鹏华新丝路指数分级证券投资基金招募说明书

鹏华基金管理有限公司
重要提示

本基金经2015年4月29日中国证券监督管理委员会下发的《关于核准鹏华新丝路指数分级证券投资基金募集的批复》（证监许可［2015］766号文）注册，进行募集。

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。中国证监会不对基金的投资价值和市场前景等作出实质性判断或保证。

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，包括但不限于：市场风险、管理风险、操作风险、流动性风险、信用风险、本基金特有风险（包括作为指数基金的风险、作为上市基金的风险和作为分级基金的风险）及其他风险，等等。

本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，为证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。同时本基金为指数基金，通过跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。

从本基金所分拆的两类基金份额来看，鹏华新丝路A分额为稳健收益类份额，具有低风险且预期收益相对较低的特征；鹏华新丝路B分额为积极收益类份额，具有高风险且预期收益相对较高的特征。

基金的过往业绩并不预示其未来表现，基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金表现的保证。

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人基金投资的“买者自负”原则，在投资人作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行承担。投资有风险，投资人在投资本基金前应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同等信息披露文件，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。

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》”）、《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》”）等有关法律法规的规定，以及《鹏华新丝路指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）的约定编写。

本招募说明书确述了鹏华新丝路指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”或“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，并经中国证监会注册。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

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：指鹏华新丝路指数分级证券投资基金
2、基金管理人：指鹏华基金管理有限公司
3、基金托管人：指招商银行股份有限公司
4、基金合同：指《鹏华新丝路指数分级证券投资基金基金合同》及对该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《鹏华新丝路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
6、招募说明书或本招募说明书：指《鹏华新丝路指数分级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《鹏华新丝路指数分级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，并经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、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
20、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，按其持有的基金份额不同，可区分为鹏华新丝路A份额持有人、鹏华新丝路B份额持有人及鹏华新丝路A份额持有人及鹏华新丝路B份额持有人
21、基金销售业务：指通过鹏华基金管理人以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、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务
22、销售机构：指鹏华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代理协议，代为办理基金销售业务的场外机构，以及可通过上海证券交易所交易系统办理基金销售业务的会员单位
23、场外：指通过上海证券交易所交易系统外的销售机构利用其自身柜台或其他交易系统办理本基金基金份额的认购、申购和赎回的场所。通过该等场所办理基金份额的认购、申购和赎回也称为场外认购、场外申购和场外赎回
24、场内：指通过具有相应业务资格的上海证券交易所会员单位利用上海证券交易所交易系统办理本基金基金份额的认购、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
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开放式基金账户、上海证券账户的建立和管理、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。基金的登记机构为鹏华基金管理有限公司或接受鹏华基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构，本基金的登记机构为中国证券登记结算有限责任公司
27、登记结算系统：指中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统，登记在该系统的基金份额也称为场外份额
28、证券登记系统：指中国证券登记结算有限责任公司上海分公司证券登记系统，登记在该系统的基金份额也称为场内份额
29、开放式基金账户：指投资人通过场外销售机构在中国证券登记结算有限责任公司注册的、用于记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户
30、上海证券账户：指投资人在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司开设的上海证券交易所人民币普通股票账户（即A股账户）或证券投资基金账户
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而引起的基金份额变动及结余情况的账户
32、标的指数：指鹏华新丝路指数
33、基金份额：指鹏华新丝路份额、鹏华新丝路A份额和/或鹏华新丝路B份额
34、鹏华新丝路份额：指鹏华新丝路指数分级证券投资基金之基础份额
35、鹏华新丝路A份额：指鹏华新丝路指数分级证券投资基金之A份额，固低风险且预期收益相对较低的稳健收益类份额
36、鹏华新丝路B份额：指鹏华新丝路指数分级证券投资基金之B份额，固高风险且预期收益相对较高的积极收益类份额
37、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
38、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
39、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
40、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限
41、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日
42、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
43、T+n日：指自T日起第n个工作日（不包含T日）
44、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
45、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
46、认购：指在基金募集期内，投资人申请购买基金份额的行为
47、上市交易：指基金投资者通过上海证券交易所会员单位以集中竞价的方式买卖基金份额的行为
48、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
49、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将基金份额兑换为现金的行为
50、巨额赎回：指本基金单个开放日，鹏华新丝路份额净赎回申请（赎回申请总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请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（包括鹏华新丝路份额、鹏华新丝路A份额、鹏华新丝路B份额）的10%
51、配对转换：指鹏华新丝路份额与鹏华新丝路A份额、鹏华新丝路B份额之间按约定的转换规则进行转换的行为，包括基金份额的分拆和合并
52、分拆：指基金份额持有人将其持有的场内鹏华新丝路份额按照2份场内鹏华新丝路份额对应1份鹏华新丝路A份额与1份鹏华新丝路B份额的比例进行转换的行为
53、合并：指基金份额持有人将其持有的鹏华新丝路A份额与鹏华新丝路B份额按照1份鹏华新丝路A份额与1份鹏华新丝路B份额对应2份场内鹏华新丝路份额的比例进行转换的行为
54、折算：指在基金份额持有人所持基金资产净值不变的前提下，由基金管理人按照一定比例调整鹏华新丝路份额净值、鹏华新丝路A份额参考净值和/或鹏华新丝路B份额参考净值，使得基金份额持有人所持基金份额相应变化的行为，包括定期折算和不定期折算
55、定期折算：指基金管理人按一定的周期进行的基金份额折算的行为
56、不定期折算：指当鹏华新丝路份额净值、鹏华新丝路A份额参考净值和/或鹏华新丝路B份额参考净值满足一定的条件时，基金管理人进行的基金份额折算行为
57、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
58、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，包括系统内转托管和跨系统转托管
59、系统内转托管：指投资者将持有的基金份额在登记结算系统内不同销售机构（网点）之间进行转托管的行为
60、跨系统转托管：指投资者将持有的鹏华新丝路份额在登记结算系统和证券登记系统之间进行转托管的行为
61、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基金申购申请的一种投资方式
62、元：指人民币元
63、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
64、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
65、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值
66、基金份额净值：指每一份基金份额所代表的基金资产净值，按基金份额的不同，可区分为鹏华新丝路份额净值、鹏华新丝路A份额净值、鹏华新丝路B份额净值
67、基金份额参考净值：指在基金份额净值计算的基础上，根据基金合同给定的计算公式得到的基金份额估算价值，按基金份额的不同，可区分为鹏华新丝路A份额参考净值、鹏华新丝路B份额参考净值。基金份额参考净值是对基金份额价值的一个估算，并不代表基金份额持有人可获得的实际价值
68、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
69、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
70、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
1、名称：鹏华基金管理有限公司
2、住所：深圳市福田区福华三路168号深圳国际商会中心43层
3、设立日期：1998年12月22日
4、法定代表人：何如
5、办公地址：深圳市福田区福华三路168号深圳国际商会中心43层
6、电话：（0755）82021233 传真：（0755）82021155
7、联系人：吕奇志
8、注册资本：人民币15亿元
9、股权结构：

出资人名称	出资额（万元）	出资比例
国信证券股份有限公司	7,500	50%
意大利欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）	7,350	49%
深圳市北融信投资发展有限公司	150	1%
总 计	15,000	100%

（二）主要人员情况
1、基金管理人董事会成员
何如先生，董事长，硕士，高级会计师，国籍：中国。历任中国电子器件公司深圳公司副总会计师兼财务处处长、总会计师、常务副总经理、总经理、党委书记，深圳发展银行行长助理、副行长、党委委员、副董事长、行长、党委副书记，现任国信证券股份有限公司董事长、党委书记，鹏华基金管理有限公司董事长。
邓召明先生，董事，经济学博士，讲师，国籍：中国。历任北京理工大学管理与经济学院讲师、中国兵器工业总公司主任科员、中国证监会处长、南方基金管理有限公司副总经理，现任鹏华基金管理有限公司总裁、党总支书记。
孙煜扬先生，董事，经济学博士，国籍：中国。历任贵州省政府经济体制改革委员会主任科员、中共深圳市委政策研究室副处长、深圳证券结算公司常务副总经理、深圳证券交易所首任行政总监、香港深证（集团）有限公司助理总经理、香港深业控股有限公司副总经理、中国高新技术产业投资管理有限公司董事长兼行政总裁、鹏华基金管理有限公司董事总裁、国信证券股份有限公司副总裁，现任国信证券股份有限公司顾问。
周中国先生，董事，会计学硕士研究生，国籍：中国。曾任深圳市华为技术有限公司定价中心经理助理；2000年7月起历任国信证券有限责任公司资金财务总部业务经理、外派财务经理、高级经理、总经理助理、副总经理、人力资源总部副总经理；2015年4月至今任国信证券股份有限公司资金财务总部副总经理。
Massimo Mazzini先生，董事，经济和商学学士。国籍：意大利。曾在安达信（Arthur Andersen MBA）从事风险管理和资产管理工作，历任CA AIPG SGR投资总监、CAAM AI SGR及CA AIPG SGR首席执行官和投资总监、东方汇理资产管理股份有限公司（CAAM SGR）投资副总监、农业信贷另类投资集团（Credit Agricole Alternative Investments Group）国际执行委员会委员、欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）投资方案部投资总监、Epsilon 资产管理股份公司（Epsilon SGR）首席执行官，现任欧利盛资本股份公司（Eurizon Capital S.A.）（卢森堡）董席执行官和总经理。
Alessandro Varaldo先生，董事，经济学和商业管理博士，国籍：意大利。曾任米兰德意志银行集团Finanza e Futuro Fondi Sprind股份公司投资管理部债券基金和现金头寸管理高级经理，IMI Fideuram资产管理股份公司投资管理部固定收益组合和现金管理业务负责人，圣保罗银行投资公司（Banca Sanpaolo Invest S.p.A.）财务及管销策划部负责人，Capitalia股份公司（Capitalia S.p.A.）产品和销售部负责人，Capitalia投资管理股份公司（Capitalia Investment Management S.A.）董事总经理，Unicredit Holding财务风险管理部意大利企业法人风险管理业务负责人，欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）首席市场官、欧利盛资本股份公司（Eurizon Capital S.A.）（卢森堡）董事，现任意大利联合圣保罗银行股份有限公司（Intesa Sanpaolo S.p.A.）储蓄、投资和养老金产品部负责人。
史际春先生，独立董事，法学博士，国籍：中国。历任安徽大学讲师、中国人民大学副教授，现任中国人民大学法学院教授、博士生导师，国务院特殊津贴专家，兼任中国法学会经济法学研究会副会长、北京市人大常委会和法制委员会委员。
张元先生，独立董事，大学本科，国籍：中国。曾任新疆军区干事、秘书、编辑，甘肃省委研究室干事、副处长、处长、副主任，中央金融工作委员会研究室主任，中国银监会政策法规部（研究局）主任（局长）等职务；2005年6月至2007年12月，任中央国债登记结算有限责任公司董事长兼党委书记；2007年12月至2010年12月，任中央国债登记结算有限责任公司监事长兼党委副书记。
高骏女士，独立董事，工商管理硕士，国籍：中国。曾任中国进出口银行副处长、负责贷款管理和运营，项目涉及制造业、能源、电信、购国并购；2007年加入曼达林投资顾问有限公司，现任曼达林投资顾问有限公司执行合伙人。
2、基金管理人监事会成员
黄俞先生，监事会主席，研究生学历，国籍：中国。曾在中农信公司、正大财务公司工作，曾任鹏华基金管理有限公司董事、监事，现任深圳市北融信投资发展有限公司董事长。
Andrea Vismara先生，监事，法学学士，律师，国籍：意大利。曾在意大利多家律师事务所担任律师，先后在法国农业信贷集团（Credit Agricole Group）东方汇理资产管理股份有限公司（CAAM SGR）法务部、产品开发部、欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）治理与股权部工作，现在欧利盛资本资产管理股份公司运营部工作。
陈冰女士，监事，本科学历，国籍：中国。曾任国信证券股份有限公司资金财务部会计、上海营业部财务科副科长、资金财务科副经理、资金财务部资金科经理、资金财务部主任会计师兼科经理、资金财务部总经理助理、资金财务总部副总经理等，现任国信证券资金财务总部副总经理兼资金运营部总经理、融资融券部总经理。
苏波先生，职工监事，博士，国籍：中国。历任深圳经济特区证券公司研究所副所长、投资部经理，南方基金管理有限公司投研部研究员、客户服务主管、西部理财中心总经理、渠道服务二部总监助理，易方达基金管理有限公司信息技术部总经理助理；2008年11月加盟鹏华基金管理有限公司，现任鹏华基金管理有限公司总裁助理、机构理财部总经理。
刘慧红女士，职工监事，本科学历，国籍：中国。曾在中国工商银行深圳分行、平安证券公司工作，1998年12月加盟鹏华基金管理有限公司，历任登记结算部副总经理，现任公司登记结算部执行总经理。
于丹女士，职工监事，法学硕士，国籍：中国。历任北京市金杜律师事务所律师；2011年7月加盟鹏华基金管理有限公司，现任监察稽核部法务主管，现任监察稽核部总经理助理。
3、高级管理人员情况
何如先生，董事长，简历同前。
邓召明先生，董事，总裁，简历同前。
高阳先生，副总裁，特许金融分析师（CFA），经济学硕士，国籍：中国。历任中国国际金融有限公司经理，博时基金管理有限公司博时价值增长基金基金经理、固定收益部总经理、基金裕泽基金经理、基金裕隆基金经理、股票投资部总经理，现任鹏华基金管理有限公司副总裁。
胡甫先生，副总裁，经济学硕士，国籍：中国。曾就职于全国社会保障基金理事会投资部、境外投资部，现任鹏华基金管理有限公司副总裁。
高鹏先生，副总裁，经济学硕士，国籍：中国。历任博时基金管理有限公司监察法律部监察稽核经理，鹏华基金管理有限公司监察稽核部副总经理、监察稽核部总经理、职工监事、督察长，现任鹏华基金管理有限公司副总裁。
高永杰，督察长，法学硕士，国籍：中国。历任中共中央办公厅秘书局干部、中国证监会办公厅新闻处干部、秘书处副处级秘书、发行监管部副处长、人事教育部副处长、处长，现任鹏华基金管理有限公司督察长、监察稽核部总经理。
4、本基金拟任基金经理
焦文龙先生，经济学硕士，6年证券从业经验。2009年6月加盟鹏华基金管理有限公司，历任监察稽核部金融工程师，现任量化及衍生品投资部资深量化研究员，从事量化研究工作。焦文龙先生具备基金从业资格。
5、投资决策委员会成员情况
邓召明先生，鹏华基金管理有限公司董事、总裁、党总支书记。
高阳先生，鹏华基金管理有限公司副总裁。
初冬女士，鹏华基金管理有限公司总裁助理、固定收益投资总监、固定收益部总经理，社保基金组合投资经理及鹏华丰盛稳固收益债券基金、鹏华双债增利债券基金、鹏华双债加利债券基金基金经理。
冀洪涛先生，鹏华基金管理有限公司总裁助理、机构投资部总经理，社保基金组合投资经理。
程世杰先生，鹏华基金管理有限公司首席权益投资官，鹏华价值优势基金基金经理。
黄鑫先生，鹏华基金管理有限公司基金管理部总经理、鹏华动力增长基金、鹏华品牌传承混合基金基金经理。
王咏辉先生，鹏华基金管理有限公司量化及衍生品投资部总经理，鹏华中证500指数（LOF）基金、鹏华地产分级基金、鹏华沪深300指数（LOF）基金基金经理。
阳先伟先生，鹏华基金管理有限公司固定收益部执行总经理，鹏华丰收债券基金、鹏华双债保利债券基金、鹏华可转债债券基金基金经理。
陈鹏先生，鹏华基金管理有限公司基金管理部副总经理，鹏华中国50混合基金基金经理，鹏华消费领先混合基金基金经理。
6、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、依法募集资金，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募集、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，确定鹏华新丝路份额申购、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、按照规定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、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》、《基金法》、《销售办法》、《运作办法》、《信息披露办法》等法律法规的行为，并承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违法行为的发生。
2、基金管理人的禁止行为：
（1）将基金管理人固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
（2）不公平地对待公司管理的不同基金财产；
（3）利用基金财产或者职务之便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）侵占、挪用基金财产；
（6）泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
（7）玩忽职守，不按照规定履行职责；
（8）法律、行政法规以及中国证监会禁止的其他行为。
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）违反法律法规、基金合同或托管协议；
（3）故意损害基金份额持有人或基金合同其他当事人的合法权益；
（4）在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；
（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，不按照规定履行职责；
（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，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
（8）除按本基金管理人制度进行基金运作投资外，直接或间接进行其他股票投资；
（9）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；
（10）违反证券交易所业务规则，利用对敲、倒仓等非法手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；
（11）贬损同行，以提高自己；
（12）在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成份；
（13）以不正当手段谋求业务发展；
（14）有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；
（15）其他法律、行政法规禁止的行为。
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）不得利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者牟取利益；
（3）不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，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
（4）不从事损害基金财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、内控控制的原则
基金管理人的内部控制遵循以下原则：
（1）健全性原则：内部控制应当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、部门和岗位职责应当保持相对独立，公司基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离；
（4）相互制约原则：公司内部部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡；
（5）成本效益原则：公司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。
2、制订内部控制制度应当遵循以下原则：
（1）合法合规性原则：基金管理人内控制度应当符合国家法律、法规、规章和各项规定；
（2）全面性原则：内部控制制度应当涵盖基金管理人经营管理的各个环节，不得留有制度上的空白或漏洞；
（3）审慎性原则：制定内部控制制度应当以审慎经营、防范和化解风险为出发点；
（4）适时性原则：内部控制制度的制定应当随着有关法律法规的调整和基金管理人经营战略、经营方针、经营理念等内外部环境的变化进行及时的修改或完善。
3、内部控制体系
（1）董事会下设合规与风险控制委员会，主要负责制定基金管理人风险控制战略和控制政策、协调突发重大风险等事项。
（2）公司督察长负责对基金管理人各业务环节合法合规运作进行监督检查，组织、指导基金管理人内部监察稽核工作，并可向董事会和中国证监会直接报告。
（3）公司经营管理层、督察长、监察稽核部、公司各部门总经理定期召开会议对各类风险予以充分的评估和防范，对业务过程中潜在和存在的风险进行通报、讨论，并及时采取防范和控制措施。
（4）监察稽核部负责对基金管理人各部门的风险控制情况进行检查，定期不定期对业务部门内部控制制度执行情况和遵循国家法律、法规及其他规定的执行情况进行检查，并适时提出整改建议。
（5）业务部门：对本部门业务范围内的业务风险负有管控和及时报告的义务。
（6）员工：依照公司“全面风险管理、全员风险控制”的理念，公司每个员工均负有一线风险控制职责，负责把公司的风险控制理念和措施落实到每一个业务环节当中，并负有把业务过程中发现的风险隐患或风险问题及时进行报告、反馈的义务。
4、内部控制措施
（1）公司通过不断健全法人治理结构，充分发挥独立董事和监事会的监督职能，力争从源头上杜绝不正当关联交易、利益输送和内部人控制现象的发生，保护投资人利益和公司合法权益。
（2）管理层牢固树立了内控优先的风险管理理念，并着力培养全体员工的风险防范意识，营造浓厚的风险管理文化氛围，保证全体员工及时了解国家法律法规和公司规章制度，使风险意识贯穿公司各个部门、各个岗位和各个环节。
（3）公司依据自身经营特点建立了包括岗位自控、相关部门和岗位之间相互监督制衡、督察长和监察稽核部监督的、权责统一、严密有效的三道内控防线。
（4）建立并不断完善内部控制体系及内部控制制度：自成立来，公司不断完善内控组织架构、控制程序、控制措施以及控制职责，建立健全内部控制体系。通过不断地对内部控制制度进行修订和更新，公司的内部控制制度不断走向完善。
（5）建立健全各项管理制度和业务规章：公司建立了包括投资管理制度、基金会计制度、信息披露制度、监察稽核制度、信息技术管理制度、公司财务制度等基本管理制度以及包括岗位设置、岗位职责、操作流程手册在内的业务流程、规章等，从基本管理制度和业务流程上进行风险控制。
（6）建立了岗位分离、相互制衡的内控机制：公司在岗位设置上采取了严格的分离制度，实现了基金投资与交易、交易与清算、公司会计与基金会计等业务岗位的分离制度，形成了不同岗位之间的相互制衡机制，从岗位设置上减少和防范操作及操守风险。
（7）建立健全了岗位责任制：公司通过健全岗位责任制使每位员工都能明确自己的岗位职责和风险管理责任。
（8）构建风险管理系统：公司通过建立风险评估、预警、报告、控制以及监督程序，并经过适当的程序修订和完善，定期或实时对风险进行评估、预警、监督、从而识别、评估和预警与公司管理及基金运作有关的风险，通过明晰的报告渠道，对风险问题进行层层监督、管理、控制，使部门和管理层因时把握风险状况并及时、快速作出风险控制决策。
（9）建立自动化监督控制系统：公司启用了恒生安易系统以及自行开发的投资指标监控系统等计算机辅助控制系统，对投资比例限制、“禁止买入股票名单”、交叉交易等方面进行电子化控制，有效地防止了运作风险和操守风险。
（10）不断强化投资纪律，严格实施股票库制度：公司不断强化投资纪律，加强集体决策机制，各基金的行业配置比例、基金经理个股投权、基准仓位等由投资决策委员会决定。同时，公司建立了严格的股票库制度、禁止和限制投资股票制度，并由研究小组负责维护，所有股票投资必须完全从股票库中选择。公司还建立了契约风险评估制度，定期对各基金遵守基金合同的情况进行评估，防范契约风险。
5、基金管理人关于内部合规控制书的声明
（1）基金管理人确知建立、实施和维持内部控制制度是基金管理人董事会及管理层的责任；
（2）本基金管理人承诺以上关于内部控制的披露真实、准确；
（3）本基金管理人承诺根据市场变化和公司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）基金托管人情况
1、基本情况
名称：招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）
设立日期：1987年4月8日
注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦
注册资本：252.198亿元
法定代表人：李建红
行长：田惠宇
资产托管业务批准文号：证监基金字[2002]83号
电话：0755—83077301
传真：0755—83195201
资产托管部信息披露负责人：朱万鹏
招商银行成立于1987年4月8日，是我国第一家完全由企业法人持股的股份制商业银行，总行设在深圳。自成立以来，招商银行先后进行了三次增资扩股，并于2002年3月成功地发行了15亿A股，4月9日在上交所挂牌（股票代码：600036），是国内第一家采用国际会计标准上市的公司。2006年9月又成功发行了22亿H股，9月22日在香港联交所挂牌交易（股票代码：3968），10月5日行使H股超额配售，其发行了242亿H股。截止2014年9月30日，本集团总资产5.0331万亿元人民币，高级法下资本充足率11.45%，权重法下资本充足率10.89%。
2002年8月，招商银行成立基金托管部；2005年8月，经报中国证监会同意，更名为资产托管部，下设业务支持室、产品管理室、业务营运室、稽核监察室、基金外包业务室5个职能处室，现有员工60人。2002年11月，经中国人民银行和中国证监会批准获得证券投资基金托管业务资格，成为国内第一家获得该项业务资格上市银行；2003年4月，正式办理基金托管业务。招商银行作为托管业务资质最全的商业银行，拥有证券投资基金托管、受托投资管理托管、合格境外机构投资者托管（QFII）、全国社会保障基金托管、保险资金托管、企业年金基金托管等业务资格。
招商银行确立“因势而变、先您所想”的托管理念和“财富所托、信守承诺”的托管核心价值，独创“6S托管银行”品牌体系，以“保护您的业务、保护您的财富”为历史使命，不断创新托管系统、服务和产品：在业内率先推出“网上托管银行系统”、托管业务综合系统和“6心”托管服务标准，首家发布私募基金绩效分析报告，开办国内首个托管银行网站，成功托管国内第一只券商集合资产管理计划、第一只FOF、第一只信托资金计划、第一只股权私募基金、第一家实现货币市场基金赎回资金T+1到账、第一只境外银行ODII基金、第一只红利ETF基金、第一只“1+N”基金专户理财、第一家大小非解禁资产、第一单TOT受托管，实现从单一托管服务商向全面投资者服务机构的转变，得到了同业认可。
经过十年发展，招商银行资产托管规模快速壮大。2013年招商银行加大商收益托管产品营销力度，新增托管公募开放式基金18只，新增首发公募开放式基金托管规模达到1.5亿元。克服国内证券市场震荡下行的不利形势，托管费收入、托管资产均创出历史新高，实现托管费收入1.062亿元，较上年增长62.47%，托管资产余额1.86万亿元，较年初增长71.86%。作为公益慈善基金的首个独立第三方托管人，成功签约“壹基金”公益资金托管，为我国公益慈善资金监管、信息披露进行有益探索，该项目荣获2012中国金融品牌「金象奖」“十大公益项目”奖；四度蝉联获《财资》“中国最佳托管专业银行”。
2、主要人员情况
李建红先生，本行董事长、非执行董事，2014 年 7 月起担任本行董事、董事长。英国东伦敦大学工商管理硕士、吉林大学经济管理专业硕士，高级经济师。招商局集团有限公司董事长，兼任招商局国际有限公司董事会主席、招商局能源运输股份有限公司董事长、中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司董事长、招商局华建公路投资有限公司董事长和招商局资本投资有限责任公司董事长。曾任中国远洋运输（集团）总公司总裁助理、总经济师、副总裁，招商局集团有限公司董事、总裁。
田惠宇先生，本行行长、执行董事，2013 年 5 月起担任本行行长、本行执行董事。美国哥伦比亚大学公共管理硕士学位，高级经济师。曾于 2003 年7 月至2013 年 5 月历任上海银行副行长、中国建设银行上海市分行副行长、深圳市分行行长、中国建设银行零售业务总监兼北京市分行行长。
丁伟先生，本行副行长。大学本科毕业，副研究员。1996 年 12 月加入本行，历任杭州分行办公室主任兼营业部总经理、杭州分行行长助理、副行长、南京支行行长，南昌分行行长，总行人力资源部总经理，总行行长助理，2008 年 4 月起任本行副行长。兼任招银国际金融有限公司董事长。
姜然女士，招商银行资产托管部总经理，大学本科毕业，具有基金托管人高级管理人员任职资格。先后供职于中国农业银行黑龙江省分行，华商银行，中国农业银行深圳市分行，从事信贷管理、托管工作。2002 年 9 月加盟招商银行至今，历任招商银行总行资产托管部经理、高级经理、总经理助理等职。是国内首家推出的网上托管银行的主要设计、开发者之一，具有 20 余年银行信贷及托管专业从业经验。在托管产品创新、服务流程优化、市场营销及客户关系管理等领域具有深入的研究和丰富的实务经验。
3、基金托管业务经营情况
截至2014年11月 30日，招商银行股份有限公司托管了招商安泰系列证券投资基金（含招商股票证券投资基金、招商平衡型证券投资基金和招商债券证券投资基金），招商现金增值开放式证券投资基金、华夏经典配置混合型证券投资基金、长城久泰沪深 300 指数证券投资基金、华夏货币市场基金、光大保德信货币市场基金、华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金、海富通强化回报混合型证券投资基金、