

上 证 新 兴 产 业 交 易 型 开 放 式 指 数 证 券 投 资 基 金 招 募 说 明 书 (更 新) 摘 要

2013年第2期

基金管理人:诺安基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

重要提示

(一)上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会2011年2月16日证监许可[2011]240号文核准公开募集,本基金的基金合同于2011年4月7日正式生效。

(二)基金管理人保证本《招募说明书》的内容真实、准确、完整。本《招募说明书》经中国证监会核准,但中国证监会对本基金募集的核准,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

(三)投资有风险,投资者认购(或申购)基金时应认真阅读该基金《招募说明书》及《基金合同》等,全面了解本基金产品特性及风险收益特征,应充分考虑投资人自身的风险承受能力,并对于认购(或申购)基金的意见、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资者“买者自负”原则,在投资者作出投资决策后,须承担基金投资中出现的各类风险,包括:市场风险、管理风险、技术风险、本基金特有的风险及其他风险。

本基金以一元初始面值募集基金份额,在市场波动等因素的影响下,基金投资有可能出现亏损或基金份额净值低于初始面值。

(四)基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成新基金业绩表现的保证。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对本基金的承认和接受,并按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

本招募说明书(更新)已经基金托管人复核。本招募说明书(更新)所载内容截止日为2013年10月7日,有关财务数据和净值表现截止日为2013年9月30日(财务数据未经审计)。

一、基金管理人

(一)基金管理人概况
公司名称:诺安基金管理有限公司
住所:深圳市南山区大道4013号兴业银行大厦19—20层
设立时间:2003年12月9日
法定代表人:秦维坤
办公地址:同住所
批准设立机关及批准设立文号:中国证监会证监基金字[2003]132号
组织形式:有限责任公司
存续期限:持续经营
电话:0755-83026688
传真:0755-83026677
联系人:陈刚
注册资本:1.5亿元人民币
股权结构:

股东单位	出资额(万元)	出资比例
中国对外经济贸易信托投资有限公司	6000	40%
深圳市捷隆投资有限公司	6000	40%
大恒新纪元科技股份有限公司	3000	20%
合 计	15000	100%

(二)证券投资基金管理情况
截至2013年10月7日,本基金管理人共管理二十八只开放式基金:诺安平衡证券投资基金、诺安货币市场基金、诺安股票证券投资基金、诺安安心收益债券型证券投资基金、诺安价值增长股票证券投资基金、诺安灵活配置混合型证券投资基金、诺安成长股票证券投资基金、诺安增利债券型证券投资基金、诺安中证100指数证券投资基金、诺安中小盘精选股票证券投资基金、诺安主题精选股票型证券投资基金、诺安沪深300指数证券投资基金、上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金、诺安上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金、诺安保本混合型证券投资基金、诺安多策略股票型证券投资基金、诺安油气能源股票型证券投资基金(LOF)、诺安全球收益不动产证券投资基金、诺安动力灵活配置混合型证券投资基金、诺安中证创业成长指数分级证券投资基金、诺安汇鑫保本混合型证券投资基金、诺安双利债券型发起式证券投资基金、中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金、诺安中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金、诺安纯债定期开放债券型证券投资基金、诺安鸿鑫保本混合型证券投资基金、诺安信用债券一年定期开放债券型证券投资基金、诺安稳收益一年定期开放债券型证券投资基金。

(三)主要人员情况
1. 董事会成员
秦维坤先生,董事长,工商管理硕士。历任北京中联新技术有限公司总经理,香港昌维发展有限公司总经理,香港先锋投资有限公司总经理,中国新纪元有限公司副总裁,诺安基金管理有限公司副董事长。

徐卫阳先生,副董事长,工商管理硕士。历任中国化工进出口总公司财务部副总经理,中化国际贸易股份有限公司副总经理,中化河北进出口公司总经理,中化国际 控股 股份有限公司总经理,中化股份有限公司战略规划部、投资发展部总经理,中国对外经济贸易信托有限公司党委书记。

张家林先生,董事,高级工程师,全国人民政协协商会议第9、10、11届委员。曾任中科院自动化研究所研究员,高级工程师,中国自动化技术公司副总经理。现任中国大恒(集团)有限公司董事长、大恒新纪元科技股份有限公司董事长。

阮阳文先生,独立董事,工科学士。历任中共北京市委副秘书长兼办公厅主任,中共北京市石景山区委书记,中共北京市委常委、秘书长,北京国际电气工程公司董事长,北京国际电力开发投资公司董事长。

朱秉刚先生,独立董事,教授级高级经济师。历任石油部计划司副司长,中国石油天然气集团公司计划局副总、营销中心副主任。

陆南屏先生,独立董事。历任新华社香港分社办公厅综合处处长、办公厅副主任、国际问题研究中心办公室主任、国家外汇管理局办公室主任、政策规划司司长、副局长。

2. 监事会成员
李致文先生,监事,企业管理硕士。历任中国化工集团进出口办公室经理,中化集团香港实业公司副总经理,中化汇富资产管理公司副总经理,中化欧洲资本公司副总经理兼董事(厦门)实业投资有限公司副总经理,现任中国对外经济贸易信托有限公司副总经理。

赵显明先生,监事,金融学硕士。历任中国人民银行深圳经济特区分行证券管理办公室副主任,深圳证券交易所理事兼秘书长,君安证券香港公司副总经理等职。
戴明安先生,监事。历任浙江证监局营业部监管室主管,国泰君安证券公司部门主管,诺安基金管理有限公司交易中心总监。

梅律昔先生,监事,硕士。历任长城证券有限责任公司研究员,鹏华基金管理有限公司研究员,诺安基金管理有限公司研究员、基金运营助理、基金经理、研究部副总监、投资部副总监、投资部副总监。

3. 高级管理人员
秦维坤先生,总经理,经济学硕士,经济师。曾任中国通用技术(集团)控股有限责任公司资产经营部副经理,中国对外经济贸易信托投资有限公司投资银行部副总经理。2002年10月开始参加诺安基金管理有限公司筹备工作,任公司副董事长,现任公司总经理。
杨文先生,副总经理,企业管理学博士。曾任国泰君安证券公司研究所金融工程研究员,中融基金管理有限公司市场部经理。2003年8月加入诺安基金管理有限公司,历任市场部副经理、发展战略部总监,现任公司副经理。

杨谷先生,副总经理,经济学硕士,CFA。曾任平安证券公司综合研究所研究员,西北证券公司资产管理部研究员。2003年10月加入诺安基金管理有限公司,现任公司副总经理、投资总监、诺安股票证券投资基金基金经理、诺安沪深300指数证券投资基金基金经理、诺安多策略股票型证券投资基金基金经理。

4. 投资决策委员会成员的姓名及职务
本公司投资决策委员会分为股票类基金投资决策委员会和固定收益类基金投资决策委员会,具体如下:

股票类基金投资决策委员会:主席由公司总经理陶成文先生担任,委员包括:杨谷先生、副总经理、投资总监、基金经理;张平先生,总经理助理兼配置基金组投资总监;邹翔先生,成长基金组投资总监兼价值基金组投资总监;基金经理;王创练先生,研究部总监。
固定收益类基金投资决策委员会:主席由公司总经理陶成文先生担任,委员包括:杨谷先生、副总经理、投资总监、基金经理;杨文先生,副总经理;张乐秀先生,固定收益部总监、基金经理;王创练先生,研究部总监。

上述人员之间不存在近亲属关系。

(一)基本情况
名称:中国工商银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区复兴门内大街55号
成立时间:1984年1月1日
法定代表人:姜建清
注册资本:人民币349,018,545,827元
联系人:赵金
联系人:赵金

(二)主要人员情况
截至2013年9月,中国工商银行资产托管部共有员工179人,平均年龄30岁,95%以上员工拥有大学本科学历以上学历,高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

(三)基金托管业务情况
作为中国大陆托管业务的先行者,中国工商银行自1998年在国内首家提供托管服务以来,秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨,依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队,严格履行资产托管人职责,为境内外广大资产投资者、金融机构管理机构和企事业单位安全、高效、专业托管服务,赢得了社会各界的广泛赞誉和高度评价。建立了“国内银行托管中最早、最成熟的产品线”,拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会公益基金、企业年金基金、QFII资产、QDII资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII专户资产、ESCROW等门类齐全的托管产品体系,同时在全国率先开展绩效评估、风险管理等增值服务,可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至2013年9月,中国工商银行共托管证券投资基金337只,其中封闭式5只,开放式332只。自2003年以来,本行连续十年获得《亚洲货币》、《英国 全球财资》、《香港 财资》、《美国 环球财资》、《内地 证券时报》、《上海证券报》境内权威财经媒体评选的41项最佳托管银行大奖;是获得奖项最多的国内托管银行,优质托管服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

三、基金服务机构
(一)基金服务机构
(1)申购赎回代理证券公司
1 安信证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层及25层
办公地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层
法定代表人:牛冠兴
开放式基金咨询电话:4008-001-001
开放式基金业务传真:0755-82583555
联系人:陈静
联系电话:0755-82558305
客户服务专线:4008-001-001
网址:www.axzq.com.cn

2 渤海证券股份有限公司
注册地址:天津经济技术开发区第二大街42号写字楼101室
办公地址:天津市南开区滨水西道8号(000381)
法定代表人:杜庆平
电话:022-28451861
传真:022-28451892
联系人:王树权
客户服务专线:400-651-5988
网址:www.bhzq.com.cn

3 长江证券股份有限公司
注册地址:湖北省武汉市江汉区新华路特号
办公地址:湖北省武汉市江汉区新华路特号
法定代表人:胡润立
电话:021-63219781
传真:021-51062029
联系人:李浩
客户服务电话:4008-888-999或027-85808318
网址:www.cjzq.com.cn

4 东兴证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街5号 新大厦B座12、15层
办公地址:北京市西城区金融大街5号 新大厦B座12、15层
法定代表人:崔庆平
联系电话:010-6555202
传真:010-66552446
客户服务电话:4008-888-993
网址:www.dxzq.net

5 国都证券有限责任公司
注册地址:北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层、10层
办公地址:北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层、10层
法定代表人:常浩
电话:010-84181333
传真:010-84183111-3389
联系人:黄涛
联系电话:0571-87902080

客户服务电话:400-818-8118
网址:www.guodu.com

6 广发证券股份有限公司
注册地址:广州市天河区河北路183号大都会广场43楼
办公地址:广东省广州市天河区河北路183号大都会广场43、42、41、38、36、19、18楼
法定代表人:王志伟
联系人:肖梅梅
统一客户服务电话:95575,或致电各地营业网点
开放式基金业务传真:020-87555305
网址:www.gf.com.cn

7 国海证券股份有限公司
注册地址:广西壮族自治区南宁市滨湖路46号
办公地址:广西壮族自治区南宁市滨湖路46号
法定代表人:张维雄
联系人:武斌
联系电话:0755-8370413
传真:0755-83700205
客户服务电话:400888100(全国)、95563(广西)
网址:www.guohai.com.cn

8 国联证券股份有限公司
注册地址:无锡市县前东街168号
办公地址:无锡市县前东街168号国联大厦703室
法定代表人:雷建辉
电话:0510-82831662
传真:0510-82830162
联系人:袁雨婷
客户服务电话:4008885288、0510-82588168
网址:www.glsc.com.cn

9 国泰君安证券股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区商城路618号
办公地址:上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦20楼
法定代表人:万建华
客户服务电话:4008-888-666
网址:www.gtja.com

10 国信证券股份有限公司
注册地址:深圳市罗湖区红岭中路国信证券大厦十六层至二十六层
办公地址:深圳市罗湖区红岭中路国信证券大厦十六层至二十六层
法定代表人:何如
电话:0755-82130833
传真:0755-82133302
联系人:齐晓燕
客户服务热线:95536
网址:www.guosen.com.cn

11 国元证券股份有限公司
注册地址:安徽省合肥市寿春路179号
办公地址:安徽省合肥市寿春路179号
法定代表人:吴良志
客户服务专线:400-8888-777
网址:www.gyzq.com.cn

12 广州证券股份有限公司
注册地址:广州市先烈中路69号东山广场主楼五楼
办公地址:广州市先烈中路69号东山广场主楼五楼
法定代表人:刘东
电话:020-87322668
传真:020-87325036
联系人:黄朝正
客户服务电话:020-961303
网址:www.gzs.com.cn

13 华安证券股份有限公司
注册地址:上海市陆家嘴环路166号未来资产大厦2层
办公地址:上海市陆家嘴环路166号未来资产大厦2层
法定代表人:陈林
电话:021-50122222
联系人:楼斯佳
客户服务电话:400-820-9898
网址:www.huanstock.com

14 红塔证券股份有限公司
注册地址:云南省昆明市北京路155号附1号
办公地址:云南省昆明市北京路155号附1号红塔大厦7-11楼
法定代表人:况雨桐
客户服务电话:0871-35771390
网址:www.hongtazq.com

15 湘财证券股份有限公司
注册地址:上海市淮海中路98号
办公地址:上海市广东路689号
法定代表人:王开国
联系人:金鑫、李芳芳
电话:021-23219000
传真:021-23219100
客户服务电话:95553,或拨打各城市营业网点咨询电话
网址:www.htsec.com

16 齐鲁证券有限公司
注册地址:山东省济南市经十路20518号
办公地址:山东省济南市经十路20518号
法定代表人:李野
联系人:吴昊
开放式基金咨询电话:0531-81283906
开放式基金业务传真:0531-81283900
客服电话:95538
网址:www.qlzq.com.cn

17 申银万国证券股份有限公司
注册地址:上海市常熟路171号
法定代表人:丁国荣
电话:021-54038888
传真:021-54038844
联系人:孙洪岩
客户服务电话:95523或4008889523
网址:www.sywg.com

18 山西证券股份有限公司
注册地址:太原市府西街69号山西国际贸易中心
办公地址:太原市府西街69号山西国际贸易中心A座26—01层
法定代表人:侯健
联系人:张丽娟
联系电话:0351-86866703
传真:0351-86867079
客户服务电话:400-666-1618
网址:www.sxwz.com.cn

19 信达证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
办公地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼信达金融中心
法定代表人:张志刚
联系人:唐静
联系电话:010-63081000
传真:010-63080978
客户服务电话:400-800-8899
网址:www.cindasc.com

20 西南证券股份有限公司
注册地址:重庆市渝中区临江路2号合景国际大厦A幢22层
办公地址:重庆市渝中区临江路2号合景国际大厦A幢22层
法定代表人:王珠林
客户服务电话:408096096
网址:www.swsc.com.cn

21 新时代证券有限责任公司
注册地址:北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501
办公地址:北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501
法人代表:刘汝军
电话:010-83561149
传真:010-83561094
联系人:孙艳
客户服务电话:400-698-9898
网址:www.xsdq.com.cn

22 兴业证券股份有限公司
注册地址:福建省福州市湖东路99号
办公地址:福州市湖东路268号证券大厦;上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼
法定代表人:兰荣
电话:021-68419974
联系人:杨晓芳
客户服务电话:400-8888-123
网址:www.xyzq.com.cn

23 招商证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区益田路江苏大厦38层43-45楼
办公地址:深圳市福田区益田路江苏大厦38层43-45楼
法定代表人:李玮
电话:0755-82943666
传真:0755-82960141
联系人:黄健
客户服务电话:95565、0755-26951111
网址:www.newone.com.cn

24 光大证券股份有限公司
注册地址:上海市静安区新闻路1508号
办公地址:上海市静安区新闻路1508号
法定代表人:徐浩明
联系人:刘晨
电话:021-22169999
传真:021-68815009
客户服务电话:400-8888-788
网址:www.ebscn.com

25 浙商证券股份有限公司
注册地址:浙江省杭州市杭大路1号
办公地址:浙江省杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A区67楼
法定代表人:吴承根
联系人:吴鹏
电话:0571-87902080

客户服务电话:967777
网址:www.stocke.com

28 中国中投证券有限责任公司(即中国建投投资证券有限责任公司)
注册地址:深圳市福田区益田路与福中路交界荣超商务中心A栋第18层-21层及第04层
办公地址:深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第04、18层至21层
法定代表人:龙增来
联系人:刘璇
电话:0755-82023442
传真:0755-82026539
客户服务电话:400-600-8008
网址:www.china-invs.cn

29 中信证券股份有限公司
注册地址:广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦第A层
办公地址:广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦第A层
法定代表人:王东明
联系人:陈忠
电话:010-84683893
传真:010-84685600
客户服务电话:010-84588888
网址:www.csc.ccit.com

30 中信建投证券股份有限公司
注册地址:北京市朝阳区安立路66号
办公地址:北京市东城区朝内大街188号中信建投证券公司
法定代表人:张佑君
联系人:权唐
开放式基金咨询电话:4008-888-108
开放式基金业务传真:010-65182621
客户服务电话:400-8888-108
网址:www.csc108.com

31 二级市场交易型开放式证券投资基金
包括具有经纪业务资格及深圳证券交易所会员资格的所有证券公司。
基金管理人可根据有关法律法规,选择其他符合要求的机构代理销售本基金,并及时公告。

(二)登记结算机构
名称:中国证券登记结算有限责任公司
住所:北京西城区金融大街27号投资广场23层
法定代表人:金颖
办公地址:北京西城区金融大街27号投资广场23层
电话:010-58598839
传真:010-58598907

(三)出具法律意见书的律师事务所和经办律师
名称:北京市国合律师事务所
住所:北京市东城区建国门内大街7号光华长安大厦2座1910室
法定代表人/负责人:付朝晖
电话:010-65178866
传真:010-65180276
经办律师:虞发荣

(四)审计会计师事务所的会计师事务所和经办注册会计师
名称:德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)
(住所:上海市浦东新区东川路222号外滩中心30楼
执行事务合伙人:卢伯刚
电话:021-61418888
传真:021-63350003
联系人:余志斌
经办注册会计师:胡小敏、王明静

十、基金名称
上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金

十一、基金的投资目标
本基金的投资目标: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。

十二、基金的投资范围
本基金主要投资于标的指数成份股票、备选成份股票、一级市场新发股票、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,基金管理人可在履行适当程序后,将其纳入投资范围。

本基金投资于标的指数的成份股票及备选成份股票的比例不低于基金资产净值的90%,同时为有效管理投资组合,基金可投资于经中国证监会允许的各种金融衍生品,如权证以及其他与标的指数或标的指数成份股票相关的衍生工具,该部分资产比例不超过基金资产净值的10%。

十三、基金的投资策略
本基金的投资策略:本基金主要采取完全复制跟踪标的指数的策略,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投资组合,并根据标的指数的成份股票及其权重的变动进行相应调整。基金投资于标的指数的成份股票及备选成份股票的比例不低于基金资产净值的90%。

本基金将根据标的指数的成份股票的构成及其权重构建股票资产投资组合,但在特殊情况下,本基金可以选择其他证券或证券组合对标的指数中的股票加以替换,这些情况包括但不限于以下情形:
1) 法律法规限制; 2) 标的指数成份股流动性严重不足; 3) 标的指数的成份股票长期停牌; 4) 其他合理原因导致本基金管理人认为对标的指数的跟踪构成严重阻碍的。

在正常情况,本基金对标的指数的跟踪目标是:力争将基金份额日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%,年化跟踪误差控制在跟踪误差容忍度以内。如因标的指数成份股票停牌、流动性不足或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。

十四、投资决策依据
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。

十五、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,并指大组合调整决策以及重大的单项投资决策;基金经理制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、赎回净值申报的编制决策。

十六、投资组合管理
研究、决策、组合构建、交易、评估、组合维护的有密切配合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:基金经研,研究人员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,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研究报告,定期召开或遇重大事件时召开投资决策委员会会议,决策相关事项,基金经理根据投资决策委员会的决议,每日进行基金投资组合的日常决策。
3) 组合构建:根据标的指数的指数,结合研究报告,基金经理以完全复制跟踪成份股及其权重的方法构建组合。在追求跟踪误差和跟踪误差最小化的前提下,基金经理将采取适当的方法,以降低买入成本、控制跟踪误差。
4) 交易执行:由中央交易室负责具体的交易执行,同时维护一线临盘的职责。
5) 基金绩效评估:风控经理定期和不定期进行投资组合绩效评估,并提供相关报告。绩效评估能够确认组合是否实现了投资目标,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略,进而调整投资组合。
6) 风险监控与调整:基金经理跟踪标的指数变动,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情况以及组合投资绩效评估的结果,对投资组合进行实时监控调整,密切跟踪标的指数的指数。

基金管理人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组合做出调整,并在招募说明书及其他更新公告。
十七、投资组合管理
1) 组合构建
基金管理人构建投资组合的过程主要分为三步:确定目标组合、确定建仓策略和逐步调整。
1) 确定目标组合:基金管理人根据完全复制跟踪的指数的成份股及其权重的方法确定目标组合。
2) 确定建仓策略:基金经理根据对成份股流动性、公行为等因素的分析,确定合理的建仓策略。
3) 逐步调整:根据完全复制法确定目标组合之后,基金经理在在规定时间内采用适当的手段调整实际组合直至达到跟踪目标要求。

本基金跟踪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6个月内达到上述投资比例。此后,如因标的指数成份股票调整、基金申购或赎回导致现金头寸提高而使得基金资产比例不符合上述一投资比例的,基金管理人将在10个交易日内进行调整。

1) 组合日常管理
1) 跟踪标的指数的构成及权重,结合基金当前持有的证券组合及其比例,制作下一交易日本基金的申购赎回清单并公告;
2) 将基金持有的证券组合构成与标的指数进行比较,制定目标组合构成及权重,确定合理的交易策略;

3) 实施合理的交易策略,以实现基金最优组合结构。
4) 成份股定期调整及临时调整
跟踪标的指数的跟踪偏离度和跟踪误差:基金经理依据投资决策委员会的决策,在指数成份股调整生效前,分析并制定成份股调整策略,尽量减少成份股调整带来的跟踪偏离度和跟踪误差。
在标的指数的成份股票调整期间,若出现成份股调整临时调整的情形,本基金管理人将密切关注本股票调整,并及时制定相应的投资组合调整策略。

4) 成份股指数的日常跟踪与分析
跟踪标的指数的成份股信息数据 如:股本变化、分红、配股、增发、停牌、复牌等 以及成份股公司其他重大信息,分析这些信息对指数的影响,并据此确定基金的申购赎回清单以及基金的每日交易策略。
5) 申购赎回情况的跟踪与分析
跟踪基金申购和赎回信息,结合基金的现金头寸管理,分析其对组合的影响,制定交易策略以应对基金申购或赎回的影响。

6) 替代投资
对个别成份股,若其存在投资受限、严重的流动性困难、财务风险较大、面临重大不利司法诉讼或者有其他充分合理的理由认为其市场价格被严重低估,本基金可以不投资该成份股,而用备选股,甚至现金来代替,或者选择与其行业相近、定价特征类似或收益率相关性较高的其他股票来代替,即采用替代投资策略“应对”。采用替代投资策略的原则是使得本基金投资组合对标的指数的跟踪误差最小化,以利于本基金投资目标的实现。

7) 衍生品投资
为有效管理投资组合,基金可投资于经中国证监会允许的各种金融衍生产品,如权证以及其他与标的指数或标的指数的成份股相关的衍生工具。基金投资于衍生工具的目的,是使得基金的投资组合更紧密地跟踪标的指数,以便更好地实现基金的投资目标。本基金投资于各种衍生工具的比例不超过投资组合资产净值的10%。

基金拟投资于新推出的金融衍生产品的,需将有关投资方案通知基金托管人,并报告中国证监会备案后公告。
十八、风险收益特征
本基金是股票型基金,其风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、混合基金,本基金为指数型基金,具有与标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征,属于证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。

十九、基金投资组合报告
本投资组合报告所载数据截止日为2013年9月30日,本报告中所列财务数据未经审计。

(一)报告期末基金投资组合情况

如果指数发布机构变更或者停止上述标的指数编制及发布,或者上述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,进行适当变更,并同时更换本基金的基金名称与业绩比较基准。其中,若标的指数变更