民生加银新战略灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书摘要

2020 年第 1 号

基金管理人:民生加银基金管理有限公司

基金托管人:广发银行股份有限公司

二零二零年八月

重要提示

民生加银新战略灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经 2015 年 5 月 11 日中国证监会证监许可【2015】865 号文注册,基金合同于 2015 年 6 月 26 日正式生效。

根据中国证监会 2017 年 8 月 31 日发布的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称“《流动性风险管理规定》”),对已经成立的开放式基金,原基金合同内容不符合该《流动性风险管理规定》的,应当在《流动性风险管理规定》施行之日起 6 个月内修改基金合同并公告。根据《流动性风险管理规定》等法律法规,经与基金托管人协商一致,并报监管机构备案,民生加银基金管理有限公司对民生加银新战略灵活配置混合型证券投资基金的基金合同进行了修改。修改后的基金合同已于 2018 年 3 月 23 日起生效。

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做出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

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。

基金在投资运作过程中可能面临各种风险,既包括市场风险,也包括基金自身的管理风险、技术风险、合规风险以及本基金特有风险等。巨额赎回风险是开放式基金所特有的一种风险,即当单个开放日基金的净赎回申请超过上一开放日基金总份额的百分之十时,投资人将可能无法及时赎回持有的全部基金份额。

本基金是混合型证券投资基金,预期风险高于债券型基金和货币市场基金,低于股票型基金,属于中高预期风险和中高预期收益的基金产品。投资者应当认真阅读基金合同、招募说明书、基金产品资料概要等基金信息披露文件,了解基金的风险收益特征,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自身的风险承受能力相适应,自主判断基金的投资价值,自主做出投资决策,自行承担投资风险,并通过基金管理人或基金管理人委托的具有基金销售业务资格的其他机构购买基金。

本基金的投资范围包括中小企业私募债券,中小企业私募债券是根据相关法律法规由非上市中小企业采用非公开方式发行的债券。中小企业私募债券的风险主要包括信用风险、流动性风险、市场风险等。信用风险指发债主体违约的风险,是中小企业私募债券最大的风险。流动性风险是由于中小企业私募债券交投不活跃导致的投资者被迫持有到期的风险。市场风险是未来市场价格(利率、汇率、股票价格、商品价格等)的不确定性带来的风险,它影响债券的实际收益率。这些风险可能会给基金净值带来一定的负面影响和损失。

基金管理人承诺依照恪尽职守、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,基金管理人管理的其他基金的业绩也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,在做出投资决策后,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。投资有风险,投资人认购(或申购)本基金时应认真阅读本招募说明书。

除非另有说明,本招募说明书所载内容截止日为 2020 年 06 月 26 日,基金经理相关信息更新截止日为 2020 年 7 月 27 日,有关财务数据和净值表现截止日为 2020 年 03 月 31 日。(财务数据未经审计)

招募说明书约定的基金产品资料概要编制、披露与更新要求,自《信息披露办法》实施之日起一年后开始执行。

一、基金管理人

一、基金管理人概况

名称:民生加银基金管理有限公司

注册地址:深圳市福田区莲花街道福中三路 2005 号民生金融大厦 13 楼 13A

办公地址:深圳市福田区莲花街道福中三路 2005 号民生金融大厦 13 楼 13A

法定代表人:张焕南

成立时间:2008 年 11 月 3 日

批准设立机关及批准设立文号:中国证券监督管理委员会证监许可[2008]1187 号

组织形式:有限责任公司(中外合资)

注册资本:人民币叁亿元

存续期间:永续经营

经营范围:基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务

股权结构:公司股东为中国民生银行股份有限公司(持股 63.33%)、加拿大皇家银行(持股 30%)、三峡财务有限责任公司(持股 6.67%)

电话:010-68960030

传真:010-88566500

联系人:张冬梅

民生加银基金管理有限公司设有股东会、董事会、监事会;董事会下设专门委员会:审计委员会、合规与风险管理委员会、薪酬与提名委员会;经营管理层下设专门委员会:投资决策委员会、风险控制委员会和产品委员会,以及设立常设部门。投资决策委员会下设权益资产条线投资决策委员会、固收资产条线投资决策委员会、大类资产配置条线投资决策委员会等三个资产条线投决会。其中:

公司投资决策委员会:

主席:总经理李操纲

成员:副总经理于善辉、总经理助理兼专户理财二部总监刘霄汉、投资部总监兼权益研究部总监吴鹏飞、固定收益部总监陆欣、交易部总监周晓芳

权益资产条线投资决策委员会:

联席主席:投资部总监兼权益研究部总监吴鹏飞、总经理助理兼专户理财二部总监刘霄汉

成员:总经理李操纲、副总经理于善辉、投资部副总监孙伟、基金经理柳世庆、基金经理王亮、基金经理高松、交易部总监周晓芳

固收资产条线投资决策委员会:

主席:固定收益部总监陆欣

成员:总经理李操纲、副总经理于善辉、总经理助理兼专户理财二部总监刘霄汉、专户理财一部负责人宋立军、固收研究部负责人张汀、交易部总监周晓芳

大类资产配置条线投资决策委员会:

主席:量化投资部负责人何江

成员:总经理李操纲、副总经理于善辉、交易部总监周晓芳

6、上述人员之间不存在亲属关系。

三、基金管理人的职责

按照《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金管理人必须履行以下职责:

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、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、编制季度报告、中期报告和年度报告;

7、计算并公告基金净值信息,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、按照规定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。

四、基金管理人承诺

1、基金管理人承诺严格遵守《中华人民共和国证券法》,并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、基金管理人承诺严格遵守《基金法》、《运作办法》,建立健全的内部控制制度,采取有效措施,防止以下《基金法》、《运作办法》禁止的行为发生:

(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)不公平地对待其管理的不同基金财产;

(3)利用基金财产或职务之便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)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明示、暗示他人从事相关的交易活动;

(7)玩忽职守,不按照规定履行职责;

(8)法律法规和中国证监会禁止的其他行为。

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)越权或违规经营;

(2)违反基金合同或托管协议;

(3)损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法利益;

(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)泄漏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;利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动;

(8)除按法律法规、基金管理公司制度进行基金投资外,直接或间接进行其他股票交易;

(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)故意损害投资人及其他同业机构、人员的合法权益;

(11)以不正当手段谋求业务发展;

(12)有悖社会公德,损害证券投资基金人员形象;

(13)信息披露不真实,有误导、欺诈成分;

(14)法律法规和中国证监会禁止的其他行为。

4、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。

5、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)违反规定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、行政法规规定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被代理人、受雇人或任何第三人谋取利益;

3、不违反现行有效的有关法律法规、基金合同和中国证监会的有关规定,泄漏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明示、暗示他人从事相关的交易活动;

4、不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

六、基金管理人的内部控制制度

本基金管理人即民生加银基金管理有限公司(以下简称“公司”)为保证本公司诚信、合法、有效经营,防范、化解经营风险和所管理的资产运作风险,充分保护资产委托人、公司和公司股东的合法权益,依据《基金法》、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》等法律法规和中国证监会的有关文件,以及《民生加银基金管理有限公司章程》,制定《民生加银基金管理有限公司内部控制大纲》。

内部控制体系是指公司为防范和化解风险,保证经营运作符合公司的发展规划,在充分考虑内外部环境的基础上,通过建立组织机制、运用管理方法、实施操作程序与控制措施而形成的系统。内部控制制度是公司为实现内部控制目标而建立的一系列组织机制、管理办法、操作程序与控制措施的总称。

内部控制制度由公司章程、内部控制大纲、基本管理制度、部门管理制度、各项具体业务规则等部分组成。

1、内部控制的总体目标

(1)保护基金投资人利益不受侵犯,维护股东的合法权益。

(2)保证公司经营运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则,自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营理念。

(3)建立和健全法人治理结构,形成合理的决策、执行和监督机制。

(4)防范和化解经营风险,提高经营管理效益,确保经营业务的稳健运行和受托资产的安全完整,实现公司的持续、稳定、健康发展。

(5)确保公司经营目标和发展战略的顺利实施。

(6)确保基金、公司财务和其他信息真实、准确、完整、及时。

2、内部控制遵循以下原则

(1)健全性原则。内部控制须覆盖公司的各项业务、各个部门和各级岗位,并渗透到各项业务过程,涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个环节。

(2)有效性原则。通过科学的内控手段和方法,建立合理适用的内控程序,并适时调整和不断完善,维护内控制度的有效执行。

(3)独立性原则。公司各机构、部门和岗位的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。

3、制定内部控制制度遵循以下原则

(1)合法合规性原则。公司内控制度应当符合国家法律、法规、规章和各项规定。

(2)全面性原则。内部控制制度应当涵盖公司经营管理的各个环节,不得留有制度上的空白和漏洞。

(3)审慎性原则。制定内部控制制度应当以审慎经营、防范和化解风险为出发点。

(4)有效性原则。内部控制制度应当是可操作的,有效的。

(5)适时性原则。内部控制制度的制定应当随着有关法律法规的调整和公司经营战略、经营方针、经营理念等内外部环境的变化进行及时的修改或完善。

4、内部控制的基本要素

内部控制的基本要素包括控制环境、风险评估、控制活动、信息沟通和内部监控。

(1)控制环境构成公司内部控制的基础,控制环境包括经营理念和内控文化、公司治理结构、组织结构、员工道德素质等内容。

(2)公司管理层应当牢固树立内控优先和风险管理理念,培养全体员工的风险防范意识,营造一个浓厚的内控文化氛围,保证全体员工及时了解国家法律法规和公司规章制度,使风险意识贯穿到公司各个部门、各个岗位和各个环节。

(3)公司按“利益公平、信息透明、信誉可靠、责任到位”的基本原则制定治理结构,充分发挥独立董事和监事会的监督职能,严禁不正当关联交易、利益输送和内部人控制现象的发生,保护投资者利益和公司合法权益。

(4)公司根据健全性、高效性、独立性、制约性、前瞻性及防火墙等原则设计内部组织架构,建立决策科学、运营规范、管理高效的运行机制,包括民主、透明的决策程序和管理议事规则,高效、严谨的业务执行系统,以及健全、有效的内部监督和反馈系统。

各职能部门是公司内部控制的具体实施单位。各部门在公司基本管理制度的基础上,根据具体情况制订本部门的业务管理规定、操作流程及内部控制规定,加强对业务风险的控制。部门管理层应定期对部门内风险进行评估,确定风险管理战略并实施,监控风险管理绩效,以不断改进风险管理能力。

(5)公司设立顺序递进、权责统一、严密有效的内控防线:

1)各岗位职责明确,有详细的岗位说明书和业务流程,各岗位人员在上岗前均应知悉并以书面方式承诺遵守,在授权范围内承担责任。

2)建立重要业务处理凭据传递和信息沟通机制,相关部门和岗位之间相互监督制衡。

3)公司督察长和内部监察稽核部门独立于其他部门,对内部控制制度的执行情况实行严格的检查和反馈。

(6)内部控制风险评估包括定期和不定期的风险评估、开展新业务之前的风险评估以及违规、投诉、危机事件发生后的风险评估等。

(7)风险评估是每个控制主体的责任。

1)董事会下属的合规与风险管理委员会和督察长对公司制度的合规性和有效性进行评估,并对公司与基金运作的合法合规性进行监督检查。

2)投资决策委员会负责对基金投资过程中的市场风险进行评估和控制。

3)各级部门负责对职责范围内的业务所面临的风险进行识别和评估。

(8)授权控制是内部控制活动的基本要点,它贯穿于公司经营活动的始终。授权控制的主要内容包括:

1)股东会、董事会、监事会和管理层必须充分了解和履行各自的职权,建立健全公司授权标准和程序,确保授权制度的贯彻执行。

2)公司各业务部门、分支机构和公司员工必须在规定的授权范围内行使相应的职责。

3)公司业务实行分级授权管理,任何部门和个人不得越级越权办理业务。

4)公司重大业务的授权必须采取书面形式,授权书须明确授权内容和时效,经授权人签章确认后下达到被授权人,并报有关部门备案。

5)公司授权要适当,对已获授权的部门和人员须建立有效的评价和反馈机制,对已不适用的授权须及时修改或取消。

(9)建立完善的资产分离制度,基金资产与公司资产、不同基金的资产和其他委托资产要实行独立运作,单独核算。

(10)建立科学、严格的岗位分离制度,业务授权、业务执行、业务记录和业务监督严格分离,投资和交易、交易和清算、基金会计和公司会计等重要岗位不得有人员的重叠。重要业务部门和岗位须实行物理隔离。

(11)制定切实有效的应急应变措施,建立危机处理机制和程序。

(12)采用适当、有效的信息系统,识别、采集、加工并相互交流经营活动所需的一切信息。信息系统须保证业务经营信息和财务会计资料的真实性、准确性和完整性,必须能实现公司内部信息的沟通和共享,促进公司内部管理顺畅实施。

(13)根据组织架构和授权制度,建立清晰的业务报告系统,凡是属于超越权限的任何决策必须履行规定的请示报告程序。

(14)内部控制的监督完善由公司合规与风险管理委员会、督察长和监察稽核部等部门在各自的职权范围内开展。必要时,公司董事会、监事会、合规与风险管理委员会、总经理等均可聘请外部专家对公司内部控制进行检查和评价。

(15)根据市场环境、新的金融工具、新的技术应用和新的法律法规等情况,公司须组织专门部门对原有的内部控制进行全面的检讨,审查其合法合规性、合理性和有效性,适时改进。

5、内部控制的主要内容

(1)研究业务控制主要内容包括:

1)研究工作应保持独立、客观。

2)建立严密的研究工作业务流程,形成科学、有效的研究方法。

3)建立投资对象备选库制度,研究部门根据基金合同要求,在充分研究的基础上建立和维护备选库。

4)建立研究与投资的业务交流制度,保持通畅的交流渠道。

5)建立研究报告质量评价体系。

(2)投资决策业务控制主要内容包括:

1)投资决策应当严格遵守法律法规的有关规定,符合基金合同所规定的投资目标、投资范围、投资策略、投资组合和投资限制等要求。

2)健全投资决策授权制度,明确界定投资权限,严格遵守投资限制,防止越权决策。

3)投资决策应当有充分的投资依据,重要投资要有详细的研究报告和风险分析支持,并有决策记录。

4)建立投资风险评估与管理制度,在设定的风险权限额度内进行投资决策。

5)建立科学的投资管理业绩评价体系,包括投资组合情况、是否符合基金产品特征和决策程序、基金绩效归因分析等内容。

(3)基金交易业务控制主要内容包括:

1)基金交易实行集中交易制度,基金经理不得直接向交易员下达投资指令或者直接进行交易。

2)公司应当建立交易监测系统、预警系统和交易反馈系统,完善相关的安全设施。

3)投资指令应进行审核,确认其合法、合规与完整后方可执行,如出现指令违法违规或者其他异常情况,应当及时报告相应部门与人员。

4)公司应当执行公平的交易分配制度,确保不同投资者的利益能够得到公平对待。

5)建立完善的交易记录制度,交易记录应当及时进行反馈、核对并存档保管。

6)建立科学的交易绩效评价体系。

7)场外交易、网下申购等特殊交易应当根据内部控制的原则制定相应的流程和规则。

8)建立严格有效的制度,防止不正当关联交易损害基金持有人利益。基金投资涉及关联交易的,应在相关投资研究报告中特别说明,并报公司相关部门批准。

(4)基金清算和基金会计业务控制主要内容包括:

1)规范基金清算交割和会计核算工作,在授权范围内,及时准确地完成基金清算,确保基金资产的安全。

2)基金会计与公司会计在人员、空间、制度上严格分离。

3)对所管理的基金以基金作为会计核算主体,每只基金分别设立不同的独立帐户,进行单独核算,保证不同基金在名册登记、帐户设置、资金划转、帐簿记录等方面相互独立。

4)公司应当采取合理的估值方法和科学的估值程序,公允反映基金所投资的有价证券在估值时点的价值。

5)与托管银行间的业务往来严格按《托管协议》进行,分清权责,协调合作,互相监督。

(5)基金营销业务控制主要内容包括:

1)新产品开发前应进行充分的市场调研和可行性论证,进行风险识别,提出风险控制措施。

2)以竭诚服务于基金投资者为宗旨,开展市场营销、基金销售及客户服务等各项业务,严禁误导和欺骗投资者。

3)注重对市场的开发和培育,统一部署基金的营销战略计划,建立客户服务体系,为投资者提供周到的售前、售中和售后服务。

4)以诚信为原则进行基金和公司的对外宣传,自觉维护公司形象。

(6)信息披露控制主要内容包括:

1)严格按照法律、法规和中国证监会的有关规定,建立完善的信息披露制度,保证公开披露的信息真实、准确、完整、及时。

2)公司设立信息披露负责人,负责信息披露工作,进行信息的组织、审核和发布。

3)公司对信息披露应当进行持续检查和评价,对存在的问题及时提出改进办法,对信息披露出现的失误提出处理意见,并追究相关人员的责任。

4)公司掌握内幕信息的人员在信息公开披露前不得泄露其内容。

(7)信息技术系统控制主要内容包括:

1)根据国家有关法律法规的要求,遵循安全性、实用性、可操作性原则,严格制定信息系统的管理规章、操作流程、岗位手册和风险控制制度。

2)信息技术系统的设计开发应符合国家、金融行业软件工程标准的要求,编写完整的技术资料;在实现业务电子化时,应设置保密系统和相应控制机制,并保证计算机系统的可稽性。

3)对信息系统的项目立项、设计、开发、测试、运行和维护整个过程实施明确的责任管理,信息技术系统投入运行前,必须经过业务、运营、监察稽核等部门的联合验收。

4)公司应当通过严格的授权制度、岗位责任制度、门禁制度、内外网分离制度等管理措施,确保系统安全运行。

5)计算机机房、设备、网络等硬件要求应当符合有关标准,设备运行和维护整个过程实施明确的责任管理,严格划分业务操作、技术维护等方面的职责。

6)公司软件的使用应充分考虑软件的安全性、可靠性、稳定性和可扩展性,应具备身份验证、访问控制、故障恢复、安全保护、分权制约等功能。

7)信息技术系统设计、软件开发等技术人员不得介入实际的业务操作。

8)建立计算机系统的日常维护和管理,数据库和操作系统的密码口令应当分别由不同人员保管。用户使用的密码口令要定期更换,不得向他人透露。

9)对信息数据实行严格的管理,保证信息数据的安全、真实和完整,并能及时、准确地传递到各职能部门。

10)严格计算机交易数据的授权修改程序,建立电子信息数据的定期查验制度。

11)建立电子信息数据的即时保存和备份制度,重要数据应当异地备份并且长期保存。

12)指定专人负责计算机病毒防范工作,建立定期病毒检测制度。

13)信息技术系统应当定期稽核检查,完善业务数据保管等安全措施,进行排除故障、灾难恢复演习,确保系统可靠、稳定、安全地运行。

(8)公司财务管理控制主要内容包括:

1)公司根据国家颁布的会计准则和财务通则,严格按照公司财务和基金财务相互独立的原则制定公司会计制度、财务制度、会计工作操作流程和会计岗位工作手册,并针对各个风险控制点建立严密的会计系统控制。

2)公司应当明确职责划分,在岗位分工的基础上明确各会计岗位职责,严禁需要相互监督的岗位由一人独自操作全过程。

3)建立凭证制度,通过凭证设计、登录、传递、归档等一系列凭证管理制度,确保正确记载经济业务,明确经济责任。

4)建立账务组织和账务处理体系,正确设置会计账簿,有效控制会计记账程序。

5)建立复核制度,通过会计复核和业务复核防止会计差错的产生。

6)建立严格的成本控制和业绩考核制度,强化会计的事前、事中和事后监督。

7)制定财务收支审批制度和费用报销管理办法,自觉遵守国家财税制度和财经纪律。

8)制定完善的会计档案保管和财务交接制度,财会部门应妥善保管密押、业务用章、支票等重要凭据和会计档案,严格会计资料的调阅手续,防止会计数据的毁损、散失和泄密。

9)强化财产登记保管和实物资产盘点制度。

(9)监察稽核控制主要内容包括:

1)公司设立督察长,对董事会负责。根据公司监察稽核工作的需要和董事会授权,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。

2)督察长应当定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况,董事会应当对督察长的报告进行审议。

3)公司设立监察稽核部门,对公司经营层负责,开展监察稽核工作,公司应保证监察稽核部门的独立性和权威性。

4)全面推行监察稽核工作的责任管理制度,明确监察稽核部门各岗位的具体职责,配备充足的监察稽核人员,严格监察稽核人员的专业任职条件,严格监察稽核的操作程序和组织纪律。

5)公司应当强化内部检查制度,通过定期或不定期检查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)公司董事会和管理层应当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,应当追究有关部门和人员的责任。

6、基金管理人关于内部控制制度的声明

(1)公司承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确。

(2)公司承诺根据市场变化和公司业务发展不断完善内部控制制度。

二、基金托管人

一、基金托管人情况

(一)基本情况

名称:广发银行股份有限公司

住所:广州市越秀区东风东路 713 号

办公地址:北京市西城区菜市口大街 1 号院 2 号楼信托大厦

法定代表人:尹兆君

成立时间:1988 年 7 月 8 日

组织形式:股份有限公司

注册资本:197 亿人民币

存续期间:持续经营

基金托管资格批文及文号:中国证监会、中国银监会《关于核准广东发展银行证券投资基金托管资格的批复》,证监许可[2009]363 号

联系人:顾洪峰

联系电话:(010)65169885

广发银行股份有限公司成立于 1988 年,是国务院和中国人民银行批准成立的我国首批股份制商业银行之一,总部设于广东省广州市,注册资本 197 亿元。三十二年来,广发银行栉风沐雨、艰苦创业,以自己不断壮大的发展历程,见证了中国经济腾飞和金融体制改革的每一个脚印。

截至 2019 年 12 月 31 日,广发银行总资产 2.63 万亿元、总负债 2.42 万亿元、实现营业收入 763.12 亿元、净利润 125.81 亿。

(二)主要人员情况

广发银行股份有限公司总行设资产托管部,是从事资产托管业务的职能部门,内设客户营销处、保险与期货业务处、增值与外包业务处、业务运行处、内控与综合管理处,部门全体人员均具备本科以上学历和基金从业资格,部门经理以上人员均具备研究生以上学历。

部门负责人蒋柯先生,经济学硕士,高级经济师,从事托管工作二十余年,托管经验丰富。曾担任大型国有商业银行资产托管部托管业务运作中心副处长、全球资产托管处副处长、全球资产托管处副处长(主持工作)等职务。曾被中国证券业协会聘任为证券投资基金估值工作小组组长。2015 年 1 月,经中国证监会核准资格,任广发银行资产托管部副总经理,2018 年 7 月任广发银行资产托管部总经理。

部门负责人梁冰女士,经济学博士,研究员,曾任中国人民银行研究局产业经济研究处副处长、金融法律研究处副处长、处长、广发银行总行金融机构部副总经理等职务,曾在遵义市人民政府挂职 1 年。2018 年 6 月,经中国证监会核准资格,任广发银行资产托管部副总经理。

(三)基金托管业务经营情况

广发银行股份有限公司于 2009 年 5 月 4 日获得中国证监会、银监会核准开办证券投资基金托管业务,基金托管业务批准文号:证监许可[2009]363 号。截至 2019 年 12 月末,托管资产规模 25,266.63 亿元。建立了一只优秀、专业的托管业务团队,保证了托管服务水准在行业的领先地位。建立了完善的产品线,产品涵盖证券投资基金、基金公司客户特定资产管理计划、证券公司客户资产管理计划、保险资金托管、股权投资基金、产业基金、信托计划、银行理财产品、QDII 托管、交易资金托管、专项资金托管、中介资金托管等,能为托管产品提供全面的托管服务。

二、基金托管人的内部控制制度

(一)内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律、法规、规章、行政性规定、行业准则和行内有关管理规定,守法经营、规范运作、严格监察,确保业务的稳健运行,保证基金资产的安全完整,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。

(二)内部控制组织结构

广发银行股份有限公司总行下设资产托管部,是全行资产托管业务的管理和运营部门,专设内控与综合管理处,配备了专职内部监察稽核人员,负责托管业务的内部控制和风险管理工作,具有独立行使监督稽核工作的职权和能力。

(三)内部风险控制原则

资产托管部建立了托管系统和完善的制度控制体系。制度体系包含管理制度、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

基金托管人负有对基金管理人的投资运作行使监督权的职责。根据《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定,基金托管人对基金的投资对象和范围、投资组合比例、投资限制、费用的计提和支付方式、基金会计核算、基金资产估值和基金净值的计算、收益分配、申购赎回以及其他有关基金投资和运作的事项,对基金管理人进行业务监督、核查。

(一)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。利用资产托管业务基金监督系统,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。

(二)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。

三、相关服务机构

(一)销售机构及联系人

1.直销机构

民生加银基金管理有限公司

注册地址:深圳市福田区福中三路 2005 号民生金融大厦 13 楼 13A

办公地址:深圳市福田区福中三路 2005 号民生金融大厦 13 楼 13A

法定代表人:张焕南

客服电话:400-8888-388

联系人:林泳江

电话:0755-23999809

传真:0755-23999810

网址:www.msjyfund.com.cn

2.代销机构

(1)广发银行股份有限公司

注册地址:广州市东风东路 713 号

办公地址:广州市东风东路 713 号

法定代表人:王滨

电话:010-65169830

传真:010-65169555

联系人:李春磊

客服电话:95508

网址:www.cgbchina.com.cn/

(2)中国民生银行股份有限公司

注册地址:北京市西城区复兴门内大街 2 号

办公地址:北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人:洪崎

客服电话:95568

联系人:穆婷

电话:010-58560666

传真:010-57092611

网址:www.cmbc.com.cn

(3)国泰君安证券股份有限公司

注册地址:中国(上海)自由贸易试验区商城路 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 层

法定代表人:贺青

客户服务热线:95521

联系人:钟伟镇

电话:021-38676666

传真:021-38670666

网址:www.gtja.com

(4)中国银河证券股份有限公司

注册地址:北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

办公地址:北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人:陈共炎

客服电话:400-888-8888

联系人:辛国政

电话:010-83574507

传真:010-83574807

网址:www.chinastock.com.cn

(5)深圳众禄基金销售股份有限公司

注册地址:深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼

办公地址:深圳市罗湖区梨园路 8 号 HALO 广场 4 楼

法定代表人:薛峰

客服电话:400-6788-887

联系人:童彩平

电话:0755-33092861

传真:0755-33227951

公司网站:www.zlfund.cn 及 www.jjmmw.com

(6)蚂蚁(杭州)基金销售有限公司

注册地址:杭州市余杭区仓前街道文一西路 1218 号 1 栋 202 室

办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼

法定代表人:陈柏青

客服电话:4000-766-123

联系人:顾祥柏

电话:021-60897840

传真:0571-26698533

公司网站:www.fund123.cn

(7)上海財咖啡基金销售有限公司

注册地址:上海市自由贸易试验区世纪大道 1168 号 B 座 1701A 室

办公地址:上海市自由贸易试验区花园石桥路 66 号 3301 室

法定代表人:周泉恭

客服电话:400-021-1010

联系人:杨迎雪

电话:021-61600500

传真:021-61600502

网站:www.caicoffeefund.com

(8)上海天天基金销售有限公司

注册地址:上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

办公地址:上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 10 楼

法定代表人:其实

客服电话:400-1818-188

联系人:丁珊珊

电话:010-65980380-8010

传真:020-87597505

公司网站:www.1234567.com.cn

(9)平安证券股份有限公司

注册地址:深圳市福田区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

办公地址:深圳市福田区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

法定代表人:何之江

联系人:石静武

业务咨询电话:95511 转 8

网站:stock.pingan.com

(10)交通银行股份有限公司

注册地址:上海市自由贸易试验区银城中路 188 号

办公地址:上海市自由贸易试验区银城中路 188 号

法定代表人:任德奇

客服电话:95559

联系人:张作伟

电话:021-20581740

传真:021-58408842

网址:http://www.bankcomm.com/

(11)渤海银行股份有限公司

注册地址:天津市河西区马场道 201-205 号

办公地址:天津市河东区海河东路 218 号渤海银行大厦

法定代表人:李伏安

客服电话:95541

联系人:王宏

网址:www.cbhb.com.cn

(12)兴业银行股份有限公司

注册地址:福州市湖东路 154 号

办公地址:福州市湖东路 154 号

法定代表人:高建平

客服电话:95561

基金业务联系人:刘玲

电话:021-52629999

网址:www.cib.com.cn

(13)浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址:浙江省杭州市文二西路 1 号元茂大厦 903

办公地址:浙江省杭州市西湖区翠柏路 7 号电子商务产业园 2 号楼 2 楼

法定代表人:凌顺平

联系人:林海明

电话:0571-88911818

传真:0571-86800423

网站:www.10jqka.com.cn

(14)北京展恒基金销售股份有限公司

注册地址:北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号

办公地址:北京市朝阳区华严北里 2 号民建大厦 6 层

法定代表人:闫振杰

联系人:张云

电话:010-59601366-7024

传真:010-62020355

网站:www.myfund.com/

(15)上海汇付基金销售有限公司

注册地址:上海市黄浦区中山南路 100 号 19 层

办公地址:上海 宜山路 700 号普天信息产业园 C5 栋 2 楼

法定代表人:冯修敏

联系人:臧静

电话:8621-54677888-6717

传真:021-33323830

网站:www.bundwealth.com

(16)上海陆金所基金销售有限公司

注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号

法定代表人:王之光

客服电话:4008-2190-31

联系人:宁博宇

电话:021-20665952

传真:021-22066653

网站:www.lufunds.com

(17)北京微动利基金销售有限公司

注册地址:北京市石景山区古城西路 113 号景山财富中心 341

办公地址:北京市石景山区古城西路 113 号景山财富中心 341

法定代表人:梁洪军

客服电话:400-819-6665

联系人:季长军

电话:010-68854005

传真:010-38854009

网站:www.buyforyou.com

(18)北京钱景基金销售有限公司

注册地址:北京市海淀区丹棱街 6 号丹棱 SOHO 1008-1012

办公地址:北京市海淀区丹棱街 6 号丹棱 SOHO 1008-1012

法定代表人:赵荣春

客服电话:400-893-6885

联系人:高静

电话:010-57418813

传真:010-57569671

网站:www.qianjing.com

(19)珠海盈米基金销售有限公司

注册地址:珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491

办公地址:广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼 B1201-1203

法定代表人:肖雯

客服电话:020-89629066

联系人:吴焜浩

电话:020-89629021

传真:020-89629011

网站:www.yingmi.cn

(20)北京虹点基金销售有限公司

注册地址:北京市朝阳区西大望路 1 号 1 号楼 16 层 1603 室

办公地址:北京市朝阳区工人体育馆北路甲 2 号盈科中心 B 座裙楼二层

法定代表人:郑毓栋