(上接D9版)

风险控制的具体制度主要包括投资风险管理制度、交易风险管理制度、财务风险控制制度以及岗位分离制度、防火墙制度、岗位职责、反馈制度、保密制度、员工行为准则等程序性风险管理制度。

(2)投资管理制度

基金投资管理制度包括基金投资管理的原则、组织结构、投资禁止制度、投资策略、投资研究、投资决策、投资执行、投资的风险管理等方面内容,适用于基金投资的全过程。

(3)监察稽核制度

公司设立督察长,组织、指导监察稽核工作,督察长由总经理提名,经董事会聘任,对董事会负责,报中国证监会核准。督察长有权参加或者列席公司董事会以及公司业务、投资决策、风险管理等相关会议,有权调阅公司相关文件、档案,就内部控制制度的执行情况独立地履行检查、评价、报告、建议职能。督察长应当定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况,董事会应当对督察长的报告进行审议。

公司设立监察稽核部门,具体执行监察稽核工作。公司配备了充足合格的监察稽核人员,明确规定了监察稽核部门及内部各岗位的职责和工作流程。

监察稽核制度包括监察稽核体系、监察稽核工作内容、监察稽核方法和程序等。通过这些制度的建立,监督公司各业务部门和人员遵守法律、法规和规章的有关情况;评估公司各业务部门和人员执行公司内部控制制度、各项管理制度和业务规章的情况。

2.内部控制的原则

(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。

3.内部控制的组织架构

(1)风险管理委员会:风险管理委员会是董事会下设负责根据董事会的授权对公司的风险管理制度进行审查并提供咨询和建议的专门委员会,其工作重点包括:审议公司的风险管理制度,对公司存在的风险隐患和可能出现的风险问题进行研究、预测和评估,对重大突发性风险事件提出指导意见。

(2)投资决策委员会:投资决策委员会为公司非常设投资决策机构。投资决策委员会具体职责为:分析判断宏观经济形势和市场走势,制定基金重大投资决策和投资授权;对投资决策的执行情况进行监控;对基金经理进行的交易行为进行监督管理;考核基金经理的业绩;

(3)督察长:督察长组织、指导公司的监察稽核工作,监督检查基金及公司运作的合法合规情况和公司的内部风险控制情况;督察长履行职责的范围,应涵盖基金及公司运作的所有业务环节;有权参加或者列席公司董事会以及公司业务、投资决策、风险管理等相关会议,有权调阅公司相关文件、档案;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察、稽核;定期独立出具稽核报告,报送中国证监会和董事长;

(4)风险控制委员会:风险控制委员会对识别、防范、控制基金运作各个环节的风险全面负责,尤其重点关注基金投资组合的风险状况,对基金投资运作的风险进行测量和监控,对投资组合计划提出风险防范措施。同时,负责审核公司的风险控制制度和风险管理流程,确保对公司整体风险的评估、识别、监控与管理;

(5)监察稽核部:公司设立监察稽核部并保证其工作的独立性和权威性,充分发挥其职能作用。监察稽核部监督公司各业务部门和人员严格遵守法律法规、基金合同和公司内部各项规章制度,对公司各类规章制度及内部风险控制制度的完备性、合理性、有效性进行评估,组织各部门对存在的风险隐患或出现的风险问题进行讨论、研究,提出解决方案,并监督整改;

(6)业务部门:对本部门业务范围内的风险负有管控和及时报告的义务;

(7)员工:依照公司"风险控制落实到人"的理念,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

本基金管理人高度重视内部控制和风险管理的重要性,强调要让风险控制渗透到公司的每一项业务和公司的文化中去,要求所有员工以他们的能力、诚信和职业道德来控制、管理风险。本基金管理人采取的主要措施包括:

(1)建立了比较完善的内部控制和风险管理系统。由风险控制委员会组织、监察稽核部执行,通过与董事会到管理层到每个员工不断的沟通和交流,识别和评估从治理结构到一线业务操作等公司所有方面、所有业务流程中公司运作和基金管理的风险点和风险程度,明确划分风险责任,并制定相应的风险控制措施。本基金管理人强调在内部控制和风险管理中,要全员参与,责任明确和合理分工,让所有的员工对风险管理都有清晰的意识,清楚知道他们在风险控制中的地位和责任。在风险识别和风险评估的基础上,监察稽核部建立了覆盖公司所有业务的稽核检查项目表,该表为从法律法规、基金合同和内部规章等方面确保公司运作和基金管理合规和风险控制提供了检查和监督的手段;

(2)完善监察稽核工作流程,加强日常稽核工作,促进风险管理的数量化和自动化,提高风险管理的时效和频率。公司专门建立了作富风险控制系统,能对基金投资风险和业绩评估做到动态更新。同时监察稽核部通过质询、评估和报告等工作流程,以建立一种机制,使任何内控工作和外部审计中发现的问题能够得到及时的解决;

(3)对风险实行动态的监控和管理。一方面,周期性根据公司的业务发展和内部审核、稽查的情况进行评估和调整;另一方面,在变化的环境中,不断识别、评估新的风险,尤其强调对新产品和新业务的风险分析、评估和控制,强调新的法律法规对风险管理的要求。为确保公司运作和基金管理能够符合最新颁布的法律法规要求,本基金管理人还在组织机制上进行了设计,由监察稽核部的内控人员和法律事务人员分工合作,保证对与基金有关的法律法规进行实时跟踪、全面收集、准确分解并及时落实。

5.基金管理人内部控制制度声明书

基金管理人关于内部控制制度的声明如下:

(1)本基金管理人承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确;

(2)本基金管理人承诺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)基本情况

名称:中国建设银行股份有限公司(简称:中国建设银行)

住所:北京市西城区金融大街25号

办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

法定代表人:郭树清

成立时间:2004年09月17日

组织形式:股份有限公司

注册资本:贰仟叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元人民币

存续期间:持续经营

基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字[1998]12号

联系人:尹 东

联系电话:(010) 6759 5003

中国建设银行股份有限公司拥有悠久的经营历史,其前身"中国人民建设银行"于1954年成立,1996年易名为"中国建设银行"。中国建设银行是中国四大商业银行之一。中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于2004年9月分立而成立,承继了原中国建设银行的商业银行业务及相关的资产和负债。中国建设银行(股票代码:939)于2005年10月27日在香港联合交易所主板上市,是中国四大商业银行中首家在海外公开上市的银行。2006年9月11日,中国建设银行又作为第一家H股公司晋身恒生指数。2007年9月25日中国建设银行A股在上海证券交易所上市并开始交易。A股发行后中国建设银行的已发行股份总数为:233,689,084,000股(包括224,689,084,000股H股及9,000,000,000股A股)。

截至2009年12月31日,中国建设银行实现净利润1,068.36亿元,较上年增长15.32%,每股盈利为0.46元,较上年增加0.06元,盈利水平好于预期;平均资产回报率为1.24%,较上年降低0.07个百分点,加权平均净资产收益率为20.87%,较上年提高0.19个百分点,整体盈利趋势向好;总资产达到96,233.55亿元,较上年增长27.37%;资产质量在国内大银行中保持领先,不良贷款额和不良贷款率持续双降,信贷资产质量持续改善,不良贷款率为1.50%,较上年末下降0.71个百分点;拨备水平充分,拨备覆盖率为175.77%,较上年末提升44.19个百分点。

中国建设银行在中国内地设有1.3万余个分支机构,并在香港、新加坡、法兰克福、约翰内斯堡、东京、首尔、纽约及胡志明市设有分行,在悉尼设有代表处,拥有建行亚洲、建银国际、建行伦敦、建信基金、建信金融租赁、建信信托等多家子公司。全行已安装运行自动柜员机(ATM)36,021台,拥有员工约30万人,为客户提供全面的金融服务。

中国建设银行得到市场和业界的支持和广泛认可,在2009年共获得50多个国内外奖项。中国建设银行在美国《银行家》杂志公布的"全球金融品牌500强"、"全球银行1000强"中分列第9位和第12位,被《亚洲货币》杂志评为2009年度"中国区最佳银行",被《欧洲货币》杂志评为2009年度"中国最佳银行",连续两年被香港《资本》杂志评为"中国杰出零售银行",荣获《亚洲银行家》杂志颁发的"中国风险管理成就奖",中国扶贫基金会颁发的"20年特别贡献奖"等奖项,被中国红十字基金会评为"最具责任感企业"。

中国建设银行总行设投资托管服务部,下设综合制度处、基金市场处、资产托管处、QFII托管处、基金核算处、基金清算处、监督稽核处和投资托管团队,涉外资产核算团队、养老金托管服务团队、养老金托管市场团队、上海各分中心等12个职能处室,现有员工130余人。2008年,中国建设银行一次性通过了根据美国注册会计师协会(AICPA)颁布的审计准则公告第70号(SAS70)进行的内部控制审计,安永会计师事务所为此提交了"业内最干净的无保留意见的报告",中国建设银行成为取得国际同业首遍认同并接受的SAS70国际专项认证的托管银行。

(二)主要人员情况

罗中涛,投资托管服务部总经理,曾就职于国家统计局、中国建设银行总行评估、信贷、委托代理等业务部门并担任领导工作,对统计、评估、信贷及委托代理业务具有丰富的管理经验。

李春信,投资托管服务部副总经理,曾就职于中国建设银行总行人事教育部、计划部、筹资储蓄部、国际业务部,对商业银行综合经营计划、零售业务及国际业务具有丰富的客户服务和业务管理经验。

纪伟,投资托管服务部副总经理,曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部,长期从事大客户的客户管理及服务工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

(三)基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行,中国建设银行一直秉持"以客户为中心"的经营理念,不断加强风险管理和内部控制,严格履行托管人的各项职责,切实维护资产持有人的合法权益,为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展,中国建设银行托管资产规模不断扩大,托管业务品种不断增加,已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系,是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2010年6月30日,中国建设银行已托管158只证券投资基金,其中封闭式基金6只,开放式基金152只。建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平,赢得了业内的高度认同。2010年初,中国建设银行被总部设于美国伦敦的《全球托管人》杂志评为2009年度"国内最佳托管银行"(Domestic Top Rated),并连续第三年被香港《财资》杂志评为"中国最佳次托管银行"。

二、基金托管人的内部控制制度

(一)内部控制目标

作为基金托管人,中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和本行内有关管理规定,守法经营、规范运作、严格监察,确保业务的稳健运行,保证基金财产的安全完整,确保有关信息的真实、准确、完整、及时,保护基金份额持有人的合法权益。

(二)内部控制组织结构

中国建设银行设有风险与内控管理委员会,负责全行风险管理与内部控制工作,对托管业务风险控制工作进行检查指导。投资托管服务部专门设置了监督稽核处,配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作,具有独立行使监督稽核工作职权和能力。

(三)内部控制制度及措施

投资托管服务部具备系统、完善的制度控制体系,建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程,可以保证托管业务的规范操作和顺利进行:业务人员具备从业资格;业务管理严格实行复核、审核、检查制度,授权工作实行集中控制,业务印章按规程保管、存放、使用,账户资料严格保管,制约机制严格有效;业务操作区专门设置,封闭管理,实施音像监控;业务信息由专职信息披露人负责,防止泄密;业务实现自动化操作,防止人为事故的发生,技术系统完整、独立。

三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

(一)监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定,监督所托管基金的投资运作。利用自行开发的"托管业务综合系统——基金监督子系统",严格按照现行法律法规以及基金合同规定,对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督,并定期编写基金投资运作监督报告,报送中国证监会。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中,对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

(二)监督流程

1.每工作日按时通过基金监督子系统,对各基金投资运作比例控制指标进行例行监控,发现投资比例超标等异常情况,向基金管理人发出书面通知,与基金管理人进行情况核实,督促其纠正,并及时报告中国证监会。

2.收到基金管理人的划款指令后,对涉及各基金的投资范围、投资对象及交易对手等内容进行合法合规性监督。

3.根据基金投资运作监督情况,定期编写基金投资运作监督报告,对各基金投资运作的合法合规性、投资独立性和风格显著性等方面进行评价,报送中国证监会。

4.通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易,电话或书面要求基金管理人进行解释或举证,并及时报告中国证监会。

五、相关服务机构

(一)基金份额销售机构

1.直销机构:

名称:华富基金管理有限公司直销中心

地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1000号31层

联系人:李晔

咨询电话:021-50619688,400-700-8001

传真:021-68415680

网址:www.hffund.com

2.场内代销机构

具有基金代销资格且符合深圳证券交易所风险控制要求的深圳证券交易所场内会员单位,包括国信证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、平安证券有限责任公司、长城证券有限责任公司、光大证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、方正证券有限责任公司、华泰证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、广州证券有限责任公司、世纪证券有限责任公司、华西证券有限责任公司、国海证券有限责任公司、联讯证券有限责任公司、南京证券有限责任公司、华鑫证券有限责任公司、华林证券有限责任公司、厦门证券有限公司、中国民族证券有限责任公司、中银万国证券股份有限公司、中信万通证券有限责任公司、海通证券股份有限公司、山西证券股份有限公司、民生证券有限责任公司、兴业证券股份有限公司、广发华福证券有限责任公司、长江证券股份有限公司、东莞证券有限责任公司、国联证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、东北证券股份有限公司、恒泰证券股份有限公司、华安证券有限责任公司、东海证券有限责任公司、中信证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、中山证券有限责任公司、第一创业证券有限责任公司、大同证券经纪有限责任公司、宏源证券股份有限公司、西藏证券经纪有限责任公司、湘财证券有限责任公司、中国国际金融有限公司、华泰联合证券有限责任公司、东方证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、西南证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、西部证券股份有限公司、渤海证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、华龙证券有限责任公司、万联证券有限责任公司、齐鲁证券有限公司、国元证券股份有限公司、国都证券有限责任公司、中银国际证券有限责任公司、华宝证券有限责任公司、红塔证券股份有限公司、日信证券有限责任公司、浙商证券有限责任公司、中航证券有限公司、财富证券有限责任公司、金元证券股份有限公司、国盛证券有限责任公司、中原证券股份有限公司、德邦证券有限责任公司、财通证券有限责任公司、新时代证券有限责任公司、江海证券有限公司、中国建银投资证券有限责任公司、中信建投证券有限责任公司、安信证券股份有限公司、银泰证券有限责任公司、瑞银证券有限责任公司。

3.场外代销机构

(1)中国建设银行股份有限公司

注册地址:北京市西城区金融大街25号

办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

法定代表人:郭树清

联系人:尹东

电话:010-67595003

客户服务统一咨询电话:95533

网址:http://www.ccb.com

(2)中国工商银行股份有限公司

住所:北京市西城区复兴门内大街55号

法定代表人:姜建清

电话:010-66107900

传真:010-66107914

联系人:刘业伟

客户服务电话:95588

网址:www.icbc.com.cn

(3)交通银行股份有限公司

住所:上海市浦东新区银城中路188号

法定代表人:胡怀邦

电话:(021)58781234

传真:(021)58408483

联系人:曹榕

客户服务电话:95559

网址:www.bankcomm.com

(4)招商银行股份有限公司

地址:深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人:秦晓

联系人:邓炯鹏

客户服务电话:95555

网址:www.cmbchina.com

(5)上海浦东发展银行

注册地址:上海市浦东新区浦东南路500号

办公地址:上海市中山东一路12号

法定代表人:吉晓辉

电话:(021)61618888

传真:(021)63602431

联系人:虞容云

客户服务热线:95528

公司网站:www.spdb.com.cn

(6)中信银行股份有限公司

注册地址:北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

法定代表人:孔丹

客服电话:95558

联系人:丰靖

电话:010-65557013

传真:010-65550827

网址:http://bank.ecitic.com

(7)中国光大银行股份有限公司

住所:北京市西城区复兴门外大街6号光大大厦

法定代表人:唐双宁

联系人:李伟

客服电话:95595,或拨打各城市营业网点咨询电话。

网址:www.cebbank.com

(8)深圳发展银行股份有限公司

法定代表人:肖遂宁

地址:深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦

联系人:姜鹏

联系电话:0755-82088888

传真电话:0755-82080714

客户服务电话:95501

公司网址:www.sdb.com.cn

(9)北京银行股份有限公司

住所:北京市西城区金融大街甲17号北京银行大厦

法定代表人:阎冰竹

联系人:王曦

联系电话:010-66223248

客服电话:010-96169(北京)022-96269(天津)021-53599688(上海)

公司网址:http://www.bankofbeijing.com.cn

(10)华安证券有限责任公司

住所:安徽省合肥市长江中路357号

法定代表人:李工

联系人:甘霖

电话:0551-5161821

传真:0551-5161672

公司网址:www.huaans.com.cn

(11)国泰君安证券股份有限公司

住所:上海市浦东新区商城路618号

法定代表人:祝幼一

联系人:芮敏祺

电话:021-38676161

传真:021-38670161

客户服务热线:4008-888-666

公司网站:http://www.gtja.com.cn

(12)海通证券股份有限公司

住所:上海市淮海中路98号

法定代表人:王开国

联系人:金芸、李笑鸣

电话:021-53594566

传真:021-53858549

客户服务热线:021-962503

公司网站:http:// www.htsec.com

(13)光大证券股份有限公司

住所:上海市静安区新闸路1508号

法定代表人:徐浩明

联系人:刘晨

电话:021-22169999

传真:021-22169134

客户服务热线:10108998 4008888788

公司网站:http:// www.ebscn.com

(14)中国银河证券股份有限公司

住所:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

法定代表人:顾伟国

联系人:田薇

电话:(010)66568047

传真:010-66568116

客户服务热线:4008888888

公司网站:http://www.chinastock.com.cn

(15)东海证券有限责任公司

住所:常州延陵西路59号常信大厦18、19楼

法定代表人:朱科敏

联系人:程学军

电话:021-50586660

传真:021-50586660-8881

客户服务热线:021-52574550

公司网址:http://www.longone.com.cn

(16)兴业证券股份有限公司

住所:福州市湖东路268号

办公地址:浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼21层

法定代表人:兰荣

联系人:谢高得

电话:021-38565785

传真:021-38565955

公司网站:http:// www.xyzq.com.cn

(17)中信证券股份有限公司

住所:深圳市罗湖区湖贝路1030号海龙王大厦

法定代表人:王东明

电话:010-84683893

传真:010-84865560

联系人:陈忠

网址:www.ecitic.com

(18)长城证券有限责任公司

住所:深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14/16/17层

法定代表人:黄耀华

联系人:匡婷

电话:0755-83516289

传真:0755-83516199

客户服务热线:0755-82288968

公司网站:www.cc168.com.cn

(19)新时代证券有限责任公司

住所:北京市西城区金融大街1号A座8层

法定代表人:马金声

电话:(010)83561146

传真:(010)83561094

联系人:戴狄

客户服务电话:4006989898

网址:www.xsdzq.cn

(20)安信证券股份有限公司

住所:深圳市福田区金田路2222号安联大厦34层、28层A02单元

法定代表人:牛冠兴

电话:0755-82825555

传真:0755-23982970

联系人:余江

客户服务电话:4008001001

公司网址:www.essence.com.cn

(21)平安证券有限责任公司

住所:广东省深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8层

法定代表人:杨宇翔

联系人:周勤

电话:0755-22626172

传真:0755-82400862

客户服务电话:4008816168

公司网址:http:\\www.pingan.com

(22)招商证券股份有限公司

住所:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层

法定代表人:宫少林

联系人:黄健

联系电话:0755-82943666

传真:0755-82943636

网站:www.newone.com.cn

客户服务电话:95565、4008888111

(23)江海证券有限责任公司

住所:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号

法定代表人:孙名扬

联系人:徐世旺

电话:0451-82336863

传真:0451-82287211

客户服务热线:400-666-2288

网址:www.jhzq.com.cn

(24)爱建证券有限责任公司

住所:上海市南京西路758号24楼

法定代表人:张建华

联系人:陈敏

电话:021-32229888

网站:www.ajzq.com

客户服务电话:021-63340678

(25)万联证券有限责任公司

住所:广州市中山二路18号广东电信广场36-37层

法定代表人:李勤全

联系人:罗剑斌

联系电话:020-37865070

传真:020-37865008

网站:www.wlzq.com.cn

客服电话:400-8888-133

(26)长江证券股份有限公司

住所:武汉市新华路特8号长江证券大厦

法定代表人:胡运钊

联系人:李良

电话:021-63219781

传真:021-51062920

客户服务热线:4008-888-999或027-85808318

客户服务网站:www.95579.com

(27)信达证券股份有限公司

注册地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

办公地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

法定代表人:张志刚

联系人:唐静

联系电话:010-63081000

传真:010-63080978

客服电话:400-800-8899

公司网址:www.cindasc.com

(28)齐鲁证券有限责任公司

注册地址:山东省济南市经十路20518号

办公地址:山东省济南市经十路17703号

法定代表人:李玮

联系人:吴阳

电话:0531-81283938

传真:0531-81283900

客服电话:95538

网址:www.qlzq.com.cn

(29)国信证券股份有限公司

注册地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层

法人代表人:何如

基金业务联系人:齐晓燕

联系电话:0755-82130833

传真:0755-82133302

客户服务电话:95536

公司网址:www.guosen.com.cn

(30)南京证券有限责任公司

住所:南京市大钟亭8号?

法定代表人:张华东

电话:025-83367888?

传真:025-83360066??

联系人:徐翔

网站:www.njzq.com.cn

客户服务电话:4008285888

(31)天风证券有限责任公司

住所:武汉东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦四楼

法定代表人:余磊

联系人:翟璟

电话:027-87618882

传真:027-87618863

客户服务热线:027-87618882或028-86711410

公司网址:www. tfzq.com

(32)广发华福证券有限责任公司

住所:福州市五四路157号新天地大厦7、8层

法定代表人:黄金琳

电 话:0591-87383623

传 真:0591-87383610

网站:www.gfhfzq.com.cn

客户服务电话:96326

(33)申银万国证券股份有限公司

住所:上海市常熟路171号

法定代表人:丁国荣

电话:021-54033888

传真:021-54038844

联系人:邓寒冰

客户服务电话:962505

网址:www.sywg.com.cn

(34)华泰联合证券有限责任公司

住所:深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第五层(01A、02、03、04)、17A、18A、24A、25A、26A

办公地址:深圳市福田中心区中心广场香港中旅大厦第5层、17层、18层、24层、25层、26层

法定代表人:马昭明

联系人:庞晓芸

电话:0755-82492000

传真:0755-82492962

客户服务电话:95513

公司网址:www.lhzq.com

(35)民生证券

住所:北京市朝阳门外大街16号中国人寿大厦1901室

办公地址:北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心16-18层

法定代表人:岳献春

联系人:赵明

电话:(010)85127622

传真:(010)85127917

客服电话:400-619-8888

网址:www.mszq.com

(36)厦门证券有限公司

住所:厦门市莲前西路2号莲富大厦十七楼

法定代表人:傅毅辉

联系人:卢金文

联系方式:0592-5161642

客户服务电话:0592-5163588

网址:www.xmzq.cn

(37)大通证券股份有限公司

住所:大连市中山区人民路24号

办公地址:大连市中山区人民路24号

法定代表人:于宏民

电话:0411-39673202

传真:0411-39673219

联系人:谢立军

客服电话:4008169169

公司网站:www.dalton.com.cn

(38)世纪证券有限责任公司

住所:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦41层

法定代表人:卢长才

联系人:刘军辉

电话:0755-83199599

传真:0755-83199545

客服电话:0755-83199599

公司网址:www.csco.com.cn

(39)中山证券有限责任公司

注册地址:广东省深圳市福田区益田路江苏大厦B座15层

办公地址:广东省深圳市福田区益田路江苏大厦B座15层

法定代表人:吴泳良

电话:0755-82944659

传真:0755-82960582

联系人:刘军

客服电话:0755-82943750

网址:www.zszq.com.cn

(二)登记结算机构

名称:中国证券登记结算有限责任公司

住所:中国北京西城区金融大街27号投资广场23层

办公地址:中国北京西城区金融大街27号投资广场23层

法定代表人:金颖

联系人:朱立元

电话:010-58598839

传真:010-58598907

(三)出具法律意见书的律师事务所

名称:国浩律师集团(上海)事务所

住所:上海市南京西路580号南证大厦31楼

负责人:管建军

电话:021-52341668

传真:021-52341670

联系人:方恒

经办律师:方恒、谢海燕

(四)审计基金财产的会计师事务所

名称:天健正信会计师事务所有限公司

住所:北京市西城区月坛北街26号恒华国际商务中心4层401

法定代表人姓名:梁青民

电话:021-61264626

传真:021-61264624

联系人:马静

经办注册会计师:马静、曹小勤

六、基金的募集

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他法律法规的有关规定募集。本基金募集申请已经中国证监会2010年2010年7月27日证监许可【2010】989号文批准。

本基金份额初始面值为1.00元人民币,按初始面值发售。

(一)基金类型和运作方式

基金的类别:债券型证券投资基金

基金的运作方式:契约型。本基金合同生效后三年内封闭运作,在深圳证券交易所上市交易,基金合同生效满三年后,转为上市开放式基金(LOF)。

(二)基金的存续期限

不定期

(三)募集方式和募集场所

本基金将通过场外和场内两种方式公开募集,场外将通过本基金管理人的直销中心及本基金代销机构的代销网点募集,场内将通过深圳证券交易所内具有相应业务资格的会员单位募集。销售机构名单详见"五、相关服务机构"中的"(一)基金份额销售机构"。尚未取得相应业务资格,但属于深圳证券交易所会员的其他机构,可在本基金上市后,代理投资人通过深圳证券交易所交易系统参与本基金的上市交易。

通过场内认购的基金份额登记在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记结算系统(以下简称"证券登记结算系统"),本基金在深圳证券交易所上市交易后,基金份额持有人可以通过深圳证券交易所交易基金份额,但在本基金封闭期内不得赎回;

通过场外认购的基金份额登记在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(以下简称"注册登记系统"),在本基金封闭期内不得赎回,但可以通过跨系统转托管转至证券登记结算系统后通过深圳证券交易所上市交易。

(四)募集期限

本基金自2010年9月1日至2010年9月17日发售。本基金募集期限自基金份额发售之日起不超过三个月。

(五)募集对象

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和机构投资者以及合格境外机构投资者。

(六)基金份额的认购

1.认购费用

本基金以认购金额为基数采用比例费率计算认购费用。

	认购金额(含认购费)	认购费率
场外认购费率	认购金额<50万元	0.6%
	50万元≤认购金额<200万元	0.4%
	200万元≤认购金额<500万元	0.2%
	认购金额≥500万元	每笔1000元
场内认购费率	深圳证券交易所会员单位按照场外认购费率设定场内认购费率	

基金认购费用不列入基金财产,主要用于基金的市场推广、销售、注册登记等募集期间发生的各项费用。

2.募集期利息的处理方式

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,其中利息以注册登记机构的记录为准。

3.基金认购份额的计算

(1)场外认购份额的计算

场外认购为金额认购,计算公式如下:

净认购金额=认购金额/(1+认购费率)

认购费用=认购金额-净认购金额

认购份额=(净认购金额+募集期利息)/基金份额初始面值

场外认购份额的计算结果保留到小数点后2位,小数点2位以后的部分四舍五入,由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。利息折算份额的计算保留到小数点后2位,小数点2位以后的部分四舍五入,由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

例:某投资人在场外投资10000元认购本基金,认购费率为0.6%,募集期产生的利息为5.50元,则可认购本基金份额为:

认购净金额=10000/(1+0.6%)=9940.36元

认购费用=10000-9940.36=59.64元

认购份额=(9940.36+5.50)/1.00=9945.86份

即该投资人在场外投资10000元认购本基金,可认购到9945.86份基金份额。

(2)场内认购份额的计算

场内认购为份额认购,计算公式如下:

认购金额=基金份额初始面值×认购份额×(1+认购费率)

认购费用=基金份额初始面值×认购份额×认购费率

净认购金额=基金份额初始面值×认购份额

利息折算份额=认购金额利息/基金份额初始面值

场内认购金额的计算结果保留到小数点后2位,小数点2位以后的部分四舍五入。场内认购金额的利息折算的份额保留到整数位,余额计入基金资产。例:某投资人在场内认购本基金10000份基金份额,认购费率为0.6%,募集期产生的利息为5.50元,则认购金额为:

认购金额=1.00×10000x/(1+0.6%)=10060元

认购费用=1.00x10000x0.6%=60元

净认购金额=1.00x10000=10000元

利息折算的份额=5.50/1.00=5.50份

即该投资人在场内认购10000份基金份额,需缴纳认购金额10060元。募集期产生的利息为5.50元,利息折算的份额保留到整数位为5份,其余0.50份对应金额计入基金财产,投资人可认购到10005份基金份额。

(七)基金份额认购金额的限制

1.投资人认购前,需按销售机构规定的方式全额缴款。

2.投资人在募集期内可以多次认购基金份额,但已受理的认购申请不允许撤销。

3.场外代销机构每次单笔最低认购金额为1000元,直销机构首次单笔最低认购金额为10万元,追加申购单笔最低申购金额为1万元;场内认购单笔最低认购份额为1000份,超过1000份的认购份额须为1000份的整数倍,每笔认购份额最大不超过99,999,000份。

4.募集期间的单个投资人的累计认购金额不设限制。

(八)认购申请的确认

基金销售机构对认购申请的受理并不代表申请一定成功,而仅代表销售机构确实接收到申请。申购的确认以注册登记机构或基金管理人的确认结果为准。投资人可在基金合同生效后到各销售网点或以其规定的其它合法有效的方式查询最终成交确认情况。

(九)募集资金

基金募集期的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用,不得从基金资产中列支。基金募集期间募集的资金存入专门账户,在基金募集行为结束前,任何人不得动用。

(十)基金募集规模的上限

基金募集规模上限为20亿份(不包括利息折算的基金份额),规模控制措施详见基金份额发售公告的有关规定。

七、基金合同的生效

(一)基金备案的条件

1.本基金自基金份额发售之日起3个月内,在基金募集份额总额不少于2亿份,基金募集金额不少于2亿元,并且基金份额持有人的人数不少于200人的条件下,基金募集期届满或基金管理人依据法律法规及招募说明书决定停止基金发售,且基金募集达到基金备案条件,基金管理人应当自基金募集结束之日起10日内聘请法定验资机构验资,自收到验资报告之日起10日内,向中国证监会提交验资报告,办理基金备案手续。自中国证监会书面确认之日起,基金备案手续办理完毕,基金合同生效。

2.基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日对基金合同生效事宜予以公告。

3.本基金合同生效前,投资人的认购款项只能存入专用账户,任何人不得动用。认购资金在募集期形成的利息在本基金合同生效后折成投资人认购的基金份额,归投资人所有。利息转份额的具体数额以注册登记机构的记录为准。

(二)基金募集失败

1.基金募集期届满,未达到基金备案条件,则基金募集失败。

2.如基金募集失败,基金管理人应以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用,在基金募集期届满后30日内返还投资人已缴纳的认购款项,并加计银行同期存款利息。

3.如基金募集失败,基金管理人、基金托管人及代销机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和代销机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。

(三)基金存续期内的基金份额持有人数量和资金数额

基金合同生效后的存续期内,基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元,基金管理人应当及时报告中国证监会;基金份额持有人数量连续20个工作日达不到200人,或连续20个工作日基金资产净值低于5000万元,基金管理人应当向中国证监会说明出现上述情况的原因并提出解决方案。

八、基金份额的上市交易

(一)基金上市交易的条件

知基金具备下列条件,基金管理人可依据《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》,向深圳证券交易所申请上市交易。

1.经中国证监会核准发售且基金合同生效;

2.基金合同期限五年以上;

3.基金份额持有人不少于1000人;

4.基金募集金额不低于2亿元;

5.深圳证券交易所要求的其他条件。

(二)上市交易的时间和地点

基金合同生效后3个月内开始在深圳证券交易所上市交易。

在确定基金上市交易时间后,基金管理人最迟在上市前3个工作日在至少一种指定报刊和网站上刊登公告。

基金上市后,登记在证券登记结算系统中的基金份额可直接在深圳证券交易所上市交易;登记在注册登记系统中的基金份额通过办理跨系统转托管业务将基金份额转托管到证券登记结算系统后,方可上市交易。

(三)上市交易的规则

1.本基金上市首日的开盘参考价为前一交易日基金份额净值;

2.本基金实行价格涨跌幅限制,涨跌幅比例限制为10%,自上市首日起实行;

3.本基金买入申报数量为100份或其整数倍;

4.本基金申报价格最小变动单位为0.001元人民币;

5.本基金上市交易遵循《深圳证券交易所交易规则》及相关规定。

(四)上市交易的费用

本基金上市交易的费用按照深圳证券交易所有关规定办理。

(五)上市交易的行情揭示

本基金在深圳证券交易所挂牌交易,交易行情通过行情发布系统揭示。行情发布系统同时揭示基金前一交易日的基金份额净值。

(六)上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市

本基金的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市按照相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所的有关规定执行。

(七)相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所对基金上市交易的规则等规定内容进行调整的,本基金的基金合同相应予以修改,且此修改无须召开基金份额持有人大会。

九、基金份额的申购与赎回

(一)申购和赎回场所

本基金的申购与赎回将通过销售机构进行,场外申购与赎回将通过本基金管理人的直销中心及本基金代销机构的代销网点办理,场内申购与赎回将通过深圳证券交易所内具有相应业务资格的会员单位办理。销售机构名单详见"五、相关服务机构"中的"(一)基金份额销售机构"。基金管理人可根据情况变更或增减代销机构,并予以公告。若基金管理人或其指定的代销机构开通电话、传真或网上等交易方式,投资人可以通过上述方式进行申购与赎回,具体办法由基金管理人另行公告。

通过场内申购的基金份额登记在证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记结算系统,基金份额持有人可以通过深圳证券交易所交易基金份额;通过场外申购的基金份额登记在注册登记系统,可以通过跨系统转托管转至证券登记结算系统后通过深圳证券交易所上市交易。

(二)申购和赎回的开放日及时间

1.开放日及