

上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金更新的招募说明书(摘要)

2018年第2号

上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”或“华泰瑞瑞上证中小盘ETF”)根据2010年11月3日中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于核准上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》(证监许可[2010]1563号)和2010年12月9日《关于上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集确认函》(基金部函[2010]748号)的核准,进行募集。本基金的基金合同于2011年1月26日正式生效。

华泰瑞瑞基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”或“管理人”或“本公司”)保证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。

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,投资者在投资本基金前,应全面了解本基金的产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,并承担基金投资中出现的各类风险,包括:因经济、政治、社会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、由于基金投资组合长期回报与基金产生的流动性风险、基金管理人及基金管理人实施过程中产生的基金管理风险、本基金的特有风险等。

投资者认购(或申购)本基金前应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同。基金管理人建议投资者根据自身的具体情况,选择适合自己自己的基金产品,并且中长期持有。

基金的投资业绩并不预示其未来表现。本更新招募说明书相关内容截止日为2018年7月25日,有关财务和净值数据均以2018年9月30日截止,财务和业绩数据未经审计。

基金管理人华泰瑞瑞基金管理有限公司为本次更新的招募说明书中的投资组合信息和业绩表现进行了复核确认。

基金管理人(一)基金管理人概况名称:华泰瑞瑞基金管理有限公司住所:中国(上海)自由贸易试验区民生路1199弄上证大道五道口广场所17层

法定代表人:贾波法定日期:2004年11月18日批准设立机关:中国证监会基金业协会批准设立文号:证监基金字[2004]170号经营范围:基金管理业务;发起设立基金;中国证监会批准的其他业务

组织形式:有限责任公司注册资本:贰亿元人民币存续期间:持续经营联系人:汪晔

联系电话:400-888-0001,(021)38601777股权结构: PineBridge Investments LLC(柏瑞投资有限公司)49%、华泰证券股份有限公司49%、苏州高新高新技术产业股份有限公司2%

(二)主要人员情况贾波先生:董事长,学士,曾任职于工商银行江苏省分行,2001年7月至2016年11月在华泰证券工作,历任经纪业务总部主任、零售客户服务总部地区经理、南中二路路业务部总经理、南京长江营业部总经理、企划部副经理(主持工作)、北京分公司总经理、投资管理部总经理等职务。2016年12月加入华泰瑞瑞基金管理有限公司。

崔雁先生:董事,学士,曾任职于工商银行江苏省分行,2001年7月至2016年11月在华泰证券工作,历任经纪业务总部主任、零售客户服务总部地区经理、南中二路路业务部总经理、南京长江营业部总经理、企划部副经理(主持工作)、北京分公司总经理、投资管理部总经理等职务。2016年12月加入华泰瑞瑞基金管理有限公司。

吴海云女士:监事,硕士,于香港银行与资产管理业拥有丰富经验。曾任汇丰环球投资管理财务部副总监,以及曾在富国银行、瑞银全球资产管理、瑞银私人银行、东方汇理资产管理公司等多个重要岗位。2017年6月加入华泰瑞瑞基金管理有限公司,任资产管理部副总监。

刘旭女士:监事,十二年证券从业经验。1993年12月进入上市公司,曾任无锡解放路两路营业部总经理、副总经理,无锡无锡东一路营业部负责人,无锡城市中心营业部总经理,无锡分公司总经理等职务。现任华泰证券股份有限公司苏州分公司总经理。

柳军先生:监事,硕士,2000-2001年任上海汽车集团财务有限公司财务,2001-2004年任华泰基金管理有限公司高级基金核算员,2004年7月加入华泰瑞瑞基金管理有限公司,任基金业务部总监、上证红利ETF基金经理助理。2009年6月起任华泰瑞瑞(原友邦)上证红利ETF基金经理助理。2010年10月起担任华泰瑞瑞基金副总监。

2011年1月起担任华泰瑞瑞(原友邦)上证中小盘ETF基金副总监,2011年12月起任华泰瑞瑞基金副总监,2012年5月起任华泰瑞瑞基金副总监,2012年5月起任华泰瑞瑞基金副总监,2012年5月起任华泰瑞瑞基金副总监,2012年5月起任华泰瑞瑞基金副总监,2012年5月起任华泰瑞瑞基金副总监。

2015年6月起任华泰瑞瑞基金副总监,2015年6月起任华泰瑞瑞基金副总监,2015年6月起任华泰瑞瑞基金副总监,2015年6月起任华泰瑞瑞基金副总监,2015年6月起任华泰瑞瑞基金副总监,2015年6月起任华泰瑞瑞基金副总监。

有人分配收益;5.进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;6.编制半年度、半年度和年度基金报告;

7.计算并公告基金资产净值,确定基金份额申购、赎回对价;按规定受理申购和赎回申请,及时、足额支付投资者申购之基金份额或赎回对价;采取适当合理的措施实现开放式基金份额申购、赎回或赎回对价的支付符合基金合同等法律文件的规定;

8.办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项;9.依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会;

10.保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表、代表基金签订的重大合同及其他相关资料;

11.以基金管理人名义,代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为;

12.组织并参加基金财产清算小组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;

13.中国证监会规定的其他职责。(四)基金管理人承诺严格遵守现行有效的法律法规、基金合同和中国证监会的有关规定,建立健全内部控制制度,采取有效措施,防止违反现行有效的法律法规、基金合同和中国证监会有关规定的行为发生。

2. 本基金管理人承诺严格遵守《中华人民共和国证券法》、《基金法》及有关法律法规,建立健全的内部控制制度,采取有效措施,防止下列行为发生:

(1)将其固有财产或与他人财产混同于基金财产从事证券投资;(2)不公平对待其管理的不同基金财产以外的第三人谋取利益;(3)用基金财产为基金份额持有人以外的第三人谋取利益;(4)向基金份额持有人有违诚信承诺或收益者承诺损失;(5)法律法规或中国证监会禁止的其他行为。

3. 本基金管理人承诺严格遵守《中华人民共和国证券法》、《基金法》及有关法律法规,建立健全的内部控制制度,采取有效措施,防止下列行为发生:

(1)越权违规经营;(2)违反基金合同或托管协议;(3)违反基金份额持有人或其他基金相关机构的合法利益;(4)向中国证监会报送的投资资料中弄虚作假;(5)在公开信息披露和宣传推介材料中有虚假记载、误导性陈述;(6)违规承诺、滥用职权。

7. 违反现行有效的法律法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定,泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息;

(8) 违反证券交易所业务规则,利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格,扰乱市场秩序;

(9) 贬损同行,以抬高自己;(10) 以不正当手段谋求业务发展;(11) 有悖社会公德,损害证券投资基金行业形象;

(12) 在公开信息披露和宣传推介材料中有虚假记载、误导性陈述;(13) 其他法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。

(1) 依照有关法律法规和基金合同的规定,本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益;

(2) 不利用职务之便为自己及代理人、受雇人或第三人谋取利益;

(3) 不违反现行有效的法律法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定,泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息;

(4) 不从事损害基金份额持有人和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

(五) 基金管理人的内部控制制度(一) 内部控制的原则(1) 健全性原则。内部控制必须覆盖公司各个部门和各级岗位,并渗透到各项业务过程,涵盖决策、执行、监督、反馈等各个环节;

(2) 有效性原则。通过科学的内控手段和方法,建立合理的内控程序,维护内部控制的有效性;

(3) 独立性原则。公司在精简的基础上设立能够充分满足经营运作需要的机构、部门和岗位,各机构、部门和岗位的职责保持独立。内部控制的检查评价部门与内部控制的建立和执行部门;

(4) 相互制约原则。公司内部部门和岗位的设置应权责分明、相互制衡,消除内部控制中的盲点;

(5) 防火墙原则。公司基金资产、自有资金、其他资产应当分离,基金投资研究、决策、执行、清算、评估等部门和岗位,应当在物理上和制度上适当隔离,以达到风险防范的目的;

(6) 成本效益原则。公司运用科学化的经营管理方法降低运作成本,提高经济效益,以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

(二) 内部控制的主要环节(1) 控制环境董事、监事、高级管理人员,全面负责公司风险和财务监控,审查公司的内部控制,并对重大关联交易进行审计;董事会下设薪酬、考核与资格审查委员会,对董事、总经理、督察长、财务总监和其他高级管理人员的候选人进行资格审查,以确保具有中国证监会所要求的任职资格,制定董事、监事、总经理、督察长、财务总监、其他高级管理人员及基金经理的薪酬/报酬/计划或方案。

公司管理层在总经理领导下,认真执行董事会确定的内部控制制度,为有效贯彻公司董事会制定的经营方针及发展战略,设立了投资决策委员会和风险控制委员会,就基金投资和公司内部控制专业意见及时提供决策支持。

(2) 公司设立督察长,对董事会负责,主要职责对公司内部控制的合法性、有效性和合理性进行审查,发现重大风险事件时向公司董事长和中国证监会报告。

(3) 风险评估公司风险控制部定期评估公司风险状况,范围包括所有能对经营目标产生负面影响的内外部因素,评估这些因素对公司总体经营目标产生影响的程度及可能性,并将评估报告报公司董事会及高层管理人员。

(4) 信息与沟通控制部通过自我控制、职责分离、监察稽核、实物控制、业绩评价、严格授权、资产分离、危机处理等政策、程序等措施。

自我控制以各岗位的目标责任为控制基础,是内部控制的第一道防线。在公司内部建立科学、严格的岗位分离制度,在相关部门及岗位之间建立重要业务事项凭据传递和信息沟通制度,后续部门及岗位对前一道防线及岗位负有监督责任,使相互监督制衡的机制成为内部控制的第二道防线。充分发挥督察长和合规监察部对各岗位、各部门、各机构、各业务条线全面监察稽核作用,建立内部控制的第三道防线。

(5) 信息与沟通公司建立了内部办公信息系统与业务汇报体系,形成了自上而下的信息传递渠道和自下而上的信息汇报渠道,通过有效的信息交流渠道,保证了公司员工及高级管理人员可以充分了解其职责相关的信息,并及时传达适当的人员进行处理。

(6) 内部监督控制部、督察长和合规监察部,是内部控制的第四道防线。内部监督控制部在各自的职权范围内开展。本公司设立了独立于各业务部门法律监察部,其中监察稽核人员履行内部稽核职能,检查、评价公司内部控制制度合理性、完备性和有效性,监督公司内部控制制度的执行情况,揭示公司内部管理及基金运作中的风险,及时提出改进意见,促进公司内部管理制度的有效执行。

9. 基金管理人关于内部控制的声明(1) 基金管理人承诺建立、实施和维护内部控制制度是本公司董事会及管理层的责任;

(2) 本公司承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确;

(3) 本公司承诺将根据市场环境的变化及公司的发展不断完善内部控制制度。

二、基金托管人(一) 基本情况名称:中国银行股份有限公司(简称“中国银行”)住所及办公地址:北京市西城区复兴门内大街1号首次注册日期:1983年09月1日注册资本:人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万零玖佰贰拾玖元整

法定代表人:陈四清中国银行股份有限公司(简称“中国银行”)基金托管业务批准文号:中国证监会证监基金字[1998]24号托管部门信息披露联系人:王兆文传真:(010)66594942

中国银行客服电话:95566(二) 基金托管部门及主要人员情况中国银行托管业务部设立于1998年,现有员工110余人,大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验,且具备海外工作经历,通过培训及考核,60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务,中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行,中国银行拥有证券投资基金、基金(一对多、一对一)、社保基金、保险资金、OPF、ROFIF、ODI、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内,中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务,为各类客户提供个性化的托管增值服务,是国内领先的大型中资托管机构。

(三) 证券投资基金托管情况截至2018年6月30日,中国银行已托管674只证券投资基金,其中境内基金638只,ODI基金36只,覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型、FOF等多种类型的基金,满足了不同客户多元化的投资理财需求,基金托管规模位居同业前列。

(四) 托管业务的内部控制制度中国银行托管业务部风险管理与控制工作是中国银行全面风险管理工作的组成部分,秉承中国银行风险控制理念,坚持“规范运作、稳健控制”的原则。中国银行托管业务部风险控制工作贯穿各业务环节,通过风险识别与评估、风险控制措施设计及制度落实、内外业务检查及审计等流程强化托管业务全、全、全的风险管控。

2007年起,中国银行连续聘请外部会计师事务所开展托管业务内部控制审计工作。先后获得基于“SAS70”、“AAAF06/06”、“ISAE3402”和“ISAR616”等国际主流内控审计准则的无保留意见的审阅报告。2017年,中国银行继续获得了基于“ISAE3402”和“ISAE1616”双准则的内部控制审计报告。中国银行托管业务内控制度完善,内控措施严密,能够有效保证托管资产的安全。

(五) 托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序根据《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》等相关规定,基金托管人发现基金管理人出现投资指令违规法律、行政法规和其他有关规定,或者违反基金合同约定的,应当拒绝执行,并及时通知基金管理人,并及时向国务院证券监督管理机构报告。基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经执行的指令违反法律法规、行政法规和其他有关规定,或者违反基金合同约定的,应当及时通知基金管理人,并及时向国务院证券监督管理机构报告。

三、相关服务机构(一) 申购赎回受理证券公司(一级交易商)1) 长江证券股份有限公司办公地址:湖北武汉市新华路特8号长江证券大厦办公地址:湖北省武汉市新华路特8号长江证券大厦法定代表人:尤力贵联系人:龚爽电话:(021)61118795传真:(021)68751151客服电话:95579或4008-888-899

2) 德邦证券股份有限公司办公地址:上海市福山路500号26楼办公地址:上海市福山路500号26楼法定代表人:姚文平电话:(021)68751151

联系人:朱磊电话:(021)68761616传真:(021)68767981客服电话:400-888-8128

3) 东兴证券股份有限公司办公地址:北京市西城区金融大街5号新盛大厦B12-15层办公地址:北京市西城区金融大街5号新盛大厦B12-15层法定代表人:李贵勇联系人:汤汇川电话:(010)66565316

传真:(010)66565246客服电话:400-888-8993

4) 方正证券股份有限公司办公地址:湖南省长沙市芙蓉中路2段华侨国际大厦22-24层办公地址:湖南省长沙市芙蓉中路2段华侨国际大厦22-24层法定代表人:高利联系人:郭晓红电话:(0731)85832503

传真:(0731)85832214

客服电话:95571

5) 光大证券股份有限公司办公地址:上海市静安区新闸路1508号办公地址:上海市静安区新闸路1508号法定代表人:薛峰联系人:周倩电话:(021)22169999

传真:(021)22169134

客服电话:95525

6) 广发证券股份有限公司办公地址: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:广州市天河区珠江新城珠江西路5号广州国际金融中心19、20层

办公地址:广州市天河区珠江新城珠江西路5号广州国际金融中心19、20层

法定代表人:孙树斌联系人:殷琦电话:(020)88836999

传真:(020)88836654

客服电话:95386

7) 广州证券股份有限公司办公地址:广东省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:广东省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:何如联系人:周杨电话:(0755)82130833

传真:(0755)82133952

客服电话:95536

8) 国信证券股份有限公司办公地址:广东省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:广东省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:何如联系人:周杨电话:(0755)82130833

传真:(0755)82133952

客服电话:95536

9) 申万宏源证券股份有限公司办公地址:上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心57楼办公地址:上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心57楼

法定代表人:陈良联系人:刘川川电话:68777990

传真:68777929

客服电话:4008209888

11) 华泰证券股份有限公司办公地址:南京市江东中街228号办公地址:南京市江东中街228号华泰证券广场,深圳市福田区深南大道4117号深泰大厦18楼

法定代表人:周易联系人:庞晓宇电话:025-88338963

传真:0755-82492962(深圳)

客服电话:95567

12) 中泰证券股份有限公司办公地址: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22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

13) 山西证券股份有限公司办公地址:山西省太原市晋西北路69号山西国际中心东塔楼办公地址:山西省太原市晋西北路69号山西国际中心东塔楼

法定代表人:魏晓斌联系人:郭晓红电话:(0351)8696959

传真:(0351)8696619

客服电话:400-666-1618,(0351)95573

14) 西南证券股份有限公司办公地址:重庆市江北区北桥8号西南证券大厦办公地址:重庆市江北区北桥8号西南证券大厦

法定代表人:吴坚联系人:张煜电话:(023)63766141

传真:(023)63810422

客服电话:400-809-6096

15) 浙商证券股份有限公司办公地址:浙江省杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A座6-7楼办公地址:浙江省杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A座6-7楼

法定代表人:吴承斌联系人:张梦男电话:(0571)87818988

传真:(0571)87801913

客服电话:(0571)95345

(三) 律师事务所和经办律师名称:北京市中银律师事务所住所:北京朝阳区东三环中路39号建外SOHO A座31层

负责人:王玲电话:(021)24126000

传真:(021)24126150

经办律师:靳庆军、傅快联系人:傅快电话:(010)66565316