东吴增利债券型证券投资基金招募说明书

基金管理人:东吴基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司

二零一一年六月

【重要提示】

本基金经中国证监会2011年5月26日证监许可【2011】818号文核准募集。

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核准,但中国证监会对本基金募集的核准,并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

投资有风险,投资者认购(或申购)本基金时应认真阅读本招募说明书,全面认识本基金产品的风险收益特征,充分考虑投资者自身的风险承受能力,并对于认购(或申购)基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资者"买者自负"原则,在投资者作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化导致的投资风险,由投资者自行负担。投资者基金投资要承担相应风险,包括市场风险、管理风险、流动性风险、本基金特定风险、操作或技术风险、合规风险等。在投资者作出投资决策后,基金投资运作与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行负责。

本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的中低风险品种,其预期风险与预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。本基金为债券型基金,投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产的80%,包括国内依法发行上市的国家债券、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、公司债券、短期融资券、资产证券化产品、可转换债券、可分离债券和回购等金融工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益证券品种。其中,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金不直接从二级市场买入股票或权证等权益类资产。本基金投资于股票或权证等权益类资产的比例不超过基金资产的20%。

本基金以一元的发售面值募集基金份额,在市场波动等因素的影响下,基金投资仍有可能出现亏损或基金份额净值低于该发售面值。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

基金管理人的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人承诺依照恪尽职守、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。

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》)、《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》),及其他相关规定以及《东吴增利债券型证券投资基金基金合同》编写。

本招募说明书阐述了东吴增利债券型证券投资基金的投资目标、策略、风险、费率等与投资者投资决策有关的全部必要事项,投资者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,并经中国证监会核准。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和本基金合同的当事人,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:

本合同、《基金合同》 指《东吴增利债券型证券投资基金基金合同》及对本合同的任何有效的修订和补充

中国 指中华人民共和国(仅为《招募说明书》目的不包括香港特别行政区、澳门特别行政区及台湾地区)

法律法规 指中国现时有效并公布实施的法律、行政法规、部门规章及规范性文件

《基金法》 指《中华人民共和国证券投资基金法》

《销售办法》 指《证券投资基金销售管理办法》

《运作办法》 指《证券投资基金运作管理办法》

《信息披露办法》 指《证券投资基金信息披露管理办法》

元 指中国法定货币人民币元

基金或本基金 指依据《基金合同》募集的东吴增利债券型证券投资基金

招募说明书 指《东吴增利债券型证券投资基金招募说明书》,即用于公开披露本基金的基金管理人及基金托管人、相关服务机构、基金的募集、基金合同的生效、基金份额的交易、基金份额的申购和赎回、基金的投资、基金的业绩、基金的财产、基金资产的估值、基金收益与分配、基金的费用与税收、基金的信息披露、风险揭示、基金的终止与清算、基金合同的内容摘要、基金托管协议的内容摘要、对基金份额持有人的服务、其他应披露事项、招募说明书的存放及查阅方式、备查文件等涉及本基金的信息,供基金投资者选择并决定是否提出基金认购或申购申请的要约邀请文件,及其定期的更新

托管协议: 指基金管理人与基金托管人签订的《东吴增利债券型证券投资基金托管协议》及其任何有效修订和补充

发售公告 指《东吴增利债券型证券投资基金基金份额发售公告》

《业务规则》 指《东吴基金管理有限公司开放式基金业务规则》

中国证监会 指中国证券监督管理委员会

银行监管机构 指中国银行业监督管理委员会或其他经国务院授权的机构

基金管理人 指东吴基金管理有限公司

基金托管人 指中信银行股份有限公司

基金份额持有人 根据《基金合同》取得基金份额的投资者

基金代销机构 指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件,取得基金代销业务资格,并与基金管理人签订基金销售与服务代理协议,代为办理本基金发售、申购、赎回和其他基金业务的代理机构

销售机构 基金管理人及基金代销机构

基金销售网点 基金管理人的直销网点及基金代销机构的代销网点

注册登记业务 东吴基金登记、存管、清算和交收业务,具体内容包括投资者基金账户管理、基金份额注册登记、清算及基金交易确认、发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等

基金注册登记机构 东吴基金管理有限公司或其委托的其他符合条件的办理基金注册登记业务的机构

《基金合同》当事人 受《基金合同》约束,根据《基金合同》享受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

个人投资者 符合法律法规规定的条件可以投资开放式证券投资基金的自然人

机构投资者 符合法律法规规定可以投资开放式证券投资基金的在中国合法注册登记并存续或经政府有关部门批准设立的并存续的企业法人、事业法人、社会团体和其他组织

合格境外机构投资者 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的可以投资于中国境内合法资格的证券投资基金的中国境外的基金管理机构、保险公司、证券公司以及其他资产管理机构

投资者 指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和法律法规或中国证监会允许购买开放式证券投资基金的其他投资者的总称

基金合同生效日 基金募集达到法律规定及《基金合同》约定的条件,基金管理人聘请法定机构验资并办理完毕基金备案手续,获得中国证监会书面确认之日

募集期 指自基金份额发售之日起不超过3个月的期限

基金存续期 指《基金合同》生效后合法存续的不定期之期间

基金封闭期 自基金合同生效之日起至基金开始办理赎回业务的期间,本基金封闭期为1年

日/天 指公历日

月 指公历月

工作日 指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日

开放日 指销售机构办理本基金份额申购、赎回等业务的工作日

T日 指申购、赎回或办理其他基金业务的申请日

T+n日 指自T日起第n个工作日(不包含T日)

认购 指在本基金募集期内投资者购买本基金基金份额的行为

发售 指在本基金募集期内,销售机构向投资者销售本基金份额的行为

申购 指基金投资者根据基金销售网点规定的手续,向基金管理人购买基金份额的行为。

赎回 指基金投资者根据基金销售网点规定的手续,向基金管理人卖出基金份额的行为。

巨额赎回 指在单个开放日,本基金的基金份额净赎回申请(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)超过上一日本基金总份额的10%时的情形

基金账户 指基金注册登记机构给投资者开立的用于记录投资者持有基金管理人管理的开放式基金份额情况的账户

交易账户 指各销售机构为投资者开立的记录投资者通过该销售机构办理基金交易所引起的基金份额的变动及结余情况的账户

转托管 指投资者将其持有的同一基金账户下的基金份额从某一交易账户转入另一交易账户的业务

基金转换 指投资者向基金管理人提出申请将其所持有的基金管理人管理的任一开放式基金(转出基金)的全部或部分基金份额转换为基金管理人管理的任何其他开放式基金(转入基金)的基金份额的行为

定期定额投资计划 指投资者通过有关销售机构提出申请,约定每期扣款日、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者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

基金收益 指基金投资所得红利、股息、债券利息、证券投资收益、证券持有期间的公允价值变动、银行存款利息以及其他收入。

基金资产总值 指基金所拥有的各类证券及票据价值、银行存款本息和本基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和

基金资产净值 指基金资产总值扣除负债后的净资产值

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

货币市场工具 指现金;一年以内(含一年)的银行定期存款、大额存单;剩余期限在三百九十七天以内(含三百九十七天)的债券;期限在一年以内(含一年)的债券回购;期限在一年以内(含一年)的中央银行票据;中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的金融工具

指定媒体 指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊和互联网网站

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

销售服务费 指从基金资产中计提的,用于本基金市场推广、销售以及为基金份额持有人服务的费用

基金份额类别 指根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同将本基金的基金份额分为不同的类别,各基金份额类别分别设置代码,分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值。

三、基金管理人

(一)基金管理人概况

1. 名称:东吴基金管理有限公司
2. 住所:上海市浦东新区源深路279号(200135)
3. 办公地址:上海市浦东新区源深路279号(200135)
4. 法定代表人:徐建平
5. 设立日期:2004年9月2日
6. 批准设立机关及批准设立文号:中国证券监督管理委员会证监基金字【2004】132号
7. 组织形式:有限责任公司(国内合资)
8. 注册资本:1亿元人民币
9. 联系人:吴靖
10. 电话:021-50509888
11. 传真:021-50509884
12. 客户服务电话:021-50509666,4008210588
13. 公司网址:www.scfund.com.cn
14. 股权结构:

持股单位	出资额(万元)	占总股本比例
东吴证券股份有限公司	4900	49%
上海兰生(集团)有限公司	3000	30%
江阴澄星实业集团有限公司	2100	21%
合 计	10.000	100%

15. 简要情况介绍:

东吴基金管理有限公司设立投资管理部、研究策划部、国际业务部、产品策略部、市场营销部、机构理财部、基金事务部、信息技术部、综合管理部和监察稽核部等10个职能部门。公司已管理的第一只产品东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金,于2005年2月1日基金合同生效,托管行为中国工商银行股份有限公司。公司已管理的第二只产品东吴价值成长双动力股票型证券投资基金,于2006年12月15日基金合同生效,托管行为中国银行股份有限公司。公司已管理的第三只产品东吴行业轮动股票型证券投资基金,于2008年4月23日基金合同生效,托管行为华夏银行股份有限公司。公司已管理的第四只产品东吴优信稳健债券型证券投资基金,于2008年11月5日基金合同生效,托管行为中国建设银行股份有限公司。公司已管理的第五只产品东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金,于2009年5月6日基金合同生效,托管行为中国农业银行股份有限公司。公司已管理的第六只产品东吴新经济股票型证券投资基金,与2009年12月30日基金合同生效,托管行为中国建设银行股份有限公司。公司已管理的第七只产品东吴货币市场证券投资基金,与2010年5月11日基金合同生效,托管行为中国农业银行股份有限公司。公司已管理的第八只产品东吴新创业股票型证券投资基金,于2010年6月29日基金合同生效,托管行为中国工商银行股份有限公司。公司已管理的第九只产品东吴中证新兴产业指数型证券投资基金,于2011年2月11日基金合同生效,托管行为中国农业银行股份有限公司。

(二)主要人员情况

1.董事会成员

吴永敏先生,董事长,硕士研究生,高级审计师,高级经济师,中共党员。历任无锡县长征企业会计,苏州市财政局科员、苏州市税务局副科长、苏州市税务局三分局局长、苏州市税务局科长、苏州市审计局副局长。现任东吴证券股份有限公司党委书记、董事长。

金燕萍女士,副董事长,大学,高级政工师,中共党员。历任上海外贸总公司党委委员、党委办公室副主任,上海海外公司党总支书记,上海广告公司党委副书记、副总经理,上海实业(集团)有限公司办事处常务副主任、党总支书记。现任上海兰生(集团)有限公司总裁助理、投资管理部总经理。

徐建平先生,董事,大学,会计师,中共党员。历任张家港市财政局科长兼市房改办副主任,苏州证券有限责任公司张家港检会证券营业部总经理、公司总裁助理兼资产管理总部总经理,东吴证券有限责任公司副总裁。现任东吴基金管理有限公司总经理。

陆宏伟先生,董事,研究生,经济师,中共党员。历任江苏省计划经济委员会副科长,江苏省国际信托投资公司证券部经理,信泰证券有限公司董事、齐鲁证券有限公司董事。现任江苏澄星实业集团有限公司常务副总裁。

王金来先生,董事,大学,经济师,中共党员。历任苏州市二轻局秘书,苏州市经济体制改革委员会副科长、处长、助理调研员,兼苏州市证券期货监督管理办公室证券处处长和苏州市企业上市工作办公室证券处处长,东吴证券股份有限公司投行总部副总经理。现任东吴证券有限责任公司董事会秘书。

戴继雄先生,董事,硕士,历任上海复星高科技(集团)有限公司财务、审计副总监,现担任上海兰生(集团)有限公司财务副总监、财务部总经理。

贝政新先生,独立董事,大学,教授。历任苏州大学商学院财经学院讲师、副教授。现任苏州大学商学院财经学院教授。

张平先生,独立董事,博士,研究员。现任中国社科院经济研究所研究员,兼职中央财经大学金融学院教授和江南信托经济学家。

陈如奇先生,独立董事,大专学历,中共党员,高级经济师,历任新疆人民银行巴州中心支行科员,新疆农业银行巴州及目治区分行科长、处长,交通银行上海分行处长、副行长,交通银行广州分行行长,交通银行香港分行总经理等职。现任光大证券有限责任公司独立董事。

2.监事会成员

马震亚先生,监事长,大学,会计师。历任苏州市审计局科员、副主任科员,苏州证券有限责任公司财务部总经理,东吴证券有限责任公司财务总监。现任东吴证券股份有限公司副总裁,中共东吴证券股份有限公司党委纪委书记,党委委员。

赵江先生,监事,大专,会计师。曾任中国船舶工业集团公司澄西船厂财务处会计科长,现任江阴澄星实业集团有限公司审计部经理、兼资产管理部经理。

王炯女士,员工监事,硕士学历。曾任大鹏证券研究所和投资部研究员、首席分析师助理,东吴基金管理有限公司基金经理助理等职,现任东吴基金管理有限公司总裁助理、投资总监、兼投资管理部总经理。

3.高管人员

吴永敏先生,董事长。(简历请参见上述董事会成员介绍)

徐建平先生,总经理。(简历请参见上述董事会成员介绍)

胡玉杰女士,副总经理,经济学硕士,历任大鹏证券有限责任公司营业部总经理、融资服务公司董事、副总经理;2004年9月加入东吴基金管理有限公司任市场总监职务;2008年7月起至今任东吴基金管理有限公司副总经理。

吴威先生,督察长,经济学博士,历任兴业证券股份有限公司研究发展中心高级研究员、国际业务部负责人、兴业基金管理有限公司筹备组成员,兴业基金管理有限公司副总经理,日本野村证券北京代表处业务拓展总监。现任东吴基金管理有限公司督察长。

4.基金经理

韦勇先生,16年的证券从业经历。香港公开大学MBA毕业,曾任贵州证券交易经理、汉唐证券投资经理、恒泰证券投资经理等职。现任东吴优信稳健基金、货币基金基金经理。

5.投资决策委员会成员

徐建平 总经理;

王 炯 总裁助理、投资总监、兼投资管理部总经理;

殷 琪 研究副总监、研究策划部总经理;

陈 宪 首席策略规划师。

上述人员之间不存在近亲属关系。

(三)基金管理人的职责

1)欢洁募集基金,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、赎回和登记事宜;如认为基金代销机构违反《基金合同》、基金销售与服务代理协议及国家有关法律规定,应显报中国证监会和其他监管部门,并采取必要措施保护基金投资者的利益;

2)办理基金备案手续;

3)自《基金合同》生效之日起,以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产;

4)配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策,以专业化的经营方式管理和运作基金财产;

5)按照《证券法》、《基金法》及其他有关规定,履行信息披露及报告义务;

6)严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定,基金管理人的义务包括但不限于:

7)欢洁募集基金,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、赎回和登记事宜;如认为基金代销机构违反《基金合同》、基金销售与服务代理协议及国家有关法律规定,应显报中国证监会和其他监管部门,并采取必要措施保护基金投资者的利益;

8)办理基金份额的发售、登记、核算、结转、基金份额持有人名册等;

9)依据《基金合同》及有关法律规定监督基金托管人,如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定,应呈报中国证监会和其他监管部门,并采取必要措施保护基金投资者的利益;

10)决定基金托管人更换时,提名新的基金托管人;

11)选任、委托、更换基金代销机构,对基金代销机构的相关行为进行监督和处理;

12)相任或委托其他符合条件的机构担任基金注册登记机构办理基金注册登记业务并获得《基金合同》规定的费用;

13)欢报《基金合同》及有关法律规定决定基金收益的分配方案;

14)在《基金合同》约定的范围内,拒绝或暂停受理申购与赎回申请;

15)在符合有关法律法规和《基金合同》的前提下,制订和调整《业务规则》,决定和调整除调高管理费率和托管费率之外的基金相关费率结构和收费方式;

16)欢照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利,为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利;

17)在法律法规允许的前提下,为基金的利益依法为基金进行融资;

18)以基金管理人的名义,代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为;

19)选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构;

20)法律法规和《基金合同》规定的其他职责。

2.根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金管理人的义务包括但不限于:

1)欢法募集基金,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、赎回和登记事宜;如认为基金代销机构违反《基金合同》、基金销售与服务代理协议及国家有关法律规定,应呈报中国证监会和其他监管部门,并采取必要措施保护基金投资者的利益;

2)办理基金备案手续;

3)以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产;

4)配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策,以专业化的经营方式管理和运作基金财产;

5)建立健全内部风险控制、监察稽核、财务管理及人事管理等制度,保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立,对所管理的不同基金分别管理,分别记账,进行证券投资;

6)除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外,不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益,不得委托第三人运作基金财产;

7)欢法接受基金托管人的监督;

8)采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定,按有关规定计算并公告基金资产净值,确定基金份额申购、赎回的价格;

9)欢法基金会计核算并编制基金财务会计报告;

10)编制季度、半年度和年度基金报告;

11)严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定,履行信息披露及报告义务;

12)妥守基金商业秘密,不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外,在基金信息公开披露前应予保密,不向他人泄露;

13)按《基金合同》约定确定基金收益分配方案,及时向基金份额持有人分配基金收益;

14)按规定受理申购与赎回申请,及时、足额支付赎回款项;

15)欢报《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会,并执行其决定;

16)按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料15年以上;

17)确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出,并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式,随时查阅到与基金有关的公开资料,并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件;

18)组织并参加基金财产清算小组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;

19)和监督人、依法被撤销或者被依法宣告破产时,及时报告中国证监会并通知基金托管人;

20)因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时,应当承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;

21)监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务,基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时,基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿;

22)当基金管理人将其义务委托第三方处理时,应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任;但因第三方责任导致基金财产或基金份额持有人利益受到损失,而基金管理人首先承担了责任的情况下,基金管理人有权向第三方追偿;

23)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实施其他法律行为;

24)基金管理人在察集期间未能达到基金的备案条件,《基金合同》不能生效,基金管理人承担全部募集费用,将已募集资金并加计银行同期存款利息在基金募集期结束后30日内退还基金认购人;

25)执行生效的基金份额持有人的决定;

26)建立并保存基金份额持有人名册,定期或不定期向基金托管人提供基金份额持有人名册;

27)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

(二)基金托管人的权利和义务

1.根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金托管人的权利包括但不限于:

1)自《基金合同》和《托管协议》生效之日起,依法律法规、《基金合同》和《托管协议》的规定安全保管基金财产;

2)依《基金合同》和《托管协议》约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入;

3)监督基金管理人对本基金的投资运作,如发现基金管理人有违反《基金合同》、《托管协议》及国家法律法规行为,对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形,应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正,基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的,应呈报中国证监会,并采取必要措施保护基金投资者的利益;

4)以基金托管人和基金份额持有人的名义,代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或实施其他法律行为;

5)以基金托管人名义开立证券交易资金账户,用于证券交易资金清算;

6)以基金的名义在中央国债登记结算有限公司开设银行间债券托管账户,负责基金投资债券的后台匹配及资金的清算;

7)履行开戒召集基金份额持有人大会;

8)依据《基金合同》及有关法律规定监督基金托管人,如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定,应呈报中国证监会和其他监管部门,并采取必要措施保护基金投资者的利益;

9)欢法选任、更换基金托管人,提名新的基金托管人;

10)法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

2.根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金托管人的义务包括但不限于:

1)安全保管基金财产;

2)建立健全内部风险控制、监察稽核、财务管理及人事管理等制度,保证所管理的基金财产和基金托管人的财产相互独立,对所管理的不同基金分别管理,分别记账,进行证券投资;

3)除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外,不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益,不得委托第三人运作基金财产;

4)按照《基金合同》的规定,根据基金管理人的投资指令,及时办理清算、交割事宜;

5)妥守基金商业秘密,除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外,在基金信息公开披露前予以保密,不得向他人泄露;

6)复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额申购、赎回价格;

7)办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项;

8)对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告出具意见,说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行;如果基金管理人有未执行《基金合同》规定的行为,还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施;

9)自基金合同生效之日起,保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料15年以上;

10)建立并保存基金份额持有人名册;

11)按规定制作相关账册并与基金管理人核对;

12)欢据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项;

13)按照规定召集基金份额持有人或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会;

14)按照法律法规和《基金合同》约定监督基金管理人的投资运作;

15)参加基金财产清算小组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;

16)组织解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时,及时报告中国证监会和银行监管机构,并通知基金管理人;

17)因违反《基金合同》导致基金财产损失时,应承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;

18)按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人大会召集人召集基金份额持有人大会,并执行其决定;

19)法律法规和《基金合同》规定的其他职责。

3.根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金托管人的权利包括但不限于:

1)分享基金财产收益;

2)参与分配清算后的剩余基金财产;

3)按照法律法规和《基金合同》的规定申请赎回其持有的基金份额;

4)按照规定要求召开基金份额持有人大会;

5)对需或者委派代表出席基金份额持有人大会,对基金份额持有人大会审议事项行使表决权;

6)查阅或者复制公开披露的基金信息资料;

7)监督基金管理人的投资运作;

8)对基金管理人、基金托管人、基金销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼;

9)法律法规及《基金合同》规定的其他权利。

4.按照法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务,基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时,基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿;

5)当基金管理人将其义务委托第三方处理时,应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任;但因第三方责任导致基金财产或基金份额持有人利益受到损失,而基金管理人首先承担了责任的情况下,基金管理人有权向第三方追偿;

6)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实施其他法律行为;

7)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

(三)基金管理人的职责

1)欢法募集基金,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、赎回和登记事宜;如认为基金代销机构违反《基金合同》、基金销售与服务代理协议及国家有关法律规定,应显报中国证监会和其他监管部门,并采取必要措施保护基金投资者的利益;

2)办理基金备案手续;

3)自《基金合同》生效之日起,以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产;

4)配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策,以专业化的经营方式管理和运作基金财产;

5)建立健全内部风险控制、监察稽核、财务管理及人事管理等制度,保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立,对所管理的不同基金分别管理,分别记账,进行证券投资;

6)除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外,不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益,不得委托第三人运作基金财产;

7)欢法接受基金托管人的监督;

8)采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定,按有关规定计算并公告基金资产净值,确定基金份额申购、赎回的价格;

9)欢法基金会计核算并编制基金财务会计报告;

10)编制季度、半年度和年度基金报告;

11)严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定,履行信息披露及报告义务;

12)妥守基金商业秘密,不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外,在基金信息公开披露前应予保密,不向他人泄露;

13)按《基金合同》约定确定基金收益分配方案,及时向基金份额持有人分配基金收益;

14)按照《基金合同》规定受理申购与赎回申请,及时、足额支付赎回款项;

15)欢报《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会,并执行其决定;

16)按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料15年以上;

17)确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出,并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式,随时查阅到与基金有关的公开资料,并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件;

18)组织并参加基金财产清算小组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;

19)和监督人、依法被撤销或者被依法宣告破产时,及时报告中国证监会并通知基金托管人;

20)因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时,应当承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;

21)监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务,基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时,基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿;

22)当基金管理人将其义务委托第三方处理时,应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任;但因第三方责任导致基金财产或基金份额持有人利益受到损失,而基金管理人首先承担了责任的情况下,基金管理人有权向第三方追偿;

23)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实施其他法律行为;

24)基金管理人在察集期间未能达到基金的备案条件,《基金合同》不能生效,基金管理人承担全部募集费用,将已募集资金并加计银行同期存款利息在基金募集期结束后30日内退还基金认购人;

25)执行生效的基金份额持有人的决定;

26)建立并保存基金份额持有人名册,定期或不定期向基金托管人提供基金份额持有人名册;

27)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

(四)基金管理人承诺

1.基金管理人将根据基金合同的规定,按照招募说明书列明的投资目标、理念、策略及限制等全权处理本基金的投资。

2.基金管理人严格遵守《证券法》、《基金法》、《信息披露办法》、《运作办法》、《销售办法》、建立健全内部控制制度,采取有效措施,防止以下《基金法》及有关法规禁止的行为发生:

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)承销证券;

6)向他人贷款或者提供担保;

7)从事承担无限责任的投资;

8)买卖其他基金份额,但是国务院另有规定的除外;

9)向本基金管理人、基金托管人出资或者买卖本基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券;

10)买卖与本基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与本基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券;

11)从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;

12)欢照法律、行政法规有关规定,由中国证监会规定禁止的其他活动。

法律法规或监管部门对上述限制另有规定时从其规定。

3.基金管理人将加强人员管理,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,不从事以下行为:

1)越权或违规经营;

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合同当事人的合法权益;

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;

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;

8)违反证券交易所所业务规则,利用对敲、对倒、对舍等手段操纵市场价格,扰乱市场秩序;

9)在公开信息披露中故意含有虚假、误导、欺诈成分;

10)其他法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。

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)不利用职务之便为自己、被代理人、被代表人、受雇人或任何其他第三人谋取不当利益;

3)不泄漏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。

(五)基金管理人的内部控制制度

1.风险管理的理念

1)风险管理是业务发展的保障;

2)最高管理层负最终责任;

3)分工明确、相互牵制的组织结构是前提;

4)制度建设是基础;

5)制度执行监督是保障;

2.风险管理的原则

1)健全性原则:风险控制必须覆盖公司的各项业务、各个部门和各级人员,并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个经营环节;

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:公司设风险管理委员会,督察长和监察稽核部,各风险控制机构和人员具有并保持高度的独立性和权威性,负责对公司各部门风险控制工作进行监察和稽核;

4)相互制约原则:公司内部部门和岗位的设置必须权责分明、相互制约,同时强化监察稽核部对各部门的监察稽核职能;

5)防火墙原则:公司基金投资业务和公司自有资投资业务应在空间上和制度上适当隔离,投资决策和交易清算应严格分离。对因业务需要知悉内幕信息的人员,应对其相应行为制定严格的审批程序和过失处罚措施。

6)适时性原则:公司内部控制制度的制定应具有前瞻性,并且随着公司经营战略、经营方针、经营管理等内部环境的变化和国家法律、法规、政策制度等外部环境的改变而及时进行相应的修改和完善。

7)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.风险管理和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工明确、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,各个业务部门负责本部门的风险评估和监控,监察部负责监察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)风险管理委员会:作为总裁领导下的专门委员会之一,风险管理委员会负责协助经营管理层建立健全内部控制制度,保证公司内控制度适应业务发展的需要,制定公司的业务风险管理政策,主持重大业务的可行性论证,协助经营管理层处理其他有关内部控制方面的重大事项。

3)督察长:独立行使督察权利;直接对董事会负责;按季向风险控制委员会提交独立的风险管理报告和风险管理建议。

4)监察稽核部:监察稽核部负责公司内控机制与制度的建立、监察、评估和建议。

5)业务部门:风险管理是每一个业务部门最首要的责任。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程序,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。

4.风险管理和内部风险控制的措施

1)建立内控结构,完善内控制度;公司建立、健全了内控结构,高管人员关于内控有明确的分工,确保各项业务活动有恰当的组织和授权,确保监察活动是独立的,并得到高管人员的支持,同时置备操作手册,并定期更新。

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,做到基金经理分开,投资决策分开,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、健全岗位责任制:建立、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中的风险隐患上报,以防范和减少风险。

4)建立风险分类、识别、评估、报告、提示程序:建立了评估风险的程序,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,从而以最快速度作出决策。

5)建立有效的内部监控系统:建立了足够、有效的内部监控系统,如电脑预警系统、投资监控系统,能对可能出现的各种风险进行全面和实时的监控。

6)建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,用以提示指数趋势、行业及个股的风险,以便公司及时采取有效的措施,对风险进行分散、控制和规避,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和适当的培训,使员工明确其职责所在,控制风险。

5.基金管理人关于内部合规控制声明书

1)本公司承诺