利、股息、债券利息、票据投资收益、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

45、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

46、基金资产净值:指基金资产总值减去基金负债后的价值

47、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

48、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

49、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

50、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

51、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:国泰基金管理有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区浦东大道1200号2层225室
办公地址:上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层-19层
成立时间:1998年3月5日
法定代表人:陈勇胜
注册资本:壹亿壹仟万元人民币
联系人:辛怡
联系电话:021-31089000,400-888-8688
股权结构:

股东名称	股权比例
中国建银投资有限责任公司	60%
意大利忠利集团	30%
中国电力财务有限公司	10%

二、基金管理人管理基金的基本情况

截至2018年9月30日,本基金管理人共管理93只开放式证券投资基金:国泰金鹰增长灵活配置混合型证券投资基金、国泰金龙系列证券投资基金(包括2只子基金,分别为国泰金龙行业精选证券投资基金、国泰金龙债券证券投资基金)、国泰金马稳健回报证券投资基金、国泰货币市场证券投资基金、国泰金鹿保本增值混合证券投资基金、国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金、国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金(由金鼎证券投资基金转型而来)、国泰金牛创新成长混合型证券投资基金、国泰沪深300指数证券投资基金(由国泰金象保本增值混合证券投资基金转型而来)、国泰双利债券证券投资基金、国泰区位优势混合型证券投资基金、国泰中小盘成长混合型证券投资基金(LOF)(由金盛证券投资基金转型而来)、国泰纳斯达克100指数证券投资基金、国泰价值经典灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、上证180金融交易型开放式指数证券投资基金、国泰上证180金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国泰事件驱动策略混合型证券投资基金、国泰信用互利分级债券型证券投资基金、国泰成长优选混合型证券投资基金、国泰大宗商品配置证券投资基金(LOF)、国泰现金管理货币市场基金、国泰金泰灵活配置混合型证券投资基金(由国泰金泰平衡混合型证券投资基金变更注册而来,国泰金泰平衡混合型证券投资基金由金泰证券投资基金转型而来)、国泰民安增利债券型发起式证券投资基金、国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金、国泰估值优势混合型证券投资基金(LOF)(由国泰估值优势可分离交易股票型证券投资基金封闭期届满转换而来)、上证5年期国债交易型开放式指数证券投资基金、国泰上证5年期国债交易型开放式指数证券投资基金联接基金、纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金、国泰中国企业境外高收益债券型证券投资基金、国泰黄金交易型开放式证券投资基金、国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金、国泰聚信价值优势灵活配置混合型证券投资基金、国泰民益灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、国泰国策驱动灵活配置混合型证券投资基金、国泰浓益灵活配置混合型证券投资基金、国泰安康定期支付混合型证券投资基金(原国泰安康养老定期支付混合型证券投资基金)、国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金、国泰金鑫股票型证券投资基金(由金鑫证券投资基金转型而来)、国泰新经济灵活配置混合型证券投资基金、国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金、国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金(由国泰目标收益保本混合型证券投资基金转型而来)、国泰深证TMT50指数分级证券投资基金、国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金、国泰睿吉灵活配置混合型证券投资基金、国泰国证银行总行工作,历任国际部副总经理、资金计划部总经理、会计部总经理。1999年3月至2010年1月,在中国国际金融有限公司工作,历任财务总监、公司管委会成员、顾问。2010年4月至2012年3月,任汉石投资管理有限公司(香港)董事总经理。2013年8月至2016年1月,任中金基金管理有限公司独立董事。2017年3月起任公司独立董事。

吴群,独立董事,博士研究生,高级会计师。1986年6月至1999年1月在中国财政研究院研究生部会计教研室工作,历任讲师、副研究员、副主任、主任。1991年起兼任中国财政研究院研究生部(财政部财政科研所研究生部)硕士生导师。1999年1月至2003年6月在沪江德勤北京分所工作,历任技术部/企业风险管理部高级经理、总监,管理咨询部总监。2003年6月至2005年11月,在中国电子产业工程有限公司工作,担任财务部总经理。2014年9月至2016年7月兼任中国上市公司协会军工委员会副会长,2016年8月起兼任中国上市公司协会军工委员会顾问。2005年11月至2016年7月在中国电子信息产业集团有限公司工作,历任审计部副主任、资产部副主任(主持工作)、主任。2012年3月至2016年7月,担任中国电子信息产业集团有限公司总经济师。2003年1月至2016年11月,在中国电子信息产业集团有限公司所投资的境内外多个公司担任董事、监事。2017年5月起兼任首约科技(北京)有限公司独立董事。2017年10月起任公司独立董事。

2、监事会成员

梁凤玉,监事会主席,硕士研究生,高级会计师。1994年8月至2006年6月,先后于建设银行辽宁分行国际业务部、人力资源部、葫芦岛市分行城内支行、葫芦岛市分行计财部、葫芦岛市分行计财部、葫芦岛市分行国际业务部、建设银行辽宁分行计划财务部工作,任业务经理、副行长、副总经理等职。2006年7月至2007年3月在中国建银投资有限责任公司财务会计部工作。2007年4月至2008年2月在中国投资咨询公司任财务总监。2008年3月至2012年8月在中国建银投资有限责任公司财务会计部任高级经理。2012年9月至2014年8月在建投投资有限责任公司任副总经理。2014年12月起任公司监事会主席。

Yezdi Phiroze Chinoy,监事,大学本科。1995年12月至2000年5月在Jardine Fleming India任公司秘书及法务。2000年9月至2003年2月,在Dresdner Kleinwort Benson任合规部主管、公司秘书兼法务。2003年3月至2008年1月任JP Morgan Chase India合规部副总经理。2008年2月至2008年8月任Prudential Property Investment Management Singapore法律及合规部主管。2008年8月至2014年3月任Allianz Global Investors Singapore Limited东南亚及南亚合规部主管。2014年3月17日起任Generali Investments Asia Limited首席执行官。2016年12月1日起任Generali Investments Asia Limited执行董事。2014年12月起任公司监事。

刘锡忠,监事,研究生。1989年2月至1995年5月,中国人民银行总行稽核监察局主任科员。1995年6月至2005年6月,在华北电力集团财务有限公司工作,历任部门经理、副总经理。2005年7月起在中国电力财务有限公司工作,历任华北分公司副总经理、纪检监察室主持工作、风险管理部主任、资金管理部主任、河北业务部主任,现任风险管理部主任。2017年3月起任公司监事。

邓时锋,监事,硕士研究生。曾任职于天同证券。2001年9月加盟国泰基金管理有限公司,历任行业研究员、社保111组合基金经理助理、国泰金鼎价值混合和国泰金泰封闭的基金经理助理,2008年4月至2018年3月任国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金的基金经理,2009年5月至2018年3月兼任国泰区位优势混合型证券投资基金(原国泰区位优势股票型证券投资基金)的基金经理,2013年9月至2015年3月兼任国泰估值优势股票型证券投资基金(LOF)的基金经理,2015年9月至2018年3月兼任国泰央企改革股票型证券投资基金的基金经理。2017年7月起任权益投资总监。2015年8月起任公司职工监事。

倪莹,监事,硕士研究生。1998年7月至2001年3月,任新晨信息技术有限责任公司项目经理。2001年3月加入国泰基金管理有限公司,历任信息技术部总监、运营管理部总监,现任公司总经理助理。2017年2月起任公司职工监事。

宋凯,监事,大学本科。2008年9月至2012年10月,任毕马威华振会计师事务所上海分所助理经理。2012年12月加入国泰基金管理有限公司,历任审计部总监助理、纪检监察室副主任,现任审计部总监。2017年3月起任公司职工监事。

3、高级管理人员

陈勇胜,董事长,简历情况见董事会成员介绍。

周向勇,总经理,简历情况见董事会成员介绍。

李辉,大学本科,18年金融从业经历。1997年7月至2000年4月任职于上海远洋运输公司,2000年4月至2002年12月任职于中宏人寿保险有限公司,2003年1月至2005年7月任职于海康人寿保险有限公司,2005年7月至2007年7月任职于AIG集团,2007年7月至2010年3月任职于星展银行。2010年4月加入国泰基金管理有限公司,先后担任财富大学负责人、总经理办公室负责人、人力资源部(财富大学)及行政管理部负责人,2015年8月至2017年2月任公司总经理助理,2017年2月起担任公司副总经理。

封雪梅,硕士研究生,20年金融从业经历,曾就职于中国工商银行北京分行营业部、大成基金管理有限公司、信达澳银基金管理有限公司,2015年1月至2018年7月在国寿安保基金管理有限公司工作,任总经理助理,2018年7月加入国泰基金管理有限公司,担任公司副总经理。

李永梅,博士研究生学历,硕士学位,19年证券从业经历。1999年7月至2014年2月就职于中国证监会陕西监管局,历任稽查处副主任科员、主任科员、行政办公室副主任、稽查二处副处长等;2014年2月至2014年12月就职于中国证监会上海专员办,任副处长;2015年1月至2015年2月就职于上海申乐实业控股集团有限公司,任副总经理;2015年2月至2016年3月就职于嘉合基金管理有限公司,2015年7月起任公司督察长;2016年3月加入国泰基金管理有限公司,担任公司督察长。

4、本基金基金经理

吴晨,硕士研究生,CFA,FRM,16年证券基金从业经历。2001年6月加入国泰基金管理有限公司,历任股票交易员、债券交易员;2004年9月至2005年10月,英国城市大学卡斯商学院金融系学习;2005年10月至2008年3月在国泰基金管理有限公司任基金经理助理;2008年4月至2009年3月在长信基金管理有限公司从事债券研究;2009年4月至2010年3月在国泰基金管理有限公司任投资经理。2010年4月起任国泰金龙债券证券投资基金的基金经理,2010年9月至2011年11月任国泰金鹿保本增值混合证券投资基金的基金经理,2011年12月起任国泰信用互利分级债券型证券投资基金的基金经理,2012年9月至2013年11月任国泰6个月短期理财债券型证券投资基金的基金经理,2013年10月起兼任国泰双利债券证券投资基金的基金经理,2016年1月起兼任国泰鑫保本混合型证券投资基金的基金经理,2016年1月至2018年12月任国泰新目标收益保本混合型证券投资基金的基金经理,2017年8月至2018年8月任国泰民惠收益定期开放债券型证券投资基金的基金经理,2017年3月至2018年4月任国泰民丰回报定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2017年8月至2018年8月任国泰民安增益定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2017年9月起兼任国泰中国企业信用精选债券型证券投资基金(ODII)的基金经理,2017年11月至2018年9月任国泰安心回报混合型证券投资基金的基金经理,2018年1月起兼任国泰招惠收益定期开放债券型证券投资基金的基金经理,2018年2月至2018年8月任国泰安惠收益定期开放债券型证券投资基金的基金经理,2018年8月起兼任国泰安增益纯债债券型证券投资基金(由国泰民安增益定期开放灵活配置混合型证券投资基金转型而来)的基金经理,2018年9月起兼任国泰瑞和纯债债券型证券投资基金的基金经理,2018年12月起兼任国泰多策略收益灵活配置混合型证券投资基金(由国泰新目标收益保本混合型证券投资基金变更而来)的基金经理。2014年3月至2015年5月任绝对收益投资(事业)部总监助理,2015年5月至2016年1月任绝对收益投资(事业)部副总监,2016年1月至2018年7月任绝对收益投资(事业)部副总监(主持工作),2017年7月起任固收投资总监,2018年7月起任绝对收益投资(事业)部总监。

5、投资决策委员会

本基金管理人设有公司投资决策委员会,其成员在公司高级管理人员、投研部门负责人及业务骨干等相关人员中产生。公司总经理可以推荐上述人员以外的投资管理相关人员担任成员,督察长和运营体系负责人列席公司投资决策委员会会议。公司投资决策委员会主要职责是根据有关法规和基金合同,审议并决策公司投资研究部门提出的公司整体投资策略、基金大类资产配置原则,以及研究相关投资部门提出的重大投资建议等。

投资决策委员会成员组成如下:

主任委员:

周向勇:总经理

委员:

周向勇:总经理

吴晨:固收投资总监、绝对收益投资(事业)部总监

邓时锋:权益投资总监、权益投资(事业)部小组负责人

吴向军:海外投资总监、国际业务部总监

胡松:养老金投资总监、养老金及专户投资(事业)部总监

6、上述成员之间均不存在近亲属或家属关系。

四、基金管理人职责

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、半年度和年度基金报告;

7、计算并公告基金资产净值与基金份额净值,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;

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。

五、基金管理人承诺

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谋取利益;

(4)向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失;

(5)法律法规或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权益;

(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,不按照规定履行职责;

(7)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,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,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;

(8)违反证券交易场所业务规则,利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格,扰乱市场秩序;

(9)贬损同行,以抬高自己;

(10)以不正当手段谋求业务发展;

(11)有悖社会公德,损害证券投资基金人员形象;

(12)在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分;

(13)其他法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。

4、基金管理人承诺严格遵守基金合同的规定,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。

5、基金管理人承诺不从事其他法规规定禁止从事的行为。

六、基金投资承诺

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,且不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。

七、基金管理人内部控制制度

1、内部控制制度概述

基金管理人为防范和化解经营运作中面临的风险,保证经营活动的合法合规和有效开展,制定了一系列组织机制、管理方法、操作程序与控制措施,形成了公司完整的内部控制体系。该内部控制体系涵盖了内部会计控制、风险管理控制和监察稽核制度等公司运营的各个方面,并通过相应的具体业务控制流程来严格实施。

(1)内部风险控制遵循的原则

1)全面性原则:内部风险控制必须覆盖公司所有部门和岗位,渗透各项业务过程和业务环节;

2)独立性原则:公司设立独立的稽核监察部,稽核监察部保持高度的独立性和权威性,负责对公司各部门内部风险控制工作进行稽核和检查;

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)保持与业务发展的同等地位原则:公司的发展必须建立在风险控制制度完善和稳固的基础上,内部风险控制应与公司业务发展放在同等地位上;

5)定性和定量相结合原则:建立完备风险控制指标体系,使风险控制更具客观性和操作性。

(2)内部会计控制制度

公司根据国家有关法律法规和财务会计准则的要求,建立了完善的内部会计控制制度,实现了职责分离和岗位相互制约,确保会计核算的真实、准确、完整,并保证各基金会计核算和公司财务管理的相互独立,保护基金资产的独立、安全。

(3)风险管理控制制度

公司为有效控制管理运营中的风险,建立了一整套完整的风险管理控制制度,其内容由一系列的具体制度构成,主要包括:岗位分离和空间分离制度、投资管理控制制度、信息技术控制、营销业务控制、信息披露制度、资料保全制度和独立的稽核制度、人力资源管理以及相应的业务控制流程等。通过这些控制制度和流程,对公司面临的投资风险和管理风险进行有效的控制。

(4)监察稽核制度

公司实行独立的监察稽核制度,通过对稽核监察部充分授权,对公司执行国家有关法律法规情况、以及公司内部控制制度的遵循情况和有效性进行全面的独立监察稽核,确保公司经营的合法合规性和内部控制的有效性。

2、基金管理人内部控制制度要素

(1)控制环境

公司经过多年的管理实践,建立了良好的控制环境,以保证内部会计控制和管理控制的有效实施,主要包括科学的公司治理结构、合理的组织结构和分级授权、注重诚信并关注风险的道德观和经营理念、独立的监察稽核职能等方面。

1)公司建立并完善了科学的治理结构,目前有独立董事4名。董事会下设提名及资格审查委员会、薪酬委员会、考核委员会等专业委员会,对公司重大经营决策和发展规划进行决策及监督;

2)在组织结构方面,公司设立的执行委员会、投资决策委员会、风险管理委员会等机构分别负责公司经营、基金投资和风险控制等方面的决策和监督职能。同时公司各部门之间有明确的授权分工和风险控制责任,既相互独立,又相互合作和制约,形成了合理的组织结构、决策授权和风险控制体系;

3)公司一贯坚持诚信为投资人服务的道德观和稳健经营的管理理念。在员工中加强职业道德教育和风险观念,形成了诚信为本和稳健经营的企业文化;

4)公司稽核监察部拥有对公司任何经营活动进行独立监察稽核的权限,并对公司内部控制措施的实施情况和有效性进行评价和提出改进建议。

(2)控制的性质和范围

1)内部会计控制

公司建立了完善的内部会计控制,保证基金核算和公司财务核算的独立性、全面性、真实性和及时性。

首先,公司根据国家有关法律法规、有关会计制度和准则,制定了完善的公司财务制度、基金会计制度以及会计业务控制流程,做好基金业务和公司经营的核算工作,真实、完整、准确地记录和反映基金运作情况和公司财务状况。

其次,公司将基金会计和公司财务核算从人员上、空间上和业务活动上严格分开,保证两者相互独立,各基金之间做到独立建账、独立核算,保证基金资产和公司资产之间、以及各基金资产之间的相互独立性。

公司建立了严格的岗位职责分离控制、凭证与记录控制、资产接触控制、独立稽核等制度,确保在基金核算和公司财务管理中做到对资源的有效控制、有关功能的相互分离和各岗位的相互监督等。

另外公司还建立了严格的财务管理制度,执行严格的预算管理和财务费用审批制度,加强成本控制和监督。

2)风险管理控制

公司在经营管理中建立了有效的风险管理控制体系,主要包括:

岗位分离和空间隔离制度:为保证各部门的相对独立性,公司建立了明确的岗位分离制度;同时实行空间隔离制度,建立防火墙,充分保证信息的隔离和保密;

投资管理业务控制:通过建立完整的研究业务控制、投资决策控制、交易业务控制,完善投资决策委员会的投资决策职能和风险管理委员会的风险控制职能,实行投资总监和基金经理分级授权制度和股票池制度,进行集中交易,以及风险管理部对投资交易实时监控等,加强投资管理控制,做到研究、投资、交易、风险控制的相互独立、相互制约和相互配合,有效控制操作风险;建立了科学先进的投资风险量化评估和管理体系,控制投资业务中面临的市场风险、集中风险、流动性风险等;建立了科学合理的投资业绩绩效评估体系,对投资管理的风险和业绩进行及时评估和反馈;

信息技术控制:为保证信息技术系统的安全稳定,公司在硬件设备运行维护、软件采购维护、网络安全、数据库管理、危机处理机制等方面均制定实施了完善的制度和控制流程;

营销业务控制:公司制定了完善的市场营销、客户开发和客户服务制度,以保证在营销业务中对有关法律法规的遵守,以及对经营风险的有效控制;

信息披露控制和资料保全制度:公司制定了规范的信息披露管理办法,保证信息披露的及时、准确和完整;在资料保全方面,建立了完善的信息资料保全备份系统,以及完整的会计、统计和各种业务资料档案;

独立的监察稽核制度:稽核监察部有权对公司各业务部门工作进行稽核检查,并保证稽核的独立性和客观性。

3)内部控制制度的实施

公司风险管理委员会首先从总体上制定了公司风险控制制度,对公司面临的主要风险进行辨识和评估,制定了风险控制原则。在风险管理委员会总体方针指导下,各部门根据各自业务特点,对业务活动中存在的风险点进行了揭示和梳理,有针对性地建立了详细的风险控制流程,并在实际业务中加以控制。

(3)内部控制制度实施情况检查

公司稽核监察部在进行风险评估的基础上,对公司各业务活动中内部控制措施的实施情况进行定期和不定期的监察稽核,重点是业务活动中风险暴露程度较高的环节,以确保公司经营合法合规、以及内部控制制度的有效遵循。

在确保现有内部控制制度实施情况的基础上,公司会根据新业务开展和市场变化情况,对内部控制制度进行及时的更新和调整,以适应公司经营活动的变化。公司稽核监察部在对内部控制制度的执行情况进行监察稽核的基础上,也会重点对内部控制制度的有效性进行评估,并提出相应改进建议。

(4)内部控制制度实施情况的报告

公司建立了有效的内部控制制度实施报告流程,各部门对于内部控制制度实施过程中出现的失效情况须及时向公司高级管理层和稽核监察部报告,使公司高级管理层和稽核监察部及时了解内部控制出现的问题并作出妥善处理。

稽核监察部在对内部控制实施情况的监察中,对发现的问题均立即向公司高级管理层报告,并提出相应的建议,对于重大问题,则通过督察长及时向公司董事长和中国证监会报告。同时稽核监察部定期出具独立的监察稽核报告,直接报公司董事长和中国证监会。

3、基金管理人内部控制制度声明书

基金管理人保证以上关于内部控制制度的披露真实、准确,并承诺基金管理人将根据市场变化和业务发展不断完善内部控制制度,切实维护基金份额持有人的合法权益。

第四部分 基金托管人

一、基本情况

名称:中国银行股份有限公司(简称“中国银行”)
住所及办公地址:北京市西城区复兴门内大街1号
首次注册登记日期:1983年10月31日
注册资本:人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整
法定代表人:陈四清
基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字【1998】24号
托管部门信息披露联系人:王永民
传真:(010)66594942
中国银行客服电话:95566
二、基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于1998年,现有员工110余人,大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验,且具有海外工作、学习或培训经历,60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务,中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

(下转A14版)

国泰基金管理有限公司国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同

基金管理人:国泰基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司

第一部分 前言

一、订立本基金合同的目的、依据和原则

1、订立本基金合同的目的是保护投资人合法权益,明确基金合同当事人的权利义务,规范基金运作。

2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》(以下简称“《合同法》”)、《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》”)、《公开募集证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称“《流动性风险管理规定》”)和其他有关法律法规。

3、订立本基金合同的原则是平等自愿、诚实信用、充分保护投资人合法权益。

二、基金合同是规定基金合同当事人之间权利义务关系的基本法律文件,其他与基金相关的涉及基金合同当事人之间权利义务关系的任何文件或表述,如与基金合同有冲突,均以基金合同为准。基金合同当事人按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。

基金合同的当事人包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人。基金投资人自依本基金合同取得基金份额,即成为基金份额