# 易方达沪深300医药卫生交易型开放式指数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**
**二零一三年八月**
**重要提示**

本基金根据2013年7月3日中国证券监督管理委员会《关于核准易方达沪深300医药卫生交易型开放式指数证券投资基金募集的批复》(证监许可[2013]862号)和2013年8月13日《关于易方达沪深300医药卫生交易型开放式指数证券投资基金募集时间安排的确认函》(基金部函[2013]710号)核准,进行募集。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。

证券投资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。本基金属股票型基金,其风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金在股票型基金中属于指数型基金,主要采用完全复制法紧密跟踪标的指数的表现,本基金的业绩表现与沪深300医药卫生指数的表现密切相关。

证券投资基金分为股票基金、混合基金、债券基金、货币市场基金等不同类型,投资人投资不同类型的基金将获得不同的收益预期,也将承担不同程度的风险。一般来说,基金的收益预期越高,投资人承担的风险也越大。

本基金按照基金份额初始面值1.00元发售,在市场波动等因素的影响下,基金份额净值可能低于基金份额初始面值。

因折算、分红等行为导致基金份额净值变化,不会改变基金的风险收益特征,不会降低基金投资风险或提高基金投资收益。本基金以1元初始面值开展基金募集或因折算、分红等行为导致基金份额净值调整至1元初始面值或1元附近,在市场波动等因素的影响下,基金投资仍有可能出现亏损或基金净值仍有可能低于初始面值。

本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动,投资人在投资本基金前,需充分了解本基金的产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,对投资本基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策,并承担基金投资中出现的各类风险,包括市场风险、管理风险、技术风险、本基金特有风险及其他风险等。特有风险包括:指数化投资的风险、标的指数的风险、跟踪偏离度和跟踪误差的风险、基金交易价格与份额净值发生偏离的风险,参考IOPV决策和IOPV计算错误的风险、投资人申购失败的风险、投资人赎回失败的风险、本基金场内外份额申购赎回对价方式不同的风险、基金场内份额赎回对价的变现风险、套利风险、申购赎回清单差错风险、二级市场流动性风险、退市风险、第三方机构服务的风险等。

对于场内申购:投资者申购的基金份额当日可卖出,当日未卖出的基金份额在份额交收成功之前不得卖出和赎回;即在目前结算规则下,T日申购的基金份额当日可卖出,T日申购当日未卖出的基金份额,T+1日不得卖出和赎回,T+1日交收成功后T+2日可卖出和赎回。因此为投资者办理申购业务的代理券商若发生交收违约,将导致投资者不能及时、足额获得申购当日未卖出的基金份额,投资者的利益可能受到影响。

场外申购赎回业务的申购费率、赎回费率可能会根据市场交易佣金水平、印花税率等相关交易成本的变动而调整。投资者在办理场外申购、赎回业务时之前应仔细阅读本基金的招募说明书及基金管理人的相关公告。

投资有风险,投资者认购《或申购》基金时应仔细阅读本基金的招募说明书及基金合同,了解本基金的风险收益特征,并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投资人的风险承受能力相适应。

基金管理人承诺以恪尽职守、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。当投资人赎回时,所得可能会高于或低于投资人先前所支付的金额。本基金的过往业绩及其净值高低并不预示未来业绩表现。基金管理人所管理的其他基金的业绩并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。

## 一、绪言

《易方达沪深300医药卫生交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》(以下简称“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》”)及其他有关法律法规以及《易方达沪深300医药卫生交易型开放式指数证券投资基金合同》(以下简称基金合同、本基金合同)编写。

本招募说明书阐述了易方达沪深300医药卫生交易型开放式指数证券投资基金的投资目标、策略、风险、费率等主要投资人投资决策有关的全部必要事项,投资人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。本招募说明书由易方达基金管理有限公司编释。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合同当事人之间权利、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基金合同当事人,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。基金份额持有人作为基金合同当事人并不以在基金合同上书面签章为必要条件。基金合同与当事人应按照《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。

## 二、释义

在本招募说明书中,除非文意另有所指,下列词语或简称具有如下含义:

1.基金或本基金:指易方达沪深300医药卫生交易型开放式指数证券投资基金
2.基金管理人:指易方达基金管理有限公司
3.基金托管人:指中国建设银行股份有限公司
4.基金合同:指《易方达沪深300医药卫生交易型开放式指数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
5.托管协议:指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《易方达沪深300医药卫生交易型开放式指数证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
6.招募说明书;指《易方达沪深300医药卫生交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》及其定期的更新
7.基金份额发售公告;指《易方达沪深300医药卫生交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告》
8.基金份额上市交易公告书;指《易方达沪深300医药卫生交易型开放式指数证券投资基金基金份额上市交易公告书》
9.交易型开放式指数证券投资基金;指《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》定义的交易型开放式指数基金(简称ETF[Exchange Traded Fund])
10.标的指数;指沪深300医药卫生指数及其未来可能发生的变更
11.ETF联接基金:指将绝大多数基金财产投资于本基金,与本基金的投资目标类似,采用开放式运作方式的基金。在不违反法律法规及不损害基金份额持有人利益的前提下,基金管理人可根据基金发展需要,募集并管理以本基金为目标ETF的其他一只或多只联接基金
12.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、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等
13.《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,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
14.《销售办法》;指中国证监会2011年6月9日颁布、同年10月1日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
15.《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》及颁布机关对其不时做出的修订
16.《运作办法》;指中国证监会2004年6月29日颁布、同年7月1日实施的《证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
17.中国证监会;指中国证券监督管理委员会
18.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
19.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
20.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
21.机构投资者;指依法可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法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
22.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》及相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法发行的证券投资基金的中国境外的机构投资者
23.投资人;指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及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人的合称
24.基金份额持有人;指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人
25.基金销售业务;指基金管理人或销售机构宣传推介基金,发售基金份额,办理基金份额的申购、赎回、转换、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务。
26.销售机构;指直销机构和代销机构
27.直销机构;指易方达基金管理有限公司
28.代销机构;指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件,取得基金代销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,包括发售代理机构、办理本基金场外申购赎回的销售机构和办理场内申购赎回业务的申购赎回代理券商
29.发售代理机构;指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件,由基金管理人指定的、在募集期间代理本基金发售业务的机构
30.申购赎回代理券商;指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件,由基金管理人指定的、在《基金合同》生效后代理办理本基金场内申购、赎回业务的证券公司、又称为代办证券公司
31.登记结算业务;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
32.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是中国证券登记结算有限责任公司(简称“中国结算”,网站:www.chinaclear.cn,以下简称“中国结算”)。其中,本基金认购份额的登记结算由中国结算负责办理;本基金份额在上海证券交易所场内上市交易以及申购、赎回等相关业务的登记结算由中国结算负责办理;本基金的场外申购、赎回等相关业务的登记结算由易方达基金管理有限公司负责办理
33.基金账户;指登记结算机构为投资人开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户
34.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
35.基金合同终止日;指基金合同规定的基金合同终止事由出现后,基金财产清算完毕,清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期
36.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,最长不得超过3个月
37.存续期;指基金合同生效至终止之间的不定期期限
38.日、天;指公历日
39.月;指公历月
40.工作日;指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日
41.T日;指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的开放日
42.T+n日;指自T日起第n个工作日(不包含T日),n为自然数
43.开放日;指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日
44.开放时间;指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段
45.认购;指在基金募集期内,投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为
46.发售;指在本基金募集期内,销售机构向投资人销售本基金基金份额的行为
47.申购;指基金合同生效后,投资人根据基金合同和招募说明书规定的条件,以基金合同规定的对价向基金管理人购买基金份额的行为
48.赎回;指基金合同生效后,基金份额持有人按基金合同和招募说明书规定的条件,要求将基金份额兑换为基金合同所规定对价的行为
49.场外;指不通过上海证券交易所交易系统而通过销售机构自身的柜台或者其他交易系统办理基金份额认购、申购和赎回业务的场所
50.场内;指通过上海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
51.申购赎回清单;指由基金管理人编制的用以公告申购对价、赎回对价等信息的文件,适用于场内份额的申购、赎回
52.申购对价;在场内申购赎回方式下,是指投资人申购基金份额时,按基金合同和招募说明书规定应交付的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价;在场外申购赎回方式下,是指投资人赎回基金份额时,基金管理人按基金合同和招募说明书规定应交付给赎回人的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价;在场外申购赎回方式下、赎回对价是指现金
53.赎回对价;在场内申购赎回方式下,是指投资人赎回基金份额时,基金管理人按基金合同和招募说明书规定应交付给赎回人的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价;在场外申购赎回方式下、赎回对价是指现金
54.组合证券;指本基金标的指数所包含的全部或部分证券
55.完全复制法;指一种跟踪指数的方法,通过购买标的指数中的所有成份证券,并且按照每种成份证券在标的指数中的权重确定购买的比例以构建指数组合,达到复制指数的目的
56.现金替代;指在场内申购赎回方式下,申购、赎回过程中,投资人按基金合同和招募说明书的规定,用于替代组合证券中部分证券的一定量的现金
57.现金差额;指在场内申购赎回方式下,最小申购、赎回单位的资产净值与按T日收盘价计算的最小申购、赎回单位中的组合证券市值和现金替代之差;投资者申购、赎回时应支付或应获得的现金差额根据最小申购、赎回单位对应的现金差额和申购或赎回的最小申购、赎回单位数量计算
58.预估现金部分;指在场内申购赎回方式下,由基金管理人估计并在T日申购赎回清单中公布的当日现金差额的估计值,预估现金部分由申购赎回代理券商《方小证券公司》预先垫结
59.最小申购、赎回单位;指本基金申购份额、赎回份额的最低数量,在场内申购赎回方式下,投资者申购、赎回的基金份额应为最小申购赎回单位的整数倍
60.基金份额参考净值;指基金管理人基金管理人委托的机构在开市后根据申购、赎回清单和组合证券内各只证券的实时成交数据计算,并通过上海证券交易所发布的基金份额参考净值,简称“IOPV”
61.基金份额折算;指基金管理人根据基金合同规定将投资人的基金份额进行变更登记的行为
62.收益评价日;指基金管理人计算本基金累计报酬率与标的指数累计报酬率差额之基准日
63.基金累计报酬率;收益评价日基金份额净值(如上市后基金份额发生折算,则采用剔除上市后折算因素的基金份额净值)与基金上市前一上海证券交易所交易日基金份额净值之比减去100%
64.标的指数回测累计报酬率;收益评价日标的指数收盘值与基金上市前一上海证券交易所交易日标的指数收盘值之比减去100%
65.元;指人民币元
66.基金收益;指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约
67.基金资产总值;指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和
68.基金资产净值;指基金资产总值减去基金负债后的价值
69.基金份额净值;指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数
70.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
71.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
72.中国;指中华人民共和国。就基金合同而言,不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区
73.不可抗力;指基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

## 三、基金管理人

(一)基金管理人概况
1.基金管理人:易方达基金管理有限公司
注册地址:广东省珠海市横琴新区宝中路3号4004-8室
办公地址:广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦40-43楼
批准设立机关及批准设立文号:中国证监会,证监基金字[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:4008818088
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 |
| 盈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长。

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、基金资产管理部总经理,易方达基金管理有限公司督察员兼监察部总经理、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、易方达资产管理有限公司董事。

麦力先生,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。

邓斌先生,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。

杨力先生,高级管理人员工商管理硕士《MBA》,董事。曾任美的集团空调事业部技术主管、企划经理,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,广东盈峰投资控股集团有限公司战略总监、董事、副总裁。现任盈峰投资控股集团有限公司董事、首席战略官。

谢宾先生,高级管理人员工商管理硕士《MBA》,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。

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。

朱征夫先生,法学博士,独立董事。曾任广东经济贸易律师事务所金融房地产部主任,广东大陆律师事务所合伙人,广东省国士万广东地产法律咨询服务中心副主任。现任广东东方昆仑律师事务所主任。

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。

李鲁金先生,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董事长、总经理,广州市广永国有资产经营有限公司董事长,万联证券有限责任公司董事长,广州银行副董事长。

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、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,工商管理硕士《MBA》,常务副总裁。曾任南方证券交易中心业务发展部经理,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。

肖坚先生,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》投资有限公司证券部副经理,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、总裁助理兼任专户投资总监、专户自营部投资官、基金科翔基金经理、易方达策略成长证券投资基金基金经理、易方达策略成长二号混合型证券投资基金基金经理、投资经理。现任易方达基金管理有限公司副总裁,兼任易方达资产管理有限公司董事。

陈志民先生,法学硕士、公共管理硕士,副总裁。曾任厦门国际信托投资公司信托部经理助理,南方基金管理有限公司研究员、基金经理助理、投资部副总经理《主管研究》,易方达基金管理有限公司基金投资部副总经理、机构理财部总经理、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、基金官席投资官、基金科翔基金经理、易方达50指数证券投资基金基金经理、易方达深证100交易型开放式指数基金基金经理。现任易方达基金管理有限公司副总裁,兼现金管理部总经理、易方达资产管理《香港》有限公司董事、人民币合格境外投资者《RQFII》业务负责人。

张南女士,经济学硕士、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。

涂岳先生,工商管理硕士《MBA》,首席产品执行官。曾任中国工商银行深圳分行国际业务部科员、深圳证券登记结算公司办公室经理、国际部经理,深圳证券交易所北京中心助理主任、上市部副总监、基金倩券部副总监、基金管理部总监。现任易方达基金管理有限公司首席产品执行官,兼任易方达资产管理《香港》有限公司董事。

2.基金经理

林飞先生,经济学博士,曾任融通基金管理有限公司研究员、基金经理助理,易方达基金管理有限公司基金经理助理、指数与量化投资部总经理助理、指数与量化投资部副总经理、易方达沪深300指数证券投资基金基金经理《自2009年8月26日至2010年12月31日》。现任易方达基金管理有限公司指数与量化投资部总经理、易方达深证100交易型开放式指数基金基金经理《自2006年7月4日起任职》、易方达50指数证券投资基金基金经理《自2007年2月9日起任职》、易方达深证100交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理《自2009年12月1日起任职》、用证券投资基金从事股票投资的投资决策证券投资基金基金经理《自2013年3月6日起任职》,兼任易方达资产管理《香港》有限公司基金经理。

余海燕女士,经济学硕士、曾任江丰银行Consumer Credit Risk信用风险分析师、华宝兴业基金管理有限公司分析师、基金经理助理、基金经理,易方达基金管理有限公司投资发展部产品经理。现任易方达基金管理有限公司指数与量化投资部副总经理。

3.指数与量化投资决策委员会成员

本公司指数与量化投资决策委员会成员包括:林飞先生、罗山先生、费鹏先生。

林飞先生,同上。

罗山先生,天体物理学博士。曾任巴克莱银行纽约分行衍生品交易部董事、新加坡分行信用产品交易部董事,苏格兰皇家银行香港分行权益及信用产品部总经理,加拿大皇家银行香港分行结构化产品部总经理,诚信资本合伙人,五矿证券公司副总裁,安信证券资产管理部副总经理,易方达基金管理有限公司指数及量化投资部部长兼投资经理。现任易方达基金管理有限公司易方达沪深300量化增强证券投资基金基金经理。

费鹏先生,机械工程学博士。曾任道富环球资产管理公司(SSgA)研究员、投资经理、北美主动型量化股票基金研究部主管,易方达基金管理有限公司海外投资经理,现任易方达基金管理有限公司易方达标普全球高端消费品指数增强型证券投资基金基金经理,兼任易方达资产管理《香港》有限公司基金经理。

4.上达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、转换和登记事宜;
2.办理基金资产的托管、分别记账,进行证券投资;
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.国务院证券监督管理机构规定的其他职责。

(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、规章、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赚取或违规经营;
②违反基金合同或托管协议;
③欺诈损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法利益;
④拒向中国证监会报送的资料中弄虚作假;
⑤恶意、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管;
⑥忽略职守、疏忽职权;
⑦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、规章、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。

(五)基金管理人的内部控制制度

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保护公司最审慎的投资利益。

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谨慎性原则: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代机构、部门根据业务需要制定的各种制度及实施细则等。它们新制订、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。公司重视不断随时持续检验,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是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群特征,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,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

公司根据法律法规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核对,便所公布的信息符合法律法规规定,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、操作程序和职责纪律。

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声明书

①基金管理人承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确;
②基金管理人承诺根据市场变化和基金管理人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号院1号楼
法定代表人:王洪章
成立时间:2004年09月17日
组织形式:股份有限公司
注册资本:贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整
存续期限:持续经营
基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字[1998]12号
联系人:田青
联系电话:010-67595096

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市,是中国四大商业银行中首家在海外公开上市的银行。2006年9月11日,中国建设银行又作为第一家H股公司普身国生指数。2007年9月25日中国建设银行A股在上海证券交易所上市并开始交易。A股发行后中国建设银行的已发行股份总数为:250,010,977,486股《包括240,417,319,880股H股及9,593,657,606股A股》。

截至2012年9月30日,中国建设银行资产总额132,964.82亿元,较上年末增长8.26%。截至2012年9月30日止九个月,中国建设银行实现净利润1,585.19亿元,较上年同期增长13.87%。年化平均资产回报率为1.65%,年化加权平均净资产收益率为24.18%。利息净收入2,610.24亿元,较上年同期增长17.05%。净利差为2.57%,净利息收益率为2.74%,分别较上年同期提高0.01和0.06个百分点。手续费及佣金净收入699.21亿元,较上年同期增长1.64%。

中国建设银行在中国内地设有13万余个分支机构,并在香港、新加坡、法兰克福、约翰内斯堡、东京、首尔、纽约、胡志明市及悉尼设有分行,在莫斯科、台北设有代表处,海外机构已覆盖到全球13个国家和地区,基本完成在全球主要金融中心的网络布局,24小时不间断服务能力和基本服务架构已初步形成。中国建设银行筹建、设立开展银行20家,拥有建广亚洲、建银国际、建行伦敦、建信基金、建信金融租赁、建信信托、建信人寿、中德住房储蓄银行等多家子公司,为客户提供一体化全面金融服务能力进一步增强。

2012年上半年,本集团各方面良好表现,得到市场与社会各界广泛认可,先后荣获国内外知名机构授予的30多个重要奖项。本集团在英国《银行家》2012年“全球银行1000强”中位列第6,较去年上升2位;在美国《财富》世界500强中排名77位,较去年上升31位;在美国《福布斯》2012年度全球上市公司2000强排名第13位,较去年上升4位。本集团是境内唯一一家连续四年蝉联香港《亚洲公司治理》称志颁发的《亚洲企业管治年度大奖》的上市公司,并先后获得《环球金融》《财资》《中国银行业协会等颁发的《中国最佳银行》、《卓越管理及公司管治》与《2011年度最具社会责任金融机构》等奖项。

中国建设银行拥有综合投资银行业务部,下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII托管处、核算处、清算处、监督稽核处、涉外资产核算团队、养老金托管处、托管业务系统规划与管理团队、上海备份中心等12个职能处室、团队,现有员工209人。自2007年起,托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计,并已经成为常规化的内控工作手段。

2.主要人员情况

杨新卉,投资托管业务部总经理,曾就职于中国建设银行江苏省分行、广东省分行、中国建设银行总行会计部、营运管理部、长期从事计划财务、会计结算、营运管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

纪伟,投资托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷经