

# 天弘精选混合型证券投资基金 招募说明书（更新）

基金管理人：天弘基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

日 期：二零一零年五月

## 重要提示

天弘精选混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会 2005 年 6 月 20 日证监基金字【2005】104 号文核准募集。本基金的基金合同于 2005 年 10 月 8 日正式生效。

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作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

投资有风险，投资者认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书。基金招募说明书自基金合同生效之日起，每 6 个月更新一次，并于每 6 个月结束之日后的 45 日内公告。

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，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。

本招募说明书所载内容截止日为 2010 年 4 月 8 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2010 年 3 月 31 日（财务数据未经审计）。

## 目 录

一、 绪言 .....	3
二、 释义 .....	3
三、 基金管理人.....	6
四、 基金托管人.....	15
五、 相关服务机构.....	20
六、 基金的募集.....	32
七、 基金合同的生效 .....	32
八、 基金份额的申购与赎回 .....	33
九、 基金非交易过户、转托管、冻结 .....	39
十、 基金的投资.....	40
十一、 基金的业绩.....	48
十二、 基金的财产 .....	49
十三、 基金资产的估值 .....	50
十四、 基金的收益与分配 .....	54
十五、 基金的费用与税收 .....	55
十六、 基金的会计与审计 .....	58
十七、 基金的信息披露 .....	59
十八、 风险揭示.....	64
十九、 基金的终止与清算 .....	66
二十、 基金合同的内容摘要 .....	67
二十一、 基金托管协议的内容摘要.....	80
二十二、 基金份额持有人服务.....	86
二十三、 其他应披露的事项 .....	87
二十四、 招募说明书的存放与查阅方式 .....	89
二十五、 备查文件.....	89

## 一 绪言

本招募说明书依据《基金法》等有关法律法规及《天弘精选混合型证券投资基金基金合同》编写。

本招募说明书阐述了天弘精选混合型证券投资基金的投资目标、策略、风险、费率等与投资者投资决策有关的全部必要事项，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

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。本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。基金投资者自依据基金合同取得基金份额之时，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，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

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称代表如下含义：

基金或本基金	指依据《基金合同》所设立的天弘精选混合型证券投资基金
招募说明书	指《天弘精选混合型证券投资基金招募说明书》及其定期的更新
《基金合同》	指《天弘精选混合型证券投资基金基金合同》及其的任何修订和补充
中国	指中华人民共和国(不包括香港特别行政区、澳门特别行政区及台湾地区)
法律法规	指中国现时有效并公布实施的法律、行政法规、行政规章及规范性文件、地方法规、地方规章及规范性文件
《基金法》	指《中华人民共和国证券投资基金法》

《销售办法》	指《证券投资基金销售管理办法》
《运作办法》	指《证券投资基金运作管理办法》
《信息披露办法》	指《证券投资基金信息披露管理办法》
元	指中国法定货币人民币元
发售公告	指《天弘精选混合型证券投资基金份额发售公告》
业务规则	指《天弘基金管理有限公司开放式基金业务规则》
中国证监会	指中国证券监督管理委员会
银行监管机构	指中国银行业监督管理委员会或其他经国务院授权的机构
基金管理人	指天弘基金管理有限公司
基金托管人	指中国工商银行股份有限公司（以下简称；中国工商银行；）
基金代销机构	指依据有关基金销售与服务代理协议办理本基金发售、申购、赎回和其他基金业务的代理机构；基金销售代理人等同于基金代销机构
销售机构	指基金管理人及基金销售代理人
基金销售网点	指基金管理人的直销网点及基金销售代理人的代销网点
注册登记业务	指包括但不限于基金登记、存管、清算和交收业务，具体内容包 括投资者基金账户管理、基金份额注册登记、清算及基金交易确 认、发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等
基金注册登记机构	指天弘基金管理有限公司或其委托的其他机构
《基金合同》当事人	指受《基金合同》约束，根据《基金合同》享受权利并承担义务 的法律主体
个人投资者	指符合法律法规规定的条件可以投资证券投资基金的自然人
机构投资者	指符合法律法规规定可以投资证券投资基金的在中华人民共和 国注册登记或经政府有关部门批准设立的机构
合格境外机构投资者	指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理办法》的可

	投资于中国境内证券的中国境外的机构投资者
投资者	指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者的总称
基金合同生效日	指本基金首次募集符合本基金合同规定生效条件后，向中国证监会办理基金备案手续，中国证监会作出书面确认之日
设立募集期	指自基金份额发售之日起不超过 3 个月，设立募集期等同于首次募集期、发售期限
基金存续期	指基金合同生效后合法存续的不定期之期间
日/天	指公历日
月	指公历月
工作日	指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日
T 日	指销售机构在规定时间收到投资者认购、申购、赎回或其它业务申请的日期
T+n 日	指自 T 日起第 n 个工作日（不包含 T 日）
认购	指本基金在设立募集期内，投资者购买本基金份额的行为
申购	指本基金合同生效后，基金投资者申请购买基金份额的行为
赎回	指本基金合同生效后，基金投资者卖出基金份额的行为
转托管	指投资者将其持有的同一基金账户下的基金份额从某一交易账户转入另一交易账户的业务
基金账户	指注册登记机构为基金投资者开立的记录其持有的由该注册登记机构办理注册登记的基金份额变动及其余额情况的账户
交易账户	指各销售机构为投资者开立的记录投资者通过该销售机构办理基金认购、申购、赎回及转托管等业务所引起的基金份额的变动及余额情况的账户
定期定额投资计划	指投资者通过有关销售机构提出申请，约定每期扣款日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资者指定银行账户内自动完成扣款及基金申购申请的一种投资方式

基金收益	指基金投资所得股票红利、债券利息、买卖证券差价、银行存款利息以及其他合法收入
基金资产总值	指基金所拥有的各类证券及票据价值、银行存款本息、本基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和
基金资产净值	指基金资产总值扣除负债后的净资产值
基金份额净值	指计算日基金资产净值除以计算日发行在外的基金份额总数
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
指定报刊	指中国证监会指定的用以进行信息披露的全国性报刊
不可抗力	指本合同当事人无法预见、无法抗拒、无法避免且在本合同由基金托管人、基金管理人签署之日后发生的，使本合同当事人无法全部履行或无法部分履行本合同的任何事件，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、法律法规变化、突发停电或其他突发事件、国际或国内金融市场风险事故的发生、证券交易所非正常暂停或停止交易

凡未在本招募说明书中进行释义或者说明的其它术语或者名词，原则上按照有关法律法规或本基金的基金合同中的定义、解释或者说明。

### 三 基金管理人

#### （一）基金管理人概况

机构名称：天弘基金管理有限公司

注册地址：天津市河西区马场道 59 号天津国际经济贸易中心 A 座 16 层

办公地址：天津市河西区马场道 59 号天津国际经济贸易中心 A 座 16 层

成立日期：天弘基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2004]164 号文批准，于 2004 年 11 月 8 日成立。

法定代表人：李琦

联系电话：022-83865568

传真：022-83865569

联系人：吕传红

组织形式：有限责任公司

注册资本：人民币 1 亿元

邮编：300203

股权结构：

出资人名称	出资额	出资比例
天津信托有限责任公司	4800 万元	48%
兵器财务有限责任公司	2600 万元	26%
内蒙古君正能源化工股份有限公司	2600 万元	26%
合 计	1 亿元	100%

天弘基金管理有限公司建立了包括股东会、董事会、监事会、经理层在内的规范健全的现代公司治理结构。董事会通过设立督查委员会、提名委员会，以加强董事会对于公司经营的战略性指导和对公司运作的有效监督。经理层设置投资决策委员会、风险管理委员会、考评委员会三个专门委员会，负责议决公司经营管理过程中的相关事宜。公司根据法律、法规的要求和业务发展的需要设置投资部、市场部、机构理财部、监察稽核部、信息技术部、基金运营部、财务部、综合管理部和人力资源部等部门，成立了北京分公司、上海分公司。

公司自成立以来未受到中国证监会、中国银监会及其他有关机关的处罚。

公司已经建立健全了涵盖投资管理、销售管理、风险控制、监察稽核、基金会计、信息披露、财务管理、人力资源管理、信息技术管理和员工行为准则等各方面的管理制度体系。

## （二）主要人员情况

### 1、董事会成员基本情况：

李琦先生，董事长，硕士研究生。历任天津市民政局事业处团委副书记，天津市人民政府法制办公室、天津市外经贸委办公室干部，天津信托有限责任公司条法处处长、总经理助理兼条法处处长。现任天津信托有限责任公司副总经理。

石忠林先生，董事，硕士研究生，经济师。历任中国兵器工业信息中心中北信息公司部门经理、总经理助理，兵器财务有限责任公司综合业务部业务经理、投资业务部副经理、项



目合作部部门经理。现任兵器财务有限责任公司投资总监、投资业务部部门经理，深圳鑫润投资有限公司董事，北京乔波冰雪家园有限公司董事长，武汉瑞华置业有限公司董事。

熊必琪女士，独立董事，硕士研究生，高级会计师。历任天津市四新油漆厂财务科长、副厂长，天津油漆厂财务科长，天津灯塔涂料股份有限公司副总经理兼总会计师、总经理、董事长、党委书记。现任天津灯塔关西涂料化工有限公司董事长，天津市海运股份有限公司独立董事。

李汉成先生，独立董事，大学本科。历任最高人民法院人事厅副处长、审判员、高级法官。现任北京市尚公律师事务所合伙人、律师，大凌集团有限公司独立非执行董事。

田军先生，独立董事，博士研究生。历任中国人民解放军 6410 工厂宣传干事，国家物价局处长，伦敦经济学院国际经济研究中心研究员，中国经济学会（英国）主席秘书长，英国 Crasby-MTM 公司副总裁，英国富地石油轮胎公司副总裁。现任富地燃气投资有限公司总裁。

卢信群先生，董事，大学本科。历任北京华仪软件系统工程公司技术经理，北京金田电脑经营公司技术经理，联想科技技术经理，香港荣基科技有限公司部门经理，北京君正投资管理顾问有限公司部门经理。现任内蒙古君正能源化工股份有限公司副总裁兼财务总监。

姜希先生，董事，大学本科。历任天津市税务局河西分局财会科副科长，天津市地方税务局副主任科员，国泰君安证券天津分公司投行部经理，天津环球高新技术投资公司投资部部门经理。现任天津信托有限责任公司投行部经理。

## 2、监事会成员基本情况：

苏钢先生，监事会主席，大学本科。曾任职于北京理工大学，北京君正投资管理顾问有限公司，博弘国际投资控股有限公司，博华资产管理有限公司。现任君正国际投资（北京）有限公司董事长，内蒙古君正能源化工股份有限公司董事。

李金林先生，监事，硕士研究生，教授。历任北京工业学院管理工程系助教、讲师，北京理工大学管理学院副教授、教授、副院长。现任北京理工大学管理与经济学院教授、党委书记，四川北方硝化棉股份有限公司独立董事。

童建林先生，监事，大学本科，高级会计师。历任三峡证券宜昌营业部财务部经理，亚洲证券财务会计管理总部财务经理，天弘基金管理有限公司监察稽核部副总经理。现任天弘

基金管理有限公司监察稽核部总经理。

### 3、高级管理人员基本情况

胡敏女士，总经理，硕士研究生，高级会计师。历任北方工业集团财务有限责任公司财务结算部会计主管，车道沟工作站负责人，兵器财务有限责任公司投资业务部副经理，天弘基金管理有限公司督察长、副总经理。

吕传红先生，督察长，硕士研究生。历任湖北省荆门市沙洋区人民检察院助理检察员、检察员，湖北省贸易厅纪检监察员，南开大学法学院讲师，天津开元律师事务所兼职律师，中国证券监督管理委员会天津监管局干部，中国证券监督管理委员会公职律师。

### 4、本基金基金经理

吕宜振先生，博士研究生，自2001年开始从事证券行业工作。历任易方达基金管理有限公司研究主管，信诚基金管理有限公司研究总监、信诚精粹成长股票型证券投资基金基金经理。现任天弘基金管理有限公司投资总监、天弘永定价值成长股票型证券投资基金基金经理。

徐正国先生，硕士研究生，自2004年开始从事证券行业工作，通过美国注册金融分析师（CFA）考试。2004年7月加盟天弘基金管理有限公司，历任公司固定收益证券研究员、银行间市场债券交易员、行业研究员、高级研究员、天弘精选混合型证券投资基金基金经理助理。

历任基金经理：陈天丰先生，任职期间：2005年10月至2006年4月。

王国强先生，任职期间：2006年4月至2007年7月。

许利明先生，任职期间：2007年7月至2009年3月。

### 5、基金管理人投资决策委员会成员的姓名和职务

胡敏女士，总经理；吕宜振先生，投资总监、本基金基金经理、天弘永定价值成长股票型证券投资基金基金经理；姚锦女士，研究部主管、天弘永利债券型证券投资基金基金经理、天弘周期策略股票型证券投资基金基金经理；马志强先生，天弘永定价值成长股票型证券投资基金基金经理；徐正国先生，本基金基金经理。

上述人员之间不存在近亲属关系。

### （三）基金管理人职责

按照《基金法》，基金管理人必须履行以下职责：

- 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、赎回和登记等事宜；
- 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、基金管理人遵守法律法规的承诺

本基金管理人承诺不从事违反《证券法》、《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》等法律法规的活动，并承诺建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止违法行为的发生。

##### 2、基金管理人禁止性行为的承诺

本基金管理人依法禁止从事以下行为：

- （1）将其自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。

##### 3、基金经理承诺

（1）依照有关法律法规和基金合同的规定，本着勤勉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、被代理人、被代表人、受雇他人或任何其他第三人谋取不当利益；

（3）不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；

（4）不从事损害基金资产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

#### （五）基金管理人的内部控制制度

本基金管理人为加强内部控制，促进公司诚信、合法、有效经营，保障基金份额持有人利益，维护公司及公司股东的合法权益，依据《证券法》、《基金法》、《证券投资基金公司管理办法》、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》等法律法规，并结合公司实际情况，制定有关内部控制制度。

##### 1、公司内部控制的总体目标

（1）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定，自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营理念。

（2）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。

（3）确保基金、公司财务和其他信息真实、准确、完整、及时。

##### 2、公司内部控制遵循以下原则

（1）健全性原则。内部控制涵盖公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员，并包括决策、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，建立合理的内控程序，维护内控制度的有效执行。

（3）独立性原则。公司各机构、部门和岗位职责的设置保持相对独立，公司基金财产、自有财产与其他财产的运作相互分离。

（4）相互制约原则。公司设置的各部门、各岗位权责分明、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、内部控制组织体系

公司建立了“四层三线”立体全面完善的内部控制组织体系。

四层是指由权力机构层（股东会、董事会、监事会及其下属委员会）、公司经理层、监察稽核部、各业务部门的内控责任人组成。

三线是指由需要制衡的一线岗位的“双人、双职、双责”，以及无需或无法制衡的其他一线岗位的“单人单岗、后续监督为保障”构成的第一道内控防线；由相关部门、相关岗位之间的相互监督制衡构建的第二道内控防线；由督察长、监察稽核部独立于其他部门对整个公司实施全面监督反馈的第三道内控防线。

### 4、内部控制的制度体系

公司根据法律法规，结合公司实际情况，制定了全面、合理、有效的“四层”内部控制制度体系。内控制度按照其效力大小，自上而下分为以下四个层次：第一个层次是公司章程，为开展内控工作提供原则性的指导意见；第二个层次是公司内部控制大纲，它是对公司章程规定的内控原则的细化和展开，是各项基本管理制度的纲要和总揽，是制定各项规章制度的基础和依据；第三个层次是公司基本管理制度，包括风险控制制度、投资管理制度、销售管理制度、基金会计制度、信息披露制度、监察稽核制度、信息技术管理制度、财务管理制度、人力资源管理制度、资料档案管理制度、业绩评估考核制度和紧急应变制度等；第四个层次是部门业务规章，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。

### 5、内部控制的主要内容

#### （1）基金研究业务

研究业务控制主要内容包括：研究工作保持独立、客观，不受任何部门及个人的不正当影响；建立严密的研究工作业务流程，形成科学、有效的研究方法；建立投资对象备选库制度，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；建立研究与投资的业务交流制度，保持通畅的交流渠道；建立研究报告质量评价体系，不断提高研究水平。

#### （2）投资业务

基金投资应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

等要求；应当确立科学的投资理念，根据决策的风险防范原则和效率性原则制定合理的决策程序；投资决策有充分的投资依据，重要投资有详细的研究报告和风险分析支持，并有决策记录；在进行投资时应有明确的投资授权制度，并应建立与所授权限相应的约束制度和考核制度；建立严格的投资禁止和投资限制制度，保证基金投资的合法合规性；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，将重点投资限制在规定的风险权限额度内；对于投资结果建立科学的投资管理业绩评价体系。

### （3） 基金交易业务

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；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；交易管理部门审核投资指令，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；公司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；建立完善的交易记录制度，及时核对并存档保管每日投资组合列表等；建立科学的交易绩效评价体系；根据内部控制的原则，制定场外交易、网下申购等特殊交易的流程和规则。

### （4） 基金销售

基金管理人依据《基金法》、《销售管理办法》、《运作管理办法》等法律法规以及证监会的规定，从代销机构、宣传推介材料、销售业务规范、内部管理及监察稽核等方面，通过不断完善规章制度与操作流程、加强风险控制、强化人员培训和职业道德意识等，做好本基金销售的内部控制工作。

### （5） 基金会计核算

建立了基金会计的工作制度及相应的操作控制规程，确保会计业务有章可循；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行相关业务的相互核查监督机制；为了防范基金会计在资金头寸管理上出现透支风险，制定了资金头寸管理制度；为了确保基金资产的安全，公司严格规范基金清算交割工作，并在授权范围内，及时准确地完成基金清算；强化会计的事前、事中、事后监督和考核制度；为了防止会计数据的毁损、散失和泄密，制定了完善的档案保管和财务交接制度。



#### （6）信息披露

公司建立并不断完善信息披露制度，保证公开披露的信息真实、准确、完整。公司设立了信息披露负责人，并建立了相应的程序进行信息的收集、组织、内外审核和发布工作，以此加强对信息的审查核对，使所公布的信息符合法律法规的规定，同时加强对信息披露的检查和评价，对存在的问题及时提出改进办法。

#### （7）信息技术系统

公司根据国家法律法规的要求，遵循安全性、实用性、可操作性原则，在信息技术系统的设计开发、电子化业务、硬件和软件的使用与开发设计、信息数据的保存备份等方面，制定严格的信息系统的管理制度与控制措施。

#### （8）监察稽核

公司设立督察长，对董事会负责，经董事会聘任，报中国证监会核准。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。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。

公司设立监察稽核部开展监察稽核工作，公司保证监察稽核部的独立性和权威性。公司明确了监察稽核部及内部各岗位的具体职责，配备了充足的人员，严格制订了专业任职条件、操作程序和组织纪律。

监察稽核部强化内部检查制度，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。

公司董事会和经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，追究有关部门和人员的责任。

### 6、内部控制和风险管理的措施

（1）确立加强内部控制、风险控制的指导思想，以及内部控制、风险控制的目标和原则；

（2）建立完善内部控制、风险控制制度体系；

（3）建立相互分离、相互制衡的内控机制；

（4）建立层次分明、权责明确、涵盖全面的风险控制组织体系；

- (5) 建立定性和定量相结合的风险控制方法；
- (6) 建立稳健合理有效的分类、识别、评估、控制、报告与提示的风险控制程序和制定严格合理的制衡与监督措施；
- (7) 制定持续有效的风险控制制度的评价和检查机制；
- (8) 加强培训，不断提高员工自我内部控制和风险管理意识。

#### 7、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经理层的责任；
- (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）基金托管人基本情况

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：姜建清  
注册资本：人民币 334,018,850,026 元  
联系电话：010-66105799  
联系人：蒋松云

### （二）主要人员情况

截至2010年3月末，中国工商银行资产托管部共有员工125人，平均年龄30岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有硕士以上学位或高级职称。

### （三）基金托管业务经营情况

作为中国首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国工商银行始终坚持“诚实信用、勤勉尽责”的原则，严格履行着资产托管人的责任和义务，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的业务管理模式、健全的托管业务系统、强大的市场营销能力，为广大基金份额持有人和众多资产管理机构提供安全、高效、专业的托管服务，取得了优异业绩。截至 2010 年 3 月，托管证券投资基金 152 只，其中封闭



式 9 只，开放式 143 只。至今已形成包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社保基金、企业年金、产业基金、QFII 资产、QDII 资产等产品在内的托管业务体系。2010 年初，中国工商银行凭借在 2009 年国内外托管领域的杰出表现和品牌影响力，先后被英国《全球托管人》和香港《财资》评选为“2009 年度中国最佳托管银行”，本届《财资》评选首次设立了在亚太地区证券和基金服务领域有突出贡献的年度行业领导者奖项，中国工商银行资产托管部周月秋总经理荣获“年度最佳托管银行家”称号，是仅有的两位获奖人之一。自 2004 年以来，中国工商银行资产托管服务已经获得 22 项国内外大奖。

#### （四）基金托管人职责

基金托管人应当履行下列职责：

- 1、安全保管基金财产；
- 2、按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户；
- 3、对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立；
- 4、保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- 5、按照基金合同的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
- 6、办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
- 7、对基金财务会计报告、中期和年度基金报告出具意见；
- 8、复核、审查基金管理人计算的基金资产净值和基金份额申购、赎回价格；
- 9、按照规定召集基金份额持有人大会；
- 10、按照规定监督基金管理人的投资运作；
- 11、法律、法规和基金合同规定的其它职责。

#### （五）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改进和加强内部风险管理工作，在积极拓展各项托管业务的同时，把加强风险防范和控制的力度，精心培育内控文化，完善风险控制机制，强化业务项目全过程风险管理作为重要工作来做。2008 年，中国工商银行资产托管部再次通过了评估组织内部控制和安全措施是否充分的最权威的国际资

格认证 SAS70（审计标准第 70 号）。通过 SAS70 国际专项认证，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，已经启动 SAS70 审计年度化、常规化的项目。

### 1、内部风险控制目标

保证业务运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，强化和建立守法经营、规范运作的经营思想和经营风格，形成一个运作规范化、管理科学化、监控制度化的内控体系；防范和化解经营风险，保证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、内部风险控制组织结构

中国工商银行资产托管业务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风险管理政策，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，依照有关法律规章，对业务的运行独立行使稽核监察职权。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

### 3、内部风险控制原则

（1）合法性原则。内控制度应当符合国家法律法规及监管机构的监管要求，并贯穿于托管业务经营管理活动的始终。

（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，必须做到已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委托资产的安全与完整。

（5）有效性原则。内控制度应根据国家政策、法律及经营管理的需要适时修改完善，并保证得到全面落实执行，不得有任何空间、时限及人员的例外。

（6）独立性原则。资产托管部托管的基金资产、托管人的自有资产、托管人托管的其他资产应当分离；直接操作人员和控制人员应相对独立，适当分离；内控制度的检查、评价部门必须独立于内控制度的制定和执行部门。

#### 4、内部风险控制措施实施

（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，建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度，并采取了良好的防火墙隔离制度，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特别情况，以检查资产托管部在实现内部控制目标方面的进展，并根据检查情况提出内部控制措施，督促职能管理部门改进。

（3）人事控制。资产托管部严格落实岗位责任制，建立“自控防线”、“互控防线”、“监控防线”三道控制防线，健全绩效考核和激励机制，树立“以人为本”的内控文化，增强员工的责任心和荣誉感，培育团队精神和核心竞争力。并通过进行定期、定向的业务与职业道德培训、签订承诺书，使员工树立风险防范与控制理念。

（4）经营控制。资产托管部通过制定计划、编制预算等方法开展各种业务营销活动、处理各项事务，从而有效地控制和配置组织资源，达到资源利用和效益最大化目的。

（5）内部风险管理。资产托管部通过稽核监察、风险评估等方式加强内部风险管理，定期或不定期地对业务运作状况进行检查、监控，指导业务部门进行风险识别、评估，制定并实施风险控制措施，排查风险隐患。

（6）数据安全控制。我们通过业务操作区相对独立、数据和传真加密、数据传输线路的冗余备份、监控设施的运用和保障等措施来保障数据安全。

（7）应急准备与响应。资产托管业务建立专门的灾难恢复中心，制定了基于数据、应用、操作、环境四个层面的完备的灾难恢复方案，并组织员工定期演练。为使演练更加接近实战，资产托管部不断提高演练标准，从最初的按照预订时间演练发展到现在的“随机演练”。从演练结果看，资产托管部完全有能力在发生灾难的情况下两个小时内恢复业务。

#### 5、资产托管部内部风险控制情况

（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，依照有关法律规章，全面贯彻落实全程监控思想，确保资产托管业务健康、稳定地发展。

（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员工的共同参与，只有这样，风险控制制度和措施才会全面、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职责范围内的风险负责，通过建立纵向双人制、横向多部门制的内部组织结构，形成不同部门、不同岗位相互制衡的组织结构。

（3）建立健全规章制度。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，形成各个业务环节之间的相互制约机制。

（4）内部风险控制始终是托管部工作重点之一，保持与业务发展同等地位。资产托管业务是商业银行新兴的中间业务，资产托管部从成立之日起就特别强调规范运作，一直将建立一个系统、高效的风险防范和控制体系作为工作重点。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。

#### （六）基金托管人对基金管理人运作本基金进行监督的方法和程序

根据《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关证券法律法规的规定，基金托管人对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金申购资金的到账和赎回资金的划付、基金收益分配等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

基金托管人发现基金管理人的违反《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关证券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确认并以书面形式对基金托管人发出回函。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。基金管理人对基金托管人通知

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。

## 五 相关服务机构

### （一）基金份额发售机构

#### 1、直销机构：

##### （1）天弘基金管理有限公司

住所、办公地址：天津市河西区马场道 59 号天津国际经济贸易中心 A 座 16 层

法定代表人：李琦

联系人：王巍巍

邮编：300203

电话：022-83865560

传真：022-83865569

网址：www.thfund.com.cn

客户服务热线：400-710-9999、022-83310988

##### （2）天弘基金管理有限公司北京分公司

办公地址：北京市西城区金融大街一号金亚光大厦A座15层

联系人：张婷

邮编：100033

电话：010-83571789-6287

传真：010-83571800

网址：www.thfund.com.cn

##### （3）天弘基金管理有限公司天津理财中心

办公地址：天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层

联系人：司媛

电话：022-83310208-8282

传真：022-83865569

网址：[www.thfund.com.cn](http://www.thfund.com.cn)

客户服务热线：400-710-9999、022-83310988

## 2、代销机构：

### （1）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

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：姜建清

电话：010-66106912

传真：010-66107914

联系人：田耕

网址：[www.icbc.com.cn](http://www.icbc.com.cn)

客户服务热线：95588

### （2）兴业银行股份有限公司

注册地址：福州市湖东路154号中山大厦

办公地址：上海市江宁路168号

法定代表人：高建平

电话：021-52629999

传真：021-62569070

联系人：苏健

网址：[www.cib.com.cn](http://www.cib.com.cn)

客户服务热线：95561

### （3）中国邮政储蓄银行有限责任公司

注册地址：北京市西城区宣武门西大街131号

办公地址：北京市西城区宣武门西大街131号

法定代表人：刘安东

电话：010-66421200

传真：010-66415194

联系人：陈春林

网址：[www.psbc.com](http://www.psbc.com)

客户服务热线：11185

（4）中信银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

法定代表人：孔丹

电话：010-65557013

传真：010-65550827

联系人：金蕾

网址：[bank.ecitic.com](http://bank.ecitic.com)

客户服务热线：95558

（5）交通银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路188号

办公地址：上海市浦东新区银城中路188号

法定代表人：胡怀邦

电话：021-58781234

传真：021-58408483

联系人：蔡雪

网址：[www.bankcomm.com](http://www.bankcomm.com)

客户服务热线：95559

（6）招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道7088号

办公地址：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦

法定代表人：秦晓

电话：0755-83077024

传真：0755-83195049

联系人：徐彪

网址：[www.cmbchina.com](http://www.cmbchina.com)

客户服务热线：95555

（7）华夏银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街22号华夏银行大厦

办公地址：北京市东城区建国门内大街22号华夏银行大厦

法定代表人：吴健

电话：010-85238423

传真：010-85238680

联系人：董金

网址：[www.hxb.com.cn](http://www.hxb.com.cn)

客户服务热线：95577

（8）中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京西城区金融大街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：郭树清

传真：010-66275654

联系人：王琳

网址：[www.ccb.com](http://www.ccb.com)

客户服务热线：95533

（9）国泰君安证券股份有限公司

注册地址：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

法定代表人：祝幼一

电话：021-62580818-213

传真：021-62569400



联系人：韩星宇

网址：[www.gtja.com](http://www.gtja.com)

客户服务热线：400-8888-666

（10）中信建投证券有限责任公司

注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街188号

法定代表人：张佑君

电话：010-85130588

传真：010-65182261

联系人：权唐

网址：[www.csc108.com](http://www.csc108.com)

客户服务热线：400-8888-108

（11）招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座39j 45层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座40层

法定代表人：宫少林

电话：0755-82943511

传真：0755-82943237

联系人：黄健

网址：[www.newone.com.cn](http://www.newone.com.cn)

客户服务热线：400-8888-111、0755-26951111

（12）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2-6层

办公地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座2-6层

法定代表人：顾伟国

电话：010-66568888

传真：010-66568536

联系人：李洋

网址：[www.chinastock.com.cn](http://www.chinastock.com.cn)

客户服务热线：400-8888-888

（13）海通证券股份有限公司

注册地址：上海市淮海中路98号

办公地址：上海市黄浦区广东路689号10楼

法定代表人：王开国

电话：021-23219000

传真：021-63410456

联系人：李笑鸣

网址：[www.htsec.com](http://www.htsec.com)

客户服务热线：400-8888-001、021-962503或拨打各城市营业网点咨询电话

（14）渤海证券股份有限公司

注册地址：天津市经济技术开发区第二大街42号写字楼101室

办公地址：天津市南开区宾水西道8号（奥体中心北侧）

法定代表人：王春峰

电话：022-28451861

传真：022-28451892

联系人：姜莹

网址：[www.ewww.com.cn](http://www.ewww.com.cn)

客户服务热线：400-6515-988

（15）山西证券股份有限公司

注册地址：太原市府西街69号山西国际贸易中心

办公地址：太原市府西街69号山西国际贸易中心

法定代表人：侯巍

电话：0351-8686766、0351-8686708

传真：0351-8686619

联系人：张治国

网址：[www.i618.com.cn](http://www.i618.com.cn)

客户服务热线：0351-8686868

（16）华泰证券股份有限公司

注册地址：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦

办公地址：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦

法定代表人：吴万善

电话：025-84457777-893

传真：025-84579879

联系人：程高峰

网址：[www.htsc.com.cn](http://www.htsc.com.cn)

客户服务热线：025-84579897、400-8888-168

（17）天相投资顾问有限公司

注册地址：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701

办公地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座4层

法定代表人：林义相

电话：010-66045522

传真：010-66045500

联系人：陈少震

网址：[www.txsec.com](http://www.txsec.com)

客户服务热线：010-66045678

（18）申银万国证券股份有限公司

注册地址：上海市常熟路171号

办公地址：上海市常熟路171号

法定代表人：丁国荣

电话：021-54033888

传真：021-54030294

联系人：李清怡

网址：[www.sw2000.com.cn](http://www.sw2000.com.cn)

客户服务热线：021-962505

（19）江南证券有限责任公司

注册地址：江西省南昌市抚河北路291号教育出版大厦6楼

办公地址：江西省南昌市抚河北路291号教育出版大厦6楼

法定代表人：杜航

电话：0791-6768763

联系人：戴蕾

网址：[www.scstock.com](http://www.scstock.com)

客户服务热线：0791-6781119

（20）齐鲁证券有限公司

注册地址：山东省济南市经十路128号

办公地址：山东省济南市经十路128号

法定代表人：李玮

电话：0531-81283906

传真：0531-81283900

联系人：王霖

网址：[www.qizq.com.cn](http://www.qizq.com.cn)

客户服务热线：95538

（21）中银国际证券有限责任公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层

办公地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层

法定代表人：唐新宇

电话：021-68604866

传真：021-58883554

联系人：龚正

网址：[www.bocichina.com.cn](http://www.bocichina.com.cn)

客户服务热线：852-2121-0088

（22）光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闻路1508号

办公地址：上海市静安区新闻路1508号

法定代表人：徐浩明

电话：8621-2216-9999

传真：8621-6215-1789

联系人：李芳芳

网址：[www.ebscn.com](http://www.ebscn.com)

客户服务热线：400-888-8788

（23）新时代证券有限责任公司

注册地址：北京市西城区金融街大街1号A座8层

办公地址：北京市西城区金融街大街1号A座8层

法定代表人：马金声

电话：010-83561177

传真：010-83561000

联系人：戴荻

网址：[www.xsdzq.cn](http://www.xsdzq.cn)

客户服务热线：400-698-9898

（24）长江证券股份有限公司

注册地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦

办公地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦

法定代表人：胡运钊

电话：027-65799999

传真：027-85481900

联系人：李良

网址：[www.95579.com](http://www.95579.com)

客户服务热线：400-8888-999

（25）华泰联合证券有限责任公司

注册地址：深圳市深南东路5047号发展银行大厦10、24、25层

办公地址：深圳市深南东路5047号发展银行大厦10、24、25层

法定代表人：马昭明

电话：0755-82492000

传真：0755-82492062

联系人：庞晓芸

网址：[www.lhzq.com](http://www.lhzq.com)

客户服务热线：400-8888-555

（26）平安证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区金田路中华国际交易广场8层

办公地址：深圳市福田区金田路中华国际交易广场8层

法定代表人：杨宇翔

电话：0755-22627802

传真：0755-82433794

联系人：袁月

网址：[www.pingan.com.cn](http://www.pingan.com.cn)

客户服务热线：95511

（27）世纪证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦40-42层

办公地址：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦40-42层

法定代表人：卢长才

电话：0755-83199511

传真：0755-83199545

联系人：张婷

网址：[www.csc0.com.cn](http://www.csc0.com.cn)

客户服务热线：0755-83199599

（28）上海证券有限责任公司

注册地址：上海市西藏中路336号

办公地址：上海市西藏中路336号

法定代表人：郁衷民

电话：021-53519888

传真：021-53519888

网址：[www.shzq.com](http://www.shzq.com)

客户服务热线：021-962518

（29）安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层

办公地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层

法定代表人：牛冠兴

电话：0755-82558305

传真：0755-82558355

网址：[www.essence.com.cn](http://www.essence.com.cn)

客户服务热线：400-800-1001

（30）宏源证券股份有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市文艺路233号宏源大厦

办公地址：北京市海淀区西直门北大街甲43号金运大厦B座6层

法定代表人：冯戎

电话：010-62294608-6240

传真：010-62296854

网址：[www.hysec.com](http://www.hysec.com)

客户服务热线：0991-400-800-0562

（31）广州证券有限责任公司

注册地址：广州市先烈中路69号东山广场主楼5楼

办公地址：广州市先烈中路69号东山广场主楼6楼

法定代表人：吴志明

电话：020-87322668

传真：020-87325036

联系人：樊刚正

网址：www.gzs.com.cn

客户服务热线：961303

3、基金管理人可根据有关法律法规规定，变更基金代销机构，并及时公告。

4、本基金全部销售机构的网点分布、购买程序和联系方式等详细信息，请参见本基金的基金份额发售公告及其它相关公告。

## （二）注册登记机构

名称：天弘基金管理有限公司

住所、办公地址：天津市河西区马场道 59 号天津国际经济贸易中心 A 座 16 层，300203

法定代表人：李琦

电话：022-83865598

传真：022-83865565

联系人：田中甲

## （三）律师事务所和经办律师

名称：嘉德恒时律师事务所

办公地址：天津市河西区马场道 59 号天津国际经济贸易中心 A 座 10 层 1009-1010

法定代表人：孟卫民

电话：022-83865255

传真：022-83865266

联系人：续宏帆

经办律师：韩刚、续宏帆

## （四）会计师事务所和经办注册会计师



名称：普华永道中天会计师事务所有限公司

办公地址：中国上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

法定代表人：杨绍信

电话：86 (21) 2323 3283

传真：86 (21) 2323 8800

联系人：张鸿

经办注册会计师：汪棣、张鸿

## 六 基金的募集

本基金由管理人依照《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、基金合同及其他有关规定，并经中国证监会证监基金字【2005】104 号文核准募集。募集期为 2005 年 8 月 22 日至 2005 年 9 月 27 日。

经德勤华永会计师事务所验资，募集的净销售额为 339,099,940.28 元人民币，认购款项在设立募集期间产生的银行利息共计 43,855.38 元人民币。募集有效认购总户数为 4761 户，按照每份基金份额 1.00 元计算，设立募集期间募集的有效份额为 339,099,940.28 份基金份额，利息结转的基金份额为 43,855.38 份基金份额，两项合计共 339,143,795.66 份基金份额，已全部计入投资者基金账户，归投资者所有。

## 七 基金合同的生效

### （一）基金合同的生效

本基金合同已于 2005 年 10 月 8 日正式生效。

### （二）基金存续期内的基金份额持有人数量和资金额

本基金的基金合同生效后，基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元的，基金管理人应当及时报告中国证监会；连续 20 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会说明原因和报送解决方案。

法律、法规或证券监管部门另有规定的，从其规定办理。