中小企业板交易型开放式指数基金招募说明书（更新）摘要

2019年第1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2019年6月8日，有关财务数据和净值表现数据截止日为2019年3月31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
设立日期：1998年4月9日
法定代表人：杨明辉
联系人：邱曦
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%
POWER CORPORATION OF CANADA	13.9%
MACKENZIE FINANCIAL CORPORATION	13.9%
天津海鹏科技咨询有限公司	10%
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，硕士，高级经济师。现任中信证券股份有限公司党委副书记、执行董事、总经理、执行委员会委员，华夏基金（香港）有限公司董事长。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，中信信托董事，信诚基金管理有限公司董事长，中国建银投资证券有限责任公司执行董事、总裁等。

Barry Sean McInerney先生：董事，硕士。现任万信投资公司（Mackenzie Financial Corporation）总裁兼首席执行官。曾在多家北美领先的金融机构担任高级管理职位。

胡祖六先生：董事，博士，教授。现任春华资本集团主席，兼任百胜中国控股有限公司非执行董事长，香港联交所与瑞银集团等上市公司董事等。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、董事总经理等。

杨冰先生：董事，硕士。现任中信证券股份有限公司执行委员会委员、资产管理业务行政负责人。曾任中信证券股份有限公司固定收益部交易员、资产管理业务投资经理、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，现任数量投资部总监，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联接基金基金经理（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）、华夏创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2017年12月8日起任职）、战略新兴成指交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2018年7月13日起任职）、华夏创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理（2018年8月14日起任职）、华夏中小企业板交易型开放式指数基金发起式联接基金基金经理（2018年9月10日起任职）、战略新兴成指交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理（2019年6月5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；2006年6月8日至2017年3月24日期间，方军先生任基金经理。

3、本公司量化投资决策委员会

主任：张弘弢先生，华夏基金管理有限公司董事总经理，基金经理。
成员：阳琨先生，华夏基金管理有限公司副总经理、投资总监，基金经理。
徐猛先生，华夏基金管理有限公司数量投资部总监，基金经理。
宋洋女士，华夏基金管理有限公司数量投资部总监，基金经理。
4、上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（一）基金托管人情况

1、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：田国立
成立时间：2004年9月17日
组织形式：股份有限公司
注册资本：人民币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。本行于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)。

2018年6月末，本集团资产总额228,051.82亿元，较上年末增加6,807.99亿元，增幅3.08%。上半年，本集团盈利平稳增长，利润总额较上年同期增加93.27亿元至1,814.20亿元，增幅5.42%；净利润较上年同期增加84.56亿元至1,474.65亿元，增幅6.08%。

2017年，本集团先后荣获香港《亚洲货币》“2017年中国最佳银行”，美国《环球金融》“2017最佳转型银行”、新加坡《亚洲银行家》“2017年中国最佳数字银行”、“2017年中国最佳大型零售银行奖”、《银行家》“2017最佳金融创新奖”及中国银行业协会“年度最具社会责任金融机构”等多项重要奖项。本集团在英国《银行家》“2017全球银行1000强”中列第2位；在美国《财富》“2017年世界500强排行榜”中列第28名。

中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合与合规管理处、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，在安徽合肥设有托管运营中心，在上海设有托管运营中心上海分中心，共有员工315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。

2、主要人员情况

纪伟，资产托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行南通分行、总行计划财务部、信贷经营部任职，并在总行公司业务部、投资托管业务部、授信审批部担任领导职务。具拥有八年托管从业经历，熟悉各项托管业务，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

龚毅，资产托管业务部资深经理（专业技术一级），曾就职于中国建设银行北京市分行国际部、营业部并担任副行长，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，资产托管业务部资深经理（专业技术一级），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。

郑绍平，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行投资部、委托代理部、战略客户部，长期从事客户服务、信贷业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

原玎，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行国际业务部，长期从事海外机构及海外业务管理、境内外汇业务管理、国外金融机构客户营销拓展等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

3、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、(R)QFII、(R)QDII、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2018年二季度末，中国建设银行已托管857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。中国建设银行先后9次获得《金球托管人》“中国最佳托管银行”、4次获得《财资》“中国最佳次托管银行”、连续5年获得中债登“优秀资产托管机构”等奖项，并在2016年被《环球金融》评为中国市场唯一一家“最佳托管银行”、在2017年荣获《亚洲银行家》“最佳托管系统实施奖”。

（二）基金托管人的内部控制制度

1、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。

2、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。资产托管业务部配备了专职内控合规人员负责托管业务的内控合规工作，具有独立行使内控合规工作职权和能力。

3、内部控制制度及措施

资产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

1、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“新一代托管应用监督子系统”，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。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。

2、监督流程

（1）每工作日按时通过新一代托管应用监督子系统，对各基金投资运作比例控制等情况进行监控，如发现投资异常情况，向基金管理人进行风险提示，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，如有重大异常事项及时报告中国证监会。

（2）收到基金管理人的划款指令后，对指令要素等内容进行核查。

（3）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，如有必要将及时报告中国证监会。

三、相关服务机构

（一）销售机构

1、场内申购、赎回代理机构

（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：田国立
客户服务电话：95533
传真：010-66275654
联系人：王嘉朔
网址：www.ccb.com

（2）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
客户服务电话：95521

（3）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：北京市朝阳门内大街188号
法定代表人：王常青
客户服务电话：95587
传真：010-65182261
联系人：权唐
网址：www.csc108.com

（4）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

（5）招商证券股份有限公司
住所：深圳市福田区福田街道福华一路111号
办公地址：深圳市福田区福田街道福华一路111号
法定代表人：霍达
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：95565

（6）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：广州市天河区马场路26号广发证券大厦
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

（7）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：北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦
法定代表人：张佑君
电话：010-60838888
传真：010-60836029
联系人：郑慧
网址：www.cs.ecitic.com
客户服务电话：95548

（8）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号国际企业大厦C座
法定代表人：陈共炎
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：4008-888-888或95551

（9）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

（10）申万宏源证券有限公司
住所：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（200031）
法定代表人：李梅
电话：021-33389888
传真：021-33388224
联系人：陈宇
网址：www.swhysc.com
客户服务电话：95523、400-889-5523

（11）兴业证券股份有限公司
住所：福州市湖东路268号
办公地址：上海市浦东新区长柳路36号
法定代表人：杨华辉
电话：021-38565547
传真：021-38565955
联系人：乔琳雪
网址：www.xyzq.com.cn
客户服务电话：95562

（12）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
客户服务电话：95579、400-888-8999

（13）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：王连志
电话：0755-82558305
传真：0755-82558355
联系人：陈剑虹
网址：www.essence.com.cn
客户服务电话：95517

（14）湘财证券股份有限公司
住所：湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼
办公地址：湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼
法定代表人：孙永祥
电话：021-38784580-8918
传真：021-68865680
联系人：李欣
网址：www.xcsc.com
客户服务电话：95351

（15）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
客户服务电话：95578

（16）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
客户服务电话：400-651-5988

（17）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
客户服务电话：95597

（18）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：山东省青岛市市南区东海西路28号龙翔广场东座5层
法定代表人：姜晓林
电话：0531-89606165
传真：0532-85022605
联系人：刘晓明
网址：http://sd.citics.com
客户服务电话：95548

（19）东吴证券股份有限公司
住所：苏州工业园区翠园路181号
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：95330

（20）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：张志刚
电话：010-63081000
传真：010-63080978
联系人：尹旭航
网址：www.cindasc.com
客户服务电话：95321

（21）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

（22）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
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

（23）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：上海市静安区新闸路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

（24）南京证券股份有限公司
住所：江苏省南京市江东中路389号
办公地址：江苏省南京市江东中路389号
法定代表人：步国旬
电话：025-58519523
传真：025-83369725
联系人：王万君
网址：www.njzq.com.cn
客户服务电话：95386

（25）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

（26）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：祁昊
网址：www.glsc.com.cn
客户服务电话：95570

（27）浙商证券股份有限公司
住所：杭州市江干区五星路201号
办公地址：杭州市江干区五星路201号浙商证券大楼8楼
法定代表人：吴承根
电话：0571-87901053
传真：0571-87901913
联系人：谢相辉
网址：www.stocke.com.cn
客户服务电话：95345

（28）平安证券股份有限公司
住所：深圳市福田中心区金田路4036号荣超大厦16-20层
办公地址：深圳市福田中心区金田路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
客户服务电话：95511-8

（29）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
客户服务电话：95563

（30）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
法定代表人：-
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

（31）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

（32）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

（33）国盛证券有限责任公司
住所：南昌市北京西路88号江信国际金融大厦
办公地址：江西省南昌市红谷滩新区凤凰中大道1115号北京银行大楼
法定代表人：徐丽峰
电话：0791-86283372、15170012175
传真：0791-86281305
联系人：占文驰
网址：www.gszq.com
客户服务电话：956080

（34）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：010-58124967
传真：028-86150040
联系人：谢国梅
网址：www.hx168.com.cn
客户服务电话：95584

（35）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：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室（830002）
法定代表人：韩志谦
电话：0991-2307105
传真：0991-2301927
联系人：王怀春
网址：www.hysec.com
客户服务电话：400-800-0562

（36）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：021-20315290
传真：021-20315125
联系人：许曼华
网址：www.zts.com.cn
客户服务电话：95538

（37）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
客户服务电话：95358

（38）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.avicsec.com
客户服务电话：95335

（39）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：021-54967552
传真：021-54967032
联系人：杨莉娟
网址：www.cfsc.com.cn
客户服务电话：95323、400-109-9918

（40）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：0755-83320851
传真：0755-82026942
联系人：胡芷境
网址：www.china-invs.cn
客户服务电话：400-600-8008、95532

（41）华宝证券有限责任公司
住所：上海市陆家嘴环路166号27楼
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：张德根
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：田国立
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

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：丁志男
联系电话：0755-25941405
传真：0755-25987133

（三）律师事务所

名称：北京市天元律师事务所
住所：北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦10层
办公地址：北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦10层
法定代表人：朱小辉
联系电话：010-57763888
传真：010-57763777
联系人：李晗
经办律师：吴冠雄、李晗

（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：上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场二座普华永道中心11楼
执行事务合伙人：李丹
联系电话：021-23238888
传真：021-23238800
联系人：单峰、赵雪
经办注册会计师：单峰、赵雪

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。

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。

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2019年第1季度报告：

“5.1 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	2,600,273,336.88	99.52
	其中：股票	2,600,273,336.88	99.52
2	固定收益投资	3,782,329.40	0.14
	其中：债券	3,782,329.40	0.14
	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	7,441,123.22	0.28
7	其他各项资产	1,271,448.37	0.05
8	合计	2,612,768,237.87	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

5.2.1 报告期末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	52,934,314.03	2.03
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,636,918,517.13	62.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	49,042,149.70	1.88
F	批发和零售业	103,625,048.04	3.97
G	交通运输、仓储和邮政业	43,400,951.00	1.66
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	313,297,945.43	12.00
J	金融业	206,785,640.85	7.92
K	房地产业	27,972,090.00	1.07
L	租赁和商务服务业	92,759,057.40	3.55
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	8,743,858.20	0.33
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	43,126,457.66	1.65
R	文化、体育和娱乐业	21,654,973.44	0.83
S	综合	-	-
	合计	2,600,261,002.88	99.59

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

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	4,936,772	173,132,594.04	6.63
2	002304	洋河股份	782,007	101,989,352.94	3.91
3	002475	立讯精密	3,371,613	83,616,002.40	3.20
4	002230	科大讯飞	2,222,740	80,663,234.60	3.09
5	002142	宁波银行	3,396,921	72,129,362.04	2.76
6	002027	分众传媒	10,813,148	67,798,437.96	2.60
7	002594	比亚迪	1,185,686	63,422,344.14	2.43
8	002024	苏宁易购	4,965,916	62,196,745.80	2.38
9	002202	金风科技	3,798,399	55,266,705.45	2.12
10	002008	大族激光	1,258,574	53,111,822.80	2.03

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	3,782,329.40	0.14
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,782,329.40	0.14

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明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	128061	启明转债	9,628	962,800.00	0.04
2	127012	招路转债	7,010	701,000.00	0.03
3	128059	视源转债	3,108	310,800.00	0.01
4	113022	浙商转债	2,770	304,284.50	0.01
5	128057	博彦转债	2,560	256,000.00	0.01

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。

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本基金投资的前十名证券的发行主体中，宁波银行股份有限公司出