上证医药卫生交易型开放式指数发起式证券投资基金招募说明书

认购代码:510663　交易代码:510660
发售时间:2013年2月25日至2013年3月22日
发售机构:中信证券 中信建投证券 中国银河证券 国信证券 国泰君安证券 海通证券 申银万国证券 广发证券 中投证券 安信证券等各大证券公司

重要提示

上证医药卫生交易型开放式指数发起式证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证监会2012年9月13日证监许可[2012]1223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。

本基金为发起式基金,在基金募集时,基金管理人股东将运用其自有资金认购本基金的金额不低于1000万元,认购的基金份额持有期限不低于三年,基金管理人股东认购的基金份额持有期限满三年后,基金管理人股东将根据自身情况决定是否继续持有,届时,基金管理人股东有可能赎回其认购的本基金份额。另外,在基金合同生效之日起三年后的对应日,如果本基金的资产规模低于2亿元,基金合同将自动终止,投资者将面临基金合同可能终止的不确定性风险。基金管理人股东的认购行为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等因素产生波动,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。本基金投资中的风险包括:因整体政治、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管理风险,某一基金的特定风险等。本基金是股票基金,风险和收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股,在股票基金中属于较高风险、较高收益的产品。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,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

一、绪言

《上证医药卫生交易型开放式指数发起式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《上证医药卫生交易型开放式指数发起式证券投资基金基金合同》(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。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。基金投资者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。基金投资者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:

基金或本基金:	指上证医药卫生交易型开放式指数发起式证券投资基金。
交易型开放式指数基金:	指《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》定义的"交易型开放式指数基金"。
基金管理人:	指华夏基金管理有限公司。
基金托管人:	指中国建设银行股份有限公司。
基金合同:	指《上证医药卫生交易型开放式指数发起式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。
托管协议:	指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《上证医药卫生交易型开放式指数发起式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。
招募说明书:	指《上证医药卫生交易型开放式指数发起式证券投资基金招募说明书》及其定期的更新。
基金份额发售公告:	指《上证医药卫生交易型开放式指数发起式证券投资基金基金份额发售公告》。
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。
《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做出的修订。
《销售办法》:	指中国证监会2011年6月9日颁布、同年10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做出的修订。
《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。
《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做出的修订。
业务规则:	指上海证券交易所发布实施的《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》、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关于上海证券交易所交易型开放式基金登记结算业务实施细则》及上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司发布的其他相关规则和规定。
中国证监会:	指中国证券监督管理委员会。
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。
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。
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。
机构投资者:	指依法可以投资于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。
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。
投资者:	指个人投资者、机构投资者、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者的合称。
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者。
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、赎回等业务。
销售机构:	指华夏基金管理有限公司。
直销机构:	指华夏基金管理有限公司。
代销机构:	指发售代理机构和/或申购赎回代理机构。
发售代理机构:	指基金管理人指定的代理本基金发售业务的机构。
申购赎回代理机构:	指基金管理人指定的代理本基金申购、赎回业务的机构。
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。
登记结算业务:	指根据《中国证券登记结算有限责任公司关于上海证券交易所交易型开放式基金登记结算业务实施细则》定义的基金份额的登记、托管和结算业务。
登记结算机构:	指办理登记结算业务的机构。基金的登记结算机构为中国证券登记结算有限责任公司。
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。
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。
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。
存续期:	指基金合同生效至终止之间的不定期期限。
工作日:	指上海证券交易所的正常交易日。
T日:	指销售机构在规定时间受理投资者申购、赎回或其他业务有效申请的工作日。
T+n日:	指自T日后第n个工作日(不包含T日)。
开放日:	指为投资者办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日。
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。
认购:	指在基金募集期内,投资者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。
申购:	指基金合同生效后,投资者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。
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基金管理人购回基金份额的行为。
申购赎回清单:	指由基金管理人编制的用以公告申购对价、赎回对价等信息的文件。
申购对价:	指投资者申购基金份额时,按基金合同和招募说明书规定应交付的组合证券、现金替代、现金差额和/或其他对价。
赎回对价:	指投资者赎回基金份额时,基金管理人按基金合同和招募说明书规定应交付给赎回人的组合证券、现金替代、现金差额和/或其他对价。
标的指数:	指上证医药卫生行业指数及其未来可能发生的变更,或基金管理人根据需要更换的其他指数。
最小申购、赎回单位:	指基金申购份额、赎回份额的最低数量,投资者申购、赎回的基金份额应为最小申购、赎回单位的整数倍。
元:	指人民币元。
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、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约。
基金资产总值:	指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和。
基金资产净值:	指基金资产总值减去基金负债后的价值。
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。
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。
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。
不可抗力:	指基金合同当事人无法预见、无法抗拒、无法避免且在基金合同由基金管理人、基金托管人签署之日以后发生的、使基金合同当事人无法全部或部分履行基金合同的任何事件,包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用、没收、恐怖袭击、传染病传播、法律法规变化、突发停电或其他突发事件,证券交易所非正常暂停或停止交易。

三、基金管理人

(一)基金管理人概况

名称:华夏基金管理有限公司
住所:北京市顺义区天竺空港工业区A区
办公地址:北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座12层
设立日期:1998年4月9日
法定代表人:王东明
联系人:崔雁巍
客户服务电话:400-818-6666
传真:010-63136700
华夏基金管理有限公司注册资本为23800万元,公司股权结构如下:

持股单位	持股占总股本比例
中信证券股份有限公司	49%
南方工业资产管理有限责任公司	11%
山东省农村经济开发投资公司	10%
POWER CORPORATION OF CANADA	10%
青岛海鹏科技投资有限公司	10%
无锡市国联发展(集团)有限公司	10%
合计	100%

(二)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基本情况

王东明先生:董事长,硕士,高级经济师,现任中信证券股份有限公司董事长、执行董事兼执行委员会委员、中国中信股份有限公司总经理、中信股份有限责任公司董事、中信国际金融控股有限公司董事、中信证券国际有限公司非执行董事、曾任职于加拿大卡皮银行证券公司投资银行部,曾任华夏证券有限责任公司国际部总经理,南方证券有限公司副总经理,中信证券股份有限公司副总经理、总经理、董事,中信资本控股有限公司非执行董事。

范勇宏先生:副董事长,博士,高级经济师,现任华夏基金管理有限公司党委书记,北京市人大代表,北京市顺义区人大常委,兼任北京市金融街商会监事长。曾任中国建设银行总行干部,华夏证券有限公司北京东四营业部总经理、总裁助理、华北区总监(副总裁),华夏基金管理有限公司总经理,第三、四届中国证监会发审委委员。

华伟荣先生:董事,硕士,高级会计师,现任无锡市国联发展(集团)有限公司副总裁,国联信托股份有限公司董事长。曾任无锡市财政局预算管理科科员、综合计划科副科长,无锡市信托投资公司部门经理、总经理助理、副总经理,国联证券有限责任公司董事、总裁,国联基金管理有限公司(现中高基金管理有限公司)董事长。

胡祖六先生:董事,博士,教授,现任春华资本集团主席,曾任国际货币基金组织高级经济学家,达沃斯世界经济论坛首席经济学家,高盛集团大中华区主席,合伙人、董事总经理。

徐刚先生:董事,博士,经济师,现任中信证券股份有限公司执行委员会委员、董事总经理、经纪业务发展与管理委员会主任委员、研究部行政负责人。曾任中国地质机械仪器工业总公司干部,曾任职于中信证券股份有限公司研究咨询部、资产管理部、金融产品开发小组、金融组、研究部、股票销售交易部,担任经理、高级经理、部门副总经理、部门总经理、部门行政负责人等职务。

葛小波先生:董事,硕士,现任中信证券股份有限公司执行委员会委员、董事总经理、计划财务部行政负责人。曾任中信证券股份有限公司投资银行部董事总经理、上市部副主任、风险控制部执行总经理、交易部(现交易与衍生产品业务部)行政负责人。

朱武祥先生:独立董事,博士,教授。现任清华大学经济管理学院金融系教授、博士生导师、系副主任,兼任北京燕京啤酒股份有限公司、北京建设(控股)有限公司、歌尔声学股份有限公司独立董事,中国金融学会常务理事。

贾建平先生:独立董事,大学本科,高级经济师。现已退休。曾任职于北京工艺品进出口公司、美国纽约中国物产有限公司(外派工作),曾担任中国银行信托咨询公司副处长、处长,中国银行卢森堡公司副总经理,中国银行意大利代表处首席代表,中银集团投资管理公司副董事长、总经理,中国银行重组上市办公室、董事会秘书办公室、上市办公室总经理,中银基金管理有限公司董事长。

谢德仁先生:独立董事,博士,教授,现任清华大学经济管理学院会计学教授、博士生导师,兼任北京超图软件股份有限公司、同方环境股份有限公司、北京双杰电气股份有限公司独立董事,中国会计学会《会计研究》编委,中国会计学会财务成本分会第七届理事会副会长,国家自然科学基金和国家社会科学基金通讯评审专家,教育部科技发展中心科研基金和科技奖励评审专家,学位与研究生教育发展中心专家。曾任清华大学经济管理学院会计学讲师、副教授。

滕天鸣先生:总经理,硕士。曾任机构理财部总经理、公司总经理助理、公司副总经理等。

张后奇先生:副总经理,博士。曾任公司总经理助理。

刘文动先生:副总经理,硕士。曾任公司总经理助理等。

吴志军先生:副总经理,学士。曾任上海分公司总经理、市场总监、公司总经理助理等。

林浩先生:副总经理,硕士。曾任公司总经理助理等。

方瑞枝女士:督察长,硕士。曾在中国金融出版社工作。

李红源先生:监事会召集人,硕士,研究员级高级工程师。现任南方工业资产管理有限责任公司总经理。曾任中国北方光学电子总公司信息部职员,中国兵器工业总公司教育局职员、主任科员、规划处副处长、计划处处长,中国兵器装备集团公司发展计划部副主任,经济运营部副主任、资本运营部巡视员兼副主任。

于少明先生:监事,大学本科,高级会计师,现任山东省农村经济开发投资公司总经理,山东高速集团有限公司总经理助理,山东高速投资控股有限公司总经理,曾任西藏地质局驻西安疗养院、探矿十二队职员,山东省交通厅黄河航运局副科长,山东省交通厅主任、副处长,山东基建股份有限公司总经理。

吕翔先生:监事,学士,现任中信证券股份有限公司投资管理部执行总经理。曾任国家劳动部综合计划与工资司副主任科员、中信证券股份有限公司人力资源管理部执行总经理。

刘义先生:监事,工商管理硕士,现任华夏基金管理有限公司党委委员、养老金业务总监。曾任中国人民银行总行计划资金司副主任科员、主任科员,中国农业发展银行总行信息电脑部信息综合处副处长(主持工作),华夏基金管理有限公司工会主席、党办主任、养老金部总经理等。

查尔斯?西姆斯先生:监事,学士,注册会计师。现任万信基金公司总裁兼首席执行官,IGM基金公司联席总裁兼首席执行官。曾任职于加拿大多伦多市的Coopers and Lybrand公司,曾任富勤谭普顿投资公司加拿大多伦多分支机构的首席财务官和销售与营销主管,富勤谭普顿投资公司加利福尼亚州国际总部副总裁、公司行政总裁,另外,曾任职于FundSERV公司董事会,并曾担任加拿大投资基金协会(IFIC)董事会成员、理事会成员。

唐茜女士:监事,法学和金融学双学士。现任华夏基金管理有限公司纪律检查委员会委员、法律监察部总经理。曾任中国工商银行北京分行法律部、证券监管部门主任科员,华夏基金管理有限公司成都分公司总经理。

2.本基金基金经理

张弘弢先生,硕士,2000年4月加入华夏基金管理有限公司,曾任研究发展部总经理等,现任数量投资部副总经理,华夏沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金(原华夏沪深300指数证券投资基金)基金经理(2009年7月10日起任职)、恒生交易型开放式指数证券投资基金基金经理(2012年8月9日起任职)、恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理(2012年8月21日起任职)、华夏沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金经理(2012年12月25日起任职)。

3.本公司投资决策委员会(股票投资)成员

滕天鸣先生:华夏基金管理有限公司总经理。

刘文动先生:华夏基金管理有限公司副总经理。

程海泳先生:华夏基金管理有限公司总经理助理、投资总监、股票投资部总经理,华夏复兴股票型证券投资基金基金经理。

巩怀志先生:华夏基金管理有限公司投资副总监、股票投资部副总经理,华夏优势增长股票型证券投资基金基金经理、华夏大盘精选证券投资基金基金经理。

王海雄先生:华夏基金管理有限公司投资副总监、股票投资部副总经理,华夏经典配置混合型证券投资基金基金经理、华夏平稳增长混合型证券投资基金基金经理。

胡建平先生:华夏基金管理有限公司股票投资部副总经理,华夏回报证券投资基金基金经理、华夏回报二号证券投资基金基金经理。

阳程先生:华夏基金管理有限公司股票投资部副总经理,兴华证券投资基金基金经理、华夏盛世精选股票型证券投资基金基金经理。

4.上述人员之间不存在近亲属关系。

(三)基金管理人的职责

1.依法募集基金,办理或者委托经国务院证券监督管理机构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。

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.编制中期和年度基金报告。

7.计算并公告基金资产净值,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.国务院证券监督管理机构规定的其他职责。

(四)基金管理人承诺

1.本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、策略及限制等全权处理本基金的投资。

2.本基金管理人不从事违反《证券法》的行为,并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。

3.本基金管理人不从事违反《基金法》的行为,并建立健全内部控制制度,采取有效措施,保证基金财产不用于下列投资或者活动:

(1)承销证券。

(2)向他人贷款或者提供担保。

(3)从事承担无限责任的投资。

(4)买卖其他基金份额,但是国务院另有规定的除外。

(5)向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券。

(6)买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、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。

(7)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。

(8)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活动。

4.本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)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。

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

基金管理人根据全面性原则、有效性原则、独立性原则、相互制约原则、防火墙原则和成本收益原则建立了一套比较完整的内部控制体系。该内部控制体系由一系列业务管理制度及相应的业务处理、控制程序组成,其体包括控制环境、风险评估、控制活动、信息沟通、内部监控等要素。公司已经通过了ISAE3402(《鉴证业务国际准则第3402号》)认证,获得无保留意见的控制设计合理性及运行有效性的报告。

1.控制环境

良好的控制环境包括科学的公司治理、有效的监督管理、合理的组织结构和有力的控制文化。

(1)公司引入了独立董事制度,目前有独立董事3名。董事会下设审计委员会等专门委员会。公司管理层设立了投资决策委员会、风险管理委员会等专业委员会。

(2)公司各部门之间有明确的授权分工,既互相合作,又互相核对和制衡,形成了合理的组织结构。

(3)公司坚持稳健经营和规范运作,重视员工的职业道德的培养,制定和颁布了《员工合规行为守则》,并进行持续教育。

2.风险评估

公司各层面和各业务部门在确定各自的目标后,对影响目标实现的风险因素进行分析。对于不可控风险,风险评估的目的是决定是否承担该风险或减少相关业务;对于可控风险,风险评估的目的是分析如何通过制度安排来控制风险程度。风险评估还包括各业务部门对日常工作中新出现的风险进行再评估并完善相应的制度,以及新业务设计过程中评估相关风险并制定风险控制制度。

3.控制活动

公司对投资、会计、技术系统和人力资源等主要业务制定了严格的控制制度。在业务管理制度上,做到了业务操作流程的科学、合理和标准化,并要求完整的记录,保存和严格的检查、复核;在岗位责任制度上,内部岗位分工合理、职责明确,不相容的职务,岗位分离设置,相互检查、相互制约。

(1)投资控制制度

①投资决策与执行相分离,投资管理决策职能和交易执行职能严格隔离,实行集中交易制度,建立和完善公平的交易分配制度,确保各投资组合享有公平的交易执行机会。

②投资授权控制,建立明确的投资决策授权制度,防止越权决策。投资决策委员会负责制定投资原则并审定资产配置比例;基金经理在投资决策委员会确定的范围内,负责确定与实施投资策略、建立和调整投资组合并下达投资指令,对于超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序;交易管理部负责交易执行。

③警示性控制,按照法规或公司规定设置各类资产投资比例的预警线,交易系统在投资比例达到接近限制比例前的某一数值时自动预警。

④禁止性控制,根据法律、法规和公司相关规定,基金禁止投资受限制的证券并禁止从事受限制的行为。交易系统通过预先的设定,对上述禁止进行自动提示和限制。

⑤多重监控和反馈,交易管理部对投资行为进行一线监控;风险管理部进行事中的监控;监察稽核部门进行事后的监控。在监控中如发现异常情况将及时反馈并督促调整。

(2)会计控制制度

①建立了基金会计的工作制度及相应的操作和控制规程,确保会计业务有章可循。

②按照相互制约原则,建立了基金会计业务的复核制度以及与托管人相关业务的相互核查监督制度。

③为了防范基金会计在资金头寸管理上出现违支风险,制定了资金头寸管理制度。

④制定了完善的档案保管和财务交接制度。

(3)技术系统控制制度

为保证技术系统的安全稳定运行,公司对硬件设备的安全运行、数据传输与网络安全管理、软硬件的维护、数据的备份、信息技术人员操作管理、危机处理等方面都制定了完善的制度。

(4)人力资源管理制度

公司建立了科学的招聘解聘制度、培训制度、考核制度、薪酬制度等人事管理制度,确保人力资源的有效管理。

(5)监察制度

公司设立了监察部门,负责公司的法律事务和监察工作。监察制度包括违规行为的调查程序和处理制度,以及对员工行为的监察。

(6)反洗钱制度

公司设立了反洗钱工作小组作为反洗钱工作的专门机构,指定专门人员负责反洗钱和反恐融资合规管理工作;各相关部门设立了反洗钱岗位,配备反洗钱负责人员,除建立健全反洗钱组织体系外,公司还制定了《反洗钱工作内部控制制度》及相关业务操作规程,确保依法切实履行金融机构反洗钱义务。

4.信息沟通

公司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,公司员工及各级管理人员可以充分了解与其职责相关的信息,信息及时送交适当的人员进行处理。目前公司业务均已做到了办公自动化,不同的人员根据其业务性质及层级具有不同的权限。

5.内部监控

公司设立了独立于各业务部门的稽核部门,通过定期或不定期检查,评价公司内部控制制度合理性、完备性和有效性,监督公司各项内部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。

6.基金管理人关于内部控制的声明

(1)本公司确知建立、实施和维持内部控制制度是本公司董事会及管理层的责任。

(2)上述关于内部控制的披露真实、准确。

(3)本公司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9月17日
组织形式:股份有限公司
注册资本:贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整
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:田青
联系电话:010-67595096

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股公司晋升恒生指数。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)。

截至2012年9月30日,中国建设银行资产总额132,964.82亿元,较上年末增长8.26%。截至2012年9月30日止九个月,中国建设银行实现净利润1,585.19亿元,较上年同期增长13.87%。年化平均资产回报率为1.65%,年化加权平均净资产收益率为24.18%。利息净收入2,610.24亿元,较上年同期增长17.05%。净利差为2.57%,净利息收益率为2.74%,分别较上年同期提高0.01和0.06个百分点。手续费及佣金净收入699.21亿元,较上年同期增长1.64%。

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、胡志明市及悉尼设有分行,在莫斯科、台北设有代表处,海外机构已覆盖到全球13个国家和地区,基本完成在全球主要金融中心的网络布局,24小时不间断服务能力和基本服务架构已初步形成。中国建设银行筹建、设立村镇银行20家,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、建信人寿、中德住房储蓄银行等多家子公司,为客户提供一体化金面金融服务能力进一步增强。

2012年上半年,本集团各方面良好表现,得到市场与社会各界广泛认可,先后荣获国内外知名机构授予的30多个重要奖项,本集团在英国《银行家》2012年"全球银行1000强"中位列第6,较去年上升2位;在美国《财富》世界500强中排名77位,较去年上升31位;在美国《福布斯》2012年度全球上市公司2000强排名第13位,较去年上升4位。本集团是境内唯一一家连续四年蝉联香港《亚洲公司治理》杂志颁发的"亚洲企业管治年度大奖"的上市公司,并先后获得《环球金融》、《财资》、中国银行业协会等颁发的"中国最佳银行"、"卓越管理及公司管治"与"2011年度最具社会责任金融机构"等奖项。

中国建设银行总行设投资托管业务部,下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII托管处、核算处、清算处、监督稽核处、涉外资产核算团队、养老金托管处、托管业务系统规划与管理团队,上海备份中心等12个职能处室、团队,现有员工209人。自2007年起,托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计,并已经成为常规化的内控工作手段。

2.主要人员情况

杨新丰,投资托管业务部总经理,曾就职于中国建设银行江苏省分行、广东省分行,中国建设银行总行会计部、营运管理部,长期从事计划财务、会计结算、营运管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

纪伟,投资托管业务部副总经理,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。

张军红,投资托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室,长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

郑绍平,投资托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行总行投资部、委托代理部,长期从事客户服务、信贷业务管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

3.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2012年9月30日,中国建设银行已托管267只证券投资基金。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,中国建设银行在2005年及目2009年起连续三年被国际权威杂志《全球托管人》评为"中国最佳托管银行",在2007年及2008年连续被《财资》杂志评为"国内最佳托管银行"奖,并获和讯网2011年度和2012年度中国"最佳资产托管银行"奖。

(二)基金托管人的内部控制制度

1.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。

2.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。投资托管业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。

3.内部控制制度及措施

投资托管业务部具备系统、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

1.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。

2.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)基金份额发售机构

1.发售协调人:

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
办公地址:上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼
法定代表人:万建华
电话:021-38676161
传真:021-38676161
联系人:芮敏祺
网址:www.gtja.com
客户服务电话:400-888-8666

2.网上现金发售代理机构:

网上现金发售代理机构为以下具有基金代销业务资格的上海证券交易所会员单位:爱建证券有限责任公司、安信证券股份有限公司、北京高华证券有限责任公司、渤海证券股份有限公司、财达证券有限责任公司、财富重昂证券有限责任公司、财富证券有限责任公司、财通证券有限责任公司、长城证券有限责任公司、长江证券股份有限公司、大通证券股份有限公司、大同证券经纪有限责任公司、德邦证券有限责任公司、第一创业证券有限责任公司、东北证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、东海证券有限责任公司、东莞证券有限责任公司、东吴证券股份有限公司、东兴证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、华福证券有限责任公司、广发证券股份有限公司、广州证券有限责任公司、国都证券有限责任公司、国海证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、国联证券股份有限公司、国盛证券有限责任公司、国泰君安证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、国元证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、恒泰长财证券有限责任公司、恒泰证券股份有限公司、红塔证券股份有限公司、宏源证券股份有限公司、华安证券有限责任公司、华宝证券有限责任公司、华创证券有限责任公司、华林证券有限责任公司、华龙证券有限责任公司、华融证券股份有限公司、华泰联合证券有限责任公司、华泰证券股份有限公司、华西证券有限责任公司、华鑫证券有限责任公司、江海证券有限公司、金元证券股份有限公司、联讯证券有限责任公司、民生证券股份有限公司、南京证券有限责任公司、平安证券有限责任公司、齐鲁证券有限公司、日信证券有限责任公司、瑞银证券有限责任公司、山西证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、申银万国证券股份有限公司、世纪证券有限责任公司、天风证券有限责任公司、天源证券经纪有限公司、万和证券经纪有限公司、万联证券有限责任公司、五矿证券经纪有限责任公司、西部证券股份有限公司、西藏同信证券有限责任公司、西南证券股份有限公司、厦门证券有限公司、湘财证券有限责任公司、新时代证券有限责任公司、信达证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、银泰证券有限责任公司、英大证券有限责任公司、招商证券股份有限公司、浙商证券有限责任公司、中国国际金融有限公司、中国中投证券有限责任公司、中国民族证券有限责任公司、中国银河证券股份有限公司、中航证券有限公司、中山证券有限责任公司、中天证券有限责