中小企业板交易型开放式指数基金招募说明书（更新）摘要

2011年第2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号文批准募集。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2011年12月8日，有关财务数据和净值表现数据截止日为2011年9月30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12层
设立日期：1998年4月9日
法定代表人：王东明
联系人：崔雁巍
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	49%
南方工业资产管理有限责任公司	11%
山东省农村经济开发投资公司	10%
POWER CORPORATION OF CANADA	10%
山东海丰国际航运集团有限公司	10%
无锡市国联发展（集团）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

王东明先生：董事长，硕士，高级经济师。现任中信证券股份有限公司董事长、中国中信集团公司董事、总经理助理，中信控股有限责任公司董事，中信国际金融控股有限公司董事、中信资本市场控股有限公司董事，中信证券国际有限公司董事。曾任中信证券有限责任公司副总经理、总经理、董事，北京华远经济建设公司副总经理，加拿大枫叶银行证券公司部门副经理，华夏证券公司发行部副总经理，南方证券公司副总裁等职务。

范勇宏先生：董事、总经理，博士。曾任华夏证券股份有限公司总裁助理、华北业务总监、华夏证券股份有限公司北京东四营业部总经理、中国建设银行总行干部。

王连洲先生：独立董事，学士。现已退休。中国《证券法》、《信托法》、《基金法》三部重要民商法律起草工作的主要组织者和参与者。曾在全国人大财经委员会和中国人民银行总行印制管理局工作。

龙涛先生：独立董事，硕士。现任海问投资咨询有限责任公司董事长、中央财经大学会计系副教授。曾在毕马威国际会计纽约分部从事审计和财务分析工作。

涂建先生：独立董事，学士。现任太平洋证券股份有限公司党委书记。曾任中国国际贸易促进委员会资产监督管理委员会资产管理中心主任。

滕天鸣先生：执行副总经理，硕士。曾任公司总经理助理和机构理财部总经理等。

王亚伟先生：副总经理，硕士。现任华夏大盘精选证券投资基金基金经理、华夏策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

张后奇先生：副总经理，博士。曾任公司总经理助理。

刘文动先生：副总经理，硕士。曾任公司总经理助理等。

吴志军先生：副总经理，学士。曾任上海分公司总经理、市场总监、公司总经理助理等。

方瑞枝女士：督察长，硕士。曾在中国金融出版社工作。

周伟明先生：监事，硕士。现任西南证券股份有限公司研究发展中心高级研究员、市场研究部经理、副总经理。曾任江苏联合信托投资有限公司研究发展部研究员、上海分部经理。

张鸣溪先生：监事，学士，中国注册会计师协会非执业会员。曾任北京证券有限责任公司投资银行部执行总经理、财务总监，华夏证券股份有限公司并购业务管理部常务副总经理、计划财务部副总经理、投资银行总部副总经理，中华会计师事务所注册会计师。

瞿颖女士：监事，硕士，中国注册会计师协会非执业会员。现任华夏基金管理有限公司稽核部总经理助理。曾就职于安永华明会计师事务所、泰康人寿保险公司。

2、本基金基金经理

方军先生，硕士。1999年加入华夏基金管理有限公司，历任研究员，华夏成长证券投资基金基金经理助理、兴华证券投资基金基金经理助理和华夏回报证券投资基金基金经理助理。现担任上证50交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2004年12月30日起任职）、中小企业板交易型开放式指数基金基金经理（2006年6月8日起任职）、华夏沪深300指数证券投资基金基金经理（2009年7月10日起任职）。

唐棕先生，美国卡耐基梅隆大学硕士。曾任美国匡拓资产管理公司（Quantal）组合经理。2007年10月加入华夏基金管理有限公司，历任数量分析师，现任中小企业板交易型开放式指数基金基金经理（2011年2月22日起任职）。

3、本公司投资决策委员会（投票投资）成员

范勇宏先生：华夏基金管理有限公司董事、总经理。

王亚伟先生：华夏基金管理有限公司副总经理，华夏大盘精选证券投资基金基金经理、华夏策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

刘文动先生：华夏基金管理有限公司副总经理、投资总监，华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）基金经理、华夏优势增长股票型证券投资基金基金经理、华夏盛世精选股票型证券投资基金基金经理。

程海泳先生：华夏基金管理有限公司总经理助理、投资副总监、股票投资部总经理，华夏复兴股票型证券投资基金基金经理。

巩怀志先生：华夏基金管理有限公司投资副总监、股票投资部副总经理，华夏优势增长股票型证券投资基金基金经理。

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9月17日
组织形式：股份有限公司
注册资本：贰仟叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆千元
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：尹东
联系电话：010-67595003

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股公司晋升恒生指数。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2011年3月31日，中国建设银行资产总额113，125.16亿元，较上年末增加5，021.99亿元，增长4.65%。2011年1季度，中国建设银行实现净利润472.33亿元，较上年同期增长34.23%；年化平均资产回报率1.71%，年化加权平均净资产收益率26.19%；利息净收入716.30亿元，较上年同期增长25.27%；净利差为2.58%，净利息收益率为2.69%，分别较上年同期提高0.28和0.30个百分点；手续费及佣金净收入231.54亿元，较上年同期增长37.29%。其中，结算、理财、电子银行、贷记卡及保理等重点产品快速增长，收入结构日趋合理。

中国建设银行在中国内地设有1.3万余个分支机构，并在香港、新加坡、法兰克福、约翰内斯堡、东京、首尔、纽约、胡志明市及悉尼设有分行，在莫斯科设有代表处，设立了湖北桃江建信村镇银行、浙江苍南建信村镇银行、安徽繁昌建信村镇银行、浙江青田建信华侨村镇银行、浙江武义建信村镇银行、陕西宁塞建信村镇银行、河北丰宁建信村镇银行、上海浦东建信村镇银行、苏州常熟建信村镇银行9家村镇银行，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、中德住房储蓄银行等多家子公司。全行已安装运行自动柜员机（ATM）39，874台，拥有员工313，867人，为客户提供全面的金融服务。

中国建设银行得到市场和业界的支持和广泛认可，2010年共获得100多个国内外奖项。本集团在英国《银行家》杂志公布的“全球商业银行品牌十强”列第二位，在“全球银行品牌500强”列第13位，并被评为2010年中国最佳银行；在美国《福布斯》杂志公布的“Interbrand2010年度最佳中国品牌价值排行榜”列第三位，银行业第一位；被《亚洲金融》杂志评为2010年度“中国最佳银行”；连续三年被香港《资本》杂志评为“中国杰出零售银行”；被中国红十字会总会授予“中国红十字杰出奉献奖章”。

中国建设银行总行设投资托管服务部，下设综合制度处、基金市场处、资产托管处、QFII托管处、基金核算处、基金清算处、监督稽核处和投资托管团队、涉外资产核算团队、养老金托管服务团队、养老金托管市场团队、上海备份中心等12个职能处室、团队，现有员工130余人。自2008年以来中国建设银行托管业务持续通过SAS70审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

（二）主要人员情况

杨新丰，投资托管服务部副总经理（主持工作），曾就职于中国建设银行江苏省分行、广东省分行、中国建设银行总行会计部、营运管理部，长期从事计划财务、会计结算、营运管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

纪伟，投资托管服务部副总经理，曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部，长期从事大客户的客户管理及服务工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

（三）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、QFII、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2011年6月30日，中国建设银行已托管195只证券投资基金。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。2010年初，中国建设银行被总部设于美国伦敦的《全球托管人》杂志评为2009年度“国内最佳托管银行”（Domestic Top Rated），并连续第三年被香港《财资》杂志评为“中国最佳次托管银行”。

三、相关服务机构

（一）销售机构

1、场内申购、赎回代理机构

（1）国泰君安证券股份有限公司
住所：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
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：400-888-8666

（2）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：400-888-8108
传真：010-65182261
联系人：权唐
网址：www.csc.com.cn

（3）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：齐晓燕
网址：www.guosen.com.cn
客户服务电话：95536

（4）招商证券股份有限公司
住所：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层
办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座40层
法定代表人：宫少林
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：400-888-8111，95565

（5）广发证券股份有限公司
住所：广州天河区天河北路183号大都会广场43楼
办公地址：广州天河北路大都会广场5、18、19、36、38、41和42楼
法定代表人：林治海
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

（6）中信证券股份有限公司
住所：广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦第A层
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
电话：010-60833722
传真：010-60833739
联系人：陈忠
网址：www.cs.ecitic.com
客户服务电话：95558

（7）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
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：顾伟国
电话：010-66568430
传真：010-66568536
联系人：田薇
网址：www.chinastock.com.cn
客户服务电话：400-888-8888

（8）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：021-962503，400-888-8001或拨打各城市营业网点咨询电话

（9）申银万国证券股份有限公司
住所：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：丁国荣
电话：021-54041654
传真：021-54033888
联系人：李清怡
网址：www.sywg.com
客户服务电话：95523，4008895523

（10）兴业证券股份有限公司
住所：福州市湖东路268号
办公地址：上海市浦东民生路1199弄五道口广场1号楼21层
法定代表人：兰荣
电话：021-38565785
传真：021-38565955
联系人：谢高得
网址：www.xyzq.com.cn
客户服务电话：400-888-8123

（11）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：胡运钊
电话：027-65799999
传真：027-85481100
联系人：李良
网址：www.95579.com
客户服务电话：95579，400-888-8999

（12）东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：牛冠兴
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：400-800-1001

（13）中信证券（浙江）有限责任公司
住所：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
法定代表人：沈强
电话：0571-87112510
传真：0571-86065161
联系人：丁思聪
网址：www.bigsun.com.cn
客户服务电话：0571-96598

（14）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：凤良志
电话：0551-2257012
传真：0551-2272100
联系人：祝丽萍
网址：www.gyzq.com.cn
客户服务电话：95578

（15）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：张志军
电话：022-28451861
传真：022-28451892
联系人：王兆权
网址：www.bhzq.com
客户服务电话：400-651-5988

（16）华泰证券股份有限公司
住所：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
电话：025-84457777-893
传真：025-84579879
联系人：程高峰
网址：www.htsc.com.cn
客户服务电话：95597

（17）中信万通证券有限责任公司
住所：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：青岛市东海西路28号
法定代表人：史洁民
电话：0532-85022026
传真：0532-85022026
联系人：丁韶燕
网址：www.zxwt.com.cn
客户服务电话：0532-96577

（18）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：高冠江
电话：010-63081000
传真：010-63080978
联系人：唐静
网址：www.cindasc.com
客户服务电话：400-800-8899

（19）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
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

（20）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：徐浩明
电话：021-22169081
传真：021-22169134
联系人：刘晨
网址：www.ebscn.com
客户服务电话：10108998，95525

（21）南京证券有限责任公司
住所：南京市鼓楼区大钟亭8号
办公地址：南京市鼓楼区大钟亭8号
法定代表人：张华东
客户服务电话：025-83364032
传真：025-83364032
联系人：石健
网址：www.njzq.com.cn

（22）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：蒋元真
电话：021-51539888
传真：021-65217206
联系人：谢秀峰
网址：www.962518.com
客户服务电话：021-962518

（23）国联证券股份有限公司
住所：江苏省无锡市县前东街168号
办公地址：江苏省无锡市县前东街168号国联大厦6-8楼
法定代表人：雷建辉
电话：0510-82831662
传真：0510-82830162
联系人：徐欣
网址：www.glsc.com.cn
客户服务电话：400-888-5288

（24）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
办公地址：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
电话：0755-22626172
传真：0755-82400862
联系人：周璐
网址：www.pingan.com
客户服务电话：400-881-6168

（25）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：张雅锋
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

（26）国都证券有限责任公司
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：常喆
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

（27）东海证券有限责任公司
住所：江苏省常州市延陵西路23号投资广场18-19楼
办公地址：江苏省常州市延陵西路23号投资广场18-19楼
法定代表人：朱科敏
电话：0519-88157761
传真：0519-88157761
联系人：李涛
网址：www.longone.com.cn
客户服务电话：400-888-8588

（28）华西证券有限责任公司
住所：四川省成都市陕西街239号
办公地址：四川省成都市陕西街239号
法定代表人：胡关金
电话：028-86126218
传真：028-86155733
联系人：王京红
网址：www.hx168.com.cn
客户服务电话：400-888-8818

（29）宏源证券股份有限公司
住所：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
法定代表人：冯戎
电话：010-88085201
传真：010-88085195
联系人：李巍
网址：www.hysec.com
客户服务电话：400-800-0562

（30）齐鲁证券有限公司
住所：济南市市中区经七路86号
办公地址：济南市市中区经七路86号23层2316
法定代表人：李玮
电话：0531-68889155
传真：0531-68889752
联系人：吴阳
网址：www.qlzq.com.cn
客户服务电话：95538

（31）第一创业证券有限责任公司
住所：深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25层
办公地址：深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25层
法定代表人：刘学民
电话：0755-25832494
传真：0755-25831718
联系人：王立洲
网址：www.fcsc.cn
客户服务电话：0755-25832523

（32）中航证券有限公司
住所：南昌市抚河北路291号
办公地址：南昌市抚河北路291号
法定代表人：杜航
电话：0791-6768763
传真：0791-6789414
联系人：余雅娜
网址：www.avicsec.com
客户服务电话：400-886-6567

（33）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：上海市肇嘉浜路750号
法定代表人：王文学
电话：021-64316962
传真：021-64333051
联系人：黄旭成
网址：www.cfsc.com.cn
客户服务电话：021-32109999，029-68918888

（34）中国建银投资证券有限责任公司
住所：深圳福田区益田路与福华三路交界处深圳国际商会中心48-50层
办公地址：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层至20层
法定代表人：杨小阳
电话：0755-82026521
传真：0755-82026539
联系人：刘权
网址：www.cjis.cn
客户服务电话：400-600-8008

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12层
法定代表人：王东明
客户服务电话：400-818-6666
传真：010-63136700
联系人：吴志军
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：王洪章
客户服务电话：95533
传真：010-66275654
联系人：王琳
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：金颖
联系人：严峰、朱立元
联系电话：0755-25946013，010-59378839
传真：010-59378907

（三）律师事务所

名称：北京市德恒律师事务所
住所：北京市西城区金融大街19号富凯大厦B座十二层
办公地址：北京市西城区金融大街19号富凯大厦B座十二层
负责人：王丽
联系电话：010-52682888
传真：010-52682999
联系人：李永飞
经办律师：李永飞、戴钦公

（四）会计师事务所

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1318号星展银行大厦6楼
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
联系电话：021-23238888
传真：021-23238800
联系人：单峰
经办注册会计师：汪棣、单峰

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）投资管理体制

本基金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；基金经理负责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。

（三）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、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、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。

（四）行生品投资

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的，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

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设银行根据本基金合同规定，于2011年10月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至2011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

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	4，505，342，589.51	98.69
	其中：股票	4，505，342，589.51	98.69
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	58，084，009.34	1.27
6	其他各项资产	1，646，521.99	0.04
7	合计	4，565，073，120.84	100.00

注：股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

（二）报告期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	148，398，702.96	3.26
B	采掘业	146，141，150.65	3.21
C	制造业	2，802，673，726.19	61.51
C0	食品、饮料	310，330，294.94	6.81
C1	纺织、服装、皮毛	131，625，182.80	2.89
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	54，993，736.73	1.21
C4	石油、化学、塑胶、塑料	436，138，518.47	9.57
C5	电子	382，703，659.53	8.40
C6	金属、非金属	129，530，188.85	2.84
C7	机械、设备、仪表	812，757，704.19	17.84
C8	医药、生物制品	492，495，231.88	10.81
C99	其他制造业	52，099，208.80	1.14
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	154，722，364.38	3.40
F	交通运输、仓储业	44，703，154.92	0.98
G	信息技术业	339，327，735.76	7.45
H	批发和零售贸易	560，374，201.22	12.30
I	金融、保险业	137，362，712.32	3.01
J	房地产业	74，556，263.05	1.64
K	社会服务业	55，195，556.94	1.21
L	传播与文化产业	41，887，021.12	0.92
M	综合类	-	-
	合计	4，505，342，589.51	98.88

（三）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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002024	苏宁电器	42，538，102	442，821，641.82	9.72
2	002304	洋河股份	1，761，557	239，571，752.00	5.26
3	002422	科伦药业	1，995，995	116，785，667.45	2.56
4	002202	金风科技	11，522，225	114，530，916.50	2.51
5	002142	宁波银行	12，249，958	113，679，610.24	2.50
6	002073	软控股份	6，054，049	110，062，610.82	2.42
7	002155	辰州矿业	3，658，107	96，244，795.17	2.11
8	002106	莱宝高科	3，610，298	88，993，845.70	1.95
9	002001	新和成	3，810，868	83，267，465.80	1.83
10	002038	双鹭药业	2，551，778	82，550，018.30	1.81

（四）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。

（五）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。

（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。

（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五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

（八）投资组合报告附注

1、报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2、基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

3、期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1，334，123.63
2	应收证券清算款	283，512.32
3	应收股利	-
4	应收利息	13，761.90
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	15，124.14
8	其他	-
9	合计	1，646，521.99

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

6、投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

十二、基金的业绩

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。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持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

阶段	净值增长率①	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
2006年6月8日至2006年12月31日	19.40%	0.98%	21.08%	1.47%	-1.68%	-0.49%
2007年1月1日至2007年12月31日	149.25%	2.23%	153.17%	2.29%	-3.92%	-0.06%
2008年1月1日至2008年12月31日	-52.62%	2.88%	-54.16%	3.02%	1.54%	-0.14%
2009年1月1日至2009年12月31日	94.19%	2.00%	96.64%	2.06%	-2.45%	-0.06%
2010年1月1日至2010年12月31日	20.71%	1.72%	21.26%	1.76%	-0.55%	-0.04%
2011年1月1日至2011年9月30日	-26.78%	1.38%	-26.92%	1.35%	0.14%	0.03%

十三、费用概览

（一）基金运作费用

1、基金费用的种类

基金运作过程中，从基金财产中支付的费用包括：

（1）基金管理人的管理费。
（2）基金托管人的托管费。
（3）基金上市初费及年费。
（4）基金的证券交易费用。
（5）基金财产拨划支付的银行费用。
（6）基金收益分配中发生的费用。
（7）基金合同生效后的信息披露费用。
（8）基金份额持有人大会费用。
（9）基金合同生效后的会计师费和律师费。
（10）按照国家有关规定可以在基金财产中列支的其他费用。

上述基金费用由基金管理人在法律法规规定的范围内按照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

2、基金费用的费率、计提标准、计提方式与支付方式

（1）基金管理人的管理费

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的0.5%年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.5%÷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。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于