工银瑞信新蓝筹股票型证券投资基金更新的招募说明书摘要

（2016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：中国银行股份有限公司

重要提示

本基金经中国证券监督管理委员会2015年6月30日证监许可【2015】1442号文注册募集。本基金基金合同已于2015 年8月6日生效。

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注册，但中国证监会对本基金募集的注册，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。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会注册。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《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、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。

投资有风险，投资者认购（或申购）基金份额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，应充分考虑投资者自身的风险承受能力，并对认购（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者基金投资的"买者自负"原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化导致的投资风险，由投资者自行负担。

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。

本基金为股票型基金，其预期收益和风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。属于风险水平较高的基金。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市交易的股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、权证、股指期货、债券（包括但不限于国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、现金，以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）。

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：股票资产占基金资产的比例为80%－95%，其中，投资于本基金界定的新蓝筹主题股票占非现金资产的比例不低于80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值的5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。

如法律法规或中国证监会允许，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金初始募集面值为人民币1.00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。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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2016年2月5日，有关财务数据和净值表现数据截止日为2015年12月31日（财务数据未经审计）。本招募说明书已经基金托管人复核。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况
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5号、甲5号6层甲5号601、甲5号7层甲5号701、甲5号8层甲5号801、甲5号9层甲5号901
办公地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦A座6－9层
邮政编码：100033
法定代表人：郭特华
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
经营范围：基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务
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：400－811－9999
股权结构：中国工商银行股份有限公司占公司注册资本的80%；瑞士信贷银行股份有限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

沈立强先生，董事长，硕士，高级会计师。1976年参加工作，先后在中国人民银行杭州分行、中国工商银行浙江分行、河北分行、上海分行工作。历任中国工商银行杭州分行营业部副主任、杭州分行营业部主任、浙江分行会计出纳处副处长、储蓄处副处长、储蓄处处长、人事处处长、党委组织部部长、营业部总经理（兼）、浙江分行行长助理、副行长、党委副书记；中国工商银行河北分行行长；中国工商银行上海分行行长，兼任上海市银行同业公会会长、上海市城市金融学会会长、上海市支付清算协会会长、上海市金融学会副会长、上海国际商会副会长、上海世界贸易中心协会副会长、中国城市金融学会常务理事、上海市宏观经济学会常务理事、中国社会科学院陆家嘴研究基地理事会理事、上海财经大学校董会董事，上海市人大代表。

Neil Harvey 先生，董事，瑞士信贷执行董事，常驻香港。瑞士信贷银行香港和大中华区首席执行官，负责私人银行、财富管理和投资银行业务。同时，Neil Harvey先生还是资产管理亚太地区副主席、亚太区运营委员会成员。Neil Harvey先生在投资银行和资产管理领域有三十年的工作经历，对新兴市场和亚太地区有着深刻的了解，在亚太地区也有十七年的工作经历。Neil Harvey先生在瑞士信贷工作十五年，担任过很多职务，目前他是资产管理亚太和新兴市场负责人。此前，他担任亚洲（除日本）投资银行和固定收益业务负责人。另外，他在瑞士信贷和其他公司都担过要职，负责澳大利亚、非洲、日本、拉美、中东、土耳其和俄罗斯地区的业务。

郭特华女士，董事，博士，现任工银瑞信基金管理有限公司总经理，兼任工银瑞信投资管理有限公司董事长，工银瑞信资产管理（国际）有限公司董事长，工银家族财富（上海）投资管理有限公司的董事。历任中国工商银行总行商业信贷部、资金计划部副处长，中国工商银行总行资产托管部处长、副总经理。

王一心女士，董事，高级经济师，中国工商银行战略管理与投资者关系部高级专家、专职董事。历任中国工商银行专项融资部（公司业务二部、营业部）副总经理；中国工商银行营业部 历任副处长、处长；中国工商银行总行技术改造信贷部经理。

王莹女士，董事，高级会计师，中国工商银行集团派驻子公司董监事办公室专家、专职派出董事，于2004年11月获得国际内审协会注册内部审计师（Certified Internal Auditor）资格证书。历任中国工商银行国际业务部外汇清算处负责人，中国工商银行清算中心外汇清算处负责人、副处长，中国工商银行稽核监督局外汇业务稽核处副处长、处长，中国工商银行内部审计局境外机构审计处处长，工行悉尼分行内部审计师、风险专家。

田国强先生，独立董事，经济学博士，上海财经大学经济学院院长，上海财经大学高等研究院院长，美国德州A&M大学经济系Alfred F. Chalk讲席教授。首批中组部"千人计划"入选者及其国家特聘专家，首批人文社会科学长江学者讲座教授，曾任上海市人民政府特聘决策咨询专家，中国留美经济学会会长（1991－1992）。2006年被《华尔街电讯》列为中国大陆十大最具影响力的经济学家之一。主要研究领域包括经济理论、激励机制设计、中国经济等。

孙祁祥女士，独立董事，经济学博士，北京大学经济学院院长，教授，博士生导师，享受国务院政府特殊津贴专家。兼任北京大学中国保险与社会保障研究中心主任，中国金融学会学术委员会委员、常务理事，中国保险学会副会长，教育部高等学校经济学类学科专业教学指导委员会委员，美国国际保险学会董事会成员、学术主持人，美国C.V. Starr冠名教授。曾任亚太风险与保险学会主席，美国国家经济研究局、美国印第安纳大学、美国哈佛大学、香港大学访问学者。在《经济研究》等学术刊物上发表论文100多篇，主持过20多项由国家部委和国际著名机构委托的科研课题。

Jane DeBevoise女士，独立董事，香港大学艺术系博士，历任银行家信托公司（1998年与德意志银行合并）董事总经理、所罗门·古根海姆基金会副主席及项目总监、香港政府委任的展览馆委员会成员，香港西九龙文娱艺术馆咨询小组政府委任委员。2003年至今担任香港亚洲艺术文献库董事局董事及主席，2009年至今担任美国亚洲艺术文献库主席。

2、监事会成员

吴敏敏女士：监事，经济学硕士。1996年入职中国工商银行深圳市分行，2007年调入中国工商银行总行。历任中国工商银行深圳分行计划财务部副总经理、财务会计部副总经理、中国工商银行股份制改革办公室战略引资与上市处副处长、战略管理与投资者关系部战略发展与合作处副处长、处长，现任中国工商银行战略管理与投资者关系部专家。

黄敏女士：监事，金融学学士。黄敏女士于2006年加入Credit Suisse Group (瑞士信贷集团)，先后担任全球投资银行战略部助理副总裁、亚太区投资银行战略部副总裁、中国区执行首席运营官，资产管理大中国区首席运营官，现任资产管理中国区负责人。

张舒冰女士：监事，硕士。2003年4月至2005年4月，任职于中国工商银行，担任主任科员。2005年7月加入工银瑞信，2005年7月至2006年12月担任综合管理部翻译兼综合，2007年至2012年担任战略发展部副总监，2012年至2014年9月任职于机构客户部，担任机构客户部副总监及总监职务；2014年9月至2015年7月，担任机构产品部总监。2014年11月至今，担任工银瑞信投资管理有限公司监事。2015年7月至今担任工银瑞信投资管理有限公司副总经理。

洪波女士：监事，硕士。ACCA 非执业会员。2005年至2008年任安永华明会计师事务所高级审计员；2008年至2009年任民生证券有限责任公司监察稽核总部业务主管；2009年6月加入工银瑞信法律合规部，现任法律合规部副总监。

倪莹女士：监事，硕士。2000年至2009年任职于中国人民大学，历任副科长、科长，校团委副书记。2009年至2011年就职于北京市委教工委，任干部处副调研员。2011年加入工银瑞信战略发展部，现任副总监。

3、高级管理人员

郭特华女士：总经理，简历同上。

朱碧艳女士：硕士，国际注册内部审计师，现任工银瑞信基金管理有限公司督察长，兼任工银瑞信投资管理有限公司监事。1997年－1999年中国华融信托投资公司证券总部经理，2000年－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。

江明波先生：硕士，现任工银瑞信基金管理有限公司副总经理，兼任工银瑞信资产管理（国际）有限公司固定收益投资总监，工银瑞信投资管理有限公司董事。2000 年7 月至2001 年11 月，任职于长城证券有限责任公司，担任研究员；2001 年12 月至2006 年12 月，任职于鹏华基金管理有限公司，历任研究员、基金经理助理、普天债券基金经理、社保债券组合、社保回购组合基金经理、机构理财部总监助理、固定收益小组负责人。2006 年加入工银瑞信基金管理有限公司。

杜海涛先生：硕士，现任工银瑞信基金管理有限公司副总经理，兼任工银瑞信资产管理（国际）有限公司董事。1997 年7 月至2002 年9 月，任职于长城证券有限责任公司，历任职员、债券（金融工程）研究员；2002 年10 月至2003年5 月，任职于宝盈基金管理有限公司，历任研究员、基金经理助理；2003 年6 月至2006 年3月，任职于招商基金管理有限公司，历任研究员、基金经理。2006 年加入工银瑞信基金管理有限公司。

赵紫英女士：博士，现任工银瑞信基金管理有限公司副总经理。1989 年8 月至1993 年5 月，任职于中国工商银行海淀支行，从事国际业务；1994 年6 月至2002 年4 月，任职于中国工商银行北京市分行国际业务部，历任综合科科长、国际业务部副总经理；2002年5月至2005年6月，任职于中国工商银行牡丹卡中心，历任市场营销部副总经理、清算部副总经理。2005年加入工银瑞信基金管理有限公司。

4、本基金基金经理

王筱苓女士，19年证券从业经验；曾任中国银行全球金融市场部首席交易员；2005年加入工银瑞信，曾任工银核心价值基金、工银精选平衡混合型基金、工银稳健成长股票型基金基金经理、专户投资部专户投资经理，现任权益投资部副总监，2011年10月11日至今，担任工银中小盘基金基金经理；2012年12月5日至今，担任工银大盘蓝筹基金基金经理；2014年6月26日至今，担任工银瑞信绝对收益混合型基金基金经理；2014年12月30日至今，担任工银消费服务行业股票基金基金经理；2015年8月6日至今，担任工银瑞信新蓝筹股票型基金基金经理。

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。
江明波先生，简历同上。
杜海涛先生，简历同上。

何江旭先生，19年证券从业经验；曾任国泰基金金鑫、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，现任工银瑞信投资管理有限公司董事、总经理；2010年4月12日至2014年7月30日，担任工银核心价值基金基金经理；2011年4月21日至2014年7月30日，担任工银消费服务行业基金的基金经理。

宋炳珅先生，12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，现任权益投资总监兼研究部总监。2012年2月14日至今，担任工银瑞信添颐债券型证券投资基金基金经理；2013年1月18日至今，担任工银双利债券基金基金经理；2013年1月28日至2014年12月5日，担任工银瑞信60天理财债券型基金基金经理；2014年1月20日至今，担任工银红利基金基金经理；2014年1月20日至今，担任工银核心价值基金基金经理；2014年10月23日至今，担任工银瑞信研究精选股票型基金基金经理；2014年11月18日至今，担任工银瑞信医疗保健行业股票型基金基金经理；2015年2月16日至今，担任工银瑞信战略转型主题股票型基金基金经理。

欧阳凯先生，14年证券从业经验；曾任中海基金管理有限公司基金经理；2010年加入工银瑞信，现任固定收益投资总监。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12月27日至今担任工银保本混合基金基金经理，2013年2月7日至今担任工银瑞信保本2号混合型发起式基金基金经理，2013年6月26日起至今担任工银瑞信保本3号混合型基金基金经理，2013年7月4日起至今担任工银信用纯债两年定期开放基金基金经理，2014年9月19日起至今担任工银瑞信新财富灵活配置混合型基金基金经理，2015年5月26日起至今担任工银丰盈回报灵活配置混合型基金基金经理。

黄安乐先生，13年证券从业经验；先后在天相投资顾问有限公司担任研究员，国信证券经济研究所担任资深分析师，国信证券资产管理总部担任投资经理、研究员；2010年加入工银瑞信，现任权益投资部总监。2011年11月23日至今，担任工银主题策略混合基金基金经理；2013年9月23日至今，担任工银瑞信精选平衡基金基金经理；2014年10月22日至今，担任工银高端制造行业股票型基金基金经理；2015年4月28日至今，担任工银新材料新能源行业股票型基金基金经理。

李剑峰先生，13年证券从业经验；曾任中央国债登记结算有限责任公司业务经理、高级副经理；2008年加入工银瑞信，曾任固定收益研究员，现任专户投资部总监，专户投资部投资经理。

上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

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：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整
法定代表人：田国立
基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号
托管部门信息披露联系人：王永民
传真：（010）66594942
中国银行客服电话：95566

三、相关服务机构

（一）基金份额发售机构
1、直销中心
名　称：工银瑞信基金管理有限公司
办公地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦A座6－9层
注册地址：北京市西城区金融大街5号、甲5号6层甲5号601、甲5号7层甲5号701、甲5号8层甲5号801、甲5号9层甲5号901
法定代表人：郭特华
全国统一客户服务电话：400－811－9999
传真：010－66583111
联系人：王秋雅
公司网站：www.icbccs.com.cn
2、其他销售机构
（1）中国工商银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街55号
法定代表人：姜建清
传真：010－66107914
客户服务电话：95588
网址：http://www.icbc.com.cn/
（2）交通银行股份有限公司
注册地址：上海市银城中路188号
办公地址：上海市银城中路188号
法定代表人：牛锡明
联系人：张宏革
电话：021－58781234
传真：021－58408483
客户服务电话：95559
网址：http://www.bankcomm.com/
（3）招商银行股份有限公司
注册地址：深圳市福田区深南大道7088号
办公地址：深圳市福田区深南大道7088号
法定代表人：李建红
联系人：邓炯鹏
电话：0755－83198888
传真：0755－83195049
客户服务电话：95555
网址：http://www.cmbchina.com/
（4）中国银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号
法定代表人：田国立
联系人：侯燕鹏
传真：010－66594431
客户服务电话：95566
网址：http://www.boc.cn/
（5）上海浦东发展银行股份有限公司
注册地址：上海市中山东一路12号
办公地址：上海市中山东一路12号
法定代表人：吉晓辉
联系人：于慧
电话：021－61618888
传真：021－63602431
客户服务电话：95528
网址：http://www.spdb.com.cn
（6）中国邮政储蓄银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区金融大街3号
办公地址：北京市西城区金融大街3号
法定代表人：李国华
联系人：陈春林
传真：010－68858117
客户服务电话：95580
网址：http://www.psbc.com
（7）渤海银行股份有限公司
注册地址：天津市河西区马场道201－205号
办公地址：天津市河西区马场道201－205号
法定代表人：李伏安
联系人：王宏
电话：022－58316666
传真：022－58316569
客户服务电话：95541
网址：http://www.cbhb.com.cn
（8）中泰证券股份有限公司
注册地址：山东省济南市经十路20518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
联系人：吴阳
电话：0531－81283938
传真：0531－81283900
客户服务电话：95538
网址：http://www.qlzq.com.cn/
（9）西南证券股份有限公司
注册地址：重庆市江北区桥北苑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
联系人：张婷
电话：023－63786220
传真：023－63786212
客户服务电话：4008096096
网址：http://www.swsc.com.cn
（10）中国国际金融有限公司
注册地址：中国北京建国门外大街1号　国贸大厦2座28层
办公地址：中国北京建国门外大街1号　国贸大厦2座28层
法定代表人：金立群
联系人：罗春蓉　武明明
电话：010－65051166
传真：010－65051156
客户服务电话：(010)85679238/85679169;(0755)83195000;(021)63861195;63861196
网址：http://www.cicc.com.cn/
（11）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：芮敏祺
电话：021－38676666
传真：021－38670161
客户服务电话：400－8888－666 / 95521
网址：http://www.gtja.com/
（12）德邦证券有限责任公司
注册地址：上海市普陀区曹杨路510号南半幢9楼
办公地址：上海市浦东新区福山路500号城建国际中心26楼
法定代表人：方加春
联系人：罗芳
电话：021－68761616
传真：021－68767981
客户服务电话：4008888128
网址：http://www.tebon.com.cn
（13）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：王春峰
联系人：王兆权
电话：022－28451861
传真：022－28451892
客户服务电话：4006515988
网址：http://www.bhzq.com
（14）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、11、12、13、15、16、18、19、20、21、22、23单元
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
客户服务电话：4006008008
网址：http://www.china-invs.cn/
（15）中信证券股份有限公司
注册地址：深圳市深南路7088号招商银行大厦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
联系人：陈忠
电话：010－84588888
传真：010－84865560
客户服务电话：010－84588888
网址：http://www.cs.ecitic.com/
（16）新时代证券股份有限公司
注册地址：北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501
办公地址：北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层
法定代表人：刘汝军
联系人：马骏杰
电话：010－83561329
传真：010－83561094
客服电话：400－698－9898
网址：www.xsdzq.cn
（17）广州证券股份有限公司
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楼
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楼
法定代表人：刘东
联系人：林洁茹
电话：020－88836999
传真：020－88836654
客户服务电话：961303
网址：http://www.gzs.com.cn
（18）中航证券有限公司
注册地址：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
联系人：余雅娜
电话：0791－6768763
传真：0791－6789414
客户服务电话：400－8866－567
网址：http://www.avicsec.com/
（19）信达证券股份有限公司
注册地址：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
联系人：唐静
电话：010－63080985
传真：010－63080978
客户服务电话：95321
网址：http://www.cindasc.com
（20）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
电话：010－85130588
传真：010－65182261
客户服务电话：4008888108
网址：http://www.csc108.com/
（21）海通证券股份有限公司
注册地址：上海市淮海中路98号
办公地址：上海市广东路689号海通证券大厦
法定代表人：王开国
联系人：金芸、李笑鸣
电话：021－23219275
传真：021－63602722
客户服务电话：95553
网址：http://www.htsec.com/
（22）华融证券股份有限公司
注册地址：北京市西城区金融大街8号
办公地址：北京市西城区金融大街8号A座3、5层
法定代表人：宋德清
联系人：黄恒
联系电话：010－58568235
联系传真：010－58568062
公司网址：www.hrsec.com.cn
客服电话：010－58568118
（23）华安证券股份有限公司
注册地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号
办公地址：安徽省合肥市南二环959号财智中心B1座
法定代表人：李工
联系人：甘霖
电话：0551－65161666
传真：0551－65161600
客户服务电话：96518、4008096518
网址：www.hazq.com
（24）兴业证券股份有限公司
注册地址：福州市湖东路99号标力大厦
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
联系人：谢高得
电话：021－38565785
传真：021－38565783
客户服务电话：4008888123
网址：http://www.xyzq.com.cn/
（25）申万宏源证券有限公司
注册地址：上海市徐汇区长乐路989号45层
办公地址：上海市徐汇区长乐路989号45层（邮编：200031）
法定代表人：李梅
联系人：黄维琳、钱达琛
电话：021－33389888
传真：021－33388224
客户服务电话：95523或4008895523
网址：www.swhysc.com
（26）平安证券有限责任公司
注册地址：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
联系人：郑舒丽
电话：0755－22626172
传真：0755－82400862
客户服务电话：4008816168
网址：http://www.pingan.com/
（27）国金证券股份有限公司
注册地址：成都市东城根上街95号
办公地址：成都市东城根上街95号
法定代表人：冉云
联系人：金喆
电话：028－86690126
传真：028－86690126
客服电话：4006600109
网址：www.gjzq.com.cn
（28）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：杨泽柱
联系人：李良
电话：027－65799999
传真：027－85481900
客户服务电话：95579;4008－888－999
网址：http://www.95579.com/
（29）中信期货有限公司
注册地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301－1305室、14层
办公地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301－1305室、14层
法定代表人：张皓
联系人：韩钰
电话：010－6083 3754
传真：010－5776 2999
客户服务电话： 400－990－8826
网址： www.citicsf.com
（30）国都证券股份有限公司
注册地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层
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
网址：www.guodu.com
客户服务电话：400－818－8118
（31）兴业银行股份有限公司
注册地址：福州市湖东路154号
办公地址：上海市江宁路168号
法定代表人：高建平
联系人：刘玲
电话：021－52629999
客服电话：95561
网址：www.cib.com.cn
（32）天相投资顾问有限公司
注册地址：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701 邮编：100032
办公地址：北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座 5 层
法定代表人：林义相
联系人：林爽
电话：010－66045608
传真：010－66045500
客户服务电话：010－66045678
网址：http://www.txsec.com
（33）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楼I、J单元
办公地址： 深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、J单元
法定代表人：薛峰
联系人：童彩萍
联系电话： 0755－33227950
传真： 0755－82080798
客户服务电话： 4006－788－887
网址： www.zlfund.cn及www.jjmmw.com
（34）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：北京市朝阳区德胜门外华严北里2号民建大厦6层
法定代表人：闫振杰
联系人：宋丽冉
联系电话： 010－62020088
客服电话：4008－886－661
传真： 62020088－8802
网址： www.myfund.com
（35）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号楼二层
办公地址： 上海市徐汇区龙田路195号3C座9楼
法定代表人：其实
联系人：潘世友
联系电话：021－54509988－7019
客服电话：400－1818－188
传真：021－64385308
网址：www.1234567.com.cn
（36）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道海曙路东2号
办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼
法定代表人：陈柏青
联系人：周嬿旻
电话：0571－28829790，021－60897869
客服电话：4000－766－123
传真：0571－26698533
网址：http://www.fund123.cn/
（37）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：薛年
联系电话：021－58870011－6705
客服电话：400－700－9665
传真：021－68596916
网址：http://www.howbuy.com/
（38）诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司
注册地址：上海市金山区廊下镇漕廊公路7650号205室
办公地址：上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心8楼
法定代表人：汪静波
联系人：李玲
联系电话：021－38602750
客服电话：400－821－5399
传真：021－38509777
网址： http://www.noah-fund.com/
（39）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10层
办公地址：北京朝外大街22号泛利大厦10层
法定代表人：王莉
联系人：习甜
联系电话：010－85650920
客服电话：400－920－0022
传真：010－85657357
网址： http://licaike.hexun.com/
(40) 浙江金观诚财富管理有限公司
注册地址：拱墅区霞湾巷239号8号楼4楼403室
办公地址：杭州市教工路18号EAC欧美中心A座D区8层
法定代表人：陆彬彬
联系人：鲁盛
联系电话：0571－56028617
客服电话：400－068－0058
传真：0571－56899710
网址： www.jincheng-fund.com
（41）上海利得基金销售有限公司
注册地址：上海市宝山区蕴川路5475号1033室
办公地址：上海东方路989号中达大厦2楼
法定代表人：盛大
联系人：徐雪吟
联系电话：021－50583533－3011
客服电话：400－005－6355
传真：021－50583533
网址： www.leadfund.com.cn
（42）嘉实财富管理有限公司
注册地址：上海市浦东新区世纪大道8号B座46楼06－10单元
办公地址：北京市朝阳区建国路91号金地中心A座6层
法定代表人：赵学军
联系人：景琪
联系电话：010－ 65215266
客服电话：400－021－8850
传真：010－65185678
网址： http://www.harvestwm.cn/
(43) 万银财富（北京）基金销售有限公司
注册地址：中国北京朝阳区北四环中路27号盘古大观3201
办公地址：北京市朝阳区望京浦项中心A座9层04－08
法定代表人：李招弟
联系人：付少帅
联系电话： 010－59497361
客服电话：400－059－8888
传真： 010－64788016
网址： www.wy-fund.com
（44）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：杨翼
联系电话：0571－88911818
客服电话：4008－773－772
网址： www.5ifund.com
（45）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
联系人：单丙烨
联系电话：021－20691832
客服电话：400－089－1289
传真：021－20691861
网址： http://www.erichfund.com
（46）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：北京市西城区宣武门外大街28号富卓大厦16层
法定代表人：杨懿
联系人： 张燕
联系电话：0755－88394666
客服电话：4008－166－1188
传真： 0755－88394677
网址： http://8.jrj.com.cn/
（47） 宜信普泽投资顾问（北京）有限公司
注册地址： 北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809
办公地址： 北京市朝阳区建国路88号SOHO现代城C座1809
法定代表人：沈伟桦
联系人： 王巨明
联系电话： 010－52855713
客服电话： 400－609－9200
网址：　www.yixinfund.com
（48） 北京植信基金销售有限公司
注册地址：北京市密云县兴盛南路8号院2号楼106－67
办公地址：北京市朝阳区建华南路6号卓明大厦2号院2层
法定代表人：杨纪峰
联系人：陶翰辰
联系电话：010－85721404
客服电话：4006－802－123
网址：www.zhixin-inv.com
（49） 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：苏昊
联系电话：010－88312877－8033
客服电话：400－001－1566
网址：www.yilucaifu.com
（50)中国国际期货有限公司
注册地址：北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢1层、2层、9层、11层、12层
办公地址：北京市朝阳区光华路16号中期大厦A座9层
法定代表人：王兵
联系人：赵森
联系电话：010－65807399
客服电话：95162
网址：www.cifco.net
（51)中期资产管理有限公司
注册地址：北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢11层1103号
办公地址：北京市朝阳区建国门外光华路16号中国中期大厦A座11层
法定代表人：路瑶
联系人：侯英建
联系电话：010－65807865
客服电话：010－65807609
网址：www.cifcofund.com
（52)中天嘉华基金销售有限公司
注册地址：北京市石景山区八大处高科技西井路3号3号楼7457房间
办公地址：北京市朝阳区京顺路5号曙光大厦C座1层
法定代表人：黄俊辉
联系人：张立新
联系电话：010－58276785
客服电话：400－650－9972
网址：www.sinowel.com
(53)北京唐鼎耀华投资咨询有限公司
注册地址：北京市延庆县延庆经济开发区百泉街10号2栋236室
办公地址：北京市朝阳区亮马桥路甲40号二十一世纪大厦A303
法定代表人：杨涛
联系人：周君
联系电话：010－53570568
客服电话：400－819－9868
网址：www.tdyhfund.com
（54）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1号楼12层1208号
法定代表人：罗细安
联系人：李皓
联系电话：13521165454
客服电话：400－001－8811
网址：www.zengcaiwang.com
（55）海银基金销售有限公司
注册地址：上海市浦东新区东方路1217号16楼B单元
办公地址：上海市浦东新区东方路1217号16楼B单元
法定代表人：刘惠
联系人：冯立
联系电话：021－80133535
客服电话：400－808－1016
网址：www.fundhaiyin.com
（56）上海大智慧财富管理有限公司
注册地址：上海浦东杨高南路428号1号楼10－11层
办公地址：上海浦东杨高南路428号1号楼10－11层
法定代表人：申健
联系人：付江
联系电话：021－20219988*31781
客服电话：020－20219931
网址：https://8.gw.com.cn/
（57）上海汇付金融服务有限公司
注册地址：上海市黄浦区中山南路100号19层
办公地址：上海市黄浦区中山南路100号19层
法定代表人：冯修敏
联系人：周丹
电话：021－33323999*8318
客服电话：4008202819
网站：fund.bundtrade.com
（58）泛华普益基金销售有限公司
注册地址：成都市成华区建设路9号高地中心1101室
办公地址：四川省成都市锦江区下东大街216号喜年广场A座1502室
联系人：付勇斌
电话：028－86758820
传真：028－86758820－805
客服电话：4008－588－588
网址：www.pyfund.com.cn/
（59） 上海陆金所资产管理有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1333号 14楼09单元
办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼
法定代表人：郭坚
联系人：宁博宇
电话：021－20665952
传真：021－22066653
客户服务电话： 4008219031
网址：www.lufunds.com
(60)北京乐融多源投资咨询有限公司
注册地址：北京市朝阳区西大望路1号1号楼16层1603室
办公地址：北京市朝阳区西大望路1号1号楼16层1603室
法定代表人：董浩
联系人： 张婷婷
电话：010－66045608
传真：010－66045500
客户服务电话： 400－068－1176
网址：www.jimufund.com
(61)上海联泰资产管理有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路277号3层310室
办公地址：上海市长宁区福泉北路518号8号楼3层
法定代表人：燕斌
联系人： 凌秋艳
电话：021－52822063
传真：021－52975270
客户服务电话： 400－046－6788
网址：www.66zichan.com
（62）君德汇富投资咨询有限公司
注册地址：北京市东城区建国门内大街18号15层办公楼一座1502室
办公地址：北京市东城区建国门内大街18号恒基中心办公楼一座2202室
法定代表人：李振
联系人：魏尧
电话：010－65181028
传真：010－65174782/65231189
客服电话：400－066－9355
网址：www.kstreasure.com
（63）上海凯石财富基金销售有限公司
注册地址：上海市黄浦区西藏南路765号602－115室
办公地址：上海市黄浦区延安东路1号凯石大厦4楼
法定代表人：陈继武
联系人：李晓明
电话：021－63333319
传真：021－63332523
客户服务电话：4000 178 000
网址：www.lingxianfund.com
（64）北京微动利投资管理有限公司
注册地址：北京市石景山区古城西路113号景山财富中心341
办公地址：北京市石景山区古城西路113号景山财富中心341
法定代表人： 梁洪军
联系人 ：季长军
电话： 010－52609656
传真： 010－51957430
客户服务电话：400－819－6665
网址：www.buyforyou.com.cn
（65）深圳富济财富管理有限公司
注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）
办公地址：深圳市南山区科苑南路高新南七道惠恒集团二期418室
法定代表人：齐小贺
联系人 刘勇
电话： 0755－83999907－813
传真： 0755－83999926
客户服务电话： 0755－83999907
网址： www.jinqianwo.cn
(66)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
法定代表人：梁蓉
联系人： 赵海峰
电话： 010－66154828
传真： 010－88067526
客户服务电话： 010－66154828
网址： www.5irich.com
（67)中证金牛（北京）投资咨询有限公司
注册地址：北京市丰台区东管头1号2号楼2－45室
办公地址：北京市宣武门外大街甲一号新华社第三工作区A座5层
法定代表人：彭运年
联系人： 孙雯
电话： 010－59336519
传真： 010－59336510
客户服务电话： 4008909998
网址： www.jnlc.com
（68）和耕传承基金销售有限公司
注册地址：郑州市郑东新区心怡路西广场路南升龙广场2号楼701
办公地址：郑州市郑东新区心怡路西广场路南升龙广场2号楼701
法定代表人：李淑慧
联系人： 裴小龙
电话： 0371－55213196
传真： 0371－85518397
客户服务电话：4000－555－671
网址： www.hgccpb.com
（69）汉口银行股份有限公司
注册地址：湖北省武汉市江汉区建设大道933号
办公地址：湖北省武汉市江汉区建设大道933号
法定代表人：陈新民
联系人：李欣
电话：027－82656704
传真：027－82656236
客服电话：96558（武汉）4006096558（全国）
网址：www.hkbchina.com
（70）东莞农村商业银行股份有限公司
注册地址：广东省东莞市东城区鸿福东路2号
办公地址：广东省东莞市东城区鸿福东路2号
法定代表人：何沛良
联系人：林培珊
电话： 0769－22866254
传真： 0679－22866282
客服电话：0769－961122
网址：www.drcbank.com
（71）齐商银行股份有限公司
注册地址：山东省淄博市张店区金晶大道105号
办公地址：山东省淄博市张店区金晶大道105号
法定代表人：杲传勇
联系人：郭媛媛
电话： 0533－2178888－9535
传真：0533－2163766
客服电话：400－86－96588
网址：www.qsbank.cc
（72）德州银行股份有限公司
注册地址：山东省德州市三八东路1266号
办公地址：山东省德州市三八东路1266号
法定代表人：孙玉芝
联系人：王方震
电话： 0534－2297326
传真：0533－2297327
客服电话：40084－96588
网址：www.dzbchina.com
（73）威海市商业银行股份有限公司
注册地址：威海市宝泉路9号
办公地址：威海市宝泉路9号
法定代表人：谭先国
联系人：刘文静
电话： 0631－5211651
传真：0631－5215726
客服电话：40000－96636
网址：www.whccb.com
（74）北京农商银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区阜成门内大街410号
办公地址：北京市西城区金融大街9号金融街中心B座
法定代表人：乔瑞
联系人：王薇娜
电话：010－63229475
传真：010－63229478
客户服务电话：96198
网址：http://www.bjrcb.com
（75）宁波银行股份有限公司
注册地址：浙江省宁波市鄞州区宁南南路７００号
办公地址：浙江省宁波市鄞州区宁南南路７００号
法定代表人：陆华裕
联系人：胡技勋
电话： 0574－89068340
传真：0574－87050024
客服电话：95574
网址：www.nbcb.com.cn
基金管理人可根据有关法律、法规的要求，选择符合要求的机构销售本基金，并及时公告。
（二）基金登记机构
名　称：工银瑞信基金管理有限公司
注册地址：北京市西城区金融大街5号、甲5号6层甲5号601、甲5号7层甲5号701、甲5号8层甲5号801、甲5号9层甲5号901
注册登记业务办公地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦A座6层
法定代表人：郭特华
全国统一客户服务电话：400－811－9999
传　真：010－66583100
联系人：朱辉毅
（三）律师事务所及经办律师
名　称：北京市天元律师事务所
住　所：北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦10层
办公地址：北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦10层
负责人：朱小辉
电　话：010－57763888
传　真：010－57763777
经办律师：吴冠雄、李晗
（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（特殊普通合伙）
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：李慧明，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

工银瑞信新蓝筹股票型证券投资基金

五、基金的类型

股票型

六、基金的投资目标

紧密跟踪中国经济动向，把握中国经济的长期发展趋势和周期变动特征，挖掘不同发展阶段下的优势资产及行业投资机会，积极选择深度受益的新兴蓝筹股票，更好地分享中国经济持续、较快成长的发展成果，力争获取超越业绩比较基准的收益。

七、基金的投资方向

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市交易的股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、权证、股指期货、债券（包括但不限于国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、现金，以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）。

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：股票资产占基金资产的比例为80%－95%，其中，投资于本基金界定的新蓝筹主题股票占非现金资产的比例不低于80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值的5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。

如法律法规或中国证监会允许，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

八、基金的投资策略

1、资产配置策略

本基金将由投资研究团队及时跟踪市场环境变化，根据宏观经济运行态势、宏观经济政策变化、证券市场运行状况、国际市场变化情况等因素的深入研究，判断证券市场的发展趋势，结合行业状况、公司价值性和成长性分析，综合评价各类资产的风险收益水平。在充足的宏观形势判断和策略分析的基础上，采用动态调整策略，在市场上涨阶段中，适当增加权益类资产配置比例，在市场下行周期中，适当降低权益类资产配置比例，力求实现基金财产的长期稳定增值，从而有效提高不同市场状况下基金资产的整体收益水平。

2、股票选择策略

（1）新蓝筹主题的界定

本基金"新蓝筹"主题的界定为：以下四类上市公司的股票。

A .行业发展状况良好，企业处于成长阶段或成熟阶段的早期，市场竞争能力强，企业经营在相对稳健的同时能够保持较高的持续成长能力；过去三年或预期未来两年主营业务收入增长率平均大于GDP 增长率的新兴蓝筹上市公司；B.企业盈利能力较强，主营业务盈利水平较高；财务管理能力较强，现金收支安排有序，资产盈利水平较高；主营业务收入、主营业务利润、息税前收益保持较高的成长性的蓝筹上市公司；C.企业在管理制度、产品开发、技术进步方面具有相当的核心竞争优势，有良好的市场知名度和较好的品牌效应的行业龙头上市公司；D .已实施改革方案，或具有改革预期的传统蓝筹公司。

未来随着企业转型，新蓝筹主题股票的识别及认定也会随之调整。如因基金管理人界定新蓝筹主题的方法调整或者上市公司经营发生变化不再属于本基金管理人所界定的新蓝筹主题的，本基金持有的新蓝筹主题股票的比例低于非现金基金资产的80%，本基金将在三十个工作日之内进行调整。

（2）股票选择

本基金投资从经济增长的长期规律出发，结合我国最新的经济发展战略和经济结构调整方向，采取自下而上的价值型投资策略，通过定性分析与定量分析相结合的办法，以"新蓝筹"资本增值型投资为主导，非常密切地关注公司的管理、历史、商业模式、成长前景。本基金对市场运行特征进行跟踪，选取在行业中已处于龙头地位且具备长期核心竞争优势、持续稳定成长性、估值相对合理和价值稳定成长的新蓝筹主题优质上市公司的股票进行重点投资。

1）定性分析

本基金对上市公司的竞争优势进行定性评估。上市公司在行业中的相对竞争力是决定投资价值的重要依据，主要包括以下几个方面：

A、公司的竞争优势：重点考察公司的市场优势，在细分市场是否占据领先位置，是否具有品牌号召力或较高的行业知名度等；资源优势，包括是否拥有独特优势的物资或非物质资源，比如市场资源、专利技术等；产品优势，包括是否拥有对产品的定价能力等以及其他优势；

B、公司治理评估：本基金认为具有良好公司治理机制的公司具有以下几个方面的特征：①公司治理框架保护并便于行使股东权利，公平对待所有股东；②尊重公司相关利益者的权利；③公司信息披露及时、准确、完整；④公司董事会勤勉、尽责，运作透明；⑤公司股东能够对董事会成员施加有效的监督，公司能够保证外部审计机构独立、客观地履行审计职责。不符合上述治理准则的公司，本基金将给予其较低的评级。

C、公司的盈利模式：对企业盈利模式的考察重点关注企业盈利模式的属性以及成熟程度，考察核心竞争力的不可复制性、可持续性、稳定性；

2）定量分析

本基金将对反映上市公司质量和增长潜力的成长性指标、财务指标和估值指标等进行定量分析，以挑选具有成长优势、财务优势和估值优势的个股。包括：成长性指标（收入增长率、营业利润增长率和净利润增长率等）、财务指标（毛利率、营业利润率、净利率、净资产收益率等）、估值指标（PE、PEG、PS等）。

3、股指期货投资策略

本基金以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货投资。本基金将根据对现货和期货市场的分析，发挥股指期货杠杆效应和流动性好的特点，采用股指期货在短期内取代部分现货，获取市场敞口，投资策略包括多头套期保值和空头套期保值。多头套期保值指当基金需要买入现货时，为避免市场冲击，提前建立股指期货多头头寸，然后逐步买入现货并解除股指期货多头，当完成现货建仓后将股指期货平仓；空头套期保值指当基金需要卖出现货时，先建立股指期货空头头寸，然后逐步卖出现货并解除股指期货空头，当现货全部清仓后将股指期货平仓。本基金在股指期货套期保值过程中，将定期测算投资组合与股指期货的相关性、投资组合beta的稳定性，精细化确定投资方案比例。

4、债券投资策略

本基金在债券投资方面，通过深入分析宏观经济数据、货币政策和利率变化趋势以及不同类属的收益率水平、流动性和信用风险等因素，以久期控制和结构分布策略为主，以收益率曲线策略、利差策略等为辅，构造能够提供稳定收益的债券和货币市场工具组合。

(1)利率策略

研究GDP、物价、就业、国际收支等国民经济运行状况，分析宏观经济运行的可能情景，预测财政政策、货币政策等政府宏观经济政策取向，分析金融市场资金供求状况变化趋势及结构，在此基础上预测金融市场利率水平变动趋势，以及金融市场收益率曲线斜度变化趋势。

组合久期是反映利率风险最重要的指标，根据对市场利率水平的变化趋势的预期，综合宏观经济状况和货币政策等因素的分析判断，可以制定出组合的目标久期，预期市场利率水平将上升时，降低组合的久期，以规避债券价格下降的风险和资本损失，获得较高的再投资收益；预期市场利率将下降时，提高组合的久期，在市场利率实际下降时获得债券价格上升的收益，并获得较高利息收入。

(2)信用策略

根据国民经济运行周期阶段，分析债券发行人所处行业发展前景，发行人业务发展状况，企业市场地位，财务状况，管理水平，债务水平等因素，评价债券发行人的信用风险，并根据特定债券的发行契约，评价债券的信用级别，确定债券的信用风险利差与投资价值。

(3)债券选择与组合优化

本基金将根据债券市场情况，基于利率期限结构及债券的信用级别，在综合考虑流动性、市场分割、息票率、税赋特点、提前偿还和赎回等因素的基础上，评估债券投资价值，选择定价合理或者价值被低估的债券构建投资组合，并根据市场变化情况对组合进行优化。

(4)可转换债券投资

可转换债券兼具权益类证券与固定收益类证券的特性，具有抵御下行风险、分享股票价格上涨收益的特点，是本基金的重要投资对象之一。本基金将选择公司基本素质优良、其对应的基础证券有着较高上涨潜力的可转换债券进行投资，并采用期权定价模型等数量化估值工具评定其投资价值，以合理价格买入并持有。

5、权证投资策略

本基金将因为上市公司进行股权分置改革、或增发配售等原因被动获得权证，或者本基金在进行套利交易、避险交易等情形下将主动投资权证。本基金进行权证投资时，将在对权证标的证券进行基本面研究及估值的基础上，结合隐含波动率、剩余期限、标的证券价格走势等参数，运用数量化期权定价模型，确定其合理内在价值，从而构建套利交易或避险交易组合，力求取得最优的风险调整收益。

6、资产支持证券投资策略

资产支持证券主要包括资产抵押贷款支持证券（ABS）、住房抵押贷款支持证券（MBS）等证券品种。本基金将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析，并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型，评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。

九、基金的业绩比较基准

1、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：

80%×沪深300指数收益率＋20%×中债综合财富指数收益率。

2、选择理由

沪深300指数是由中证指数有限公司编制，由沪深A股中规模大、流动性好的最具代表性的300只股票组成，综合反映了沪深A股市场整体表现。中债综合财富指数由中央国债登记结算有限责任公司编制，该指数旨在综合反映债券全市场整体价格和投资回报情况。该指数涵盖了银行间市场和交易所市场，成份券种包括除资产支持债和部分在交易所发行上市的债券以外的其他所有债券，具有广泛的市场代表性，能够反映债券市场总体走势。本基金管理人认为，该业绩比较基准目前能够忠实地反映本基金的风险收益特征。

本基金是股票型证券投资基金，股票投资比例为80－95%，本基金对沪深300指数和中债综合财富指数分别赋予80%和20%的权重符合本基金的投资特性。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，经与基金托管人协商一致，本基金可在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

（下转B34版）