(上接D6版)

金差额为负数,则投资人应根据其赎回的基金份额支付相应的现金。

6、申购、赎回清单的格式

申购、赎回清单的格式举例如下:

基本信息

最新公告日期	2010-12-1
基金名称	上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金
基金管理公司名称	华泰柏瑞基金管理有限公司
一级市场基金代码	510221

2010年11月30日信息内容

现金差额(单位:元)	¥11,308.75
最小申购、赎回单位资产净值(单位:元)	¥3,573,668.75
基金份额净值(单位:元)	¥3.574

2010年12月1日信息内容

预估现金部分(单位:元)	¥11,308.75
现金替代比例上限	50%
是否需要公布IOPV	是
最小申购、赎回单位(单位:份)	1,000,000
申购、赎回的允许情况	允许申购、允许赎回

成份股信息内容

股票代码	股票简称	股票数量	现金替代标志	现金替代溢价比例	固定替代金额
600004	白云机场	600	允许	10%	
600006	东风汽车	1000	允许	10%	
600007	中国国贸	300	允许	10%	
600008	首创股份	1400	允许	10%	
600009	上海机场	1200	允许	10%	
600010	包钢股份	3200	允许	10%	
600011	华能国际	3400	允许	10%	
600012	皖通高速	400	允许	10%	
600017	日照港	1100	允许	10%	
600018	上港集团	5300	允许	10%	
600020	中原高速	1100	允许	10%	
600021	上海电力	800	允许	10%	
600022	济南钢铁	1600	允许	10%	
600026	中海发展	800	允许	10%	
600027	华电国际	1300	允许	10%	
600029	南方航空	2600	允许	10%	
600031	三一重工	2500	允许	10%	
600033	福建高速	1700	允许	10%	
600035	楚天高速	500	允许	10%	
600037	歌华有线	800	允许	10%	
600038	哈飞股份	200	允许	10%	
600039	四川路桥	300	允许	10%	
600052	浙江广厦	600	允许	10%	
600054	黄山旅游	200	允许	10%	
600056	中国医药	200	允许	10%	
600058	五矿发展	500	允许	10%	
600059	古越龙山	500	允许	10%	
600060	海信电器	500	允许	10%	
600062	双鹤药业	400	允许	10%	
600063	皖维高新	300	允许	10%	
600064	南京高科	500	允许	10%	
600066	宇通客车	500	允许	10%	
600067	冠城大通	600	允许	10%	
600068	葛洲坝	2600	允许	10%	
600069	银鸽投资	700	允许	10%	
600072	中船股份	300	允许	10%	
600073	上海梅林	200	允许	10%	
600074	中达股份	600	允许	10%	
600075	新疆天业	300	允许	10%	
600078	澄星股份	500	允许	10%	
600079	人福医药	400	允许	10%	
600082	海泰发展	600	允许	10%	
600085	同仁堂	300	允许	10%	
600086	东方金钰	200	允许	10%	
600087	长航油运	1200	允许	10%	
600088	中视传媒	200	允许	10%	
600090	啤酒花	400	允许	10%	
600093	禾嘉股份	300	允许	10%	
600096	云天化	400	允许	10%	
600098	广州控股	800	允许	10%	
600100	同方股份	900	允许	10%	
600102	莱钢股份	300	允许	10%	
600103	青山纸业	1100	允许	10%	
600106	重庆路桥	500	允许	10%	
600107	美尔雅	400	允许	10%	
600108	亚盛集团	1700	允许	10%	
600109	国金证券	400	允许	10%	
600110	中科英华	1200	允许	10%	
600111	包钢稀土	600	允许	10%	
600112	长征电气	300	允许	10%	
600117	西宁特钢	600	允许	10%	
600118	中国卫星	400	允许	10%	
600120	浙江东方	300	允许	10%	
600121	郑州煤电	400	允许	10%	
600122	宏图高科	400	必须		5,716.00
600123	兰花科创	400	允许	10%	
600125	铁龙物流	900	允许	10%	
600126	杭钢股份	400	允许	10%	
600127	金健米业	500	允许	10%	
600128	弘业股份	200	允许	10%	
600129	太极集团	300	允许	10%	
600132	重庆啤酒	400	允许	10%	
600133	东湖高新	400	允许	10%	
600138	中青旅	500	允许	10%	
600139	西部资源	100	允许	10%	
600141	兴发集团	300	允许	10%	
600150	中国船舶	200	允许	10%	
600151	航天机电	500	允许	10%	
600153	建发股份	1700	允许	10%	
600157	永泰能源	200	允许	10%	
600158	中体产业	800	允许	10%	
600160	巨化股份	400	允许	10%	
600161	天坛生物	300	允许	10%	
600162	香江控股	500	允许	10%	
600163	福建南纸	600	允许	10%	
600166	福田汽车	800	允许	10%	
600169	太原重工	500	允许	10%	
600170	上海建工	500	允许	10%	
600171	上海贝岭	700	允许	10%	
600173	卧龙地产	500	允许	10%	
600176	中国玻纤	300	允许	10%	
600177	雅戈尔	1400	允许	10%	
600178	东安动力	300	允许	10%	
600183	生益科技	700	允许	10%	
600188	兖州煤业	700	允许	10%	
600190	锦州港	700	允许	10%	
600191	华资实业	300	允许	10%	
600195	中牧股份	200	允许	10%	
600196	复星医药	1200	允许	10%	
600197	伊力特	300	允许	10%	
600198	大唐电信	400	允许	10%	
600201	金宇集团	300	允许	10%	
600202	哈空调	300	允许	10%	
600208	新湖中宝	1900	允许	10%	
600210	紫江企业	1400	允许	10%	
600216	浙江医药	300	允许	10%	
600219	南山铝业	1200	允许	10%	
600220	江苏阳光	1600	允许	10%	
600221	海南航空	1500	允许	10%	
600227	赤天化	1000	允许	10%	
600230	沧州大化	200	允许	10%	
600231	凌钢股份	500	允许	10%	
600236	桂冠电力	1100	允许	10%	
600239	云南城投	300	允许	10%	
600240	华业地产	500	允许	10%	
600246	万通地产	800	允许	10%	
600249	两面针	500	允许	10%	
600251	冠农股份	200	允许	10%	
600252	中恒集团	500	允许	10%	
600255	鑫科材料	500	允许	10%	
600256	广汇股份	900	允许	10%	
600258	首旅股份	100	允许	10%	
600260	凯乐科技	500	允许	10%	
600261	浙江阳光	200	允许	10%	
600263	路桥建设	200	允许	10%	
600266	北京城建	600	允许	10%	
600267	海正药业	300	允许	10%	
600268	国电南自	200	允许	10%	
600269	赣粤高速	1500	允许	10%	
600270	外运发展	500	允许	10%	
600271	航天信息	600	允许	10%	
600276	恒瑞医药	500	允许	10%	
600281	太化股份	300	允许	10%	
600282	南钢股份	1000	允许	10%	
600283	钱江水利	200	允许	10%	
600284	浦东建设	300	允许	10%	
600288	大恒科技	400	允许	10%	
600289	亿阳信通	600	允许	10%	
600290	华仪电气	200	允许	10%	
600291	西水股份	300	允许	10%	
600293	三峡新材	300	允许	10%	
600295	鄂尔多斯	300	允许	10%	
600298	安琪酵母	200	允许	10%	
600300	维维股份	1000	允许	10%	
600307	酒钢宏兴	500	允许	10%	
600308	华泰股份	600	允许	10%	
600309	烟台万华	1000	允许	10%	
600312	平高电气	800	允许	10%	
600315	上海家化	300	允许	10%	
600316	洪都航空	400	允许	10%	
600317	营口港	700	允许	10%	
600320	振华重工	2200	允许	10%	
600322	天房发展	1100	允许	10%	
600325	华发股份	800	允许	10%	
600326	西藏天路	500	允许	10%	
600328	兰太实业	300	允许	10%	
600329	中新药业	300	允许	10%	
600330	天通股份	600	允许	10%	
600331	宏达股份	800	允许	10%	
600332	广州药业	300	允许	10%	
600333	长春燃气	300	允许	10%	
600337	美克股份	300	允许	10%	
600339	天利高新	500	允许	10%	
600348	国阳新能	1500	允许	10%	
600350	山东高速	800	允许	10%	
600351	亚宝药业	800	允许	10%	
600352	浙江龙盛	1300	允许	10%	
600354	敦煌种业	200	允许	10%	
600358	国旅联合	400	允许	10%	
600359	新农开发	200	允许	10%	
600360	华微电子	500	允许	10%	
600361	华联综超	400	允许	10%	
600363	联创光电	400	允许	10%	
600366	宁波韵升	300	允许	10%	
600368	五洲交通	400	允许	10%	
600369	西南证券	600	允许	10%	
600376	首开股份	300	允许	10%	
600377	宁沪高速	1000	必须		6,710.00
600380	健康元	700	允许	10%	
600382	广东明珠	300	允许	10%	
600386	北巴传媒	300	允许	10%	
600387	海越股份	400	允许	10%	
600388	龙净环保	200	允许	10%	
600395	盘江股份	400	允许	10%	
600396	金山股份	300	允许	10%	
600398	凯诺科技	600	允许	10%	
600406	国电南瑞	400	允许	10%	
600408	安泰集团	800	允许	10%	
600409	三友化工	600	允许	10%	
600410	华胜天成	300	允许	10%	
600415	小商品城	900	允许	10%	
600416	湘电股份	300	允许	10%	
600418	江淮汽车	1000	允许	10%	
600422	昆明制药	200	允许	10%	
600425	青松建化	400	允许	10%	
600426	华鲁恒升	400	允许	10%	
600428	中远航运	800	允许	10%	
600429	三元股份	400	允许	10%	
600432	吉恩镍业	400	允许	10%	
600435	中兵光电	400	允许	10%	
600438	通威股份	400	允许	10%	
600439	瑞贝卡	700	允许	10%	
600449	赛马实业	200	允许	10%	
600456	宝钛股份	300	允许	10%	
600458	时代新材	200	允许	10%	
600467	好当家	500	允许	10%	
600468	百利电气	200	允许	10%	
600469	风神股份	300	允许	10%	
600470	六国化工	200	允许	10%	
600475	华光股份	200	允许	10%	
600478	科力远	300	允许	10%	
600479	千金药业	300	允许	10%	
600480	凌云股份	300	允许	10%	
600481	双良节能	500	允许	10%	
600482	风帆股份	400	允许	10%	
600487	亨通光电	100	允许	10%	
600488	天药股份	400	允许	10%	
600491	龙元建设	200	允许	10%	
600496	精工钢构	300	允许	10%	
600497	驰宏锌锗	600	允许	10%	
600498	烽火通信	200	允许	10%	
600499	科达机电	600	允许	10%	
600500	中化国际	900	允许	10%	
600503	华丽家族	100	允许	10%	
600507	方大特钢	700	允许	10%	
600508	上海能源	400	允许	10%	
600509	天富热电	500	允许	10%	
600510	黑牡丹	300	允许	10%	
600511	国药股份	400	允许	10%	
600516	方大炭素	800	允许	10%	
600517	置信电气	500	允许	10%	
600518	康美药业	1500	允许	10%	
600521	华海药业	300	允许	10%	
600522	中天科技	300	允许	10%	
600523	贵航股份	200	允许	10%	
600525	长园集团	300	允许	10%	
600528	中铁二局	900	允许	10%	
600529	山东药玻	300	允许	10%	
600531	豫光金铅	200	允许	10%	
600533	栖霞建设	800	允许	10%	
600535	天士力	300	允许	10%	
600536	中国软件	100	允许	10%	
600537	海通集团	200	允许	10%	
600540	新赛股份	100	允许	10%	
600543	莫高股份	300	允许	10%	
600545	新疆城建	500	允许	10%	
600546	山煤国际	300	允许	10%	
600548	深高速	400	允许	10%	
600549	厦门钨业	300	允许	10%	
600551	时代出版	200	允许	10%	
600553	太行水泥	300	允许	10%	
600555	九龙山	700	允许	10%	
600557	康缘药业	400	允许	10%	
600565	迪马股份	600	允许	10%	
600569	安阳钢铁	1200	允许	10%	
600572	康恩贝	200	允许	10%	
600575	芜湖港	300	允许	10%	
600578	京能热电	200	允许	10%	
600580	卧龙电气	400	允许	10%	
600581	八一钢铁	500	允许	10%	
600582	天地科技	500	允许	10%	
600583	海油工程	2400	允许	10%	
600584	长电科技	1100	允许	10%	
600585	海螺水泥	1300	允许	10%	
600586	金晶科技	500	允许	10%	
600588	用友软件	400	允许	10%	
600589	广东榕泰	500	允许	10%	
600590	泰豪科技	400	允许	10%	
600595	中孚实业	700	允许	10%	
600596	新安股份	600	允许	10%	
600597	光明乳业	500	允许	10%	
600598	北大荒	900	允许	10%	
600599	熊猫烟花	100	允许	10%	
600600	青岛啤酒	400	允许	10%	
600601	方正科技	2800	允许	10%	
600602	广电电子	700	允许	10%	
600611	大众交通	800	允许	10%	
600612	老凤祥	100	允许	10%	
600616	金枫酒业	400	允许	10%	
600618	氯碱化工	300	允许	10%	
600620	天宸股份	400	允许	10%	
600621	上海金陵	500	允许	10%	
600622	嘉宝集团	500	允许	10%	
600623	双钱股份	100	允许	10%	
600624	复旦复华	300	允许	10%	
600626	申达股份	400	允许	10%	
600628	新世界	500	允许	10%	
600630	龙头股份	400	允许	10%	
600631	百联股份	800	允许	10%	
600635	大众公用	1700	允许	10%	
600636	三爱富	300	允许	10%	
600637	广电信息	500	允许	10%	
600638	新黄浦	600	允许	10%	
600639	浦东金桥	300	允许	10%	
600641	万业企业	500	允许	10%	
600642	申能股份	2400	允许	10%	
600643	爱建股份	1000	允许	10%	
600644	乐山电力	300	允许	10%	
600648	外高桥	100	允许	10%	
600649	城投控股	1400	允许	10%	
600650	锦江投资	200	允许	10%	
600651	飞乐音响	800	允许	10%	
600652	爱使股份	700	允许	10%	
600653	申华控股	2200	允许	10%	
600654	飞乐股份	900	允许	10%	
600655	豫园商城	1400	允许	10%	
600657	信达地产	600	允许	10%	
600660	福耀玻璃	1800	允许	10%	
600662	强生控股	700	允许	10%	
600663	陆家嘴	500	允许	10%	
600664	哈药股份	900	允许	10%	
600665	天地源	500	允许	10%	
600673	东阳光铝	300	允许	10%	
600674	川投能源	500	允许	10%	
600675	中华企业	1200	允许	10%	
600676	交运股份	600	允许	10%	
600677	航天通信	400	允许	10%	
600682	南京新百	300	允许	10%	
600685	广船国际	200	允许	10%	
600686	金龙汽车	400	允许	10%	
600690	青岛海尔	1000	允许	10%	
600692	亚通股份	300	允许	10%	
600702	沱牌曲酒	300	允许	10%	
600703	三安光电	200	允许	10%	
600704	中大股份	400	允许	10%	
600708	海博股份	400	允许	10%	
600710	常林股份	400	允许	10%	
600713	南京医药	300	允许	10%	
600717	天津港	1100	允许	10%	
600718	东软集团	500	允许	10%	
600720	祁连山	500	允许	10%	
600723	西单商场	400	允许	10%	
600724	宁波富达	500	允许	10%	
600725	云维股份	400	允许	10%	
600726	华电能源	1000	允许	10%	
600729	重庆百货	200	允许	10%	
600736	苏州高新	700	必须		3,731.00
600737	中粮屯河	600	允许	10%	
600741	华域汽车	1300	允许	10%	
600742	一汽富维	200	允许	10%	
600747	大连控股	900	允许	10%	
600748	上实发展	500	允许	10%	
600750	江中药业	200	允许	10%	
600754	锦江股份	200	允许	10%	
600755	厦门国贸	900	允许	10%	
600756	浪潮软件	200	允许	10%	
600759	正和股份	500	允许	10%	
600761	安徽合力	300	允许	10%	
600765	中航重机	500	允许	10%	
600770	综艺股份	500	允许	10%	
600776	东方通信	500	允许	10%	
600777	新潮实业	600	允许	10%	
600779	水井坊	400	允许	10%	
600780	通宝能源	700	允许	10%	
600782	新钢股份	500	允许	10%	
600783	鲁信高新	100	允许	10%	
600787	中储股份	500	允许	10%	
600789	鲁抗医药	400	允许	10%	
600790	轻纺城	600	允许	10%	
600797	浙大网新	1000	允许	10%	
600798	宁波海运	500	允许	10%	
600801	华新水泥	100	允许	10%	
600802	福建水泥	300	允许	10%	
600804	鹏博士	700	允许	10%	
600805	悦达投资	500	允许	10%	
600806	昆明机床	300	允许	10%	
600808	马钢股份	3000	允许	10%	
600809	山西汾酒	200	允许	10%	
600811	东方集团	1700	允许	10%	
600812	华北制药	1000	允许	10%	
600815	厦工股份	500	允许	10%	
600816	安信信托	400	允许	10%	
600818	中路股份	100	允许	10%	
600820	隧道股份	600	允许	10%	
600823	世茂股份	400	允许	10%	
600824	益民集团	600	允许	10%	
600825	新华传媒	500	允许	10%	
600826	兰生股份	200	允许	10%	
600827	友谊股份	200	允许	10%	
600829	三精制药	100	允许	10%	
600830	香溢融通	400	允许	10%	
600831	广电网络	500	允许	10%	
600832	东方明珠	2000	允许	10%	
600834	申通地铁	200	允许	10%	
600835	上海机电	500	允许	10%	
600836	界龙实业	300	允许	10%	
600838	上海九百	500	允许	10%	
600839	四川长虹	2500	允许	10%	
600844	丹化科技	200	允许	10%	
600851	海欣股份	700	允许	10%	
600858	银座股份	300	允许	10%	
600859	王府井	300	允许	10%	
600861	北京城乡	300	允许	10%	
600862	南通科技	200	允许	10%	
600863	内蒙华电	700	允许	10%	
600864	哈投股份	400	允许	10%	
600866	星湖科技	700	允许	10%	
600867	通化东宝	500	允许	10%	
600872	中炬高新	1000	允许	10%	
600874	创业环保	500	允许	10%	
600875	东方电气	800	允许	10%	
600877	中国嘉陵	600	允许	10%	
600879	航天电子	800	允许	10%	
600880	博瑞传播	500	允许	10%	
600881	亚泰集团	2400	允许	10%	
600884	杉杉股份	400	允许	10%	
600886	国投电力	800	允许	10%	
600888	新疆众和	300	允许	10%	
600893	航空动力	200	允许	10%	
600894	广钢股份	400	允许	10%	
600895	张江高科	1000	允许	10%	
600896	中海海盛	600	允许	10%	
600897	厦门空港	100	允许	10%	
600961	株冶集团	300	允许	10%	
600963	岳阳纸业	700	允许	10%	
600966	博汇纸业	400	允许	10%	
600970	中材国际	400	允许	10%	
600971	恒源煤电	200	允许	10%	
600973	宝胜股份	100	允许	10%	
600978	宜华木业	1000	允许	10%	
600983	合肥三洋	300	允许	10%	
600995	文山电力	400	允许	10%	
600997	开滦股份	800	允许	10%	
600999	招商证券	900	允许	10%	
601001	大同煤业	800	允许	10%	
601002	晋亿实业	400	允许	10%	
601003	柳钢股份	600	允许	10%	
601005	重庆钢铁	600	允许	10%	
601009	南京银行	2600	允许	10%	
601099	太平洋	400	允许	10%	
601107	四川成渝	800	允许	10%	
601117	中国化学	1200	允许	10%	
601139	深圳燃气	300	允许	10%	
601179	中国西电	1100	允许	10%	
601299	中国北车	4200	允许	10%	
601333	广深铁路	3600	允许	10%	
601588	北辰实业	2000	允许	10%	
601607	上海医药	1000	允许	10%	
601666	平煤股份	1100	允许	10%	
601727	上海电气	900	允许	10%	
601801	皖新传媒	100	允许	10%	
601808	中海油服	700	允许	10%	
601866	中海集运	3000	允许	10%	
601872	招商轮船	1700	允许	10%	
601877	正泰电器	100	允许	10%	
601888	中国国旅	300	允许	10%	
601918	国投新集	700	允许	10%	
601989	中国重工	2500	允许	10%	
601991	大唐发电	900	允许	10%	
601999	出版传媒	200	允许	10%	

(八)暂停申购、赎回的情形

在如下情况下,基金管理人可以暂停接受投资者的申购、赎回申请:

1、不可抗力导致基金无法接受申购、赎回;

2、上海证券交易所决定临时停市,导致基金管理人无法计算当日基金资产净值;

3、基金管理人开市前未能公布申购、赎回清单;

4、上海证券交易所、申购赎回代理券商、登记结算机构因异常情况无法办理申购、赎回;

5、发生基金合同规定的暂停基金资产估值的情况;

6、法律法规、上海证券交易所规定或中国证监会认定的其他情形。

在发生暂停申购或赎回的情形之一时,本基金的申购和赎回可能同时暂停。

发生上述情形之一的,基金管理人应当在当日报中国证监会备案,并及时公告。在暂停申购、赎回的情况消除时,基金管理人应及时恢复申购、赎回业务的办理并予以公告。

(九)基金申购与其他服务

在条件允许时,基金管理人可开放集合申购,即允许多个投资者集合其持有的组合证券,共同构成最小申购、赎回单位或其整数倍,进行申购。

在条件允许时,基金管理人也可采取其他合理的申购方式,并于新的申购方式开始执行前的至少3个工作日予以公告。

(十)其他

基金管理人可根据市场情况,对上述申购和赎回的安排进行补充和调整,最迟应在新的申购赎回安排实施3个工作日前在至少一家指定媒体及基金管理人网站上予以公告。

十一 基金的非交易过户、冻结、质押及其他业务

注册登记机构可依据其《业务规则》,受理基金份额的非交易过户、冻结与解冻等业务,并收取一定的手续费用。

十二 基金的投资

(一)投资目标

紧密跟踪标的指数表现,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

(二)投资范围

本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象,指数化投资比例即投资于指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的95%。如因标的指数成份股调整导致基金投资比例不符合上述标准的,基金管理人将在10个交易日内进行调整。同时为更好地实现投资目标,本基金也可少量投资于新股、债券、非成份股、股指期货及中国证监会允许基金投资的其他金融工具,股指期货以套期保值为目的,权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。但因法律法规的规定而受限制的情形除外。

(三)投资理念

本基金的投资管理将遵循指数化投资理念,以综合反映沪市中小盘公司整体状况的上证中小盘指数作为标的指数,通过完全复制的被动式投资管理实现跟踪偏离度和跟踪误差的最小化,为投资者带来良好的长期投资回报的同时,满足投资者多样化的投资需求。

(四)投资策略

在正常市场情况下,本基金日均跟踪偏离度(剔除成份股分红因素)的绝对值不超过0.2%,年跟踪误差不超过2%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围,基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

本基金采取完全复制法,即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情况(如流动性不足)导致无法获得足够数量的股票时,基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合,追求尽可能贴近目标指数的表现。

特殊情况主要是指在标的指数成份股发生变动、增发配股等公司行为导致成份股的构成及权重发生变化时,由于交易成本、交易制度、个别成份股停牌或者流动性不足等原因导致基金无法及时完成投资组合的同步调整,基金管理人需要采用其他合理的投资方法构建尽可能贴近目标指数的基金组合。

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等,主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金力争利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差,达到有效跟踪标的指数的目的。

1、决策依据

有关法律、法规、基金合同和标的指数的相关规定是基金管理人运用基金财产的决策依据。

2、投资管理体制

本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理团队制。投资决策委员会负责决定有关指数重大调整的应对决策、其他重大组合调整决策以及重大的单项投资决策;基金经理决定日常指数跟踪维护过程中的组合构建、调整决策以及每日申购、赎回清单的编制决策。

3、投资程序

研究、决策、组合构建、交易、评估、组合维护的有机配合共同构成了本基金的投资管理程序。严格的投资管理程序可以保证投资理念的正确执行,避免重大风险的发生。

(1)研究:依托公司整体研究平台,数量分析师整合外部信息以及券商等外部研究力量的研究成果开展指数跟踪,成份股公司行为等相关信息的搜集与分析、流动性分析、误差及其归因分析等工作,撰写研究报告,作为基金投资决策的重要依据。

(2)投资决策:投资决策委员会依据数量分析师提供的研究报告,定期召开或遇重大事项时召开投资决策会议,决策相关事项。基金经理根据投资决策委员会的决议,每日进行基金投资管理的日常决策。

(3)组合构建:根据标的指数,结合研究报告,基金经理以完全复制指数成份股权重方法构建组合。在追求跟踪误差和偏离度最小化的前提下,基金经理将采取适当的方法,以降低买入成本、控制投资风险。

(4)交易执行:集中交易室负责具体的交易执行,同时履行一线监控的职责。

(5)投资绩效评估:数量分析师定期和不定期对基金进行投资绩效评估,并提供相关报告。绩效评估能够确认组合是否实现了投资预期、组合误差的来源及投资策略成功与否,基金经理可以据此检讨投资策