

国联安双力中小板综指分级证券投资基金  
招募说明书（更新）摘要

基金管理人：国联安基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

## 重要提示

本基金的募集申请经中国证监会2011年10月9日证监许可[2011]1593号文核准。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本基金由基金管理人依照《国联安双力中小板综指分级证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规规定募集，并经中国证监会核准。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做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

本基金投资于证券市场，基金份额净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资人在投资本基金前，需充分了解本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对投资本基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资者根据所持有份额享受基金的收益，但同时也需承担相应的投资风险。投资本基金可能遇到的风险包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的指数投资风险、杠杆机制风险、折/溢价交易风险、以及份额配对转换及基金份额折算等业务办理过程中特定风险等等。本基金为被动投资型指数基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益均高于货币市场基金和债券型基金。

投资有风险，投资者在投资本基金前应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同。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，但不保证投资于本基金一定盈利，也不保证最低收益。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行承担。

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基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、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）所载内容截止日为2015年3月23日，有关财务数据和净值表现截止日为2014年12月31日（财务数据未经审计）。

## 一、基金合同生效日期：2012年3月23日

## 二、基金管理人

### （一）基金管理人概况

名称：国联安基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦9楼

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦9楼

法定代表人：庹启斌

成立日期：2003年4月3日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：证监基金字[2003]42号

组织形式：有限责任公司

注册资本：1.5亿元人民币

存续期间：五十年或股东一致同意延长的其他期限

电话：021-38992870

联系人：茅斐

股权结构：

股东名称	持股比例
国泰君安证券股份有限公司	51%
德国安联集团	49%

### （二）证券投资基金管理情况

截至本招募说明书（更新）所载内容截止日，公司旗下共管理24只基金：国联安德盛稳健证券投资基金（以下简称“国联安稳健混合”）、国联安德盛小盘精选证券投资基金（以下简称“国联安小盘精选混合”）、国联安德盛安心成长混合型证券投资基金（以下简称“国联安安心成长混合”）、国联安德盛精选股票证券投资基金（以下简称“国联安精选股票”）、国联安德盛优势股票证券投资基金（以下简称“国联安优势股票”）、国联安德盛红利股票证券投资基金（以下简称“国联安红利股票”）、国联安德盛增利债券证券投资

基金（以下简称“国联安增利债券”）、国联安主题驱动股票型证券投资基金（以下简称“国联安主题驱动股票”）、国联安双禧中证100指数分级证券投资基金（以下简称“国联安双禧中证100指数分级”）、国联安信心增益债券型证券投资基金（以下简称“国联安信心增益债券”）、上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“商品ETF”）、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金联接基金（以下简称“国联安上证商品ETF联接”）、国联安货币市场证券投资基金（以下简称“国联安货币”）、国联安优选行业股票型证券投资基金（以下简称“国联安优选行业股票”）、国联安信心增长债券型证券投资基金（以下简称“国联安信心增长债券”）、国联安双力中小板综指分级证券投资基金（以下简称“国联安双力中小板综指分级”）、国联安双佳信用分级债券型证券投资基金（以下简称“国联安双佳信用分级债券”）、国联安中债信用债指数增强型发起式证券投资基金（以下简称“国联安中债信用债指数增强”）、国联安保本混合型证券投资基金（以下简称“国联安保本混合”）、国联安中证股债动态策略指数证券投资基金（以下简称“国联安股债动态”）、国联安中证医药100指数证券投资基金（以下简称“国联安医药100指数”）、国联安新精选灵活配置混合型证券投资基金（“国联安新精选混合”）、国联安通盈灵活配置混合型证券投资基金（“国联安通盈混合”）和国联安鑫安灵活配置混合型证券投资基金（“国联安鑫安灵活配置混合”）。

### （三）主要人员情况

#### 1. 董事会成员

（1）唐启斌先生，董事长，经济学博士。历任华东师范大学国际金融系讲师、君安证券有限公司万航渡路营业部经理、资产管理公司研究部经理、香港公司研究策划部经理、研究发展中心主任、经纪管理部总经理、债券部总经理、副总裁，国泰君安证券股份有限公司副总裁。现任国泰君安证券股份有限公司执行董事、党委委员；国联安基金管理有限公司董事长，并代为履行总经理职责。

(2) **Andrew Douglas Eu**（余义焜）先生，副董事长，工商管理硕士。历任怡富证券投资有限公司高级研究分析员、投资经理、董事（地区业务）、JF资产管理有限公司董事、行政总裁。现任德盛安联亚太区行政总裁及公司全球执行委员会成员、德盛安联资产管理有限公司（香港）董事、研富资产管理有限公司（亚太地区）董事。

(3) 叶锦华先生（**IP Kam Wah**），董事，学士学位，澳洲注册会计师。历任瑞士银行香港分行会计经理、财务总监；瑞士银行集团财务董事、亚太区财务变更计划负责人及项目总监；瑞银环球资产管理有限公司亚太区首席财务总监及常务董事；瑞银证券投资信托股份有限公司财务总监及公司监事；瑞银环球资产管理（日本）有限公司法定核数师；国投瑞银基金管理有限公司监事、监事长。现任德盛安联资产管理有限公司首席财务总监，德盛安联资产管理公司（香港、日本、新加坡、台湾）董事、研富资产管理有限公司（亚太地区）董事。

(4) 汪卫杰先生，董事，经济学硕士，会计师职称。1994年起进入金融行业，历任君安证券有限责任公司财务部主管、稽核部副总经理、资金计划部副总经理、长沙营业部总经理、财务总部总经理、深圳分公司总经理助理、计划财务总部总经理、国泰君安证券股份有限公司计划财务总部总经理、资产负债管理委员会专职主任委员、子公司管理小组主任。现任国泰君安证券股份有限公司监事会办公室主任、纪检监察室主任。

(5) 程静萍女士，独立董事，高级经济师职称。历任上海市财政局副科长、副处长、处长、局长助理，上海市财政局、税务局副局长，上海市计划委员会、上海市发展计划委员会副主任兼上海市物价局局长、上海市发展和改革委员会副主任、第十届全国人大代表、上海市决策咨询委员会专职委员。现任上海银行独立董事、上海市创业投资行业协会会长。

(6) 王鸿嫔女士，独立董事，法学士。历任台湾摩根资产管理旗下的怡富证券投资信托有限公司副总经理、怡富证券投资顾问公司总经理，中国摩根资产管理董事总经理、上投摩根基金管理有限公司总经理。现主要从事教育工作和公益活动。

(7) 胡斌先生，独立董事，特许金融分析师(CFA)，美国伊利诺伊大学(UIUC)工商管理硕士(MBA)、上海交通大学管理工程博士。历任纽约银行梅隆资产管理公司担任Standish Mellon量化分析师、公司副总裁，Coefficient Global公司创始人之一兼基金经理。2007年11月起，于纽银梅隆西部基金管理有限公司（筹建）担任筹建组副组长。2010年7月起，于纽银梅隆西部基金管理有限公司担任首席执行官（总经理）。现任上海系数股权投资基金管理合伙企业（有限合伙）担任总经理。

## 2、监事会成员

(1) 元滢伟女士，监事会主席，北京大学光华管理学院工商管理硕士。历任中国工商银行大连分行出纳、会计、信息技术等工作，1992年担任工商银行信托公司证券部副主任；1994年加入君安证券任大连营业部总经理助理，期间兼任君安物业有限责任公司总经理；1999年担任国泰君安证券大连西安路营业部副总经理；2004年起任大连营业部总经理；2005年起任辽宁营销总部副总经理；2007年起任辽宁营销总部总经理；2009年起担任辽宁分公司总经理；2012年起任财富管理部总经理；现任国联安基金管理有限公司监事会主席。

(2) 庄小慧女士，监事，法律硕士。历任Bell, Temple见习律师、McCague, Peacock, Borlack, McInnis & Lloyd大律师及事务律师助理、金杜律师事务所事务律师助理、瑞士再保险公司法律顾问。现任德盛安联资产管理（亚太）有限公司法律顾问。

(3) 朱慧女士，职工监事，经济学学士，历任国泰证券有限公司、国泰君安证券股份有限公司财务部副经理，现任国联安基金管理有限公司财务部总监。

(4) 刘涓女士，职工监事，经济学学士，现任国联安基金管理有限公司基金事务部副总监。

## 3、公司高级管理人员

(1) 庾启斌先生，董事长，代理总经理，经济学博士。历任华东师范大学国际金融系讲师、君安证券有限公司万航渡路营业部经理、资产管理公司研究部经理、香港公司研究策划部经理、研究发展中心主任、经纪管理部总经理、债券部总经理、副总裁，国泰君安证券股份有限公司副总裁。现任国泰君安证

券股份有限公司执行董事、党委委员；国联安基金管理有限公司董事长，并代为履行总经理职责。

(2) 周浩先生，督察长，法学硕士。曾先后任职于中国证券监督管理委员会和上海航运产业基金管理有限公司。2012年2月加盟国联安基金管理有限公司，现担任国联安基金管理有限公司督察长。

(3) 李柯女士，副总经理，经济学学士。历任中国建设银行上海分行国际业务部、上海联合财务有限公司资金财务部副经理、经理、营运负责人兼内部审计师、公司副总经理、国联安基金管理有限公司财务总监、总经理助理，现担任国联安基金管理有限公司副总经理。

(4) 魏东先生，副总经理，经济学硕士。曾任职于平安证券有限责任公司和国信证券股份有限公司；2003年1月加盟华宝兴业基金管理有限公司，先后担任交易部总经理、华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金基金经理和华宝兴业先进成长股票型证券投资基金基金经理、投资副总监及国内投资部总经理职务。2009年6月加入国联安基金管理有限公司，先后担任总经理助理、投资总监的职务。2009年9月起，担任国联安德盛精选股票证券投资基金的基金经理。2009年12月至2011年8月，兼任国联安主题驱动股票型证券投资基金的基金经理。2014年3月起，兼任国联安新精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。现担任国联安基金管理有限公司副总经理。

(5) 满黎先生，副总经理，研究生学历。曾任职于华安基金管理有限公司，先后担任上海分公司高级投资顾问、西安分公司总经理、华东业务总部总经理、北京总部高级董事总经理；2012年9月加盟国联安基金管理有限公司，担任市场总监。自2012年11月起，担任国联安基金管理有限公司副总经理。

#### 4、基金经理

黄志钢先生，硕士，先后在海通期货担任研究员、国元证券股份有限公司担任衍生品部高级经理。黄志钢先生于2008年10月加盟国联安基金管理有限公司，曾担任金融工程分析师。2010年11月起，担任上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理。2010年12月起，兼任国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理助理。2012年3月起，兼任本基金基金经理。2012年6月起至2013年7月，兼任



国联安双佳信用分级债券型证券投资基金基金经理。2013年8月起，兼任国联安中证医药100指数证券投资基金基金经理。

#### 5、投资决策委员会成员

投资决策委员会是公司基金投资的最高投资决策机构。投资决策委员会由公司总经理、主管投资的副总经理、投资组合管理部负责人、固定收益业务负责人、研究部负责人及高级基金经理1-2人（根据需要）组成。投资决策委员会成员为：

唐启斌（代为履行总经理职责）投委会主席

魏东（投资总监、副总经理）投委会执行主席

韦明亮（投资组合管理部总监）

冯俊（固定收益部负责人）

高级基金经理1-2人（根据需要）

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

### 三、基金托管人

#### 一、基金托管人情况

##### （一）基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：王洪章

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

联系人：田 青

联系电话：(010)6759 5096

中国建设银行拥有悠久的经营历史，其前身“中国人民建设银行”于1954年成立，1996年易名为“中国建设银行”。中国建设银行是中国四大商业银行之一。中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于2004年9月分立而成立，承继了原中国建设银行的商业银行业务及相关的资产和负债。中国建设银行(股票代码：939)于2005年10月27日在香港联合交易所主板上市，是中国四大商业银行中首家在海外公开上市的银行。2006年9月11日，中国建设银行又作为第一家H股公司晋身恒生指数。2007年9月25日中国建设银行A股在上海证券交易所上市并开始交易。A股发行后中国建设银行的已发行股份总数为：250,010,977,486股(包括240,417,319,880股H股及9,593,657,606股A股)。

2014年上半年，本集团实现利润总额1,695.16亿元，较上年同期增长9.23%；净利润1,309.70亿元，较上年同期增长9.17%。营业收入2,870.97亿元，较上年同期增长14.20%；其中，利息净收入增长12.59%，净利息收益率(NIM)2.80%；手续费及佣金净收入增长8.39%，在营业收入中的占比达20.96%。成本收入比24.17%，同比下降0.45个百分点。资本充足率与核心一级资本充足率分别为13.89%和11.21%，同业领先。

截至2014年6月末，本集团资产总额163,997.90亿元，较上年末增长6.75%，其中，客户贷款和垫款总额91,906.01亿元，增长6.99%；负债总额152,527.78亿元，较上年末增长6.75%，其中，客户存款总额129,569.56亿元，增长6.00%。

截至2014年6月末，中国建设银行公司机构客户326.89万户，较上年末增加20.35万户，增长6.64%；个人客户近3亿户，较上年末增加921万户，增长

3.17%；网上银行客户1.67亿户，较上年末增长9.23%，手机银行客户数1.31亿户，增长12.56%。

截至2014年6月末，中国建设银行境内营业机构总量14,707个，服务覆盖面进一步扩大；自助设备72,128台，较上年末增加3,115台。电子银行和自助渠道账务性交易量占比达86.55%，较上年末提高1.15个百分点。

2014年上半年，本集团各方面良好表现，得到市场与业界广泛认可，先后荣获国内外知名机构授予的40余个重要奖项。在英国《银行家》杂志2014年“世界银行1000强排名”中，以一级资本总额位列全球第2，较上年上升3位；在美国《福布斯》杂志2014年全球上市公司2000强排名中位列第2；在美国《财富》杂志世界500强排名第38位，较上年上升12位。

中国建设银行总行设投资托管业务部，下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII托管处、养老金托管处、清算处、核算处、监督稽核处等9个职能处室，在上海设有投资托管服务上海备份中心，共有员工240余人。自2007年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

## （二）主要人员情况

赵观甫，投资托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行郑州市分行、总行信贷部、总行信贷二部、行长办公室工作，并在中国建设银行河北省分行营业部、总行个人银行业务部、总行审计部担任领导职务，长期从事信贷业务、个人银行业务和内部审计等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

纪伟，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部，长期从事大客户的客户管理及服务工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张军红，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行总行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室，长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张力铮，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行建筑经济部、信贷二部、信贷部、信贷管理部、信贷经营部、公司业务部，并在总行集团客户部和中国建设银行北京市分行担任领导职务，长期从事信贷业务和集团客户业务等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行会计部，长期从事托管业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

### （三）基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至 2014 年 9 月末，中国建设银行已托管 389 只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行自 2009 年至今连续五年被国际权威杂志

《全球托管人》评为“中国最佳托管银行”；获和讯网的中国“最佳资产托管银行”奖；境内权威经济媒体《每日经济观察》的“最佳基金托管银行”奖；中央国债登记结算有限责任公司的“优秀托管机构”奖。

## 二、基金托管人的内部控制制度

### （一）内部控制目标

作为基金托管人，中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和本行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金财产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

### （二）内部控制组织结构

中国建设银行设有风险与内控管理委员会，负责全行风险管理与内部控制工作，对托管业务风险控制工作进行检查指导。投资托管业务部专门设置了监督稽核处，配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，具有独立行使监督稽核工作职权和能力。

### （三）内部控制制度及措施

投资托管业务部具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理严格实行复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

## 三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

### （一）监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运作。利用自行开发的“托管业务综合系统——基金监督子系统”，严格按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督，并定期编写基金投资运作监督报告，报送中国证监会。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

### （二）监督流程

1.每工作日按时通过基金监督子系统，对各基金投资运作比例控制指标进行例行监控，发现投资比例超标等异常情况，向基金管理人发出书面通知，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，并及时报告中国证监会。

2.收到基金管理人的划款指令后，对涉及各基金的投资范围、投资对象及交易对手等内容进行合法合规性监督。

3.根据基金投资运作监督情况，定期编写基金投资运作监督报告，对各基金投资运作的合法合规性、投资独立性和风格显著性等方面进行评价，报送中国证监会。

4.通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易，电话或书面要求基金管理人进行解释或举证，并及时报告中国证监会。

## 四、相关服务机构

### （一）基金份额销售机构

#### 1. 场外销售机构

（1）直销机构：

国联安基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦9楼

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦9楼

法定代表人：唐启斌

联系人：茅斐

客户服务电话：400-700-0365（免长途话费）、021-38784766

网址：[www.vip-funds.com](http://www.vip-funds.com)或[www.gtja-allianz.com](http://www.gtja-allianz.com)

（2）代销机构：

1) 名称：中国工商银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街55号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街55号

法定代表人：姜建清

电话：010-66105662

联系人：查樱

客户服务电话：95588

网址：[www.icbc.com.cn](http://www.icbc.com.cn)

2) 名称：中国建设银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街25号

办公地址：北京市西城区金融大街25号

法定代表人：王洪章

电话：010-67596084

联系人：王琳

客户服务电话：95533

网址：[www.ccb.com](http://www.ccb.com)

3) 名称：上海浦东发展银行股份有限公司

住所：上海中山东一路12号

办公地址：上海中山东一路12号

法定代表人：吉晓辉

电话：021-61616206

联系人：虞谷云

客户服务电话：95528

网址：[www.spdb.com.cn](http://www.spdb.com.cn)

4) 名称：宁波银行股份有限公司

住所：浙江省宁波市鄞州区宁南南路700号

办公地址：浙江省宁波市鄞州区宁南南路700号

法定代表人：陆华裕

电话：0574-87011947

联系人：朱海亚

客户服务电话：96528或962528（上海）

网址：[www.nbcb.com.cn](http://www.nbcb.com.cn)

5) 名称：国泰君安证券股份有限公司

住所：上海市浦东新区商城路618号

办公地址：上海市银城中路168号上海银行大厦29楼

法定代表人：万建华

电话：021-38676161

联系人：芮敏琪

客户服务电话：95521

网址：[www.gtja.com](http://www.gtja.com)

6) 名称：安信证券股份有限公司

住所：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元

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

电话：0755-82558038

联系人：郑向溢

客户服务电话：400-8001-001

网址：[www.essence.com.cn](http://www.essence.com.cn)

7) 名称：广发证券股份有限公司

住所：广东省广州市天河北路183号大都会广场43楼

办公地址：广州市天河北路183号大都会广场36、38、41、42楼



法定代表人：孙树明  
电话：0755-82558305  
联系人：黄岚  
客户服务电话：95575  
网址：www.gf.com.cn

8) 名称：山西证券股份有限公司  
住所：山西省太原市府西街69号山西国贸中心东塔楼29层  
办公地址：山西省太原市府西街69号山西国贸中心东塔楼29层  
法定代表人：侯巍  
电话：0351-8686602  
联系人：孟婉婷  
客户服务电话：400-6661-618  
网址：www.i618.com.cn

9) 名称：中信建投证券股份有限公司  
住所：北京市朝阳区安立路66号4号楼  
办公地址：北京市朝阳区门内大街188号  
法定代表人：王常青  
电话：010-85130577  
联系人：魏明  
客户服务电话：400-8888-108  
网址：www.csc108.com

10) 名称：新时代证券有限责任公司  
住所：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号西海国际中心1号楼15层  
法定代表人：刘汝军  
电话：010-83561149  
联系人：孙恺  
客户服务电话：400-6989-898  
网址：www.xsdzq.cn

11) 名称：东方证券股份有限公司

住所：上海市黄浦区中山南路318号东方国际金融广场21-29层  
办公地址：上海市黄浦区中山南路318号东方国际金融广场21-29层  
法定代表人：潘鑫军  
电话：021-63325888-3108  
联系人：吴宇  
客户服务电话：95503  
网址：www.dfzq.com.cn

12) 名称：华泰证券股份有限公司  
住所：南京市中山东路90号华泰证券大厦  
办公地址：南京市中山东路90号华泰证券大厦  
法定代表人：吴万善  
电话：025-84579763  
联系人：万鸣  
客户服务电话：95597  
网址：www.htsc.com.cn

13) 名称：光大证券股份有限公司  
住所：上海市静安区新闸路1508号  
办公地址：上海静安区新闸路1508号  
法定代表人：薛峰  
电话：021-22169089  
联系人：刘晨  
客户服务电话：95525  
网址：www.ebscn.com

14) 名称：海通证券股份有限公司  
住所：上海市广东路689号海通证券大厦  
办公地址：上海市广东路689号海通证券大厦  
法定代表人：王开国  
电话：021-23219275  
联系人：李笑鸣  
客户服务电话：95553  
网址：www.htsec.com.cn

15) 名称：中信证券股份有限公司

住所：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：广东省深圳市福田区中心三路8号中信证券大厦；北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦

法定代表人：王东明

电话：010-85130579

联系人：张于爱

客户服务电话：95548

网址：[www.cs.ecitic.com](http://www.cs.ecitic.com)

16) 名称：中国中投证券有限责任公司

住所：深圳福田区益田路6003号荣超商务中心A座18-21层

办公地址：深圳福田区益田路6003号荣超商务中心A座18-21层

法定代表人：龙增来

电话：0755-82023442

联系人：刘毅

客户服务电话：400-6008-008或95532

网址：[www.cjis.cn](http://www.cjis.cn)

17) 名称：爱建证券有限责任公司

住所：上海市世纪大道1600号32楼

办公地址：上海市世纪大道1600号32楼

法定代表人：郭林

电话：62171984

联系人：陈敏

客户服务电话：021-63340678

网址：[www.ajzq.com](http://www.ajzq.com)

18) 名称：国信证券股份有限公司

住所：深圳市红岭中路1012号国信证券大厦

办公地址：深圳市红岭中路1012号国信证券大厦

法定代表人：何如

电话：0755-82133066

联系人：李颖

客户服务电话：95536

网址：[www.guosen.com.cn](http://www.guosen.com.cn)

19) 名称：华宝证券有限责任公司

住所：上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心57

办公地址：上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心57层

法定代表人：陈林

电话：021-68778081

联系人：刘闻川

客户服务电话：400-8209-898

网址：[www.cnhbstock.com](http://www.cnhbstock.com)

20) 名称：信达证券股份有限公司

住所：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

法定代表人：高冠江

电话：010-88656100

联系人：唐静

客户服务电话：400-8008-899

网址：[www.cindasc.com](http://www.cindasc.com)

21) 名称：中国银河证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街35号2-6层

办公地址：北京市西城区金融大街35号2-6层

法定代表人：陈有安

电话：010-66568047

联系人：田巍

客户服务电话：400-8888-888

网址：[www.chinastock.com.cn](http://www.chinastock.com.cn)

22) 名称：招商证券股份有限公司

住所：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层

法定代表人：宫少林

电话：0755-82943079

联系人：吴少彬

客户服务电话：95565或400-8888-111

网址：[www.newone.com.cn](http://www.newone.com.cn)

23) 名称：平安银行股份有限公司

住所：深圳市罗湖区深南东路5047号

办公地址：深圳市罗湖区深南东路5047号

法定代表人：马明哲

电话：0755-22197874

联系人：蔡宇洲

客户服务电话：95511

网址：[www.bank.pingan.com](http://www.bank.pingan.com)

24) 名称：齐鲁证券有限公司

住所：山东省济南市经七路86号

办公地址：山东省济南市经七路86号

法定代表人：李玮

电话：0531-68889157

联系人：王霖

客户服务电话：95538

网址：[www.qlzq.com.cn](http://www.qlzq.com.cn)

25) 名称：东海证券有限责任公司

住所：江苏省常州市延陵西路23号投资广场18-19楼

办公地址：上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦

法定代表人：朱科敏

电话：021-50586660-8644

联系人：霍晓飞

客户服务电话：95531

网址：[www.longone.com.cn](http://www.longone.com.cn)

26) 名称：华福证券有限责任公司

住所：福州五四路新天地大厦7至10层  
办公地址：福州五四路新天地大厦7至10层  
法定代表人：黄金琳  
电话：0591-87383623  
联系人：张腾  
客户服务电话：400-8896-326  
网址：www.gfhfzq.com.cn

27) 名称：华龙证券有限责任公司  
住所：甘肃省兰州市东岗西路638号兰州财富中心21楼  
办公地址：甘肃省兰州市东岗西路638号兰州财富中心21楼  
法定代表人：李晓安  
电话：0931-4890100  
联系人：李昕田  
客户服务电话：400-6898-888  
网址：www.hlzqgs.com

28) 名称：国金证券股份有限公司  
住所：成都市东城根上街95号成证大厦16楼  
办公地址：成都市东城根上街95号成证大厦16楼  
法定代表人：冉云  
电话：028-86690126  
联系人：金喆  
客户服务电话：400-6600-109  
网址：www.gjzq.com.cn

29) 名称：平安证券有限责任公司  
住所：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8层  
办公地址：深圳市福田区金田路4036号荣超大厦16-20楼  
法定代表人：杨宇翔  
电话：0755-22626391  
联系人：郑舒丽  
客户服务电话：95511  
网址 www.stock.pingan.com

30) 名称：中航证券有限公司

住所：江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号南昌国际金融大厦A栋41层

办公地址：江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号南昌国际金融大厦A栋41层

法定代表人：许雄斌

电话：0791-6768681

联系人：戴蕾

客户服务电话：400-8866-567

网址：[www.scstock.com](http://www.scstock.com)

31) 名称：东北证券股份有限公司

住所：长春市人民大街1138号

办公地址：长春市人民大街1138号

法定代表人：杨树财

电话：0431-85096517

联系人：安岩岩

客户服务电话：400-6000-686

网址：[www.nesc.cn](http://www.nesc.cn)

32) 名称：长江证券股份有限公司

住所：武汉市新华路特8号长江证券大厦

办公地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦

法定代表人：杨泽柱

电话：027-65799999

联系人：李良

客户服务电话：95579

网址：[www.95579.com](http://www.95579.com)

33) 名称：华融证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街8号

办公地址：北京市西城区金融大街8号

法定代表人：祝献忠

电话：010-58568118

联系人：林长华

客户服务电话：400-898-9999

网址：www.hrsec.com.cn

34) 名称：中信万通证券有限责任公司

住所：青岛市崂山区深圳路222号1号楼2001

办公地址：青岛市崂山区深圳路222号1号楼2001

法定代表人：杨宝林

电话：0532-85022326

联系人：吴忠超

客户服务电话：95548

网址：www.zxwt.com.cn

35) 名称：天风证券股份有限公司

住所：湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦四楼

办公地址：湖北省武汉市武昌区中南路99号保利广场A座37楼

法定代表人：余磊

电话：027-87618882

联系人：翟璟

客户服务电话：400-8005-000

网址：www.tfzq.com

36) 名称：江海证券有限公司

住所：哈尔滨市香坊区赣水路56号

办公地址：哈尔滨市香坊区赣水路56号

法定代表人：孙名扬

电话：0451-85863696

联系人：刘爽

客户服务电话：400-6662-288

网址：www.jhzq.com.cn

37) 名称：中信证券（浙江）有限责任公司

住所：浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦19层、20层

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦19层、20层

法定代表人：沈强



电话：0571-86078823

联系人：周妍

客户服务电话：95548

网址：www.bigsun.com.cn

38) 名称：东莞银行股份有限公司

住所：东莞市莞城区体育路21号

办公地址：东莞市莞城区体育路21号

法定代表人：廖玉林

电话：0769-2211811

联系人：张技辉

客户服务电话：400-1196-228

网址：www.dongguanbank.cn

39) 名称：西南证券股份有限公司

住所：重庆市江北区桥北苑8号

办公地址：重庆市江北区桥北苑8号

法定代表人：余维佳

电话：023-63786464

联系人：陈诚

客户服务电话：400-8096-096

网址：www.swsc.com.cn

40) 名称：东吴证券股份有限公司

住所：苏州市工业园区星阳街5号

办公地址：苏州市工业园区星阳街5号

法定代表人：范力

电话：0512-65581136

联系人：方晓丹

客户服务电话：400-8601-555

网址：www.dwzq.com.cn

41) 名称：红塔证券股份有限公司

住所：云南昆明市北京路155号附1号红塔大厦9楼

办公地址：云南昆明市北京路155号附1号红塔大厦9楼

法定代表人：况雨林

电话：0871-3577942

联系人：刘晓明

客户服务电话：400-871-8880

网址：[www.hongtastock.com](http://www.hongtastock.com)

42) 名称：西部证券股份有限公司

住所：陕西省西安市东大街232号陕西信托大厦16-17层

办公地址：陕西省西安市东大街232号陕西信托大厦16-17层

法定代表人：刘建武

电话：029-87406654

联系人：刘莹

客户服务电话：95582

网址：[www.westsecu.com.cn](http://www.westsecu.com.cn)

43) 名称：国元证券股份有限公司

住所：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：蔡咏

电话：0551-2257034

联系人：李伟卫

客户服务电话：95578

网址：[www.gyzq.com.cn](http://www.gyzq.com.cn)

44) 名称：交通银行股份有限公司

住所：上海市银城中路188号

办公地址：上海市银城中路188号

法定代表人：牛锡明

电话：021-58781234

联系人：曹榕

客户服务电话：95559

网址：[www.bankcomm.com](http://www.bankcomm.com)

45) 名称：中山证券有限责任公司

住所：深圳市福田区益田路6009号新世界中心29层

办公地址：深圳市华侨城深南大道9010号

法定代表人：黄扬录

电话：0755-82570586

联系人：罗艺琳

客户服务电话：400-1022-011

网址：[www.zszq.com](http://www.zszq.com)

46) 名称：天相投资顾问有限公司

住所：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701室

办公地址：北京市西城区新街口外大街28号C座5层

法定代表人：林义相

电话：010-66045608

联系人：尹伶

客户服务电话：010-66045678

网址：[www.txsec.com](http://www.txsec.com)

47) 名称：杭州数米基金销售有限公司

住所：浙江省杭州市滨江区江南大道3588号12层

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道3588号12层

法定代表人：陈柏青

电话：0571-28829790

联系人：周嫵旻

客户服务电话：400-0766-123

网址：[www.fund123.cn](http://www.fund123.cn)

48) 名称：上海好买基金销售有限公司

住所：上海市浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903—906室

办公地址：上海市浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903-906室

法定代表人：杨文斌

电话：021-58870011

联系人：王玉山

客户服务电话：400-7009-665

网址：[www.ehowbuy.com](http://www.ehowbuy.com)

49) 名称：北京展恒基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区华严北里2号民建大厦6层

办公地址：北京市朝阳区华严北里2号民建大厦6层

法定代表人：闫振杰

电话：010-62020088

联系人：宋丽冉

客户服务电话：400-888-6661

网址：[www.myfund.com](http://www.myfund.com)

50) 名称：上海天天基金销售有限公司

住所：上海市徐汇区龙田路195号3C-9楼

办公地址：上海市徐汇区龙田路195号3C-9楼

法定代表人：其实

电话：021-54509998

联系人：练兰兰

客户服务电话：400-181-8188

网址：[www.1234567.com.cn](http://www.1234567.com.cn)

51) 名称：深圳众禄基金销售有限公司

住所：广东省深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼

办公地址：广东省深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼

法定代表人：薛峰

电话：0755-33227950

联系人：童彩平

客户服务电话：400-678-8887

网址：[www.zlfund.cn](http://www.zlfund.cn)

52) 名称：诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

住所：上海浦东新区银城中路68号时代金融中心8楼801室

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴银城中路68号时代金融中心8楼801

法定代表人：王静波

电话：021-38602377

联系人：方成

客户服务电话：400—821—5399

网址：[www.noah-fund.com](http://www.noah-fund.com)

53) 名称：和讯信息科技有限公司

注册地址：北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层

办公地址：上海市浦东新区东方路18号保利广场E座18楼

法定代表人：王莉

电话：021-68419822

联系人：周轶

客户服务电话：400-920-0022

网址：[licaike.hexun.com](http://licaike.hexun.com)

54) 名称：万银财富（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼3201内

办公地址：北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼3201内

法定代表人：王斐

电话：010-59393923

联系人：廉亮

客户服务电话：400-081-6655

网址：[www.wy-fund.com](http://www.wy-fund.com)

55) 名称：上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路526号2幢220室

办公地址：上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层

法定代表人：张跃伟

电话：021-20691835

联系人：单丙焱

客户服务电话：400-089-1289

网址：[www.erichfund.com](http://www.erichfund.com)

基金管理人可以根据相关法律法规要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。

## 2. 场内销售机构

本基金的场内销售机构为基金管理人直销机构和具有基金代销资格的深圳证券交易所会员单位，具体销售机构名单详见深圳证券交易所网站。

## （二）注册登记机构

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

办公地址：北京西城区金融大街27号投资广场23层

法定代表人：金颖

电话：010-58598835

传真：010-58598907

联系人：任瑞新

## （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：韩炯

联系电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：安冬

经办律师：吕红、安冬

## （四）审计基金资产的会计师事务所

名称：毕马威华振会计师事务所

住所：上海市静安区南京西路1266号恒隆广场50楼

办公地址：上海市静安区南京西路1266号恒隆广场50楼

负责人：蔡廷基

联系人：王国蓓

联系电话：021-22122888

传真：021-62881889

经办注册会计师：王国蓓、钱晓英

## 五、基金的名称

本基金在分级运作期内名称为国联安双力中小板综指分级证券投资基金；  
本基金在分级运作期满后名称为国联安双力中小板综指证券投资基金（LOF）。

## 六、基金的类型

契约型开放式

本基金的分级运作期指双力中小板份额、双力 A 份额、双力 B 份额的共同运作期，具体为自基金合同生效之日起至三年期末对应日（即分级运作期到期日），如该对应日为非工作日，则顺延到下一个工作日。如果分级运作期到期日前十五个工作日内本基金触发不定期折算条件，则本基金将提前依据基金合同约定转换为国联安双力中小板综指证券投资基金（LOF），基金管理人将决定触发不定期折算条件之日后三个工作日内的某工作日为分级运作期到期日，具体的分级运作期到期日见基金管理人届时发布的公告。依据基金合同的约定，基金在分级运作期到期自动转换为国联安双力中小板综指证券投资基金（LOF），并将继续在深圳证券交易所上市交易。

## 七、基金的投资目标

本基金进行被动式指数化投资，通过严谨的数量化管理和投资纪律约束，力争保持基金净值收益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 0.35%，年跟踪误差不超过 4%，为投资者提供一个投资中小板综指的有效工具，从而分享中国经济中长期增长的稳定收益。

## 八、基金的投资方向

本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股及其备选成份股、新股（包含中小板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、权证、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具（但须

符合中国证监会的相关规定）。本基金所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）占基金资产的比例为 85%—100%，其中投资于股票的资产不低于基金资产的 85%，投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%；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，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券；权证以及其他金融工具的投资比例符合法律法规和中国证监会的规定。

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

本基金管理人自《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上述相关规定。

## 九、基金的投资策略及投资程序

### （一）基金的投资策略

本基金采用市值优先兼顾行业分层的抽样复制的方法来复制标的指数。选择数量合理的成份股，构建目标组合，实现稳定地跟踪目标指数的目的。

#### 1、目标组合的构建

##### （1）股票的筛选

中小板综合指数成份股包括在深圳中小板上市交易的所有股票，本基金在抽样复制时，将首先从样本中剔除市值极小及流动性极差的股票。

##### （2）初步确定目标组合成份股和权重

采取市值优先抽样法，对筛选出来的股票，按股票的流通市值从大到小排序，初步确定目标组合的成份股和权重。

##### （3）目标组合成份股及权重的调整

根据初步确定的目标组合成份股及权重，按照行业分类，得到目标组合的行业权重。将目标组合的行业权重与中小板综合指数的行业权重进行比较，如果某个行业两者出现较大偏离，通过调整组合成份股及权重并优化，确定最终的目标组合的成份股及权重，使得目标组合的行业权重与中小板综合指数对应行业的权重大致吻合。



为了能够更好的跟踪中小板综合指数，如果今后由于基准指数成份股结构的变化，其他抽样复制方法将更适合对基准指数的跟踪，本基金将做相应的变更。对于抽样复制方法的变更，无需召开基金份额持有人大会，但本基金管理人需在方法变更前2个工作日内在至少一种指定媒体上刊登公告，并阐明变更抽样复制方法的原因。

## 2、目标组合的调整

### （1）组合调整原则

本基金为指数型基金,基金所构建的指数化投资组合将根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。同时,本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况、新股增发因素等变化,对基金投资组合进行适时调整,以保证基金净值增长率与标的指数间的高度正相关和跟踪误差最小化。

### （2）组合调整方法

#### 1) 组合定期调整

每季度末根据上述抽样复制方法和组合调整原则调整股票组合及个股配置比例。

#### 2) 组合不定期调整

对投资组合进行动态跟踪，当行业的权重与基准产生较大偏差时，对成份股进行相应调整，以保证跟踪误差的最小化。

根据中小板综指的编制规则，因指数成份股新股发行、增发、送配等股权变动需要进行成份股权重调整，分析上述事件对组合跟踪误差的影响，并制定合理的组合调整策略。

## 3、股指期货的投资

为有效控制指数的跟踪误差，本基金在注重风险管理的前提下，以套期保值为目的，适度运用股指期货。本基金利用股指期货流动性好、交易成本低和杠杆操作等特点，通过股指期货就本基金投资组合对标的指数的拟合效果进行及时、有效地调整，并提高投资组合的运作效率等。例如在本基金的建仓期或发生大额净申购时，可运用股指期货有效减少基金组合资产配置与跟踪标之间的差距；在本基金发生大额净赎回时，可运用股指期货控制基金较大幅度减仓时可能存在的冲击成本，从而确保投资组合对指数跟踪的效果。

## （二）投资的限制

1、本基金在投资策略上兼顾投资原则以及开放式基金的固有特点，通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。基金的投资组合将遵循以下限制：

- （1）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%；
- （2）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%；
- （3）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%；
- （4）本基金投资于股票的资产不低于基金资产的 85%，投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%；
- （5）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，不得超过基金资产净值的 10%；
- （6）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%；
- （7）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%；
- （8）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%；
- （9）本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，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；
- （10）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；
- （11）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%；
- （12）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，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券；

（13）本基金投资流通受限证券，基金管理人应事先根据中国证监会相关规定，与基金托管人在本基金托管协议中明确基金投资流通受限证券的比例，根据比例进行投资。基金管理人应制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险；

（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，不得超过基金资产净值的 10%；

（15）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；

（16）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基金持有的股票总市值的 20%；

本基金管理人应当按照中国金融期货交易所要求的内容、格式与时限向交易所报告所交易和持有的卖出期货合约情况、交易目的及对应的证券资产情况等；

（17）本基金所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）占基金资产的比例为 85%—100%；

（18）本基金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%；

（19）法律法规、基金合同规定的其他比例限制。

本基金在开始进行股指期货投资之前，应与基金托管人就股指期货开户、清算、估值、交收等事宜另行具体协商。

如果法律法规对本基金合同约定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，则本基金投资不再受相关限制。

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 6 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。

## 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：

- (1) 承销证券；
- (2) 向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- (6) 买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；
- (7) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (8) 依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动；
- (9) 法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

## 十、标的指数与基金业绩比较基准

### 1、标的指数

本基金股票资产的标的指数为中小板综合指数。

中小板综合指数于 2005 年 12 月 1 日正式发布，覆盖了深圳证券交易所中小企业板上市的全部股票，以综合反映深圳证券交易所中小企业公司的整体状况。在中国经济结构转型，工业化不断推进背景下，中小企业是整个经济体中最为活跃和创新的部分，中小板综合指数是其良好的刻度和反映，具有较好的市场认知程度和接受度。

### 2、业绩比较基准

本基金业绩比较基准为： $95\% \times \text{中小板综指收益率} + 5\% \times \text{活期存款利率(税后)}$ 。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的股票指数时，本基金可以在与本基金托管人协商同意后变更业绩比较基准并及时公告。

本基金由于上述原因变更标的指数和业绩比较基准，基金管理人应于变更前在中国证监会指定的媒体上公告。

## 十一、基金的风险收益特征

本基金为被动投资型指数基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益均高于货币市场基金和债券型基金。

## 十二、基金的投资组合报告

本基金管理人的董事会及董事保证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。

本基金托管人——中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至2014年12月31日，本报告财务资料未经审计师审计。

### 1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	25,615,228.54	92.46
	其中：股票	25,615,228.54	92.46
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-

	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	1,220,850.88	4.41
7	其他资产	868,935.09	3.14
8	合计	27,705,014.51	100.00

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

## 2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 2.1 指数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、渔业	428,655.75	1.60
B	采矿业	263,101.26	0.98
C	制造业	18,811,965.68	70.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	247,254.77	0.92
E	建筑业	1,362,166.33	5.08
F	批发和零售业	1,146,065.78	4.28
G	交通运输、仓储和邮政业	155,952.95	0.58
H	住宿和餐饮业	85,752.75	0.32
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,253,846.44	4.68

J	金融业	799,345.09	2.98
K	房地产业	610,857.63	2.28
L	租赁和商务服务业	346,707.43	1.29
M	科学研究和技术服务业	45,106.60	0.17
N	水利、环境和公共设施 管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他 服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	58,450.08	0.22
S	综合	-	-
	合计	25,615,228.54	95.56

## 2.2 积极投资按行业分类的股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有积极投资股票。

## 3 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

### 3.1 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	002415	海康威视	23,479	525,225.23	1.96
2	002304	洋河股份	6,553	518,014.65	1.93
3	002024	苏宁云商	36,822	331,398.00	1.24
4	002142	宁波银行	20,353	320,152.69	1.19
5	002252	上海莱士	6,938	312,973.18	1.17

6	002500	山西证券	18,546	296,736.00	1.11
7	002202	金风科技	16,477	232,820.01	0.87
8	002081	金螳螂	12,776	214,636.80	0.80
9	002450	康得新	7,270	210,611.90	0.79
10	002146	荣盛发展	12,480	198,057.60	0.74

### 3.2 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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

### 4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

### 5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。



## 9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货，没有相关投资政策。

## 10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 10.1 本基金投资国债期货的投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货，没有相关投资政策。

### 10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 10.3 本基金投资国债期货的投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货，没有相关投资评价。

## 11 投资组合报告附注

11.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

11.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	2,387.84
2	应收证券清算款	832,405.72
3	应收股利	-
4	应收利息	403.24
5	应收申购款	33,738.29
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	868,935.09

### 11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前五名股票中不存在流通受限情况。

### 十三、基金的业绩

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资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩不代表未来表现。投资有风险，投资人在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

	基金份额净值增长率 ①	同期业绩比较基准收益率③	①-③	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率标准差 ④	②-④
2012-03-23至2012-12-31	-9.50%	-11.46%	1.96%	1.19%	1.30%	-0.11%
2013-01-01至2013-12-31	20.30%	25.05%	-4.75%	1.41%	1.41%	0.00%
2014-01-01至2014-12-31	24.74%	24.58%	0.16%	1.21%	1.20%	0.01%
2012-03-23至2014-12-31	35.81%	37.93%	-2.12%	1.28%	1.31%	-0.03%

### 十四、基金的费用与税收

#### （一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；

- 3、基金财产划拨支付的银行费用；
- 4、基金合同生效后的基金信息披露费用；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
- 7、基金的证券交易费用；
- 8、基金的开户费用、账户维护费用；
- 9、在中国证监会规定允许的前提下，本基金可以从基金财产中计提销售服务费，具体计提方法、计提标准在招募说明书或相关公告中载明；
- 10、基金上市费及年费；
- 11、标的指数使用许可费；
- 12、依法可以在基金财产中列支的其他费用。

**（二）上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。**

### **（三）基金费用计提方法、计提标准和支付方式**

#### **1、基金管理人的管理费**

在分级运作期内，基金管理费按前一日基金资产净值的 1%年费率计提。在分级运作期到期后，基金的基金管理费调整为按前一日基金资产净值的 0.75%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 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、基金托管人的托管费**

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：

$$H=E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

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。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 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、基金合同生效后的指数使用许可费

指数使用许可费的计费时间从本基金合同生效日起开始计算。指数使用许可费每日计算，逐日累计，按季支付，收取标准和方法为：

$$H=E \times 0.02\% / \text{当年天数}$$

H=每日应付的指数使用许可费；E=前一日基金的资产净值

基金合同生效之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。自基金合同生效之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。

4、除管理费、托管费和指数使用许可费之外的基金费用，由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

### （四）不列入基金费用的项目

基金管理人和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不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

（五）基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施日 2 日前在指定媒体上刊登公告。

### （六）基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

## 十五、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《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》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求，对本基金管理人于2014年11月6日刊登的本基金原招募说明书进行了更新，主要更新的内容如下：

- 1、更新了“第三部分 基金管理人”的内容。
- 2、更新了“第四部分 基金托管人”的内容。
- 3、更新了“第五部分 相关服务机构”的内容。
- 4、更新了“第十三部分 基金的投资”的内容。
- 5、更新了“第十四部分 基金的业绩”的内容。
- 6、更新了“第二十八部分 其他应披露事项”的内容。

国联安基金管理有限公司

二〇一五年五月六日