景顺长城大中华股票型证券投资基金2012年第1号更新招募说明书摘要

重要提示

(一)景顺长城大中华股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证监会2011年5月13日证监许可【2011】709号文核准募集。本基金基金合同于2011年9月22日正式生效。

(二)基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写,并经中国证监会核准,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。

(三)本基金投资于除内地以外的大中华地区证券交易市场及其他境外证券市场,除了证券投资基金的各种类似风险因素外,由于香港、台湾等证券市场及其他海外证券市场的特点和市场规则非不同于内地市场,投资人还可能面临境外投资的特定风险,包括汇率风险、境外市场投资风险、成熟市场投资风险、新兴市场投资风险、政府管制风险、政治风险、税务风险、衍生品投资风险、投资顾问风险和金融模型风险。投资者在投资本基金前,请认真阅读本招募说明书,全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,对认购(或申购)基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策,获得基金投资收益,承担相基金投资中出现的各类风险。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则,在投资人作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资人自行负责。投资有风险,投资人申购基金时应认真阅读本招募说明书。

(四)基金的过往业绩并不预示其未来表现。

(五)基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,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。基金投资人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。

(六)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,但不保证投资本基金一定盈利,也不保证最低收益。

(七)本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为2012年3月22日,有关财务数据和净值表现截止日为2011年12月31日。本招募说明书中的财务数据未经审计。

基金管理人:景顺长城基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

一、基金的名称

景顺长城大中华股票型证券投资基金

二、基金的类型

契约型开放式、股票型

三、基金的投资目标

本基金通过投资于除内地以外的大中华地区证券市场以及海外证券市场交易的大中华企业,追求长期资本增值。

四、基金的投资方向

本基金的投资范围包括股票及其他权益类证券、现金、债券、股指期货及中国证监会允许投资的其它金融工具。其中,股票及其他权益类证券包括中国证监会允许投资的普通股、优先股、公募股票型基金、存托凭证等。现金、债券及中国证监会允许投资的其它金融工具包括银行存款、可转让存单、同购协议、短期政府债券等货币市场工具;政府债券、公司债券、可转换债券、债券基金、货币基金等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券等。

本基金主要投资于除中国内地以外的大中华地区证券市场以及在其他证券市场交易的“大中华企业”。“除中国内地以外的大中华地区证券市场”为中国证监会允许投资的香港和台湾证券市场等。所谓“大中华企业”是指满足以下三个条件之一的上市公司:1)上市公司注册在大中华地区(中国内地、香港、台湾、澳门);2)上市公司中最少百分之五十之营业额、盈利、资产、或剩选活动来自大中华地区;3)控股公司,其子公司的注册办公室在大中华地区,且主要业务活动亦在大中华地区。

本基金对于股票及其他权益类证券的投资不少于基金资产净值的60%,其中投资于除中国内地以外的大中华地区证券市场以及在其他证券市场交易的大中华企业的资产不低于基金资产净值的80%;持有现金或政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。本基金的建仓期为自2011年9月22日基金合同生效日起6个月,截至本报告期末,本基金仍处于建仓期。基金合同生效2011年9月22日起至本报告期末不满一年。

十、基金管理人

一、基金管理人概况

名 称:景顺长城基金管理有限公司

住 所:深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场第一座21层

设立日期:2003年6月12日

法定代表人:赵如冰

批准设立文号:证监基金字【2003】76号

办公地址:深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场第一座21层

电 话:0755-82370388

客户服务电话:400 8888 606

传 真:0755-22381339

联系人:杨晓阳

二、基金管理人基本情况

本基金管理人景顺长城基金管理有限公司(以下简称“公司”或“本公司”)是经中国证监会证监基金字【2003】76号文批准设立的证券投资基金管理公司,由长城证券有限责任公司、景顺资产管理有限公司、开滦(集团)有限责任公司、大连实德集团有限公司共同发起设立,并于2003年6月9日获得开业批文,注册资本1.3亿元人民币,目前,各家出资比例分别为49%、49%、1%、1%。

公司设立了两个专门机构:风险管理委员会和投资决策委员会。风险管理委员会负责公司整体运营风险的控制。投资决策委员会负责指导基金财产的运作、确定基本的投资策略和投资组合的原则。

公司下设7个一级部门,分别是:投资部、市场部、运营部、人力资源部、财务行政部、法律监察稽核部、总经理办公室。其中投资部下设投资研究部、固定收益部、专户理财部、国际投资部4个二级部门;市场部下设渠道销售部、机构客户部、市场服务部、产品开发部4个二级部门;运营部下设基金事务部、信息技术部、交易管理部3个二级部门。各部门的职责如下:

1)投资部

1)投资研究部:负责根据投资决策委员会制定的投资原则进行国内股票选择和组合的投资管理并完成对宏观经济、行业公司及市场的研究。

2)固定收益部:负责根据投资决策委员会制定的投资原则进行国内债券选择和组合的投资管理并完成固定收益部的研究。

3)专户理财部:负责完成一对一、一对多等特定客户资产管理产品的投资管理。

4)国际投资部:主要负责与QDII、QFII等国际业务相关的基金产品设计、投资管理、国际合作和培训等业务。

2)市场部

1)渠道销售部:负责公司产品在各银行、券商等渠道的销售。

2)机构客户部:负责开发机构客户,并使其认识并了解我公司在企业年金、社保等方面所提供的基金产品及服务。

3)市场服务部:负责公司市场营销策略、计划制定,及客户服务管理工作。

4)产品开发部:负责基金产品及其他投资产品的设计、开发、报批等工作。

3)运营部

1)基金事务部:负责公司产品的注册登记、清算和估值核算等工作。

2)信息技术部:负责公司的计算机设备维护、系统开发及网络运行和维护。

3)交易管理部:负责完成投资部下达的交易指令、并进行事前的风险控制。

4)人力资源部:负责公司各项人力资源管理工作,包括招聘、薪资福利、绩效管理、培训、员工关系、从业资格管理、高管及基金经理资格管理等。

5)财务行政部:负责公司财务管理及日常行政事务管理。

6)法律监察稽核部:负责对公司管理和基金运作合规性进行全方位的监察稽核,并向公司管理层和监管机关提供独立、客观、公正的法律监察稽核报告。

7)总经理办公室:主要受总经理委托,协调各部门的工作,并负责公司日常办公秩序监督、工作项目管理跟进等,并负责基金风险的评估、控制及管理。

公司现有员工129人,其中,82人具有硕士以上学历。

公司已经建立了健全的内部风险控制制度、内部稽核制度、财务管理制度、人事管理制度、信息披露制度和员工行为准则等公司管理制度体系。

三、主要人员情况

1、基金管理人董事会成员

赵如冰先生,董事长,武汉水利电力学院(现武汉大学)动力系本科毕业,辽宁大学经济学硕士。曾任葛洲坝水力发电厂主任、研究员级高级工程师,葛洲坝至上海超高压直流输电葛洲坝站站长、书记,葛洲坝水力发电厂办公室主任兼外办主任,华能南方开发公司党组书记、总经理,华能房地产开发公司副总经理,中比地产开发公司总经理、党组书记,长城证券有限责任公司董事、副董事长、党委副书记等职。2009年加入本公司,现任公司董事长。

罗德城先生,董事,毕业于美国Babson学院,获学士学位及工商管理硕士学位。曾任大通银行信用分析师、花旗银行投资管理部副总裁、Capital House亚洲分公司的董事总经理。1992至1996年间出任香港投资基金公会管理委员会成员,并于1996至1997年间担任公会主席。1997至2000年间,担任香港联交所委员会成员,并在1997至2001年间担任香港证监会顾问委员会成员。现任景顺集团亚太区首席执行官。

杨平先生,董事,北京大学国际MBA学历。历任北京国际信托投资公司外汇部首席交易员、加拿大蒙特利尔银行北京分行资金部和市场部高级经理、中国人民保险公司投资部投资总监、中国人保资产管理有限公司银行外汇业务部副总经理、中国人民保险(香港)有限公司投资部总经理、长城证券有限责任公司总裁助理等职务。现任长城证券有限责任公司副总经理。

许文明先生,董事,总经理,基本学位会计学学士及香港城市大学金融工程学硕士。曾先后就职于前美国大通银行香港、台湾及伦敦分行财资部,汇丰银行总行中国环球市场部;之前曾担任台湾景顺证券投资信托股份有限公司董事兼总经理、香港景顺资产管理有限公司大中华区业务拓展总监等职务。2009年加入本公司,现任公司董事兼总经理。

李晓西先生,独立董事。曾任国务院研究室宏观经济研究司司长。现任北京师范大学校学术委员会副主任,经济与资源管理研究院院长,教授、博士生导师;中国社会科学院研究生院教授、博士生导师,教育部社会科学委员会经济学部召集人。

伍同明先生,独立董事,香港大学文学士(1972年毕业),香港会计师公会会员(HKICPA)、英国特许公认会计师(ACCA)、香港执业会计师(CPA)、加拿大公认管理会计师(CMA)。拥有超过二十年以上的会计、审核、管治程序的专业经验及知识,1972-1977受训于国际知名会计师楼“毕马威会计师行”(KPMG),现为“伍同明会计师行”所有者。

靳庆军先生,独立董事,1982年毕业于安徽大学外语系英语专业,获文学学士,1987年毕业于中国政法大学,获国际法专业法学硕士。曾担任中信律师事务所涉外专职律师,在香港马士打律师行(英国律师行Clyde & Co.从事律师工作,1993年发起设立信达律师事务所,担任执行合伙人。现任金杜律师事务所合伙人。

2、基金管理人监事会成员

黄海洲先生,监事,武汉大学硕士。曾任深圳新江南投资有限公司副总经理、长城证券有限责任公司监事、招商银行股份有限公司人力资源部经理及工程管理部经理。现任长城证券有限责任公司副总经理。

邹慧娴女士,监事,英国曼彻斯特大学会计及计算机科学学士学位,英国伦敦政治经济学院管理学硕士学位。曾任伦敦安永会计师事务所核数师,历任景顺投资管理有限公司项目主管、业务发展部副经理、企业发展部经理、亚太区监察总监。现任景顺投资管理有限公司亚太区首席行政官。

邵媛媛女士,监事,1999年毕业于安徽财贸学院会计学系,获管理学硕士学位。曾任职于深圳市天健(信德)会计师事务所、福建兴业银行深圳分行计财部。现任景顺长城基金管理有限公司监察稽核部经理。

3、其他高级管理人员

Patrick Song Liu(刘颂)先生,副总经理,英国牛津大学工商管理硕士。曾先后任职于路透香港上海办事处、路透香港、路透伦敦有限公司及伦敦洛希尔父子有限公司;于2006年加入香港景顺投资管理有限公司,担任景顺大中华区机构业务拓展部总监一职;其后被派往香港景顺驻北京代表处,担任首席代表。2009年加入本公司,现任公司副总经理。

邓体顺先生,副总经理,美国尤他大学统计学和经济学双硕士。曾担任法国东方汇理银行香港分行外汇及资金部交易员;法国巴黎银行香港分行助理重事;瑞士信贷银行香港分行董事;高盛(亚洲)有限责任公司融资部董事总经理及中国资本市场部主管。2011年11月加入本公司,现任公司副总经理。

吴建军先生,副总经理,人民银行总行金融研究所经济学硕士。曾任海南汇通国际信托投资公司证券部副经理、长城证券有限责任公司机构管理部总经理、公司总裁助理。2003年加入本公司,现任公司副总经理。

刘焕喜先生,副总经理,华中农大经贸学院投资与金融系博士。历任武汉大学教师工作处副科长、武汉大学成人教育学院讲师、《证券时报》社编辑记者、长城证券研发中心研究员、总裁办副主任、行政部副总经理。2003年加入本公司,现任公司副总经理。

4、督察长

黄卫明先生,督察长,中国人民大学法学硕士。历任国家工商局市场司主任科员,国泰君安证券公司总裁助理兼人力资源部总经理,中国证监会证券监管部、非上市公众公司部等主任科员、副处长、处长。2010年加入本公司,现任公司督察长。

5、本基金基金经理简历

本公司采用团队投资方式,即通过整个投资部门全体人员的共同努力,争取良好投资业绩。本基金报聘任基金经理如下:

谢天翎女士,台湾大学经济学学士、商学硕士、CFA。曾任台湾保诚证券投资信托股份有限公司证券投资部投资管理部海外组副理和基金经理;2008年4月加入本公司。具有11年海内外证券、基金行业从业经验。

6、本基金现任基金经理管理的基金名称及管理时间

本基金现任基金经理谢天翎女士在《台湾》保诚证券投资信托股份有限公司任职期间,曾于2005年6月至2006年5月担任保诚印度基金,2006年6月至2007年12月担任保诚质量精选组合基金,2007年5月至2007年12月担任保诚趋势精选组合基金,2007年12月至2008年3月担任保诚亚太基础建设基金,2007年12月至2008年3月担任保诚美国高科技基金。

7、本基金现任基金经理兼任其他基金基金经理的情况

无。

8、本基金历任基金经理姓名及管理时间

基金经理	管理时间
谢天翎 女士	2011年9月22日(基金合同生效日)- 至今

9、投资决策委员会委员名单

本公司的投资决策委员会由公司总经理、分管投资的副总经理、投资总监、投资研究部研究总监、国际投资部负责人等组成。

公司的投资决策委员会成员姓名及职务如下:

许文明先生,总经理;

邓体顺先生,分管投资的副总经理;

王鹏辉先生,投资总监;

唐斌德先生,投资研究部研究总监;

陈爱萍女士,国际投资部负责人。

10、上述人员之间不存在近亲属关系。

四、基金管理人的权利和义务

1、基金管理人的权利

1)自基金合同生效之日起,依照有关法律法规和基金合同的规定独立运用基金财产;

2)依照《基金合同》获得基金管理人报酬以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用;

3)提醒有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利;

4)在符合有关法律法规和本基金合同的前提下,制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则,决定基金的除调高托管费和管理费之外的费率结构和收费方式;

5)根据基金合同及有关规定监督基金托管人,对于基金托管人违反了基金合同或有关法律法规规定的行为,对基金财产、其他基金当事人的利益造成重大损失的情形,应及时呈报中国证监会和银行业监督管理机构,并采取必要措施保护基金财产及相关基金当事人的利益;

6)在基金合同约定的范围内,拒绝或暂停受理申购、赎回和转换申请;

7)自行担任基金注册登记机构或选择、更换基金注册登记机构,并对基金注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查;

8)选择、更换代销机构,并依据销售代理协议和有关法律法规,对其行为进行必要的监督和检查;

9)在基金托管人更换时,提名新的基金托管人;

10)依法召集基金份额持有人大会;

11)选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构;

12)选择、增补、更换或撤销境外投资顾问;

13)根据国家有关规定,在法律法规允许的前提下,以基金的名义依法为基金融资、融券;

14)销售基金份额;

15)依据《基金合同》及有关法律规定决定基金收益分配方案;

16)以基金管理人的名义,代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为;

17)法律法规和基金合同规定的其他权利。

2、基金管理人的义务

1)依法募集基金,办理或者委托经由证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和注册登记事宜;

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、勤勉尽责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)建立健全内部风险控制、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的财产相互独立,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;

6)除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外,不得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)计算并公告基金资产净值,确定基金份额申购、赎回价格;

9)采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回价格的方法符合基金合同等法律文件的规定;

10)按规定受理基金份额的申购和赎回申请,及时、足额支付赎回款项;

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,不得泄露基金投资计划、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,不得向他人泄露;

15)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;

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)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;

18)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;

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)因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益,应当承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;

21)基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时,应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿;

22)按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料;

23)建立并保存基金份额持有人名册;

24)面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时,及时报告中国证监会并通知基金托管人;

25)执行生效的基金份额持有人大会的决议;

26)不从事任何有损基金及其他基金合同当事人利益的活动;

27)依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利,为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利,不谋求对上市公司的控股和直接管理;

28)法律法规、基金合同规定的以及中国证监会要求的其他义务。

五、基金管理人承诺

1、本基金管理人承诺严格遵守现行有效的相关法律法规、基金合同和中国证监会的有关规定,建立健全内部控制制度,采取有效措施,防止违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会有关规定的行为发生。

2、本基金管理人的禁止行为:

1)将其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)利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人谋取利益;

4)向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失;

5)法律法规或中国证监会禁止的其他行为。

3、本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)故意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;

7)泄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;

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

9)贬损同行,以抬高自己;

10)以不正当手段谋求业务发展;

11)有悖社会公德,损害证券投资基金人员形象;

12)在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分;

13)其他法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。

4、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;

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、基金管理人的风险管理和内部控制体系

1、风险管理理念与目标

1)确保公法合规经营;

2)防范和化解风险;

3)提高经营效率;

4)保护投资者和股东的合法权益。

2、风险管理措施

1)建立健全公司组织架构;

2)树立监察稽核功能的权威性和独立性;

3)加强内控培训,培养全体员工的风险管理意识和监察文化;

4)制定员工行为规范和纪律程序;

5)建立岗位分离制度;

6)建立危机处理和灾难恢复计划。

3、风险管理和内部控制的原则

1)全面性原则:公司风险管理必须覆盖公司的所有部门和岗位,渗透各项业务过程和业务环节;

2)独立性原则:公司各机构、部门和岗位职责应当保持相对独立,公司基金财产、自有资产、其他资产的运作应当分离;

3)相互制约原则:公司及各部门在内部组织结构的设计上要形成一种相互制约机制,建立不同岗位之间的制衡体系;

4)定性和定量相结合原则:建立完备的风险管理指标体系,使风险管理更具客观性和操作性;

5)防火墙原则:基金财产、公司自有资产、其他资产的运作应当严格分开并独立核算。

4、内部控制体系

1)内部控制的组织架构

①董事会审计与风险控制委员会:负责对公司经营管理和基金投资业务进行合规性控制,并对公司内部稽核审计工作进行审核监督。该委员会主要职责是:审议并批准公司内控制度和政策并检查其实施情况;监督公司内部审计制度的实施;向董事会提名外部审计机构;负责内部审计和外部审计之间的协调;审议公司的关联交易;对公司的风险管理状况及风险管理能力及水平进行评价,提出完善风险管理和内部制度的意见,制定公司日常经营、投资集基金及运用基金资产进行投资的风险控制指标和监督制度,并不定期地对风险控制情况进行检查和监督,为董事会提供评估报告和建议,在例行董事会会议上提出公司上半年度风险控制工作总结报告;监督和指导经理层所设立的风险管理委员会的工作及董事会赋予的其他职责。

②风险管理委员会:是公司日常经营中整体风险控制的决策机构,该委员会是对公司各种风险的识别、防范和控制的非常设机构,负责公司整体运作风险的评估和控制,由总经理、副总经理、督察长、以及其他相关部门负责人或相关人员组成,其主要职责是:评估公司各机构、部门制度本身隐含的风险,以及这些制度在执行过程中显现的问题,并负责审定风险控制政策和策略;审议基金财产风险状况分析报告;基于风险与回报对业务策略提出质疑,需要时指导业务方向;审定公司的业务授权方案;负责协调处理突发性重大事件;负责界定业务风险损失责任人的责任;审议公司各项风险与内控状况的评价报告;需要风险管理委员会审议、决策的其他重大风险管理事项。

③投资决策委员会:是公司投资的最高决策机构,以定期或不定期会议的形式讨论和决定基金投资的重大问题,由公司总经理、分管投资的副总经理、投资总监、投资研究部研究总监、国际投资部负责人等组成。其主要职责包括:依照基金合同、资产管理合同的规定,确立本基金、特定客户资产管理的投资方针及投资方向;审定基金资产、特定客户资产管理的配置方案,包括基金资产、特定客户资产管理在股票、债券、现金之间的配置比例;制定基金、特定客户资产管理投资授权方案;对超出投资负责人权限的投资项目做出决定;考核包括基金经理、投资经理在内的投资团队的工作绩效;需要投资决策委员会决定的其它重大投资事项。

④督察长:督察长制度是基金管理人特有的制度。督察长负责组织指导公司的监察稽核工作;可列席公司任何会议,调阅公司任何档案材料,对基金运作、内部管理、制度执行及遵规守法情况进行内部监察、稽核,每月独立出具稽核报告,报送中国证监会和董事长。

⑤法律、监察稽核部:公司设立法律、监察稽核部,开展公司的监察稽核工作,并保证其工作的独立性和权威性,充分发挥其职能作用。法律、监察稽核部有权对公司各类规章制度及内部风险控制制度的完备性、合理性、有效性进行检查并提出相应意见和建议,并将意见和建议上报公司总经理、督察长和风险管理委员会进行讨论。法律、监察稽核部协助组织对全公司员工进行相关法律、法规、规章制度培训,回答公司各部门提出的法律咨询,并对公司出现的法律纠纷提出解决方案,同时组织各部门对公司管理上存在的风险隐患或出现的风险问题进行讨论、研究,提出解决方案,提交风险管理委员会、投资决策委员会或总经理办公会等进行审核、讨论,并监督整改。

2)内部控制的原则

公司的内部控制遵循以下原则:

①健全性原则:内部控制应当包括公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员,并涵盖到决策、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,建立合理的内控程序,维护内控制度的有效执行;

③独立性原则:公司设立独立的法律、监察稽核部,法律、监察稽核部保持高度的独立性和权威性,负责对公司各部门风险控制工作进行稽核和检查;

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。

公司制订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:内部控制制度涵盖公司管理的各个环节,不得留有制度上的空白或漏洞;

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。

3)内部风险控制措施

建立科学合理、控制严密、运行高效的内部控制体系和完善的内部控制制度。公司成立以来,根据中国证监会的要求,借鉴外方股东的经验,建立了科学合理的层次分明的内控组织架构、控制程序和控制措施以及控制职责在内的运行高效、严密的内部控制体系。通过不断地对内部控制制度进行修改,公司已初步形成了较为完善的内部控制制度。

建立健全了管理制度和业务规章。公司建立了包括风险管理制度、投资管理制度、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、公司财务制度等基本管理制度以及包括岗位设置、岗位职责、操作流程手册在内的业务流程、规章等,从基本管理制度和业务流程上进行风险控制。

建立了岗位分离、相互制衡的内控机制。公司在岗位设置上采取了严格的分离制度,实现了基金投资与交易、交易与清算、公司会计与基金会计等业务岗位的分离制度,形成了不同岗位之间的相互制衡机制,从岗位设置上减少和防范操作及挪用风险。

建立健全了岗位责任制。公司通过建立健全了岗位责任制使每位员工都能明确自己的岗位职责和风险管理责任。

构建了风险管理系统。公司通过建立风险评估、预警、报告和控制以及监督程序,并经过适当的控制流程,定期或实时对风险进行评估、预警、监督,从而确认、评估和预警与公司管理及基金运作有关的风险,通过策略的报告渠道,对风险问题进行层层监督、管理、控制,使部门和管理层及时把握风险状况并快速做出风险控制决策。建立自动化监督控制系统:公司启用了电子化投资、交易系统,对投资比例进行限制,在“股票黑名单”、交叉交易以及防范操守风险等方面进行电子化自动控制,将有效地防止合规性运作风险和操守风险。

使用数量化的风险管理手段。采用数量化、技术化的风险控制手段,建立数量化的风险管理模型,用以提示指数趋势、行业及个股的风险,以便公司及时采取有效的措施,对风险进行分散、规避和控制,尽可能减少损失。

提供足够的培训。制定了完整的培训计划,为所有员工提供足够和适当的培训,使员工具有较高的职业水准,从培养职业化专业理财队伍角度控制职业化问题带来的风险。

5、基金管理人关于内部合规控制声明书

本公司承诺以上关于内部控制的披露真实、准确;

本公司承诺根据市场变化和公司发展不断完善内部控制体系和内部控制制度。

十一、境外投资顾问

一、境外投资顾问基本情况

名称:景顺投资管理有限公司(Invesco Hong Kong Limited)

注册地址:香港皇后大道东一号太古广场三座三十二楼

成立时间:1972年10月17日

境外监管机关批准/注册号:香港证券及期货事务监察委员会注册号AAJ770

最近会计年度资产管理规模:140.51亿美元

联系人:罗德城

电话:(852)3128-6677

传真:(852)3128-6638

电子邮件:Andrew_Lo@hkg.invesco.com

公司网址:www.invesco.com.hk

二、境外投资顾问的职责

1)提供资产配置建议;

2)提供模拟投资组合;

3)提供微观与宏观分析方面的必要协助;

4)向基金管理人提供投资管理、交易、绩效与风险分析方面的必要培训。

十二、基金费用与税收

一、与基金运作有关的费用

(一)基金费用的种类

1、基金的管理费,含境外投资顾问收取的费用;

2、基金的托管费,含境外托管人收取的费用;

3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;

4、基金的证券交易费用及在境外市场的交易、清算、登记等实际发生的费用;

5、基金份额持有人大会费用;

6、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和其他为基金利益而产生的中介机构费用;

7、基金的银行汇划费用;

8、外汇兑换交易的相关费用;

9、与基金缴纳税收有关的手续费、汇款费、税务代理费等;

10、经生效的司法文书判决或裁定明确应由基金财产承担的与基金有关的诉讼、追索费用;

11、在中国证监会规定允许的前提下,本基金可以从基金财产中计提销售服务费,具体计提方法、计提标准在招募说明书或相关公告中载明;

12、按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金终止清算时所发生费用,按实际支出额从基金财产总值中扣除。

(二)基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值1.8%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.8%÷当年天数

H为每日应计提的基金的管理费

E为前一日的基金资产净值

基金的管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

2、基金的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.35%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.35%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

上述“(一)基金费用的种类”中第3-12项费用,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

二、与基金销售有关的费用

1)认购费率

投资者认购需缴纳认购费用,认购费率以有效认购申请确认金额为基数采用比例费率。费率表如下:

认购金额(M)	认购费率
M<100万	1.50%
100万≤M<500万	1.00%
M≥500万	按笔收取,1000元/笔

2)计算公式

本基金认购份额的计算如下:

净认购金额 = 认购金额/(1+认购费率);

认购费用 = 认购金额-净认购金额;

认购份额 = (净认购金额+认购利息)/基金份额发售面值。

基金认购份额计算结果保留到小数点后两位,小数点后两位以后的部分四舍五入,由此误差产生的损失由基金财产承担,产生的收益归基金财产所有。

3、赎回费

(1)赎回费率

本基金的赎回费用在投资人赎回本基金份额时收取,扣除用于市场推广、注册登记费和其他手续费后的余额归基金财产。本基金赎回费的25%归入基金财产所有。

本基金的赎回费率不高于0.5%,随持有期限的增加而递减。

持有期	赎回费率
1年以内	0.5%
1年以上(含)-2年	0.25%
2年以上(含)	0

注:赎回费而言,1年指365天,2年指730天。

2)计算公式

本基金采用“份额赎回”方式,赎回价格以T日的基金份额净值为基准进行计算,本基金赎回金额的计算如下:

赎回总金额=赎回份额×T日基金份额净值;

赎回费用=赎回总金额×赎回费率;

净赎回金额=赎回总金额-赎回费用。

赎回金额为按实际确认的有效赎回份额以当日基金份额净值为基准并扣除相应的费用,赎回金额计算结果保留到小数点后2位,小数点后两位以后的部分四舍五入,由此产生的误差计入基金财产。

三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;

3、《基金合同》生效前的相关费用,包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用;

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

四、费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后,可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率等相关费率。

调高基金管理费率和基金托管费率,须召开基金份额持有人大会审议,除非基金合同、相关法律法规或监管机构另有规定;调低基金管理费率和基金托管费率,无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日前2日在至少一种指定媒体公告。

五、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按各个国家税收法律、法规执行。

十三、基金托管人

一、基金托管人的基本情况

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349,018,545.827元

联系电话:010-66105799

联系人:赵会军

二、主要人员情况

截至2011年12月末,中国工商银行资产托管部共有员工145人,平均年龄30岁,95%以上员工拥有大学本科以上学历,高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

三、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业客户提供安全、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最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、安心账户资金、企业年金基金、QFII资产、QDII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2011年12月,中国工商银行共托管证券投资基金231只,其中封闭式7只,开放式224只。自2003年以来,本行连续八年获得香港《亚洲货币》、英国《euromoney》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的28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持续认可和广泛好评。

四、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。继2005、2007、2009年三次顺利通过评估组织内部控制和安全措施是否充分的最权威的SAS70《审计标准第70号》审阅后,2010年中国工商银行资产托管部第四次通过SAS70审阅获得无保留意见的控制及有效性报告,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,SAS70审阅已经成为年度化、常规化的内控工作手段。

(一)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。

(二