（上接D9版）

6）衍生品投资策略

衍生品不是本基金的主要投资方向。本基金在充分调研验证衍生品投资策略的基础上，可以通过衍生品投资降低个股和组合风险，规避外汇风险及其他相关风险。基金管理人可以使用远期合约和其他工具来进行外汇风险的套期保值，合理减小外汇市场波动对投资表现的负面影响。套期保值部分的比例应遵守相关法律法规和本基金合同的规定，在充分考虑投资需要和境外投资仓位后予以确定。本基金将不会对外汇进行投机交易。

（五）投资决策依据及流程

（一）决策依据

1、相关法律、法规和本基金合同的有关规定。依法决策是本基金进行投资的前提；

2、对全球宏观经济环境、美国经济情况、金融行业和房地产市场发展趋势的分析结果，以及对股票、债券和货币市场基本面的分析结果是本基金投资决策的基础；

3、投资对象收益和风险的配比关系，现金收入和资本增值配比关系。在充分权衡投资对象的收益和风险的前提下做出投资决策，是本基金维护投资者利益的重要保障；

4、投资方式。本基金在投资决策委员会领导下，通过投资团队的共同努力，由基金经理执行投资计划，争取良好投资业绩。

（二）决策程序

本基金主要通过投资美国市场上市交易的房地产信托凭证、房地产信托凭证的交易型开放式指数基金以及房地产行业上市公司股票以获取以美国为主的房地产市场收益。

本基金的决策流程包括资产配置、备选证券库筛选、组合构建、交易执行、风险管理与绩效评估、组合监控与调整六个阶段，每一阶段的职责如下：

1、资产配置

资产配置阶段采取定量与定性分析相结合的方法，从分析美国宏观经济形势以及财政和货币政策等核心问题入手，结合证券市场情况，获得主要资产类别的长期预期收益数据和信息。基金管理人实行投资决策委员会下的基金经理负责制，投资决策委员会负责战略资产配置，基金经理在战略资产配置的基础上，根据相应权限进行适当的战术资产配置及调整。

2、备选证券库筛选

本基金原则上选取美国主要市场上市交易的证券产品。筛选REIT依据对流动性、收益率、现金流、估值水平、资产负债情况、资产质量、管理人等基本面的调研分析，筛选ETF依据对流动性、规模、跟踪误差、透明度、费率等指标的调研分析，筛选股票依据对公司经营业绩、盈利状况、增长潜力、估值水平、公司治理等方面的调研分析。在深入调研的基础上构建被选证券库。

3、组合构建

基金经理根据投资限制的要求和流动性管理的需要，在合法合规的前提下，以组合整体调整收益最大化为原则，综合考虑不同资产、行业、区域的有效配置，负责实施组合构建工作。基金经理负责采取自下而上的方法进行证券选择。针对进入备选证券库的证券，基金经理和研究员通过深入调研，全面分析，对风险收益进行评估，为投资组合构建提供支持。

4、交易执行

基金管理人负责投资决策的交易执行，REITs、ETF和股票投资的交易指令将在基金管理人委托的证券交易经纪商的全球证券交易平台上实施。基金投资的交易指令将通过基金管理人内部的交易室直接下单。

5、风险管理与绩效评估

基金管理人负责风险管理和绩效评估。风险管理的主要依据是中国有关法律法规、投资地的法律法规和中国证监会的监管要求，以及基金管理人对市场风险的各种分析和判断。风险绩效评估小组定期完成基金业绩评估报告，对组合进行绩效归因分析，为投资决策提供依据。风险绩效评估小组定期完成风险评估报告，分析并提示风险。

6、组合监控与调整

基金经理根据投资决策委员会的要求，在适当的市场时机合理调整投资组合的资产配置。风险绩效评估小组对改进方案的实施进行监控。

根据全球证券市场投资环境的变化和投资操作需要，基金管理人可对上述投资程序做出调整，并在招募说明书更新中公告。

7、监察稽核部对投资的合法合规性进行监控。

（六）业绩比较基准

本基金的业绩比较基准是：人民币计价的MSCI美国REIT净总收益指数（MSCI US REIT Net Daily Total Return Index）。

MSCI美国REIT指数是一个调整市值权重的自由流通股指数，用来衡量美国市场中REITs行业的股票市场表现。截至2011年6月30日，共有106只成份股，总市值3817亿美元，自由流通股调整后的市值3603亿美元，前20大权重股占比62.02%。该指数大约覆盖整个美国REITs市场85%的市值。

MSCI美国REIT指数的特点包括：

1）广泛准确代表美国房地产REITs；

2）透明度好，有规可循的指数制定法；

3）定期复审指数–通过每个季度的指数审查，来反映发展变化的REITs市场。

MSCI使用三种不同方式计算指数，总收益（Gross DTR）指数，净总收益（Net DTR）指数。DTR计算方法为在公司宣布分红当日交易结束的时将指数成份股的分红重新投资于指数。净总收益指数在扣除预提税之后将分红重新投资，适用不享受双重征税条款的机构投资者的税率。

如果MSCI美国REIT净总收益指数停止编制或发布，或MSCI美国REIT净总收益指数编制者或所有者停止本基金对该指数的使用授权，或MSCI美国REIT净总收益指数由其他指数替代（单纯更名除外），或由于指数编制方法等重大变更导致MSCI美国REIT净总收益指数不宜继续作为业绩比较基准，或证券市场上有其他代表性更强、更合适本基金风险收益特征的业绩比较基准指数，本基金管理人可以依据审慎性原则和维护基金份额持有人合法权益的原则更换本基金的业绩比较基准。本基金由于上述原因变更业绩比较基准，应经基金托管人同意，报中国证监会备案，基金管理人应在调整前3个工作日在中国证监会指定的信息披露媒体上刊登公告。

（七）风险收益特征

本基金为股票型基金，主要投资于与在美国上市交易的REITs、REIT ETF和房地产行业股票，在证券投资基金中属于较高预期风险和预期收益的基金品种。

（八）投资限制

1.组合限制

本基金在投资策略上兼顾投资原则以及开放式基金的固有特点，通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。基金的投资组合将遵循以下限制：

1）本基金持有同一家银行的存款不得超过基金净值的20%。银行应当是中资商业银行在境外设立的分行或在最近一个会计年度达到中国证监会认可的信用评级机构评级的境外银行，但在基金托管账户的存款不受此限制。

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

3）本基金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基金资产净值的3%。

4）基金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。同一境内机构投资者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。

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）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。

6）本基金持有境外基金的市值合计不得超过基金净值的10%。（特有货币市场基金可以不受上述限制）

7）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基金、集合计划资产净值的10%。

基金管理人应当在基金合同生效后6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。若基金超过上述投资比例限制，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。

2.金融衍生品投资

本基金投资衍生品应当仅限于投资组合避险或有效管理，不得用于投机或放大交易，同时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该基金、集合计划资产净值的100%。

2）本基金投资期货交易的初始保证金、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、集合计划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、集合计划资产净值的20%。

4）基金管理人应当在本基金会计年度结束后60个工作日内向中国证监会提交包括衍生品头寸及风险分析年度报告。

3.证券借贷交易

本基金可以参与证券借贷交易，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：

①现金；

②存款证明；

③商业票据；

④政府债券；

⑤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。

6）本基金管理人将对基金参与证券借贷交易中发生的任何损失负相应责任。

4.证券回购交易

基金可以根据正常市场惯例参与正回购交易、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，应当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借出证券市值的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本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。

5）本基金管理人将对基金参与证券正回购交易、逆回购交易中发生的任何损失负相应责任。

5. 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基金总资产的50%。前项比例限制计算，基金因参与证券借贷交易、正回购交易而持有的担保物、现金不得计入基金总资产。基金如参与证券借贷交易、正回购交易、逆回购交易，本基金管理人将按照规定建立适当的内控制度、操作程序和进行档案管理。

若将来法律法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更，致使本款前述1–5项约定的投资限制被修改或取消的，基金管理人在履行适当程序后，本基金可相应调整投资限制规定，不需经基金份额持有人大会审议。

6.禁止行为

除中国证监会另有规定外，基金不得有下列行为：

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基金、集合计划资产净值的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）不公平对待不同客户或不同投资组合。

10）除法律法规规定以外，向任何第三方泄露客户资料。

11）中国证监会认定的其他行为。

若将来法律法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更，取消或变更上述投资禁止行为的，基金管理人在履行适当程序后，本基金可相应取消或调整禁止行为规定，不需经基金份额持有人大会审议。

7.基金的融资融券

在法律法规和中国证监会允许的前提下，本基金可以按照法律法规和监管部门的有关规定进行融资、融券。

（十）相关法律法规或中国证监会根据证券市场发展情况或基金具体个案等客观原因调整上述投资比例禁止、限制等事项的，如适用本基金，则本基金在履行适当程序后，可不受上述比例禁止、限制，并适时调整相关投资比例限制和禁止规定。

（十一）基金管理人代表基金行使股东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投资者权利，保护基金份额持有人的利益；

2.有利于基金资产的安全与增值。

（十二）代理投资

1.代理投票的原则

基金管理人负责代表基金行使所投资的股票以及基金的代理投票权。在有需要为本基金持有股份份额的上市公司/基金管理人所提出的决议案进行代理投票时，本基金管理人将遵循以下原则：

1）为基金份额持有人争取最大利益及保障基金份额持有人权利；

2）符合本基金既定的投资目标；

3）有利于基金资产的安全与增值；

4）遵守相关法律法规、基金合同等规定的行为规范。

2.代理投票的处理方法、程序

1）代理投票权的决定将由基金管理人做出。基金管理人将保留代理投票文件至少三年以上。

2）代理投票前，基金经理将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和反对者的意见后，勤勉尽职地代理基金行使投票权。

3）在履行代理投票职责过程中，基金管理人可根据操作需要，委托投资顾问、境外托管人或其他专业机构提供代理投票的建议、协助完成代理投票的程序等，基金管理人应对代理机构的行为进行必要的监督，并承担相应责任。

4）一般情况下，对于接纳财务报告、派息、聘请会计师事务所等有关公司日常运作事项的决议案，只要无损基金份额持有人利益及上市公司治理，基金管理人可能会选择投赞成票。

5）对于其他建议如收购合并、关联交易等重大事项，在投票日之前，基金管理人应针对上市公司股东会议案的表决方案形成初步意见，并经公司内部审核程序后，最终形成针对上市公司股东大会议案的投票意见。

6）对于所投资基金合并、转型、清算、更换管理人等重大事项，在投票日之前，基金管理人应针对所投资基金的持有人大会表决方案形成初步意见，并经公司内部审核程序后，最终形成针对持有人大会表决方案的投票意见。

7）代理投票过程中，相关讨论及决策意见等文档文件按照基金管理人有关规定予以存档。

8）基金管理人和指派的参会人员不得擅自投票，必须严格按照本基金管理人最后审批形成的投票意见进行投票。

9）基金管理人相关人员在与上市公司的接触过程中，不得私自以公司名义对上市公司股东大会议案发表承诺性意见和其他误导性言论。

10）基金管理人相关人员在代理投票中禁止参与任何形式的商业贿赂行为以及其他任何违反法律法规和基金从业人员道德规范的行为。

（十三）证券交易

本基金对基金交易服务提供商的选择和评价应本着客观、公正、公平、有利于提升本公司国际化投研服务水平以及保护本基金份额持有人的利益的指导方针进行。

1.交易券商选择考量因素

符合下列条件的国际券商，可以列入公司选择的范围之内：

1）具备在全球主要市场交易的能力；

2）具备主要市场的研究能力；

3）具备与本基金投资运作相关的研究平台或资料库；

4）能够根据基金管理人的要求，安排临时的分析和研究；

5）券商对潜在和现实的突出处理原则和程序符合本基金份额持有人的利益；

6）具备后备和灾难恢复等维护系统稳定运营的必要系统。

2.评价标准

公司每半年对国际券商服务工作评价一次，评价标准为：

1）行业和公司研究水平（含著名分析师数量）；

2）分析报告的影响力；

3）全球研究覆盖的宽度及美国市场覆盖的深度；

4）提供服务及相关服务成果的质量和可靠性，相关预测的准确性；

5）提供服务的反应速度；

6）研究成果的销售推荐水平；

7）服务态度；

8）研究的独立性；

9）联系公司调研的能力和态度；

10）交易执行的质量，包括交易的合法性和公平交易执行情况、交易执行速度、成交价格区间等；

11）对于潜在和现实的处理是否符合本基金份额持有人的利益。

3.评价方法和流程

相关投资研究人员按照以上标准对各国际券商评价和评分，经过统计排序，形成初步评价结果；

初步评价结果上报投资决策委员会成员评价，形成最终评价结果。

4.交易量及佣金分配

在证监会相关规定允许的范围内，公司通过一家证券公司的交易席位买卖证券的年交易佣金不能超过公司全年交易佣金总额的30%，公司定期召开佣金分配会议，根据券商评分确定佣金分配，佣金分配原则上以国际券商评价的结果为标准。在交易量出现异常的情况时，交易室应及时通报，佣金分配小组可不定期调整分配计划。

5.潜在利益冲突

对可能发生的潜在利益冲突，公司制定了详细的制度，包括轧美元专项制度等，考虑了从证券经纪商挑选到交易执行等各个环节可能产生的潜在利益冲突，对基本原则、禁止事项、相关信息披露、罚则、相关文件存档等进行了详细规定。

## 五、基金管理人

（一）基金管理人概况

1.名称：鹏华基金管理有限公司

2.住所：深圳市福田区福华三路168号深圳国际商会中心43层

3.设立日期：1998年12月22日

4.法定代表人：何如

5.办公地址：深圳市福田区福华三路168号深圳国际商会中心43层

6.电话：0755–82021220 传真：0755–82021155

7.联系人：梁静

8.注册资本：人民币1.5亿元

9.股权结构：

| 出资人名称 | 出资额（万元） | 出资比例 |
|---|---|---|
| 国信证券股份有限公司 | 7,500 | 50% |
| 意大利欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.） | 7,350 | 49% |
| 深圳市北融信投资发展有限公司 | 150 | 1% |
| 总 计 | 15,000 | 100% |

（二）主要人员情况

1.基金管理人董事会成员

何如先生，董事长，硕士，高级会计师，国籍：中国。历任中国电子器件公司深圳公司副总会计师兼财务处处长、总会计师、常务副总经理、总经理、党委书记，深圳发展银行行长助理、副行长、党委委员、副董事长、行长、党委副书记，现任国信证券股份有限公司董事长、党委书记，鹏华基金管理有限公司董事长。

胡继之先生，董事，金融学博士，高级经济师，国籍：中国。历任中国人民银行武汉市分行办公室科长、金融研究所副所长、所长，中国人民银行深圳分行办公室负责人，深圳证券交易所总经理助理兼办公室主任、理事会秘书长、策划总监、纪委书记、党委委员、副总经理，现任国信证券股份有限公司总裁、党委副书记。

孙煜扬先生，董事，经济学博士，国籍：中国。历任贵州省政府经济体制改革委员会主任科员、中共深圳市委政策研究室副处长、深圳证券结算公司常务副总经理、深圳证券交易所首任行政总监、香港深业（集团）有限公司助理总经理、香港深业控股有限公司副总经理、中国高新技术产业投资管理有限公司董事长兼行政总裁、鹏华基金管理有限公司董事总裁，现任国信证券股份有限公司副总裁。

Massimo Mazzini先生，董事，经济和商学学士，国籍：意大利。曾在安达信（Arthur Andersen MBA）从事风险管理和资产管理工作，历任CA AIPG SGR投资总监、CAAM AI SGR及CA AIPG SGR首席执行官和投资总监、东方汇理资产管理股份有限公司（CAAM SGR）投资副总监、农业信贷另类投资集团（Credit Agricole Alternative Investments Group）国际执行委员会委员、欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）投资方案部投资总监、Epsilon资产管理股份公司（Epsilon SGR）首席执行官，现任欧利盛资本股份公司（Eurizon Capital S.A.）（卢森堡）首席执行官和总经理，同时兼任欧利盛AI资产管理股份公司（Eurizon AI SGR）首席执行官。

Alessandro Varaldo先生，董事，经济学和商业管理博士，国籍：意大利。曾任米兰德意志银行集团Finanza e Futuro Fondi Sprind股份公司投资管理部债券基金和现金头寸管理高级经理，IMI Fideuram资产管理股份公司投资管理部固定收益组合和现金管理业务负责人，圣保罗银行投资公司（Banca Sanpaolo Invest S.p.A.）财务及营销策划部负责人，Capitalia股份公司（Capitalia S.p.A.）产品和销售部负责人，Capitalia投资管理股份公司（Capitalia Investment Management S.A.）董事总经理，Unicredit Holding财务风险管理部意大利企业法人风险管理业务负责人，现任欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A）首席市场官、欧利盛资本股份公司（Eurizon Capital S.A.）（卢森堡）董事。

史际春先生，独立董事，法学博士，国籍：中国。历任安徽大学讲师、中国人民大学副教授，现任中国人民大学法学院教授、博士生导师，国务院特殊津贴专家，兼任中国法学会经济法学研究会副会长、北京市人大常委会和法制委员会委员、北京市人民政府顾问。

李相启先生，独立董事，高级经济师、研究员，国籍：中国。历任陕西省委办公厅秘书、省委政策研究室财贸处处长、副主任，陕西省经济体制改革委员会副市记、副主任、党组书记、主任，陕西省证券监管委员会主席，中国证监会济南证管办党委书记、主任、济南稽查局局长，山东证监局局长，上海证券交易所理事会理事、产品委员会主任。

宋泓先生，独立董事，经济学博士，国籍：中国。曾在美国哥伦比亚大学作访问学者，并在陕西省社科院工作，现任中国社会科学院世界经济与政治研究所国际贸易研究室主任、研究员、教授、博士生导师。

张新民先生，独立董事，管理学博士，会计学教授，博士生导师，国籍：中国。现任对外经济贸易大学副校长兼国际商学院院长，国务院特殊津贴专家，全国MBA教育指导委员会委员，英国特许公认会计师（FCCA），澳洲注册会计师（FCPA）。

2.基金管理人监事会成员

孙枫先生，监事会主席，国际金融专业硕士，高级会计师，中国注册会计师，国籍：中国。历任武汉市经济研究所副所长，武汉市轻工业局副局长，武汉友谊宾馆机制造公司副经理，深圳市财政局企财处处长、办公室主任、副局长，深圳市商业银行董事长、党委书记，深圳发展银行董事长、党委书记，鹏华基金管理有限公司董事长、党总支书记，现任鹏华基金管理有限公司监事会主席。

Andrea Vismara先生，监事，法学学士，律师，国籍：意大利。曾在意大利多家律师事务所担任律师，先后在法国农业信贷集团（Credit Agricole Group）东方汇理资产管理股份有限公司（CAAM SGR）法务部、产品开发部工作，现在欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）治理与股权部工作。

黄俞先生，监事，研究生学历，国籍：中国。曾在中农信公司、正大财务公司工作，曾任鹏华基金管理有限公司董事，现任深圳市北融信投资发展有限公司董事长。

高鹏先生，职工监事，经济学硕士，国籍：中国。曾任博时基金管理有限公司监察法律部监察稽核经理，现任鹏华基金管理有限公司监察稽核部总经理。

刘慧红女士，职工监事，本科学历，国籍：中国。曾在中国工商银行深圳分行、平安证券公司工作，1998年12月加盟鹏华基金管理有限公司，现任鹏华基金管理有限公司登记结算部副总经理。

3.高级管理人员情况

何如先生，同上。

邓召明先生，总裁，经济学博士，讲师，国籍：中国。历任北京理工大学管理与经济学院讲师、中国兵器工业总公司主任科员、中国证监会处长、南方基金管理有限公司副总经理，现任鹏华基金管理有限公司总裁、党总支书记。

高阳先生，副总裁，经济学硕士，十年证券从业经验，CFA，国籍：中国。历任中国国际金融有限公司债券投资经理、博时基金管理有限公司博时价值增长基金基金经理、固定收益部总经理、基金裕泽基金经理、基金裕隆基金经理、股票投资部总经理，现任鹏华基金管理有限公司副总裁。

曹毅先生，副总裁，经济学博士，国籍：中国。历任中国人民银行广州分行科员，中国人民银行深圳中心支行副主任科员，南方基金管理有限公司市场拓展部总监、渠道部总监，现任鹏华基金管理有限公司副总裁。

胡湘先生，副总裁，经济学硕士。曾就职于全国社会保障基金理事会投资部、境外投资部，历任副主任科员、主任科员、副处长，鹏华基金管理有限公司总裁助理；现任鹏华基金管理有限公司副总裁。

吴伟先生，督察长，法学博士，国籍：中国。曾任中国建设银行深圳市分行法律部副科长。2001年3月加盟鹏华基金管理有限公司，历任公司法律顾问、社保基金独立稽察员、监察稽核部总监，现任公司督察长。

4.本基金拟任基金经理

裘韬先生，CFA，科学硕士，历任美国运通公司研究员，美国哥伦比亚管理公司（原美国河源投资有限公司）基金经理，现任鹏华基金管理有限公司国际业务部QDII基金经理。

5.投决决策委员会成员情况

邓召明先生，简历同上。

毕国强先生，CFA，工商管理硕士（MBA），历任中国证监会基金监管部正处级调研员，美国景顺集团加拿大环盛基金管理公司分析师，广州文冲船厂经营部船舶科科长，现任鹏华基金管理有限公司总裁助理。

裘韬先生，简历同上。

6.上述人员之间均不存在近亲属关系。

（二）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募集、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.有关法律法规和中国证监会规定的其他职责。

（四）基金管理人的承诺

1.基金管理人承诺不从事违反《证券法》、《基金法》、《销售办法》、《运作办法》、《信息披露办法》等法律法规的行为，并承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违法行为的发生。

2.基金管理人的禁止行为：

1）将基金管理人固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；

2）不公平地对待公司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）将基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；

5）承销证券；

6）向他人贷款或提供担保；

7）从事承担无限责任的投资；

8）购买不动产；

9）购买房地产抵押按揭；

10）购买贵重金属或代表贵重金属的凭证；

11）购买实物商品；

12）除应付赎回、交易清算等临时用途以外，借入现金；

13）利用融资购买证券，但投资金融衍生品除外；

14）参与未持有基础资产的卖空交易；

15）购买证券用于控制或影响发行该证券的机构或其管理层；

16）直接投资与实物商品相关的衍生品；

17）向基金管理人、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债券；

18）买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、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主承销的证券；

19）从事内幕交易、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动；

20）法律法规以及中国证监会禁止的其他行为。

3.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）违反法律法规、基金合同或托管协议；

3）欺瞒损害基金份额持有人或本基金合同其他当事人的合法权益；

4）泄向中国证监会报送的资料中弄虚作假；

5）贬抑、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）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；

8）除按本基金管理人制度进行基金运作投资外，直接或间接进行其他股票投资；

9）劝助、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；

10）违反证券交易所或其他交易场所规则，利用对敲、倒仓等非法手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；

11）贬损同行，以提高自己；

12）炫公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；

13）以不正当手段谋求业务发展；

14）有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；

15）其他法律、行政法规禁止的行为。

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）不得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

1.内部控制的原则

基金管理人的内部控制遵循以下原则：

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：公司各机构、部门和岗位职责应当保持相对独立，公司基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离；

4）相互制约原则：公司内部部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡；

5）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，以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

2.制订内部控制制度应当遵循以下原则：

1）合法合规性原则：基金管理人内控制度应当符合国家法律、法规、规章和各项规定；

2）全面性原则：内部控制制度应当涵盖基金管理人经营管理的各个环节，不得留有制度上的空白或漏洞；

3）审慎性原则：制定内部控制制度应当以审慎经营、防范和化解风险为出发点；

4）适时性原则：公司内部风险控制制度的制定，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。

3.内部控制体系

1）董事会下设风险控制与合规审计委员会，主要负责制定基金管理人风险控制战略和控制政策、协调突发重大风险等事项；

2）公司督察长负责对基金管理人各业务环节合法合规运作进行监督检查，组织、指导基金管理人内部监察稽核工作，并可向董事会和中国证监会直接报告；

3）经营管理层下设风险管理委员会，其成员包括经营管理层、督察长、监察稽核部、公司各部门负责人。风险管理委员会对各类风险予以充分的评估和防范，对业务过程中潜在和存在的风险进行通报、讨论，并及时采取防范和控制措施；

4）监察稽核部负责对基金管理人各部门的风险控制情况进行检查，定期不定期对业务部门内部控制制度执行情况和遵循国家法律、法规及其他规定的执行情况进行检查，并适时提出整改建议；

5）业务部门：对本部门业务范围内的业务风险负有管控和及时报告的义务；

6）风工：依照公司“全面风险管理、全员风险控制”的理念，公司每个员工均负有一线风险控制职责，负责把公司的风险控制理念和措施落实到每一个业务环节当中，并负有把业务过程中发现的风险隐患或风险问题及时进行报告、反馈的义务。

4.内部控制措施

1）公司通过不断健全法人治理结构，充分发挥独立董事和监事会的监督职能，力争从源头上杜绝不正当关联交易、利益输送和内部人控制现象的发生，保护投资者利益和公司合法权益；

2）管理层牢固树立了内控优先的风险管理理念，并着力培养全体员工的合规及风险防范意识，营造浓厚的风险管理文化氛围，保证全体员工及时了解国家法律法规和公司规章制度，使风险意识贯穿到公司各个部门、各个岗位和各个环节；

3）公司依据自身经营特点建立了包括岗位自控、相关部门和岗位之间相互监督制衡、督察长和监察稽核部监督的、权责统一、严密有效的三道内控防线；

4）建立并不断完善内部控制体系及内部控制制度：自成立来，公司不断完善内控组织架构、控制程序、控制措施以及控制职责，建立健全内部控制体系。通过不断地对内部控制制度进行修订和更新，公司的内部控制制度不断走向完善；

5）建立健全各项管理制度和业务规章：公司建立了包括投资管理制度、基金会计制度、信息披露制度、监察稽核制度、信息技术管理制度、公司财务制度等基本管理制度以及包括岗位设置、岗位职责、操作流程手册在内的业务流程、规章等，从基本管理制度和业务流程上进行风险控制；

6）建立了岗位分离、相互制衡的内控机制：公司在岗位设置上采取了严格的分离制度，实现了基金投资与交易、交易与清算、公司会计与基金会计等业务岗位的分离制度，形成了不同岗位之间的相互制衡机制，从岗位设置上减少和防范操作及操守风险；

7）建立健全了岗位责任制：公司通过健全岗位责任制使每位员工都能明确自己的岗位职责和风险管理责任；

8）构建风险管理系统：公司通过建立风险评估、预警、报告、控制以及监督程序，并经过适当的控制流程，定期或实时对风险进行评估、预警、监督，从而识别、评估和预警与公司管理及基金运作有关的风险，通过审阅的报告渠道，对风险问题进行层层监督、管理、控制，使部门和管理层即时把握风险状况并及时、快速作出风险控制决策；

9）建立自动化监督控制系统：公司启用投资指标监控系统等计算机辅助控制系统，对投资比例限制和禁止等方面进行电子化控制，有效地防止了运作风险和操守风险；

10）不断强化投资纪律，严格遵守证券选择流程：公司不断强化投资纪律，加强集体决策机制，各基金的行业配置比例、基金经理个股授权、基准仓位等由投资决策委员会决定。公司还建立了契约风险评估制度，定期对各基金遵守基金合同的情况进行评估，防范契约风险。

5.基金管理人关于内部合规控制书的声明

1）基金管理人确知建立、实施和维持内部控制制度是本公司董事会及管理层的责任；

2）本基金管理人承诺以上关于内部控制的披露真实、准确；

3）本基金管理人承诺根据市场变化和公司发展不断完善内部控制体系和内部控制制度。

## 六、基金的募集

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》等有关法律法规，以及基金合同的规定，经中国证监会证监许可［2011］257号文核准募集。

具体发售方案以本基金的基金份额发售公告为准，请投资者就发售和购买事宜仔细阅读本基金的基金份额发售公告。

（一）基金运作方式和类型

契约型开放式证券投资基金，QDII–股票型证券投资基金

（二）基金的存续期间

不定期

（三）募集方式

通过基金销售网点（包括基金管理人的直销中心及代销机构的代销网点，具体名单见基金份额发售公告）公开发售。除法律法规另有规定外，任何与基金份额发售有关的当事人不得预留和提前发售基金份额。

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或基金管理人的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法权利，否则，由此产生的投资人任何损失由投资人自行承担。

（四）募集期限

本基金的设立募集期限自基金份额发售之日起最长不得超过3个月。（具体募集时间详见基金份额发售公告及销售机构相关公告）

（五）募集对象

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。

（六）募集币种

人民币

（七）募集规模上限

在国家外汇管理局批准的外汇额度范围内，本基金设定募集规模上限为50亿元。募集期内超过募集规模上限时采取比例配售的方式进行确认，具体内容参见基金份额发售公告。

基金合同生效后，基金的资产规模不受募集规模上限限制，但基金管理人有权根据基金的外汇额度控制基金申购规模并暂停基金的申购。

（八）基金份额的认购

1.募集场所

本基金的认购通过基金销售机构各网点（包括基金管理人的直销中心及代销机构的代销网点，具体名单见本基金基金份额发售公告）进行。

销售机构办理本基金认购业务的城市（网点）的具体情况和联系方法，请参见本基金的基金份额发售公告。

基金管理人可以根据情况增加其他代销机构，并另行公告。

2.基金份额的面值、认购费用、认购价格及计算公式

1）基金份额面值：本基金份额初始面值为1.00元人民币。

2）认购费率

本基金单笔认购费率如下表：

| 认购金额M（元） | 认购费率 |
|---|---|
| M<100万 | 0.8% |
| 100万≤M<500万 | 0.5% |
| 500万≤M<1000万 | 0.3% |
| M≥1000万 | 每笔1000元 |

投资者在一天之内如果有多笔认购，适用费率按单笔分别计算。本基金的认购费用在投资人认购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、登记结算等基金募集期发生的各项费用。

3）认购份额的计算

净认购金额=认购金额/（1+认购费率）

认购费用=认购金额–净认购金额

认购份额=（净认购金额+认购金额利息）/基金份额初始面值

认购份额计算结果保留到小数点后两位，小数点后两位以后部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有，其中利息以登记结算机构的记录为准。

例如：某投资者认购本基金10,000元，所对应的认购费率为0.8%。假定该笔认购金额产生利息5.20元。则认购份额为：

净认购金额=认购金额/（1+认购费率）=10,000/（1+0.8%）=9,920.63元

认购费用=认购金额–净认购金额=10,000–9,920.63=79.37元

认购份额=（净认购金额+认购金额利息）/基金份额面值=（9,920.63+5.20）/1.00=9,925.83份

即：投资者投资10,000元认购本基金份额，假定该笔认购金额产生利息5.20元，则在基金合