

（上接A54版）

投资者应当按照有关法律、法规和基金合同的规定，履行适当程序，方可赎回基金份额。

（四）法律法规允许的范围内，登记机构可对上述业务内容进行调整，基金管理人将于开始实施前按照有关规定予以公告。

五、申购与赎回的限制

1. 通过本公司直销中心申购本基金，每个基金账户首次申购的最低金额为1,000元人民币（含申购费），追加申购的最低金额为人民币1,000元（含申购费）；通过本公司网上交易系统（含申购费）、电话交易系统申购本基金，每个基金账户首次申购的最低金额为100元人民币（含申购费），追加申购的最低金额为人民币100元（含申购费）。

2. 通过本公司直销中心赎回本基金，基金份额持有人赎回本基金的最低份额为100份基金份额。通过本公司网上交易平台赎回本基金，单笔赎回申请的最低份额不受限制。基金份额持有人可将其全部或部分基金份额赎回，但某笔赎回导致该基金份额持有人在一个网站的基金份额全部赎回的最低赎回限制，全部赎回的基金份额必须同时赎回。

3. 各代销机构对上述最低申购限额、交易级差、最低赎回份额持有其他规定，以各代销机构的业务规定为准。

4. 当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。其具体请参见相关公告。

5. 基金管理人可在法律法规允许的范围内，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制，基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。

六、申购与赎回的费用

本基金在申购时收取申购费用，申购费率随申购金额的增加而递减。投资人在一天之内如果有笔数申购，适用费率按单笔分别计算。具体费率如下：

申购金额（M）	申购费率
M<100万元	1.2%
100万元≤M<500万元	0.8%
500万元≤M<1,000万元	0.2%
M≥1,000万元	1000元/笔

本基金的申购费用将由基金申购人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

（二）赎回费用

本基金赎回费率如下表所示：

持有期限（N）	赎回费率
N≤7天	1.50%
8天≤N≤28天	0.50%
N≥29天	0.25%
0	0

注：①一年指365日，两年为730日。

②本基金赎回前诺安中证500交易易开放式指数证券投资基金收取基金份额持有人的基金份额持有期限满1个月持有本基金基金份额的持有期限。

赎回费用自赎回基金份额的赎回申请人承担。在基金份额持有人赎回基金份额时收取。对持续持有期少于7日的投资者收取的赎回费全额计入基金财产；对持续持有期少于7日但不少于3日的投资者收取的赎回费计入基金财产；对持续持有期不少于3日的投资者收取的赎回费计入基金财产。其用于支付注册登记费和其他必要的费用。

（三）基金管理人可在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

（四）基金管理人可在以不违反法律法规规定及基金合同约定的前提下根据市场情况制定基金促销计划，针对投资者定期和不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，基金管理人可按照中国证监会要求履行必要手续后，对投资者适当调整申购费率、赎回费率等相关费率。

（五）当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。具体处理原则和操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。

七、申购和赎回的数额和价格

1. 申购份额及余额、赎回金额的处理方式

（一）申购份额及余额的处理方式：申购的有效份额按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后，以当日基金份额净值为基础计算，结果保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产；

（二）赎回金额的处理方式：赎回金额按实际确认的有效赎回份额以当日基金份额净值为基准并扣除相关费用后，计算结果保留到小数点后2位，小数点后2位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

（三）申购份额

本基金的申购金额包括申购费用和净申购金额。其中，

净申购金额=申购金额÷（1+申购费率）

申购费用=申购金额-净申购金额

申购份额=净申购金额/申购当日基金份额净值

基金份额的计算保留小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

例：假定T日的基金份额净值为1.4500元，四笔申购金额分别为1,000.00元、100.0元、500.0元和1,000.0元，则各笔申购后获得的基金份额计算如下：

申购	申购	申购	申购
申购金额（元）A	1,000.00	100.00	500.00
净申购金额（元）a	1,000.00	100.00	500.00
申购费用（元）B	12.00	0.00	0.00
净申购金额（元）a=（1）-（2）	988.14	99.99	499.99
申购份额（份）=a÷T	11.86	7.00	34.50
基金份额净值（元）T	1.4500	1.4500	1.4500
申购份额（份）=a÷T	681.47	1484.18	3,441.30

（三）赎回金额

赎回金额=赎回当日基金份额净值×赎回份额×赎回费率

赎回金额=赎回当日基金份额净值×赎回份额-赎回费用

例：假定某投资者在T日赎回10,000.00份基金份额，持有期限1年，该日基金份额净值为1.30元，则其获得的赎回金额计算如下：

赎回金额=10,000.00×1.30=13,000.00元

赎回费用=13,000.00×0.5%=65.00元

净赎回金额=13,000.00-65.00=13,435.00元

例：假定某投资者在T日赎回10,000.00份基金份额，持有期限2年，该日基金份额净值为1.450元，则其获得的赎回金额计算如下：

赎回金额=10,000.00×1.45=14,500.00元

赎回费用=14,500.00×0.25%=36.25元

净赎回金额=14,500.00-36.25=14,463.75元

例：假定某投资者在T日赎回10,000.00份基金份额，持有3年，该日基金份额净值为1.625元，则其获得的赎回金额计算如下：

赎回金额=10,000.00×1.625=16,250.00元

（四）基金份额净值和净值计算方式

T日的基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1内公告。遇特殊情形，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。本基金基金份额净值计算，保留到小数点后4位，小数点后第5位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。具体计算公式为：

基金份额净值=基金资产净值/基金份额总数

投资者申购基金份额时，基金注册登记机构在T+1日为投资者登记权益并办理注册登记手续，投资者自T+2日（含该日）后有权利赎回部分基金份额。

投资者赎回基金份额成功后，基金注册登记机构在T+1日为投资者办理赎回款项权益的注册登记手续。

基金管理人可以在法律法规允许的范围内，对上述注册登记业务办理时间进行调整，但不得实质影响投资者的合法权益，并须依照《信息披露办法》的有关规定至少在一家指定媒体及基金管理人网站公告并报中国证监会备案。

八、拒绝或暂停接受申购的情况及处理方式

1. 因不可抗力导致基金管理人无法支付赎回款项，基金管理人可暂停接受投资者的赎回申请。

2. 发生基金合同规定的暂停基金资产估值的情况时，基金管理人可暂停接受投资者的申购申请。暂停申购期间，本基金资产净值0.5%以上的资产出现无可交易的活跃市场且采用估值技术导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金申购申请的措施。

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

5. 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。

6. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构或登记机构的异常情况导致基金销售系统、登记系统故障、证券交易结算系统或基金登记系统无法正常运作时。

7. 指数编制单位或指数发布机构异常情况导致指数数据无法正常计算、计算错误并发布异常时。

8. 基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过50%，或变相规避50%集中度的情形时。

9. 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果基金管理人认为上述暂停申购的原因消除，则应自暂停申购之日起8个工作日内，基金管理人可以接受比例限制等方式对该投资者的申购申请进行限制，基金管理人有权拒绝或全部暂停申购申请。如果投资者的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资者。基金管理人及基金托管人不承担该延迟支付或退款所产生的利息等损失。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。

（五）暂停赎回或延缓支付赎回款项的处理方式

1. 发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资者的赎回申请或延缓支付赎回款项：

2. 发生基金合同规定的暂停基金资产估值的情况时，基金管理人可暂停接受投资者的赎回申请或延缓支付赎回款项。暂停赎回期间，本基金资产净值0.5%以上的资产出现无可交易的活跃市场且采用估值技术导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请的措施。

3. 证券、期货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. 连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回时。

5. 基金管理人认为接受某笔或某些赎回申请将会影响或损害现有基金份额持有人利益时。

6. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构或登记机构的技术保障等异常情况导致无法办理赎回业务。

7. 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定暂停接受基金份额持有人的赎回申请或者延缓支付赎回款项时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停赎回公告。基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停赎回公告。如果基金管理人认为上述暂停赎回的原因消除，则应自暂停赎回之日起8个工作日内，基金管理人可以接受比例限制等方式对该投资者的赎回申请进行限制，基金管理人有权拒绝或全部暂停赎回申请。如果投资者的赎回申请被拒绝，被拒绝的赎回款项将退还给投资者。基金管理人及基金托管人不承担该延迟支付或退款所产生的利息等损失。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。

（六）巨额赎回的情形及处理方式

1. 巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额及基金转换中转入申请份额数后的余额）超过前一开放日的基金总份额的10%，即认为是发生了巨额赎回。

2. 基金巨额赎回的处理方式

（1）全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资人的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

（2）部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或因支付投资人的赎回申请而进行的资产变现可能会使基金资产净值造成较大波动时，基金管理人应当在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。

对于当日的赎回申请，应当按单个基金份额持有人赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一开放日继续赎回，直至全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。

（3）暂停赎回：连续两个开放日以上（含本开放日）发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过20个工作日，并应当在指定媒介上进行公告。

九、巨额赎回的公告

当发生上述巨额赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在3个工作日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在指定媒介上予以公告。

十二、暂停申购赎回的公告和重新开放申购赎回的公告

1. 发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人应当立即向中国证监会备案，并在规定期限内刊登暂停公告。

2. 如发生暂停的时间为1日，基金管理人应在暂停开放日，在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近一个开放日的基金份额净值。

3. 如发生暂停的时间超过1日，基金管理人可以按按照《信息披露办法》的有关规定自行确定在指定媒介上刊登基金暂停的公告次数，并应于重新开放日，在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近一个开放日各类基金份额的基金份额净值。

十三、基金的费用

基金管理人可以根据相关法律法规及基金合同中的约定决定为本基金与基金管理人管理的其他基金之间的关联交易，基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及基金合同中的规定制定并公告，并提前告知基金托管人与相关机构。

十四、基金的非交易过户

基金的非交易过户是指基金登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行等情形而产生的非交易过户以及基金份额持有人将其基金份额赠与具有民事行为能力、从事合法的金融业务的其他非交易过户。非交易过户按照《中国证券登记结算有限责任公司登记、开户、业务规则》办理。非交易过户涉及基金过户，基金管理人作为必要，可暂停接受基金的非交易过户申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过20个工作日，并应当在指定媒介上进行公告。

十五、基金的转托管

基金份额持有人可将其持有基金份额在登记机构开立的账户之间进行转托管，基金销售机构可以按照规定的时间和收取转托管费。

基金管理人可以为投资者办理定期定额投资计划，具体规则由基金管理人另行规定。投资者在办理定期定额投资计划时可自行约定每期扣款金额，每期扣款金额必须不低于基金管理人在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。

十七、基金的冻结和解冻

基金登记机构只受理国家有权机关要求的基金份额的冻结与解冻，以及登记机构认为符合法律法规规定的情况下的冻结与解冻。

基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益一并冻结，被冻结部分份额仍然参与收益分配。法律法规或监管机构另有规定的除外。

第八部分 基金的投资

一、投资目标

本基金为股票型数量增强型基金，在被动跟踪标的指数的基础上，加入增强型的积极手段，力求跟踪本基金净值增长率与标的比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，年化跟踪误差率不超过1.75%，以实现对中证500指数的有效跟踪并力争实现超越，谋求基金资产的长期增值。

二、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，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、权证、股指期货、国债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但须符合中国证监会的相关规定。

本基金股票资产占基金资产的比例不低于80%，其中投资于中证500指数成份股及备选成份股的比例不低于非现金基金资产的80%。每个交易日日终在扣除股指期货期货国债期货合约需缴纳的保证金后，基金持有现金以及到期日在1年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%其中，现金不包括结算保证金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人可在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

三、投资策略

本基金采用被动投资策略作为主要投资策略，在此基础上进行适度的主动调整，在数量化投资技术下基本跟踪沪深市场中主要权益类投资资产在严格控制风险及力争主动超额收益同时，力争实现、为投资者获取长期稳定的增值。本基金力求控制基金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0.5%，年化跟踪误差率不超过1.75%。

当期申购成份股发生调整和对成份股发生配股、增发、分红等行将时，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，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致本基金无法有效跟踪和跟踪标的指数时，基金经理将对投资组合进行适当调整，以使跟踪误差控制在限定的范围之内。

为实现有效跟踪标的指数并力争超越标的指数的投资目标，本基金股票资产占基金资产的比例不低于80%，投资于中证500指数成份股、备选成份股的非现金基金资产的比例不低于80%。本基金将采用复制法为主，增强投资为辅助的方式，按标的指数的成份股权重构建投资组合，通过加入增强型的积极手段，对基金投资组合进行适当调整，以保证本基金投资目标的实现。

二、股票投资策略

本基金采用被动投资组合复制制的方法进行构建，对于法律法规规定不能投资的股票挑选其它品种予以替代。主动投资主要采用自上而下的方法，结合宏观、中观以及微观研究，优先在中证500指数成份股中对行业、个股进行超配或低配；同时，在公司股票的基础上，对中证500指数成份股以外的股票进行超配或低配，少数中证500指数成份股以外的股票予以增强跟踪，进入基金投资组合，构建主动型投资组合。

（一）构建被动投资组合

本基金在《诺安中证500指数增强型证券投资基金基金合同》生效次日起个月内，将按照中证500指数成份股及其权重进行买入逐步买入，在控制好跟踪误差的前提下，本基金可采取适当方法，以跟踪买入方式，当申购成份股流动性不足等其他市场因素而影响跟踪误差时，可采取部分成份股、侧向标的指数的成份股或调整权重或其他影响跟踪误差的因素时，本基金可以根据市场情况，结合经验判断，对基金资产进行适当调整，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小被动投资组合对标的指数的跟踪误差。

（二）构建增强型投资组合

1. 基于成份股的增强型投资

本基金将依仗上市公司定期报告及市场公开数据，对基金投资组合进行判断并调整当前国内外宏观经济形势、所处经济周期的阶段、分析经济周期各个阶段不同行业表现的差异以及当前行业景气度水平和估值水平，并采用数量化分析并与基本面研究相结合的方法，在重点研究的标的指数成份股中选择业绩增长明确、价值被市场低估的品种进行行业和个股的增强型配置。

2. 基于非成份股的增强型投资

a)替代部分无法投资标的的指数成份股

标的指数部分成份股可能因为长期停牌、被列入本公司禁止投资股票等因素，导致本基金无法投资该成份股。本基金将首先选择与该成份股行业属性一致、相关性高的其他成份股进行替代；若成份股不缺乏符合要求的替代品种，本基金将选择成份股之外选择行业属性一致、相关性高且基本面优质的替代品种。

b)敏感性部分分散选股成份

若跟踪指数标的指数的成份股将发生调整，本基金将综合考虑跟踪误差、流动性冲击等因素，在一个限定的时间内，严格按照事先设定的交易计划对相关成份股进行替代。

c)主动投资能力较大的非成份股

本基金将依仗上市公司定期报告及市场公开数据，对基金投资组合进行判断并调整当前国内外宏观经济形势、所处经济周期的阶段、分析经济周期各个阶段不同行业表现的差异以及当前行业景气度水平和估值水平，并采用数量化分析并与基本面研究相结合的方法，在重点研究的标的指数成份股中选择业绩增长明确、价值被市场低估的品种进行行业和个股的增强型配置，获取超额收益。

3. 债券投资策略

本基金将根据国内外宏观经济形势、债券市场资金供求情况以及市场利率走势来预测债券市场利率变化趋势，并对各债券品种收益率、流动性、信用风险等因素进行综合分析，确定债券品种投资比例，同时考虑债券基金的流动性管理需要，主要投资到期日在一年以内的政府债券品种并积极参与配置。

4. 投资组合调整策略

（1）投资组合跟踪调整原则

本基金将根据标的指数的成份股及其权重进行买入逐步买入，在控制好跟踪误差的前提下，本基金可采取适当方法，以跟踪买入方式，当申购成份股流动性不足等其他市场因素而影响跟踪误差时，可采取部分成份股、侧向标的指数的成份股或调整权重或其他影响跟踪误差的因素时，本基金可以根据市场情况，结合经验判断，对基金资产进行适当调整，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小被动投资组合对标的指数的跟踪误差。

（2）投资组合调整方法

1）对标的指数的跟踪调整

本基金将根据标的指数化投资组合将根据所跟踪的中证500指数对其成份股的调整而进行相应的跟踪调整。

a)定期调整

根据中证指数公司按照定期指数编制方法公布的中证500指数成份股定期调整结果，基于本基金的股票投资组合调整原则，对基金投资组合进行相应调整。

b)不定期调整

（3）不定期调整原则：当中证500指数的成份股增发、送股等股权变动而需进行成份股权重调整时，本基金将根据中证指数公司发布的临时调整公告，基于本基金的投资组合调整原则，对投资组合进行及时调整。

（4）跟踪性调整

a)投资比例调整策略

本基金将依仗上市公司定期报告及市场公开数据，对基金投资组合中按基准权重投资的股票资产比例或个股比例超过规定限制时，本基金将对其在履行实时的流动性卖出调整，并相应地对其其他资产类别个股进行微调，以保证基金投资组合规范运行。

b)大额赎回调整

当发生大额赎回超过现金保有比例时，本基金将对股票投资组合进行同比例的被动性卖出调整，以保证基金投资组合规范运行。

5. 跟踪误差控制策略

本基金为控制投资组合相对标的指数的偏差，以“跟踪误差”为目标，控制基金相对标的指数的跟踪误差。

本基金以跟踪误差为测算指标，对投资组合进行监控与评估。其中：

$$\text{跟踪误差} = \frac{\sqrt{\sum_{i=1}^n (R_i - R_f)^2}}{n}, \text{其中}$$

$$R_f = \frac{\sum_{i=1}^n R_i}{n}, n \text{ 为计算区间，} R_i \text{ 为基金净值区间每周最后一个交易日起前30个交易日（含当日）的基金份额净值收益率，} R_f \text{ 为同期业绩比较基准。}$$

将跟踪误差的最大容忍值设定为0.5%（相应折算的跟踪误差约为7.75%），以每周为周期，如果本基金每周计算跟踪误差，计算区间为每周最后一个交易日起前30个交易日（含当日），当前一周跟踪误差超过0.5%，则基金管理人应当及时调整投资组合，找出造成跟踪误差的原因，通过对投资组合进行适当的调整，以使跟踪误差回到跟踪误差容忍范围之内。当跟踪误差在最大容忍值以内时，由基金经理酌情对跟踪误差的波动作出判断。

当本基金发展到下一阶段时，本基金将会对测算基准转换为代表相同风险度的周月跟踪误差，具体实施方式另行公告。

6. 股指期货投资策略

本基金股指期货投资将以控制风险为原则，以套期保值为目的，本基金遵循的原则、方法与股指期货的投资，并按照国家金融期货交易所套期保值管理的有关规定执行。

7. 国债期货投资策略

本基金参与国债期货交易是为了有效控制投资组合的系统性风险，本基金将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，适度运用国债期货提高投资组合运作效率。在国债期货投资时，本基金将结合国债期货的定价模型与利率敏感性分析，并充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置，谨慎进行投资，以调整债券投资组合的久期，降低投资组合的整体风险。

8. 权证投资策略

本基金管理人将以价值分析为基础，在采用权证定价模型分析其合理定价的基础上，充分考虑权证公允价值与组合相关性等因素，并充分考虑权证的可赎回性、流动性、波动性、杠杆性等特征，进行充分的投资组合风险评估，并据此进行投资决策。

四、投资管理程序

1. 投资决策委员会：定期召开会议，负责制定基金投资方向的整体战略和原则；审定基金经理提交的指数基金建仓方案、持仓方案及指数跟踪偏离度和组合仓位调整方案；审定基金投资决策报告；决定基金禁止的投资事项等。如遇重大事项，投资决策委员会召开临时会议做出决策。

2. 基金经理：负责根据投资决策委员会的投资计划、实施、调整、监督和日常管理，负责跟踪投资组合的个股投资。

3. 决策程序

（1）研究支持：指数研究用数量模型和风险跟踪模型，对总体累积偏差、行业偏差以及日跟踪误差进行测算，提供报告；基金经理分析人员从基本面分析、个股和市场走势提出报告；运营保障人员提供基金仓位、赎回变动情况、供求基金建仓报告。

（2）投资决策：投资决策委员会定期召开，定期（每周1次）或遇重大事项时召开投资决策会议，决定相关事项。基金经理根据投资决策委员会的决议，进行基金投资组合的日常决策。

（3）组合构建：根据标的指数、组合投资、基金经理以复利构建的指数成份股权重的方法构建被动组合，并在跟踪误差控制的前提下，通过增强型投资方法对投资组合进行适当的主动调整；

（4）交易执行：交易中心负责具体的交易执行，同时履行一线监控职责；

（5）跟踪绩效评估：风控跟踪部门定期和不定期跟踪投资组合实现情况、业绩归因分析、跟踪误差来源分析等，对基金进行投资绩效评估，并提供相关报告。基金经理可以根据投资绩效评估，进而调整投资组合；

（6）组合维护：基金经理将跟踪标的指数变动、组合成份股基本面情况、流动性状况、基金申购和赎回资金流动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。

五、投资限制

1. 组合限制

（1）基金的投资组合应遵循以下限制：

（2）本基金股票资产占基金资产的比例不低于80%，其中投资于中证500指数成份股及备选成份股的比例不低于非现金基金资产的80%；

（3）本基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）持有一家公司发行的证券，不得超过该上市公司可流通股票的15%；本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不得超过该上市公司可流通股票的20%；本基金持有的有表决权的股票市值不得超过基金资产净值的10%；

（4）本基金持有的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%；

（5）本基金持有的同一信用等级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基金持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的10%；

（7）本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的保持一致；