

(上接第17版)
 (七)违反法律、行政法规规定从事内幕交易;
 (八)拒绝、阻碍国务院证券监督管理机构及其派出机构依法履行职责;
 (九)玩忽职守,滥用职权,不按法律规定履行职责;
 (十)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,或利用该信息从事内幕交易,损害公司和其他同业机构、人员的合法权益;
 (十一)违反证券交易所有关规定,利用内幕信息、倒卖等方式操纵市场价格,扰乱市场秩序;
 (十二)故意损害投资人及其他同业机构、人员的合法权益;
 (十三)以不正当手段谋取企业发展的利益;
 (十四)有悖社会公德,损害证券投资基金形象;
 (十五)信息披露不真实、有误导、欺诈成分;
 (十六)法律、行政法规和中国证监会禁止的其他行为。

4. 基金管理人将根据基金合同的约定,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经营与管理。

5. 本基金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:

(一)承销证券;

(二)向他人提供担保或者提供财务资助;

(三)从事承担无限责任的投资;

(四)买卖其基金份额,但中国证监会另有规定的除外;

(五)向基金份额持有人、基金份额销售人出售;

(六)从内幕信息、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;

(七)法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

五、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及其配偶、受雇人以及任何第三人谋取利益;

3. 不通过基金操作获取有关法律、法规、基金合同规定的基金投资收益、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息,或利用该信息从事内幕交易,损害公司和其他同业机构、人员的合法权益;

4. 不从事违反《基金法》的其他行为。

6. 基金管理人的风险管理制度

投资风险管理可分为基本风险和操作风险。基本风险包括投资对象的市场风险和流动性风险;操作风险包括交易风险和操作风险。

本公司建立健全的风管理体系,针对基金运作各个环节构建了相应的风险管理方法,并加以有效执行。

7. 风险控制体系

本基金的风险管理体系包括风险控制决策体系、风险控制监督体系、风险控制执行体系、风险控制保障体系及自律体系。其中,风险控制执行体系是在风险控制决策、保障、保障和自律体系共同支持下完成的,各个风险控制环节的关系图所示:

图1.风险控制体系示意图



风险控制决策由投资决策委员会负责,风险控制监督由风险管理部总负责,风险控制执行由各业务部门和职能部门负责,风险控制保障包括各保障部门、屏障和保障、自律体系包括法制教育和道德培养等。督察长全面介入各个风险控制环节之中。

2. 投资风险管理

本基金的投资风险管理包括事前风险控制、事中风险控制和事后风险控制。事前风险控制主要包括资产配置和投资决策的风控制制,事中风险控制主要指实施交易过程中的风险控制,事后风险控制主要指投资组合构建之后的风险评估与控制。

3. 风险分析的风控制制

本基金对风险分析的风控制制包括对投资研究员在收集信息、处理信息过程中可能存在的致使基金份额持有人遭受损失的风险因素,对此,本公司建立从研究选库到投资准备库的严格研究流程和制度,并有效执行,以防潜在投资风险。

4. 投资决策的风控制制

投资决策风险主要是指因投资决策失误所导致的可能使投资遭受损失的风险,对此,本公司制定了一系列的投资决策流程和制度,以确保投资决策风险。如建立严格的投资源库制度,严格的投资权限审批制度,定期或不定期披露风险评估等。

5. 基交易的风控制制

交易风险是指基金投资实施过程中可能产生的风险,本公司严格执行集中交易制度,确保交易执行过程的公平公正,从而确保交易过程的独立性与公平性,交易部设立于基金管理部门,以有效控制交易风险。

6. 风险管理的风控制制

本公司对基金投资进行实时监控,并按季、按月进行风险定期评估,以加强投资风险的事后控制。风险管理总部对基金投资进行实时监控,并将评估报告提交投资决策委员会讨论和审议,每季度对市场变化和重大事件进行风险分析报告,提出风险预警和防范措施,以指导投资决策委员会或投资决策小组对基金投资进行定期评估,并提交相关报告。

7. 基金管理人的风控制制

1. 内部控制的原则

(1) 合规性原则。内部控制制度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、反馈等各个环节。

(2) 独立性原则。公司设立独立的督察长与监察稽核部门,并使其保持高度的独立性和权威性。

(3) 相互制约原则。公司部门和岗位的设置权责分明、相互牵制,并通过切实可行的相互制衡措施来消除内部控制中的缺点。

(4) 重要性原则。公司的发展必须建立在风险控制完善和稳固的基础上;内部风险控制与公司业务发展同等重要。

2. 内部控制的主要内容

(1) 公司治理。公司治理结构健全,股东会、董事会、监事会、经理层权责明确、制衡有效,能够有效发挥各自作用。

(2) 风险控制。公司设立了专门的风险控制委员会,认真贯彻国家的内部控制制度,严格执行公司董事会的经营方针和发展战略,制定了总经理办公会、投资决策委员会、风险管理委员会等部门的风控制制。

(3) 资产管理。公司对基金投资进行实时监控,并按季、按月进行风险定期评估,以加强投资风险的事后控制。风险管理总部对基金投资进行实时监控,并将评估报告提交投资决策委员会讨论和审议,每季度对市场变化和重大事件进行风险分析报告,提出风险预警和防范措施,以指导投资决策委员会或投资决策小组对基金投资进行定期评估,并提交相关报告。

(4) 操作控制。公司对基金投资进行实时监控,并按季、按月进行风险定期评估,以加强投资风险的事后控制。风险管理总部对基金投资进行实时监控,并将评估报告提交投资决策委员会讨论和审议,每季度对市场变化和重大事件进行风险分析报告,提出风险预警和防范措施,以指导投资决策委员会或投资决策小组对基金投资进行定期评估,并提交相关报告。

(5) 风险评估

公司内部核对人员定期评估公司及基金的风险状况,包括所有可能的经营状态、目标投资产生负面影响的因素,并根据这些因素和可能影响的程度,并将其评估报告提交总经理办公会和风险管理部。

(6) 操作控制

公司内部核对的操作设计方面,体现操作之间协调有分工,但部门之间又相互合作与制衡的原则。基金投资管理部、合规部、督察长等有操作的授权分权,各岗位的操作相对独立,并且有独立的报告系统。各业务部门之间相对独立,相互垂直。

(7) 风险评估

公司内部核对人员定期评估公司及基金的风险状况,包括所有可能的经营状态、目标投资产生负面影响的因素,并根据这些因素和可能影响的程度,并将其评估报告提交总经理办公会和风险管理部。

(8) 风险评估

公司内部核对的操作设计方面,体现操作之间协调有分工,但部门之间又相互合作与制衡的原则。基金投资管理部、合规部、督察长等有操作的授权分权,各岗位的操作相对独立,并且有独立的报告系统。各业务部门之间相对独立,相互垂直。

(9) 风险评估

公司内部核对人员定期评估公司及基金的风险状况,包括所有可能的经营状态、目标投资产生负面影响的因素,并根据这些因素和可能影响的程度,并将其评估报告提交总经理办公会和风险管理部。

(10) 风险评估

公司内部核对的操作设计方面,体现操作之间协调有分工,但部门之间又相互合作与制衡的原则。基金投资管理部、合规部、督察长等有操作的授权分权,各岗位的操作相对独立,并且有独立的报告系统。各业务部门之间相对独立,相互垂直。

(11) 风险评估

公司内部核对人员定期评估公司及基金的风险状况,包括所有可能的经营状态、目标投资产生负面影响的因素,并根据这些因素和可能影响的程度,并将其评估报告提交总经理办公会和风险管理部。

(12) 风险评估

公司内部核对的操作设计方面,体现操作之间协调有分工,但部门之间又相互合作与制衡的原则。基金投资管理部、合规部、督察长等有操作的授权分权,各岗位的操作相对独立,并且有独立的报告系统。各业务部门之间相对独立,相互垂直。

(13) 风险评估

公司内部核对人员定期评估公司及基金的风险状况,包括所有可能的经营状态、目标投资产生负面影响的因素,并根据这些因素和可能影响的程度,并将其评估报告提交总经理办公会和风险管理部。

(14) 风险评估

公司内部核对的操作设计方面,体现操作之间协调有分工,但部门之间又相互合作与制衡的原则。基金投资管理部、合规部、督察长等有操作的授权分权,各岗位的操作相对独立,并且有独立的报告系统。各业务部门之间相对独立,相互垂直。

(15) 风险评估

公司内部核对人员定期评估公司及基金的风险状况,包括所有可能的经营状态、目标投资产生负面影响的因素,并根据这些因素和可能影响的程度,并将其评估报告提交总经理办公会和风险管理部。

(16) 风险评估

公司内部核对的操作设计方面,体现操作之间协调有分工,但部门之间又相互合作与制衡的原则。基金投资管理部、合规部、督察长等有操作的授权分权,各岗位的操作相对独立,并且有独立的报告系统。各业务部门之间相对独立,相互垂直。

(17) 风险评估

公司内部核对人员定期评估公司及基金的风险状况,包括所有可能的经营状态、目标投资产生负面影响的因素,并根据这些因素和可能影响的程度,并将其评估报告提交总经理办公会和风险管理部。

(18) 风险评估

公司内部核对的操作设计方面,体现操作之间协调有分工,但部门之间又相互合作与制衡的原则。基金投资管理部、合规部、督察长等有操作的授权分权,各岗位的操作相对独立,并且有独立的报告系统。各业务部门之间相对独立,相互垂直。

(19) 风险评估

公司内部核对人员定期评估公司及基金的风险状况,包括所有可能的经营状态、目标投资产生负面影响的因素,并根据这些因素和可能影响的程度,并将其评估报告提交总经理办公会和风险管理部。

(20) 风险评估

公司内部核对的操作设计方面,体现操作之间协调有分工,但部门之间又相互合作与制衡的原则。基金投资管理部、合规部、督察长等有操作的授权分权,各岗位的操作相对独立,并且有独立的报告系统。各业务部门之间相对独立,相互垂直。

(21) 风险评估

公司内部核对人员定期评估公司及基金的风险状况,包括所有可能的经营状态、目标投资产生负面影响的因素,并根据这些因素和可能影响的程度,并将其评估报告提交总经理办公会和风险管理部。

(22) 风险评估

公司内部核对的操作设计方面,体现操作之间协调有分工,但部门之间又相互合作与制衡的原则。基金投资管理部、合规部、督察长等有操作的授权分权,各岗位的操作相对独立,并且有独立的报告系统。各业务部门之间相对独立,相互垂直。

(23) 风险评估

公司内部核对人员定期评估公司及基金的风险状况,包括所有可能的经营状态、目标投资产生负面影响的因素,并根据这些因素和可能影响的程度,并将其评估报告提交总经理办公会和风险管理部。

(24) 风险评估

公司内部核对的操作设计方面,体现操作之间协调有分工,但部门之间又相互合作与制衡的原则。基金投资管理部、合规部、督察长等有操作的授权分权,各岗位的操作相对独立,并且有独立的报告系统。各业务部门之间相对独立,相互垂直。

(25) 风险评估

公司内部核对人员定期评估公司及基金的风险状况,包括所有可能的经营状态、目标投资产生负面影响的因素,并根据这些因素和可能影响的程度,并将其评估报告提交总经理办公会和风险管理部。

(26) 风险评估

公司内部核对的操作设计方面,体现操作之间协调有分工,但部门之间又相互合作与制衡的原则。基金投资管理部、合规部、督察长等有操作的授权分权,各岗位的操作相对独立,并且有独立的报告系统。各业务部门之间相对独立,相互垂直。

(27) 风险评估

公司内部核对人员定期评估公司及基金的风险状况,包括所有可能的经营状态、目标投资产生负面影响的因素,并根据这些因素和可能影响的程度,并将其评估报告提交总经理办公会和风险管理部。

(28) 风险评估

公司内部核对的操作设计方面,体现操作之间协调有分工,但部门之间又相互合作与制衡的原则。基金投资管理部、合规部、督察长等有操作的授权分权,各岗位的操作相对独立,并且有独立的报告系统。各业务部门之间相对独立,相互垂直。

(29) 风险评估

公司内部核对人员定期评估公司及基金的风险状况,包括所有可能的经营状态、目标投资产生负面影响的因素,并根据这些因素和可能影响的程度,并将其评估报告提交总经理办公会和风险管理部。

(30) 风险评估

公司内部核对的操作设计方面,体现操作之间协调有分工,但部门之间又相互合作与制衡的原则。基金投资管理部、合规部、督察长等有操作的授权分权,各岗位的操作相对独立,并且有独立的报告系统。各业务部门之间相对独立,相互垂直。

(31) 风险评估

公司内部核对人员定期评估公司及基金的风险状况,包括所有可能的经营状态、目标投资产生负面影响的因素,并根据这些因素和可能影响的程度,并将其评估报告提交总经理办公会和风险管理部。

(32) 风险评估

公司内部核对的操作设计方面,体现操作之间协调有分工,但部门之间又相互合作与制衡的原则。基金投资管理部、合规部、督察长等有操作的授权分权,各岗位的操作相对独立,并且有独立的报告系统。各业务部门之间相对独立,相互垂直。

(33) 风险评估

公司内部核对人员定期评估公司及基金的风险状况,包括所有可能的经营状态、目标投资产生负面影响的因素,并根据这些因素和可能影响的程度,并将其评估报告提交总经理办公会和风险管理部。

(34) 风险评估

公司内部核对的操作设计方面,体现操作之间协调有分工,但部门之间又相互合作与制衡的原则。基金投资管理部、合规部、督察长等有操作的授权分权,各岗位的操作相对独立,并且有独立的报告系统。各业务部门之间相对独立,相互垂直。

(35) 风险评估

公司内部核对人员定期评估公司及基金的风险状况,包括所有可能的经营状态、目标投资产生负面影响的因素,并根据这些因素和可能影响的程度,并将其评估报告提交总经理办公会和风险管理部。

(36) 风险评估

公司内部核对的操作设计方面,体现操作之间协调有分工,但部门之间又相互合作与制衡的原则。基金投资管理部、合规部、督察长等有操作的授权分权,各岗位的操作相对独立,并且有独立的报告系统。各业务部门之间相对独立,相互垂直。

(37) 风险评估

公司内部核对人员定期评估公司及基金的风险状况,包括所有可能的经营状态、目标投资产生负面影响的因素,并根据这些因素和可能影响的程度,并将其评估报告提交总经理办公会和风险管理部。

(38) 风险评估

公司内部核对的操作设计方面,体现操作之间协调有分工,但部门之间又相互合作与制衡的原则。基金投资管理部、合规部、督察长等有操作的授权分权,各岗位的操作相对独立,并且有独立的报告系统。各业务部门之间相对独立,相互垂直。

(39) 风险评估

公司内部核对人员定期评估公司及基金的风险状况,包括所有可能的经营状态、目标投资产生负面影响的因素,并根据这些因素和可能影响的程度,并将其评估报告提交总经理办公会和风险管理部。

(40) 风险评估