

(上接A17版)

3.公司高级管理人员及督察长
王彬女士,总经理,中国籍,香港中文大学工商管理硕士,兼任国投瑞银资产管理(香港)有限公司董事、国投瑞银基金(香港)有限公司董事。曾任国投泰康信托有限公司副总经理兼董事会秘书,国投瑞银基金管理有限公司副总经理兼董事会秘书,国信证券股份有限公司资产管理部副经理兼董事兼董事会秘书,北京国信电力开发投资有限公司资产管理部,北京市人民政府新闻处主任科员,北京天然气管道公司副总经理。
王鹏先生,副总经理,中国籍,北京航空航天大学工程硕士,兼任国投瑞银资产管理(香港)有限公司董事、国投瑞银基金(香港)有限公司董事。曾任国投泰康信托有限公司副总经理兼董事会秘书,国投瑞银基金管理有限公司副总经理兼董事会秘书,国信证券股份有限公司资产管理部副经理兼董事兼董事会秘书,北京国信电力开发投资有限公司资产管理部,北京市人民政府新闻处主任科员,北京天然气管道公司副总经理。

王鹏先生,副总经理,中国籍,北京航空航天大学工程硕士,兼任国投瑞银资产管理(香港)有限公司董事、国投瑞银基金(香港)有限公司董事。曾任国投泰康信托有限公司副总经理兼董事会秘书,国投瑞银基金管理有限公司副总经理兼董事会秘书,国信证券股份有限公司资产管理部副经理兼董事兼董事会秘书,北京国信电力开发投资有限公司资产管理部,北京市人民政府新闻处主任科员,北京天然气管道公司副总经理。
王鹏先生,副总经理,中国籍,北京航空航天大学工程硕士,兼任国投瑞银资产管理(香港)有限公司董事、国投瑞银基金(香港)有限公司董事。曾任国投泰康信托有限公司副总经理兼董事会秘书,国投瑞银基金管理有限公司副总经理兼董事会秘书,国信证券股份有限公司资产管理部副经理兼董事兼董事会秘书,北京国信电力开发投资有限公司资产管理部,北京市人民政府新闻处主任科员,北京天然气管道公司副总经理。

魏志忠先生,副总经理,中国籍,武汉大学经济学博士。曾任重庆建筑专科学校(现重庆大学)经济学教研组组长,武汉大学金融系副主任,副教授,国信证券有限公司综合研究部总经理,国投瑞银基金(香港)有限公司董事兼首席,产品开发部总监,渠道服务部总监,长城基金管理有限责任公司副董事长兼副总经理,北京分公司总经理,华南营销中心总经理,宝盈基金管理有限公司总经理,副经理。
王鹏先生,副总经理,中国籍,复旦大学工商管理学硕士,兼任国投瑞银资产管理(香港)有限公司董事、国投瑞银基金(香港)有限公司董事。曾任国投泰康信托有限公司副总经理兼董事会秘书,国投瑞银基金管理有限公司副总经理兼董事会秘书,国信证券股份有限公司资产管理部副经理兼董事兼董事会秘书,北京国信电力开发投资有限公司资产管理部,北京市人民政府新闻处主任科员,北京天然气管道公司副总经理。

- 1.投资决策委员会成员:魏志忠先生,副总经理
- 2.投资决策委员会召集人:魏志忠先生,副总经理
- 3.督察长:李海文先生,副总经理兼国投瑞银总部部门总经理
- 4.首席风险官:李海文先生,副总经理兼国投瑞银总部部门总经理
- 5.基金经理:魏志忠先生,副总经理
- 6.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 7.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 8.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 9.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 10.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 11.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 12.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 13.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 14.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 15.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 16.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 17.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 18.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 19.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 20.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 21.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 22.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 23.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 24.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 25.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 26.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 27.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 28.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 29.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 30.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 31.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 32.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 33.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 34.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 35.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 36.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 37.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 38.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 39.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 40.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 41.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 42.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 43.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 44.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 45.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 46.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 47.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 48.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 49.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 50.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 51.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 52.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 53.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 54.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 55.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 56.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 57.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 58.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 59.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 60.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 61.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 62.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 63.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 64.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 65.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 66.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 67.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 68.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 69.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 70.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 71.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 72.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 73.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 74.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 75.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 76.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 77.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 78.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 79.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 80.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 81.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 82.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 83.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 84.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 85.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 86.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 87.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 88.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 89.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 90.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 91.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 92.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 93.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 94.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 95.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 96.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 97.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 98.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 99.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理
- 100.基金经理助理:魏志忠先生,副总经理

1.中国证监会规定的其他职责。
(四) 基金管理人承诺
1.本基金管理人承诺严格遵守有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定,建立健全内部控制制度,采取有效措施,防止违反现行有效的有关法律、法规、规章和中国证监会监管有关规定的工作发生。
2.本基金管理人承诺严格遵守下列行为禁止性规定:
(1)其固有财产或者他人财产同于基金财产从事证券投资;
(2)不公平地对待本基金管理人管理的不同基金财产;
(3)利用基金财产或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)违规使用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)拒绝遵守,不按照规定履行职责;
(8)法律法规和中国证监会禁止的其他行为。
3.本基金管理人承诺加强人员管理,强化内部监控,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) 超越或违反规范;
(2) 违反基金合同或托管协议;
(3) 故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法权益;
(4) 在中国证监会规定的禁止性资料中违规操作;
(5) 拒绝、干挠、阻碍或严重影响中国证监会依法监管;
(6) 拒绝遵守、阻碍或违反;
(7) 违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定,泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、未依法公开披露的投资信息、承诺及其他信息;
(8) 违反证券交易所业务规则,利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格,扰乱市场秩序;

1. 勤勉尽责,以持有人利益优先为原则;
 2. 以正当方式谋求股东合法权益;
 3. 在对外公开信息披露中杜绝虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏;
 4. 其他法律、行政法规及中国证监会禁止的行为。
- (五) 基金治理结构
1. 维护基金份额持有人的利益。在基金份额持有人的利益与公司、股东及与股东有关联关系的机构和个人等的利益发生冲突时,坚持基金份额持有人利益优先的原则;
 2. 严格遵守法律、行政法规、中国证监会及基金合同的有关规定,执行行业自律规范和公司的各项规章制度,不为了基金业绩排名等实施拉抬抬市、打压股价等损害证券市场秩序的行为,或者进行其他违反规定的操作;
 3. 独立、客观地履行职责,在作出投资建议或者进行投资活动时,不受他人干预,在授权范围内决策,研究事项作出客观、公正的独立判断;
 4. 严格遵守公司信息管理的有关规定及聘用合同中的保密条款,不得利用未公开信息为自己或者他人谋取利益,不得违反有关规定向公司股东、与业务有关联的机构、公司其他部门工作人员及与经营活动有关的未公开信息;
 5. 不利用基金财产或职务便利管理基金财产之便向任何机构和个人进行利益输送,不得从事或者配合他人从事损害基金份额持有人利益的活动。

1. 基金管理人内部控制制度
 - (1) 在有效制衡的前提下,实现基金份额持有人利益最大化;
 - (2) 确保国家有关法律法规、行业法规和公司各项规章制度的贯彻执行;
 - (3) 建立完备现代企业制度,采取科学、合理的治理结构,形成科学有效的决策机制,执行机制和监督机制;
 - (4) 将各种风险控制措施在合理的范围内,保障公司发展战略和经营目标的全面实施,维护基金份额持有人、公司及公司股东的合法权益;
 - (5) 建立行之有效的风险控制系统,保障业务稳健运行,减轻或规避各种风险。
2. 建立风险控制制度应遵循的原则
 - (1) 最高性原则:风险控制制度是基金管理人公司的核心工作,代表着公司经营管理层对全体员工的承诺,风险控制管理将始终把风险控制放在公司内部控制的首要地位并对此作出前置承诺;
 - (2) 全面性原则:风险控制制度的制订应当具有前瞻性,公司开办新的业务品种时必须提前制定并在经营运作之前建立制;
 - (3) 定性定量相结合的原则:形成一套比较完备的制度体系和量化指标体系,使风险控制工作更具科学性和可操作性。
3. 风险控制体系
 - (1) 风险控制制度体系
 - 公司风险控制制度体系由五个不同层次的制度构成:第一个层次是公司章程;第二个层次是内部控制大纲;第三个层次是基本管理制度;第四个层次是具体业务管理制度;第五个层次是各项业务操作规程。
 - 风险控制组织体系
 - 风险控制组织体系包括两个层次:
 - 第一层次:公司董事会层面对公司经营管理过程中各类风险进行预防和控制的组织,主要是通过董事会下设的合规风险控制委员会和督察长来实现的。它们在风险控制中的职责分别是:
 - ①合规风险控制委员会的主要职责是:对公司经营管理和自有资产的运作的合法性、合规性进行检查和评价;对基金资产经营的合法性、合规性进行检查和评价;对公司内部控制机制、风险控制制度的有效性进行评价,提出建议方案提交董事会。
 - ②督察长履行的职责包括对基金运作、内部管理、制度执行及遵规守法情况进行内部监督、稽核;就以上问题、稽核中发现的问题向公司经营管理层通报并提出整改和处理意见;定期向合规风险控制委员会提交工作报告;发现公司的违规行为,应立即向董事长和中国证监会报告。
 - 第二层次:公司经营管理层负责与风险控制委员会、监察稽核部及各职能部门对有效管理风险与风险控制委员会的主要职责是:评估公司内部控制制度的合法合规性、全面性、审慎性和及时性;评估公司面临与风险控制的状况;审议基金投资的风险分析与绩效分析报告;审议基金投资的重大关联方事项;评估公司业务授权方案;审议业务合作伙伴(如期货券商、交易所对手、代理机构等)的风险预测报告;评估公司新产品、新业务、新市场营销渠道等的交易对手和合规评价报告;协调各部门制定突发性重大风险事件和突发事件的解决方案;界定重大风险事件和违规事件的责任;评估法规政策、市场环境等发生重大变化对公司产生的影响等。
 - 合规与风险控制委员会下设业绩与风险评估小组,负责投资的业绩与风险分析评价,并向合规与风险控制委员会提供相关报告。
 - (2) 监察稽核部的主要职责是组织和协调公司内部控制制度的编写、修订工作,确保公司内部控制制度的完整性、合规;检查公司内部控制制度和业务流程的执行情况,出具监察稽核报告;负责信息监控系统管理,调查基金及其他类型产品的异常投资和交易以及对违规行为的调查;负责公司的法律事务、合规咨询、合规培训、责任审查等工作。
 - (3) 各业务职能部门的主要职责是对自身工作中潜在风险的自我检查和控制,各业务部门作为公司风险控制的具体实施单位,应在公司各项基本管理制度的基础上,根据具体情况制订本部门的业务管理规程、操作规范和内部控制制度并严格执行。
 4. 关于授权、研究、投资、交易等方面的控制点
 - (1) 授权制度
 - 公司的授权控制贯穿于整个公司业务。股东会、董事会、监事会和经营管理层必须充分履行各自的职责,健全公司授权控制制度,确保公司各项规章制度的贯彻执行,各项经营管理制度必须经管理层制定并操作规范,经各人员的一项工作必须经业务授权范围内授权;公司重大业务的授权必须取书面形式的授权,授权书应当明确授权内容和授权;公司授权应当适当,已获授权的部门和人员应建立有效的授权反馈机制,对已不适用的授权应及时修改或取消授权。
 - (2) 公司研究业务
 - 研究工作应保持独立、客观,不受任何部门及个人的不正当影响;建立严谨的研究工作流程,形成科学、有效的研究方法;建立投资产品备选库制度,研究人员根据投资产品的特征,在充分研究的基础上进行审慎筛选;建立研究与投资的业务交流制度,保持畅通的沟通渠道;建立研究报告质量评价体系,不断提高研究水平。
 - 基金投资决策流程下的投资决策,根据决策的风险偏好和风险控制效率原则制定合理的决策程序;在进行投资决策时应有明确的投资授权制度,并建立与所授权限相匹配的约束机制和考核标准;建立严格的禁止和限制制度,保证基金投资的合法合规性;建立投资风险评价与管理机制,将项目投资限制在一定的风险风险限额内;对于投资结果建立科学的投资业绩评价体系。
 - (4) 交易业务
 - 建立集中交易交易,实行集中交易制度,投资指令通过集中交易室完成;建立交易监测系统,预警系统和交易反馈系统,交易相关的安全监控;集中交易室应对交易指令进行审核,建立公平的交易分配制度,确保各基金利益的公平;交易记录应真实、并及时进行核对,核对和反馈要及时,确保交易数据准确和评价体系。
 - (5) 基金会计核算
 - 根据法律法规及业务的要求建立会计制度,并根据风险控制制度建立完善的会计系统和估值程序,对不同基金、不同客户独立建账,独立核算;通过复核制度、凭证制度、合理的估值方法和估值程序等会计措施真实、完整、及时地记载每一笔业务并正确进行会计核算和业务核算;建立了会计档案保管制度,确保档案真实完整。
 - 信息信息披露
 - 建立了完善的信息披露管理制度,保证公开披露的信息真实、准确、完整;设立了信息披露负责人,并建立了相应的程序进行信息的收集、组织、审核和发布,加强对信息的检查,确保所公布的信息符合法律法规的规定;加强对信息披露的检查和对内、对外信息的及时提出改进建议。
 - 监察稽核
 - 公司设立督察长,督察长由董事会聘任或解聘,报中国证监会核准,并向董事会负责。督察长依据法律法规和公司章程的规定履行职务,可以列席公司任何相关会议,调阅公司任何相关文档、文件;要求督察长对已发现的问题提供有关材料和做出口头或书面说明;行使中国证监会赋予的其他报告权和监督权。
 - 公司设立监察稽核部,开展监察稽核工作,并保证监察稽核部的独立性和有效性。公司明确了监察稽核部及内各岗位的具体职责,配备了充足的人员,严格执行了监察稽核工作的专业任职资格、操作程序和岗位职责;监察稽核部强化内部控制制度,通过定期或不定期监督检查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;公司董事会和经营管理层全力支持监察稽核工作,对违反法律、法规和公司内部控制制度的,追究相关部门人员的责任。
 5. 风险管理和内部控制措施
 - (1) 建立内控控制,完善内部控制制度;公司建立、健全了内控结构,高管人员具有明确的内控分工,确保各项业务活动有恰当的授权和控制,确保监察活动的独立进行,并得到高管人员的及时、同步、监督操作动作,并使其及时得到更新。
 - (2) 建立相互分离、相互制衡的内控机制;建立、健全了各项制度,做到基金经营分开,研究、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) 建立持仓、健全岗位责任制;建立、健全了岗位职责制,使每个员工都明确自己的任务、职责,并建立各工作岗位领域中的风险防范意识,加以防范,减少失误。
 - (4) 建立风险评估、识别、评估、报告、报告、程序;建立了合规与风险控制委员会及其后续与风险评估小组,使用适合的程序,确定和评估与业务有关的风险;建立了自上而下的风险评估报告程序,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) 建立有效的内部监控制系统;建立了足够、有效的内部监控制系统,如计算机预警系统,投资监控系统,能有效可能出现的各种风险,进行全面和实时的监控。
 - (6) 使用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,用以提示指数偏离、行业内个股偏离的风险,以便公司及时采取有效的措施,对风险进行分散、控制、规避,降低不能分散的风险。
 - (7) 制定足够的培训计划;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,使员工明确各自职责所在,控制风险。
 6. 基金管理人承诺上述关于内部控制制度的披露真实、准确,并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。

1987年重组建行的交通银行正对外营业,成为中国第一家全国性的国有股份制商业银行,总部设在上海。2004年6月25日交通银行在香港联合交易所挂牌上市,2007年5月在上海证券交易所挂牌上市。截至2016年12月31日,交通银行共发行各类人民币债券,交通银行一级资本列第17位,较上年上升2位;根据2015年美国《财富》杂志发布的世界500强企业排行榜,交通银行营业收入位列第190位,较上年上升27位。
截至2016年6月30日,交通银行资产总额为人民币9,563.22亿元,2016年1—6月,交通银行实现净利润归属母公司(人民币)37.66亿元。
交通银行总行设在中国上海(以下简称“总行”)。现有员工具有多年基金、证券和银行从业经验,具备基金从业资格,以及经济师、会计师、工程师和律师等中高级专业技术职称,员工的学历层次较高,专业分布合理,职业技能优良,职业道德素质过硬,是一支充满活力、进取性强、开拓精神、奋发向上的资产托管从业人员队伍。
(一) 基金管理人情况
1. 牛黄胤先生,董事长,执行董事。
牛先生,1938年10月至至今任本行董事长,执行董事,2013年5月至2013年10月任本行董事长,执行董事,2013年10月至2013年5月任本行副董事长,执行董事,行长。牛先生1983年毕业于中央财经大学金融系,获学士学位,1997年毕业于哈尔滨工业大学管理学院技术经济专业,获硕士学位,1999年享受国务院颁发的政府特殊津贴。
彭先生,副董事长,执行董事,行长。
彭先生2013年11月起任本行副董事长,执行董事,2013年10月起任本行行长;2010年4月至2013年9月任中国投资有限责任公司副总经理兼中央汇金资产管理有限责任公司执行董事,总经理;2005年6月至2010年4月任本行执行董事,副行长;2004年9月至2005年8月任本行副行长;2004年6月至2004年9月任本行董事,行长助理;2001年9月至2004年6月任本行行长助理;1994年至2001年历任民生银行总行信贷管理部副经理,行长,南方分行行长,广州分行行长。彭先生1996年于中国人民大学研究生部获经济学硕士学位。
袁庆伟女士,资产托管业务中心总裁。
袁女士2015年8月起任本行资产托管业务中心总裁,2009年12月至2015年8月,历任本行资产托管部总经理助理,副总经理,本行资产托管业务中心副经理;1999年12月至2007年12月,历任本行总务条线行政财务会计部副科长、科长、处长助理,副处长,会计结算部高级经理,袁女士1992年毕业于中国石油大学计算机科学与技术系,获得学士学位,2006年于新疆财经大学获硕士学位。
(二) 基金托管业务情况
截至2016年10月30日,交通银行共托管证券投资基金175只。此外,交通银行还托管了基金公司特定客户资产管理计划、证券公司客户资产管理计划、银行理财产品、信托计划、

5. 基金份额持有人大会费用;
 6. 基金的投资交易费用;
 - (1) 本基金管理人向基金托管人支付的费用包括但不限于基金资产净值费的40%;
 6. 基金资产的开户费用,账户维护费用;
 9. 按照国家和有关基金(基金合同)约定,可以在基金财产中列支的其他费用。
- (二) 基金管理人支付的费用、计提和支付方式
- 本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.30%年费率计提。管理费的计算方法如下:
H = E × 0.30% ÷ 当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值
基金管理费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付,经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月月初起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日或不工作日顺延支付,顺延至下一个工作日支付。
(三) 基金托管费按前一日基金资产净值的0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下:
H = E × 0.10% ÷ 当年天数
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日的基金资产净值
基金托管费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付,经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月月初起5个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、公休日或不工作日顺延支付,顺延至下一个工作日支付。
(四) 基金销售过程中涉及的各项佣金、手续费等相关费用按照国家法律法规、基金合同约定,由基金管理人承担,由基金管理人支付。
(五) 费用归属
在对不对基金份额持有人权益产生实质性不利影响的情况下,基金管理人和基金托管人协商一致且履行适当程序后,可根据基金发展情况,并根据法律法规规定调整本基金的任何约定和调整基金管理费率、基金托管费率等相关费率。
基金管理人必须于新的费率实施日前按照《信息披露办法》的规定在指定媒介上公告。

五、基金资产的投向和投资策略

(一) 投资目标
本基金严格控制风险的前提下,通过积极方式和投资策略,力争为投资者实现超越业绩比较基准的投资业绩。

(二) 投资范围
本基金的投资范围是具有良好流动性的金融工具,包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可分离交易可转债的公开募集债券、次级债、短期融资券、中期票据、资产支持证券、地方政府债、中期票据、定向债务融资工具、银行存款、银行承兑汇票、银行转贴现、同业拆借以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具,其投资比例应符合基金合同约定。
本基金不参与可转换(或可分离交易可转债)公司债券以外的可转债,也不参与除国债以外的权证。

(三) 不在本基金资产的投资项目
本基金资产投资于债券资产的比例不低于基金资产净值的98%。本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。
(四) 投资策略
1. 组合控制
基金的投资组合应遵循以下限制:
(1) 本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的90%;
(2) 本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%;
(3) 本基金持有一家公司的股票,其市值不超过基金资产净值的10%;
(4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司的股票,其市值不超过该股票的10%;
(5) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规模的10%;
(6) 本基金持有的同一信用级别资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规模的10%;
(7) 本基金持有的同一信用级别资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规模的10%;

①合规风险控制委员会的主要职责是:对公司经营管理和自有资产的运作的合法性、合规性进行检查和评价;对基金资产经营的合法性、合规性进行检查和评价;对公司内部控制机制、风险控制制度的有效性进行评价,提出建议方案提交董事会。

②督察长履行的职责包括对基金运作、内部管理、制度执行及遵规守法情况进行内部监督、稽核;就以上问题、稽核中发现的问题向公司经营管理层通报并提出整改和处理意见;定期向合规风险控制委员会提交工作报告;发现公司的违规行为,应立即向董事长和中国证监会报告。
第二层次:公司经营管理层负责与风险控制委员会、监察稽核部及各职能部门对有效管理风险与风险控制委员会的主要职责是:评估公司内部控制制度的合法合规性、全面性、审慎性和及时性;评估公司面临与风险控制的状况;审议基金投资的风险分析与绩效分析报告;审议基金投资的重大关联方事项;评估公司业务授权方案;审议业务合作伙伴(如期货券商、交易所对手、代理机构等)的风险预测报告;评估公司新产品、新业务、新市场营销渠道等的交易对手和合规评价报告;协调各部门制定突发性重大风险事件和突发事件的解决方案;界定重大风险事件和违规事件的责任;评估法规政策、市场环境等发生重大变化对公司产生的影响等。

合规与风险控制委员会下设业绩与风险评估小组,负责投资的业绩与风险分析评价,并向合规与风险控制委员会提供相关报告。
(2) 监察稽核部的主要职责是组织和协调公司内部控制制度的编写、修订工作,确保公司内部控制制度的完整性、合规;检查公司内部控制制度和业务流程的执行情况,出具监察稽核报告;负责信息监控系统管理,调查基金及其他类型产品的异常投资和交易以及对违规行为的调查;负责公司的法律事务、合规咨询、合规培训、责任审查等工作。
(3) 各业务职能部门的主要职责是对自身工作中潜在风险的自我检查和控制,各业务部门作为公司风险控制的具体实施单位,应在公司各项基本管理制度的基础上,根据具体情况制订本部门的业务管理规程、操作规范和内部控制制度并严格执行。
4.关于授权、研究、投资、交易等方面的控制点
(1) 授权制度
公司的授权控制贯穿于整个公司业务。股东会、董事会、监事会和经营管理层必须充分履行各自的职责,健全公司授权控制制度,确保公司各项规章制度的贯彻执行,各项经营管理制度必须经管理层制定并操作规范,经各人员的一项工作必须经业务授权范围内授权;公司重大业务的授权必须取书面形式的授权,授权书应当明确授权内容和授权;公司授权应当适当,已获授权的部门和人员应建立有效的授权反馈机制,对已不适用的授权应及时修改或取消授权。
(2) 公司研究业务
研究工作应保持独立、客观,不受任何部门及个人的不正当影响;建立严谨的研究工作流程,形成科学、有效的研究方法;建立投资产品备选库制度,研究人员根据投资产品的特征,在充分研究的基础上进行审慎筛选;建立研究与投资的业务交流制度,保持畅通的沟通渠道;建立研究报告质量评价体系,不断提高研究水平。

基金投资决策流程下的投资决策,根据决策的风险偏好和风险控制效率原则制定合理的决策程序;在进行投资决策时应有明确的投资授权制度,并建立与所授权限相匹配的约束机制和考核标准;建立严格的禁止和限制制度,保证基金投资的合法合规性;建立投资风险评价与管理机制,将项目投资限制在一定的风险风险限额内;对于投资结果建立科学的投资业绩评价体系。
(4) 交易业务
建立集中交易交易,实行集中交易制度,投资指令通过集中交易室完成;建立交易监测系统,预警系统和交易反馈系统,交易相关的安全监控;集中交易室应对交易指令进行审核,建立公平的交易分配制度,确保各基金利益的公平;交易记录应真实、并及时进行核对,核对和反馈要及时,确保交易数据准确和评价体系。
(5) 基金会计核算
根据法律法规及业务的要求建立会计制度,并根据风险控制制度建立完善的会计系统和估值程序,对不同基金、不同客户独立建账,独立核算;通过复核制度、凭证制度、合理的估值方法和估值程序等会计措施真实、完整、及时地记载每一笔业务并正确进行会计核算和业务核算;建立了会计档案保管制度,确保档案真实完整。

建立了完善的信息披露管理制度,保证公开披露的信息真实、准确、完整;设立了信息披露负责人,并建立了相应的程序进行信息的收集、组织、审核和发布,加强对信息的检查,确保所公布的信息符合法律法规的规定;加强对信息披露的检查和对内、对外信息的及时提出改进建议。
(7) 监察稽核
公司设立督察长,督察长由董事会聘任或解聘,报中国证监会核准,并向董事会负责。督察长依据法律法规和公司章程的规定履行职务,可以列席公司任何相关会议,调阅公司任何相关文档、文件;要求督察长对已发现的问题提供有关材料和做出口头或书面说明;行使中国证监会赋予的其他报告权和监督权。
公司设立监察稽核部,开展监察稽核工作,并保证监察稽核部的独立性和有效性。公司明确了监察稽核部及内各岗位的具体职责,配备了充足的人员,严格执行了监察稽核工作的专业任职资格、操作程序和岗位职责;监察稽核部强化内部控制制度,通过定期或不定期监督检查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;公司董事会和经营管理层全力支持监察稽核工作,对违反法律、法规和公司内部控制制度的,追究相关部门人员的责任。

5. 风险管理和内部控制措施
(1) 建立内控控制,完善内部控制制度;公司建立、健全了内控结构,高管人员具有明确的内控分工,确保各项业务活动有恰当的授权和控制,确保监察活动的独立进行,并得到高管人员的及时、同步、监督操作动作,并使其及时得到更新。
(2) 建立相互分离、相互制衡的内控机制;建立、健全了各项制度,做到基金经营分开,研究、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) 建立持仓、健全岗位责任制;建立、健全了岗位职责制,使每个员工都明确自己的任务、职责,并建立各工作岗位领域中的风险防范意识,加以防范,减少失误。
(4) 建立风险评估、识别、评估、报告、报告、程序;建立了合规与风险控制委员会及其后续与风险评估小组,使用适合的程序,确定和评估与业务有关的风险;建立了自上而下的风险评估报告程序,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) 建立有效的内部监控制系统;建立了足够、有效的内部监控制系统,如计算机预警系统,投资监控系统,能有效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,用以提示指数偏离、行业内个股偏离的风险,以便公司及时采取有效的措施,对风险进行分散、控制、规避,降低不能分散的风险。
(7) 制定足够的培训计划;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,使员工明确各自职责所在,控制风险。
6. 基金管理人承诺上述关于内部控制制度的披露真实、准确,并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。

四、基金托管人
(一) 基金托管人
交通银行股份有限公司(简称“交通银行”) 公司法定中文名称:交通银行股份有限公司(简称:交通银行)
公司法定英文名称: BANK OF COMMUNICATIONS CO.,LTD
法定代表人:牛黄胤
住所:上海市浦东新区银城中路188号
办公地址:上海市浦东新区银城中路188号
邮政编码:200120
电话:021-38734500
传真:021-38734500
注册资本:1987.42亿元
注册币种:人民币
基金托管资格文号及文号:中国证监会证监基金字[1998]25号
联系人:汤嘉彦
电话:056269
交通银行始建于1908年,是中国历史最悠久的银行之一,也是近代中国的发祥行之一。1987年重组建行的交通银行正对外营业,成为中国第一家全国性的国有股份制商业银行,总部设在上海。2004年6月25日交通银行在香港联合交易所挂牌上市,2007年5月在上海证券交易所挂牌上市。截至2016年12月31日,交通银行共发行各类人民币债券,交通银行一级资本列第17位,较上年上升2位;根据2015年美国《财富》杂志发布的世界500强企业排行榜,交通银行营业收入位列第190位,较上年上升27位。
截至2016年6月30日,交通银行资产总额为人民币9,563.22亿元,2016年1—6月,交通银行实现净利润归属母公司(人民币)37.66亿元。
交通银行总行设在中国上海(以下简称“总行”)。现有员工具有多年基金、证券和银行从业经验,具备基金从业资格,以及经济师、会计师、工程师和律师等中高级专业技术职称,员工的学历层次较高,专业分布合理,职业技能优良,职业道德素质过硬,是一支充满活力、进取性强、开拓精神、奋发向上的资产托管从业人员队伍。
(一) 基金管理人情况
1. 牛黄胤先生,董事长,执行董事。
牛先生,1938年10月至至今任本行董事长,执行董事,2013年5月至2013年10月任本行董事长,执行董事,2013年10月至2013年5月任本行副董事长,执行董事,行长。牛先生1983年毕业于中央财经大学金融系,获学士学位,1997年毕业于哈尔滨工业大学管理学院技术经济专业,获硕士学位,1999年享受国务院颁发的政府特殊津贴。
彭先生,副董事长,执行董事,行长。
彭先生2013年11月起任本行副董事长,执行董事,2013年10月起任本行行长;2010年4月至2013年9月任中国投资有限责任公司副总经理兼中央汇金资产管理有限责任公司执行董事,总经理;2005年6月至2010年4月任本行执行董事,副行长;2004年9月至2005年8月任本行副行长;2004年6月至2004年9月任本行董事,行长助理;2001年9月至2004年6月任本行行长助理;1994年至2001年历任民生银行总行信贷管理部副经理,行长,南方分行行长,广州分行行长。彭先生1996年于中国人民大学研究生部获经济学硕士学位。
袁庆伟女士,资产托管业务中心总裁。
袁女士2015年8月起任本行资产托管业务中心总裁,2009年12月至2015年8月,历任本行资产托管部总经理助理,副总经理,本行资产托管业务中心副经理;1999年12月至2007年12月,历任本行总务条线行政财务会计部副科长、科长、处长助理,副处长,会计结算部高级经理,袁女士1992年毕业于中国石油大学计算机科学与技术系,获得学士学位,2006年于新疆财经大学获硕士学位。
(二) 基金托管业务情况
截至2016年10月30日,交通银行共托管证券投资基金175只。此外,交通银行还托管了基金公司特定客户资产管理计划、证券公司客户资产管理计划、银行理财产品、信托计划、

1987年重组建行的交通银行正对外营业,成为中国第一家全国性的国有股份制商业银行,总部设在上海。2004年6月25日交通银行在香港联合交易所挂牌上市,2007年5月在上海证券交易所挂牌上市。截至2016年12月31日,交通银行共发行各类人民币债券,交通银行一级资本列第17位,较上年上升2位;根据2015年美国《财富》杂志发布的世界500强企业排行榜,交通银行营业收入位列第190位,较上年上升27位。
截至2016年6月30日,交通银行资产总额为人民币9,563.22亿元,2016年1—6月,交通银行实现净利润归属母公司(人民币)37.66亿元。
交通银行总行设在中国上海(以下简称“总行”)。现有员工具有多年基金、证券和银行从业经验,具备基金从业资格,以及经济师、会计师、工程师和律师等中高级专业技术职称,员工的学历层次较高,专业分布合理,职业技能优良,职业道德素质过硬,是一支充满活力、进取性强、开拓精神、奋发向上的资产托管从业人员队伍。
(一) 基金管理人情况
1. 牛黄胤先生,董事长,执行董事。
牛先生,1938年10月至至今任本行董事长,执行董事,2013年5月至2013年10月任本行董事长,执行董事,2013年10月至2013年5月任本行副董事长,执行董事,行长。牛先生1983年毕业于中央财经大学金融系,获学士学位,1997年毕业于哈尔滨工业大学管理学院技术经济专业,获硕士学位,1999年享受国务院颁发的政府特殊津贴。
彭先生,副董事长,执行董事,行长。
彭先生2013年11月起任本行副董事长,执行董事,2013年10月起任本行行长;2010年4月至2013年9月任中国投资有限责任公司副总经理兼中央汇金资产管理有限责任公司执行董事,总经理;2005年6月至2010年4月任本行执行董事,副行长;2004年9月至2005年8月任本行副行长;2004年6月至2004年9月任本行董事,行长助理;2001年9月至2004年6月任本行行长助理;1994年至2001年历任民生银行总行信贷管理部副经理,行长,南方分行行长,广州分行行长。彭先生1996年于中国人民大学研究生部获经济学硕士学位。
袁庆伟女士,资产托管业务中心总裁。
袁女士2015年8月起任本行资产托管业务中心总裁,2009年12月至2015年8月,历任本行资产托管部总经理助理,副总经理,本行资产托管业务中心副经理;1999年12月至2007年12月,历任本行总务条线行政财务会计部副科长、科长、处长助理,副处长,会计结算部高级经理,袁女士1992年毕业于中国石油大学计算机科学与技术系,获得学士学位,2006年于新疆财经大学获硕士学位。
(二) 基金托管业务情况
截至2016年10月30日,交通银行共托管证券投资基金175只。此外,交通银行还托管了基金公司特定客户资产管理计划、证券公司客户资产管理计划、银行理财产品、信托计划、

1987年重组建行的交通银行正对外营业,成为中国第一家全国性的国有股份制商业银行,总部设在上海。2004年6月25日交通银行在香港联合交易所挂牌上市,2007年5月在上海证券交易所挂牌上市。截至2016年12月31日,交通银行共发行各类人民币债券,交通银行一级资本列第17位,较上年上升2位;根据2015年美国《财富》杂志发布的世界500强企业排行榜,交通银行营业收入位列第190位,较上年上升27位。
截至2016年6月30日,交通银行资产总额为人民币9,563.22亿元,2016年1—6月,交通银行实现净利润归属母公司(人民币)37.66亿元。
交通银行总行设在中国上海(以下简称“总行”)。现有员工具有多年基金、证券和银行从业经验,具备基金从业资格,以及经济师、会计师、工程师和律师等中高级专业技术职称,员工的学历层次较高,专业分布合理,职业技能优良,职业道德素质过硬,是一支充满活力、进取性强、开拓精神、奋发向上的资产托管从业人员队伍。
(一) 基金管理人情况
1. 牛黄胤先生,董事长,执行董事。
牛先生,1938年10月至至今任本行董事长,执行董事,2013年5月至2013年10月任本行董事长,执行董事,2013年10月至2013年5月任本行副董事长,执行董事,行长。牛先生1983年毕业于中央财经大学金融系,获学士学位,1997年毕业于哈尔滨工业大学管理学院技术经济专业,获硕士学位,1999年享受国务院颁发的政府特殊津贴。
彭先生,副董事长,执行董事,行长。
彭先生2013年11月起任本行副董事长,执行董事,2013年10月起任本行行长;2010年4月至2013年9月任中国投资有限责任公司副总经理兼中央汇金资产管理有限责任公司执行董事,总经理;2005年6月至2010年4月任本行执行董事,副行长;2004年9月至2005年8月任本行副行长;2004年6月至2004年9月任本行董事,行长助理;2001年9月至2004年6月任本行行长助理;1994年至2001年历任民生银行总行信贷管理部副经理,行长,南方分行行长,广州分行行长。彭先生1996年于中国人民大学研究生部获经济学硕士学位。
袁庆伟女士,资产托管业务中心总裁。
袁女士2015年8月起任本行资产托管业务中心总裁,2009年12月至2015年8月,历任本行资产托管部总经理助理,副总经理,本行资产托管业务中心副经理;1999年12月至2007年12月,历任本行总务条线行政财务会计部副科长、科长、处长助理,副处长,会计结算部高级经理,袁女士1992年毕业于中国石油大学计算机科学与技术系,获得学士学位,2006年于新疆财经大学获硕士学位。
(二) 基金托管业务情况
截至2016年10月30日,交通银行共托管证券投资基金175只。此外,交通银行还托管了基金公司特定客户资产管理计划、证券公司客户资产管理计划、银行理财产品、信托计划、

5. 基金份额持有人大会费用;
 6. 基金的投资交易费用;
 - (1) 本基金管理人向基金托管人支付的费用包括但不限于基金资产净值费的40%;
 6. 基金资产的开户费用,账户维护费用;
 9. 按照国家和有关基金(基金合同)约定,可以在基金财产中列支的其他费用。
- (二) 基金管理人支付的费用、计提和支付方式
- 本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.30%年费率计提。管理费的计算方法如下:
H = E × 0.30% ÷ 当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值
基金管理费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付,经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月月初起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日或不工作日顺延支付,顺延至下一个工作日支付。
(三) 基金托管费按前一日基金资产净值的0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下:
H = E × 0.10% ÷ 当年天数
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日的基金资产净值
基金托管费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付,经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次