

中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金招募说明书(更新)摘

要 2016 年第 2 期

基金管理人：诺安基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

重要提示

（一）中小板等权重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 2012 年 8 月 7 日证监许可【2012】1065 号文核准公开募集，本基金的基金合同于 2012 年 12 月 10 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，投资人认购（或申购）基金时应认真阅读本基金《招募说明书》及《基金合同》等，全面认识本基金产品的风险收益特征，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）基金的意愿、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、本基金特有风险及其他风险等。

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，具有和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。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中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金招募说明书摘要（2016 年第 2 期）

1

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

身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集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2016年12月10日，有关财务数据和净值表现截止日为2016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：深圳市深南大道4013号兴业银行大厦19—20层

法定代表人：秦维舟

设立日期：2003年12月9日

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

注册资本：1.5亿元人民币

存续期限：持续经营

电话：0755—83026688

传真：0755—83026677

联系人：王嘉

股权结构：

股东单位

出资额(万元)

出资比例

中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金招募说明书摘要（2016年第2期）

2

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 2016 年 12 月 10 日，本基金管理人共管理五十二只开放式基金：诺安平衡证券投资基金、诺安货币市场基金、诺安先锋混合型证券投资基金、诺安优化收益债券型证券投资基金、诺安价值增长混合型证券投资基金、诺安灵活配置混合型证券投资基金、诺安成长股混合型证券投资基金、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、诺安中小盘精选混合型证券投资基金、诺安主题精选混合型证券投资基金、诺安全球黄金证券投资基金、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、诺安多策略混合型证券投资基金、诺安全球收益不动产证券投资基金、诺安油气能源股票证券投资基金（LOF）、诺安新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、诺安研究精选股票型证券投资基金、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、诺安稳固收益一年定期开放债券型证券投资基金、诺安泰鑫一年定期开放债券型证券投资基金、诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、诺安优势行业灵活配置混合型证券投资基金、诺安天天宝货币市场基金、诺安理财宝货币市场基金、诺安永鑫收益一年定期开放债券型证券投资基金、诺安聚鑫宝货币市场基金、诺安稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安聚利债券型证券投资基金、诺安新经济股票型证券投资基金、诺安裕鑫收益两年定期开放债券型证券投资基金、诺安低碳经济股票型证券投资基金、诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、诺安创新驱动灵活配置混合型证券投资基金、诺安先进制造股票型证券投资基金、诺安利鑫保本混合型证券投资基金、诺安景鑫保本混合型证券投资基金、诺安益鑫保本混合型证券投资基金、诺安安鑫保本混合型证券投资基金、诺安精选回报灵活配置

中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金招募说明书摘要（2016 年第 2 期）

混合型证券投资基金、诺安和鑫保本混合型证券投资基金、诺安积极回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安优选回报灵活配置混合型证券投资基金及诺安进取回报灵活配置混合型证券投资基金。

（三）主要人员情况

1. 董事会成员

秦维舟先生，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。

伊力扎提·艾合买提江先生，董事，历任吉通网络通信股份有限公司人力资源部副总经理，中化国际石油公司人力资源部总经理、公司副总经理，现任中国对外经济贸易信托有限公司总经理。

赵忆波先生，董事，硕士。历任南方航空公司规划发展部项目经理，泰信基金管理有限公司研究员，翰伦投资咨询公司（马丁可利基金）投资经理，纽银西部基金管理有限公司基金经理，现任泽熙投资管理有限公司深圳分公司总经理。

齐斌先生，董事，硕士。历任中国国贸有限责任公司董事会秘书，中国中化集团公司投资部副总经理、战略规划部副总经理。现担任中国对外经济贸易信托有限公司副总经理。

李清章先生，董事，硕士。历任天津电视台总编室副主任，天津广播电视台宣传管理部副主任。现任上海钟表有限公司董事长，上海摩士达钟表进出口有限公司董事长。

奥成文先生，董事，硕士。历任中国通用技术（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有限公司投资银行部副总经理，诺安基金管理有限公司督察长，现任诺安基金管理有限公司总经理。

汤小青先生，独立董事，博士。历任国家计委财政金融司处长，中国农业银行市场开发部副主任，中国人民银行河南省分行副行长，中国人民银行合作司副司长，中国银监会合作金融监管部副主任，内蒙古银监局、山西银监局局长，中国银监会监管一部主任，招商银行副行长。

史其禄先生，独立董事，博士。历任中国工商银行外汇业务管理处处长，中国工商银行伦敦代表处首席代表，中国工商银行新加坡分行总经理，中国工商银

中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金招募说明书摘要（2016年第2期）

行个人金融业务部副总经理，机构业务部副总经理，机构金融业务部资深专家。
赵玲华女士，独立董事，硕士。历任中国人民解放军空军总医院新闻干事，全国妇女联合会宣传部负责人，中国人民银行人事司综合处副处长，国家外汇管理局政策法规司副处长，中国外汇管理杂志社社长兼主编，国家外汇管理局国际收支司巡视员。

2. 监事会成员

李京先生，监事，企业管理硕士。历任中国中化集团总裁办公室部门经理，中化集团香港立丰实业公司总经理助理，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世盈（厦门）创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。

赵星明先生，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处副处长，深圳证券交易所理事会秘书长，君安证券香港公司副总经理等职。

戴宏明先生，监事。历任浙江证券深圳营业部交易主管，国泰君安证券公司部门主管，现任诺安基金管理有限公司交易中心总监兼首席交易师（总助级）。

梅律吾先生，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、基金经理助理、基金经理、研究部副总监、指数投资组副总监，现任指数组负责人。

3. 经理层成员

奥成文先生，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，任公司督察长，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，历任市场部总监、发展战略部总监，现任公司副总经理。

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、投资一部总监、诺安先锋混合型证券投资基金基金经理。

陈勇先生，副总经理，经济学硕士，注册会计师。曾任国泰君安证券公司中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金招募说明书摘要（2016年第2期）

固定收益部业务董事、资产管理部基金经理，民生证券公司证券投资总部副总经理。2003年10月加入诺安基金管理有限公司，历任研究部总监、合规与风险控制部总监、督察长。现任公司副总经理。

曹园先生，副总经理，本科。曾任职于国泰基金管理有限公司，先后从事于TA交易中心交易员、销售部北方区副总经理、北京公司副总经理的工作。

2010年5月加入诺安基金管理有限公司，历任华北营销中心总经理、公司总经理助理，现任公司副总经理。

马宏先生，督察长，硕士。曾任中国新兴（集团）总公司职员、中化财务公司证券部职员、中化国际贸易股份有限公司投资部副总经理、中国对外经济贸易信托投资有限公司证券部投资总监、资产管理二部副总经理、投资发展部总经理。现任公司督察长。

4. 基金经理

宋德舜先生，经济学博士，具有证券从业资格。曾任招商银行计划财务部资产负债管理经理，泰达荷银基金管理有限公司风险管理部副总经理。2010年4月加入诺安基金管理有限公司。2012年12月至2015年3月任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基金经理。2011年4月起任上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金和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基金经理，2012年12月起任中小板等权重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的姓名及职务

本公司投资决策委员会分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：主席由公司总经理奥成文先生担任，委员包括：杨谷先生，副总经理、投资一部总监、基金经理；夏俊杰先生，投资三部总监、基金经理；韩冬燕女士，投资二部执行总监、基金经理；王创练先生，研究部总监兼首席策略师（总助级）、基金经理。

固定收益类基金投资决策委员会：主席由公司总经理奥成文先生担任，委员包括：杨谷先生，副总经理、投资一部总监、基金经理；谢志华先生，固定收益事业部副总经理、基金经理、总裁助理；王创练先生，研究部总监兼首席策略

中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金招募说明书摘要（2016年第2期）

上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人情况

（一）基本情况

公司法定中文名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）

公司法定英文名称：BANK OF COMMUNICATIONS CO., LTD

法定代表人：牛锡明

住所：上海市浦东新区银城中路 188 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

邮政编码：200120

注册时间：1987 年 3 月 30 日

注册资本：742.62 亿元

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]25 号

联系人：陆志俊

电话：95559

交通银行始建于 1908 年，是中国历史最悠久的银行之一，也是近代中国发钞行之一。1987 年重新组建后的交通银行正式对外营业，成为中国第一家全国性的国有股份制商业银行，总部设在上海。2005 年 6 月，交通银行在香港联合交易所挂牌上市，2007 年 5 月在上海证券交易所挂牌上市。根据 2015 年英国《银行家》杂志发布的全球千家大银行报告，交通银行一级资本位列第 17 位，较上年上升 2 位；根据 2015 年美国《财富》杂志发布的世界 500 强公司排行榜，交通银行营业收入位列第 190 位，较上年上升 27 位。

截至 2016 年 9 月 30 日，交通银行资产总额为人民币 80,918.10 亿元。2016 年 1-9 月，交通银行实现净利润(归属于母公司股东)人民币 525.78 亿元。

交通银行总行设资产托管业务中心（下文简称“托管中心”）。现有员工具有多年基金、证券和银行的从业经验，具备基金从业资格，以及经济师、会计师、工程师和律师等中高级专业技术职称，员工的学历层次较高，专业分布合理，职业技能优良，职业道德素质过硬，是一支诚实勤勉、积极进取、开拓创新、奋发中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金招募说明书摘要（2016 年第 2 期）

7

向上的资产托管从业人员队伍。

（二）主要人员情况

牛锡明先生，牛锡明先生，董事长、执行董事。

牛先生 2013 年 10 月至今任本行董事长、执行董事，2013 年 5 月至 2013 年 10 月任本行董事长、执行董事、行长，2009 年 12 月至 2013 年 5 月任本行副董事长、执行董事、行长。牛先生 1983 年毕业于中央财经大学金融系，获学士学位，1997 年毕业于哈尔滨工业大学管理学院技术经济专业，获硕士学位，1999 年享受国务院颁发的政府特殊津贴。

彭纯先生，副董事长、执行董事、行长。

彭先生 2013 年 11 月起任本行副董事长、执行董事，2013 年 10 月起任本行行长；2010 年 4 月至 2013 年 9 月任中国投资有限责任公司副总经理兼中央汇金投资有限责任公司执行董事、总经理；2005 年 8 月至 2010 年 4 月任本行执行董事、副行长；2004 年 9 月至 2005 年 8 月任本行副行长；2004 年 6 月至 2004 年 9 月任本行董事、行长助理；2001 年 9 月至 2004 年 6 月任本行行长助理；1994 年至 2001 年历任本行乌鲁木齐分行副行长、行长，南宁分行行长，广州分行行长。

彭先生 1986 年于中国人民银行研究生部获经济学硕士学位。

袁庆伟女士，资产托管业务中心总裁。

袁女士 2015 年 8 月起任本行资产托管业务中心总裁；2007 年 12 月至 2015 年 8 月，历任本行资产托管部总经理助理、副总经理，本行资产托管业务中心副总裁；1999 年 12 月至 2007 年 12 月，历任本行乌鲁木齐分行财务会计部副科长、科长、处长助理、副处长，会计结算部高级经理。袁女士 1992 年毕业于中国石油大学计算机科学系，获得学士学位，2005 年于新疆财经学院获硕士学位。

（三）基金托管业务经营情况

截至 2016 年 9 月 30 日，交通银行共托管证券投资基金 206 只。此外，交通银行还托管了基金公司特定客户资产管理计划、证券公司客户资产管理计划、银行理财产品、信托计划、私募投资基金、保险资金、全国社保基金、养老保障管理基金、企业年金基金、QFII 证券投资资产、RQFII 证券投资资产、QDII 证券投资资产和 QDLP 资金等产品。

中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金招募说明书摘要（2016 年第 2 期）

8

三、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

诺安基金管理有限公司直销中心

本公司在深圳、北京、上海、广州、成都开设五个直销网点对投资者办理开户、

申购和赎回业务：

1、深圳直销中心

办公地址：深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19—20 层

邮政编码：518048

电话：0755-83026603 或 0755-83026620

传真：0755-83026630

联系人：胡雯

2、北京分公司

办公地址：北京市朝阳区光华路甲 14 号诺安基金大厦 8-9 层

邮政编码：100020

电话：010-59027811

传真：010-59027890

联系人：孟佳

3、上海分公司

办公地址：上海浦东新区世纪大道 210 号 21 世纪中心大厦 903 室

邮政编码：200120

电话：021-68824617

传真：021-68362099

联系人：王惠如

4、广州分公司

办公地址：广州市珠江新城华夏路 10 号富力中心 2908

邮政编码：510623

电话：020-38928980

传真：020-38928980

中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金招募说明书摘要（2016 年第 2 期）

9

联系人：黄怡珊

5、西部营销中心

办公地址：成都市高新区府城大道西段 399 号天府新谷 9 栋 1 单元 1802

邮政编码：610021

电话：028-86050157

传真：028-86050160

联系人：裴兰

2、网下现金发售代理机构和网下股票发售代理机构

(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 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：王连志

电话：0755-82825551

传真：0755-82558355

联系人：陈剑虹

客户服务电话：95517、4008001001

网址：www.essence.com.cn

(2) 第一创业证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼

办公地址：广东省深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼

法定代表人：刘学民

客户服务电话：95358

网址：www.firstcapital.com.cn

(3) 东方证券股份有限公司

注册地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 22 层-29 层

办公地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 21 层-29 层

法定代表人：潘鑫军

联系人：吴宇

电话：021-63325888

中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金招募说明书摘要（2016 年第 2 期）

10

传真：021-63326173

客户服务电话：95503

网址：www.dfzq.com.cn

(4) 东海证券股份有限公司

注册地址：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18 层

办公地址：上海浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦

法定代表人：赵俊

联系人：王一彦

电话：021-20333333

传真：021-50498825

客户服务热线：95531 或 400-8888-588

网址：www.longone.com.cn

（5）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：薛峰

电话：021-22169999

传真：021-68815009

联系人：刘晨

客户服务电话：95525

网址：www.ebscn.com

（6）广州证券股份有限公司

注册地址：广东省广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、
20 层

办公地址：广东省广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、
20 层

法定代表人：邱三发

电话：020-88836999

传真：020-88836654

中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金招募说明书摘要（2016 年第 2 期）

11

联系人：林洁茹

客户服务电话：95396

网址：www.gzs.com.cn

（7）国都证券股份有限公司

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：王少华

电话：010-84183333

传真：010-84183311-3389

联系人：黄静

客户服务电话：400-818-8118

网址：www.guodu.com

（8）国海证券股份有限公司

注册地址：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

联系人：武斌

联系电话：0755-83707413

传真：0755-83700205

客户服务电话：95563、0771-95563

网址：www.ghzq.com.cn

（9）国金证券股份有限公司

注册地址：成都市东城根上街 95 号

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

联系电话：028-86690057、028-86690058

传真：028-86690126

全国统一服务热线：95310

网址：www.gjzq.com.cn

中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金招募说明书摘要（2016 年第 2 期）

12

（10）海通证券股份有限公司

注册地址：上海市广东路 689 号

办公地址：上海市广东路 689 号

法定代表人：王开国

电话：021-23219000

传真：021-23219100

联系人：金芸、李笑鸣

客户服务电话：95553、4008888001

网址：www.htsce.com

(11) 华西证券股份有限公司

注册地址：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 号华西证券大厦

法定代表人：杨炯洋

客户服务电话：400-8888-818、95584

网址：www.hx168.com.cn

(12) 华泰证券股份有限公司

注册地址：江苏省南京市江东中路 228 号

办公地址：江苏省南京市江东中路 228 号

法定代表人：周易

电话：025-84457777-950

传真：025-84579763

联系人：李金龙

客户服务热线：95597

网址：www.htsc.com.cn

(13) 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—30 层

法定代表人：侯巍

联系人：张治国

中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金招募说明书摘要（2016 年第 2 期）

13

联系电话：0351-8686703

传真：0351-8686709

客户服务电话：95573

网址：www.i618.com.cn

(14) 申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人：李梅

联系人：曹晔

电话：021-33389888

传真：021-33388224

客服电话：95523 或 4008895523

电话委托：021-962505

网址：www.swhysc.com

（15）申万宏源西部证券有限公司

注册地址：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：北京西城区太桥大街 19 号

法定代表人：李季

电话：010-88085858

传真：010-88085195

联系人：李巍

客户服务电话：400-800-0562

网址：www.hysec.com

（16）西部证券股份有限公司

注册地址：西安市东大街 232 号信托大厦 16-17 层

办公地址：西安市东大街 232 号信托大厦 16-17 层

法定代表人：刘建武

客户服务电话：95582

中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金招募说明书摘要（2016 年第 2 期）

14

网址：www.westsecu.com

（17）新时代证券股份有限公司

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：田德军

电话：010-83561149

传真：010-83561094

联系人：孙恺

客户服务电话：95399

网址：www.xsdzq.cn

（18）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

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：95321

网址：www.cindasc.com

(19) 兴业证券股份有限公司

注册地址：福建省福州市湖东路268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：杨盛芳

客户服务电话：95562、0591-87580107

网址：www.xyzq.com.cn

(20) 招商证券股份有限公司

中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金招募说明书摘要（2016年第2期）

15

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45楼

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45楼

法定代表人：宫少林

电话：0755-82943666

传真：0755-82960141

联系人：黄健

客户服务热线：95565

网址：www.newone.com.cn

(21) 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2-6层

法定代表人：陈共炎

电话：010-66568430

传真：010-66568990

联系人：田薇

客户服务电话：400-8888-888 或 95551

网址：www.chinastock.com.cn

（22）中航证券有限公司

注册地址：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

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：0791-6768763

传真：0791-6789414

联系人：余雅娜

客户服务电话：95335、400-88-95335

网址：www.avicsec.com

（23）中国中投证券有限责任公司

中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金招募说明书摘要（2016 年第 2 期）

16

注册地址：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 4 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：高涛

联系人：刘毅

电话 0755-82023442

传真 0755-82026539

客户服务电话：95532、4006008008

网址：www.china-invs.cn

（24）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：王常青

客户服务电话：95587

开放式基金咨询电话：40-08888-108

开放式基金业务传真：010-65182261

联系人：权唐

网址：www.csc108.com

（25）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：天津市河西区宾水道 8 号

法定代表人：王春峰

联系人：王兆权

电话：022-28451861

传真：022-28451892

客户服务电话：400-6515-988

网址：www.ewww.com.cn

（26）海通证券股份有限公司

中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金招募说明书摘要（2016 年第 2 期）

17

注册地址：上海市广东路 689 号

办公地址：上海市广东路 689 号

法定代表人：王开国

电话：021-23219000

传真：021-23219100

联系人：金芸、李笑鸣

客户服务电话：95553、4008888001

网址：www.htsce.com

（27）上海证券有限责任公司

注册地址：上海市黄浦区四川中路 213 号 7 楼

办公地址：上海市黄浦区四川中路 213 号 7 楼

法定代表人：李俊杰

电话：021-63231111

联系人：王伟力

客服电话：4008918918、021-962518

网址: www.962518.com

(28) 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 号新盛大厦 B 座 12-15 层

办公地址: 北京市西城区金融大街 5 号 (新盛大厦) B 座 12、15 层

法定代表人: 魏庆华

基金销售联系人: 汤漫川

电话: 010-66555316

传真: 010-66555246

客户服务电话: 400-8888-993

网址: www.dxzq.net.cn

(29) 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: 上海市银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼

法定代表人: 杨德红

中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金招募说明书摘要 (2016 年第 2 期)

18

客户服务热线: 95521

网址: www.gtja.com

(30) 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: 0755-82133952

联系人: 齐晓燕

客户服务热线: 95536

网址: www.guosen.com.cn

(31) 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: 广东省深圳市福田区中心三路 8 号中信证券大厦

法定代表人: 张佑君

电话: 010-84683893

传真：010—84865560

联系人：陈忠

客户服务热线：95548

网址：www.cs.ecitic.com

(32) 江海证券有限公司

注册地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

办公地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

法定代表人：孙名扬

电话：0451-82336863

传真：0451-82287211

联系人：徐世旺

客户服务电话：400-666-2288

网址：www.jhzq.com.cn

中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金招募说明书摘要（2016 年第 2 期）

19

(33) 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 6/7 楼

法定代表人：吴承根

电话：0571-87902080

联系人：吴颖

客户服务电话：95345

网址：www.stocke.com

(34) 联讯证券股份有限公司

注册地址：广东省惠州市惠城区江北东江三路 55 号惠州广播电视新闻中心

办公地址：广东省惠州市惠城区江北东江三路 55 号惠州广播电视新闻中心

西面一层大堂和三、四层

法定代表人：徐刚

电话：4008888929

客户服务电话：95564

网址：www.lxzq.com.cn

(35) 华宝证券有限责任公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号 57 层 200120

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：021-50122222

联系人：楼斯佳

客户服务电话：400-820-9898

网址：www.cnhbstock.com

（36）中泰证券股份有限公司（原齐鲁证券有限公司）

注册地址：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

联系人：吴阳

中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金招募说明书摘要（2016 年第 2 期）

20

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.zts.com.cn

（37）东北证券股份有限公司

注册地址：吉林省长春市自由大路 1138 号

办公地址：吉林省长春市自由大路 1138 号证券大厦

法定代表人：李福春

联系人：潘锴

电话：0431-85096709

客户服务热线：95360

网址：www.nesc.cn

（38）长城证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 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 16/17 层

法定代表人：邵崇

电话：0755-83516289

联系人：匡婷

客户服务电话：400-6666-888、0755-33680000

网址：www.cgws.com

(39) 华融证券股份有限公司

注册地址：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

客户服务电话：95390、400-898-9999

网址：www.hrsec.com.cn

3、网上现金发售代理机构

本基金网上现金发售代理机构包括具有基金代销业务资格及深圳证券交易所会员资格的证券公司。具体名单详见深圳证券交易所网站。

中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金招募说明书摘要（2016 年第 2 期）

21

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售基金，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：北京西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：金颖

办公地址：北京西城区太平桥大街 17 号

电话：0755-25941405

传真：0755-25987132

(三) 出具法律意见书的律师事务所和经办律师

名称：北京颐合中鸿律师事务所（原北京市颐合律师事务所）

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：虞荣方、高平均

(四) 审计基金财产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：上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼

执行事务合伙人：卢伯卿

联系电话：021-6141 8888

传真：021-6335 0003

联系人：余志亮

经办注册会计师：王明静、吴迪

四、基金名称

中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金

五、基金的类型

中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金招募说明书摘要（2016 年第 2 期）

22

交易型开放式基金

六、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的最小化，实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。

七、基金的投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股票、备选成份股票、一级市场新股、债券、权证、股指期货以及法律法规或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相关规定)。其中，本基金投资于标的指数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%。

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

八、标的指数与业绩比较基准

1、标的指数

本基金的标的指数为中小板等权重指数，此指数由深圳证券信息有限公司编制维护，并于 2011 年 10 月 28 日正式发布。中小板等权重指数的成份股和中小板指数相同，采用等权重进行加权，使得指数中每只股票拥有同等地位，平衡了每只股票对指数的影响。中小板等权重指数具有高成长性和高收益性，兼具价值尺度和投资标的的功能。

2、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为中小板等权重指数收益率。

3、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，或者上述标的指数由其他指数代替，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，

进行适当的程序变更本基金的标的指数，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，并报中国证监会中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金招募说明书摘要（2016 年第 2 期）

23

会备案且在指定的媒体上刊登公告。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，报中国证监会备案并及时公告。

九、基金的投资策略

本基金主要采取完全复制策略跟踪标的指数的表现，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）法律法规的限制；（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对标的指数的跟踪构成严重制约等。

在正常情况下，本基金对标的指数的跟踪目标是：力争使得基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和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。

1、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。

2、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、其他重大组合调整决策以及重大的单项投资决策；基金经理决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、赎回清单的编制决策。

3、投资程序

中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金招募说明书摘要（2016 年第 2 期）

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：基金经理、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项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，每日进行基金投资管理的日常决策。

(3) 组合构建：根据标的指数，结合研究报告，基金经理以完全复制指数成份股及其权重的方法构建组合。在追求跟踪误差和偏离度最小化的前提下，基金经理将采取适当的方法，以降低买入成本、控制投资风险。

(4) 交易执行：交易中心负责具体的交易执行，同时履行一线监控的职责。

(5) 投资绩效评估：风控经理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) 组合监控与调整：基金经理将跟踪标的指数变动，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程序做出调整，并在招募说明书及其更新中公告。

4、投资组合管理

(1) 组合建立

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标的指数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、公司行为等因素的分析，

中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金招募说明书摘要（2016 年第 2 期）

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，基金经理在规定时间内采用适当的手段调整实际组合直至达到跟踪指数要求。

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 3 个月的时间内达到这一投资比例。此后，如因标的指数成份股调整、基金申购或赎回导致现金头寸提高等因素导致基金不符合这一投资比例的，基金管理人将在 10 个交易日内进行调整。

(2) 组合日常管理

- 1) 根据标的指数构成及权重，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。

(3) 成份股定期调整及临时调整

根据标的指数的编制规则及调整公告，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，分析并确定组合调整策略，尽量减少成份股变更带来的跟踪偏离度和跟踪误差。

在标的指数成份股票调整周期内，若出现成份股票临时调整的情形，本基金管理人将密切关注样本股票的调整，并及时制定相应的投资组合调整策略。

(4) 成份股信息的日常跟踪与分析

跟踪标的指数成份股公司信息（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，并据以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的申购赎回。

(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、面临重大不利的司法诉讼或者有充分而合理的理由认为其被市场操纵等情形时，本
中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金招募说明书摘要（2016 年第 2 期）

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、定价特征类似或者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。

5、股指期货投资策略

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等，主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

十、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，具有和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。

十一、基金投资组合报告

本投资组合报告所载数据截止日为 2016 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

16,481,524.21

89.99

其中：股票

16,481,524.21

89.99

2

基金投资

-

-

3

固定收益投资

-

-

其中：债券

-

-

资产支持证券

-

-

4

贵金属投资

-

-

5

金融衍生品投资

-

-

6

买入返售金融资产

-

-

其中：买断式回购的买入返售金融资产

-

-

7

银行存款和结算备付金合计

1,832,255.67

10.00

中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金招募说明书摘要（2016 年第 2 期）

27

8

其他资产

1,330.11

0.01

9

合计

18,315,109.99

100.00

(二) 报告期末按行业分类的股票投资组合

1、报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

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

163,395.84

0.91

B

采矿业

-

-

C

制造业

11,395,569.19

63.13

D

电力、热力、燃气及水生产和供应业

-

-

E

建筑业

793,669.61

4.40

F

批发和零售业

157,331.76

0.87

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

2,241,519.55

12.42

J

金融业

618,227.25

3.42

K

房地产业

347,113.64

1.92

L

租赁和商务服务业

465,156.19

2.58

M

科学研究和技术服务业

-

-

N

水利、环境和公共设施管理业

164,981.18

0.91

0

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

134,560.00

0.75

S

综合

-

-

合计

16,481,524.21

91.30

2、报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

(三) 报告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

002310

东方园林

17,710

276,630.20

1.53

2

002250

联化科技

14,010

228,082.80

1.26

3

002085

万丰奥威

11,000

225,940.00

1.25

4

002052

同洲电子

17,530

210,184.70

1.16

5

002424

贵州百灵

9,500

209,665.00

1.16

6

002013

中航机电

12,500

204,000.00

1.13

7

002273

水晶光电

8,228

203,231.60

1.13

8

002456

欧菲光

5,510

200,343.60

1.11

9

002065

东华软件

9,600

197,760.00

1.10

中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金招募说明书摘要（2016 年第 2 期）

28

10

002410

广联达

12,525

196,517.25

1.09

(四) 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的股票。

(五) 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。

(六) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细
本基金本报告期末未持有债券。

(七) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资
投资明细
本基金本报告期末未持有资产支持证券。

(八) 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。

(九) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

(十) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

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投资股指期货。

2、本基金投资股指期货的投资政策
本基金本报告期末未投资股指期货。

(十一) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

1、本期国债期货投资政策
本基金本报告期末未投资国债期货。

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投资国债期货。

3、本期国债期货投资评价
本基金本报告期末未投资国债期货。

中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金招募说明书摘要（2016 年第 2 期）

29

(十二) 投资组合报告附注

1、本基金本报告期投资的前十名证券的发行主体，除万丰奥威、联化科技外，
本期没有出现被监管部门立案调查的情形，也没有出现在报告编制日前一年内受
到公开谴责、处罚的情形。

(1) 2016 年 7 月 2 日，浙江万丰奥威汽轮股份有限公司全资子公司上海达克罗

涂复工业有限公司收到上海市宝山区环境保护局出具的《行政处罚决定书》（第2520160073号），主要是因为其小部分生产线存在配套建设的环保设施未经验收、在生产过程中有废气产生等问题。宝山区环保局依据国务院《建设项目环境保护管理条例》第二十八条规定，对其作出停止上述生产线加工生产和罚款柒万伍仟元整的行政处罚。现公司已责令上海达克罗及时履行处罚、整改并通过验收，并进一步扩大宁波经济技术开发区达克罗涂复有限公司生产负荷及扩大外协业务，加强学习法律法规，提高环保意识。

截至本报告期末，万丰奥威（002085）为本基金前十大重仓股。从投资角度看，我们认为上述行政监管措施对公司无实质不利影响，并不能改变公司的投资价值和长期竞争力。本基金对该股票的投资符合法律法规和公司制度的相关规定。

（2）2016年4月9日，联化科技股份有限公司子公司联华科技（德州）有限公司一期厂区东北区域的环保废水装置处理含盐废水时发生爆炸，公司收到德州市人民政府出具的《德州市人民政府关于对联化科技（德州）有限公司“4.3”一般爆炸事故调查报告的批复（德政字[2016]31号）》及附件——德州市人民政府联化科技（德州）有限公司“4.3”一般爆炸事故调查组出具的《联化科技（德州）有限公司“4.3”一般爆炸事故调查报告》（以下简称“《调查报告》”）。平原县安监局对德州联化进行罚款33万元，并追究主要人员刑事责任。现公司吸取教训，全面整改。

截至本报告期末，联化科技（002250）为本基金前十大重仓股。从投资角度看，我们认为上述行政监管措施对公司无实质不利影响，并不能改变公司的投资价值和长期竞争力。本基金对该股票的投资符合法律法规和公司制度的相关规定。

中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金招募说明书摘要（2016年第2期）

30

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。

3、其他资产构成

序号

名称

金额（元）

1

存出保证金

587.70

2

应收证券清算款

-

3

应收股利

-

4

应收利息

742.41

5

应收申购款

-

6

其他应收款

-

7

待摊费用

-

8

其他

-

9

合计

1,330.11

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。

5、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

(1) 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况

(2) 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

6、投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

十二、基金的业绩

本基金的过往业绩不代表未来表现。

一、中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金报告期基金份额净值增长率与同期业绩基准收益率比较表

阶段

份额净值增长率①

份额净值增长率标准差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

2012. 12. 10~2012. 12. 31

1. 70%

0. 21%

11. 30%

1. 34%

-9. 60%

-1. 13%

2013. 1. 1~2013. 12. 31

13. 37%

1. 41%

23. 26%

1. 54%

-9. 89%

-0. 13%

2014. 1. 1~2014. 12. 31

13. 70%

1. 14%

20. 22%

1. 28%

-6. 52%

-0. 14%

2015. 1. 1~2015. 12. 31

47.98%

2.58%

58.00%

2.75%

-10.02%

-0.17%

2016.1.1~2016.9.30

-17.68%

1.91%

-19.20%

2.06%

1.52%

-0.15%

中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金招募说明书摘要（2016年第2期）

31

2012.12.10~2016.9.30

59.70%

1.83%

110.57%

1.98%

-50.87%

-0.15%

注：本基金业绩比较基准：中小板等权重指数收益率。

二、中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

注：本基金的建仓期为3个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同规定。

十三、基金的费用概览

（一）基金的费用种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金管理人与标的指数许可方签订的相应指数使用许可协议约定的基金的指数使用许可费；

4、因基金的证券交易或结算而产生的费用（包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、权证交易的结算费及其他类似性质的费用等）

；

5、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；

中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金招募说明书摘要（2016 年第 2 期）

32

6、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；

7、基金上市费及年费；

8、基金收益分配中发生的费用；

9、基金份额持有人大会费用；

10、基金的银行汇划费用；

11、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

（二）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

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.5% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，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。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.1% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，于次月首日起 5 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。

3、《基金合同》生效后的指数使用许可费

本基金按照基金管理人与标的指数许可方所签订的指数使用许可协议中所规定的指数使用许可费计提方法支付指数使用许可费。其中，《基金合同》生效前的许可使用固定费不列入基金费用。

中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金招募说明书摘要（2016 年第 2 期）

33

在通常情况下，指数使用许可费按前一日基金资产净值的 0.03% 的年费率计提。

计算方法如下：

$H = E \times 0.03\% \div \text{当年天数}$

H 为每日计提的指数使用许可费

E 为前一日的基金资产净值

《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个季度起，指数许可使用许可费的收取下限为每季度 5 万元，即不足人民币 5 万元则按照 5 万元收取。

指数使用许可费每日计算，逐日累计，按季支付。于次季首日起 10 个工作日内从基金资产中一次性支付给深圳证券信息有限公司。

上述一、基金费用的种类中第 4—11 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

（三）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。基金合同生效之前的律师费、会计师费和信息披露费用等不得从基金财产中列支。

（四）基金管理费和基金托管费的调整

在符合相关法律法规和履行了必备的程序的条件下，基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费，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 2 日在至少一种中国证监会指定媒体及基金管理人网站上刊登公告。

（五）其他费用

按照国家有关规定和基金合同约定，基金管理人可以在基金财产中列支其他的费用，并按照相关的法律法规的规定进行公告或备案。

（六）基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金招募说明书摘要（2016 年第 2 期）

十四、对招募说明书本次更新部分的说明

本招募说明书（更新）依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集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》及其它有关法律法规的要求，对本基金管理人于 2016 年 7 月 25 日刊登的《中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）》进行了更新，主要更新的内容如下：

- 1、在“重要提示”部分，更新了招募说明书内容的截至日期及相关财务数据的截至日期。
- 2、在“第三部分 基金管理人”中，更新了证券投资基金管理情况、主要人员情况、基金管理人的风险管理体系和内部控制制度的相关信息。
- 3、在“第四部分 基金托管人”中，更新了基金托管人概况、基金托管业务经营情况、内部控制制度的相关信息。
- 4、在“第五部分 相关服务机构”中，更新了基金份额发售机构的相关信息。
- 5、在“第八部分 基金的投资”中，更新了“十、基金投资组合报告”的内容。相关数据及内容的截止日期为 2016 年 9 月 30 日。
- 6、在“第九部分 基金的业绩”中，更新了本基金报告期基金份额净值增长率与同期业绩基准收益率比较表以及本基金份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图。
- 7、在“第二十一部分 其他应披露事项”，列举了本基金在本报告期内的相关公告。

十五、签署日期

2016 年 12 月 10 日

以上内容仅为摘要，须与本招募说明书（更新）正文所载之详细资料一并阅读。

诺安基金管理有限公司

中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金招募说明书摘要（2016 年第 2 期）