

（续前D14版）

本基金认购、申购、赎回等业务可由基金管理人及基金管理人委托的具有基金代销业务资格的其他机构办理。基金管理人委托其他机构办理本基金下列申购、赎回、赎回等业务,应当与其签订书面委托代理协议,以明确授权内容和责任,并由基金管理人按照法律法规和基金合同约定的标准办理本基金的认购、申购和赎回等业务。

十三、基金的投资

(一) 投资目标
紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

(二) 投资范围

本基金主要投资于标的指数成份股,备选成份股,为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于非标的指数成份股 包中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票、新股、债券、股指期货和中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会的规定。在建仓完成后,本基金投资于标的指数成份股,备选成份股的比例不低于基金资产净值的95%,如法律法规允许基金投资其他品种,基金管理人可在履行适当程序后,可以择机进行投资。

(三) 投资策略

本基金管理人坚持指数化投资理念,以低成本投资于标的指数的成份证券为目标场合,以期获得标的指数所代表的市场平均水平的投资收益。

1.股票投资策略

本基金主要采取完全复制法,即按照标的指数的成份股组成及其权重构建投资组合,并根据标的指数的成份股及其权重的变动进行相应的调整。但特殊情况时,如成份股停牌、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通股量发生变化、成份股公司行为、市场流动性不足等,导致无法按照标的指数成份股及其权重进行同步调整,本基金管理人将对投资组合进行优化,尽量降低跟踪误差。

在正常市场情况下,本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%,年跟踪误差不得超过2%。如因标的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,本基金管理人应采取合理措施降低跟踪误差,跟踪误差进一步放大。

2.债券投资策略

本基金在保持基金资产流动性的前提下,可以投资于短期在一年期以内的政府债券、央行票据和金融债,债券投资的目的主要是保证基金资产流动性并提高基金资产的收益率。

3.股指期货投资策略

本基金股指期货持仓将根据风险管理原则,以套期保值为目的。主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约,本基金参与股指期货合约的交易,降低投资组合跟踪误差或对冲系统性风险,达到有效控制跟踪误差的目的。

4. 股指期货风险管理

本基金管理人应在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和招募说明书(更新)等文件中披露股指期货交易情况,包括投资政策、持仓情况、风险敞口等,并充分揭示股指期货交易对基金收益和风险的影响及其是否符合规定的投资政策与目标。

5. 股指期货决策程序

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.投资管理程序:本基金投资决策采取自上而下的基金经理制。投资决策委员会负责确定有关指数重大调整的对标要求,其他重大调整决策以及重大的标的投资决策;投资决策委员会日常跟踪跟踪过程中的组合构建、调整决策以及每日申购赎回的编制决策。

3. 投资支持

研究支持:投资决策委员会、组合投资、交易执行、绩效评估、组合维护等流程的有机结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以保证投资理念的严格执行,避免外部信息对基金经理的干扰,减少非市场因素对基金经理支持:基金经理小组依托基金经理人整体研究平台,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、成份股公司等有关信息的研究和分析,流动性分析、误差及其归因分析等工作,深入研究,为基金投资决策提供重要依据。

6.组合构建:根据标的指数的成份股组成及其权重,基金经理通过定量、定性、定期调整重大事项(如新股发行)等方式,对标的指数的成份股进行跟踪,基金经理通过定量、定性、定期调整重大事项(如新股发行)等方式,对标的指数的成份股进行跟踪,基金经理通过定量、定性、定期调整重大事项(如新股发行)等方式,对标的指数的成份股进行跟踪。

6.组合维护:基金经理将跟踪标的指数变动,结合成份股基本面情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量规模以及组合投资绩效、基金资产净值等因素,对投资组合进行实时监控,在确保基金资产的前提下,根据市场环境变化和实际需要,对上述投资组合和程序做调整,并及时编制申购赎回清单。

7. 业绩比较基准

本基金业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数的代码为000033长传指数。

1. 标的指数涨跌幅:跟踪\$ME300指数,上证综指和深证成指涨跌幅发布,在上证综指300指数样本数中,综合考虑主营业务增长率、净利润增长率、净资产收益率三个成长性指标,选择前100只成长性最快的股票构成中小板300指数成份股,以剔除中小板成长股的整体权重。

如标的指数编制方式变更或标的指数的编制、发布或授权,或标的指数由其他指数替代,或由指数编制方法变更等原因导致本基金业绩比较基准变更,本基金管理人应在变更前至少30个工作日发布变更公告,变更后的投资标的指数和基金名称,若变更标的指数涉及法律法规的限制,在不影响投资者利益的前提下,经与基金托管人协商一致,则无需召开基金份额持有人大会,基金管理人应与基金托管人协商一致,报中国证监会备案并公告。

6.组合维护:基金经理将跟踪标的指数变动,结合成份股基本面情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量规模以及组合投资绩效、基金资产净值等因素,对投资组合进行实时监控,在确保基金资产的前提下,根据市场环境变化和实际需要,对上述投资组合和程序做调整,并及时编制申购赎回清单。

(四) 申购赎回与转换

1. 申购赎回与转换:本基金管理人应当在基金合同、招募说明书中明确基金份额持有人申购、赎回、转换、定投、定期定额投资等业务,并明确申购赎回清单的编制规则。

2. 基金资产净值

本基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

(一) 申购赎回与转换

1. 申购赎回与转换:本基金管理人应当在基金合同、招募说明书中明确基金份额持有人申购、赎回、转换、定投、定期定额投资等业务,并明确申购赎回清单的编制规则。

2. 基金资产净值

本基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

(二) 申购赎回与转换

1. 申购赎回与转换:本基金管理人应当在基金合同、招募说明书中明确基金份额持有人申购、赎回、转换、定投、定期定额投资等业务,并明确申购赎回清单的编制规则。

2. 基金资产净值

本基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

(三) 申购赎回与转换

1. 申购赎回与转换:本基金管理人应当在基金合同、招募说明书中明确基金份额持有人申购、赎回、转换、定投、定期定额投资等业务,并明确申购赎回清单的编制规则。

2. 基金资产净值

本基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

(四) 申购赎回与转换

1. 申购赎回与转换:本基金管理人应当在基金合同、招募说明书中明确基金份额持有人申购、赎回、转换、定投、定期定额投资等业务,并明确申购赎回清单的编制规则。

2. 基金资产净值

本基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

(五) 申购赎回与转换

1. 申购赎回与转换:本基金管理人应当在基金合同、招募说明书中明确基金份额持有人申购、赎回、转换、定投、定期定额投资等业务,并明确申购赎回清单的编制规则。

2. 基金资产净值

本基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

(六) 申购赎回与转换

1. 申购赎回与转换:本基金管理人应当在基金合同、招募说明书中明确基金份额持有人申购、赎回、转换、定投、定期定额投资等业务,并明确申购赎回清单的编制规则。

2. 基金资产净值

本基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

(七) 申购赎回与转换

1. 申购赎回与转换:本基金管理人应当在基金合同、招募说明书中明确基金份额持有人申购、赎回、转换、定投、定期定额投资等业务,并明确申购赎回清单的编制规则。

2. 基金资产净值

本基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

(八) 申购赎回与转换

1. 申购赎回与转换:本基金管理人应当在基金合同、招募说明书中明确基金份额持有人申购、赎回、转换、定投、定期定额投资等业务,并明确申购赎回清单的编制规则。

2. 基金资产净值

本基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

(九) 申购赎回与转换

1. 申购赎回与转换:本基金管理人应当在基金合同、招募说明书中明确基金份额持有人申购、赎回、转换、定投、定期定额投资等业务,并明确申购赎回清单的编制规则。

2. 基金资产净值

本基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

(十) 申购赎回与转换

1. 申购赎回与转换:本基金管理人应当在基金合同、招募说明书中明确基金份额持有人申购、赎回、转换、定投、定期定额投资等业务,并明确申购赎回清单的编制规则。

2. 基金资产净值

本基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

(十一) 申购赎回与转换

1. 申购赎回与转换:本基金管理人应当在基金合同、招募说明书中明确基金份额持有人申购、赎回、转换、定投、定期定额投资等业务,并明确申购赎回清单的编制规则。

2. 基金资产净值

本基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

(十二) 申购赎回与转换

1. 申购赎回与转换:本基金管理人应当在基金合同、招募说明书中明确基金份额持有人申购、赎回、转换、定投、定期定额投资等业务,并明确申购赎回清单的编制规则。

2. 基金资产净值

本基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

(十三) 申购赎回与转换

1. 申购赎回与转换:本基金管理人应当在基金合同、招募说明书中明确基金份额持有人申购、赎回、转换、定投、定期定额投资等业务,并明确申购赎回清单的编制规则。

2. 基金资产净值

本基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

(十四) 申购赎回与转换

1. 申购赎回与转换:本基金管理人应当在基金合同、招募说明书中明确基金份额持有人申购、赎回、转换、定投、定期定额投资等业务,并明确申购赎回清单的编制规则。

2. 基金资产净值

本基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

(十五) 申购赎回与转换

1. 申购赎回与转换:本基金管理人应当在基金合同、招募说明书中明确基金份额持有人申购、赎回、转换、定投、定期定额投资等业务,并明确申购赎回清单的编制规则。

2. 基金资产净值

本基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

(十六) 申购赎回与转换

1. 申购赎回与转换:本基金管理人应当在基金合同、招募说明书中明确基金份额持有人申购、赎回、转换、定投、定期定额投资等业务,并明确申购赎回清单的编制规则。

2. 基金资产净值

本基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

(十七) 申购赎回与转换

1. 申购赎回与转换:本基金管理人应当在基金合同、招募说明书中明确基金份额持有人申购、赎回、转换、定投、定期定额投资等业务,并明确申购赎回清单的编制规则。

2. 基金资产净值

本基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

(十八) 申购赎回与转换

1. 申购赎回与转换:本基金管理人应当在基金合同、招募说明书中明确基金份额持有人申购、赎回、转换、定投、定期定额投资等业务,并明确申购赎回清单的编制规则。

2. 基金资产净值

本基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

(十九) 申购赎回与转换

1. 申购赎回与转换:本基金管理人应当在基金合同、招募说明书中明确基金份额持有人申购、赎回、转换、定投、定期定额投资等业务,并明确申购赎回清单的编制规则。

2. 基金资产净值

本基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

(二十) 申购赎回与转换

1. 申购赎回与转换:本基金管理人应当在基金合同、招募说明书中明确基金份额持有人申购、赎回、转换、定投、定期定额投资等业务,并明确申购赎回清单的编制规则。

2. 基金资产净值

本基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

(二十一) 申购赎回与转换

1. 申购赎回与转换:本基金管理人应当在基金合同、招募说明书中明确基金份额持有人申购、赎回、转换、定投、定期定额投资等业务,并明确申购赎回清单的编制规则。

2. 基金资产净值

本基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

(二十二) 申购赎回与转换

1. 申购赎回与转换:本基金管理人应当在基金合同、招募说明书中明确基金份额持有人申购、赎回、转换、定投、定期定额投资等业务,并明确申购赎回清单的编制规则。

2. 基金资产净值

本基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

(二十三) 申购赎回与转换

1. 申购赎回与转换:本基金管理人应当在基金合同、招募说明书中明确基金份额持有人申购、赎回、转换、定投、定期定额投资等业务,并明确申购赎回清单的编制规则。

2. 基金资产净值

本基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

(二十四) 申购赎回与转换

1. 申购赎回与转换:本基金管理人应当在基金合同、招募说明书中明确基金份额持有人申购、赎回、转换、定投、定期定额投资等业务,并明确申购赎回清单的编制规则。

2. 基金资产净值

本基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

(二十五) 申购赎回与转换

1. 申购赎回与转换:本基金管理人应当在基金合同、招募说明书中明确基金份额持有人申购、赎回、转换、定投、定期定额投资等业务,并明确申购赎回清单的编制规则。

2. 基金资产净值

本基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

(二十六) 申购赎回与转换

1. 申购赎回与转换:本基金管理人应当在基金合同、招募说明书中明确基金份额持有人申购、赎回、转换、定投、定期定额投资等业务,并明确申购赎回清单的编制规则。

2. 基金资产净值

本基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

(二十七) 申购赎回与转换

1. 申购赎回与转换:本基金管理人应当在基金合同、招募说明书中明确基金份额持有人申购、赎回、转换、定投、定期定额投资等业务,并明确申购赎回清单的编制规则。

2. 基金资产净值

本基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

(二十八) 申购赎回与转换

1. 申购赎回与转换:本基金管理人应当在基金合同、招募说明书中明确基金份额持有人申购、赎回、转换、定投、定期定额投资等业务,并明确申购赎回清单的编制规则。

2. 基金资产净值

本基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

(二十九) 申购赎回与转换

1. 申购赎回与转换:本基金管理人应当在基金合同、招募说明书中明确基金份额持有人申购、赎回、转换、定投、定期定额投资等业务,并明确申购赎回清单的编制规则。

2. 基金资产净值

本基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

(三十) 申购赎回与转换

1. 申购赎回与转换:本基金管理人应当在基金合同、招募说明书中明确基金份额持有人申购、赎回、转换、定投、定期定额投资等业务,并明确申购赎回清单的编制规则。

2. 基金资产净值

本基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

(三十一) 申购赎回与转换

1. 申购赎回与转换:本基金管理人应当在基金合同、招募说明书中明确基金份额持有人申购、赎回、转换、定投、定期定额投资等业务,并明确申购赎回清单的编制规则。

2. 基金资产净值

本基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

(三十二) 申购赎回与转换

1. 申购赎回与转换:本基金管理人应当在基金合同、招募说明书中明确基金份额持有人申购、赎回、转换、定投、定期定额投资等业务,并明确申购赎回清单的编制规则。

2. 基金资产净值

本基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

(三十三) 申购赎回与转换

1. 申购赎回与转换:本基金管理人应当在基金合同、招募说明书中明确基金份额持有人申购、赎回、转换、定投、定期定额投资等业务,并明确申购赎回清单的编制规则。

2. 基金资产净值

本基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

(三十四) 申购赎回与转换

1. 申购赎回与转换:本基金管理人应当在基金合同、招募说明书中明确基金份额持有人申购、赎回、转换、定投、定期定额投资等业务,并明确申购赎回清单的编制规则。

2. 基金资产净值

本基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

(三十五) 申购赎回与转换

1. 申购赎回与转换:本基金管理人应当在基金合同、招募说明书中明确基金份额持有人申购、赎回、转换、定投、定期定额投资等业务,并明确申购赎回清单的编制规则。

2. 基金资产净值

本基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

(三十六) 申购赎回与转换

1. 申购赎回与转换:本基金管理人应当在基金合同、招募说明书中明确基金份额持有人申购、赎回、转换、定投、定期定额投资等业务,并明确申购赎回清单的编制规则。

2. 基金资产净值

本基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

(三十七) 申购赎回与转换

1. 申购赎回与转换:本基金管理人应当在基金合同、招募说明书中明确基金份额持有人申购、赎回、转换、定投、定期定额投资等业务,并明确申购赎回清单的编制规则。

2. 基金资产净值

本基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

(三十八) 申购赎回与转换

1. 申购赎回与转换:本基金管理人应当在基金合同、招募说明书中明确基金份额持有人申购、赎回、转换、定投、定期定额投资等业务,并明确申购赎回清单的编制规则。

2. 基金资产净值

本基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

(三十九) 申购赎回与转换

1. 申购赎回与转换:本基金管理人应当在基金合同、招募说明书中明确基金份额持有人申购、赎回、转换、定投、定期定额投资等业务,并明确申购赎回清单的编制规则。

2. 基金资产净值

本基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

(四十) 申购赎回与转换

1. 申购赎回与转换:本基金管理人应当在基金合同、招募说明书中明确基金份额持有人申购、赎回、转换、定投、定期定额投资等业务,并明确申购赎回清单的编制规则。

2. 基金资产净值

本基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

(四十一) 申购赎回与转换

1. 申购赎回与转换:本基金管理人应当在基金合同、招募说明书中明确基金份额持有人申购、赎回、转换、定投、定期定额投资等业务,并明确申购赎回清单的编制规则。

2. 基金资产净值

本基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

(四十二) 申购赎回与转换

1. 申购赎回与转换:本基金管理人应当在基金合同、招募说明书中明确基金份额持有人申购、赎回、转换、定投、定期定额投资等业务,并明确申购赎回清单的编制规则。

2. 基金资产净值

本基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

(四十三) 申购赎回与转换

1. 申购赎回与转换:本基金管理人应当在基金合同、招募说明书中明确基金份额持有人申购、赎回、转换、定投、定期定额投资等业务,并明确申购赎回清单的编制规则。

2. 基金资产净值

本基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

(四十四) 申购赎回与转换

1. 申购赎回与转换