（上接D5版）

由于开放式基金的特殊要求，本基金必须保持一定的现金比例以应付赎回的需求，在管理现金头寸时，有可能存在现金不足的风险和现金过多而带来的机会成本风险。此外，本基金也可能由于向投资人分红而面临现金不足的风险。

2、技术风险

在当计算机系统、通信网络等技术保障系统出现异常情况，可能导致基金日常的赎回无法按正常时限完成、注册登记系统瘫痪、核算系统无法按正常时限产生净值、基金的投资交易指令无法及时传输等风险。

3、大额赎回风险

本基金为开放式基金，基金规模将随着投资人对基金单位的赎回而不断变化，若是由于投资人的连续大量赎回而导致基金管理人被迫以低于目标价格抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响。

4、顺延或暂停赎回风险

因为市场剧烈波动或其他原因而连续出现巨额赎回，并导致基金管理人的现金支付出现困难，基金投资人在赎回基金份额时，可能会遇到部分顺延赎回或暂停赎回等风险。

5、不可抗力风险

战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金资产有遭受损失的风险，以及证券市场、基金管理人可能因不可抗力无法正常工作，从而有影响基金的赎回按正常时限完成的风险。基金管理人自基金合同生效之日起三个月内可不开放赎回，之后，本基金每日开放赎回，但赎回款项到账较国内基金慢，投资者投资于本基金的资金将受到一定的流动性限制。

6、合同生效风险

基金合同的生效需取决于某些先决条件，例如基金备案条件和募集期的要求。若此类先决条件未能得到满足，则将可能会导致基金募集失败。

7、交易结算风险

在基金的投资交易中，因交易的对手方无法履行对一位或多位的交易对手的支付义务而使得基金在投资交易中蒙受损失的可能性。

8、会计核算风险

会计核算风险主要是指由于会计核算及会计管理上违规操作形成的风险或错误，通常是指基金管理人在计算、整理、制证、填单、登账、编表、保管及其相关业务处理中，由于客观原因与非主观故意所造成的行为过失，从而对基金收益造成影响的风险。

9、税务风险

税务风险指因本基金投资于全球不同国家/地区市场，不同国家对海外投资基金的收益税收规定有所不同，可能对基金投资收益实现产生影响。

10、金融模型风险

投资管理人在有时会使用金融模型来进行资产定价、趋势判断、风险评估等辅助其做出投资决策。但是金融模型通常是建立在一系列的学术假设之上的，投资实践和学术假设之间存在一定的差距；而且金融模型结论的准确性往往受制于模型使用的数据的精确性。因此，投资者在使用金融模型时，面临出现错误结论的可能性，从而承担投资损失的风险。

11、证券借贷风险

本基金可能会涉及证券借贷交易。在进行证券借贷交易时，将选择信用评级高的证券公司，但是仍有可能面临信用风险。在从事证券借贷交易期间，可能会发生无法追加担保物导致被强制平仓的风险，对投资者造成经济损失。如果贷款利率出现波动，导致证券公司提高融资利率，将增加融资成本。交易期间，可能出现借贷标的证券范围调整、暂停交易或终止上市等情况，证券公司可能会提前终止证券交易，可能会给投资者造成经济损失。

12、回购交易风险

回购交易指债券交易的双方在进行债券交易的同时，以契约方式约定在将来某一日期以约定的价格（本金和按约定回购利率计算的利息），由债券的“卖方”（正回购方）向“买方”（逆回购方）再次购回该笔债券的交易行为。从交易发起人的角度出发，凡是抵押出债券，借入资金的交易就称为进行债券正回购；凡是主动借出资金，获取债券质押的交易就称为进行逆回购。由于融资方必须有足额的债券作抵押，因此债券回购的安全性比较高、收益相对稳定。但是，回购交易有可能面临恶意违约风险和流动性不足造成的操作风险，给投资者造成经济损失。

四、基金投资

（一）投资目标

本基金主要投资于全球证券市场，把握全球经济趋势，精选景气投资行业，并在此基础上投资于其中的优势公司，实现充分分享全球经济增长收益的目标；同时在投资国家或地区配置上，有效实现全球分散化投资，力争充分分散风险，追求基金资产的稳定增值。

（二）基准资市

本基金的基准货币是人民币。

（三）投资范围

本基金投资组合中股票及其他权益类证券占基金资产的60%-95%，现金、货币市场工具及中国证监会允许投资的其他金融工具占基金资产的5%-40%。

本基金将80%以上的股票资产投资于大盘类股票。其中，大盘股定义如下：股票按总市值从大到小排序，位于各自交易所三分之一之前或者各自交易所所属行业三分之一以前的股票为大盘股。（行业分类按全球行业分类标准（GICS）确定）。在此期间对于未纳入最近一次排序范围内的股票（如新股、恢复上市股票等），本基金参照上述规则决定是否属于大盘股。基金因所持有股票价格的变化而导致大盘股投资比例低于上述规定的不在限制之内，但基金管理人应在合理期限内进行调整，最长不超过6个月。未来，随股票市场发展和个股市值差异的变化，基金管理人可在保持大盘风格的前提下适当调整大盘股定义标准，并及时公告。

本基金将80%以上的股票资产投资于业绩比较基准内的澳大利亚、奥地利、比利时、加拿大、丹麦、芬兰、法国、德国、希腊、香港、爱尔兰、荷兰、新西兰、挪威、葡萄牙、新加坡、西班牙、瑞典、瑞士、美国、英国等23个全球发达地区市场，并将根据业绩比较基准指数的调整，对投资地区做对应调整。对于尚未与证监会签署双边监管合作谅解备忘录（以下简称“MOU”）的国家/地区的投资限制将遵从证监会QDII投资的有关规定，目前为单个非MOU国家的投资不超过基金净值的3%，非MOU国家全部投资总和不超过基金净值的10%。

（四）投资理念

1、本基金认为在全球经济的发展过程中，在不同时期，各行业的景气度不同，把握行业景气周期的变化，能够更加充分的分享全球经济增长的成果。

2、本基金认为着眼于全球主流国家或地区的分散化配置，能够更有效地分散由于区域配置带来的非系统性风险，更加有利于中国境内的投资者分散风险，获得稳定收益。

3、本基金管理人认为通过投资过程中的有效外汇对冲管理，可以很大程度地规避人民币汇率风险。

（五）投资策略

本基金投资组合的构建采用了自上而下的行业配置和自下而上的个股精选相结合的方法，运用行业基本面研究方法与Black-Litterman资产配置理论体系实现行业层面的风险最优配置，在行业内部，运用全球量化选股模型精选个股，投资管理人将两者进行有机结合，构建最优化的投资组合。

1、资产配置策略

全球宏观经济的走势是资产配置的基础，本基金管理人将密切关注跟踪各项宏观经济指标的变化，在此基础上，制定中长期资产配置战略，确定投资权益类金融产品和现金货币类工具大类资产配置的比例。

2、股票投资策略

①行业配置策略：把握全球经济运行趋势，最优化配置景气行业

本基金自上而下的行业配置采用了由Black 和 Litterman 于上世纪九十年代逐步开发成型的Black-Litterman资产配置模型。本基金管理人定期根据投资研究团队对行业景气程度的判断，明确各行业的投资价值和预期收益率，将预期收益率作为新的变量，运用Black-Litterman资产配置模型对市场组合进行优化，得到的新投资组合的行业配置权重将成为指导基金管理人行业配置的重要决策依据。

在具体行业的景气程度和投资价值分析中，基金管理人将运用行业时钟理论，辅以宏观因子回归模型和风格投资因子回归模型，结合对行业发展趋势和行业政策的主观评价，最终形成对MSCI世界指数的十个一级行业与二十四个子行业进行行业投资价值的综合评估。

行业景气程度和投资价值分析的主要参考指标：

OECD综合领先指标
OECD 工业制造指标
OECD核心通货膨胀率
OECD PPI
Brent原油期货价格
美元指数
全球长期利率
全球流动性指标
信用价差
行业估值水平
行业竞争优势
行业成长性
行业政策环境

在对全球行业景气程度和投资价值的分析过程中，本基金将前瞻性地把握世界经济增长方式以及产业结构发生根本性改变时期产生的巨大资源、高科技、高端消费品需求，通过投资于全球范围内受惠的行业龙头公司，使中国投资者最直接分享世界经济成长与行业板块轮动的收益，获得长期、稳定的投资回报。

②个股选择策略：数量化精选全球优势公司

在得到了最优化的行业配置比例之后，基金管理人将对利用全球量化选股模型形成的备选投资组合进行行业比例调整，将自下而上的选股结果根据自上而下的行业配置进行调整，从而构建最优化的股票投资组合。

基金管理人使用的全球量化选股模型对全球10000多只股票做基本面分析，从中选择各行业有代表性的、流通性良好的股票作为配置基础。该模型主要考察六个核心投资主题：估值、赢利能力、收益质量、管理影响、趋势及分析师情绪的变化。估值主题旨在抓住证券的潜在定价错误，通常对比公司的内在价值及其市场价值。赢利能力评估公司的盈利是否超过其资产成本。收益质量评估公司的盈利是否来源于持续性更强，以现金为基础的来源，而不是应计项目的增长。管理影响评估公司管理层的策略及行为。趋势预测由于对公司特定信息的反应不足而造成的股价变化。最后，分析师情绪变化参考买方分析师对某一公司收益及前景的观点按时间变化的情况。

运用这一量化模型可以在行业中选出最具有投资价值的股票，能够超越行业中的其他同类股票，获得超额收益。

3、外汇现金与货币市场工具投资策略

在货币市场类投资部分，资产配置以安全性、流动性为资产配置原则，并兼顾收益性与货币篮子管理来制订具体策略。在制定货币投资策略时，采取分散化的办法管理外汇头寸策略，被动对冲因资产配置引起的外汇比例偏离。

多币种国际化投资一个重要特点是，可以降低组合中各资产之间的相关度，有效提高投资组合的风险调整后收益。进行国际化的多币种投资将意味着资产将以多币种的形式存在，由于各币种之间汇率的波动，存在着汇率风险。为了有效的管理汇率风险，为投资者获取稳定的人民币收益，本基金的外汇管理贯彻以下政策与策略。

本基金将贯彻以实现外汇管理的套期保值，有效规避人民币汇率风险为主的外汇管理政策。在基金的运作初期拟定不使用衍生品与外汇避险工具。市场风险暴露将主要通过大类资产的配置调整，汇率风险通过多币种现金跟踪业绩基准汇率篮子的方式缓解，即与业绩基准中美元、欧元、英镑、日元、加元、瑞士法郎、澳元、港币、瑞典克朗、新加坡元、挪威克朗、丹麦克朗等货币的比例保持一致。在未来，外汇管理的目标将主要依靠套期保值策略来实现。由于考虑收益性的目标，本基金在资产配置过程中仍然不可避免的存在外汇风险敞口，为了进一步降低风险敞口，本基金将充分利用全球市场上存在的汇率管理工具以及包括：货币远期、货币掉期等衍生金融工具来对冲汇率风险。

4、金融衍生产品的投资策略

出于避险和提高组合管理效率的目的本基金可投资于经过中国证监会认可的包括期权、期货、远期、互换、挂钩性结构化产品等在内的金融衍生产品。

应用远期、指数期货、期权等等的金融衍生产品可以有效提高组合管理与资产配置的效率，本基金将在以下方面应用金融衍生产品作为实现组合管理策略的工具：充分利用股票（或者指数）期货合约、期权合约、权证等金融工具，实现组合股票头寸的套期保值，改善组合的风险收益特性；利用股票（或者指数）期货合约、期权合约、权证等金融工具保证金交易的杠杆特性，调节组合现金头寸，实现提高组合流动性的目标；利用金融衍生工具更好地跟踪组合基准；

此外，在符合有关法律法规规定的前提下，本基金还可进行证券借贷交易、回购交易等投资，以增加收益。未来，随着全球证券市场投资工具的发展和丰富，基金可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。

（六）业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：摩根斯坦利世界大盘股指数（MSCI World Large Cap Index）

如法律法规发生变化，或基金变更投资范围，或市场中出现其他更具有代表性的、更适合用于本基金的、投资者认同度更高的业绩比较基准，或原指数供应商变更或停止原指数的编制及发布，在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

（七）风险收益特征

本基金为股票型基金，风险和收益高于货币基金、债券基金和混合型基金。同时，本基金为全球股票型证券投资基金，除了需要承担与国内证券投资基金类似的市场波动风险之外，本基金还面临汇率风险、国别风险、新兴市场风险等海外市场投资所面临的特别投资风险。此外，由于投资国家与地区市场的分散，风险低于投资单一市场的股票型基金。

（八）投资决策

本基金投资决策的基本原则是依据本基金合同所制定投资基本方针、投资范围及投资限制等，拟订基金投资策略及执行投资计划。在追求投资收益的稳健增长的同时，积极管理组合面临的风险，最大限度地保障基金持有人的利益。

为提高投资决策效率和专业性水平，公司在经营管理层下设国际投资决策委员会，作为国际投资管理的核心决策机构。国际投资决策委员会会根据基金投资决策小组形成资产配置建议对基金的资产配置下达指导性意见。国际投资决策委员会的每次会议决议形成书面报告，为监察稽核提供查核依据。本基金的具体投资决策采用集体决策模式，基金投资决策小组定期召开周、月、季度、年度投资决策会议制定投资决策。

具体投资组合的流程具体分为五步，在风险控制的前提下以月为单位循环下述投资流程：

1、全球资产资产配置：基金管理人根据中国证监会有关规定、基金合同和市场情况确定各资产类配置比例和各资产类投资比例范围。在符合基金合同投资限制的前提下，基金管理人每月对资产配置比例进行调整。

2、区域相对价值决定：国际投资决策委员会会同国际业务部对各个境外主要券商（包括境外投资顾问）提供的价值分析报告进行研究，决定在资产配置比例下各资产类别中具体投资品种。

3、投资组合构建：基金管理人在确定的战略资产配置与投资目标结构的范围内，构建和调整投资组合。

股票投资组合的构建。本基金投资组合的构建采用了自上而下的行业配置和自下而上的个股精选相结合的方法。在MSCI世界指数组合的基础上，结合基金管理人对行业景气和投资价值的判断，运用Black-Litterman资产配置模型实现行业层面的风险最优配置。在行业内部，基金管理人将对利用全球量化选股模型形成的备选投资组合进行行业比例调整，将自下而上的选股结果根据自上而下的行业配置进行调整，从而构建最优化的股票投资组合。

基金管理人根据宏观经济形势、利率平价研究对不同币种货币市场工具及外汇风险暴露进行管理，控制汇率风险。

外汇远期、股指期货等为本基金辅助性投资工具，投资原则为有利于加强基金风险控制。

4、交易执行：基金管理人通过公司指定的交易管理系统向各主交易券商的全球交易平台下指令执行。

5、业绩回顾与组合修正：基金管理人将采用归因分析等技术手段，评价业绩贡献的构成，为资产配置和组合调整提供依据。基金管理人下设风险管理小组，根据中国证监会和境外相关市场的监管要求，制定风险管理制度，实施有效的风险管理。

（九）投资限制

1、持有同一家银行的存款不得超过本基金资产净值的20%。在托管账户的存款可以不受上述限制。

2、持有同一机构（政府、国际金融组织除外）发行的证券市值不得超过基金资产净值的10%。

3、持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不得超过本基金资产净值的10%，其中，持有任一国家或地区市场的证券资产不得超过本基金资产净值的3%。

4、不得购买证券用于控制或影响发行该证券的机构或其管理层。基金管理人管理的全部基金不得持有同一机构10%以上具有投票权的证券发行总量。指数基金可以不受上述限制。

前项投资比例限制应当合并计算同一机构境内外上市的总股本，同时应当一并计算全球存托凭证和美国存托凭证所代表的基础证券，并假设对持有的股本权证行使转换。

5、持有非流动性资产市值不得超过基金资产净值的10%。

前项非流动性资产是指法律或基金合同规定的流通受限证券以及中国证监会认定的其他资产。

6、持有境外基金的市值合计不得超过基金资产净值的10%。持有货币市场基金可以不受上述限制。

7、基金管理人管理的全部基金持有任何一只境外基金，不得超过该境外基金总份额的20%。

若超过上述第1项—第7项的投资比例限制，应当在超过比例后30个工作日内采用合理的商业措施减仓以符合投资比例限制要求。

本基金将遵照中国证监会最新调整的上述投资比例。

8、对于因基金份额拆分、大比例分红等集中持续营销活动引起的基金净资产规模在10个工作日内增加10亿元以上的情形，而导致股票投资比例低于基金合同约定的，基金管理人同基金托管人协商一致并及时书面报告中国证监会后，应在3个月内调整以符合基金合同约定。

9、相对于基金资产，股票及其他权益类证券投资比例为60-95%。

10、本基金的建仓期为基金合同生效之日起6个月内。基金管理人应当在基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

11、本基金投资衍生产品应当严格遵守下列规定：

①本基金的金融衍生品全部敞口不得高于基金资产净值的100%。

②本基金投资期货支付的初始保证金、投资期权支付或收取的期权费、投资柜台交易衍生品支付的初始费用的总额不得高于基金资产净值的10%。

③本基金投资于远期合约、互换等柜台交易金融衍生品，应当符合以下要求：

1）所有参与交易的对手方（中资商业银行除外）应当具有不低于中国证监会认可的信用评级机构评级。

2）交易对手方应当至少每个工作日对交易进行估值，并且基金可在任何时候以公允价值终止交易。

3）任一交易对手方的市值计价敞口不得超过基金资产净值的20%。

④本基金不得直接投资与实物商品相关的衍生品。

12、本基金参与证券借贷交易，并且应当遵守下列规定：①所有参与交易的对手方（中资商业银行除外）应当具有中国证监会认可的信用评级机构评级；②应当采取市值计价制度进行调整以确保担保物市值不低于已借出证券市值的102%；③借方应当在交易期内及时向本基金支付已借出证券产生的所有股息、利息和分红。一旦借方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留和处置担保物以满足索赔需要；④除中国证监会另有规定外，担保物可以是以下金融工具或品种：现金、存款证明、商业票据、政府债券、中资商业银行或由不低于中国证监会认可的信用评级机构评级的境外金融机构（作为交易对手方或其关联方的除外）出具的不可撤销信用证；⑤本基金有权在任何时候终止证券借贷交易并在正常市场惯例的合理期限内要求归还任一或所有已借出的证券。

13、根据正常市场惯例本基金参与正回购交易、逆回购交易，并且应当遵守下列规定：①所有参与正回购交易的对手方（中资商业银行除外）应当具有中国证监会认可的信用评级机构信用评级；②参与正回购交易，采取市值计价制度对卖出收益进行调整以确保现金不低于已售出证券市值的102%。一旦买方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留或处置卖出收益以满足索赔需要；③买方应当在正回购交易期内及时向基金支付售出证券产生的所有股息、利息和分红；④参与逆回购交易，应当对购入证券采取市值计价制度进行调整以确保已购入证券市值不低于支付现金的102%。一旦卖方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留或处置已购入证券以满足索赔需要。

14、本基金参与证券借贷交易、正回购交易，所有已借出而未归还证券总市值或所有已售出而未回购证券总市值均不得超过本基金总资产的50%。

前项比例限制计算，本基金因参与证券借贷交易、正回购交易而持有的担保物、现金不计入基金总资产。

15、其他的投资比例符合《基金法》及相关法规的有关规定。

（十）禁止行为

为维护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、购买房地产抵押按揭。

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、交易清算等临时用途以外，借入现金。该临时用途借入现金的比例不得超过本基金资产净值的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、从事证券承销业务。

9、向他人贷款或者提供担保；

10、从事承担无限责任的投资；

11、直接投资与实物商品相关的衍生品；

12、向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人、境外资产托管人发行的股票或者债券；

13、买卖与其基金管理人、基金托管人、境外资产托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人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；

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、不公平对待不同客户或不同投资组合。

16、除法律法规规定以外，向任何第三方泄露客户资料。

17、依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

（十一）若法律法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更，致使现行法律法规的投资禁止行为和投资组合比例限制被修改或取消，基金管理人在履行适当程序后，本基金可相应调整禁止行为和投资限制规定。

（十二）投资组合比例调整

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例规定的，基金管理人应当在30个交易日内进行调整。法律法规另有规定时，从其规定。

（十三）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

基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人权利，保护基金份额持有人的利益；

基金管理人按照有关规定代表基金独立行使股东权利，保护基金份额持有人的利益；

有利于基金资产的安全与增值。

（十四）代理投票权的政策和程序

1、代理投票权的决定将由国际投资决策委员会做出。

2、基金管理人可委托境外投资顾问或境外托管人进行代理投票。由于国外的公司治理标准、法律或监管要求和披露实务操作与中国的相关规定存在差异，当委托投票权与非中国证券相关时，受托机构将考虑在相关外国市场上适用的不同的法律法规，提出决定如何行使表决权的建议。

3、在某些中国以外的法域中，就基金持有股票行使投票权的持有人可能被限制在股东大会召开日期前后的一段时间内对股票进行交易。由于此类交易限制会妨碍基金管理人可能导致基金的流动性受损，如果存在此类限制，基金管理人在一般情况下将不行使代理投票权。此外，某些中国以外的法域要求投票的股东就不同的基金披露当前的持股情况，如果存在此类披露要求，基金管理人在一般情况下将不行使委托投票权，以保护基金持有信息。

4、基金将保留委托投票权的记录，至少保存3年以上。其中包括：

①基金作为证券持有人收到的有报告义务的发行人的证券持有人会议相关的材料；

②发行人的名称；

③证券的交易所代码；

④会议日期；

⑤会议上需投票的事项的简要描述；

⑥需投票的事项是否由发行人、其管理层或其他人或公司提出；

⑦基金是否对该等事项进行了投票；

⑧基金如何就该等事项进行了投票；

⑨基金的投票是赞成还是反对发行人的管理层的提议。

（十五）证券交易

1、证券经纪商的交易执行能力、研究实力和提供的研究服务，是选择证券经纪商以及分配交易量最主要的原则和标准，包括以下几个方面：

交易执行能力。主要指证券经纪商是否对投资指令进行了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；

研究机构的实力和水平。主要是指证券经纪商能否所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；

提供研究服务的质量。主要指证券经纪商承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告及讲座。

2、交易量分配的方法及标准

针对境外投资基金业务涉及多个海外证券市场的金融产品投资特点，如不同交易时间、多国货币计价、不同国家风险溢价、每个国家证券交易的法规、税收和监管方式都有差别，证券经纪商的选择更注重其全球范围内上市公司研究力量的综合实力、单个国家证券市场的特色研究力量和遍布全球主要证券交易市场的交易平台的便捷性、高效性。

针对新证券经纪商之等级评分，一律先由国际业务部提出证券经纪商候选名单，金融工程部依证券经纪商所提供近三年财务报表数据来作信用调查，提出证券经纪商评估报告书，呈报风险控制委员会核准后方可进行下单。

往来下单证券经纪商名单均需以定期评分方式进行确定。

每半年评分一次。

由基金经理/交易员根据证券经纪商研究服务品质、交易执行能力进行评分。

打分纪录归档并送监察稽核部和国际业务部备案。

依交易对象分级所可列示的额度及相关法规定，公司将对各证券经纪商的交易总量实施限额控制。额度管理根据境外投资基金交易对手的信用风险控制的有关规定执行。

3、对于在证券经纪商选择和分仓中存在或潜在的利益冲突，管理人应该本着维护持有人的利益出发进行妥善处理，并及时进行披露。

4、交易佣金的返还。管理人每年年初根据对证券经纪商的评价和考核，与证券经纪商签订服务协议，在协议中规定详细的交易佣金的收取标准，严格禁止佣金返还的情况出现。

五、基金的业绩

本基金在业绩披露中将采用全球投资表现标准（GIPS）

1、在业绩表述中采用统一的货币；

2、按照GIPS的相关规定和标准进行计算；

3、如果GIPS的标准与国内现行要求不符时，同时公布不同标准下的计算结果，并说明其差异；

4、对外披露时，需要注明业绩计算标准是符合GIPS要求的。

六、基金管理人

（一）基金管理人基本情况

1、基本信息

名称：长盛基金管理有限公司

住所：深圳市福田区福中三路1006号诺德中心八楼GH单元

办公地址：北京市海淀区北太平庄路18号城建大厦A座21层

法定代表人：陈平

成立时间：1999年3月

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会证监基金字［1999］6号

组织形式：有限责任公司（中外合资）

注册资本：人民币壹亿伍仟万元

存续期间：持续经营

电话：010-82255818

传真：010-82255988

联系人：叶金松

2、经营概况

本基金管理人经中国证监会证监基字［1999］6号文件批准，于1999年3月成立，注册资本为人民币10000万元。截至目前，本公司股东及其出资比例为：国元证券股份有限公司占注册资本的41%；新加坡星展资产管理有限公司占注册资本的33%；安徽省创新投资有限公司占注册资本的13%；安徽省投资集团有限责任公司占注册资本的13%。截至2010年3月18日，基金管理人共管理两只封闭式基金、十一只开放式基金和六只社保基金委托资产，同时管理多只专户理财产品。

（二）主要人员情况

1、基金管理人董事会成员：

陈平先生，董事长，硕士。曾在合肥工业大学管理系任教，历任安徽省国际信托投资公司证券发行部副经理、证券投资部经理，国元证券有限责任公司副总裁，2004年10月始任长盛基金管理有限公司董事，现为长盛基金管理有限公司董事长。

凤良志先生，董事，博士，高级经济师。曾历任安徽省政府办公厅第二办公室副主任、安徽省国际信托投资公司副总经理、安徽省证券管理办公室主任、安徽省政府驻香港窗口公司黄山有限公司董事长、安徽省国际信托投资公司副总经理（主持工作）、安徽国元控股（集团）有限责任公司暨国元信托有限责任公司董事长，现为国元证券股份有限公司（原国元证券有限责任公司）董事长。

钱正先生，董事，学士，高级经济师。曾任安徽省人大常委办公厅副处长、处长，安徽省信托投资公司副总经理、党委副书记，安徽省国有资产管理局分党组书记。现为安徽省信用担保集团有限公司总经理。

杜长胜先生，董事，学士。历任安徽省第一轻工业厅研究室副主任，安徽省轻工业厅生产技术处，企业管理处处长、副厅长，安徽省巢湖市市委常委、常务副市长，安徽省发改委副主任，现任安徽省投资集团有限责任公司党委书记、总经理。

蔡咏先生，董事，学士，高级经济师。曾在安徽财贸学院财政金融系任会计教研室主任、安徽省国际经济技术合作公司美国（德班）分公司任财务经理，历任安徽省国际信托投资公司国际金融部经理、深圳证券营业部总经理、安徽省政府驻香港窗口公司黄山有限公司总经理助理，安徽省国际信托投资公司证券总部副总经理，现为国元证券股份有限公司（原国元证券有限责任公司）董事、总裁。

何玉珠女士，董事，学士。历任JP摩根证券（亚洲）有限公司副总裁、瑞银集团董事总经理。现为星展资金管理有限公司首席执行官、新加坡财富管理学院资深顾问。

吴积民先生，董事，工商管理硕士，特许财务分析师。有逾二十年投资银行及资产管理经验，曾任职多个主要财务机构，包括汇丰银行及JP摩根。现任星展资产管理（香港）董事。

李伟强先生，独立董事，美国加州大学洛杉矶分校工商管理硕士，美国宾州州立大学政府管理硕士和法国文学硕士。曾任摩根士丹利纽约、新加坡、香港等地投资顾问、副总裁，花旗环球金融亚洲有限公司高级副总裁。现任香港国际资本管理有限公司董事长。

张仁良先生，独立董事，经济及金融学教授。曾为香港消费者委员会有关银行界调查的项目协调人，太平洋经济合作理事会（PECC）属下公司管制研究小组主席，上海交通大学管理学院兼职教授及上海复旦大学顾问教授。现为民政事务总署下的《伙伴倡自强》社区协作计划主席，为香港证监会的公股东权益小组服务。于2007年被委任为太平绅士。2009年获香港特区政府颁发铜紫荆星章。

荣兆梓先生，独立董事，经济学学士，教授；兼任黄山金马股份有限公司独立董事。曾任安徽省社会科学院副主编，现为安徽大学经济学院院长，校学术委员会委员，产业经济学和工商管理硕士点学科带头人；武汉大学商学院博士生导师，安徽省政府特邀咨询员；全国马经史学会常务理事，全国资本论研究会常务理事，安徽省经济学会常务理事。

陈华平先生，独立董事，博士毕业，教授，博士生导师。曾任中国科技大学信息管理与决策研究室主任、管理学院副院长，现任中国科学技术大学计算机学院执行院长，中国科技大学管理学院商务智能实验室主任。

2、基金管理人监事会成员：

沈和付先生，监事会主席，法学学士。曾任安徽省国际经济技术合作公司经理助理，安徽省信托投资公司法律部副主任。现为国元证券股份有限公司合规总监。

叶斌先生，监事，学士，高级经济师。曾任安徽大学管理系讲师、教研室副主任，历任安徽省信托投资公司部门经理、副总经理。现为安徽省中小企业信用担保中心副主任，安徽省信用担保集团有限公司副总经理。

钱进先生，监事，硕士研究生。曾任安徽省节能中心副主任、安徽省经贸投资集团董事、安徽省医药集团股份公司总经理。现为安徽省投资集团有限责任公司总经济师。

林良友先生，监事，学士。曾在花旗银行、瑞信出任要职。现为星展银行（香港）有限公司私人银行部业务主管。

张利宁女士，监事，学士。曾任华北计算技术研究所会计、太极计算机公司子公司北京润物信息技术有限公司主管会计，历任长盛基金管理有限公司业务运营部总监和财务会计部总监。现为长盛基金管理有限公司监察稽核部总监。

3、基金管理人高级管理人员

陈平先生，董事长，硕士。同上。

陈礼华先生，硕士，高级经济师。历任国务院财务税收物价大检查办公室、财政部国债司和国债金融司主任科员，华泰财产保险股份有限公司投资部研发处负责人、经理，南方基金管理有限公司总经理助理兼投资总监、投资交易总监，长盛基金管理有限公司副总经理等职。现任长盛基金管理有限公司总经理。

周兵先生，硕士，经济师。历任中国银行总行综合计划部副主任科员、香港南洋商业银行内地融资部副经理、香港中银国际亚洲有限公司企业财务部经理、广发证券股份有限公司北京业务总部副总经理（期间兼任海南华银国际信托投资公司北京证券营业部托管组负责人）、北京朝阳门大街证券营业部总经理等职。现任长盛基金管理有限公司副总经理。

杨思乐先生，伦敦政治经济学院会计与金融硕士。历任野村项目融资有限公司副经理；汇丰投资银行副经理；康联马洪资产管理公司投资经理；新加坡星展银行助理副总裁、副总裁；2007年8月起，加入长盛基金管理有限公司，现任长盛基金管理有限公司副总经理。

叶金松先生，大学，会计师。历任美菱股份有限公司财务部经理，安徽省信托投资公司财会部副经理，国元证券有限责任公司清算中心主任、风险监管部副经理、经理等职，现任长盛基金管理有限公司督察长。

4、基金经理

吴达先生，伦敦经济学院金融经济学硕士，美国特许金融分析师（CFA）。历任新加坡星展资产管理有限公司研究员、星展珊顿收益基金经理助理、星展增裕基金经理、专户投资经理、资产配置委员会委员；新加坡毕盛高荣资产管理公司专户投资组合经理、资产配置委员会成员；华夏基金管理有限公司国际策略分析师兼固定收益投资经理；2007年8月起加入长盛基金管理有限公司，现任国际业务部总监。

邓永健先生，英国兰卡斯特大学MBA，美国特许金融分析师（CFA）。历任欣佩投资管理有限公司基金经理；元大京华证券（香港）有限公司高级经理；大福资产管理有限公司副总监；星展资产管理（香港）有限公司总监/高级投资经理；加拿大宏利资产管理（香港）股票部行政总监。2007年12月加入长盛基金管理有限公司。

5、投资决策委员会成员

陈礼华先生，硕士，总经理，同上。

朱剑彪先生，金融学博士。历任广东商学院投资金融系教师、党支部书记；广州证券有限公司宏观与策略研究员、投资银行部项目经理、基金部经理；金鹰基金管理有限公司筹备组成员、董事会秘书、研究总监、投研副总监兼研究总监和督察长。2007年4月起加入长盛基金管理有限公司，现任总经理助理、社保业务管理部总监、固定收益部总监，社保组合组合经理。

潘九岩先生，硕士。曾任博时基金管理公司交易部任中央交易员，2002年起至今在长盛基金管理有限公司任职，先后担任交易主管、同智基金经理助理、交易部副总监，现在担任交易部总监。

白仲光先生，金融工程专业工学博士，2003年加入长盛基金管理有限公司，历任研究员、高级金融工程师、基金经理等职务。现任金融工程与量化投资部总监，长盛中证100指数基金基金经理。

吴达先生，伦敦政治经济学院金融经济学硕士，美国特许金融分析师CFA。曾就职于新加坡星展资产管理有限公司，历任星展珊顿全球收益基金经理助理、星展增裕基金经理；新加坡毕盛高荣资产管理公司亚太专户投资组合经理、资产配置委员会成员；华夏基金管理有限公司国际策略分析师、固定收益投资经理；2007年8月起加入长盛基金管理有限公司，现任国际业务部总监，长盛积极配置债券型证券投资基金基金经理。

戴春平先生，经济学博士。历任泰康保险资产管理中心投资经理、鹏华基金管理有限公司基金经理助理、中国人寿资产管理公司投资经理助理、融通基金管理公司投资决策委员会委员和融通新监筹基金经理。2009年10月加入长盛基金管理有限公司，现任投资管理部总监，长盛同德主题增长股票型证券投资基金基金经理。

李庆林先生，经济学硕士。曾先后在长城证券有限公司、国元证券有限公司和建信基金管理有限公司担任研究员等职务。2009年2月加入长盛基金管理有限公司，现任研究发展部副总监，长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

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、编制基金季度报告、中期和年度基金报告；

7、计算基金资产净值并公告基金份额净值和基金份额累计净值，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）基金管理人承诺

1、严格遵守《基金法》及相关法律法规，建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止违反上述法律法规行为的发生；

2、防止下列禁止行为的发生：

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牟取利益；

④向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；

⑤依照法律、行政法规有关规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他行为。

3、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不能利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者谋取利益；

③不泄露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不协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

（五）基金管理人的内部控制制度

1、内部控制的原则

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。公司各部门和岗位职责保持相对独立，基金资产、公司自有资产、委托理财及其他资产的运作应当分离。

④相互制约原则。公司及各部