

工银瑞信沪深 300 指数证券投资基金  
更新的招募说明书摘要

基金管理人：工银瑞信基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

二〇一一年四月

## 重要提示

本基金经中国证券监督管理委员会2009年1月5日证监许可[2009]6号文核准募集。本基金基金合同于2009年3月5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。

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《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。

投资有风险，投资者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，由投资者自行承担。

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2011年3月4日，有关财务数据和净值表现数据截止日为2010年12月31日。

## 一、基金管理人

### （一）基金管理人概况

#### 1、基金管理人基本情况

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丙 17 号北京银行大厦

办公地址：北京市西城区金融大街丙 17 号北京银行大厦 8 层

邮政编码：100140

法定代表人： 李晓鹏

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

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：010-5869 8918

股权结构：中国工商银行股份有限公司占公司注册资本的 55%；瑞士信贷占公司注册资本的 25%；中国远洋运输（集团）总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

李晓鹏先生：董事长，经济学博士。自 2005 年 10 月起任中国工商银行股份有限公司副行长。1984 年加入中国工商银行，2004 年 9 月任中国工商银行副行长，曾任中国工商银行河南省分行副行长、总行营业部总经理、四川省分行行长、中国华融资产管理公司副总裁、中国工商银行行长助理兼北京市分行行长等职。目前兼任中国工商银行（阿拉木图）股份公司董事长、中国工商银行（中东）有限公司董事长、工银金融租赁有限公司董事长、中国城市金融学会副会长、中国农村金融学会副会长、中国银行业协会金融租赁专业委员会主任和行业发展研究委员会主任。

Neil Harvey 先生：董事。瑞士信贷董事总经理，长驻香港工作，负责资产管理部的环球新兴市场及亚太区市场业务，是资产管理部的全球管理委员会成员并兼任瑞士信贷亚

太地区执行委员会成员。2010 年重返瑞士信贷工作，在此之前任职于复兴集团（Renaissance Group），最后担任复兴集团的副首席执行官及全球主席。在 2006 年加盟复兴集团之前，Harvey 先生合作创立了以亚太地区市场为主的多策略对冲基金——Bennelong 资产管理公司。Harvey 先生 1993 年初次加入瑞士信贷香港公司。他在任的十年间，分别在投资银行业务方面担任了多种不同的职务、涉足多个区域。他离任前是香港投资银行部和客户拓展业务的负责人。此外，他创立并管理了瑞士信贷在亚洲（除日本）的固定收益业务，并担任了多个领导职务，包括新兴市场固定收益分配全球负责人，管理中东、非洲、土耳其和拉丁美洲的业务。

David Peter Walker 先生：独立董事，1978 年至 1983 年任职于 J.P.Morgan，负责跨国企业的资金管理咨询研究的推广及进行，以及推广及执行债务融资；1983 年至 1990 年任职于 Bankers Trust，先后担任资本市场部发起成员、执行董事及美国资本市场部主管、负责亚太区（日本除外）的银行及证券业务；1990 年至 2003 年 5 月，任职于瑞士信贷第一波士顿，担任执行董事、证券产品业务主管、投资银行部主管等职；2003 年 6 月至今，成立物业发展业务公司，并兼任几家英国公司的董事。

陈晓燕女士：董事，学士。1982—1984 年任职于中国人民银行会发局。1984—1986 年任中国工商银行会计部营业处处长。1986—1998 年任中国工商银行会计部副主任。1998—1999 年任中国工商银行银行卡部主任。1999—2001 年任中国工商银行资金营运部总经理。2001 年 1 月至 2009 年 7 月任中国工商银行个人金融业务部总经理。2009 年 7 月至今任中国工商银行资产业务总监兼资产管理部总经理。

刘国恩先生：独立董事，经济学博士，北京大学光华管理学院经济学教授，北大光华卫生经济与管理研究院执行院长，北京大学中国医药经济研究中心主任，博士生导师。曾执教美国南加利福尼亚大学（1995—1999）、美国北卡大学（2000—2006，获终身教职）；曾担任中国留美经济学会 2004—2005 届主席以及国际医药经济学会亚太联合会主席。目前担任国务院城镇居民医疗保险试点评估专家组成员等职，同时承担了包括国家发改委、世界银行等直接立项资助的重大课题。

牛大鸿先生：独立董事，博士。1995—2000 年 ASIAN MERCHANTS PTE LTD 副总经理、总经理。1999—2000 年 MERCHANTS HOLDINGS (SINGAPORE) PTE LTD 副总裁（兼）。2000 年至今 PHQ HOLDINGS (SINGAPORE) PTE LTD 执行总裁。

蔡昀先生：董事，学士。1990—1993 年任职于中远总公司审计处。1993—1994 年任职于中远（集团）总公司审计处。1994—1996 年任职于中远英国公司。1996—1998 年任中远（集

团) 总公司监督部审计室副主任。1998-1999 年任中远(集团) 总公司监督部审计处处长。1999-2006 年任中远英国公司副总经理。2006 年 11 月至今任中远(集团) 总公司财务部副总经理。

赵跃女士: 董事, 硕士。1987-1994 年在中国工商银行信托投资公司工作。1994-1998 年在工商国际金融有限公司工作, 1998.01-1998.09 任工商国际金融有限公司常务董事、副总经理。1998-2002 年任中国工商银行证券投资基金托管部总经理。2002-2004 年任中国工商银行资产托管部副总经理(总经理级)。2004 年至今任中国工商银行养老金业务部(原企业年金中心) 总经理。

郭特华女士: 董事, 总经理, 博士。1989-1998 年中国工商银行总行商业信贷部、资金计划部副处长, 1998-2005 年中国工商银行总行资产托管部历任处长, 副总经理。

## 2. 监事会成员

张衢先生: 监事会主席, 博士。1997.5-1998.8 任中国工商银行浙江省分行行长、党组书记。1998.8-2000.11 任中国工商银行广东省分行行长、党委书记。2000.11-2005.10 中国工商银行副行长、党委委员。2005.10-2008.5 年任中国工商银行股份有限公司副行长、党委委员。

Sarah Pearson 女士: 监事, 法学学士。拥有英格兰、香港和澳大利亚(新南威尔士州) 的执业事务律师资格。现任瑞士信贷董事总经理兼首席运营官, 负责亚太区及全球新兴市场的资产管理业务。Pearson 女士于 1994 年加盟伦敦瑞士信贷金融产品(Credit Suisse Financial Products), 1996 年至 2010 年年中曾先后派驻香港、新加坡、东京和悉尼。出任现有职务前, Pearson 女士曾任亚太区区域总顾问六年, 并在 2006 年至 2010 年期间担任瑞士信贷澳洲区首席运营官以及亚太区副信誉风险核准人。加入瑞士信贷之前, Pearson 女士曾在高伟绅律师事务所的伦敦银行部门担任事务律师。

王妍敏女士: 监事, 硕士, 会计师。1997.08-1999.04 中远(集团) 总公司资产管理中心员工。1999.04-2009.02 中远(集团) 总公司监督部员工。2009.02 至今任中远(集团) 总公司监督部财务审计室副经理。2010 年 7 月起兼任中远慈善基金会监事。

江明波先生: 监事, 毕业于复旦大学, 获理学硕士学位。2000 年 7 月至 2001 年 12 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, 2001 年 12 月至 2003 年 7 月担任债券研究员; 2003 年 7 月至 2003 年 11 月担任基金经理助理; 2003 年 11 月 26 日至 2007 年 1 月 20 日担任普天债券基金经理; 2004 年 6 月至 2006 年 12 月, 担任全国社保基金债券组合和回购组合基金经理; 2006

年 8 月至 2006 年 12 月担任机构理财部总监助理；2004 年 6 月至 2006 年 12 月担任固定收益小组负责人。2008 年 4 月 14 日至今，担任工银瑞信信用添利基金基金经理。2011 年 2 月 10 日至今，担任工银瑞信四季收益基金基金经理。2008 年 11 月起，担任专户投资部副总监。2009 年 11 月起，担任专户投资部固定收益总监。2010 年 6 月起，担任专户投资部总监。2011 年 2 月起，担任固定收益投资总监。

刘坤女士：监事，硕士，中国注册会计师协会会员、英国特许公认会计师公会会员。2002 年至 2007 年，任职于华安基金管理有限公司北京分公司，担任高级经理；2000 年至 2002 年，任职于环球太阳海网络电视有限公司，担任高级财务经理；1998 年至 2000 年，任职于北京东方龙马系统集成有限公司，担任财务经理。1995 年至 1998 年，任职于北京康拓科技开发集团总公司，担任主管会计。1991 年至 1994 年，任职于北京康捷电子工程有限公司，担任主管会计。2007 年 11 月加入工银瑞信基金管理有限公司，担任高级经理。2010 年 8 月起担任财务部业务主管。

### 3. 其他高级管理人员

朱碧艳女士：督察长，硕士，国际注册内部审计师。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。

夏洪彬先生：副总经理，工商管理硕士。1999 年至 2003 年任职于瑞士信贷资产管理公司，历任高级风险分析师、副总裁；2003 年至 2005 年，任职于瑞士信贷第一波士顿，曾担任 CSFB/Tremont 对冲基金指数的数量分析员、基金经理、副总裁。2006 年加入瑞士信贷集团资产管理部，历任副总裁、董事。

肖在翔先生：副总经理，毕业于中国社会科学院研究生院。1980 年至 1982 年任职于中国人民银行，1984 年至 2007 年任职于中国工商银行，历任储蓄部储蓄业务处处长，零售业务部副总经理，个人金融业务部副总经理。

### 4. 本基金基金经理

樊智先生，毕业于天津大学，获博士学位。2003 年 4 月至 2005 年 6 月，任职于中信证券股份有限公司研究部，担任高级研究员。2005 年 7 月加入工银瑞信基金管理有限公司市场营销部从事产品开发工作；2005 年 12 月至 2009 年 9 月，任职于风险管理部，历任业务主管、风险管理部副总监。2009 年 9 月 8 日至今，担任工银瑞信沪深 300 基金和工银瑞信上证央企 ETF 基金基金经理。2010 年 11 月 5 日至今，担任工银瑞信深证红利 ETF 基金基金经理。2010 年 11 月 9 日至今，担任工银瑞信深证红利 ETF 联接基金基金经理。

本基金历任基金经理：胡文彪先生，2009 年 3 月 5 日至 2011 年 2 月 10 日管理本基

金。

#### 5. 投资决策委员会成员

主任：总经理郭特华女士。

成员：权益投资总监何江旭先生，固定收益投资总监江明波先生，首席经济学家陈超先生，权益投资部总监曹冠业先生，国际业务总监郝康先生，固定收益部总监杜海涛先生。

上述人员之间均不存在近亲属关系。

## 二、基金托管人

### 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：郭树清

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元人民币

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：尹东

联系电话：(010) 6759 5003

## 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丙 17 号北京银行大厦 8 层

注册地址：北京市西城区金融大街丙 17 号北京银行大厦

法定代表人：杨凯生

客户服务电话：010-58698918

全国统一客户服务电话：400-811-9999

传真：010-66583111

联系人：杨光

公司网站：www.icbccs.com.cn

#### 2. 代销机构

## (1) 中国工商银行股份有限公司

注册地址：中国北京复兴门内大街 55 号

办公地址：中国北京复兴门内大街 55 号

法定代表人：姜建清

客户服务电话：95588（全国）

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

## (2) 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：肖钢

客户服务电话：95566

网址：[www.boc.cn](http://www.boc.cn)

## (3) 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：郭树清

客户服务电话：95533

网址：[www.ccb.com](http://www.ccb.com)

## (4) 中国农业银行股份有限公司

住所：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：项俊波

客户服务电话：95599

网址：[www.95599.cn](http://www.95599.cn)

## (5) 交通银行股份有限公司

住所：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：胡怀邦

电话：(021) 58781234

传真：(021) 58408483

联系人：曹榕



客户服务电话：95559

网址：[www.bankcomm.com](http://www.bankcomm.com)

(6) 招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：傅育宁

联系人：邓炯鹏

客户服务统一咨询电话：95555

网址：[www.cmbchina.com](http://www.cmbchina.com)

(7) 中国光大银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门外大街 6 号光大大厦

法定代表人：唐双宁

联系人：李伟

电话：010-68098778

传真：010-68560312

客服电话：95595（全国）

网址：[www.cebbank.com](http://www.cebbank.com)

(8) 北京银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街甲 17 号首层

办公地址：北京市西城区金融大街丙 17 号

法定代表人：闫冰竹

联系人：王曦

电话：010-66223584

传真：010-66226045

客户服务电话：010-95526

公司网站：[www.bankofbeijing.com.cn](http://www.bankofbeijing.com.cn)

(9) 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

总行地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：董文标

客服电话：95568

联系人：董云巍

网址：www.cmbc.com.cn

(10) 深圳发展银行股份有限公司

地址：深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦

邮政编码：518001

联系人：周勤

传真电话：0755-82080714

客服电话：95501

公司网址：www.sdb.com.cn

(11) 中信银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

法定代表人：孔丹

客服电话：95558

联系人：金蕾

电话：010-65557013

传真：010-65550827

网址：<http://bank.ecitic.com>

(12) 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：刘宝凤

客服电话：400-888-8811

联系人：王宏

联系电话：022-58316666

传真：022-58316259

网址：www.cbhb.com.cn

(13) 华夏银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

法定代表人：吴建

客服电话：95577

网址：www.hxb.com.cn

(14) 北京农村商业银行

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

联系电话：63229475

传真：63229478

客服电话：96198

公司网址：www.bjrcb.com

(15) 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：徐浩明

电话：(021) 22169999

传真：(021) 22169134

公司网址：www.ebscn.com

(16) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区商城路 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 层

法定代表人：祝幼一

联系人：芮敏祺

电话：021-38676161

传真：021-38670161

客户服务热线：400-8888-666

公司网站：www.gtja.com

(17) 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

法定代表人：顾伟国

联系人：李洋

电话：(010) 66568047

公司网址：www.chinastock.com.cn

(18) 中信建投证券有限责任公司

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：张佑君

开放式基金咨询电话：400-8888-108

开放式基金业务传真：(010) 65182261

联系人：魏明

公司网址：www.csc108.com

(19) 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

法定代表人：宫少林

电话：0755-82943666

传真：0755-82943636

联系人：黄健

客户服务热线：95565、4008888111

公司网址：www.newone.com.cn

(20) 中信证券股份有限公司

注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 A 层

法定代表人：王东明

电话：010-84683893

联系人：陈忠

公司网址：www.ecitic.com

(21) 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：浦东新区民生路 1199 弄证大·五道口广场 1 号楼 21 层

法定代表人：兰荣

客服电话：4008888123

业务联系电话：021-38565785

业务联系人：谢高得

网站 [www.xyzq.com.cn](http://www.xyzq.com.cn)

(22) 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

法定代表人：王开国

客户服务热线：400-8888-001、021-962503

公司网址：[www.htsec.com](http://www.htsec.com)

(23) 中信万通证券有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区苗岭路 29 号澳柯玛大厦 15 层（1507-1510 室）

办公地址：青岛市东海西路 28 号

法定代表人：史洁民

联系电话：0532-85022273

传真：0532-85022605

联系人：刘光明

公司网址：[www.zxwt.com.cn](http://www.zxwt.com.cn)

客户咨询电话：0532-96577

(24) 长江证券股份有限公司

住所：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：胡运钊

电话：027-65799999

传真：027-85481900

联系人：李良

网址：[www.95579.com](http://www.95579.com)

客户服务电话：95579 或 4008-888-999

(25) 申银万国证券股份有限公司

注册地址：上海市常熟路 171 号

办公地址：上海市常熟路 171 号

法定代表人：丁国荣

电话：021-54033888

传真：021-54035333

客服电话：021-962505

网址：[www.sw2000.com.cn](http://www.sw2000.com.cn)

(26) 恒泰证券股份有限公司

注册地址：内蒙古呼和浩特市新城区新华东街 111 号邮编 010010

办公地址：内蒙古呼和浩特市新城区新华东街 111 号邮编 010010

法定代表人：刘汝军

电话：0471-4913998

传真：0471-4930707

联系人：常向东

客户服务电话：0471-4961259

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

(27) 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

开放式基金咨询电话：4008001001

开放式基金业务传真：0755-82558355

联系人：陈剑虹

联系电话：0755-82558305

网址：<http://www.essence.com.cn>

(28) 国元证券股份有限公司

公司注册及办公地址：安徽省合肥市寿春路 179 号

法定代表人：凤良志

联系人：程维

联系电话：0551-2207936

传真电话：0551-2207965

客户服务电话：全国：4008888777

安徽省：96888

公司网址：[www.gyzq.com.cn](http://www.gyzq.com.cn)

(29) 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

法人代表人：何如

基金业务联系人：齐晓燕

联系电话：0755-82130833

传真：0755-82133302

全国统一客户服务电话：95536

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

(1) 华泰联合证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第五层（01A、02、03、04）、17A、18A、24A、25A、26A

办公地址：深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第 5 层、17 层、18 层、24 层、25 层、26 层  
法定代表人：马昭明

联系人：盛宗凌

电话：0755-82492000

传真：0755-82492962

公司网站：[www.lhzq.com](http://www.lhzq.com)

客服电话：95513，400-8888-555

(30) 国联证券股份有限公司

法定代表人：雷建辉

注册地址：无锡市县前东街 168 号

办公地址：无锡市县前东街 8 号 6 楼、7 楼

联系人：袁丽萍

开放式基金咨询电话：4008885288，0510-82588168

公司网站：<http://www.glsc.com.cn>

## (31) 中国民族证券有限责任公司

注册地址：北京市丰台区北路 81 号

办公地址：北京市西城区金融街 5 号新盛大厦 A 座 6-9 层

邮政编码：100140

负责人：赵大建

投诉电话：400-889-5618

公司网站：[www.e5618.com](http://www.e5618.com)

## (32) 广发证券股份有限公司

法定代表人：王志伟

注册地址：广州市天河北路183号大都会广场43楼

办公地址：广东省广州天河北路大都会广场18、19、36、38、41和42楼

联系人：黄岚

统一客户服务热线：95575或致电各地营业网点

公司网站：广发证券网 <http://www.gf.com.cn>

## (33) 长城证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层

法定代表人：黄耀华

联系人：匡婷

电话：0755-83516289

传真：0755-83516199

客户服务热线：0755-33680000、400 6666 888

长城证券网站：[www.cc168.com.cn](http://www.cc168.com.cn)

## (34) 华宝证券有限责任公司

注册地址：上海市陆家嘴环路 166 号未来资产大厦 23 层

法定代表人：陈林

组织形式：有限责任公司

客户服务电话：4008209898

公司网站：<http://www.cnhbstock.com/>

## (35) 渤海证券股份有限公司

注册地址：天津经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室



法定代表人：王春峰

联系人：王兆权

客户服务电话：4006515988

公司网址：www.bhzq.com

(36) 齐鲁证券有限公司

注册地址：济南市经十路20518号

法定代表人：李玮

联系人：吴阳

电话：0531-81283906

传真：0531-81283900

客户服务热线：95538

公司网址：www.qlzq.com.cn

(37) 东海证券有限责任公司

注册地址：江苏省常州市延陵西路 59 号常信大厦 18 楼

办公地址：江苏省常州市延陵西路 59 号常信大厦 18 楼

法定代表人：朱科敏

联系人：李涛

电话：0519-88157761

传真：0519-88157761

公司网址：<http://www.longone.com.cn>

客户服务热线：0519-88166222 021-52574550 0379-64902266

免费服务热线：400-888-8588

(38) 宏源证券股份有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐文艺路233号宏源大厦

办公地址：北京海淀区西直门北大街甲43号金运大厦B座

法定代表人：汤世生

联系人：李巍

联系电话：010-88085338

传真：010-88085240

公司网站：www.hysec.com

客服电话：4008-000-562

(39) 中国建银投资证券有限责任公司

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 层至 20 层

法定代表人：杨小阳

电话：(0755) 82026521

传真：(0755) 82026539

联系人：刘权

客户服务热线：400-600-8008

网址：www.cjis.cn

(40) 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 (518048)

法定代表人：杨宇翔

全国免费业务咨询电话：4008816168

网址：<http://www.PINGAN.com>

(2) 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

联系电话：0791-6768763

联系传真：0791-6789414

公司网址 [www.avicsec.com](http://www.avicsec.com)

客服电话 400-8866-567

(41) 上海证券有限责任公司

注册地址：上海市黄浦区西藏中路 336 号

法定代表人：郁忠民

网址：[www.962518.com.cn](http://www.962518.com.cn)

客户服务电话：021-962518

(42) 东兴证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层

办公地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层

法定代表人：崔海涛

联系人：汤漫川

联系电话：010-66555316

传真：010-66555246

公司网站：www.dxzq.net.cn

(43) 山西证券股份有限公司

办公（注册）地址：山西省太原市府西街 69 号山西国贸中心东塔楼

法定代表人：侯巍

客服电话：400-666-1618

联系人：张治国

联系电话：0351-8686703

网址：www.i618.com.cn

(44) 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：上海市福山路 500 号城建大厦 26 楼

法定代表人：方加春

电话：021-68761616

传真：021-68767981

客户服务电话：4008888128

公司网址：www.tebon.com.cn

(45) 东方证券股份有限公司

注册地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 22 层-29 层

法定代表人：王益民

联系人：吴宇

电话：021-63325888

传真：021-63326173

客户服务热线：95503

公司网站：www.dfzq.com.cn

(46) 广发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、8、10 层  
法定代表人：黄金琳  
电 话：0591-87841160  
传 真：0591-87841150  
公司网址：www.gfhfzq.com.cn

(47) 广州证券有限责任公司

注册地址：广州市先烈中路 69 号东山广场主楼五楼  
办公地址：广州市先烈中路 69 号东山广场主楼五楼，17 楼  
法定代表人： 吴志明  
电话：020-87322668  
传真：020-87325036  
联系人：樊刚正  
客户服务电话：020-961303  
网址：www.gzs.com.cn

(48) 中信金通证券有限责任公司

注册地址：浙江省杭州市中河南路11号万凯庭院商务楼A座  
联系人：俞会亮  
联系电话：0571-85776115  
公司网站：www.bigsun.com.cn  
客户服务中心电话：0571-96598

(49) 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 号楼信达金融中心  
法定代表人：张志刚  
联系人：唐静  
联系电话：010-63081000  
传真：010-63080978  
客服电话：400-800-8899  
公司网址：www.cindasc.com

## (50) 中国国际金融有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

法定代表人：李剑阁

联系人：王雪筠

## (51) 方正证券有限责任公司

注册地址：湖南长沙芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层

办公地址：湖南长沙芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层

法定代表人：雷杰

联系人：彭博

联系电话：0731-85832343

客服电话：95571

公司网址：www.foundersc.com

## (52) 西南证券股份有限公司

注册地址：重庆市渝中区临江支路2号合景国际大厦A幢

法人代表人：王珠林

联系人：徐雅筠

联系电话：023-63786060

传真：023-63786215

客服电话：4008096096

公司网址：www.swsc.com.cn

## (53) 厦门证券有限公司

注册地址：厦门市莲前西路2号莲富大厦十七楼

法定代表人：傅毅辉

联系人：卢金文

联系方式：0592-5161642

网址：www.xmzq.cn

客户服务电话：0592-5163588

## (54) 华龙证券有限责任公司

注册（办公）地址：甘肃省兰州市静宁路308号

法定代表人：李晓安

联系人：李昕田

联系电话：0931-4890100

传真：0931-4890118

客服电话：0931-4890100、4890619、4890618

公司网址：www.hlzqgs.com

(55) 联讯证券有限责任公司

注册地址：广东省惠州市下埔路 1 4 号

法定代表人：徐刚

联系人：丁宁

电话：010-64408820

传真：010-64408252

客服电话：400-8888-929

网址：<http://www.lxzq.com.cn>

(56) 西藏同信证券有限责任公司

客户服务电话：400-881-1177

网址：[www.xzsec.com](http://www.xzsec.com)

(57) 华融证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区月坛北街 26 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：丁之锁

联系人：梁宇

联系电话：010-58568007

联系传真：010-58568062

公司网址：[www.hrsec.com.cn](http://www.hrsec.com.cn)

客服电话：010-58568118

(58) 东北证券股份有限公司

注册地址：长春市自由大路 1138 号

办公地址：长春市自由大路 1138 号

法定代表人：矫正中

联系人：潘锴

电话：0431-85096709

客户服务电话：4006000686

网址：www.nesc.cn

(59) 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：0871-3577930

联系人：刘晓明

电话：0871-3577942

(60) 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：南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

法定代表人：吴万善

电话：025-84457777

联系人：樊昊

客服电话：025-95597（江苏省外需加区号）

网址：www.htsc.com.cn

(61) 中原证券股份有限公司

注册地址 郑州市郑东新区商务外环路 10 号

办公地址 郑州市郑东新区商务外环路 10 号

法定代表人 石保上

联系人 程月艳 耿铭

联系电话 0371—65585670

联系传真 0371--65585665

公司网址 www.ccnew.com

客服电话 967218 400-813-9666

(62) 国都证券有限责任公司

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

基金管理人可根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和本基金基金合同等的规定, 选择其他符合要求的机构代理销售本基金, 并及时履行公告义务。

## (二) 基金注册登记机构

名称: 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丙 17 号北京银行大厦

注册登记业务办公地址: 北京经济技术开发区西环中路地盛南街 1 号国光高科大厦 4 层

法定代表人: 李晓鹏

客户服务电话: 010-58698918

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、李晓明

## (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

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: 王静, 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

工银瑞信沪深 300 指数证券投资基金

#### 五、基金的类型

股票型指数基金。

#### 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，谋求基金资产的长期增值。

#### 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，包括沪深 300 指数的成份股及其备选成份股、新股（一级市场首次发行）、债券，以及经中国证监会批准的允许本基金投资的其它金融工具。法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种（如股票指数期货等），基金管理人履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金投资于股票资产占基金资产的比例为 90%-95%，投资于标的指数成分股票、备选成分股票的资产占基金资产的比例不低于 80%（但因法律法规限制原因，导致本基金不能投资相关股票，而致使本基金不能达到上述比例的情形除外）。现金、债券资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为 5%-10%，其中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 5%。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

本基金原则上采取完全复制策略，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 0.3%，偏离度年化标准差不超过 4%。

##### 1. 标的指数

本基金股票资产跟踪的标的指数为沪深 300 指数。沪深 300 指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权，由中证指数有限公司开发的中国 A 股市场指数，它的样本选自沪深两个证券市场，覆盖了大部分流通市值，其成份股票为中国 A 股市场中代表性强、流动

性高的股票，能够反映 A 股市场总体发展趋势。

## 2. 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）有充分而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）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。

本基金的行业分类标准采用全球行业分类体系（GICS，Global Industry Classification Standard）。GICS 分类标准是摩根斯坦利资本国际公司（MSCI）和标准普尔（S&P）共同推出的全球行业分类标准。

## 3. 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。

#### 4. 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。

#### 5. 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、股票指数期货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。

#### （五）投资管理程序

##### 1. 投资决策依据

（1）本基金采用指数化投资，在追求跟踪偏离度与跟踪误差最小化的前提下，根据本基金的标的指数成份股票构成及其权重，形成基金投资建议，供投资决策委员会决策参考。

（2）遵守有关法律法规和基金合同的规定；

（3）以维护基金份额持有人利益为基金投资决策的准则。

##### 2. 投资程序

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。

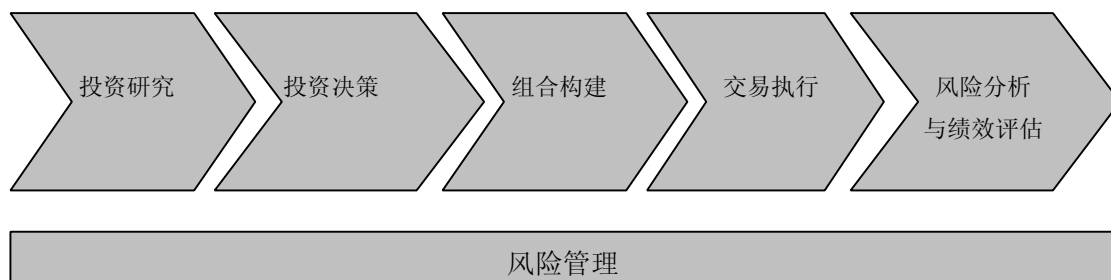


图 1-1 投资管理流程

### (1) 投资研究

研究员独立开展研究工作,在借鉴外部研究成果的基础上,开展宏观经济及政策分析、债券市场分析、行业及上市公司分析,为投资决策委员会及各基金经理提供独立、统一的投资决策支持平台。本基金采取指数化投资策略,金融工程研究人员在追求跟踪偏离度与跟踪误差最小化的前提下,根据标的指数成份股票构成及其权重,形成基金投资建议。

### (2) 投资决策

投资决策委员会是基金投资的最高决策机构,决定基金总体投资策略及资产配置方案,审核基金经理提交的投资计划,提供指导性意见,并审核其他涉及基金投资管理的重大问题。

基金经理在公司总体投资策略的指导下,根据基金合同关于投资目标、投资范围及投资限制等规定,制定相应的投资计划,报投资决策委员会审批。

### (3) 投资组合构建

基金经理根据投资决策委员会的决议,在权限范围内,评估证券的投资价值,选择证券构建基金投资组合,并根据市场变化调整基金投资组合,进行投资组合的日常管理。

### (4) 交易执行

交易员负责在合法合规的前提下,执行基金经理的投资指令,并实施一线风险监控。

### (5) 风险分析及绩效评估

风险管理部对投资组合的风险水平及基金的投资绩效进行评估,报风险管理委员会,抄送投资决策委员会、投资总监及基金经理,并就基金的投资组合提出风险管理建议。

法律合规部对基金的投资行为进行合规性监控,并对投资过程中存在的合规风险向基金经理、投资总监、投资决策委员会及风险管理委员会进行风险提示。

## 九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率 $\times$ 95%+商业银行税后活期存款利率 $\times$ 5%。

本基金的标的指数为沪深 300 指数,同时考虑股票资产占基金资产的比例为 90%-95%,现金、债券资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为 5%-10%,因此本基金设定上述业绩比较基准。

随着市场环境的变化,如果上述标的指数不适用本基金时,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,并报中国证监会核准或者备案。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。本基金为指数型基金,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。

#### 十一、基金的投资组合报告

本投资组合报告期为 2010 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 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	4,530,885,839.23	94.58
	其中:股票	4,530,885,839.23	94.58
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	240,225,193.48	5.01
6	其他资产	19,293,300.10	0.40
7	合计	4,790,404,332.81	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。

##### 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

###### (1) 指数投资按行业分类的股票投资组合

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	15,942,675.00	0.33
B	采掘业	570,993,853.88	11.94
C	制造业	1,589,491,957.00	33.25
C0	食品、饮料	253,631,025.96	5.30
C1	纺织、服装、皮毛	15,969,773.68	0.33
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	108,920,752.41	2.28
C5	电子	23,690,116.00	0.50
C6	金属、非金属	404,227,649.20	8.45
C7	机械、设备、仪表	568,810,043.93	11.90
C8	医药、生物制品	196,660,002.34	4.11
C99	其他制造业	17,582,593.48	0.37
D	电力、煤气及水的生产和供应业	121,089,900.33	2.53
E	建筑业	138,974,723.27	2.91
F	交通运输、仓储业	204,927,402.05	4.29
G	信息技术业	152,975,463.68	3.20
H	批发和零售贸易	139,489,072.28	2.92
I	金融、保险业	1,214,043,887.36	25.39
J	房地产业	224,396,915.52	4.69
K	社会服务业	41,259,472.20	0.86
L	传播与文化产业	6,836,250.00	0.14
M	综合类	105,951,501.06	2.22
	合计	4,526,373,073.63	94.67

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。

(2) 积极投资按行业分类的股票投资组合

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	采掘业	-	-
C	制造业	-	-
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	-	-
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-

F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	4,512,765.60	0.09
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	4,512,765.60	0.09

### 3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### (1) 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	600036	招商银行	12,691,925	162,583,559.25	3.40
2	601318	中国平安	2,874,183	161,414,117.28	3.38
3	601328	交通银行	25,032,455	137,177,853.40	2.87
4	600016	民生银行	20,424,319	102,530,081.38	2.14
5	601166	兴业银行	3,598,494	86,543,780.70	1.81
6	600000	浦发银行	6,155,537	76,267,103.43	1.60
7	600030	中信证券	5,858,701	73,761,045.59	1.54
8	601088	中国神华	2,829,822	69,924,901.62	1.46
9	000002	万科A	8,304,748	68,265,028.56	1.43
10	601601	中国太保	2,696,592	61,751,956.80	1.29

#### (2) 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	600816	安信信托	331,821	4,512,765.60	0.09

### 4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金报告期末未持有债券。

### 5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金报告期末未持有债券。

### 6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金报告期末未持有资产支持证券。

### 7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金报告期末未持有权证。

### 8、投资组合报告附注

(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。

(2) 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。

(3) 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	500,000.00
2	应收证券清算款	13,815,924.37
3	应收股利	-
4	应收利息	56,696.99
5	应收申购款	4,920,678.74
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	19,293,300.10

## (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。

## (5) 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中未存在流通受限情况。

## 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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	600816	安信信托	4,512,765.60	0.09	重要事项停牌

## 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。

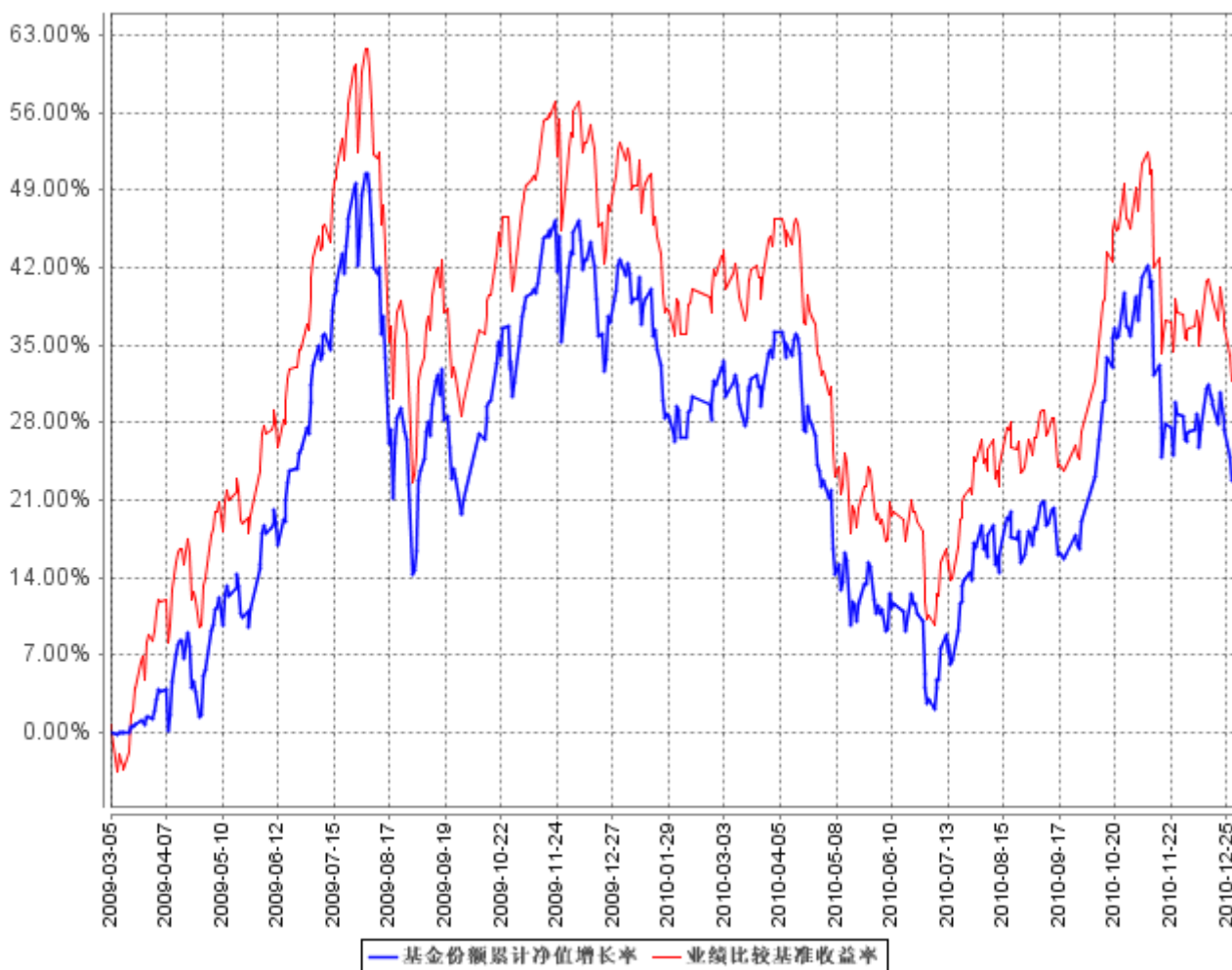
1、本基金合同生效日为 2009 年 3 月 5 日，基金合同生效以来（截至 2010 年 12 月 31 日）的投资业绩及同期基准的比较如下表所示：

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
2009.3.5-2009.12.31	42.79%	1.78%	53.32%	1.85%	-10.53%	-0.07%
2010 年	-11.79%	1.52%	-11.78%	1.50%	-0.01%	0.02%
自基金合同生效起至今	25.95%	1.64%	35.26%	1.68%	-9.31%	-0.04%

2、自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



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：本基金基金合同于 2009 年 3 月 5 日生效，按基金合同规定，本基金自基金合同生效起六个月内为建仓期。截至报告期末，本基金各项投资比例符合基金合同的规定：投资于股票资产占基金资产的比例为 90%-95%，投资于标的指数成分股票、备选成分股票的资产占基金资产的比例不低于 80%（但因法规限制原因，导致本基金不能投资相关股票，而致使本基金不能达到上述比例的情形除外）。现金、债券资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为 5%-10%，其中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 5%。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

1. 基金管理人的管理费；
2. 基金托管人的托管费；
3. 基金财产拨划支付的银行费用；
4. 基金合同生效后的基金信息披露费用；

5. 基金份额持有人大会费用；

6. 基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；

7. 基金的证券交易费用；

8. 在中国证监会规定允许的前提下，本基金可以从基金财产中计提销售服务费，具体计提方法、计提标准在招募说明书或相关公告中载明；

9. 依法可以在基金财产中列支的其他费用。

(二)上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

(三)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 0.50%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

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 0.10 %年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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. 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。

#### (四) 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。基金合同生效前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。

(五) 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。基金管理人必须最迟于新的费率实施日 2 日前在指定媒体上刊登公告。

#### (六) 基金销售费用

本基金申购费、赎回费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式请详见本招募说明书“八、基金份额的申购、赎回与转换”中的“(六) 申购费与赎回费”与“(七) 申购份数与赎回金额的计算方式”中的相关规定。

### 十四、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《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“三、基金管理人”部分，更新了管理人的法定代表人、董事会成员、监事会成员简历、基金经理的简历、成员及投资决策委员会成员名单。
- 2、在“四、基金托管人”部分，对基金托管人基本情况的相关内容进行了更新。
- 3、在“五、相关服务机构”部分，对部分代销机构的信息进行了更新并根据相关公告增加了相关代销机构信息。
- 4、“八、基金份额的申购、赎回与转换”部分，根据有关公告，更新了“(十三) 基金转换”的内容，更新了“(十六) 定期定额投资计划”中办理场所部分的内容。
- 5、在“九、基金的投资”部分，更新了本基金截至2010年12月31日的财务数据及投资组合情况。
- 6、在“十、基金的业绩”部分，更新了截至2010年12月31日本基金的业绩表现。
- 7、在“二十二、其他应披露事项”部分，增加了本次更新内容期间的历次公告。
- 8、更新了附件“基金托管协议摘要”部分基金管理人的法定代表人。

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

二〇一一年四月十六日