华富中小板指数增强型证券投资基金招募说明书（更新）（摘要）

（2013年第1号）

基金管理人：华富基金管理有限公司
基金托管人：中国建设银行股份有限公司
重要提示

华富中小板指数增强型证券投资基金由华富基金管理有限公司依照有关法律法规及约定发起，并经中国证券监督管理委员会证监许可【2011】1352号文核准，核准日期为2011年8月25日，本基金基金合同于2011年12月9日正式生效。

本基金管理人保证本招募说明书内容真实、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。

投资人应当认真阅读本基金的《基金合同》、本招募说明书等基金法律文件，了解本基金的风险收益特征，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断本基金是否和投资人的风险承受能力相适应。

本基金不同于具有稳定收益和低风险的银行存款和国债，本基金投资于股票资产占基金资产的比例为85%-95%，属于较高风险、较高收益的投资品种。适合有稳定收入来源、风险承受能力相对较强、并希望分享中国证券市场长期发展成果的投资者。中国资本市场未来发展前景广阔，但股市投资始终伴随风险，股价波动更是无法避免，本基金至少85%的资产投资于股票市场，基金份额净值必然会随股市行情变化上下波动，持有人购买的基金份额净值因此存在下跌甚至亏损的可能性。对希望通过短期资金、借贷资金以及养老资金进行投机快速获得高额收益的投资者可能面临较大的风险。

华富基金承诺以恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。本基金的过往业绩和华富基金旗下其他基金的业绩不构成对本基金业绩表现的保证。华富基金提醒投资人基金投资的"实者自负"原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行负担。

证券投资基金是一种长期投资工具，其主要功能是分散投资，降低投资单一证券所带来的个别风险。基金不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具，投资人购买基金，既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益，也可能承担基金投资所带来的损失。

投资人应当充分了解基金定期定额投资和零存整取等储蓄方式的区别。定期定额投资是引导投资人进行长期投资、平均投资成本的一种简单易行的投资方式。但是定期定额投资并不能规避基金投资所固有的风险，不能保证投资人获得收益，也不是替代储蓄的等效理财方式。

本基金在投资运作过程中可能面临各种风险，既包括市场风险，也包括管理风险、技术风险以及其它风险等。巨额赎回风险是开放式基金所特有的一种风险，即当单个交易日基金的净赎回申请超过基金总份额的百分之十时，投资人将可能无法及时赎回持有的全部基金份额。

本基金的《基金合同》和《招募说明书》已通过指定报刊和华富基金的互联网网站www.hffund.com进行了公开披露。

投资人应当通过基金管理人或具有基金代销业务资格的其他机构购买和赎回基金，基金代销机构名单详见本基金《招募说明书》以及相关公告。

选择优秀的基金产品长期持有，是基金持有人规避市场短期波动风险、获取投资收益的有效方法。华富基金鼓励投资者避免短期频繁操作，坚持长期投资。

基金招募说明书自基金合同生效日起，每6个月更新一次，并于每6个月结束之日后的45日内公告，更新内容截至每6个月的最后1日。

本招募说明书（更新）所载内容截止日为2013年6月9日，有关财务数据和净值表现截止日为2013年3月31日。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：华富基金管理有限公司
住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1000号31层
办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1000号31层
邮政编码：200120
法定代表人：章宏韬
设立日期：2004年4月19日
核准设立机关：中国证监会
核准设立文号：中国证监会证监基金字【2004】47号
组织形式：有限责任公司
注册资本：1.2亿元人民币
存续期间：持续经营
经营范围：基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务
联系人：尤艳
电话：021-68886996
传真：021-68887997

股权结构：华安证券股份有限公司49%、安徽省信用担保集团有限公司27%、合肥兴泰控股集团有限公司24%。

（二）主要人员情况

1、基金管理人董事会成员

章宏韬先生，董事长，本科学历，工商管理硕士学位。历任安徽省农村经济管理干部学院政治处职员，安徽省农村经济委员会调查研究处秘书、副科秘书，安徽证券交易中心综合部（办公室）经理助理、副经理（副主任），安徽省证券公司合肥蒙城路营业部总经理，华安证券有限责任公司总裁办副主任、总裁助理兼办公室主任，现任华安证券股份有限公司党委委员、副总裁，华安期货有限责任公司董事。

李工先生，董事，本科学历，香港浸会大学工商管理硕士学位。历任合肥市财政局副科长、科长、副局长，合肥市信托投资公司总经理兼党支部书记，合肥市政府副秘书长、合肥市财政局党组书记，合肥市商业银行董事长、党组书记、行长，合肥市政府副秘书长、党组副书记，合肥市政府办公厅主任，中共肥西县委书记、肥西县人大常委会主任，安徽省农村信用联合社副理事长、副主任。现任华安证券股份有限公司党委书记、董事长，华安期货有限责任公司董事。

杨新潮先生，董事，大专学历，高级经济师。历任安徽省经贸委综合处、财金处调研员，安徽省经贸投资集团总经理，安徽省中小企业担保公司董事长、总经理。现任安徽省信用担保集团副总经理，安徽省科技产业投资公司董事长。

刘庆年先生，董事，大学本科学历。历任解放军某部排长、指导员，副营职干事，合肥市财政局任党组秘书、合肥高新技术开发区财政局副局长（主持工作）、合肥市财政证券公司总经理（法人代表），国元证券寿春路第二营业部总经理，华富基金管理有限公司督察长。

姚怀然先生，董事，学士学位、研究生学历。历任人民银行安徽省分行金融管理处主任科员，安徽省证券公司营业部经理、总办主任、总经理助理兼证券投资总部总经理，华安证券有限责任公司总裁助理兼证券投资总部总经理，华富基金管理有限公司董事长。现任华富基金管理有限公司总经理。

刘瑞中先生，独立董事，研究生学历。历任安徽铜陵财专教师，中国经济体制改革研究所助理研究员、信息部主任；中国国际期货经纪有限公司任信息部经理、深圳公司副总经理，北京商品交易所常务副总裁，深圳特区证券公司（现巨田证券）高级顾问。现任北京华创投资管理有限公司总裁，深圳神华期货经纪有限公司独立董事。

陈庆平先生，独立董事，工商管理硕士。历任上海金融专科学校讲师、处长，申银证券公司哈尔滨营业部总经理，上海鑫兆投资管理咨询有限公司顾问，上海金融学院客座教授。现任宁波国际银行上海分行行长。

汪明华先生，独立董事，法律研究生学历。历任安徽省高级人民法院审判员、处长、主任，合肥市中级人民法院副院长，省高级法院经济庭、民二庭庭长等职。现任安徽承义应用法学研究所所长。

2、基金管理人监事会成员

王忠道先生，监事会主席，本科学历。历任上海财经大学金融理论教研室助教，安徽省财政厅副主任科员，安徽信托投资公司部门经理、安徽省中小企业信用担保中心副主任、安徽省皖煤投资有限公司总经理。现任安徽省信用担保集团有限责任公司总经济师。

梅鹏军先生，监事，金融学博士。先后供职于安徽省国际经济技术合作公司，安徽省物资局（后更名为"安徽省徽商集团有限公司"），合肥兴泰控股集团有限公司。现任合肥兴泰控股集团有限公司金融研究所所长。

陈大毅先生，监事，研究生学历。先后供职于安徽省证券公司上海自忠路营业部、徐家汇路营业部，华安证券上海总部，华安证券网络经纪公司（筹）。现任华富基金管理有限公司总经理助理兼运作保障部总监。

李宏升先生，监事，本科学历。历任国元证券斜土路营业部交易部经理，交通银行托管部基金会计、基金清算。现任华富基金管理有限公司综合管理部总监。

3、基金高级管理人员及督察长

姚怀然先生，公司总经理，学士学位、研究生学历。历任人民银行安徽省分行金融管理处主任科员，安徽省证券公司营业部经理、总办主任、总经理助理兼证券投资总部总经理，华安证券有限责任公司总裁助理兼证券投资总部总经理，华富基金管理有限公司董事长。现任华富基金管理有限公司总经理，董事。

满志弘女士，公司督察长，管理学硕士，CPA。曾任道勤控股股份有限公司财务部总经理，华富基金管理有限公司监察稽核部副总监兼董事会秘书。

4、本基金基金经理简介

朱蓓女士，上海交通大学安泰管理学院会计学硕士、研究生学历，六年证券投资研究、保险公司资产管理从业经历，曾担任平安资产管理有限责任公司量化投资部投资经理助理，华富基金金融工程研究员、产品设计经理。现任华富量子生命力股票型基金基金经理、华富中证100指数基金基金经理、华富中小板指数增强型基金基金经理。

本基金历任基金经理：

郭晨先生，2011年12月9日至2012年12月19日担任华富中小板指数增强型基金基金经理。

5、投资决策委员会成员

投资决策委员会是负责基金投资决策的最高权力机构，由公司分管投资业务的领导、涉及投资和研究的部门的业务负责人以及投资决策委员会认可的其他人员组成。投资决策委员会主席由公司分管投资业务的最高业务领导担任，负责投决会的召集和主持。

投资决策委员会成员姓名和职务如下：

姚怀然先生	总经理
龚炜先生	投研副总监兼基金投资部总监
陈茹女士	基金投资部副总监兼首席策略分析师
汪开振先生	非公募资产管理部总监
胡伟先生	固定收益部副总监
王光力先生	研究发展部副总监

上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（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

中国建设银行股份有限公司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）。

截至2012年12月31日，中国建设银行资产总额139，728.28亿元，较上年末增长13.77%。2012年，中国建设银行实现净利润1，936.02亿元，较上年同期增长14.26%。年化资产回报率为1.47%，年化加权净资产收益率为21.98%。利息净收入3532.02亿元，较上年同期增长15.97%。净利差为2.58%，净利息收益率为2.75%，均较上年同期提高0.01个百分点。手续费及佣金净收入962.18亿元，较上年同期增长7.51%。

中国建设银行在中国内地设有1.4万余个分支机构，并在香港、新加坡、法兰克福、约翰内斯堡、东京、首尔、纽约、胡志明市、悉尼、墨尔本设有分行，在莫斯科、台北设有代表处，海外机构已覆盖到全球13个国家和地区，基本完成在全球主要金融中心的网络布局，24小时不间断服务能力和基本服务架构已初步形成。中国建设银行筹建、设立村镇银行26家，拥有建行亚洲、建银国际，建行伦敦、建信基金、建信金融租赁、建信信托、建信人寿、中德住房储蓄银行等多家子公司，为客户提供一体化全面金融服务能力进一步增强。

2012年，本集团各方面良好表现，得到市场与社会各界广泛认可，先后荣获国内外知名机构授予的30多个重要奖项。在英国《银行家》杂志联合Brand Finance发布的"世界银行品牌500强"以及Interbrand发布的"2012年度中国最佳品牌"中，位列中国银行业首位；在美国《财富》杂志"世界500强排名"中列第77位，较上年上升31位。此外，本集团还荣获了国内外重要机构授予的包括公司治理、中小企业服务、私人银行、现金管理、托管、投行、投资者关系和企业社会责任等领域的多个专项奖。

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、核算处、清算处、监督稽核处、涉外资产核算团队、养老金托管处、托管业务系统规划与管理团队、上海备份中心等12个职能处室、团队，现有员工210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。

三、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、直销机构：

名称：华富基金管理有限公司直销中心
住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1000号31层
办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1000号31层
联系人：李晔
咨询电话：021-50619688，400-700-8001
传真：021-68415680
网址：www.hffund.com

2、代销机构：

①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
客服电话：95533
电话：010-66275654
传真：010-66275654
联系人：王琳
公司网站：www.ccb.com

②交通银行股份有限公司
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
法定代表人：胡怀邦
传真：021-58408483
联系人：陈铭铭
客服电话：95559
网址：www.bankcomm.com

③招商银行股份有限公司
住所：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦
办公地址：深圳市福田区深南大道7088号
法定代表人：傅育宁
电话：0755-83198888
传真：0755-83195049
联系人：邓炯鹏
客服电话：95555
公司网址：www.cmbchina.com

④中信银行股份有限公司
住所：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座
法定代表人：田国立
客服电话：95558
联系人：郭伟
电话：010-65556960
传真：010-65550827
网址：http://bank.ecitic.com

⑤上海浦东发展银行股份有限公司
注册地址：上海市浦东新区浦东南路500号
办公地址：上海市中山东一路12号
法定代表人：吉晓辉
电话：021-61618888
传真：021-63604199
联系人：高天、窦谷云
客服电话：95528
公司网站：www.spdb.com.cn

⑥平安银行股份有限公司
住所：深圳市罗湖区深南东路5047号
法定代表人：孙建一
联系人：周晓霞
联系电话：0755-22166212
传真电话：0755-82080714
客户服务电话：95511
公司网址：www.bank.pingan.com

⑦北京银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区金融大街甲17号首层
办公地址：北京市西城区金融大街丙17号
法定代表人：闫冰竹
联系人：谢小华
电话：010-66223587
传真：010-66226045
客户服务电话：95526
公司网站：www.bankofbeijing.com.cn

⑧渤海银行股份有限公司
住所：天津市河西区马场道201-205号
法定代表人：刘宝凤
电话：022-58316666
传真：022-58316569
联系人：王宏
客服电话：400-888-8811
网址：www.cbhb.com.cn

⑨深圳农村商业银行股份有限公司
住所：深圳市罗湖区深南东路3038号合作金融大厦
法定代表人：李伟
电话：0755-25188263
传真：0755-25188785
联系人：陈聪
客服电话：400-196-1200
网址：www.4001961200.com

⑩上海农村商业银行股份有限公司
注册地址：上海市浦东新区浦东大道981号
办公地址：上海市浦东新区银城中路8号中融碧玉蓝天大厦15-23层
法定代表人：胡平西
联系人：吴海平
电话：021-38576666
传真：021-50105124
客服电话：400-696-2999、021-962999
网址：www.shrcb.com

⑪华夏银行股份有限公司
注册地址：北京市东城区建国门内大街22号
办公地址：北京市东城区建国门内大街22号
法定代表人：吴建
联系人：马旭
电话：010-85238425
传真：010-85238680
客服电话：95577
网址：www.hxb.com.cn

⑫中国民生银行股份有限公司
住所：北京市西城区复兴门内大街2号
法定代表人：董文标
客户服务电话：95568
传真：010）57092611
联系电话：010）57092615
联系人：董云巍
网址：www.cmbc.com.cn

⑬中国农业银行股份有限公司
法定代表人：蒋超良
住所：北京市东城区建国门内大街69号
办公地址：北京市东城区建国门内大街69号
客服电话：95599
网址：www.abchina.com

⑭华安证券股份有限公司
住所：安徽省合肥市长江中路357号
法定代表人：李工
联系人：甘霖
联系电话：0551-65161821
传真：0551-65161672
客服电话：0551-96518、400-809-6518
公司网址：www.hazq.com

⑮爱建证券有限责任公司
住所：上海世纪大道1600号陆家嘴商务广场25楼
法定代表人：郭林
联系人：戴莉丽
电话：021-32229888
传真：021-62878701
客服电话：021-63340678
网址：www.ajzq.com

⑯信达证券股份有限公司
注册（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
联系人：唐静
电话：010-63081000
传真：010-63080978
客服电话：400-800-8899
网址：www.cindasc.com

⑰国都证券有限责任公司
注所：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层
法定代表人：常喆
联系人：黄静
电话：010-84183333
客服电话：400-818-8118
网址：www.guodu.com

⑱东北证券股份有限公司
住所：吉林省长春市自由大路1138号
法定代表人：矫正中
联系人：安岩岩
电话：0431-85096517
客服电话：400-600-0686、0431-85096733
网址：www.nesc.cn

⑲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
法定代表人：余磊
联系人：刘鑫
电话：027-87618882
传真：027-87618863
客服电话：027-87618882、028-86711410
网址：www.tfzq.com

⑳齐鲁证券有限公司
注册地址：济南市经七路86号
办公地址：济南市经七路86号23层
法定代表人：李玮
联系人：吴阳
电话：0531-68889155
传真：0531-68889752
客服电话：95538
网址：www.qlzq.com.cn

㉑民生证券股份有限公司
住所：北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16-18层
办公地址：北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16-20层
法定代表人：余政
联系人：赵明
电话：010-85127622
传真：010-85127917
客服电话：400-619-8888
公司网址：www.mszq.com

㉒国联证券股份有限公司
住所：无锡市县前东街168号
法定代表人：雷建辉
电话：0510-82831662
传真：0510-82830162
联系人：包峥琛
客服电话：95570
网址：www.glsc.com.cn

㉓光大证券股份有限公司
住所：上海市静安区新闸路1508号
法定代表人：徐浩明
联系人：刘晨、李芳芳
电话：021-22169999
传真：021-22169134
客服电话：400-888-8788、1010899
网址：www.ebscn.com

㉔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层至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18层至21层
法定代表人：龙增来
联系人：刘毅
电话：0755-82023442
传真：0755-82026539
客服电话：400-600-8008、95532
网址：www.china-invs.cn

㉕万联证券有限责任公司
住所：广州市天河区珠江东路高德置地广场F栋18、19层
法定代表人：张建军
联系人：罗创斌
电话：020-37865070
传真：020-37865008
客服电话：400-888-8133
网址：www.wlzq.com.cn

㉖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：浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼20层
法定代表人：兰荣
联系人：雷宇钦
电话：0591-38507679
客服电话：95562
公司网站：www.xyzq.com.cn

㉗山西证券股份有限公司
住所：山西省太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼
法定代表人：侯巍
联系人：郭熠
电话：0351-8686659
传真：0351-8686619
客服电话：400-666-1618
网址：www.i618.com.cn

㉘日信证券有限责任公司
注册地址：内蒙古呼和浩特市新城区锡林南路18号
办公地址：北京市西城区闹市口大街1号长安兴融中心西座11层
法定代表人：孔佑杰
联系人：陈韦杉
电话：010-88086830
公司网站：www.rxzq.com.cn

㉙江海证券有限公司
住所：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
联系人：张宇宏
电话：0451-82336863
传真：0451-82287211
客服电话：400-666-2288
网址：www.jhzq.com.cn

㉚长城证券有限责任公司
住所：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14/16/17层
法定代表人：黄耀华
联系人：李春芳
电话：0755-83516222
传真：0755-83516189
客服电话：400-666-6888、0755-33680000
网址：www.cgws.com

㉛大通证券股份有限公司
住所：辽宁省大连市沙河口区会展路129号大连国际金融中心A座-大连期货大厦38、39层
法定代表人：张智河
联系人：谢立军
电话：0411-39673202
客服电话：400-816-9169
网址：www.daton.com.cn

㉜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：上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼
法定代表人：万建华
联系人：芮敏祺
电话：021-38676666
传真：021-38670666
客服电话：400-888-8666
网址：www.gtja.com.cn

㉝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
法定代表人：庞介民
联系人：王旭华
电话：0471-4972343
传真：0471-4961259
客服电话：0471-4972343
公司网址：www.cnht.com.cn

㉞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16-26层
法定代表人：何如
联系人：齐晓燕
电话：0755-82130833
传真：0755-82133952
客服电话：95536
网址：www.guosen.com.cn

㉟招商证券股份有限公司
注册地址：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
联系人：林生迎
联系电话：0755-82943666
传真：0755-82943636
公司网站：www.newone.com.cn

㊱厦门证券有限公司
住所：厦门市莲前西路2号莲富大厦17楼
法定代表人：傅毅辉
联系人：赵钦
电话：0592-5161642
传真：0592-5161140
客服电话：0592-5163588
网址：www.xmzq.cn

㊲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
法定代表人：王常青
联系人：权唐
电话：010-65183888
传真：010-65182261
客服电话：400-888-8108
公司网址：www.csc108.com

㊳海通证券股份有限公司
住所：上海市广东路689号
法定代表人：王开国
联系人：李笑鸣
电话：021-23219000
传真：021-23219100
客服电话：95553
网址：www.htsec.com

㊴申银万国证券股份有限公司
注册地址：上海市常熟路171号
办公地址：上海市常熟路171号
法定代表人：储晓明
电话：021-33389888或021-54033888
传真：021-54038844
客户服务电话：400-889-5523、95523
电话委托：021-962505
网址：www.swyg.com

㊵新时代证券有限责任公司
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
法定代表人：刘汝军
电话：010-83561149
传真：010-83561049
联系人：孙恺
客服电话：400-698-9898
网址：www.xsdzq.cn

㊶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号国际企业大厦C座
法定代表人：陈有安
联系人：田薇
电话：010-66568430
传真：010-66568188
客服电话：400-888-8888
网址：www.chinastock.com.cn

㊷华龙证券有限责任公司
办公地址：甘肃省兰州市城关区东岗西路638号财富大厦
法定代表人：李晓安
联系人：李昕田
电话：0931-4890619
客服电话：96668
网址：www.hlzqgs.com

㊸南京证券有限责任公司
住所：江苏省南京市玄武区大钟亭8号
法定代表人：张华东
联系人：徐翔
电话：025-83364032
传真：025-83320066
客服电话：400-828-5888
网址：www.njzq.com.cn

㊹华福证券有限责任公司
注册地址：福州市五四路157号新天地大厦7、8层
办公地址：福州市五四路157号新天地大厦7-10层
法定代表人：黄金琳
联系人：张腾
电话：0591-87383623
传真：0591-87383610
客服电话：0591-96326
公司网站：www.hfzq.com.cn

㊺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、28层A02单元
深圳市福田区深南大道凤凰大厦1栋9层
法定代表人：牛冠兴
联系人：陈剑虹
电话：0755-82825551
客服电话：400-800-1001
公司网站：www.essence.com.cn

㊻中山证券股份有限公司
注册地址：深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心29层
法定代表人：吴永良
联系人：李珍
电话：0755-82570586
客服电话：400-102-2011
公司网站：www.zszq.com

㊼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楼
法定代表人：杨宇翔
联系人：邓舒丽
电话：0755-22626391
客服电话：95511-8
网址：www.pingan.com

㊽华泰证券股份有限公司
注册地址：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
办公地址：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
法定代表人：吴万善
联系人：万鸣
联系电话：025-83290979
客服电话：95597
公司网站：www.htsc.com.cn

㊾湘财证券有限责任公司
注册地址：湖南省长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼
办公地点：湖南省长沙市天心区湘府中路198号标志商务中心11楼
法定代表人：陈学荣
联系人：钟康莺
联系电话：021-68634518
传真：021-68865680
客服电话：400-888-1551
公司网址：www.xcsc.com

㊿东吴证券股份有限公司
注册地址：苏州工业园区翠园路181号
办公地址：苏州工业园区翠园路181号
法定代表人：吴永敏
联系人：方晓丹
联系电话：0512-65581136
客服电话：400-860-1555
公司网站：www.dwjq.com.cn

51华宝证券有限责任公司
注所：上海世纪大道100号环球金融中心57楼
法定代表人：陈林
联系人：汪明丽
电话：021-68778075
客服电话：400-820-9898
公司网站：www.cnhbstock.com

52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：北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦
法定代表人：王东明
联系人：陈忠
电话：010-60833799
传真：010-60833739
公司网站：www.es.ecitic.com

53世纪证券有限责任公司
住所：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦4042层
法定代表人：卢长才
联系人：袁媛
电话：0755-83199599
传真：0755-83199545
网址：www.csco.com.cn

54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
法定代表人：胡云钊
联系人：李良
电话：027-65799999
传真：027-85481900
客户服务电话：4008-888-999，95579
网址：www.95579.com

55中信万通证券有限责任公司
注册地址：青岛市崂山区苗岭路29号澳柯玛大厦15层（1507-1510室）
办公地址：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼第20层
法定代表人：杨宝林
联系人：吴忠超
电话：0532-85022326
客户服务电话：0532-96577
网址：www.zxwt.com.cn

56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：广西南宁市滨湖路46号
法定代表人：张雅锋
联系人：牛孟宇
电话：0755-83709350
客服电话：95563
网址：www.ghzq.com.cn

57中信证券（浙江）有限责任公司
注册地址：浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层
办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层
法人代表：沈强
联系人：王需需
客服电话：0571-95548
公司网站：www.bigsun.com

58杭州数米基金销售有限公司
住所：杭州市余杭区仓前街道海曙东路2号
办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼
法定代表人：陈柏青
联系人：周嫦旻
电话：0571-28829790、021-60897869
传真：0571-26698533
客服电话：4000-766-123
公司网址：www.fund123.cn

59北京展恒基金销售有限公司
住所：北京市顺义区后杀峪镇安富街6号
办公地址：北京市朝阳区德胜门外华严北里2号民建大厦6层
法定代表人：闫振杰
联系人：焦琳
电话：010-85189120-8023
传真：010-85189120-8017
客服电话：4008886661
公司网址：www.myfp.cn

60上海好买基金销售有限公司
住所：上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449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
联系人：张茹
电话：021-58870011
传真：021-68596919
客服电话：400-700-9665
公司网址：www.ehowbuy.com

61深圳众禄基金销售有限公司
住所：深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、J单元
办公地址：深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、J单元
法定代表人：薛峰
联系人：汤素娅
电话：0755-33227950
传真：0755-82080798
客服电话：4006-788-887
公司网址：www.zlfund.cn及www.jjmmw.com

62和讯信息科技有限公司
办公地址：北京市朝外大街22号泛利大厦10层
法定代表人：王莉
联系人：周轶
电话：021-20835789
传真：021-20835885

63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
联系人：敖玲
电话：021-58788678-8201
传真：021—58787698
客服电话：400-089-1289
公司网站：www.erichfund.com

（二）注册登记机构

名称：华富基金管理有限公司
住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1000号31层
法定代表人：章宏韬
联系人：陈大毅
电话：021-68886996
传真：021-68887997

（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
负责人：韩炯
电话：021-31358666
传真：021-31358600
联系人：黎明
经办律师：吕红、黎明

（四）审计基金财产的会计师事务所

名称：天健会计师事务所（特殊普通合伙）
主要经营场所：杭州市西溪路128号9楼
执行事务合伙人：胡少先
电话：021-62281910
传真：021-62286290
联系人：曹小勤
经办注册会计师：曹小勤、李勤

四、基金的名称

华富中小板指数增强型证券投资基金

五、基金的类型

契约型、开放式

六、基金的投资目标

本基金为股票指数增强型基金，以被动跟踪标的指数为主，力争控制本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%，年化跟踪误差不超过7.75%。在分享中小板市场平均收益的基础之上，力争通过增强手段实现超越比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。

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，包括国内依法发行上市的股票（其中包括创业板、中小板股票及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券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的相关规定）。

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。

基金的投资组合比例为：

本基金投资于股票资产占基金资产的比例为85%-95%，其中被动投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于股票资产的80%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%；其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

八、基金的投资策略

作为指数增强型基金，本基金的投资策略是在指数化投资的基础之上，采用适度的主动投资辅助提高收益，降低投资风险。指数化投资部分本基金采用完全复制的方法，按照标的指数的成分股组成及其权重构建指数化投资组合，并按照标的指数成分股及其权重的变动进行相应调整。主动投资部分本基金将采用定量结合定性的方法适度调整资产配置及精选个股，在一定的跟踪误差范围内追求超越指数的收益。

（一）资产配置策略

本基金为股票指数增强型基金，为实现有效跟踪标的指数并力争超越比较基准的投资目标，本基金投资于股票资产占基金资产的比例为85%-95%，其中被动投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于股票资产的80%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

本基金将根据市场情况及投资研究团队的研究成果，在基金合同规定的范围内对基金资产配置进行适当的主动调整，确定基金资产中股票、债券和现金的配置比例。

（二）股票投资策略

本基金采用"指数化被动投资为主、主动增强为辅"的投资策略来构建股票投资组合，指数化投资部分运用被动投资策略，采用全复制的方法，对成分股及备选成分股进行配置。增强投资部分依托本公司投研团队的研究成果构建增强股票组合，争取获得超额收益。

1.指数化被动投资策略

被动投资部分本基金采用完全复制指数的投资策略，即按照标的指数成份股及其权重构建股票组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。

①股票组合构建

本基金在建仓期内，将按照标的指数各成份股及其权重对其逐步买入。本基金可以根据市场情况适时买入，以降低建仓成本。

②股票组合调整

本基金根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。本基金还将根据基金份额申购赎回情况、法律法规中的投资比例限制等因素对股票组合进行适时调整。

i）定期调整

标的指数每年在固定时间对成分股及权重进行定期调整。本基金将按照标的指数对成份股及其权重的调整方案，对股票投资组合进行相应调整。

ii）不定期调整

a.当标的指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重调整时，本基金将根据标的指数编制单位在股权变动公告日次日发布的临时调整决定及其需调整的权重比例，进行相应调整。

b.当标的指数成分股及权重因新股上市快速计入指数需进行调整时，本基金将根据标的指数编制单位发布的临时调整决定进行相应调整。

c.如果预期标的指数的成份股及权重将发生调整，本基金可对投资组合进行前瞻性调整。

d.本基金根据申购和赎回情况，结合现金头寸管理，调整投资股票资产配置比例。

③成份股替代股票的选择

如果因成份股停牌、流动性不足或法律法规中的投资比例限制等因素使得本基金无法购买标的指数某成份股或者无法按照标的指数某成份股的权重购买足够数量的该成份股时，本基金可以根据市场情况，买入该成份股的替代股票，以维持该成份股在本基金股票资产中的配置比例。

2.主动增强投资策略

作为指数增强型基金，本基金将在指数化被动投资的基础之上，适当进行部分主动投资，一方面弥补在指数化投资过程中，由于交易成本、管理费用等因素造成的与比较基准之间的差距，另一方面力争在一定的跟踪误差下，取得部分超额收益。本基金主要采用以下几种主动增强投资策略：

①成分股及备选成分股的增强策略

本基金跟踪标的为中小板指数，中小板公司规模较小，成立时间较短，大多属于新兴行业，相比大盘蓝筹股，非系统性机会和非系统性风险都较大，因此对成分股和备选成分股进行适度增强十分必要。

本基金将依托公司投研平台、通过案头研究，实地调研，结合外部专业研究力量等方式，综合考查行业发展前景、公司成长性、估值、非系统性风险等因素，适当超配行业发展前景好、估值低、成长性好、投资风险小的成分股或备选成分股，低配基本面和估值存在瑕疵的成分股。

②非成分股及备选成分股的增强策略

本基金将适当的投资于非成分股及备选成分股，来获取超额收益。依托于本基金管理人投研团队的深入研究，筛选出非成分股增强股票，择机进行配置。

③一级市场股票投资增强策略

本基金可以适当参与一级市场股票的投资，包括新股申购、增发等方式，在严格控制额外风险的前提下提高基金的收益水平。

（三）债券投资策略

本基金基于流动性管理、提高基金资产的使用效率、增强收益的需要，可以进行适当的债券投资。本基金依托基金管理人的固定收益团队，采用久期控制下的主动性投资策略，主要包括：久期控制、期限结构配置、市场转换、相对价值判断和信用风险评估等管理手段。在有效控制整体资产风险的基础上，根据对宏观经济发展状况、金融市场运行特点等因素的分析确定组合整体框架；对债券市场、收益率曲线以及各种债券品种价格的变化进行预测，相机而动、积极调整。

（四）权证投资策略

本基金的权证投资将以保值为主要投资策略，充分利用来达到控制风险、实现保值和锁定收益等目的。

（五）跟踪偏离的监控与管理

本基金为股票指数增强型基金，力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制