（上接D11版）

18）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实施其他法律行为；

19）组织并参加基金财产清算组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

20）因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人的合法权益，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

21）基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

22）确保基金投资于中国证监会规定的金融产品或工具，严格按照《基金法》、《试行办法》、基金合同及有关法律法规有关投资范围和比例限制的规定确定清晰、可执行的投资范围和投资比例，并在规定时间内，对超范围、超比例的投资进行调整；

23）承担受信责任，在挑选、委托投资顾问过程中，履行尽职调查义务，对其委托的境外投资顾问及其他第三方机构的相关事项的法律后果承担责任。

24）法律法规、中国证监会和外管局根据审慎监管原则规定的其他职责以及基金合同规定的其他义务。

2、基金托管人

（1）基金托管人基本情况

名称：中国银行股份有限公司

住所：北京市复兴门内大街1号

法定代表人：肖钢

成立日期：1983年10月31日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字［1998］24号

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币贰仟伍佰叁拾捌亿叁仟玖佰壹拾陆万贰仟零玖元

存续期间：持续经营

经营范围：吸收人民币存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；从事同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱服务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外币兑换；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；发行和代理发行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代客外汇买卖；外汇信用卡的发行和代理国外信用卡的发行及付款；资信调查、咨询、见证业务；组织或参加银团贷款；国际贵金属买卖；海外分支机构经营与当地法律许可的一切银行业务；在港澳地区的分行依据当地法令可发行或参与代理发行当地货币；经中国人民银行批准的其他业务。

（2）基金托管人的权利

1）依据法律法规和基金合同的规定安全保管基金财产；

2）依照基金合同的约定获得基金托管费；

3）监督基金管理人对本基金的投资运作；

4）在基金管理人职责终止时，提名新的基金管理人；

5）依据法律法规和基金合同的规定召集基金份额持有人大会；

6）选择、更换境外托管人并与之签署有关协议；

7）法律法规、基金合同规定的其它权利。

（3）基金托管人的义务

1）安全保管基金财产，准时将公司行为信息通知基金管理人，确保基金及时收取所有应得收入；

2）设立专门的基金托管部，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产境内托管事宜；

3）按规定开设基金财产的资金帐户和证券帐户；

4）除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益；

5）对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整和独立；

6）按照有关法律法规和基金合同的规定以受托人名义或其指定的代理人名义登记资产；

7）每月结束后7个工作日内，向中国证监会和外管局报告基金境外投资情况，并按相关规定进行国际收支申报；

8）办理基金的有关结汇、售汇、收汇、付汇和人民币资金结算业务；

9）选择符合《试行办法》第十九条规定的境外托管人。对基金的境外财产，可授权境外托管人代为履行其承担的受托人职责。境外托管人在履行职责过程中，因本身过错、疏忽等原因而导致基金财产受损的，托管人应当承担相应责任；

10）保管《或委托境外托管人》由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

11）保存基金托管业务活动的记录、帐册、报表和其他相关资料；

12）按照基金合同的规定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

13）保守基金商业秘密。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予以保密，不得向他人泄露；

14）办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

15）对基金财务会计报告、半年度和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人有未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

16）保存基金份额持有人名册；

17）复核基金管理人计算的基金财产净值、基金份额净值和基金份额申购、赎回价格；

18）按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

19）依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；

20）按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；

21）按照规定监督基金管理人的投资运作；

22）因过错违反基金合同导致基金财产损失，应承担赔偿责任，其责任不因其退任而免除；除法律法规另有规定外，基金托管人不承担连带责任；

23）基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金向基金管理人追偿；

24）对其委托第三方机构相关事项的法律后果承担责任；

25）法律法规、中国证监会和外管局规定的其他职责以及基金合同规定的其他义务。

3、基金份额持有人

（1）基金投资者购买本基金基金份额的行为即视为对基金合同的承认和接受，基金投资者自依据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。基金份额持有人作为当事人并不以在基金合同上书面签章为必要条件。每份基金份额具有同等的合法权益。

（2）基金份额持有人的权利

1）分享基金财产收益；

2）参与分配清算后的剩余基金财产；

3）依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；

4）按照规定要求召开基金份额持有人大会；

5）出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；

6）查阅或者复制公开披露的基金信息资料；

7）监督基金管理人的投资运作；

8）对基金管理人、基金托管人、招募书合法权益的行为依法提起诉讼；

9）法律法规、基金合同规定的其它权利。

（3）基金份额持有人的义务

1）遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；

2）缴纳基金认购、申购款项及法律法规和基金合同规定的费用；

3）在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；

4）不从事任何有损基金及其他基金份额持有人合法利益的活动；

5）执行基金份额持有人大会的决议；

6）返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人、基金托管人、各自委托的第三方机构及其他基金份额持有人处获得的不当得利；

7）基金份额持有人应遵守基金管理人、基金托管人、代理销售机构和注册登记机构的相关交易及业务规则；

8）法律法规及基金合同规定的其他义务。

（二）基金份额持有人大会

1、本基金的基金份额持有人大会，由本基金的基金份额持有人和或其合法授权代表组成。基金份额持有人持有的每一基金份额具有同等的投票权。

2、有以下事由情形之一时，应召开基金份额持有人大会：

（1）终止基金合同，但基金合同另有约定的除外；

（2）转换基金运作方式；

（3）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；

（4）更换基金管理人、基金托管人；

（5）变更基金类别；

（6）变更基金投资目标、范围或策略；

（7）变更基金份额持有人大会程序；

（8）本基金与其它基金合并；

（9）对基金合同当事人权利、义务产生重大影响，需召开基金份额持有人大会的变更基金合同等其他事项；

（10）法律法规或中国证监会规定的其它应当召开基金份额持有人大会的事项。

3、以下情况不需召开基金份额持有人大会，可由基金管理人和基金托管人协商后修改基金合同：

（1）调低基金管理费、基金托管费；

（2）在法律法规和基金合同规定的范围内变更本基金的申购费率或收费方式、调低赎回费率；

（3）因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改；

（4）对基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化；

（5）对基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；

（6）经中国证监会允许，基金管理人、注册登记机构、代销机构在法律法规规定的范围内调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则；

（7）在不违反法律法规规定的情况下，接受其它币种的申购、赎回；

（8）除法律法规或基金合同规定应当召开基金份额持有人大会以外的其它情形。

4、召集方式：

（1）除法律法规另有规定或基金合同另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。

（2）基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起十日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。

基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起六十日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当自行召集。

（3）代表基金份额百分之十以上的基金份额持有人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起十日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。

基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起六十日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额百分之十以上的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。

基金托管人应当自收到书面提议之日起十日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起六十日内召开。

（4）代表基金份额百分之十以上的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，代表基金份额百分之十以上的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前三十日报中国证监会备案。

（5）基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

（6）基金份额持有人大会的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

5、通知

召开基金份额持有人大会，召集人应当于会议召开前30天在至少一种指定媒体上公告。基金份额持有人大会不得就未经公告的事项进行表决。基金份额持有人大会通知将至少载明以下内容：

（1）会议召开的时间、地点、方式；

（2）会议拟审议的主要事项、议事程序和表决方式；

（3）会议形式；

（4）代理投票的授权委托书的内容要求（包括但不限于代理人身份、代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；

（5）出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；

（6）会务常设联系人姓名、电话；

（7）权益登记日；

如采用通讯表决方式，则载明具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见的寄交和收取方式、投票表决的截止日以及表决票的送达地址等内容。

6、开会方式

基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会。现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委派其代理人出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席，基金管理人或基金托管人不派代表出席的，不影响表决效力；通讯方式开会指按照基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。会议召开方式由召集人确定，但决定基金管理人更换或基金托管人的更换、转换基金运作方式和提前终止基金合同事宜必须以现场开会方式召开基金份额持有人大会。

现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

（1）亲自出席会议者持有基金份额的凭证和受托出席会议者出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、本基金合同和会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的注册登记资料相符；

（2）经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，全部有效凭证所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的50%以上（含50%，下同）。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

（1）召集人按基金合同规定公告会议通知后，在两个工作日内连续公布相关提示性公告；

（2）召集人按本基金合同规定通知基金托管人或和基金管理人（分别或共同称为“监督人”）到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；

（3）召集人在监督人和其聘请的公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取和统计基金份额持有人的书面表决意见，如监督人经通知拒不到场监督的，不影响表决效力；

（4）本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的50%以上（含50%）；

（5）直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的其它代表，同时提交的持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的注册登记资料相符；

（6）会议通知公布前已报中国证监会备案。

如果开会条件达不到上述的条件，则召集人可另行确定并公告重新表决的时间（至少应在25个工作日后），且确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日不变。

7、议事内容与程序

（1）议事内容及提案权

1）议事内容限为本条前述第（二）款规定的基金份额持有人大会召开事由范围内的事项。

2）基金管理人、基金托管人、代表基金份额10%以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案。

3）对于基金份额持有人提交的提案，大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

a、关联性。大会召集人对于基金份额持有人提案涉及事项与基金有直接关系，并且不超出法律法规和基金合同规定的基金份额持有人大会职权范围的，应提交大会审议；对于不符合上述要求的，不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决，应当在该次基金份额持有人大会上进行解释和说明。

b、程序性。大会召集人可以对基金份额持有人的提案涉及的程序性问题作出决定。如将其提案进行分拆或合并表决，需征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会作出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

4）单独或合并持有权益登记日基金总份额10%以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，或基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获得基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于六个月。法律法规另有规定的除外。

5）基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后，如果需要对原有提案进行修改，应当在基金份额持有人大会召开前30日及时公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少与公告日期有30日的间隔期。

6）基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

（2）议事程序

在现场开会的方式下，由召集人授权代表主持。首先大会主持人按照规定程序宣布会议议事程序及注意事项，确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议，报经中国证监会核准或备案后生效；在通讯表决开会的方式下，首先由召集人在会议通知中公布提案，在所通知的表决截止日期后第二个工作日由大会聘请的公证机关的公证员统计全部有效表决并形成决议，报经中国证监会核准或备案后生效。

8、表决

（1）基金份额持有人所持每份基金份额享有平等的表决权。

（2）基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1）特别决议

对于特别决议应当经参加大会的基金份额持有人（或其授权代表）所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方为有效。

2）一般决议

对于一般决议应当经参加大会的基金份额持有人（或其授权代表）所持表决权的百分之五十以上（含百分之五十）通过方为有效。

更换基金管理人或者基金托管人、转换基金运作方式或终止基金合同应当以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，符合会议通知规定的书面表决意见即视为有效表决。

基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

（3）采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则表面符合法律法规、基金合同和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决；表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

9、计票

（1）现场开会

1）基金份额持有人大会的主持人为召集人授权出席大会的代表，如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中推举两名基金份额持有人代表与一名监督员（如果基金管理人为召集人，则监督员由基金托管人授权的人员担任；如基金托管人为召集人，则监督员由基金管理人授权的人员担任）共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和或授权代表中推举两名基金份额持有人代表与基金管理人、基金托管人授权的一名监督员共同担任监票人，但如果基金管理人和基金托管人的授权代表未出席，则大会主持人可自行选举三名基金份额持有人代表担任监票人。

2）监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。

3）如果会议主持人对于提交的表决结果有怀疑，可以对所投票数进行重新清点；如果会议主持人未进行重新清点，而出席会议的基金份额持有人或者基金份额持有人代理人对会议主持人宣布的表决结果有异议，其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点，会议主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

4）在基金管理人或基金托管人担任召集人的情形下，如果在计票过程中基金管理人或者基金托管人拒不配合的，则参加会议的基金份额持有人有权推举三名基金份额持有人代表共同担任监票人进行计票。

如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。

（2）通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式可采取如下方式：

由大会召集人聘请的公证机关的公证员进行计票。

10、生效与公告

（1）基金份额持有人大会按照《基金法》有关规定表决通过的事项，召集人应当自通过之日起五日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

（2）生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有法律约束力。基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决定。

（3）基金份额持有人大会决议应当自中国证监会核准或出具无异议意见后2日内，由基金份额持有人大会召集人在指定媒体公告。

（4）如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机关、公证员姓名等一同公告。

11、法律法规或监管机关对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。

（三）基金的收益与分配

1、基金利润的构成

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基金费用和税收后的余额；基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

2、基金可供分配利润

基金可供分配利润指截至收益分配基准日资产负债表中基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

3、收益分配原则

基金收益分配是指按规定将基金的可供分配利润按基金份额进行比例分配。

本基金的每份基金份额享有同等分配权；

收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由基金份额持有人自行承担。当投资人的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金注册登记机构可将投资人的现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额；

（3）本基金收益分配方式

1）本基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式，基金份额持有人可自行选择收益分配方式；基金份额持有人事先未做出选择的，默认的分红方式为现金红利；

2）分红方式的设置与变更

具体规定在招募说明书中列示。

4）在符合基金收益分配条件的情况下，本基金收益每年最多分配6次，每次基金收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的10%；

5）若基金合同生效不满3个月则可不进行收益分配；

6）基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过15个工作日；

7）基金收益分配后每一基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

8）法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

4、收益分配方案

基金收益分配方案中载明基金收益的范围、基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式及有关手续费等内容。

5、收益分配方案的确定与公告

基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人核实后确定，基金管理人按法律法规的规定向中国证监会备案并公告。

6、收益分配中发生的费用

（1）收益分配采用红利再投资方式免收再投资的费用。

（2）收益分配时发生的银行转账等手续费用由基金份额持有人自行承担。当基金份额持有人的现金红利小于一定金额，不足于支付银行转账或其他手续费用时，基金注册登记机构可将基金份额持有人的现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。、

（四）基金的费用

1、基金费用的种类

（1）基金管理人的管理费，含境外投资顾问取取的费用；

（2）基金托管人的托管费，含境外托管人收取的费用；

（3）基金的证券交易和清算费用；

（4）基金合同生效以后的信息披露费用；

（5）基金份额持有人大会费用；

（6）基金合同生效以后的会计师费和律师费；

（7）基金的资金汇划费用；

（8）外汇兑换交易的相关费用；

（9）在证监会规定允许的前提下，本基金可以从基金财产中计提销售服务费，具体计提方法、计提标准在招募说明书或相关公告中载明；

按照国家有关规定可以列入的其他费用。

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，包括投资顾问费）按基金财产净值的1.5%年费率计提。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金财产净值的1.5%年费率计提。计算方法如下：

H=E×1.5%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金财产净值

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10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，包括向境外托管人其支付的相应服务费）按基金财产净值的0.3%年费率计提。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金财产净值的0.3%年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.3%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金财产净值

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10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）款至第3至第10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

本条第（一）款约定以外的其他费用，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，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。

4、基金费用调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费、基金托管费，无须召开基金份额持有人大会。

5、税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，依照国家法律法规和基金投资所在地的法律法规的规定履行纳税义务。

（五）基金的投资

1、投资目标

本基金通过投资于发达市场交易型开放式基金（ETF）等金融工具，在国际范围内分散投资风险，追求基金资产长期增值。

2、基准货币

本基金的基准货币是人民币。

3、投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的交易型开放式基金（ETF）、债券、货币市场工具以及中国证监会允许本基金投资的其他金融工具。其中，ETF的标的市场是美洲、欧洲、及亚太地区的发达国家和地区。具体为澳大利亚、奥地利、比利时、加拿大、丹麦、芬兰、法国、德国、希腊、香港特别行政区、爱尔兰、意大利、日本、荷兰、新西兰、挪威、葡萄牙、新加坡、西班牙、瑞典、瑞士、英国和美国。

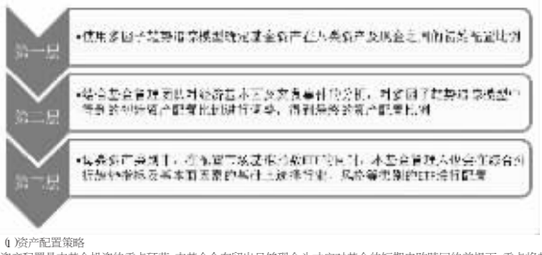
本基金各类资产配置的比例范围为：ETF占基金资产的比例为60%-95%，债券、现金及中国证监会允许的其它投资品种的比例为基金资产的5%-40%（现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%）。

如与中国证监会签订双边监管合作谅解备忘录的国家或地区增加、减少或变更，根据有关法律法规，本基金投资的证券市场范围将作相应调整。如果业绩比较基准中成熟市场的覆盖发生变动，本基金投资的证券市场范围亦将作相应调整。在有关法律法规发生变动时，本基金资产配置比例等应作相应调整。

4、投资策略

本基金的投资策略主要分为资产配置策略和单个金融产品选择策略两个部分，其中，将基金资产在全球成熟金融市场的股票类资产和债券类资产之间进行配置将是本基金获取超额收益的主要来源。

从具体运作来说，本基金的投资策略又分为以下三个层次：



（1）资产配置策略

资产配置是本基金投资的重点环节，本基金会在留出足够现金头寸应对基金的短期申购赎回的前提下，重点将基金资产在以下大大类别资产之间进行动态配置，分别是：美国股票、日本股票、欧洲成熟市场股票、亚太成熟市场股票（除日本外）、美国债券、欧洲债券、美国通胀关联债券和欧洲通胀关联债券。

本基金的初步资产配置将在运用本基金管理人与境外投资顾问共同开发的多因子趋势追踪系统分析的基础上，结合本基金投研团队对相关资产类别未来趋势的判断确定。具体流程如下：

1）多因子趋势追踪模型介绍

本基金管理人与境外投资顾问共同开发的多因子趋势追踪系统是本基金整体投资策略的重要组成部分。该系统通过对相关资产类别的动量因子，基本面因子的量化分析，来确定一定时期较为强势的资产类别，综合风险和相关性的分析，确定各个资产类别的初始配置权重，把握上涨趋势，避开下跌趋势。基金成立初期，本模型的计算主要由境外投资顾问完成。

A、动量策略

动量效应（momentum）是建立在行为金融学理论基础之上的一种统计规律，所谓动量效应是指如果某只证券或者某个证券组合在前一段时期表现较好，那么，下一段时期该证券或者证券投资组合仍将有良好表现。

本基金投资过程中资产动量的分析主要是采用投资顾问开发的合成期权分析方法，通过对各类资产类别历史收益率、波动率等指标的系统分析，把握资产的上涨趋势，避开资产的下跌趋势，并得到该类资产的预期收益率。

B、组合收益/风险优化过程

在第一步分析的基础上，本基金将使用基于均值/方差方法的组合优化模型确定相关资产类别的初始配置权重。

通过前面的分析，本基金管理人形成对相关资产类别预期收益率的判断，再结合通过历史波动率及相关衍生品隐含波动率的分析形成本基金预期波动率的判断，以及不同资产类别之间相关性的判断等，在风险控制指标的约束下，运用马克维茨均值/方差的分析方法确定相关资产类别的初始配置比例。

C、基本面因子分析

在以上分析的基础上，本基金会进一步借助境外投资顾问的宏观量化分析体系，综合考虑相关市场宏观经济，资本市场及经济政策等因子，根据当期特定市场环境，以及不同资产类别的特点，采用数量化的方法，对优化过程形成的初始配置权重进行调整。

本基金所涉及的部分基本面因子如下表所示：

宏观经济	资本市场
工业增加值；信心指数；	全市场ROE、EV/EBITDA；
生产消费物价指数；	利润率；
市场利率；大宗商品价格等	估值指标；股息率等

D、基金管理人的分析与判断

在多因素趋势追踪模型分析的基础上，本基金管理人将综合考虑模型分析结果、经济基本面因素及市场突发事件等，确定本基金资产配置的目标权重。

在这个过程中，本基金管理人将以模型分析的结果为主。同时辅之以对于无法量化的基金基本面指标的分析，如部分经济政策、经济周期指标等，以及对未来趋势的判断来对模型分析结果进行调整。

但是，在市场出现突发事件或某些特定的市场环境下，本基金将主要依靠基金管理团队对于相关突发事件和市场环境的分析来确定基金的资产配置，此时，资产配置的结果可能会与多因子趋势分析模型的结论有较大差异。

（2）ETF选择策略

本基金每个资产类别下ETF个券的选择主要分为两个部分：首先，本基金为全球资产配置型基金，因此，在确定了资产配置的比例后，本基金将在每个资产类别下重点配置跟踪该类别市场基准指数的ETF；另外，考虑到相关市场ETF发展的实际情况，当入选资产类别为股票类资产时，本基金管理人也会在控制风险的同时，积极配置该资产类别下的行业，主题和风格等子类别的ETF，以提高基金业绩，为投资者获得超额收益。

1）市场基准指数ETF的选择

对于市场基准类指数ETF，本基金选择的标准如下：

A、跟踪指数的市场代表性

ETF跟踪的标的指数需有较高的市场代表性和知名度，能够反映标的市场的整体收益水平等。

B、规模和流动性

基金规模的大小决定了其长期的生命力。同时，本基金主要在二级市场上买卖ETF；相关二级市场的有效性非常重要。本基金将优先选择二级市场交易量大或有强大做市商的ETF。

C、费率和税率

在其它条件相同的情况下，本基金将优先选择费率和税率较低的ETF。

D、跟踪误差

跟踪误差是衡量ETF基金的重要指标之一，跟踪误差小代表指数的拟合效果好，以及管理人较高的投资运作水平。本基金优先选择跟踪误差更小的ETF。

E、管理人经验

基金管理人需要具有丰富的ETF运作经验，并且，该基金的管理和研究团队应该有长期良好的历史记录，人员稳定。同时，该基金管理人应该具有稳健良好的财务状况，有良好的风险控制制度和记录。本基金将优先选择该类管理人管理的ETF。

2）子类别ETF的选择

当入选的资产类别为股票类资产时，本基金会积极配置该市场上的行业，主题，风格等子类别ETF，子类别ETF的选择在考虑以上ETF选择标准的基础上，还将另外考虑以下指标：

A、动量指标

本基金将采用动量方法分析相关子资产类别下的ETF，选择动量表现较好的子类别进行配置。

B、基本面因素

本基金在选择子类别ETF时，将会依据相关子类别的基本面因素，如估值水平，成长前景，比较优势等因素，辅助投资决策。

（3）债券投资策略

考虑到债券相关ETF的流动性总体来说不如股票型ETF，因此，当入选类别为债券类资产时，本基金将可能部分直接投资于债券。具体投资债券的策略采用“自上而下”和“自下而上”相结合的方法：

1）自上而下的配置

对该资产类别中涉及的国家/地区的宏观经济进行分析，包括对通货膨胀、GDP增长、国际贸易、外汇储备、投资者信心、储蓄等数据的研究，及对全球市场经济发展的判断，来分析汇率和利率的发展趋势，在此基础上确定对收益率曲线的进行分析和预测，确定最优化的组合久期。

2）自下而上的个券选择

在公司固定收益团队研究支持下，对个券进行分析，确定具体配置的个券品种。

5、业绩比较基准

50%MSCI全球指数（此处指全收益指数）+50%花旗全球政府债券指数

MSCI全球指数（MSCI World Index）是MSCI Barra指数公司编制的自由流通市值加权指数，主要用来衡量全球发达市场的表现。截至2010年2月，MSCI全球指数包含23个发达国家市场，分别为：澳大利亚、奥地利、比利时、加拿大、丹麦、芬兰、法国、德国、希腊、香港特别行政区、爱尔兰、意大利、日本、荷兰、新西兰、挪威、葡萄牙、新加坡、西班牙、瑞典、瑞士、英国和美国。共1654家上市公司，总市值共计21万亿美元。

花旗全球政府债券指数（World Government Bond Index）是由花旗集团指数部门采用市值加权的方法编制，包括23个国家的政府债券，包括：澳大利亚、奥地利、比利时、加拿大、丹麦、芬兰、法国、德国、希腊、爱尔兰、意大利、日本、马来西亚、荷兰、挪威、波兰、葡萄牙、新加坡、西班牙、瑞典、瑞士、英国和美国。

当市场出现更合适，更权威的比较基准时，经基金托管人同意，本基金管理人履行适当的程序后，可以选用新的比较基准，并将及时公告。

6、风险收益特征

在正常市场情况下，本基金的风险收益特征类似于全球平衡型基金，属于中等预期风险和收益的证券投资品种，其预期风险和收益水平低于全球股票型基金，高于债券基金和货币市场基金。

在部分极端市场情况下，本基金存在策略失效的风险，此时的预期风险水平可能会显著增加。

有关本基金详细的风险揭示及风险管理方法请见本基金招募说明书相关部分。

7、投资限制

（1）持有同一家银行的存款不得超过本基金净值的20%。在基金托管账户的存款可以不受上述限制。

（2）本基金持有非流动性资产市值不得超过基金净值的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。

（3）本基金投资基金资产的比例，不得低于基金净值的60%。

（4）每只境外基金投资比例不超过本基金资产净值的20%。本基金投资境外伞型基金的，该伞型基金应当视为一只基金。

（5）本基金不得投资于以下基金：

1）其他基金中基金；

2）联接基金（A Feeder Fund）；

3）投资于前述两项基金的伞型基金子基金。

（6）中国证监会对投资限制的其他规定。

若超过上述第（1）项—第（6）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。

8、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财产净值的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）向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；

（12）买卖与其基金管理人、基金托管人、境外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。

（13）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；

（14）不公平对待不同客户或不同投资组合。

（15）除法律法规规定以外，向任何第三方泄露客户资料。

（16）依照法律法规有关规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

9、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。

10、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。

11、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债权人权利，保护基金投资者的利益；

（2）有利于基金财产的安全与增值。

（六）基金财产的估值

1、估值目的

基金财产的估值目的是客观、准确地反映基金财产的价值，确定基金财产净值，并为基金份额的申购与赎回提供计价依据。

2、估值频率

基金合同生效后，每个工作日对基金财产进行估值，T+1日完成T日估值。

3、估值对象

本基金所拥有的股票和银行存款本息、应收款项和其它投资等资产。

4、估值方法

（1）已上市流通的有价证券，以其所挂牌证券交易所估值日的收盘价估值，估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。

（2）对于非上市证券，参照主要做市商或其他权威价格提供机构的报价进行估值，即首选按估值日的最近买价估值。

（3）在任何情况下，基金管理人如采用本项第1、2小项规定的方法对基金财产进行估值，