# 易方达标普全球高端消费品指数增强型证券投资基金更新的招募说明书摘要

**基金管理人:易方达基金管理有限公司**
**基金托管人:中国银行股份有限公司**
**二〇一五年七月**
**重要提示**

本基金根据2011年12月15日中国证券监督管委员会《关于核准易方达标普全球高端消费品指数增强型证券投资基金募集的批复》(证监许可【2011】2013号)和2012年4月16日《关于易方达标普全球高端消费品指数增强型证券投资基金募集时间安排的确认函》(基金部函【2012】230号)的核准,进行募集。本基金的基金合同于2012年6月4日正式生效。

基金管理人保证《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。

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。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》、《运作办法》、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。

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。

本基金投资于股票及股票存托凭证的资产不低于基金资产净值的90%,其中投资标普全球高端消费品指数成份股及备选成份股的资产不低于股票及股票存托凭证资产的80%。本基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动,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,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主要风险包括:本基金特有的风险,主要包括投资高端消费品企业的风险、指数化投资的特殊风险等;境外投资风险,主要包括市场风险、政府管制风险、监管风险、政治风险、流动性风险、汇率风险、利率风险、衍生品风险、金融模型风险、信用风险等;运作风险,主要包括管理风险、税务风险、交易结算风险、法律风险、证券借贷/正回购/逆回购风险等;特殊风险;等等。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。

本基金由易方达基金管理有限公司独立管理,未聘请境外投资顾问。

投资有风险,投资者投资本基金时应认真阅读本招募说明书;基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本招募说明书已经本基金托管人复核。除非另有说明,本招募说明书所载内容截止日为2015年6月4日,有关财务数据截止日为2015年3月31日,净值表现截止日为2014年12月31日。(本报告中财务数据未经审计)

一、基金的名称

易方达标普全球高端消费品指数增强型证券投资基金

二、基金的类型

契约型、开放式

三、基金的投资目标

本基金为指数增强型基金,在严格控制跟踪误差的基础上,追求超越业绩比较基准的投资回报,力争实现基金资产的长期稳健增值。

四、基金的投资方向

本基金主要投资于标普全球高端消费品指数成份股及备选成份股,也可以投资于其他股票及股票存托凭证、股票型基金;政府债券、公司债券、可转换债券及经中国证监会认可的国际金融组织发行的固定收益类证券;银行存款、回购、短期政府债券与货币市场基金等货币市场工具;经中国证监会认可的金融衍生产品;以及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金投资于股票及股票存托凭证的资产不低于基金资产净值的90%,其中投资标普全球高端消费品指数成份股及备选成份股的资产不低于股票及股票存托凭证资产的80%;现金或者到期日不超过一年的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。

五、基金的投资策略

本基金以指数化投资为主,并辅以有限度的增强操作。本基金将以标普全球高端消费品指数的成份股构成及权重为基础,并基于量化模型和基本面研究进行投资组合的构建。在投资组合建立后,基金管理人将适时对投资组合进行调整,力争将投资组合对业绩比较基准的年化跟踪误差控制在8%以内,并力求获得超越业绩比较基准的投资回报。

1、资产配置策略

本基金追求对股票和股票存托凭证的充分投资。本基金投资于股票及股票存托凭证的资产不低于基金资产净值的90%,现金或者到期日不超过一年的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。基金管理人将综合考虑股票市场的风险收益特征、跟踪误差和基金的净赎情况等因素,确定权益类资产与固定收益类资产的具体配置比例。

2、权益类资产的投资策略

本基金投资标普全球高端消费品指数成份股及备选成份股的资产不低于股票及股票存托凭证资产的80%。

标普全球高端消费品指数是用于反映生产、销售高端消费品或者提供高端消费服务的公司股价表现的指数。截至2015年6月30日,标普全球高端消费品指数的成份股由以下行业中营业收入主要来自高端消费品与高端消费服务的公司构成:酿酒商与葡萄酒商行业、个人用品行业、汽车制造商行业、摩托车制造商行业、消费电子产品行业、家庭装饰品行业、住宅建筑行业、消闲用品行业、服装、服饰与奢侈品行业、鞋类行业、赌场与赌博行业、酒店、度假村与豪华游轮行业、消闲设施行业、特殊消费服务行业、互联网零售行业、百货商店行业、专卖店行业、家庭装饰零售行业。其中,酿酒商与葡萄酒商行业和个人用品行业属于日常消费品行业,其他行业属于非日常生活消费品行业。

(1)行业配置策略

基金管理人将在综合考虑以下因素的基础上,将基金资产在高端消费品各细分行业间进行配置:

1)各细分行业的成长及盈利预期:高端消费品各细分行业内部竞争格局和市场需求的变化趋势不同,导致各细分行业的成长性及盈利能力存在较大差异。基金管理人将对全球高端消费品各细分行业的成长性、盈利能力及其未来增长潜力进行分析,超配成长性好、盈利能力较强且未来增长潜力较大的细分行业。

2)各细分行业对全球宏观经济因素变化的反应:基金管理人将深入分析全球宏观经济因素变化对各细分行业的影响,超配受宏观经济因素变化正面影响较大或负面影响较小的细分行业。

3)技术指标:基金管理人将对高端消费品各细分行业股票价格变化趋势以及交易量变化等技术指标进行分析,以此作为行业配置的参考。

4)各细分行业的相对估值水平:本基金将对高端消费品各细分行业的相对估值水平进行动态分析,增加相对估值水平较低的细分行业的配置比例,降低相对估值水平较高的细分行业的配置比例。

(2)个券选择策略

本基金将对成长因素、价值因素、质量因素和技术因素等影响高端消费品上市公司股价的因素进行综合分析,从而对高端消费品上市公司的投资价值进行评估,在此基础上,高配价值被低估的股票、低配价值被高估的股票。

1)成长因素

高端消费品企业由于主要国家与地区的经济发展水平与需求增长速度、品牌知名度与忠诚度、市场占有率变化、新增产能的增长、定价能力、收购兼并等因素,呈现不同的收入与利润增长。基金管理人将对高端消费品企业短期与中长期收入与利润增长率的历史数据以及研究机构的预期数据进行分析,并进行同行业比较,对高端消费品上市公司的成长性进行综合研判,重点选择未来成长性较好的上市公司。

2)价值因素

基金管理人将参照高端消费品上市公司的行业特性,选择合适的分析方法挑选价值被低估的上市公司。采用的方法包市盈率法(P/E)、市净率法(P/B)、市销率法(P/S)、市盈率-长期成长法(PEG)、企业价值/销售收入(EV/SALES)、企业价值/息税折旧摊销前利润法(EV/EBITDA)、自由现金流贴现模型(FCFF、FCFE)或股利贴现模型(DDM)等。

3)质量因素

基金管理人将通过对高端消费品上市公司财务数据的分析,对上市公司的盈利能力、运营质量、资产质量和现金流质量等进行综合判断,重点选择盈利能力、运营质量、资产质量及现金流质量较高的上市公司。

4)技术因素

基金管理人将通过对股票价格趋势变化和交易量变化的综合分析,预测股票价格未来变化方向和投资者偏好,以此作为买入或卖出股票的参考。

(3)权益类投资组合的构建和调整

本基金将以标普全球高端消费品指数的成份股构成及权重为基础,根据基金管理人对行业与个股的价值评估,结合行业与个股偏离以及跟踪误差等风险指标,使用投资组合优化模型,构造风险调整后收益较高的投资组合。

在投资运作过程中,当指数成份股与权重发生变化、公司事件造成影响、基金管理人对行业与个股的评价改变、基金发生申购与赎回以及投资的企业出现突发性重大事件时,基金管理人将对组合进行相应调整,追求超越业绩比较基准的投资回报。

3、固定收益品种与货币市场工具的投资策略

固定收益品种和货币市场工具投资部分,本基金将在研究分析基金的申购赎回需求,分析各国主要固定收益品种的期限结构、信用风险、利率走势、相对人民币的汇率走势等因素的基础上,主要投资于流动性较好、回报稳健的投资品种。

4、衍生品的投资策略

本基金将本着谨慎的原则,在风险可控的前提下,以避险和有效管理为主要目的,适度参与衍生品投资。衍生品投资的主要策略包括:

(1)避险

本基金可利用外汇远期、期货、期权或掉期等衍生品种,以规避外币资产的汇率风险,避免汇率剧烈波动对基金的业绩产生不良影响;可利用证券相关的衍生产品,以规避单个证券在短时期内剧烈波动的风险等。

(2)有效管理

有效管理主要包括对现金流量的有效管理、降低股票或股票存托凭证买入或卖出的市场冲击成本等。当短期申购规模较大时,基金净值会因仓位的大幅摊薄而受到影响,利用金融衍生品可有效管理现金流量,减少不利影响。为追求对股票和股票存托凭证的充分投资,降低跟踪误差,本基金也可投资于金融衍生品。当基金买入或卖出股票、股票存托凭证时,大量买入或卖出会造成证券价格的短期波动,抬高买入成本或压低卖出价格,可考虑利用金融衍生品的杠杆和流动性进行阶段性替代等。

六、基金的业绩比较基准

标普全球高端消费品指数(净收益指数,使用估值汇率折算)

七、基金的风险收益特征

本基金为股票基金,其预期风险与收益水平高于货币市场基金、债券基金和混合型基金。本基金在控制跟踪误差的基础上,力争获得超越业绩比较基准的收益。长期来看,本基金具有与业绩比较基准相近的风险水平。

本基金主要投资于全球高端消费品企业,需承担汇率风险、国家风险和高端消费品企业特有的风险。

八、基金投资组合报告(未经审计)

本基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

本基金的托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同的规定,复核了本报告的内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告有关数据的期间为2015年1月1日至2015年3月31日。

1. 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(人民币元) | 占基金总资产的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 36,689,792.55 | 91.42 |
| | 其中:普通股 | 35,931,364.48 | 89.53 |
| | 存托凭证 | 171,355.10 | 0.43 |
| | 优先股 | 587,072.97 | 1.46 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中:债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| | 其中:远期 | - | - |
| | 期货 | - | - |
| | 期权 | - | - |
| | 权证 | - | - |
| 5 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 6 | 货币市场工具 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 2,791,797.20 | 6.96 |
| 8 | 其他资产 | 652,793.47 | 1.63 |
| 9 | 合计 | 40,134,383.22 | 100.00 |

2. 报告期末在各个国家(地区)证券市场的股票及存托凭证投资分布

| 国家(地区) | 公允价值(人民币元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|
| 美国 | 16,768,898.85 | 44.30 |
| 德国 | 7,357,885.08 | 19.44 |
| 法国 | 4,930,765.34 | 13.03 |
| 英国 | 3,765,051.77 | 9.95 |
| 瑞士 | 1,474,604.12 | 3.90 |
| 香港 | 1,203,564.90 | 3.18 |
| 日本 | 786,861.13 | 2.08 |
| 意大利 | 402,161.36 | 1.06 |
| 合计 | 36,689,792.55 | 96.93 |

注:(1)国家(地区)类别根据其所在的证券交易所确定。

(2)ADR、GDR按照存托凭证本身挂牌的证券交易所确定。

3. 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

(1)报告期末指数投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

| 行业类别 | 公允价值(人民币元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|
| 能源 | - | - |
| 材料 | - | - |
| 工业 | - | - |
| 非必需消费品 | 29,339,435.62 | 77.51 |
| 必需消费品 | 7,350,356.93 | 19.42 |
| 保健 | - | - |
| 金融 | - | - |
| 信息技术 | - | - |
| 电信服务 | - | - |
| 公用事业 | - | - |
| 合计 | 36,689,792.55 | 96.93 |

注:以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

(2)报告期末积极投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

本基金本报告期末无积极投资的股票及存托凭证。

4. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票及存托凭证投资明细

(1)期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票及存托凭证投资明细

| 序号 | 公司名称(英文) | 公司名称(中文) | 证券代码 | 所在证券市场 | 所属国家(地区) | 数量(股) | 公允价值(人民币元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | Daimler AG | - | DAI GR | 德国证券交易所Xetra交易平台 | 德国 | 6,264 | 3,746,075.61 | 9.90 |
| 2 | NIKE Inc | - | NKE US | 纽约证券交易所 | 美国 | 5,976 | 3,682,691.63 | 9.73 |
| 3 | Diageo PLC | - | DGE LN | 伦敦证券交易所 | 英国 | 19,166 | 3,247,014.14 | 8.58 |
| 4 | LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SA | - | MC FP | 巴黎纽约泛欧证券交易所 | 法国 | 1,800 | 1,969,248.46 | 5.20 |
| 5 | Bayerische Motoren Werke AG | - | BMW GR | 德国证券交易所Xetra交易平台 | 德国 | 2,233 | 1,733,066.94 | 4.58 |
| 6 | Estee Lauder Cos Inc/The | - | EL US | 纽约证券交易所 | 美国 | 3,170 | 1,619,189.57 | 4.28 |
| 7 | Cie Financiere Richemont SA | - | CFR VX | 瑞士证券交易所 | 瑞士 | 2,831 | 1,401,610.96 | 3.70 |
| 8 | Adidas AG | - | ADS GR | 德国证券交易所Xetra交易平台 | 德国 | 2,630 | 1,291,669.56 | 3.41 |
| 9 | VF Corp | - | VFC US | 纽约证券交易所 | 美国 | 2,712 | 1,254,487.35 | 3.31 |
| 10 | Pernod-Ricard SA | - | RI FP | 巴黎纽约泛欧证券交易所 | 法国 | 1,413 | 1,037,322.47 | 2.74 |

注:此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

(2)期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票及存托凭证投资明细

本基金本报告期末无积极投资的股票及存托凭证。

5. 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

6. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

9. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

10. 投资组合报告附注

(1)本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

(2)本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

(3)其他各项资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(人民币元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | 539,735.75 |
| 3 | 应收股利 | 69,242.61 |
| 4 | 应收利息 | 304.16 |
| 5 | 应收申购款 | 43,510.95 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 652,793.47 |

(4)报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

(5)A.报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

(5)B.报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末无积极投资的股票。

九、基金的业绩

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。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金合同生效日为2012年6月4日,基金合同生效以来(截至2014年12月31日)的投资业绩及与同期基准的比较如下表所示:

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 基金合同生效至2012年12月31日 | 7.60% | 0.60% | 21.04% | 1.09% | -13.44% | -0.49% |
| 2013年1月1日至2013年12月31日 | 31.51% | 0.90% | 30.85% | 0.88% | 0.66% | 0.02% |
| 2014年1月1日至2014年12月31日 | -3.82% | 0.80% | -4.65% | 0.71% | 0.83% | 0.09% |
| 基金合同生效至2014年12月31日 | 36.10% | 0.80% | 51.02% | 0.88% | -14.92% | -0.08% |

注:1.同期业绩比较基准已经转换为以人民币计价。

2.上述净值表现数据按照《证券投资基金信息披露编报规则第2号<基金净值表现的编制及披露>》的相关规定编制。

十、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

设立日期:2001年4月17日

法定代表人:刘晓艳

联系电话:400 881 8088

联系人:贺晋

注册资本:12,000万元人民币

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总裁、董事、副董事长。现任易方达基金管理有限公司董事长,易方达国际控股有限公司董事长。

刘晓艳女士,经济学博士,副董事长、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、监察部总经理、市场部总经理、总裁助理、公司副总裁、常务副总裁、董事。现任易方达基金管理有限公司副董事长、总裁,易方达资产管理(香港)有限公司董事长。

秦力先生,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,广发控股(香港)有限公司董事,广东金融高新区股权交易中心有限公司董事长。

杨力先生,高级管理人员工商管理硕士(EMBA),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,开源证券有限责任公司副董事长,盈峰资本管理有限公司总经理。

刘东辉先生,管理学博士,董事。曾任广州市东建实业总公司发展部投资计划员,广州商贸中心(马来西亚)有限公司副总经理、董事总经理,广州东建南洋经贸发展有限公司董事总经理,广东粤财信托有限公司综合管理部副总经理、信托管理三部副总经理。现任广东粤财信托有限公司总经理助理、信托管理三部总经理。

刘韧先生,经济学硕士,董事。曾任湖南证券发行部经理助理,湘财证券投资银行总部总经理助理,财富证券投资银行总部副总经理,五矿二十三冶建设集团副总经理、党委委员。现任广东省广晟资产经营有限公司总经理助理、资本运营部部长,兼任佛山市国星光电股份有限公司董事,深圳市中金岭南有色金属股份有限公司监事,新晨期货有限公司董事。

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。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,广东省国土厅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市场拓展部总经理、总裁助理、市场总监。现任易方达基金管理有限公司监事会主席。

李韧金先生,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、广州市广永国有资产经营有限公司董事长。现任广州金融控股集团有限公司副董事长、总经理,万联证券有限责任公司董事长,广州银行副董事长,广州股权交易中心有限公司董事长,立根融资租赁有限公司董事长,广州立根小额再贷款股份有限公司董事长。

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、市场部总经理。现任易方达基金管理有限公司互联网金融部总经理。

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、副总裁。现任易方达基金管理有限公司常务副总裁,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、基金投资部总经理、总裁助理、专户投资总监、专户首席投资官;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,易方达资产管理有限公司董事长,ACE GP董事,ACE Investment Fund LP投资决策委员会委员。

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、南京分公司总经理、成都分公司总经理、上海分公司总经理、总裁助理、市场总监。现任易方达基金管理有限公司副总裁。

马骏先生,高级管理人员工商管理硕士(EMBA),副总裁。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、现金管理部总经理、总裁助理、固定收益投资总监、固定收益首席投资官;基金科讯基金经理、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固定收益总部总经理,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、证券交易负责人员(RO),就证券提供意见负责人员(RO)、提供资产管理负责人员(RO),中债资信评估有限责任公司独立董事。

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、监察部总经理。现任易方达基金管理有限公司督察长。

范岳先生,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、基金债券部副总监、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,易方达资产管理(香港)有限公司董事。

2、基金经理

张胜记先生,管理学硕士。曾任易方达基金管理有限公司投资经理助理、基金经理助理、行业研究员、易方达沪深300交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金(原易方达沪深300指数证券投资基金)基金经理(自2011年1月1日至2013年11月13日)。现任易方达基金管理有限公司易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自2010年3月29日起任职)、易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理(自2010年3月31日起任职)、易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自2012年8月9日起任职)、易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理(自2012年8月21日起任职)、易方达50指数证券投资基金基金经理(自2012年9月28日起任职)、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(自2014年9月13日起任职),兼任易方达资产管理(香港)有限公司基金经理。

本基金历任基金经理情况:费鹏先生,管理时间为2012年6月4日至2014年9月12日。

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、张胜记先生。

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、易方达深证100交易型开放式指数基金基金经理、易方达50指数证券投资基金基金经理、易方达深证100 交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理、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经理、易方达沪深300非银行金融交易型开放式指数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、就证券提供意见负责人员(RO)、提供资产管理负责人员(RO)、证券交易负责人员(RO)。

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资深投资经理。现任易方达基金管理有限公司指数及量化投资部副总经理、易方达沪深300量化增强证券投资基金基金经理。

张胜记先生,同上。

4、上述人员之间均不存在近亲属关系。

十一、 费用概览

(一)与基金运作相关的费用

1.基金费用的种类

(1)基金管理人的管理费;

(2)基金托管人的托管费;

(3)基金合同生效以后的信息披露费用;

(4)基金份额持有人大会费用;

(5)基金合同生效以后的会计师费和律师费;

(6)基金的证券交易或结算所产生的费用,以及在境外市场的开户、交易、结算、登记、存管等各项费用;

(7)外汇兑换交易的相关费用;

(8)基金的资金汇划费用;

(9)基金的指数使用费与指数数据费;

(10)为了基金利益,除去基金管理人与基金托管人因自身原因而导致的、与基金有关的诉讼、追索费用;

(11)基金依照有关法律法规应当缴纳或预提的任何税收、征费及相关的利息、费用和罚金,以及直接为处理基金税务事项产生的税务代理费;

(12)按照国家有关规定、基金合同约定或行业惯例可以列入的其他费用。

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。

2.基金费用计提方法、计提标准和支付方式

(1)基金管理人的管理费

基金管理人的基金管理费(如基金管理人委托境外投资顾问,包括境外投资顾问费)按前一日基金资产净值的1.2%年费率计提。

在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的1.2%年费率计提。计算方法如下:

H=E×1.2%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

(2)基金托管人的托管费

基金托管人的基金托管费(如基金托管人委托境外托管人,包括向其支付的相应服务费)按前一日基金资产净值的0.35%年费率计提。

在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的0.35%年费率计提。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

基金托管费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

(3)本条第(一)款第3至第12项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定,列入当期基金费用。

3.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。

4.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。

基金管理人必须于新的费率实施日前在至少一种指定媒体上公告。

(二)与基金销售有关的费用

1.申购费

(1)申购费率:

本基金对通过直销中心申购的特定投资群体与除此之外的其他投资者实施差别的申购费率。

特定投资群体指全国社会保障基金、依法设立的基本养老保险基金、依法制定的企业年金计划筹集的资金及其投资运营收益形成的企业补充养老保险基金(包括企业年金单一计划以及集合计划),以及可以投资基金的其他社会保险基金。如将来出现可以投资基金的住房公积金、享受税收优惠的个人养老账户、经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型,基金管理人可将其纳入特定投资群体范围。

特定投资群体可通过本基金直销中心申购本基金A类基金份额。基金管理人可根据情况变更或增减特定投资群体申购本基金A类基金份额的销售机构,并按规定予以公告。

通过基金管理人的直销中心申购本基金人民币基金份额的特定投资群体申购费率见下表:

| 申购金额M(人民币元)(含申购费) | 申购费率 |
|---|---|
| M<100万 | 0.12% |
| 100万≤M<500万 | 0.08% |
| 500万≤M<1000万 | 0.002% |
| M≥1000万 | 1000元/笔 |

通过基金管理人的直销中心申购本基金美元现汇基金份额的特定投资群体申购费率见下表:

| 申购金额M(美元)(含申购费) | 申购费率 |
|---|---|
| M<20万 | 0.12% |
| 20万≤M<100万 | 0.08% |
| 100万≤M<200万 | 0.002% |
| M≥200万 | 200美元/笔 |

其他投资者申购本基金人民币基金份额的申购费率见下表:

| 申购金额M(人民币元)(含申购费) | 申购费率 |
|---|---|
| M<100万 | 1.2% |
| 100万≤M<500万 | 0.8% |
| 500万≤M<1000万 | 0.02% |
| M≥1000万 | 1000元/笔 |

其他投资者申购本基金美元现汇基金份额的申购费率见下表:

| 申购金额M(美元)(含申购费) | 申购费率 |
|---|---|
| M<20万 | 1.2% |
| 20万≤M<100万 | 0.8% |
| 100万≤M<200万 | 0.02% |
| M≥200万 | 200美元/笔 |

(2)申购费的收取方式和用途

在申购费按金额分档的情况下,如果投资者多次申购,申购费适用单笔申购金额所对应的费率。

本基金的申购费由申购投资者承担,不计入基金财产,主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

(3)申购份额的计算

本基金的申购金额包括申购费用和净申购金额,其中:

净申购金额=申购金额/(1+申购费率)

申购费用=申购金额-净申购金额

申购份数=净申购金额/T日基金份额净值

对于1000万元人民币(含)或200万美元(含)以上的申购,净申购金额=申购金额-绝对数额的申购费金额

申购费用以人民币元或美元为单位,四舍五入,保留至小数点后二位;申购份额采取四舍五入的方法保留小数点后二位,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。

2.赎回费

(1)赎回费率:

本基金(包括人民币基金份额和美元现汇基金份额)赎回费率如下:

| 持有时间(天) | 赎回费率 |
|---|---|
| 0-364 | 0.5% |
| 365-729 | 0.3% |
| 730及以上 | 0% |

(2)赎回费的收取方式和用途

本基金的赎回费由赎回投资者承担,在基金份额持有人赎回基金份额时收取,赎回费总额的25%归基金财产,其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

(3)赎回金额的计算方式

本基金的净赎回金额为赎回总金额扣减赎回费用,其中:

赎回费用=赎回份额×T日基金份额净值×赎回费率

净赎回金额=赎回份额×T日基金份额净值-赎回费用

净赎回金额、赎回费用以人民币元或美元为单位,四舍五入,保留小数点后两位,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.投资者通过本公司网上交易系统(www.efunds.com.cn)进行申购、赎回的交易费率,请具体参照我公司网站上的相关说明。

4.基金管理人可以在基金合同规定的范围内调整申购费率和赎回费率,调整后的申购费率和赎回费率在《更新的招募说明书》中列示。上述费率如发生变更,基金管理人还应于新的费率实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

5.基金管理人可以在不违背法律法规规定及《基金合同》约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划。在基金促销活动期间,基金管理人可以对投资者开展不同的费率优惠活动。

十二、基金托管人

名称:中国银行股份有限公司(简称“中国银行”)

住所及办公地址:北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期:1983年10月31日

注册资本:人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

法定代表人:田国立

基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字【1998】24 号

托管部门信息披露联系人:王永民

客服电话:95566

传真:(010)66594942

十三、境外资产托管人

名称:中国银行(香港)有限公司

住所:香港花园道1号中银大厦

办公地址:香港花园道1号中银大厦

法定代表人:岳毅总裁

成立时间: 1964年10月16日

组织形式:股份有限公司

存续期间:持续经营

联系人:黄晚仪 副总经理 托管业务主管

联系电话:852-3962-3753

十四、相关服务机构

(一)基金份额销售机构

1、直销机构: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

法定代表人:刘晓艳

电话:020-85102506

传真:4008818099

联系人