

(上接A29版)

类型可转换债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类品种 含货币市场工具、股指期货以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人将在履行适当程序后，将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：

股票资产占基金资产的比例为90%-95%。其中，本基金投资于中小板价格指数成份股及备选股成份的资产不低于股票资产的90%；在扣除股指期货合约需缴纳的保证金后，本基金所持有的交易金额到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金投资于中小板价格指数成份股及备选股成份的资产不低于股票资产的90%；在扣除股指期货合约需缴纳的保证金后，本基金所持有的交易金额到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%；权证投资占基金资产净值的比例不超过3%。

八、基金的投资策略

1. 资产配置策略
本基金的投资范围包括：股票资产占基金资产的比例为90%-95%，其中，本基金投资于中小板价格指数成份股及备选股成份的资产不低于股票资产的90%；在扣除股指期货合约需缴纳的保证金后，本基金所持有的交易金额到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。基金管理人将综合考虑市场环境、基金资产的流动性要求及投资比例等因素，确定股票、债券等资产的具体配置比例。

本基金力争将年化跟踪误差控制在4%以内，日跟踪偏离度绝对值的平均值控制在0.35%以内。

2. 股票投资策略

本基金主要采用完全复制法进行投资，即按照中小板价格指数成份股组成及权重构建股票投资组合。但是在以下情况下时，基金管理人将对投资组合进行适当调整，以保证本基金资产与业绩比较基准的紧密跟踪。

1) 当发生基金预期数成份股或权重发生变化；

2) 由于市场因素影响、法律法规限制等原因，本基金无法根据指数构建组合；

3. 基金发生申购赎回、成份股发现金股息等可能影响跟踪效果的情形。

2. 股票组合的动态调整

在基金运作过程中，当发生以下情况时，基金管理人将对投资组合进行调整：

1) 指数编制方法发生变更。基金管理人将评估指数编制方法变更对指数成份股及权重的影响，适时进行投资组合调整；

2) 指数成份股定期或临时调整。基金管理人将根据指数成份股调整方案，判断指数成份股调整对投资组合的影响，在此基础上确定组合调整策略；

3) 标的指数成份股出现股本变化、增发、配股、派发现金股息等情形。基金管理人将密切关注这些情形对指数的影响，并据此确定相应的投资组合调整策略；

4) 基金发生申购赎回时，参与新股申购等影响跟踪效果的情形。基金管理人将分析这些情形对跟踪效果的影响，据此对投资组合进行相应调整。

5) 法律法规限制、股票流动性不足、股票停牌等因素导致本基金无法根据指数建立组合。基金管理人将根据市场环境，以跟踪误差最小化原则对投资组合进行调整。

2.3 权证为本基金辅助性投资工具。权证的投资原则为：在扣除基金资产增值、控制风险、实现保值和锁定收益。

3. 股指期货投资策略

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，按照相关法律法规的有关规定，进行股指期货投资。具体而言，本基金将运用股指期货进行如下投资：

1) 市场风险管理

为达到风险管理目的，当发生以下市场暴露，若本基金投资组合中股票组合的市场暴露小于与市场比较基准的市场暴露，本基金可通过买入股指期货以实现与市场比较基准相近的市场暴露，

2) 流动性风险管理

出现大量申购或净赎回的情况时，本基金将使用股指期货来进行流动性风险管理。如出现大量申购时，本基金买入数量匹配的股指期货合约以满足权益类资产配置比例的要求，并在净申购资金到账后逐步平仓；反之，如出现大量净赎回时，本基金可空单数量匹配的股指期货合约以满足权益类资产配置比例的要求，并在卖出现股票的同时逐步平仓。此外，如出现出现大量净赎回，本基金在逐步卖出现票的同时买入数量匹配的股指期货合约以保持与市场暴露度，并在投资者赎回的同时逐步平仓。

九、基金的投资业绩比较基准

中小板价格指数收益率×95%+活期存款利率 税后×5%

十、基金的风险收益特征

本基金属股票基金，预期风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场

基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

十一、基金投资组合报告 (未经审计)

本基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

本基金的投资人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同的规定，已于2013年4月17日复核了本报告的内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本报告期自2013年1月1日起至本报告期末为2012年10月1日至2012年12月31日。

1.报告期末基金资产组合情况			
序号	项目	金额(元)	占基金总资产百分比(%)
1	权益投资	230,734,554.91	91.94
2	固定收益投资	230,734,554.91	91.94
3	其中：债券	-	-
4	资产支持证券	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
8	银行存款和结算备付金合计	15,720,425.10	6.26
9	其他各项资产	19,236,345.82	7.79
10	合计	250,957,771.45	100.00

2.报告期末按行业分类的股票投资组合			
A)积极投资按行业分类的股票投资组合			
代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔	7,642,634.42	3.08
B	采掘业	14,034,092.15	5.66
C	制造业	140,176,596.89	56.50
D	食品饮料	15,678,023.01	6.26
E	纺织服装、皮毛	5,120,543.94	2.06
G	医药、生物	25,498,289.68	10.20
H	信息技术	1,096,752.00	0.44
I	金属、非金属	4,063,696.35	1.64
J	机械、设备、仪表	32,220,507.61	12.99
K	化学、石化、塑胶、塑料	19,236,345.82	7.75
L	电子	31,703,219.18	12.78
M	电力、煤气及水的生产和供应业	3,482,251.00	1.40
N	房地产业	960,091.30	0.39
O	其他	1,096,752.00	0.44
P	通信、设备、仪表	32,220,507.61	12.99
Q	金融、保险	10,172,583.96	4.10
R	其他	6,513,854.58	2.63
S	社会服务业	3,918,821.40	1.58
L	传播与文化行业	-	-
M	综合类	-	-
合计		230,734,554.91	92.99

3.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

4) 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002024	苏宁电器	2,336,664	15,538,815.60	6.26
2	002304	洋河股份	130,533	12,187,866.21	4.91
3	002415	海康威视	236,335	7,352,381.85	2.96
4	001242	宁波银行	670,359	7,146,026.94	2.88
5	002422	华信国际	119,185	6,676,743.70	2.69
6	002001	金发科技	6,070,798.20	2,453	0.99
7	002236	大华股份	128,175	5,940,911.25	2.39
8	002155	豫矿矿业	292,867	5,880,769.36	2.37
9	002241	聚尔泽普	148,050	5,581,485.09	2.25
10	002038	永和股份	121,023	4,787,630.52	1.93

5) 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

1. 本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

2. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

3. 本基金本报告期末未持有债券。

4. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

5. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

6. 本基金本报告期末未持有权证。

7. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

8. 其他各项资产构成

1) 本基金本报告期末未持有资产支持证券。

2. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

3. 本基金本报告期末未持有权证。

4. 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5. 本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

6. 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明

7. 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8. 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明

9. 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明

10. 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明

11. 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明

12. 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明

13. 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明

14. 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明

15. 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明

16. 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明

17. 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明

18. 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明

19. 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明

20. 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明

21. 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明

22. 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明

23. 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明

24. 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明

25. 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明

26. 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明

27. 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明

28. 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明

29. 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明

30. 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明

31. 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明

32. 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明

33. 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明

34. 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明

35. 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明

36. 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明

37. 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明

38. 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明

39. 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明

40. 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明

41. 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明

42. 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明

43. 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明

44. 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明

45. 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明

46. 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明

47. 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明

48. 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明

49. 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明

50. 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明

51. 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明

52. 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明

53. 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明

54. 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明

55. 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明

56. 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明

57. 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明

58. 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明

59. 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明

60. 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明

61. 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明

62. 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明

63. 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明

64. 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明

65. 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明

66. 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明

67. 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明

68. 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明

69. 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明

70. 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明

71. 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明

72. 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明

73. 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明

74. 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明

75. 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明

76. 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明

77. 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明

78. 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明

79. 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明

80. 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明

81. 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明

82. 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明

83. 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明

84. 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明

85. 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明

基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

2) 基金托管人的基金托管费

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的0.22%年费率计提。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的0.22%年费率计提。计算方法如下：

H=E×R÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

3) 基金的指数使用许可费

本基金为股票指数基金，需根据与深圳证券信息有限公司所签署的指数使用许可协议约定向深圳证券信息有限公司支付指数使用许可费。指数使用许可费自基金合同生效日起计提，计算方法如下：

H=E×0.02%÷当年天数

H为每日应付的指数使用许可费

E为本基金前一日基金资产净值

本基金基金合同生效日所在季度的指数使用许可费，按实际计提金额收取，不设下限。自基金合同生效日所在季度的下一季度起，指数使用许可费收取下限为每季度 5 万元，即不足 5 万元时按照 5 万元收取。

指数使用许可费每日计提，累计计提，按季支付。指数使用许可费的支付由基金管理人向基金托管人发送支付指令，经基金托管人复核后于每一季度结束后且收到深圳证券信息有限公司有效商业发票后的10个工作日内从基金财产中一次性支付给深圳证券信息有限公司。

若指数使用许可费的计算方法和费率等发生变更，本基金将采用调整后的方法或费率计算指数使用许可费。基金管理人应及时按照《信息披露管理办法》的规定在指定媒介上刊登公告。此项调整无需召开基金份额持有人大会。

4) 本基金第(八)至第(9)项费用由基金管理人 and 基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入当期基金费用。

3. 不列入基金费用的项目

基金管理人 and 基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费及会计师费以及其他费用不从基金资产中支付。

4. 基金费用的调整

基金管理人 and 基金托管人应协商酌情调低基金管理费和基金托管费，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须逐于新的费率实施日2日前在至少一家指定媒介上刊登公告。

5) 与基金销售有关的费用

1) 申购费

2) 赎回费

基金中基金份额场内与场外的申购费率相同，最高为1.2%，且随申购金额的增加而递减，具体费率如下表所示：

申购金额(元)

100元≤M<100元

100元≤M<200元

200元≤M<500元

500元≤M<1,000元

1,000元≤M<2,000元

2,000元≤M<5,000元

5,000元≤M<10,000元

10,000元≤M<50,000元

50,000元≤M<100,000元

100,000元≤M<500,000元

500,000元≤M<1,000,000元

1,000,000元≤M<5,000,000元

5,000,000元≤M<10,000,000元

10,000,000元≤M<50,000,000元

50,000,000元≤M<100,000,000元

100,000,000元≤M<500,000,000元

500,000,000元≤M<1,000,000,000元

1,000,000,000元≤M<5,000,000,000元

5,000,000,000元≤M<10,000,000,000元

10,000,000,000元≤M<50,000,000,000元

50,0