

华润元大中创100交易型开放式指数证券投资基金招募说明书 更新 摘要

基金管理人：华润元大基金管理有限公司
基金托管人：招商证券股份有限公司
二〇一六年一月

【重要提示】
华润元大中创100交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）经2015年3月9日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可【2015】363号文准予募集注册。本基金基金合同于2015年5月25日正式生效。

基金管理人保证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注册，但中国证监会对本基金募集的注册，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会有收益。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或保证。

投资有风险，投资人认购（或申购）本基金时应认真阅读本招募说明书和基金合同等信息披露文件，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，自主判断基金的投资价值，谨慎、自主做出投资决策，并自行承担投资风险。本基金面临的主要风险是市场风险、信用风险、流动性风险、管理风险、操作风险、合规性风险及本基金的特有风险等。本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，为证券投资基金中高风险预期收益、较高预期收益的品种。同时本基金为交易型开放式指数基金，采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。

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，本基金管理人不对基金的投资于本基金一定盈利，也不保证最低收益。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。

基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在其他投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化导致的投资风险，由投资者自行承担。

除特别说明外，本招募说明书所载内容截止日为2015年11月25日，有关财务数据和净值表现截止日为2015年9月30日（财务数据未经审计）。

一、基金合同生效日期
2015年5月25日

二、基金管理人概况
（一）基金管理人概况
名称：华润元大基金管理有限公司
住所：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）
办公地址：深圳市福田区中心四路1-1号嘉里建设广场第三座7层
邮政编码：518048
法定代表人：路强
成立时间：2013年1月17日
注册资本：2.0亿元人民币
存续期限：永续经营
联系人：林瑞卿
电话：（0755）188399008
传真：（0755）188399046

华润元大基金管理有限公司（以下简称“公司”）经中国证监会证监许可[2012]1746号文批准设立。公司股权结构如下：

股东名称	股权比例
华润国际信托股份有限公司	51%
元大证券投资信托有限公司	49%

本基金管理人公司治理结构完善，经营运作规范，能够切实维护基金份额持有人的合法权益。公司董事会下设薪酬与提名委员会、合规审核委员会、风险管理委员会三个专门委员会，具有针对性地研究公司在经营管理与基金运作中的相关问题，制定相应的政策，并充分发表独立董事的意见，切实加强对公司运作的监督。

公司监事会由四位监事组成，主要负责检查公司的财务以及对公司董事、高级管理人员的行为进行监督。

公司实行董事会领导下的总经理负责制，总经理根据公司章程及董事会授权，全面主持公司日常经营管理工作。督察长负责公司及基金运作的监督稽核工作，由公司董事会聘任，对董事会负责。公司经营管理层设投资决策委员会、特定客户资产管理投资决策委员会、产品审议委员会、风险管理委员会、固定收益投资管理管理委员会、IT治理委员会等由总经理行使授权的议事决策机构。

公司按照不同业务职能，分为十个部门。其中投资部门包括投资管理部、固定收益部、特定客户资产管理部三个部门；市场部包括营销部和渠道规划部两个部门；后台运营部包括信息技术部、运营管理部、综合管理部和财务四个部门，同时还设立了独立于各业务部门的监察合规部，对公司及基金投资运作、内部管理等事项进行事前、事中、事后独立监督。

截至到2015年11月25日，公司有员工164人，其中61%的员工具有硕士及以上学历，94%的员工具有基金从业资格。

公司已经建立健全投资管理制度、风险控制制度、监察稽核制度、基金会计制度、财务管理制度、信息技术管理制度、信息披露制度等公司管理制度。

（二）主要成员情况

1.基金管理人董事会成员
路强先生，董事长，本科学历。历任中国华润总公司进出口贸易经理，大连保税区宝利行华润国贸有限公司副总经理，华润投资开发有限公司副总经理，董事、副总经理，华润国际信托股份有限公司副总经理。现任华润元大基金管理有限公司董事长，兼任深圳红树林创业投资有限公司总经理，深圳华润元大资产管理有限公司执行董事。

历任女士，副董事长，博士学历。历任中国人民银行金融研究所高级研究员，香港岭南大学社会科学院讲师，美国安泰国际商学院亚太亚东国际研究院，荷兰海牙大学及研究中心主管，荷兰国际精英全球职业规划服务业务资深顾问，现任元大证券（香港）有限公司董事总经理，招商局中国基金有限公司独立董事。

孟扬女士，董事，硕士学历。历任北京大学助教，深圳国际信托投资公司租赁部业务员、副科长、科长、副经理、资产管理部经理、总经理助理，深圳国际信托投资有限责任公司副总经理，华润国际信托投资有限公司董事、总经理。现任华润国际信托投资有限公司董事长，华润金融控股有限公司副总经理，深圳红树林创业投资有限公司董事长，国信证券股份有限公司董事。

刘永先生，董事，博士学历。历任泰国WALL RESEARCH投资有限公司总经理，宝来证券研发部总经理组组长，宝来证券基金部特别助理，助理室主任，国际金融部副总经理，宝来证券（香港）有限公司总经理，宝来证券投资信托股份有限公司总经理。现任元大证券投资信托股份有限公司总经理，PT AMCI Managemen Investasi Indonesia公司（简称AMII资产管理公司）董事（Commissioner）。

刘胤宏先生，独立董事，硕士学历。历任北京世纪律师事务所公司证券部律师，北京世纪律师事务所法律事务部高级合伙人，深圳分所主任，深圳格林赛特环保能源科技服务有限公司监事，深圳南天信息技术有限公司董事。

孙茂竹先生，独立董事，硕士学历。历任北京市第二建筑工程公司工人，现任中国人民大学商学院教授、博士生导师，北京建筑设计研究院股份有限公司独立董事，洛阳钼业科技股份有限公司独立董事，北京首都开发股份有限公司独立董事。

刘永先生，董事，硕士学历。历任美国化学银行（Chemical Bank）经理，菲利浦莫里斯公司（Philip Morris Inc）经理，中华开发公司经理，蓝盾管理咨询有限公司负责人，罗门兄弟（Salomon Brothers）副总裁，华盛顿资本集团（Washington Capital Group）执行董事，瑞士联合银行集团（UBS）执行董事，阿凡提公司（Avant Corporation）首席财务官，Union Natn Inc.负责人，瑞信信贷（瑞信）（CSFB）董事总经理。现任瀚彩金融服务股份有限公司独立董事，利源股份有限公司董事，富昌通股份有限公司董事，德信工业股份有限公司董事，微滴科技股份有限公司监法人代表。

林瑞卿先生，董事，总经理，本科学历。历任元大宝来证券股份有限公司服务管理部科长，元大宝来证券投资信托股份有限公司客户服务部经理、行销部副经理，投资管理部副经理，通路事业部资深副经理。现任深圳华润元大资产管理有限公司总经理。

林瑞卿先生，董事，曾晓光，硕士学历。历任深圳三九医药贸易有限公司财务部经理，华润国际信托投资有限公司监察稽核部监察稽核主管，华润国际信托投资有限公司证券投资部高级信託经理、总经理助理、执行董事。现任深圳证券期货业纠纷调解中心调解员，深圳华润元大资产管理有限公司执行监事。

三、基金管理人监事会成员
卢伦女士，监事，硕士学历。历任华为技术有限公司人力资源部经理，晨星（深圳）资讯有限公司股票部研究员，华润（集团）有限公司财务部资产副监，现任华润国际信托投资有限公司财务管理部副监。

林武田先生，监事，博士学历。历任尧干股份有限公司董事长兼总经理，元大建设开发股份有限公司总经理，元大证券股份有限公司执行行副监，元大创业投资有限公司董事长，元大国际财务管理股份有限公司董事长，财团法人元大文教基金会执行长，元大金融控股股份有限公司执行长，现任元大证券投资信托股份有限公司董事长。

张杨帆先生，监事，硕士学历。历任德勤华永会计师事务所高级审计师，华润国际信托有限公司财务管理经理，现任华润元大基金管理有限公司财务部总经理助理。

傅雅伦女士，监事，硕士学历。历任美商花旗银行中理财银行专员、训练师，JPMorgan林明投信基金事务部副理，台湾群益证券投资通路部经理，客服部经理，元大证券投资信托股份有限公司稽核部资深经理、行政管理部经理，客服部经理，现任华润元大基金管理有限公司运营管理部副经理。

3.基金管理人高级管理人员
路强先生，董事长。简历见董事会成员介绍。
林瑞卿先生，总经理。简历见董事会成员介绍。
何伟先生，督察长。简历见董事会成员介绍。

4.本基金基金经理
杨伟先生，厦门大学金融工程博士，6年金融行业从业经历。历任兴业证券股份有限公司风险管理专员，平安信托有限责任公司金融工程及量化投资研究员，2013年加入华润元大基金管理有限公司，现任华润元大中国A50指数型证券投资基金基金经理、华润元大信息传媒科技混合型证券投资基金基金经理、华润元大中创100交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

5.投资决策委员会成员
林瑞卿（总经理）
李洋昇（投资管理部总经理兼固定收益部总经理）
李孟霞（投资管理部投资总监）
上述成员之间无近亲属关系。

三、基金托管人
（一）基金托管人情况
名称：招商证券股份有限公司
住所：广东省深圳市福田区益田路江苏大厦A座38—45层
办公地址：广东省深圳市福田区益田路江苏大厦A座38—45层
法定代表人：肖少林
成立时间：1993年 8月
组织形式：股份有限公司
注册资本：人民币46.61亿元
存续期间：持续经营
基金托管业务批准文号：证监许可[2014]78号
联系人：秦海
联系电话：0755-20961111

招商证券是百年招商局旗下金融企业，经过二十多年创业发展，已成为拥有证券市场业务全牌照的一流券商，并经中国证券监督管理委员会认定为A类AA级券商。招商证券具有稳定的持续盈利能力，科学合理的风险管理架构，专业的服务能力。公司拥有多层次客户服务渠道，在北

京、上海、广州、深圳等城市拥有162家批准设立的证券营业部和11家证券经纪业务管理分公司，同时在香港设有分支机构，全资拥有招商证券国际股份有限公司、招商期货有限公司、招商致远资本投资有限公司、招商证券投资有限公司、招商证券资产管理有限公司、参股博时基金管理有限公司、招商基金管理有限公司，构建起国内国际业务一体化的综合证券服务平台。招商证券致力于“全面提升核心竞争力，打造中国最佳投资银行”。公司将以卓越的金融服务实现客户价值增长，推动证券行业进步，立志打造产品丰富、服务一流、能力突出、品牌卓越的国际化金融机构，成为客户信赖、社会尊重、股东满意、员工自豪的优秀金融企业。

2.主要人员情况
招商证券托管部员工平均具备7年以上的证券基金后台运营或结算托管工作经验，其中多人具备丰富的证券投资基金业务运作经验，会计师事务所审计经验，以及大型IT公司的软件设计与开发经验，人员专业背景覆盖了金融、会计、经济、计算机等各领域，其中本科以上人员占100%，硕士研究生占比达到70%，高级管理人员均拥有硕士研究生或以上学历。

3.基金托管业务经营情况
招商证券托管部是国内首批获得证券投资基金托管业务的证券公司，可为各类公开募集证券投资基金设立的证券投资基金提供托管服务。托管部拥有独立的安全监控系统，稳定、高效的托管业务系统，完善的业务管理制度。招商证券托管部秉承“诚实信用、谨慎勤勉”的原则，为基金份额持有人利益履行基金托管职责。除此之外，招商证券于2012年10月获得中国证监会准予开展私募基金综合托管服务试点的正式批复，成为业内首家可以从事私募基金托管业务的券商，经验丰富，服务优质，业绩突出。截至2015年三季度，招商证券共托管14只公募基金。

（二）基金托管人内部控制制度
1.内部控制目标
招商证券作为基金托管人：
（1）托管业务的经营运作遵守国家有关法律法规和行业监管规则，自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营理念。
（2）建立科学合理的控制机制，运行高效的内部控制体系，保持托管业务内部控制制度健全、执行有效。
（3）防范和化解经营风险，提高经营管理效益，使托管业务稳健运行和受托资产安全完整，实现托管业务的目标、持续、健康发展。
（4）不断改善和完善内部控制机制，体制和各项业务制度、流程，提高业务运作效率和效果。

2.内部控制组织结构
招商证券设有风险管理部，风险管理部是公司审议投资决策、风险控制政策、风险偏好、容忍度和经济资本等风险限额配置方案，拥有公司重大风险业务和创新的业务项目的最终裁量权。风险管理部、法律合规部及稽核监察部为公司的风险管理职能部门。

资产托管部内部设置专门负责稽核监控工作的内控稽核岗，配备专职监察稽核人员，在托管部总经理的直接领导下，依据有关法律法规，对业务的运行独立行使监督稽核职权。

3.内部控制制度及措施
招商证券托管部制定了各项管理制度和操作规程，建立了科学合理、控制严密、运行高效的内部控制体系，保持托管业务健全、有效执行；安全保管基金财产，保持基金财产的独立性；实行经营场所封闭化管理，并配备录音和录像监控系统；有独立的综合托管业务系统；业务管理实行复核和检查机制，建立了严格有效的操作制约体系；托管部树立内控优先和风险管理理念，培养稽核岗全体员工的风险防范和保密意识。

四、基金管理人对于基金管理人运作基金进行监督的方法和程序
1.监督方法
基金管理人根据《基金法》、《运作办法》等法律法规的规定和基金合同、托管协议的约定，对基金合同生效后所托管基金的投资范围、投资比例、投资限制等进行监督，并及时提示基金管理人违规风险。

2.监督程序
基金管理人发现基金管理人投资指令或实际投资运作违反法律法规、基金合同和托管协议的约定，应及时以电话提醒和书面提示等方式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人发出书面通知后应在限期内对纠正行为以书面形式向基金托管人作出回函，就基金托管人的疑义进行解释或举证，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定的期限内及时改正，在上述规定改正期限内，基金托管人有权随时对前项规定进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人违反基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

四、相关服务机构
（一）基金份额发售机构
1.网下现金发售直销机构
名称：华润元大基金管理有限公司
住所：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）
办公地址：深圳市福田区中心四路1-1号嘉里建设广场第三座7层
法定代表人：路强
成立时间：2013年1月17日
电话：（0755）1883990008
传真：（0755）188399046
联系人：李伟
客户服务电话：4000-1000-89
网址：www.cryuantafund.com

个人投资者可以通过本基金管理人网上直销交易平台办理开户、认购、申购、赎回等业务，具体交易规则请参阅本基金管理人网站公告。
网上交易网址：www.cryuantafund.com。

2.网下现金发售和网下股票发售代理机构
（1）招商证券股份有限公司
住所：广东省深圳市福田区益田路江苏大厦A座38—45层
办公地址：广东省深圳市福田区益田路江苏大厦A座38—45层
法定代表人：肖少林
联系人：秦海
联系电话：0755-26951111
客服电话：95565
网址：www.newone.com.cn

（2）光大证券股份有限公司
注册地址：上海市静安区新闸路1508号
办公地址：上海市静安区新闸路1508号
法定代表人：薛峰
邮政编码：200040
联系人：刘晨
电话：021-22169134
客服电话：95525
网址：www.ebscn.com

（3）华泰证券股份有限公司
注册地址：江苏省南京市中环路78号
办公地址：江苏省南京市中环路78号证券大厦2001室
法定代表人：李伟
联系人：马晓娟
客户服务电话：95538
电话：021-20315525
传真：021-20315137
网址：www.htsc.com.cn

（4）兴业证券股份有限公司
注册地址：福州市湖东路268号
办公地址：上海市虹口区119弄证券大厦五楼D1广场7号楼22楼
法定代表人：兰荣
联系人：黄婓
电话：0591-38162212
传真：0591-39870738
客服电话：95562
网址：www.guosen.com.cn

（5）东吴证券股份有限公司
注册地址：苏州工业园区星阳街5号东吴证券大厦
办公地址：苏州工业园区星阳街5号东吴证券大厦
法定代表人：范力
联系人：方晓红
电话：0512-6558021
客服电话：400-860-1555
网址：www.dwzq.com.cn

（6）国信证券股份有限公司
注册地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十层
办公地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十层
法定代表人：何如
联系人：齐晓燕
电话：0755-82130633
传真：0755-82133952
客服电话：95536
网址：www.guosen.com.cn

（7）中国银河证券股份有限公司
注册地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
办公地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
法定代表人：陈有安
电话：010-66566000
网址：www.chinastock.com.cn

（8）中信证券（山东）有限责任公司
注册地址：山东省青岛市市南区深圳路222号1号楼2001
办公地址：山东省青岛市市南区深圳路222号1号楼20层
法定代表人：杨宝林
联系人：吴昊
电话：0532-85022326
传真：0532-85022805
客服电话：95548
网址：www.citicsec.com

（9）中信证券（上海）有限责任公司
注册地址：上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼
办公地址：上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼
法定代表人：杨雄飞
电话：021-38676666
传真：021-38676666
客服电话：400-888-8888
（10）中信证券股份有限公司
注册地址：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座
办公地址：北京朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦9层
法定代表人：王东明
电话：010-60838888
传真：010-60838629
客服电话：95548
网址：www.cscitic.com

（9）中信证券（山东）有限责任公司
注册地址：山东省青岛市市南区深圳路222号1号楼2001
办公地址：山东省青岛市市南区深圳路222号1号楼20层
法定代表人：杨宝林
联系人：吴昊
电话：0532-85022326
传真：0532-85022805
客服电话：95548
网址：www.citicsec.com

（10）中国国际金融有限公司
注册地址：北京市建国门外大街1号国贸大厦27层及28层
办公地址：北京市建国门外大街1号国贸大厦27层及28层
法定代表人：金立群
电话：010-69511166
传真：010-69511166
网址：www.cicc.com

（11）国泰君安证券股份有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路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29楼
法定代表人：杨雄飞
电话：021-38676666
传真：021-38676666
客服电话：400-888-666 / 95521
网址：www.gtja.com

（12）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4号楼
办公地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼

法定代表人：王常青
电话：010-85156398
传真：010-61828261
客服电话：400-888-8108
网址：www.csc108.com
3.网上现金发售代理机构
具有基金销售业务资格且符合深圳证券交易所风险控制要求的深圳证券交易所会员单位，详见基金份额发售公告。

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其它符合要求的机构销售本基金或变更上述销售机构，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：北京市西城区太平桥大街17号
办公地址：北京市西城区太平桥大街17号
法定代表人：周明
电话：（0755）25946013
传真：（0755）25967122
联系人：严峰

（三）出具法律意见书的律师事务所
名称：上海市通力律师事务所
住所：上海市银城中路68号时代金融中心19楼
办公地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼
负责人：刘静
电话：（021）31358666
传真：（021）31358600
联系人：安杰、陆奇

（四）审计会计师事务所
名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
住所：北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
办公地址：北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
法定代表人：Ng Albert Kong Ping 吴港平
电话：（010）58153000、（0755）25028828
传真：（010）85188298、（0755）25026188
联系人：李妍明

经办注册会计师：吴翠蓉、高鹤
五、基金名称类型
（一）本基金名称：华润元大中创100交易型开放式指数证券投资基金

（二）本基金类型：股票型证券投资基金
（三）本基金运作方式：交易型开放式

六、基金投资目标和投资方向
（一）投资目标
本基金采用被动式投资策略，通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准表现相当，以便为投资者带来长期收益。

（二）投资范围
本基金投资于中创100指数的成份股及其备选股成份，债券、货币市场工具、权证、股指期货、银行存款、资产支持证券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（但须符合中国证监会的相关规定）。

七、基金的投资策略
本基金主要采取完全复制法，即完全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及其权重的变动进行相应调整。当预期指数成份股发生调整或成份股发生调整、增发、分红等进行时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致跟踪误差不足时，或其他原因导致无法有效跟踪和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当调整和调整，从而使使得投资组合紧密地跟踪标的指数。

当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等进行时，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，基金管理人会对投资组合进行适当调整，确保跟踪误差。如有因股票停牌、股票流动性或性其他一些影响跟踪指数的市场因素，导致基金管理人无法依指数权重购买成份股，基金管理人可以根据市场情况，结合经验判断，对投资组合进行适当调整，以获得更接近跟踪的收益率。

定期调整：本基金投资组合根据所跟踪的中创100指数对其成份股的调整而进行相应的定期跟踪调整。

不定期调整：根据指数编制规则，中创100指数成份股因增发、配股等股权变动而需进行成份股权重重新调整，本基金将根据中创100指数在股权变动公告日次日发布的临时调整决定及其调整的股权比例，进行相应调整。

本基金将采用货币市场工具对基金资产进行流动性管理。在满足安全性和保本流动性的基础上，本基金将结合宏观分析和微观分析制定投资策略，有效利用基金资产，更好地实现跟踪标的指数的投资目标。同时，根据本基金申购和赎回情况，对投资组合进行适当调整，从而有效跟踪标的指数。

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，如股指期货、权证以及其他与标的指数的指数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。基金投资于各种衍生工具的比例合计不得超过基金资产总值的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公告。在日常市场情况下，本基金资产净值增长率与业绩比较基准之间的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%。

（四）投资决策依据和投资流程
1.投资决策依据
（1）国家有关法律、法规和基金合同的有关规定；
（2）公司投资及风险控制政策；
（3）本基金采用被动式指数化投资，在追求跟踪偏离度与跟踪误差最小化的前提下，根据标的指数的成份股的结构及权重，形成基金投资组合；
（4）以维护基金份额持有人利益为基金投资决策的准则。

2.投资决策机制
本基金实行投资决策委员会下的基金经理负责制。基金经理负责基金的日常投资运作，基金投资的重大事项须向投资决策委员会报告。

3.投资决策流程
研究、决策、组合构建、交易、评估、组合维护的有机配合共同构成了本基金的投资决策流程。严格的组合维护可以保证投资组合的正确执行，避免重大风险的发生。

（1）研究：指数数据的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、成份股等相关信息的搜集与分析、流动性分析等工作，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指数投资研究小组提供的研究报告，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，每日进行基金投资管理的日常工作。

（3）组合构建：基金经理根据标的指数相关信息，结合内部指数投资研究，以指数复制法构建投资组合。在追求跟踪误差最小化的前提下，基金经理将采取适当的投资方法，以降低投资组合成本、控制投资风险。
（4）交易执行：运营管理部交易员负责具体的交易执行，同时履行一线监控的职责。

（5）投资绩效评估：投资管理部定期和不定期对基金进行投资绩效评估，并提供相关报告。绩效评估能够确认组合是否实现了投资策略，组合跟踪标的指数的投资策略成功与否，基金经理可以据此检讨投资策略，进而调整投资组合。

（6）组合监控与调整：基金经理跟踪标的指数的表现，结合成份基金基本面情况、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，对投资组合进行监控和调整，密切跟踪标的指数。

基金管理人将根据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，并在基金招募说明书及其更新中公告。

（一）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和备选成份股的比例不低于基金资产的90%；
（2）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%，本基金持有的有价证券市值不得超过基金资产净值的33%，基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不得超过该权证的10%；
（3）本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的10%；
（4）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的20%；
（5）本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的10%；
（6）本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%；
（7）本基金投资于资产支持证券信用等级为BBB（以含BBB）的资产支持证券，基金持有的资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出；
（8）本基金资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，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；
（9）本基金在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%；债券回购最长期限为1年，债券回购到期后不得展期；
（10）本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过该资产支持证券规模的10%；
（11）本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和不得超过该基金资产净值的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；
（12）本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该基金持有的股票总市值的20%；
（13）本基金持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关规定；
（14）本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值不得超过该资产支持证券规模的10%；
（15）每个交易日日终在扣除股指期货合约所需缴纳的保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的余额；
（16）基金投资于各种衍生工具的比例合计不得超过基金资产总值的10%；
（17）本基金的资金资产总值不得超过基金资产净值的140%；
（18）法律法规及中国证监会规定和基金合同约定的其他投资限制。

因证券市场波动、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数的成份股流动性限制等基金管理人之外的因素致使基金投资组合比例不符合上述投资比例限制的，基金管理人应在10个交易日内进行调整，法律法规另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

如果法律法规对上述投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人可在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

2.禁止行为
因证券市场波动、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数的成份股流动性限制等基金管理人之外的因素致使基金投资组合比例不符合上述投资比例限制的，基金管理人应在10个交易日内进行调整，法律法规另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

如果法律法规对上述投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人可在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

2.禁止行为
因证券市场波动、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数的成份股流动性限制等基金管理人之外的因素致使基金投资组合比例不符合上述投资比例限制的，基金管理人应在10个交易日内进行调整，法律法规另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

如果法律法规对上述投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人可在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

2.禁止行为
因证券市场波动、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数的成份股流动性限制等基金管理人之外的因素致使基金投资组合比例不符合上述投资比例限制的，基金管理人应在10个交易日内进行调整，法律法规另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

如果法律法规对上述投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人可在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

2.禁止行为
因证券市场波动、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数的成份股流动性限制等基金管理人之外的因素致使基金投资组合比例不符合上述投资比例限制的，基金管理人应在10个交易日内进行调整，法律法规另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

如果法律法规对上述投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人可在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

2.禁止行为
因证券市场波动、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数的成份股流动性限制等基金管理人之外的因素致使基金投资组合比例不符合上述投资比例限制的，基金管理人应在10个交易日内进行调整，法律法规另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

如果法律法规对上述投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人可在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

2.禁止行为
因证券市场波动、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数的成份股流动性限制等基金管理人之外的因素致使基金投资组合比例不符合上述投资比例限制的，基金管理人应在10个交易日内进行调整，法律法规另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

如果法律法规对上述投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人可在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

2.禁止行为
因证券市场波动、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数的成份股流动性限制等基金管理人之外的因素致使基金投资组合比例不符合上述投资比例限制的，基金管理人应在10个交易日内进行调整，法律法规另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

如果法律法规对上述投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人可在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

2.禁止行为
因证券市场波动、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数的成份股流动性限制等基金管理人之外的因素致使基金投资组合比例不符合上述投资比例限制的，基金管理人应在10个交易日内进行调整，法律法规另有规定的，从其规定。