（上接A17版）

资于原油采掘、服务等原油相关公司股票的以原油为主题的主动基金；现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

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

二、投资策略

本基金在全球范围内精选优质的原油ETF、原油基金，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进行投资，力求基金净值增长率与业绩比较基准增长率相当。通常情形下，本基金大部分资产将投资于原油ETF，在原油ETF投资品种缺失或流动性不足，或投资其他金融工具可以更好地实现本基金投资目标情况下，本基金可选择其他金融工具进行投资，以实现投资目标。

1、原油ETF投资策略

本基金将优先选择跟踪标的与本基金业绩比较基准相同或相关性大的原油ETF进行投资。

本基金选择原油ETF的因素包括：

（1）跟踪标的：ETF所跟踪标的指数与本基金业绩比较基准的相关性；

（2）基金管理公司：公司管理该类基金的经验和管理历史以及规模；

（3）二级市场交易情况：该原油ETF历史成交量、报价连续性，以及是否有做市商等；

（4）基金投资组合评价指标：基金的长期表现和跟踪效率、基金的波动性和风险调整后收益及业绩归因分析、基金的年内日均成交量及流动性、基金的费率等。

此外，本基金不参与原油ETF的实物申赎。

2、原油基金投资策略

本基金将优先选择跟踪标的与本基金业绩比较基准相同或相关性大的原油指数基金进行投资。

本基金将根据原油股票主动基金主要通过定量分析策略和定性分析策略相结合的方式优选标的基金。在基金资产主要投资于原油采掘、服务等原油相关公司股票的主动基金中，本基金通过分析各类基金的费率水平、历史收益、夏普比率、历史回撤、波动率等量化指标，挑选出合适的基金组成标的基金池。再对标的基金池中的基金进行筛选和配置，通过深入了解标的基金的具体策略及投资领域，将资产分散投资于不同基金管理人、投资策略的基金，构建基金投资组合。

3、股票等其他资产的投资策略

本基金仅在跟踪原油价格或原油相关指数的ETF、指数基金投资品种缺失或流动性不足的情况下进行股票投资。如本基金进行股票投资，本基金将重点投资于满足基金管理人以下分析标准的原油相关的公司：公司经营稳健，盈利能力较强或具有较好的盈利预期；财务状况运行良好，资产负债结构相对合理，财务风险较小；公司治理结构合理、管理团队相对稳定、管理规范、具有清晰的长期愿景与企业文化、信息透明。

本基金将根据对国际汇率和利率走势的判断，投资于能取得稳定回报因定收益类品种；经营历史较长、单位风险的超额收益较高、下方风险较低的债券基金；投资回报优良，同时严格控制流动性风险和信用风险的货币市场基金等。

4、衍生品投资及证券借贷策略

为降低留存现金、汇率因素的影响，本基金还将本着谨慎原则，在风险可控的前提下，投资于以原油ETF、原油股票指数ETF为标的资产的期货与期权，以及外汇远期合约等衍生品。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合约规避外币资产对人民币的汇率风险，避免汇率剧烈波动对基金的业绩产生不良影响；可利用以原油ETF为标的资产的衍生工具，规避原油市场的系统性风险；还可利用证券相关的衍生产品规避单个证券在短时期内剧烈波动的风险等。

（2）有效管理：主要包括对现金流量的有效管理、降低补市成本等。在短期的申购赎回规模较大或市场大幅波动时，利用金融衍生品可迅速调整现金头寸，同时管理风险资产以减少不利影响。

此外，在符合有关法律法规的前提下，本基金还可在严格进行风险控制的前提下，进行证券借贷交易、回购交易等投资，以提高投资收益。

5、未来，随着全球证券市场投资工具的发展和丰富，基金管理人可以在不改变投资目标的前提下，遵循法律法规的规定，相应调整和更新相关投资策略并在招募说明书更新中公告。

四、业绩比较基准

标普高盛原油商品指数（S&P GSCI Crude Oil Index ER）收益率

标普高盛原油商品指数（S&P GSCI Crude Oil Index ER）属于标普高盛商品系列指数之一。该指数由高盛于1991年研发，并被标准普尔公司于2007年收购。根据该指数的编制方法，目前指数的标的资产由流动性高、交投活跃的美国西德克萨斯原油期货（WTI）近月主力合约构成；WTI近月主力合约在固定时间内进行展期。该指数旨在为原油期货投资者提供公开、可靠的业绩比较基准，属于可投资商品期货指数。

如果指数编制单位停止计算编制以上指数或更改指数名称、或今后法律法规发生变化、或有更适当的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出、或市场上出现更加适用于本基金的业绩基准的指数时，本基金管理人可以根据本基金的投资范围和投资策略，调整基金的业绩比较基准，但应在取得基金托管人同意后报中国证监会备案，并及时公告，无须召开基金份额持有人大会审议。

五、风险收益特征

本基金为基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

（1）购买不动产

（2）购买房地产抵押权债；

（3）购买贵重金属或代表贵重金属的凭证；

（4）购买实物商品；

（5）除应付赎回、交易清算等临时时地位外，借入现金。该临时用途借入现金的比例不得超过基金资产净值的10%；

（6）利用融资购买证券，但投资金融衍生品除外；

（7）参与未持有基础资产的卖空交易；

（8）购买证券用于控制或影响发行该证券的机构或其管理层；

（9）直接投资与实物商品相关的衍生品；

（10）从事证券承销业务；

（11）违反规定向他人贷款或者提供担保；

（12）从事承担无限责任的投资；

（13）向其基金管理人、基金托管人出资；

（14）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

（15）法律、行政法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

6、基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当将各基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部风控机制，相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规履行信息披露义务；涉及关联方投资，重大关联交易应当提交基金管理人重事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过，基金管理人重事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

7、法律法规或监管部门取消上述限制或限制、禁止行为规定或从事关联交易的条件和要求，本基金可不受相关限制、法律法规或监管部门对上述限制、禁止行为规定或从事关联交易的条件和要求的约束，本基金可以变更后的规定为准。经与基金托管人协商一致，基金管理人可依据法律法规或监管部门规定直接对基金合同进行变更，该变更无须召开基金份额持有人大会审议。

七、基金管理人代表基金行使所投资证券产生权利的处理原则及方法

1、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使所投资证券权利，保护基金份额持有人的利益；

2、不谋求对上市公司的控股权，不参与所投资上市公司的经营管理；

3、有利于基金资产的安全与增值。

八、衍生品投资的风险管理与流动性

（一）投资衍生品的风险管理

金融衍生品的投资过程，同时也是风险管理的过程。在金融衍生品的投资业务中，包括了“事前的风险定位、事中的风险管理和事后的风险评估”的全过程、多角度、全方位的风险监控体系。

1.事前风险控制：投资决策前，投资研究人员必须对所运用的金融衍生品的原理、特性、运作机制、风险有深入的研究和分析。对拟投资方案可能蕴含的风险进行充分评估，并进行必要的情形分析和压力测试。金融衍生品的投资方案经审批后方可执行。

2.事中风险控制：衍生品研究组对交易对手的信用评级进行跟踪，防范信用风险的发生，并利用现代金融工程的手段对对组合进行风险评估。基金经理或衍生品研究组对衍生品头寸以及风险敞口进行监控，一旦衍生品的亏损超过投资方案防范的目标，应按制度进行汇报，并考虑采取强制平仓等措施以避免出现严重的风险事件。

3.事后风险控制：基金经理或衍生品研究组定期对基金的衍生品交易策略、运作情况做投资回顾分析和风险评估，识别内部控制中的弱点和系统中的不足，提供改进的建议；定期评估、审定和改进风险管理政策。

（二）投资衍生品的决策流程

1.基金经理在内外部研究的支持下，本着组合避险和有效管理的策略原则，提出衍生品投资需求及相关报告，并按照公司制度提交审议。审批通过后，基金经理将投资指令提交集中交易室执行。

2.基金经理对衍生品的投资运作情况进行回顾和评估检讨。

九、代理投票

1.基金管理人行使代理投票权应遵循基金份额持有人利益最大化的原则。

2.行使代理投票权应考虑不同地区市场上适用的法律或监管要求、公司治理标准、披露实务操作等存在的差异，充分研究提案的合理性，并综合考虑投资顾问、独立第三方研究机构等的意见后，选择合适的方式行使投票权。本基基金投资者利益最大化的原则，对持股比例较小或难以非思要事项、支付较高费用等情况时，基金管理人可以选择不参与上市公司的投票。

3.代理投票权的执行，可选择实地投票、通过交易经纪商系统投票、委托境外投资顾问、托管人或第三方代理投票机构投票等方式。

4.基金管理人应保留投票记录。

十、证券交易管理

1.基金管理人挑选证券经纪商主要考虑的因素包括：交易执行能力、研究报告质量、提供研究服务质量、法规监管资讯服务及以及价值贡献等方面。

（1）交易执行能力：主要指券商是否能够对投资指令进行有效的执行，以及能否取得较高质量的成交结果。衡量交易执行能力的指标主要有：是否完成交易、成交的及时性、成交价格、对市场的影响等；

（2）研究报告的质量：主要是指券商能否提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专题研究报告，报告内容是否详实，投资建议是否准确等；

（3）提供研究服务的质量，主要包括协助安排上市公司调研、研究资料共享、路演服务、日常沟通交流、接受委托研究的服务质量等方面；

（4）法规监管资讯服务。主要包括境外投资法律规定、交易监管规则、信息披露、个人利益冲突、税收等资讯的提供与培训；

（5）价值贡献。主要是指证券经纪商对公司研究团队、投资团队在业务能力提升上所做的培训服务，对公司投资提升所作出的贡献；

（6）其他因素。主要是证券经纪商的财务状况，经营行为规范、风险管理机制、近年内有无重大违规行为等。

2.席位交易量的分配依据

基金管理人主要根据以下主要因素对证券经纪商的评价结果进行交易量的分配：评价证券经纪商将重点依据其交易执行能力、研究报告质量、提供研究服务质量、法规监管资讯服务和价值贡献等方面的指标，并采用十分制进行评分。

评分的计算公式是：∑(第i项评价项目×项目权重)，其中各项目权重由基金管理人根据相关法规要求和内部制度进行确定。

3.其他事项

本基金管理人将根据有关规定，在基金定期报告中对所选择的证券经纪商、基金通过该证券经纪商买卖证券的成交量以及所支付的佣金等进行披露。对于在证券经纪商选择和交易量分配中存在或潜在的利益冲突，管理人应该本着尽可能维护持有人的利益进行妥善处理，并按规定进行报告。

十一、未来条件许可情况下的基金模式转换

根据市场变化，若经来条件许可，本基金管理人将依据审慎性原则和维护基金份额持有人合法权益的原则，使本基金转为采取ETF交易模式或ETF联接基金模式，届时基金管理人在履行适当程序后，将报证监会核准并提前公告。

第五节基金管理人

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：邓晓峰

联系电话：400 881 8088

联系人：贺晋

注册资本：12,000万元人民币

批准设立机关及文号：中国证券监督管理委员会、证监基金字[2001]4号

经营范围：基金募集、基金销售；资产管理；经中国证监会批准的其他业务

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

董事会：王兆华先生，工商管理硕士、董事长。曾任中国平安保险公司证券部研究咨询室总经理助理；平安证券有限责任公司研究咨询部副总经理（主持工作）、国债部副总经理（主持工作）、资产管理部副总经理、总经理；中国平安保险股份有限公司投资管理部副总经理（主持工作）；全国社会保障基金理事会投资部资产配置处处长、投资部副主任、境外投资部主任、投资部主任、证券投资部主任。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。

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时期部经理、基金经理、基金投资时期部副总经理、基金资产管理部总经理；易方达基金管理有限公司投资管理部副总经理、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。现任易方达基金管理有限公司总裁；易方达资产管理（香港）有限公司董事长；易方达国际控股有限公司董事。

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、投资管理部总经理、公司总经理助理、公司总经理、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投资小镇有限公司董事长。

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、全国经理；佛山顺德百年科技有限公司行政总监；美的空调派别营销中心区域经理；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；盈峰资本管理有限公司总经理；开源证券股份有限公司副董事长。

王海先生，经济学、工商管理（国际）硕士，董事。曾任工商银行江西省分行法律顾问室科员；工商银行珠海分行法律顾问室办事员、营业部计划信贷部信贷员、办公室行长秘书、信贷管理部业务主办、资产风险管理部经理助理兼法律室副主任、资产风险管理部副总经理兼法律室副主任、资产风险管理部副总经理兼法律室主任、资产风险管理部总经理兼法律室主任、资产风险管理部总经理兼特殊资产管理部负责人；工商银行珠海分行资产风险管理总经理兼特殊资产管理部负责人；公司业务部总经理、副行长；工商银行广东省分行公司业务部副总经理（主持工作）、总经理；工商银行副关分行行长、党委书记。现任广东粤财信托有限公司总经理。

刘昭先生，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；五矿证券投资银行总部总经理；五矿证券经纪业务总部总经理；五矿证券经纪业务总部总经理兼营业部总经理；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；新筑期货有限公司董事；广晟有色金属股份有限公司董事；东江环保股份有限公司董事长。

朱征天先生，法学博士，独立董事。曾任广东经济贸易委员会法规处处长；广州市广东国有资产经营有限公司董事；广州股权交易中心副主任。现任广东东方昆仑律师事务所主任。

忻裕女士，工商行政管理硕士，独立董事。曾任中国国际经济贸易仲裁委员会秘书处秘书；美国加州高盛集团公司证券分析师；美国加州大学洛杉矶分校工商学院教授；香港科技大学副教授；中欧国际工商学院教授；瑞士洛桑管理学院教授。现任中欧国际工商学院教授。

谭劲松先生，管理学博士（会计学），独立董事。曾任邵阳市财会学校教师；中山大学管理学院助教、讲师、副教授。现任中山大学管理学院教授。

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。

李韵金先生，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；广州市广东国有资产经营有限公司董事长；广州股权交易中心副主任。现任广东东方昆仑律师事务所主任。

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、互联网金融部总经理。现任易方达基金管理有限公司总裁助理；广东粤财互联网金融股份有限公司董事。

张达洪先生，经济学硕士，副总经理兼财务负责人。曾任广发证券公司证券业务发展部、广东证券股份有限公司证券业务发展部经理、广东证券股份有限公司证券业务发展部副总经理；易方达基金管理有限公司副总裁兼固定收益总部总经理；易方达资产管理有限公司董事；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（ROFII）业务负责人、证券交易负责人（RO）、就证券提供意见负责人员（RO）、提供资产管理负责人员（RO）、ROFII/QFII产品投资决策委员会委员；中信资信评估有限责任公司董事。现任易方达基金管理有限公司副总裁。

吴炎荣先生，工学硕士，副总经理兼财务负责人。曾任易方达基金管理有限公司基金会计部、基金会计部副总经理、市场部华东大区销售经理、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、上海投资部、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副总；深圳众大投资有限公司投资部副经理；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、固定收益投资决策委员会委员、基金经理兼固定收益部总经理。现任易方达基金管理有限公司副总裁兼固定收益部总经理；易方达资产管理有限公司董事；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（ROFII）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）、ROFII/QFII产品投资决策委员会委员；现任易方达基金管理有限公司副总裁。

赵荣春先生，工学硕士，副总经理兼财务负责人。曾任易方达基金管理有限公司基金会计部、基金会计部副总经理、基金投资部总经理、公募基金投资部总经理、总裁助理、权益投资总监、主动权益投资总监、基金经理、基金管理部总经理、易方达科汇灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达价值精选股票型证券投资基金基金经理。现任易方达基金管理有限公司副总裁，兼权益投资部总经理。

张南木先生，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、证券交易所北京中心助理主任、上市部副总监、基金投资部副总监、基金管理部总监。现任易方达基金管理有限公司首席产品官；易方达资产管理（香港）有限公司董事、另类投资决策委员会委员。

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、指数与量化投资部副总经理、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兼指数与量化投资部总经理、易方达沪深300交易型开放式指数基金基金经理、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2015年11月19日）、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、易方达上证中盘交易型开放式指数基金基金经理（自2010年3月29日起任至今）、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日起任至今）、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日起任至今）、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日起任至今）、易方达50指数证券投资基金基金经理（自2012年8月29日起任至今）、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日起任至今）、易方达港股通生活小型股指数证券投资基金（LOF）基金经理（自2016年11月7日起任至今）、兼任易方达资产管理（香港）有限公司基金经理。

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、张胜记先生、王建军先生。

林飞先生，经济学博士，副总经理兼基金管理有限公司研究部、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、易方达上证50交易型开放式指数基金基金经理、易方达深证100交易型开放式指数基金基金经理、易方达沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、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、易方达沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金经理、易方达沪深300价值交易型开放式指数证券投资基金基金经理、易方达沪深300主题证券投资基金基金经理、易方达沪深300主题证券投资基金联接基金基金经理、易方达中证500交易型开放式指数证券投资基金基金经理、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、指数与量化投资部总经理、量化基金投资决策委员会委员、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）、ROFII/QFII产品投资决策委员会成员。

张胜记先生，同上。

王建军先生，经济学博士，曾任汇添富基金管理有限公司指数量分析师；易方达基金管理有限公司量化研究员、基金经理助理、指数与量化投资部总经理助理、易方达深证100交易型开放式指数基金基金经理、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、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理、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、易方达中小板指数交易型开放式指数证券投资基金基金经理、易方达并购重组指数分级证券投资基金基金经理、易方达生物科技指数分级证券投资基金基金经理、易方达银行指数分级证券投资基金基金经理。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、投资经理。

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.依法募集资金，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.选择、更换成熟券商外汇经纪商；

13.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）改变招募基金份额持有人或其他基金机构有关的合法利益；

（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、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）有法律法规禁止证券投资机构从事证券投资业务人员形象；

（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）促进公司全体员工将守职履责、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的范各种风险，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；第二个层面是公司基本管理制度；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。公司重视对制度的持续检验，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；各级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撤销或取消授权。

（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；建立投资决策参考意见的形式、内容和时效性等内容，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，并权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，将重点投资限制和重点关注的风险权限额度内；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，并根据风险控制应能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；公司通过规范的会计政策、完审制度、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。此加强对信息的审查核对，使所公布的信息符合法律法规的规定，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，向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，严格制订了专业化职业伦理、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，促使公司各项管理制度的规范运行。

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）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和公司业务发展不断完善内部控制制度。

第六节基金的份额类别

本基金根据所收取费用的差异，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购基金时收取认购/申购费用，并不再从本类别基金资产计提销售服务费的基金份额，称为A类基金份额；从本基基金产中计提销售服务费，并不收取认购/申购费用的基金份额，称为C类基金份额。在基金份额类别内，根据认购、申购、赎回计价和费用的不同，分为人民币份额和美元份额（特指美元现汇基金份额，下同）。

本基金对A类人民币份额、A类美元份额、C类人民币份额、C类美元份额分别设置代码，分别披露基金份额净值和基金份额累计净值。人民币份额和美元份额各种投资运作，共同承担投资净值、共同承担投资成本。投资者在认购、申购基金份额时可自行选择基金份额类别，并受付相应申购的款项。

份额类别	A类人民币份额	C类人民币份额	A类美元份额	C类美元份额
首次申购最低金额	10元（直销中心为5万元）	10元（直销中心为5万元）	100美元（直销中心为100美元）	100美元（直销中心为100美元）
追加申购最低金额	10元（直销中心为1000元）	10元（直销中心为1000元）	100美元（直销中心为100美元）	100美元（直销中心为100美元）
单笔赎回最低份额	10份	10份	10份	10份
基金账户最低基金份额余额	10份	10份	10份	10份
销售服务费（年费率）	0	0.3%	0	0.3%

根据基金市场情况，基金管理人可在不违反法律法规以及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，增加新的基金份额类别、或者调整现有基金份额类别的费率水平、或者停止现有基金份额类别的销售、或者增加新的销售币种、或者调整现有基金销售币种设置、或者变更现有币种的销售等，调整前基金管理人需及时公告并报中国证监会备案，无须召开基金份额持有人大会审议批准。

除非基金管理人在未来条件成熟后另行公告并通相关安排，本基金不同基金份额类别之间不得互相转换。

第七节基金的募集

一、基金类型与运作方式

本基金为境外基金中基金，基金运作方式为契约型、上市开放式（LOF）

二、上市交易所

深圳证券交易所

三、基金的存续期间

不定期

四、基金份额的募集期、募集方式及场所、募集对象

1.募集期：本基金募集期限自基金份额发售之日起不超过3个月，具体发售时间由基金管理人根据相关法律法规以及基金合同的规定确定，并在基金份额发售公告中披露。

2.募集地所及募集方式：

（1）募集场所

本基金通过各销售机构的基金销售网点公开发售，基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并予以公告。具体销售机构联系方式以及发售公告及后续关于变更或增减本基金销售机构的公告为准，请投资人就募集机认购的具体事宜仔细阅读发售公告。

（2）募集方式

本基金入类上所列销售通过场内、场外两种方式公开发售；A类美元份额、C类人民币份额、C类美元份额通过场外公开发售。在基金募集阶段，本基金将针对A类人民币份额、A类美元份额、C类人民币份额、C类美元份额设置不同的认购代码进行募集。

① 场外发售

场外认购将通过各销售机构的基金销售网点或投资销售机构提供的其他方式公开发售，各销售机构的具体名单见《基金份额发售公告》以及基金管理人届时发布的相关公告。

② 场内发售

场内认购将通过具有基金销售业务资格，且经深圳证券交易所及其指定的登记结算机构认可的会员单位发售（具体名单详见《基金份额发售公告》）或相关业务公告）。本基金认购期结束前获得基金销售业务资格的会员单位也可办理场内发售。

③场外认购的A类人民币份额登记在中国结算公司登记结算系统基金份额持有人开放式基金账户下；场内认购的A类人民币份额登记在中国结算深圳分公司证券登记系统基金份额持有人深圳证券账户下。A类美元份额、C类美元份额以及C类人民币份额的登记结算机构为易方达基金管理有限公司。

④ 本基金认购采取全额缴款认购的方式，基金投资者在募集期内可多次认购，认购一经受理不得撤销。

⑤ 基金销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购的确认以登记结算机构的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况，投资者应及时查询并妥善行使合法权利。

（2）本基金人民币基金份额发售面值为人民币1.00元。本基金份额的初始面值为人民币基金份额的初始面值按照募集期最后一日美元伯值汇率进行折算，以美元为单位，四舍五入保留小数点后四位。

3.募集对象：符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、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。

五、募集规模

本基金募集份额总额不少于2亿份，基金募集金额（美元金额需折算为人民币）不少于2亿元人民币。

本基金可根据中国证监会、外管局核准的境外投资额度（美元额度需折算为人民币），对基金发售规模进行限制。若募集期内有效认购申请金额（不含利息）超过募集规模上限，将采取末日比例配售的方式进行确认、募集规模的具体方案详见《基金份额发售公告》。

六、募集币种

人民币、美元。

七、认购时间安排

认购的具体业务办理时间由基金管理人依据相关法律法规、基金合同确定并公告。

八、基金的认购

1.认购程序：投资者认购时间安排、认购时应提交的文件和办理的手续，详见本基金的《发售公告》。

2.认购数量限制

（1）本基金场内认购采用份额认购的方式，场外认购采用金额认购方式。

（2）投资人认购基金份额采用全额缴款的认购方式。投资人认购时，需按销售机构规定的方式备足认购的金额。

（3）投资人在募集期内可以多次认购基金份额，已经正式受理的认购申请不得撤销。

（4）通过场内非直销销售机构认购本基金场内A类人民币份额时，每笔最低认购份额为1,000份，超过1,000份的必须是1,000份的整数倍。

（5）在基金募集期内，除基金份额发售公告另有规定，投资人通过场外非直销销售机构或本公司网上