

# 中小企业板交易型开放式指数基金招募说明书(更新)摘要

## 2016 年第 2 号

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

### 重要提示

中小企业板交易型开放式指数基金（以下简称“本基金”）经中国证监会 2006 年 5 月 11 日证监基金字[2006]92 号文核准募集。本基金基金合同于 2006 年 6 月 8 日正式生效。

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，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者根据所持有的基金份额享受基金收益，同时承担相应的投资风险。本基金投资中的风险包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券市场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，由于基金份额持有人连续大量赎回基金产生的流动性风险，本基金的特定风险等。本基金属股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，采用完全复制策略，跟踪反映中小企业板市场的标的指数，是股票基金中风险较高的产品。投资有风险，投资人申购基金时，应认真阅读本招募说明书，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，谨慎做出投资决策。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本摘要根据本基金的基金合同和招募说明书编写，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。

本招募说明书所载内容截止日为 2016 年 12 月 8 日，有关财务数据和净值表现数据截止日为 2016 年 9 月 30 日。（本招募说明书中的财务资料未经审计）

## 一、基金管理人

### （一）基金管理人概况

名称：华夏基金管理有限公司

住所：北京市顺义区天竺空港工业区 A 区

办公地址：北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层

成立日期：1998 年 4 月 9 日

法定代表人：杨明辉

联系人：张静

客户服务电话：400-818-6666

传真：010-63136700

华夏基金管理有限公司注册资本为 23800 万元，公司股权结构如下：

持股单位

持股占总股本比例

中信证券股份有限公司

62.2%

山东省农村经济开发投资公司

10%

POWER CORPORATION OF CANADA

10%

青岛海鹏科技投资有限公司

10%

南方工业资产管理有限责任公司

7.8%

合计

100%

## （二）主要人员情况

### 1、基金管理人董事、监事、经理及其他高级管理人员基本情况

杨明辉先生：董事长、党委书记，中信证券股份有限公司执行董事、总经理，硕士，高级经济师。曾任中信证券公司董事、襄理、副总经理，中信控股公司董事、常务副总裁，中国建银投资证券有限责任公司党委副书记、执行董事、总裁，兼任信诚基金管理有限公司董事长、证通股份有限公司董事等。

杨一夫先生：董事，硕士。现任鲍尔太平有限公司总裁，负责总部加拿大鲍尔公司在中国的投资活动，兼任三川能源开发有限公司董事、中国投资协会常务理事。曾任国际金融公司（世界银行组织成员）驻中国的首席代表等。

胡祖六先生：董事，博士，教授。现任春华资本集团主席。曾任国际货币基金组织高级经济学家，达沃斯世界经济论坛首席经济学家，高盛集团大中华区主席、合伙人、董事总经理。

中小企业板交易型开放式指数基金招募说明书（更新）摘要

3

沈强先生：董事，硕士，高级经济师。现任中信证券股份有限公司经纪业务发展与管理委员会主任。曾任浙江省国际信托投资公司证券管理总部总经理，金通证券股份有限公司总经理，中信证券（浙江）有限责任公司总经理、党委书记、执行董事，中信证券股份有限公司经纪业务发展与管理委员会副主任等。

葛小波先生：董事，硕士。中信证券党委委员、董事总经理。葛先生于2007年荣获全国金融五一劳动奖章。

汤晓东先生：董事、总经理，硕士。曾任职于摩根大通、荷兰银行、苏

格兰皇家银行、中国证监会等。

朱武祥先生：独立董事，博士，教授。现任清华大学经济管理学院金融系教授、博士生导师，兼任北京建设（香港上市）、华夏幸福基业、中海油海洋工程、东兴证券、中兴通讯等五家上市公司独立董事。

贾建平先生：独立董事，大学本科，高级经济师。现已退休。兼任东莞银行独立董事。曾任职于北京工艺品进出口公司、美国纽约中国物产有限公司（外派工作），曾担任中国银行信托咨询公司副处长、处长，中国银行卢森堡公司副总经理，中国银行意大利代表处首席代表，中银集团投资管理公司副董事长、总经理，中国银行重组上市办公室、董事会秘书办公室、上市办公室总经理，中银基金管理有限公司董事长。

谢德仁先生：独立董事，博士，教授。现任清华大学经济管理学院会计学教授、博士生导师，兼任中华联合人寿保险股份有限公司、博彦科技股份有限公司（上市公司）、朗新科技股份有限公司独立董事，中国会计学会第八届理事会理事，中国会计学会财务成本分会第八届理事会副会长。

张霄岭先生：副总经理，博士。现兼任上海高级金融学院客座教授、清华大学五道口金融学院特聘教授。曾任中国技术进出口总公司项目经理、美国联邦储备委员会（华盛顿总部）经济学家、摩根士丹利（纽约总部）信用衍生品交易模型风险主管、中国银监会银行监管三部副主任等。

刘义先生：副总经理，硕士。现任华夏基金管理有限公司党委委员，兼任华夏资本管理有限公司执行董事、总经理。曾任中国人民银行总行计划资金司副主任科员、主任科员，中国农业发展银行总行信息电脑部信息综合处副处长（主持工作），华夏基金管理有限公司监事、党办主任、养老金业务总监等。

阳琨先生：副总经理、投资总监，硕士。现任华夏基金管理有限公司党委委员。曾任中国对外经济贸易信托投资有限公司财务部部门经理，宝盈基金管理有限公司基金经理助理，

中小企业板交易型开放式指数基金招募说明书（更新）摘要

益民基金管理有限公司投资部部门经理，华夏基金管理有限公司股票投资部副总经理等。

李一梅女士：副总经理，硕士。兼任上海华夏财富投资管理有限公司执行董事、总经理，证通股份有限公司董事。曾任基金营销部总经理、营销总监、市场总监等。

周璇女士：督察长，硕士。现任华夏基金管理有限公司纪委书记。曾任华夏基金管理有限公司总经理助理；曾任职于中国证监会、北京金融街建设开发公司。

李红源先生：监事长，硕士，研究员级高级工程师。现任南方工业资产管理有限责任公司总经理。曾任中国北方光学电子总公司信息部职员，中国兵器工业总公司教育局职员、主任科员、规划处副处长、计划处处长，中国兵器装备集团公司发展计划部副主任、经济运营部副主任、资本运营部巡视员兼副主任。

吕翔先生：监事，学士。现任中信证券股份有限公司投资管理部执行总经理。曾任国家劳动部综合计划与工资司副主任科员，中信证券股份有限公司人力资源管理部执行总经理。

张伟先生：监事，硕士，高级工程师。现任山东高速投资控股有限公司党委书记、副总经理，兼任山东渤海轮渡股份有限公司董事。曾任山东省济青公路工程建设指挥部办公室财务科职员，济青高速公路管理局经营财务处副主任科员，山东基建股份有限公司计划财务部经理，山东高速股份有限公司董事、党委委员、总会计师。

汪贵华女士：监事，博士。现任华夏基金管理有限公司董事总经理。曾任财政部科研所助理研究员、中关村证券股份有限公司计划资金部总经理、华夏基金管理有限公司财务总监等。

李彬女士：监事，硕士。现任华夏基金管理有限公司合规部总监。曾任中信证券股份有限公司基金管理部项目经理、中信基金管理有限责任公司监察稽核部高级副总裁、华夏基金管理有限公司法律监察部总监等。

宁晨新先生：监事，博士，高级编辑。现任华夏基金管理有限公司办公室总监、董事会秘书（兼）。曾任中国证券报社记者、编辑、办公室主

任、副总编辑，中国政法大学讲师。

## 2、本基金基金经理

方军先生，硕士。1999年7月加入华夏基金管理有限公司，曾任研究员、华夏成长证券投资基金基金经理助理、兴华证券投资基金基金经理助理、华夏回报证券投资基金基金经理助理、数量投资部副总经理等，现任数量投资部总监，上证50交易型开放式指数证券投资基金基金经理

（2004年12月30日起任职）、中小企业板交易型开放式指数基金基金经理（2006年6月8日起任职）、华夏沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2009年7月10日起任职）、华夏上证

50交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2015

中小企业板交易型开放式指数基金招募说明书（更新）摘要

5

年3月17日起任职）、华夏中证500交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2015年5月5日起任职）、华夏中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2015年5月5日起任职）。

徐猛先生，清华大学工学硕士。曾任财富证券助理研究员，原中关村证券研究员等。2006年2月加入华夏基金管理有限公司，曾任数量投资部基金经理助理、上证原材料交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理（2016年1月29日至2016年3月28日期间）等，现任数量投资部高级副总裁，上证金融地产交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理（2013年4月8日起任职）、华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2015年3月12日起任职）、华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2015年3月12日起任职）、恒生交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2015年12月21日起任职）、恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2015年12月21日起任职）、中小企业板交易型开放式指数基金基金经理（2016年12月1日起任职）、华夏上证50交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2016年12月1日起任职）。

历任基金经理：2011年2月22日至2012年2月29日期间，唐棕先生

任基金经理。

### 3、本公司量化投资决策委员会

主任：王路先生，华夏基金管理有限公司数量投资部执行总经理、首席量化投资官，基金经理。

成员：汤晓东先生，华夏基金管理有限公司董事、总经理。

张弘弢先生，华夏基金管理有限公司数量投资部董事总经理，基金经理。

方军先生，华夏基金管理有限公司数量投资部总监，基金经理。

杨志诚先生，华夏基金管理有限公司数量投资部总监。

4、上述人员之间不存在近亲属关系。

## 二、基金托管人

### （一）基金托管人基本情况

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

中小企业板交易型开放式指数基金招募说明书（更新）摘要

6

成立时间：2004 年 9 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：010-67595096

中国建设银行成立于 1954 年 10 月，是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行，总部设在北京。中国建设银行于 2005 年 10 月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码 939)，于 2007 年 9 月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码 601939)。

2015 年末，本集团资产总额 18.35 万亿元，较上年增长 9.59%；客户贷款和垫款总额 10.49 万亿元，增长 10.67%；客户存款总额 13.67 万亿元，增长 5.96%。净利润 2,289 亿元，增长 0.28%；营业收入 6,052 亿元，增长 6.09%，其中，利息净收入增长 4.65%，手续费及佣金净收入增长 4.62%。平均资产回报率 1.30%，加权平均净资产收益率 17.27%，成本收入比 26.98%，资本充足率 15.39%，主要财务指标领先同业。

物理与电子渠道协同发展。营业网点“三综合”建设取得新进展，综合性网点数量达 1.45 万个，综合营销团队 2.15 万个，综合柜员占比达到 88%。启动深圳等 8 家分行物理渠道全面转型创新试点，智慧网点、旗舰型、综合型和轻型网点建设有序推进。电子银行主渠道作用进一步凸显，电子银行和自助渠道账务性交易量占比达 95.58%，较上年提升 7.55 个百分点；同时推广账号支付、手机支付、跨行付、龙卡云支付、快捷付等五种在线支付方式，成功实现绝大多数主要快捷支付业务的全行集中处理。

转型业务快速增长。信用卡累计发卡量 8,074 万张，消费交易额 2.22 万亿元，多项核心指标继续保持同业领先。金融资产 1,000 万以上的私人银行客户数量增长 23.08%，客户金融资产总量增长 32.94%。非金融企业债务融资工具累计承销 5,316 亿元，承销额市场领先。资产托管业务规模 7.17 万亿元，增长 67.36%；托管证券投资基金数量和新增只数均为市场第一。人民币国际清算网络建设再获突破，继伦敦之后，再获任瑞士、智利人民币清算行资格；上海自贸区、新疆霍尔果斯特殊经济区主要业务指标居同业首位。

2015 年，本集团先后获得国内外各类荣誉总计 122 项，并独家荣获美国《环球金融》杂志“中国最佳银行”、香港《财资》杂志“中国最佳银行”及香港《企业财资》杂志“中国最佳银行”等大奖。本集团在英国《银行家》杂志 2015 年“世界银行品牌 1000 强”中，以一  
中小企业板交易型开放式指数基金招募说明书（更新）摘要



2000 强中位列第二。

中国建设银行总行设资产托管业务部，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、跨境托管运营处、监督稽核处等 10 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 220 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，资产托管业务部总经理，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。

张军红，资产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，资产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，资产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 2016 年一季度末，中国建设银行已托管 584 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 年至今连续六年被国际权威杂志《全球托管人》评为“中国最佳托管银行”。

中小企业板交易型开放式指数基金招募说明书（更新）摘要

8

### 三、相关服务机构

#### （一）销售机构

##### 1、场内申购、赎回代理机构

###### （1）国泰君安证券股份有限公司

住所：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：杨德红

电话：021-38676161

传真：021-38670161

联系人：芮敏祺

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

客户服务电话：95521

###### （2）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

客户服务电话：400-888-8108

传真：010-65182261

联系人：权唐

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

(3) 国信证券股份有限公司

住所：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号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 1012 号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：0755-82133952

联系人：周杨

网址：www.guosen.com.cn

客户服务电话：95536

中小企业板交易型开放式指数基金招募说明书（更新）摘要

9

(4) 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 40 层

法定代表人：宫少林

电话：0755-82943666

传真：0755-82943636

联系人：黄健

网址：www.newone.com.cn

客户服务电话：400-888-8111、95565

(5) 广发证券股份有限公司

住所：广州天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼（4301-4316 房）

办公地址：广州天河区天河北路 183-187 号大都会广场 5、18、19、

36、38、39、41、42、43、44 楼

法定代表人：孙树明

电话：020-87555888

传真：020-87555417

联系人：黄岚

网址：www.gf.com.cn

客户服务电话：95575 或致电各地营业网点

（6）中信证券股份有限公司

住所：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：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：010-60833722

传真：010-60833739

联系人：陈忠

网址：www.cs.ecitic.com

客户服务电话：95548

（7）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

中小企业板交易型开放式指数基金招募说明书（更新）摘要

10

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：010-66568430

传真：010-66568990

联系人：田薇

网址：www.chinastock.com.cn

客户服务电话：400-888-8888

（8）海通证券股份有限公司

住所：上海市淮海中路 98 号

办公地址：上海市黄浦区广东路 689 号 10 楼

法定代表人：王开国

电话：021-23219000

传真：021-63410456

联系人：金芸、李笑鸣

网址：www.htsec.com

客户服务电话：95553、400-888-8001

（9）申万宏源证券有限公司

住所：新疆乌鲁木齐市文艺路 233 号

办公地址：北京市西城区太平桥大街 19 号

法定代表人：李梅

客户服务电话：400-800-0562

传真：010-88085599

联系人：钱达琛

网址：www.hysec.com

（10）兴业证券股份有限公司

住所：福州市湖东路 268 号

办公地址：上海市浦东民生路 1199 弄五道口广场 1 号楼 21 层

法定代表人：兰荣

电话：021-38565785

传真：021-38565955

中小企业板交易型开放式指数基金招募说明书（更新）摘要

11

联系人：谢高得

网址：www.xyzq.com.cn

客户服务电话：95562

（11）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

传真：027-85481900

联系人：李良

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

客户服务电话: 95579、400-888-8999

(12) 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、28 层 A02 单元

法定代表人: 牛冠兴

电话: 0755-82558305

传真: 0755-82558355

联系人: 陈剑虹

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

客户服务电话: 400-800-1001

(13) 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: 0551-62257012

传真: 0551-62272100

联系人: 祝丽萍

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

客户服务电话: 95578

中小企业板交易型开放式指数基金招募说明书(更新)摘要

12

(14) 渤海证券股份有限公司

住所: 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

法定代表人: 王春峰

电话: 022-28451991

传真: 022-28451892

联系人: 蔡霆

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

客户服务电话: 400-651-5988

(15) 华泰证券股份有限公司

住所: 南京市江东中路 228 号

办公地址: 南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场、深圳市福田区

深南大道 4011 号港中旅大厦 18 楼

法定代表人: 周易

电话: 0755-82492193

传真: 0755-82492962 (深圳)

联系人: 庞晓芸

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

客户服务电话: 95597

(16) 中信证券(山东)有限责任公司

住所: 山东省青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001

办公地址: 山东省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

传真: 0532-85022605

联系人: 吴忠超

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

客户服务电话: 95548

(17) 东吴证券股份有限公司

住所: 苏州工业园区翠园路 181 号

中小企业板交易型开放式指数基金招募说明书(更新)摘要

13

办公地址: 苏州工业园区星阳街 5 号

法定代表人: 范力

电话: 0512-65581136

传真: 0512-65588021

联系人：方晓丹

网址：www.dwzq.com.cn

客户服务电话：0512-33396288

（18）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：尹旭航

电话：010-63081000

传真：010-63080978

联系人：唐静

网址：www.cindasc.com

客户服务电话：95321

（19）方正证券股份有限公司

住所：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层

办公地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层

法定代表人：雷杰

电话：0731-85832503

传真：0731-85832214

联系人：郭军瑞

网址：www.foundersc.com

客户服务电话：95571

（20）长城证券股份有限公司

住所：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层

办公地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层

法定代表人：黄耀华

电话：0755-83516089

中小企业板交易型开放式指数基金招募说明书（更新）摘要

14

传真：0755-83515567



联系人：李春芳

网址：www.cgws.com

客户服务电话：400-666-6888、0755-33680000

(21) 光大证券股份有限公司

住所：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：薛峰

电话：021-22169081

传真：021-22169134

联系人：刘晨

网址：www.ebscn.com

客户服务电话：95525、400-888-8788

(22) 南京证券股份有限公司

住所：江苏省南京市玄武区大钟亭 8 号

办公地址：江苏省南京市玄武区大钟亭 8 号

法定代表人：步国旬

客户服务电话：400-828-5888

传真：025-83364032

联系人：石健

网址：www.njzq.com.cn

(23) 上海证券有限责任公司

住所：上海市西藏中路 336 号

办公地址：上海市西藏中路 336 号

法定代表人：龚德雄

电话：021-51539888

传真：021-65217206

联系人：张瑾

网址：www.962518.com

客户服务电话：400-891-8918

中小企业板交易型开放式指数基金招募说明书（更新）摘要

15

（24）国联证券股份有限公司

住所：无锡市太湖新城金融一街8号国联金融大厦

办公地址：无锡市太湖新城金融一街8号国联金融大厦

法定代表人：姚志勇

电话：0510-82831662

传真：0510-82830162

联系人：徐欣

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

客户服务电话：95570

（25）平安证券有限责任公司

住所：深圳市福田区中心区金田路4036号荣超大厦16-20层

办公地址：深圳市福田区中心区金田路4036号荣超大厦16-20层

法定代表人：谢永林

电话：021-38631117

传真：021-33830395

联系人：石静武

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

客户服务电话：95511-8

（26）国海证券股份有限公司

住所：广西桂林市辅星路13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：何春梅

电话：0755-83709350

传真：0755-83704850

联系人：牛孟宇

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

客户服务电话：95563

(27) 国都证券股份有限公司

住所：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

中小企业板交易型开放式指数基金招募说明书（更新）摘要

16

法定代表人：常喆

电话：010-84183389

传真：010-84183311-3389

联系人：黄静

网址：www.guodu.com

客户服务电话：400-818-8118

(28) 东海证券股份有限公司

住所：江苏省常州延陵西路23号投资广场18层

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：赵俊

电话：021-20333333

传真：021-50498825

联系人：王一彦

网址：www.longone.com.cn

客户服务电话：95531、400-888-8588

(29) 恒泰证券股份有限公司

住所：内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号

办公地址：内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号

法定代表人：庞介民

电话：021-68405273

传真：021-68405181

联系人：张同亮

网址：www.cnht.com.cn

客户服务电话：400-196-6188

(30) 华西证券股份有限公司

住所：四川省成都市高新区天府二街 198 号

办公地址：四川省成都市高新区天府二街 198 号

法定代表人：杨炯洋

电话：010-52723273

传真：028-86150040

中小企业板交易型开放式指数基金招募说明书（更新）摘要

17

联系人：谢国梅

网址：[www.hx168.com.cn](http://www.hx168.com.cn)

客户服务电话：400-888-8818

(31) 申万宏源西部证券有限公司

住所：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦  
20 楼 2005 室

办公地址：新疆乌鲁木齐市天山区文艺路 233 号宏源大厦 8 楼

法定代表人：李季

电话：010-88085258

传真：010-88013605

联系人：唐岚

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

客户服务电话：400-800-0562

(32) 中泰证券股份有限公司

住所：山东省济南市市中区经七路 86 号

办公地址：山东省济南市市中区经七路 86 号

法定代表人：李玮

电话：0531-68889155

传真：0531-68889185

联系人：吴阳

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

客户服务电话：95538

(33) 第一创业证券股份有限公司

住所：广东省深圳市罗湖区笋岗路 12 号中民时代广场 B 座 25、26 层

办公地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 18 楼

法定代表人：刘学民

电话：0755-25831754

传真：0755-23838750

联系人：毛诗莉

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

客户服务电话：400-888-1888

中小企业板交易型开放式指数基金招募说明书（更新）摘要

18

(34) 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：王宜四

电话：0791-86768681

传真：0791-86770178

联系人：戴蕾

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

客户服务电话：95335

(35) 华鑫证券有限责任公司

住所：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01（b）单元

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 8 号

法定代表人：俞洋

电话：021-54967203

传真：021-54967293

联系人：王道

网址：www.cfsc.com.cn

客户服务电话：021-32109999、029-68918888、400-109-9918

(36) 中国中投证券有限责任公司

住所：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18 层-

21 层及第 04 层 01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23 单元

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：高涛

电话：0755-82023442

传真：0755-82026539

联系人：刘毅

网址：www.china-invs.cn

客户服务电话：400-600-8008、95532

(37) 华宝证券有限责任公司

住所：上海市陆家嘴环路 166 号 27 楼

中小企业板交易型开放式指数基金招募说明书（更新）摘要

19

办公地址：上海市陆家嘴环路 166 号 27 楼

法定代表人：陈林

电话：021-50122128

传真：021-50122398

联系人：徐方亮

网址：www.cnhbstock.com

客户服务电话：400-820-9898

2、场外申购、赎回销售机构

(1) 华夏基金管理有限公司

住所：北京市顺义区天竺空港工业区 A 区

办公地址：北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层

法定代表人：杨明辉

客户服务电话：400-818-6666

传真：010-63136700

联系人：李一梅

网址：www.ChinaAMC.com

(2) 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：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：王洪章

客户服务电话：95533

传真：010-66275654

联系人：王嘉朔

网址：www.ccb.com

3、二级市场交易代办证券公司

具有深圳证券交易所会员资格的所有证券公司（投资者在深圳证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金二级市场交易）。

4、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

中小企业板交易型开放式指数基金招募说明书（更新）摘要

20

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

联系人：丁志勇

联系电话：0755-25941405

传真：0755-25987133

(三) 律师事务所

名称：北京市德恒律师事务所

住所：北京市西城区金融大街 19 号富凯大厦 B 座十二层

办公地址：北京市西城区金融大街 19 号富凯大厦 B 座十二层

负责人：王丽

联系电话：010-52682888

传真：010-52682999

联系人：李永飞

经办律师：李永飞、戴钦公

#### （四）会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：上海市湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼

执行事务合伙人：李丹

联系电话：021-23238888

传真：021-23238800

联系人：许康玮、赵雪

经办注册会计师：许康玮、洪磊

#### 四、基金的名称

本基金名称：中小企业板交易型开放式指数基金。

中小企业板交易型开放式指数基金招募说明书（更新）摘要

21

#### 五、基金的类型

本基金类型：交易型开放式基金。

#### 六、基金的投资目标

本基金的投资目标：紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

#### 七、基金的投资方向

本基金的投资方向：本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。

为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于新股、债券及中国证监会



允许基金投资的其他金融工具。

## 八、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基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。

### （一）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。

### （二）投资管理程序

研究、投资决策、组合构建、交易执行、投资绩效评估、组合维护的有机配合共同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、研究支持：基金经理小组、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、跟踪误差及其归因分析等工作，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。基金经理小组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决策。

3、组合构建：根据标的指数情况，结合研究支持，基金经理小组以完全复制标的指数成

中小企业板交易型开放式指数基金招募说明书（更新）摘要

22

份股及其权重的方法构建组合。在追求跟踪误差和跟踪偏离度最小化的前提下，基金经理小组将采取适当的方法，以降低买入成本、控制投资风险。

4、交易执行：交易管理部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：风险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预期、组合跟踪误差的来源及投资策略成功与否，基金经理小组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：基金经理小组将跟踪标的指数变动，结合成份股基本面情况、成份股公司行为、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等，采取适当的跟踪技术对投资组合进行监控和调整，密切跟踪标的指数。

基金管理人在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管理程序做出调整，并在基金招募说明书更新中公告。

### （三）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，如期权、期货、权证以及其他与标的指数或标的指数成份股相关的衍生工具。基金投资于衍生工具的目标，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。基金投资于各种衍生工具的比例合计不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后公告。

### 九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为深圳证券交易所编制并发布的中小企业板价格指数（指数代码为 399005，简称为“中小板指”）。

如果深圳证券交易所变更或停止中小企业板价格指数的编制及发布、或中小企业板价格指数由其他指数替代、或由于指数编制方法发生重大变更等原因导致中小企业板价格指数不宜继续作为标的指数，或市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时，本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，进行适当的程序变更本基金的标的指数。其中，若标的指数变更涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更，则基金

管理人应就变更标的指数召开基金份额持有人大会，并报中国证监会核准或者备案。若标的指数变更对基金投资无实质性影响（包括但不限于编制机构变更、指数更名等），则无需召开基金份额持有人大会，基金管理人应在取得基金托管人同意后，报中国证监会备案。

中小企业板交易型开放式指数基金招募说明书（更新）摘要

23

#### 十、基金的风险收益特征

本基金属股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，采用完全复制策略，跟踪反映中小企业板市场的标的指数，是股票基金中风险较高的产品。

#### 十一、基金的投资组合报告

以下内容摘自本基金 2016 年第 3 季度报告：

##### “5.1 报告期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号

项目

金额

占基金总资产的比例（%）

1

权益投资

2,591,226,377.99

98.72

其中：股票

2,591,226,377.99

98.72

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

33,415,527.39

1.27

7

其他各项资产

83,341.25

0.00

8

合计

2,624,725,246.63

100.00

注：股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码

行业类别

公允价值

占基金资产净值比例（%）

A

农、林、牧、渔业

21,198,682.93

0.81

B

采矿业

-

-

C

制造业

1,724,204,813.27

65.75

D

电力、热力、燃气及水生产和供应业

-

-

E

建筑业

96, 663, 297. 92

3. 69

F

批发和零售业

77, 906, 169. 44

2. 97

中小企业板交易型开放式指数基金招募说明书（更新）摘要

24

G

交通运输、仓储和邮政业

-

-

H

住宿和餐饮业

-

-

I

信息传输、软件和信息技术服务业

293, 841, 381. 76

11. 21

J

金融业

207, 930, 866. 90

7. 93

K

房地产业

31, 834, 086. 91

1. 21

L

租赁和商务服务业

71,989,156.78

2.75

M

科学研究和技术服务业

-

-

N

水利、环境和公共设施管理业

22,272,493.88

0.85

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

43,342,785.20

1.65

S

综合

-

-

合计

2,591,183,734.99

98.82

5.3 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股票投资  
明细

金额单位：人民币元

序号

股票代码

股票名称

数量（股）

公允价值

占基金资产净值比例（%）

1

002415

海康威视

3,859,573

94,443,751.31

3.60

2

002450

康得新

5,145,223

93,025,631.84

3.55

3

002024

苏宁云商



7, 186, 916

77, 906, 169. 44

2. 97

4

002304

洋河股份

1, 081, 107

72, 531, 468. 63

2. 77

5

002673

西部证券

2, 826, 784

67, 023, 048. 64

2. 56

6

002594

比亚迪

1, 080, 386

60, 058, 657. 74

2. 29

7

002736

国信证券

3, 511, 833

57, 875, 007. 84

2. 21

8

002456

欧菲光

1, 546, 988

56, 248, 483. 68

2. 15

9

002241

歌尔股份

1, 858, 654

56, 187, 110. 42

2. 14

10

002202

金风科技

3, 262, 454

51, 155, 278. 72

1. 95

5. 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. 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  
投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5. 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。

中小企业板交易型开放式指数基金招募说明书（更新）摘要

25

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。

5.8 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  
投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货投资。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号

名称

金额

1

存出保证金

76,799.51

2

应收证券清算款

-

3

应收股利

-

4

应收利息

6,541.74

5

应收申购款

-

6

其他应收款

-

7

待摊费用

-

中小企业板交易型开放式指数基金招募说明书（更新）摘要

26

8

其他

-

9

合计

83,341.25

5.11.4 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。

5.11.5 期末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。

#### 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。”

#### 十二、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财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

下述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

阶 段

净值增长率①

净值增长率标准差②

业绩比较基准收益率③

业绩比较基准收益率标准差④

①—③

②—④

2006年6月8日至2006年12月31日

19.40%

0.98%

21.08%

1.47%

-1.68%

-0.49%

2007年1月1日至2007年12月31日

149.25%

2.23%

153.17%

2.29%

-3.92%

-0.06%

2008年1月1日至2008年12月31日

-52.62%

2.88%

-54.16%

3.02%

1.54%

-0.14%

2009年1月1日至2009年12月31日

94.19%

2.00%

96.64%

2.06%

-2.45%

-0.06%

2010年1月1日至2010年12月31日

20.71%

1.72%

21.26%

1.76%

-0.55%

-0.04%

2011年1月1日至2011年12月31日

-36.71%

1.38%

-37.09%

1.41%

0.38%

-0.03%

2012年1月1日至2012年12月31日

-1.24%

1.45%

-1.38%

1.47%

0.14%

-0.02%

2013年1月1日至2013年12月31日

17.90%

1.53%

17.54%

1.54%

0.36%

-0.01%

2014年1月1日至2014年12月31日

9.29%

1.26%

9.67%

1.26%

-0.38%

0.00%

中小企业板交易型开放式指数基金招募说明书（更新）摘要

27

2015年1月1日至2015年12月31日

54.61%

2.75%

53.70%

2.72%

0.91%

0.03%

2016年1月1日至2016年9月30日

-17.01%

1.99%

-19.18%

2.01%

2.17%

-0.02%

### 十三、费用概览

#### (一) 基金运作费用

##### 1、基金费用的种类

基金运作过程中，从基金财产中支付的费用包括：

- (1) 基金管理人的管理费。
- (2) 基金托管人的托管费。
- (3) 基金上市初费及年费。
- (4) 基金的证券交易费用。
- (5) 基金财产拨划支付的银行费用。
- (6) 基金收益分配中发生的费用。
- (7) 基金合同生效后的信息披露费用。
- (8) 基金份额持有人大会费用。
- (9) 基金合同生效后的会计师费和律师费。
- (10) 按照国家有关规定可以在基金财产中列支的其他费用。

上述基金费用由基金管理人在法律法规规定的范围内按照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

##### 2、基金费用的费率、计提标准、计提方式与支付方式

###### (1) 基金管理人的管理费

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的0.5%年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$



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 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

#### (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 0.1% 年费率计提。

计算方法如下：

中小企业板交易型开放式指数基金招募说明书（更新）摘要

28

$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$

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 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

(3) 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。降低基金管理费率和基金托管费率，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前 3 个工作日内在至少一种指定媒体上刊登公告。

(4) 本条第（一）款第 1 项中第（3）至第（10）项费用由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

### 3、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。基金募集期间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。

#### (二) 基金销售费用

## 1、场内申购赎回的对价、费用及价格

(1) 场内申购对价是指投资者申购基金份额时应交付的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。场内赎回对价是指投资者赎回基金份额时，基金管理人应交付给赎回人的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。场内申购对价、赎回对价根据申购赎回清单和投资者申购、赎回的基金份额数额确定。

(2) 投资者在场内申购或赎回基金份额时，代办证券公司可按照不高于 0.5% 的标准收取佣金，其中包含证券交易所、登记结算机构等收取的相关费用。

(3) T 日的基金份额净值在当日收市后计算，并在 T+1 日公告，计算公式为计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数。T 日的申购赎回清单在当日深圳证券交易所开市前公告。如遇特殊情况，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。

场内申购、赎回以基金份额申请，佣金计算公式为：

申购/赎回佣金 = 基金份额面值 × 申购/赎回份额 × 佣金比率

## 2、场外申购、赎回的费用及价格

(1) 投资者在办理场外申购时需交纳前端申购费用，具体费率如下：

申购金额（含申购费）

前端申购费率

中小企业板交易型开放式指数基金招募说明书（更新）摘要

29

100 万元以下

1.5%

100 万元以上（含 100 万元）-500 万元以下

1.2%

500 万元以上（含 500 万元）-1000 万元以下

0.8%

1000 万元以上（含 1000 万元）

每笔 500 元

投资者在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。

场外申购以金额申请，需交纳前端申购费用。

申购费用适用比例费率时，申购份额的计算方法如下：

净申购金额=申购金额/（1+前端申购费率）

前端申购费用=申购金额-净申购金额

申购份额=净申购金额/T 日场外申购价格

申购费用为固定金额时，申购份额的计算方法如下：

前端申购费用=固定金额

净申购金额=申购金额-前端申购费用

申购份额=净申购金额/T 日场外申购价格

净申购金额及申购份额的计算结果以四舍五入的方法保留小数点后两位。

例一：假定 T 日的场外申购价格为 1.200 元，若三笔场外申购金额分别为 1,000 元、100 万元、500 万元，则各笔申购负担的前端申购费用和获得的基金份额计算如下：

申购 1

申购 2

申购 3

申购金额（元，A）

1,000.00

1,000,000.00

5,000,000.00

适用前端申购费率（B）

1.5%

1.2%

0.8%

净申购金额（ $C=A/(1+B)$ ）

985.22

988,142.29

4,960,317.46

前端申购费 (D=A-C)

14.78

11,857.71

39,682.54

场外申购份额 (E=C/1.200)

821.02

823,451.91

4,133,597.88

若场外申购金额为 1000 万元，则申购负担的前端申购费用和获得的基金份额计算如下：

申购 4

申购金额（元，A）

10,000,000.00

前端申购费（B）

500.00

净申购金额 (C=A-B)

9,999,500.00

场外申购份额 (D=C/1.200)

8,332,916.67

(2) 投资者在办理场外赎回时需交纳赎回费用，赎回费率为赎回总额的 0.5%。所收取赎回费用的 25% 须归入基金资产，其余用作销售机构、登记结算机构的手续费。

场外赎回以份额申请，需交纳赎回费用，计算公式为：

赎回总金额 = 赎回份额 × T 日场外赎回价格

赎回费用 = 赎回总额 × 赎回费率

中小企业板交易型开放式指数基金招募说明书（更新）摘要

30

赎回金额 = 赎回总额 - 赎回费用

例二：假定某投资者在 T 日赎回 10,000 份，该日场外赎回价格为 1.250 元，则其获得的赎回金额计算如下：

赎回总金额=10,000.00×1.250=12,500.00 元

赎回费用=12,500.00×0.5%=62.50 元

赎回金额=12,500.00-62.50=12,437.50 元

(3) 基金管理人与销售机构商定后，可以调整场外申购费、赎回费的费率水平或收费方式，并报中国证监会核准或者备案后公告。

(4) 场外申购、赎回价格由基金管理人计算并公告。T 日场外申购价格的计算公式为根据 T 日申购赎回清单确定的申购对价在后续交易日内的买入成本除以对价的申购份额，T 日场外赎回价格的计算公式为根据 T 日申购赎回清单确定的赎回对价在后续交易日内的卖出价值除以赎回份额，场外申购、赎回价格计算精确到 0.001 元，小数点后第四位四舍五入。T 日场外申购价格最迟于 T+4 日公告，T 日场外赎回价格最迟于 T+3 日公告。如遇特殊情况，基金管理人可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。

基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对以特定交易方式（如网上交易、移动客户端交易）等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

#### 十四、对招募说明书更新部分的说明

中小企业板交易型开放式指数基金招募说明书（更新）依据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》、基金合同及其他法律法规的要求，对本基金管理人于 2016 年 7 月 22 日刊登的本基金招募说明书（更新）进行了更新，主要更新内容如下：

（一）更新了“三、基金管理人”中相关信息。

（二）更新了“五、相关服务机构”中相关信息。

（三）更新了“九、基金份额的申购与赎回”中申购赎回清单的格式举例等内容。

（四）更新了“十一、基金的投资”中相关信息。

（五）更新了“十二、基金的业绩”，该部分内容均按有关规定编制，并经基金托管人复核。

中小企业板交易型开放式指数基金招募说明书（更新）摘要

31

（六）更新了“二十三、对基金份额持有人的服务”中相关内容。

（七）更新了“二十四、其他应披露事项”，披露了自上次招募说明书更新截止日以来涉及本基金的相关公告。

华夏基金管理有限公司

二〇一七年一月二十日