富国全球债券证券投资基金招募说明书(更新)(摘要)

(二0一一年第一号)

富国全球债券证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督委员会2010年9月2日证监许可[2010]1200号文核准募集。本基金的基金合同于2010年10月20日正式生效。

【重要提示】

投资有风险,投资人拟申购本基金时应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,应充分考虑投资人自身的风险承受能力,并对于申购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则,在投资人作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资人自行负责。

本基金投资于境外证券市场,基金净值会因为境外证券市场波动等因素产生波动。在投资本基金前,投资者应全面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,对认购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策,获得基金投资收益,并承担基金投资中出现的风险,基金在投资运作过程中可能面临各种风险,既包括市场风险,也包括基金自身的管理风险、投资风险、交易对手风险、运作风险和合规与道德风险等。巨额赎回风险是开放式基金所特有的一种风险,即当单个交易日基金的净赎回申请超过基金总份额的百分的十时,投资人将可能无法及时赎回持有的全部基金份额。投资有风险,投资者认购(或申购)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。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成新基金业绩表现的保证。

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资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

本摘要根据本基金的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,应详细查阅本基金的基金合同。

本招募说明书所载内容截止至2011年4月20日,基金投资组合报告截止至2011年3月31日(财务数据未经审计)。

一、基金的名称

富国全球债券证券投资基金

二、基金的类型

契约型开放式

三、基金的投资目标

本基金主要投资于全球债券市场,通过运用基金中基金(FOF:fund of funds)这种国际流行的投资管理模式,力争实现资产运作细分化、组合配置最优化、风险管理精细化、风险调整后收益最大化,从而谋求基金资产的长期稳定增值。

四、基金的投资方向

本基金的投资范围包括但不限于在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境外债券型及货币型交易型开放式指数基金(债券型及货币型ETF),主动管理的债券型及货币型公募基金,公开发行、上市的债券,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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其它品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金投资组合比例为:债券型交易型开放式指数基金(债券型ETF)、主动管理的债券型公募基金、债券合计不低于基金资产的80%,投资于基金的部分不低于本基金基金资产的60%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

本基金的基金资产将投资于全球主要证券市场,主要投资于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的证券市场,投资于与中国证监会签署双边监管合作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超过基金资产净值的10%。与中国证监会签署双边监管合作备忘录国家或地区如下表所示:

所属大洲	国家或地区			
北美洲	美国	加拿大		
南美洲	巴西	阿根廷		
欧洲	英国	乌克兰	法国	卢森堡
	德国	意大利	荷兰	比利时
	瑞士	葡萄牙	罗马尼亚	土耳其
	挪威	列支敦士登	俄罗斯	爱尔兰
	奥地利	西班牙	马耳他	
亚洲	香港	新加坡	日本	马来西亚
	韩国	印度尼西亚	越南	印度
	约旦	阿联酋	泰国	蒙古
	迪拜	台湾	科威特	
大洋洲	澳大利亚	新西兰		
非洲	埃及	南非	尼日利亚	

如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增加、减少或变更,本基金投资的主要证券市场相应调整。

五、基金的投资策略

本基金采用战略资产配置与战术资产配置相结合的策略,通过“自上而下”的方式进行资产配置,在有效分散风险(即:分散投资于单一国家或区域债券基金、单一债券类型基金以及单一基金公司及经理人的投资风险)的同时,力争实现基金资产风险调整后收益最大化。在本基金资产组合的构建过程中,根据不同投资标的的投资等级和波动性等特征,基金资产被区分为核心资产和卫星资产。

(一)资产配置策略

在大类资产配置层面,本基金主要通过战略资产配置策略与战术资产配置策略有机结合的方式进行投资管理。

本基金战略资产配置(SAA)的投资标的和配置比例以业绩比较基准-巴克莱全球债券指数(Barclay Global Aggregate Index)为基础。战略资产配置策略是决定基金资产长期收益和波动率的关键,也是实现本基金投资目标的根本,其目的是通过分散投资有效降低投资组合风险。因此,本基金战略资产配置策略将落实在核心资产配置上。

本基金核心资产配置主要着眼于投资等级债券共同基金的低波动特性,并以投资等级债券基金为主要资产配置工具。核心资产配置比例将参考巴克莱全球债券指数资产配置比例。

本基金战术资产配置(TAA)将根据市场形势,对基金资产组合进行动态调整。战术资产配置主要决策因素包括:各区域与国家的景气周期、总体经济指标、货币政策、利率水平、信用市场的利差变化等。本基金在对上述因素进行充分研究后,确定卫星资产配置和调整方案。

本基金卫星资产配置着眼于投资品种的弹性和高票息收入,以ETF等较具弹性的短期投资工具,投资于高票息的新兴市场债券或高收益债券的债券基金等为主要配置工具。特别是部分新兴市场的政治经济稳定度在逐步提升,其主权评级一经调升将会引发新兴市场债券价格的上扬。同样,高收益债券也存在评级获得调升的潜在可期收益。

本基金投资的各类债券型基金定义如下:

1、投资等级债券基金是以经国际主要评等机构(如标准普尔、穆迪及惠誉等)评为投资等级的政府债券、公司债以及其他固定收益品种(如房地产抵押债券、金融抵押债券等)为主要投资目标的债券基金,例如美国投资等级债券基金、欧洲投资等级债券基金等。

2、高收益债券基金是以经国际主要评等机构评为非投资等级公司债为主要投资目标的债券基金,例如美国高收益债券基金、欧洲高收益债券基金等。

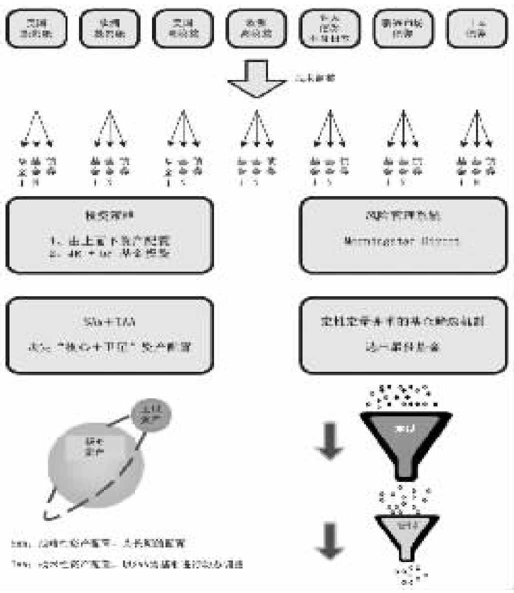
3、亚太地区(不含日本)债券基金是以亚太地区或国家的政府公债及公司债为主要投资目标的债券基金。

4、日本债券基金是以日本的政府公债及公司债为主要投资目标的债券基金。

5、新兴市场债券基金是以新兴市场国家的政府公债及公司债为主要投资目标的债券基金。

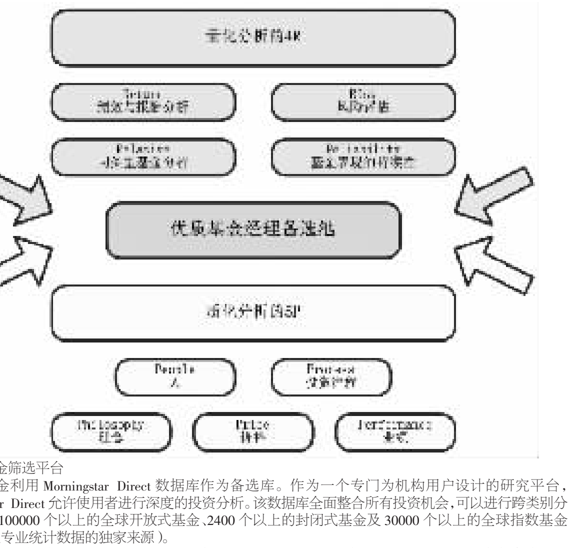
本基金投资主体示意图

(债券型基金与债券)



(二)基金配置策略

基金评选流程



1、基金筛选平台

本基金利用Morningstar Direct数据库作为备选库。作为一个专门为机构用户设计的研究平台,Morningstar Direct允许使用者进行深度的投资分析。该数据库全面整合所有投资机会,可以进行跨类别分析,包括100000个以上的全球开放式基金、2400个以上的封闭式基金及30000个以上的全球指数基金(其为晨星专业统计数据的独家来源)。

基于此平台,本基金管理人能够进行以持仓、收益为基础的风格分析,进行深入的同业/竞争力分析和透彻的经理业绩评价,同时对投资进行有效监测和报告。

本基金首先筛选出合适的候选基金。除收益外,本基金管理人还关注其规模大小、投资组合的特征(信用评级、久期、流动性等)以及是否符合本基金投资理念和投资范围等。

2、定量分析

本基金利用十个定量因素对可投资基金进行打分,每只基金依据在过往选定的时间窗口内这十项指标的表现,可获取相应分数,而十项指标得分按照各自权重的加总就是这只基金的总得分,依据这个总分我们进行基金排名,得出定量分析的结果。

这十项指标包含分析基金风险的标准差,跟踪误差,下跌标准差及分析基金收益特征及与同类型基金比较的Alpha,收益,信息比率,升市捕捉(Up-Market Capture),跌市捕捉(Down-Market Capture),上升潜力比率及下跌风险保护。各项指标的权重由投资团队根据投资经验和定量分析结果决策确定,并定期进行回顾、有效性检验和调整。

3、定性分析

本基金可向经过定量分析得出的备选基金池中的基金公司发出询问书(RFP,Request for Proposal),询问书内容包含五十多个问题,这些问题主要用来具体分析每个备选基金基金管理人在理念、过程、人、业绩和价格这5项指标(5P)的表现,这项分析的主要目标是评估基金公司是否具有可持续发展的模式,最终用以评估旗下基金重复以往业绩的概率。

定性分析具体内容包含:

(1)理念:这个项目主要考察基金公司的股东结构,管理层的经营哲学,公司业务拓展目标,以及是否为员工提供合理的激励机制等因素;

(2)过程:这个项目主要考察基金的风格与策略是否具有一致性,投资组合的建构方法是否严谨,基金的运作是否合法合规,是否有适当的风险管理与控制等因素;

(3)人:这个项目主要考察人员的流动,员工的素质与从业经历,资源的分配与组织架构等因素;

(4)业绩:这个项目主要考察基金超额收益的来源,分析历史业绩的优缺点,业绩表现的稳定性等因素;

(5)价格:这个项目虽然重要但并不是最关键的因素,我们在了解费用结构后,可以就不同的基金经理人进行比较,以分析其合理性。

4、现场尽职调查

本基金管理人可对可投资基金的管理公司进行现场尽职调查,以确定其对询问书(RFP)反馈的真实性。本基金管理人将着重讨论研究过程、考核组合经理、合规和运作过程。

5、最终决定

在对现场考察书面报告进行审查后,本基金管理人将综合考虑5P、访谈记录、各种约束和投资方针以及监管要求,得出最终投资基金名单。

6、业绩回顾与监测

季度监测:本基金管理人对每个基金的业绩进行季度考评,就滚动的一年期业绩与基准比较或者和第三方定义的可比均值比较。根据季度监测报告的分析,若基金的业绩没有达到相关标准,将根据下列准则被纳入不同观察名单:

红色区——基金近6个月未能达到基准和同业水平。

黄色区——基金近3个月未能达到基准和同业水平。

任何在此名单上的基金将被密集追踪,如果连续两个季度出现在红色区名单上,且无合理解释时,则将进行替换。

(三)债券投资

本基金将根据需要适度进行债券投资。债券投资将作为债券基金投资的补充,以优化流动性管理、分散投资风险为主要目标。本基金将主要投资于信用等级为投资级以上的债券。

(四)金融衍生品投资

本基金将以投资组合避险或有效管理为目标,在基金风险承受能力许可的范围内,本着谨慎原则,适度参与衍生品投资。衍生品投资的主要策略包括:利用汇率衍生品,降低基金汇率风险;利用指数衍生品,降低基金的市场整体风险等。

本基金主要投资于在经中国证监会认可的交易所上市交易的金融衍生品,当这些交易所没有本基金需要的衍生产品时,在严格风险控制的前提下,本基金将采用场外交易市场(OTC)买卖衍生产品。

(五)股票型基金投资

当本基金管理人判断市场出现明显的趋势性投资机会时,本基金可以适度投资主动管理的股票型基金、股票型交易型开放式指数基金(股票型ETF),从而努力获取超额收益。

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:Barclay Global Aggregate Index。

Barclay全球债券指数是Barclay债券系列指数之一,用以衡量全球主要债券资产的表现。该指数主要由其美国全债指数(US Aggregate Index)、泛欧全债指数(Pan-European Aggregate Index)、亚太全债指数(Asian-Pacific Aggregate Index)组成,广泛包含三大区块的各种不同等级、产业及久期的债券。该指数每日追踪成份债的到期与新发行,进行必要替换,并以每月最后一个交易日的成份债作为下月价格计算的标准,亦即该指数再平衡的频率是以月为单位。截止至2010年5月底,巴克莱全球债券指数成分债资产配置中,按所属区域划分,美国占38.8%,欧洲占32.6%,亚太占22.8%,其他占5.8%;按资产类别划分,国债占52.2%,信用债占20.3%,证券化债占18.2%,机构和地方政府债占9.3%;按评级情况划分,Aaa级占53.2%,Aa级占30.3%,A级占10.2%,Baa级占6.3%。

本基金的业绩比较基准将在业绩评价期开始即予以明确,且和基金的投资风格一致。而Barclay债券系列指数为全球最具公信力的业绩比较基准指数之一,其业绩比较基准的数据可以合理的频率获取,组成业绩比较基准的成分和权重可以清晰的确定,业绩比较基准并具有可复制性,故被全球资产管理公司所广泛采用。

如果今后法律法规发生变化,或者指数编制单位停止计算编制该指数或更改指数名称、或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金业绩基准的指数时,经与基金托管人协商一致,本基金可以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

本基金为债券型基金中基金,属于证券投资基金中的中低风险品种,其预期风险和收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。

八、基金投资组合报告

1、期末基金资产组合情况

金额单位:元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:普通股	-	-
	存托凭证	-	-
2	基金投资	239,869,807.09	60.14
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	55,082,327.24	13.81
8	其他资产	103,921,219.74	26.05
9	合计	398,873,354.07	100.00

2、期末在各个国家(地区)证券市场的权益投资分布

注:本基金本报告期末未持有权益投资。

3、期末按行业分类的权益投资组合

注:本基金本报告期末未持有权益投资。

4、期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权益投资明细

注:本基金本报告期末未持有权益投资。

5、期末按债券信用等级分类的债券投资组合

注: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

注: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

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8、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

注:本基金本报告期末未持有金融衍生品。

9、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

金额单位:元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	SKANDIA-US TOTAL RTN BOND-A	开放式	契约型开放式	Pacific Investment Management Co LLC	45,030,987.68	12.31
2	FIDELITY FNDS-US HIGH YLD-A¥	开放式	契约型开放式	FIL Fund Management Ltd	40,740,873.30	11.14
3	FRANK TEMP INV GL BD-A MDIS¥	开放式	契约型开放式	Franklin Advisers Inc	23,893,668.95	6.53
4	SKANDIA-EMERGING MKT DEBT-A	开放式	契约型开放式	Stone Harbor Investment Partners LP	23,217,640.97	6.35
5	BGF-WORLD BOND FUND-¥A1	开放式	契约型开放式	BlackRock Luxembourg SA	22,905,576.59	6.26
6	PIMCO-GLB H/Y BOND-E-ACC	开放式	契约型开放式	Pimco Global Advisors Ltd	18,559,679.11	5.08
7	FULLERTON ASIAN BOND-A	开放式	契约型开放式	Fullerton Fund Management Co Ltd	13,821,650.43	3.78
8	ISHARES BARCLAYS AGGREGATE	开放式	ETF基金	BlackRock Fund Advisors	11,373,026.48	3.11
9	ISHARES BARCLAYS TIPS BOND	开放式	ETF基金	BlackRock Fund Advisors	6,226,560.63	1.70
10	SPDR DB INTL GOV INFL-PROT	开放式	ETF基金	SSGA Funds Management Inc	5,548,681.32	1.52

10、投资组合报告附注

(1)申明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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。

本基金本期投资的前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查的,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

(2)申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

本基金投资的前十名基金中,没有投资于超出基金合同规定备选基金库之外的基金。

(3)其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	103,854,283.41
3	应收股利	48,701.66
4	应收利息	13,253.26
5	应收申购款	4,981.41
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	103,921,219.74

(4)报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

(5)报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名基金中不存在流通受限情况。

(6)投资组合报告附注的其他文字描述部分。

因四舍五入原因,投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

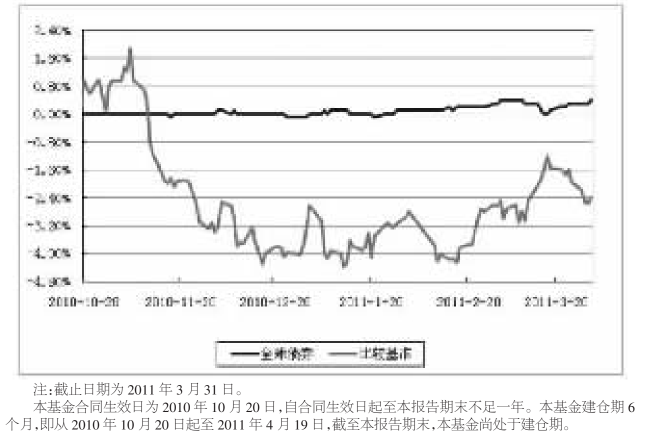
九、基金的业绩

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,投资人在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

1、富国全球债券证券投资基金历史各时间段份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

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
2010.10.20-2010.12.31	0.00%	0.04%	-2.63%	0.42%	2.63%	-0.38%
2011.1.1-2011.3.31	0.40%	0.06%	0.23%	0.36%	0.17%	-0.30%
2010.10.20-2011.3.31	0.40%	0.05%	-2.41%	0.39%	2.81%	-0.34%

2、自基金合同生效以来富国全球债券证券投资基金累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注:截止日期为2011年3月31日。

本基金合同生效日为2010年10月20日,自合同生效日起至本报告期末不足一年。本基金建仓期6个月,即从2010年10月20日起至2011年4月19日,截至本报告期末,本基金尚处于建仓期。

十、基金管理人

一、基金管理人概况

本基金基金管理人为富国基金管理有限公司,基本信息如下:

名称:富国基金管理有限公司
注册地址:上海市浦东新区花园石桥路33号花旗集团大厦5、6层
办公地址:上海市浦东新区花园石桥路33号花旗集团大厦5、6层
法定代表人:陈敏
总经理:窦玉明
成立日期:1999年4月13日
电话:(021)68597788
传真:(021)68597799
联系人:李长伟
注册资本:1.8亿元人民币
股权结构(截止于2011年4月20日):

股东名称	出资比例
海通证券股份有限公司	27.775%
申银万国证券股份有限公司	27.775%
加拿大蒙特利尔银行	27.775%
山东省国际信托有限公司	16.675%

公司设立了投资决策委员会和风险控制委员会等专业委员会。投资决策委员会负责制定基金投资的重大决策和投资风险管理。风险控制委员会负责公司日常运作的风险控制和管理工作,确保公司日常经营活动符合相关法律法规和行业监管规则,防范和化解运作风险、合规与道德风险。

公司目前下设十七个部门和三个分公司,分别是:权益投资部、固定收益部、另类投资部、研究部、集中交易部、专户投资部、机构业务部、零售业务部、营销策划与产品部、客服与电子商务部、战略发展部、监察稽核部、计划财务部、人力资源部、行政管理部、信息技术部、运营部、北京分公司、深圳分公司和成都分公司。权益投资部:负责权益类基金产品的投资管理;固定收益部:负责固定收益类产品的研究与投资管理;另类投资部:负责FOF、PE、定量类产品等的研究与投资管理;研究部:负责行业研究、上市公司研究和宏观研究等;集中交易部:负责投资交易和风险控制;专户投资部:在固定收益部、权益投资部和另类投资部内设立的虚拟部门,独立负责年金等专户产品的投资管理;机构业务部:负责年金、帐户、社保以及共同基金的机构客户营销工作;零售业务部:管理华东营销中心、华中营销中心、华南营销中心(深圳分公司)、北方营销中心(北京分公司)、西部营销中心(成都分公司)、华北营销中心,负责共同基金的零售业务;营销策划与产品部:负责产品开发、营销策划和品牌建设等;客服与电子商务部:负责电子商务与客户服务;战略发展部:负责公司战略的研究、规划与落实;监察稽核部:负责监察、风控、法务和信息披露;信息技术部:负责软件开发与系统维护等;运营部:负责基金会计与清算;计划财务部:负责公司财务计划与管理;人力资源部:负责人力资源规划与管理;行政管理部:负责文秘、行政后勤等。

截止到2011年4月20日,公司有员工182人,其中62%以上具有硕士以上学历。所有人员在最近三年内均未受到所在单位及有关管理部门的处罚。

二、主要人员情况

1、董事会成员

陈敏女士,董事长。生于1954年,中共党员,工商管理硕士,经济师。历任上海市信托投资公司副处长、处长;上海市外经贸委处长;上海万国证券公司党委书记;申银万国证券股份有限公司副总裁、党委委员。2004年开始担任富国基金管理有限公司董事长。

窦玉明先生,董事,总经理。生于1969年,硕士。历任北京中信国际合作公司交易员;深圳君安证券公司投资经理;大成基金管理有限公司基金经理助理;嘉实基金管理有限公司投资总监、总经理助理、副总经理兼基金经理。2008年开始担任富国基金管理有限公司总经理。

麦陈婉芬女士(Constance Mak),副董事长。文学及商学学士,加拿大注册会计师。1977年加入加拿大毕马威会计事务所的前身Thorne Riddell公司,并于1989年成为加拿大毕马威的合伙人之一。1989年至2000年作为合伙人负责毕马威在加拿大中部地区的对华业务。现任BMO投资有限公司亚洲业务总经理,兼任加中贸易理事会董事。

李明山先生,董事。生于1952年,中共党员,硕士,高级经济师。历任申银万国证券股份有限公司副总经理;上海证券交易所副总经理。现任海通证券股份有限公司总经理。

方荣义先生,董事。生于1966年,中共党员,博士,高级会计师。历任北京用友电子财务技术有限公司研究所信息中心副主任;厦门大学工商管理教育中心副教授;中国人民银行深圳经济特区分行深圳市中心支行会计处副处长;中国人民银行深圳市中心支行非银行金融机构处处长;中国银行业监督管理委员会深圳监管局财务会计处处长、国有银行监管处处长。现任申银万国证券股份有限公司财务总监。

Edgar Normund Legzdins先生,董事。生于1958年,学士,加拿大注册会计师。1980年至1984年在Coopers & Lybrand担任审计工作;1984年加入加拿大BMO银行金融集团蒙特利尔银行。现任BMO投资有限公司首席执行官、BMO金融集团高级副总裁及董事总经理。

葛航先生,董事。生于1966年,大学本科,经济师。历任山东省国际信托有限公司资金信托部业务经理;山东省国际信托有限公司租赁信托部副经理、经理。现任山东省国际信托有限公司自营业务部经理。

戴国强先生,独立董事。生于1952年,博士学位。历任上海财经大学助教、讲师、副教授、教授,金融学院副院长、常务副院长、院长;上海财经大学教授、博士生导师,金融学院党委书记,教授委员会主任。现任上海财经大学MBA学院院长、党委书记。

Wai P.Lam先生,独立董事。生于1936年,会计学博士。1962年至1966年在PriceWaterHouseCoopers会计师事务所担任助理会计和高级会计;1966年至1969年在加拿大圣玛利亚大学担任教师;1973年至2002年在加拿大Windsor大学担任教授。现任加拿大Windsor大学名誉教授。

汤期庆先生,独立董事,生于1955年,经济学硕士。历任上海针织品批发公司办事员、副科长;上海市第一商业局副科长、副处长、处长;上海交电家电商业集团公司总经理;上海市第一商业局局长助理、副局长;上海商务中心总经理;长江经济联合发展集团总裁、副董事长、党组书记。现任上海水产集团总公司董事长、党委书记。

李宪明先生,独立董事。生于1969年,中共党员,博士。历任吉林大学法学院教师。现任上海市锦天城律师事务所律师、高级合伙人。

2、监事会成员

金同水先生,监事长。生于1965年,大学本科。历任山东省国际信托有限公司科员、项目经理、业务经理;鲁信投资有限公司财务经理;山东省国际信托有限公司高级业务经理。现任山东省国际信托有限公司风险管理部经理。

沈寅先生,监事。生于1962年,法学学士。历任上海市中级人民法院助理审判员、审判员、审判组长;上海市第二中级人民法院办公室综合科科长。现任申银万国证券股份有限公司合规稽核总部高级法律顾问。

夏瑾璐女士,监事。生于1971年,工商管理硕士。历任上海大学外语系教师;荷兰银行上海分行结构融资部经理;蒙特利尔银行金融机构部总裁助理;荷兰银行上海分行助理副总裁。现任蒙特利尔银行上海代表处首席代表。

仇夏萍女士,监事。生于1960年,中共党员,研究生。历任中国工商银行上海分行杨浦支行所主任;华夏证券有限公司上海分公司财务主管。现任海通证券股份有限公司计划财务部副总经理。

胡志荣女士,监事。生于1973年,中共党员,硕士。历任四川成都邮电通信设备厂财务处会计;厦门金达通信电子有限公司财务部财务主管。现任富国基金管理有限公司财务经理。

丁飚先生,监事。生于1976年,民革党员,硕士。历任中国建设银行上海市分行信贷员、富国基金管理有限公司营销策划经理、客户服务部经理。现任富国基金管理有限公司客服与电子商务部高级客户服务经理。

3、督察长

李长伟先生,督察长。生于1964年,中共党员,经济学硕士,工商管理硕士,讲师。历任河南省政府发展研究中心干部;中央党校经济学部讲师;申银万国证券股份有限公司海口营业部总经理、北京管理总部副总经理兼北京营业部总经理、富国基金管理有限公司副总经理。2008年开始担任富国基金管理有限公司督察长。

4、经营管理层人员

窦玉明先生,总经理(简历请参见上述关于董事的介绍)。

林志松先生,副总经理。生于1969年,中共党员,大学本科,工商管理硕士。曾在漳州商检局办公室、晋江商检局检验科、厦门证券公司投资发展部工作。曾任富国基金管理有限公司监察稽核部稽察员、高级稽察员、部门副经理、经理、督察长。2008年开始担任富国基金管理有限公司副总经理。

陈戈先生,副总经理。生于1972年,中共党员,硕士,1996年起开始从事证券行业工作。曾任君安证券研究所研究员。2000年10月加入富国基金管理有限公司,历任研究策划部研究员、研究策划部经理、总经理助理,2005年4月起任富国天益价值证券投资基金基金经理至今,2009年1月起兼任权益投资部总经理。2008年开始担任富国基金管理有限公司副总经理。

孟朝霞女士,副总经理。生于1972年,硕士研究生,12年金融领域从业经历。曾任新华人寿保险股份有限公司企业年金管理中心总经理,泰康养老保险股份有限公司副总经理。2009年开始担任富国基金管理有限公司副总经理。

5、本基金基金经理

本基金基金经理:(1)林如惠,1969年出生,硕士研究生。自1999年开始从事证券行业工作,曾任保诚证券投资信托股份有限公司(台湾)研究员、基金经理、基金经理海外组主管;2007年11月至今任富国基金管理有限公司境外投资部副总经理。(本基金管理人于2011年5月19日公告,林如惠女士自2011年5月19日起不再担任本基金基金经理。)

(2)张峰,1969年出生,硕士研究生。自2002年开始从事证券行业工作,曾任摩根史丹利研究部助理,里昂证券股票分析员,摩根大通执行董事,美林证券高级董事;自2009年7月至今任富国基金管理有限公司周期性行业研究负责人。

6、投资决策委员会成员

投资决策委员会成员构成如下:公司总经理窦玉明先生,公司主管投研副总经理陈戈先生,研究部总经理朱少醒先生,固定收益部总经理饶刚先生等人员。

列席人员包括:督察长、集中交易部总经理以及投委会主席邀请的其他人员。

本基金采取集体投资决策制度。

7、上述人员之间不存在近亲属关系。

十一、境外投资顾问

一、境外投资顾问基本情况

●公司名称:蒙特利尔银行资产管理公司(BMO Asset Management Inc.)

●注册地址:加拿大

77 King Street West
Suite 4200
Toronto,ON M5K 1J5
Canada

●公司创办日期:1925年

●法人代表:Michael Stanley,注册金融分析师(CFA),工商管理硕士(MBA)

总裁,首席执行官(CEO)兼首席投资官(CIO)

●管理资产 (管理资产)截止2009/12/31:380亿加币

●联系人:Larry Cini,注册金融分析师

机构投资市场营销与客户服务协会
联系电话:416-359-5951
联系传真:416-359-5950
联系E-mail: larry.cini@joneshewar d.com

●公司简介:

蒙特利尔银行资产管理公司(BMO Asset Management Inc.)于1925年成立,并开始运营。1984年,Burns Fry收购了这一家族企业,并在1991年收购RMN Investment Counsel后,Jones Heward Investment Management Inc.(“JHIC”)正式进入机构投资市场。1994年,Burns Fry与Nesbitt Thomson合并,随后又与Bank of Montreal Investment Counsel合并,自此Jones Heward公司成为加拿大蒙特利尔银行(BMO)金融集团的一员,为其百分之一百拥有的子公司。2010年5月,Jones Heward公司更名为蒙特利尔银行资产管理公司。蒙特利尔银行资产管理公司管理总资产超过380亿加币。业务范围包括养老金,基金,捐赠,信托,保险公司准备金,企业公积金,和共同基金。

加拿大蒙特利尔银行(BMO)BMO金融集团是一个高度多元化的金融服务机构。总资产超过达2800亿美元,员工人数近35000人。BMO涉及业务广泛,包括零售银行,财富管理和投资银行产品年及解决方案。

二、境外投资顾问主要人员情况

●首席执行官兼首席投资官:Michael Stanley,

注册金融分析师(CFA),加拿大多伦多大学1979年工商管理硕士,加拿大安大略省合格投资组合经理,自1994年以来,Michael便在蒙特利尔银行任职,1996年2月加入蒙特利尔银行资产管理公司。在蒙特利尔银行任职之前,他还是加拿大一家投资咨询公司的投资组合经理人。

●首席财政官:Christina Chen,

Christina Chen现任BMO金融集团旗下众多子公司(包括BMO Investment Inc., Jones Heward Investment Counsel Inc., Harris Investment Management Inc. 以及HIM-Money Inc.)的首席财务官.Christina于1998年加入蒙特利尔银行并在公司审计部担任财务分析师。1999年,她调职到BMO InvestorLine公司并升任首席财务官。Christina于1993年获得注册会计师证书。在加入BMO之前,她在一家经纪公司担任股票研究助理。她于多伦多大学获得工商管理硕士学位,同时也是加拿大滑铁卢大学的名誉学士。

三、参与本基金产品投资的主要人员情况

●Michael Stanley:

注册金融分析师(CFA),加拿大多伦多大学1979年工商管理硕士,加拿大安大略省合格投资组合经理,自1994年以来,Michael便在蒙特利尔银行任职,1996年2月加入蒙特利尔银行资产管理公司。在蒙特利尔银行任职之前,他还是加拿大一家投资咨询公司的投资组合经理人。

●Serge G. Pépin:

Serge G. Pépin先生是是BMO共同基金的投资总监,负责监督240亿元的投资项目,责任包括选拔和监督投资管理者,监督系列基金平台上的多基金解决方案。曾就职于宏利金融集团(Manulife Financial Corporation)旗下Maritime人寿保险公司,任投资管理服务部副总裁。Pépin先生具有20年从业经验,他于1987年毕业于英属哥伦比亚大学(University of British Columbia),并获文学与政治学学士学位。

●Steven Shepherd:

注册金融分析师(CFA),高级经理,目前负责BMO共同基金的投资工作,14年证券市场研究以及金融产品开发经历。在此之前,曾先后从事过金融产品营销、产品开发、共同基金管理、委托理财计划管理、结构性产品研究以及机构投资理财顾问等工作。Shepherd先生毕业于西安大略大学Richard Ivey商学院,获工商管理学士学位。

四、境外投资顾问的职责

1.为境外证券投资基金投资提供技术支持,包括投资管理(研究、决策、交易和风险管理)解决方案、工具、系统以及人员培训。

2.提供决策建议,包括风险监控报告、资产配置建议、子基金研究报告、行业及个券研究报告、子基金选择与调整的建议、投资区域、行业及个券选择与调整的建议等。

十二、基金的费用与税收

(一)与基金运作有关的费用

1、基金费用的种类

(1)基金的管理费;

(2)基金的托管费;

(3)《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;

(4)基金在所投资市场实际发生的证券交易、清算、登记等费用(out-of-pocket fees);

(5)基金份额持有人大会费用;

(6)《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费,税务顾问费等根据有关法规、《基金合同》及相应协议的规定,由基金管理人根据其他有关法规及相应协议的规定,按费用支出金额支付,列入或摊入当期基金费用;

(7)基金依照有关法律法规应当缴纳的,购买或处置证券有关的任何税收和费用(包括但不限于关税、印花税、交易及其他税收及预扣提税以及与前述各项有关的税收和费用任何利息、罚金及费用)(简称“税收”);

(8)代表基金投票等与基金投资活动直接相关的费用,法律法规另有规定的除外;

(9)基金的银行汇划费用;

(10)因更换境外托管人而进行的资产转移所产生的费用;

(11)按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

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)基金的管理费

基金的管理费包括基金管理人的管理费和境外投资顾问的投资顾问费两部分,其中境外投资顾问的投资顾问费在境外投资顾问与基金管理人签订的《顾问协议》中进行约定。

本基金的管理费按前一日基金资产净值0.9%的年费率计提。计算方法如下:

$H=E\times0.9\%\div$当年天数

H为每日应计提的基金的管理费

E为前一日的基金资产净值

基金的管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。境外投资顾问的投资顾问费由基金管理人进行支付,具体支付程序在《顾问协议》中列示。

(2)基金的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.22%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

$H=E\times0.22\%\div$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

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类”中第3-11项费用,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

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,基金收取认购费的,可以从认购费中列支,以所收取的认购费为上限;

(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。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日前2日在指定媒体公告。

5、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按各个国家或地区税收法律、法规执行。

(二)与基金销售有关的费用

1、申购费用

本基金申购费率最高不高于1.6%,且随申购金额的增加而递减,具体费率如下表所示:

购买金额(M)	申购费率
M<100万	0.8%
100万≤M<1000万	0.5%
M≥1000万	每笔1,000元

本基金的申购费用由申购基金份额的投资者承担,不列入基金财产,主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

2、赎回费用

本基金的赎回费率按持有时间递减,具体费率如下:

持有期限	赎回费率
小于90天	0.3%
大于等于90天	0

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担。投资者可将其持有的全部或部分基金份额赎回。本基金的赎回费用在投资者赎回本基金基金份额时收取,扣除用于市场推广、注册登记费和其他手续费后的余额归基金财产,赎回费归入基金财产的比例不得低于法律法规或中国证监会规定的比例下限。目前赎回费的25%归基金资产所有。

3、本基金的申购费率、赎回费率和收费方式由基金管理人根据《基金合同》的规定确定并在《招募说明书》中列示。基金管理人可以根据《基金合同》的相关约定调整费率或收费方式,基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前2个工作日在指定媒体公告。

4.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,针对特定地域范围、特定行业、特定职业的投资者以及以特定交易方式等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间,按相关监管部门要求履行相关手续后,基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

(三)其他费用

本基金其他费用根据相关法律法规执行。

十三、基金托管人

(一)基金托管人基本情况

名称:中国工商银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区复兴门内大街55号
成立时间:1984年1月1日
法定代表人:姜建清
注册资本:人民币334,018,850,026元
联系电话:010-66105799
联系人:赵会军

(二)主要人员情况

截至2011年3月末,中国工商银行资产托管部共有员工130人,平均年龄30岁,95%以上员工拥有大学本科以上学历,高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

(三)基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者,中国工商银行自1998年在国内首家提供托管服务以来,秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨,依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队,严格履行资产托管人职责,为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务,展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、安心账户资金、企业年金基金、QFII资产、QDII资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII专户资产、ESCROW等门类齐全的托管产品体系,同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务,可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至2011年3月,中国工商银行共托管证券投资基金205只,其中封闭式8只,开放式197只。自2003年以来,本行连续七年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的25项最佳托管银行大奖;2010年,本行资产托管部总经理获得《财资》设立的年度中国最佳托管银行家个人大奖。本行是获得奖项最多的国内托管银行,优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

十四、境外资产托管人

本基金的境外托管人为布朗兄弟哈里曼银行(Brown Brothers Harriman & Co.)。

一、基本情况

名称:布朗兄弟哈里曼银行(Brown Brothers Harriman & Co.)
地址:140 Broadway New York, NY 10005
法定代表人:Andrew J. F. Tucker
组织形式:合伙制公司
存续期间:持续经营

成立于1818年的布朗兄弟哈里曼银行(“BBH”)是全球领先的托管银行之一。BBH自1928年起已经开始在美国提供托管服务。1963年,BBH开始为客户提供全球托管服务,是首批开展全球托管业务的美国银行之一。目前全球员工超过4千人,在全球16个国家和地区设有分支机构。

BBH的惠誉长期债务评级为A+,短期评级为F1,自主评级为A/B。

二、托管业务及主要人员情况情况

布朗兄弟哈里曼银行的全球托管业务隶属于本行的投资者服务部。在全球范围内,该部门由本行合伙人William B. Tyree先生领导。在亚洲,该部门由本行合伙人Andrew J. F. Tucker先生领导。

作为一家全球化公司,BBH拥有服务全球跨境投资的专长,其全球托管网络覆盖全球近一百个市场。截至2010年12月31日,托管的资产达到了2.896万亿美元,其中约百分之七十是跨国境投资的资产。亚洲是BBH业务增长最快的地区之一。我们投身于亚洲市场,迄今已逾25年,服务资产为3千6百亿美元。

投资者服务部是公司最大的业务部门,拥有超过1,890名员工。我们坚持为客户提供稳定优质的服务,并为根据客户具体需求提供定制化的全面解决方案,真正做到“以客户为中心”。

由于坚持长期提供优质稳定的客户服务,BBH在行业评比中屡获殊荣,包括在2010年在《全球托管行》(Global Custodian)杂志的“2010全球托管评比”中被评为“全球托管行第一名”。在2010年《全球投资者》杂志(Global Investor)的“2010全球托管评比”中被评为“全球托管行全体(加权)第一名”。

三、境外托管人的职责

1、安全保管受托财产;

2、计算境外受托资产的资产净值;

3、按照相关合同的约定,及时办理受托资产的清算、交割事宜;

4、按照相关合同的约定和所适用国家、地区法律法规的规定,开设受托资产的资金账户以及证券账户;

5、按照相关合同的约定,提供与受托资产业务活动有关的会计记录、交易信息;

6、保存受托资产托管业务活动的记录、账册以及其他相关资料;

7、其他由基金托管人委托其履行的职责。

十五、相关服务机构

(一)基金份额发售机构

1、直销机构:富国基金管理有限公司
注册地址:上海市浦东新区花园石桥路33号花旗集团大厦5、6层
办公地址:上海市浦东新区花园石桥路33号花旗集团大厦5、6层
法定代表人:陈敏
总经理:窦玉明
成立日期:1999年4月13日
电话:(021)68597070
传真:(021)68597979
联系人:林燕珏
客户服务统一咨询电话:95105686、4008880688(全国统一,免长途话费)
公司网站:www.fullgoal.com.cn

2、代销机构:

(1)中国工商银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址:北京市西城区复兴门内大街55号
法定代表人:姜建清
联系电话:(010)66107900
传真:(010)66107914
联系人:田耕
客户电话:95588
公司网站:www.icbc.com.cn

(2)中国建设银行股份有限公司
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:郭树清
电话:(010)66275654
联系人:王琳
客服电话:95533
公司网站:www.ccb.com

(3)招商银行股份有限公司
注册地址:深圳市福田区深南大道7088号
办公地址:深圳市福田区深南大道7088号
法定代表人:秦晓
电话:(0755)83198888
传真:(0755)83195109
联系人:王楠
客服电话:95555
公司网站:www.cmbchina.com

(4)交通银行股份有限公司
住所:上海市浦东新区银城中路188号
法定代表人:胡怀邦
联系电话:(021)58781234
传真:(021)58408842
联系人:曹榕
客服电话:95559
公司网站:www.bankcomm.com

(5)东莞银行有限责任公司
注册地址:东莞市城区运河东一路193号
办公地址:东莞市城区运河东一路193号
法定代表人:廖玉林
联系人:胡昱
电话:(0769)22119061
传真:(0769)22117730
服务热线:96228
网址:www.dongguanbank.cn

(6)渤海银行股份有限公司
注册地址:天津市河西区马场道201-205号

(下转D27版)