

平安大华沪深300交易型开放式指数证券投资基金招募说明书(更新)摘要

2018年第1期

基金管理人:平安大华基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
二〇一八年六月

【重要提示】

平安大华沪深300交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经2017年11月8日中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)注册,并经【2017】12055号文准予募集注册。本基金基金合同于2017年12月25日正式生效。

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注册,但中国证监会对本基金募集的注册,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。中国证监会不对本基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或保证。

证券投资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。证券投资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享受基金投资收益,也可能承担本基金投资所带来的损失。本基金属股票型基金,其风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币型基金。本基金在股票型基金中属于中高风险类型,主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现,本基金的业绩表现与沪深300指数的表现密切相关。

证券投资基金分为股票型基金、混合型基金、债券型基金、货币型基金等不同类型的基金,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。

本基金按照基金份额初始面值1.00元发售,在市场波动等因素的影响下,基金份额净值可能低于基金份额初始面值。

因折算、分红等行为导致基金份额净值变化,不会改变基金的风险收益特征,本基金在1元初始面值并开展基金募集或赎回等行为导致基金份额净值调整至1元初始面值或基金净值归1元附近,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是低于初始面值。

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,对投资本基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策,并自行承担基金投资中出现的各类风险,包括市场风险、管理风险、技术风险、本基金特有的风险及其他风险等。特有风险包括:指数化投资的风险、标的指数的风险、跟踪偏离度和跟踪误差的风险、基金交易价格与份额净值发生偏离的风险、参考IOPV, 误差和IOPV, 计算错误的风险、投资人申购失败的风险、投资人赎回失败的风险、基金赎回对价的变现风险、套利风险、申购赎回清单差错风险、二级市场流动性风险、退市风险、第三方机构服务的风险等等。投资者申购的基金份额当日可卖出,当日未卖出的基金份额在份额交收成功之前不得卖出和赎回,即在目前申购规则下,T日申购的基金份额当日可卖出,T日申购当日未卖出的基金份额,T+1日不得卖出和赎回,T+1日交收成功且T+2日可卖出和赎回,因此为投资者办理申购业务的代理券商若发生交收违约,将导致投资者不能及时、足额获得申购当日未卖出的基金份额,投资者的利益可能受到不利影响。

投资有风险,投资者在认购(申购)基金前应仔细阅读本基金的招募说明书及基金合同,了解本基金的运作方式、投资目标、投资范围、投资策略、资产配置及业绩比较基准等信息,并仔细阅读基金合同、基金管理人、基金托管人、基金销售机构的法律文件,了解基金管理人、基金托管人、基金销售机构的资质情况及其他相关信息,作出独立的判断,并自行承担投资风险。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,不保证基金资产一定盈利,也不保证最低收益。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。

基金管理人提醒投资者基金投资的“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,由投资者自行承担。

本招募说明书自2018年1月1日起内容截止日期为2018年6月24日,其中投资组合报告与基金业绩数据自2018年3月31日起,有关财务数据未经审计。

本基金托管人工商银行股份有限公司于2018年7月19日对本招募说明书(2018年第一期)进行了复核。

一、基金管理人

(一)基金管理人概况

名称:平安大华基金管理有限公司
注册地址:深圳市福田区福田街道益田路5033号平安金融中心34层
办公地址:深圳市福田区福田街道益田路5033号平安金融中心34层
法定代表人:罗春凤

设立日期:2015年11月7日
批准设立机关及批准设立文号:中国证监会 证监许可[2010]1917号
组织形式:有限责任公司(中外合资)
注册资本:人民币30000万元
存续期间:持续经营
联系人:吴小红
联系电话:0755-22623179

股东名称、股权结构及持股比例:

股东名称	出资额(万元)	出资比例
平安信托有限责任公司	18,210	60.7%
大华资产管理(香港)有限公司	7,500	25%
三盈融资租赁有限公司	4,290	14.3%
合计	30,000	100%

基金管理人无任何受重大行政处罚记录。
客服电话:400-800-4800(免长途话费)

(二)主要人员情况
1、董事、监事及高级管理人员
(1)董事会成员
罗春凤先生,董事长,博士,高级经济师。1966年生。曾任中国全国总工会国际干部学院,平安保险集团办公室主任助理,平安人寿广州分公司副总经理,平安人寿总公司人事行政部/培训部总经理,平安保险集团品牌宣传部总经理,平安人寿北京分公司总经理,现任平安大华基金管理有限公司副总经理,平安大华基金管理有限责任公司董事长,中国平安保险(集团)股份有限公司董事长兼深圳平安大华汇通财富管理有限公司执行董事。

姚波先生,董事,硕士,1971年生。曾任R.J.Michalski Inc.(美国)养老金咨询分析师,Guardian Life Ins.Co(美国)助理精算师,Swiss Re(美国)精算师,Deloitte Actuarial Consulting Ltd.(香港)精算师,中国平安保险(集团)股份有限公司常务副总经理兼首席财务官兼总精算师。

陈敏达先生,董事,硕士,1948年生,新加坡。曾任香港罗兵咸会计师事务所审计,新鸿基证券有限公司执行董事;DBS唯道汇富有限公司执行董事,平安证券有限责任公司副总经理,平安证券有限责任公司副董事长/副总经理,平安证券有限责任公司董事长,中国平安保险(集团)执行委员会执行顾问。现任集团投资管理委员会副主任。

肖宇鹏先生,董事,学士,1970年生。曾任职于中国证监会系统,平安大华基金管理有限公司督察长。现任平安大华基金管理有限公司总经理。

杨玉萍女士,董事,学士,1983年生。曾于平安数据科技(深圳)有限公司从事运营规划,现任平安保险(集团)股份有限公司人力资源中心薪酬规划管理部人力资源经理。

叶杨琦女士,董事,硕士,1961年生,加拿大籍。曾任职于澳新银行、渣打银行,汇丰银行并担任高级管理职务。2011年加入大华银行集团,任大华银行(中国)有限公司非执行董事,大华银行集团董事总经理兼香港区总裁兼大华银行(中国)有限公司非执行董事,同时担任香港上市公司“数码通电讯集团有限公司”独立董事,非执行董事。

张文杰先生,董事,学士,1964年生,新加坡。现任大华资产管理(香港)有限公司执行董事及首席执行官,新加坡投资管理协会执行委员会委员。历任新加坡政府投资公司“特别投资部门”首席投资员,大华资产管理(香港)有限公司股票和全球科技团队主管。

李兆良先生,独立董事,博士,1965年生。曾任招商局蛇口工业区华南液化气船务公司远洋三副,二副,后加入中国平安保险(集团)任总公司办公室法律事务主任,总公司办公室主任助理,高级法律顾问,兼任中国平安保险(集团)总公司保险业务部法律事务主任,总公司投资审查委员会委员,广东海正律师事务所专职律师,合伙人;现任广东华瀚律师事务所主任律师、合伙人。

李娟娟女士,独立董事,学士,1965年生。曾任安徽商业高等专科学校会计教师,深圳兴粤会计师事务所项目经理,深圳职业技术学院经济学院会计专业主任,深圳职业技术学院计划处处长;现任深圳职业技术学院经济学院副院长。

刘雪生先生,独立董事,硕士,1963年生。曾任深圳国际中华会计师事务所审计,深圳华侨城集团公司会计师、财务经理,正公司副总经理、会计师、深圳国际会计师事务所临时负责人、所长助理,现任深圳市注册会计师协会副秘书长。

潘汉鹏先生,独立董事,学士,1949年生。曾任新加坡赫利财务有限公司助理经理,新加坡花旗银行副总裁,新加坡大华银行高级执行副总裁,现任彩日丰利有限公司非执行董事,一合环保控股有限公司独立董事,进美建筑集团有限公司独立董事,华业集团有限公司独立董事。

(2)监事会成员
崔敬文先生,监事长,硕士,1967年生。曾任江西客车厂厂长助理工程师;深圳市龙岗区投资管理公司经济研究部科员;平安银行(原深圳发展银行)营业部综合室主任、支行会计部副主任、总行电脑部规划室经理,总行零售银行部综合室经理,总行稽核部稽核室主管,总行稽核部总经理助理,广东南粤银行总行稽核部副总经理,总行人力资源部总经理,惠州分行筹建办副主任、分行行长,总行稽核部总经理,现任中国平安保险(集团)股份有限公司稽核监察部总经理兼,兼任重庆金融资产管理公司监事会主席。

冯方女士,监事,硕士,1975年生,新加坡。曾任职于渣打银行和旗下的富敦资产管理公司以以及新加坡毕盛资产公司、鼎赋资本管理公司。于2013年加入大华资产管理,现任区域总办公室主任。

郭晶女士,监事,硕士,1979年生。曾任广东道达集团研发总监助理,侨鑫基金人力资源部管理;现任平安大华基金管理有限公司人力资源部副经理。

李峥女士,监事,硕士,1985年生。曾任德勤华永会计师事务所高级审计员,深圳市宝能投资集团财务部会计主管,现任平安大华基金管理有限公司稽核稽核岗。

(3)公司高级管理人员
罗春凤先生,博士,高级经济师。1966年生。曾任中华全国总工会国际干部学院,平安保险集团办公室主任助理,平安人寿广州分公司副总经理,平安人寿总公司人事行政部/培训部总经理,平安保险集团品牌宣传部总经理,平安人寿北京分公司总经理,平安大华基金管理有限公司副总经理,平安大华基金管理有限公司总经理,现任平安大华基金管理有限公司董事长兼任深圳平安大华汇通财富管理有限公司执行董事。

肖宇鹏先生,学士,1970年生。曾任职于中国证监会系统,平安大华基金管理有限公司督察长,现任平安大华基金管理有限公司总经理。

付强先生,博士,高级经济师,1969年生。曾任中国华润总公司进出口副经理、申银万国证券研究所高级研究员、申万巴黎基金管理有限公司高级研究员,安信证券首席分析师,嘉实基金管理有限公司产品总监,平安证券有限责任公司副总经理。现任平安大华基金管理有限公司副总经理。

林婉文女士,1969年生,毕业于新加坡国立大学,拥有学士和荣誉学位,新加坡籍。曾任新加坡国防部职员,大华银行集团助理经理,电子渠道负责人,个人金融部投资产品销售主管,大华银行集团行政助理,大华资产管理公司大区业务开发主管,高级经理。现任平安大华基金管理有限公司副总经理。

汪涛先生,1976年生,毕业于谢菲尔德大学,金融硕士学位。曾任上海赛宁国际贸易有限公司销售经理,汇丰银行上海分行市场代表,新加坡华侨银行产品经理,渣打银行产品主管,宁波银行总行人个银行部总经理助理,总行审计部副总经理,总行资产托管部副总经理,永赢基金管理有限公司督察长。现任平安大华基金管理有限公司副总经理。

陈特正先生,督察长,学士,1969年生。曾任深圳发展银行龙岗支行行长助理,老华支行副行长,龙岗支行副行长、布吉支行行长、深圳分行信贷风控部总经理,平安银行深圳分行信贷管理部总经理,平安银行总行授信审批部高级审批师,平安银行沈阳分行行长助理兼风控总监。现任平安大华基金管理有限公司督察长。

2、基金基金经理
成钧先生,上海交通大学博士,南京大学和上海证券交易所博士后,曾任

职于上海证券交易所、国泰基金管理有限公司、嘉实基金管理有限公司、中国平安人寿保险股份有限公司。2017年2月加入平安大华基金管理有限公司,现任平安大华沪深300交易型开放式指数证券投资基金(2017/12/25至今)、平安大华中证500交易型开放式指数证券投资基金(2018-03-23至今)、平安大华沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2018-04-04至今)、平安大华MSCI中国A股国际交易型开放式指数证券投资基金(2018-06-15至今)、平安大华MSCI中国A股低波动交易型开放式指数证券投资基金(2018-06-27至今)、平安大华MSCI中国A股国际交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2018-06-21)基金经理。

3、投资决策委员会成员
本公司投资决策委员会成员包括:副总经理林婉文女士、衍生品投资中心投资执行总经理 DANIEL DONGNING SUN先生,基金经理谢勇先生。

林婉文女士,1969年生,毕业于新加坡国立大学,拥有学士和荣誉学位,新加坡籍。曾任新加坡国防部职员,大华银行集团助理经理,电子渠道负责人,个人金融部投资产品销售主管,大华银行集团行政助理,大华资产管理公司大区业务开发主管,高级经理。现任平安大华基金管理有限公司副总经理。

DANIEL DONGNING SUN先生,北京大学硕士,美国哥伦比亚大学博士,约翰霍普金斯大学博士后。先后担任瑞士再保险自营交易量化分析师,花旗集团投资银行高级副总裁,瑞士银行投资银行交易量化总监,德意志银行战略科技量化部门负责人。2014年10月加入平安大华基金管理有限公司,任衍生品投资中心投资执行总经理。现任平安大华沪深300指数增强型证券投资基金、平安大华沪深300指数量化增强证券投资基金、平安大华鑫荣混合债券证券投资基金、平安大华量化先锋混合型证券投资基金、平安大华精选沪港深股票型证券投资基金基金经理。

谢勇先生,厦门大学财政金融学,7年证券从业经历。曾任第一创业证券研究所行业研究员、民生证券研究所高级研究员,第一创业证券资产管理部高级研究员,2014年12月加入平安大华基金管理有限公司,任投资研究部高级研究员,现任平安大华策略先锋混合型证券投资基金、平安大华智慧中国灵活配置混合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。

(二)基金管理人职责

1、依法募集资金,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;

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、建立健全内部控制制度、监察与稽核、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、依法接受基金托管人的监督;

8、编制并公告申购赎回清单,计算并公告基金资产净值,确定基金份额申购、赎回价格;赎回价;

9、采取适当合理的措施使其计算基金份额认购价格、申购、赎回对价的方法符合基金合同及适用法律文件的规定;

10、按规定受理申购和赎回申请,及时、足额支付赎回对价;

11、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;

12、编制中期、半年度和年度基金报告;

13、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;

14、保守基金商业秘密,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;

15、按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基金收益;

16、依据《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;

17、按规定保存基金财产管理业务活动的会计账簿、报表、记录和其他相关资料,保存期限不少于15年;

18、确保向基金份额持有人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及时、准确地查阅和复制;同时,保证投资者能及时、准确地查阅和复制;

19、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;

20、面临破产时,依法被撤销或被依法宣告破产时,及时报告中国证监会并通知基金托管人;

21、因违反基金合同导致基金财产的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;

22、监督基金托管人按法律法规和基金合同约定履行自己的义务,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;

23、当基金管理人将其义务委托第三人处理时,应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任;

24、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;

25、基金管理人召集期间未能达到召集的条件的,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活期存款利息在基金募集期结束后30日内退还基金认购人,同时将其已冻结的募集解冻;

26、执行生效的基金份额持有人大会的决议;

27、建立并保存基金份额持有人名册;

28、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)基金管理人承诺
1、基金管理人关于遵守法律法规的承诺
(1)基金管理人承诺不从事违反《中华人民共和国证券法》的行为,并承诺建立健全的内部控制制度,采取有效措施,防止违反《中华人民共和国证券法》行为的发生;

(2)基金管理人承诺不得从事以下违反《基金法》的行为,并承诺建立健全的内部控制制度,采取有效措施,防止下列行为的发生:
1)将基金管理人固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资;

2)不公平地对不同基金财产进行利益输送;

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反承诺收益或者承担损失;

5)侵占、挪用基金财产;

6)泄露因职务便利获取的未公开信息,利用该信息从事或者暗示、明示他人从事相关的交易活动;

7)玩忽职守,不按照规定履行职务;

8)法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他行为。

(3)基金管理人承诺加强内部风险控制,建立健全的内部控制制度,严格遵守国家有关法律、法规和规章,诚实守信,勤勉尽责,不得从事以下活动:

1)超越授权范围行事;

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合法权益的合法权益;

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,不按照规定履行职责;

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,或利用该信息从事或者暗示、明示他人从事相关的交易活动;

8)协助、接受委托以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易;

9)违反证券交易所业务规则,利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格,扰乱市场秩序;

10)贬低同行,以提高自己;

11)在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分;

12)以不正当手段谋求业务发展;

13)有悖社会公德,损害证券投资基金人形象;

14)法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他行为。

2、基金管理人关于禁止性行为的承诺
为维护基金份额持有人的合法权益,本基金禁止从事下列行为:

(1)承销证券和投资证券;

(2)违反规定向他人贷款或提供担保;

(3)、从事承担无限责任的投资;

(4)、买卖其他基金份额,但是中国证监会另有规定的除外;

(5)、向基金管理人、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禁止的其他活动。

如法律法规及监管部门规定,基金管理人可调整上述禁止性规定,在适用于本基金的情况下,则本基金投资可不再受相关限制。

3、基金风险控制
(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)、不能利用职务之便为自己、受雇人或任何第三人谋取利益;

(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,或利用该信息从事或者暗示、明示他人从事相关的交易活动;

(4)、不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

(5)基金管理人内部控制制度
1、内部控制概述
(1)为了保证基金规范运作,有效地防范和化解管理风险、经营风险以及操作风险,确保基金财产和公司财务以及其他信息真实、准确、完整,并最大程度地保护基金份额持有人的利益,本基金管理人建立了科学、严密、运行高效的内部控制制度。

内部控制制度是指公司为实现内部控制目标而建立的一系列组织机制、管理方法、操作程序与控制措施的总称。内部控制制度由内部控制大纲、基本管理制度、部门业务规章等组成。

公司内部控制大纲是对公司章程规定的内部控制原则的细化和展开,是对各项基本管理制度的总括和指导,内部控制大纲明确了内控目标、内控原则、控制环境、内控缺陷等内容。

基本管理制度包括内部审计控制制度、风险控制制度、投资管理制、监察稽核制度、基金会计核算、信息披露制度、信息技术管理制度、资料档案管理制度、业务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、岗位职责、操作守则等的具体说明。

2、内部控制原则
健全性原则。内部控制制度必须覆盖公司的各项业务、各个部门和机构,各级人员,并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个环节。
有效性原则。通过科学合理的内控手段和方法,建立合理的内控程序,维护内部控制制度的有效执行。
独立性原则。公司各机构、部门和岗位在职能上应当保持相对独立,公司基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离。
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,并通过切实可行的措施来实行。
成本效益原则。公司应充分发挥各机构、各部门及各级员工的工作积极性和运用科学化的方法,尽量降低经营运营成本,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、主要内部控制制度
(1)财务会计控制制度
公司依据《中华人民共和国会计法》、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算业务指引》、《企业财务通则》等国家有关法律、法规制订了基金会计制度、公司财务管理制度、会计工作操作流程和会计岗位责任制,并对各个风险控制点建立严密的信息系统控制。

内部控制制度包括凭证控制制度、复核制度、账务处理程序、基金估值制度和程序、基金财务清算制度和程序、成本控制制度、财务收支审批制度和费用报销管理制度、财产登记保管和实物资产盘点制度、会计档案保管和财务交接制度等。

(2)风险控制管理制度
风险控制委员会风险控制委员会根据公司制定,风险控制制度由风险控制的目标和原则、风险控制的具体制度、风险控制的操作程序、风险类型的界

定、风险控制的主要措施、风险控制的具体制度、风险控制制度的监督与评价等部分构成。

风险控制的具体制度主要包括投资风险管理制度、交易风险管理制度、财务风险控制制度以及岗位分离制度、防火墙制度、岗位职责、反馈制度、保密制度、员工行为准则等程序性风险管理制度。

(三)监察稽核制度
公司设立督察长,经董事会聘任,报中国证监会相关机构认可。根据《公司监察稽核工作的需要,督察长可以列席公司相关会议,调阅公司相关档案,就内部控制制度的执行情况独立地履行检查、评价、报告、建议职能。督察长定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况,董事会对督察长的报告进行审议。

公司设立法律合规监察部开展监察稽核工作,并保证法律合规监察部的独立性和权威性。公司明确了法律合规监察部及内部各岗位的具体职责,严格制订了专业任职条件、操作程序和组织机构。

法律合规监察部内部监督检查制,通过定期或不定期检查内部控制制度的执行情况,促使公司各项经营管理活动的规范运行。

公司董事会和管理层充分重视和支持监察稽核工作,对违反法律法规和公司内部控制制度的,追究有关人员和人员的责任。

二、基金托管人

名称:中国工商银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区复兴门内大街55号
成立时间:1984年1月1日
法定代表人:易会满

注册资本:人民币35,640,625.71万元
联系电话:010-66105799

联系人:郭明
2、主要人员情况
截至2018年6月,中国工商银行资产托管部共有员工212人,平均年龄33岁,95%以上员工拥有大学本科以上学历,高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

3、基金托管业务经营情况
作为中国大陆托管服务的先行者,中国工商银行自1998年在国内首家提供托管服务以来,秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨,依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队,严格履行资产托管人职责,为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企事业单位提供高效、专业的托管服务,展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中丰富、成熟的技术产品线和团队,拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、基本养老保险、住房公积金、QFII资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII专户资产、ESCROW等门类齐全的托管产品体系,同时在国内率先开展绩效评估,风险管理等增值服务,可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至2017年末,中国工商银行共托管证券投资基金815只。自2003年以来,本行连续十年获得香港《亚洲周刊》“全球托管人”、“香港财经”、“美国《环球金融》”、“内地《证券时报》”、“上海证券报”等海内外权威财经媒体评选的54项最佳托管银行大奖,是获得奖项最多的国内托管银行,优良的服务品质获得国内外金融领域的认可和广泛好评。

二、基金托管人的内部控制制度
中国工商银行资产托管部自成立以来,各项业务飞速发展,始终保持在资产托管行业的优势地位。这些成绩的取得,是与资产托管部“一手抓业务拓展,一手抓内控建设”的做法是分不开的。资产托管部非常重视内控和专业化风险管理工

作,在积极拓展各项业务的同时,始终将加强风险防范和控制的力量,精心培育内控文化,完善内控体系,确保业务各项全过程中风险管理作为重点工作来做。继2007、2009、2010、2011、2012、2013、2014、2015、2016、2017共十一次顺利通过评估组内部控制和风险控制措施的ISAE3402审核,获得无保留意见的控制及有效性评价。表明独立第三方对我行托管服务在风险管理、内部控制方面的健全性和有效性的全面认可,也证明中国工商银行托管服务的风险控制能力已经与国际大型托管银行接轨,达到国际先进水平。目前,ISAE3402审阅已经成为年度化、常规化的内控工作手段。

1、内部控制目标
保证业务运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规定,强化和建立守法经营、规范运作的经营思想和经营风格,形成一整套运作规范化、管理制度化和内控程序化的内控体系,预防和管理经营风险,确保托管资产的安全完整;维护持有人的权益,保障资产托管业务安全、有效、稳健运行。

2、内部控制组织结构
中国工商银行资产托管部内部风险控制组织结构由中国工商银行稽核监察部门(内控合规部、内部审计局)、资产托管部内设风险控制处及资产托管部各业务处室共同组成。总行稽核监察部门负责制定全行资产管理政策,对各业务部门风险控制工作进行指导、监督。资产托管部内部设置专门负责稽核监察工作的内部风险控制处,配备专职稽核监察人员,在总经理的直接领导下,依照有关法律、法规,对业务的运营实施稽核监察职能。各业务处室在各层业务范围内实施具体的风险控制措施。

3、内部控制制度
(1)合法性原则。内部控制制度应当符合国家法律法规及监管机构的监管要求,并贯穿于资产托管业务经营管理的始终。
(2)完整性原则。托管业务的各项经营管理活动都必须有相应的规范程序和监督制约;监督制约应渗透到托管业务的全过程和各个操作环节,覆盖所有的部门、岗位和人员。
(3)及时性原则。托管业务经营活动必须在发生时能准确及时地记录;按照“内控优先”的原则,新设机构或新增业务品种时,必须做到先建立相关的规章制度。

(4)审慎性原则。各项业务经营活动必须防范风险,审慎经营,保证基金资产和其他托管资产的安全与完整。
(5)有效性原则。内部控制制度应根据国家法律法规及监管管理的需要适时修改完善,并保证得到全面落实执行,不得有任何时间、地点及人员的例外。
(6)独立性原则。设立专门履行托管人职责的管理部门;直接操作人员和控制人员必须相对独立,适当分离;内部控制中的监督、评价部门必须独立于内部控制的风险和控制部门。

4、内部控制措施
(1)严格的隔离制度。资产托管业务与传统业务实行严格分离,建立了明确的职责分工、清晰的业务流、详细的书面手册、专门的人员行为规范等,系列规章制度,并实施了物理隔离和逻辑隔离,能够确保资产独立、环境独立、人员独立、业务制度和管理独立、网络独立。
(2)高层检查。主管行领导与部门高级管理层作为工作行托管业务政策和策略的制定者和管理者,要求下级部门及时报告经营管理情况和异常情况,以检查资产托管在实现内部控制目标方面的进展,并根据检查和评估提出内部风险控制措施,督促职能部门改进。

3、资产托管部内部控制措施
(1)资产托管部内部设置专职稽核监察部门,配备专职稽核监察人员,在总经理的直接领导下,依照有关法律法规,全面负责实施全程监控思想,确保托管业务健康、稳定发展。
(2)完善组织结构,实施全员风险管理。完善的风险管理体系需要从上至下每个岗位都承担风险管理责任,只有这样,风险控制措施才能全面、有效。资产托管部实施全员风险管理,将风险控制责任落实到具体业务部门和业务岗位,每位员工对自己岗位涉及的风险负责,通过建立部门内控制,横向到部门、纵向到岗位,形成各部门、不同岗位相互制衡的组织结构。
(3)建立内部控制制度。资产托管部十分重视内控制度的建设,一贯坚持把风险防范和控制的理念和方法融入岗位职责、制度建设和工作流程中。经过多年努力,资产托管部已经建立了一整套内部风险控制制度,包括:岗位职责、业务操作流程、稽核监察制度、信息披露制度等,覆盖所有部门和岗位,渗透各项业务过程,形成各业务环节之间的相互制约机制。
(4)内部风险控制体系。资产托管部将风险控制作为首要工作,并在发展同等条件下,资产托管业务是优先发展的中国业务,资产托管部从成立之日起就特别强调规范运作,一直将建立一系统、高效、有效的风险防范和控制体系作为工作主题。随着市场环境的变化和托管业务的快速发展,新问题、新情况不断出现,资产托管部始终将风险管理放在与业务发展同等重要的位置,视风险防范和控制为托管业务生存和发展的生命线。

三、基金托管人对基金管理人运用基金投资监督的方法和程序
根据《基金法》、基金合同、托管协议和有关基金法规的规定,基金托管人对基金的投资范围和投资对象、基金投融资比例、基金投资禁止行为、基金参与银行间债券市场、基金资产净值的计算、基金份额净值计算、应收到账资金、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露中登载业绩业绩数据等项进行监督和复核。
基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、基金合同、基金托管协议或有关基金法律法规规定的行为,应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正,基金管理人收到通知后应及时核对,并以书面形式对基金托管人发出回函确认。在限期内,基金托管人有权随时对通知事项进行复查,督促基金管理人改正。基金管理人拒不执行通知的违规事项未能在限期内纠正的,基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人有关基金重大违规行为,应立即报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正。

三、相关服务机构
(一)基金销售机构
1、发售协调人
名称:平安证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区中心区金田路4036号荣超大厦16-20层
办公地址:深圳市福田区中心区金田路4036号荣超大厦16-20层
法定代表人:曹实凡
联系人:石静爽
联系电话:0755-22631417
客服电话:400-886-1688
传真:0755-82408662
网址:stock.pingan.com

(2) 中银证券证券股份有限公司
注册地址:北京市朝阳门内大街66号4号楼
办公地址:北京市朝阳区安立路188号
法定代表人:王常青
联系人:刘畅
联系电话:010-65068231
客服电话:400-6818261
网址:www.ccb.com

(3) 国信证券股份有限公司
注册地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16-26层
办公地址:深圳市福田区红