新华中证环保产业指数分级证券投资基金招募说明书（更新）摘要

基金管理人：新华基金管理有限公司
基金托管人：中国建设银行股份有限公司

重要提示

新华中证环保产业指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）的募集申请经中国证监会2014年5月20日证监许可【2014】513号文核准募集。本基金合同已于2014年9月11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。

投资有风险，投资者认购或申购本基金时应认真阅读本招募说明书，全面认识本基金产品的风险收益特征，充分考虑投资人自身的风险承受能力，并对于认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资人基金投资要承担相应风险，包括市场风险、管理风险、流动性风险、本基金特定风险、操作或技术风险、合规风险等。在投资人作出投资决策后，基金投资运作与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

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，也不保证基金份额持有人的最低收益。

本招募说明书（更新）所载内容截止日为2015年9月11日，有关财务数据和净值表现截止日为2015年6月30日(财务数据未经会计师事务所审计)。

一 基金管理人

（一）基金管理人概况

1、名称：新华基金管理有限公司

2、住所：重庆市江北区建新东路85 号附1号1层1-1

3、设立日期：2004年12月9日

4、法定代表人：陈重

5、办公地址：北京市海淀区西三环北路11号海通时代商务中心C1座

重庆市渝中区较场口88号A座7-2；

6、电话：010—68726666

传真：010— 88423310

7、联系人：齐岩

8、注册资本：21,750万元人民币

9、股权结构：

股东名称	出资额（万元人币）	出资比例
恒泰证券股份有限公司	12,750	58.62%
新华信托股份有限公司	7,680	35.31%
杭州永原网络科技有限公司	1,320	6.07%
合 计	21,750	100%

（二）主要人员情况

1、董事会成员

陈重先生：董事长，金融学博士。历任原国家经委中国企业管理协会研究部副主任、主任；中国企业报社社长；中国企业管理科学基金会秘书长；重庆市政府副秘书长；中国企业联合会常务副理事长；享受国务院特殊津贴专家。现任新华基金管理有限公司董事长。

张宗友先生：董事，硕士。历任内蒙古证券有限责任公司营业部经理、人事部经理；太平洋证券股份有限公司副总裁，分管经纪业务；恒泰证券股份有限公司副总裁，分管人力资源、信息技术、经纪业务等事务。现任新华基金管理有限公司总经理。

于芳女士：董事。历任北京市水利建设管理中心项目管理及法务专员、新时代证券有限责任公司总经理助理、副总经理。现任恒泰证券股份有限公司合规总监。齐鲁民先生：董事，博士。曾就职于中国人民银行深圳分行、蔚深证券公司、汉唐证券公司，曾任恒泰证券有限责任公司总裁助理、副总裁等职务，现任恒泰证券股份有限公司副总裁。

胡波先生：独立董事，博士，历任中国人民大学财政金融学院教师、中国人民大学风险投资发展研究中心研究员、副主任、执行主任，现任中国人民大学财政金融学院副教授。

张贵龙先生：独立董事，硕士，曾任山西临汾地区教育学院教师。现任职于北京大学财务部。

宋敏女士：独立董事，硕士，历任四川省资阳市人民法院法官、中国电子系统工程总公司法务人员、北京市中济律师事务所执业律师，现任北京东清律师事务所合伙人。

2、基金管理人监事会成员

王海兵先生：监事会主席，学士。曾任山西证券有限责任公司业务部副经理、山西天元会计师事务所审计部经理、长财证券经纪有限责任公司财务部副经理、财务总监、恒泰证券有限责任公司合规负责人、合规总监等职务，现任恒泰证券股份有限公司财务总监。

李会忠先生：职工监事，硕士。八年证券从业经验，历任新华基金管理有限公司投资管理部行业分析师。现任新华基金管理有限公司金融工程部副总监、新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华中证环保产业指数分级证券投资基金基金经理、新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华灵活主题混合型证券投资基金基金经理。

别冶女士：职工监事，金融学学士。八年证券从业经验，历任《每日经济新闻》、《第一财经日报》财经记者，新华基金媒体经理，现任新华基金总经理办公室主任助理。

3、高级管理人员

陈重先生：董事长，简历同上。

张宗友先生：总经理，简历同上。

徐端粤先生：副总经理，学士。历任上海君创财经顾问有限公司并购部经理、上海力矩产业投资管理有限公司并购部经理、新时代证券有限责任公司投行部项目经理。现任新华基金管理有限公司副总经理。

晏益民先生：副总经理，学士。历任大通证券投行总部综合部副总经理，泰信基金机构理财部总经理，天治基金北京分公司总经理，天治基金总经理助理，新华基金总经理助理，现任新华基金管理有限公司副总经理。

齐岩先生：督察长，学士。历任中信证券股份有限公司解放北路营业部职员、天津管理部职员、天津大港营业部综合部经理，现任新华基金管理有限公司督察长。

4、本基金基金经理

李昱女士：管理学硕士，历任广发证券股份有限公司环市东营业部大户主管，广发证券股份有限公司资产管理部投资经理。李昱女士于2010年3月加入新华基金管理有限公司，历任专户管理部负责人。现任新华基金管理有限公司基金管理部副总监、新华优选成长混合型证券投资基金基金经理、新华中证环保产业指数分级证券投资基金基金经理。

李会忠先生：职工监事，硕士。八年证券从业经验，历任新华基金管理有限公司投资管理部行业分析师。现任新华基金管理有限公司金融工程部副总监、新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华中证环保产业指数分级证券投资基金基金经理、新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华灵活主题混合型证券投资基金基金经理。

5、投资管理委员会成员

主席：总经理张宗友先生；成员：总经理助理兼投资总监、基金管理部总监崔建波先生、固定收益部总监于泽雨先生、李昱女士。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

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：王洪章

成立时间：2004年09月17日

组织形式：股份有限公司

注册资本：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) 6759 5096

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。中国建设银行于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)。于2014年末，中国建设银行市值约为2,079亿美元，居全球上市银行第四位。

于2014年末，本集团资产总额167,441.30亿元，较上年增长8.99%；客户贷款和垫款总额94,745.23亿元，增长10.30%；客户存款总额128,986.75亿元，增长5.53%。营业收入5,704.70亿元，较上年增长12.16%；其中，利息净收入增长12.28%，净利息收益率(NIM)2.80%；手续费及佣金净收入占营业收入比重为19.02%；成本收入比为28.85%。利润总额2,990.86亿元，较上年增长6.89%；净利润2,282.47亿元，增长6.10%。资本充足率14.87%，不良贷款率1.19%，拨备覆盖率222.33%。

客户基础进一步夯实，全年公司机构有效客户和单位人民币结算账户分别新增11万户和68万户，个人有效客户新增1,188万户。网点“三综合”覆盖面进一步扩大，综合性网点达到1.37万个，综合柜员占比达到80%，综合营销团队1.75万个，网点功能逐步向客户营销平台、体验平台和产品展示平台转变。深化网点柜面业务前后台分离，全行超过1.45万个营业网点30类柜面实时性业务产品实现总行集中处理，处理效率提高60%。总分行之间、总分行与子公司之间、境内外以及各分行之间的业务联动和交叉营销取得重要进展，集团综合性、多功能优势逐步显现。

债务融资工具累计承销3,989.83亿元，承销额连续四年同业排名第一。以“养颐”为主品牌的养老金融产品体系进一步丰富，养老金受托资产规模、账户管理规模分别新增188.32亿元和62.34万户。投资托管业务规模增幅38.06%，新增证券投资基金托管只数和首发份额市场领先。跨境人民币客户数突破1万个、结算量达1.46万亿元。信用卡累计发卡量6,593万张，消费交易额16,580.81亿元，多项核心指标同业第一。私人银行业务持续推进，客户数量增长14.18%，金融资产增长18.21%。

2014年，本集团各方面良好表现，得到市场与业界广泛认可，先后荣获国内外知名机构授予的100余项重要奖项。在英国《银行家》杂志2014年“世界银行1000强排名”中，以一级资本总额位列全球第2；在英国《金融时报》全球500强排名第29位，新兴市场500强排名第3位；在美国《福布斯》杂志2014年全球上市公司2000强排名中位列第2；在美国《财富》杂志世界500强排名第38位。此外，本集团还荣获国内外重要媒体评出的诸多重要奖项，覆盖公司治理、社会责任、风险管理、公司信贷、零售业务、投资托管、债券承销、信用卡、住房金融和信息科技等多个领域。

中国建设银行总行设投资托管业务部，下设综合处、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、监督稽核处等9个职能处室，在上海设有投资托管服务上海备份中心，共有员工220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。

（二）主要人员情况

赵观甫，投资托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行郑州市分行、总行信贷部、总行信贷二部、行长办公室工作，并在中国建设银行河北省分行营业部、总行个人银行业务部、总行审计部担任领导职务，长期从事信贷业务、个人银行业务和内部审计等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。纪伟，投资托管业务部副总经理，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，具有丰富的客户管理及服务经验。

别冶女士：职工监事，金融学学士。八年证券从业经验，历任《每日经济新闻》、《第一财经日报》财经记者，新华基金媒体经理，现任新华基金总经理办公室主任助理。

3、高级管理人员

陈重先生：董事长，简历同上。

张宗友先生：总经理，简历同上。

徐端粤先生：副总经理，学士。历任上海君创财经顾问有限公司并购部经理、上海力矩产业投资管理有限公司并购部经理、新时代证券有限责任公司投行部项目经理。现任新华基金管理有限公司副总经理。

晏益民先生：副总经理，学士。历任大通证券投行总部综合部副总经理，泰信基金机构理财部总经理，天治基金北京分公司总经理，天治基金总经理助理，新华基金总经理助理，现任新华基金管理有限公司副总经理。

齐岩先生：督察长，学士。历任中信证券股份有限公司解放北路营业部职员、天津管理部职员、天津大港营业部综合部经理，现任新华基金管理有限公司督察长。

4、本基金基金经理

李昱女士：管理学硕士，历任广发证券股份有限公司环市东营业部大户主管，广发证券股份有限公司资产管理部投资经理。李昱女士于2010年3月加入新华基金管理有限公司，历任专户管理部负责人。现任新华基金管理有限公司基金管理部副总监、新华优选成长混合型证券投资基金基金经理、新华中证环保产业指数分级证券投资基金基金经理。

李会忠先生：职工监事，硕士。八年证券从业经验，历任新华基金管理有限公司投资管理部行业分析师。现任新华基金管理有限公司金融工程部副总监、新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华中证环保产业指数分级证券投资基金基金经理、新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华灵活主题混合型证券投资基金基金经理。

5、投资管理委员会成员

主席：总经理张宗友先生；成员：总经理助理兼投资总监、基金管理部总监崔建波先生、固定收益部总监于泽雨先生、李昱女士。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

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：王洪章

成立时间：2004年09月17日

组织形式：股份有限公司

注册资本：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) 6759 5096

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。中国建设银行于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)。于2014年末，中国建设银行市值约为2,079亿美元，居全球上市银行第四位。

于2014年末，本集团资产总额167,441.30亿元，较上年增长8.99%；客户贷款和垫款总额94,745.23亿元，增长10.30%；客户存款总额128,986.75亿元，增长5.53%。营业收入5,704.70亿元，较上年增长12.16%；其中，利息净收入增长12.28%，净利息收益率(NIM)2.80%；手续费及佣金净收入占营业收入比重为19.02%；成本收入比为28.85%。利润总额2,990.86亿元，较上年增长6.89%；净利润2,282.47亿元，增长6.10%。资本充足率14.87%，不良贷款率1.19%，拨备覆盖率222.33%。

客户基础进一步夯实，全年公司机构有效客户和单位人民币结算账户分别新增11万户和68万户，个人有效客户新增1,188万户。网点“三综合”覆盖面进一步扩大，综合性网点达到1.37万个，综合柜员占比达到80%，综合营销团队1.75万个，网点功能逐步向客户营销平台、体验平台和产品展示平台转变。深化网点柜面业务前后台分离，全行超过1.45万个营业网点30类柜面实时性业务产品实现总行集中处理，处理效率提高60%。总分行之间、总分行与子公司之间、境内外以及各分行之间的业务联动和交叉营销取得重要进展，集团综合性、多功能优势逐步显现。

债务融资工具累计承销3,989.83亿元，承销额连续四年同业排名第一。以“养颐”为主品牌的养老金融产品体系进一步丰富，养老金受托资产规模、账户管理规模分别新增188.32亿元和62.34万户。投资托管业务规模增幅38.06%，新增证券投资基金托管只数和首发份额市场领先。跨境人民币客户数突破1万个、结算量达1.46万亿元。信用卡累计发卡量6,593万张，消费交易额16,580.81亿元，多项核心指标同业第一。私人银行业务持续推进，客户数量增长14.18%，金融资产增长18.21%。

2014年，本集团各方面良好表现，得到市场与业界广泛认可，先后荣获国内外知名机构授予的100余项重要奖项。在英国《银行家》杂志2014年“世界银行1000强排名”中，以一级资本总额位列全球第2；在英国《金融时报》全球500强排名第29位，新兴市场500强排名第3位；在美国《福布斯》杂志2014年全球上市公司2000强排名中位列第2；在美国《财富》杂志世界500强排名第38位。此外，本集团还荣获国内外重要媒体评出的诸多重要奖项，覆盖公司治理、社会责任、风险管理、公司信贷、零售业务、投资托管、债券承销、信用卡、住房金融和信息科技等多个领域。

中国建设银行总行设投资托管业务部，下设综合处、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、监督稽核处等9个职能处室，在上海设有投资托管服务上海备份中心，共有员工220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。

（二）主要人员情况

赵观甫，投资托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行郑州市分行、总行信贷部、总行信贷二部、行长办公室工作，并在中国建设银行河北省分行营业部、总行个人银行业务部、总行审计部担任领导职务，长期从事信贷业务、个人银行业务和内部审计等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。纪伟，投资托管业务部副总经理，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，具有丰富的客户管理及服务经验。

纪伟，投资托管业务部副总经理，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。

张军红，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行总行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室，长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张力静，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行建筑经济部、信贷二部、信贷部、信贷管理部、信贷经营部、公司业务部，并在总行集团客户部和中国建设银行北京市分行担任领导职务，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，投资托管业务部副总经理，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。

（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2015年6月末，中国建设银行已托管514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。中国建设银行自2009年至今连续五年被国际权威杂志《全球托管人》评为“中国最佳托管银行”。

二、基金托管人的内部控制制度

（一）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。

（二）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。投资托管业务部专门设置了监督稽核处，配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，具有独立行使监督稽核工作职权和能力。

（三）内部控制制度及措施

投资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

（一）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“托管业务综合系统——基金监督子系统”，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，并定期编写基金投资运作监督报告，报送中国证监会。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。

（二）监督流程

1.每工作日按时通过基金监督子系统，对各基金投资运作比例控制指标进行例行监控，发现投资比例超标等异常情况，向基金管理人发出书面通知，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，并及时报告中国证监会。

2.收到基金管理人的划款指令后，对涉及各基金的投资范围、投资对象及交易对手等内容进行合法合规性监督。

3.根据基金投资运作监督情况，定期编写基金投资运作监督报告，对各基金投资运作的合法合规性、投资独立性和风格显著性等方面进行评价，报送中国证监会。

4.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，并及时报告中国证监会。

三 相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、场外发售机构

（1）直销机构：

新华基金管理有限公司北京直销中心

办公地址：北京市海淀区西三环北路11号海通时代商务中心C1座

法定代表人：陈重

联系人：张秀丽

电话：(010)68730999

传真：(010)68731199

客服电话：400-819-8866

网址：www.ncfund.com.cn

电子直销：新华基金网上交易平台

网址：https://trade.ncfund.com.cn

（2）其他销售机构

1) 中国建设银行股份有限公司

注册地址：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

联系人：张静

客服电话：95533

公司网址：www.ccb.com

2）光大证券股份有限公司

住所：上海市静安区新闸路1508号

法定代表人：薛峰

联系人：刘晨

客服电话：95525

网址：www.ebscn.com

3）国泰君安证券股份有限公司

注册地址：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

联系人：朱雅崴、芮敏祺

客服电话：400-8888-666 / 95521

网址：www.gtja.com

4）海通证券股份有限公司

住所：上海市广东路698号

法定代表人：王开国

联系人：李笑鸣

客服电话：95553

网址：www.htsec.com

5）恒泰证券股份有限公司

住所：内蒙古呼和浩特赛罕区敕勒川大街东方君座D座

法定代表人：庞介民

联系人：魏巍

客服电话：400-196-6188

网址：www.cnht.com.cn

6) 华西证券股份有限公司

注册地址：四川省成都市青羊区陕西街239号

办公地址：四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦

法定代表人：杨炯洋

联系人：张曼

客服电话：95584

网址：www.hx168.com.cn

7) 齐鲁证券有限公司

住所：济南市经七路86号

法定代表人：李玮

联系人：吴阳

客服电话：95538

网址：www.qlzq.com.cn

8) 新时代证券有限责任公司

住所：北京市海淀区北三环西路99号西海国际中心1号楼15层

法定代表人：刘汝军

联系人：田芳芳

客服电话：400-698-9898

公司网址：www.xsdzq.cn

9) 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

法定代表人：陈有安

联系人：邓颜

客服电话：400-888-8888

网址：www.chinastock.com.cn

10) 中信建投证券股份有限公司

注册地址：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

联系人：权唐

客服电话：95587

网站：www.csc108.com

11) 中信证券（山东）有限责任公司

住所：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼第20层

法定代表人：杨宝林

客服电话：95548

联系人：吴忠超

公司网址：www.citicssd.com

12) 中信证券（浙江）有限责任公司

住所：浙江省杭州市解放东路29号迪凯银座22、23层

法定代表人：沈强

联系人：李珊

客服电话：95548

网址：www.bigsun.com.cn

13) 中信证券股份有限公司

注册地址：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：北京朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦

法定代表人：王东明

联系人：侯艳红

客服电话：95548

网址：www.cs.ecitic.com

14）华龙证券有限责任公司

住所：兰州市城关区东岗西路638号财富中心

法定代表人：李晓安

联系人：李昕田

客服电话：400-689-8888，0931-96668

网址：www.hlzqgs.com

15) 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16-26层

法定代表人：何如

联系人：周杨

客服电话：95536

网址：www.guosen.com.cn

16) 平安证券有限责任公司

住所：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

联系人：石静武

客服电话：95511-8

网址：www.pingan.com

17）东海证券股份有限公司

注册地址：江苏省常州市延陵西路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：朱科敏

联系人：王一彦

客服电话：95531或400-8888-588

网址：www.longone.com.cn

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

法定代表人：吴万善

联系人：庞晓芸

客服电话：95597

网址：www.htsc.com.cn

19）华安证券股份有限公司

住所：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号

法定代表人：李工

联系人：甘霖

客服电话：96518（安徽）400-80-96518（全国）

网址：www.hazq.com

20）湘财证券有限责任公司

注册地址：湖南省长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼

办公地址：上海市浦东银城东路139号华能大厦

法定代表人：陈学荣

客服电话：021-68865020

联系人：杜颖灏

网址：www.xcsc.com

21）东吴证券股份有限公司

注册地址：苏州工业园区星阳街 5 号

办公地址：苏州工业园区星阳街5号

法定代表人：吴永敏

客户服务电话：4008601555

网址：www.dwzq.com.cn

22）东北证券股份有限公司

住所：长春市自由大路1138号

法定代表人：杨树财

联系人：安岩岩

客服电话：400-600-0686

网址：www.nesc.cn

23）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

法定代表人：李梅

联系人：钱达琛

客服电话：95523或4008895523

网址：www.swhysc.com

24）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38—45层

法定代表人：宫少林

联系人：林生迎

客服电话：95565

网站：www.newone.com.cn

25) 上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层

办公地址：上海市徐汇区龙田路195号3C座7楼

法定代表人：其实

客服电话：400-1818-188

联系人：丁姗姗

网址：www.1234567.com.cn

26) 深圳众禄基金销售有限公司

注册地址：深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25层I单元

办公地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8 楼

法定代表人：薛峰

客户服务电话：4006-788-887

联系人：童彩平

网址：www.zlfund.cn/www.jjmmw.com

27) 杭州数米基金销售有限公司

注册地址：杭州市余杭区仓前街文一西路1218号1栋202室

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道3588号12楼

法定代表人：陈柏青

联系人：李晓明

客户服务电话：4000-766-123

网址：www.fund123.cn

28) 上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室

办公地址：上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦9楼

法定代表人：杨文斌

联系人：胡凯怡

客户服务电话：400-700-9665

网址：www.ehowbuy.com

29) 上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路526号2幢220室

办公地址：上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层

法定代表人：张跃伟

客服电话：400-820-2899

联系人：毛林

公司网站：www.erichfund.com

30) 和讯信息科技有限公司

注册地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦

办公地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦

法定代表人：王莉

客服电话：4009200022

联系人：魏亚娄

公司网站：licaike.hexun.com

31) 万银财富（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区北四环中29号院5号楼3201内

办公地址：北京市朝阳区北四环中27号院5号楼3201内

法定代表人：王斐

客服电话：400-059-8888

联系人：张晋

公司网站：www.wy-fund.com

32) 北京钱景财富投资管理有限公司

注册地址：北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012

办公地址：北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012

法定代表人：赵荣春

客服电话：400-678-5095

联系人：高静

公司网站：www.niuji.net

33) 北京展恒基金销售有限公司

注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街6号

办公地址：北京市朝阳区华严北里2号民建大厦6层

法定代表人：闫振杰

客服电话：400-888-6661

联系人：王琳

公司网站：www.myfund.com

34) 浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903室

办公地址：浙江省杭州市翠柏路7号杭州电子商务产业园2号楼2楼

法定代表人：凌顺平

联系人：林海明

客服电话：4008-773-772

公司网站：www.5ifund.com

35) 北京恒天明泽基金销售有限公司

注册地址：北京市经济技术开发区宏达北路10号五层5122室

办公地址：北京市朝阳区东三环中路20号乐成中心A座23层

法定代表人：梁越

联系人：张晔

客服电话：4007-868-868

公司网站：www.chtfund.com

36) 北京增财基金销售有限公司

注册地址：北京市西城区南礼士路66号1号楼12层1208号

办公地址：北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208-1209室

法定代表人：罗细安

联系人：王天

客服电话：400-001-8811

公司网站：www.zcvc.com.cn

37)一路财富（北京）信息科技有限公司

注册地址：北京市西城区车公庄大街9 号五栋大楼C 座702

办公地址：北京市西城区阜成门大街2 号万通新世界广场A 座2208

法定代表人：吴雪秀

联系人：刘栋栋

客服电话：400-001-1566

网址：www.yilucaifu.com

38)北京创金启富投资管理有限公司

注册地址：北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A

办公地址：北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A

联系人：赵海峰

客服电话：400-6262-818

公司网站：www.5irich.com

39)深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#

办公地址：北京市西城区金融大街35号 国际企业大厦C座9层

法定代表人：杨懿

联系人：张燕

客服电话：400-166-1188

网址：8.jrj.com.cn

2、场内发售机构

场内销售机构为具有基金代销业务资格的深圳证券交易所会员单位，具体名单可在深交所网站查询。

3、基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并予以公告。

（二）基金注册登记机构

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：朱立元

电话：(010)59378839

传真：(010)59378907

（三）律师事务所与经办律师

名称：上海市通力律师事务所

注册地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

办公地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

联系人：安冬

电话：(021)31358666

传真：(021)31358600

经办律师：安冬、陆奇

（四）会计师事务所与经办注册会计师

会计师事务所：瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：北京市海淀区西四环中路16号院2号楼4层

办公地址：北京市东城区永定门西滨河路8号院7号楼中海地产广场西塔5-11层

法定代表人：杨剑涛

电话：010—88095588

传真：010—88091199

经办注册会计师：张伟、胡慰

四 基金的名称

本基金名称：新华中证环保产业指数分级证券投资基金。

五 基金的类型

基金类型：契约型开放式。

六 基金的投资目标

本基金采用被动式指数化投资方法，通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，以实现对标的指数的有效跟踪。在正常市场情况下，力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪误差不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%。

七 基金的投资方向

本基金可投资于具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股及备选成份股等股票（包括中小板、创业板以及其它经中国证监会核准上市的股票）、债券、权证及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

此外，如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的比例范围为90—95%，其中投资于标的指数成份股及备选成份股的组合比例不低于非现金基金资产的80%。现金或者到期日在1年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

八 基金的投资策略

本基金按照成份股在中证环保产业指数中的基准权重构建指数化投资组合，原则上采用完全复制法，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，基金管理人会对实际投资组合进行适当调整，以便实现对跟踪误差的有效控制。

1、资产配置策略

本基金股票投资占基金资产的比例范围为90—95%，其中投资于标的指数成份股及备选成份股的组合比例不低于非现金基金资产的80%。现金或者到期日在1年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

为进一步降低投资组合的跟踪误差，基金管理人将综合考虑股票市场状况以及基金运作的资金需求等因素，在法律法规和基金合同规定的范围内，进行科学的现金需求预测，尽可能保持现金资产合理比重，防止大量现金拖累导致跟踪误差的加大。

2、股票投资策略

（1）投资组合的构建

本基金采用完全复制方法构建股票投资组合，基金资产按照中证环保产业指数的成份股构成及其基准权重进行投资以拟合、跟踪标的指数的业绩表现。

在建仓期间，本基金将依据对市场整体以及成份股运行情况的全面分析，结合基金经理经验判断，采取逐步建仓策略，按照中证环保产业指数各成份股的基准权重对其逐步买入，在确保跟踪误差最小化的基础上，降低由于买入成本上升所带来的影响。

（2）投资组合的调整

在基金的日常运作中，出现：① 基金申购、赎回变动；②标的指数成份股定期或不定期调整；③标的指数成份股的配股、增发及分红；④标的指数成份股停牌或流动性严重不足；⑤法律法规及基金合同中对成份股投资比例限制等情况时，容易导致投资组合与标的指数的偏离，因此本基金将适时调整投资组合，对跟踪误差进行有效控制。

从组合调整的频率上来划分，主要可分为定期调整和不定期调整：

1）定期调整

根据中证环保产业指数的调整规则，该指数的成份股原则上每半年调整一次，一般为每年的1月初和7月初实施调整，调整方案提前两周公布。在指数定期调整方案公布之后，基金管理人将根据调整后的成份股及权重状况，结合对市场行情的分析判断，适时对现有组合的构成进行相应调整。同时考虑冲击成本对组合跟踪误差的影响，样本股调整时本基金采用逐步调整的方式进行。

2）不定期调整

a.基金管理人将依据对市场行情的分析研究，判断基金申购、赎回的未来变化趋势，并据此进行投资组合的相应调整，以减少现金流对跟踪误差的冲击，从而有效跟踪标的指数。

b.当标的指数成份股出现临时调整时，基金管理人将密切关注相关调整公告，及时进行投资组合的调整，以更好地拟合标的指数。

c.当标的指数成份股出现临配股、增发及分红等情形导致权重发生变化时，基金管理人将权衡跟踪成份股的权重变化，实时调整投资组合各成份股头寸。

d.当标的指数成份股的投资比例受到法律法规及基金合同的限制，或由于停牌、流动性严重不足造成投资组合无法按照基准权重进行配置时，基金管理人将依据行业基本面相似性、历史收益率高度相关性以及流动性充足性等标准，选取替代股票或组票组合进行投资，尽量降低由此产生的跟踪误差。

（3）跟踪误差管理

基金管理人通过设定阈值的方式对投资组合跟踪误差进行日常监控。当跟踪误差超过0.3%时，基金管理人将对跟踪误差进行归因分析，从申购\赎回现金流冲击、成份股调整、成份股替代、交易成本等方面综合测算，判断形成跟踪误差的主要来源，采取有针对性的措施防止跟踪误差的进一步扩大。

3、现金头寸管理

一方面，为应对基金的日常赎回、计提管理费和托管费等相关费用、支付交易成本、参与上市公司配股及增发等行为，以及满足法律法规和基金合同的相关规定，基金应持有必要的现金头寸。而另一方面，过多的现金留存将形成现金拖累，影响投资组合对标的指数的有效跟踪。

因此，基金管理人将通过科学的现金流预判、成份股流动性的有效分析以及现金资产的收益性管理等方面，进行积极的现金头寸管理，以减少现金拖累带来的跟踪误差。

4、债券投资策略

本基金债券投资主要基于流动性管理的需要，在满足跟