天弘中证500指数型发起式证券投资基金招募说明书

基金管理人:天弘基金管理有限公司
基金托管人:国泰君安证券股份有限公司
重要提示

天弘中证500指数型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)于2014年12月15日获得中国证监会准予注册的批复(证监许可【2014】1364号)。

本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会备案,但中国证监会接受本基金募集注册的备案,并不表明其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,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动。投资有风险,投资人认购(或申购)基金时应认真阅读本招募说明书,全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,对认购(或申购)基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资人在获得基金投资收益的同时,亦承担基金投资中出现的各类风险,可能包括:证券市场整体环境引发的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、大量赎回或暴跌导致的流动性风险、基金管理人在投资经营过程中产生的操作风险以及本基金特有风险等。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。

本基金为股票型基金,属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种,其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

本基金并非保本基金,基金管理人并不能保证投资于本基金不会产生亏损。

投资者应当认真阅读《基金合同》、《招募说明书》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,了解基金的风险收益特征,根据自身的投资目的、投资经验、资产状况等判断基金是否和自身的风险承受能力相适应,并通过基金管理人或基金管理人委托的具有基金销售业务资格的其他机构购买基金。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资者注意基金投资的“买者自负”原则,在做出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行负担。

一、绪言

《天弘中证500指数型发起式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》”)、《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》”)、《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《天弘中证500指数型发起式证券投资基金基金合同》(以下简称“本合同”或“基金合同”)编写。

本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

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:指天弘中证500指数型发起式证券投资基金
2、基金管理人:指天弘基金管理有限公司
3、基金托管人:指国泰君安证券股份有限公司
4、基金合同:指《天弘中证500指数型发起式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《天弘中证500指数型发起式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、招募说明书或本招募说明书:指《天弘中证500指数型发起式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《天弘中证500指数型发起式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,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
10、《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
11、《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日实施的《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
13、中国证监会:指中国证券监督管理委员会
14、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
15、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
16、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
17、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
18、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
19、发起资金:指用于认购发起式基金且来源于基金管理人的股东资金、基金管理人固有资金、基金管理人高级管理人员或基金经理(指基金管理人员工中依法具有基金经理资格者,包括但可能不限于本基金的基金经理,同时也可以包括基金经理之外公司投研人员)等人员的资金
20、发起资金提供方:指以发起资金认购本基金且承诺以发起资金认购的基金份额持有期限不少于三年的基金管理人的股东、基金管理人、基金管理人高级管理人员或基金经理(指基金管理人员工中依法具有基金经理资格者,包括但可能不限于本基金的基金经理,同时也可以包括基金经理之外公司投研人员)等人员
21、投资人: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
22、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
23、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、转托管及定期定额投资等业务
24、销售机构:指天弘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
25、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
26、登记机构:指办理登记业务的机构。基金的登记机构为天弘基金管理有限公司或接受天弘基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构
27、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
28、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买卖基金的基金份额变动及结余情况的账户
29、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
30、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
31、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
32、存续期:指基金合同生效至终止之间的不定期期限
33、工作日:指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日
34、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
35、T+n日:指自T日起第n个工作日(不包含T日)
36、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
37、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
38、《业务规则》:指《天弘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人共同遵守
39、认购:指在基金募集期内,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
40、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
41、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的规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为
42、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
43、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
44、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
45、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%
46、元:指人民币元
47、标的指数:指中证500指数
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、互联网网站及其他媒介
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:天弘基金管理有限公司
住所:天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层
办公地址:天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层
成立日期:2004年11月8日
法定代表人:李琦
联系电话:(022)83310208
组织形式:有限责任公司
注册资本:人民币1.8亿元
股权结构

天弘基金管理有限公司(以下简称“公司”或“本公司)经中国证监会证监基金字[2004]164号文批准于2004年11月8日成立,截止最近工商登记信息,公司注册资本为人民币1.8亿元,股权结构为:

股东名称	股权比例
天津信托有限责任公司	48%
内蒙古君正能源化工股份有限公司	36%
芜湖高新投资有限公司	16%
合计	100%

经本公司股东会决议通过,并经中国证券监督管理委员会批复核准(证监许可[2014]536号),公司注册资本由1.8亿元增加至5.143亿元,相应工商变更登记完成后,股权结构变更为:

股东名称	股权比例
浙江蚂蚁小微金融服务集团有限公司	51%
天津信托有限责任公司	16.8%
内蒙古君正能源化工股份有限公司	15.6%
芜湖高新投资有限公司	5.6%
新疆天瑞博丰股权投资合伙企业(有限合伙)	3.5%
新疆天惠新盟股权投资合伙企业(有限合伙)	2%
新疆天阜恒基股权投资合伙企业(有限合伙)	2%
新疆天聚宸兴股权投资合伙企业(有限合伙)	3.5%
合计	100%

截止披露日,相关工商变更正在办理中。

截至2014年12月31日,本公司旗下管理的基金有天弘精选混合型证券投资基金、天弘永利债券型证券投资基金、天弘永定价值成长股票型证券投资基金、天弘周期策略股票型证券投资基金、天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)、天弘添利分级债券型证券投资基金、天弘丰利债券型证券投资基金(LOF)、天弘现金管家货币市场基金、天弘债券型发起式证券投资基金、天弘安康养老混合型证券投资基金、天弘增利宝货币市场基金、天弘稳利定期开放债券型证券投资基金、天弘弘利债券型证券投资基金、天弘同利分级债券型证券投资基金、天弘通利混合型证券投资基金和天弘季加利理财债券型证券投资基金。

公司下设股票投资、固定收益投资、中央交易、国际业务、品牌管理、渠道管理、互联网金融、机构理财、风险管理、监察稽核、信息技术、基金运营、公司财务、客户服务、综合管理、人力资源等部门和北京分公司、上海分公司、广州分公司。随着公司业务发展的需要,将对相关业务部门进行适当的调整。

基金管理人无任何处罚记录。

(二)主要人员情况

1、董事会成员基本情况

李琦先生,董事长,硕士研究生。历任天津市民政局事业处团委副书记,天津市人民政府法制办公室、天津市外经贸委办公室干部,天津信托有限责任公司条法处处长、总经理助理兼条法处处长。现任天津信托有限责任公司副总经理。

卢信群先生,副董事长,大学本科。历任君正国际投资(北京)有限公司研究员、研究部经理、投资部经理,乌海市君正科技有限责任公司副总裁,财务总监。现任北京博辉创新光电技术股份有限公司监事,君正国际投资(北京)有限公司董事,内蒙古君正能源化工股份有限公司董事、副总经理。

郭树强先生,董事,总经理,硕士研究生。历任华夏基金管理有限公司交易主管、基金经理、研究总监、机构投资总监、投资决策委员会委员、机构投资决策委员会主任、公司管委会委员、公司总经理助理。现任本公司总经理、投资总监。

漆腊水先生,独立董事,硕士研究生。历任福州军区军政干部学校教官、解放军军事交通学院教官、天津市体改委处长、副主任、天津市发改委副主任、天津国际工程咨询公司总经理。现任天津市工程咨询协会会长、天津市房地产发展(集团)股份有限公司独立董事、天津天保基建股份有限公司独立董事、天津海泰科技发展股份有限公司独立董事、天津天海汽车同步器有限公司独立董事、天津应大股份有限公司独立董事、中国国际经济贸易仲裁委员会仲裁员、天津市仲裁委员会仲裁员、天津财经大学客座教授。

田军先生,独立董事,博士研究生。历任中国人民解放军6410工厂宣传干事,国家物价局干部,英国伦敦政治经济学院国际经济研究中心研究员,中国经济学会(英国)秘书长、主席,英国Crosby-MTM公司副总裁,富地燃气投资有限公司总裁,富地石油集团公司副总裁、首席运营官,现任富地石油集团公司总裁。

王国华先生,独立董事,博士研究生。历任中央财经大学教授,中国银河证券股份有限公司稽核审计部副总经理,银河创新资本管理有限公司董事长、总经理。现任中国中投证券有限责任公司投行总部总经理,中央财经大学教授、博士生导师。

付岩先生,董事,大学本科。历任北洋(天津)物产集团有限公司期货部交易员,中国经济开发信托投资公司天津证券部投资部职员,顺驰(中国)地产有限公司资产管理部高级经理、天津信托有限责任公司投资银行部项目经理。现任天津信托有限责任公司自营业务部副经理。

2、监事会成员基本情况

苏钢先生,监事会主席,大学本科。历任博华资产管理有限公司副总经理,君正国际投资(北京)有限公司副总裁。现任北京博辉创新光电技术股份有限公司副董事长,北京君正投资管理顾问有限公司总经理,内蒙古君正能源化工股份有限公司董事。

韩海潮先生,监事,硕士研究生。历任三峡证券天津白堤路营业部、勤俭道营业部信息技术部经理,亚洲证券天津勤俭道营业部营运总监。现任本公司运营总监、信息技术总监兼信息技术部总经理。

张牡霞女士,监事,硕士研究生。历任新华社上海证券报财经要闻部记者、天弘基金市场部电子商务专员、电子商务部业务拓展主管、总经理助理,现任本公司互联网金融业务部副总经理。

3、高级管理人员基本情况

郭树强先生,董事,总经理,简历参见董事会成员基本情况。

陈钢先生,副总经理,硕士研究生。历任华龙证券公司固定收益部高级经理、北京宸星投资管理公司投资经理、兴业证券公司债券总部研究部经理、银华基金管理有限公司机构理财部高级经理、中国人寿资产管理有限公司固定收益部高级投资经理。2011年7月份加盟本公司,现任公司副总经理、资深基金经理、固定收益总监兼固定收益部总经理,分管公司固定收益投资业务。

周晓明先生,副总经理,硕士研究生。历任中国证券市场研究院设计中心及其下属北京标准股份制咨询公司经理、万通企业集团总裁助理、中工信托有限公司投资部副总、国信证券北京投资银行一部经理、北京证券投资银行部副总、嘉实基金市场部副总监、渠道部总监;香港汇富集团高级副总裁;工银瑞信基金市场部副总监;嘉实基金产品和营销总监;盛世基金拟任总经理。2011年8月加盟本公司,同月被任命为公司首席市场官,现任公司副总经理,分管公司电子商务业务。

宁辰先生,副总经理,硕士研究生。历任三峡证券投资分析师、亚洲证券天津勤俭道营业部部门经理和营销总监、亚洲证券天津管理总部总经理助理。2006年8月加盟本公司任市场部总经理,2011年4月任命为公司总经理助理,现任公司副总经理,分管分公司渠道销售业务。

张磊先生,副总经理,硕士研究生。历任清华兴业投资管理公司证券分析师、嘉实基金基金直销经理、泰信基金北京理财中心经理、华夏基金机构理财部总经理、九鼎投资管理有限公司副总经理和合伙人、北京杰思汉能资产管理公司执行总裁。2012年10月加盟本公司,2012年11月任命为公司总经理助理,现任公司副总经理,分管公司机构业务。

童建林先生,督察长,大学本科,高级会计师。历任当阳市产权证券交易中心财务部经理、副总经理,亚洲证券有限责任公司宜昌总部财务主管、宜昌营业部财务部经理、公司财务会计总部财务主管,华泰证券有限责任公司上海总部财务项目主管,本公司基金会计、监察稽核部副总经理、监察稽核部总经理。现任本公司督察长。

4、本基金拟任基金经理

李蕴炜先生,理学硕士,拥有8年证券从业年限。历任亚洲证券有限责任公司股票分析师、Ophedge investment services运营分析师。2007年加盟本公司,历任交易员、行业研究员、高级研究员、天弘精选混合型证券投资基金基金经理助理、天弘安康养老混合型证券投资基金基金经理、天弘永定价值成长股票型证券投资基金基金经理。现任天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)基金经理。

5、基金管理人投资决策委员会成员的姓名和职务

郭树强先生,董事、总经理,投资决策委员会主席、投资总监;

陈钢先生,本公司副总经理、固定收益总监兼固定收益部总经理、天弘永利债券型证券投资基金基金经理、天弘添利分级债券型证券投资基金基金经理、天弘丰利债券型证券投资基金(LOF)基金经理、天弘债券型发起式证券投资基金基金经理、天弘稳利定期开放债券型证券投资基金基金经理、天弘弘利债券型证券投资基金基金经理、天弘同利分级债券型证券投资基金基金经理;

钱文成先生,股票投资部副总经理、天弘精选混合证券投资基金基金经理、天弘周期策略股票型证券投资基金基金经理、天弘安康养老混合型证券投资基金基金经理、天弘通利混合型证券投资基金基金经理;

刘冬先生,投资部总经理助理、宏观策略分析师;

肖志刚先生,股票研究部总经理、天弘周期策略股票型证券投资基金基金经理、天弘精选混合证券投资基金基金经理、天弘永定价值成长股票型证券投资基金基金经理;

李蕴炜先生,股票研究部副总经理、天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)基金经理;

王登峰先生,天弘增利宝货币市场基金基金经理、天弘现金管家货币市场基金基金经理、天弘季加利理财债券型证券投资基金基金经理;

姜晓丽女士,天弘永利债券型证券投资基金基金经理、天弘安康养老混合型证券投资基金基金经理、天弘稳利定期开放债券型证券投资基金基金经理及天弘通利混合型证券投资基金基金经理。

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;
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、编制季度、半年度和年度基金报告;
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、法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他职责。

(四)基金管理人承诺

1、基金管理人遵守法律的承诺

本基金管理人承诺不从事违反《证券法》、《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》等法律法规的活动,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。

基金管理人禁止性行为的承诺

本基金管理人依法禁止从事以下行为:

(1)将其自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。

2、基金经理承诺

(1) 依照有关法律法规和基金合同的规定,本着勤勉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、被代理人、被代表人、受雇他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。
(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)基金管理人的风险管理与内部控制制度

1、风险管理的原则

(1)全面性原则:公司风险管理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;
(2)独立性原则:公司设立独立的监察稽核部,监察稽核部保持高度的独立性和权威性,负责对公司各部门风险控制工作进行稽核和检查;
(3)相互制约原则:公司及各部门在内部组织结构的设计上要形成一种相互制约的机制,建立不同岗位之间的制衡体系;
(4)定性和定量相结合原则:建立完备的风险管理指标体系,使风险管理更具客观性和操作性;
(5)重要性原则:公司的发展必须建立在风险控制完善和稳固的基础上,内部风险控制与公司业务发展同等重要。

2、风险管理和内部风险控制体系结构

公司的风险管理体系结构是一个分工明确、相互牵制的组织结构,由最高管理层对风险管理负最终责任,各个业务部门负责本部门的风险评估和监控,监察稽核部负责监察公司的风险管理措施的执行。具体而言,包括如下组成部分:

(1)董事会:负责监督检查公司的合法合规运营、内部控制、风险管理,从而控制公司的整体运营风险;
(2)督察长:独立行使督察权利,直接对董事会负责,及时向审计与风险控制委员会提交有关公司规范运作和风险控制方面的工作报告;
(3)投资决策委员会:负责指导基金财产的运作、制定本基金的资产配置方案和基本的投资策略;
(4)基金运作风险管理委员会:根据公司总体风险控制目标,将交易、运营风险控制目标和要求分配到各部门;讨论、协调各部门之间的风险管理过程;听取各部门风险管理工作方面的汇报,确定未来一段时间各部门应重点关注的风险点,并调整与改进相关的风险处理和控制策略;讨论向公司高级管理层提交的基金运作风险报告;
(5)监察稽核部:负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察,并为每一个部门的风险管理提供合规控制标准,使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标;
(6)风险管理部:通过投资交易系统的风控参数设置,保证各投资组合的投资比例合规;参与各投资组合新股申购、一级债申购、银行间交易等场外交易的风险识别与评估,保证各投资组合场外交易的事中合规控制;负责各投资组合投资绩效、风险的计量和控制;
(7)业务部门:风险管理是每一个业务部门最首要的责任。各部门的部门经理对本部门的风险负全部责任,负责履行公司的风险管理程序,负责本部门的风险管理系统的开发、执行和维护,用于识别、监控和降低风险。

3、内部控制制度综述

(1)风险控制制度

公司风险控制的目标为严格遵守国家法律法规、行业自律规定和公司各项规章制度,自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营风格;不断提高经营管理水平,在风险最小化的前提下,确保基金份额持有人利益最大化;建立行之有效的风险控制机制和制度,确保各项经营管理活动的健康运行与公司财产的安全完整;维护公司信誉,保持公司的良好形象。针对公司面临的各种风险,包括政策和市场风险,管理风险和职业道德风险,分别制定严格防范措施,并制定岗位分离制度、空间分离制度、作业流程制度、集中交易制度、信息披露制度、资料保全制度、保密制度和独立的监察稽核制度等相关制度。

(2)监察稽核制度

监察稽核工作是公司内部风险控制的重要环节。公司设督察长和监察稽核部。督察长全面负责公司的监察稽核工作,可在授权范围内列席公司任何会议,调阅公司任何档案材料,对基金资产运作、内部管理、制度执行及遵规守法情况进行内部监察、稽核,出具监察稽核报告,报公司董事会和中国证监会。如发现公司有重大违规行为,应立即向公司董事会和中国证监会报告。

监察稽核部具体执行监察稽核工作,并协助督察长工作。监察稽核部具有独立的检查权、独立的报告权、知晓权和建议权。具体负责对公司内部风险控制制度提出修改意见,并提交基金运作风险管理委员会;检查公司各部门执行内部管理制度的情况;监督公司资产运作、财务收支的合法性、合规性、合理性;监督基金财产运作的合法性、合规性、合理性;调查公司内部的违规事件;协助监管机关调查处理相关事项;负责员工的离任审计;协调外部审计事宜等。

(3)内部会计控制制度

建立了基金会计的工作制度及相应的操作控制规程,确保会计业务有章可循;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行相关业务的相互核查监督机制;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;为了确保基金资产的安全,公司严格规范基金清算交割工作,并在授权范围内,及时准确地完成基金清算;强化会计的事前、事中、事后监督和考核制度;为了防止会计数据的毁损、散失和泄密,制定了完善的档案保管和财务交接制度。

4、风险管理和内部风险控制的措施

(1)建立、健全内控体系,完善内控制度。公司建立、健全了内控结构,高管人员关于内控有明确的分工,确保各项业务活动有恰当的组织和授权,确保监察稽核工作是独立的,并得到高管人员的支持,同时置备操作手册,并定期更新;
(2)建立相互分离、相互制衡的内控机制。公司建立、健全了各项制度,做到基金经理分开、投资决策分开、基金交易集中,形成不同部门、不同岗位之间的制衡机制,从制度上减少和防范风险;
(3)建立、健全岗位责任制。公司建立、健全了岗位责任制,使每个员工都明确自己的任务、职责,并及时将各自工作领域中的风险隐患上报,以防范和减少风险;
(4)建立风险分类、识别、评估、报告、提示程序。公司建立了基金运作风险管理委员会,使用适合的程序,确认和评估与公司运作有关的风险;公司建立了自下而上的风险报告程序,对风险隐患进行层层汇报,使各个层次的人员及时掌握风险状况,从而以最快速度做出决策;
(5)建立内部监控系统。公司建立了有效的内部监控系统,如电脑预警系统、投资监控系统,能对可能出现的各种风险进行全面和实时的监控;
(6)使用数量化的风险管理手段。采取数量化、技术化的风险控制手段,建立数量化的风险管理模型,用以提示市场趋势、行业及个股的风险,以便公司及时采取有效的措施,对风险进行分散、控制和规避,尽可能地减少损失;
(7)提供足够的培训。公司制定了完整的培训计划,为所有员工提供足够和适当的培训,使员工明确其职责所在,控制风险。

5、基金管理人关于内部合规控制声明书

本公司确知建立、维护、维持和完善内部控制制度是本公司董事会及管理层的责任。本公司特别声明以上关于内部控制的披露真实、准确,并承诺将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)基金托管人情况

1、基本情况

名称:国泰君安证券股份有限公司
住所:上海浦东新区商城路618号
办公地址:上海市浦东新区银城中路168号29层
法定代表人:万建华
成立时间:1999年8月18日
组织形式:股份有限公司
注册资本:陆拾壹亿元人民币
存续期间:持续经营
基金托管业务批准文号:证监许可[2014]511号
联系人:胡凯
联系电话:021-38676666

国泰君安证券前身为国泰证券和君安证券,1999年8月18日两公司合并新设为国泰君安证券股份有限公司。截至2013年12月31日,国泰君安证券注册资本为61亿元人民币,直接设有5家境内子公司和1家境外子公司,并在全国设有30家分公司和195家证券营业部,是国内最早开展各类创新业务的券商之一。2008-2013年,公司连续六年在中国证监会证券公司分类评价中被评为A类AA级,为目前证券公司获得的最高评级。

2、主要人员情况

万建华先生,中国国籍,无境外居留权,1956年1月出生,中共党员,高级经济师,现任国泰君安董事长、党委书记。曾任职于人民银行总行;1993年加入招商银行,先后担任总行副行长、常务副行长,期间曾兼任国通证券(现招商证券)董事长、长城证券公司董事长、香港江南财务公司总经理等职;2001年主持筹建中国银联,2002年3月起担任中国银联党委书记、总裁;2007年8月起担任上海国际集团总裁、副董事长;2010年9月起任国泰君安党委书记,2010年12月起任国泰君安董事长、党委书记。

蒋忆明先生,中国国籍,无境外居留权,1963年11月出生,经济学硕士,会计师,现任国泰君安副总裁、财务总监。1990年7月参加工作,任深圳宇康太阳能有限公司财务部经理;1993年5月起历任君安财务顾问公司财务部副经理、经理,君安证券经纪业务部副总经理,资金计划部副总经理、总经理,财务总监;1999年8月起任国泰君安深圳分公司副总经理;2000年10月起任国泰君安总会计师;2004年3月起任国泰君安财务总监;2013年11月22日起任国泰君安副总裁、财务总监。

陈忠义先生,中国国籍,无境外居留权,1970年10月出生,经济学学士,中级经济师,现任国泰君安证券资产托管部总经理。1993年参加工作,曾任职于君安证券清算部总经理助理、国泰君安证券营运中心副总经理、光大证券营运管理总部总经理等职。“全国金融五一劳动奖章”、“金融服务能手”称号获得者,中国证券业协会托管结算专业委员会副主任委员,带领团队设计的“直通式证券清算质量管理国际化标准平台”,被评为上海市2011年度金融创新奖二等奖。2014年2月起任国泰君安证券资产托管部总经理。

国泰君安证券资产托管部,现有员工全部具备基金从业资格及本科以上学历,管理人员及业务骨干均具有多年基金、证券和银行的从业经验,从业人员囊括了经济师、会计师、注册会计师、律师、国际注册内部审计师等中高级专业技术职称及专业资格,专业背景覆盖了金融、会计、经济、法律、计算机等各领域,是一支诚实勤勉、积极进取、专业分布合理,职业技能优良的资产托管从业人员队伍。

3、基金托管业务经营情况

国泰君安证券于2013年4月3日取得私募基金综合托管业务资格,于2014年5月20日取得证券投资基金托管资格,可为各类公开募集基金、非公开募集基金提供托管服务。国泰君安证券坚守“诚信专业、质量为本”的服务宗旨,通过组建经验丰富的专业团队、搭建安全高效的业务系统,为基金份额持有人提供值得信赖的托管服务。

(二)基金托管人的内部控制制度

1、内部控制目标

严格遵守国家法律法规、行业规章及公司内相关管理规定,加强内部管理,保证资产托管部业务规章的健全和各项规章的贯彻执行,通过对各种风险的梳理、评估、监控,有效地实现对各项业务风险的监控和管理,确保业务稳健运行,保护基金份额持有人的合法权益。

2、内部控制组织结构

国泰君安证券在董事会中内设风险控制委员会,是公司风险管理的最高决策机构;公司在经营管理层面设置风险管理委员会,对公司经营风险实行统筹管理,对风险管理重大事项进行审议与决策;风险管理部门包括专职履行风险管理职责的风险管理部、合规部、法律部、稽核审计部,以及计划财务部、信息技术部、营运中心等履行其他风险管理职责的部门。(下转A34版)

天弘中证500指数型发起式证券投资基金基金份额发售公告

基金管理人:天弘基金管理有限公司
基金托管人:国泰君安证券股份有限公司
重要提示

1、天弘中证500指数型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)的募集已获中国证监会证监许可【2014】1364号文注册。中国证监会对本基金的注册并不代表中国证监会对本基金的风险和收益作出实质性判断、推荐或者保证。

2、本基金的基金管理人和注册登记机构为天弘基金管理有限公司(以下简称“本公司”),基金托管人为国泰君安证券股份有限公司(以下简称“国泰君安证券”)。

3、本基金为股票型基金,基金运作方式为契约型、开放式、发起式。

4、本基金份额的基金代码为000962。

5、本基金仅通过本公司直销系统(仅直销网点)进行公开发售。

6、本基金的发售期为自2015年1月19日至2015年1月19日止。

7、在本基金募集期间,本基金的发售对象为符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、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。

8、本基金不设最高认购限额,在本基金募集期内,通过本公司直销网点(不含网上交易)的首次认购单笔最低金额为10,000元,追加认购的单笔最低金额1,000元。

9、投资者欲认购本基金,须开立本公司基金账户,已经有该类账户的投资者不须另行开立。

10、本基金的认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有,其中利息转份额以基金注册登记机构的记录为准。

11、销售机构对投资者认购申请的受理并不表示对该申请的成功确认,而仅代表销售机构确实接收了认购申请,认购申请成功与否及其确认情况应以本基金《基金合同》生效后基金注册登记机构的确认为准。投资者在T日规定时间内提交的认购申请,应于T+1日通过本公司直销系统或客户服务中心查询认购申请是否被成功受理。投资者应于基金合同生效后通过本公司直销系统或客户服务中心查询认购确认份额。

12、本公告仅对本基金发售的有关事项和规定予以说明。投资者欲了解本基金的详细情况,请阅读2015年1月15日刊登在《中国证券报》上的《天弘中证500指数型发起式证券投资基金招募说明书》。本基金的招募说明书及本公告将同时发布在本公司网站(www.thfund.com.cn)。投资者亦可通过本公司网站了解本公司的详细情况和本基金发售的相关事宜。

13、开户、认购等事项的详细情况请向销售机构咨询。投资者可拨打本公司的客户服务电话(010)83571789、400-710-9999咨询购买事宜。

14、在募集期间,如出现增加发售机构的情形,本公司将及时公告。

15、本公司可综合各种情况对本基金的发售安排做适当调整。

16、风险提示:

证券投资基金是一种长期投资工具,其主要功能是分散投资,降低投资单一证券所带来的个别风险。基金投资不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具,投资者购买基金,既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益,也可能承担基金投资所带来的损失。

本基金为股票型基金,属证券投资基金中的较高风险收益品种。本基金并非保本基金,基金管理人并不能保证投资于本基金不会产生亏损。投资者应当认真阅读《基金合同》、《招募说明书》等基金法律文件,了解基金的风险收益特征,根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和自身的风险承受能力相适应,并通过基金管理人直销系统购买基金。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资者注意基金投资的“买者自负”原则,在做出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行负担。

一、基金募集基本情况

(一)基金名称及代码

基金名称:天弘中证500指数型发起式证券投资基金;
基金代码:000962。

(二)基金类型

股票型基金。

(三)基金运作方式

契约型、开放式、发起式。

(四)基金存续期限

不定期。

基金合同生效满三年之日(指自然日),若基金资产净值低于两亿元的,基金合同应当终止。《基金合同