

新华中证环保产业指数分级证券投资基金

上市交易公告书

基金管理人：新华基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

注册登记人：中国证券登记结算有限责任公司

上市地点：深圳证券交易所

上市时间：2014 年 10 月 16 日

公告时间：2014 年 10 月 13 日

目 录

一、重要声明与提示	3
二、基金概览	4
三、基金的募集与上市交易	9
四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人情况	15
五、基金主要当事人简介	17
六、基金合同摘要	24
七、基金财务状况	48
八、基金投资组合	51
九、重大事件揭示	57
十、基金管理人承诺	60
十一、基金托管人承诺	61
十二、备查文件目录	62

一、重要声明与提示

新华中证环保产业指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）上市交易公告书（以下简称“本公告”）依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 1 号〈上市交易公告书的内容与格式〉》、《深圳证券交易所交易规则》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，本基金管理人的董事会及董事保证本公告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

本基金托管人保证本公告中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、深圳证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。

本公告第七节“基金财务状况”未经审计。

凡本公告未涉及的有关内容，请投资者详细查阅 2014 年 8 月 6 日登载在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站（www.ncfund.com.cn）上的《新华中证环保产业指数分级证券投资基金招募说明书》。

二、基金概览

（一）基金名称：新华中证环保产业指数分级证券投资基金

基金简称：新华中证环保产业指数分级；场内简称：新华环保；基金代码：164304；

基金简称：新华环保 A 份额；场内简称：NCF 环保 A；基金代码 150190；

基金简称：新华环保 B 份额；场内简称：NCF 环保 B；基金代码：150191；

（二）基金类型：股票型

（三）基金运作方式：契约型开放式

（四）本基金的基金份额包括新华中证环保产业指数分级证券投资基金之基础份额（简称“新

华环保份额”)、新华中证环保产业指数分级证券投资基金之稳健收益类份额(简称“新华环保 A 份额”)与新华中证环保产业指数分级证券投资基金之积极进取类份额(简称“新华环保 B 份额”)。其中,新华环保 A 份额、新华环保 B 份额的基金份额比始终保持 1:1 的比例不变。??

(五) 基金存续期限: 不定期

(六) 场外将通过各销售机构的基金销售网点公开发售, 各销售机构的具体名单见基金份额发售公告以及基金管理人届时发布的增加销售机构的相关公告。场内将通过深圳证券交易所内具有基金销售业务资格并经深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司认可的会员单位发售(具体名单详见基金份额发售公告或相关业务公告)。本基金募集期结束前获得基金销售业务资格的会员单位也可代理场内基金份额的发售。

基金发售结束后, 场外认购的全部基金份额将确认为新华环保份额; 场内认购的全部基金份额按照 1:1 的比例自动分离为预期收益与预期风险不同的两种份额类别, 即新华环保 A 份额和新华环保 B 份额。

基金合同生效后, 新华环保份额设置单独的基金代码, 只可以进行场内与场外的申购和赎回, 但不上市交易。新华环保 A 份额与新华环保 B 份额交易代码不同, 只可在深圳证券交易所上市交易, 不可进行申购或赎回。

(七) 新华环保份额的申购与赎回: 本基金基金合同生效后, 投资人可通过场内或场外两种方式对新华环保份额进行申购与赎回。投资人办理新华环保份额场内申购和赎回业务的场所为具有基金销售业务资格且具有场内基金申购赎回资格的深圳证券交易所会员单位。投资人需使用深圳证券账户, 通过深圳证券交易所交易系统办理新华环保份额场内申购、赎回业务。投资人办理新华环保份额场外申购和赎回业务的场所为基金管理人直销机构和场外代销机构。投资人需使用中国证券登记结算有限责任公司开放式基金账户办理新华环保份额场外申购、赎回业务。投资人应当在基金管理人和场内、场外代销机构办理新华环保份额申购、赎回业务的营业场所或按基金管理人和场内、场外代销机构提供的其他方式办理新华环保份额的申购和赎回。本基金具体的场内、场外销售网点将由基金管理人在招募说明书或其他相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构, 并予以公告。

(八) 份额配对转换: 配对转换是指本基金的新华环保份额与新华环保 A 份额、新华环保 B 份额之间的配对转换, 包括以下两种方式的配对转换。

分拆指基金份额持有人将其持有的每两份新华环保份额的场内份额申请转换成一份新华环保 A 份额与一份新华环保 B 份额的行为。

合并指基金份额持有人将其持有的每一份新华环保 A 份额与一份新华环保 B 份额申请转换成两份新华环保份额的场内份额的行为。

(九) 定期份额折算: 对于新华环保 A 份额的约定收益, 即新华环保 A 份额每个会计年度 12 月 31 日的基金份额参考净值超出 1.000 元部分, 将折算为场内新华环保份额分配给新华环保 A 份额持有人。新华环保份额持有人持有的每 2 份新华环保份额将按 1 份新华环保 A 份额获得新增新华环保份额的分配。持有场外新华环保份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外新华环保份额的分配; 持有场内新华环保份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内新华环保份额的分配。经过上述份额折算, 新华环保 A 份额的基金份额参考净值和新华环保份额的基金份额净值将相应调整。有关定期份额折算的具体规定请见本基金招募说明书以及相关公告。

(十) 不定期份额折算: 除以上定期份额折算外, 本基金还将在以下两种情况进行不定期份额折算, 即: 当新华环保份额的基金份额净值高至 1.500 元或以上; 当新华环保 B 份额的基金份额参考净值低至 0.250 元或以下。有关不定期份额折算的具体规定请见本基金招募说明书以及相关公告。

(十一) 新华环保 A 份额和新华环保 B 份额的终止运作: 经基金份额持有人大会决议通过,

新华环保 A 份额与新华环保 B 份额可申请终止运作。该基金份额持有人大会决议须经本基金所有份额以特别决议的形式表决通过，即须经参加基金份额持有人大会的新华环保份额、新华环保 A 份额与新华环保 B 份额各自的基金份额持有人或其代理人所持该级基金份额表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方为有效。

（十二）基金份额总额：截至 2014 年 10 月 9 日，本基金的基金份额总额为 983,952,960.83 份；其中，新华环保：270,505,880.83 份，NCF 环保 A：355,223,540.00 份，NCF 环保 B：355,223,540.00 份。

（十三）基金份额参考净值：

截至 2014 年 10 月 9 日，新华环保份额参考净值为 1.034 元，新华环保 A 份额参考净值为 1.005 元，新华环保 B 份额的基金份额参考净值为 1.063 元。

（十四）本次上市交易的基金份额简称：NCF 环保 A、NCF 环保 B

（十五）本次上市交易的基金份额总额：NCF 环保 A：355,223,540.00 份；NCF 环保 B：355,223,540.00 份（截至 2014 年 10 月 9 日）

（十六）本次上市交易的基金份额交易代码：NCF 环保 A：150190；NCF 环保 B：150191

（十七）上市交易的证券交易所：深圳证券交易所

（十八）上市交易日期：2014 年 10 月 16 日

（十九）基金管理人：新华基金管理有限公司

（二十）基金托管人：中国建设银行股份有限公司

（二十一）本次上市交易的基金份额注册登记机构：中国证券登记结算有限责任公司

三、基金的募集与上市交易

（一）本次基金上市前基金募集情况

1、基金募集申请的核准机构和核准文号：中国证券监督管理委员会监许可【2014】513 号文

2、基金运作方式：契约型开放式基金

3、基金合同期限：不定期

4、发售日期：2014 年 8 月 11 日起至 2014 年 9 月 5 日止

5、发售价格：1.00 元人民币

6、发售方式：本基金通过场外、场内两种方式公开发售

7、发售机构

（1）场内发售机构

具有基金代销资格的深圳证券交易所会员单位。（具体名单可在深交所网站查询）。下列会员单位已具有基金代销业务资格：

爱建证券、安信证券、渤海证券、财达证券、财富证券、财富里昂、财通证券、长城证券、长江证券、诚浩证券、川财证券、大通证券、大同证券、德邦证券、第一创业、东北证券、东方证券、东海证券、东莞证券、东吴证券、东兴证券、方正证券、光大证券、广发证券、广州证券、国都证券、国海证券、国金证券、国开证券、国联证券、国盛证券、国泰君安、国信证券、国元证券、海通证券、恒泰长财、恒泰证券、红塔证券、宏源证券、宏信证券、华安证券、华宝证券、华创证券、华福证券、华林证券、华龙证券、华融证券、华泰联合、华泰证券、华西证券、华鑫证券、江海证券、金元证券、联讯证券、民生证券、民族证券、南京证券、平安证券、齐鲁证券、日信证券、瑞银证券、山西证券、上海证券、申银万国、世纪证券、首创证券、天风证券、天源证券、万和证券、开源证券、万联证券、西部证券、西藏同信、西南证券、厦门证券、湘财证券、新时代证券、信达证券、兴业证券、银河证券、银泰证券、英大证券、招商证券、浙商证券、中航证券、中金公司、中山证券、中投证券、中天证券、中信建投、中信浙江、中信万通、中信证券、中银证券、中邮证券、中原证券（排名不分先后）。

本基金募集结束前获得基金代销资格的深圳证券交易所会员单位可通过深圳证券交易所系统办理本基金的场内认购业务。

(2) 场外发售机构??

1) 直销机构: 新华基金管理有限公司

2) 代销机构:

中国建设银行股份有限公司、光大证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、恒泰证券股份有限公司、华西证券股份有限公司、齐鲁证券有限公司、新时代证券有限责任公司、中国银河证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中信证券(山东)有限责任公司、中信证券(浙江)有限责任公司、中信证券股份有限公司、东海证券股份有限公司、华龙证券有限责任公司、华泰证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、平安证券有限责任公司、华安证券股份有限公司、湘财证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、上海天天基金销售有限公司、深圳众禄基金销售有限公司、杭州数米基金销售有限公司、上海好买基金销售有限公司、上海长量基金销售投资顾问有限公司、和讯信息科技有限公司、万银财富(北京)基金销售有限公司、北京钱景财富投资管理有限公司、北京展恒基金销售有限公司、浙江同花顺基金销售有限公司、北京恒天明泽基金销售有限公司、北京增财基金销售有限公司。

8、验资机构名称: 瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)

9、募集资金总额及入账情况

本次募集的募集有效认购总户数为 8,358 户,有效净认购总金额为 983,784,772.57 元人民币,认购资金的银行利息 168,188.26 元人民币,其中,场外认购缴存资金产生折算为基金份额的利息为 105,690.26 元人民币,场内认购缴存资金产生折算为基金份额的利息为 62,498.00 元人民币。本基金有效净认购总额 983,784,772.57 元人民币及场外认购缴存资金产生折算为基金份额的利息 168,188.26 元人民币已于 2014 年 9 月 11 日全额划入本基金在基金托管人中国建设银行股份有限公司开立的新华中证环保产业指数分级证券投资基金托管专户;场内认购缴存资金产生折算为基金份额的利息 65,778.48 元人民币,已于银行结息日(2014 年 9 月 20 日)划入本基金在基金托管人中国建设银行股份有限公司开立的新华中证环保产业指数分级证券投资基金托管专户。

10、本基金募集备案情况

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》以及《新华中证环保产业指数分级证券投资基金基金合同》、《新华中证环保产业指数分级证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金募集符合有关条件,本基金管理人已向中国证监会办理基金备案手续,并于 2014 年 9 月 11 日获书面确认,基金合同自该日起正式生效。自基金合同生效之日起,本基金管理人开始正式管理本基金。

11、基金合同生效日:2014 年 9 月 11 日

12、基金合同生效日的基金份额总额: 983,952,960.83 份。

(二) 本基金的日常申购、赎回业务安排

本基金管理人将于 2014 年 10 月 13 日起开始办理本基金的日常申购和赎回业务,具体业务办理时间等情况在开放申购和赎回公告中规定。

(三) 新华环保上市交易的主要内容

1、本基金上市交易的核准机构和核准文号: 深证上【2014】358 号

2、上市交易日期: 2014 年 10 月 16 日。

3、上市交易的证券交易所: 深圳证券交易所。

投资者在深圳证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金交易。

4、基金简称: 新华环保 A 份额、新华环保 B 份额 场内简称: NCF 环保 A、NCF 环保 B

5、基金交易代码：NCF 环保 A：150190、NCF 环保 B：150191

6、本次上市交易份额（截至 2014 年 10 月 9 日）：NCF 环保 A：355,223,540.00 份、NCF 环保 B：355,223,540.00 份

7、未上市交易份额的流通规定：未上市交易的新华环保办理跨系统转托管到场内（证券登记结算系统）后，可以向具有基金代销业务资格且符合深圳证券交易所风险控制要求的深圳证券交易所会员单位，根据基金合同配对转换的规定申请将份额分拆成 NCF 环保 A 和 NCF 环保 B，分拆后的 NCF 环保 A 和 NCF 环保 B 可以在深圳证券交易所场内上市流通。

8、基金资产净值的披露：基金合同生效后，在新华环保 A 份额、新华环保 B 份额上市交易前或者开始办理新华环保份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和新华环保份额的基金份额净值、新华环保 A 份额和新华环保 B 份额的基金份额参考净值。在新华环保 A 份额、新华环保 B 份额上市交易后或者开始办理新华环保份额申购或者赎回后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日的新华环保份额的基金份额净值和基金份额累计净值、新华环保 A 份额和新华环保 B 份额各自的基金份额参考净值。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和新华环保份额的基金份额净值、新华环保 A 份额和新华环保 B 份额各自的基金份额参考净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，将基金资产净值、新华环保份额的基金份额净值和基金份额累计净值、新华环保 A 份额和新华环保 B 份额各自的基金份额参考净值登载在指定媒体上。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人情况

（一）基金份额持有情况

截至 2014 年 10 月 9 日，基金份额持有人户数为 8360 户，平均每户持有的基金份额为 117,697.72 份；其中，新华环保为 3714 户，平均每户持有的基金份额为 72,889.19 份；NCF 环保 A 为 4646 户，平均每户持有的基金份额为 76,758.77 份；NCF 环保 B 为 4646 户，平均每户持有的基金份额为 76,758.77 份。

（二）持有人结构

截至 2014 年 10 月 9 日，本基金场内份额持有人结构如下：场内机构投资者持有的基金份额为 60,323,228.00 份，占场内基金总份额的 8.46%；场内个人投资者持有的基金份额为 652,919,270.00 份，占场内基金总份额的 91.54%。机构投资者持有的本次上市交易的 NCF 环保 A 份额为 30,161,612.00 份，占本次 NCF 环保 A 上市交易基金份额比例为 8.49%；个人投资者持有的本次上市交易的 NCF 环保 A 份额为 325,061,928.00 份，占本次 NCF 环保 A 上市交易份额比例为 91.51%。机构投资者持有的本次上市交易的 NCF 环保 B 份额为 30,161,616.00 份，占本次 NCF 环保 B 上市交易基金份额比例为 8.49%；个人投资者持有的本次上市交易的 NCF 环保 B 份额为 325,061,924.00 份，占本次 NCF 环保 B 上市交易份额比例为 91.51%。

（三）截至 2014 年 10 月 9 日，前十名场内基金份额持有人情况：

序号	持有人名称（全称）	持有 NCF 环保 A 份额	占 NCF 环保 A 份额比例	持有 NCF 环保 B 份额	占 NCF 环保 B 份额比例
----	-----------	----------------	-----------------	----------------	-----------------

0899017317	东方证券股份有限公司	13,000,253.00	3.66%	13,000,252.00	3.66%
------------	------------	---------------	-------	---------------	-------

0899045437	都邦财产保险股份有限公司—传统保险产品	10,001,264.00	2.82%	10,001,263.00	2.82%
------------	---------------------	---------------	-------	---------------	-------

0020115565	宋伟铭	2,470,048.00	0.70%	2,470,048.00	0.70%
------------	-----	--------------	-------	--------------	-------

0121711571	王安志	1,990,168.00	0.56%	1,990,169.00	0.56%
------------	-----	--------------	-------	--------------	-------

0098011661	蒲元月	1,503,204.00	0.42%	1,503,205.00	0.42%
------------	-----	--------------	-------	--------------	-------

0105263720	何结冰	1,500,306.00	0.42%	1,500,306.00	0.42%
0105319999	杨景麟	1,500,084.00	0.42%	1,500,084.00	0.42%
0057044930	郑淑金	1,000,282.00	0.28%	1,000,281.00	0.28%
0122166882	廖国伟	1,000,165.00	0.28%	1,000,165.00	0.28%
0073718033	高凤英	1,000,097.00	0.28%	1,000,097.00	0.28%

注：以上信息依据中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司提供的持有人信息编制。

五、基金主要当事人简介

（一）基金管理人

1、公司概况

名称：新华基金管理有限公司

住所：重庆市江北区建新东路85号附1号1层1-1

办公地址：北京市海淀区西三环北路11号海通时代商务中心C1座

重庆市渝中区较场口88号A座7-2

法定代表人：陈重

设立日期：2004年12月9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【2004】197号

注册资本：壹亿陆仟万元整

股权结构：

出资单位	出资额（万元）	占注册资本金比例
新华信托股份有限公司	7680	48%
恒泰证券股份有限公司	7000	43.75%
杭州永原网络科技有限公司	1320	8.25%
合计	16000	100%

2、内部组织结构及职能

公司设立了投资管理委员会、专户投资管理委员会和风险管理委员会等专业委员会。

投资管理委员会是公司旗下证券投资基金资产运作的决策机构，总经理担任主任委员，其他委员由总经理指定人员担任。根据《基金法》、《基金合同》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等的规定，审议、决定基金经理提出的投资策略和投资方案，定期对基金经理的业绩进行评价；审核并决定基金产品方案；对基金资产运作所涉及的重大投资进行决策。

专户投资管理委员会是公司特定客户资产管理业务资产运作的决策机构，由总经理办公会研究决定其主任委员及其他成员。根据《基金法》、《资产管理合同》、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》等的规定，审议、决定专户投资经理提出的投资策略和投资方案，定期对专户投资经理的业绩进行评价，对专户管理所涉及的重大投资进行决策。

风险管理委员会负责确保公司内部控制制度的有效执行及投资风险的严格控制，定期或不定期对公司内部风险控制制度的有效执行进行评估，对公司经营、投资中的风险进行研究、分析，并提出改进意见。

公司设基金管理部、研究部、专户管理部、金融工程部、交易部、市场营销部、运作保障部、综合管理部、监察稽核部、北京分公司、机构业务部、电子商务部、董事会办公室等部门及分支机构，总经理根据业务需要决定各部门管理序列。

基金管理部：主要负责公司旗下基金的管理工作，进行基金投资组合管理的计划、实施，促进基金业绩目标的实现。

研究部：对宏观经济及金融市场、行业、公司进行研究，为公司旗下基金及专户管理的投资组合提供研究支持；对券商等研究机构进行评价，为交易席位分配提供客观支持。

专户管理部：主要负责公司担任投资顾问及“一对一”或“一对多”的相关专户投资业务，负责大客户的开发与维护。

金融工程部：主要负责公司基金及专户管理投资的风险及绩效评估、基金新产品开发及申报、数量化投资及其它金融工程工作。

交易部：负责公司旗下基金及专户管理投资的网上集中交易及网下交易等工作。

市场营销部：负责公司销售渠道的拓展及维护工作；负责公司整体营销策略的制定、实施；配合金融工程部进行新产品开发工作；负责公司网站及网上交易的开发、拓展及维护工作；为投资者提供包括但不限于基金认购、申购、赎回、业务咨询等客户服务工作。

运作保障部：负责公司旗下基金及专户管理投资运作的后台工作，包括：基金及专户管理投资的会计、估值、核算、过户代理、清算及结算联络等；负责规划、建设公司各项业务开展所需的信息技术系统，进行研究开发和运行支持。

综合管理部：进行公司的人力资源管理、财务管理、行政管理。

监察稽核部：负责公司内部的监查稽核工作，监督公司内部控制制度的执行情况，确保国家法律、法规和公司内部管理制度的有效执行；负责公司法律事务的管理，对外合同的审核，公司对外信息披露的组织及审核等工作。

北京分公司：主要负责公司授权开展的各项工作。

机构业务部：主要负责基金销售工作的机构客户开发与维护。

电子商务部：主要负责互联网金融、产品直销和客户服务等工作。

董事会办公室：主要负责处理董事会日常事务性工作；公司营销策划、媒体联络及对外信息披露等相关工作；结合公司及子公司业务情况，开展公司整体形象宣传工作。

3、人员情况

截至 2014 年 10 月 9 日，我公司共有 123??名员工，其中博士学位 5??人、硕士学位 48????人和学士学位 52??人。

4、信息披露负责人：齐岩

咨询电话：010-68726666

5、基金管理业务情况

公司目前旗下有二十一基金产品，即新华优选分红混合型证券投资基金、新华优选成长股票型证券投资基金、新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金、新华钻石品质企业股票型证券投资基金、新华行业周期轮换股票型证券投资基金、新华中小市值优选股票型证券投资基金、新华灵活主题股票型证券投资基金、新华优选消费股票型证券投资基金、新华纯债添利债券型发起式证券投资基金、新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金、新华趋势领航股票型证券投资基金、新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金、新华信用增益债券型证券投资基金、新华壹诺宝货币市场基金、新华惠鑫分级债券型证券投资基金、新华一路财富灵活配置混合型证券投资基金、新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金、新华阿里一号保本混合型证券投资基金、新华鑫安保本一号混合型证券投资基金、新华中证环保产业指数分级证券投资基金以及新华财富金 30 天理财债券型证券投资基金。

6、本基金基金经理简介

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

李会忠先生：经济学硕士。2007 年 9 月加入新华基金管理有限公司，历任新华基金管理有限公司行业研究员、策略分析师、新华钻石品质企业股票型证券投资基金基金经理助理。现任新华基金管理有限公司金融工程部副总监，2014 年 7 月起任新华一路财富灵活配置混合型证

券投资基金基金经理，2014 年 9 月起任新华中证环保产业指数分级证券投资基金基金经理。

（二）基金托管人

1、公司概况

名称：中国建设银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：王洪章

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

联系人：田 青

联系电话：(010)6759 5096

2、主要人员情况

截至 2014 年 9 月 11 日，中国建设银行资产托管部共有员工 110 人，平均年龄 33 岁，100% 以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。??

3、基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至 2013 年 12 月 31 日，中国建设银行已托管 349 只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行自 2009 年至 2012 年连续四年被国际权威杂志《全球托管人》评为“中国最佳托管银行”；获和讯网的中国“最佳资产托管银行”奖；境内权威经济媒体《每日经济观察》的“最佳基金托管银行”奖；中央国债登记结算有限责任公司的“优秀托管机构”奖。

（三）基金验资机构

名称：瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：北京市海淀区西四环中路 16 号院 2 号楼 4 层

办公地址：北京市东城区永定门西滨河路 8 号院 7 号楼中海地产广场西塔 5-11 层

法定代表人：杨剑涛

电话：010—88219191

传真：010—88210558

经办注册会计师：李荣坤、张吉范

联系人：李荣坤

六、基金合同摘要

（一）基金管理人、基金份额持有人和基金托管人的权利、义务

1、基金管理人的权利与义务

（1）根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

- 1) 依法募集资金；
- 2) 自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；
- 3) 依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；

- 4) 销售基金份额;
- 5) 按照规定召集基金份额持有人大会;
- 6) 依据《基金合同》及有关法律、法规规定监督基金托管人,如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律、法规规定,应呈报中国证监会和其他监管部门,并采取必要措施保护基金投资者的利益;
- 7) 在基金托管人更换时,提名新的基金托管人;
- 8) 选择、更换基金销售机构,对基金销售机构的相关行为进行监督和处理;
- 9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用;
- 10) 依据《基金合同》及有关法律、法规规定决定基金收益的分配方案;
- 11) 在《基金合同》约定的范围内,拒绝或暂停受理申购与赎回申请;
- 12) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利,为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利;
- 13) 在法律法规允许的前提下,为基金的利益依法为基金进行融资;
- 14) 以基金管理人的名义,代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为;
- 15) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构;
- 16) 在符合有关法律、法规的前提下,制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换的业务规则;
- 17) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

(2) 根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金管理人的义务包括但不限于:

- 1) 依法募集资金,办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜;
- 2) 办理基金备案手续;
- 3) 自《基金合同》生效之日起,以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产;
- 4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策,以专业化的经营方式管理和运作基金财产;
- 5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度,保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立,对所管理的不同基金分别管理,分别记账,进行证券投资;
- 6) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外,不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益,不得委托第三人运作基金财产;
- 7) 依法接受基金托管人的监督;
- 8) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定,按有关规定计算并公告基金资产净值、基金份额净值、新华环保 A 份额与新华环保 B 份额的基金份额参考净值,确定新华环保份额申购、赎回的价格;
- 9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;
- 10) 编制季度、半年度和年度基金报告;
- 11) 严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定,履行信息披露及报告义务;
- 12) 保守基金商业秘密,不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外,在基金信息公开披露前应予保密,不向他人泄露;
- 13) 按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案,及时向基金份额持有人分配基金收益;
- 14) 按规定受理申购与赎回申请,及时、足额支付赎回款项;
- 15) 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会;
- 16) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上;

- 17) 确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出, 并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式, 随时查阅到与基金有关的公开资料, 并在支付合理成本的前提下得到有关资料的复印件;
- 18) 组织并参加基金财产清算小组, 参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;
- 19) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时, 及时报告中国证监会并通知基金托管人;
- 20) 因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时, 应当承担赔偿责任, 其赔偿责任不因其退任而免除;
- 21) 监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务, 基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时, 基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿;
- 22) 当基金管理人将其义务委托第三方处理时, 应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任;
- 23) 以基金管理人名义, 代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为;
- 24) 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件, 《基金合同》不能生效, 基金管理人承担全部募集费用, 将已募集资金并加计银行同期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人;
- 25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议;
- 26) 建立并保存基金份额持有人名册;
- 27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

2、基金份额持有人的权利与义务

基金投资者持有本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受, 基金投资者自依据《基金合同》取得基金份额, 即成为本基金份额持有人和《基金合同》的当事人, 直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为《基金合同》当事人并不以在《基金合同》上书面签章或签字为必要条件。

同一类别每份基金份额具有同等的合法权益。

(1) 根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定, 基金份额持有人的权利包括但不限于:

- 1) 分享基金财产收益;
- 2) 参与分配清算后的剩余基金财产;
- 3) 依法申请赎回其持有的新华环保份额或转让新华环保 A 份额、新华环保 B 份额;
- 4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集基金份额持有人大会;
- 5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会, 对基金份额持有人大会审议事项行使表决权;
- 6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料;
- 7) 监督基金管理人的投资运作;
- 8) 对基金管理人、基金托管人、基金销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁;
- 9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

(2) 根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定, 基金份额持有人的义务包括但不限于:

- 1) 认真阅读并遵守《基金合同》;
- 2) 了解所投资基金产品, 了解自身风险承受能力, 自行承担投资风险;
- 3) 关注基金信息披露, 及时行使权利和履行义务;
- 4) 缴纳基金认购、申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用;
- 5) 在其持有的基金份额范围内, 承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任;
- 6) 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动;
- 7) 执行生效的基金份额持有人大会的决议;
- 8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利;
- 9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

3、基金托管人的权利与义务

(1) 根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：

- 1) 自《基金合同》生效之日起，依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产；
- 2) 依《基金合同》约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他费用；
- 3) 监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人违反《基金合同》及国家法律法规行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- 4) 根据相关市场规则，为基金开设资金账户、证券账户等投资所需账户、为基金办理证券交易资金清算；
- 5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；
- 6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；
- 7) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

(2) 根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：

- 1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；
- 2) 设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；
- 3) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；
- 4) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；
- 5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；
- 6) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户等投资所需账户，按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
- 7) 保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；
- 8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值、新华环保 A 份额与新华环保 B 份额的基金份额参考净值、新华环保份额申购、赎回价格；
- 9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
- 10) 对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行；如果基金管理人未执行《基金合同》规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；
- 11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；
- 12) 建立并保存基金份额持有人名册；
- 13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
- 14) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；
- 15) 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，召集基金份额持有人大会或配合基金管理人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
- 16) 按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；
- 17) 参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- 18) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行监管机构，并通知基金管理人；
- 19) 因违反《基金合同》导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而

免除；

20) 按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿；

21) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

(二) 基金份额持有人大会

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人大会的审议事项应分别由新华环保份额、新华环保 A 份额、新华环保 B 份额的基金份额持有人独立进行表决。基金份额持有人持有的每一基金份额在其对应的份额类别内拥有平等的投票权。

1、召开事由

(1)、当出现或需要决定下列事由之一的，经基金管理人、基金托管人或单独或合计持有新华环保份额、新华环保 A 份额、新华环保 B 份额各自份额 10%以上(含 10%)的基金份额持有人(以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同)提议时，应当召开基金份额持有人大会：

- 1) 终止《基金合同》；
- 2) 更换基金管理人；
- 3) 更换基金托管人；
- 4) 转换基金运作方式；
- 5) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；
- 6) 变更基金类别；
- 7) 本基金与其他基金的合并；
- 8) 变更基金投资目标、范围或策略；
- 9) 变更基金份额持有人大会程序；
- 10) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
- 11) 终止新华环保 A 份额、新华环保 B 份额上市，但因本基金不再具备上市条件而被深圳证券交易所终止上市的除外；
- 12) 对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；
- 13) 法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

(2) 以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

- 1) 调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；
- 2) 法律法规要求增加的基金费用的收取；
- 3) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整新华环保份额的申购费率、调低赎回费率或者在不影响现有基金份额持有人利益的前提下变更收费方式；
- 4) 因相应的法律法规、深圳证券交易所或登记机构的相关业务规则发生变动而应当对《基金合同》进行修改；
- 5) 对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生重大变化；
- 6) 按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

2、会议召集人及召集方式

(1) 除法律法规规定或《基金合同》另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。

(2) 基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。

(3) 基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金

管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当由基金托管人自行召集。

(4) 单独或合计持有新华环保份额、新华环保 A 份额、新华环保 B 份额各自份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，单独或合计持有新华环保份额、新华环保 A 份额、新华环保 B 份额各自份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开。

(5) 单独或合计持有新华环保份额、新华环保 A 份额、新华环保 B 份额各自份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计持有新华环保份额、新华环保 A 份额、新华环保 B 份额各自份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

(6) 基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

3、召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

(1) 召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 30 日，在指定媒体公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

- 1) 会议召开的时间、地点和会议形式；
- 2) 会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；
- 3) 有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；
- 4) 授权委托证明的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；
- 5) 会务常设联系人姓名及联系电话；
- 6) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- 7) 召集人需要通知的其他事项。

(2) 采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。

(3) 如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。

4、基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式以及法律法规或监管机构允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

(1) 现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托证明委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或基金托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

1) 亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定,并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符;

2) 经核对,汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示,有效的新华环保份额、新华环保 A 份额、新华环保 B 份额的基金份额不少于在权益登记日各自基金总份额的二分之一(含二分之一)。若到会者在权益登记日代表的有效的新华环保份额、新华环保 A 份额、新华环保 B 份额各自基金份额少于在权益登记日各自基金份额的二分之一,召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内,就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会到会者在权益登记日代表的有效的新华环保份额、新华环保 A 份额、新华环保 B 份额的基金份额应不少于在权益登记日各自基金份额的三分之一(含三分之一)。

(2) 通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式在表决截至日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式进行表决。

在同时符合以下条件时,通讯开会的方式视为有效:

1) 会议召集人按《基金合同》约定公布会议通知后,在两个工作日内连续公布相关提示性公告;

2) 召集人按基金合同约定通知基金托管人(如果基金托管人为召集人,则为基金管理人)到指定地点对表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人(如果基金托管人为召集人,则为基金管理人)和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的表决意见;基金托管人或基金管理人经通知不参加收取表决意见的,不影响表决效力;

3) 本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的,基金份额持有人所持有的新华环保份额、新华环保 A 份额、新华环保 B 份额的基金份额不小于在权益登记日各自基金份额的二分之一(含二分之一);若本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见基金份额持有人所持有的新华环保份额、新华环保 A 份额、新华环保 B 份额小于在权益登记日各自基金份额的二分之一,召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内,就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一(含三分之一)以上新华环保份额、新华环保 A 份额、新华环保 B 份额各自基金份额的持有人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见;

4) 上述第 3) 项中直接出具表决意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人,同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具表决意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定,并与基金登记机构记录相符。

(3) 在法律法规和监管机关允许的情况下,本基金的基金份额持有人亦可采用其他非书面方式授权其代理人出席基金份额持有人大会;在会议召开方式上,本基金亦可采用其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合的方式召开基金份额持有人大会,会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。

5、议事内容与程序

(1) 议事内容及提案权

1) 议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项,如《基金合同》的重大修改、决定终止《基金合同》、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、法律法规及《基金合同》规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

2) 基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日新华环保份额、新华环保 A 份额、新华环保 B 份额各自份额 10%以上(含 10%)的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前就召开事由向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案。

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开前及时公告。

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

3) 对于基金份额持有人提交的提案，大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

关联性。大会召集人对于基金份额持有人提案涉及事项与基金有直接关系，并且不超出法律法规和基金合同规定的基金份额持有人大会职权范围的，应提交大会审议；对于不符合上述要求的，不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决，应当在该次基金份额持有人大会上进行解释和说明。

程序性。大会召集人可以对基金份额持有人的提案涉及的程序性问题做出决定。如将其提案进行分拆或合并表决，需征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会做出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

(2) 议事程序

1) 现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

会议召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名（或单位名称）、身份证明文件号码、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）和联系方式等事项。

2) 通讯开会

在通讯开会的情况下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期后 2 个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。

6、表决

新华环保份额、新华环保 A 份额、新华环保 B 份额的基金份额持有人所持每份基金份额在其对应的份额类别内享有同等表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

(1) 一般决议，一般决议须经出席会议的新华环保份额、新华环保 A 份额、新华环保 B 份额的各自基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过方为有效；除下列第 2 项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

(2) 特别决议，特别决议应当经参加大会的新华环保份额、新华环保 A 份额、新华环保 B 份额的各自基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》、本基金与其他基金合并以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

7、计票

（1）现场开会

1) 如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力。

2) 监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。

3) 如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有怀疑，可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点，重新清点以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。

4) 计票过程应由公证机关予以公证，基金管理人或基金托管人拒不出席大会的，不影响计票的效力。

（2）通讯开会

在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

8、生效与公告

基金份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会备案。

基金份额持有人大会的决议自完成备案手续之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 个工作日内在指定媒体上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决议。生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。

9、本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等的规定，凡是直接引用法律法规的部分，如将来法律法规修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

（三）基金合同解除和终止的事由、程序

1、《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

（1）基金份额持有人大会决定终止的；

（2）基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；

（3）《基金合同》约定的其他情形；

（4）相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

2、基金财产的清算

（1）基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

（2）基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

(3) 基金财产清算小组职责：基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

(4) 基金财产清算程序：

- 1) 《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；
- 2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- 3) 对基金财产进行估值和变现；
- 4) 制作清算报告；
- 5) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- 6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；
- 7) 对基金剩余财产进行分配。

(5) 基金财产清算的期限为 6 个月。

3、清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

4、基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，分别计算新华环保份额、新华环保 A 份额、新华环保 B 份额各自的应计分配比例，并据此向新华环保份额、新华环保 A 份额、新华环保 B 份额各自的基金份额持有人按其持有的基金份额比例进行分配。

5、基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

6、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

(四) 争议的处理和适用的法律

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京市，仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力。

《基金合同》受中国法律管辖。

(五) 基金合同存放地和投资者取得合同的方式

基金合同可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、销售机构的办公场所和营业场所查阅。

七、基金财务状况

(一) 本基金募集期间相关费用明细

本基金募集期间发生的信息披露费、会计师费、律师费及其他费用由基金管理人承担，不从基金财产列支，其他各基金销售机构根据本基金招募说明书设定的费率或佣金比例收取认购费。

(二) 本基金发售后至本公告书公告前的重要财务事项

本基金认购后至本公告书公告前无重要财务事项发生。

(三) 本基金 2014 年 10 月 9 日资产负债表（未经审计）如下：

时间项目 2014 年 10 月 9 日

资产： -

银行存款 358,582,258.87

结算备付金	15,857,640.87
存出保证金	153,165.52
交易性金融资产	644,533,845.18
其中：股票投资	644,533,845.18
基金投资	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	-
其他资产	111,577.03
资产总计	1,019,238,487.47
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	-
应付证券清算款	-
应付赎回款	-
应付管理人报酬	762,453.22
应付托管费	167,739.69
其他负债	622,126.50
负债合计	1,552,319.41
所有者权益：	-
实收基金	983,952,960.83
未分配利润	33,733,207.23
所有者权益合计	1,017,686,168.06
负债和所有者权益总计	1,019,238,487.47

八、基金投资组合

截至 2014 年 10 月 9 日本基金的基金投资组合情况如下：

（一）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	644,533,845.18	63.24
	其中：股票	644,533,845.18	63.24
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	374,439,899.74	36.74
6	其他资产	264,742.55	0.03
7	合计	1,019,238,487.47	100.00

（二）报告期末按行业分类的股票投资组合

行业	数量	市值	净值比
----	----	----	-----

A 农、林、牧、渔业	- 0.00	0.00%
B 采矿业	- 0.00	0.00%
C 制造业	31,249,208	419,268,400.44 41.20%
D 电力、热力、燃气及水生产和供	11,207,570	98,029,874.33 9.63%
E 建筑业	2,513,896	46,185,871.86 4.54%
F 批发和零售业	1,344,900	6,858,990.00 0.67%
G 交通运输、仓储和邮政业	- 0.00	0.00%
H 住宿和餐饮业	- 0.00	0.00%
I 信息传输、软件和信息技术服务	612,202	13,185,171.36 1.30%
J 金融业	366,400	6,415,664.00 0.63%
K 房地产业	- 0.00	0.00%
L 租赁和商务服务业	- 0.00	0.00%
M 科学研究和技术服务业	961,422	13,522,520.54 1.33%
N 水利、环境和公共设施管理业	1,606,863	41,067,352.65 4.04%
P 教育	- 0.00	0.00%
Q 卫生和社会工作	- 0.00	0.00%
R 文化、体育和娱乐业	- 0.00	0.00%
S 综合	- 0.00	0.00%
合计	49,862,461	644,533,845.18 63.33%

(三) 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

股票代码	股票名称	数 量	市 值	市值占净值比
600537	亿晶光电	528,611	8,975,814.78	0.8820%
601727	上海电气	1,433,520	8,687,131.20	0.8536%
600526	菲达环保	592,287	8,570,392.89	0.8421%
600674	川投能源	478,453	8,526,032.46	0.8378%
600184	光电股份	271,049	8,467,570.76	0.8320%
600187	国中水务	1,188,652	8,332,450.52	0.8188%
002665	首航节能	190,350	8,219,313.00	0.8076%
601012	隆基股份	400,761	8,155,486.35	0.8014%
600151	航天机电	776,455	8,152,777.50	0.8011%
600979	广安爱众	1,154,462	8,069,689.38	0.7929%

(四) 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

报告期末，本基金未持有债券。

(五) 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

报告期末，本基金未持有债券。

(六) 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

报告期末，本基金未持有资产支持证券。

(七) 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

报告期末，本基金未持有权证。

(八) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

1、 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

报告期末，本基金无股指期货投资。

2、 本基金投资股指期货的投资政策

本基金合同尚无股指期货投资政策。

（九）报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

1、本基金投资国债期货的投资政策

本基金合同尚无国债期货投资政策。

2、报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

报告期末，本基金无国债期货投资。

3、本基金投资国债期货的投资评价

报告期末，本基金无国债期货投资。

（十）投资组合报告附注

1、本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、本报告期内，本基金投资的前十名证券没有超出基金合同约定。

3、其他资产构成

序号 名称 金额（元）

1 存出保证金 153,165.52

2 应收证券清算款 -

3 应收股利 -

4 应收利息 111,577.03

5 应收申购款 -

6 其他应收款 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

9 合计 264,742.55

4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末，本基金未持有处于转股期的可转换债券。

5、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末，本基金未持有流通受限的股票。

6、投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

九、重大事件揭示

本基金以下信息披露事项均已通过指定报刊以及基金管理人网站(www.ncfund.com.cn)进行公开披露，并已报送相关监管部门备案。

1、2014年8月6日，刊登于基金管理人网站的新华中证环保产业指数分级证券投资基金基金合同；

2、2014年8月6日，刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及基金管理人网站的新华中证环保产业指数分级证券投资基金基金合同摘要；

3、2014年8月6日，刊登于基金管理人网站的新华中证环保产业指数分级证券投资基金托管协议；

4、2014年8月6日，刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及基金管理人网站的新华中证环保产业指数分级证券投资基金份额发售公告；

5、2014年8月6日，刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及基金管理人网站的新华中证环保产业指数分级证券投资基金招募说明书；

6、2014年8月8日，刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及基金管理人网站的关于旗下新华中证环保产业指数分级证券投资基金新增东海证券、华龙证券、华泰证券、国信证券和平安证券为代销机构的公告；

7、2014年8月11日，刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及基金管理人网站的关于新华中证环保产业指数分级证券投资基金份额上网发售提示性公告；

8、2014年8月19日，刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及基金管理人网站的新华中证环保产业指数分级证券投资基金关于增加华安证券股份有限公司为代销机构的公告；

9、2014年8月22日，刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及基金管理人网站的新华中证环保产业指数分级证券投资基金关于增加代销机构的公告；

10、2014年9月12日，刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及基金管理人网站的关于旗下新华中证环保产业指数分级证券投资基金基金合同生效公告。

11、2014年9月16日，刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及基金管理人网站的关于新华中证环保产业指数分级证券投资基金基金经理变更公告。

12、2014年9月30日，刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及基金管理人网站的关于开通新华中证环保产业指数分级证券投资基金基金系统内转托管和跨系统转托管业务的公告。

13、2014年9月30日，刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及基金管理人网站的关于开通新华中证环保产业指数分级证券投资基金份额配对转换业务的公告。

14、2014年10月9日，刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及基金管理人网站的新华中证环保产业指数分级证券投资基金关于增加东北证券股份有限公司为代销机构的公告。

15、2014年10月9日，刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及基金管理人网站的新华中证环保产业指数分级证券投资基金开放日常申购、赎回业务公告。

16、2014年10月10日，刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及基金管理人网站的新华中证环保产业指数分级证券投资基金关于在网上交易及部分代销机构开通定投业务并参与网上交易费率优惠活动的公告。

十、基金管理人承诺

本基金管理人就本基金上市交易之后履行管理人职责做出如下承诺：

- （一）严格遵守《基金法》及其他法律法规、基金合同的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。
- （二）真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件，披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息，并接受中国证监会、深圳证券交易所的监督管理。
- （三）在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后，将及时予以公开澄清。

十一、基金托管人承诺

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺：

- （一）严格遵守《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，设立专门的基金托管部，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员负责基金财产托管事宜。
- （二）根据《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付等行为进行监督和核查。
- （三）基金托管人发现基金管理人的行为违反《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，督促基金管理人改正。
- （四）基金托管人发现基金管理人重大违规行为，将立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

十二、备查文件目录

投资者如需了解本基金更详细信息，可向基金管理人、基金托管人或销售代理人申请免费查阅存放在上述机构的办公场所、营业场所的下列文件；投资者也可在支付工本费后，在合理时间内取得以下文件的复制件或复印件，但应以基金合同正本为准。

- （一）中国证监会核准新华中证环保产业指数分级证券投资基金募集的文件；
- （二）《新华中证环保产业指数分级证券投资基金基金合同》；
- （三）《新华中证环保产业指数分级证券投资基金招募说明书》；
- （四）《新华中证环保产业指数分级证券投资基金托管协议》；
- （五）关于申请募集新华中证环保产业指数分级证券投资基金之法律意见书；
- （六）基金管理人业务资格批件、营业执照；
- （七）基金托管人业务资格批件、营业执照；
- （八）中国证监会要求的其他文件。

新华基金管理有限公司

二〇一四年十月十三日