华安沪深300指数分级证券投资基金招募说明书

基金管理人:华安基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司

二〇一二年五月

重要提示

华安沪深300指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)由华安基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)依照有关法律法规及约定发起,并经中国证券监督管理委员会2012年3月5日证监许可[2012]278号文核准。本基金的《基金合同》和《招募说明书》已通过《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和基金管理人的互联网网站(www.huaan.com.cn)进行了公开披露。

本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作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

证券投资基金(以下简称“基金”)是一种长期投资工具,其主要功能是分散投资,降低投资单一证券所带来的个别风险。基金不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具,投资人购买基金,既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益,也可能承担基金投资所带来的损失。

基金分为股票基金、混合基金、债券基金、货币市场基金等不同类型,投资人投资不同类型的基金将获得不同的收益预期,也将承担不同程度的风险。一般来说,基金的收益预期越高,投资人承担的风险也越大。本基金是一只股票型指数基金,投资于标的指数成份股及其备选股的比例不低于基金资产的85%。本基金主要采用完全复制策略,跟踪标的指数市场表现,目标为获取市场平均收益,属于较高风险、较高预期收益的基金品种,其风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

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,投资人在投资本基金前,需充分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,包括市场风险、管理风险、流动性风险、合规性风险、操作和技术风险、本基金的特定风险(如指数化投资风险、投资替代风险、跟踪偏离风险、杠杆机制风险、折溢价交易风险、份额配对转换业务及基金份额折算等业务办理过程中的特有风险等)和投资股指期货的风险。巨额赎回风险是开放式基金所特有的一种风险,即当单个开放日华安沪深300份额的净赎回申请超过前一开放日全部基金份额(包括华安沪深300份额、华安沪深300A份额和华安沪深300B份额)的10%时,投资人将可能无法及时赎回持有的全部华安沪深300份额。

本基金场外认购采用金额认购的方式。单笔认购最低金额为50,000元,追加认购的单笔认购最低金额为50,000元;本基金场内认购采用份额认购的方式,单笔最低认购份额为50,000份,超过50,000份的须是1,000份的整数倍。本基金申购采用金额申购的方式,单笔申购最低金额为50,000元,追加申购的单笔申购最低金额为50,000元。

投资人应当认真阅读《基金合同》、《招募说明书》等基金法律文件,了解基金的风险收益特征,并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资人的风险承受能力相适应。

投资人应当充分了解基金定期定额投资和零存整取等储蓄方式的区别。定期定额投资是引导投资人进行长期投资、平均投资成本的一种简单易行的投资方式。但是定期定额投资并不能规避基金投资所固有的风险,不能保证投资人获得收益,也不是替代储蓄的等效理财方式。

基金管理人依照格尽职守,诚实信用,谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产,但不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。本基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现(如《基金管理人管理的其他基金的业绩不构成对本基金业绩表现的保证”)。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则,在作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资人自行负担。

投资人应当通过基金管理人或具有基金代销业务资格的其他机构购买赎回基金,基金代销机构名单详见本基金《招募说明书》以及相关公告。

本基金以1元发售面值开展基金募集,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净值仍有可能低于发售面值。

一、绪言

《华安沪深300指数分级证券投资基金招募说明书》(以下简称“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》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)及其他有关规定以及《华安沪深300指数分级证券投资基金合同》(以下简称“基金合同”)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合同当事人之间权利、义务的法律文件,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。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

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:指华安沪深300指数分级证券投资基金

2、基金管理人:指华安基金管理有限公司

3、基金托管人:指中国建设银行股份有限公司

4、基金合同:指《华安沪深300指数分级证券投资基金基金合同》及对本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《华安沪深300指数分级证券投资基金托管协议》及对该托管协议以任何有效修订和补充

6、招募说明书或本招募说明书:指《华安沪深300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《华安沪深300指数分级证券投资基金份额发售公告》

8、上市交易公告书:指《华安沪深300指数分级证券投资基金之华安沪深300A份额与华安沪深300B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,自2004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作出的修订

11、《销售办法》:指中国证监会2004年6月25日颁布、同年7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作出的修订

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作出的修订

13、《运作办法》:指中国证监会2004年6月29日颁布、同年7月1日实施的《证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时作出的修订

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:指依法可以投资开放式证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法注册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:指符合现实有效的相关法律法规规定可以投资于中国境内证券市场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、基金销售业务:指基金管理人或代销机构宣传推介基金,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

23、销售机构:指直销机构和代销机构

24、直销机构:指华安基金管理有限公司

25、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了基金销售服务代理协议,代为办理基金销售业务的机构,以及可通过深圳证券交易所交易系统办理基金销售业务的会员单位。其中可通过深圳证券交易所交易系统办理本基金销售业务的机构必须是具有基金代销业务资格、并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的,可通过深圳证券交易所交易系统办理本基金销售业务的深圳证券交易所会员单位

26、基金销售网点:指直销机构的直销中心及代销机构的代销网点

27、会员单位:指具有基金代销业务资格的深圳证券交易所会员单位

28、场外:指通过深圳证券交易所外的销售机构办理基金份额认购、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、赎回由称为场外认购、场外申购、场外赎回

29、场内:指通过深圳证券交易所内具有相应业务资格的会员单位利用交易所交易系统办理基金份额认购、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

30、注册登记业务:指基金登记、存管、过户、清算和交收业务,具体内容包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额注册登记、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、办理非交易过户业务等

31、注册登记机构:指办理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

32、注册登记系统: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,通过场外销售机构认购、申购的基金份额登记在本系统

33、证券登记结算系统:指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,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

34、场外份额:指登记在注册登记系统下的基金份额

35、场内份额:指登记在证券登记结算系统下的基金份额

36、基金账户:指注册登记机构为投资人开立的、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

37、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买卖本基金的基金份额变动及结余情况的账户

38、深圳证券账户:指在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开设的深圳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

39、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

40、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

41、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

42、存续期:指基金合同生效至终止之间的不定期期限

43、工作日:指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

44、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工作日

45、T+n日:指自T日起第n个工作日(不包含T日)

46、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

47、日/天:指公历日

48、月:指公历月

49、交易时间:指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

50、《业务规则》:指深圳证券交易所发布实施的《深圳证券交易所上市开放式基金业务规则》、《深圳证券交易所开放式基金申购赎回业务实施细则》、《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》、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》及代销机构业务规则等相关业务规则和实施细则

51、标的指数:沪深300指数

52、华安沪深300份额:指华安沪深300指数分级证券投资基金之基础份额

53、华安沪深300A份额:指华安沪深300份额按基金合同约定规则所分离的稳健收益类基金份额

54、华安沪深300B份额:指华安沪深300份额按基金合同约定规则所分离的积极收益类基金份额

55、认购:指在基金募集期内,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

56、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

57、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

58、上市交易:指基金合同生效后投资人通过场内会员单位以集中竞价的方式买卖华安沪深300A份额、华安沪深300B份额的行为

59、配对转换:指根据基金合同的约定,本基金的华安沪深300份额与华安沪深300A份额、华安沪深300B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:指根据基金合同的约定,基金份额持有人将其持有的每2份华安沪深300份额的场内份额申请转换成1份华安沪深300A份额与1份华安沪深300B份额的行为

61、合并:指根据基金合同的约定,基金份额持有人将其持有的每1份华安沪深300A份额与1份华安沪深300B份额进行配对申请转换成2份华安沪深300份额的场内份额的行为

62、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、某一基金基金份额转换为基金管理人管理的、且由同一注册登记机构办理注册登记的其他基金基金份额的行为

63、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机构持有份额的行为,包括系统内转托管及跨系统转托管

64、系统内转托管:指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)之间进行转托管的行为

65、跨系统转托管:指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

66、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、申购金额及扣款方式,由该销售机构为每期约定申购日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及受理基金申购申请的一种投资方式

67、巨额赎回:指本基金单个开放日,华安沪深300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)超过上一日全部基金份额(包括华安沪深300份额、华安沪深300A份额和华安沪深300B份额)10%的情形

68、元:指人民币元

69、基金利润:指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额;基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额

70、基金资产总值:指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收款项及其他资产的价值总和

71、基金资产净值:指基金资产总值减去基金负债后的价值

72、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

73、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

74、指定媒体: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体

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

76、不可抗力:指本基金合同当事人无法预见、无法避免且无法克服的客观事件或因素

三、基金管理人

(一)基金管理人概况

1、名称:华安基金管理有限公司

2、住所:上海市浦东新区世纪大道8号,上海国金中心二期31、32层

3、办公地址:上海市浦东新区世纪大道8号,上海国金中心二期31、32层

4、法定代表人:李劲

5、设立日期:1998年6月4日

6、批准设立机关及批准设立文号:中国证监会证监基字[1998]20号

7、联系电话:(021)38969999

8、联系人:冯颖

9、客户服务中心电话:40088-50099

10、网址:www.huaan.com.cn

(二)主持股东和股权结构

1、注册资本:1.5亿元人民币

2、股权结构

持股单位	持股占总股本比例
上海国际信托有限公司	20%
上海电气(集团)总公司	20%
上海锦江国际投资管理有限公司	20%
上海工业投资(集团)有限公司	20%
国泰君安投资管理股份有限公司	20%

(三)主要人员情况

1、基金管理人董事、监事、经理及其他高级管理人员

(1)董事会

朱仲群先生,研究生学历。历任中国人民银行人事司、办公厅副处长、处长,国家开发银行办公厅处长,中国光大银行大连分行行长助理、监察室副主任,中国平安人寿保险股份有限公司北京分公司党委副书记兼副总经理、党委书记兼总经理,长城人寿保险股份有限公司总经理、副董事长、董事,现任上海国际集团有限公司总经理助理,华安基金管理有限公司董事长。

李劲先生,大学学历,高级管理人员工商管理硕士(EMBA)。历任中国兴南(集团)公司证券投资部副总经理,北京汇正财经顾问有限公司董事总经理,上海证券交易所深圳办事处主任,中国投资信息有限公司董事总经理,现任华安基金管理有限公司董事、总裁。

冯祖新先生,研究生学历,历任上海市经济委员会办公室副主任科员、主任科员,上海市经济委员会信息中心副主任、主任,上海市工业投资公司副总经理、总经理,上海工业投资(集团)有限公司副总裁,现任上海工业投资(集团)有限公司总裁、法定代表人、党委副书记。

乌名驹先生,大学学历,高级会计师,历任上海凯鼎自行车股份有限公司副董事长兼总经理,上海东方上市企业博览中心副总经理,上海锦江国际投资管理有限公司董事兼总经理,锦江国际(集团)有限公司副总裁及计划财务部经理、金融事业部总经理、上海锦沧文华大酒店董事长、锦江麦德龙现购自运有限公司副董事长、北京昆仑饭店董事、上海锦江国际旅馆投资有限公司董事、锦江之星旅馆有限公司董事、锦江国际集团财务有限责任公司董事兼财务总监。

董鑑华先生,大学学历,高级经济师。历任上海市审计局固定资产投资科员、副处长、处长,上海市审计局财政审计处处长,现任上海电气(集团)总公司财务总监。

王松先生,研究生学历,高级经济师。历任建设银行总行投资部职员,国泰证券有限公司北京办事处副主任、发行二部副总经理、债券部总经理,国泰君安证券股份有限公司债券业务一部总经理、固定收益证券总部总经理、固定收益证券总部总监、总裁助理,现任国泰君安证券股份有限公司副总裁。

独立董事:

萧灼基先生,研究生学历,教授。历任全国政协委员,政协经济委员会委员,北京大学经济学院教授,博士生导师,北京市、云南省、吉林省、成都市、武汉市等省市专家顾问,北京市场经济研究所所长,《经济界》杂志社社长、主编。

吴伯庆先生,大学学历,一级律师,曾被评为上海市优秀律师与上海市十佳法律顾问。历任上海市城市建设局秘书科长、上海市第一律师事务所副主任、上海市金茂律师事务所主任、上海市律师协会副会长。现任上海市金茂律师事务所高级合伙人、上海仲裁委员会仲裁员、上海市律师协会顾问。

夏大慰先生,研究生学历,教授。历任上海财经大学科研处处长,上海财经大学南德管理学院院长,上海财经大学常务副校长,现任上海国家会计学院院长、党委书记、APEC金融与发展项目执行秘书处秘书长,兼任香港中文大学荣誉教授、中国工业经济研究与开发促进会副会长、中国会计学会副会长、财政部会计准则委员会咨询专家、上海证交所上市公司专家委员会委员、上海工业经济专业研究会主任委员等职务。

(2)监事会

谢伟民先生,研究生学历,副教授。历任上海市城建沪南工务所干部,空军政治学院训练部中共党史研究室正营级教员、讲师,上海市计委直属机关党委干事,中共上海市综合经济工作委员会组织处干部、宣传员(副处级)、副处长,中共上海市金融工作党委组织处(宣传处)副处长兼机关党委副书记、机关纪委书记(正处级)、现任华安基金管理有限公司监事会主席。

陈涵女士,研究生学历,经济师。历任上海国际信托投资公司金融一部项目经理、资产信托总部实业投资部副经理、资产管理总部投资业务部副科长,现任上海国际信托投资有限公司资产管理总部投资业务部科长。

柳振铎先生,研究生学历,高级经济师。历任上海良工阀门厂团委书记、车间主任、副厂长,上海机电工业管理局办公室副主任、规划处处长,上海电气(集团)总公司副总裁兼上海机电股份公司党委书记、总经理。

章卫进先生,大专学历,会计师。历任上海市有色金属总公司财务处科员、外经处会计主管,英国SONOFEC公司(长驻伦敦)业务经理、上海有色金属总公司房产公司财务部经理、办公室主任,上海工业投资(集团)有限公司财务部业务主管、副经理,现任上海工业投资(集团)有限公司财务部经理。

李梅清女士,大专学历,会计师。历任上海新亚(集团)股份有限公司财务部副经理、上海新亚(集团)有限公司财务部副经理,锦江国际(集团)有限公司计划财务部副经理及上市公司部副经理,上海锦江国际投资管理有限公司财务总监、金融事业部财务总监。

汪宝山先生,大学学历,经济师。历任建行上海市分行团委书记、直属党委书记、建行宝山宝钢支行副行长、建行上海市分行办公室副主任,国泰证券公司综合管理部总经理,公司专职党委副书记兼行政管理部总经理,公司专职党委副书记兼上海营业总部总经理,国泰君安证券专职董事、党委办公室主任、机关党委书记,公司党委委员、工会主席,国泰君安投资管理股份有限公司董事长、党委书记、国泰君安证券股份有限公司党委委员。

赵敏先生,研究生学历,助理研究员。曾在上海社会科学院人口与发展研究所工作,历任华安基金管理有限公司综合管理部总经理、电子商务部总经理、上海营销总部总经理,现任华安基金管理有限公司总裁助理,兼任信息技术部总监。

诸慧女士,研究生学历,经济师。历任华安基金管理有限公司监察稽核部高级监察员,集中交易部总监助理,现任华安基金管理有限公司集中交易部总经理。

(3)高级管理人员

朱仲群先生,研究生学历,历任中国人民银行人事司、办公厅副处长、处长,国家开发银行办公厅处长,中国光大银行大连分行行长助理,监察室副主任,中国平安人寿保险股份有限公司北京分公司党委副书记兼副总经理、党委书记兼总经理,长城人寿保险股份有限公司总经理、副董事长、董事,现任上海国际集团有限公司总经理助理,华安基金管理有限公司董事长。

李劲先生,大学学历,高级管理人员工商管理硕士(EMBA)。历任中国兴南(集团)公司证券投资部副总经理,北京汇正财经顾问有限公司董事总经理,上海证券交易所深圳办事处主任,中国投资信息有限公司董事总经理,现任华安基金管理有限公司董事总经理。

尚志民先生,工商管理硕士,15年证券、基金从业经验。曾在上海证券报研究所、上海证大投资管理有限公司工作,进入华安基金管理有限公司后曾先后担任公司研究发展部高级研究员,1999年6月至2001年9月担任安顺证券投资基金的基金经理,2000年7月至2001年9月同时担任安瑞证券投资基金的基金经理,2001年9月至2003年9月担任华安创新证券投资基金的基金经理,2003年9月至今担任安顺证券投资基金的基金经理,2006年9月起同时担任华安宏利股票型证券投资基金的基金经理。现任华安基金管理有限公司副总裁、首席投资官。

章国富先生,研究生学历,22年经济、金融从业经验。曾任上海财经大学副教授、硕士生导师,上海大华会计师事务所会计师、中国诚信证券评估有限公司上海分公司副总经理、上海华虹(集团)有限公司财务部副部长(主持工作)、上海信虹投资管理有限公司副总经理兼上海新鑫投资有限公司财务总监,现任华安基金管理有限公司督察长。

2、本基金基金经理

牛勇先生,复旦大学经济学硕士、FRM(金融风险管理师)、7年证券、金融从业经历,曾在泰康人寿保险股份有限公司从事研究工作。2008年5月加入华安基金管理有限公司后任风险管理与金融工程部高级金融工程师。2009年7月3日至2010年9月2日担任华安中国A股增强指数证券投资基金的基金经理助理;2010年6月18日起至今担任上证180交易型开放式指数证券投资基金的基金经理;2010年9月2日起至今担任华安MSCI中国A股指数增强型证券投资基金的基金经理;2010年11月18日起至今担任上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金;2010年11月18日起至今担任华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。

张昊先生,密歇根大学金融工程硕士、4年证券、基金行业从业经历。曾在美国Trafelet Delta Funds担任量化分析师、风险对冲管理师等职。2009年6月加入华安基金管理有限公司后任风险管理与金融工程部高级金融工程师。

3、本公司采取集体投资决策制度,公司投资决策委员会成员的姓名和职务如下:

李劲先生,总裁

尚志民先生,副总裁、首席投资官

顾建国先生,财富管理中心总经理

陈俏宇女士,基金经理

汪光成先生,基金经理

杨明先生,研究发展部总经理、首席宏观策略师

翁启森先生,全球投资部总经理、基金经理

上述人员之间不存在近亲属关系。

4、业务人员的准备情况:

截至2012年3月31日,公司目前共有员工297人,主要来自国内外证券公司等金融机构,其中80.1%以上具有三年证券业或五年金融业从业经历,具有丰富的实际操作经验。所有上述人员在最近三年内均未受到所在单位及有关管理部门的处罚。公司业务由投资与研究、营销、后台支持等三个业务板块组成。

(四)基金管理人的职责

根据《基金法》的规定,基金管理人应履行以下职责:

1、依法募集基金,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、集中申购、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、编制基金定期报告;

7、计算并公告基金资产净值、每万份基金净收益等公开披露的相关基金信息,确定基金份额集中申购、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、中国证监会规定的其他职责。

(五)基金管理人的承诺

1、基金管理人承诺建立健全内部控制制度,采取有效措施,防止违反《证券法》行为的发生;

2、基金管理人承诺建立健全内部控制制度,采取有效措施,防止违反《基金法》及相关法律法规的行为的发生;

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)欺权或违规经营;

(2)违反基金合同或托管协议;

(3)欺意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法利益;

(4)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)泄露在证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)除为基金管理人进行基金投资外,直接或间接进行其他投票交易,也不协助、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;

(9)勒助、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)其他法律法规及中国证监会禁止的行为。

4、基金管理人关于履行诚信义务的承诺

基金管理人承诺将以取信于市场、取信于社会为宗旨,按照诚实信用、勤勉尽责的原则,严格遵守有关法律法规和中国证监会发布的监管规定,不断更新投资理念,规范基金运作。

5、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、代理人、代表人、受雇人或任何第三人谋取不当利益;

(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;

(4)除为基金管理人进行基金投资外,不直接或间接进行其他投票交易,也不协助、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。

(六)基金管理人的内部控制制度

1、内部控制的原则

(1)避全性原则

内部控制包括公司各项业务、各个部门或机构和全体人员,并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个环节。

(2)有效性原则

通过科学的内部控制手段和方法,建立合理的内部控制程序,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、内部控制的组织体系

公司的内部控制组织体系是一个权责分明、分工明确的组织结构,以实现对公司从决策层到管理层、操作层的全面监督和控制。具体而言,包括以下组成部分:

(1)董事会:董事会对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任。

(2)监事会:监事会依照公司法和公司章程对公司经营管理活动、董事和公司管理层的行为行使监督权。

(3)督察长:督察长对董事会直接负责。对公司的日常经营管理活动进行合规性监督和检查,直接向公司董事会和中国证监会报告。

(4)给规与风险管理委员会:合规与风险管理委员会是为加强公司在业务运作过程中的风险控制而成立的非常设机构,以召开例会形式开展工作,向公司总经理负责。主要职责是定期和不定期审议公司合规报告、风险管理报告以及其他风险控制重大事项。

(5)给规监察稽核部:合规监察稽核部负责对公司内部控制制度的执行情况进行合规性监督检查,向公司合规与风险管理委员会和总经理报告。

(6)各业务部门:内部控制是每一个业务部门和员工最首要和基本的职责。各部门的主管在权限范围内,对其负责的业务进行检查监督和风险控制。各位员工根据国家法律法规、公司规章制度、道德规范和行为准则、自己的岗位职责进行自律。

3、内部控制制度概述

公司内部控制制度由内部控制大纲、基本管理制度、部门业务规章等部分组成。

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,是各项基本管理制度的纲要和总揽,内部控制大纲应当明确内控目标、内控原则、控制环境、内控措施等内容。

基本管理制度包括风险控制制度、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、资料档案管理制度、业绩评估考核制度和紧急应变制度等。

部门业务规章是在基本管理制度的基础上,对各部门的主要职责、岗位设置、岗位责任、操作守则等的具体说明。

4、基金管理人内部控制五要素

内部控制的基本要素包括:控制环境、风险评估、控制活动、信息沟通、内部监控。

(1)控制环境

控制环境构成公司内部控制的基础,包括公司治理结构体系和内部控制体系。公司内部控制体系又包括公司的经营理念和内控文化、内部控制的组织体系、内部控制的制度体系、员工的道德操守和素质等内容。

公司自成立以来,通过不断加强公司管理层和员工对内部控制的认识和控制意识,致力于从公司文化、组织结构、管理制度等方面营造良好的控制环境氛围,使风险意识贯穿公司各个部门、各个岗位和各个业务环节。逐步完善了公司治理结构、加强了公司内部合规控制建设,建立了公司内部控制体系。

(2)风险评估

公司通过对组织结构、业务流程、经营运作活动进行分析、测试检查,发现风险,将风险进行分类、按重要性排序,找出风险分布点,分析其发生的可能性及对目标的影响程度,评估目前的控制程度和风险高低,找出引致风险产生的原因,采取定性定量的手段分析考量风险的高低和危害程度。在风险评估后,确定应进一步采取的对应措施,对内部控制制度、规则、公司政策等进行修订和完善,并监督各个环节的改进实施。

(3)控制活动

公司的一系列规章制度、业务规则在制定、修订的过程中,也得到了一贯的实施。主要包括:组织结构控制、操作控制、会计控制。

① 组织结构控制

公司各个部门的设置体现了部门之间的职责分工,及部门间相互合作与制衡的原则。基金投资管理、基金运作、市场营销等业务部门有明确的授权分工,各部门的操作相互独立、相互牵制并且有独立的报告系统,形成权责分明、严格有效的三道监控防线。

以各岗位目标责任制为基础的第一道监控防线;各部门内部工作岗位合理分工、职责明确,对不相容的职务、岗位分离设置,使不同的岗位之间形成一种相互检查、相互制约的关系,以减少差错或舞弊发生的风险。

各相关部门、相关岗位之间相互监督和牵制的第二道防线;公司在相关部门、相关岗位之间建立标准化的业务操作流程、重要业务处理表单传递及信息沟通制度,后续部门及岗位对前一部门及岗位负有监督和检查的责任。

以合规监察稽核部对各部门、各岗位、各项业务全面实施监督反馈的第三道监控防线。

② 操作控制

公司制定了一系列的基本管理制度,如风险控制制度、投资管理制度、基金会计制度、公司财务制度、信息披露制度、监察稽核制度、信息技术管理制度、资料档案管理制度、业绩评估考核制度和紧急应变制度等,控制日常运作和经营中的风险。公司各业务部门在实际操作中遵照实施。

③ 会计控制

公司确保基金资产与公司自有资产完全分开,分账管理,独立核算;公司会计核算与基金会计核算在业务规范、人员岗位和办公区域上严格分开。公司对所管理的不同基金分别设立账户,分账管理,以确保每只基金和基金资产的完整独立。

基本的会计控制措施主要包括:复核、对账制度;凭证、资料管理制度;会计账务的组织和处理制度。运用会计核算与账务系统,准确计算基金资产净值,采取科学、明确的资产估值方法和估值程序,公允地反映基金在估值时点的价值。

④ 信息内控

为了及时实现信息的沟通,有效地达成目下而上的报告和自上而下的反馈,公司采取以下措施:

建立了内部办公自动化信息系统与业务汇报体系,通过建立有效的信息交流渠道,保证公司各级管理人员和员工可以充分了解与其职责相关的信息,保证信息及时送达适当的人员进行处理。

制定了管理和业务报告制度,包括定期报告和不定期报告制度。按既定的报告路线和报告频率,在适当的时间向适当的内部人员和外部机构进行报告。

⑤ 内部监控

监控是监督和评估内部控制体系设计合理性和运行有效性的过程,对控制环境、控制活动等进行持续的检验和完善。

监察稽核人员负责日常监督工作,促使公司员工积极参与和遵循内部控制制度,保证制度的有效实施。

公司合规监察稽核部对各业务部门内部控制制度的实施情况进行持续的检查,检验其是否符合设计要求,并及时地充实和完善,反映政策法规、市场环境、组织调整等因素的变化趋势,确保内控制度的有效性。

5、基金管理人内部控制制度声明

基金管理人声明以上关于内部控制制度的披露真实、准确,并承诺公司将根据市场变化和业务发展来不断完善内部风险控制制度。

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:王洪章

成立时间:2004年09月17日

组织形式:股份有限公司

注册资本:贰千叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元

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:250,010,977,486股(包括240,417,319,880股H股及9,593,657,606股A股)。

(下转D10版)

华安沪深300指数分级证券投资基金基金份额发售公告

重要提示

1.华安沪深300指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)的发售已获2012年3月5日中国证监会《关于核准华安沪深300指数分级证券投资基金募集的批复》(证监许可[2012]278号)和2012年5月23日《关于华安沪深300指数分级证券投资基金募集时间安排的确认函》(基金部函[2012]344号)核准。中国证监会对本基金的核准并不代表中国证监会对本基金的风险和收益作出实质性判断、推荐或者保证。

2.本基金为股票型基金,基金运作方式为契约型开放式,基金管理人为华安基金管理有限公司(以下简称“本公司”),基金托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称“中国建设银行”)。

3.本基金通过场外、场内两种方式公开发售,其中,场外发售机构包括直销机构和代销机构,场内发售机构为具有基金销售资格的深圳证券交易所会员单位。

4.本基金的基金代码为160417,基金简称为华安沪深300指数分级,场内简称为华安300。

5.本基金的发售期为2012年6月1日起至2012年6月18日。

6.本基金募集期内不设募集目标上限。

7.本基金的募集对象包括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、机构投资者以及合格境外机构投资者。

8.募集期内,投资者可对本基金进行多次认购,认购一经受理,不得撤销。投资者应保证用于认购的资金来源合法,投资者应有权自行支配,不存在任何法律上