长盛中证全指证券公司指数分级证券投资基金招募说明书

基金管理人:长盛基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

重要提示

本基金2015年6月3日经中国证券监督管理委员会证监许可（2015）1127号文注册募集。

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。

本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动而波动,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。

投资本基金的风险包括:因政治、经济、社会等环境因素对证券市场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积极管理风险,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,以及由于本基金股票资产投资比例为85%以上,其中标的指数成份股及其备选成份股的投资比例不低于非现金基金资产的80%产生的特定风险等。运作过程中,本基金共有三类基金份额,分别为长盛中证证券公司份额、长盛中证证券公司A份额、长盛中证证券公司B份额。其中长盛中证证券公司份额为普通的股票型指数基金,具有较高风险、较高预期收益的特征;长盛中证证券公司A份额的风险与预期收益较低;长盛中证证券公司B份额采用了杠杆式的结构,风险和预期收益有所放大,将高于普通的股票型基金。

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,但不保证投资本基金一定盈利,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,由投资人自行负责。

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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）和其他相关法律法规的规定及《长盛中证全指证券公司指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）等编写。

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。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人的当事人,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

1、基金或本基金:指长盛中证全指证券公司指数分级证券投资基金

2、基金管理人:指长盛基金管理有限公司

3、基金托管人:指中国农业银行股份有限公司

4、基金合同:指《长盛中证全指证券公司指数分级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《长盛中证全指证券公司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《长盛中证全指证券公司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《长盛中证全指证券公司指数分级证券投资基金基金份额发售公告》

8、《上市交易公告书》:指《长盛中证全指证券公司指数分级证券投资基金之长盛中证证券公司份额、长盛中证证券公司A份额和长盛中证证券公司B份额上市交易公告书》

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》:指2012年12月28日经第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议通过,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

11、《销售办法》:指中国证监会2013年3月15日颁布、同年6月1日起实施的《证券投资基金销售管理办法》及不时做出的修订

12、《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

13、《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

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: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、长盛中证证券公司份额:指长盛中证全指证券公司指数分级证券投资基金之基础份额

23、长盛中证证券公司A份额:指长盛中证证券公司分级份额按基金合同约定规则所分离的稳健收益类份额

24、长盛中证证券公司B份额:指长盛中证证券公司分级份额按基金合同约定规则所分离的积极收益类份额

25、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

26、销售机构:指基金管理人以及符合《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,为办理基金销售业务的机构

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

28、注册登记机构:指办理本基金注册登记业务的机构。本基金的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司

29、注册登记系统: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,通过场外销售机构认购、申购的基金份额登记在本系统

30、证券登记结算系统:中国证券登记结算有限责任公司上海分公司证券登记结算系统,通过场内会员单位认购、申购或买入的基金份额登记在本系统

31、开放式基金账户:指投资者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开放式基金账户。基金投资者办理场外认购、场外申购和场外赎回等业务时需具有开放式基金账户。记录在该账户下的基金份额登记在注册登记机构的注册登记系统

32、上海证券账户:指投资者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或证券投资基金账户。基金投资者通过上海证券交易所交易系统办理基金交易、场内认购、场内申购和场内赎回等业务时需持有上海证券账户。记录在该账户下的基金份额登记在注册登记机构的证券登记结算系统

33、业务规则:指上海证券交易所发布实施的《上海证券交易所开放式基金业务管理办法》、《上海证券交易所上市开放式基金业务指引》、《上海证券交易所证券投资基金上市规则》及对其不时做出的修订,中国证券登记结算有限责任公司发布实施的《中国证券登记结算有限责任公司上市开放式基金登记结算业务实施细则》及对其不时做出的修订,以及销售机构业务规则等相关业务规则和实施细则

34、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基金的基金份额变动及结余情况的账户

35、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

36、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,清算结果报告中国证监会备案并予以公告的日期

37、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,最长不得超过三个月

38、存续期:指基金合同生效至终止之间的不定期期限

39、工作日:指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

40、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

41、T+n日:指自T日起第n个工作日(不包含T日),n为自然数

42、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

43、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

44、认购:指在基金募集期内,投资人根据基金合同及招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

45、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

46、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

47、场外:指不通过上海证券交易所交易系统而通过自身的柜台或者其他交易系统办理基金份额认购、申购和赎回业务的基金销售机构和场所。通过该等场所办理基金份额的认购、申购、赎回也称为场外认购、场外申购、场外赎回

48、场内:指通过上海证券交易所会员单位和上海证券交易所交易系统办理基金份额认购、申购、赎回和上市交易业务的场所。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

49、场外份额:指登记在注册登记系统下的基金份额

50、场内份额:指登记在证券登记结算系统下的基金份额

51、基金转换:指基金份额持有人按照本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

52、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

53、巨额赎回:指本基金若本基金单个开放日内,长盛中证证券公司份额净赎回申请(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）超过上一日本基金总份额(包括长盛中证证券公司份额、长盛中证证券公司A份额、长盛中证证券公司B份额)的10%时的情形

54、标的指数:指中证全指证券公司指数

55、上市交易:基金存续期间投资者通过场内会员单位以集中竞价的方式买卖长盛中证证券公司份额、长盛中证证券公司A份额、长盛中证证券公司B份额的行为

56、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

57、系统内转托管:基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（交易单元）之间进行转登记的行为

58、跨系统转托管:基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统间进行转登记的行为

59、场内份额配对转换:指根据基金合同的约定,本基金场内的长盛中证证券公司份额与长盛中证证券公司A份额、长盛中证证券公司B份额之间按约定的转换规则进行转换的行为,包括分拆与合并

60、分拆:指根据基金合同约定,基金份额持有人将其所持有的每2份场内长盛中证证券公司份额分拆成1份长盛中证证券公司A份额与1份长盛中证证券公司B份额的行为

61、合并:指根据基金合同约定,基金份额持有人将其所持有的每1份长盛中证证券公司A份额与1份长盛中证证券公司B份额进行配对,申请转换为2份场内长盛中证证券公司份额的行为

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、银行存款利息以及其他合法收入

64、基金资产总值:指基金拥有的各类证券、银行存款本息和基金应收的款项以及其他投资所形成的价值总和

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、基金份额参考净值:在T日基金份额净值计算的基础上,采用“虚拟清算”原则,本基金按照基金合同约定的资产及收益的分配规则进行资产分配从而计算得到T日长盛中证证券公司A份额、长盛中证证券公司B份额的估算价值。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

67、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

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(参考)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:指本合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

71、中国:指中华人民共和国。就基金合同而言,不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区

三、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称:长盛基金管理有限公司

住所:深圳市福田中心区福中三路诺德金融中心主楼10D

办公地址:北京市海淀区北大资源大厦A座21层

法定代表人:高新

电话:(010)82019988

传真:(010)82255988

联系人:叶金松

本基金管理人经中国证监会证监基金字[1999]6号文件批准,于1999年3月26日成立,注册资本为人民币18900万元。截至目前,基金管理人股东及其出资比例为:国元证券股份有限公司(注册资本的41%);新加坡星展银行有限公司(注册资本的33%);安徽省信用担保集团有限公司(注册资本的13%);安徽省投资集团控股有限公司(注册资本的13%)。截至2015年6月30日,基金管理人共管理三十九只开放式基金和五只社保基金委托资产,同时管理专户理财产品。

（二）主要人员情况

1. 基金管理人董事会成员

高新先生,董事长,管理工程硕士。曾担任安徽省国际信托投资公司证券发行部副经理、证券营业部经理,安徽国元信托投资有限责任公司总经理助理,上海安中投资管理公司总经理,国元证券有限责任公司投资银行总部总经理、总裁助理、副总裁,国元证券股份有限公司副总裁。

蔡咏先生,董事,学士,高级经济师。曾任安徽财经大学财政金融系讲师、会计教研室主任,安徽省国际经济技术合作公司美国分公司财务经理,安徽省国际信托投资公司国际金融部经理、深圳证券部经理、证券总部副总经理,香港黄山有限公司总经理助理,国元证券股份有限公司董事、总裁、党委副书记。现任国元证券股份有限公司董事长、党委书记,兼任安徽国元控股(集团)有限责任公司党委委员、国元证券(香港)有限公司董事长。

钱万先生,董事,博士。曾任安徽省政府办公厅综合调研室干部、科员、副主任科员、一处副主任科员、主任科员、秘书一室主任科员、副调研员、副主任,安徽省政府金融工作办公室处长、综合处处长、副主任、党组成员,淮南市政府副市长。现任安徽省信用担保集团有限公司总经理、党委副书记。

陈翔先生,董事,硕士。曾任安徽省六安行署办公室秘书,副科长、科长、副主任,安徽省政府办公厅综合调研室助理调研员、副主任、调研员,安徽省政府办公厅一处处长、助理巡视员兼秘书一室主任、副主任、党组成员,安徽省政府副秘书长、安徽省政府办公厅党组成员,安徽省委统战部副部长,安徽省工商联党组书记、第一副主席,安徽省委非公有制经济和社会组织工作委员会副书记。现任安徽省投资集团控股有限公司董事长、党委书记。

葛甘牛先生,董事,硕士。曾任职多个金融机构,包括所罗门兄弟公司、瑞士信贷第一波士顿银行(香港)有限公司、美林集团、德意志银行、荷兰银行、中国银行股份有限公司、瑞士信贷银行股份有限公司、瑞信方正证券有限责任公司。现任星展银行(中国)有限公司董事、行长/行政总裁。

陈健元先生,董事,硕士。曾任职多个金融机构,包括高盛(亚洲)有限责任公司、巴克莱银行。现任星展银行(香港)有限公司董事总经理兼北亚洲区私人银行业务主管。

周兵先生,董事、总经理,经济学硕士。曾任中国银行总行综合计划部副主任科员、香港南洋商业银行内地融资部副经理、香港中银国际亚洲有限公司企业财务部经理、广发证券股份有限公司北京业务总部副总经理(期间兼任海南华银国际信托投资公司北京证券营业部托管组负责人)、北京朝阳门大街证券营业部总经理。2004年10月加入长盛基金管理有限公司,曾任公司副总经理。现任长盛基金管理有限公司总经理,兼任长盛基金(香港)有限公司董事长。

李伟强先生,独立董事,美国加州大学洛杉矶分校工商管理硕士,美国宾州州立大学政府管理硕士和法国文学硕士。曾任摩根士丹利组约、新加坡、香港等地投资顾问、副总裁,花旗环球金融亚洲有限公司高级副总裁。现任香港国际资本管理有限公司董事长。

张仁良先生,独立董事,博士,公共政策讲座教授。曾任香港消费者委员会有关银行界调查的项目协调人、水平洋经济合作理事会(PECC)属下公司管制研究小组主席、上海交通大学管理学院兼职教授、上海复旦大学顾问教授、香港城市大学讲座教授、香港浸会大学工商管理学院院长。现任香港教育学院校长、香港金融管理局ABF香港创富债券指数基金监督委员会主席。2007年被委任为太平绅士。2009年获香港特区政府颁发铜紫荆星章。

荣兆梓先生,独立董事,学士,教授。曾任安徽大学经济学院副院长、院长。现任安徽大学教授、校学术委员会委员、政治经济学博士点学科带头人,武汉大学学院博士生导师,中国科技大学兼职教授,安徽省政府决策咨询专家委员会委员,全国马经史学会理事,全国资本论研究会常务理事,安徽省经济学会副会长。

周放生先生,独立董事,在职研究生毕业。曾任国家国有资产管理局副处长、处长,国有资产管理研究所副所长,国家经贸委国有企业脱困工作办公室副主任,财政部财政科学研究所国有资产管理研究室主任,国务院国资委企业改革局副巡视员。现任中国企业改革与发展研究会副会长,中国外运股份有限公司独立监事,恒安国际集团有限公司独立董事,北京北斗星通导航技术股份有限公司独立董事,中航光电科技股份有限公司独立董事。

2. 监事会成员

陈新先生,监事会主席,硕士,经济师。曾担任交通银行淮南分行信贷员,安徽省国债服务中心投资副经理,香港黄山有限公司投资业务经理,国元证券有限责任公司投资管理总部总经理、总裁助理、副总裁。现任国元证券股份有限公司副总裁,兼公司董事会秘书,同时兼任国元期货有限公司董事,国元股权投资有限公司董事,国元证券(香港)有限公司董事。

吴达先生,监事,伦敦政治经济学院金融经济学硕士,特许金融分析师CFA。曾就职于新加坡星展资产管理有限公司,历任星展珊顿全球收益基金经理助理、星展增裕基金经理,新加坡毕盛高荣资产管理公司亚太专户投资组合经理、资产配置委员会成员,华夏基金管理有限公司国际策略分析师、固定收益投资经理。2007年8月起加入长盛基金管理有限公司,曾任长盛彩税配置债券型证券投资基金基金经理。现任长盛基金管理有限公司国际业务部总监,长盛环球景气行业太盛精选股票型证券投资基金基金经理,兼任长盛基金(香港)有限公司副总经理,长盛创富资产管理有限公司总经理。

魏晰诺先生,监事,英国雷丁大学硕士。历任中国人寿资产管理有限公司投资组合经理、高级组合经理,合众资产管理有限公司组合管理部总经理。2013年7月加入长盛基金管理有限公司,现任社保业务管理部总监,社保组合组合经理。

3. 管理层成员

高新先生,董事长,管理工程硕士。同上。

周兵先生,董事、总经理,经济学硕士。同上。

杨思乐先生,董事,拥有北京大学法学学士学位与英国伦敦政治经济学院硕士学位、特许另类投资分析师CAIA。从1992年9月开始曾先后任职于太古集团、摩根银行、野村项目融资有限公司、汇丰投资银行亚洲、美亚能源有限公司、康联马洪资产管理公司、星展银行有限公司(新加坡)。2007年8月起加入长盛基金管理有限公司,现任长盛基金管理有限公司副总经理,兼任长盛基金(香港)有限公司董事、总经理。

叶金松先生,大学,会计师。曾任美菱股份有限公司财会部经理,安徽省信托投资公司财会部副经理,国元证券有限责任公司清算中心主任、风险监管部副经理、经理。2004年10月起加入长盛基金管理有限公司,现任长盛基金管理有限公司督察长。

林培富先生,上海财经大学经济学硕士。曾任安徽省信托投资公司国际业务部科长、副经理,投资银行总部副经理、经理;国元证券有限责任公司基金公司筹备组负责人;2005年1月加入长盛基金管理有限公司,曾任公司总经理助理,现任长盛基金管理有限公司副总经理,兼任人力资源部总监、长盛基金(香港)有限公司董事、长盛创富资产管理有限公司执行董事。

王宁先生,EMBA。历任华夏基金管理有限公司基金经理助理,兴业基金经理等职务。2005年8月加盟长盛基金管理有限公司,曾任基金经理助理、长盛动态精选证券投资基金基金经理、长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金基金经理、长盛成长价值证券投资基金基金经理、长盛同庆中证800指数分级证券投资基金基金经理,公司总经理助理等职务。现任长盛基金管理有限公司副总经理,权益投资部总监,社保组合组合经理,长盛同智优势成长混合型证券投资基金(LOF)基金经理,长盛城镇化主题股票型证券投资基金基金经理,长盛同德主题增长股票型证券投资基金基金经理。

蔡宾先生,中央财经大学硕士,特许金融分析师CFA。历任宝盈基金管理有限公司研究员、基金经理助理。2006年2月加入长盛基金管理有限公司,曾任研究员、社保组合助理、投资经理,长盛彩极配置债券型证券投资基金基金经理、长盛同禧信用增利债券型证券投资基金基金经理,长盛同鑫保本混合型证券投资基金基金经理、长盛同鑫专业配置混合型证券投资基金基金经理,公司总经理助理等职务。现任长盛基金管理有限公司副总经理,固定收益部总监,社保组合组合经理,长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金基金经理。

4.本基金基金经理

冯雨生先生,1983年11月出生。北京大学金融学硕士,CFA(特许金融分析师)。2007年7月加入长盛基金管理有限公司,曾任金融工程与量化投资部金融工程研究员等职务。现任长盛中证100指数证券投资基金基金经理,长盛沪深300指数证券投资基金(LOF)基金经理,长盛高端装备制造灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金基金经理,长盛成长价值证券投资基金基金经理。拟任长盛中证全指证券公司指数分级证券投资基金基金经理。

5. 投资决策委员会成员

周兵先生,董事、总经理,经济学硕士。同上。

王宁先生,EMBA,副总经理。同上。

蔡宾先生,副总经理,中央财经大学硕士,特许金融分析师CFA。同上。

吴达先生,监事,伦敦政治经济学院金融经济学硕士,特许金融分析师CFA。同上。

魏晰诺先生,监事,英国雷丁大学硕士。同上。

刘旭明先生,清华大学管理学硕士。曾任中信证券研究部首席分析师、国信证券经济研究所首席分析师。2013年7月加入长盛基金管理有限公司,现任研究部总监,长盛生态环境主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛养老健康产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛转型升级主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金经理。

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发售、申购、赎回和注册登记事宜;

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、编制季度报告、中期和年度基金报告;

7、计算并公告基金资产净值、基金份额净值、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、有关法律、法规和中国证监会规定的其他职责。

（四）基金管理人承诺

1、基金管理人承诺严格遵守《基金法》及相关法律法规,建立健全的内部控制制度,采取有效措施,防止违反上述法律法规的行为发生;

2、基金管理人承诺防止下列禁止行为的发生:

（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。

3、基金经理承诺

（1）依照有关法律、法规和基金合同的规定,本着诚信的原则为基金份额持有人谋取最大利益;

（2）不能利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者谋取利益;

（3）不泄露在任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向内容,基金投资计划等信息;

（4）不协助、接受委托或以其它任何形式为其它组织或个人进行证券交易。

（五）基金管理人的内部控制制度

1、内部控制的原则

本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。公司各部门和岗位职责保持相对独立,基金资产、公司自有资产、委托理财及其他资产的运作应当分离。

（4）相互制约原则。公司及各部门在内部组织结构和岗位的设置上要权责分明、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。

（6）风险控制与业务发展并重原则。公司的发展必须建立在风险控制制度完善和健全的基础上,内部风险控制应与公司业务发展成正比例等地位上。

2、完备严密的内部控制体系

公司建立了“三层控制二道监督”（董事会—经营管理层—业务操作层、督察长—监察稽核部）内部控制组织体系。董事会下设的风险控制管理委员会定期或者不定期听取督察长关于风险控制方面的报告。督察长负责监督检查公司内部风险控制情况,组织指导公司监察稽核工作,对基金运作、内部管理、制度执行及遵规守法进行监察稽核;公司风险控制委员会定期对基金资产运作的风险进行评估,对存在的风险隐患或发现的风险问题进行研究;监察稽核部负责日常的风险监控工作,对公司各部门业务流程的风险控制工作进行监察稽核,并通过全面梳理与投资运作相关的法律、法规、基金合同及公司制度,从法规规制、合同规制、公司制度规制三个层面及时和全面揭示风险控制要素,明确风险点并标识各风险点所采用的控制工具与控制方法,使得对各风险点的监控真正落到实处。

3、内部控制制度的内容

公司严格按照《基金法》及其配套法规、《证券投资基金管理人的管理指导意见》等相关法律法规的规定,按照合法合规性、全面性、审慎性、适时性原则,建立健全内部控制制度。公司内部控制制度由内部控制大纲、基本管理制度和部门业务规章等三部分有机组成。

（1）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,是公司各项基本管理制度的纲要和总揽,内部控制大纲对内控目标、内控原则、控制环境、内控措施等内容加以明确。

（2）公司基本管理制度包括风险管理制度、稽核监察制度、投资管理制度、基金会计核算制度、信息技术管理制度、公司财务制度、资料档案管理制度、人力资源管理制度、人事任免制度、法律法规制度、内部控制制度、业务流程和操作守则等的具体说明。部门业务规章由公司相关部门依据公司章程和基本管理制度,并结合部门职责和业务运作的要求拟定,其制定和实施需报经公司总经理办公会批准。

公司的内部控制制度会随着市场的发展和金融创新来进行相关调整。公司各部门对规章制度的调整与更新情况由监察稽核部负责监督。

4、内部控制实施

（1）建立了详细的内部控制指引,使内部控制制度和各项控制措施能够得以有效实施;

（2）建立了严格评价程序,以评估控制制度建立后能得到执行。主要由监察稽核部定期或不定期地检查各个部门的工作流程,以纠正不符合公司规章制度的情况,对制度中存在的不合理情况,监察稽核部有权提请相关部门修改,同时报告总经理和公司督察长,以保证多重检查复核。

（3）建立了报告制度。报告制度能将内部控制制度中的实质性不足或控制失效及时向公司高级管理层和监管部门进行报告。公司的督察长定期向中国证监会和公司董事长出具监察稽核报告,指出近期存在的问题,提出改进的方法和时间。监察稽核部监督负责公司的日常监察稽核工作,定期向督察长出具检查报告。

5、基金管理人关于内部控制的声明

本公司确知建立内部控制制系统、维持其有效性以及有效执行内部控制制度是本公司董事会及管理层的责任,董事会承担最终责任;本公司特别声明以上关于内部控制和风险管理的披露真实、准确,并承诺根据市场的变化和公司的发展不断完善风险管理和内部控制制度。

四、基金托管人

（一）基金托管人情况

1、基本情况

名称: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:刘士余

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

截止2015年3月31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254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、汇盛证券投资基金、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债券投资基金、长信利息收益开放式证券投资基金、长城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、景顺长城内需增长灵活配置混合型证券投资基金、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、富国天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、富国天时转债债券型证券投资基金、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、易方达奕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、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联接基金、富国中证500指数增强型证券投资基金、长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金、中海消费主题精选股票型证券投资基金、长城环球景气精选股票型证券投资基金、长城核心竞争力股票型证券投资基金、景顺长城核心竞争力股票型证券投资基金、光大保德信行业轮动股票型证券投资基金、富兰克林国海亚洲(除日本)机会股票型证券投资基金、汇添富消费品精选股票型证券投资基金、鹏华刚保本混合型证券投资基金、汇添富财富增长债券型证券投资基金、嘉实全球房地产证券投资基金、长城久利分级债券型证券投资基金、长城久盛精选股票型证券投资基金、长城久兴保本混合型证券投资基金、长城久泰债券型证券投资基金、安信目标收益债券型证券投资基金、富国天利增利债券型证券投资基金、安信稳健增利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)、工银瑞信信用纯债债券型证券投资基金、工银瑞信中证企业债指数增强债券型证券投资基金、易方达月月利得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、国泰投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、金元惠理惠利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、招商双倍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