新华中证环保产业指数分级证券投资基金招募说明书(更新)摘要

重要提示

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")的募集申请经中国证监会2014年5月20日证监许可【2014】 513号文核准募集。本基金合同已于2014年9月11日正式生效。

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做出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

投资有风险,投资者认购或申购本基金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,充分考虑投资人自身的风险承受能力,并对于认购(或申购)基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资人基金投资要承担相应风险,包括市场风险、管理风险、流动性风险、本基金特定风险、操作或技术风险、合规风险等。在投资人作出投资决策后,基金投资运作与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行负责。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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,也不保证基金份额持有人的最低收益。

本招募说明书(更新)所载内容截止日为2018年3月11日,有关财务数据和净值表现截止日为2017年12月31日(财务数据未经会计师事务所审计)。

基金管理人:新华基金管理股份有限公司

基金托管人:中国建设银行股份有限公司

一 、基金管理人

(一) 基金管理人概况

名称:新华基金管理股份有限公司

住所:重庆市江北区聚贤岩广场6号力帆中心2号办公楼第19层

设立日期:2004年12月9日

法定代表人:陈重

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

重庆市江北区聚贤岩广场6号力帆中心2号办公楼第19层

电话:010-68779666

传真:010-68779528

联系人:齐岩

注册资本:21,750万元人民币

股权结构:

股东名称	出资额(万元人币)	出资比例
恒泰证券股份有限公司	12,750	58.62%
新华信托股份有限公司	7,680	35.31%
杭州永原网络科技有限公司	1,320	6.07%
合 计	21,750	100%

(二)主要人员情况

1、董事会成员

陈重先生:董事长,金融学博士。历任原国家经委中国企业管理协会研究部副主任、主任;中国企业报社社长;中国企业管理科学基金会秘书长;重庆市政府副秘书长;中国企业联合会常务副理事长;享受国务院特殊津贴专家。现任新华基金管理股份有限公司董事长。

张宗友先生::董事,硕士。历任内蒙古证券有限责任公司营业部总经理、太平洋证券有限责任公司副总经理、恒泰证券有限责任公司副总经理,现任新华基金管理股份有限公司总经理。

胡三明先生:董事,博士。曾就职于中国太平洋财产保险股份有限公司、泰康资产管理有限公司、合众资产管理有限公司、中英益利资产管理公司,历任泰康资产管理有限公司资产负债管理部组合经理、合众资产权益投资部高级投资经理、中英益利资产管理公司权益投资部总经理,现任恒泰证券股份有限公司投资总监。

于芳女士:董事。历任北京市水利建设管理中心项目管理及法务专员、新时代证券有限责任公司总经理助理、副总经理。现任恒泰证券股份有限公司首席风险官。

胡波先生:独立董事,博士。历任中国人民大学财政金融学院教师、中国人民大学风险投资发展研究中心研究员、副主任、执行主任,现任中国人民大学财政金融学院副教授。

张贵龙先生:独立董事,硕士。曾任山西临汾地区教育学院教师。现任职于北京大学财务部。

宋敏女士:独立董事,硕士。历任四川省资阳市人民法院法官,中国电子系统工程总公司法务人员,北京市中济律师事务所执业律师,北京市东清律师事务所律师,现任北京市保利威律师事务所合伙人。

2、基金管理人监事会成员

杨淑飞女士:监事会主席,硕士。历任航天科工财务公司结算部经理、航天科工财务公司风险管理部经理,航天科工财务公司总会计师、总法律顾问、董秘、副总裁,华浩信联(北京)科贸有限公司财务总监,现任恒泰证券股份有限公司财务总监。

张浩先生:职工监事,硕士。历任长盛基金管理有限公司信息技术部副总监,长盛基金管理有限公司风险管理部副总监, 合众资产管理股份有限公司风险管理部总监,房宝信业(北京)投资管理有限公司总经理。现任新华基金管理股份有限公司监察稽核部总监。

别治女士:职工监事,金融学学士。十年证券从业经验,历任《每日经济新闻》、《第一财经日报》财经记者,新华基金管理有限公司媒体经理,现任新华基金管理股份有限公司总经理办公室副主任。

3、高级管理人员

陈重先生:董事长,简历同上。

张宗友先生:总经理,简历同上。

齐岩先生:督察长,学士。历任中信证券股份有限公司解放北路营业部职员、天津管理部职员、天津大港营业部综合部经理,现任新华基金管理股份有限公司督察长兼任子公司北京新华富时资产管理有限公司董事。

徐端骞先生:副总经理,学士。历任上海君创财经顾问有限公司并购部经理、上海力矩产业投资管理有限公司并购部经理、新时代证券有限责任公司投行部项目经理。现任新华基金管理股份有限公司副总经理。

晏益民先生:副总经理,学士。历任大通证券投行总部综合部经理,泰信基金机构理财部总经理,天治基金北京分公司总经理,天治基金总经理助理,新华基金管理股份有限公司总经理助理,现任新华基金管理股份有限公司副总经理。

沈健先生:副总经理,硕士。历任嘉实基金管理有限公司机构客户部高级客户经理、海富通基金管理有限公司渠道副总监、天治基金管理有限公司市场总监、纽银梅隆西部基金管理有限公司渠道销售副总监、华商基金管理有限公司渠道业务部部门总经理,现任新华基金管理股份有限公司副总经理。

崔建波先生:副总经理,硕士。历任天津中融证券投资咨询公司研究员、申银万国天津佟楼营业部投资经纪顾问部经理、海融资讯系统有限公司研究员、和讯信息科技有限公司证券研究部、理财服务部经理、北方国际信托股份有限公司资产部信托高级投资经理、新华基金管理股份有限公司总经理助理。现任新华基金管理股份有限公司副总经理兼投资总监、权益投资部总监、基金经理。

4、本基金基金经理

(1) 历任基金经理

李昱女士,管理本基金时间:2014年09月11日至2015年9月15日。

李会忠先生,管理本基金时间:2014年9月15日至2016年11月3日。

张永超先生,管理本基金时间:2016年7月20日至2017年9月1日。

(2)现任基金经理

邓岳先生:信息与信号处理专业硕士,9年证券从业经验,历任北京红色天时金融科技有限公司量化研究员,国信证券股份有限公司量化研究员,光大富尊投资有限公司量化研究员、投资经理,盈融达投资(北京)有限公司投资经理。2017年6月加入新华基金管理股份有限公司, 现任新华中证环保产业指数分级证券投资基金基金经理、新华华丰灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

5、投资管理委员会成员

主席:总经理张宗友先生;成员:副总经理兼投资总监、权益投资部总监崔建波先生、投资总监助理于泽雨先生、研究部总监张霖女士、金融工程部副总监李会忠先生、固定收益与平衡投资部总监姚秋先生、基金经理付伟先生。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

一、基金托管人情况

(一)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:田国立

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

中国建设银行成立于1954年10月,是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行,总部设在北京。本行于2005年10月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码939),于2007年9月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码601939)。

2017年6月末,本集团资产总额216,920.67亿元,较上年末增加7,283.62亿元,增幅3.47%。上半年,本集团实现利润总额1,720.93亿元,较上年同期增长1.30%;净利润较上年同期增长3.81%至1,390.09亿元,盈利水平实现平稳增长。

2016年,本集团先后获得国内外知名机构授予的100余项重要奖项。荣获《欧洲货币》"2016中国最佳银行",《环球金融》"2016中国最佳消费者银行"、"2016亚太区最佳流动性管理银行",《机构投资者》"人民币国际化服务钻石奖",《亚洲银行家》"中国最佳大型零售银行奖"及中国银行业协会"年度最具社会责任金融机构奖"。本集团在英国《银行家》2016年"世界银行1000强排名"中,以一级资本总额继续位列全球第2;在美国《财富》2016年世界500强排名第22位。

中国建设银行总行设资产托管业务部,下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII托管处、养老金托管处、清算处、核算处、跨境托管运营处、监督稽核处等10个职能处室,在上海设有投资托管服务上海备份中心,共有员工220余人。自2007年起,托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计,并已经成为常规化的内控工作手段。

(二)主要人员情况

纪伟,资产托管业务部总经理,曾先后在中国建设银行南通分行、总行计划财务部、信贷经营部任职,并在总行公司业务部、投资托管业务部、授信审批部担任领导职务。其拥有八年托管从业经历,熟悉各项托管业务,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

龚毅,资产托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行北京市分行国际部、营业部并担任副行长,长期从事信贷业务和集团客户业务等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

郑绍平,资产托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行总行投资部、委托代理部、战略客户部,长期从事客户服务、信贷业务管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲,资产托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行总行会计部,长期从事托管业务管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

原玎,资产托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行总行国际业务部,长期从事海外机构及海外业务管理、境内外汇业务管理、国外金融机构客户营销拓展等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

(三)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、(R)QFII、(R)QDII、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2017年二季度末,中国建设银行已托管759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。中国建设银行连续11年获得《全球托管人》、《财资》、《环球金融》"中国最佳托管银行"、"中国最佳次托管银行"、"最佳托管专家——QFII"等奖项,并在2016年被《环球金融》评为中国市场唯一一家"最佳托管银行"。

二、基金托管人的内部控制制度

(一)内部控制目标

作为基金托管人,中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和本行内有关管理规定,守法经营、规范运作、严格监察,确保业务的稳健运行,保证基金财产的安全完整,确保有关信息的真实、准确、完整、及时,保护基金份额持有人的合法权益。

(二)内部控制组织结构

中国建设银行设有风险与内控管理委员会, 负责全行风险管理与内部控制工作,对托管业务风险控制工作进行检查指导。资产托管业务部配备了专职内控合规人员负责托管业务的内控合规工作,具有独立行使内控合规工作职权和能力。

(三)内部控制制度及措施

资产托管业务部具备系统、完善的制度控制体系,建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程,可以保证托管业务的规范操作和顺利进行;业务人员具备从业资格;业务管理严格实行复核、审核、检查制度,授权工作实行集中控制,业务印章按规程保管、存放、使用,账户资料严格保管,制约机制严格有效;业务操作区专门设置,封闭管理,实施音像监控;业务信息由专职信息披露人负责,防止泄密;业务实现自动化操作,防止人为事故的发生,技术系统完整、独立。

三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

(一)监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定,监督所托管基金的投资运作。利用自行开发的"新一代托管应用监督子系统",严格按照现行法律法规以及基金合同规定,对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中,对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

(二)监督流程

1、每工作日按时通过新一代托管应用监督子系统,对各基金投资运作比例控制等情况进行监控,如发现投资异常情况,向基金管理人进行风险提示,与基金管理人进行情况核实,督促其纠正,如有重大异常事项及时报告中国证监会。

2、收到基金管理人的划款指令后,对指令要素等内容进行核查。

3、根据基金投资运作监督情况,定期编写基金投资运作监督报告,对各基金投资运作的合法合规性和投资独立性等方面进行评价,报送中国证监会。

4、通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易,电话或书面要求基金管理人进行解释或举证,并及时报告中国证监会。

三、相关服务机构

(一)基金份额发售机构

1、场外发售机构

(1)直销机构:

新华基金管理股份有限公司北京直销中心

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

法定代表人:陈重

联系人:陈静

电话:(010)68730999

传真:(010)68731199

客服电话:400-819-8866

网址:www.ncfund.com.cn

电子直销:新华基金网上交易平台

网址:https://trade.ncfund.com.cn

(2)其他销售机构

1) 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:田国立

联系人:张静

客服电话:95533

网址:www.ccb.com

2)光大证券股份有限公司

住所:上海市静安区新闸路1508号

法定代表人:周健男

联系人:刘晨

客服电话:95525

网址:www.ebscn.com

3)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

客服电话: 95521

网址:www.gtja.com

4)海通证券股份有限公司

住所:上海市广东路698号

法定代表人:周杰

联系人:李笑鸣

客服电话:95553

网址:www.htsec.com

5)恒泰证券股份有限公司

住所:内蒙古呼和浩特赛罕区敕勒川大街东方君座D座

法定代表人:庞介民

联系人:熊丽

客服电话:400-196-6188

网址:www.cnht.com.cn

6) 华西证券股份有限公司

注册地址:四川省成都市青羊区陕西街239号

办公地址:四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦

法定代表人:杨炯洋

联系人:张曼

客服电话:95584

网址:www.hx168.com.cn

7) 中泰证券股份有限公司

住所:济南市市中区经七路86号

法定代表人:李玮

联系人:吴阳

客服电话:95538

网址:www.qlzq.com.cn

8) 新时代证券股份有限公司

住所:北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501

法定代表人:叶顺德

联系人:田芳芳

客服电话:400-698-9898

公司网址:www.xsdzq.cn

9) 中国银河证券股份有限公司

住所:北京市西城区金融大街35号2-6层

法定代表人:陈共炎

联系人:邓颜

客服电话:400-888-8888

网址:www.chinastock.com.cn

10) 中信建投证券股份有限公司

注册地址:北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址:北京市朝阳门内大街188号

法定代表人:王常青

联系人:权唐

客服电话:95587

网站:www.csc108.com

11) 中信证券(山东)有限责任公司

住所:青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼第20层

法定代表人:姜晓林

客服电话:95548

联系人:吴忠超

公司网址:www.citicssd.com

12) 中信证券股份有限公司

注册地址:广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座

办公地址:北京朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦

法定代表人:张佑君

联系人:侯艳红

客服电话:95548

网址:www.cs.ecitic.com

13)华龙证券股份有限公司

住所:兰州市城关区东岗西路638号财富中心

法定代表人:李晓安

联系人:李昕田

客服电话:400-689-8888、0931-96668

网址:www.hlzqgs.com

14) 国信证券股份有限公司

住所:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16-26层

法定代表人:何如

联系人:李颖

客服电话:95536

网址:www.guosen.com.cn

15) 平安证券股份有限公司

住所:深圳市福田中心区金田路4036号荣超大厦16-20层

法定代表人:刘世安

联系人:石静武

客服电话:95511-8

网址:www.pingan.com

16)东海证券股份有限公司

注册地址:江苏省常州延陵西路23号投资广场18层

办公地址:上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦

法定代表人:赵俊

电话:021-20333333

联系人:王一彦

客服电话:95531;400-8888-588

网址:www.longone.com.cn

17)华泰证券股份有限公司

住所:南京市江东中路228号

法定代表人:周易

联系人:庞晓芸

客服电话:95597

网址:www.htsc.com.cn

18)华安证券股份有限公司

住所:安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号

法定代表人:章宏韬

联系人:甘霖

客服电话:96518(安徽)400-80-96518(全国)

网址:www.hazq.com

19)湘财证券股份有限公司

住所: 长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼

法定代表人:林俊波

客服电话:021-68865020

联系人:杜颖灏

网址:www.xcsc.com

20)东吴证券股份有限公司

注册地址:苏州工业园区星阳街 5 号

办公地址:苏州工业园区星阳街5号

法定代表人:范力

客户服务电话:4008601555

网址:www.dwzq.com.cn

21)东北证券股份有限公司

住所:长春市生态大街6666号

法定代表人:李福春

联系人:安岩岩

客服电话:400-600-0686

网址:www.nesc.cn

22)申万宏源证券有限公司

住所:上海市徐汇区长乐路989号45层

法定代表人:李梅

联系人:钱达琛

客服电话:95523或4008895523

23)招商证券股份有限公司

住所:深圳市福田区益田路江苏大厦38-45层

法定代表人:霍达

联系人:林生迎

客服电话: 95565

网站: www.newone.com.cn

24)北京肯特瑞财富投资管理有限公司

注册地址:北京市海淀区中关村东路66号1号楼22层2603-06

办公地址:北京市大兴区亦庄经济开发区科创十一街十八号院京东集团总部

法定代表人:江卉

客服电话: 个人业务:95118 企业业务:400-088-8816

网址:http://fund.jd.com

25)北京虹点基金销售有限公司

注册地址:北京市朝阳区工人体育场北路甲2号裙房2层222单元

办公地址:北京市朝阳区工人体育场北路甲2号裙房2层222单元

法定代表人:胡伟

联系人:陈铭洲

座机:010-65951887

客服电话:400-618-0707

26)北京增财基金销售有限公司

注册地址:北京市西城区南礼士路66号1号楼12层1208号

办公地址: 北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208-1209室

法定代表人: 罗细安

联系人: 张蕾

客服电话:400-001-8811

公司网址:www.zcvc.com.cn

27)北京创金启富投资管理有限公司

注册地址:北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A

办公地址:北京市西城区白纸坊东街2号经济日报社A座综合楼712号

法定代表人:梁蓉

联系人:李婷婷

客服电话:400-6262-818

公司网址:www.5irich.com

28)大泰金石基金销售有限公司

办公地址:上海市浦东新区峨山路505号东方纯一大厦15楼

注册地址:江苏省南京市建邺区江东中路222号南京奥体中心现代五项馆2105室

法定代表人:袁顾明

客服热线:400-928-2266

公司网址: www.dtfunds.com

29)上海好买基金销售有限公司

注册地址:上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号

办公地址:上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦9楼

法定代表人:杨文斌

联系人:胡凯隽

客服电话:400-700-9665

公司网址:www.howbuy.com

30)和讯信息科技有限公司

注册地址:北京市朝阳区朝外大街22号1002室

办公地址:北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦10层

法定代表人:王莉

客服电话: 400-920-0022

联系人:刘洋

公司网址:licaike.hexun.com

31)北京恒天明泽基金销售有限公司

注册地址:北京市经济技术开发区宏达北路10号五层5122室

办公地址: 北京市朝阳区东三环中路20号乐成中心A座23层

法定代表人:周斌

联系人:张晔

客服电话:4007-868-868

公司网站:www.chtfund.com

32)北京汇成基金销售有限公司

注册地址:北京市海淀区中关村大街11号11层1108

办公地址:北京市海淀区中关村大街11号11层1108

法定代表人:王伟刚

客服电话:400-619-9059

网址:www.fundzone.cn

33)上海汇付基金销售有限公司

注册地址:上海市黄浦区中山南路100号19层

办公地址:上海市宜山路700号普天信息产业园2期C5栋2楼

法定代表人:金佶

汇付网站:https://tty.chinapnr.com

汇付客服热线:400-821-3999

34)上海证券有限责任公司

住所: 上海市黄浦区四川中路213号7楼

法定代表人:李俊杰

联系人:许曼华

客服电话:021-962518

网址:www.962518.com

35)浙江金观诚财富管理有限公司

注册地址:浙江省杭州市拱墅区登云路45号(锦昌大厦)1幢10楼1001室

办公地址:杭州市拱墅区登云路45号(锦昌大厦)一楼金观诚财富

法定代表人:蒋雪琦

联系人:孙成岩

客服电话:400-068-0058

网址:www.jincheng-fund.com

36)上海凯石财富基金销售有限公司

注册地址:上海市黄浦区西藏南路765号602-115室

办公地址:上海市黄浦区延安东路1号凯石大厦4楼

法定代表人: 陈继武

联系人:葛佳蕊

客服电话:4000-178-000

网址:www.lingxianfund.com

37)上海利得基金销售有限公司

注册地址:上海市宝山区蕰川路5475号1033室

办公地址:上海浦东新区峨山路91弄61号10号楼12楼

法定代表人:李兴春

联系人:曹怡晨

客服电话:400-067-6266

网址:http://a.leadfund.com.cn/

38)上海联泰资产管理有限公司

注册地址:中国(上海)自由贸易试验区富特北路277号3层310室

办公地址:上海市长宁区福泉北路 518 号 8 座 3 层

法定代表人:燕斌

联系人:陈东

客服电话:4000-466-788

公司网址:www.66zichan.com

39)上海陆金所基金销售有限公司

注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元

办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼

法定代表人:胡学勤

联系人:何雪

客服电话:4008219031

公司网站:www.lufunds.com

40)北京钱景基金销售有限公司

注册地址:北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012

办公地址:北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012

法定代表人:赵荣春

客服电话: 400-893-6885

联系人:盛海娟

公司网站:www.niuji.net

41)上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址:上海市浦东新区高翔路526号2幢220室

办公地址:上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层

法定代表人:张跃伟

联系人:唐诗洋

客服电话:400-820-2899

公司网站: www.erichfund.com

42)上海基煜基金销售有限公司

注册地址:上海市崇明县长兴镇潘园公里1800号2号楼6153室(上海泰和经 济发展区)

办公地址:上海市昆明路518号北美广场A1002-A1003室

法定代表人:王翔

联系人:蓝杰

客服电话:400-820-5369

公司网站:www.jiyufund.com.cn

43)深圳众禄基金销售有限公司

注册地址:深圳市罗湖区笋岗街道梨园路物资控股置地大厦8楼801

办公地址:深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8 楼

法定代表人:薛峰

客服电话:4006-788-887

联系人:童彩平

公司网址:www.zlfund.cn,www.jjmmw.com

44)蚂蚁(杭州)基金销售有限公司

注册地址:杭州市余杭区仓前街文一西路1218号1栋202室

办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道3588号12楼

法定代表人:陈柏青

联系人:韩爱彬

客服电话:4000-766-123

公司网站:www.fund123.cn

45)上海天天基金销售有限公司

注册地址:上海市徐汇区龙田路190 号2 号楼2 层

办公地址: 上海市徐汇区龙田路195 号3C 座7 楼

法定代表人:其实

客服电话:400-1818-188

联系人:丁姗姗

公司网址:www.1234567.com.cn

46)浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址:浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903室

办公地址:浙江省杭州市翠柏路7号杭州电子商务产业园2号楼2楼

法定代表人:凌顺平

联系人:林海明

客服电话:4008-773-772

公司网站:www.5ifund.com

47)深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址:深圳市福田区福田街道民田路178号华融大厦27层2704

办公地址:北京市西城区金融大街35号 国际企业大厦C座9层

法定代表人:马勇

联系人:张燕

客服电话:400-166-1188

网址:http://www.new-rand.cn

48)一路财富(北京)信息科技有限公司

注册地址:北京市西城区阜成门外大街2号1幢A2208室

办公地址:北京市西城区阜成门大街2 号万通新世界广场A 座2208

法定代表人:吴雪秀

联系人:刘栋栋

客服电话:400-001-1566

网址:www.yilucaifu.com

49)宜信普泽投资顾问(北京)有限公司

注册地址:北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809

办公地址:北京市朝阳区建国路88号SOHO现代城C座180

法定代表人:戎兵

联系人:刘梦轩

客服电话:400-6099-200

公司网站:www.yixinfund.com

50)珠海盈米财富管理有限公司

注册地址:珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491

办公地址:广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼B1201-1203

法定代表人:肖雯

联系人:钟琛

客服电话:020-89629066

公司网址:www.yingmi.cn

51)北京展恒基金销售股份有限公司

注册地址:北京市顺义区后沙峪镇安富街6号

办公地址: 北京市朝阳区安苑路15-1号邮电新闻大厦2层

法定代表人: 闫振杰

客服电话: 400-8188-000

联系人:马林

公司网站:www.myfund.com

52)中信期货有限公司

住所: 广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场 (二期) 北座13层1301-1305室、14层

法定代表人:张皓

联系人:洪诚

客服电话:400-990-8826

网址: www.citicsf.com

53)中证金牛(北京)投资咨询有限公司

注册地址:北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室

办公地址:北京市宣武门外大街甲一号新华社第三工作区A座5层

法定代表人:钱昊旻

联系人:仲甜甜

客服电话:4008-909-998

网址:www.jnlc.com

54)众升财富(北京)基金销售有限公司

注册地址:北京市朝阳区望京东园四区13号楼A座9层908室

办公地址:北京市朝阳区望京浦项中心A座9层04-08

法定代表人:李招娣

客服电话: 400-876-9988

联系人:李艳

公司网站:www.zscffund.com

55)奕丰金融服务(深圳)有限公司

注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A 栋 201 室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)

办公地址:深圳市南山区海德三道航天科技广场A座17楼1704室 法定代表人:TEO WEE HOWE

联系人:项晶晶

客服电话:400-684-0500

网址:www.ifastps.com.cn

56)武汉市伯嘉基金销售有限公司

注册地址:武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际SOHO城(一期)第7幢23层1号、4号

办公地址:武汉市泛海国际SOHO城7栋2301、2304

法定代表人:陶捷

客服电话:400-027-9899

网址: www.buyfunds.cn

57)泰诚财富基金销售(大连)有限公司

注册地址:辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号

办公地址:辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号

法定代表人:林卓

联系人:李晓涵

客服电话:400-0411-001

公司网址:www.haojiyoujijin.com/www.taichengcaifu.com

58)嘉实财富管理有限公司

注册地址: 上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心办公楼二期46层4609-10单元

办公地址:北京市朝阳区建国路91号金地中心A座6层

法定代表人:赵学军

联系人:余永键

客户服务电话:400-021-8850

网址:www.harvestwm.cn

2、场内发售机构

场内销售机构为具有基金代销业务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。

3、基金管理人可根据情况变更或增减销售机构,并予以公告。

(二)基金注册登记机构

名称:中国证券登记结算有限责任公司

住所:北京市西城区太平桥大街17号

办公地址:北京市西城区太平桥大街17号

法定代表人:周明

联系人:朱立元

电话:(010)59378839

传真:(010)59378907

(三)律师事务所与经办律师

名称:上海市通力律师事务所

注册地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼

办公地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼

联系人:安冬

电话:(021)31358666

传真:(021) 31358600

经办律师:安冬、陆奇

(四)会计师事务所与经办注册会计师

会计师事务所: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:010-88095588

传真:010—88091199

经办注册会计师:张伟、胡慰

四、基金的名称

本基金名称:新华中证环保产业指数分级证券投资基金。

五、基金的类型

基金类型:契约型开放式。

六 、基金的投资目标

本基金采用被动式指数化投资方法,通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段,以实现对标的指数的有效跟踪。在正常市场情况下,力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪误差不超过0.35%,年跟踪误差不超过4%。

七、基金的投资方向

本基金可投资于具有良好流动性的金融工具,包括标的指数成份股及备选成份股等股票(包括中小板、创业板以及其它经中国证监会核准上市的股票)、债券、权证及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

此外,如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为:本基金股票投资占基金资产的比例范围为90—95%,其中投资于标的指数成份股及备选成份股的组合比例不低于非现金基金资产的80%。现金或者到期日在1年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

八、基金的投资策略

本基金按照成份股在中证环保产业指数中的基准权重构建指数化投资组合,原则上采用完全复制法,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时, 基金管理人会对实际投资组合进行适当调整,以便实现对跟踪误差的有效控制。

1、资产配置策略

本基金股票投资占基金资产的比例范围为90—95%,其中投资于标的指数成份股及备选成份股的组合比例不低于非现金基金资产的80%。现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等) 或者到期日在1年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

为进一步降低投资组合的跟踪误差,基金管理人将综合考虑股票市场状况以及基金运作的资金需求等因素,在法律法规和基金合同规定的范围内,进行科学的现金需求预测,尽可能保持现金资产合理比重,防止大量现金拖累导致跟踪误差的加大。

2、股票投资策略

(1)投资组合的构建

本基金采用完全复制方法构建股票投资组合,基金资产按照中证环保产业指数的成份股构成及其基准权重进行投资以拟合、跟踪标的指数的业绩表现。

在建仓期间,本基金将依据对市场整体以及成份股运行情况的全面分析,结合基金经理经验判断,采取逐步建仓策略,按照中证环保产业指数各成份股的基准权重对其逐步买入,在确保跟踪误差最小化的基础上,降低由于买入成本上升所带来的影响。

(2)投资组合的调整

在基金的日常运作中,出现:① 基金申购、赎回变动;②标的指数成份股定期或不定期调整;③标的指数成份股的配股、增发及分红;④标的指数成份股停牌或流动性严重不足;⑤法律法规及基金合同中对成份股投资比例限制等情况时,容易导致投资组合与标的指数的偏离,因此本基金将适时调整投资组合,对跟踪误差进行有效控制。

从组合调整的频率上来划分,主要可分为定期调整和不定期调整:

1)定期调整

根据中证环保产业指数的调整规则, 该指数的成份股原则上每半年调整一次,一般为每年的1月初和7月初实施调整,调整方案提前两周公布。在指数定期调整方案公布之后,基金管理人将根据调整后的成份股及权重状况,结合对市场行情的分析判断,适时对现有组合的构成进行相应调整。同时考虑冲击成本对组合跟踪误差的影响,样本股调整时本基金采用逐步调整的方式进行。

2)不定期调整

a.基金管理人将依据对市场行情的分析研究,判断基金申购、赎回的未来变化趋势,并据此进行投资组合的相应调整,以减少现金流对跟踪误差的冲击,从而有效跟踪标的指数。

b.当标的指数成份股出现临时调整时,基金管理人将密切关注相关调整公告,及时进行投资组合的调整,以更好地拟合标的指数。

c.当标的指数成份股出现配股、增发及分红等情形导致权重发生变化时,基金管理人将积极跟踪成份股的权重变化,实时调整投资组合各成份股头寸。

d.当标的指数成份股的投资比例受到法律法规及基金合同的限制,或由于停牌、流动性严重不足造成投资组合无法按照基准权重进行配置时,基金管理人将依据行业基本面相似性、历史收益率高度相关性以及流动性充足性等标准,选取替代股票或组票组合进行投资,尽量降低由此产生的跟踪误差。

(3)跟踪误差管理

基金管理人通过设定阈值的方式对投资组合跟踪误差进行日常监控。当跟踪误差超过0.3%时,基金管理人将对跟踪误差进行归因分析,从申购\赎回现金流冲击、成份股调整、成份股替代、交易成本等方面综合测算,判断形成跟踪误差的主要来源,采取有针对性的措施防止跟踪误差的进一步扩大。

3、现金头寸管理

一方面,为应对基金的日常赎回、计提管理费和托管费等相关费用、支付交易成本、参与上市公司配股及增发等行为,以及满足法律法规和基金合同的相关规定,基金应持有必要的现金头寸。而另一方面,过多的现金留存将形成现金拖累,影响投资组合对标的指数的有效跟踪。

因此,基金管理人将通过科学的现金流预判、成份股流动性的有效分析以及现金资产的收益性管理等方面,进行积极的现金头寸管理,以减少现金拖累带来的跟踪误差。

4、债券投资策略

本基金债券投资主要基于流动性管理的需要, 在满足跟踪误差最小化的前提下,主要选择信用等级高、剩余期限短以及流动性充裕的到期日在一年期以内的政府债券进行投资。

5、投资管理程序

(1)决策和交易机制:本基金实行投资管理委员会下的基金经理负责制。投资管理委员会的主要职责是制定基金投资的整体策略和原则,审定基金定期投资报告及决定基金禁止的投资事项等。基金经理主要负责投资组合的构建、调整和日常管理等工作。中央交易室负责资产运作的一线监控,并保证确保交易指令在合法、合规的前提下得到执行。

(2)组合构建:基金经理依据跟踪指数成份股或备选成份股的权重占比、停复牌情况以及每日基金申购赎回的资金情况,在追求跟踪误差最小化的目标下,决定交易的数量和时机。

(3)交易操作和执行:中央交易室依据基金经理指令,制定交易策略,通过组合交易系统执行指数投资组合的交易。中央交易室确保投资指令处于合法、合规的执行状态,对交易过程中出现的任何情况,负有监控、处置的职责。中央交易室确保将无法自行处置并可能影响指令执行的交易状况和市场变化向基金经理、投资总监及时反馈。

(4)投资组合风险分析:数量分析师对指数投资的偏差风险和流动性风险进行每日跟踪测算,并提供数量风险分析报告。研究部行业研究员对基准指数成份股中基本面变化、流动性变化等企业情况提供及时的风险分析报告。

(5) 投资管理委员会在确保基金持有人利益的前提下有权根据环境变化和实际需要调整上述投资管理程序。

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:95%×中证环保产业指数收益率 +5%×商业银行活期存款利率(税后)。

由于本基金的投资标的为中证环保产业指数,且本基金现金或者到期日在一年之内的政府债券不低于基金资产净值的 5%, 因此本基金将业绩比较基准定为中证环保产业指数收益率+5%×商业银行活期存款利率(税后)。

随着法律法规和市场环境发生变化,如果上述业绩比较基准不适用本基金、或者本基金业绩比较基准中所使用的指数暂停或终止发布,或者推出更权威的能够表征本基金风险收益特征的指数,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,根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整。若标的指数、业绩比较基准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业绩比较基准召开基金份额持有人大会,并报中国证监会备案。若业绩比较基准变更对基金投资无实质性影响(包括但不限于标的指数供应商变更、指数更名等),本基金管理人可以在取得基金托管人同意后变更业绩比较基准,不需要召集基金份额持有人大会,但需报中国证监会备案并及时公告。

十、基金的风险收益特征

本基金是股票型基金,具有较高预期收益、较高预期风险的特征。预期收益和预期风险高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。同时本基金为指数基金,通过跟踪标的指数表现,具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。

从本基金的基金份额来看,新华环保A份额为稳健收益类份额,具有低预期风险且预期收益相对较低的特征;新华环保B份额为积极收益类份额,具有高预期风险且预期收益相对较高的特征。

十一、基金的投资组合报告

本基金管理人的董事会及董事保证所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,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。

本基金的托管人——中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至2017年12月31日。

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	185,832,389.54	94.53
	其中:股票	185,832,389.54	94.53
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	-	-
	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	10,714,777.88	5.45
7	其他各项资产	31,943.62	0.02
8	合计	196,579,111.04	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

报告期末,本基金未持有积极投资的股票。

(1)积极投资按行业分类的股票投资组合

报告期末,本基金未持有积极投资的股票。

(2)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	1,898,899.00	0.97
B	采矿业	-	-
C	制造业	116,405,333.15	59.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	29,686,422.82	15.18
E	建筑业	13,344,392.02	6.82
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	5,460,579.91	2.79
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	17,258,172.64	8.82
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	1,778,590.00	0.91
	合计	185,832,389.54	95.00

3、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) 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	002366	台海核电	89,110	2,356,959.50	1.20
2	300237	美晨生态	130,530	2,175,935.10	1.11
3	002341	新纶科技	77,200	2,123,000.00	1.09
4	002080	中材科技	79,807	2,102,914.45	1.07
5	002202	金风科技	111,171	2,095,573.35	1.07
6	300274	阳光电源	110,962	2,082,756.74	1.06
7	300203	聚光科技	58,210	2,069,365.50	1.06
8	600388	龙净环保	118,556	2,051,018.80	1.05
9	600116	三峡水利	229,977	2,046,795.30	1.05
10	002573	清新环境	89,904	2,043,517.92	1.04

(2) 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

报告期末,本基金未持有积极投资的股票。

4、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。

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

报告期末,本基金未持有债券。

6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

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

报告期末,本基金未持有贵金属。

8、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。

9、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

本基金本报告期末未持有股指期货。

(2)本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末尚无股指期货投资政策。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(1)本期国债期货投资政策

本基金本报告期末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

本基金本报告期末未持有国债期货。

(3)本期国债期货投资评价

本报告期末本基金无国债期货投资。

11、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,本基金投资的前十名股票没有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	14,434.38
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,164.60
5	应收申购款	15,344.64
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	31,943.62

(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)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

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	002366	台海核电	2,356,959.50	1.20	重大资产重组,停牌

2)期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末,本基金未持有积极投资的股票。

十二 、基金的业绩

本基金成立以来的业绩如下:

(一) 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

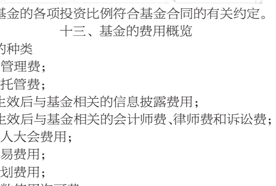
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2014.9.11-2014.12.31	5.40%	1.35%	6.64%	1.45%	-1.24%	-0.10%
2015.1.1-2015.12.31	35.97%	3.07%	37.84%	2.71%	-1.87%	0.36%
2016.1.1-2016.12.31	-16.05%	1.88%	-16.18%	1.81%	0.13%	0.07%
2017.1.1-2017.12.31	-2.03%	0.93%	-0.91%	0.93%	-1.12%	0.00%
自基金成立至今 (2014.9.11-2017.12.31)	17.87%	2.08%	22.08%	1.91%	-4.21%	0.17%

(二)自基金合同生效以来基金累计份额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

新华中证环保产业指数分级证券投资基金

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2014年9月11日至2017年12月31日)



注:报告期内本基金的各项投资比例符合基金合同的有关约定。

十三、基金的费用概览

(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、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;

4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费;

5、基金份额持有人大会费用;

6、基金的证券交易费用;

7、基金的银行汇划费用;

8、基金的标的指数使用许可费;

9、基金上市费用;

10、按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

(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

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.0%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×1.0%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提,按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。费用自动扣划后,基金管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.22%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.22%÷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,按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。费用自动扣划后,基金管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。

3、基金的标的指数使用许可费

本基金作为指数基金,需根据与指数所有人中证指数有限公司签署的指数许可使用协议的约定向中证指数有限公司支付标的指数许可使用费。如上述指数许可使用协议约定的费率发生变更,本条下的标的指数许可使用费将相应变更,基金管理人将在更新的招募说明书或公告中予以披露。

通常情况下, 标的指数许可使用费按前一日基金资产净值的 0.02%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×年费率/当年天数

H 为每日应付的标的指数许可使用费,

E 为前一日的基金资产净值

标的指数许可使用费的收取下限为每季度人民币5万元(大写:伍万元整)。计费期间不足一季度的,根据实际天数按比例计算,该季度标的指数许可使用费收取下限的计算方法如下:标的指数许可使用费的收取下限=5万元 * 本基金在本季度的实际运作天数/所在季度的实际天数

标的指数许可使用费从基金合同生效日开始每日计算,逐日累计。标的指数许可使用费的支付方式为每季支付一次,自基金合同生效日起,由基金管理人向基金托管人发送指数使用费划付指令,经基金托管人复核后,于每年 1 月、4 月、7 月、10 月的前十(10)个工作日前从基金财产中一次性支付给中证指数有限公司上一季度的标的指数许可使用费。

上述"一、基金费用的种类中第3-7、9、10项费用",根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

(三)不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

1、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;

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;

3、《基金合同》生效前的相关费用;

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

(四)基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

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》、《销售方法》、《信息披露办法》及其他有关法律法规的要求,对本基金管理人于2017年10月25日刊登的本基金招募说明书(《新华中证环保产业指数分级证券投资基金招募说明书(更新)》)进行了更新,主要更新的内容如下:

1、在"重要提示"中,更新了招募说明书内容的截止日期及有关财务数据的截止日期。

2、在"三、基金管理人"中,对基金管理人概况和主要人员情况进行了更新。

3、在"四、基金托管人"中,对基金托管人的信息进行了更新。

4、在"五、相关服务机构"中,更新了代销机构的相关信息。

5、在"十三、基金的投资"中,更新了本基金投资组合报告的内容,数据截止时间为2017年12月31日。

6、更新了"十四、基金的业绩"数据,数据截止时间为2017年12月31日。

7、在"一、前言"、"二、释义"、"十、新华环保份额的申购与赎回"、"十三、基金的投资"、"十六、基金资产的估值"、"二十一、基金的信息披露"、"二十二、风险揭示"部分中,根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》更新了相关内容。

8、在"二十七、其他应披露事项"中,披露了自2017年9月12日至2018年3月11日期间本基金的公告信息:

1)本基金管理人、托管人目前无重大诉讼事项。

2)2017年9月12日 关于旗下部分基金增加武汉市伯嘉基金销售有限公司为销售机构并参加申购费率优惠活动的公告

3)2017年10月14日 新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在武汉市伯嘉基金销售有限公司开通定期定额投资业务、基金转换业务的公告

4)2017年10月25日 新华中证环保产业指数分级证券投资基金招募说明书(更新)

5)2017年10月26日新华中证环保产业指数分级证券投资基金2017年第3季度报告

6)2017年11月23日 关于旗下基金增加天天基金销售有限公司为销售机构并参加申购费率优惠活动的公告

7)2017年12月22日 关于旗下基金调整流通受限股票估值方法的公告

8)2017年12月27日 关于新华中证环保产业指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务期间暂停及恢复申购、赎回、定期定额投资业务、转托管、配对转换业务的公告

9)2017年12月27日 关于新华中证环保产业指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务的公告

10)2017年12月30日 新华基金管理股份有限公司关于旗下基金2017年年度资产净值的公告

11)2017年12月30日 新华基金管理股份有限公司旗下产品实施增值税政策的公告

12)2018年1月3日 关于新华中证环保产业指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务期间新华环保A份额停复牌的公告

13)2018年1月4日 关于新华环保A份额定期份额折算后次日前收盘价调整的公告

14)2018年1月4日 关于新华中证环保产业指数分级证券投资基金定期份额折算结果及恢复交易的公告

15)2018年1月4日 关于新华中证环保产业指数分级证券投资基金之新华环保A份额约定年收益率调整的公告

16)2018年1月6日 关于旗下部分基金增加泰诚财富基金销售(大连)有限公司为销售机构并开通基金定投及参加费率优惠活动的公告

17)2018年1月20日新华中证环保产业指数分级证券投资基金2017年第4季度报告

18)2018年1月30日 新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在北京展恒基金销售股份有限公司开展费率优惠活动的公告

新华基金管理股份有限公司

二○一八年四月二十四日