

(上接B5版)

- (1) 承销团券;
(2) 违反约定向投资人贷款或者提供担保;
(3) 从事损害股东权益的投票;
(4) 实际实行基金额度,但中国证监会另有规定的除外;
(5) 向其基金管理人、基金托管人出资;
(6) 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;
(7) 法律、行政法规和中国证监会规定的禁止的其他活动。

五、基金经理管理

1、依据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、利用股东便利为自己及其被代理人、受托人或任何第三人谋取利益;

3、不违反行业公认的有关法律法规、基金合同和中国证监会的有关规定,泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的基本情况,尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息,或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动;

4、不从事损害基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

六、基金管理人的风险管理制度

本基金的风险管理体系包括风险控制决策体系、风险控制监控体系、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、监控、保障和自律体系共同支持下完成的,各风险控制环节的关系如图1所示:



风险控制决策由投资决策委员会负责,风险控制监控由风险管理部负责,风险控制执行由各业务部门承担职能部门负责,风险控制保障包括财务保障、屏障保障和技术保障,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。

二、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。事前风险控制主要指投资分析阶段的风控策略,事中风险控制主要指交易实施过程中的风控策略;事后风险控制主要指投资组合构建之后的风控策略。

(1) 投资分析的风险控制

投资分析的主要任务是投资研究人员在收集信息、处理信息过程中可能存在的导致基金份额持有人遭受损害的不利因素,本公司会建立从研究初选到投资备选库的严格研究流程和制度,并有效执行,以防范投资分析风险。

(2) 投资决策的风险控制

投资决策的主要任务是指投资决策失误所导致的可能使投资遭受损失的风险。对此,本公司制定了详细的决策流程和制度,以防范投资决策风险。如建立严格的投资决策库制度,严格的投資权限审批制度,定期不定期地对投资和风险评估。

(3) 基金日常的风险控制

投资风险管理主要指投资研究人员在收集信息、处理信息过程中可能存在的导致基金份额持有人遭受损害的不利因素,本公司会建立从研究初选到投资备选库的严格研究流程和制度,并有效执行,以防范投资分析风险。

(4) 投资操作的风险控制

本公司对基金投资实行实时监控,并按月、季进行风险评价,以加强投资风险的实时防范。风险管理部定期对基金投资操作进行评价,并将评估报告提交投资决策委员会讨论和审议;每季度分析市场环境和重要事件,根据市场变化情况,对基金投资提出调整建议和预警;根据投资决策委员会的授权,对投资决策委员会的授权,定期对投资组合进行评估,并提交相关报告。

七、基金管理人的风险管理和服务机制

1、内部控制的原则

(1) 全面原则。内部控制制度覆盖公司的各项业务,各部门对各级人员,并渗透到决策、监督、反馈各个环节。

(2) 独立性原则。公司设立的督察长与监察稽核部门,并使他们保持高度的独立性与权威性。

(3) 相互制约的原则。公司部门和岗位的职责权限分明,相互制衡,并通过可行的相互制衡措施来消除内部控制中的盲点。

(4) 重要原则。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步。

2、内部控制的主要内容

公司董事会、监事会会重建建立完善的公司治理结构与内部控制体系。基金管理人在董事会下设立有独立董事的审计与风险管理委员会,负责评价公司内部的内部控制体系,公司监事会负责监督外部独立审计机构的工作评价报告,确保公司审计报告的真实、可靠、完整。

公司管理人在总经理领导下,认真执行董事会的内部控制战略,为了确保公司董事会制定的经营方针及发展战略,设立了总经理办公室、投资决策委员会、风险控制委员会等委员会,分别为公司经营、基金投资、风险管理的重大决策。

此外,公司设有督察长,权力归公司监察与稽核工作,对公司和基金运作的合法性、合规性及合理性进行全面监督,监督公司风险控制工作,发生重大风险事件时向公司董事长和中国证监会报告。

八、基金管理人的风险管理和服务机制

1、基本托管人基本情况

名称:上海银行股份有限公司(以下简称“上海银行”)

住所:上海市浦东新区陆家嘴环路168号

办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路168号

法定代表人:陈鹤峰

成立时间:2002年12月29日

组织形式:股份有限公司

注册资本:人民币54.04亿元

存续期间:持续经营

基金托管业务批准文号:中国证监会证监许可[2009]814号

托管部门:金融市场部,叶虹红

电话:021-68475888

传真:021-68476936

上海银行成立于1995年12月29日,是一家由国有股份、中资法人股份、外资股份及个人股份共同组成股份制商业银行,现位于上海。

近年来,上海银行以“精品银行”为战略愿景,以“精诚至上,信义立行”为企业核心价值观,以“总体形象、区域兼顾、局部凸显亮化”为指导思想,持续推进专业化经营和精细化管理,经营实力和盈利能力显著提升。根据市场和自身条件,上海银行形成了“中小企业综合金融服务”、“城市居民财富管理服务”等特色金融产品,在零售金融、企业金融、金融市场、资产管理、普惠金融等方面取得显著成效。

公司内部组织结构设计合理,部门间职责分工明确,各业务部门操作独立,并且有独立的报告系统。各业务部门之间相互独立,相互牵制。

各业务部门内部岗位合理、职责明晰,能够相互检查、相互制约的机制,以减少舞弊或差错发生的风险,各工作均能严格按照相应的内部控制制度。

在明确的责任制度基础之上,设置科学、合理、标准化的业务操作流程,每项业务操作清晰、书面化的操作手册,同时规定完备的处理手续,保存完整的业务记录,制定严格的检查、复核标准。

(4) 信息沟通

公司建立了内部自动化信息系统与业务汇报系统,通过建立有效的信息交流渠道,保证公司员工及各级管理人员可以充分了解与职责相关的信息,保证信息传递适时适当的过程。

(5) 监督机制

基金管理人设立了包括各业务部门的监察稽核部门,履行内部风险控制、检查、评估工作,并保持高度的独立性和权威性,负责对托管业务的内部控制制度进行指导和监督。

九、基金托管人

1、基本情况

名称:上海银行股份有限公司(以下简称“上海银行”)

住所:上海市浦东新区陆家嘴环路168号

办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路168号

法定代表人:陈鹤峰

成立时间:2002年12月29日

组织形式:股份有限公司

注册资本:人民币54.04亿元

存续期间:持续经营

基金托管业务批准文号:中国证监会证监许可[2009]814号

托管部门:金融市场部,叶虹红

电话:021-68475888

传真:021-68476936

上海银行成立于1995年12月29日,是一家由国有股份、中资法人股份、外资股份及个人股份共同组成股份制商业银行,现位于上海。

近年来,上海银行以“精品银行”为战略愿景,以“精诚至上,信义立行”为企业核心价值观,以“总体形象、区域兼顾、局部凸显亮化”为指导思想,持续推进专业化经营和精细化管理,经营实力和盈利能力显著提升。根据市场和自身条件,上海银行形成了“中小企业综合金融服务”、“城市居民财富管理服务”等特色金融产品,在零售金融、企业金融、金融市场、资产管理、普惠金融等方面取得显著成效。

公司内部组织结构设计合理,部门间职责分工明确,各业务部门操作独立,并且有独立的报告系统。各业务部门之间相互独立,相互牵制。

各业务部门内部岗位合理、职责明晰,能够相互检查、相互制约的机制,以减少舞弊或差错发生的风险,各工作均能严格按照相应的内部控制制度。

在明确的责任制度基础之上,设置科学、合理、标准化的业务操作流程,每项业务操作清晰、书面化的操作手册,同时规定完备的处理手续,保存完整的业务记录,制定严格的检查、复核标准。

(4) 信息沟通

公司建立了内部自动化信息系统与业务汇报系统,通过建立有效的信息交流渠道,保证公司员工及各级管理人员可以充分了解与职责相关的信息,保证信息传递适时适当的过程。

(5) 监督机制

基金管理人设立了包括各业务部门的监察稽核部门,履行内部风险控制、检查、评估工作,并保持高度的独立性和权威性,负责对托管业务的内部控制制度进行指导和监督。

十、相关服务机构

1、基金托管人

名称:上海银行股份有限公司(以下简称“上海银行”)

住所:上海市浦东新区陆家嘴环路168号

办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路168号

法定代表人:陈鹤峰

成立时间:2002年12月29日

组织形式:股份有限公司

注册资本:人民币54.04亿元

存续期间:持续经营

基金托管业务批准文号:中国证监会证监许可[2009]814号

托管部门:金融市场部,叶虹红

电话:021-68475888

传真:021-68476936

上海银行成立于1995年12月29日,是一家由国有股份、中资法人股份、外资股份及个人股份共同组成股份制商业银行,现位于上海。

近年来,上海银行以“精品银行”为战略愿景,以“精诚至上,信义立行”为企业核心价值观,以“总体形象、区域兼顾、局部凸显亮化”为指导思想,持续推进专业化经营和精细化管理,经营实力和盈利能力显著提升。根据市场和自身条件,上海银行形成了“中小企业综合金融服务”、“城市居民财富管理服务”等特色金融产品,在零售金融、企业金融、金融市场、资产管理、普惠金融等方面取得显著成效。

公司内部组织结构设计合理,部门间职责分工明确,各业务部门操作独立,并且有独立的报告系统。各业务部门之间相互独立,相互牵制。

各业务部门内部岗位合理、职责明晰,能够相互检查、相互制约的机制,以减少舞弊或差错发生的风险,各工作均能严格按照相应的内部控制制度。

在明确的责任制度基础之上,设置科学、合理、标准化的业务操作流程,每项业务操作清晰、书面化的操作手册,同时规定完备的处理手续,保存完整的业务记录,制定严格的检查、复核标准。

(4) 信息沟通

公司建立了内部自动化信息系统与业务汇报系统,通过建立有效的信息交流渠道,保证公司员工及各级管理人员可以充分了解与职责相关的信息,保证信息传递适时适当的过程。

(5) 监督机制

基金管理人设立了包括各业务部门的监察稽核部门,履行内部风险控制、检查、评估工作,并保持高度的独立性和权威性,负责对托管业务的内部控制制度进行指导和监督。

十一、基金的募集

一、基金募集的依据

本基金的募集依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》等有关法律法规及基金合同的规定。

二、基金募集的条件

本基金募集应当符合以下条件:

(1) 基金募集申请经中国证监会核准;

(2) 基金募集金额不少于2亿元人民币且不少于基金份额持有人数不少于200人;

(3) 基金募集期限内每天的净销售额不低于500万元人民币。

三、基金募集的期限

本基金的募集期限不超过3个月。

四、基金募集的程序

本基金的募集程序如下:

(1) 募集申请的受理与确认

投资者认购本基金份额的,应填写基金销售网点的基金认购申请表,并按基金销售网点的要求提交相关材料。

(2) 募集资金的划拨与验资

基金管理人收到投资者的基金认购款项后,将通过基金销售网点向投资者出具基金认购凭证,并由基金销售网点向基金管理人发送基金认购数据。

(3) 募集资金的保管

基金管理人收到投资者的基金认购款项后,将通过基金销售网点向投资者出具基金认购凭证,并由基金销售网点向基金管理人发送基金认购数据。

(4) 募集资金的运用

基金管理人收到投资者的基金认购款项后,将通过基金销售网点向投资者出具基金认购凭证,并由基金销售网点向基金管理人发送基金认购数据。

(5) 募集资金的公告

基金管理人收到投资者的基金认购款项后,将通过基金销售网点向投资者出具基金认购凭证,并由基金销售网点向基金管理人发送基金认购数据。

(6) 募集资金的监督

基金管理人收到投资者的基金认购款项后,将通过基金销售网点向投资者出具基金认购凭证,并由基金销售网点向基金管理人发送基金认购数据。

(7) 募集资金的使用

基金管理人收到投资者的基金认购款项后,将通过基金销售网点向投资者出具基金认购凭证,并由基金销售网点向基金管理人发送基金认购数据。

(8) 募集资金的返还

基金管理人收到投资者的基金认购款项后,将通过基金销售网点向投资者出具基金认购凭证,并由基金销售网点向基金管理人发送基金认购数据。

(9) 募集资金的利息

基金管理人收到投资者的基金认购款项后,将通过基金销售网点向投资者出具基金认购凭证,并由基金销售网点向基金管理人发送基金认购数据。

(10) 募集资金的利息的处理

基金管理人收到投资者的基金认购款项后,将通过基金销售网点向投资者出具基金认购凭证,并由基金销售网点向基金管理人发送基金认购数据。

(11) 募集资金的利息的计算

基金管理人收到投资者的基金认购款项后,将通过基金销售网点向投资者出具基金认购凭证,并由基金销售网点向基金管理人发送基金认购数据。

(12) 募集资金的利息的支付

基金管理人收到投资者的基金认购款项后,将通过基金销售