(上接A22版)

65、T+n日：指自T日起第n个工作日（不包含T日）

66、开放日：指为基金投资者办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

67、交易时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

68、认购：指在基金募集期间，基金投资者申请购买基金份额的行为

69、申购：指在基金存续期内，基金投资者申请购买基金份额的行为

70、赎回：指在基金存续期内基金份额持有人按基金合同规定的条件要求卖出基金份额的行为

71、可赎回金额：本基金存续期内，基金份额持有人在某一日的可赎回金额为该日其持有的基金份额数与该日基金份额净值计算之积

72、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的公告在本基金份额与基金管理人管理的其他基金份额间的转换行为

73、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变更所持基金份额销售机构的操作

74、巨额赎回：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）超过上一日基金总份额的10%

75、元：指人民币元

76、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

77、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

78、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

79、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的数值

80、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

81、指定媒体：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体

82、不可抗力：指本基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服，且在本基金合同由基金管理人、基金托管人签署之日后发生的，使本基金合同当事人无法全部或部分履行本基金合同的任何事件，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用、没收、法律法规变化、突发停电或其他突发事件、证券交易所非正常暂停或停止交易

三、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：金元比联基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区花园石桥路33号花旗集团大厦36楼3608室，200120

办公地址：上海市浦东新区花园石桥路33号花旗集团大厦36楼，200120

设立日期：2006年11月13日

法定代表人：任开宇

联系人：李晓琳

电话：（021）68881801

注册资本：人民币1.5亿元

金元比联基金管理有限公司经中国证监会证监基金字〔2006〕222号文批准设立，公司的股权结构如下：

股东名称	股权比例
金元证券股份有限公司	51%
比利时联合资产管理有限公司	49%

本基金管理人公司治理结构完善，经营运作规范，能够切实维护基金投资者的利益。股东会为公司权力机构，由全体股东组成，决定公司的经营方针以及选举和更换董事、监事等事宜。公司章程中明确公司股东通过股东会依法行使权利，不以任何形式直接或者间接干预公司的经营管理和基金资产的投资运作。

董事会为公司的执行机构，对股东会负责，并向股东会汇报。公司董事会由7名董事组成，其中3名为独立董事。根据公司章程的规定，董事会履行《公司法》规定的有关重大事项的决策权，对公司基本制度的制定权和对总经理等经营管理人员的监督和奖惩权。

公司设监事会，由3名监事组成，其中包括1名员工代表监事。监事会向股东会负责，主要负责检查公司财务并监督公司董事、高级管理人员尽职情况。

公司日常经营管理由总经理负责。公司根据经营运作需要设置基金管理部、运营保障部、财务部、市场部、监察稽核部以及人事行政部六个职能部门。此外，公司还设有投资决策委员会、风险管理委员会、合规审核委员会、新产品委员会、资格审查委员会以及薪酬委员会。

（二）主要人员情况

1、董事会成员

任开宇先生，董事，董事长。博士。曾任长春证券有限公司总裁助理，新华证券有限公司监事长，金元证券有限公司投行总监。2008年至今，任金元证券股份有限公司副总裁。

雷俊先生，董事。硕士学位。曾任职于上海宝钢集团，华宝信托投资公司和金元证券有限公司。2005年至今，任首都机场集团公司资本运营部总经理。

Karel Heyndrickx先生，董事。大学毕业，曾任职于比利时Boerenbond集团，ABB保险，KBC保险等公司，2004至2009年任KBC集团组织部门总经理，2009年至今任比利时联合资产管理公司执行董事及执行委员会成员。

Johan Dewolfs先生，董事。大学毕业。曾任职于KBC Bank。2009至今任比利时联合资产管理公司执行董事及执行委员会成员。

彭振兴先生，独立董事。学士学位。曾任香港政府证监处高级主任，香港证监会高级总监，中国证监会规划委委员，2003年至今，任彭振兴顾问有限公司董事。

谢德荪先生，独立董事。博士学位。1975年至今，任美国斯坦福大学金融风控教授。

范剑平先生，独立董事。硕士学位。历任中国人民大学讲师、副教授，国家发改委经济研究所研究员，国家信息中心研究员，经济预测部主任。

2、监事会成员

吴毓锋先生，监事长，硕士学位。曾任海南省国际信托投资公司证券营业部财务经理，历任金元证券股份有限公司财务部业务主管、助理总经理、副总经理和总经理，现任金元证券股份有限公司财务总监。

陈翔女士（Ms. Angie Chan），监事。学士学位。曾任瑞士信贷银行香港分行市场推广部主任，比利时联合银行香港分行副总经理，比利时联合银行台湾区总经理，现任比利时联合资产管理公司亚太区总监。

陈迪鹏先生，员工监事。学士学位。曾任振通证券信息部主管，金元证券电脑总部助理主管工程师，现任金元比联基金管理有限公司信息技术部总监。

3、公司高管人员

任开宇先生，董事长，简历同上。

张嘉宾先生，总经理，兼任投资决策委员会主席，工商管理硕士。曾任深业美国公司（纽泽西）副总裁，瑞银华宝（纽约）业务经理，富国基金管理有限公司总经理助理、市场总监，信诚基金管理有限公司副总经理、首席市场官，中国光大资产管理有限公司（香港）首席运营官，民生加银基金管理有限公司总经理，现任金元比联基金管理有限公司总经理。

符刃先生，督察长，硕士学位。曾任海南国信资产管理公司总经理助理，香港海信投资有限公司总经理，历任金元证券有限公司基金筹备组负责人，现任金元比联基金管理有限公司督察长。

陈凯先生，市场总监，硕士学位。曾任上海国际期货苏州营业部交易员、交易主管、研究员、总经理，嘉实基金管理有限公司渠道经理，国联安基金管理有限公司部门总监，现任金元比联基金管理有限公司市场总监。

邝晓星先生，财务总监，代运营总监职务，学士学位。曾任海南省国际信托投资公司上海宜山路证券营业部总经理，金元证券有限责任公司上海宜山路证券营业部总经理，金元证券有限责任公司财务总部经理助理，历任金元证券有限责任公司基金筹备组成员，现任金元比联基金管理有限公司财务总监，代运营总监职务。

4、本基金拟任基金经理

李飞先生，基金经理，CFA，加拿大西蒙弗雷泽大学经济学硕士。曾任国盛证券信券分析员。2006年6月加入金元比联基金管理有限公司，历任宏观经济及债券研究员，高级宏观经济及债券研究员，金元比联丰利债券型证券投资基金的基金经理助理，现任金元比联丰利债券型证券投资基金的基金经理。8年证券、基金等金融行业从业经历，具有基金从业资格。

5、投资决策委员会成员

张嘉宾先生，总经理，兼任投资决策委员会主席，简历同上。

吴广利先生，基金经理，上海交通大学工学学士，北京大学经济学硕士。曾任海通证券研究所研究员、长江巴黎百富勤研究部研究经理。2006年7月加入金元比联基金管理有限公司，历任行业研究员、首席行业研究员兼金元比联宝石动力保本混合型证券投资基金基金经理助理，金元比联成长动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理，现任金元比联成长动力灵活配置混合型证券投资基金和金元比联核心动力股票型证券投资基金的基金经理。9年证券、基金等金融行业从业经历，具有基金从业资格。

李飞先生，基金经理，简历同上。

黄奕士先生，基金经理，南京大学经济学学士，香港大学工商管理硕士。曾任苏物贸证券（现东吴证券）证券分析师，国泰君安证券股份有限公司证券分析师，广发证券股份有限公司研究员、投行业务经理。2008年7月加入金元比联基金管理有限公司，历任高级行业研究员、金元比联宝石动力保本混合型证券投资基金基金经理助理，现任金元比联价值增长股票型证券投资基金和金元比联消费主题股票型证券投资基金的基金经理。16年证券、基金等金融行业从业经历，具有基金从业资格。

夏福陆先生，基金经理，河海大学工学学士，华东师范大学经济学硕士。曾任湘财证券研究员，富邦证券研究员，兴业证券高级行业研究员。2009年12月加入金元比联基金管理有限公司，历任高级行业研究员，金元比联宝石动力混合型证券投资基金的基金经理助理和金元比联丰利债券型证券投资基金的基金经理助理，现任金元比联宝石动力混合型证券投资基金的基金经理。6年证券、基金等金融行业从业经历，具有基金从业资格。

侯斌女士，基金经理，上海财经大学经济学学士。曾任光大保德信基金管理有限公司行业研究员。2010年6月加入金元比联基金管理有限公司，历任高级行业研究员，金元比联成长动力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理和金元比联核心动力股票型证券投资基金的基金经理助理，现任金元比联成长动力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。9年基金等金融行业从业经历，具有基金从业资格。

何贤女士，基金经理，上海理工大学管理学学士，英国兰卡斯特大学理学硕士。曾任万家基金管理有限公司行业研究员。2006年5月加入金元比联基金管理有限公司，历任行业研究员、高级行业研究员，金元比联价值增长股票型证券投资基金的基金经理助理，现任金元比联价值增长股票型证券投资基金的基金经理。8年证券、基金等金融行业从业经历，具有基金从业资格。

6、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，办理或者委托经国务院证券监督管理机构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、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、编制中期和年度基金报告；

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15年以上；

11、严格遵守《基金合同》中有关保本和保本条款的约定。第一个保本周期的保本周期到期日若发生需要保本赔付的情形，基金管理人应向基金份额持有人履行保本差额的支付义务；基金管理人不能全额履行保本赔付差额支付义务的，基金管理人应于保本周期到期日后5个工作日内向担保人发出裁明需担保人代偿金额的《履行保证责任通知书》，要求担保人在接到《履行保证责任通知书》及相关数据资料后5个工作日内将需代偿的金额划入基金管理人在基金托管人处开立的指定账户中。基金管理人应在保本周期到期日后20个工作日内（包含第20个工作日）将保本赔付差额支付给基金份额持有人。

自第二个保本周期起的后续各保本周期的保本周期到期日若发生需要保本赔付的情形，基金管理人应按届时签定的《保证合同》或《风险买断合同》的相关约定履行相应义务；

12、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；

13、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《证券法》、《基金法》及其他法律法规的行为，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）不公平地对待公司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）违法违规以及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）滥权或违规经营；

（2）违反法律法规、基金合同或托管协议；

（3）故意损害基金份额持有人或本基金合同其他当事人的合法权益；

（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；

（7）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；

（8）违反证券交易所业务规则，扰乱市场秩序；

（9）在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；

（10）其他法律、法规及中国证监会禁止的行为。

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）不得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；

（4）不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

（五）基金管理人的内部控制制度

1、内部控制的原则

（1）健全性原则。内部控制应当包括公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员，并涵盖到决策、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、部门和岗位职责应当保持相对独立，公司基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离。

（4）相互制约原则。公司内部部门和岗位的设置应当权责分明、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，以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

2、内部控制的主要内容

（1）控制环境

公司建立健全的法人治理结构，充分发挥独立董事和监事会的监督职能，严禁不正当关联交易、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。

公司管理层树立内控优先的风险管理理念，培养全体员工的风险防范意识，建立风险控制优先、风险控制人人有责、一线人员第一责任的公司内控文化，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。

公司建立决策科学、运营规范、管理高效的运行机制，确保公司各项决策、决议的执行中，“四眼”原则贯穿全程。各部门及岗位有明确的授权分工、工作职责和业务流程，通过重要凭据传递及信息沟通制度，实现相关部门、相关岗位之间的监督制衡。

公司建立有效的人力资源管理制度，健全激励约束机制。通过法律法规培训、制度教育、执业操守教育和行为准则教育等，确保公司人员了解与从业有关的法规与监管部门规定，熟知公司相关规章制度、岗位职责与操作流程，具备与岗位要求相适应的操守和专业胜任能力。

（2）风险评估

公司建立科学严密的风险评估体系，对公司的业务风险、人员风险、法律风险和财务风险等进行识别、评估和分析，及时防范和化解风险。通过科学的风险量化技术和严格的风险聚额控制对投资风险实现定量分析和管理。通过收集与投资组合相关的会计和市场数据，建立一个投资风险测评与绩效评估的信息技术平台。由监察稽核部定期向投资决策委员会和风险管理委员会提交风险测评报告。

（3）内控机制

公司全部的经营管理决策，均按照明确成文的决策程序与规定进行，防止超越或违反决策程序的随意决策行为的发生。

操作层面上，公司依据自身经营特点，以各岗位目标责任制为基础形成第一道内控防线，以相关部门、相关岗位之间相互监督制衡形成第二道内控防线，以监察稽核部、风险管理委员会、督察长对公司各机构、各部门、各岗位、各项业务全面实施监督反馈形成第三道内控防线，并建立内部违规违章行为的处罚机制。同时，按照分级管理、规范操作、有限授权、业务眼踪的原则，制定公司授权管理制度，并严格区分业务授权与管理授权。

（4）信息与沟通

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，保证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，保证信息及时送达适当的人员进行处理。

（5）监督与内部稽核

本公司设立了独立于各业务部门的监察稽核部，其中监察稽核人员履行内部稽核职能，检查、评价公司内部控制制度合理性、完备性和有效性，监督公司内部控制制度的执行情况，揭示公司内部管理及基金运作中的相关风险，及时提出改进意见，促进公司内部管理制度有效地执行。监察稽核人员具有相对的独立性，定期不定期出具监察稽核报告。

3、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变化及公司的发展不断完善内部控制制度。

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：项俊波

成立时间：2009年1月15日

注册资本：32,479,411.7万元人民币

存续期间：持续经营

组织形式：股份有限公司

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基金字〔1998〕23号

联系电话：010-63201510

传真：010-63201816

联系人：李芳菲

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。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，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。

（二）主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工130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。

（三）基金托管业务经营情况

截止2011年6月9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100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、裕阳证券投资基金、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型证券投资基金、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、金元比联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、信诚利丰债券型证券投资基金、金元比联丰利债券型证券投资基金、交银施罗德先锋股票型证券投资基金、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指数证券投资基金（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、工银瑞信中小盘成长股票型证券投资基金、东吴货币市场证券投资基金、博时创业成长股票型证券投资基金、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、兴业沪深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、益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、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、招商安赢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、新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。

（四）基金托管人的内部控制制度

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。

（五）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，同时记录工作日志。

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，请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。

五、相关服务机构

（一）直销机构

金元比联基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区花园石桥路33号花旗集团大厦3608室

办公地址：上海市浦东新区花园石桥路33号花旗集团大厦3608室

法定代表人：任开宇

电话：021-68882809

传真：021-68882865

联系人：孙筱君

客户服务专线：400-666-0666，021-61601898

网址：www.jyklbc.com

（二）代销机构

1、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：项俊波

客户服务电话：95599

公司网址：www.abchina.com

电话：010-68424199

联系人：李芳菲

2、上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区浦东南路500号

办公地址：上海市中山东一路12号

法定代表人：吉晓辉

电话：（021）61618888

传真：（021）63602431

联系人：徐伟、虞谷云

客户服务热线：95528

公司网站：www.spdb.com.cn

3、深圳发展银行股份有限公司

住所：广东省深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦

办公地址：广东省深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦

法定代表人：肖遂宁

电话：（0755）82088888

联系人：张青

客服电话：95501

公司网站：www.sdb.com.cn

4、中国民生银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街2号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街2号

法定代表人：董文标

电话：010-57092615

传真：010-57092611

联系人：崔云婉

客户服务热线：95568

公司网站：www.cmbc.com.cn

5、华夏银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街22号

法定代表人：吴建

电话：（010）85238422

传真：（010）85238419

联系人：郑鹏

公司网站：www.hxb.com.cn

6、金元证券股份有限公司

注册地址：海南省海口市南宝路36号证券大厦4层

办公地址：深圳市深南大道4001 时代金融中心大厦17楼

法定代表人：陆涛

联系电话：（0755）83025022

传真：（0755）83025625

联系人：马贤清

客户服务热线：4008-888-228

公司网址：www.jyzq.cn

7、国泰君安证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区商城路618号

法定代表人：万建华

电话：021-38676666

传真：021-38670666

服务热线：4008888666

联系人：芮敏祺

网址：www.gtja.com

8、中信建投证券有限责任公司

注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼

法定代表人：张佑君

办公地址：北京市朝阳门内大街188号

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

9、招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38—45层

法定代表人：宫少林

电话：0755-82943666

传真：0755-82943636

联系人：黄健

客户服务热线：95565、4008888111

网址：www.newone.com.cn

10、广发证券股份有限公司

注册地址：广东省珠海市吉大海滨路光大国际贸易中心26楼2611室

办公地址：广州市天河北路183号大都会广场36、38、41、42楼

法定代表人：王志伟

电话：（020）87555888

传真：（020）87557987

联系人：肖中梅

网址：www.gf.com.cn

11、中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦第A层

法定代表人：王东明

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦

联系人：陈忠

电话：010-60833722

传真：010-60833739

公司网站：www.cs.ecitic.com

12、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：顾伟国

客户服务电话：4008-888-888

传真：（010）66568536

联系人：田薇

公司网址：www.chinastock.com.cn

13、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

电话：021-23219000

传真：021- 23219100

联系人：李笑鸣

客服电话：95553或拨打各城市营业网点咨询电话

公司网址：www.htsec.com

14、华泰证券股份有限公司

注册地址：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦

法定代表人：吴万善

联系人：程高峰、万鸣

电话：025-83290979

传真：025-51863323

客服电话：95597

公司网址：www.htsc.com.cn

15、华泰联合证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第五层（01A、02、03、04）、17A、18A、24A、25A、26A

办公地址：深圳市福田中心区中心广场香港中旅大厦第5层、17层、18层、24层、25层、26层

法定代表人：马昭明

联系电话：（0755）82492000

传真：（0755）82492962

联系人：盛宗凌

客户服务查询电话：95513

公司网站：www.lhzq.com

16、申银万国证券股份有限公司

注册地址：上海市常熟路171号

法定代表人：丁国荣

联系电话：（021）54033888

传真：（021）54035333

联系人：胡洁静

网址：www.sywg.com.cn

17、兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路268号

邮政编码：350003

法定代表人：兰荣

注册资金：22亿元人民币

办公地址：浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼21层

邮政编码：200135

客服电话：4008888123

业务联系电话：021-38565785

业务联系人：谢高得

兴业证券公司网站：www.xyzq.com.cn

18、国元证券股份有限公司

注册地址：安徽省合肥市寿春路179号

法定代表人：凤良志

联系电话：0551-2257021

传真：（0551）2272100

联系人：祝丽萍

客户服务咨询电话：95578、400-888-8777

公司网站：www.gyzq.com.cn

19、光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闸路1508号

办公地址：上海市静安区新闸路1508号

法定代表人：徐浩明

客户服务电话：10108998、4008888788

传真：021-22169134

联系人：刘晨

网址：www.ebscn.com

20、广发华福证券有限责任公司

注册地址：福州五四路新天地大厦7、8、10层

法定代表人：黄金琳

客户服务电话：96326（福建省外请先拨0591）

传真：0591-87383610

联系人：张腾

公司网址：www.ghfzq.com.cn

联系人：张萍

客户服务热线：4008-888-228

公司网址：www.jyzq.cn.com

21、信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

法定代表人：高冠江

联系人：唐静

联系电话：010-63081000

传真：010-63080978

客服电话：400-800-8899

公司网址：www.cindasc.com

22、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：胡运钊

客户服务热线：95579或4008-888-999

联系人：李良

电话：027-65799999

传真：027-85481900

长江证券客户服务网站：www.95579.com

23、天相投资顾问有限公司

注册地址：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701

办公地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座4层

（下转A24版）

（上接A22版）

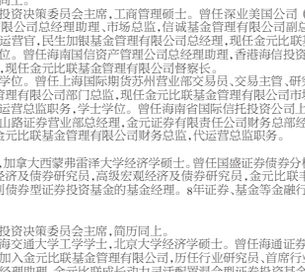
而定，是一个事先给定的参数。二是组合资产与安全底线的差额。用组合保险策略的术语，该参数被称为安全垫（Cushion）。它决定了组合资产的最大止损额。按传统CPPI进行操作时，必须首先决定风险乘数的大小和安全底线。

传统CPPI的缺点基于其两个前提假设：一是给定的乘数所产生的“路径依赖”现象；二是保本资产仅为现金及现金等价物导致市场上流动程中风险暴露增加缓慢问题。针对传统CPPI的上述不足，本基金管理人从如下两个角度对传统CPPI进行了优化处理：

首先，优化CPPI将传统CPPI和基于期权的组合保险策略（Option-Based Portfolio Insurance，下简称“OBPI”）的原理相结合，把标的资产的波动纳入到模型的考虑当中，动态调整风险乘数。模拟表明，动态调整成熟后，优化CPPI可以有效的缓解“路径依赖”现象；其次，在不跌破安全底线的前提下，本保本资产中加入一定比例的债券以替换现金的方式进行改进。

通过动态调整乘数，以及在不跌破安全底线的前提下用债券替换现金，可以迅速增大或减少风险暴露程度，在上升的市场中，通过增大的风险暴露增大股票仓位，从而更好的跟踪上升的行情，为投资者获得更高的收益；在下跌的市场中迅速减少风险暴露，增加现金的部位，从而达到保本的目的。

优化CPPI图示



本基金保本投资配置策略示例：

假设本基金募集规模为20亿元人民币，认购费为1600万元，无风险利率为3.06%，则保本周期到期日的投资组合的最低目标价值为20.16亿元，期初的安全底线为18.417亿元（[illegible]）。本基金运作首日，假定优化CPPI根据市场状况确定当日的风险乘数为2，则本基金将投资3.166亿元（即（20-18.417）×2）于风险资产，剩余16.834亿元（即20-3.166）投资于保本资产。根据优化CPPI，保本资产中，现金为14.169亿元，债券价值为2.665亿元。

假定三个月后《金融时内股票市场（上证）》本基金的保本资产、风险资产于该期间的收益率分为2%、10%，则保本基金的资产17.171亿元（16.834×1.02），风险资产3.483亿元（3.166×1.1），基金资产净值为20.654亿元（17.171+3.483）。此时本基金的安全底线为18.556亿元（[illegible]）。假定优化CPPI确定该日的风险乘数为4，则本基金将投资8.392亿元（即20.654-18.556）×4）于风险资产，12.262亿元于保本资产（即20.654-8.392）。根据优化CPPI，保本资产中，现金为7.28亿元，债券价值4.982亿元。

假设一年后《金融时内股票市场下跌》，本基金保本资产、风险资产于该期间的的收益率分别为5%、-2%，即保本资产为12.875亿元（12.262×1.05），风险资产8.224亿元（8.392×0.98），基金资产净值为21.099亿元（12.875+8.224）。此时的安全底线为18.981亿元（[illegible]）。假定优化CPPI确定该日的风险乘数为3，则本基金投资将投资6.354亿元（21.099-18.981）×3）于风险资产，14.745亿元（21.099-6.354）于保本资产。根据优化CPPI，保本资产中，现金为10.305亿元，债券价值为4.440亿元。

假设一年后，本基金保本周期到期，基金资产净值为24亿元，则保本周期内的累计收益率为20%（为解释优化CPPI目的，本基金管理人假设20%为保本周期内的累计收益率。现实中，本基金各保本周期的累计收益率可能高于20%，也可能低于20%）。

本示例假定无风险利率在模拟期间内是固定的，但实际投资过程中无风险利率是一个变量，本基金将按照实际的市场无风险利率水平运作。

（6）投资策略

本基金按照“优化恒定比例组合保险策略”对股票、债券和现金的投资比例进行动态调整，从而达到防御下跌、参与增值的目的。

本基金的股票投资采取行业配置指导下的个股精选方法，即：首先进行行业投资价值评估，确定拟投资的优势行业；其次进行行业内个股的精选，从质地和估值两个维度精选优质股票构建股票组合。

本基金的债券投资组合以相对低估的债券作为主要投资对象，并通过对债券的信用、久期和凸性等的灵活配置，进行相对积极主动的操作，力争获取超越债券基准的收益。

1）投资策略

本基金在满足流动性及风险监控要求下，通过宏观经济方面自上而下的分析及债券市场方面自下而上的判断，把握市场利率水平的运行态势，根据债券市场收益率曲线的整体运动方向进行债券投资。具体的投资策略主要有：

票息策略

票息策略是指投资于较高票息的债券，通