

工银瑞信中证新能源指数分级证券投资基金 之新能A级与新能B级上市交易公告书

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

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：2015年8月3日

公告日期：2015年7月29日

目 录

一、重要声明与提示.....	2
二、基金概览.....	3
三、基金的募集与上市交易.....	5
四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人情况.....	8
五、基金主要当事人简介.....	10
六、基金合同摘要.....	13
七、基金财务状况.....	13
八、基金投资组合.....	14
九、重大事件揭示.....	17
十、基金管理人承诺.....	17
十一、基金托管人承诺.....	18
十二、备查文件目录.....	18
附件：基金合同内容摘要.....	19

一、重要声明与提示

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”）之新能A级份额与新能B级份额上市交易公告书依据《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〉》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报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。

本基金托管人中国银河证券股份有限公司保证本报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。

凡本上市交易公告书未涉及的有关内容，请投资者详细查阅刊登在2015年6月12日《证券时报》以及工银瑞信基金管理有限公司网站（www.icbccs.com.cn）上的《工银瑞信中证新能源指数分级证券投资基金招募说明书》。

二、基金概览

1、基金名称：工银瑞信中证新能源指数分级证券投资基金（基金份额场内简称：新能母基）

2、基金类型：股票型

3、基金运作方式：契约型开放式

4、基金份额分级：

本基金的基金份额包括 工银瑞信中证新能源指数分级证券投资基金之工银新能源份额（场内简称“新能母基”，基金代码：164821）、工银瑞信中证新能源指数分级证券投资基金之工银新能源 A 份额（场内简称“新能 A 级”，基金代码：150327）与工银瑞信中证新能源指数分级证券投资基金之工银新能源 B 份额（场内简称“新能 B 级”，基金代码：150328）。其中，工银新能源 A 份额和工银新能源 B 份额的基金份额配比始终保持

1:1 的比例不变。

5、本基金的存续期为不定期。

6、新能A级、新能B级与新能母基的资产合并运作。

7、工银瑞信中证新能源指数分级证券投资基金之基础份额的申购与赎回：投资者可通过场外或场内两种方式对本基金进行申购与赎回。场外申购和赎回业务的场所为基金管理人直销机构和其他场外销售机构。场内申购和赎回业务的场所为具有基金销售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，具体销售网点和会员单位的名单由基金管理人在招募说明书或其他公告中列明。新能A级份额与新能B级份额只上市交易，不接受申购和赎回。

8、场内份额配对转换：场内份额配对转换是指本基金场内的基础份额与分级份额之间进行转换的行为，包括分拆与合并。分拆指场内的基础份额按照1:1的基金份额配比分拆成新能A级和新能B级的行为。合并指新能A级和新能B级按照1:1的基金份额配比合并成基础份额的行为。

9、基金份额折算：基金份额定期折算的频率为每年折算1次。基金份额不定期折算的条件是基础份额的基金份额净值高至1.5000元或以上，或新能B级的基金份额参考净值低至0.2500元或以下。有关基金份额折算的约定，参见基金合同“二十二、基金份额折算”。定期折算基准日或不定期折算基准日的具体日期，详见基金管理人届时发布的公告。

10、基金份额总额：截至2015年7月27日，本基金的份额总额为268,185,414.24份；其中，基础份额为89,706,153.24份；新能A级为89,239,630.00份；新能B级为89,239,631.00份。

11、基金份额净值：截至2015年7月27日，基础份额的基金份额净值为0.9995元，新能A级的基金份额净值为1.0031元，新能B级的基金份额净值为0.9959元。

12、本次上市交易的基金份额简称及交易代码：份额简称：新能A级，交易代码：150327；份额简称：新能B级，交易代码：150328。

13、本次上市交易份额：新能A级：89,239,630.00份；新能B级：89,239,631.00份

14、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所

15、上市交易日期：2015年8月3日

16、基金管理人：工银瑞信基金管理有限公司

17、基金托管人：中国银河证券股份有限公司

18、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）本基金上市前募集情况

1、本基金募集申请的注册机构和注册批复文号：中国证券监督管理委员会证监许可[2015]1103号。

2、基金运作方式：契约型开放式

3、基金存续期：不定期

4、发售日期：2015年6月15日至2015年7月3日

5、发售价格：1.00元人民币

6、发售方式：本基金通过场内、场外两种方式公开发售。

7、发售机构：

（1）场内发售机构

本基金通过深圳证券交易所上网定价发售，基金份额发售机构为深圳证券交易所内具有基金销售资格的会员单位。

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、高华证券、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、开源证券、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、太平洋证券、天风证券、天源证券、万和证券、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）

(2) 场外发售机构

1) 直销机构：工银瑞信基金管理有限公司。

2) 其他销售机构：

中国银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、北京农商行股份有限公司、兴业银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、中国邮政储蓄银行股份有限公司、招商证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、平安证券有限责任公司、天风证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、国都证券有限责任公司、国联证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、西南证券股份有限公司、新时代证券有限责任公司、华安证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、大通证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、渤海证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、德邦证券有限责任公司、齐鲁证券有限公司、长城证券股份有限公司、中航证券有限公司、中国国际金融有限公司、信达证券股份有限公司、广州证券股份有限公司、天相投资顾问有限公司、深圳众禄基金销售有限公司、北京展恒基金销售有限公司、上海天天基金销售有限公司、杭州数米基金销售有限公司、上海好买基金销售有限公司、和讯信息科技有限公司、上海利得基金销售有限公司、浙江金观诚财富管理有限公司、浙江同花顺基金销售有限公司、上海长量基金销售投资顾问有限公司、深圳市新兰德证券投资咨询有限公司、一路财富（北京）信息科技有限公司、海银基金销售有限公司、上海大智慧财富管理有限公司等。

基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并予以公告。

8、验资机构名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

9、认购资金总额及入账情况：本次认购总金额268,103,813.23元人民币，该资金已于2015年7月8日全额划入本基金在基金托管人中国银河证券股份有限公司开立的基金托管专户；认购资金的银行利息共81,946.10元，其中人民币81,601.01已折算为基金份额分别计入各基金份额持有人基金账户，另人民币345.09元归入基金资产。

本基金按照每份基金份额 1.00 元计算，募集期间募集资金及其利息结转的基金份额共计268,185,414.24份，其中场外认购的基金份额为89,706,153.24份；场内认购的基金份额为178,479,261.00份。

10、基金备案情况

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》等相关法律、法规的规定以及《工银瑞信中证新能源指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）的有关约定，本基金募集结果符合备案条件，工银瑞信基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）已向中国证监会办理完毕基金备案手续，并于2015年7月9日获中国证监会书面确认，本基金合同自该日起正式生效。基金合同生效之日起，本基金管理人正式开始管理本基金。

11、基金合同生效日：2015年7月9日。

12、基金合同生效日的基金总份额：268,185,414.24份。

（二）本基金上市交易的主要内容

1、基金上市交易的核准机构和核准文号：深圳证券交易所深证上[2015]368号

2、上市交易日期：2015年8月3日

3、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所。投资者在具有基金销售业务资格的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、基础份额简称及代码：工银中证新能源指数分级，场内简称：新能母基，基金代码：164821。

5、上市交易份额简称及代码：新能A级，基金代码：150327；新能B级，基金代码：150328。

6、本次上市交易份额：新能A级 89,239,630.00份；新能B级 89,239,631.00份。

7、基金资产净值的披露：开放式基金每日收市后对基金资产净值进行的估值

基金管理人每个开放日对基金资产估值。用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人于每个工作日交易结束后将经过基金托管人复核的基金净值传给深交所，深交所于次日通过行情系统“市盈率 I”揭示。根据《基金法》，开放式基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此基金管理人公布的基金净值负责。

8、未上市交易份额的流通规定：对于托管在场内的新能母基份额，基金份额持有人符合相关办理条件的前提下，将其分拆为新能A级份额和新能B级份额即可上市流通；对于托管在场外的份额，基金份额持有人符合相关办理条件的前提下，将其跨系统转托管至深圳证券交易所场内后分拆为新能A级份额和新能B级份额即可上市流通。

9、本基金开通跨系统转托管业务日期：2015年8月3日，具体业务按照中国证券登记结算有限责任公司的相关规定办理。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人情况

（一）本基金基金份额持有情况

截至2015年7月27日，工银瑞信中证新能源指数分级证券投资基金之新能母基的持有人总户数为2,915户，其中场外持有人总户数为2,915户；新能A级持有人总户数为641户，全部为场内持有人；新能B级持有人总户数为641户，全部为场内持有人；新能母基平均每户持有的场外基金份额为30,733.98份，新能A级平均每户持有的场内基金份额为139,219.39份，新能B级平均每户持有的场内基金份额为139,219.39份。

（二）场内基金份额持有人结构

新能A级：场内机构投资者持有的基金份额25,976,662.00份，占比29.11%；场内个人投资者持有的基金份额63,262,968.00份，占比70.89%。

新能B级：场内机构投资者持有的基金份额25,976,668.00份，占比29.11%；场内个人投资者持有的基金份额63,262,963.00份，占比70.89%。

（三）截至2015年7月27日，场内新能A级基金份额前十名持有人情况

序号	持有人名称（全称）	持有新能A级份额 （份）	占场内基金 总份额的比例（%）
1	陈淑英	6,575,767	7.37%
2	招商证券股份有限公司	4,000,466	4.48%
3	株洲千金文化广场有限公司	3,000,437	3.36%
4	申银万国证券股份有限公司	3,000,437	3.36%
5	上海得金投资中心（有限合伙）	2,500,365	2.80%
6	深圳平安大华汇通财富-平安银行-平安汇通-艾方多策略对冲增强8号特定客户资产管理计划	2,500,365	2.80%
7	北京千石财富-华泰证券-艾方多策略对冲增强1号资产管理计划	2,500,364	2.80%

8	北京千石财富-华泰证券-千石资本-艾方多策略对冲增强3号资产管理计划	2,500,364	2.80%
9	北京千石财富-华泰证券-南京银行股份有限公司	2,500,364	2.80%
10	银河资本-中国银行-银河资本-艾方多策略对冲套利2号资产管理计划	2,500,364	2.80%
总计		31,579,293	35.39%

截至2015年7月27日，场内新能B级基金份额前十名持有人情况

序号	持有人名称（全称）	持有新能B级份额 （份）	占场内基金 总份额的比例（%）
1	陈淑英	6,575,767	7.37%
2	招商证券股份有限公司	4,000,467	4.48%
3	株洲千金文化广场有限公司	3,000,437	3.36%
4	申银万国证券股份有限公司	3,000,437	3.36%
5	北京千石财富-华泰证券-艾方多策略对冲增强1号资产管理计划	2,500,365	2.80%
6	北京千石财富-华泰证券-千石资本-艾方多策略对冲增强3号资产管理计划	2,500,365	2.80%
7	北京千石财富-华泰证券-南京银行股份有限公司	2,500,365	2.80%
8	银河资本-中国银行-银河资本-艾方多策略对冲套利2号资产管理计划	2,500,365	2.80%
9	上海得金投资中心（有限合伙）	2,500,364	2.80%
10	深圳平安大华汇通财富-平安银行-平安汇通-艾方多策略对冲增强8号特定客户资产管理计划	2,500,364	2.80%
总计		31,579,296	35.39%

五、基金主要当事人简介

（一）基金管理人

1、基本信息

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 5 号新盛大厦 A 座

邮政编码：100033

法定代表人：郭特华

总经理：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

组织形式：有限责任公司

注册资本：贰亿元人民币

营业执照注册号：100000400011263

经营范围：基金募集，基金销售，资产管理，中国证监会许可的其他业务

信息披露联系人：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

2、经营概况

公司设立了三个专门机构：执行委员会、风险管理委员会和投资决策委员会。执行委员会负责公司日常经营管理活动中的重要决策，风险管理委员会负责公司整体运营风险的控制。投资决策委员会负责指导基金财产的运作、确定基本的投资策略和投资组合的原则。

本公司下设十九个部门，分别是财务部、人力资源及行政部、权益投资部、固定收益

部、专户投资部、中央交易室、研究部、战略发展部、产品开发部、机构产品部、战略客户部、营销管理部、养老金部、电子商务及客户服务部、法律合规部、指数投资部、风险管理部、信息科技部、运作部。

权益投资部在投资决策委员会授权范围内负责建立、完善权益投资部投资管理流程并负责权益投资组合日常管理工作。固定收益部在投资决策委员会授权范围内制定和完善固定收益投资管理制度和固定收益部工作流程，制定各固定收益类基金的投资方案并跟踪和评估投资方案的执行。专户投资部在投资决策委员会授权范围内负责建立、完善专户投资部投资管理制度和业务流程，并负责公司旗下除共同基金外其余资产组合的日常投资管理工作。指数投资部在投资决策委员会授权范围内负责建立、完善指数投资部投资管理制度和业务流程，并负责公司境内外指数投资管理工作。研究部负责对宏观经济、行业公司及市场的研究并提出决策意见。中央交易室负责投资指令的交易。战略发展部从事公司发展战略研究、品牌管理和媒体关系维护。产品开发部负责新产品创新与开发。机构产品部负责机构产品开发，组织机构产品审核，负责产品管理、销售支持与客户服务。战略客户部是公司战略客户业务的归口管理部门。营销管理部是公司银行渠道代销业务，以及除战略客户部负责客户外的机构客户直销业务的销售管理部门。风险管理部负责基金投资风险管理及数量研究、合规监控工作。养老金部是养老金业务的牵头部门，组织推动公司养老金业务发展。电子商务及客户服务部负责通过电子商务平台和网络营销渠道向客户提供基金金融服务和销售。法律合规部负责对公司管理和业务运作合规性进行全方位监察稽核，并向公司管理层和监管机关提供独立、客观、公正的法律监察稽核报告。运作部负责公司开放式基金的注册登记、清算、核算和会计工作。信息科技部负责公司的计算机设备维护、系统开发及网络运行和维护。人力资源及行政部负责公司人力资源招聘、薪酬、考核、培训及行政管理等工作。财务部负责公司财务管理及日常行政事务管理等工作。

截止到 2015 年 6 月 30 日，我公司共有员工 430 人，其中 68%以上人员具有硕士以上学历。

3、本基金基金经理

赵栩先生，7 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，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。

（二）基金托管人

1、基金托管人情况

名称：中国银河证券股份有限公司

注册地址：中国北京西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：陈有安

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：75.37 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：010-66568278

中国银河证券股份有限公司是中国证券行业领先的综合性金融服务提供商，提供经纪、销售和交易、投资银行等综合证券服务。2007 年 1 月 26 日，公司经中国证监会批准，由中国银河金融控股有限责任公司作为主发起人，联合 4 家国内机构投资者共同发起正式成立。中央汇金投资有限责任公司为公司实际控制人。公司本部设在北京，注册资本为人民币 75.37 亿元。公司于 2013 年 5 月 22 日在香港联合交易所上市，控股股东为中国银河金融控股有限责任公司。

2、主要人员情况

银河证券托管部管理团队具有十年以上银行、公募基金、证券清算等金融从业经验，骨干员工从公司原有运营部门抽调，可为客户提供更多安全高效的资金保管、产品核算及产品估值等服务。

3、基金托管业务经营情况

银河证券托管部于 2014 年 1 月正式成立，在获得证券监管部门批准获得托管资格后已可为各类公开募集资金设立的证券投资基金提供托管服务。托管部拥有独立的安全监控设施，稳定、高效的托管业务系统，完善的业务管理制度，同时秉承公司“忠诚、包容、创新、卓越”的企业精神，为基金份额持有人利益履行基金托管职责。

（三）基金验资机构

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

六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件。

七、基金财务状况

深圳证券交易所在工银瑞信中证新能源指数分级证券投资基金认购期间未收取任何费用，其他各基金销售机构根据本基金招募说明书设定的费率收取认购费。

本基金发售后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

工银瑞信中证新能源指数分级证券投资基金截至2015年7月27日资产负债表如下：

单位：人民币元

资产	期末数	负债及持有人权益	期末数
资产：		负债：	
银行存款	18,181,082.09	应付证券清算款	1,134,819.52
清算备付金		应付赎回款	
交易保证金		应付赎回费	
应收证券清算款		应付管理人报酬	132,244.76
应收股利		应付托管费	26,448.96
应收利息	30,055.23	应付销售服务费	
应收申购款		应付交易费用	671.51
其他应收款	77,460.27	应付利息	

股票投资市值	1,070,215.00	应付收益	
其中：股票投资成本	1,142,777.00	未交税金	
债券投资市值		其他应付款	19,917.42
其中：债券投资成本		卖出回购证券款	
权证投资市值		短期借款	
其中：权证投资成本		其他负债	
配股权证		负债合计	1,314,102.17
买入返售证券	250,000,000.00	持有人权益：	
待摊费用		实收基金	268,185,414.24
其它资产		未实现利得	
		未分配收益	-140,703.82
		持有人权益合计	268,044,710.42
资产合计：	269,358,812.59	负债与持有人权益总计：	269,358,812.59

八、基金投资组合

工银瑞信中证新能源指数分级证券投资基金的投资组合如下：

(一) 截至 2015 年 7 月 27 日，基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资		
	其中：股票	1,070,215.00	0.40
2	固定收益投资		
	其中：债券		
	资产支持证券		
3	贵金属投资		
4	金融衍生品投资		
5	买入返售金融资产	250,000,000.00	92.81
	其中：买断式回购的买入返售金融资产		
6	银行存款和结算备付金合计	18,181,082.09	6.75
7	其他各项资产	107,515.50	0.04
8	合计	269,358,812.59	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。

(二) 按行业分类的股票投资组合

1、截至 2015 年7 月27日，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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	928,496.00	0.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	48,332.00	0.02
E	建筑业	8,512.00	0.00
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	55,931.00	0.02
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	28,944.00	0.01
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	1,070,215.00	0.40

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

截至2015年7月27日，本基金未持有积极投资的股票。

(三) 按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

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明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占资产净值比例
----	------	------	-------	------	---------

				(人民币元)	(%)
1	601727	上海电气	4,600	60,720.00	0.02
2	600089	特变电工	4,100	54,899.00	0.02
3	601106	中国一重	4,100	42,189.00	0.02
4	002202	金风科技	2,400	41,976.00	0.02
5	002594	比亚迪	800	40,024.00	0.01
6	600406	国电南瑞	2,300	38,111.00	0.01
7	000559	万向钱潮	1,800	31,356.00	0.01
8	600875	东方电气	1,900	30,381.00	0.01
9	000826	桑德环境	800	28,944.00	0.01
10	600021	上海电力	1,400	26,600.00	0.01

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明细

截至2015年7月27日，本基金未持有积极投资的股票。

(四) 截至2015年7月27日，按券种分类的债券投资组合

截至2015年7月27日，本基金未持有按券种分类的债券投资组合。

(五) 截至2015年7月27日，按公允价值占净值比例大小排序的前五名债券明细

截至2015年7月27日，本基金未持有债券投资组合。

(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

截至2015年7月27日，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

截至2015年7月27日，本基金未持有权证。

(八) 投资组合报告附注

1、声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查，无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

2、声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

3、其他资产构成

序号	名称	金额（元）
----	----	-------

1	存出保证金	
2	应收证券清算款	
3	应收股利	
4	应收利息	30,055.23
5	应收申购款	
6	其他应收款	77,460.27
7	待摊费用	
8	其他	
9	合计	107,515.50

4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

截至2015年7月27日，本基金未持有债券。

5、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

(1) 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

截至2015年7月27日，本基金持有的指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

(2) 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

截至2015年7月27日，本基金未持有积极投资股票。

九、重大事件揭示

本基金自合同生效至上市交易公告书公告前未发生对基金份额持有人有较大影响的重
大事件。

十、基金管理人承诺

本基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出承诺：

(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

基金托管人就本基金上市交易后履行托管人职责做出如下承诺：

(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，并在限期内，随时对通知事项进行复查，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

下列文件存放在本基金管理人和托管人的办公场所，投资者可在办公时间免费查阅；也可按工本费购买本基金合同复制件或复印件，但应以基金合同正本为准。

- (一) 中国证监会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；
- (二) 《工银瑞信中证新能源指数分级证券投资基金基金合同》；
- (三) 《工银瑞信中证新能源指数分级证券投资基金招募说明书》；
- (四) 《工银瑞信中证新能源指数分级证券投资基金托管协议》；

- (五) 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。

附件：基金合同内容摘要

一、基金合同当事人简介

(一) 基金管理人

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

法定代表人：郭特华

成立日期：2005 年 6 月 21 日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

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

存续期间：持续经营

(二) 基金托管人

名称：中国银河证券股份有限公司

住所：中国北京西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：陈有安

成立时间：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

组织形式：股份有限公司（上市）

注册资本：人民币 75.37 亿元

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

经营范围：证券经纪；证券投资咨询；与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问；证券承销与保荐；证券自营；融资融券；证券投资基金代销；为期货公司提供中间介绍业务；代销金融产品业务；基金托管。

（三）基金份额持有人

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，即成为基金份额持有人和基金合同当事人。基金份额持有人作为当事人并不以在基金合同上书面签章或签字为必要条件。

工银新能源份额、工银新能源 A 份额和工银新能源 B 份额的基金份额持有人持有的每一份基金份额按基金合同约定仅在其各自份额类别内拥有同等的权益。

二、基金合同当事人的权利及义务

（一）基金管理人的权利及义务

1、基金管理人的权利

- （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注册登记机构办理基金注册登记业务并获取《基金合同》规定的费用；
- （10）依据《基金合同》及有关法律、法规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、赎回或转换申请；

(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) 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；

(14) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券、期货经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；

(15) 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、转换等的业务规则；

(16) 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、基金管理人的义务

(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、工银新能源份额的基金份额净值、工银新能源 A 份额与工银新能源 B 份额的基金份额参考净值、基金份额折算比例，确定工银新能源份额申购、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) 按规定受理工银新能源份额申购与赎回申请，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条件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活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。

(二) 基金托管人的权利及义务

1、基金托管人的权利

- (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，为基金开设证券账户及其他投资所需账户，为基金办理证券、期货交易资金清算；
- (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、基金托管人的义务

- (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》、《托管协议》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、证券账户和投资所需其他账户，按照《基金合

同》及《托管协议》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，因审计、法律等外部专业顾问提供的情况除外；

(8) 复核基金管理人计算的基金资产净值、工银新能源份额的基金份额净值、工银新能源 A 份额与工银新能源 B 份额的基金份额参考净值、基金份额折算比例和工银新能源份额申购、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》及《托管协议》的规定进行；如果基金管理人未执行《基金合同》及《托管协议》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) 从基金管理人或其委托的登记机构处接收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》及《托管协议》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，并通知基金管理人；

(19) 因违反《基金合同》及《托管协议》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。

(三) 基金份额持有人的权利及义务

1、基金份额持有人的权利

- (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) 转让其持有的工银新能源 A 份额和工银新能源 B 份额，依法申请赎回或转让其持有的工银新能源份额；
- (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、基金服务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、基金份额持有人的义务

- (1) 认真阅读并遵守《基金合同》、招募说明书等信息披露文件；
- (2) 了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，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。

三、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成。基金份额持有人大会的审议事项应分别由工银新能源份额、工银新能源 A 份额与工银新能源 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级别内具有同等的投票权，且相同类别基金份额的同等投票权不因基金份额持有人取得基金份额的方式（场内认/申购、场外认/申购、自动分离、分拆、合并或上市交易）而有所差异。

本基金基金份额持有人大会不设立日常机构。

（一）召开事由

1、除法律法规、中国证监会和基金合同另有规定的以外，当出现或需要决定下列事由之一的，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（法律法规和中国证监会另有规定的除外）；
- （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）单独或合计持有 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（①以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同；②“单独或合计持有 10%以上（含 10%）基金份额”指单独或合计持有工银新能源份额、工银新能源 A 份额与工银新能源 B 份额各自的基金总份额 10%以上基金份额的基金份额持有人，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；
- （12）终止基金份额上市，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；
- （13）对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；
- （14）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、在不违背法律法规和基金合同的约定，以及对基金份额持有人利益无实质性不利影

响的情况下，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、基金托管费及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》规定的范围内且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下调整工银新能源份额的申购费率、赎回费率或变更收费方式；
- （4）因相应的法律法规、深圳证券交易所或注册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）在不损害已有基金份额持有人权益的情况下增加、取消或调整基金份额类别设置；
- （7）在符合有关法律法规的前提下，经中国证监会允许，基金管理人、销售机构、注册登记机构在法律法规规定的范围内且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则；
- （8）在法律法规或中国证监会允许的范围内且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下推出新业务或服务；
- （9）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。

（二）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，并自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

4、单独或合计持有 10%以上（含 10%）基金份额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 10%以上（含 10%）基金份额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 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

5、单独或合计持有 10%以上（含 10%）基金份额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 10%以上（含 10%）基金份额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。

（三）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，在指定媒介公告。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。

（四）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、通讯开会方式或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，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一（①含二分之一；②指全部有效凭证所对应的工银新能源份额、工银新能源 A 份额和工银新能源 B 份额分别占权益登记日工银新能源份额、工银新能源 A 份额和工银新能源 B 份额各自基金总份额二分之一以上，下同）。若到会者在权益登记日代表的有效的基金份额少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一，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工银新能源份额、工银新能源 A 份额和工银新能源 B 份额应不少于本基金在权益登记日工银新能源份额、工银新能源 A 份额和工银新能源 B 份额各自基金总份额的三分之一（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或大会公告载明的其他方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或大会公告载明的其他方式进行表决。

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 2 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）到指定地点对书面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书面表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取书面表决意见的，不影响表决效力；

（3）本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的工银新能源份额、工银新能源 A 份额和工银新能源 B 份额分别不小于在权益登记日工银新能源份额、工银新能源 A 份额和工银新能源 B 份额各自基金总份额的二分之一（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工银新能源份额、工银新能源 A 份额和工银新能源 B 份额小于在权益登记日工银新能源份额、工银新能源 A 份额和工银新能源 B 份额各自基金总份额的二分之一，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以上（含三分之一）工银新能源份额、工银新能源 A 份额和工银新能源 B 份额各自基金份额的基金份额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）项中直接出具书面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、受托出具书面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，并与基金注册登记机构记录相符。

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并行使表决权；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。基金份额持有人可以采用书面、网络、电话或其他方式进行表决，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

（五）议事内容与程序

1、议事内容及提案权

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。

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。

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。

(六) 表决

工银新能源份额、工银新能源 A 份额和工银新能源 B 份额的基金份额持有人持有的每一份基金份额在其份额类别内拥有同等的投票权。

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，一般决议须经参加大会的工银新能源份额、工银新能源 A 份额和工银新能源 B 份额的基金份额持有人或其代理人所持工银新能源份额、工银新能源 A 份额和工银新能源 B 份额各自类别内的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工银新能源份额、工银新能源 A 份额和工银新能源 B 份额的基金份额持有人或其代理人所持工银新能源份额、工银新能源 A 份额和工银新能源 B 份额各自类别内的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，但应当计入出具书面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。

（七）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书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

（八）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表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。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。

（九）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，基金管理人与基金托管人协商一致并提前公告后，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。

四、基金的收益与分配

（一）收益的构成

基金本期利润是指基金本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。基金本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额。

期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

（二）收益分配原则

在存续期内，本基金（包括工银新能源份额、工银新能源 A 份额、工银新能源 B 份额）不进行收益分配。

在本基金工银新能源份额、工银新能源 A 份额、工银新能源 B 份额的运作期间内，基金管理人可根据实际情况，在履行适当程序后对基金收益分配原则进行调整。

五、基金的费用与税收

（一）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。

(二) 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：

$$H=E \times 1.0\% \div \text{当年天数}$$

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，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：

$$H=E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

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：

$$H = E \times 0.02\% \div \text{当年天数}$$

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。

4、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。

（三）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。

（四）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。

（五）税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

六、基金财产的投资范围和投资限制

（一）投资范围

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。

（二）投资限制

基金投资组合比例限制

（1）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%；

（2）本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%，但标的指数成份股票及其备选成份股票不受此限；

（3）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%，但标的指数成份股票及其备选成份股票不受此限；

（4）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；本基金持有的同一权证不超过该权证的 10%；本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；

（5）本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上（含 BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

（6）本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%，中国证监会规定的特殊品种除外；本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；基金管理人管理的全部证券投资基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

(7) 本基金的基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

(8) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；

(9) 本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%；其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

(10) 本基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；

(11) 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）不低于基金资产的 90%；

(12) 本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约价值不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；

(13) 每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券；

(14) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

(15) 如果法律法规或监管机构以后允许基金投资其它金融工具时，投资比例遵从法律法规和监管机构的规定；

(16) 法律法规及中国证监会规定的其他限制。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。因证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例规定的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规或监管机构另有规定时，从其规定。

如果法律法规对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

七、基金资产净值的计算方法和公告方式

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

基金合同生效后，在开始办理工银新能源份额的申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和工银新能源份额的基金份额净值、工银新能源 A 份额与工银新能源 B 份额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工银新能源份额的基金份额净值、工银新能源 A 份额与工银新能源 B 份额的基金份额参考净值。基金管理人应当在前述最后一个市场交易日的次日，将基金资产净值以及工银新能源份额的基金份额净值、工银新能源 A 份额与工银新能源 B 份额的基金份额参考净值登载在指定媒介上。

八、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

（一）基金合同的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或本基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议须报中国证监会备案，自表决通过之日起生效，决议生效后依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

（二）基金合同的终止

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。

（三）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六个月。

(四) 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剩余财产中支付。

(五) 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，分别计算工银新能源份额、工银新能源 A 份额和工银新能源 B 份额各自的应计分配比例，并据此由工银新能源份额、工银新能源 A 份额和工银新能源 B 份额各自的基金份额持有人根据其持有的基金份额比例进行分配。

(六) 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。

(七) 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。

九、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，除非仲裁裁决另有规定，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，基金合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

《基金合同》受中国法律管辖。

十、基金合同的存放及查阅方式

《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。