

银瑞信睿智深证100指数分级证券投资基金更新的招募说明书摘要

(2015年第1号)

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司 基金托管人:中国民生银行股份有限公司

重要提示

工银瑞信睿深100指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证监会基金部备案,于2015年6月17日(关于核准工银瑞信睿深100指数分级证券投资基金募集的批复)(证监基金字[2015]1122号文)核准公开募集,本基金基金合同于2015年10月25日正式生效。

投资有风险,投资者申购基金前应仔细阅读本招募说明书。基金过往业绩并不预示其未来表现,基金管理人不对基金业绩做出任何实质性承诺。基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产,但不保证基金本金,也不保证投资收益,基金管理人不能保证基金一定盈利,也不保证最低收益。本招募说明书所载内容截止日为2015年4月24日,有关财务数据和净值表现数据截止日为2015年3月31日(财务数据未经审计),数据仅供参考,投资者据此操作,风险自担。

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司

G	交通運輸、倉儲和郵政業	-	-
H	住宿和餐飲業	-	-
I	信息傳輸、軟件和信息技術服務業	1,705,417.50	7.49
J	金融業	3,417,531.04	15.02
K	房地產業	1,744,066.63	7.66
L	租賃和商務服務業	380,221.85	1.67
M	科學研究和技術服務業	-	-
N	水利、環境和公共設施管理業	614,252.15	2.70
O	居民服務、修理和個人服務業	-	-
P	教育	-	-
Q	邊境和社會工作	-	-
R	文化、體育和娛樂業	370,860.00	1.63
S	綜合	155,336.60	0.68
	合計	21,555,984.21	94.72

注:由于四舍五入的原因,基金总资产净值的比例之和与合计可能有误差。
2.报告期未积极投资按行业分类的股票投资组合

代码	股票简称	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000002	万科A	73,245	1,012,345.90	4.45
2	000651	格力电器	19,738	864,129.64	3.80
3	000001	平安银行	45,285	713,238.75	3.13
4	000776	广发证券	25,006	697,647.40	3.07
5	000333	美的集团	17,655	581,732.25	2.56
6	000166	申万宏源	29,683	512,328.58	2.23
7	000025	长安汽车	21,012	484,956.96	2.16
8	000783	长江证券	34,884	474,154.04	2.08
9	002024	苏宁云商	29,594	457,371.57	2.01
10	000100	TCL集团	65,500	386,450.00	1.70

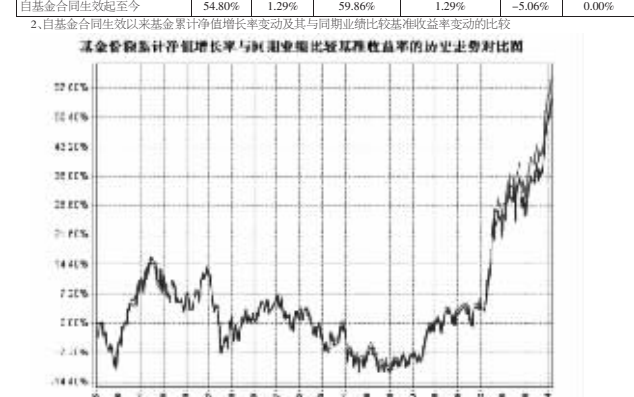
3.报告期未积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资组合
4.报告期未积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资组合
5.报告期未积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资组合
6.报告期未积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资组合
7.报告期未积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资组合
8.报告期未积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资组合
9.报告期未积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债期货投资组合
10.报告期未积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他衍生品投资组合

11.本基金投资组合符合基金合同规定的各项投资组合比例
12.本基金投资组合符合基金合同规定的各项投资组合比例

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	703,611.64
2	应收证券清算款	168,790.59
3	应收利息	356.11
4	其他应收款	-
5	应收股利	-
6	其他	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	239,958.34

14. 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
15. 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
16. 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000025	长安汽车	484,956.96	2.13	重大事项



注:本基金成立于2015年10月25日,故无2012年-2014年数据。

2. 本基金合同约定,本基金合同每6个月,截至报告期末,本基金的各项投资比例符合基金合同关于投资组合、投资范围等方面的约定;本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%,且在投资组合中投资于标的指数的成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的95%。

十五 费用说明
(一)基金管理人的管理费
(二)基金托管人的托管费
(三)标的指数的许可使用费
(四)基金合同生效后标的指数许可使用费
(五)基金合同生效后标的指数许可使用费
(六)基金资产的估值费用
(七)基金资产的估值费用
(八)基金资产的估值费用
(九)基金资产的估值费用
(十)基金资产的估值费用

管理本基金的投资组合水平,以更好地实现本基金的投资目标。本基金管理人上述投资组合管理工具,旨在提高本基金投资效率,减少交易成本,降低跟踪误差的目的,不得使用于投机交易目的,或用于杠杆放大基金的投资。

十六 投资策略
(一)资产配置策略
(二)股票投资策略
(三)债券投资策略
(四)衍生品投资策略
(五)其他金融工具投资策略
(六)风险控制策略
(七)基金资产估值策略
(八)基金资产估值策略
(九)基金资产估值策略
(十)基金资产估值策略

十七 投资目标
本基金管理人建立了规范的投资管理流程和严格的风险管理体系,贯彻于投资研究、投资决策、组合构建、交易执行、风险管理及绩效评估的全过程。
本基金管理人建立了规范的投资管理流程和严格的风险管理体系,贯彻于投资研究、投资决策、组合构建、交易执行、风险管理及绩效评估的全过程。

十八 基金投资组合
本基金管理人建立了规范的投资管理流程和严格的风险管理体系,贯彻于投资研究、投资决策、组合构建、交易执行、风险管理及绩效评估的全过程。
本基金管理人建立了规范的投资管理流程和严格的风险管理体系,贯彻于投资研究、投资决策、组合构建、交易执行、风险管理及绩效评估的全过程。

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金总资产比例(%)
A	农林牧渔	33,453.72	0.15
B	制造业	298,542.13	1.30
C	采矿业	11,833,026.61	52.00
D	电力、热力、燃气及生产和供应业	104,402.00	0.47
E	建筑业	257,444.40	1.13
F	批发和零售业	575,561.58	2.53

十九 基金投资组合
本基金管理人建立了规范的投资管理流程和严格的风险管理体系,贯彻于投资研究、投资决策、组合构建、交易执行、风险管理及绩效评估的全过程。
本基金管理人建立了规范的投资管理流程和严格的风险管理体系,贯彻于投资研究、投资决策、组合构建、交易执行、风险管理及绩效评估的全过程。