

---

深证红利交易型开放式指数证券投资基金  
更新的招募说明书摘要  
(2017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：中国农业银行股份有限公司

## 重要提示

本基金经中国证券监督管理委员会2010年6月13日证监许可[2010]808号文核准募集，本基金基金合同于2010年11月5日起正式生效。

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，投资者投资本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，并对投资基金的意愿、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，由投资者自行承担。

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《证券投资基金法》、《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。

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，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2017年5月4日，有关财务数据和净值表现数据截止日为2017年3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

中国银监会银监复【2005】105号

经营范围：基金募集；基金销售；资产管理以及中国证监会许可的其它业务。

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。

Neil Harvey 聂瀚文先生，董事，是瑞士信贷（香港）有限公司董事总经理，常驻香港。聂先生是瑞信大中华区主席兼香港CEO，同时他也是亚太区资产管理主席；并为亚太区运营委员会成员。聂先生从事投资银行和资产管理业务长达三十年，在亚太地区工作二十年，拥有对新兴市场和亚太区的丰富经验和深入了解。聂先生在瑞士信贷工作了十七年，

担任过很多要职，他之前曾为亚太区和新兴市场资产管理部主管。此前，亦曾担任亚洲（除日本）投资银行部和固定收益业务负责人。另外，他在瑞信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，现任副总监。

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，现任工银瑞信运作部联席总监。

## 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，9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ETF连接基金基金经理，2013年5月28日至今担任工银标普全球自然指数基金（自2016年12月6日起，变更为工银瑞信国际原油证券投资基金（LOF））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。

本基金历任基金经理：

樊智先生：2010年11月5日至2011年7月14日管理本基金。

何江先生：2011年5月25日至2014年10月21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。

江明波先生，简历同上。

杜海涛先生，简历同上。

宋炳坤先生，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，担任工银瑞信红利混合型证券投资基金基金经理；2014年1月20日至今，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日至今，担任工银战略转型主题股票基金基金经理；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2017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；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。

上述人员之间均不存在近亲属关系。

## 二、基金托管人

名称：中国农业银行股份有限公司（简称中国农业银行）

住所：北京市东城区建国门内大街69号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座

法定代表人：周慕冰

成立日期：2009 年 1 月 15 日

批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复[2009]13 号

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]23 号

注册资本：32,479,411.7 万元人民币

存续期间：持续经营

联系电话：010-66060069

传真：010-68121816

联系人：林葛

### 三、相关服务机构

#### （一）基金份额销售机构

##### 1、申购赎回代理证券公司

###### （1）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：[www.gtja.com](http://www.gtja.com)

###### （2）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：齐晓燕

电话：0755-82130833

传真：0755-82133952



客户服务电话：95536

网址：[www.guosen.com.cn](http://www.guosen.com.cn)

(3) 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：95565、4008888111

网址：[www.newone.com.cn](http://www.newone.com.cn)

(4) 光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 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：[www.ebscn.com](http://www.ebscn.com)

(5) 山西证券股份有限公司

注册地址：太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼

办公地址：太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼

法定代表人：侯巍

联系人：郭熠

电话：0351-8686659

传真：0351-8686619

客户服务电话：4006661618

网址：[www.i618.com.cn](http://www.i618.com.cn)

(6) 广发证券股份有限公司

注册地址：广州市天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼（4301-4316 房）

办公地址：广东省广州天河北路大都会广场 5、18、19、36、38、39、41、42、43、44 楼

法定代表人：孙树明

联系人：黄岚

电话：020—87555888

传真：020—87555305

客户服务电话：95575 或致电各地营业网点

网址：<http://www.gf.com.cn>

（7）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：0871-3577946

联系人：高国泽

电话：0871-3577942

（8）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：[www.htsec.com](http://www.htsec.com)

（9）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：[www.qlzq.com.cn](http://www.qlzq.com.cn)

(10) 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

电话：0591-87383623

传真：0591-87383610

客户服务电话：96326（福建省外请先拨 0591）

网址：[www.hfzq.com.cn](http://www.hfzq.com.cn)

(11) 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：北京市东城区朝阳门内大街 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/>

(12) 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>

## (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：[www.swsc.com.cn](http://www.swsc.com.cn)

## (14) 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>

## (15) 华泰证券股份有限公司

注册地址：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、深圳市福田区深南大道 4011 号港中旅大厦 24 楼

法定代表人：吴万善

联系人：庞晓芸

电话：025-84457777

传真：025-84579763

客户服务电话：95597

网址：<http://www.htsc.com.cn/>

## (16) 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 2—6 层

法定代表人：陈有安

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/>

## 2、二级市场交易代理证券公司

包括具有经纪业务资格及深圳证券交易所会员资格的所有证券公司。

3、基金管理人可根据有关法律法规，选择其他符合要求的机构销售本基金，并及时公告。

### （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：周明

联系人：崔巍

电话：010-59378856

传真：010-59378907

### （三）律师事务所及经办律师

名称：北京德恒律师事务所

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、王莹

### （四）会计师事务所及经办注册会计师

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

法定代表人：杨绍信

经办注册会计师：许康玮、吴海霞

联系电话：(021) 23238888

传 真：(021) 23238800

联系人：吴海霞

#### 四、基金的名称

本基金名称：深证红利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：股票型指数基金

#### 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，力争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、一级市场新股、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。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。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%。

#### 八、基金的投资策略

本基金采取完全复制策略，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0.1%，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，确定合理的交易策略。

3) 实施交易策略，以实现基金最优组合结构。

##### （3）标的指数成份股票定期调整

根据标的指数的编制规则及调整公告，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。

##### （4）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的申购赎回清单以及基金的每日交易策略。

##### （5）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。

##### （6）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。

#### (7) 跟踪偏离度的监控与管理

基金经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、现金控制情况、标的指数成份股调整前后的操作以及成份股未来可能发生的变化等，并优化跟踪偏离度管理方案。

### 2、其他金融工具投资策略

本基金基于流动性管理的需要，本基金可以投资于期限在一年期以下的国家债券、央行票据和政策性金融债，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。

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。本基金投资于各种衍生工具的比例不超过基金资产净值的 10%。

## 九、基金的标的指数与业绩比较基准

本基金的标的指数为深证红利价格指数。

本基金股票资产跟踪的标的指数为深证红利价格指数（简称“深红利 P”，当前代码为 399324）。深证红利价格指数是由深圳证券交易所委托深圳证券信息有限公司编制并发布的市场指数，它的成份股选自在深圳证券交易所上市的具有稳定分红历史、较高分红比例且流动性较有保证的 40 只股票组成，成份股每年调整一次。深证红利价格指数成份股数量适中、股息回报率高、规模和流动性较好，适宜作为投资标的和指数衍生工具的基础。深证红利价格指数样本股包括众多成熟的绩优股或分红能力较强的成长股，整体市场表现良好，指数回报率自基日以来在各指数中名列前茅。

本基金的业绩比较基准为：本基金标的指数

如果指数发布机构变更或者停止上述标的指数编制及发布，或者上述标的指数由其它指数代替，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，进行适当的程序变更本基金的标的指数，并同时更换本基金的基金名称与业绩比较基准。其中，若标的指



数变更涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更，则基金管理人应就变更标的指数召开基金份额持有人大会，并在通过之日起 5 日内报中国证监会核准或者备案且在指定媒体上刊登公告。若标的指数变更对基金投资无实质性影响(包括但不限于编制机构变更、指数更名等)，则无需召开基金份额持有人大会，基金管理人应在取得基金托管人同意后，报中国证监会备案。并应至少提前 30 个工作日在中国证监会指定的信息披露媒体上刊登公告。

## 十、基金的风险收益特征

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。本基金为指数基金，主要采用完全复制策略，跟踪标的指数市场表现，是股票基金中处于中等风险水平的基金产品。

## 十一、基金的投资组合报告

本投资组合报告期为 2017 年 1 月 1 日起至 3 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	223,659,693.18	99.00
	其中：股票	223,659,693.18	99.00
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	2,244,075.37	0.99
8	其他资产	17,234.69	0.01
9	合计	225,921,003.24	100.00

注：1、股票投资项含可退替代款估值增值。

2、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	1,391,784.30	0.62
C	制造业	143,357,635.71	63.58
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,587,440.00	1.15
E	建筑业	-	-
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	-	-
J	金融业	45,246,861.32	20.07
K	房地产业	26,566,761.85	11.78
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	4,509,210.00	2.00
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	-	-
	合计	223,659,693.18	99.19

注：1、合计项不含可退替代款估值增值；

2、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沪港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	000651	格力电器	912,082	28,912,999.40	12.82
2	000333	美的集团	854,381	28,450,887.30	12.62
3	000002	万科A	789,946	16,257,088.68	7.21
4	000858	五粮液	354,298	15,234,814.00	6.76
5	000001	平安银行	1,616,105	14,819,682.85	6.57
6	000776	广发证券	578,035	9,878,618.15	4.38
7	002304	洋河股份	105,820	9,246,551.60	4.10
8	000166	申万宏源	1,233,470	7,647,514.00	3.39
9	000783	长江证券	681,430	6,671,199.70	2.96
10	000423	东阿阿胶	99,900	6,553,440.00	2.91

### 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、处罚的投资决策程序说明：

广发证券：

违规行为：

经查，广发证券涉嫌违法违规的事实如下：2014年9月，广发证券对杭州恒生网络技术服务有限公司HOMS系统（以下简称HOMS系统）开放接入。同年12月，广发证券上海分公司对该系统开放专线接入，2015年5月19日，专线连通。2015年3月30日，广发证券上海分公司为上海铭创软件技术有限公司系统（以下简称铭创系统）安装第三个交易网关。对于上述外部接入的第三方交易终端软件，广发证券未进行软件认证许可，未对外部系统接入实施有效管理，对相关客户身份情况缺乏了解。截止调查日，广发证券客户中有123个使用HOMS系统、铭创系统接入的主账户。对上述客户，广发证券未采集客户交易终端信息，未能确保客户交易终端信息的真实性、准确性、完整性、一致性、可读性，未采取可靠措施采集、记录与客户身份识别有关的信息。2015年5月25日，广发证券已知

悉并关注 HOMS 系统等系统存在引发违规配资及违反账户实名制管理有关规定等问题,广发证券在未采集上述客户身份识别信息的情况下,未实施有效的了解客户身份的回访、检查等程序。综上,广发证券未按照《证券登记结算管理办法》第二十四条,《关于加强证券期货经营机构客户交易终端信息等客户信息管理的规定》第六条、第八条、第十三条,《中国证监会关于加强证券经纪业务管理的规定》第三条第(四)项,《中国证券登记结算有限责任公司证券账户管理规则》第五十条的规定对客户的信息进行审查和了解,违反了《证券公司监督管理条例》第二十八条第一款的规定,构成《证券公司监督管理条例》第八十四条第(四)项所述的行为,获利 6,805,135.75 元。时任广发证券经纪业务总部总经理王新栋、信息技术部总经理林建何为直接负责的主管人员,广发证券上海分公司总经理梅纪元、上海分公司电脑部主管周翔为其他直接责任人员。

处分类型:

根据当事人违法行为的事实、性质、情节和社会危害程度,依据《证券公司监督管理条例》第八十四条的规定,我会拟决定:

一、对广发证券责令整改,给予警告,没收违法所得 6,805,135.75 元,并处以 20,415,407.25 元罚款;

二、对王新栋给予警告,并处以 10 万元罚款;

三、对林建何给予警告,并处以 10 万元罚款;

四、对梅纪元给予警告,并处以 10 万元罚款;

五、对周翔给予警告,并处以 10 万元罚款。

投资决策流程符合公司的制度要求,目前公司经营状况良好,业绩稳定,对投资无重大影响。

#### 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	16,732.20
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	502.49
5	应收申购款	-

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,234.69

#### 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

无。

#### 1.11.6 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。

#### 1.11.7 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。

#### 1.11.8 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2010年11月5日，基金合同生效以来（截至2017年3月31日）的投资业绩及同期基准的比较如下表所示：

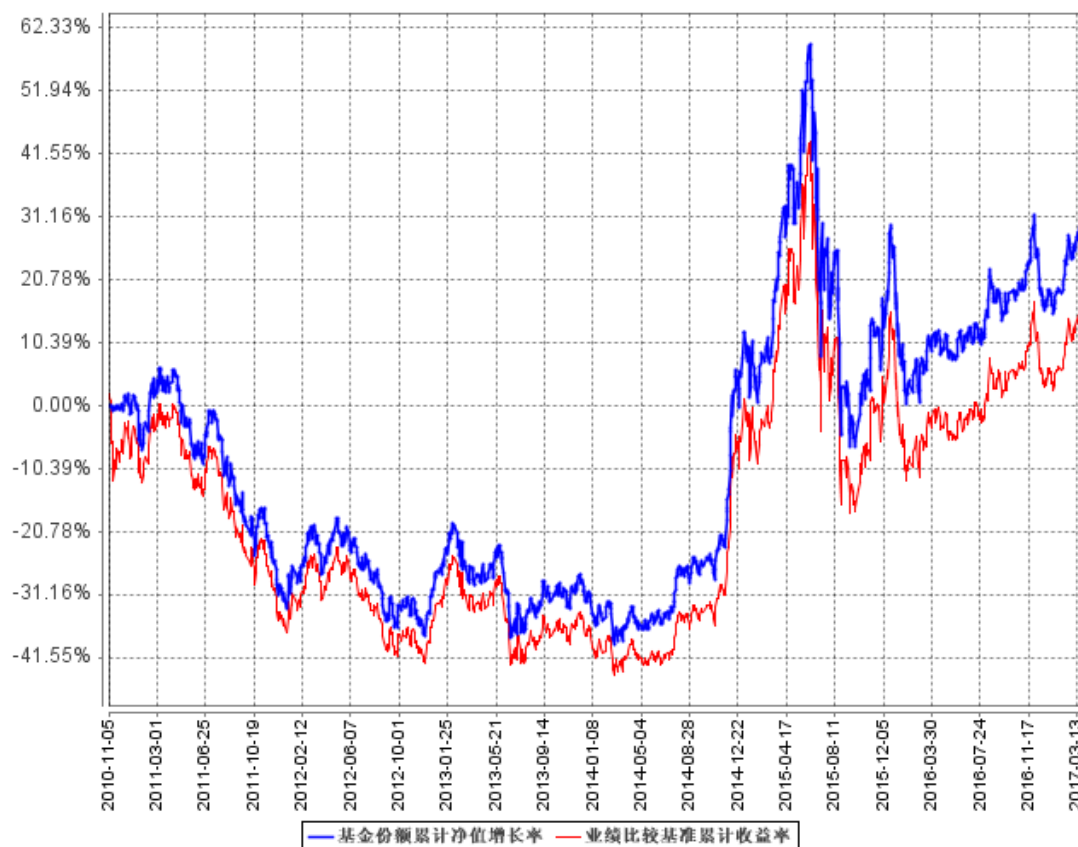
阶段	净值增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基准 收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
2010.11.5-2010.12.31	0.35%	0.59%	-5.45%	1.97%	5.80%	-1.38%
2011年	-31.14%	1.37%	-31.48%	1.38%	0.34%	-0.01%
2012年	5.20%	1.43%	4.00%	1.44%	1.20%	-0.01%
2013年	-4.55%	1.46%	-5.66%	1.47%	1.11%	-0.01%

2014年	55.32%	1.34%	52.53%	1.36%	2.79%	-0.02%
2015年	15.61%	2.62%	14.44%	2.68%	1.17%	-0.06%
2016年	-6.54%	1.35%	-6.61%	1.45%	0.07%	-0.10%
2017.1.1-2017.3.31	10.38%	0.82%	10.81%	0.82%	-0.43%	0.00%
自基金合同生效起至今	28.52%	1.62%	14.80%	1.68%	13.72%	-0.06%

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：

(2010年11月5日至2017年3月31日)

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于2010年11月5日生效。

2、根据基金合同规定，本基金建仓期为3个月。截至本报告期末，本基金的投资符合基金合同关于投资范围及投资限制的规定：本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%。

### 十三、基金的费用与税收

#### (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) 基金合同生效后的信息披露费用；
- (4) 基金上市费及年费；
- (5) 基金收益分配中发生的费用；
- (6) 基金份额持有人大会费用；
- (7) 基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
- (8) 基金的证券交易费用；
- (9) 基金财产拨划支付的银行费用；
- (10) 标的指数许可使用费；
- (11) 按照国家有关规定可以在基金财产中列支的其他费用。

2、上述基金费用由基金管理人在法律法规规定的范围内按照合理价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

##### 3、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

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$ ，本基金年管理费率为 0.5%

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，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 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、休息日，支付日期顺延。

###### (2) 基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$ ，本基金年托管费率为 0.1%

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值



基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起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、休息日，支付日期顺延。

### （3）标的指数许可使用费

在通常情况下，基金标的指数许可使用费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{标的指数许可使用费年费率} \div \text{当年天数}$ ，根据基金管理人与标的指数供应商签订的相应指数许可协议的规定，本基金标的指数许可使用费年费率为0.03%

H为每日应计提的基金标的指数许可使用费

E为前一日基金资产净值

自基金合同生效之日起，基金标的指数许可使用费每日计提，按季支付。根据基金管理人与标的指数供应商签订的相应指数许可协议的规定，标的指数许可使用费的收取下限为每季（自然季度）人民币50,000元，当季标的指数许可使用费不足50,000元的，按照50,000元支付。由基金管理人向基金托管人发送基金标的指数许可使用费划付指令，经基金托管人复核后于每年1月，4月，7月，10月首日起3个工作日内将上季度标的指数许可使用费从基金财产中一次性支付，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

（4）除管理费和托管费之外的基金费用由基金托管人根据其他有关法律法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

### 4、不列入基金费用的项目

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，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金募集期间所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付，基金收取认购费的，可以从认购费中列支。

5、基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。降低基金管理费率和基金托管费率，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率实施日前2日在指定媒体上刊登公告。

### （二）与基金销售有关的费用

详见本基金招募说明书第九章第（六）部分。

### （三）基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

#### 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，主要更新的内容如下：

1、在“三、基金管理人”部分，更新了基金管理人主要人员情况等信息。

2、在“四、基金托管人”部分，根据基金托管人提供的最新信息对本基金托管人的情况进行了更新。

3、在“十、基金的投资”部分，更新了本基金最近一期基金投资组合报告的内容。

4、在“十一、基金的业绩”部分，更新了截至最近一期本基金的业绩表现。

5、在“二十三、其他应披露事项”部分，更新了本次更新内容期间的历次公告。

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](http://www.icbccs.com.cn)。

工银瑞信基金管理有限公司

二〇一七年六月十七日