# 嘉实泰和混合型证券投资基金招募说明书

**基金管理人:嘉实基金管理有限公司**
**基金托管人:中国建设银行股份有限公司**
**二零一四年四月**

**重要提示**

嘉实泰和混合型证券投资基金由泰和证券投资基金转型而来。依据2014年3月14日中国证监会《关于泰和证券投资基金基金份额持有人大会决议备案的回函》(基金部函[2014]148号)以及泰和证券投资基金基金份额持有人大会决议,泰和证券投资基金由封闭式基金转为开放式基金、调整存续期限、终止上市、调整投资目标、范围和策略、修订基金合同,并更名为"嘉实泰和混合型证券投资基金"。2014年4月4日起,由《泰和证券投资基金基金合同》修订而成的《嘉实泰和混合型证券投资基金基金合同》生效,原《泰和证券投资基金基金合同》同日起失效。

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,但并不表明中国证监会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: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、基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险、本基金的特定风险等等。本基金为混合型基金,其预期风险和预期收益低于股票型基金,高于债券型基金及货币市场基金。投资者在投资本基金之前,请仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同,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,理性判断市场,谨慎做出投资决策。

本基金按照1.00元初始面值开展集中申购,在市场波动等因素的影响下,基金份额净值可能低于1.00元。本基金是由泰和证券投资基金转型而来的契约型开放式基金,在集中申购期结束后将进行基金份额折算。通过份额折算使得基金份额净值调整为1.000元以后,未改变本基金的风险收益特征,既不会降低基金投资风险,也不会提高基金投资收益。

投资有风险,投资人集中申购或申购基金时应认真阅读本招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

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。

## 一、绪言

《嘉实泰和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")依照《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》")以及《嘉实泰和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、误导性陈述或重大遗漏,并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。

本招募说明书由基金管理人解释。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,并经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")备案。基金合同是约定基金合同当事人之间权利、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

《招募说明书》中除非文意另有所指,下列词语具有如下含义:

1、基金或本基金:指嘉实泰和混合型证券投资基金

2、泰和基金:指泰和证券投资基金,运作方式为契约型封闭式

3、基金管理人:指嘉实基金管理有限公司

4、基金托管人:指中国建设银行股份有限公司

5、基金合同或《基金合同》:指《嘉实泰和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,本基金合同由《泰和证券投资基金基金合同》修订而成

6、托管协议:指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《嘉实泰和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,本托管协议由《泰和证券投资基金托管协议》修订而成。

7、招募说明书或本招募说明书:指《嘉实泰和混合型证券投资基金招募说明书》及其定期的更新

8、基金份额发售公告:指《嘉实泰和混合型证券投资基金集中申购期基金份额发售公告》

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》:《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《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、《信息披露办法》:《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》:《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、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:指符合现实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

20、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

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:指基金管理人或代销机构宣传推介基金,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

23、销售机构:指直销机构和代销机构

24、直销机构:指嘉实基金管理有限公司

25、代销机构:指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件,取得基金代销业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议,代为办理基金销售业务的机构

26、基金销售网点:指直销机构的直销中心及代销机构的代销网点

27、登记业务:指基金登记、存管、过户、清算和结算业务,具体内容包括投资者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等

28、登记机构:指办理登记业务的机构。本基金的登记机构为嘉实基金管理有限公司或接受嘉实基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构

29、《业务规则》:指《嘉实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登记方面的业务规则,由基金管理人和投资者共同遵守

30、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

31、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、转换及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

32、基金转型:指对包括泰和证券投资基金由封闭式基金转为开放式基金,调整存续期限,终止上市,调整投资目标、范围和策略,修订基金合同,并更名为"嘉实泰和混合型证券投资基金"等一系列事项的统称

33、基金合同生效日:指本《嘉实泰和混合型证券投资基金基金合同》生效起始日,本基金合同自泰和证券投资基金终止上市之日起生效,原《泰和证券投资基金基金合同》自同一日起失效

34、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

35、集中申购期:指本基金合同生效后仅开放申购、不开放赎回的一段时间,最长不得超过3个月

36、存续期:指自《泰和证券投资基金基金合同》生效之日起至本《嘉实泰和混合型证券投资基金基金合同》终止且基金财产清算结果报中国证监会备案并公告之日止的不定期期限

37、工作日:指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

38、T日:指销售机构在规定的开放时间受理投资者申购、赎回或其他业务有效申请的工作日

39、T+n日:指自T日起第n个工作日(不包含"T日")

40、开放日:指为投资者办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

41、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

42、申购:指基金合同生效后,投资者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

43、赎回:指基金合同生效后,基位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

44、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

45、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

46、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

47、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%

48、元:指人民币元

49、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

50、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

51、基金资产净值:指基金资产总值减去基金负债后的价值

52、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

53、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

54、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

55、不可抗力:指本基金合同当事人无法预见、无法抗拒、无法避免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、恐怖袭击、传染病传播、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等

## 三、基金管理人

(一)基金管理人基本概况

1、基本信息

| | |
|---|---|
| 名称 | 嘉实基金管理有限公司 |
| 注册地址 | 上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期23楼01-03单元 |
| 办公地址 | 北京市建国门北大街8号华润大厦8层 |
| 法定代表人 | 安军 |
| 总经理 | 赵学军 |
| 成立日期 | 1999年3月25日 |
| 注册资本 | 1.5亿元 |
| 股权结构 | 中诚信托有限责任公司40%,德意志资产管理(亚洲)有限公司30%,立信投资有限责任公司30%。 |
| 存续期间 | 持续经营 |
| 电话 | (010)65215588 |
| 传真 | (010)65186578 |
| 联系人 | 付强 |

嘉实基金管理有限公司经中国证监会证监基字[1999]5号文批准,于1999年3月25日成立,是中国第一批基金管理公司之一,是中外合资基金管理公司。公司注册地上海,总部设在北京并设深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人、QDII资格和特定资产管理业务资格。

嘉实基金管理有限公司无任何受处罚记录。

2、管理基金情况

截止2013年12月31日,基金管理人共管理2只封闭式证券投资基金、54只开放式证券投资基金,具体包括嘉实泰和封闭、嘉实丰和价值封闭、嘉实成长收益混合、嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实债券、嘉实服务增值行业混合、嘉实优质企业股票、嘉实货币、嘉实沪深300ETF联接(LOF)、嘉实超短债债券、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实海外中国股票(QDII)、嘉实研究精选股票、嘉实多元债券、嘉实量化阿尔法股票、嘉实回报混合、嘉实基本面50指数(LOF)、嘉实稳固收益债券、嘉实价值优势股票、嘉实H股指数(QDII)、嘉实主题新动力股票、嘉实多利分级债券、嘉实领先成长股票、嘉实深证基本面120ETF、嘉实深证基本面120ETF联接、嘉实黄金(QDII-FOF-LOF)、嘉实信用债券、嘉实周期优选股票、嘉实安心货币、嘉实中创400ETF、嘉实中创400ETF联接、嘉实沪深300ETF、嘉实优化红利股票、嘉实全球房地产(QDII)、嘉实理财宝7天债券、嘉实增强收益定期债券、嘉实纯债债券、嘉实中证中期企业债指数(LOF)、嘉实中证500ETF、嘉实增强信用定期债券、嘉实中证500ETF联接、嘉实中证中期国债ETF、嘉实中证金边中期国债ETF联接、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实研究阿尔法股票、嘉实如意宝定期债券、嘉实美国成长股票(QDII)、嘉实丰益策略定期债券、嘉实丰益信用定期债券、嘉实新兴市场双币分级债券、嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实宝A/B、嘉实活期宝货币、嘉实1个月理财债券。其中嘉实增长混合、嘉实稳健混合和嘉实债券属于嘉实理财通系列基金。同时,基金管理人还管理多个全国社保基金、企业年金、特定客户资产投资组合。

(二)主要人员情况

1、基金管理人董事、监事、总经理及其他高级管理人员基本情况

安奎先生,董事长、大学本科,中共党员。曾任吉林农业机械研究所主任;吉林省信托投资公司外经处处长、香港吉信有限公司总经理;吉林省证券公司总经理;东北证券有限责任公司监事长;吉林天信投资公司总经理;中诚信托有限责任公司副总经理。2011年8月5日起任嘉实基金管理有限公司董事长。

赵学军先生,董事、总经理,经济学博士,中共党员。曾就职于天津通信广播公司电视设计所、外经贸部中国仪器进出口总公司、北京商品交易所、天津纺织原材料交易所、商鼎期货经纪有限公司、北京证券有限公司、大成基金管理有限公司。2000年10月至今任嘉实基金管理有限公司董事、总经理。

高方先生,董事,大学本科,中共党员,高级经济师。曾任中国建设银行总行副处长,外企服务总公司宏银实业公司副总经理。1996年9月至今历任中诚信托有限责任公司总裁助理、副总裁,现任中诚信托有限责任公司副总裁。

Bernd Amlung先生,董事,德国籍,德国拜罗伊特大学商业管理专业硕士。自1989年起加入德意志银行以来,曾在私人财富管理、全球市场部工作。现任德意志资产与财富管理公司(Deutsche Asset & Wealth Management, London)全球战略与业务发展部负责人,MD。

Mark Cullen先生,董事,澳大利亚籍,澳大利亚莫纳什大学经济政治专业学士。曾任达灵顿商品(Darlington Commodities)商品交易主管,贝恩(Bain&Company)期货与商品部负责人,德意志银行(纽约)全球股票投资部首席运营官、MD。现任德意志资产管理(纽约)全球首席运营官、MD。

韩家乐先生,董事。1990年毕业于清华大学经济管理学院,硕士研究生。1990年2月至2000年5月任海问证券投资咨询有限公司总经理;1994年至今任北京德恒有限责任公司总经理;2001年11月至今任立信投资有限责任公司董事长。

王巍先生,独立董事,美国福特姆大学文理学院国际金融专业博士。曾任职于中国建设银行辽宁分行。曾任中国银行总行国际金融研究所助理研究员,美国化学银行分析师,美国世界银行顾问,中国南方证券有限公司副总裁,万盟投资管理有限公司董事长。2004至今任万盟并购集团董事长。

张维炯先生,独立董事,中共党员,教授、加拿大不列颠哥伦比亚大学商学院博士。曾任上海交通大学动力机械工程系教师,上海交通大学管理学院副教授、副院长。1997年至今任中欧国际工商学院教授、副院长。

汤欣先生,独立董事,中共党员。1998年至2000年为北京大学法学院博士后研究人员、授课教师,曾任中国证监会并购重组审核委员会第一、二届委员,2000年至今历任清华大学法学院讲师、副教授。现任清华大学商法研究中心副主任、法学院副教授。

朱蕾女士,监事,中共党员,硕士研究生。曾任首都医科大学教师,中国保险监督管理委员会主任科员,国都证券有限责任公司高级经理,中欧基金管理有限公司发展战略官、北京代表处首席代表、董事会秘书。2007年10月至今任中诚信托有限责任公司国际业务部总经理。

穆耀先生,监事,经济师,硕士研究生。曾任西安电子科技大学助教,长安信息产业(集团)股份有限公司董事会秘书,北京德恒有限责任公司财务主管。2001年11月至今任立信投资有限公司财务总监。

王利刚先生,监事,经济学学士。2001年2月至今,就职于嘉实基金管理有限公司综合管理部、人力资源部,历任人力资源部副总监、总监。

曾宪政先生,监事,法学硕士。1999年7月至2003年10月就职于首钢集团,2003年10月至2008年6月,为国浩律师集团(北京)事务所证券部律师。2008年7月至今,就职于嘉实基金管理有限公司法律稽核部、法律部,现任法律部总监。

宋振韬女士,副总经理,中共党员,硕士研究生,经济师。1981年6月至1996年10月任职于中办警卫局。1996年11月至1998年7月于中国银行海外行管理部任副处长。1998年7月至1999年3月任博时基金管理公司总经理助理。1999年3月至今任职于嘉实基金管理有限公司,历任督察员和公司副总经理。

张峰先生,副总经理,中共党员、硕士。曾就职于国家计委,曾任嘉实基金管理有限公司研究部副总监、市场部总监、公司督察长。

戴京焱先士,副总经理,武汉大学经济学硕士,加拿大大不列颠哥伦比亚大学MBA。历任平安证券投资银行部总经理、平安保险集团公司资产管理部副总经理兼负责人;平安证券公司副总经理,平安集团投资审批委员会委员。2004年3月加盟嘉实基金管理有限公司任公司总经理助理,2008年7月起任公司副总经理。

王炜女士,督察长,中共党员,法学硕士。曾就职于中国政法大学法学院、北京市陆通联合律师事务所、北京市智浩律师事务所、新华保险股份有限公司。曾任嘉实基金管理有限公司法律部总监。

2、基金经理

张弢先生,经济学硕士,CFA,具有基金从业资格,11年证券从业经历。曾任兴安证券有限责任公司金融工程分析师、行业分析师、投资经理。2005年9月加盟嘉实基金管理有限公司,任行业分析师,曾任社保组合基金经理;2009年1月16日至2010年6月7日任嘉实增长混合基金经理。2012年1月4日至2014年3月28日任嘉实策略增长基金经理。2010年6月8日至今任嘉实研究精选基金经理。2013年6月19日至今任嘉实泰和基金经理。

3、股票投资决策委员会

本基金采取集体投资决策制度,股票投资决策委员会的成员包括:公司总经理助理兼公司首席投资官(股票业务)邵建先生,公司总经理助理詹凌蔚先生,总经理助理詹凌蔚先生,定量投资部负责人张自力先生,机构投资一部总监党开宇女士,机构投资二部总监郭杰先生,资深基金经理陈勤先生、邹唯先生、张弢先生。

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、转换和登记事宜;

2、办理基金备案手续;

3、对所管理的不同基金资产分别管理、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和基金份额累计净值,确定基金份额申购、赎回价格;

8、办理与基金资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、保存基金资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。

(四)基金管理人的承诺

1、本基金管理人承诺严格遵守相关法律法规、基金合同和中国证监会的有关规定,建立健全内部控制制度,采取有效措施,防止违反有关法律法规、基金合同和中国证监会有关规定的行为发生。

2、本基金管理人承诺严格遵守《中华人民共和国证券法》、《基金法》及有关法律法规,建立健全的内部控制制度,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资产从事证券投资;

(2)不公平地对待其管理的不同基金资产;

(3)利用基金资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)法律法规或中国证监会规定禁止的其他行为。

3、本基金管理人承诺加强人员管理,强化职业操守,督促和约束其工遵守国家有关法律法规及行业规范,诚实信用、勤勉尽责,不得将基金资产用于以下投资或活动:

(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)向其基金管理人、基金托管人出资;

(5)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;

(6)依照法律法规有关规定,由中国证监会规定禁止的其他活动。

法律法规或监管部门调整上述禁止行为的,本基金不受上述限制。

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及其代理人、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、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;

(4)不从事损害基金资产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

(五)基金管理人的内部控制制度

1、内部控制制度概述

为加强内部控制,防范和化解风险,促进公司诚信、合法、有效经营,保障基金份额持有人利益,根据《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》并结合公司具体情况,公司已建立健全内部控制体系和内部控制制度。

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,是各项基本管理制度的纲要和总揽。基本管理制度包括投资管理、信息披露、信息技术管理、公司财务管理、基金会计、人力资源管理、资料档案管理、业绩评估考核、监察稽核、风险控制、紧急应变等制度。部门业务规章是对各部门的主要职责、岗位设置、岗位责任、操作守则等具体说明。

2、内部控制的原则

(1)健全性原则:内部控制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、部门和岗位在职能上必须保持相对独立;

(4)相互制约原则: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。

(5)成本效益原则: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。

3、内部控制组织体系

(1)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。董事会下设审计与合规委员会,负责检查公司内部管理制度的合法合规性及内控制度的执行情况,充分发挥独立董事监督职能,保护投资者利益和公司合法权益。

(2)股票投资决策委员会由公司总经理、总经理助理、总监及资深基金经理组成,负责指导权益类基金资产的运作、确定基本的投资策略和投资组合的原则。

(3)风险控制委员会为公司风险管理的最高决策机构,由公司总经理、督察长及相关总监组成,负责全面评估公司经营管理过程中的各项风险,并提出防范化解措施。

(4)督察长积极对公司各项制度、业务的合法合规性及公司内部控制制度的执行情况进行监察、稽核,定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况。

(5)监察稽核部:公司管理层重视和支持监察稽核工作,并保证监察稽核部的独立性和权威性,配备了充足合格的监察稽核人员,明确监察稽核部门及其各岗位的职责和工作流程、组织纪律。监察稽核部具体负责公司各项制度、业务的合法合规性及公司内部控制制度的执行情况的监察稽核工作。

(6)业务部门:部门负责人为所在部门的风险控制第一责任人,对本部门业务范围内的风险负有管控及时报告的义务。

(7)岗位员工:公司努力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。员工在其岗位职责范围内承担相应的内控责任,并负有对岗位工作中发现的风险隐患或风险问题及时报告、反馈的义务。

4、内部控制措施

公司确立"制度上控制风险、技术上量化风险",积极吸收或采用先进的风险控制技术和手段,进行内部控制和风险管理。

(1)公司逐步健全法人治理结构,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。

(2)公司设置的组织结构,充分体现职责明确、相互制约的原则,各部门均有明确的授权分工,操作相互独立。公司逐步建立决策科学、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。

(3)公司设立了顺序递进、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。

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

(5)公司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。

(6)授权控制应当贯穿于公司经营活动的始终,授权控制的主要内容包括:

①股东会、董事会、监事会和管理层完分了解和履行各自的职权,建立健全公司授权标准和程序,确保授权制度的贯彻执行;

②公司各部门、分公司及员工在规定授权范围内行使相应的职责;

③重大业务授权采取书面形式,授权书应当明确授权内容和时效;

④对已获授权的部门和人员建立有效的评价和反馈机制,对已不适用的授权应及时修改或取消授权。

(7)建立完善的基础财务核算与基金资产估值系统和资产分离制度,基金资产与公司自有资产、其他委托资产以及不同基金的资产之间实行独立运作,分别核算,及时、准确和完整地反映基金资产的状况。

(8)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。投资、研究、交易、IT等重要业务部门和岗位进行物理隔离。

(9)建立和维护信息管理系统,严格信息管理,保证客户资料等信息安全、真实和完整。积极维护信息沟通渠道的畅通,建立清晰的报告系统,各级领导、部门及员工均有明确的报告途径。

(10)建立和完善客户服务标准,加强基金销售管理,规范基金宣传推介,不得有不正当销售行为和不正当竞争行为。

(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,对发生严重影响基金份额持有人利益、可能引起系统性风险、严重影响社会稳定的突发事件,按照预案妥善处理。

(12)公司建立健全内部监控制度,督察长、监察稽核部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;定期评价内部控制的有效性并适时改进。

①对公司各项制度、业务的合法合规性核查。由监察稽核部设计各部门监察稽核点明细,按照查核项目和查核程序进行部门自查、监察部核查,确保公司各项制度、业务符合有关法律、行政法规、部门规章及行业监管规则;

②对内部风险控制制度的持续监督。由监察稽核部组织相关业务部门、岗位共同识别风险点,界定风险责任人,设计内部风险点自我评估表,对风险点进行评估和分析,并由监察稽核部监督风险控制措施的执行,及时防范和化解风险;

③督察长发现公司存在重大风险或者有违法违规行为,在告知总经理和其他有关高级管理人员的同时,向董事会、中国证监会和公司所在地中国证监会派出机构报告。

5、基金管理人关于内部控制的声明

(1)基金管理人承诺以上关于内部控制的披露真实、准确;

(2)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控制体系和内部控制制度。

## 四、基金托管人

(一)基本情况

名称:中国建设银行股份有限公司(简称:中国建设银行)

住所:北京市西城区金融大街25号

办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

法定代表人:王洪章

成立时间:2004年09月17日

组织形式:股份有限公司

注册资本:贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间:持续经营

基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字[1998]12号

联系人:田青

联系电话:(010) 6759 5096

中国建设银行股份有限公司拥有悠久的经营历史,其前身"中国人民建设银行"于1954年成立,1996年易名为"中国建设银行"。中国建设银行是中国四大商业银行之一。中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于2004年9月分立而成立,承继了原中国建设银行的商业银行业务及相关的资产和负债。中国建设银行(股票代码:939)于2005年10月27日在香港联合交易所主板上市,是中国四大商业银行中首家在海外公开上市的银行。2006年9月11日,中国建设银行又作为第一家H股公司晋身恒生指数。2007年9月25日中国建设银行A股在上海证券交易所上市并开始交易。A股发行后中国建设银行的已发行股份总数为:250,010,977,486股(包括240,417,319,880股H股及9,593,657,606股A股)。

截至2013年6月30日,中国建设银行资产总额148,592.14亿元,较上年末增长6.34%。2013年上半年,中国建设银行实现净利润1,199.64亿元,较上年同期增长12.65%。年化资产回报率为1.66%,年化加权净资产收益率为23.90%。利息净收入1,876.60亿元,较上年同期增长10.59%。净利差为2.54%,较上年同期提高0.01个百分点。净利息收益率为2.71%,与上年同期持平。手续费及佣金净收入555.24亿元,较上年同期增长12.76%。

中国建设银行在中国内地设有14万余个分支机构,并在香港、新加坡、法兰克福、约翰内斯堡、东京、首尔、纽约、胡志明市、悉尼、台北设有10家一级海外分行,拥有建行亚洲、建行伦敦、建行俄罗斯、建行迪拜、建银国际等5家全资子公司,海外机构已覆盖到全球14个国家和地区,基本完成在全球主要金融中心的网络布局,24小时不间断服务能力和基本服务架构已初步形成。中国建设银行筹建、设立村镇银行27家,拥有建信基金、建信租赁、建信信托、建信人寿、中德住房储蓄银行等多家子公司,为客户提供一体化全面金融服务能力进一步增强。

2013年上半年,本集团各方面良好表现,得到市场与社会各界广泛认可,先后荣获国内外知名机构授予的近30个重要奖项。在英国《银行家》杂志2013年"世界银行1000强排名"中位列第5,较上年上升1位;在美国《财富》世界500强排名第50位,较上年上升27位;在美国《福布斯》2013年全球2000强上市企业排行榜中位列全球第2,较上年提升11位。此外,本集团还荣获了国内外重要机构授予的包括公司治理、中小企业服务、私人银行、现金管理、托管、投行、投资者关系和企业社会责任等领域的多个专项奖。

中国建设银行总行设投资托管业务部,下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII托管处、核算处、清算处、监督稽核处、涉外资产核算团队、养老金托管处、托管业务系统规划与管理团队、上海备份中心等12个职能处室、团队,现有员工225人。自2007年起,托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计,并已经成为常规化的内控工作手段。

(二)主要人员情况

杨新丰,投资托管业务部总经理,曾就职于中国建设银行江苏省分行、广东省分行、中国建设银行总行会计部、营运管理部,长期从事计划财务、会计结算、营运管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

纪伟,投资托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部,长期从事大客户的客户管理及服务工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张军红,投资托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室,长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

郑绍平,投资托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行总行投资部、委托代理部,长期从事客户服务、信贷业务管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

(三)基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行,中国建设银行一直秉持"以客户为中心"的经营理念,不断加强风险管理和内部控制,严格履行托管人的各项职责,切实维护资产持有人的合法权益,为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展,中国建设银行托管资产规模不断扩大,托管业务品种不断增加,已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系,是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2013年6月30日,中国建设银行已托管311只证券投资基金。建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平,赢得了业内的高度认同。中国建设银行在2005年及自2009年起连续四年被国际权威杂志《全球托管人》评为"中国最佳托管银行",在2007年及2008年连续被《财资》杂志评为"国内最佳托管银行"奖,并获和讯网2011年度和2012年度中国"最佳资产托管银行"奖,和瑞内权威经济媒体《每日经济观察》2012年度"最佳基金托管银行"奖。

(四)基金托管人的内部控制制度

1、内部控制目标

作为基金托管人,中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和本行内有关管理规定,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

中国建设银行设有风险与内控管理委员会,负责全行风险管理与内部控制工作,对托管业务风险控制工作进行检查指导。投资托管业务部专门设置了监督稽核处,配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作,具有独立行使监督稽核工作职权和能力。

3、内部控制制度及措施

投资托管业务部具备系统、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;业务管理严格实行复核、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

1、监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定,监督所托管基金的投资运作。利用自行开发的"托管业务综合系统——基金监督子系统",严格按照现行法律法规以及基金合同规定,对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督,并定期编写基金投资运作监督报告,报送中国证监会。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中,对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

2、监督流程

(1)每工作日按时通过基金监督子系统,对各基金投资运作比例控制指标进行例行监控,发现投资比例超标等异常情况,向基金管理人发出书面通知,与基金管理人进行情况核实,督促其纠正,并及时报告中国证监会。

(2)收到基金管理人的划款指令后,对涉及各基金的投资范围、投资对象及交易对手等内容进行合法合规性监督。

(3)根据基金投资运作监督情况,定期编写基金投资运作监督报告,对各基金投资运作的合法合规性、投资独立性和风格显著性等方面进行评价,报送中国证监会。

(4)通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易,电话或书面要求基金管理人进行解释或举证,并及时报告中国证监会。

## 五、相关服务机构

(一)基金份额销售机构

1、直销机构:嘉实基金管理有限公司直销中心,上海直销中心、深圳、成都、青岛、杭州、福州、南京、广州分公司和嘉实网上交易。

(1)嘉实基金管理有限公司直销中心

| | | | |
|---|---|---|---|
| 办公地址 | 北京市朝阳区建国路91号金地中心A座6层 | | |
| 电话 | (010) 65215588 | 传真 | (010)65215577 |
| 联系人 | 赵虹 | | |

(2)嘉实基金管理有限公司上