工银瑞信中证新能源指数分级证券投资基金更新的招募说明书摘要

（2018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:中国银河证券股份有限公司

重要提示

工银瑞信中证新能源指数分级证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会2015年6月2日《关于准予工银瑞信中证新能源指数分级证券投资基金注册的批复》(证监许可〔2015〕1103号文)准予募集注册,本基金基金合同已于2015年7月9日生效,自该日起基金管理人开始管理本基金。

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。

工银瑞信基金管理有限公司(以下称"本基金管理人"或"基金管理人")保证招募说明书的内容真实、准确、完整。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。

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。

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。

本基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人所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。

本招募说明书所载内容截止日为2018年1月8日, 有关财务数据和净值表现数据截止日为2017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

尚军先生,董事长,中国工商银行战略管理与投资者关系部资深专家、专职派出董事。复旦大学工商管理(国际)硕士,高级经济师。历任中国工商银行河南郑州分行团委书记,国际部副总经理,河南分行国际部副总经理、储蓄处处长、国际业务处处长,河南分行副行长、党委委员,陕西分行党委书记、行长等职务。

Michael Levin先生,董事,瑞士信贷董事总经理、亚太地区资产管理主管。Levin先生负责制定和指导亚太区资产管理战略,包括销售、产品和合作伙伴关系。他还与机构和私人银行密切合作,以提供资产管理投资解决方案。在2011年8月加入瑞士信贷之前, Levin先生是AsiaCrest Capital的首席执行官,AsiaCrest Capital是一家位于香港的对冲基金FoF。再之前, 他曾在Hite Capital和英仕曼集团担任投资组合经理。Levin先生也是Metropolitan Venture Partners的联合创始人。他在流动和非流动性另类投资行业拥有超过20年的经验。Levin先生毕业于美国宾夕法尼亚大学沃顿商学院,并获得经济学理学士学位。

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,兼任工银瑞信资产管理(国际)有限公司董事长。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,中国工商银行战略管理与投资者关系部高级专家、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总裁。

2.监事会成员

郑剑锋先生,监事,金融学科学双硕士。2005年12月起,郑剑锋先生任职于中国工商银行监事会办公室,先后担任综合管理处处长、监督专员和监事会办公室副主任,主要负责风险、内控及董事高管履职的监督检查工作。2014年6月起, 郑剑锋先生被任命为中国工商银行战略管理与投资者关系部集团派驻子公司董监事办公室高级专家、专职派出董事。

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。

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,现任内控稽核部总监。

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,现任战略发展部总监。

章琼女士,监事,硕士。2001年至2003年任职于富友证券财务部;2003年至2005年任职于银河基金,担任注册登记专员。2005年加入工银瑞信运作部,现任运作部总监。

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。1997-1999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。

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。

郝炜先生,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,工银瑞信投资管理有限公司董事。2001年4月至2005年6月,任职于中国工商银行资产托管部。2005年加入工银瑞信基金管理有限公司。

4、 本基金基金经理

赵栩先生,10年证券从业经验;2008年加入工银瑞信,曾任风险管理部金融工程分析师,现任指数投资中心投资部副总监,2011年10月18日至今担任工银上证央企ETF基金基金经理;2012年10月9日至今担任工银深证红利ETF基金基金经理;2012年10月9日至今担任工银深证红利和ETF连接基金基金经理, 2015年7月9日至今担任工银瑞信中证环保产业指数分级基金基金经理,2015年7月9日至今担任工银瑞信中证新能源指数分级基金基金经理,2017年12月25日至今担任工银瑞信创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

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。

宋炳珅先生,13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。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,担任工银瑞信红利混合型证券投资基金基金经理;2014年1月20日至2017年5月27日,担任工银瑞信核心价值混合型证券投资基金基金经理;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,担任工银医疗保健行业股票型基金基金经理;2015年2月16日至2017年12月22日,担任工银战略转型主题股票型基金基金经理;2017年4月12日至今,担任工银瑞信中国制造2025股票型证券投资基金基金经理。

欧阳凯先生,15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2014年4月21日担任工银保本混合基金基金经理,2013年2月7日至2017年2月6日担任工银保本2号混合型发起式基金 (自2016年2月19日起变更为工银瑞信优质精选混合型证券投资基金) 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日起至今担任工银瑞信纯债定期开放基金基金经理,2014年9月19日起至今担任工银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,14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,现任权益投资总监。2011年11月23日至今,担任工银瑞信主题策略混合型证券投资基金基金经理;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2017年10月9日,担任工银瑞信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;2016年1月29日至今,担任工银瑞信国家战略主题股票型基金基金经理;2017年4月21日至今,担任工银瑞信互联网加股票型证券投资基金基金经理。

李剑峰先生,14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,现任固定收益投资总监兼养老金投资中心总经理。

郝康先生,17年证券从业经验;先后在澳大利亚首源投资管理公司担任基金经理,在联和运通投资顾问管理公司担任执行董事,在工银瑞信担任国际业务总监,在工银瑞信资产管理(国际)有限公司担任副总经理;2016年加入工银瑞信基金管理有限公司,现任权益投资总监,兼任工银瑞信(国际)投资总监,2016年12月30日至今,担任工银瑞信沪港深股票型证券投资基金基金经理;2017年11月9日至今,担任工银瑞信沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

名称:中国银河证券股份有限公司(以下简称"银河证券")
注册地址:中国北京西城区金融大街35号2-6层
法定代表人:陈共炎
成立日期:2007年1月26日
批准设立机关和批准设立文号:证监会、证监机构字[2007]25号
注册资本:101.37亿元人民币
存续期间:持续经营
基金托管资格批文及文号:证监许可【2014】629号
联系人:李蔚
联系电话:95551

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、场内销售机构

场内销售机构为具有基金销售资格、并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的、可通过深圳证券交易所交易系统办理本基金销售业务的深圳证券交易所场内会员单位。

3、场外销售机构
(1) 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
客户服务电话:95566
传真:010-66594431
联系电话:010-66594431
联系人:侯燕鹏
公司网站:http://www.boc.cn/
(2) 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
电话:021-61618888
传真:021-63602431
联系人:于慧
客户服务电话: 95528
网址: http://www.spdb.com.cn
(3) 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
电话:010-63229475
传真:010-63229478
联系人:王薇娜
客户服务电话: 96198
网址:http://www.bjrcb.com
(4) 招商证券股份有限公司
注册地址: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38-45层
法定代表人:宫少林
联系人:林生迎
电话:0755-82960223
传真:0755-82943636
客户服务电话:4008888111;95565
网址:http://www.newone.com.cn/
(5) 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/
(6) 平安证券股份有限公司
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/
(7) 天风证券股份有限公司
注册地址:湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦4楼
办公地址:湖北省武汉市江汉区唐家墩路32号国资大厦B座4楼
法定代表人: 余磊
联系电话:(027)87618889
传真:(027)87618882
联系人:刘鑫
客服电话:(027)87618889
公司网址:http://www.tfzq.com
(8) 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/
(9) 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
(10)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
(11)国联证券股份有限公司
注册地址:无锡市县前东街168号
办公地址:江苏省无锡市太湖新城金融一街8号国联金融大厦702室
法定代表人:范炎
联系人:沈刚
电话:0510-82831662
传真:0510-82830162
客户服务电话:4008885288(全国),0510-82588168(无锡)
网址:http://www.glsc.com.cn
(12)兴业证券股份有限公司
注册地址:福州市湖东路268号
办公地址:上海市浦东新区长柳路36号
法定代表人:杨华辉
联系人:乔琳雪
电话:021-38565547
传真:021-38565783
客户服务电话:95562
网址:www.xyzq.com.cn
(13)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
(14)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
(15)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
(16)长江证券股份有限公司
注册地址: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:崔少华(代行)
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/
(17)大通证券股份有限公司
注册地址:辽宁省大连市沙河口区会展路129号大连国际金融中心A座-大连期货大厦38、39层
办公地址:辽宁省大连市沙河口区会展路129号大连国际金融中心A座-大连期货大厦38、39层
法定代表人:董永成
客服电话:4008-169-169
网址: www.daton.com.cn
(18)中国银河证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街35号2-6层
办公地址:北京市西城区金融大街35号2-6层
法定代表人:陈共炎
联系人:田薇
电话:010-66568430
传真:010-66568990
客户服务电话:4008888888
网址:http://www.chinastock.com.cn/
(19)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:95521
网址:http://www.gtja.com/
(20)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
(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)光大证券股份有限公司
注册地址: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:薛峰
联系人:刘晨
电话:021-22169081
传真:021-22169134
客户服务电话:4008888788;95525
网址:http://www.ebscn.com/
(23)安信证券股份有限公司
注册地址: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
联系人:陈剑虹
电话:0755-82825551
传真:0755-82558355
客户服务电话:4008001001
网址:http://www.essences.com.cn
(24)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:95310
网址:www.gjzq.com.cn
(25)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
(26)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/
(27)中国国际金融股份有限公司
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/
(28)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:北京市西城区宣武门西大街甲127号大成大厦6层
法定代表人:高冠江
传真:010-63080978
客户服务电话:95321
网址:http://www.cindasc.com
(29)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:邱三发
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
(30)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
办公地址: 北京市西城区金融街5号新盛大厦B座4层
法定代表人:林义相
联系人:谭磊
电话:010-66045182
传真:010-66045518
传真: 010-66045527
网址: www.txsec.com
(31)深圳众禄基金销售股份有限公司
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
(32)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
(33)蚂蚁(杭州)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/
(34)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.ehowbuy.com/
(35)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/
(36)浙江金观诚基金销售有限公司
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
(37)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
(38)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:李兴春
联系人:徐雪吟
联系电话:021-50583533-3011
客服电话:400-921-7755
传真:021-50583533
网址: www.leadfund.com.cn
(39)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/
(40)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
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
(41)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 号国企大厦 C 座 9 层
法定代表人:马令海
联系人:邓洁
客服电话:4008507771
传真:010-58325282
网址: t.jrj.com
(42)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
(43)国信证券股份有限公司
注册地址: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
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
联系人:周杨
电话:0755-82130833
传真:0755-82133952
客户服务电话:95536
网址:http://www.guosen.com.cn/
(44)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/
(45)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
(46)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
注册日期:1988年8月26日
注册资本:190.52亿元人民币
联系人:刘玲
电话:021-52629999
客服电话:95561
网址:www.cib.com.cn
(47)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/
(48)上海陆金所基金销售有限公司
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
(49)北京虹点基金销售有限公司
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:胡伟
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.hongdianfund.com
(50)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
(51)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:王哲宇
电话:021-63333389
传真:021-63333390
客户服务电话:4006 433 389
网址:www.lingxianfund.com
(52)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
(53)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
(54)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
(55)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
(56)通华财富(上海)基金销售有限公司
注册地址: 上海市虹口区同丰路667弄107号201室
办公地址: 上海市浦东新区金桥路28号新金桥大厦5楼
法定代表人: 周盛
联系人: 金昌明
联系电话:021-61766938
客服电话: 400-669-5156
网址:https://www.tonghuafund.com
(57)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 7 0 0 号
办公地址:浙江省宁波市鄞州区宁南南路 7 0 0 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
(58)长城证券股份有限公司
注册地址:深圳市深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层
办公地址:深圳市深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层
法定代表人:黄耀华
联系人:高峰
电话:0755-83516094
传真:0755-83516199
客户服务电话:400-6666-888
网址:www.cgws.com
(59)中国民生银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区复兴门内大街2号
办公地址:北京市西城区西绒线胡同28号天安国际办公大楼
法定代表人:洪崎
联系人:董云巍
电话:010-58560666
传真:010-57092611
客户服务电话:95568
网址:http://www.cmbc.com.cn/
(60)太平洋证券股份有限公司
注册地址:云南省昆明市青年路389号志远大厦18层
办公地址:北京市西城区北展北街9号华远企业号D座3单元
法定代表人:李长伟
联系人:唐昌田
传真:010-88321763
客户服务电话:4006650999
网址:www.tpyzq.com
(61)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
(62)北京钱景基金销售有限公司
注册地址:北京市海淀区丹棱街丹棱SOHO 1008-1012
办公地址:北京市海淀区丹棱街丹棱SOHO 1008-1012
法定代表人:赵荣春
联系人:盛海娟
电话: 010-57418813
传真:010-57569671
客户服务电话: 400-893-6885
网址: www.qianjing.com
(63)奕丰金融服务(深圳)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:深圳市南山区海德三道航天科技广场A座17楼1704室
法定代表人:TEO WEE HOWE
联系人: 陈广浩
电话: 0755 8946 0500
传真: 0755 2167 4453
客户服务电话:400-684-0500
网址: www.ifastps.com.cn
(64)珠海盈米财富管理有限公司
注册地址:珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491
办公地址:广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼B1201-1203
法定代表人:肖雯
联系人:钟琛
电话:020-89629099
传真:020-89629011
客服电话:020-89629066
网址:www.yingmi.cn
(65)北京汇成基金销售有限公司
注册地址:北京市海淀区中关村大街11号11层1108
办公地址:北京市海淀区中关村大街11号11层1108
法定代表人: 王伟刚
联系人: 李瑞真
电话: 010-56282140
传真: 010-62680827
客户服务电话: 400-619-9059
网址: www.fundzone.cn
(66)北京广源达信基金销售有限公司
注册地址:北京市西城区新街口外大街28号C座六层605室
办公地址:北京市朝阳区宏泰东街浦项中心B座19层
法定代表人:齐剑辉
联系人: 王英俊
电话: 010-52798634
传真: 010-82055860
客户服务电话: 400-623-6060
网址: www.niuniufund.com
(67)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北路甲19号SOHO嘉盛中心30层3001室
法定代表人:李悦
联系人: 张晔
电话: 010-56642600
传真: 010-56642623
客户服务电话: 4008-980-618
网址: www.chtfund.com
(68)泰诚财富基金销售(大连)有限公司
注册地址:辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号
办公地址:辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号
法定代表人:林卓
联系人: 姜焕洋
电话: 0411-88891212
传真: 0411-84396536
客户服务电话: 400-0411-001
网址: www.taichengcaifu.com
(69)北京新浪仓石基金销售有限公司
注册地址:北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2地块新浪总部科研楼5层518室
办公地址:北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2地块新浪总部科研楼5层518室
法定代表人: 李昭琛
联系人: 吴翠
电话: 010-60619607
传真: 8610-62676582
客户服务电话: 010-62675369
网址: www.xincai.com
(70)华西证券股份有限公司
注册地址:四川省成都市陕西街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:杨炯阳
联系人:金达勇
电话:0755-83025723
传真:0755-83025991
网址:http://www.hx168.com.cn
(71)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/
(72)北京肯特瑞财富投资管理有限公司
注册地址: 北京市海淀区中关村东路66号1号楼22层2603-06
办公地址:北京市亦庄经济开发区科创十一街十八号院京东集团总部A座
法定代表人: 江卉
联系人: 万容
电话: 010-89188345
传真: 89189566
客户服务电话: 个人业务:95118 企业业务:400 088 8816
网址:http://fund.jd.com
(73)上海华夏财富投资管理有限公司
注册地址:上海市虹口区东大名路687号1幢2楼268室
办公地址:北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座16层
法定代表人:毛淮平
联系人:仲秋玥
电话: 010-88066632
传真: 010-88066214
客户服务电话: 400-817-5666
网址:www.amcfortune.com
(74)北京蛋卷基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507
办公地址:北京市朝阳区望京阜通东大街 望京SOHO T3 A座 19层
法定代表人: 钟斐斐
联系人: 戚晓强
电话: 010-61840688
传真: 010-61840699
客户服务电话: 4000618518
网址: https://danjuanapp.com
(75)江海证券有限公司
注册地址:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号
办公地址:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号
法定代表人:孙名扬
联系人:张宇宏
电话:0451-82336863
传真:0451-82287211
客户服务电话:4006662288
网址:http://www.jhzq.com.cn
(76)大同证券有限责任公司
注册地址:山西省大同市大北街13号
办公地址:太原市长治路111 号山西世贸中心A 座F12、F13
法定代表人:董祥
联系人:薛津
电话:0351-4130322
传真:0351-4192803
客户服务电话:4007121212
网址:http://www.dtsbc.com.cn
(77)上海基煜基金销售有限公司
注册地址: 上海市崇明县长兴镇路潘园公路1800号2号楼6153室(上海泰和经济发展区)
办公地址: 上海市杨浦区昆明路518号A1002室
法定代表人:王翔
联系人: 蓝杰
电话: 021-65370077-220
传真: 021-55085991
客户服务电话: 400-820-5369
网址: www.jiyufund.com.cn
(78)大泰金石基金销售有限公司
注册地址: 南京市建邺区江东中路222号南京奥体中心现代五项馆2105室
办公地址: 上海市浦东新区峨山路505号东方纯一大厦15楼
法定代表人:袁顾明
联系人: 赵明
电话: 021-20324155
传真: 021-20324199
客户服务电话: 400-928-2266
网址:www.dtfunds.com
(79)上海挖财金融信息服务有限公司
注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02、03室
办公地址: 中国(上海)自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02、03室
法定代表人: 胡燕亮
联系人:樊晴晴
电话: 021-50810687
传真: 021-58300279
客户服务电话:021-50810673
网址: www.wacaijijin.com
(80)上海万得基金销售有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区福山路33号11楼B座
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区福山路33号8楼
法定代表人:王廷富
联系人: 沈杰
电话: 021-5132 7185
传真: 021-5071 0161
客户服务电话:400-821-0203
网址:www.520fund.com.cn
(81)金惠家保险代理有限公司
注册地址:北京市海淀区东升园公寓1号楼1层南部
办公地址:北京市朝阳门外大街18号丰联广场A座1009
法定代表人: 夏予柱
联系人: 胡明哲
电话: 15810201340
传真: 028-62825327
客户服务电话: 400-8557333
网址: www.jhjfund.com
(82)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

基金管理人可根据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》和本基金基金合同等的规定,选择其他符合要求的机构销售本基金,并及时履行公告义务。

(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
注册地址:北京市西城区太平桥大街17号
注册登记业务办公地址:北京市西城区太平桥大街17号
法定代表人:周明
电话:010-50938856
传真:010-50938907
联系人:崔巍

(三)出具法律意见书的律师事务所
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
负责人:俞卫锋
电话:021-31358666
传真:021-31358600
联系人:孙睿
经办律师:黎明、孙睿

(四)审计基金财产的会计师事务所
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

本基金名称:工银瑞信中证新能源指数分级证券投资基金

五、基金的类型

本基金类型:股票型证券投资基金

六、基金的投资目标

采用指数化投资,通过控制基金投资组合相对于标的指数的偏离度,实现对标的指数的有效跟踪。通过产品分级设置,为不同份额投资者提供具有差异化收益和风险特征的投资工具。

七、基金的投资方向

本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具,包括中证新能源指数的成份股及其备选成份股、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、短期融资券(含超短期融资券))、资产支持证券、债券回购、股指期货、权证以及经中国证监会允许基金投资的其它金融工具,但需符合中国证监会的规定。法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金的股票资产投资比例不低于基金资产的90%,其中投资于中证新能源指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的80%,任何交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。股指期货、权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

八、基金的投资策略

本基金采取完全复制策略,即按照标的指数的成份股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及其权重的变动进行相应调整。但因特殊情况(如市场流动性不足、成分股被限制投资等)导致基金无法获得足够数量的股票时,基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合,追求尽可能贴近目标指数的表现。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0.35%,偏离度年化标准差不超过4%。

1、股票资产指数化投资策略

本基金股票资产投资原则上采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数。通常情况下,本基金根据标的指数成分股票在指数中的权重确定成分股票的买卖数量。

在特殊情况下,本基金将选择其它股票或股票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)本基金资产规模过大导致本基金持有该股票比例过高;
(4)成份股上市公司存在重大虚假陈述等违规行为、或者面临重大的不利行政处罚或司法诉讼;
(5)有充分合理的理由认为其市场价格被操纵等。

进行此等替换遵循的原则如下:
(1)优先考虑用以替换的股票与被替换的股票属于同一行业;
(2)替换后,该成份股票所在行业在基金股票资产组合中的权重与标的指数中该行业权重相一致;
(3)用以替换的股票或股票组合与被替换的股票在考查期内日收益率序列风险收益特征高度相关,能较好地代表被替代股票的收益率波动情况。

2、股票指数化投资日常投资组合管理

(1)标的指数定期调整

根据标的指数的编制规则及调整公告,本基金在指数成份股调整生效前,分析并确定组合调整策略,及时进行投资组合的优化调整,减少流动性冲击,尽量减少标的指数成份股变动所带来的跟踪偏离度和跟踪误差。

(2)成份股公司信息的日常跟踪与分析

跟踪标的指数成份股公司信息(如:股本变化、分红、配股、增发、停牌、复牌等),以及成份股公司其他重大信息,分析这些信息对指数的影响,并根据这些信息确定基金投资组合每日交易策略。

(3)标的指数成份股票临时调整

在标的指数成份股票调整周期内,若出现成份股票临时调整的情形,本基金管理人将密切关注样本股票的调整,并及时制定相应的投资组合调整策略。

(4)申购赎回情况的跟踪与分析

跟踪本基金申购和赎回信息,结合基金的现金头寸管理,分析其对组合的影响,制定交易策略以应对基金的申购赎回。

(5)跟踪偏离度的监控与管理

每日跟踪基金组合与标的指数表现的偏离度,每月末、季度末定期分析基金的实际组合与标的指数表现的累计偏离度、跟踪误差变化情况及其原因,并优化跟踪偏离度管理方案。

3、债券投资策略

本基金基于流动性管理及策略性投资的需要,将投资于国债、金融债等期限在一年期以下的债券,债券投资的目的是保证基金资产流动性,有效利用基金资产,提高基金资产的投资收益。

4、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,参与股指期货的投资。此外,本基金还将运用股指期货来对冲诸如预期大额申购赎回、分红等特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理。

本基金通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究,主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征,通过资产配置、品种选择,谨慎进行投资,以降低投资组合的整体风险。

5、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。

6、其他金融工具投资策略

在法律法规许可时,本基金可基于谨慎原则运用权证等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理,以提高投资效率,管理基金投资组合风险水平,以更好地实现本基金的投资目标。本基金管理人运用上述金融衍生工具必须是出于追求基金充分投资、减少交易成本、降低跟踪误差的目的,不得应用于投机交易目的,或用作杠杆工具放大基金的投资。

九、基金的业绩比较基准

本基金投资组合的业绩比较基准为: 中证新能源指数收益率×95%+金融机构人民币活期存款基准利率(税后)×5%。

十、基金的风险收益特征

本基金属于股票型基金,其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。此外,本基金作为指数型基金,采用完全复制策略,跟踪标的指数表现,目标为获取指数的平均收益,是股票基金中处于中等风险水平的基金产品。

本基金的分级设定则决定了不同份额具有不同的风险和收益特征。工银新能源A份额具有低风险、低预期收益的特征;工银新能源B份额具有高风险、高预期收益的特征。

十一、基金的投资组合报告

本报告期自2017年10月1日起至12月31日止(财务数据未经审计)。

1.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	47,358,316.58	93.73
	其中:股票	47,358,316.58	93.73
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	3,132,509.92	6.20
8	其他资产	35,367.76	0.07
9	合计	50,526,194.26	100.00

注:由于四舍五入的原因金额占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

1.2.1报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	39,442,238.08	78.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,647,738.00	7.26
E	建筑业	950,199.00	1.89
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,371,815.50	4.72
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	946,326.00	1.88
	合计	47,358,316.58	94.28

注:由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

1.2.2报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合
无。

1.2.3报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
无。

1.3 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

1.3.1报告期末指数投资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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600703	三安光电	109,612	2,783,048.68	5.54
2	002594	比亚迪	40,600	2,641,030.00	5.26
3	601012	隆基股份	62,595	2,280,961.80	4.54
4	002202	金风科技	91,091	1,717,065.35	3.42
5	600089	特变电工	166,544	1,650,451.04	3.29
6	002460	赣锋锂业	22,800	1,635,900.00	3.26
7	002466	天齐锂业	30,729	1,635,090.09	3.26
8	601985	中国核电	209,100	1,536,885.00	3.06
9	300124	汇川技术	44,700	1,297,194.00	2.58
10	600406	国电南瑞	65,300	1,193,684.00	2.38

1.3.2报告期末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明细
无。

1.4 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。

1.5 报告期末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明细
本基金本报告期末未持有债券。

1.6 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。

1.7 报告期末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明细
本基金本报告期末未持有贵金属。

1.8 报告期末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明细
本基金本报告期末未持有权证。

1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

1.9.1报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有股指期货投资,也无期间损益。

1.9.2本基金投资股指期货的投资政策
本报告期内,本基金未运用股指期货进行投资。

1.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

1.10.1本期国债期货投资政策
本报告期内,本基金未运用国债期货进行投资。

1.10.2报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货投资,也无期间损益。

1.10.3本期国债期货投资评价
本报告期内,本基金未运用国债期货进行投资。

1.11 投资组合报告附注

1.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未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。

1.11.2本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。

1.11.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	5,062.45
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	720.92
5	应收申购款	29,584.39
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	35,367.76

1.11.4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。

1.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

1.11.5.1报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明
无。

1.11.5.2报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明
无。

1.11.6投资组合报告附注的其他文字描述部分
无。

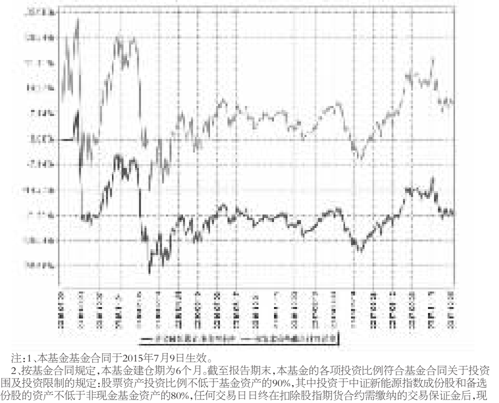
十二、基金的业绩

基金管理人承诺以恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不向投资者保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

1、本基金合同生效日为2015年7月9日,基金合同生效以来(截至2017年12月31日)的投资业绩及同期基准的比较如下表所示:

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
2015.7.9至2015.12.31	-7.28%	2.13%	26.15%	3.18%	-33.43%	-1.05%
2016年	-18.81%	1.97%	-18.60%	1.98%	-0.21%	-0.01%
2017年	5.69%	1.02%	7.82%	1.01%	-2.13%	0.01%
自基金合同生效日起至今	-20.44%	1.69%	10.71%	1.99%	-31.15%	-0.30%

2、本基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较:
(2015年7月9日至2017年12月31日)



注:1、本基金基金合同于2015年7月9日生效。

2、按基金合同规定,本基金建仓期为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范围及投资限制的规定:股票资产投资比例不低于基金资产的90%,其中投资于中证新能源指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的80%,任何交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。股指期货、权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

十三、费用概览

(一)与基金运作有关的费用

1. 基金费用的种类
(1)基金管理人的管理费;
(2)基金托管人的托管费;
(3)标的指数许可使用费;
(4)因基金的证券、期货交易或结算而产生的费用;
(5)基金合同生效以后的信息披露费用;
(6)基金份额持有人大会费用;
(7)基金合同生效以后的会计师费和律师费;
(8)基金资产的资金汇划费用;
(9)基金上市费及年费;
(10)按照国家有关法律法规规定可以列入的其他费用。

2. 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

(1)基金管理人的管理费

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的1.0%年费率计提。

在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的1.0%年费率计提。计算方法如下:

H=E×1.0%÷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,逐日累计至每个月月末,按月支付。经基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核无误后,次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

若遇法定节假日或不可抗力致使无法按时支付的, 顺延至法定节假日结束之日起3个工作日内或不可抗力情形消除之日起3个工作日内支付。

(2)基金托管人的基金托管费

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的0.2%年费率计提。

在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的0.2%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.2%÷当年天数
H 为每日应计提的基金托管费
E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提,逐日累计至每个月月末,按月支付。经基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核无误后,次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

若遇法定节假日或不可抗力致使无法按时支付的, 顺延至法定节假日结束之日起3个工作日内或不可抗力情形消除之日起3个工作日内支付。

(3)基金合同生效后的标的指数许可使用费

本基金的标的指数使用许可费按前一日基金资产净值的0.02%的年费率计提,且收取下限为每季度人民币5万元(基金合同生效日所在季度除外)。计算方法如下:

H= E×0.02%÷当年天数
H为每日应计提的标的指数使用许可费
E为前一日的基金资产净值

标的指数使用许可费每日计算,逐日累计,按季支付。标的指数使用许可费的支付由基金管理人向基金托管人发送划付指令,经基金托管人复核后从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至法定节假日结束之日起3个工作日内或不可抗力情形消除之日起3个工作日内支付。

基金管理人可根据指数使用许可协议,对上述计提标准和计提方式进行合理变更,此项变更无需召开基金份额持有人大会,基金管理人将在更新招募说明书或其他公告中披露基金最新适用的计提标准和计提方法。

本条第(一)款第4至第10项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定,列入当期基金费用。

3. 不列入基金费用的项目

本条第(一)款约定以外的其他费用,以及基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失等不列入基金费用。

4. 基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费,无须召开基金份额持有人大会。

5. 税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

(二)与基金销售有关的费用

1、 申购费用

本基金申购采用金额申购方式,申购费率如下表。投资者在一天之内如果有多笔申购,费率按单笔分别计算。

申购金额M(含申购费)	申购费率
M<5万	1.0%
5万≤M	0%

本基金的申购费用由申购人承担,不列入基金资产,用于基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

工银新能源份额的场内申购费率由基金代销机构参照场外申购费率执行。

申购费用的计算方法:
净申购金额=申购金额/(1+申购费率)
申购费用=申购金额-净申购金额

2、赎回费用

本基金的场内赎回适用固定的赎回费率为0.7%。

场外赎回费率按基金份额持有期限递减。从场内转托管至场外的基金份额,从场外赎回时,其持有期限从转托管转入确认日开始计算。

连续持有时间(N)	场外赎回费率
N<1年	0.7%
1年≤N<2年	0.25%
N≥2年	0%

(注:1年指365天,2年为730天,依此类推)

3、工银新能源份额的赎回费用由基金份额持有人承担,其中不低于25%的部分归入基金财产,其余部分用于支付注册登记费和其他必要的等相关手续费。

4、基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式,并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

5、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划,定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间,按相关监管部门要求履行必要手续后,基金管理人可以适当调低工银新能源份额的申购费率和赎回费率。

6、办理工银新能源份额的场内申购、赎回业务应遵守深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关业务规则。若相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对场内申购、赎回业务规则有新的规定,基金合同相应予以修改,并按照新规定执行,且此项修改无须召开基金份额持有人大会。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《基金法》、《运作办法》、《销售管理办法》、《信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求,对本基金招募说明书进行了更新,更新内容如下:

1、 在"重要提示"部分,更新了招募说明书内容截止日及财务数据和净值表现数据截止日。

2、在"三、基金管理人"部分,更新了基金管理人主要人员的信息。

3、在"五、相关服务机构"部分,更新了场外销售机构的相关信息。

4、在"十三、基金的投资"部分,更新了基金的最近一期的投资组合报告等信息。

5、在"十四、基金的业绩"部分,更新了基金截至2017年12月31日的业绩表现情况。

6、在"二十六、对基金份额持有人的服务"部分,更新了为基金份额持有人提供的在线客户服务等相关信息。

7、在"二十七、其他应披露事项"部分,增加了本次更新内容期间的本基金相关的公告。

上述内容仅为本更新招募说明书的摘要,投资人欲查询本更新招募说明书正文,可登陆工银瑞信基金管理有限公司网站www.icbccs.com.cn。

工银瑞信基金管理有限公司
二〇一八年二月十四日