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)

重要提示 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"华泰柏瑞上证中小盘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 核准,进行嘉集。本基金的基金合同于2011年1月26日正式生效。

《程序记》等系。华盛亚的逐步目间了601年7280日正元王级。 华秦村福基金管理有限公司(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,

本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券期货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:因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险、人别证券特有的非系统性风险、由于基金投资者连续大量赎回基金产生的流动性风险、基金管理人在基金管理实施过程中产 生的基金管理风险、本基金的特定风险等等。

工的选举。自述中域、中华基本的对于尼州城市对于 投资者),似乎基金的成功,其则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 风险收益偏好,选择适合自己的基金产品,并且中长期持有。 基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本更新招募说明书所载内容截止日为2013年7月25日,有关财务和业绩表现数据截止日为2013年6月30

本基金托管人中国银行股份有限公司已对本次更新的招募说明书中的投资组合报告和业绩表现进行

一 基金管理人 (一)基金管理人概况 名称:华泰柏瑞基金管理有限公司 住所:上海浦东新区民生路1199弄上海证大五道口广场1号楼17层

成立日期: 2004年11月18日

批准设立机关:中国证券监督管理委员会 批准设立文号:中国证监会证监基金字[2004]178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

注册资本: 贰亿元人民币

存续期间:持续经营

股权结构: PineBridge Investments LLC(柏瑞投资有限责任公司)49%、华泰证券股份有限公司49%、苏 州新区高新技术产业股份有限公司2%

央财经领导/组办公室副局长。2014年至2004年任生李祉亲股份有限公司总裁。 姜治平先生:董事、硕士、曾就职于CR&R环保公司、Unisy优利系统日本有限公司。1994年—2002年任组约银行梅隆资产管理公司高级投资组合经理,2003年—2010年任纽约梅隆资产管理公司亚太区行政总裁, 年—2011年任纽约梅隆银行被动投资及交易型开放式指数证券投资基金全球主管,2012年3月至今任柏 吴祖芳先生:董事,硕士,1992年起至今历任华泰证券股份有限公司部门负责人、子公司负责人、总裁助

理、业务总监、经务所审别的裁。 Rajeev Mittal先生:董事、学士,1992年加入美国国际集团,2009—2011年担任柏瑞投资(欧洲分公司) 总经理,新兴市场投资主管,全球固定收益研究团队主管和行政总裁(欧洲分公司),2011年至今担任柏瑞 投资亚洲有限公司业务行政总裁(亚洲,日本除外)、总经理、新兴市场投资总管,全球固定收益研究团队主

韩勇先生:董事,博士,曾任职于君安证券有限公司、华夏证券有限公司和中国证券监督管理委员会, 2007年7月至2011年9月任华安基金管理有限公司制造经理。2011年10月加入华泰村瑞基金管理有限公司朱小平先生:独立董事,硕士,1983至今任中国人民大学商学院教授。

陈念良先生:独立董事,1977年至今任香港陈应达律师事务所首席合伙人 藤加玉先生,独立董事,博士,1988—1997年任江苏巨龙水泥集团有限公司团委书记、财务处长、副总经济师,1997—1999年任长城证券有限公司投资银行部副总经理,1999—2000年任亚洲控股有限公司投资银行部副总经理,2000—2001年任北京华创投资管理有限公司执行总裁,2001年至今任上海德汇集团有限公司董事

杨科先生:独立董事,学士,2001年至今任北京市天元律师事务所律师。2010年至今任该律师事务所合

常// 字先生。监事长、学士、2004-2007年任美国国际集团全球投资公司资深财务分析师、2007年至今任 柱瑞投资亚洲有限公司(原美国国际集团亚洲投资公司)亚洲区首席财务官。 王桂芳女士:监事、硕士、1996-2003年任华泰证券股份有限公司西藏南路营业部总经理、2003-2006年 任华泰证券股份有限公司上海总部总经理,2006年至今任华泰证券股份有限公司上海城市中心营业部总经

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年任华安基金管理

有限公司高级基金核算员。2004年7月加入华泰柏瑞基金管理有限公司,历任基金事务部总监、上班至和ETT基金经理助理。2009年6月起任华泰柏瑞(原友邦华泰)上证红利交易型开放式指数基金基金经理。2010年10月起担任指数投资部副总监。2011年1月起兼任华泰柏瑞上证中小盘ETF基金、华泰柏瑞上证中小盘ETF 联接基金基金经理。2012年5月起担任华泰柏瑞沪深300ETF基金及华泰柏瑞沪深300ETF联接基金基金经 陈培先生: 监事,硕士。2001-2004年,就职于富国基金管理有限公司,任基金会计等职。2004年6月加入

华泰村瑞基金管理有限公司、现任基金事务部总监。 3.总经理及其他高级管理人员 韩勇先生:总经理,博士、曾任职于君安证券有限公司、华夏证券有限公司和中国证券监督管理委员会,

2007年7月至2011年9月任华安基金管理有限公司副总经理。2011年10月加入华泰柏瑞基金管理有限公司。 王溯舸先生:副总经理,硕士、1997-2000年任深圳特区证券公司总经理助理、副总经理,2001-2004年任 华泰证券股份有限公司受托资产管理总部总经理。

陈晖女士:督察长,硕士,1993-1999年任江苏证券有限责任公司北京代表处代表,1999-2004年任华泰 证券股份有股公司北京总部总经理。 房伟力先生:副总经理,硕士,1997—2001年任上海证券交易所登记结算公司交收系统开发经理,

2001-2004年任华安基金管理有限公司基金登记及结算部门总监。2004-2008年5月任华泰柏瑞基金管理有

张娅女士:9年证券(基金)从业经验,美国俄亥俄州肯特州立大学金融工程硕士、MBA,具有多年海内 外金融从业经验。曾在芝加哥期货交易所,Danzas-AEU公司,SunGard Energy和联合证券工作。2004年加入本公司,从事投资研究和金融工程工作。2006年11月开始至今担任华泰柏瑞(原友邦华泰)上证红利ETF基金 的基金经理。2010年10月1日起任华泰柏瑞指数投资部总监。2011年1月起兼任华泰柏瑞上证中小盘ETF基 金、华泰柏瑞上证中小盘ETF联接基金基金经理。2012年5月起担任华泰柏瑞沪深300ETF基金及华泰柏瑞沪

深300ETF联接基金基金经理。 5 投资冲笼委员会成员

7.1次以代表安贝玄加內 主席:总至理等勇先生; 成员:副总经理王溯舸先生;投资部总监汪晖先生;研究部副总监蔡静女士;田汉卿女士;固定收益部总 监董元星先生;基金经理沈涛先生。

列席人员:督察长陈辉女士;投资决策委员会主席指定的其他人员。 上述人员之间不存在近亲属关系。

三)基金管理人的职责

、依法募集基金,办理或者委托经国务院证券监督管理机构认定的其他机构代为办理基金份额的发 2、办理基金备案手续:

3、自基金合同生效之日起,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产,建立健全内部风险控 。19世歷或日间王及二时。大學大師大師,因為他大師的歌問。在中是用語並附了,是立院主的即於他 制、監察与薛敬,財务管理及人事管理等制度,保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立,对所 管理的不同基金财产分别管理、分别记帐,进行证券投资;

4.按照基金合同的约定确定基金收益分配方案,及时向基金份额持有人分配收益;

5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告; 6、编制季度、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 小月界开公口盗虫员,伊瓜,哪定盗虫刀侧中网,吸巴对加;这处定义是中两种吸凹中间,及时,定侧又付投资者申购之基金份额该则已支付。实现适当合理的措施使计算开放式基金份额认购、申购、赎回对价的方法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;

0.70是74年达州)自在4.5.71中5人5月161及18中74、 9.依据任金法》,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产促诉还没利益等以即里人口问及共同针对 11、以基金管理人名义代表基金份额持有人利益产促诉定处利和适者实施其他法律行为; 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。

(1.) 本基金管理人東泛严格遵守现行有效的相关法律、法规、规章、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、防止进反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会 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)将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资;

(2)不公平地对待其管理的不同基金财产; (3)利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人谋取利益;

(4)向基金份额持有人讳规承诺收益或者承扣损失:

(5) 法律法规或中国证监会禁止的其他行为。

、本基金管理人承诺加强人员管理,强化职业操守,督促和约束员工遵守国家有关法律、法规及行业规 范,诚实信用、勤勉尽贵,不从事以下活动:

(1) 越权或讳规经营:

(1) 趣权 50 走规空宫; (2) 违反基金合同或托管协议; (3) 故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法利益; (4)在向中国证监会报送的资料中基虑作假。

(5)拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管; (6)玩忽职守、滥用职权;

(7)违反现行有效的有关法律、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)违反证券交易场所业务规则,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,损害证券投资基金人员形象;

(12)在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分; (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其代理人、受雇人或任何第三人读取利益: (3)不违反现行有效的有关法律、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)不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

(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、監督、反馈等各个经营环节; (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,维护内控制度的有效执行;

(2)相效任原则。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,各机构、部门和岗位,各机构、部门和岗位职能上保持相对独立。内部控制的检查评价部门必须独立于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,相互制衡原则。公司基金资产。自有资产,其他资产的运作应当分离。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、法别是作的内部控制的投

2、内部控制的主要内容

2./\frace\text{2./\frace}\text{1./\frace}\text{2./\frace}\text{1./\frace}\text{2./\frace}\text{1./\frace}\text{2./\frace}\text{1./\frace}\text{2./\frace}\tex 公司管理层在总经理停下,认真执行董事会确定的内部控制战略,为了有效预创公司董事会制定的 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,就基金投资和风险控制等发表专业意见

公司设立督察长,对董事会负责,主要负责对公司内部控制的合法合规性、有效性和合理性进行审查,

公司风险控制人员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部和外部因 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

(3)控制活动

控制活动包括自我控制、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

自我控制以各岗位的目标责任制为基础,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,在科关部「和村关岗位之间建立重要业务处理凭据传递和信息沟通制度,后续部门及位对前一部门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。充分发挥督察长和法律 监察部对各岗位, 各部门, 各机构, 各项业务全面监察稽核作用, 建立内部控制的第三道防线。

公司建立了内部办公自动化信息系统与业务汇报体系,形成了自上而下的信息传播渠道和自下而上的信息呈报渠道。通过建立有效的信息交流渠道,保证了公司员工及各级管理人员可以充分了解与其职责相 关的信息,并及时送达适当的人员进行处理。

内部监控由公司风险管理与审计委员会、督察长、风险控制委员会和法律监察部等部门在各自的职权 范围内开展。本公司设立了独立于各业务部门的法律监察部、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有效地执行。

3、基金管理人关于内部控制的声明

(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。

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 首次注册登记日期:1983年10月31日

注册资本:人民币或仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰或拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字【1998】24 号 托管及投资者服务部总经理:李爱华

托管部门信息披露联系人:唐州徽 传真:(010)66594942

(二)基金托管部门及主要人员情况 中国银行于1998年设立基金托管部、为进一步树立以投资者为中心的服务理念,中国银行于2005年3月 23日正式将基金托管部更名为托管及投资者服务部,现有员工120余人。另外,中国银行在重点分行已开展

银行率先开展绩效评估、风险管理等增值服务,为各类客户提供个性化的托管服务,托管资产规模居同业前

截至2013年6月末,中国银行已托管长盛创新先锋混合、长盛同盛封闭、长盛同智优势混合(LOF)、大 成2020年6周期混合、大成蓝筹稳健混合、大成优选LOF、大成景宏封闭、工银大金蓝筹股票、工银核心价值股票、国泰产深300指数、国泰金鹿保本混合、国泰金鹏蓝筹混合、国泰区位优势股票、国投瑞银稳定增利债 券、海富通股票、海富通货币、海富通精选或号混合、海富通收益增长混合、海富通中证100指数(LOF)、华宝兴业大盘精选股票、华宝兴业力力组合股票、华宝兴业先进成长股票、华寅南路混合、华夏大盛精选混合、华夏回报三年混合、全,原本是一个企业联讯CDF、嘉实银行储券、嘉实成次收益混合。嘉实服务增值行业混合、嘉实沪深300指数(LOF)、嘉实货币、嘉实稳健混合、嘉实研究精选股票、嘉实增长混合、嘉实债 券、嘉实主题混合、嘉实回报混合、嘉实价值优势股票型、金鹰成份优选股票、金鹰行业优势股票、银河成长股票、易方达平稳增长混合、易方达策略成长混合、易方达策略成长二号混合、易方达积极成长混合、易方达货币、易方达稳健收益债券、易方达深证100ETF、易方达中小盘股票、易方达深证100ETF联接、万家180指 数、万家稳健增利债券、银华优势企业混合、银华优质增长股票、银华领先策略股票、景顺长城动力平衡混合、景顺长城优选股票、景顺长城货币、景顺长城鼎益股票(LOF)、泰信天天收益货币、泰信优质生活股票、泰信蔗筹精选股票、泰法宏利精选股票、泰法宏利集利债券、泰达宏利中证 财富大盘指数、华泰柏瑞盛世中国股票、华泰柏瑞积极成长混合、华泰柏瑞价值增长股票、华泰柏瑞货币、华 泰柏瑞量化现行股票型、南方高增长股票(LOP)、国富潜力组合股票,国富强化收益债券、国富成长动力股票、宝盈核心优势混合、招商行业领先股票、东方核心动力股票、华安行业轮动股票型、摩根士丹利华鑫强收益债券型、诺德中小盘股票型、民生加银稳健成长股票型、博时宏观回报债券型、易方达岁丰添利债券型、富 金融交易型开放式指数、国泰上证180金融交易型开放式指数证券投资基金联接、诺德优选30股票型、泰达宏利聚利分级债券型、国联安优选行业股票型、长盛同鑫保本混合型、金鹰中证技术领先指数增强型、泰信中证200指数、大成内需增长股票型、银华永祥保本混合型、招商深圳电子信息传媒产业(TMT)50交易型开 放式指数、招商深证TMT50交易型开放式指数证券投资基金联接、嘉实深证基本面120交易型开放式指数证 大华行业先锋股票型、华泰柏瑞信用增利债券型、泰信中小盘精选股票型、海富通国策导向股票型、中邮上证380指数增强型、泰达宏利中证500指数分级、长盛同禧信用增利债券型、银华中证内地资源主题指数分级、平安大华深证300指数增强型、嘉实安心货币市场、上投摩根健康品质生活股票型、工银瑞信睿智中证 500指数分级、招商优势企业灵活配置混合型、国泰中小板300成长交易型开放式指数、国泰中小板300成长 交易型开放式指数证券投资基金联接、景顺长城优信增利债券型、诺德周期策略股票型、长盛电子信息产业股票型、诺安中证创业成长指数分级、信诚双盈分级债券型、嘉实沪深300交易型开放式指数、民生加银信用双利债券型、工银瑞信基本面量化策略股票型、信诚周期轮动股票型、富兰克林国海研究精造股票型、诺安 汇鑫保本混合型、平安大华策略先锋混合型、华宝兴业中证短融的指数债券型、180等权重交易型开放式指数、华安双月鑫短期理财债券型、大成景恒保本混合型、景顺长城上证180等权重交易型开放式指数证券投资基金联接、上投摩根分红添利债券型、嘉实优化红利股票型、长盛同鑫二号保本混合型、招商信用增强债 券型、华宝兴业资源优选股票型、中证500沪市交易型开放式指数、大成中证500沪市交易型开放式指数证券 分至、千重人工员等的边域不是、干血内的一次列至力的人情势也,不更更重信用代选债券型、7.08人指数此分投资基金联发、博用压存了操作了业务理划、诺德深证的有数分级、华夏安康信用代选债券型、行底多元收益债券型、广发双债添利债券型、长盛添利30天理财债券型、信诚理财力日盈债券型、长盛添利60天理财债券 型发起式、平安大华添利债券型、大成理财21天债券型发起式、华泰柏瑞稳健收益债券型、信诚添金分级债券型、国泰现金管理货币市场、国投瑞银纯债债券型、银华中证中票50指数债券型、华安信用增强债券型、长盛同丰分级债券型、汇添富理财21天债券型发起式、国泰国证房地产业指数分级、招商央视财经50指数、嘉 实中证中期企业债指数、大成中证100交易型开放式指数、长盛纯债债券型、华夏双债增强债券型、泰达宏利 大一直,对证正证的是从人场上。 信用合利定期开放债券型,招商安润保本混合型、长盛上证市值百强交易型开放式、烧整上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金联接、南方中债中期票据指数债券型发起式、嘉实中证金边中期国债交易型牙 放式、嘉实中证金边中期国债交易型开方式指数证券投资基金联接、国投瑞银中高等级债券型、上投摩根成 债券型、嘉实海外中国股票(QDII)、银华全球优选(QDII-FOF)、长盛环球景气行业大盘精选股票型(QDII) 华秦柏瑞亚洲领导企业股票型(QDII)、信诚金砖四国积极配置(QDII)、海富通大中华精选股票型(QDII) 招商标普金砖四国指数 (LOF-QDII)、华宝兴业成熟市场动量优选 (QDII)、大成标普500等权重指数 (QDII)、长信标普100等权重指数 (QDII)、博时抗通胀增强回报 (QDII)、华安大中华升级股票型 (QDII)、信诚全球商品主题 (QDII)、上投摩根全球天然资源股票型、工银瑞信中国机会全球商置股票型 (QDII)、基方达标普全球高端常费品指数增强型 (QDII)、建信全球资源股票型 (QDII)、为在全身是开放式指数证券投资基金联接 (QDII)、广发纳斯达克100指数 (QDII)、工银 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 个日本证券的PS和企业的的股中 中国银行开办各类基金托管业务均获得相应的授权、自1998年开办托管业务以来严格按照相关法律法 规的规定以及监管部门的监管要求、以控制和防范基金托管业务风险为主线、制定了包括托管业务授权管 理制度、业务操作规程、员工职业道德规范、保密守则等在内的各项业务管理制度、将风险控制落实到每个 工作环节,保证托管基金资产与银行自有资产以及各类托管资产的相互独立和资产的安全。最近一年内,可 管及投资者服务部及其高级管理人员无重大违法违规行为,未受到中国证监会

(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》、《证券投资基金运作管理办法》的相关规定,基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律、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,立即通知基金管理人,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

立中通从经验宣传水,才经时中间到的证法分面自自体的价格的。企业工程人和及火经验宣传人的语义的特定经验的投资指令违反法律,行政法规和其他有关规定,或者违反基金合同约定的,应当立即通知基金管理人,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) 申顺陳回代理证券公司(一级交易商) 1)长江证券股份有限公司 注册地址:湖北省武汉市新华路特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:胡运钊

电话:(027)65799999

专真:(027)85481900

客服电话:95579或4008-888-999

公司客服网址:www.95579.com 2)德邦证券有限责任公司 注册地址:上海市福山路500号26楼

办公地址,上海市福山路500号26楼

电话:(021)68761616

传真: (021)68767981 客服电话: 400-888-8128

公司网址:www.tebon.com.cr

3)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:徐勇力

电话:(010)66555316 传真:(010)66555246

公司网址:www.dxzq.net.cn

4)方正证券股份有限公司 注册地址: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

传真:(0731)85832214 客服电话:95571

5)光大证券股份有限公司

注册地址: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:徐浩明

联系人:刘晨

传真:(021)22169134 客服电话:95525

6)广发证券股份有限公司

注册地址: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:广州市天河北路183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

联系人:黄岚 电话:(020)87555888 传真:(020)87555305

客服电话:95575

注册地址: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

联系人:林洁茹 电话:(020)88836999

客服电话:961303

公司网址:www.gzs.c 名 3 国信证券股份有限公司 注册地址: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

电话:(0755)82130833

传真:(0755)82133302 容服电话:95536 公司网址:www.gu 9)宏源证券股份有限公司 注册地址: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 联系人:李巍 电话:(010)88085858 传真:(010)88085195 客服电话:400-800-0562

公司网址:www.hysec.com 10)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
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:孔晓君 电话:(0755)82569143 传真: (0755)82492962

客服电话:95597 公司网址:www.htsc.com.cn 11) 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23层

法定代表人:李玮 传真:(0531)68889752 客服电话:95538

公司网址:www.qlzq.com.cn 12)山西证券股份有限公司 注册地址:山西省太原市府西街69号山西国贸中心东塔楼办公地址:山西省太原市府西街69号山西国贸中心东塔楼 法定代表人:侯巍

电话:(0351)8686659 传真:(0351)8686619 客服电话:400-666-1618、(0351)95573 公司网址:www.i618.com.cc 13)西南证券股份有限公司

注册地址:重庆市汀北区桥北苑8号 办公地址:重庆市江北区桥北苑8号西南证券大厦 法定代表人:余维佳

由话・(023)6378614 客服电话:400-809-609

联系人:郭熠

公司网址:www.swsc.com.c 14) 浙商证券股份有限公司 注册地址:浙江省杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A座6-7楼

电话: (021)64718888 传直 (0571)87901913

公司网址:www.stocke.com.cr 15)中国银河证券股份有限公司 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:陈有安 联系人:田薇 电话:(010)66568430 传真:(010)66568990

客服电话:400-888-8888 16)中航证券有限公司 注册地址:南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融大厦A座41楼办公地址:南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融大厦A座41楼

法定代表人:杜航 传真:(0791)86770178

客服电话: 400-886-6567 公司网址: www.avicsec.com 17)中国中投证券有限责任公司 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04层01、02、03、05

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: 龙增来 联系人:刘毅 电话:(0755)82023442 传真:(0755)82026539

客服电话:400-600-8008 18)中信建投证券股份有限公司 注册地址:北京市安立路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

联系人:权唐

传真:(010)65182261

客服电话:400-888-8108 公司网址:www.csc108.com 二)注册登记机构

名称:中国证券登记结算有限责任公司

法定代表人:金颖 电话:(021)68870676 传真:(021)68870064

三)律师事务所和经办律师 名称:北京市金杜律师事务所 E环中路39号建外SOHO A座31层

电话: (021)24126000 经办律师:靳庆军、傅轶

联系人: 傅轶 (四)会计师事务所和经办注册会计师 名称:普华永道中天会计师事务所有限公司 住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1233号汇亚大厦1604-1608室

办公地址:上海市湖滨路202号普华永道中心11楼 法定代表人:杨绍信 电话:(021)23238888

传真:(021)23238800 联系人:单峰 经办注册会计师:薛竟、单峰

四 基金的名称 易型开放式指数证券投资基金

投资基金 六 基金的投资目标 紧密跟踪标的指数表现,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。 七 基金的投资范围 本基金以床的指数成份股、备选成份股为主要投资对象、指数化投资比例即投资于指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的55%,如因标的指数成份股调整导致基金投资比例不符合上述标准的,基金管理人将在10个交易日内进行调整。同时为更好地实现投资目标、本基金也可少量投资于新股、债

券、非成份股、股指期货及中国证监会允许基金投资的其他金融工具、股指期货以套期保值为目的、权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。但因法律法规的规定而受限制的

五 基金的类型

八 基金的投资策略 八 塞亚印以只用时 在正常市场情况下,本基金日均限踪偏离度(剔除成份股分红因素)的绝对值不超过0.2%,年限踪误差 不超过2%。如因指数编制规则调整或其他因素导致限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腐度。跟踪误差进一步扩大。 本基金采取完全复制法,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进行相应调整。但在因特殊情况(如流动性不足)导致无法获得足够数量 的股票时,基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合,追求尽可能贴近目标指数 的表现。 特殊情况主要是指在标的指数成份股发生变动、增发/配股等公司行为导致成份股的构成及权重发生

变化时,由于交易成本、交易制度、个别成份股停牌或者流动性不足等原因导致基金无法及时完成投资组合的同步调整,基金管理人需要采用其他合理的投资方法构建尽可能贴近目标指数的基金组合。 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 呆值操作。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

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团队制。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 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

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。 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数量分析师提供的研究报告,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权重方法构建组合。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,以降低买人成本,控制投资风险。

。则元以宋、3日日99年、2017日13日日2日7日7日7日18日7日7日9日 14年3月7以日4年3月7日 1日日7日7日 1日日7日 1日日7日7日 1日日7日 1日日7日

(4)交易执行:集中交易室负责具体的交易执行,同时履行一线监控的职责。 (5)投资额效率估、数量分析师定期和不定期对基金进行投资额效率估,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, (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

東回的現金流量/南亞/達金之達中的政府的自我及交別,至日成功政委學用目的心,如此在人们、委並平等 東回的現金流量情況以及组合投資缴效用信的结果,对投资组合进行监控和国際、客切跟影宗的指数。 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,并在基金招募说明书及其更新中公告 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。本基金标的指数变更的,相应更换基金名称和业绩比较基准,并在

18年1日止血云 用率式以2012日。 华泰村瑞上证中小盘ETF属于交易型开放式指数基金,运用完全复制的被动式投资策略进行指数化投资,力求获得与标的指数基本一致的风险收益特征。因此,本基金选用标的指数:即上证中小盘指数作为业

十 基金的风险收益特征 本基金属于股票型基金中的指数型基金,股票最低仓位为95%,并采用完全复制的被动式投资策略:

绩比较基准,能够忠实地反映本基金的风险收益特征。

报中国证监会备案后及时公告

方面,相对于混合基金、债券基金与货币市场基金而言,其风险和收益较高,属于股票型基金中高风险、高收益的产品;另一方面,相对于采用抽样复制的指数型基金而言,其风险和收益特征将更能与标的指数保持基 本一致。 十一 基金的投资组合报告

1、期末基金资产组合情况 84,784,127

4,247,180.10

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	859,201.83	0.95
В	采矿业	4,621,126.56	5.09
C	制造业	41,848,040.41	46.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,523,425.13	8.2
E	建筑业	3,964,384.11	4.30
F	批发和零售业	5,330,219.05	5.8
G	交通运输、仓储和邮政业	4,813,379.57	5.3
Н	住宿和餐饮业	94,275.00	0.1
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,611,004.91	3.9
J	金融业	4,916,215.66	5.4
K	房地产业	3,792,282.90	4.1
L	租赁和商务服务业	935,661.48	1.0
M	科学研究和技术服务业	272,052.00	0.3
N	水利、环境和公共设施管理业	377,519.28	0.4
0	居民服务、修理和其他服务业	-	0.0
P	教育	-	0.0
Q	卫生和社会工作	-	0.0
R	文化、体育和娱乐业	1,300,061.04	1.4
S	综合	513.003.86	0.5

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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(%)
601939	建设银行	377,379	1,566,122.85	1.72
600900	长江电力	183,500	1,269,820.00	1.40
600535	天士力	25,054	980,864.10	1.08
600011	华能国际	173,100	924,354.00	1.02
600089	特变电工	108,636	874,519.80	0.96
601117	中国化学	81,173	772,766.96	0.85
600795	国电电力	330,749	754,107.72	0.83
600315	上海家化	16,520	743,234.80	0.82
600276	恒瑞医药	27,839	733,836.04	0.81
600332	广州药业	21,066	721,721.16	0.79
	601939 600900 600535 600011 600089 601117 600795 600315 600276 600332	601939 建设银行 600900 长江电力 600535 天土力 600011 华能国际 600089 特変电工 601117 中国化学 600795 国电电力 600315 上海家化 600276 恒環版符 600332 广州药业	601939 建设银行 377,379 600900 长江电力 183,500 600535 天土力 25,054 600011 华能国际 173,100 600089 特変电工 108,636 601117 中国化学 81,173 600795 国电电力 330,749 600315 上海家化 16,520 600276 恒瑞医药 27,839	601939 建设银行 377,379 1,566,122,85 600900 长江电力 183,500 1,269,820,00 600535 天土力 25,054 980,864,10 600011 华他国际 173,100 924,354,00 600189 特变电工 108,636 874,5193 601117 中国化学 81,173 772,766,96 600795 国电电力 330,749 754,107,72 600315 上海家化 16,520 743,244,80 600376 恒瑶医药 27,839 733,836,04 600332 广州药业 21,066 721,721,16

注: 本基金本报告期末未持有债券投资组合

5. 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 注:本基金本报告期末未持有债券投资组合。 6. 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明细 注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

2)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 3) 其他资产构成 应收股利 163,126,6 待摊费用 2,473,993.32

1)报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的,也没有在报告编制日前

注: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 本基金本报告期末前十名股票未存在流通受限的情况。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产、但不保证基金一定盈利。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特有人认购或交易基金的各项费用,计人费用后实际收益水平要低于所列数 字。基金的业绩报告截止日为2013年6月30日

阶段 净值增长率① 1)-3) 2-4 -24.19% -33.80% 1.30% 1.40% -9.61% -0.10% 2012年 0.43% -0.14%0.38% -38.30% -29.51%

3、图示自基金合同生效以来基金份额净值的变动情况,并与同期业绩比较基准的变动的比较 点水传播器(李帕斯) 木型阿尔亚特化物基甲次基本 "Usint Line" (11)

十三 基金的费用与税收

(10)指数使用费;

十二 基金的业绩

(1)基金管理人的管理费

(2)基金柱管人的托管费; (3)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);

(4)基金合同生效以后的信息披露费用; (5)基金份额持有人大会费用; (6)基金合同生效以后的会计师费和律师费和诉讼费;

(7)基金资产的资金汇划费用及开户费用; (8)基金上市费及年费; (9)基金收益分配中发生的费用;

(11)按照国家有关法律法规规定和基金合同约定,可以列人的其他费用。 本基金终止清算时所发生费用,按实际支出额从基金资产总值中扣除。 2.基金费用计提方法、计提标准和支付方式

(1)其全管理人的管理费 (1) 基金管理人的管理贸 基金管理人的基金管理费按基金资产净值的0.50%年费率计提。 在通常情况下、基金管理费按前一日基金资产净值的0.50%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.50%÷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。经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起 盛並自建页每日日晚,按月又刊。红盛並自建入一 工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。 (2)基金托管人的基金托管费 基金托管人的基金托管费按基金资产净值的0.10%年费率计提

在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的0.10%年费率计提。计算方法如下: 任理吊闸优下,基金托官货货制 H=E×0.10%÷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 2.79m2 11263 20,17m3 基金托管费每日计提,按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起 工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

(3)指数使用费: 本基金的指数使用费即指数许可使用基点费,为ETF年度基金资产净值的0.03%(3bp),许可使用基点费的收取下限为每季人民币伍万(50,000)元(即不足5万元部分按照5万元收取)。在通常情况下,指数许可使用基点费按前一日的ETF基金资产净值的0.03%(3个基点)的年费率计提。指数许可使用基点费每日计 算,逐日累计。

H为每日应付的指数许可使用基点费,E为前一日的ETF基金资产净值。 (4)本条第(一)款第1项第(3)至第(11)条费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应 协议的规定,列入当期基金费用。

H=E×0.03%/当年天数

3、不列入基金费用的项目 下列费用不列人基金费用: 1)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;

(2)基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用; (3)《基金合同》生效前的相关费用,包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用; (4)其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列人基金费用的项目。 4、基金管理费和基金托管费的调整 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。

本基金认购费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式请详见本招募说明书"六、基金的募集"中 八)投资人对基金份额的认购"中的相关规定。 本基金申购费 赎回费的费率水平、收取方式和使用方式请详见本招募说明书"十、基金份额的申购赎中的"(六)申购。赎回的对价和费用"中的相关规定。 (三)基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

本基金定作过程中涉及的各纳税主体,依照国家法律法规的规定履行纳税义务。
十四 对招募说明书更新部分的说明
本基金管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《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,结合本基金管理人对
本基金实施的投资管理活动。本基金的招募说明书进行了更新,主要更新的内容如下;
1、"三、基金管理》、"部分,对董事会成员和监事会成员和监事会成是和监查基金经理的相关信息作了更新。
2、"四、基金任管人"部分,根据基金任管人提供的更新内容作了相应的更新。
3、"五 相关服务机构"部分,更新了"一级交易商"的相关信息。
4、"十二、基金的投资"部分,对基金投资组合报告作了更新。
5、"十三、基金的业绩"部分,对基金投资业绩作了更新。
6、"二十四、其他应按露事项"部分,根据前次招募说明书(更新)公布日至本次更新内容截止日的历