# 

**中融基金管理有限公司**

**基金中基金基金池管理办法**

**2016年 月 日**

目 录

[第一章 总则 3](#_Toc454705374)

[第二章 基金池分类及投资限制 3](#_Toc454705375)

[第三章 基金池的管理和相关部门职责 5](#_Toc454705376)

[第四章 附则 6](#_Toc454705377)

# 总则

1. 为规范公司基金中基金（以下简称“公募FOF”）投资业务，防范投资风险，切实维护基金中基金份额持有人合法权益，根据《证券法》、《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作指引第2号——基金中基金指引》等有关法律法规和公司有关规定，制定本办法。
2. 本办法适用于公司公募FOF产品投资的基金。

# 基金池分类及投资限制

1. 公司公募FOF基金池包括基础池、精选池、核心池等。
2. 有下列情形之一的基金，应当禁止调入基金池：
3. 基金的运作期限少于1年的基金品种；
4. 最近定期报告披露的规模低于1亿元的基金品种；
5. 分级基金等具有复杂、衍生品性质的基金品种，中国证监会另行规定的除外；
6. 中国证监会不允许投资的其他基金品种；
7. 公司投委会认为应当禁止投资的其他基金品种。
8. 基础池是公司管理的公募FOF可投资基金的集合。基础池的基金数量原则上不超过市场上基金总数量的40%。
9. 精选池是公司管理的公募FOF可投资较高比例基金的集合。精选池中的基金必须从基础池中选择，精选池的基金数量原则上不超过基础池基金数量的25%。
10. 核心池是公司管理的公募FOF可重点投资基金的集合。核心池中的基金必须从精选池中选择，核心池的基金数量原则上不超过精选池基金数量的25%。
11. 公司管理的公募FOF所投资的基金必须在公司基金池中，除此以外，还应当遵循以下比例限制：
12. 单只公募FOF所投资的单只基础池基金，持仓市值不得超过该公募FOF资产净值的5%。
13. 单只公募FOF产品所投资的单只精选池基金，持仓市值不得超过该公募FOF资产净值的10%；
14. 单只公募FOF产品所投资的单只核心池基金，持仓市值不得超过该公募FOF资产净值的15%；
15. 单只公募FOF产品所投资的单只核心池基金，持仓市值需要突破上述第三点所列比例限制的，应当提请公司投资决策委员会审核，投委会审核通过的，持仓市值不得超过该公募FOF资产净值的20%；
16. 公募FOF完全按照有关指数的构成比例持有基金的，可以不受前述比例限制。
17. 因市场涨跌、基金基本面变化等各种原因导致公募FOF持仓的基金品种或其持仓比例不符合第八条要求的，基金经理或者投资经理应当在十个可操作交易日内调整持仓使其符合要求。风险管理部在此期间应当予以提醒、督促。

# 基金池的管理和相关部门职责

1. 公司研究部门负责建和维护基金池，研究部门应当配备基金研究人员，承担基金相关研究工作。投资部门可以向研究部门提出基金池出入池建议。
2. 风险管理部门负责在基金池管理中做好以下工作：
3. 监督基金池的建立和维护，具体工作包括但不仅限于检查基础数据是否真实准确、筛选标准是否有效执行，根据需要参与尽职调查，审阅相关报告等；
4. 对公司管理的公募FOF产品持仓进行监控，对于超出基金池相关制度限制比例的情况，及时向投资部门发出风险警示和操作提示。
5. 交易部应当根据基金池的调整情况及时做好开户等支持性工作。运营部应当根据基金池的调整情况，按照《中融基金管理有限公司基金中基金运营管理办法》的规定，及时做好运营相关的支持性工作。
6. 信息技术部应当配合基金池的管理做好系统录入、权限设置、数据对接等支持性工作。
7. 法律合规部应当积极推动建立基金池相关制度及相关工作流程；对基金池管理相关工作进行监督和不定期专项稽核。
8. 基金池的建立

公司研究部门负责拟定基金池的筛选标准，筛选标准经研究总监审核通过后，研究部门应当向法律合规部、风险管理部报备。

研究部门按照基金池的筛选标准，建立基金池，基金池经研究总监审核通过后，报风险管理部审核通过后正式建立。

基金池建立后，研究部门应当向法律合规部、风险管理部、交易部、运营部和信息技术部报备。

1. 基金池的维护

基金池的维护包括定期和不定期的两种方式。

1. 定期维护。基金定期报告公布后二十个工作日内，研究部门应当根据最新数据对基金池进行定期调整，调整后的基金池经研究总监审核通过后，报风险管理部审核通过后正式生效。调整后的基金池应当向法律合规部、风险管理部、交易部、运营部和信息技术部报备。
2. 不定期维护。研究部门应当保持对各基金池具体品种的跟踪研究。当具体品种情况发生较大变化时，研究部门应当及时提出出入池建议和申请，出入池申请经研究总监审核通过后，报风险管理部审核通过后正式生效。调整后的基金池应当向法律合规部、风险管理部、交易部门、运营部和信息技术部报备。

# 附则

1. 根据公司相关制度，基金池信息应严格保密；凡有权接触基金池信息的员工，禁止向无关人员泄露；禁止对基金池进行批量导出和复制，未经公司保密工作负责人或其授权人的批准，不得以任何形式获取或向外界透露基金池信息。
2. 本办法经总经理办公会审议通过，并自公布之日起施行。