上证中央企业50交易型开放式指数证券投资基金更新的招募说明书摘要

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司

二〇一一年九月

重要提示

本基金经中国证券监督管理委员会2009年6月26日证监许可〔2009〕577号文核准募集。本基金的基金合同于2009年8月26日正式生效。

投资有风险,投资人认购(或申购)基金时应认真阅读招募说明书。基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写,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。

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作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,投资者在投资本基金前,应全面了解本基金的产品特性,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、个别证券特有的非系统性风险、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。本基金属于股票型基金,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,主要采用完全复制策略,跟踪标的指数市场表现,目标为获取市场平均收益,是股票基金中处于中等风险水平的基金产品。本基金初始募集净值1元。在市场波动因素影响下,本基金净值可能低于初始面值,本基金投资者有可能出现亏损。

基金管理人管理的其它基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。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。

本招募说明书所载内容截止日为2011年8月25日,有关财务数据和净值表现数据截止日为2011年6月30日。

一、基金管理人

(一)基金管理人概况

1、基金管理人基本情况

名称:工银瑞信基金管理有限公司

住所:北京市西城区金融大街丙17号北京银行大厦

办公地址:北京市西城区金融大街丙17号北京银行大厦8层

邮政编码:100140

法定代表人:李晓鹏

成立日期:2005年6月21日

批准设立机关:中国证监会

批准设立文号:中国证监会证监基金字〔2005〕93号

中国银监会银监复〔2005〕105号

组织形式:有限责任公司

注册资本:贰亿元人民币

联系人:朱碧艳

联系电话:010-5869 8918

股权结构:中国工商银行股份有限公司占公司注册资本的55%;瑞士信贷占公司注册资本的25%;中国远洋运输(集团)总公司占公司注册资本的20%。

存续期间:持续经营

(二)主要人员情况

1.董事会成员

李晓鹏先生:董事长,经济学博士。自2005年10月起任中国工商银行股份有限公司副行长。1984年加入中国工商银行,2004年9月任中国工商银行副行长,曾任中国工商银行河南省分行副行长、总行营业部总经理、四川省分行行长、中国华融资产管理公司副总裁、中国工商银行行长助理兼北京市分行行长等职。目前兼任中国工商银行(阿拉木图)股份公司董事长、中国工商银行(中东)有限公司董事长、工银金融租赁有限公司董事长、中国城市金融学会副会长、中国农村金融学会副会长、中国银行业协会金融租赁专业委员会主任和行业发展研究委员会主任。

Neil Harvey先生:董事。瑞士信贷董事总经理,长驻香港工作,负责资产管理部的环球新兴市场及亚太区市场业务,是资产管理部的全球管理委员会成员并兼任瑞士信贷亚太地区执行委员会成员。2010年重返瑞士信贷工作,在此之前任职于复兴集团(Renaissance Group),最后担任复兴集团的副首席执行官及全球主席。在2006年加盟复兴集团之前,Harvey先生合作创立了以亚太地区市场为主的多策略对冲基金——Bennelong资产管理公司。Harvey先生1993年初次加入瑞士信贷香港公司。他在任的十年间,分别在投资银行业务方面担任了多种不同的职务,涉足多个区域。他离任前是香港投资银行部和客户拓展业务的负责人。此外,他创立并管理了瑞士信贷在亚洲(除日本)的固定收益业务,并担任了多个领导职务,包括新兴市场固定收益分配全球负责人,管理中东、非洲、土耳其和拉丁美洲的业务。

David Peter Walker先生:独立董事,1978年至1983年任职于J.P.Morgan,负责跨国企业的资金管理咨询研究的推广及进行,以及推广及执行债务融资;1983年至1990年任职于Bankers Trust,先后担任资本市场部发起成员、执行董事及美国资本市场部主管、负责亚太区(日本除外)的银行及证券业务;1990年至2003年5月,任职于瑞士信贷第一波士顿,担任执行董事、证券产品业务主管、投资银行部主管等职;2003年6月至今,成立物业发展业务公司,并兼任几家美国公司的董事。

陈晓燕女士:董事,学士。1982-1984年任职于中国人民银行会发局。1984-1986年任中国工商银行会计部营业处处长。1986-1998年任中国工商银行会计部副主任。1998-1999年任中国工商银行银行卡部主任。1999-2001年任中国工商银行资金营运部总经理。2001年1月至2009年7月任中国工商银行个人金融业务部总经理。2009年7月至今任中国工商银行资产业务总监兼资产管理部总经理。

刘国恩先生:独立董事,经济学博士,北京大学光华管理学院经济学教授,北大光华卫生经济与管理研究院执行院长,北京大学中国医药经济研究中心主任,博士生导师。曾执教美国南加利福尼亚大学(1995-1999)、美国北卡大学(2000-2006,获终身教职);曾担任中国留美经济学会2004-2005届主席以及国际医药经济学会亚太联合会主席。目前担任国务院城镇居民医疗保险试点评估专家组成员等职,同时承担了包括国家发改委、世界银行等直接立项资助的重大课题。

牛大鸿先生:独立董事,博士。1995-2000年ASIAN MERCHANTS PTE LTD副总经理、总经理。1999-2000年MERCHANTS HOLDINGS (SINGAPORE) PTE LTD副总裁(能)。2000年至今PHQ HOLDINGS (SINGAPORE) PTE LTD执行总裁。

蔡昀先生:董事,学士。1990-1993年任职于中远总公司审计处。1993-1994年任职于中远(集团)总公司审计处。1994-1996年任职于中远英国公司。1996-1998年任中远(集团)总公司监督部审计室副主任。1998-1999年任中远(集团)总公司监督部审计处处长。1999-2006年任中远美国公司副总经理。2006年11月至今任中远(集团)总公司财务部副总经理。

赵跃女士:董事,硕士。1987-1994年在中国工商银行信托投资公司工作。1994-1998年在工商国际金融有限公司工作,1998.01-1998.09任工商国际金融有限公司常务董事、副总经理。1998-2002年任中国工商银行证券基金托管部总经理。2002-2004年任中国工商银行资产托管部副总经理(总经理级)。2004年至今任中国工商银行养老金业务部(职业年金中心)总经理。

郭特华女士:董事,总经理,博士。1989-1998年中国工商银行总行商业信贷部、资金计划部副处长,1998-2005年中国工商银行总行资产托管部历任处长、副总经理。

2. 监事会成员

张薇先生:监事会主席,博士。1997.5-1998.8任中国工商银行浙江省分行行长、党组书记。1998.8-2000.11任中国工商银行广东省分行行长、党委书记。2000.11-2005.10中国工商银行副行长、党委委员。2005.10-2008.5年任中国工商银行股份有限公司副行长、党委委员。

Sarah Pearson女士:监事,法学学士,拥有英格兰、香港和澳大利亚(新南威尔士州)的执业事务律师资格。现任瑞士信贷董事总经理兼首席运营官,负责亚太区及全球新兴市场的资产管理业务。Pearson女士于1994年加盟伦敦瑞士信贷金融产品(Credit Suisse Financial Products),1996年至2010年年中曾先后派驻香港、新加坡、东京和悉尼。出任现有职务前,Pearson女士曾任亚太区区域总顾问六年,并在2006年至2010年期间担任瑞士信贷澳洲區首席运营官以及亚太区副信誉风险核准人。加入瑞士信贷之前,Pearson女士曾在高伟绅律师事务所的伦敦银行部门担任事务律师。

王妍敏女士:监事,硕士,会计师。1997.08-1999.04中远(集团)总公司资产管理中心员工。1999.04-2009.02中远(集团)总公司监督部员工。2009.02至今任中远(集团)总公司监督部财务审计室副经理。2010年7月起兼任中远慈善基金会监事。

江玥波先生:11年证券从业经验;曾任鹏华基金普天债券基金经理、固定收益负责人;2004年6月至2006年12月,担任全国社保基金二零四组合和三零四组合基金经理;2006年加入工银瑞信,现任固定收益投资总监,2008年4月14日至今,担任工银瑞信信用添利基金基金经理,2011年2月10日至今,担任工银瑞信四季收益基金基金经理。

刘坤女士:监事,硕士,中国注册会计师协会会员、英国特许公认会计师公会会员。2002年至2007年,任职于华安基金管理有限公司北京分公司,担任高级经理;2000年至2002年,任职于环球太阳海网络电视有限公司,担任高级财务经理;1998年至2000年,任职于北京东方龙马系统集成有限公司,担任财务经理。1995年至1998年,任职于北京康拓科技开发集团总公司,担任主管会计。1991年至1994年,任职于北京康捷电子工程有限公司,担任主管会计。2007年11月加入工银瑞信基金管理有限公司。2011年6月起担任财务部副总监。

3.其他高级管理人员

朱碧艳女士:督察长,硕士,国际注册内部审计师。1997-1999年中国华融信托投资公司证券总部经理,2000-2005年中国华融资产管理公司投资银行部、证券业务部高级副经理。

夏洪彬先生:副总经理,工商管理硕士。1999年至2003年任职于瑞士信贷资产管理公司,历任高级风险分析师、副总裁;2003年至2005年,任职于瑞士信贷第一波士顿,曾担任CSFB/Tremont对冲基金指数的数量分析员、基金经理、副总裁。2006年加入瑞士信贷集团资产管理部,历任副总裁、董事。

肖在翔先生:副总经理,毕业于中国社会科学院研究生院。1980年至1982年任职于中国人民银行,1984年至2007年任职于中国工商银行,历任储蓄部储蓄业务处处长、零售业务部副总经理,个人金融业务部副总经理。

4.本基金基金经理

何江先生,6年证券从业经验:先后在北京方速信融科技有限公司担任高级分析师、金诚信用评估有限公司担任分析师;2005年加入工银瑞信,曾任风险管理部投资风险管理业务主管,2011年5月25日至今担任工银沪深300基金、工银上证央企ETF基金、工银深证红利ETF基金、工银深证红利ETF联接基金的基金经理。

本基金历任基金经理

胡文彪先生,2009年8月26日至2011年2月10日管理本基金。

樊智先生,2009年9月8日至2011年7月14日管理本基金。

5.投资决策委员会成员

郭特华女士,投资决策委员会主任,简历同上。

何江旭先生,14年证券从业经验:曾担任国泰基金金鑫、基金金鼎、金马稳健回报、金鹰增长以及金牛创新成长基金的基金经理,基金管理部总监兼权益投资副总监;2009年加入工银瑞信,现任权益投资总监;2010年4月12日至今,担任工银核心价值基金基金经理;2011年4月21日至今,担任工银消费服务行业基金的基金经理。

江玥波先生,简历同上。

陈超先生,首席经济学家,毕业于中国人民银行研究生部,获经济学博士学位。2000年8月至2005年2月,任职于中国人民银行,担任主任科员。2005年2月至2007年9月,任职于中央汇金投资有限责任公司,担任副主任。2007年9月至2009年10月,任职于中国投资有限责任公司,担任高级经理。2009年10月,加入工银瑞信基金管理有限公司,担任首席经济学家。

曹冠业先生,10年证券从业经验,CFA、FRM:先后在东方汇理担任结构基金和亚太股票基金经理,香港恒生投资管理公司担任香港中国股票和QFII基金投资经理;2007年加入工银瑞信,现任权益投资部总监;2007年11月29日至2009年5月17日,担任工银核心价值基金基金经理;2008年2月14日至2009年12月25日,担任工银全球基金基金经理;2009年5月18日至今,担任工银成长基金基金经理。

郝琪先生,16年证券从业经验:先后在首源投资管理公司担任基金经理,联和远通投资顾问管理公司担任执行董事,北京博动科技有限责任公司担任执行董事和财务总监;2007年加入工银瑞信,现任国际业务总监;2008年2月14日至今,担任工银全球基金基金经理。

杜海涛先生,14年证券从业经验:先后在宝盈基金管理有限公司担任基金经理助理,招商基金管理有限公司担任招商现金增值基金基金经理;2006年加入工银瑞信,现任固定收益部总监;2006年9月21日至2011年4月21日,担任工银货币市场基金基金经理;2007年5月11日至今,担任工银增强收益债券型基金基金经理;2010年8月16日至今,担任工银双利债券型基金基金经理;2011年8月10日至今,担任工银瑞信添顺债券型基金基金经理。

杨军先生,14年证券从业经验:先后在广发基金管理有限公司担任投资经理,长城基金管理有限公司担任基金经理;2010年加入工银瑞信基金管理有限公司;2010年5月18日至今,担任工银红利基金基金经理。

宋炳珅先生,7年证券从业经验:曾任中信建投证券有限公司研究员;2007年加入工银瑞信,现任研究部副总监。

上述人员之间均不存在近亲属关系。

(三)基金管理人的职责

1. 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售、申购、赎回和登记事宜;
2. 办理基金备案手续;
3. 对所管理的不同基金资产分别管理、分别记账,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. 编制中期和年度基金报告;
7. 计算并公告基金资产净值,确定基金份额申购、赎回价格;
8. 办理与基金资产管理业务活动有关的信息披露事项;
9. 召集基金份额持有人大会;
10. 保存基金资产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料;
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者实施其他法律行为;
12. 国务院证券监督管理机构规定的其他职责。

(四)基金管理人承诺

1.本基金管理人将根据基金合同的规定,按照招募说明书列明的投资目标、策略及限制等全权处理本基金的投资。

2.本基金管理人不从事违反《证券法》的行为,并建立健全内部控制制度,采取有效措施,防止违反《证券法》行为的发生。

3.本基金管理人不从事违反《基金法》的行为,并建立健全内部控制制度,采取有效措施,保证本基金财产不用于下列投资或者活动:

①承销证券;

②向他人贷款或者提供担保;

③从事承担无限责任的投资;

④买卖其他基金份额,但是国务院另有规定的除外;

⑤向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券;

⑥买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券;

⑦从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;

⑧聚拢法律、行政法规有关规定,由中国证监会规定禁止的其他活动;

⑨法律法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,则本基金投资不再受相关限制。

4.本基金管理人将加强人员管理,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、勤勉尽责、不从事以下行为:

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牟取利益;

④向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失;

⑤其它法律法规以及国务院证券监督管理机构禁止的行为。

5.基金经理承诺

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利益。

②不利用职务之便为自己、被代理人、被代表人、受雇人或任何其他第三人谋取不当利益。

③不泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密以及尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息。

④不以任何形式为除基金管理人以外的其他组织或个人进行证券交易。

(四)基金管理人的内部控制制度

1.内部控制的原则

①健全性原则。内部控制应当包括公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员,并涵盖到决策、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,维护内控制度的有效执行。

③独立性原则。基金管理人各机构、部门和岗位职责应当保持相对独立,基金管理人基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离。

④相互制约原则。基金管理人内部部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡。

⑤成本效益原则。基金管理人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。

2.内部控制的主要内容

①控制环境

董事会下设公司治理与风险控制委员会,负责对公司治理结构进行定期的评估、检验,提出对公司治理结构的修改和完善方案,对公司经营管理和基金投资业务进行风险管理和合规性控制,对公司内部稽核审计工作结果进行审查和监督并向董事会报告;董事会下设资格审查与薪酬委员会,负责对股东推荐的董事人选资格、高级管理人员资格、独立董事资格进行审查,拟定董事、监事、高级管理人员薪酬和激励政策,报股东会或董事会批准。

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战略,为了有效贯彻公司董事会制定的经营方针及发展战略,总经理下设执行委员会,负责公司日常经营管理活动中的重要决策,执行委员会下设投资决策委员会和风险管理委员会,就基金投资和风险控制等发表专业意见及建议,投资决策委员会是基金的最高投资决策机构。

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,发现重大风险事件时向公司董事会和中国证监会报告。

②风险评估

a.董事会下属的公司治理与风险控制委员会和督察长对公司内外部风险进行评估;

b.执行委员会下属的风险管理委员会负责对公司经营管理中的重大突发性事件和重大危机情况进行评估,制定危机处理方案并监督实施;负责对基金投资和运作中的重大问题和重大事项进行风险评估;

c.各级部门负责对职责范围内的业务所面临的风险进行识别和评估。

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、资产分离等政策、程序或措施。

控制活动体现为: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、授权制度、资产分离制度等,在相关部门和相关岗位之间建立重要业务处理凭据传递和信息沟通制度,后续部门及岗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合规部对各岗位、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。

④信息与沟通

公司建立双向的信息交流途径,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。公司根据组织架构和授权制度,建立了清晰的业务报告系统。

⑤内部监控

内部监控由公司治理与风险控制委员会、督察长、风险管理委员会和法律合规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合规部,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

①基金管理人确知建立、实施和维持内部控制制度是本公司董事会及管理层的责任;

②上述关于内部控制的披露真实、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)基金托管人概况

1.基本情况

名称:招商银行股份有限公司(以下简称"招商银行")

设立日期:1987年4月8日

注册地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦

办公地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦

注册资本:215.77亿元

法定代表人:傅育宁

行长:马蔚华

资产托管业务批准文号:中国证监会证监基字〔2002〕83号

电话:0755—83199084

传真:0755—83195201

资产托管部信息披露负责人:张燕

三、相关服务机构

(一)基金份额发售机构

1.申购赎回代理券商(简称"一级交易商")

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

法定代表人:祝幼一

电话:021-38676666

传真:021-38670666

联系人:韩星宇

网址:www.gtja.com

客户服务电话:021-962588、400-888-8666

②中信建投证券有限责任公司

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:张佑君

客户服务电话:400-888-8108

传真:010-65182261

联系人:权唐

网址:www.csc108.com

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16层至26层

办公地址:深圳市罗湖区红岭中路1010号国际信托大厦9层

法定代表人:何如

电话:0755-82130833

传真:0755-82133302

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:林生迎

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:广州市天河北路183号大都会广场43楼

办公地址:广东广州天河北路大都会广场18、19、36、38、41和42楼

法定代表人:王志伟

电话:020-87555888

传真:020-87555417

联系人:黄凤

网址:www.gf.com.cn

客户服务电话:95575或致电各营业网点

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:北京朝阳区新源南路6号京城大厦

法定代表人:王东明

电话:010-84588266

传真:010-84865560

联系人:陈忠

网址:www.cs.ecitic.com

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华泰联合证券有限责任公司

住所:深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第五层

办公地址:深圳市福田中心区中心广场香港中旅大厦第5层、17层、18层、24层、25层、26层

法定代表人:马昭明

电话:0755-82492000

传真:0755-82492962

联系人:盛宗凌

网址:www.lhzq.com

客户服务电话:95513、400-888-8555

⑩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:021-54033888

传真:021-54030294

联系人:李清怡

网址:www.sw2000.com.cn

客户服务电话:021-962505

⑪兴业证券股份有限公司

住所:福建省福州市湖东路99号标力大厦

办公地址:福建省福州市湖东路99号标力大厦

法定代表人:兰荣

电话:021-68419974

传真:021-68419867

联系人:谢高得

网址:www.xyzq.com.cn

客户服务电话:021-68419393转1098

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:胡运钊

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或4008-888-999

⑬天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

⑭中信金通证券有限责任公司

住所:浙江省杭州市中河南路11号万凯庭院商务楼A座

办公地址:浙江省杭州市中河南路11号万凯庭院商务楼A座

法定代表人:刘军

电话:0571-85783715

传真:0571-85783771

联系人:王勤

网址:www.bigsun.com.cn

客户服务电话:0571-96598

⑮万联证券股份有限公司

注册地址:内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号邮编010010

办公地址:内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号邮编010010

法定代表人:刘汝军

电话:0471-4913998

传真:0471-4930707

联系人:常向东

客户服务电话:0471-4961259

网址:www.cnht.com.cn

⑯国元证券股份有限公司

住所:合肥市寿春路179号

办公地址:合肥市寿春路179号

法定代表人:凤良志

电话:0551-2207938

传真:0551-2634400-1171

联系人:祝丽萍

网址:www.gyzq.com.cn

客户服务电话:全国:400-888-8777、安徽地区:96888

⑰渤海证券股份有限公司

注册地址:天津市经济技术开发区第二大街42号写字楼101室

办公地址:天津市南开区宾水西道8号

法定代表人:杜庆平

联系人:王兆权

联系电话:022-28451861

传真:022-28451892

客户服务电话:400-6515-988

网址:www.bhzq.com

⑱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:程商峰

网址:www.htsc.com.cn

客户服务电话:400-888-8168、025-84579897

⑲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:丁凝燕

网址:www.zxwt.com.cn

客户服务电话:0532-96577

⑳东方证券股份有限公司

住所:上海市中山南路318号2号楼22层-29层

办公地址:上海市中山南路318号2号楼22层-29层

法定代表人:王益民

电话:021-63325888

传真:021-63326173

联系人:吴宇

网址:www.dfzq.com.cn

客户服务电话:95503

㉑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:021-22169089

传真:021-22169134

联系人:李芳芳

网址:www.ebscn.com

客户服务电话:10108998、400-888-8788

㉒长城证券有限责任公司

注册地址: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

联系人:匡婷

电话:0755-83516289

传真:0755-83516199

客户服务热线:0755-33680000、400 6666 888

长城证券网站:www.cc168.com.cn

㉓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:谢秀珠

网址:www.962518.com

客户服务电话:021-962518

㉔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

㉕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

法人代表: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

㉖中航证券有限公司

注册地址:南昌市抚河北路291号

法定代表人:姚江涛

联系人:戴蕾

电话:0791-6794744

传真:0791-6789414

客户服务热线:0791-6781119

公司网站:www.avicsec.com

㉗长江证券股份有限公司

办公(注册)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

组织形式:股份有限公司

客服电话:400-666-1618

联系人:张治国

联系电话:0351-8686703

网址:www.i618.com.cn

㉘广州证券有限责任公司

注册地址:广州市先烈中路69号东山广场主楼五楼

办公地址:广州市先烈中路69号东山广场主楼五楼、17楼

法定代表人: 吴志明

电话:020-87322668

传真:020-87325036

联系人:樊剛正

客户服务电话: 020-961303

网址:www.gzs.com.cn

㉙华龙证券有限责任公司

注册(办公)地址:甘肃省兰州市静宁路308号

法定代表人:李晓安

联系人:李昕田

联系电话:0931-4890100

传真:0931-4890118

客服电话:0931-4890100、4890619、4890618

公司网址:www.hlzqgs.com

㉚东北证券股份有限公司

注册地址:长春市自由大路1138号

办公地址:长春市自由大路1138号

法定代表人:矫正中

联系人: 潘衡

电话:0431-85096709

客户服务电话:4006000686

网址:www.nesc.cn

㉛信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(100007)

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(100007)

法定代表人:王少华

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

㉜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

法人代表: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:021-52574550、0519-88166222、0379-64902266、400-888-8588

㉝宏源证券股份有限公司

注册地址:新疆乌鲁木齐文艺路233号宏源大厦

办公地址:北京海淀区西直门北大街甲43号金运大厦B座

法定代表人:汤世生

联系人:李巍

联系电话:010-88085338

传真:010-88085240

公司网站:www.hysec.com

客服电话:4008-000-562

㉞齐鲁证券有限公司

住所:山东省济南市经十路128号

办公地址:山东省济南市经十路128号

法定代表人:李玮

电话:0531-81283906

传真:0531-81283900

联系人:吴阳

网址:www.qlmz.com.cn

客户服务电话:95538

㉟德邦证券有限责任公司

住所:上海市普陀区曹杨路510号南半幢9楼

办公地址:上海市福山路500号城建大厦26楼

法定代表人:方加春

电话:021-68761616

传真:021-68767981

联系人:罗芳

网址:www.tebon.com.cn

客户服务电话:400-888-8128

㊱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

㊲西藏同信证券有限责任公司

住所:拉萨市北京中路101号

办公地址:上海市永和路118弄东方企业园24号

法定代表人:贾绍君

电话:021-36533016

传真:021-36533017

联系人:王伟光

网址:www.xzsec.com

客户服务电话:400-881-1177

㊳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

联系人:黄英

联系电话:010-66555835

传真:010-66555246

公司网站:www.dxzq.net.cn

㊴万正证券有限责任公司

注册地址:湖南长沙芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层

办公地址:湖南长沙芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层

法定代表人:雷杰

联系人:彭博

联系电话:0731-85832343

客服电话:95571

公司网址:www.foundersc.com

㊵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至10层

法定代表人:黄金琳

联系人:张腾

联系电话:0591-87383623

业务传真:0591-87383610

统一客户服务电话:96326(福建省外请先拨0591)。

公司网址:www.hfzq.com.cn

㊶西南证券股份有限公司

注册地址:重庆市渝中区临江支路2号合景国际大厦A幢

法人代表:王珠林

联系人:徐雅筠

联系电话:023-63786060

传真:023-63786215

客服电话:4008096096

公司网址:www.swsc.com.cn

㊷信达证券股份有限公司

注册地址:北京市西城区三里河东路5号中商大厦10层

办公地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼信达金融中心

法定代表人:高冠江

联系人:唐静

联系电话:010-63081000

传真:010-63080978

客服电话:400-800-8899

公司网址:www.cindasc.com

㊸红塔证券股份有限公司

地址:云南省昆明市北京路155号附1号红塔大厦9楼

法定代表人:况雨林

客服电话:0871-3577930

联系人:刘晓明

电话:0871-3577942

㊹华宝证券有限责任公司

注册地址:上海市陆家嘴环路166号未来资产大厦23层

法定代表人: 陈林

组织形式:有限责任公司

客户服务电话:4008209898

公司网站: http://www.cnhbstock.com/

2.二级市场交易代理券商

包括具有经纪业务资格及上海证券交易所会员资格的所有证券公司。

3.基金管理人可根据《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》、《证券投资基金销售管理办法》和本基金基金合同等的规定,选择其他符合要求的机构代理销售本基金,并及时履行公告义务。

(二)登记结算机构

名称:中国证券登记结算有限责任公司

地址:北京市西城区太平桥大街17号

法定代表人:陈耀先

联系人:刘永卫

电话:(021)58872625

传真:(021)68870311

(三)律师事务所及经办律师

名 称:北京市德恒律师事务所

住 所:北京市西城区金融街19号富凯大厦B座十二层

办公地址:北京市西城区金融街19号富凯大厦B座十二层

负责人:王丽

电 话:(010)66575888

传 真:(010)65232181

经办律师:徐建军、李晓明

(四)会计师事务所及经办注册会计师

名 称:安永华明会计师事务所

住 所:北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城,东三办公楼16层

办公地址:北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城,东三办公楼16层

法定代表人:葛明

经办注册会计师:王静、王珊珊

联系电话:(010)58152145

传真:(010)58114645

联系人:王珊珊

四、基金的名称

本基金名称:工银瑞信上证中央企业50交易型开放式指数证券投资基金

五、基金的类型

本基金类型:交易型开放式指数证券投资基金

六、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的最小化,实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。

七、基金的投资方向

本基金主要投资于标的指数成份股票、备选成份股票,一般市场新发股票、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中,基金投资于标的指数成份股票及备选成份股票的比例不低于基金资产净值的90%,但因法律法规的规定而受限制的情形除外。

八、基金的投资策略

本基金主要采取完全复制策略,跟踪标的指数的表现,即按照标的指数的成份股票的构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票及其权重的变动进行相应调整。基金投资于标的指数成份股票及备选成份股票的比例不低于基金资产净值的90%。

在一般情形下,本基金将根据标的指数的成份股票的构成及其权重构建股票资产投资组合,但在特殊情况下,本基金可以选择其它证券或证券组合对标的指数中的股票加以替换,这些情况包括但不限于以下情形:①法律法规的限制;②标的指数成份股流动性严重不足;③标的指数的成份股票长期停牌;④其它合理原因导致本基金管理人对标的指数的跟踪构成严重制约等。

在正常情况下,本基金对标的指数的跟踪目标是:力争使得基金日收益率与业绩比较基准日收益率偏离度的年度平均值不超过0.2%,偏离度年化标准差不超过2%。

1.股票资产日常投资组合管理

①投资组合的建立

基金管理人构建投资组合的过程主要分为三步:确定目标组合、确定建仓策略和组合调整。

1.确定目标组合:根据复制标的指数成份股及其权重的方法确定目标组合。

2.确定建仓策略:根据对成份股流动性、公司行为等因素的分析,确定合理的建仓策略。

3.组合调整:根据复制法确定目标组合之后,在合理时间内采用适当的手段调整实际组合直至达到跟踪指数要求。

②投资组合日常管理

1.根据标的指数构成及权重,结合基金当前持有的证券组合及其比例,制作下一交易日基金的申购赎回清单并公告。

2.将基金持有的证券组合构成与标的指数进行比较,制定目标组合构成及权重,确定合理的交