

(上接A21版)

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.进行基金清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有关的信息披露事项;

9.按照规定召集基金份额持有人大会;

10.保守基金交易等商业秘密,不泄露基金份额持有人信息,不利用基金财产为本人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为;

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.履行法律法规及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《中华人民共和国证券法》的行为,并承诺建立健全内部控制制度,采取有效措施,防止违反基金合同的规定;

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,防止违反基金合同的规定;

3.基金管理人承诺严格遵守基金合同,并承诺建立健全内部控制制度,采取有效措施,防止违反基金合

同规定的行为;

4.基金管理人承诺加强人员管理,强化执业操守,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;

5.基金管理人承诺不从事其他法律规定禁止从事的行为。

(五)基金经理承诺

1.依照法律法规和基金合同的原则,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、配偶、子女或他人谋取利益;

3.利用基金财产为基金份额持有人以外的第三个人牟取利益;

4.向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失;

5.侵占、挪用基金财产;

6.法律、行政法规和中国证监会禁止的其他行为。

(六)基金管理人的声明

1.基金管理人承诺建立健全的内部控制制度,对基金管理人内部的各项工作进行监督和检查。

(1)全面性原则

公司设立独立的风险管理部,风险管理部保持高度的独立性和权威性,负责对公司各部风险管理工

作进行监督检查。

(3)相互制约原则

公司及各部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

建立完备的内部控制管理体系,使风险管理更具客观性和操作性。

2.风险管理的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明、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,各个业务部门负责人对风险管理评估和监控,风险管理部负责监督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

负责制定公司的风险管理政策,对风险管理负完全的和最终的责任。

(2)监事会

是公司常设的监察机构,对股东大会负责。监事会对公司财务、公司董事、总经理及其他高级管理人

员进行监督。

(3)合规审慎及风险管理委员会

作为董事会下设的专业委员会之一,对公司内部控制制度、监督稽核制度进行检查评估;审查公司财

务,对公司内部管理制度、投资决策程序和运作流程进行合规性审议;对公司资产与基金资产的经营进

行评估。

(4)风险控制委员会

为总经理下设的专业委员会之一,风险控制委员会负责拟定公司风险管理战略及政策,制定灾难

复原计划,制定和紧急情况处理制度,确保公司风险管理符合标准,就潜在风险与相关部门协调,审阅公司计

划报告,确保公司所有的风险管理、识别问题、评估各类风险,提出风险控制建议,使公司

在一种风险管理的环境中实现业务目标。

(5)监察稽核

监察稽核部负责设计及实施公司合规审计计划,检查公司各项业务的合规情况及监督公司内部规章

制度的执行情况,定期监督监测及公司管理层进行汇报。

(6)督察长

独立行使督权权利;直接对董事会负责;就内部控制制度和执行情况独立地履行检查、评价、报告、建

议和批评;定期和不定期地向董事会对公司内部控制执行情况进行检查。

(7)风险管理部门

风险管理部负责制定公司风险管理政策和防范及控制措施,组织执行,并为每一个部门的风险管理

系统提供帮助,汇总公司所有的风险管理、识别问题、评估各类风险,提出风险控制建议,使公司

在一种风险管理的环境中实现业务目标。

(8)监禁稽核部

监察稽核部负责设计及实施公司合规审计计划,检查公司各项业务的合规情况及监督公司内部规章

制度的执行情况,定期监督监测及公司管理层进行汇报。

(9)业务部门

风险管理部是每一个业务部门的主要责任,部门经理对本部门的风险负全部责任,负责履行公司的风

险管理政策,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。

(10)风险管理部内部风险控制的措施

(1)建立内部控制体系,完善内控制度

公司建立健全了内控体系,通过高管人员关于内控的明确分工,确保各项业务活动有恰当的组织和

授权,确保日常工作顺利进行,并得到高管理人员的支持,同时置备工作手册,并定期更新。

(2)建立相对分离、相互制约的内部控制机制

健全了各全维度制度,做到基金经分公开,投资决策公开,基金交易集中,形成不同部门、不同岗位

之间制衡机制,从制度上减少防范风险。

(3)建立、健全内岗轮岗制度

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的风险隐患上报,以消除和减少风险。

(4)建立风险分类、识别、评估、报告、提示程序

建立了风险评估机制,通过风险的识别、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

风险预警制度,对风险隐患进行跟踪汇报,使各个层次的人员及时掌握风险状况,从而以最快速度作出决

策。

(5)建立有效的内部监控系统

建立了足够的内部控制系统,如电脑预警系统、投资监控系统,对可能出现的各种风险进行全面

和动态的监控。

(6)使用现代化的风险控制手段

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,用以揭示指数趋势、行业及个股

的风险,对公司及分支机构有效的措施,对风险进行分析、控制和抑制,尽可能地减少损失。

(7)提供足够的培训

制定了完整的培训计划,为所有员工提供足够的培训,使员工明确其职责所在,控制风险。

四、基金托管人

(一)基本托管人情况

1.基本情况

名称:中信银行股份有限公司(以下简称简称:中信银行)

住所:北京市东城区朝阳门北大街9号富华大厦C座

办公地址:北京市东城区朝阳门北大街9号文化大厦

法定代表人:常振明

成立时间:1987年4月7日

组织形式:股份有限公司

注册资本:46737亿元人民币

存续期间:持续经营

基金托管业批准文号:证监基金字[2004]125号

联系人:中信银行资产管理部

联系电话:(010)65557000

经办部门:中信银行资产管理部

经办人:王伟

经办部门:中信银行资产管理部