华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金招募说明书

场内简称:恒生通　认购代码:513663
发售时间:2014年12月9日至2014年12月17日
发售机构:中信证券　国泰君安证券　海通证券　申银万国证券
中信建投证券　国信证券　中国银河证券　广发证券
光大证券　长江证券　中国中投证券　安信证券等各大证券公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
重要提示

华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证监会2014年12月3日证监许可[2014]1303号文注册募集。

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,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

本基金跟踪香港市场股票指数,基金净值会因为香港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、汇率风险;基金所投资的股票、债券、衍生品等各种投资工具的相关风险;由于基金份额持有人连续大量赎回基金产生的流动性风险;本基金的特定风险等。本基金是股票基金,风险高于货币市场基金、债券基金和混合基金。

本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股。基金优先通过港股通投资标的指数的成份股、备选成份股,未来如果出现由于沪港通额度受限、业务规则发生重大变更等影响投资运作的情形时,为了更好地保护投资人利益,实现投资目标,本基金将可以直接委托香港的经纪商投资标的指数的成份股、备选成份股。

在目前的结算规则下,T日申购的基金份额在T+1日可以卖出或赎回。投资者认购本基金时需具有上海证券账户,上海证券账户是指上海证券交易所A股账户或上海证券交易所证券投资基金账户,但需注意:使用基金账户只能参与本基金的现金认购和二级市场交易,如投资者需要参与基金的申购、赎回,则应使用A股账户。

投资有风险,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。

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。

一、绪言

《华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》(以下简称“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》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《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《华夏沪港通恒生交易型开放式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。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。基金投资者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。基金投资者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

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:指华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金。
2、基金管理人:指华夏基金管理有限公司。
3、基金托管人:指中国农业银行股份有限公司。
4、基金合同、《基金合同》:指《华夏沪港通恒生交易型开放式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《华夏沪港通恒生交易型开放式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《华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》及其定期的更新。
7、基金份额发售公告:指《华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告》。
8、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。
9、《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。
10、《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。
11、《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。
12、《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。
13、交易型开放式指数证券投资基金:指《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》定义的“交易型开放式指数基金”
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《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。
20、投资人、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、赎回等业务。
23、销售机构:指直销机构和代销机构。
24、直销机构:指华夏基金管理有限公司。
25、代销机构:指发售代理机构和/或申购赎回代理机构。
26、发售代理机构:指基金管理人指定的代理本基金发售业务的机构。
27、申购赎回代理机构:指基金管理人指定的代理本基金申购、赎回业务的机构。
28、登记业务:指《中国证券登记结算有限责任公司关于上海证券交易所交易型开放式基金登记结算业务实施细则》以及相关业务规则定义的基金份额的登记、托管和结算业务。
29、登记机构:指办理登记业务的机构。基金的登记机构为中国证券登记结算有限责任公司。
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》:指基金管理人、上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则和规定。
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和招募说明书规定的条件要求基金管理人购回本基金基金份额的行为。
43、申购赎回清单:指由基金管理人编制的用以公告申购对价、赎回对价等信息的文件。
44、申购对价:指投资者申购基金份额时,按基金合同和招募说明书规定应交付的现金替代、现金差额和/或其他对价。
45、赎回对价:指投资者赎回基金份额时,基金管理人按基金合同和招募说明书规定应交付给赎回人的现金替代、现金差额和/或其他对价。
46、最小申购赎回单位:指基金申购份额、赎回份额的最低数量,投资者申购、赎回的基金份额应为最小申购、赎回单位的整数倍。
47、元:指人民币元。
48、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。
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报刊、互联网网站或其他媒介。
54、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。

三、基金管理人

(一)基金管理人概况
名称:华夏基金管理有限公司
住所:北京市顺义区天竺空港工业区A区
办公地址:北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座12层
设立日期:1998年4月9日
法定代表人:杨明辉
联系人:崔雁巍
客户服务电话:400-818-6666
传真:010-63136700
华夏基金管理有限公司注册资本为23800万元,公司股权结构如下:

持股单位	持股占总股本比例
中信证券股份有限公司	62.2%
山东省农村经济开发投资公司	10%
POWER CORPORATION OF CANADA	10%
青岛海鹏科技投资有限公司	10%
南方工业资产管理有限责任公司	7.8%
合计	100%

(二)主要人员情况
1、基金管理人董事、监事、经理及其他高级管理人员基本情况
杨明辉先生:董事长、代总经理、党委书记,中信证券股份有限公司党委委员,硕士,高级经济师。兼任华夏资本管理有限公司董事长。曾任中信证券公司董事、襄理、副总经理,中信控股公司董事、常务副总裁,中国建银投资证券有限责任公司党委副书记、执行董事、总裁,兼任信诚基金管理有限公司董事长等。
杨一夫先生:董事,硕士。现任鲍尔太平有限公司总裁,负责总部加拿大鲍尔公司在中国的投资活动,兼任三川能源开发有限公司董事、中国投资协会常务理事。曾任国际金融公司(世界银行组织成员)驻中国的首席代表等。
胡祖六先生:董事,博士,教授。现任春华资本集团主席。曾任国际货币基金组织高级经济学家,达沃斯世界经济论坛首席经济学家,高盛集团大中华区主席、合伙人、董事总经理。
徐刚先生:董事,博士,经济师。现任中信证券股份有限公司执行委员会委员、董事总经理、经纪业务发展与管理委员会主任委员、研究部行政负责人,兼任中信证券(山东)、中信期货、前海股权投资公司、青岛蓝海股权交易中心、厦门两岸股权交易中心等公司董事。曾任中国地质机械仪器工业总公司干部,曾任职于中信证券股份有限公司研究咨询部、资产管理部、金融产品开发小组、金融组、研究部、股票销售交易部,担任经理、高级经理、部门副总经理、部门总经理、部门行政负责人等职务。
葛水波先生:董事,硕士。现任中信证券股份有限公司执行委员会委员、董事总经理、计划财务部行政负责人,兼任华夏资本管理有限公司董事。曾任中信证券股份有限公司资银行部高级经理、上市部副主任、风险控制部执行总经理、交易部(现交易与衍生产品业务部)行政负责人。
朱武祥先生:独立董事,博士,教授。现任清华大学经济管理学院金融系教授、博士生导师、系副主任,兼任北京建设(香港上市)及华夏幸福基业、中海油海洋工程、荣信三家内地上市公司的独立董事,中国金融学会常务理事。
贾建平先生:独立董事,大学本科,高级经济师。现已退休。兼任东莞银行独立董事。曾任职于北京工艺品进出口公司、美国纽约中国物产有限公司(外派工作),曾担任中国银行信托咨询公司副处长、处长,中国银行卢森堡公司副总经理,中国银行意大利代表处首席代表,中银集团投资管理公司副董事长、总经理,中国银行重组上市办公室,董事会秘书办公室、上市办公室总经理,中银基金管理有限公司董事长。
谢德仁先生:独立董事,博士,教授。现任清华大学经济管理学院会计学教授、博士生导师,兼任同方环境股份有限公司、北京双杰电气股份有限公司、博彦科技股份有限公司(上市公司)、朗新科技股份有限公司独立董事,中国会计学会财务成本分会第七届理事会副会长。曾任清华大学经济管理学院会计学讲师、副教授。
吴志军先生:副总经理,学士。曾任上海分公司总经理、市场总监、公司总经理助理等。
林浩先生:副总经理,投资决策委员会主席,硕士。曾任公司总经理助理等。
张霄岭先生:副总经理,博士。现兼任上海高级金融学院客座教授、清华大学五道口金融学院特聘教授。曾任中国技术进出口总公司项目经理、美国联邦储备委员会(华盛顿总部)经济学家、摩根士丹利(纽约总部)信用衍生品交易模型风险主管、中国银监会银行监管三部副主任等。
汤晓东先生:督察长,硕士。曾任职于摩根大通、荷兰银行、苏格兰皇家银行、中国证监会等。
李红源先生:监事长,硕士,研究员级高级工程师。现任南方工业资产管理有限责任公司总经理。曾任中国北方光学电子总公司信息部职员,中国兵器工业总公司教育局职员、主任科员、规划处副处长、计划处处长,中国兵器装备集团公司发展计划部副主任、经济运营部副主任、资本运营部巡视员兼副主任。
罗楚良先生:监事,硕士,高级工程师。现任山东省农村经济开发投资公司总经理(法定代表人)、党委副书记,兼任山东高速投资控股有限公司法定代表人、总经理,山东高速环球融资租赁有限公司法定代表人,执行董事兼总经理,山东高速路桥集团股份有限公司董事。曾任山东省交通厅政策法规处副主任科员、主任科员,山东省交通厅外事外经处副处长,山东基建股份有限公司董事、副总经理,山东高速股份有限公司董事、常务副总经理。
吕翔先生:监事,学士。现任中信证券股份有限公司投资管理部执行总经理。曾任国家劳动部综合计划与工资司副主任科员,中信证券股份有限公司人力资源管理部执行总经理。
康茜女士:监事,法学和金融学双学士。现任华夏基金管理有限公司纪律检查委员会委员、法律监察部总经理,兼任华夏资本管理有限公司常务副总经理。曾任中国工商银行北京分行法律部、证券监管部门主任科员,华夏基金管理有限公司成都分公司总经理。
刘文灿先生:监事,工商管理硕士。现任华夏基金管理有限公司法律监察部总监。曾任原北京市二商局干部,中国国际贸易促进委员会干部,华夏基金管理有限公司财务部总经理、办公室主任、稽核总监、人力资源总监等。
王芬华女士:监事,经济学学士。现任华夏基金管理有限公司人力资源部副总经理。曾任北京NTT DATA人力资源部职员,华夏基金管理有限公司人力资源部总经理助理等。
2、本基金基金经理
王路先生,博士。曾任美国纽约德意志资产管理公司基金经理及定量股票研究负责人、美国纽约法兴银行组合经理、大成基金国际业务部副总监等。2008年11月加入华夏基金管理有限公司,现任数量投资部总经理,恒生交易型开放式指数证券投资基金基金经理(2012年8月9日起任职)、恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理(2012年8月21日起任职)、上证原材料交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理(2013年3月28日起任职)、上证主要消费交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理(2013年3月28日起任职)、上证金融地产交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理(2013年3月28日起任职)。
张弘弢先生,硕士。2000年4月加入华夏基金管理有限公司,曾任研究发展部总经理等,现任数量投资部副总经理、华夏沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理(2009年7月10日起任职)、恒生交易型开放式指数证券投资基金基金经理(2012年8月9日起任职)、恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理(2012年8月21日起任职)、华夏沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金经理(2012年12月25日起任职)、上证能源交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理(2013年3月28日起任职)、上证医药卫生交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理(2013年3月28日起任职)。
3、本公司股票投资决策委员会
主任:阳晖先生,华夏基金管理有限公司投资总监、股票投资部副总经理,华夏兴华混合型证券投资基金基金经理、华夏盛世精选股票型证券投资基金基金经理。
成员:林浩先生,华夏基金管理有限公司副总经理。
王海雄先生,华夏基金管理有限公司首席投资官,华夏经典配置混合型证券投资基金基金经理、华夏平稳增长混合型证券投资基金基金经理、华夏回报证券投资基金基金经理、华夏回报二号证券投资基金基金经理。
孙彬先生,华夏行业精选股票型证券投资基金(LOF)基金经理、华夏大盘精选证券投资基金基金经理。
郑煜女士,华夏基金管理有限公司股票投资部副总经理,华夏收入股票型证券投资基金基金经理。
郑晓辉先生,华夏基金管理有限公司股票投资部副总经理,华夏优势增长股票型证券投资基金基金经理。
列席人员:汤晓东先生,华夏基金管理有限公司督察长。
4、上述人员之间不存在近亲属关系。
(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。
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、国务院证券监督管理机构规定的其他职责。
(四)基金管理人承诺
1、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。
2、本基金管理人不从事违反《证券法》的行为,并建立健全内部控制制度,采取有效措施,防止违反《证券法》行为的发生。
3、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)购买不动产。
(2)购买房地产抵押按揭。
(3)购买贵重金属或代表贵重金属的凭证。
(4)购买实物商品。
(5)除应付赎回、交易清算等临时用途以外,借入现金。该临时用途借入现金的比例不得超过基金、集合计划资产净值的10%。
(6)利用融资购买证券,但投资金融衍生品除外。
(7)参与未持有基础资产的卖空交易。
(8)从事证券承销业务。
(9)中国证监会禁止的其他行为。
4、本基金管理人将加强人员管理,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,不从事以下行为:
(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)依照法律、行政法规有关规定,由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他行为。
5、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利益。
(2)不利用职务之便为自己、被代理人、被代表人、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。
(五)基金管理人的内部控制制度
基金管理人根据全面性原则、有效性原则、独立性原则、相互制约原则、防火墙原则和成本收益原则建立了一套比较完整的内部控制体系。该内部控制体系由一系列业务管理制度及相应的业务处理、控制程序组成,具体包括控制环境、风险评估、控制活动、信息沟通、内部监控等要素。公司已经通过了ISAE3402(《鉴证业务国际准则第3402号》)认证,获得无保留意见的控制设计合理性及运行有效性的报告。
1、控制环境
良好的控制环境包括科学的公司治理、有效的监督管理、合理的组织结构和有力的控制文化。
(1)公司引入了独立董事制度,目前有独立董事3名。董事会下设审计委员会等专门委员会。公司管理层设立了投资决策委员会、风险管理委员会等专业委员会。
(2)公司各部门之间有明确的授权分工,既互相合作,又互相核对和制衡,形成了合理的组织结构。
(3)公司坚持稳健经营和规范运作,重视员工的合规守法意识和职业道德的培养,并进行持续教育。
2、风险评估
公司各层面和各业务部门在确定各自的目标后,对影响目标实现的风险因素进行分析。对于不可控风险,风险评估的目的是决定是否承担该风险或减少相关业务;对于可控风险,风险评估的目的是分析如何通过制度安排来控制风险程度。风险评估还包括各业务部门对日常工作中新出现的风险进行再评估并完善相应的制度,以及新业务设计过程中评估相关风险并制定风险控制制度。
3、控制活动
公司对投资、会计、技术系统和人力资源等主要业务制定了严格的控制制度。在业务管理制度上,做到了业务操作流程的科学、合理和标准化,并要求完整的记录、保存和严格的检查、复核;在岗位责任制度上,内部岗位分工合理、职责明确,不相容的职务、岗位分离设置,相互检查、相互制约。
(1)投资控制制度
①投资决策与执行相分离。投资管理决策职能和交易执行职能严格隔离,实行集中交易制度,建立和完善公平的交易分配制度,确保各投资组合享有公平的交易执行机会。
②投资授权控制。建立明确的投资决策授权制度,防止越权决策。投资决策委员会负责制定了严格的控制制度。在业务管理制度上,做到了业务操作流程的科学、合理和标准化,并要求完整的记录、保存和严格的检查、复核;在岗位责任制度上,内部岗位分工合理、职责明确,不相容的职务、岗位分离设置,相互检查、相互制约。
③警示性控制。按照法规或公司规定设置各类资产投资比例的预警线,交易系统在投资比例达到接近限制比例前的某一数值时自动预警。
④禁止性控制。根据法律、法规和公司相关规定,基金禁止投资受限制的证券并禁止从事受限制的行为。交易系统通过预先的设定,对上述禁止进行自动提示和限制。
⑤多重监控和反馈。交易管理部对投资行为进行一线监控;风险管理部进行事中的监控;监察稽核部门进行事后的监控。在监控中如发现异常情况将及时反馈并督促调整。
(2)会计控制制度
①建立了基金会计的工作制度及相应的操作和控制规程,确保会计业务有章可循。
②按照相互制约原则,建立了基金会计业务的复核制度以及与托管人相关业务的相互核查监督制度。
③为了防范基金会计在资金头寸管理上出现透支风险,制定了资金头寸管理制度。
④制定了完善的档案保管和财务交接制度。
(3)技术系统控制制度
为保证技术系统的安全稳定运行,公司对硬件设备的安全运行、数据传输与网络安全管理、软硬件的维护、数据的备份、信息技术人员操作管理、危机处理等方面都制定了完善的制度。
(4)人力资源管理制度
公司建立了科学的招聘解聘制度、培训制度、考核制度、薪酬制度等人事管理制度,确保人力资源的有效管理。
(5)监察制度
公司设立了监察部门,负责公司的法律事务和监察工作。监察制度包括违规行为的调查程序和处理制度,以及对员工行为的监察。
(6)反洗钱制度
公司设立了反洗钱工作小组作为反洗钱工作的专门机构,指定专门人员负责反洗钱和反恐融资合规管理工作;各相关部门设立了反洗钱岗位,配备反洗钱负责人员。除建立健全反洗钱组织体系外,公司还制定了《反洗钱工作内部控制制度》及相关业务操作规程,确保依法切实履行金融机构反洗钱义务。
4、信息沟通
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,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,信息及时送交适当的人员进行处理。目前公司业务均已做到了办公自动化,不同的人员根据其业务性质及层级具有不同的权限。
5、内部监控
公司设立了独立于各业务部门的稽核部门,通过定期或不定期检查,评价公司内部控制制度合理性、完备性和有效性,监督公司各项内部控制制度的执行情况,确保公司各项经营管理活动的有效运行。
6、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的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:蒋超良
成立日期:2009年1月15日
批准设立机关和批准设立文号:中国银监会银监复[2009]13号
基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字[1998]23号
注册资本:32,479,411.7万元人民币
存续期间:持续经营
联系电话:010-68121510
传真:010-68121816
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。在海外,中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉,每年位居《财富》世界500强企业之列。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。
2、主要人员情况
中国农业银行托管业务部现有员工140余名,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。
3、基金托管业务经营情况
截至2014年9月30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227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、博时内需增长灵活配置混合型证券投资基金、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、金元惠理成长动力灵活配置混合型证券投资基金、天治稳健双益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、长信利丰债券型证券投资基金、金元惠理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交易型开放式指数证券投资基金联接基金(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、兴全沪深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、泰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(LOF)、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、招商安瑞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、浙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、南方保本混合型证券投资基金、交银施罗德先进制造股票证券投资基金、上投摩根新兴动力股票型证券投资基金、富兰克林国海策略回报灵活配置混合型证券投资基金、金元惠理保本混合型证券投资基金、招商安达保本混合型证券投资基金、深证300价值交易型开放式指数证券投资基金、南方中国中小盘股票指数证券投资基金(LOF)、交银施罗德深证300价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金、富国中证500指数增强型证券投资基金(LOF)、长信内需成长股票型证券投资基金、大成中证内地消费主题指数证券投资基金、中海消费主题精选股票型证券投资基金、长盛同瑞中证200指数分级证券投资基金、景顺长城核心竞争力股票型证券投资基金、汇添富信用债债券型证券投资基金、光大保德信行业轮动股票型证券投资基金、富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金、长信利息收益开放式证券投资基金、汇添富逆向投资股票型证券投资基金、大成新锐产业股票型证券投资基金、申万菱信中小板指数分级证券投资基金、广发消费品精选股票型证券投资基金、鹏华金刚保本混合型证券投资基金、汇添富理财14天债券型证券投资基金、嘉实全球房地产证券投资基金、金元惠理新经济主题股票型证券投资基金、东吴保本混合型证券投资基金、建新社会责任股票型证券投资基金、嘉实理财宝7天债券型证券投资基金、富兰克林国海恒久信用债券型证券投资基金、大成月添利理财债券型证券投资基金、安信目标收益债券型证券投资基金、富国7天理财宝债券型证券投资基金、交银施罗德理财21天债券型证券投资基金、易方达中债新综合指数发起式证券投资基金(LOF)、工银瑞信用纯债债券型证券投资基金、大成现金增利货币市场基金、景顺长城支柱产业股票型证券投资基金、易方达月月利理财债券型证券投资基金、摩根士丹利华鑫量化配置股票型证券投资基金、东方央视财经50指数增强型证券投资基金、交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金、鹏华理财21天债券型证券投资基金、国泰民安增利债券型发起式证券投资基金、万家14天理财债券型证券投资基金、华安纯债债券型发起式证券投资基金、金元惠理保本混合型证券投资基金、南方中证500交易型开放式指数证券投资基金、招商双债增强分级债券型证券投资基金、景顺长城品质投资股票型证券投资基金、中海可转换债券债券型证券投资基金、融通标普中国可转债指数增强型证券投资基金、大成现金宝场内实时申赎货币市场基金、交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金、国泰中国企业境外高收益债券型证券投资基金、富兰克林国海焦点驱动灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城沪深300等权重交易型开放式指数证券投资基金、广发聚源定期开放债券型证券投资基金、大成景安短融债券型证券投资基金、嘉实研究阿尔法股票型证券投资基金、新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金、富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金、汇添富高息债债券型证券投资基金、东方利群混合型发起式证券投资基金、南方稳利一年定期开放债券型证券投资基金、景顺长城四季金利纯债债券型证券投资基金、华夏永福养老理财混合型证券投资基金、嘉实丰益信用定期开放债券型证券投资基金、国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金、交银施罗德定期支付双息平衡混合型证券投资基金、光大保德信现金宝货币市场基金、易方达投资级信用债债券型证券投资基金、广发趋势优选灵活配置混合型证券投资基金、华润元大保本混合型证券投资基金、长盛双月红一年期定期开放债券型证券投资基金、富国国有企业债债券型证券投资基金、富安达信用主题轮动纯债债券型发起式证券投资基金、景顺长城沪深300指数增强型证券投资基金、中邮定期开放债券型证券投资基金、安信永利信用定期开放债券型证券投资基金、工银瑞信信息产业股票型证券投资基金、大成景祥分级债券型证券投资基金、富兰克林国海岁岁恒丰定期开放债券型证券投资基金、景顺长城景益货币市场基金、万家市政纯债定期开放债券型证券投资基金、建信稳定添利债券型证券投资基金、上投摩根双债增利债券型证券投资基金、嘉实活期宝货币市场基金、融通通源一年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金、大成信用增利一年定期开放债券型证券投资基金、鹏华品牌传承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、汇添富恒生指数分级证券投资基金、长盛航天海工装备灵活配置混合型证券投资基金、广发新动力股票型证券投资基金、东吴阿尔法灵活配置混合型证券投资基金、诺安天天宝货币市场基金、前海开源可转债债券型发起式证券投资基金、新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金、富国天盛灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城中小板创业板精选股票型证券投资基金、中邮双动力混合型证券投资基金、建信改革红利股票型证券投