金鹰中证500指数分级证券投资基金招募说明书

基金管理人：金鹰基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司
二〇一二年四月

【重要提示】

金鹰中证500指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）的募集已获中国证监会2012年2月27日证监许可【2012】247号文批准。

本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核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值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。

本基金管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

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，投资者在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，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，由于基金投资人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、本基金特有的风险等等。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。

本基金的金鹰中证500指数基金份额，其预期收益与风险较高，一般而言，其预期收益与风险高于混合型、债券型与货币市场基金份额。从金鹰中证500指数基金（场内）份额当中分离出来的金鹰中证500A份额，其风险收益特性为低风险、预期收益稳定，但在本基金资产出现极端损失的情况下，金鹰中证500A仍可能面临无法取得约定收益乃至本金受损的风险；金鹰中证500B份额的风险收益特性为风险较高、预期收益较高；由于本基金的资产及收益将按照约定收益优先分配给金鹰中证500A的份额持有人，在本基金资产出现损失的情况下，则金鹰中证500B份额将首先面临本金损失。

投资人认购本基金时应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同，本基金单笔认申购金额不低于五万元人民币。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。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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”）、《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”）及其他有关规定以及《金鹰中证500指数分级证券投资基金基金合同》编写。

本招募说明书阐述了金鹰中证500指数分级证券投资基金的投资目标、策略、风险、费率等与投资人投资决策有关的全部必要事项，投资人在做出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

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，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。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本基金合同的当事人，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。

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：

基金或本基金	指金鹰中证500指数分级证券投资基金
基金合同或本基金合同	指《金鹰中证500指数分级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
基金份额或本基金份额	本基金包含了三种不同的份额：金鹰中证500指数分级证券投资基金份额（为本基金基础份额）、以及从金鹰中证500指数基金份额当中分拆而成的金鹰中证500A、金鹰中证500B基金份额
本基金总份额	金鹰中证500指数基金份额数=金鹰中证500A基金份额数+金鹰中证500B基金份额数之和
招募说明书	指《金鹰中证500指数分级证券投资基金招募说明书》及其定期更新
托管协议	指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《金鹰中证500指数分级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
业务规则	指《金鹰基金管理有限公司开放式基金业务规则》
发售公告	指《金鹰中证500指数分级证券投资基金份额发售公告》
《上市规则》	《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》
《上市交易公告书》	《金鹰中证500指数分级证券投资基金之金鹰中证500A、金鹰中证500B上市交易公告书》
中国	指中华人民共和国（仅为《基金合同》目的，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区及台湾地区）
中国证监会	指中国证券监督管理委员会
中国银监会	指中国银行业监督管理委员会
《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，自2004年6月1日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及法机关对其不时做出的修订
《运作办法》	指中国证监会2004年6月29日颁布，同年7月1日起实施的《证券投资基金运作管理办法》及其颁布机关对其不时做出的修订
《销售办法》	指中国证监会2011年6月21日颁布，同年10月1日实施的《证券投资基金销售管理办法》及对其不时作出的修订
《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日起实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及其颁布机关对其不时做出的修订
《发售公告》	指2006年10月31日经第十届全国人民代表大会常务委员会第二十四次会议通过，自2007年1月1日起实施的《中华人民共和国发售公告》及颁布机关对其不时作出的修订
元	指人民币元
基金合同当事人	指受本基金合同约束，根据本基金合同享受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
基金份额分级	将金鹰中证500基金份额当作成为风险收益特性不同的金鹰中证500A、金鹰中证500B两级份额；在本基金的存续期内，金鹰中证500A、金鹰中证500B之间的份额配比为1:1
基金管理人	指金鹰基金管理有限公司
基金托管人	指交通银行股份有限公司
基金份额持有人	指依据法律法规、招募说明书和本基金合同合法取得基金份额的投资人
注册登记业务	指本基金登记、存管、过户、清算和交收业务，具体内容包括投资人基金账户管理、基金份额注册登记、清算和结算、基金销售业务确认、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等
注册登记机构	指办理基金注册登记业务的机构；本基金的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司
注册登记系统	指中国证券登记结算有限责任公司开放式基金注册登记系统
证券登记结算系统	指中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记结算系统
投资人	指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和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者
个人投资者	指依据中华人民共和国有关法律法规及其他有关规定可以投资于开放式证券投资基金的自然人
机构投资者	指在中国境内合法注册登记或经有权政府部门批准设立和有效存续并依法可以投资证券投资基金的企业法人、事业法人、社会团体或其它组织
合格境外机构投资者	指符合证律法规规定、经中国证监会批准可以投资于中国证券市场，并取得国家外汇管理局额度批准的中国境外的机构投资者
基金投资者	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者
基金募集期	指基金合同和招募说明书中载明，并经中国证监会核准的基金份额自基金份额发售之日起最长不超过3个月
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》约定的条件，基金管理人聘请法定机构验资并向中国证监会办理备案手续后，中国证监会的书面确认之日
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，按照基金合同规定的程序终止基金合同的日期
存续期	指本基金合同生效至终止之间的不定期期限
工作日	指上海证券交易所和深圳证券交易所及其他交易场所的正常交易日
发售	指在基金募集期内，销售机构向投资者销售本基金基金份额的行为
认购	指在基金募集期内，投资者按照本基金合同的规定申请购买本基金基金份额的行为
申购	指在基金存续期内，投资者按照本基金合同的规定申请购买本基金基金份额的行为
赎回	指基金存续期内，基金份额持有人按本基金合同规定的条件，要求本基金管理人将其持有的本基金基金份额兑换为现金的行为
巨额赎回	指在本基金单个开放日内，基金净赎回申请份额（基金赎回申请总份额扣除申购申请总份额之余额）与净转出申请份额（基金转出申请总份额扣除转入申请总份额之余额）之和超过上一开放日本基金总份额10%的情形；
基金转换	指基金份额持有人按照本基金管理人届时有效的业务规则进行的金鹰中证500基金份额与基金管理人管理的、由同一注册登记人办理注册登记的其他基金份额间的转换行为
转托管	指基金份额持有人将其基金账户内的同一基金的基金份额从一个交易账户转入另一交易账户的行为
基金销售业务	指基金的宣传推介、认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务
销售机构	指直销机构及代销机构
直销机构	指金鹰基金管理有限公司；
代销机构	指依法律法规及中国证监会的相关规定，选择符合《证券投资基金销售管理办法》规定条件，并经中国证监会认定的，办理基金份额的认购、申购、赎回和其他基金业务的具有基金代销业务资格的机构
基金销售网点	指基金管理人及其代销机构办理基金份额认购、申购、赎回和其他基金业务的营业场所
指定媒体	指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊和互联网网站
标的指数	中证500指数
金鹰中证500份额	本基金基础份额，投资者在场外认/申购的金鹰中证500份额不进行基金份额分拆；投资者在场内认购的金鹰中证500份额将自动进行基金份额分拆；投资者在场内申购的金鹰中证500份额，可选择进行基金份额分拆，也可选择不进行基金份额分拆
基金份额分拆	将每2份金鹰中证500场内份额（不含）以1份金鹰中证500A份额与1份金鹰中证500B份额
基金份额合并	指根据基金合同的约定，基金份额持有人将其持有的每1份金鹰中证500A份额与1份金鹰中证500B份额进行配对，申请转换成2份金鹰中证500份额的场内份额的行为
金鹰中证500A	按照《基金合同》约定的规则，从金鹰中证500基金份额当中分拆出的、获得剩余资产与收益分配权的基金份额；就其风险收益特性而言，属于稳健收益类基金份额
金鹰中证500B	按照《基金合同》约定的规则，从金鹰中证500基金份额当中分拆出的、获得约定收益分配权的基金份额；就其风险收益特性而言，属于积极收益类基金份额
基金份额的级别	指基金份额是A级份额、B级份额还是金鹰中证500基金份额；金鹰中证500A属A级份额，金鹰中证500B属B级份额，金鹰中证500基金份额为本基金基础份额
基金份额的属性	指基金份额是场内份额还是场外份额，二者属性不同
基金账户	指注册登记人为基金投资者开立的记录其持有的由该注册登记人办理注册登记的基金份额余额及其变动情况的账户
交易账户	指销售机构为基金投资者开立的记录其持有的由该销售机构办理认购、申购、赎回、转换及转托管等业务的基金份额余额及其变动情况的账户
深圳证券账户	指在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开设的深圳证券交易所人民币普通股票账户或证券投资基金账户
开放日	指为投资者办理金鹰中证500基金申购、赎回等业务的上海、深圳证券交易所交易日（基金管理人依据相关法律法规及本基金合同的规定公告暂停金鹰中证500份额申购、赎回时除外）
T日	指销售机构在规定时间内受理投资者申购、赎回或其他业务申请的日期
T+n日	指T日起（不包括T日）的第n个工作日
指令	指基金管理人在运用基金财产进行投资时，向基金托管人发出的资金划拨及实物券调拨等指令
场内	指通过深圳证券交易所内的会员单位利用交易所开放式基金交易系统办理基金份额认购、申购、赎回和上市交易的场所，通过该等场所办理基金份额的认购、申购、赎回也称为场内认购、场内申购、场内赎回
场外	指通过基金管理人或代销机构办理基金份额认购、申购和赎回的场所，通过该等场所办理基金份额的认购、申购、赎回也称为场外认购、场外申购、场外赎回
会员单位	指具有开放式基金代销资格，经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的、可通过深圳证券交易所开放式基金销售系统办理开放式基金的认购、申购、赎回和转托管等业务的深圳证券交易所会员单位
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。转托管包括系统内转托管和跨系统转登记
系统内转托管	指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（交易单元）之间进行转托管的行为
跨系统转登记	指基金份额持有人将其持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统间进行转登记的行为
份额配对转换	指本基金的金鹰中证500场内份额与金鹰中证500A份额、金鹰中证500B份额之间按约定的转换规则进行转换的行为，包括分拆和合并
折算日	指分为定期折算日与不定期折算日；定期折算日为金鹰中证500指数分级基金存续期内每个会计年度第一个工作日；不定期折算日为折算前当日金鹰中证500B的份额参考净值小于0.2500（不含0.2500）或金鹰中证500份额净值大于2.0000（不含2.0000）元人民币的工作日；若定期折算日与不定期折算日为同一日，则按照不定期折算规则进行折算；若基金合同生效日为所处会计年度的第一个工作日则不进行折算。

上市交易	投资者通过场内会员单位以集中竞价的方式买卖基金份额的行为
上市交易所	深圳证券交易所
交易时间	指开放日本基金接受申购、赎回或其他交易的时间段
定期定额投资计划	指投资者通过有关销售机构提出申请，约定每期扣款日、扣款金额及扣款方式，由销售机构在每期约定扣款日在投资者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
基金收益	指基金管理人运用基金资产投资所得股票红利、股息、债券利息，买卖证券价差，银行存款利息和其他合法收入以及因运用基金财产带来的成本或费用的节约
基金资产总值	基金资产总值是指本基金拥有的各类有价证券及票据价值、银行存款本息、债券的应计利息，基金应收的申购基金款，缴存的保证金以及其他投资所形成的价值总和
基金资产净值	指基金资产总值减去基金负债后的价值
金鹰中证500指数基金份额净值	指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数
基金份额参考净值	指在T日基金份额净值计算的基础上，采用“虚拟滴清算”原则，即假定T日为本基金的提前终止日，本基金按照基金合同约定的份额收益分配和资产分配规则进行资产分配从而计算得到T日本基金基金份额所分拆的两类基金份额份额净值的一个估算，并不代表基金份额持有人可获得的实际价值
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
法律法规	指中华人民共和国现行有效的法律、行政法规、部门规章及其他规范性文件以及对其做出的不时修改和补充
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
不可抗力	指无法预见、无法克服、无法避免的任何事件和因素，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用和没收、法律法规变化、突发停电、恐怖袭击、传染病传播、证券交易场所非正常暂停或停止交易以及其他突发事件

三、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：金鹰基金管理有限公司
注册地址：广东省珠海市吉大九洲大道东段商业银行大厦7楼16单元
办公地址：广东省广州市天河区体育西路189号城建大厦22、23楼
设立日期：2002年12月25日
法定代表人：刘东
联系电话：020-83282855
联系人：祝红
注册资本：人民币2.5亿元
股权结构：

发起人名称	出资额（万元）	出资比例
广州证券有限责任公司	12250	49%
广州药业股份有限公司	5000	20%
广东美的电器股份有限公司	5000	20%
东亚联丰投资管理有限公司	2750	11%
总计	25000	100%

（二）主要人员情况

1、公司董事及监事

刘东先生，董事长，经济学硕士，高级经济师。曾在中国现代国际关系研究所、中国信达信托投资公司驻武汉证券交易中心任职，历任中国信达信托投资公司北京营业部总经理、证券业务总部副总经理，新疆宏源信托投资股份有限公司总经理助理兼证券业务总部总经理，宏源证券股份有限公司党委委员、副总经理，宏源期货有限公司董事长，现任广州证券有限责任公司总经理。经公司第三届董事会第十六次会议选举通过，并报经中国证监会核准，2010年4月起担任公司董事长。

郑德理先生，董事，留美经济学博士，教授，高级经济师。历任广州中山大学管理学院讲师、副教授，美国乔治华盛顿大学助教，美国华盛顿投资咨询公司副研究员，美国华盛顿投资咨询公司副研究员，美国华盛顿投资咨询公司研究员转型经济处经济顾问。现任广州证券有限责任公司副总经理、首席经济学家，兼任广州风险投资促进会会长，广州市政协委员，上市公司独立董事等。

梁建伟先生，董事，工商管理硕士。历任中国长城铝业公司供销处干部，广东美的电器股份有限公司董事局秘书，现任广东美的集团董事副总裁。

温婉容女士，董事，商科毕业。历任德盛安联资产管理香港有限公司市场及传媒经理、景顺投资管理亚洲有限公司副总裁、德意志资产管理（香港）有限公司区域销售总监、Societe Generale Asset Management Asia Ltd.高级副总裁、德盛安联资产管理香港有限公司行政总裁、香港财务策划师学会行政总裁等职。2011年7月加入东亚联丰投资管理有限公司，现任东亚联丰投资管理有限公司行政总裁。

陈炳华先生，董事，硕士，会计师。曾任广州药业股份有限公司财务部部长，现任广州药业股份有限公司财务总监。

吴晓球先生，独立董事，国民经济管理学博士。历任江西省余江县商业局秘书、中国人民大学经济研究所主任、中国人民大学财政金融学院副院长、中国人民大学研究生院副院长，现任中国人民大学校长助理、财政金融学院常务副院长、金融与证券研究所所长、教授、博导。

杜金岷先生，独立董事，博士、教授、博士生导师。历任高校讲师、副教授，现任暨南大学教授、经济学院党委书记、副院长，广东中青年经济工作者学会副秘书长，广东经济学会常务理事，中华外国经济学说研究会理事，广东金融学会理事，广州留学归国人员协会理事等。

黄元生先生，独立董事，经济学硕士、副教授、高级会计师。历任中山大学会计教研室主任及会计系副主任，广州市康乐会计师事务所副所长及所长，现任广州万隆康正会计师事务所主任会计师。

颜俊先生，独立董事，法学博士，资深律师，资深会计人。曾是广东华邦世纪律师事务所的创始合伙人，中国工商银行深圳市分行法律顾问，现任吉林大学法学院兼职副教授，金杜律师事务所资深合伙人，中华全国律师协会会员，广东省法学会民商法研究会常务理事。

刘晓东先生，监事，工商管理硕士。曾任深圳市审计局主任科员，招商银行总行稽核部高级审计师，鹏华基金管理有限公司监察稽核部副总监，现任金鹰基金管理有限公司监察稽核部总监。

曾巧女士，监事，管理学学士。历任佛山会计师事务所审计助理、美的集团审计部审计经理，现任美的集团审计监察部总监。

姚万义先生，监事，大学本科。历任中共北京市纪律检查委员会北京市监察局办公厅主任、副局长、常委等职，中国证监会北京证管办副主任、巡视员等职，现任北京证券业协会顾问。

2、公司高级管理人员

殷克胜先生，总经理，经济学博士。曾在综合开发研究院（中国深圳）、深圳市体改办任职，历任深圳证监局法规处副处长、上市公司处处长，鹏华基金管理有限公司董事，常务副总经理，方正证券有限责任公司基金公司筹备组组长等职。经公司第三届董事会第十六次会议选举通过，并报经中国证监会核准，2010年4月起担任公司总经理。

刘葆先生，副总经理，经济学博士，副教授。历任深圳国资经营公司（前资控股）资产经营部总经理助理，上海复旦大学博士后流动站（金融研究方向）博士后研究员，深圳华强集团资本经营部副部长，广州越秀集团资本经营部副经理，广州证券有限责任公司总裁助理兼资产管理总部总经理，金鹰基金管理有限公司总经理助理等职。经公司第二届董事会第二十一次会议审议通过，并报经中国证监会核准，2008年12月起担任公司副总经理。

邹容辰女士，副总经理，法律硕士。历任交通银行深圳分行公司业务部科长、交通银行深圳华富支行行长助理、交通银行深圳福田支行行长、交通银行深圳分行个人金融部总经理、零售信贷管理部总经理、华夏银行深圳分行个人业务部总经理等职。经公司第三届董事会第十九次会议审议通过，并报经中国证监会核准，2010年10月起担任公司副总经理。

苏文锋先生，督察长，经济学硕士。历任广州市经济管理干部学院外贸经济系党支部书记，南方证券广州分公司研究发展部总经理、南方证券广州分公司大德路营业部总经理；南方证券广州分公司办公室主任、南方证券广州分公司投资银行部总经理，华鼎担保投资有限公司副总经理等职，金鹰基金管理有限公司市场拓展部副总监等职。经公司第二届董事会第二十一次会议审议通过，并报经中国证监会核准，2008年9月起担任公司督察长。

3、本基金基金经理

林华量，本科学历，基金从业经历9年。2002年10月加入金鹰基金管理有限公司，先后担任交易员、交易主管、金鹰成份股优选证券投资基金基金经理助理、基金经理。林华量在以往工作期间从未受到监管机构行政处罚或采取行政监管措施，不存在《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金法》等法律、法规规定的不得担任基金管理公司基金经理的情形。

4、投资决策委员会成员

本基金采取集体投资决策制度，投资决策委员会成员有：

殷克胜先生，投资决策委员会主席，总经理；

杨绍基先生，投资决策委员会委员，公司首席投资官，基金经理；

杨　刚先生，投资决策委员会委员，研究发展部总监；

彭裕祥先生，投资决策委员会委员，基金管理部总监，基金经理；

徐海森女士，投资决策委员会委员，集中交易部总监。

5、上述人员之间均不存在近亲属关系。

（三）基金管理人的义务

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

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、赎回和登记事宜；如认为基金代销机构违反《基金合同》、基金销售与服务代理协议及国家有关法律规定，应及报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

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、勤勉尽责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、配合基金的保管人对基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

6、除依据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人不得从事以下活动：

（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）用基金财产承销证券；

（6）用基金财产向他人贷款或提供担保；

（7）用基金财产从事无限责任的投资；

（8）用基金财产买卖其他基金份额，但国务院另有规定的除外；

（9）以基金财产向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；

（10）以基金财产买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人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；

（11）用基金财产从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

（12）基金财产参与股票发行申购，所申报的金额超过基金的总财产，基金所申报的股票数量超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

（13）违反基金合同关于投资范围、投资策略和投资比例等约定；

（14）法律、法规、中国证监会及基金合同禁止的其他行为。

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）在包括向中国证监会报送的资料中进行虚假信息披露；

（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）除按本公司制度进行基金运作投资外，直接或间接进行其他股票投资；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；

（9）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；

（10）贬损同行，以提高自己；

（11）在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；

（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）参与洗钱或为洗钱活动提供协助；

（15）法律法规禁止的其他行为。

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）不利用职务之便为自己、代理人、代表人、受雇人或任何其他第三人谋取不当利益。

（3）不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。

（四）基金管理人的内部控制制度

1、内部控制制度概述

为保证公司规范化运作，有效地防范和化解经营风险，确保基金和公司财务和其他信息真实、准确、完整，及时，从而最大程度地维护基金持有人的合法权益，本基金管理人建立了科学合理、控制严密、运行高效的内部控制制度。

内部控制制度是指公司为实现内部控制目标而建立的一系列组织机制、管理方法、操作程序与控制措施的总称。内部控制制度由公司章程、内部控制大纲、基本管理制度、部门业务规章等部分组成。

公司章程是规范公司与其他相关利益主体之间关系的基本规则以及保证这些规则得以具体执行的依据。

公司内部控制大纲是对公司章程规定的内控原则的细化和展开，是对各项基本管理制度的总揽和指导，内部控制大纲明确了内控目标、内控原则、控制环境、内控措施等内容。

基本管理制度包括内部会计控制制度、内控控制制度、投资管理制度、监察稽核制度、基金会计制度、信息披露制度、信息技术管理制度、公司财务制度、资料档案管理制度、业绩评估考核制度和灾难恢复制度等。

部门业务规章是在基本管理制度的基础上，对各部门的主要职责、岗位设置、岗位责任、操作守则等的具体说明。

公司完善内控机制遵循以下原则：

健全性原则。内部控制机制必须覆盖公司的各项业务、各个部门和各级人员，并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个经营环节。

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。

独立性原则。公司必须在精简的基础上设立能充分满足公司经营运作需要的机构、部门和岗位，各机构、部门和岗位职能上保持相对独立性。

相互制约原则。内部部门和岗位的设置必须权责分明、相互牵制，并通过切实可行的相互制衡措施来消除内部控制的盲点。

防火墙原则。公司投资、研究、交易等相关部门，应当在物理上和制度上适当隔离。对因业务需要知悉内幕信息的人员，应制定严格的批准程序和监督处罚措施。

成本效益原则。公司应充分发挥各机构、各部门及广大职员的工作积极性，尽量降低经营运作成本，保证以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

公司制定内部控制制度遵循以下原则：

合法合规原则。公司内控制度应当符合国家法律、法规、规章和各项规定。

全面性原则。内部控制制度必须覆盖公司的所有部门和岗位，渗透各项业务过程和业务环节，并普遍适用于公司每一个职员。

审慎性原则。内部控制的核心是风险控制，内部控制制度的制定要以审慎经营、防范和化解风险为出发点。

适时性原则。内部控制制度的制定应具有前瞻性，并且必须随着公司经营战略、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及时进行相应的修改和完善。

（1）内部会计控制制度

公司依据《中华人民共和国会计法》、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》、《企业财务通则》等国家有关法律、法规制订了基金会计制度、公司财务制度、会计工作操作流程和会计岗位工作手册，并针对各个风险控制点建立了控制措施，保持通畅的会计系统控制。

内部会计控制制度包括凭证制度、账务组织和账务处理程序、复核制度、基金估值制度和程序、基金财务清算制度和程序、成本控制和业绩考核制度、会计档案保管和财务交接制度、财产登记保管和实物资产盘点制度、统一采购和工程招标制度、财务收支审批制度和费用报销管理办法等。

（2）风险管理控制制度

风险控制制度由风险控制委员会组织各部门拟订，报公司总经理办公会议审议通过后实施。风险控制制度由总则、风险控制的目标和原则、风险控制的机构设置、风险控制的程序、风险类型的届定、风险控制的主要措施、风险控制的具体制度、风险控制制度的监督与评价等部分组成。

风险控制的具体制度主要包括投资风险管理制度、交易风险控制制度、财务风险控制制度、公司资产管理制度等业务风险控制制度，以及岗位分离制度、业务空间隔离制度、作业规则、岗位职责、反馈制度、资料保全制度、保密制度、员工行为守则等程序性风险管理制度。

（3）投资管理制度

投资管理制度包括研究业务管理制度、投资决策管理制度、基金交易管理制度等。

制订研究业务管理制度的目的是保持研究工作的独立、客观。研究业务管理制度包括：建立严密的研究工作业务流程，形成科学、有效的研究方法；根据基金合同要求，在充分研究的基础上建立和维护投资对象备选库；建立研究与投资的业务交流制度，保持通畅的交流渠道；建立研究报告质量评价体系。

制订投资决策业务管理制度的目的是严格遵守法律法规的有关规定，确保基金的投资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。投资决策业务管理制度包括投资决策授权制度；投资决策支持制度，重要投资要有详细的研究报告和风险分析支持；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；投资管理业绩评价制度等。

制订基金交易管理制度的目的是保证基金投资交易的安全、有效、公平。基金交易管理制度包括基金交易的集中交易制度；交易监测、预警、反馈机制；投资指令审核制度；投资指令签名学分配制度；交易记录保管制度；交易绩效评价制度等。

（4）监察稽核制度

公司设立监察稽核，负责监察稽核工作，督察长由总经理提名，经董事会聘任，对董事会负责，报中国证监会核准。

除应当回避的情况外，督察长可以列席公司相关会议，调阅公司相关档案，就内部控制制度的执行情况独立地履行检查、评价、报告、建议职能。

督察长应当定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况，董事会应当对督察长的报告进行审议。

公司设立监察稽核部门，具体执行监察稽核工作。公司明确规定了监察稽核部门及内部各岗位的具体职责，严格审查监察稽核人员的专业任职条件，配备了充足的合格的监察稽核人员，明确规定了监察稽核的操作程序和组织纪律。

监察稽核制度包括检查公司各业务部门和工作人员是否遵守法律、法规、规章的有关规定；检查公司各业务部门和工作人员对公司内部控制制度、各项管理制度、业务规章的执行情况；对公司各部门作业流程的遵守合规性和有效性的检查、监督、评价及建议等。

2、内部控制制度的要素

内部控制制度具备控制环境、控制的性质与范围、实施、检查和报告等五个要素：

（1）控制环境

公司已经建立了一种保证其具备内部会计控制和风险管理控制的制度，并建立起由高级管理层监督的控制且已明确规定控制的责任。

公司从影响控制环境的因素，例如公司组织结构、各项控制制度及对公司各项业务的牵制力、公司管理层和员工对内部控制的认识和态度等方面加强控制意识，并致力于从公司文化、组织结构、管理制度等方面营造良好的控制环境氛围。

（2）控制的性质和范围

内部会计控制包括对帐簿、记录的规定和职责分类的控制，以保护基金资产。风险管理控制包括限额交易、市场风险、操作风险、流动性风险等风险的控制。

（3）实施

本基金管理人制订了详细、合理的书面化内部控制指引。内部控制指引提出了内部风险控制的目标、原则、基本要求和实施程序。

（4）检查

本基金管理人建立了一套科学的控制检验程序，根据市场环境、金融工具、技术应用、法律法规等因素的变化及发展情况，不断测试和调整风险控制制度，以确保风险控制制度持续运作并充分有效的制度。

（5）报告

本基金管理人建立了控制报告制度，即督察长和监察稽核部及时将风险控制制度的实质性缺陷或失控向公司董事会和总经理报告的制度。本基金管理人具备完善的信息系统确保报告程序的有效性和保密性，保证以及时可靠的方式取得准确详细的信息。

监察稽核部定期和不定期检查和指导各部门的风险管理工作，形成风险管理报告书与建议书，上报公司管理层和风险控制委员会。实施重点管理的原则，对投资管理部、研究发展部、财务部门、基金会计等重要的业务部门和人员进行重点监督与防范。

3、基金管理人内部控制制度声明书

基金管理人关于内部控制制度的声明如下：

（1）本基金管理人承诺以上关于内部风险控制的披露真实、准确；

（2）本基金管理人承诺根据市场变化和公司业务发展不断完善内部控制制度。

四、基金托管人

（一）基金托管人基本情况

1、基金托管人概况

公司法定中文名称：交通银行股份有限公司　简称：交通银行）

公司法定英文名称：BANK OF COMMUNICATIONS CO.,LTD

法定代表人：胡怀邦

住所：上海市浦东新区银城中路188号

办公地址：上海市浦东新区银城中路188号

邮政编码：200336

注册时间：1987年3月30日

注册资本：618.8561亿元

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字〔1998〕25号

联系人：张咏东

电话：021-32169999

交通银行始建于1908年，是中国历史最悠久的银行之一，也是近代中国发钞行之一。交通银行先后于2005年6月和2007年5月在香港联交所、上交所挂牌上市，是中国2010年上海世博会唯一的商业银行全球合作伙伴。《财资》杂志（The Asset）2010年全球最佳交易银行评选“中，交通银行荣膺“中国最具成长性现金管理银行”、“最佳次托管银行”两项大奖。英国《银行家》杂志2011年公布的全球1000家银行排名，交通银行以343.21亿美元的一级资本连续第三年跻身全球商业银行50强。截至2011年9月30日止，交通银行资产总额达到人民币4.36万亿元，实现净利润人民币384.16亿元。

交通银行总行设资产托管部。现有员工具有多年基金、证券和银行的从业经验，具备基金从业资格，以及经济师、会计师、工程师和律师等中高级专业技术职称，员工的学历层次较高，专业分布合理，职业技能优良，职业道德素质过硬，是一支诚实勤勉、积极进取、开拓创新、奋发向上的资产托管从业人员队伍。

2、主要人员情况

生锡明先生，交通银行行长，哈尔滨工业大学经济学硕士，高级经济师。2009年12月起担任交通银行副董事长、行长。

王滨先生，交通银行副行长，主管交通银行资产托管业务，南开大学经济学博士，高级经济师。曾任交通银行北京分行副行长、交通银行天津分行行长、交通银行北京分行行长。2006年1月至今任交通银行副行长、党委委员兼北京分行党委书记。

谷娜莎女士，交通银行资产托管部总经理，大学学历，经济师。曾任交通银行研究开发部主任科员、交通银行信托部代理业务处处长、交通银行证券投资基金托管部规划处副处长、交通银行证券投资基金托管部内控巡查处处长；2001年1月任交通银行证券投资基金托管部总经理助理，2002年5月起任交通银行资产托管部副总经理，2007年12月起任交通银行资