（上接B10版）

002326	永太科技	100	深市退补现金替代	10.0%	1430
002332	仙琚制药	300	深市退补现金替代	10.0%	3318
002340	格林美	300	深市退补现金替代	10.0%	3564
002342	巨力索具	400	深市退补现金替代	10.0%	3204
002345	潮宏基	100	深市退补现金替代	10.0%	2060
002362	汉王科技	100	深市退补现金替代	10.0%	1000
002383	合众思壮	100	深市退补现金替代	10.0%	1481
002384	东山精密	200	深市退补现金替代	10.0%	2124
002386	天原集团	300	深市退补现金替代	10.0%	2001
002392	北京利尔	200	深市退补现金替代	10.0%	1464
002393	力生制药	100	深市退补现金替代	10.0%	2840
002408	齐翔腾达	300	深市退补现金替代	10.0%	4650
002410	广联达	200	深市退补现金替代	10.0%	3602
002414	高德红外	100	深市退补现金替代	10.0%	1821
002424	贵州百灵	200	深市退补现金替代	10.0%	3494
002428	云南锗业	200	深市退补现金替代	10.0%	4668
002429	兆驰股份	400	深市退补现金替代	10.0%	5440
002437	誉衡药业	100	深市退补现金替代	10.0%	1595
002440	闰土股份	200	深市退补现金替代	10.0%	2720
002444	巨星科技	200	深市退补现金替代	10.0%	1892
002449	国星光电	300	深市退补现金替代	10.0%	2298
002450	康得新	400	深市退补现金替代	10.0%	8888
002461	珠江啤酒	200	深市退补现金替代	10.0%	1944
002463	沪电股份	500	深市退补现金替代	10.0%	2105
002465	海格通信	100	深市退补现金替代	10.0%	2684
002470	金正大	300	深市退补现金替代	10.0%	4548
002475	立讯精密	100	深市退补现金替代	10.0%	3240
002477	雏鹰农牧	400	深市退补现金替代	10.0%	7760
002479	富春环保	200	深市退补现金替代	10.0%	2568
002480	新筑股份	200	深市退补现金替代	10.0%	2064
002482	广田股份	300	深市退补现金替代	10.0%	5400
002489	浙江永强	200	深市退补现金替代	10.0%	1822
002498	汉缆股份	200	深市退补现金替代	10.0%	1810
002506	超日太阳	700	深市退补现金替代	10.0%	3969
002534	杭锅股份	100	深市退补现金替代	10.0%	1430
002574	明牌珠宝	100	深市退补现金替代	10.0%	1916
002585	双星新材	200	深市退补现金替代	10.0%	2212
002601	佰利联	100	深市退补现金替代	10.0%	2635
002612	朗姿股份	100	深市退补现金替代	10.0%	3201
002646	青青稞酒	100	深市退补现金替代	10.0%	2466
002648	卫星石化	200	深市退补现金替代	10.0%	3510
002651	利君股份	100	深市退补现金替代	10.0%	1424
002653	海思科	100	深市退补现金替代	10.0%	3132
600004	白云机场	600	允许	10.0%	
600008	首创股份	1500	允许	10.0%	
600017	日照港	1700	允许	10.0%	
600021	上海电力	900	允许	10.0%	
600033	福建高速	1900	允许	10.0%	
600038	哈飞股份	200	允许	10.0%	
600054	黄山旅游	200	允许	10.0%	
600056	中国医药	200	允许	10.0%	
600059	古越龙山	500	允许	10.0%	
600061	中纺投资	400	允许	10.0%	
600063	皖维高新	1400	允许	10.0%	
600064	南京高科	500	允许	10.0%	
600067	冠城大通	1000	允许	10.0%	
600069	银鸽投资	800	允许	10.0%	
600072	中船股份	400	允许	10.0%	
600073	上海梅林	400	允许	10.0%	
600075	新疆天业	400	允许	10.0%	
600078	澄星股份	500	允许	10.0%	
600079	人福医药	500	允许	10.0%	
600086	东方金钰	300	允许	10.0%	
600088	中视传媒	200	允许	10.0%	
600103	青山纸业	1100	允许	10.0%	
600106	重庆路桥	1000	允许	10.0%	
600107	美尔雅	400	允许	10.0%	
600110	中科英华	1600	允许	10.0%	
600112	长征电气	500	允许	10.0%	
600117	西宁特钢	600	允许	10.0%	
600121	郑州煤电	400	允许	10.0%	
600122	宏图高科	1200	允许	10.0%	
600127	金健米业	700	允许	10.0%	
600138	中青旅	600	允许	10.0%	
600139	西部资源	400	允许	10.0%	
600141	兴发集团	400	允许	10.0%	
600151	航天机电	700	允许	10.0%	
600157	永泰能源	1000	允许	10.0%	
600158	中体产业	900	允许	10.0%	
600161	天坛生物	300	允许	10.0%	
600162	香江控股	500	允许	10.0%	
600163	福建南纸	700	允许	10.0%	
600171	上海贝岭	700	允许	10.0%	
600176	中国玻纤	500	允许	10.0%	
600178	东安动力	300	允许	10.0%	
600184	光电股份	100	允许	10.0%	
600195	中牧股份	300	允许	10.0%	
600197	伊力特	300	允许	10.0%	
600198	大唐电信	400	允许	10.0%	
600199	金种子酒	500	允许	10.0%	
600200	江苏吴中	800	允许	10.0%	
600210	紫江企业	1600	允许	10.0%	
600220	江苏阳光	1900	允许	10.0%	
600223	鲁商置业	500	允许	10.0%	
600226	升华拜克	400	允许	10.0%	
600227	赤天化	1000	允许	10.0%	
600231	凌钢股份	500	允许	10.0%	
600236	桂冠电力	1200	允许	10.0%	
600239	云南城投	800	允许	10.0%	
600240	华业地产	1100	允许	10.0%	
600246	万通地产	800	允许	10.0%	
600251	冠农股份	200	允许	10.0%	
600258	首旅股份	100	允许	10.0%	
600261	阳光照明	300	允许	10.0%	
600268	国电南自	400	允许	10.0%	
600269	赣粤高速	1600	允许	10.0%	
600270	外运发展	500	允许	10.0%	
600277	亿利能源	400	允许	10.0%	
600284	浦东建设	500	允许	10.0%	
600287	江苏舜天	300	允许	10.0%	
600288	大恒科技	400	允许	10.0%	
600289	亿阳信通	600	允许	10.0%	
600290	华仪电气	500	允许	10.0%	
600292	九龙电力	300	允许	10.0%	
600293	三峡新材	300	允许	10.0%	
600295	鄂尔多斯	300	允许	10.0%	
600298	安琪酵母	200	允许	10.0%	
600300	维维股份	1100	允许	10.0%	
600308	华泰股份	1100	允许	10.0%	
600311	荣华实业	900	允许	10.0%	
600312	平高电气	900	允许	10.0%	
600322	天房发展	1200	允许	10.0%	
600325	华发股份	900	允许	10.0%	
600326	西藏天路	500	允许	10.0%	
600328	兰太实业	300	允许	10.0%	
600329	中新药业	200	允许	10.0%	
600330	天通股份	600	允许	10.0%	
600332	广州药业	300	允许	10.0%	
600333	长春燃气	300	允许	10.0%	
600337	美克股份	500	允许	10.0%	
600339	天利高新	500	允许	10.0%	
600340	华夏幸福	500	允许	10.0%	
600351	亚宝药业	900	允许	10.0%	
600360	华微电子	700	允许	10.0%	
600366	宁波韵升	500	允许	10.0%	
600373	中文传媒	200	允许	10.0%	
600380	健康元	800	允许	10.0%	
600386	北巴传媒	300	允许	10.0%	
600387	海越股份	400	允许	10.0%	
600388	龙净环保	200	允许	10.0%	
600408	安泰集团	1000	允许	10.0%	
600409	三友化工	1000	允许	10.0%	
600410	华胜天成	600	允许	10.0%	
600416	湘电股份	600	允许	10.0%	
600425	青松建化	500	允许	10.0%	
600426	华鲁恒升	900	允许	10.0%	
600428	中远航运	1100	允许	10.0%	
600429	三元股份	500	允许	10.0%	
600435	北方导航	600	允许	10.0%	
600436	片仔癀	100	允许	10.0%	
600438	通威股份	500	允许	10.0%	
600439	瑞贝卡	900	允许	10.0%	
600449	宁夏建材	400	允许	10.0%	
600458	时代新材	500	允许	10.0%	
600460	士兰微	600	允许	10.0%	
600467	好当家	500	允许	10.0%	
600468	百利电气	200	允许	10.0%	
600469	风神股份	300	允许	10.0%	
600475	华光股份	200	允许	10.0%	
600478	科力远	300	允许	10.0%	
600479	千金药业	300	允许	10.0%	
600480	凌云股份	300	允许	10.0%	
600481	双良节能	400	允许	10.0%	
600482	风帆股份	400	允许	10.0%	
600487	亨通光电	200	允许	10.0%	
600488	天药股份	400	允许	10.0%	
600491	龙元建设	800	允许	10.0%	
600496	精工钢构	600	允许	10.0%	
600499	科达机电	600	允许	10.0%	
600501	航天晨光	300	允许	10.0%	
600503	华丽家族	900	允许	10.0%	
600507	方大特钢	700	允许	10.0%	
600509	天富热电	500	允许	10.0%	
600510	黑牡丹	400	允许	10.0%	
600511	国药股份	400	允许	10.0%	
600517	置信电气	500	允许	10.0%	
600521	华海药业	400	允许	10.0%	
600522	中天科技	800	允许	10.0%	
600523	贵航股份	200	允许	10.0%	
600525	长园集团	700	允许	10.0%	
600531	豫光金铅	200	允许	10.0%	
600533	栖霞建设	100	允许	10.0%	
600537	亿晶光电	300	允许	10.0%	
600545	新疆城建	700	允许	10.0%	
600551	时代出版	300	允许	10.0%	
600557	康缘药业	400	允许	10.0%	
600563	法拉电子	200	允许	10.0%	
600569	安阳钢铁	1300	允许	10.0%	
600570	恒生电子	700	允许	10.0%	
600572	康恩贝	600	允许	10.0%	
600575	芜湖港	700	允许	10.0%	
600578	京能热电	400	允许	10.0%	
600580	卧龙电气	700	允许	10.0%	
600581	八一钢铁	500	允许	10.0%	
600584	长电科技	1200	允许	10.0%	
600586	金晶科技	1300	允许	10.0%	
600589	广东榕泰	600	允许	10.0%	
600590	泰豪科技	400	允许	10.0%	
600594	益佰制药	300	允许	10.0%	
600596	新安股份	700	允许	10.0%	
600597	光明乳业	500	允许	10.0%	
600601	方正科技	3000	允许	10.0%	
600602	仪电电子	700	允许	10.0%	
600611	大众交通	800	允许	10.0%	
600612	老凤祥	200	允许	10.0%	
600616	金枫酒业	400	允许	10.0%	
600618	氯碱化工	300	允许	10.0%	
600622	嘉宝集团	600	允许	10.0%	
600623	双钱股份	100	允许	10.0%	
600628	新世界	600	允许	10.0%	
600633	浙报传媒	200	允许	10.0%	
600635	大众公用	1800	允许	10.0%	
600636	三爱富	400	允许	10.0%	
600637	百视通	800	允许	10.0%	
600639	浦东金桥	400	允许	10.0%	
600641	万业企业	500	允许	10.0%	
600643	爱建股份	100	允许	10.0%	
600644	乐山电力	300	允许	10.0%	
600651	飞乐音响	1000	允许	10.0%	
600653	申华控股	2400	允许	10.0%	
600654	飞乐股份	1000	允许	10.0%	
600657	信达地产	600	允许	10.0%	
600662	强生控股	900	允许	10.0%	
600673	东阳光铝	300	允许	10.0%	
600675	中华企业	1500	允许	10.0%	
600676	交运股份	600	允许	10.0%	
600683	京投银泰	500	允许	10.0%	
600685	广船国际	300	允许	10.0%	
600702	沱牌舍得	300	允许	10.0%	
600704	物产中大	700	允许	10.0%	
600707	彩虹股份	600	允许	10.0%	
600710	常林股份	400	允许	10.0%	
600717	天津港	1100	允许	10.0%	
600720	祁连山	500	允许	10.0%	
600723	首商股份	400	允许	10.0%	
600724	宁波富达	600	允许	10.0%	
600725	云维股份	400	允许	10.0%	
600736	苏州高新	900	允许	10.0%	
600737	中粮屯河	700	允许	10.0%	
600740	山西焦化	500	允许	10.0%	
600743	华远地产	500	允许	10.0%	
600747	大连控股	1400	允许	10.0%	
600748	上实发展	600	允许	10.0%	
600750	江中药业	300	允许	10.0%	
600755	厦门国贸	1300	允许	10.0%	
600759	正和股份	800	允许	10.0%	
600761	安徽合力	500	允许	10.0%	
600765	中航重机	600	允许	10.0%	
600773	西藏城投	300	允许	10.0%	
600776	东方通信	500	允许	10.0%	
600780	通宝能源	600	允许	10.0%	
600782	新钢股份	600	允许	10.0%	
600787	中储股份	700	允许	10.0%	
600789	鲁抗医药	500	允许	10.0%	
600790	轻纺城	700	允许	10.0%	
600797	浙大网新	900	允许	10.0%	
600801	华新水泥	300	允许	10.0%	
600805	悦达投资	800	允许	10.0%	
600810	神马股份	300	允许	10.0%	
600815	厦工股份	500	允许	10.0%	
600816	安信信托	400	允许	10.0%	
600819	耀皮玻璃	100	允许	10.0%	
600820	隧道股份	700	允许	10.0%	
600824	益民集团	700	允许	10.0%	
600825	新华传媒	600	允许	10.0%	
600829	三精制药	200	允许	10.0%	
600830	香溢融通	400	允许	10.0%	
600831	广电网络	500	允许	10.0%	
600835	上海机电	500	允许	10.0%	
600844	丹化科技	500	允许	10.0%	
600851	海欣股份	800	允许	10.0%	
600858	银座股份	500	允许	10.0%	
600864	哈投股份	400	允许	10.0%	
600866	星湖科技	600	允许	10.0%	
600867	通化东宝	700	允许	10.0%	
600869	三普药业	300	允许	10.0%	
600872	中炬高新	1100	允许	10.0%	
600874	创业环保	600	允许	10.0%	
600879	航天电子	900	允许	10.0%	
600880	博瑞传播	600	允许	10.0%	
600884	杉杉股份	400	允许	10.0%	
600888	新疆众和	400	允许	10.0%	
600961	株冶集团	400	允许	10.0%	
600963	岳阳林纸	900	允许	10.0%	
600978	宜华木业	1200	允许	10.0%	
600983	合肥三洋	300	允许	10.0%	
600993	马应龙	300	允许	10.0%	
600995	文山电力	500	允许	10.0%	
601000	唐山港	800	允许	10.0%	
601002	晋亿实业	500	允许	10.0%	
601010	文峰股份	200	允许	10.0%	
601011	宝泰隆	200	允许	10.0%	
601100	恒立油缸	300	允许	10.0%	
601107	四川成渝	900	允许	10.0%	
601126	四方股份	200	允许	10.0%	
601208	东材科技	200	允许	10.0%	
601311	骆驼股份	200	允许	10.0%	
601519	大智慧	600	允许	10.0%	
601588	北辰实业	2200	允许	10.0%	
601616	广电电气	800	允许	10.0%	
601636	旗滨集团	300	允许	10.0%	
601678	滨化股份	300	允许	10.0%	
601777	力帆股份	400	允许	10.0%	
601801	皖新传媒	200	允许	10.0%	
601880	大连港	1400	允许	10.0%	
601886	江河幕墙	200	允许	10.0%	
601908	京运通	200	允许	10.0%	
601999	出版传媒	300	允许	10.0%	

八、拒绝或暂停申购的情形及处理方式

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

1、因不可抗力导致基金无法正常运作。

2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接收投资人的申购申请。

3、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

4、证券交易所、申购赎回代理券商、登记机构等因异常情况无法办理申购，或者指数编制单位、证券交易所等因异常情况使申购赎回清单无法编制或编制不当。

5、基金管理人开市前因异常情况未能公布申购赎回清单。

6、基金管理人认为接受某笔或某批申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。

7、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人利益的情形。

8、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第1、2、3、4、5、7项暂停申购情形时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒体上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

九、暂停赎回的情形及处理方式

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请：

1、因不可抗力导致基金无法正常运作。

2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接收投资人的赎回申请。

3、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

4、证券交易所、申购赎回代理券商、登记机构等因异常情况无法办理赎回，或者指数编制单位、证券交易所等因异常情况使申购赎回清单无法编制或编制不当。

5、基金管理人开市前因异常情况未能公布申购赎回清单。

6、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述暂停赎回情形时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒体上刊登暂停赎回公告。

在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

十、集合申购与其他服务

在条件允许时，经与基金托管人协商一致后，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。在不损害基金份额持有人利益的前提下，基金管理人有权制定集合申购业务的相关规则。

不违反法律法规且对持有人利益无实质性不利影响的情况下，在条件允许时，经与基金托管人协商一致后，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予以公告。

ETF、联接基金是指将其绝大部分基金财产投资于跟踪同一标的指数的ETF、紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，采用开放式运作方式的基金。若本基金指出联接基金，在本基金上市之前，联接基金可以用股票或现金特殊申购本基金基份额，不收取申购费用。

基金管理人指定的代理机构可依据本基金合同开展其他服务，双方需签订书面委托代理协议，并报中国证监会备案。

十一、基金的非交易过户等业务

登记机构可依据其业务规则，受理基金份额的转托管、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、其他

基金管理人可以在法律法规允许的范围内，在不影响基金份额持有人利益的前提下，根据市场情况对上述申购和赎回安排进行补充和调整，并在开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

第十部分　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成份股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、新股、债券、权证、股指期货及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相关规定。

如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，其投资比例遵循届时有效的法律法规和相关规定。

待基金参与融资融券和转融通业务的相关规定颁布后，基金管理人可以在不改变本基金既有投资策略和风险收益特征并在控制风险的前提下，参与融资融券业务以及通过证券金融公司办理转融通业务，以提高投资效率及进行风险管理。届时基金参与融资融券、转融通等业务的风险控制原则、具体参与比例限制、费用收支、信息披露、估值方法及其他相关事项按照中国证监会的规定及其他相关法律法规的要求执行，无需召开基金份额持有人大会决定。

基金的投资组合比例为：本基金建仓期为3个月，在建仓完成后，本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的95%，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。

三、投资策略

1、完全复制法的投资策略

本基金主要采取完全复制法，即按照标的指数的成份股的构成及其权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整。本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的95%。

一般情形下，本基金将根据标的指数成份股的构成及其权重构建股票资产投资组合，但在标的指数成份股发生调整、配股、增发、分红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时，基金管理人将对投资组合进行优化，以更紧密的跟踪标的指数。本基金将根据市场情况，结合经验判断，综合考虑相关性、估值、流动性等因素挑选标的指数中其他成份股或备选成份股进行替代，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。

在正常情况下，本基金力争控制投资组合的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度小于0.2%，年化跟踪误差不超过2%。

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，选择流动性好、交易活跃的期货合约，并根据对证券市场和期货市场运行趋势的研判，以及对股指期货合约的估值定价，与股票现货资产进行匹配，实现多头或空头的套期保值操作，由此获得股票组合产生的超额收益。本基金在运用股指期货时，将充分考虑股指期货的流动性及风险收益特征，对冲系统性风险以及特殊情况下的流动性风险，以改善投资组合的风险收益特性。

权证为本基金辅助性投资工具，投资原则为有利于加强基金风险控制，有利于基金资产增值。

根据有关规定，本基金投资权证遵循下述投资比例限制：

1)、本基金在任何交易日买入权证的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的千分之五。

2)、本基金持有的全部权证，其市值不超过基金资产净值的百分之三。

3)、本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不超过该权证的百分之十。

若未来法律法规或监管部门有新规定的，本基金将按最新规定执行。

2、投资组合构建

本基金投资组合的构建主要分为三步：确定目标组合、制定建仓策略、组合调整。

（1）确定目标组合：基金管理人主要采用完全复制标的指数成份股的构成及权重的方法确定目标组合；

（2）制定建仓策略：基金经理根据对标的指数成份股的流动性和交易成本等因素的分析，制定合理的建仓策略；

（3）组合调整：基金经理在规定的时间内，采用适当的方法和措施对组合进行调整，直至达到紧密跟踪标的指数的要求。

3、投资组合的日常管理

（1）标的指数成份股公司行为信息的跟踪与分析：跟踪标的指数成份股公司行为信息以及成份股公司其他重大信息，包括但不限于成份股发生配股、增发、分红、停牌、复牌等，分析这些信息对指数的影响，并进行相应的组合调整分析，为投资决策提供依据。

（2）标的指数的跟踪与分析：跟踪标的指数的调整等变化，确定标的指数变化是否与预期一致，分析是否存在差异及差异产生的原因，为投资决策提供依据。

（3）每日申购赎回情况的跟踪与分析：跟踪基金申购和赎回情况，分析其对投资组合的影响。

（4）组合持有证券、现金头寸及流动性分析：基金经理跟踪分析实际组合与目标组合的差异及其原因，并对拟调整的成份股进行流动性分析。

（5）组合调整：找出将实际组合调整为目标组合的最优方案，确定组合交易计划；如发生标的指数成份股调整、成份股公司发生并购重组等重大事项，基金经理召集会议，决定基金的操作策略；调整组合，达到目标组合的持仓结构。

（6）每日申购赎回清单的制作：基金经理以T-1日指数成份股的构成及其权重为基础，考虑T日将会发生的上市公司变动等情况，制作T日的申购赎回清单并公告。

4、投资组合的定期管理

（1）每月

每月末，根据基金合同中基金管理费、基金托管费等的支付要求，及时检查组合中的现金比例，进行支付现金的准备。

每月末，基金经理对投资操作、投资组合表现、跟踪误差等进行分析，分析最近投资组合与标的指数的跟踪偏离度和跟踪误差情况，找出未能有效控制较大偏离的原因。

（2）每半年

根据标的指数的编制规则及调整公告，基金经理依据投资决策委员会的决策，在标的指数成份股调整生效前，分析并制定投资组合调整策略，尽量减少因成份股变动带来的跟踪偏离度和跟踪误差。

5、投资绩效评估

（1）每日对基金的跟踪偏离度进行分析；

（2）每月末对本基金的运行情况进行量化评估；

（3）每月末根据评估报告分析当月的投资操作、组合状况和跟踪误差等情况，重点分析基金的跟踪误差和跟踪偏离度的产生原因、现金控制情况、标的指数成份股调整前后的操作以及成份股未来可能发生的变化等。

在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度不超过0.2%，年化跟踪误差不超过2%。当跟踪偏离度和年化跟踪误差超过上述目标范围时，基金管理人将通过日均分析模型找出跟踪误差的来源，并采取合理措施避免跟踪偏离度和跟踪误差进一步扩大。

四、投资决策依据和决策程序

1、投资决策依据

有关法律、法规、基金合同以及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负责制。投资决策委员会负责决定有关标的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。基金经理决定日常标的指数跟踪维护过程中的组合构建、调整决策以及每日申购、赎回清单的编制等决策。

3、投资管理程序

研究、投资决策、组合构建、交易执行、绩效评估、组合监控与调整等流程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：数量投资部依托公司整体研究平台，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，并撰写相关的研究报告，作为本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投资部提供的研究报告，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，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，基金经理主要以完全复制标的指数成份股权重的方法构建组合。在追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化的前提下，基金经理将采取适当的方法，提高投资效率、降低交易成本、控制投资风险。

（4）交易执行：交易部负责具体的交易执行，同时履行一线监控的职责。

（5）绩效评估：绩效评估与风险管理组定期和不定期对基金进行投资绩效评估，并提供相关的绩效评估报告。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，基金经理可以据此总结和检讨投资策略，进而调整投资组合。

（6）组合监控与调整：基金经理将跟踪标的指数的变动，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情况以及组合投资绩效评估的结果等，对投资组合进行监控和调整，密切跟踪标的指数。

基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下，有权根据环境变化和实际需要对上述投资程序做出调整，并在基金招募说明书及其更新中予以公告。

五、投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的95%；

（2）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的3%；

（3）本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的10%；

（4）本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%；

（5）本基金进入全国银行间同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%；

（6）基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

（7）本基金投资于股指期货的，在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的10%；在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的100%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%；在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整。

基金管理人应当自基金合同生效之日起3个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：