大成中债1-3年国开行债券指数证券投资基金更新招募说明书

基金管理人:大成基金管理有限公司
基金托管人:上海银行股份有限公司
二〇二〇年三月
重 要 提 示

大成中债1-3年国开行债券指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证监会2019年9月2日证监许可【2019】1609号文予以注册。本基金的基金合同于2019年9月26日正式生效。

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,并不表明中国证监会对本基金的投资价值和市场前景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,基金资产净值会因为证券市场波动等因素产生波动,投资人根据所持有的基金份额享受基金收益,同时承担相应的投资风险。本基金投资中的风险包括但不限于:标的指数回报与债券市场平均回报偏离的风险、标的指数波动的风险、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险、标的指数变更的风险、流动性风险、市场风险、合规性风险、管理风险与操作风险等。本基金为债券型基金,其预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份券及备选成份券,具有与标的指数相似的风险收益特征。

投资有风险,投资人在投资本基金之前,请仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同等信息披露文件,全面认识本基金的风险收益特征和产品特性,并充分考虑自身的风险承受能力,自主判断基金的投资价值,理性判断市场,自主、谨慎做出投资决策,并自行承担投资风险。

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,由投资人自行负担。

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、基金产品资料概要等信息披露文件,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。

本基金单一投资者持有的基金份额不得达到或超过基金份额总额的20%,但在基金运作过程中因份额赎回等情形被动达到或超过20%的除外。法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

本基金主要投资于政策性金融债,可能面临政策性银行改制后的信用风险、政策性金融债流动性风险和投资集中度风险等。

本基金本次更新招募说明书仅对基金经理相关信息进行了更新,基金经理相关信息更新截止日为2020年3月13日。

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》)、《公开募集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》”)、其他有关规定及《大成中债1-3年国开行债券指数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《大成中债1-3年国开行债券指数证券投资基金基金合同》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。投资者取得依基金合同所发行的基金份额,即成为基金份额持有人和本基金基金合同的当事人,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》、《运作办法》、《信息披露办法》、《销售办法》、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《大成中债1-3年国开行债券指数证券投资基金基金合同》。

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:指大成中债1-3年国开行债券指数证券投资基金

2、基金管理人:指大成基金管理有限公司

3、基金托管人:指上海银行股份有限公司

4、基金合同:指《大成中债1-3年国开行债券指数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《大成中债1-3年国开行债券指数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《大成中债1-3年国开行债券指数证券投资基金招募说明书》及其更新

7、基金份额发售公告:指《大成中债1-3年国开行债券指数证券投资基金基金份额发售公告》

8、基金产品资料概要:指《大成中债1-3年国开行债券指数证券投资基金产品资料概要》及其更新

9、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

10、《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,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,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》修正的《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

11、《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

12、《信息披露办法》:指中国证监会2019年7月26日颁布、同年9月1日实施的《公开募集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

13、《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

14、《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

15、中国证监会:指中国证券监督管理委员会

16、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

17、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

18、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

19、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

20、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

21、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境内证券投资的境外法人

22、投资人、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

23、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

24、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。

25、销售机构:指大成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

26、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

27、登记机构:指办理登记业务的机构。基金的登记机构为大成基金管理有限公司或接受大成基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构

28、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

29、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、赎回等业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户

30、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

31、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

32、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

33、存续期:指基金合同生效至终止之间的不定期期限

34、工作日:指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

35、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

36、T+n日:指自T日起第n个工作日(不包含T日)

37、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

38、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

39、《业务规则》:指《大成基金管理有限公司开放式基金注册登记业务规则》,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

40、认购:指在基金募集期内,投资人申请购买基金份额的行为

41、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

42、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

43、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

44、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

45、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

46、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%

47、元:指人民币元

48、基金收益:指基金投资所得债券利息、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

49、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

50、基金资产净值:指基金资产总值减去基金负债后的价值

51、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

52、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

53、指定媒介:指中国证监会指定的用以进行信息披露的全国性报刊及指定互联网网站(包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站)等媒介

54、销售服务费:指从基金财产中计提的,用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务的费用

55、基金份额类别:指本基金根据是否收取认购/申购费、销售服务费的不同,将基金份额分为不同的类别。在认购/申购时收取认购/申购费用,且不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为A 类基金份额;不收取认购/申购费,但从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为C类基金份额

56、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

57、摆动定价机制:指当开放式基金遭遇大额申购赎回时,通过调整基金份额净值的方式,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,确保投资人的合法权益不受损害并得到公平对待

58、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。

59、标的指数:指中债金融估值中心有限公司编制并发布的中债-1-3年国开行债券指数及其未来可能发生的变更,或基金管理人按照基金合同约定更换的其他指数

三、基金管理人

(一)基金管理人概况

名称:大成基金管理有限公司
住所:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层
办公地址:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层
设立日期:1999年4月12日
注册资本:贰亿元人民币
股权结构:公司股东为中泰信托有限责任公司(持股比例50%)、中国银河投资管理有限公司(持股比例25%)、光大证券股份有限公司(持股比例25%)三家公司。
法定代表人:吴庆斌
电话:0755-83183388
传真:0755-83199588
联系人:肖剑

(二)主要人员情况

1. 董事会成员:

吴庆斌先生,董事长,清华大学法学及工学双学士。先后任职于西南证券飞虎网、北京国际信托有限责任公司、广联(南宁)投资股份有限公司等机构。2012年7月至今,任广联(南宁)投资股份有限公司董事长;2012年任职于中泰信托有限责任公司,2013年6月至今,任中泰信托有限责任公司董事长。2019年11月3日起任大成基金管理有限公司董事长。

翟斌先生,副董事长,北京大学经济学硕士。曾在深圳市建材集团、君安证券、新华信托、招商证券股份有限公司等多家机构任职,2017年8月加入光大证券股份有限公司,历任机构业务总部董事总经理、机构业务总部总经理兼私募业务部总经理,现任光大证券股份有限公司机构业务总部总经理。2019年11月3日起任大成基金管理有限公司副董事长。

谭晓冈先生,董事、总经理,哈佛大学公共管理硕士。曾在财政部、世界银行、全国社保基金理事会任职。2016年7月加入大成基金管理有限公司,2016年12月至2019年8月任大成国际资产管理有限公司总经理, 2017年2月至2019年6月任大成基金管理有限公司副总经理,2019年7月起任大成基金管理有限公司总经理,2019年8月起任大成国际资产管理有限公司董事长。

李超女士,董事,华中科技大学管理学学士。2007年6月至2008年5月,任职于深圳晨星咨询有限责任公司;2008年7月至2011年8月, 任德勤华永会计师事务所高级审计员;2011年8月至2018年5月, 任平安信托有限责任公司稽核监察部模型团队团队经理;2018年5月至今, 任中泰信托有限责任公司稽核审计部总经理。

郭向东先生,董事,中国人民大学金融学在职研究生。1996年至1998年在中国新技术创业投资公司负责法律事务;1998年至2000年在中国华融信托投资公司负责法律事务;2000年至2006年任职于中国银河证券有限责任公司法律部;2007年1月加入中国银河投资管理有限公司, 任职于负债处置部;2007年7月至2013年2月,历任人力资源部负责人、风险控制部总经理、监事会办公室主任、审计部负责人, 曾兼任北京银河吉星创业投资有限责任公司监事;2013年2月起任资产管理部总经理兼行政负责人。

杨晓帆先生,独立董事,香港浸会大学工商管理学士。2006年至2011年,任惠理集团有限公司高级投资分析师兼投资组合经理;2012年至2016年,任FALCON EDGE CAPITAL LP 合伙人和大中华区负责人;2016年至今,任晨曦投资管理公司(ANATOLE INVESTMENT MANAGEMENT) 主要创始人。

胡维翊先生,独立董事,波士顿大学国际银行与金融法硕士。1991年7月至1994年4月, 任全国人大常委会办公厅研究室政治组主任科员;1994年5月至1998年8月,任北京乾坤律师事务所合伙人;2000年2月至2001年4月任北京市中凯律师事务所律师;2001年5月至今,历任北京市天铎律师事务所副主任、主任,现任北京市天铎律师事务所合伙人。

金李先生,独立董事,美国麻省理工学院金融学博士。现任北京大学光华管理学院副院长,九三学社中央常委,全国政协委员,经济委员会委员。曾在美国哈佛大学商学院任教十多年, 并兼任哈佛大学费正清东亚研究中心执行理事。

黄隽女士,独立董事,中国人民大学经济学博士。现任中国人民大学应用经济学院教授、副院长。研究方向为货币政策、商议银行理论与政策、艺术品金融,出版多本专著,在经济、金融类学术核心期刊上发票多篇学术论文,具有丰富的教学和科研经验。

2. 监事会成员

许国平先生,监事会主席,中国人民大学国民经济学博士。1987年至2004年先后任中国人民银行国际司处长,东京代表处代表,研究局调研员,金融稳定局体改处处长;2005年6月至2008年1月任中央汇金投资有限责任公司建行股权管理部主任;2005年8月至2016年11月任中国银河金融控股有限责任公司董事、副总经理、党委委员;2007年2月至2016年11月任中国银河投资管理有限公司董事长、总裁、党委书记;2010年6月至2014年3月兼任北京银河吉星创业投资有限责任公司董事长;2007年1月至2015年6月任中国银河证券股份有限公司董事;2014年1月至2017年6月任银河基金管理有限公司党委书记;2014年3月至2018年1月任银河基金管理有限公司董事长(至2017年11月)及法定代表人;2018年3月加入大成基金管理有限公司,任监事会主席。

邓金煌先生,职工监事,上海财经大学管理学硕士。2001年9月至2003年9月任职于株洲电力局;2003年9月至2006年1月攻读硕士学位;2006年4月至2010年5月任华为三康技术有限公司人力资源专员;2010年5月至2011年9月任招商证券人力资源部高级经理;2011年9月至2016年8月任融通基金管理有限公司综合管理部总监助理;2016年8月加入大成基金管理有限公司, 任人力资源部副总监;现任大成基金管理有限公司人力资源部总监。

陈焓女士,职工监事,吉林大学法学硕士。2005年8月至2008年3月任金杜律师事务所深圳分所公司证券部律师;2008年3月加入大成基金管理有限公司,历任监察稽核部律师、总监助理;现任大成基金管理有限公司监察稽核部副总监。

3. 高级管理人员情况

吴庆斌先生,董事长。简历同上。

谭晓冈先生,总经理。简历同上。

肖剑先生,副总经理,哈佛大学公共管理硕士。曾任深圳市南山区委(政府)办公室副主任,深圳市广聚能源股份有限公司副总经理兼广聚投资控股公司执行董事、总经理,深圳市人民政府国有资产监督管理委员会副处长、处长。2014年11月加入大成基金管理有限公司,2015年1月起任公司副总经理,2019年8月起任大成国际资产管理有限公司总经理。

温智敏先生, 副总经理, 哈佛大学法学博士。曾任职于美国Hunton & Williams国际律师事务所纽约州执业律师。中银国际投行业务副总裁,香港三山投资公司董事总经理, 标准银行亚洲有限公司董事总经理兼中国投行业务主管。2015年4月加入大成基金管理有限公司,任首席战略官,2015年8月起任公司副总经理。

周立新先生,副总经理兼首席信息官,中央党校经济管理本科。曾任新疆精河县党委办公室机要员、新疆精河县团委副书记、新疆精河县人民政府体改委副主任、新疆精河县八家户农场党委书记、新疆博尔塔拉蒙古自治州团委副书记及少工委主任、江苏省铁路发展股份有限公司办公室主任、江苏省铁路发展股份有限公司投股企业及江苏省铁路实业集团有限公司控股企业负责人、中国华闻投资控股有限公司燃气战略管理部项目经理。2005年1月加入大成基金管理有限公司,历任客户服务中心总监助理、市场部副总经理、上海分公司副总经理、客户服务部总监兼上海分公司总经理、公司助理总经理,2015年8月起任公司副总经理,2019年5月起兼任首席信息官。

姚余栋先生,副总经理,英国剑桥大学经济学博士。曾任职于原国家经贸委企业司、美国花旗银行伦敦分行。曾任世界银行咨询顾问,国际货币基金组织国际资本市场部和非洲部经济学家,原黑龙江省招商局副局长,黑龙江省商务厅副厅长,中国人民银行货币政策二司副巡视员,中国人民银行货币政策司副司长,中国人民银行金融研究所所长。2016年9月加入大成基金管理有限公司,任首席经济学家,2017年2月起任公司副总经理。

赵冰女士,督察长,清华大学工商管理硕士。曾供职于中国证券协会资格管理部、专业联络部、基金公司会员部,曾任中国证券业协会分析师委员会委员、基金销售专业委员会委员。曾参与基金业协会筹备组的筹备工作。曾先后任中国证券投资基金业协会投教与媒体公关部负责人、理财及服务机构部负责人。2017年7月加入大成基金管理有限公司,2017年8月起任公司督察长。

4、本基金基金经理

李富强:经济学硕士。证券从业年限6年。2009年7月至2013年12月任中国银行间市场交易商协会市场创新部高级助理。2014年1月至2017年7月任北信瑞丰基金管理有限公司固定收益部基金经理。2017年7月加入大成基金管理有限公司,任职于固定收益总部。2018年7月16日至2019年3月9日任大成强化收益定期开放债券型证券投资基金基金经理。2018年7月16日至2019年3月2日任大成景利混合型证券投资基金基金经理。2018年7月16日起任大成可转债增强债券型证券投资基金、大成景盛一年定期开放债券型证券投资基金、大成月月盈短期理财债券型证券投资基金基金经理。2018年7月16日至2020年3月11日任大成景益平稳收益混合型证券投资基金基金经理。2018年7月16日至2019年9月29日任大成景丰债券型证券投资基金(LOF)基金经理。2018年11月16日起任大成景禄灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2019年6月12日起任大成景润灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2019年9月26日起任大成中债1-3年国开行债券指数证券投资基金基金经理。2019年11月25日起任大成通惠三年定期开放债券型证券投资基金基金经理。2019年12月9日起任大成惠嘉一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍:中国

汪伟:金融学硕士。证券从业年限6年。曾担任广州证券资产管理部债券投资经理、金鹰基金集中交易部交易主管、广东南粤银行金融市场部债券投资经理、金鹰基金固定收益部基金经理。2019年5月加入大成基金管理有限公司,任职于固定收益总部。2019年9月12日起任大成惠福纯债债券型证券投资基金、大成景盈债券型证券投资基金基金经理。2019年10月15日起任大成中债1-3年国开行债券指数证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍:中国

方孝成:经济学硕士。证券从业年限14年。2000年7月至2001年12月任新华社参编部编辑。2002年1月至2005年12月任J.D. Power (MacGraw Hill集团成员)市场研究部分析师。2006年1月至2009年1月任大公国际资信评估有限公司金融机构部副总经理。2009年2月至2011年1月任合众人寿保险股份有限公司风险管理部信用评级室主任。2011年2月至2015年9月任合众资产管理股份有限公司固定收益投资部投资经理。2015年9月至2017年7月任光大永明资产管理股份有限公司固定收益投资部执行总经理。2017年7月加入大成基金管理有限公司。2017年11月8日起任大成景旭纯债债券型证券投资基金基金经理。2018年1月23日至2019年9月29日任大成现金增利货币市场基金基金经理。2018年3月23日至2019年9月29日任大成慧成货币市场基金基金经理。2018年8月28日起任大成惠利纯债债券型证券投资基金基金经理。2018年12月27日起任大成惠明定期开放纯债债券型证券投资基金基金经理。2019年6月24日起任大成景盈债券型证券投资基金基金经理。2019年6月27日起任大成中债3-5年国开行债券指数证券投资基金基金经理。2019年7月31日起任大成惠福纯债债券型证券投资基金基金经理。2020年3月11日起任大成中债1-3年国开行债券指数证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍:中国

5、公司投资决策委员会(固定收益)

公司固定收益投资决策委员会由7名成员组成,设固定收益投资决策委员会主席1名,其他委员6名。名单如下:

谭晓冈,公司总经理,固定收益投资决策委员会主席;姚余栋,公司副总经理,固定收益投资决策委员会委员;王立,基金经理,固定收益总部总监,固定收益投资决策委员会委员;谢民,交易管理部副总监,固定收益投资决策委员会委员;陈会荣,基金经理,固定收益投资决策委员会委员;方孝成,基金经理,固定收益投资决策委员会委员;杨艳林,研究员,固定收益投资决策委员会委员。

6、上述人员之间不存在亲属关系。

(三)基金管理人的职责

按照《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金管理人必须履行以下职责:

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和、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、赎回对价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净值信息,确定基金份额申购、赎回对价;

9、进行基金会计核算并编制基金的财务会计报告;

10、编制季度报告、中期报告和年度报告;

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以保密,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,应承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;

21、监督基金托管人按法律法规和基金合同规定履行自己的义务,基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时, 基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿;

22、当基金管理人将其义务委托第三方处理时,应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任;

23、以基金管理人的名义,代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为;

24、执行生效的基金份额持有人大会的决议;

25、建立并保存基金份额持有人名册;

26、法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

(四)基金管理人承诺

1、基金管理人承诺严格遵守《证券法》,并建立健全的内部控制制度,采取有效措施,防止违反《证券法》行为的发生;

2、基金管理人承诺严格遵守《基金法》、《运作办法》,建立健全的内部控制制度,采取有效措施,防止以下《基金法》、《运作办法》禁止的行为发生:

(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)法律法规和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)损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法利益;

(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;

(7)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;

(8)除按本公司制度进行基金投资外,直接或间接进行其他股票交易;

(9)协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易;

(10)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;

(11)故意损害基金投资者及其他同业机构、人员的合法权益;

(12)以不正当手段谋求业务发展;

(13)有悖社会公德,损害证券投资基金人员形象;

(14)信息披露不真实,有误导、欺诈成分;

(15)法律法规和中国证监会禁止的其他行为。

4、本基金管理人将根据基金合同的规定,按照招募说明书列明的投资目标、策略及限制等全权处理本基金的投资。

5、本基金管理人不从事违反《基金法》的行为,并建立健全内部控制制度,采取有效措施,保证基金财产不用于下列投资或者活动:

(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)买卖其他基金份额,但是中国证监会另有规定的除外;

(5)向其基金管理人、基金托管人出资;

(6)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;

(7)法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券,或者从事其他重大关联交易的,应当遵循基金份额持有人利益优先的原则,防范利益冲突,符合国务院证券监督管理机构的规定,并履行信息披露义务。

若法律法规或监管部门取消上述禁止性规定,履行适当程序后,本基金投资可不受上述规定限制。

(五)基金经理的承诺

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及其被代理人、受雇人或任何第三人谋取利益;

3、不违反现行有效的有关法律法规、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;

4、不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

(六)基金管理人的内部控制制度

本基金管理人为加强内部控制,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,依据《证券法》、《证券投资基金公司管理办法》、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》等法律法规,并结合公司实际情况,制定《大成基金管理有限公司内部控制大纲》。

公司内部控制是指公司为防范和化解风险,保证经营许符合公司的发展规划,在充分考虑内外部环境的基础上,通过建立组织机制、运用管理方法、实施操作程序与控制措施而形成的系统。公司建立科学合理、控制严密、运行高效的内部控制体系,制定科学完善的内部控制制度。

公司内部控制制度由内部控制大纲、基本管理制度、部门业务规章等部分组成。

公司董事会对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任,公司管理层对内部控制制度的有效执行承担责任。

1、公司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。

2、公司内部控制遵循以下原则

(1)健全性原则。内部控制涵盖公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员,并包括决策、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、部门和岗位职责的设置保持相对独立,公司基金财产、自有资产与其他资产的运作相互分离。

(4)相互制约原则。公司设置的各部门、各岗位权责分明、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,以合理的成本控制达到最佳的内部控制效果。

3、公司制定内部控制制度遵循以下原则

(1)合法合规性原则。公司内控制度符合国家法律、法规、规章和各项规定。

(2)全面性原则。内部控制制度涵盖公司经营管理的各个环节,不得留有制度上的空白或漏洞。

(3)审慎性原则。制定内部控制制度以审慎经营、防范和化解风险为出发点。

(4)适时性原则。随着有关法律法规的调整和公司经营战略、经营方针、经营理念等内外部环境的变化进行及时的修订或完善内部控制制度。

4、内部控制的基本要素

内部控制的基本要素包括控制环境、风险评估、控制活动、信息沟通和内部监控。

(1)控制环境构成公司内部控制的基础,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)公司管理层牢固树立内控优先和风险管理理念,培养全体员工的风险防范意识,营造一个浓厚的内控文化氛围,保证全体员工及时了解国家法律法规和公司规章制度,使风险意识贯穿到公司各个部门、各个岗位和各个环节。

(3)健全公司法人治理结构,充分发挥独立董事和监事会的监督职能,禁止不正当关联交易、利益输送和内部人控制现象的发生,保护投资者利益和公司合法权益。

(4)公司的组织结构体现职责明确、相互制约的原则,各部门有明确的授权分工,操作相互独立。公司建立决策科学、运营规范、管理高效的运行机制,包括民主、透明的决策程序和管理议事规则,高效、严谨的业务执行系统,以及健全、有效的内部监督和反馈系统。

(5)依据公司自身经营特点设立顺序递进、权责统一、严密有效的内控防线:

1)各岗位职责明确,有详细的岗位说明书和业务流程,各岗位人员在上岗前均应知悉并以书面方式承诺遵守,在授权范围内承担责任。

2)建立重要业务处理凭据传递和信息沟通制度,相关部门和岗位之间相互监督制衡。

3)公司督察长和内部监察稽核部门独立于其他部门,对内部控制制度的执行情况实行严格的检查和反馈。

4)风险管理部主要负责对投资组合的市场风险、流动性风险和信用风险等进行风险测量,并提出风险调整的建议;对投资业绩进行评价,包括整体表现分析、业绩构成分析以及业绩短期和长期持续性检验;对将要展开的新业务和创新性产品的投资做全面的风险评估,提出风险预警等工作。

(6)建立有效的人力资源管理制度,健全激励约束机制,确保公司各级人员具备与其岗位要求相适应的职业操守和专业胜任能力。

(7)建立科学严密的风险评估体系,对公司内外部风险进行识别、评估和分析,及时防范和化解风险。

(8)建立严谨、有效的授权管理制度,授权控制贯穿于公司经营活动的始终。

1)确保股东会、董事会、监事会和管理层充分了解和履行各自的职权,建立健全公司授权标准和程序,保证授权制度的贯彻执行。

2)公司各业务部门、分支机构和各级人员在规定授权范围内行使相应的职责。

3)公司重大业务的授权采取书面形式,明确授权书的授权内容和时效。

4)公司适当授权,建立授权评价和反馈机制,包括已获授权的部门和人员的反馈和评价,对已不适用的授权及时修订或取消授权。

(9)建立完善的资产分离制度,公司资产与基金财产、不同基金的资产之间和其他委托资产,实行独立运作,分别核算。

(10)建立科学、严格的岗位分离制度,明确划分各岗位职责,投资和交易、交易和清算、基金会计和公司会计等重要岗位不得有人员的重叠。重要业务部门和岗位进行物理隔离。

(11)制订切实有效的应急应变措施,建立危机处理机制和程序。

(12)维护信息沟通渠道的畅通,建立清晰的报告系统。

(13)建立有效的内部监控制度,设置督察长和独立的监察稽核部门,对公司内部控制制度的执行情况进行持续的监督,保证内部控制制度落实。公司定期评价内部控制的有效性,并根据市场环境、新的金融工具、新的技术应用和新的法律法规等情况进行适时改进。

5、内部控制的主要内容

(1)公司自觉遵守国家有关法律法规,按照投资管理业务的性质和特点严格制定管理规章、操作流程和岗位手册,明确揭示不同业务可能存在的风险点并采取控制措施。

(2)研究业务控制主要内容包括:

1)研究工作保持独立、客观。

2)建立严密的研究工作业务流程,形成科学、有效的研究方法。

3)建立投资对象备选库制度,根据基金合同要求,在充分研究的基础上建立和维护备选库。

4)建立研究与投资的业务交流制度,保持通畅的交流渠道。

5)建立研究报告质量评价体系。

(3)投资决策业务控制主要内容包括:

1)严格遵守法律法规的有关规定,符合基金合同所规定的投资目标、投资范围、投资策略、投资组合和投资限制等要求。

2)健全投资决策授权制度,明确界定投资权限,严格遵守投资限制,防止越权决策。

3)投资决策有充分的投资依据,重要投资有详细的研究报告和风险分析支持,并有决策记录。

4)建立投资风险评估与管理制度,在设定的风险权限额度内进行投资决策。

5)建立科学的投资管理业绩评价体系,包括投资组合情况、是否符合基金产品特征和决策程序、基金绩效归属分析等内容。

(4)基金