(上接 D5 版) 5)建立切实有效的内部控制系统,查错防弊,清除隐患,保证业务稳健运行; 6)规范公司与股东之间的关联交易,避免股东干涉公司正常的经营管理活动。 (2)内部控制的原则 公司内部控制制度的建立产格谱顺以下原则

内部控制的原则 门内部控制制度的建立严格遵循以下原则 面性原则: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

懷等各个环节。
2) 有效性原则,一方面,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,另一方面,强化内部管理制度的高度权威性,任何人不得拥有超越制度或违反规章的权力;
3) 如立性原则。公司长机构,那门和岗位在限度上保持相对建立性,内部控制的检查,评价部门独立于内部控制的建立,执行部门、公司基金资产,自有资产以及其他资产的遗址之地,内部控制的检查,评价部门和岗位的设置必须权费分明。相互制衡,并通过切实可行的相互制约措施来消除内部控制中的自点。

制效果。
(3)內部控制制度的主要內容
(3)內部控制制度的主要內容
(3)內部控制制度的主要內容
(3)內部控制制度的主要內容
(3)內部控制制度的主要內容
(3)內部控制制度的主要內容
(5)內部控制制度的主要內容
(5)內部控制制度的方域控制和业务控制。
1)环境控制,指与內部定制附关的环境因素相互作用的综合效果及其对业务。员工的影响力,环境控制构成公司
郭控制的基础。公司致力于从治理结构。组织材构。企业文化、员工素面控制等方面实现良好的环境控制。
2)业务控制,包括投资管理业务控制,信息披露控制、信息技术系统控制。全计系统控制。监察精核控制及其它方的内部控制等。
4)股份管理业务控制:涉及到研究业务控制、投资决策业多控制、基金交易业务控制和对关联方交易的监控:
1)研究业务控制主要包括。
(3)司的部署(中部组织的企业企业,从资法等企业。

e. 监察稽核矩制、公司设立督察长、督察长直接对董事会负责、经董事会聘任,并报中国证监会核准。公司设立监察稽核部,对公司经营层负责,开展监察稽核工作,并保证监察稽核部门的独立性和权威性,确保公司各项经营管理 活动的有效运行。 6.其他内部控制机制;其他内部控制包括对销售和客户服务的控制,对基金托管人和基金代销机构等合作方的 控制,接收控制,危收理控制,持续的控制检验等。 第四部分 基金托管人

办公地址:上海市浦东新区银城中路 188 号 邮政编码。200120 注册时间。1987 年 3 月 30 日 注册时间。1987 年 3 月 30 日 注册资本,人民币 618.85 亿元 基金托管资格权文及文号,中国证监会证监基字[1998]25 号 联系人、張咏东 电话。021-32169999 交通银行始键于1908 年,是中国历史最悠久的银行之一,也形 2007 年 8 日本海市首东 上名所比較上年 岛中国中国的

电话。021-32169999 交通银行给证于1908年,是中国历史最悠久的银行之一,也是近代中国发钞行之一。交通银行先后于 2005年 6 2007年 5 月在香港联交所,上交所法除上市,是中国 2010年上海世博会唯一的商业银行全球合作农作,(實質) [The Asset]"2010年全球最快在多超代评选中,交通银行资源"中国最县联长线金管理银行","最佳水社企业等 项项大发、美国代银行家》资志 2011年公布的全球 1000 家银行锋名,交通银行以 343.21 亿美元的一级货本生货等 陈身全装海电影杆节 50氪 藏是 2011年 9 月 30 日上,交通银行资产金额达到人民币 43.65 万亿元,美现得利润人

一、王安八以同仇 牛锡明先生,交通银行行长,哈尔滨工业大学经济学硕士,高级经济师。2009 年 12 月起担任交通银行副董事长、

B收合中国证益会。 基金托管人发现基金管理人有重大违规行为,须立即报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正。

(不)具他學則 最近一年內及通報行及其負責资产托管业务的高級管理人员无重大违法违规行为,未受到中国人民银行、中国 证监会、中国银监会及其他有关机关的处罚。负责基金托管业务的高级管理人员在基金管理公司无兼职的情况。 季五部分 相关服务机构

第五部分 相关服务机构
-、基金份额发售机构
-)网下现金发售直销机构
安基金管理有限公司直销中心
公司在探测、过度、上海 广州、成都开设五个直销网点对投资者办理开户和认购业务;深圳直销中心
公处址、深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19—20 层
时度 4075、518048

市朝阳区光华路甲14号8-9层

地址:上海浦东新区世纪大道 210 号 903 室 编码:200120

A公地址:广州市珠: B改编码:510623 L话:020-38928980 是话:020-38928980 市珠江新城华夏路 10 号富力中心 502

狀系人,求丟三 (二)阿下羅金发售代理机构和网下股票发售代理机构 本基金阅下羅金发售代理机构和网下股票发售代理机构名单及其相关信息,参见基金份额发售公告。 (三)网上海级变替代理机构 《本本本百八年以四 上现金发售代理机构包括具有基金代销业务资格及深圳证券交易所会员资格的证券公司。具体名单详 具质网址 基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择其他符合要求的机构代理销售基金,并及时公告。 二、吞记结翰机构

城区金融大街 27 号投资广场 23 层 上記 : 0755-25941405 封真 : 0755-25987132 三、出具法律意见书的律师事务所和经办律师

定代表人/负责人/负责人/何赖斯 近,010-65180276 埃,010-65180276 均律师,虞卖方,高平均 审计基金财产的会计师事多所和经办注册会计师 练,国富浩华支计师事务所、特殊普通合伙) 所,北京海淀区西四环中路 16 号院 2 号楼 4 层 三组玄企业、基础学

联系人:门票 经办注册会计师:李英、韦雪

第六部分 基金的賽集 ,本基金由基金管理人依照(基金法),(室作办法),(销售办法),基金合同及其他有关规定募集。 ,核准定件

點金类型:股票型 基金的运作方式:交易型开放式 存续期间:不定期 四、募集方式

集方式。" 《集方式》 都可越转网上现金认购,网下现金认购和网下股票认购三种方式。 跟金认购是指投资者通过基金管理人员和定的发售代理机构用深圳证券交易所网上系统以现金进行认购。 现票以购是指投资者通过基金管理人及指使的发售代理机构以限金进行认购。 设票以购是指投资者通过基金管理人指定的发售代理机构以股票进行认购。 发票以购是指投资者通过基金管理人指定的发售代理机构以股票进行认购。 发售机场对认购申请的受理并不代表该申请一定成功,而仅代表发售机构确实接收到认购申请、认购的确 结算机构成是查理公司的确认结果旁相或于认购申请及认购份额的确认情况,投资者应及时查询并妥 去权利。否则,由此产生的投资者任何损失由投资者自行承担。

(1.575-1.575) 符合法律法规规定的个人投资者、机构投资者及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者。 七、繁集场所 投资者应当在基金管理人及其指定发售代理机构办理基金发售业务的营业场所,或者按基金管理人或发售代理 根据在企业中通过企业等的

基金管理人、发售代理机构办理基金发售业务的具体情况和联系方式,请参见发售公告。 基金管理人可以根据情况增加其他发售代理机构,并另行公告。 、(A/B)// / P 投资者认购本基金时需持有证券账户,证券账户是指深圳证券交易所 A 股账户(以下简称"A 股账户")或深圳

投资省认购本基金时需持有业券帐户,业券帐户是指深圳业券交易所 A 股帐户(以下尚称"A 股帐户")或深圳 证券交易所证券投资基金账户,则应注意; (1)深圳证券交易所证券投资基金帐户(能进行基金份额的现金认购和二级市场交易,如投资者需要参与网下 股票以购或基金份额的申购,账回,则应开立。長账户。 (2) 开户当日无法办理和定交易,建议投资者在进行认购前至少2个工作日办理开户手续。 2.如投资者已开立证券帐户,则应注意; (1)如投资者未办理指定交易,或指定交易在不办理本基金发售业务的证券公司,需要指定交易或转指定交易,在 可为理本基金发售业务的证券公司。 (2)当日办理指定交易或转指定交易的投资者当日无法进行认购,建议投资者在进行认购至少提前1个工作日 为理格定多员或转指定交易手续。 5.1.以除用

本基金的认购费用由投资者承担,认购费率不高于0.8%,认购费率如下表:

上,周上现金认购 1. 从即时间: 详见报金价细发售公告。 3. 通过发售代理机构进行网上界金认购的认购金额的计算。 通过发售代理机构进行网上界金认购的投资者,认购以基金份额申请,认购佣金、认购金额的计算公式为。 人助佣金二认购价格以认购份额。佣金比率, 从购佣金出场的格以认购份额。佣金比率, 从购留金1认购价格以场购份额。(14佣金比率) 从购佣金出场管体以价格以价值的企业。 从购佣金的工资格,以购价值。 1. 某投资者通过某发售代理机构采用现金方式交纳认购佣金。 则需准备的资金金额订集如下。

认购用金=1,000x0.8%=8. 元 认购金额=1,000x(1-0.8%)=1,008. 元 即投资者需准备 1,008 元资金。方可认购到 1,000 份本基金基金份额。 3,认购限额,网上现金以购以基金份额申请。单一帐户每笔认购份额需为 1,000 份或其整数倍,最高不得超过 99,999,000 份。投资者可以多次认购。累计认购价额不没上限。 4.认购手续,投资者在认购本基金时,据按发售代理机构的规定。备足认购资金,办理认购手续。网上现金认购申请提交后,投资者可以在当日交易时间内撤销指定的认购申请。

5、清算交收、T 日通过发售代理机构提交的网上现金认购申请,由该发售代理机构冻结相应的认购资金, 登记结算机构进行清算交收,并将有效认购数据发送发售协调人,发售协调人于网上现金认购结束后的第4个工作日将实

1、則定額=800,000×(14-0.5%)=804,000 元 注稅營務所得认购份額。 200,000,000-807,00=800,080 份 即,若该投疫的,000-807,00=800,080 份 第一生也利息方 80 元,则可得到600,080 份基金份额。 3.通过发售代理机构进行网下聚金认购的认购金额的计算。同通过发售代理机构进行网上现金认购的认购金额 的;1.4以限限额。网下聚金认购以基金份额申请,投资者通过发售代理机构进行网下现金认购的,每笔认购的领额须为 4.000 份或非数效值,投资者通过基金管理人办理网下基金认购的。每笔认购价额或为 过部分缓为,1万份的整数值,投资者可以多次认购。累计认购份额不设上现。 5.认购年线,投资者在认购本基金时,据按销售机构的规定,到销售网点办理相关认购手续,并各定认购资金。网 下现金、以申申请推交后在销售机构规定的时间之后不得撤销。 6.消费交收;打通过基金管理人基分例可干现金以购申请,由基金管理人进行有效认购款项的清算交收、紧集 期结束后,基金管理人基个部本个工作日将汇总的认购款项及其利息划往基金紧集专户。其中,认购款项利息将折算 为基金份额用投资者所有。

4、转殊情形
(1)已公告的将被调出中小板等权重指数的成份股不得用于认购本基金。
(1)已公告的将被调出中小板等权重指数的成份股不得用于认购本基金。
(2)限制个股认购规模。基金管理人可根据网下股票认购目前3个月个股的交易量、价格波动及其他异常情况。
(2)原制个股认购规模进行限制,并在阿下股票认购用面至3个工作日公告限制认购规模的个股名单。
(3)临时拒绝个股认购,对于在网下股票认购期间价格波动异常或认购申报数量异常的个股,基金管理人可不经
5.消费之收

公告,途前逐而分批电波较深的认同时报。
5. 海算交份
5. 海算交份
5. 海算交份
5. 海算交份
6. 海里交份
6. 海里交份
6. 海里交份
6. 海里交易
6. 海里
6.

投资者的认购份额= (第i只股票在股票认购期最后一日的均价x有效认购数量)/1.00

其中。
(1) 代表投资者提定认购申请的第;只股票,如投资者仅提交了1只股票的申请,则;=1。
(2) 常;只股票在网下股票认购期最后一日的均价"由基金管理人根据采训证券交易所的当日行情数据,以该股票的总成交金额能以总成交股数计算。以四全五人的方法保留小股点后两位。若该股票在当日传除成无成交,则以同方法计算是近一个交易目的均价作为计算价格。否果一股聚在同下股票认购即最后一日全登记货期和规划分量,可以为一个大方式讨废罪之很多,以即则是一日均价,在股票企股利以股股。
1)除息,调整后价格。阿下股票认购期最后一日均价,在股票金股利或股息
2) 港股,调整后价格。阿下股票以购期最后一日均价,在股票金股利或股息
2) 港股,调整后价格。阿下股票以购期最后一日均价,4年股产股产的分,14年股产股产股份)(4年股产股股份)(4年股产股股份)(4年股上股份)(4年股上股份)(4年股上股股份)(4年股上股股股股份)(4年股上股股股股股份)(4) 进股且配股;调整后价格。阿下股票认购期最后一日均价,4年股价,在股份人们,4年股股股股股份)(4) 进股且配股;调整后价格。(阿下股票认购期最后一日均价,4亿股份人或股比例)(1) 年股股股股股份

5)除息且送股;调整后价格=(网下股票认购期最后一日均价-每股现金股利或股息)/(1+每股送股比例) 6)除息且配股;调整后价格=(网下股票认购期最后一日均价+配股价x配股比例-每股现金股利或股息)/(1+每股

配股比例)
7)除息,送股且配股,调整后价格=(何下股票认购期最后一日均价+配股价×配股比例—每股现金股利或股息)/(1+每股送股比例+每股起股比例)
(3)*有效从购数量是拍由基金管理人确认的并据此以进行清算交收的股票股款,其中;
1)对于经公告限制认购取粮的个股,如果投资者申报的个股认购数量总额大于下述公式计算的 qmax ,基金管理人有权对投资者的认购申报收进产指必免债机。

Cash 为网上现金认购和冈下现金认购的合计申请数额,pq,为除限制认购规模的个股和基金管理人全部或部分 能控指绝的个股以外均其它个股在网下股票以购购最后一日均价和认购申根数量乘积,*** 为途限制认购规模的个股 接均价计算的其在网下股票认购购最后一日在标的指数中的权重(认购则面句标的指数调整公告)则基金等的是 根据公告调整后的或的股名单以及标的指数编制规则计算调整后的多成份股构成权重,并以其作为计算依据),pp 该股在网下股票以购购最后一日的均价。

第七部分 基金合同的生效 第七部分 基金合同的生效 一、基金合同生效条件 本基金目基金价额发售之日起3个月内,在基金募集价额总额不少于2亿份、基金募集金额(含网下股票认购所 赛集的股票市值1水少于2亿元人民币,且基金认购产数不少于200户的条件下,基金管理人依据法律法规及招募院的 明书可以决定停止基金货售,并在10日内购销产定验资机和股资,自收到整资报告之目起10日内,向中国监监会办 理基金备案手续。 基金募集公别基金备案条件的,自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起。(基金 台同)生效;否则《基金台同》不生效。基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对《基金台同》生效事宜予以公生

一、基金份额的上市 《基金合同》生效后,具备下列条件的,基金管理人可依据《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》,向深圳证券

所作用基金份额上市。

1. 基金赛集金额(令假干股票)、陈宏智理人则依据《梁圳证券交易所证券投资基金上市规则》,向深圳证券易所申请基金多额(令假干股票认购所票集的股票市值)不低于2亿元人民币;

2. 基金价额持有人不少于0000人。

3. (深圳证券交易所证券投资基金上市规则)规定的其他条件。
基金上市前,基金管理人应与深圳证券交易所签订工市协议书。基金份额获准在深圳证券交易所上市的,基金管 医在基金份额上市日的3个工作目前发布基金份额上市交易公告书。

— 基金份额原制上市日03个工作目前发布基金份额上市交易公告书。
— 基金份额原则出市交易

(807),张文阳《说·梦知明》(守有大地)。 王、管停上市交易期间出现下列情形之一的,深圳证券交易所可暂停基金的上市交易,并报中国证监会备案; 1. 不再具备《野训证券交易所证券投资基金上市规则)规定的上市条件, 3. 产量进发评划证券交易所证券发晚的资土市, 3. 产量进发评划证券交易所有关规则的。 4. 深圳证券交易所认为应当暂停其上市的其他情形。 当暂停上市临光润除后,基金管理人可间张到证券交易所提出恢复上市申请,经深圳证券交易所核准后可恢复 金金上市,并在至少一种指定媒体发布基金恢复上市公告。 四、终止上市交易

以《美术》》》。 基金份额上市交易后,有下列情形之一的,深圳证券交易所可终止基金的上市交易,并报中国证监会备案: 1、自暂停上市之日起半年内未能消除暂停上市原因的;

1.目對除上市之日起半年內未能消除對於上市原因的;
2.(基金合同於止,
3.基金份繼持有人大会決定终止上市;
3.基金份繼持有人大会決定终止上市;
5.深圳证券交易所外之為空場終止上市的其他情形。基金管理人应当在收到深圳证券交易所終止基金上市的决于起之日内安布基金終止上市の其他情形。基金管理人应当在收到深圳证券交易所終止上市的,本基金将在履行运当程户起之日内安布基金終止上市公告。
若因上述 1.4 项等原因使本基金不再具备上市条件而被深圳证券交易所终止上市的开放式指数基金。否届时本会理人已有以该指数作为标的指数的指数法金、则本基金将本着维护基金份额持有人合法权益的原则,确定是取其他合适的指数作为标的指数的指数选金、则本基金将本着维护基金份额持有人合法权益的原则,确定是取其他合适的指数作为标的指数。
五.基金份额参与净值(IOPV)的计算与公告基金管理人在每一交易日开市前间深圳证券交易所提供当日的申购赎回清单、深圳证券交易所在开市后根据申包海律单组组合证券内各只证券的实时成交数据,计算并发布基金份额参考净值(IOPV),供投资者交易、申购、赎金份额时参考。

機削公告,同时採中围止监会备案。 中期与赎回的开始时间 基金自(基金合同)生效之日起不超过3个月的时间起开始办理申购,赎回,具体业务办理时间在招募说明书 成另行公告,基金可在基金上市交易之前开始力理申购,但在基金申请上市期间,可暂停办理申购;具体赎 办理时间在赎回开始公告中规定。 金管理人在申购开始日前依照(信息按露办法)的有关规定在指定媒体上公告。

基金管理人在申购开始日,赎回开始日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。
(- 申购与城间的原则。
"份额申购 份额赎回 原则 即本基金的申购 赎回与以份额申请。
(- 中級,赎回申请接空后不得撤销。
(- 中級,赎回申请接空后不得撤销。
(- 申购,赎回申请接空后不得撤销。
(- 申购,赎回申请接空后不得撤销。
(- 申购,赎回申请接空后不得撤销。
(- 申购,赎回申请接空后不得撤销。
(- 申购,账回应的效率的。)
(- 申购,账回应的效率的。)
(- 申购,账回应的效率的。)
(- 申购,账回的参查份额需为最小申助账回单位的整数倍。
在多金净中期,账回的基金份额需为最小申助账回单位的整数倍。
在多金净小申购帐回单位为20万份,基金管理人有权对其进行更改,并在调整生效前依照《信息披露办法》的。
成定至少在一家指定媒体公告并报中国证监会备案。
(- 申购与账回的程序

(大學) 「基金投资者必须根据申购、赎回代理券商规定的程序,在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。 學營者在申购本基金时须按申购、赎回清单的规定各足相应数量的股票和现金,投资者在提交赎回申请时,必须

、申购与赎回的清算交收与登记 上基金申购赎回过程中涉及的股票和基金份额交收适用深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的

七、用购赎回酒串的/1分子的4九 1 申购赎回清单公告内容包括。最小申购赎回单位所对应的组合证券内各成份证券数据、现金替代、T日现金 50 遊价比例、T日允许现金替代的最高比例、T日预估现金部分、T-1 日现金差额、基金份额净值及其他相关内容。 2、申购赎回清单组合证券相关内容 组合业产业各基金额的指数所包含的全部或部分证券。申购赎回清单将公告最小申购赎回单位所对应的各成 2. 企业工业和工证帐码

7/中夠映图中(1) 中胸映图单位是基金申购赎回的最基本单位。 购赎回酒单观金替作相关内容 替代是指申购 赎回过程中 投资者按《基金合同》和招募说明书的规定,用于替代组合证券中部分证券的一

定な室口、定17年時、駅回以程中,投資省按(基金合同)和招募説明书的規定,用于替代組合证券中部分证券的一定数量的現金、 定数量的現金、 (1)現金替代分为3种类型,禁止現金替代(标志为"禁止"),可以現金替代(标志为"允许")和必須現金替代(标志 为"必須")。 5·须门。 蒙止现金替代是指在申购,駿回基金份额时,汝成份证券不允许使用现金作为替代。 可以现金替代是指在申购基金份额时,允许使用现金作为全部或部分该成份证券的替代,但在赎回基金份额时, 是一日以上月14年內容。至时獨可,允许使用现金作为全部或部分该成份证券 「多年的。」 「全替代是指在申购、赎回基金份额时」。 「该成份证券必须使用现金作为替代。 「以现金替代」

)可以现金管代 适用情形:可以现金替代的证券一般是由于停牌等原因导致投资者无法在申购时买人的证券,或基金管理人 以采用现金替代的其他情形。

以为可以采用更多替代的其他情形。

2) 替代金额:对于可以现金替代的证券;替代金额的计算公式为:替代金额:对于可以现金替代的证券的代金额的计算公式为:替代金额:对于可以现金替代的证券。转代金额的计算公式为:替代金额—替代金等场格。
由前"该证券参考价格"的确定原则为:
A、该证券生常会局中,是用最新成交价;B、用意修伊供价格。C、该证券停粮上当日元成交时;采用前收盘价(为虑当日的除权除息等因素)。
如果都加速安克易序等价格确定则发生完化。以深圳证券交易所通知规定的参考价格为准。
取取可以现金替代溢价的原因是、对于使用可以现金替代的证券。基金管理人有申购财金额价,是用的发展的产量作,基金管理人有的原因是、对于使用可以现金替代的证券。基金管理人有的原因是、对于使用可以现金替代的证券。基金管理人有的原因是、对于使用可以现金替代的证券。基金管理人有的原因是一种原格,是不是一种原格,是一种原格。这种原本是一种原格的实际成本,则基金管理人将退还多级取的衰竭。如果预先成取的金额依于基金的人该部分证券的实际成本,则基金管理人有规定。
3) 替代金额的处理程序
T日、基金管理人在申购赎租程序

放音化盖侧三角两次包带的 被语气证 分类体的人就中部上致微凝症 (水泉區) 11 异的木胸人的单形 放音气证分析的人就中部上致微凝症 (水泉區) 11 异的木胸人的单形 放音气证分析 有现金替代目 16 百年 142 日 16 年 17 工作日 16 五年 49 日 16 五年 17 工作日 16 五年 49 日 16 五年 17 工作日 16 五年 49 时 18 五年 21 个交易日)基金管理人将应退款和补款的明细及正 2 数据数法给相关申畴顺回代理券商和基金任管人,相关款项的清算交收将于进后 3 个工作日内完成。 4 分析代谢,为更有效比别基金任管人,相关款项的清算交收将于进后 3 个工作日内完成。 4 分析代谢,为更有效比别基金任务是一定任务。 4 五年 18 元年 18 元年

 $\sum_{i=1}^{\infty}$ 英。只替代证券的數量。该证券参与价格。100% 表金替代比例(%)= $\frac{14}{2}$ 甲购基金份额×参考基金份额净值(1979) 参考基金份額净值目前为最新基金份额参考净值。如果深圳证券交易所参考基金份额净值计算方式发生变化, 以深圳证券交易所通知规定的参考基金份额净值为准。

(3)必須現金替代 1)适用情形:必須現金替代的证券—般是由于标的指数调整。即将被剔除的成份证券,或基金管理人出于保护持 有人利益等原因以为有必要实行必须现金替代的成份证券。 2)替代金融 对于必须现金替代的证券,基金管理人将在申勒赎回清单中公告替代的一定数量的现金,即"固定 替代金额"。固定替代金额的计算方法为申购赎回清单中该证券的数量乘以其了日预计开盘价。

002011 002017 002022 002023 002024 002025 002028 002029	东信和平 科华生物 海特高新 苏宁电器 航天电器	900 300 200 800 100	允许 允许 允许 允许 允许	21.00% 21.00% 21.00% 21.00% 21.00%	
002022 002023 002024 002025 002028 002029	科华生物 海特高新 苏宁电器 航天电器	200 800 100	允许 允许 允许	21.00% 21.00% 21.00%	
002023 002024 002025 002028 002029	海特高新 苏宁电器 航天电器	800 100	允许 允许	21.00% 21.00%	
002024 002025 002028 002029	苏宁电器 航天电器	100	允许	21.00%	
002025 002028 002029	航天电器				
002028 002029					
002029			允许	21.00%	
	思源电气	1200	允许	21.00%	
	七匹狼	2100	允许	21.00%	
002030	达安基因	300	允许	21.00%	
002037	久联发展	100	允许	21.00%	
002038	双鹭药业	200	允许	21.00%	
002041	登海种业	100	允许	21.00%	
002045	广州国光	100	允许	21.00%	
002048	宁波华翔	200	允许	21.00%	
002051	中工国际	100	允许	21.00%	_
002056	横店东磁	300	允许	21.00%	_
002064	华峰氨纶	100	允许	21.00%	
002065	东华软件	800	允许	21.00%	
	※平¥X11+ 獐子岛		允许		
002069		100		21.00%	
002073	软控股份	100	允许	21.00%	
002078	太阳纸业	100	允许	21.00%	
002080	中材科技	500	允许	21.00%	
002081	金螳螂	100	允许	21.00%	
002083	平日股份	100	允许	21.00%	
002091	江苏国泰	200	允许	21.00%	
002092	中泰化学	300	允许	21.00%	
002093	国脉科技	100	允许	21.00%	
002097	山河智能	100	允许	21.00%	
002104	恒宝股份	200	允许	21.00%	
002104	天马股份	100		21.00%	+
			允许		+
002123	荣信股份	100	允许	21.00%	1
002128	露天煤业	100	允许	21.00%	
002129	中环股份	100	允许	21.00%	
002242	九阳股份	200	允许	21.00%	
002218	拓日新能	100	允许	21.00%	
002233	塔牌集团	500	允许	21.00%	
002237	恒邦股份	100	允许	21.00%	
002161	远望谷	100	允许	21.00%	
002244	浜江集团	200	允许	21.00%	
002032	苏泊尔	100	允许	21.00%	
002142	宁波银行	100	允许	21.00%	
002142	薬宝瘟科	100	允许	21.00%	
	兴化股份	700	允许		
002109	三領闽光		允许	21.00%	
002110	三钠圆元 东华科技	100		21.00%	
002140		200	允许	21.00%	
002146	荣盛发展	100	允许	21.00%	
002152	广电运通	800	允许	21.00%	
002153	石基信息	1200	允许	21.00%	
002155	辰州矿业	300	允许	21.00%	
002172	澳洋科技	2300	允许	21.00%	
002183	怡亚通	1500	允许	21.00%	
002191	劲嘉股份	300	允许	21.00%	
002202	金风科技	200	允许	21.00%	
002001	新和成	800	允许	21.00%	
002179	中航光电	100	允许	21.00%	
002269	美邦服饰	200	允许	21.00%	
002254	泰和新材	5000	允许	21.00%	
002249	大洋电机	2100	允许	21.00%	
002063	远光软件	300	允许	21.00%	
002232	启明信息	100	允许	21.00%	
002230	科大讯飞	200	允许	21.00%	
002100	天康生物	100	允许	21.00%	
002154	报喜鸟	100	允许	21.00%	
002167	东方锆业	200	允许	21.00%	
002277	友阿股份	100	允许	21.00%	
002362	汉王科技	300	允许	21.00%	
002385	大北农	100	允许	21.00%	1
002383	海普瑞	800	允许	21.00%	+
002399	20年10年10年2月 20年10年10年2月	100	允许	21.00%	+
002415	科伦药业	100	允许	21.00%	+
					+
002068	黑猫股份	100	允许	21.00%	+
002086	东方海洋	500	允许	21.00%	
002089	新海宜	100	允许	21.00%	
002096	南岭民爆	100	允许	21.00%	
002304	洋河股份	200	允许	21.00%	
002121	科陆电子	300	允许	21.00%	
002294	信立泰	100	允许	21.00%	
002168	深圳惠程	100	允许	21.00%	
002299	圣农发展	200	允许	21.00%	
002310	东方园林	100	允许	21.00%	
002408	齐翔腾达	100	允许	21.00%	1
002408	荣盛石化	100	允许	21.00%	+
002493	上西正春	100	允许	21.00%	+
					+
002013	中航精机	200	允许	21.00%	1
002156	通富微电	100	允许	21.00%	
002003	伟星股份	500	允许	21.00%	
002004	华邦制药	100	允许	21.00%	
002005	德豪润达	100	允许	21.00%	
002006	精功科技	200	允许	21.00%	
002079	苏州固锝	100	允许	21.00%	
002190	成飞樂成	100	允许	21.00%	
002223	鱼跃医疗	100	允许	21.00%	1
002225	漢耐股份	700	允许	21.00%	+
002225	类解胶份 大华股份	700		21.00%	+
002236 002241			允许		1
	歌尔声学	200	允许	21.00%	
002405 002594	四维图新	100 800	允许 允许	21.00%	

基金合同》生效后,为揭高交易便利,本基金可以进行份额扩解。
 基金份额折算的时间
 基金份额折算的时间
 基金份额折算的时间
 基金份额折算的时间
 基金份额折算的原则
 基金份额折算的原则
 基金份额折算的原则
 基金份额折算自,基金份量、内容记结算机构申请办理,并由登记结解机构进行基金份额的变更登记。
 基金份额折算日。基金份数自基金份额自当基金份额合理人持有的基金份额持有人的权益无实质性影響。
 据参有人持有的基金份额合理人表金份额分享后或基金份额折算对基金份额持有人的权益无实质性影点金份额折算的基金份额折算的表金份额折算的方法。
 如果基金份额折算的方法
 基金份额折算公告中到示。
 基金份额折算的方法
 基金份额折算的方法
 基金份额折算公告中到示。
 基金份额新算以方法在份额折算公告中列示。
 基金份额的非交易过户。该特自解索
 全记结算机构可根据其业务规则受理基金份额的非交易过户。该结与解源等业务、并收取一定的手续费用。
 第十部分
 基金的投资
 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的最小化,实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。

— 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,包括标的指数成份股票,各造成份股票,一级市场新发股票, 券,权证,股指期常以及注律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但缓符合中国证监会相关规定)。其 本基金投资干标的指数成份股票及各造成份股票的比例不成于基金资产价值的90%。 加法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

三、投资理念 本基金以积合、跟踪中小板等权重指数为原则,通过指数化的方式投资于中小企业上市公司,力求为投资者提供 成本较低的标的指数投资工具。

成本校底的标的指数投资工具。 四、标的指数单址域比较基准 1.标的指数 本基金的标的指数为中人领等权重指数,此指数由深圳证券信息有限公司编制维护,并于 2011年 10 月 28 日正 设布、中小板等权重指数的成份股和中小板指数相同,采用等权重进行加权,使得指数中每只股票拥有同等地位, 有了每只股票对指数的影响,中小板等权重指数具有高成长性和高收益性,兼具价值尺度和投资标的的功能。 2.业绩比较基准。

平衡了每只聚评对批数的影响。中小板等权重指数具有高成长性和高收益性,兼具价值尺度和投资标的的功能。
2. 业绩比较基准
本基金的业绩比较基准为中小板等权重指数收益率。
3. 如果指数发布机构变更或者停止上述标的拍数编制及发布,或者上述标的指数由其他指数代替,本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则,进行适当的程序变更本基金的转势,指数,使更强力。
3. 如果指数发布机构变更或者停止上述标的拍数编制及发布,或者上述标的指数由其他指数代替,本基金管理人可以依据维护基金份额持有人大会,并报中国证监会备案且在指定的媒体工制会公告。若标的指数变更对基金投资无法理性影响。但括任风界中编制机构变更消数更多等,则无需召开基金份额持有人大会,基金是份表生化常人同避后,提中国证监会备案并及时公告。
五. 投资策略
基金任常人同避后,担中国证监会备案并及时公告。
五. 投资策略
本基金主要采取完全复制策略摄除标的指数的表现,即按照标的指数的成份股票的构成及其权重构建基金股票按组会,并根据标的指数成份股票及各违成份股票的比例承依于基金资产净值的 90%。
本基金并根据标的指数的成份股票及的均成分是实现在分量的比例本依于基金资产净值的 90%。
本基金种根据标的指数的成份股票的构成,这些标合包括但不限于以下情形。(1)法律法规伺限制,(2)标的指数的成份股票的的成份原来,同时使解(4)其他合理 服局导致本基金管理人的指数的服然的成份服务的成份服务的成份服务的企理服务的本基金管理人的指数的服然的成分重要的企业标的指数的服然的成分是未是一个现代的一个工作,是不是一个工作,是

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负责制,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限踪推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

对次误,其他無人组言國歷次數以及進入的早級收收於東流臺至建次定日布指数減減率的沒有平的组言构建。與整 決策以及應用於 研究。 研究,以保证投資理念的正确执行。避免生产和企物的发生。 (1)研究,基金经理,研究人员保任全人可整体研究平台,整合外部信息以及券商等外部研究力量的研究成果开展 指数限器。成份股公司行为等相关信息的搜集与分析,流动性分析,淡是及其归因分析等工作,撰写研究报告,作为基 多投资决策的重要依赖。使需要引金依据研究和发展。主题可用或通重大中期时召开投资决策委员会会议,决策相关基 支投资决策的重要依赖,使需要引金依据研究和发展。主题可用或通重大中期时召开投资决策委员会会议,决策相关基 为发现实现在整代税,使需要引金依据研究和发展。主题可用或通重大中期时召开投资决策委员会会议,决策相关事 是一个人员工程,提供资本资金的地区,每日由产品全投资管理的日常决策。 基本资本特益,提供的市场数,将全研发化各一基金经理以完全规则相较或价便及其收重的方法构建组合,在追求 服然起差和编高度是从化的销售下,基金经理将采取适当的方法、以降低买人成本、控制投资风险。 (4)写身地分子及与中心的产具体的支贴,可同时便用一个概定部的财务。 (5)投资地分证务中心的产具体的支贴外不同时间产一概定部的财务。 (4)写身地分评分。与中心的产具体的支收策的发现。在多经理可以提出处计投资额,进而调整投资组合。 (4)写为地分等的,从分级的资本资本的实现,就可能是被对于经历,并是使用关密,适而调整、经验的工程 (5)投资地分评价。因标识是的关键的实现,是是一种企业的的基本。在一种心,并是他用关键,是一种和联盟的现象 (4)投资的对于是一种,是一种一种企业的企业,并是一种的企业,并是一种和联盟的现象,并是 (5)组合管理。 (1)组合管理。 (1)组合管理,是一种研究是企业和标价保险是可能发现的是一种对方法确定目标组合。 (2)确定自根设度组合的过程主要分为一步,确定目标组在分配,由处于经济发展的企业,是一种分子的 是一种企业,是一种分类的企业,是一种分别是一种分析,确定合理的建作领域。 (3)逐步则是一种研究,是一种分类的企业,是一种分类的企业,是一种分类的企业,是一种分类的企业,是一种分别的一种分别的企业,是一种的企业,是一种分别的企业,是一种分别的企业,是一种分别的企业,是一种分别的企业,是一种分别的企业,是一种分别的企业,是一种分别的企业,是一种分别的企业,是一种分别的企业,是一种分别的企业,是一种分别的企业,是一种分别的企业,是一种分别的企业,是一种分别的企业,是一种企业,是一种分别的企业,是一种的企业,是一种分别的企业,是一种分别的企业,是一种的企业,是一种的企业,是一种的企业,是一种企业,是一种的企业,是一种企业,是一种企业,是一种的企业,是一种企业,是一种企业,是一种企业,是一种企业,是一种企业,是一种的

到照路指数要求。 本基金服務标的指数的投资组合资产不低于基金资产净值的 90%。本基金将在(基金合同)生效之日起 3 个月的时间内达到这一投资比例。此后,如因标的指数成份股调整、基金申购或赎回导致现金头寸提高等因素导致基金不符合这一投资比例的。基金管理人将在 10 个交易日内进行调整。 (2)组合日常管理。 1)根据标的指数构成及权重,结合基金当前持有的证券组合及其比例,制作下一交易日基金的申购赎回清单并 A.生

(6)替代投资 付予则成份股,若其存在投资受限、严重的流动性困难、财务风险较大、而临重大不利的司法诉讼或者有充分而 台理的理由以为其被市场撞纵等情形时,本基金可以不投资该成份股,而用备选股,甚至现金米代替,或者选择与其 行业相近,定价特征类似或者收益率相关性较高的其他股票米代替,即采用"替代投资策略"应对,采用替代投资策略 5,股指期份投资策略 本基金投资组合对标相据风险管理的原则,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,交易活跃的股指期偿合约,通过多头或空头多期保值等策略进行套期保值操作,本基金 力争利用股指割货的杠杆作用,降低股票仓位频繁调整的交易成本和限踪误差,达到有效跟踪标的指数的目的。 六,投资限制

条销证券。 向他人格款或推供担保。 从事承担无限责任的投资。 买卖其绝基金份额。但法律法规或中国证监会另有规定的除外。 问基金管理人,基金托管人抵货或者买卖其基金管理人,基金托管人发行的股票或债券; 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 的证券或者采销期内承销的证券;

司安行的证券或者承销期内承销的证券; 1.从事内幕交易 7.从事内幕交易,推狱证券价格及其他不正当的证券交易活动; 8.当时有效的法律法规。中国证监会及任金台同规定禁止从事的其他行为。 对于因上达 5.6 项情形等或支控法投资标的指数成份股或备选成份股、基金管理人将在严格控制跟踪误差的前提 下结合使用其他合理方法进行替代。 如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定,本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。 (二段资组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制; 基金的投资组合应遵循以下限制; 1.本基金在任何交易日买人权证的金额,不超过上一交易日基金资产净值的 90%; 2.本基金在任何交易日买人权证的金额,不超过上一交易日基金资产净值的 90%。 2.本基金在任何交易日买人权证的金额,不超过上一交易日基金资产净值的 90%。 3.本基金进入金围银行间则业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%; 4.本基金财产参与股票发行申购,所申报的金额不得超过基金资产净值的 40%; 4.本基金财产参与股票发行申购,所申报的金额不得超过本基金的总资产,所申报的股票数量不得超过拟发行 股票公司本次发行股票的总量;

4、本基金财产参与股票发行申购,所申报的金额不得超过本基金的总资产,所申报的股票数量不得超过取发行股票的总量。 股票公司本次交行股票的总量。 股票公司本次交行股票的总量。 支持证券,其市位不得超过基金资产单值的 20%。持有的同一(持同一信用级别)资产支持证券的比例,不得超过该资资产支持证券,其市位不得超过基金资产单位的 20%。持有的同一(持同一信用级别)资产支持证券的比例。据金管理人管理的全部基金投资于同一原始仅这人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券的证规模的 10%; 6、本基金应投资于信用级别评级分 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间,如果其信用等数下除。不得各位资格能。这在评级报告发布之日起。3个月内予以公需要出; 1)本基金投资于标的指数或份按。备适成份接的比例不低于基金资产净值的 90%; 2)本基金投资于标的指数或份按。备适成份接的比例不低于基金资产净值的 90%; 2)本基金化任何交易日、人权证的总金额、不超过一次多目基金资产净值的 0.5%。基金持有的全部权证的市但证金差分另有规定的。强处是是一个企业。

=; 市场进行债券回购的资金全额不得权过其全资产净值的 40%。

九、基金的融资融券 本基金可以根据届时有效的有关法律法规和政策的规定进行融资融券。 第十一部分 基金的财产

第十一部分 基金的财产 基金资产总值是指本基金拥有的各类有价证券及票据价值、银行存款本息、债券的应计利息、基金应收的申购基 金款、资存的保证金以及其他投资所形成的价值总和。 其构成主要有; 1、银行存款及其应计利息。 2.结算各付金及其应计利息。 3.相报有关规定缴纳的保证金及其应收利息; 4.应收证券交易,消算款;

消算范围。 4.基金财产的债权不得与基金管理人、基金托管人固有财产的债务相抵销;不同基金财产的债权债务,不得相互抵销。由因基金财产本身承担的债务,不得对基金财产强制执行。 第十二部分 基金资产的估值

一、估值目的 基金资产的估值目的是客观、准确地反映基金财产的价值,并为基金份额的申购与赎回提供计价依据。 一、IOIBLU 未基金的估值日为基金合同生效后相关的证券交易场所的正常营业日以及法律法规规定需要对外披露基金净值的非营业日。

三、估值对象 基金所拥有的股票、债券、权证和银行存款本息、应收款项和其他投资等资产和负债。 网 估值程序 四、信值程序 基金日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行。基金份额净值由基金管理人完成估值后,将估值结果以双 方约定形式报给基金任管人、基金托管人接基金台同规定的估值方法,时间,程序进行复核、基金托管人复核无误后 特结果反馈检查金管理人人用基金管理人对外公布,月末,中中和平允倍复核与基金会计假目的核对同时进行。

五、估值方法 本基金按以下方式进行估值: 1、股票估值方法 1、似宗的旧历755. [1)上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值,估值日无交易的,且最近交易日后经济环境未发生变化的,以最近交易日的收盘价估值,估值日无交易,但最近交易日后经济环境发生了重大变化的,将参考类似

(2)水上中收录的证据: ①首次发行的股票,采用估值技术确定公允价值进行估值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估

①首次安行的股票,采用值徵技术确定公允价值进行估值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值。②首次公开发行有明确锁定期的股票,同一股票在交易所上市后,按估值日其所在证券交易所上市的同一股票以第(1)条确定的估值价格进行估值。
③选股、特增股、危股和公开增发新段等为方发行的股票,依估值日该上市公司在证券交易所上带的同一流通股票以第(1)条确定的估值价格进行估值。
④非公开发行有明确锁定期的股票按如下方法进行估值:
④,非公开发行有明确锁定期的股票按如下方法进行估值:
A. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票以第(1)条确定的估值价格代为信值日该中公开发行股票的初始取得成本时,原来用在证券交易所上市交易的同一股票以第(1)条确定的估值价格的一个工分产行股票的创始取得成本时,应该开考证券交易所上市交易的同一股票以第(1)条确定的估值价格的一个工分产产行股票的的价值,以上被下列公式确定估值日该单公开发行股票的价值。
PFU-G-(P-O)XOIL-D)701 (PV 分估值日该单公开发行股票的价值。C 为该非公开发行股票的初给取得成本时,应该产为价值的价值,C 为该非公开发行股票的初给取得成本 因发益业务导致市场价格解收到,应于除仅日对省的取得价值的发展,D7 为估值日任证券交易所上市交易的一段原的市价。D1 为资本公开发行股票的约条据所含的交易所的交易关数,不含价值日当天。 1 (1)在证券交易所市场上的实验,以为规定进行价值。 1 (1)在证券交易所市场注牌交易的实行净价交易的债务系统价值日本实易,且最近交易日的条环境设有。1 (1)在证券交易所市场注牌交易的实行净价交易的债务统价值日本交易,但最近交易日已经济环境未发生出来发现的,以最近交易目的收益价价值。1 (1)在证券交易所市场注牌交易的实行价值(2017年的,1000年的,1000年的一个工分,1000年的一个工价,1000年的一个工分,1000年的一个工分,1000年的一个工分,1000年的一个工分,1000年的一个工分,1000年的一个工分,1000年的一个工分,1000年的一个工分,1000年的一个工分,1000年的一个工分,1000年的一个工分,1000年的一个工分,1000年的一个工分,1000年的一个工分,1000年的工分,1