易方达中小板指数分级证券投资基金招募说明书

基金管理人：易方达基金管理有限公司
基金托管人：中国建设银行股份有限公司
二〇一二年八月

重要提示

1.本基金根据2012年5月22日中国证券监督管理委员会《关于核准易方达中小板指数分级证券投资基金募集的批复》（证监许可［2012］680号）和2012年7月31日《关于易方达中小板指数分级证券投资基金募集时间安排的确认函》（基金部函［2012］672号）的核准，进行募集。

2.基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。

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，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

3.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。

4.本基金为设有7年分级运作期的开放式基金：分级运作期内，本基金采取分级方式进行运作，即易方达中小板指数分级证券投资基金之基础份额（易基中小板份额，场内简称“易基中小”）、易方达中小板指数分级证券投资基金之稳健收益类份额（易基中小板A类份额，场内简称“易基稳健”）及易方达中小板指数分级证券投资基金之进取收益类份额（易基中小板B类份额，场内简称“易基进取”）等三类份额共同运作。其中，易基中小板A类份额、易基中小板B类份额的基金份额比例始终保持1:1的比例不变；分级运作期届满或提前结束后，本基金自动转换为上市开放式基金（LOF），基金名称将变更为“易方达中小板指数证券投资基金（LOF）”，基金份额仅包括易方达中小板指数证券投资基金之场内基金份额与场外基金份额（易基中小板份额”）。

在基金募集期内，本基金场外认购首次单笔认购的最低金额及追加认购的单笔认购最低金额均为人民币50,000元（含认购费）。本基金通过具有基金销售资格的深圳证券交易所会员单位进行场内认购的单笔最低认购份额为50,000份，超过50,000份的须为1,000份的整数倍，且单笔认购最高不得超过99,999,000份。

在本基金分级运作期内，易基中小板份额首次申购（包括场外申购和场内申购）的单笔最低金额及追加申购的单笔最低金额均为人民币50,000元。本基金自动转换为上市开放式基金（LOF）后，场外申购时，投资者通过代销网点或本公司网上交易系统首次申购的单笔最低金额为1,000元人民币，通过本公司直销中心首次申购的单笔最低金额为50,000元人民币，追加申购单笔最低金额均为1,000元人民币。场内申购时，单笔申购金额最低为1,000元人民币（以上金额均含申购费）。

本基金投资于证券、期货市场，基金净值会因为证券、期货市场波动等因素而产生波动，投资有风险，投资者在投资本基金前，敬请认真阅读本招募说明书，全面认识本基金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，亦承担基金投资中出现的各类风险。

投资本基金可能遇到的风险主要包括：因政治、经济、投资者心理与交易制度等各种因素对证券价格产生影响而形成的市场风险；基金管理人在基金管理实施过程中产生的管理风险；因基金份额持有人大量赎回或市场基跌导致的流动性风险；因本基金设有分级运作期限且投资于股指期货而引致的特定风险；以及其他意外因素导致的风险等。其中，本基特定风险包括：（1）与本基金指数化投资方式相关的特定风险，如本基金为保持与业绩比较基准一致的风险收益特征而在不能系统性风险；本基金对于无法获取足额数量的股票寻找投资替代品而潜在的投资替代风险；因业绩比较基准变更或投资组合调整导致的标的指数变更风险；以及因基金业绩表现与业绩比较基准产生差异而导致的跟踪偏差风险等；（2）与本基金运作方式相关的特定风险。如与本基分级运作期内易基中小板A类份额与易基中小板B类份额上市交易或分级运作期结束后易基中小板份额上市交易相关的流动性风险、折溢价风险；与本基金分级运作期内易基中小板B类份额基金份额参考净值计算规则相关的杠杆风险、与易基中小板A类份额约定收益支付方式相关的风险、易基中小板A类份额与易基中小板B类份额的本金风险及因基金份额折算导致基金份额风险收益特征变化风险；因基金份额折算业务过程中折算方式、折算业务处理规则等导致的份额折算风险；以及本基金分级运作期内份额配对转换业务相关的操作风险等；（3）与本基金投资于股指期货相关的特定风险。如因股指期货合约与标的指数波动不一致导致的基差风险以及股指期货合约之间价差异常变动可能导致的展期风险；因股指期货交易采取保证金制度且盯市结算可能导致的盯市结算风险；因所选择的期货经纪商破产清算或违规经营导致的第三方风险等。本基金属于证券投资基金中高预期风险、高预期收益品种。长期而言，其风险收益水平高于混合基金、债券基金和货币市场基金。

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引致的投资风险，由投资者自行负责。

5.基金的过往业绩并不预示其未来表现。

一、绪 言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作办法》）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第5号《招募说明书的内容与格式》》等有关法律法规以及《易方达中小板指数分级证券投资基金基金合同》编写。

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。基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人，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

本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语有如下含义：

基金或本基金：	分级运作期内，指易方达中小板指数分级证券投资基金；分级运作期届满或提前结束，基金运作方式自动转换后，指易方达中小板指数证券投资基金（LOF）
易方达中小板指数证券投资基金（LOF）：	指易方达中小板指数分级证券投资基金分级运作期届满或提前结束后，自动转换成的上市开放式基金（LOF）
基金合同：	指《易方达中小板指数分级证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充
招募说明书或本招募说明书：	指《易方达中小板指数分级证券投资基金招募说明书》及其定期更新
基金份额发售公告：	指《易方达中小板指数分级证券投资基金基金份额发售公告》
托管协议：	指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《易方达中小板指数分级证券投资基金托管协议》及该托管协议的任何有效修订和补充
中国证监会：	指中国证券监督管理委员会
银行业监督管理机构：	指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会
《基金法》：	指2003年10月28日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过的自2004年6月1日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
《销售办法》：	指中国证监会2011年6月9日颁布、同年10月1日起实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机构对其不时做出的修订
《运作办法》：	指中国证监会于2004年6月29日颁布，同年7月1日起实施的《证券投资基金运作管理办法》及颁布机构对其不时做出的修订
《信息披露办法》：	指中国证监会2004年6月8日颁布，同年7月1日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机构对其不时作出的修订
基金管理人：	指易方达基金管理有限公司
基金托管人：	指中国建设银行股份有限公司
登记结算业务：	指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资者基金账户的建立和管理、基金份额注册登记、基金交易的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等
登记结算机构：	指办理登记结算业务的机构。本基金的登记结算机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金管理人也可以自行或委托其他机构担任登记结算机构
投资者、基金投资者：	指符合法律法规规定的个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者的合称
个人投资者：	指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人
机构投资者：	指依法可以投资于证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法注册登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织
合格境外机构投资者：	指符合现实有效的相关法律法规规定可以投资于中国境内证券市场的中国境外的机构投资者
基金合同当事人：	指受基金合同约束，根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人
基金份额持有人：	指依基金合同和招募说明书合法取得本基金基金份额的投资者
年度对应日：	指递增年份的同月同日，如2011年9月11日的年度对应日为2011年以后每一年的9月11日
基金募集期：	指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不超过3个月
基金合同生效日：	指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期
存续期：	指基金合同生效至终止之间的不定期期限
分级运作期：	指本基金采取分级运作方式的运作期间，本基金基金合同生效日后7年内（含7年）为分级运作期，但分级运作期可能提前结束
分级运作期限：	7年
分级运作周年：	指本基金基金合同生效日相邻两个年度对应日之间的运作期间。第1个分级运作周年指本基金基金合同生效日第1-1个年度对应日（含该日）至基金合同生效日第1个年度对应日（不含该日）之间的运作期间；其中i=1,2,3,4,5,6,7。基金合同生效日的第0个年度对应日即基金合同生效日
日/天：	指公历日
月：	指公历月
工作日、交易日：	指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日
《业务规则》：	指易方达基金管理有限公司、深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司及代销机构的相关业务规则
场外：	指不通过深圳证券交易所交易系统而通过自身的柜台或者其他交易系统办理基金份额认购、申购和赎回基金的基金销售机构和场所
场内：	指通过深圳证券交易所会员单位和深圳证券交易所交易系统办理基金份额认购、申购、赎回和上市交易业务的场所
注册登记系统：	中国证券登记结算有限责任公司开放式基金注册登记系统，通过场外销售机构认购、申购的基金份额登记在本系统
证券登记结算系统：	中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记结算系统，通过场内会员单位认购、申购或买入的基金份额登记在本系统
上市交易：	指本基金分级运作期内，投资者通过场内会员单位以集中竞价的方式买卖易基中小板A类份额、易基中小板B类份额的行为；以及分级运作期届满或提前结束，本基金自动转换为上市开放式基金（LOF）后，投资者通过场内会员单位以集中竞价的方式买卖易基中小板份额的行为
《上市交易公告书》	本基金分级运作期内，指《易方达中小板指数分级证券投资基金之易基中小板A类份额和易基中小板B类份额上市交易公告书》；本基金分级运作期届满或提前结束，自动转换为上市开放式基金（LOF）后，指《易方达中小板指数证券投资基金（LOF）上市交易公告书》
认购：	指在基金募集期内，投资者按照基金合同的规定申请购买本基金易基中小板份额的行为
申购：	指基金合同生效后的存续期内，投资者根据基金合同和招募说明书的规定申请购买本基金易基中小板份额的行为
赎回：	指基金合同生效后的存续期内，基金份额持有人按基金合同规定的条件要求将本基金易基中小板份额兑换为现金的行为
基金转换：	指基金份额持有人按基金管理人规定的条件，申请将其持有的基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金的基金份额的行为
系统内转托管：	基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（交易单元）之间进行转登记的行为
跨系统转托管：	基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统间进行转登记的行为
定期定额投资计划：	指投资者通过有关销售机构提出申请，约定每期申购日、申购金额及申购方式，由销售机构于每期约定申购日在投资者指定银行账户内自动完成扣款及受理基金申购申请的一种投资方式
自动分离：	指本基金发售结束后，投资者在场内认购的每2份易基中小板份额在发售结束后按1:1比例自动转换为1份易基中小板A类份额和1份易基中小板B类份额
配对转换：	指本基金分级运作期内，易基中小板份额与易基中小板A类份额、易基中小板B类份额之间按约定的转换规则进行转换的行为，包括分拆和合并
分拆：	指本基金分级运作期内，根据基金合同的约定，基金份额持有人申请将其持有的每2份易基中小板份额的场内份额按1:1的比例转换为1份易基中小板A类份额与1份易基中小板B类份额的行为
合并：	指本基金分级运作期内，根据基金合同的约定，基金份额持有人将其持有的每1份易基中小板A类份额与每1份易基中小板B类份额申请按照1:1的比例转换成2份易基中小板份额的场内份额的行为
易基中小板份额：	分级运作期内，指本基金的基础份额；分级运作期届满或提前结束，本基金自动转换为上市开放式基金（LOF）后，指易方达中小板指数证券投资基金（LOF）之基金份额。分级运作期内，投资者在场外认购、申购的易基中小板份额不进行基金份额分拆；投资者在场内认购的易基中小板份额，可选择进行基金份额分拆，也可选择不进行基金份额分拆；分级运作期届满或提前结束，本基金自动转换为上市开放式基金（LOF）后，投资者在场外或场内申购的易基中小板份额均不可进行基金份额分拆
易基中小板A类份额：	本基金分级运作期内，易基中小板份额按基金合同约定规则所自动分离或选择分拆的稳健收益类基金份额
易基中小板B类份额：	本基金分级运作期内，易基中小板份额按基金合同约定规则所自动分离或选择分拆的进取收益类基金份额
易基中小板A类份额的本金：	除非基金合同又意另有所指，对于每份易基中小板A类份额而言，指1.0000元
易基中小板A类份额约定年基准收益率：	易基中小板A类份额约定年基准收益率为固定利率7%，但基金管理人并不承诺或保证易基中小板A类份额持有人的该等收益，易基中小板A类份额的基金份额持有人可能会面临无法取得约定应得收益的风险甚至损失本金的风险
易基中小板A类份额累计约定应得收益：	易基中小板A类份额依据约定年基准收益率及基金合同约定的截至计算日的实际天数计算的累计收益
易基中小板B类份额应得资产及收益：	在每个分级运作周年末，本基金净资产优先分配予易基中小板A类份额的本金及约定应得收益后扣除易基中小板份额所代表的资产净值后的剩余净资产
标的指数：	本基金的标的指数为中小板价格指数
巨额赎回：	分级运作期内，指本基金单个开放日内的易基中小板份额净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一开放日基金总份额的10%；分级运作期届满或提前结束，本基金自动转换为上市开放式基金（LOF）后，指本基金单个开放日内的易基中小板份额（包括易基中小板份额、易基中小板A类份额及易基中小板B类份额）的10%；分级运作期届满或提前结束，本基金自动转换为上市开放式基金（LOF）后，指本基金单个开放日内的易基中小板份额（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一开放日基金总份额的10%
代销机构：	指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并接受基金管理人委托，代为办理基金销售业务的机构
直销机构：	指易方达基金管理有限公司
销售机构：	指直销机构和代销机构
基金销售网点：	指直销机构的直销网点及代销机构的代销网点
基金账户：	指登记结算机构为基金投资者开立的记录其持有的由该登记结算机构办理登记结算业务的基金份额余额及其变动情况的账户
基金交易账户：	指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认购、申购、赎回、转换及转托管等业务而引起的基金份额的变动及结余情况的账户
深圳证券账户：	指投资者在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开立的深圳证券交易所人民币普通股票账户（即A股账户）或证券投资基金账户
开放日：	指为投资者办理基金申购、赎回或其他业务的工作日
交易时间：	指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段
T日：	指销售机构在规定时间受理投资者申购、赎回或其他业务申请的工作日
T+n日：	指T日后（不包括T日）第n个工作日，n指自然数
元：	指人民币元
基金利润：	指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额
基金资产总值：	指基金所持有的各类有价证券、银行存款本息、基金的应收款项和其他投资所形成的价值总和
基金资产净值：	指基金资产总值减去基金负债后的价值
基金份额净值：	指以计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数所得的单位基金份额的价值，分级运作期内，计算日基金份额总数为计算日易基中小板份额、易基中小板A类份额与易基中小板B类份额的份额数之和；分级运作期届满或提前结束后，计算日基金份额总数为计算日易基中小板份额总数
基金份额参考净值：	指分级运作期内，本基金按照基金合同约定的基金份额类别及净值计算规则计算得到的T日本基金每份易基中小板A类份额与每份易基中小板B类份额的份额价值。基金份额参考净值并不代表基金份额持有人可获得的实际价值
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
法律法规：	指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等
指定媒体：	指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网网站及其他媒体
中国：	指中华人民共和国，就本基金招募书而言，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区
不可抗力：	指任何无法预见、无法克服、无法避免的事件和因素。

三、基金管理人

（一）基金管理人基本情况

1.基金管理人：易方达基金管理有限公司

注册地址：广东省珠海市香洲区情侣路428号九洲港大厦4001室

办公地址：广州市体育西路189号城建大厦25-28楼

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字［2001］4号

法定代表人：叶俊英

设立日期：2001年4月17日

组织形式：有限责任公司

注册资本：12,000万元人民币

存续期限：持续经营

联系人：陈晓梅

联系电话：400 881 8088

2.股权结构：

股东名称	出资比例
广东粤财信托有限公司	1/4
广发证券股份有限公司	1/4
盐峰投资控股集团有限公司	1/4
广东省广晟资产经营有限公司	1/6
广州市广永国有资产经营有限公司	1/12
总 计	100%

（二）主要人员情况

1.董事、监事及高级管理人员

叶俊英先生，经济学博士，董事长。曾任中国南海石油联合服务总公司条法部科员、副科长、科长，广东省烟草专卖局专卖办公室干部，广发证券有限责任公司投资银行部总经理、公司董事、副总裁，易方达基金管理有限公司董事兼总裁、副董事长兼总裁。现任易方达基金管理有限公司董事、总裁。

刘晓艳女士，经济学博士，董事、总裁。曾任广发证券有限责任公司投资理财部副经理、基金经理，基金投资理财部副总经理、基金管理部副总经理，易方达基金管理有限公司人力资源部副总经理、总裁助理兼市场部总经理、公司副总裁、常务副总裁。现任易方达基金管理有限公司董事、总裁，兼任易方达资产管理（香港）有限公司董事长。

泰力先生，经济学博士，董事。曾任广发证券投资银行部常务副总经理、投资理财部总经理、资金营运部总经理、规划管理部总经理、投资自营部总经理、公司总经理助理、副总经理。现任广发证券股份有限公司董事、常务副总经理，兼任广发信德投资管理有限公司董事长、广发控股（香港）有限公司董事。

郑斌先生，经济学硕士，董事。曾任广东粤财信托投资公司计划资金部副经理、广东粤财信托投资有限公司信托管理一部总经理、广东粤财信托有限公司副总经理、广东粤财投资控股有限公司副总经理助理。现任广东粤财投资控股有限公司副总经理，兼任广东粤财信托有限公司总经理。

杨万先生，EMBA，董事。曾任美的集团空调事业部技术主管、金划经理，佛山顺德百年科技有限公司行政总监，美的空调深圳营销中心区域经理，佛山顺德创佳电器有限公司董事、副总经理，长虹空调广州营销中心营销总监，广东新雅家具股份有限公司战略总监、董事、副总裁。现任盛峰投资控股集团有限公司董事、首席战略官。

谢亮先生，EMBA，董事。曾任53011、53061部队财务部门助理员，广州军区生产管理部财务部门助理员、处长，广东省广晟资产经营有限公司总经理助理兼计划财务部部长。现任广东省广晟资产经营有限公司副总经理。

谢石松先生，法学博士，独立董事。现任中山大学法学院教授、国际法研究所所长。兼任中国国际私法学会副会长，武汉大学法学院、西北政法大学兼职教授，中国国际经济贸易仲裁委员会仲裁员及专家咨询委员会成员，上海、广州、深圳、厦门、珠海、佛山、肇庆、惠州等仲裁委员会仲裁员。

王化成先生，经济学博士，独立董事。曾任中国人民大学商学院助教、讲师、副教授。现任中国人民大学商学院教授、博士生导师。

何小锋先生，经济学硕士，独立董事。曾任广东省韶关市教育局干部、中共广东省韶关市委宣传部干部、北京大学经济学院讲师、副教授、金融系主任兼教授及博士生导师。现任北京大学经济学院教授、博士生导师。

陈国祥先生，经济学硕士，监事会主席。曾任交通银行广州分行江南西营业部经理，广东粤财信托投资公司证券部副总经理、基金部总经理，易方达基金管理有限公司总裁助理兼市场拓展部总经理、市场总监。现任易方达基金管理有限公司监事会主席。

李航金先生，经济学硕士，监事。曾任华南师范大学外语系党总支书记、中国证监会广州证管办处长。现任广州国际控股集团有限公司副总经理、广州市广永国有资产经营有限公司党支部书记、董事长兼总裁，力联证券有限责任公司董事长（兼）、广州银行副董事长（兼）。

廖智先生，经济学硕士，监事。曾任广东证券股份有限公司基金部主管、易方达基金管理有限公司综合管理部副总经理、易方达基金管理有限公司人力资源部副总经理。现任易方达基金管理有限公司市场部总经理。

张优造先生，MBA，常务副总裁。曾任南方证券交易中心发展部经理，广东证券公司发行上市部经理、深圳证券业务部总经理、基金部总经理，易方达基金管理有限公司董事兼副总裁。现任易方达基金管理有限公司常务副总裁，兼任易方达资产管理（香港）有限公司董事。

肖俊先生，经济学硕士，副总裁。曾任广东粤财信托投资公司职员，香港安财投资有限公司财务部经理，粤信（香港）投资有限公司业务部副经理，广东粤财信托投资公司基金部经理，易方达基金管理有限公司投资管理部常务副总经理、研究部总经理兼任基金投资部总经理、总裁助理兼任基金投资部总经理、总裁助理兼任基金投资总监及基金投资部总经理、总裁助理兼任基金投资总监、基金首席投资官、基金科翔基金经理、基金科瑞基金经理、基金科汇基金经理、易方达积极成长基金基金经理、机构理财部投资经理。现任易方达基金管理有限公司副总裁。

陈彤先生，经济学博士，副总裁。曾任中国经济开发信托投资公司成都营业部研发部副经理、交易部经理、研发部经理、证券总部研究部行业研究员，易方达基金管理有限公司市场拓展部主管、基金科瑞基金经理、市场部华东区大区销售经理、市场部总经理助理华东区大区销售经理及南京分公司总经理、上海分公司总经理兼南京分公司及成都分公司总经理、总裁助理兼上海分公司和南京分公司以及成都分公司的总经理、市场总监兼上海分公司和南京分公司以及成都分公司的总经理。现任易方达基金管理有限公司副总裁。

张南女士，经济学博士，督察长。曾任广东省经济贸易委员会主任科员、副处长，易方达基金管理有限公司市场拓展部副总经理，督察长兼监察部总经理。现任易方达基金管理有限公司督察长。

2.基金经理

王建军先生，经济学博士，曾任汇添富基金管理有限公司数量分析师、易方达基金管理有限公司量化研究员、基金经理助理。现任易方达深证100交易型开放式指数基金基金经理（自2010年9月27日起）、易方达深证100交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自2010年9月27日起）、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自2011年9月20日起）、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（自2011年9月20日起）。

3.境内投资决策委员会成员

本公司境内投资决策委员会成员包括：刘晓艳女士、肖俊先生、陈志民先生、马骏先生、刘震先生。

刘晓艳女士，同上。

肖俊先生，同上。

陈志民先生，同上。

马骏先生，高级管理人员工商管理硕士（EMBA）。曾任君安证券有限公司营业部职员、深圳众大投资有限公司投资部副总经理，广发证券有限责任公司研究员，易方达基金管理有限公司固定收益部总经理、固定收益投资总监、总裁助理、总裁助理、基金科讯基金经理、易方达50指数基金基金经理、易方达深证100ETF基金基金经理。现任易方达基金管理有限公司固定收益首席投资官兼任易方达资产管理（香港）有限公司人民币合格境外投资者（RQFII）业务负责人。

刘震先生，理学硕士。曾任D.E.Shaw &Co机构部副总裁，加拿大皇家银行多美年证券公司（RBC Dominion Securities）股权衍生产品部副总裁，HorizonLive.com高级副总裁，美国银行证券公司（Banc of America Securities）机构部总监，Sycamore Hill Capital Management高级量化策略师，瑞银投资银行（UBS Investment Bank）自营部执行董事兼任交易员，布莱文崔华德美国资产管理公司（Brevan Howard Asset Management）量化投资总监兼任交易员，北京红色天时金融科技有限公司（The Red Capital, LLC）执行合伙人，易方达基金管理有限公司指数与量化投资部总经理、投资经理。现任易方达量化衍伸股票型证券投资基金基金经理。

4.上述人员之间均不存在近亲属关系。

（三）基金管理人的职责

1. 依法募集基金，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、转换和登记事宜；
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、半年度和年度基金报告；
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. 中国证监会规定的其他职责。

（四）基金管理人的承诺

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、基金合同和中国证监会有关规定的行为发生。

2. 本基金管理人承诺严格遵守《证券法》、《基金法》及有关法律法规，建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止下列行为发生：

（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）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；
（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）根据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、商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。

5. 基金管理人的内部控制制度

（1）基金管理人的内部控制目标

为保证公司规范化运作，有效地防范和化解经营风险，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，本基金管理人建立了科学、严密、高效的内部控制体系。

1. 公司内部控制的总体目标

（1）保证公司经营管理活动的合法合规性；
（2）保证基金份额持有人的合法权益不受侵犯；
（3）实现公司稳健、持续发展，维护股东权益；
（4）促进公司全体员工恪守职业操守，正直诚信，廉洁自律，勤勉尽责；
（5）保护公司最重要的资本：公司声誉。

2. 公司内部控制遵循的原则

（1）全面性原则：内部控制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，并普遍适用于公司每一位职员；

（2）审慎性原则：内部控制的核心是有效防范各种风险，公司组织体系的构成、内部管理制度的建立都要以防范风险、审慎经营为出发点；

（3）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；

（4）独立性原则：公司根据业务的需要设立相对独立的机构、部门和岗位；公司内部部门和岗位的设置必须权责分明；

（5）有效性原则：各种内部管理制度具有高度的权威性，应是所有员工严格遵守的行动指南；执行内部管理制度不能有任何例外，任何人不得拥有超越制度或违反规章的权力；

（6）适时性原则：内部控制应具有前瞻性，并且必须随着公司经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律法规、政策制度等外部环境的改变及时进行相应的修改和完善；

（7）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，力争以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

3. 内部控制的制度体系

公司制定了合理、完备、有效并易于执行的制度体系。公司制度体系由不同层面的制度构成。按照其效力大小分为四个层面：第一个层面是公司章程；第二个层面是公司内部控制大纲，它是公司制定各项规章制度的基础和依据；第三个层面是公司基本管理制度；第四个层面是公司各机构、部门根据业务需要制定的各种制度及实施细则等。它们的制订、修改、实施、废止应该遵循相应的程序，每一层面的内容不得与其以上层面的内容相违背。公司重视制度的持续检验，结合业务的发展、法规及监管环境的变化以及公司风险控制的要求，不断检讨和增强公司制度的完备性、有效性。

4. 关于授权、研究、投资、交易等方面的控制点

（1）授权制度

公司的授权制度贯穿于整个公司活动。股东会、董事会、监事会和管理层必须充分履行各自的职权，健全公司逐级授权制度，确保公司各项规章制度的贯彻执行；各项经济经营业务和管理程序必须遵从管理层制定的操作规程，经办人员的每一项工作必须在业务授权范围内进行。公司重大业务的授权必须采取书面形式，授权书应当明确授权内容和时效。公司授权要适当，对已获授权的部门和人员应建立有效的评价和反馈机制，对已不适用的授权应及时修改或取消授权。

（2）公司研究业务

研究工作应保持独立、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；建立投资产品备选库制度，研究部门根据投资产品的特征，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，保持畅通的交流渠道；建立研究报告质量评价体系，不断提高研究水平。

（3）基金投资业务

基金投资应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；在进行投资时应有明确的投资权限制度，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，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。

（4）交易业务

建立集中交易室和集中交易制度，投资指令通过集中交易室完成；应建立交易监测系统、预警系统和交易反馈系统，完善相关的安全设施；集中交易室应对交易指令进行审核，建立公平的交易分配制度，确保各基金利益的公平；交易记录应完善，并及时进行反馈、核对和存档保管；同时应建立科学的投资交易绩效评价体系。

（5）基金会计核算

公司根据会计法律及业务的要求建立会计制度，并根据风险控制点建立严密的会计系统，对于不同基金、不同客户独立建账，独立核算；公司通过复核制度、凭证制度、合理的估值方法和估值程序等会计措施真实、完整、及时地记载每一笔业务并正确进行会计核算和业务核算。同时还建立会计档案保管制度，确保档案真实完整。

（6）信息披露

公司建立了完善的信息披露制度，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、审核和发布工作，以此加强对信息的审查和管理，使所公布的信息合法律法规的规定，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）监察稽核

公司设立督察长，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进行检查、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。

公司设立监察部开展监察稽核工作，并保证监察部的独立性和权威性。公司明确了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、操作程序和组织纪律。

监察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，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，追究有关部门和人员的责任。

5. 基金管理人关于内部控制制度的声明书

（1）本公司承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确；

（2）本公司承诺根据市场变化及公司业务发展不断完善内部控制制度。

四、基金托管人

（一）基金托管人情况

1. 基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司（简称“中国建设银行”）

住所：北京市西城区金融大街25号

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号

法定代表人：王洪章

成立日期：2004年9月17日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元人民币

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字［1998］12号

存续期间：持续经营

联系人：尹 东

联系电话：010-6759 5003

发展概况：

中国建设银行股份有限公司拥有悠久的经营历史，其前身“中国人民建设银行”于1954年成立，1996年易名为“中国建设银行”。中国建设银行是中国四大商业银行之一。中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于2004年9月分立而成立，承继了原中国建设银行的商业银行业务及相关的资产和负债。中国建设银行（股票代码：939）于2005年10月27日在香港联合交易所主板上