

# 招商上证消费 80 交易型开放式指数 证券投资基金联接基金 更新的招募说明书摘要

(二零一三年第一号)

招商上证消费80交易型开放式指数证券投资基金联接基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会2010年10月8日《关于核准上证消费80交易型开放式指数证券投资基金及联接基金募集的批复》（证监许可〔2010〕1360号文）核准公开募集。本基金的基金合同于2010年12月8日正式生效。本基金为指数型开放式。

## 重要提示

投资有风险，投资人认购（或申购）本基金时应认真阅读本招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本招募说明书摘要根据本基金的基金合同和招募说明书编写，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。

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。

本更新招募说明书所载内容截止日为 2012 年 12 月 8 日，有关财务和业绩表现数据截止日为 2012 年 9 月 30 日，财务和业绩表现数据未经审计。

## 一、基金管理人

### （一）基金管理人概况

**名称：**招商基金管理有限公司

**住所：**深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 28 楼

**设立日期：**2002 年 12 月 27 日

**法定代表人：**马蔚华

**办公地址：**深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 28 楼

**电话：**(0755) 83196351

**传真：**(0755) 83076974

**联系人：**曾倩

**注册资本：**人民币 2.1 亿元

**股权结构和公司沿革：**

招商基金管理有限公司于 2002 年 12 月 27 日经中国证监会证监基金字[2002]100 号文批准设立，是中国第一家中外合资基金管理公司。公司由招商证券股份有限公司、ING Asset Management B.V. (荷兰投资)、中国电力财务有限公司、中国华能财务有限责任公司、中远财务有限责任公司共同投资组建。经公司股东会通过以及中国证监会批准，公司的注册资本金已经由人民币一亿元 (RMB 100, 000, 000 元) 增加为人民币二亿一千万元 (RMB 210, 000, 000 元)。2007 年 5 月 22 日，经公司股东会通过并由中国证监会批复同意，招商银行股份有限公司受让中国电力财务有限公司、中国华能财务有限责任公司、中远财务有限责任公司及招商证券股份有限公司分别持有的公司 10%、10%、10% 及 3.4% 的股权；公司外资股东 ING Asset Management B.V. (荷兰投资) 受让招商证券股份有限公司持有的公司 3.3% 的股权。目前招商基金管理有限公司的股东股权结构为：招商银行股份有限公司持有公司全部股权的 33.4%，招商证券股份有限公司持有公司全部股权的 33.3%，ING Asset Management B.V. (荷兰投资) 持有公司全部股权的 33.3%。

公司主要中方股东招商银行成立于 1987 年 4 月 8 日，总行设在深圳，业务以中国市场为主。招商银行于 2002 年 4 月 9 日在上海证券交易所上市 (股票代码：600036)。2006 年 9 月 22 日，招商银行在香港联合交易所上市 (股份代号：3968)。目前，招商银行注册资本为人民币 215.77 亿元，总资产超过人民币两万亿元。

招商证券股份有限公司是百年招商局旗下金融企业，经过多年创业发展，已成为拥有证券市场业务全牌照的一流券商。2009 年 11 月，招商证券在上海证券交易所上市 (代码 600999)。

公司外方股东 ING Asset Management B.V. (荷兰投资) 是 ING 集团的专门从事资产管理业务的全资子公司。ING 集团是全球最大的多元化金融集团之一，投资业务遍及 60 多个国家。

公司本着“诚信、融合、创新、卓越”的经营理念，力争成为客户推崇、股东满意、员工热爱，并具有国际竞争力的专业化的资产管理公司。

## （二） 主要人员情况

### 1、基金管理人董事、监事及其他高级管理人员介绍：

马蔚华，男，西南财经大学经济学博士，美国南加州大学荣誉博士，高级经济师。1982年至1985年，在辽宁省计委工作，历任副处长、副秘书长；1985年至1986年，在辽宁省委办公厅工作；1986年至1988年，在中共安徽省委办公厅工作；1988年至1990年，任中国人民银行办公厅副主任；1990年至1992年，任中国人民银行计划资金司副司长；1992年至1998年，任中国人民银行海南省分行行长兼国家外汇管理局海南分局局长；1999年3月至今任招商银行行长。现任本公司董事长。

Satish Bapat，男，美国费城天普大学工商管理硕士，注册会计师。1994年，加入美国德勤会计师事务所；2010年，加入ING投资管理任首席财务总监。现任本公司董事。

邓晓力，女，高级分析师。美国纽约州州立大学经济学博士。历任AT&T任市场科学决策部市场分析师，Providian Financial金融公司高级风险分析师，花旗银行风险管理部高级分析师。2001年11月加入招商证券，历任风险管理部副总经理、总经理，其间于2004年1月至9月被中国证监会借调至南方证券行政接管组工作。现任招商证券副总裁，分管财务部、风险控制部、清算中心、培训中心。现任本公司董事。

许小松，男，经济学博士。历任深圳证券交易所综合研究所副所长，南方基金管理有限公司首席经济学家、副总经理，国联安基金管理有限公司总经理，2011年加入招商基金管理有限公司，现任公司总经理、董事。

郑文光，男，美国寿险管理学会寿险管理院士、香港中文大学工商管理硕士。1973年至1984年间先后担任美国友邦保险有限公司香港区副总裁助理、市场拓展部经理、副总裁（营业部）等职务；1984年至2000年间先后担任安泰人寿保险（百慕达）有限公司助理总经理、总经理、执行董事等职务；2000年至2009年间担任ING集团亚太区香港、澳门地区总经理。1988年至今担任香港海港扶轮社社员；1999年至今担任香港童军总会筲箕湾区协会会长；2010年至今担任交通康联人寿保险公司独立董事。现任本公司独立董事。

陈春花，女，华南理工大学工商管理学院教授、博导，南京大学博士后。曾任华南理工大学工商管理学院副院长，现任北京大学客座研究员、新加坡国立大学客座教授、澳洲国立大学国际管理硕士课程客座教授、广东省企业管理协会常务理事、广东省企业文化协会常务理事和广东省精神文明协会理事。陈春花教授曾先后出任山东六和集团总裁、康佳集团、科龙集团、TCL集团、美的家电、南方航空、广东电信等公司管理顾问。讲授课程主要有《组

织行为学》、《企业文化与跨文化管理》等。现任本公司独立董事。

周语菡，女，美国加州州立大学索诺玛分校 MBA。曾先后就职于丸红株氏会社（美国）公司产品部，Ananda(USA)亚洲业务部，美国 ASI 太平洋地区业务发展部副主任，美国 iLink Global 公司高级分析员以及咨询委员会委员。2001 年初至 2005 年，就职于香港招商局中国投资管理有限公司，出任董事总经理一职，管理上市直接投资基金-招商中国直接投资基金（HK0133）。其间曾先后出任招商证券监事会主席，巨田证券监事会主席，巨田基金管理有限公司董事等职务。2006 年至 2007 年，任职于中集集团，出任南美战略发展项目负责人。2008 年至今，出任招商局中国基金有限公司(HK0133)之董事及招商局中国投资管理有限公司的董事总经理。现任公司独立董事。

张卫华，女，会计师。1981 年 07 月—1983 年 11 月，任江苏省连云港市汽车运输公司财务部会计；1983 年 11 月—1988 年 08 月，任中国银行连云港分行外汇会计部主任；1988 年 08 月—1994 年 11 月，历任招商银行总行国际部、会计部主任、证券业务部总经理助理；1994 年 11 月—2006 年 02 月，历任招银证券、国通证券及招商证券股份有限公司总裁助理兼稽核审计部总经理；2001 年 12 月—2009 年 04 月，任招商证券股份有限公司职工代表监事；2006 年 03 月—2009 年 04 月，任招商证券股份有限公司稽核监察总审计师；2009 年 04 月起任招商证券股份有限公司合规总监，现任公司监事会主席。

周松，男，武汉大学世界经济本科专业，硕士学历。1997 年 2 月加入招商银行，1997 年 2 月至 2006 年 6 月历任招商银行总行计划资金部经理、总经理助理、副总经理，2006 年 6 月至 2007 年 7 月任招商银行总行计划财务部副总经理，2007 年 7 月至 2008 年 7 月任招商银行武汉分行副行长。2008 年 7 月起担任招商银行总行计划财务部负责人，现任本公司监事。

钟丽仪，女，香港中文大学行政人员工商管理硕士学位、美国加州州立大学弗雷斯诺分校科学学士学位。自 1991 年以来一直在资产管理行业工作，曾先后任职富达投资香港高级经理、巴克莱国际基金亚洲区销售副总监、巴克莱国际投资管理（BGI）大中华区机构业务发展总监，2010 年 5 月加入 ING 投资管理公司，任北亚区机构业务发展主管，负责 ING 投资管理北亚地区的机构业务发展。现任公司监事。

路明，男，中南财经政法大学金融学硕士。1999 年加入银华基金管理公司，担任交易主管职务；2005 年加入东方基金管理公司，担任交易总监职务；2006 年 7 月加入招商基金管理有限公司，曾任交易部高级交易员、首席交易员，现任交易部总监，公司监事。

庄永宙，男，清华大学工学硕士。1996 年加入中国人民银行深圳市中心支行科技处；1997 年加入招商银行总行电脑部；2002 年起参与招商基金管理有限公司筹备，公司成立后

曾任信息技术部高级经理、副总监，现任信息技术部总监，公司监事。

王晓东，女，上海财经大学经济学硕士。曾任南方证券有限公司深南中路营业部总经理、深圳特区证券总经理助理、巨田基金管理有限公司（现摩根士丹利华鑫基金）副总经理、华林证券有限责任公司总裁，2007年加入招商证券股份有限公司。2007年9月至2010年3月任招商基金管理有限公司监事长，现任招商基金管理有限公司副总经理。

赵生章，男，中国人民大学经济学博士。曾任国信证券有限公司投资银行部任项目经理、招商证券股份有限公司投资银行二部副经理、内核部经理（投行内核小组负责人）、公司董事会办公室经理（负责公司公开发行及上市等相关事宜），2002年起参与招商基金管理有限公司筹备，公司成立后曾任督察长、总经理助理，现任招商基金管理有限公司副总经理。

欧志明，男，华中科技大学经济学及法学双学士、投资经济硕士；2002年加入广发证券深圳业务总部任机构客户经理；2003年4月至2004年7月于广发证券总部任风险控制岗从事风险管理工作；2004年7月加入招商基金管理有限公司，曾任法律合规部高级经理、副总监、总监，现任公司督察长兼董事会秘书。

## **2、本基金基金经理介绍**

王平，男，中南大学管理科学与工程专业硕士。2006年加入招商基金管理有限公司，历任投资风险管理部助理数量分析师、风险管理部数量分析师、高级风控经理、副总监，主要从事投资风险管理、金融工程与数量化投资策略研究、股指期货投资策略研究等工作。现任招商深证100指数证券投资基金基金经理（管理时间：2010年6月22日至今）、上证消费80交易型开放式指数证券投资基金及联接基金基金经理（管理时间：2010年12月8日至今）、深证电子信息传媒产业（TMT）50交易型开放式指数证券投资基金及联接基金基金经理（管理时间：2011年6月27日至今）、招商中证大宗商品股票指数分级证券投资基金基金经理（管理时间：2012年6月28日至今）。

## **3、投资决策委员会成员**

公司的投资决策委员会由如下成员组成：总经理助理兼固定收益投资部负责人张国强、总经理助理兼股票投资部负责人袁野、总经理助理兼量化投资部负责人吴武泽、总经理助理兼专户资产投资部负责人杨渺、基金经理陈玉辉、交易部总监路明。

## **4、上述人员之间均不存在近亲属关系。**

## **二、基金托管人**

## 1、基金托管人基本情况

本基金之基金托管人为中国工商银行股份有限公司（简称“中国工商银行”），基本情况如下：

名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

成立时间：1984 年 1 月 1 日

法定代表人：姜建清

注册资本：人民币 349,018,545,827 元

联系电话：010-66105799

联系人：赵会军

## 2、基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自1998年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、安心账户资金、企业年金基金、QFII资产、QDII资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII专户资产、ESCROW等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至2012年9月，中国工商银行共托管证券投资基金269只，其中封闭式6只，开放式263只。自2003年以来，本行连续八年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的33项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

## 3、基金托管部门的设置及员工情况

截至 2012 年 9 月末，中国工商银行资产托管部共有员工 161 人，平均年龄 30 岁，95%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。

### 三、相关服务机构

#### (一) 销售机构

##### 1、直销机构：招商基金管理有限公司

招商基金客户服务中心电话：400-887-9555（免长途话费）

招商基金电子商务网上交易平台

交易网站：[www.cmfchina.com](http://www.cmfchina.com)

交易电话：400-887-9555（免长途话费）

电话：（0755）83195018

传真：（0755）83199059

联系人：李涛

##### 招商基金华东机构理财中心

地址：上海市浦东南路 588 号浦发大厦 29 楼 AK 单元

电话：（021）58796636

联系人：王雷

##### 招商基金华南机构理财中心

地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 23 楼

电话：（0755）83196377

联系人：苏菁

##### 招商基金养老金及华北机构理财中心

地址：北京市西城区丰盛胡同 28 号太平洋保险大厦 B 座 2 层西侧 207-219 单元

电话：（010）66290590

联系人：仇小彬

##### 招商基金直销交易服务联系方式

地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 23 层招商基金市场部客户服务中心

电话：（0755）83196359 83196358

传真：（0755）83196360

备用传真：（0755）83199266

联系人：贺军莉

##### 2、代销机构：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：姜建清

电话：95588

传真：010-66107914

联系人：王均山

**3、 代销机构：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

法定代表人：傅育宁

电话：(0755) 83198888

传真：(0755) 83195050

联系人：邓炯鹏

**4、 代销机构：中国农业银行股份有限公司**

注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：蒋超良

电话：95599

传真：(010) 85109219

联系人：刘一宁

**5、 代销机构：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

法定代表人：肖钢

电话：95566

传真：(010) 66594853

联系人：张建伟

**6、 代销机构：交通银行股份有限公司**

注册地址：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

**7、 代销机构：中国邮政储蓄银行股份有限公司**

注册地址：北京市西城区金融大街 3 号



法定代表人：李国华

电话：95580

传真：(010) 68858117

联系人：陈春林

**8、 代销机构：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：田国立

电话：95558

传真：(010) 65550827

联系人：郭伟

**9、 代销机构：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

电话：95595

传真：(010) 63636248

联系人：李伟

**10、 代销机构：上海浦东发展银行股份有限公司**

注册地址：上海市浦东新区浦东南路 500 号

法定代表人：吉晓辉

电话：(021) 61618888

传真：(021) 63604199

联系人：高天

**11、 代销机构：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

电话：010-66223587

传真：010-66226045

联系人：谢小华

**12、 代销机构：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

法定代表人：吴建

电话：(010) 85238667

传真：(010) 85238680

联系人：郑鹏

**13、 代销机构：平安银行股份有限公司**

注册地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号

法定代表人：肖遂宁

电话：(0755) 82088888

传真：(0755) 82080714

联系人：张莉

**14、 代销机构：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) 82960223

传真：(0755) 82960141

联系人：林生迎

**15、 代销机构：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

法定代表人：万建华

电话：021-38676666

传真：021-38670666

联系人：芮敏祺

**16、 代销机构：海通证券股份有限公司**

注册地址：上海市淮海中路 98 号

法定代表人：王开国

电话：021-23219000

传真：021-23219100

联系人：金芸、李笑鸣

**17、 代销机构：广发证券股份有限公司**

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

法定代表人：孙树明

电话：（020）87555888

传真：（020）87555417

联系人：黄岚

**18、 代销机构：申银万国证券股份有限公司**

注册地址：上海市常熟路 171 号

法定代表人：丁国荣

电话：021-54033888

传真：021-54038844

联系人：曹晔

**19、 代销机构：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

法定代表人：杨宇翔

电话：（0755）22626391

传真：（0755）82400862

联系人：郑舒丽

**20、 代销机构：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

法定代表人：徐浩明

电话：（021）22169999

传真：（021）22169134

联系人：刘晨

**21、 代销机构：财富证券有限责任公司**

注册地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 楼

法定代表人：周晖

电话：（0731）4403319

传真：（0731）4403439

联系人：郭磊

**22、 代销机构：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

法定代表人：牛冠兴

电话：0755-82825551

传真：0755-82558355

联系人：余江

**23、代销机构：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

法人代表人：何如

电话：0755-82130833

传真：0755-82133952

联系人：齐晓燕

**24、代销机构：兴业证券股份有限公司**

注册地址：福州市湖东路 99 号

法定代表人：兰荣

电话：(021) 38565785

传真：(021) 38565955

联系人：谢高得

**25、代销机构：长江证券股份有限公司**

注册地址：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

**26、代销机构：中银国际证券有限责任公司**

注册地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层

法定代表人：许刚

电话：(021) 20328000

传真：(021) 50372474

联系人：李丹

**27、代销机构：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

法定代表人：黄金琳

电话：(0591)87383623

传真：(0591)87383610

联系人：张腾

**28、代销机构：国海证券股份有限公司**

注册地址：广西桂林市辅星路 13 号

法定代表人：张雅锋

电话：(0755)83709350

传真：(0755)83704850

联系人：牛孟宇

**29、代销机构：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

法定代表人：吴万善

电话：0755-83290978

传真：(025) 84579763

联系人：陈志军

**30、代销机构：大通证券股份有限公司**

注册地址：大连市中山区人民路 24 号

法定代表人：于宏民

电话：0411-39673202

传真：0411-39673219

联系人：谢立军

**31、代销机构：中航证券有限公司**

注册地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼

法定代表人：杜航

电话：0791-86768681

传真：0791-86770178

联系人：戴蕾

**32、代销机构：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 27 层

法定代表人：陈林

电话：(021) 50122222

传真：(021) 50122200

联系人：宋歌

**33、代销机构：方正证券股份有限公司**

注册地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦 22—24 层

法定代表人：雷杰

电话：0731-85832503

传真：0731-85832214

联系人：郭军瑞

**34、代销机构：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

法定代表人：陈有安

电话：(010) 66568430

传真：(010) 66568532

联系人：田薇

**35、代销机构：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

法定代表人：王常青

电话：4008888108

传真：(010) 65182261

联系人：权唐

**36、代销机构：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

法定代表人：张志刚

电话：(010) 63081000

传真：(010) 63080978

联系人：唐静

**37、代销机构：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：010-60838888

传真：010-60833739

联系人：陈忠

**38、代销机构：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

法定代表人：丁之锁

电话：010-58568007

传真：010-58568062

联系人：梁宇

**39、代销机构：天相投资顾问有限公司**

注册地址：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701

法定代表人：林义相

电话：010-66045608

传真：010-66045527

联系人：林爽

**40、代销机构：宏源证券股份有限公司**

注册地址：新疆乌鲁木齐市文艺路 233 号

法定代表人：冯戎

电话：(010) 88085858

传真：(010) 88085195

联系人：李巍

**41、代销机构：齐鲁证券有限公司**

注册地址：山东省济南市经十路 20518 号

法定代表人：李玮

电话：0531-68889155

传真：0531-68889752

联系人：吴阳

**42、代销机构：红塔证券股份有限公司**

注册地址：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

电话：0871-3577398

传真：0871-3578827

联系人：高国泽

**43、代销机构：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

法定代表人：徐勇力

电话：010-66555316

传真：010-66555246

联系人：汤漫川

**44、代销机构：山西证券股份有限公司**

注册地址：太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼

法定代表人：侯巍

电话：0351-8686659

传真：0351-8686619

联系人：郭熠

**45、代销机构：西藏同信证券有限责任公司**

注册地址：西藏自治区拉萨市北京中路 101 号

法定代表人：贾绍君

电话：021-36533016

传真：021-36533017

联系人：王伟光

**46、代销机构：中山证券有限责任公司**

注册地址：深圳市福田区益田路 6009 号新世界中心 29 层

法定代表人：吴永良

电话：0755-82943755

传真：0755-82940511

联系人：李珍

**47、代销机构：广州证券有限责任公司**



注册地址：广州市先烈中路 69 号东山广场主楼十七楼

法定代表人：吴志明

电话：020-87322668

传真：020-87325036

联系人：林洁茹

**48、代销机构：东海证券有限责任公司**

注册地址：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18-19 楼

法定代表人：朱科敏

电话：021-20333333

传真：021-50498851

联系人：汪汇

**49、代销机构：华龙证券有限责任公司**

注册地址：兰州市城关区静宁路 308 号

法定代表人：李晓安

电话：0931-8784502

传真：0931-4890628

联系人：李杨

**50、代销机构：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

法定代表人：庞介民

电话：0471-4972343

传真：0471-4961259

联系人：王旭华

**51、代销机构：万和证券有限责任公司**

注册地址：海口市南沙路 49 号通信广场二楼

法定代表人：朱治理

电话：0755-82830333

传真：0755-25161630

联系人：黎元春

**52、代销机构：东吴证券股份有限公司**

注册地址：苏州工业园区翠园路 181 号商旅大厦 18-21 层

法定代表人：吴永敏

电话：0512-65581136

传真：0512-65588021

联系人：方晓丹

**53、代销机构：五矿证券有限公司**

注册地址：深圳市福田区金田路 4028 号经贸中心 48 楼

法定代表人：张永衡

电话：0755-82545707

传真：0755-82545500

联系人：高克南

**54、代销机构：中信证券（浙江）有限责任公司（原中信金通证券）**

公司注册地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 588 号恒鑫大厦主楼 19、20 层公司

法人代表：沈强

电话：0571-86078823

传真：0571-85713721

联系人：周妍

**55、代销机构：民生证券有限责任公司**

注册地址：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16-18 层

法定代表人：岳献春

电话：010-85127622

传真：010-85127917

联系人：赵明

**56、代销机构：渤海证券股份有限公司**

注册地址：天津市经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

法定代表人：杜庆平

电话：022-28451861

传真：022-28451892

联系人：王兆权

**57、代销机构：中国中投证券有限责任公司**

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-21 层及第 04 层 01. 02. 03. 05. 11. 12. 13. 15. 16. 18. 19. 20. 21. 22. 23 单元

法定代表人：龙增来

电话：0755-82023442

传真：0755-82026539

联系人：刘毅

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

**58、代销机构：国金证券股份有限公司**

注册地址：成都市青羊区东城根上街 95 号

法定代表人：冉云

电话：028-86690302

传真：028-86690126

联系人：金喆

**59、代销机构：西南证券股份有限公司**

注册地址：重庆市江北区桥北苑 8 号

法定代表人：余维佳

电话：023-63786141

传真：023-63786212

联系人：张煜

**60、代销机构：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

法定代表人：常喆

电话：010-84183333

传真：010-84183311-3142

联系人：张睿

**61、代销机构：浙商证券股份有限公司**

注册地址：浙江省杭州市杭大路 1 号

法定代表人：吴承根

电话：021-64718888

传真：021-64713795

联系人：李凌芳

**62、代销机构：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

法人代表：张跃伟

电话：021-58788678-8816

传真：021-58787698

联系人：吕慧

**63、代销机构：深圳众禄基金销售有限公司**

注册地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

法人代表：薛峰

电话：0755-33227950

传真：0755-82080798

联系人：汤素娅

**64、代销机构：杭州数米基金销售有限公司**

注册地址：杭州市余杭区仓前街道海曙路东 2 号

法人代表：陈柏青

电话：0571-28829790

传真：0571-26698533

联系人：周嫵旻

**65、代销机构：北京展恒基金销售有限公司**

注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号

法人代表：闫振杰

电话：010-62020088

传真：010-62020088-8802

联系人：张晶晶

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

## **(二) 注册登记机构**

名称：招商基金管理有限公司

注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 28 楼

法定代表人：马蔚华

电话：（0755）83076445

传真：（0755）83196436

联系人：宋宇彬

## **(三) 律师事务所和经办律师**

名称：北京市高朋律师事务所

注册地址：北京市朝阳区东三环北路 2 号南银大厦 28 层

法定代表人：王磊

电话：（010）59241188

传真：（010）59241199

经办律师：王明涛、李勃

联系人：王明涛

## **(四) 会计师事务所和经办注册会计师**

名称：德勤华永会计师事务所有限公司

注册地址：上海市延安东路 222 号 30 楼

法定代表人：卢伯卿

电话：（021）61418888

传真：（021）63350177

经办注册会计师：曾浩、汪芳

联系人：曾浩

**四、基金的名称：**招商上证消费80交易型开放式指数证券投资基金联接基金

**五、基金类型：**指数型开放式

**六、基金的投资目标：**通过主要投资于上证消费80交易型开放式指数证券投资基金，密切跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

## 七、投资方向

本基金主要投资于上证消费 80ETF、上证消费 80 指数成份股和备选成份股。为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中投资于上证消费 80ETF 的比例不少于基金资产净值的 90%, 现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。

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。

## 八、基金的投资策略

本基金为上证消费 80ETF 的联接基金,主要通过投资于上证消费 80ETF, 以实现业绩基准的紧密跟踪, 力争将日均跟踪偏离度的控制在 0.3%以内, 年跟踪误差控制在 4%以内。

### 1、资产配置策略

本基金主要投资于上证消费 80ETF、上证消费 80ETF 指数成份股和备选成份股, 达到跟踪标的指数的目标。本基金投资于目标 ETF 的资产比例不低于基金资产净值的 90%; 现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。

### 2、目标 ETF 投资策略

本基金对基金的投资仅限于目标 ETF, 目前目标 ETF 仅指上证消费 80ETF。

#### (1) 基金组合的构建

基金合同生效后, 本基金将主要按照标的指数成份股的权重构建股票组合, 并在建仓期内将股票组合换购成目标 ETF, 使本基金投资于目标 ETF 的比例不少于基金资产净值的 90%。

#### (2) 目标 ETF 的投资方式

本基金作为上证消费 80ETF 的联接基金, 投资于上证消费 80ETF 的方式既包括在一级市场以股票篮子组合对该 ETF 进行申购与赎回, 也包括在二级市场以现金直接买卖该 ETF 份额。本基金投资于目标 ETF 的方式以申购和赎回为主, 但在目标 ETF 二级市场流动性较好的情况下, 为了更好地实现本基金的投资目标, 不足一级市场最小申购赎回单位资产净值的部分可以从二级市场买入 ETF 份额或者投资于上证消费 80 指数的成份股和备选成份股等。本基金在二级市场的 ETF 份额投资将不以套利为目的, 只是为了减小与标的指数的跟

踪偏离度和跟踪误差。

### (3) 基金组合的调整

本基金将根据申购和赎回情况，结合基金的现金头寸管理，对基金投资组合进行调整，从而有效跟踪标的指数。

当本基金在一级市场申购赎回和在二级市场买卖目标 ETF 或本基金自身的申购赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，基金经理会对投资组合进行适当调整，降低跟踪误差。

### 3、股票投资策略

本基金的股票投资以标的指数成份股和备选成份股部分的投资为主，采用被动式指数化投资的方法进行日常管理。针对我国证券市场新股发行制度的特点，本基金将参与一级市场新股认购。

### 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和有效利用基金资产。

### 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。本基金的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，不得用于投机交易目的。

### 6、跟踪误差、跟踪偏离度控制策略

本基金采取“跟踪误差”和“跟踪偏离度”这两个指标对投资组合进行日常的监控与管理，其中，跟踪误差为核心监控指标，跟踪偏离度为辅助监控指标。基金管理人将建立对事后跟踪误差的两级监控体系，即分别建立以 3%与 4%为阈值的监控线，实施严格的事后跟踪误差管理，同时通过对组合事前跟踪误差的估计与分解获取有效的降低跟踪误差的组合调整方法，以求有效控制投资组合相对于目标指数的偏离风险。

本基金对标的指数的跟踪目标是：力争使基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.3%，年化跟踪误差不超过 4%。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过了上述范围，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。

## **(二) 投资程序**

### **1、投资决策依据**

- (1) 须符合国家有关法律法规，严格遵守基金合同及公司章程；
- (2) 维护基金份额持有人利益作为基金投资的最高准则。

### **2、投资程序**

- (1) 投资决策委员会定期召开会议，提出资产配置比例的指导意见；
- (2) 基金经理根据投资决策委员会的指导意见确定具体的资产配置方案；
- (3) 基金经理依据目标 ETF 基金以及目标指数成份股的名单及权重，进行投资组合构建；
- (4) 基金经理及风险管理部定期对投资组合的偏离度和跟踪误差进行跟踪和评估，并对风险隐患提出预警；
- (5) 基金经理根据基金的申购赎回等状况，适时进行投资组合调整；
- (6) 在投资决策过程中，风险管理部负责对各决策环节的事前及事后风险、操作风险等投资风险进行监控，并在整个投资流程完成后，对投资风险及绩效做出评估，提供给投资决策委员会、投资总监、基金经理等相关人员，以供决策参考。

## **九、业绩比较基准：**

本基金业绩比较基准： $\text{上证消费 80 指数收益率} \times 95\% + \text{商业银行活期存款利率（税后）} \times 5\%$ 。

如果上证消费 80 交易型开放式指数证券投资基金变更其标的指数，或者中证指数有限公司变更或停止上证消费 80 指数的编制及发布，或者上证消费 80 指数被其他指数所替代，或者由于指数编制方法等重大变更导致上证消费 80 指数不宜继续作为目标基金的标的指数，或者证券市场有其他代表性更强、更适合于本基金投资的指数推出，经与托管人协商一致，履行相应程序后，本基金的标的指数可根据目标基金的业绩比较基准的更换而做相应的变更。

## **十、投资组合报告：**

招商上证消费 80 交易型开放式指数证券投资基金联接基金管理人—招商基金管理有限公司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。

本投资组合报告所载数据截至 2012 年 09 月 30 日，来源于《招商上证消费 80 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2012 年第 3 季度报告》。



### 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	1,186,555,913.50	94.96
3	固定收益投资	48,347,000.00	3.87
	其中：债券	48,347,000.00	3.87
	资产支持证券	-	-
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	12,971,768.84	1.04
7	其他资产	1,665,924.76	0.13
8	合计	1,249,540,607.10	100.00

### 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

### 3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

### 4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	48,347,000.00	3.87
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	48,347,000.00	3.87

### 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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	1101096	11 央行票据 96	300,000	29,013,000.00	2.32
2	1101088	11 央行票据 88	200,000	19,334,000.00	1.55

#### 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

本基金本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

本基金本报告期末未持有权证。

#### 8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	招商上证消费80ETF	股票型	交易型开放式（ETF）	招商基金管理有限公司	1,186,555,913.50	95.04

#### 9、投资组合报告附注

（1）报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

（2）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，本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

##### （3）其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	196,428.58
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,398,355.20
5	应收申购款	71,140.98
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	1,665,924.76
---	----	--------------

#### (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) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

### 十一、基金的业绩

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。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

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	净值增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
2010.12.08-2010.12.31	-0.90%	0.40%	-4.77%	1.41%	3.87%	-1.01%
2011.01.01-2011.12.31	-24.42%	1.17%	-26.09%	1.23%	1.67%	-0.06%
2012.01.01-2012.06.30	8.41%	1.35%	8.24%	1.37%	0.17%	-0.02%
2012.01.01-2012.09.30	5.61%	1.28%	5.20%	1.29%	0.41%	-0.01%
基金成立起至2012.09.30	-20.90%	1.20%	-25.95%	1.26%	5.05%	-0.06%

### 十二、基金的费用概览

#### (一) 与基金运作有关的费用

1、与基金运作有关的费用列示：

- (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) 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。

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

## 2、基金管理费

本基金基金财产中目标ETF 的部分不收取管理费。在通常情况下，按前一日基金资产净值扣除基金财产中目标ETF份额所对应资产净值后的剩余部分（若为负数，则取0）的0.5%年费率计提基金管理费。管理费的计算方法如下：

$$H = \text{MAX} (E \times 0.5\% \div \text{当年天数}, 0)$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值扣除基金财产中目标ETF 份额所对应资产净值后剩余部分的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起2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、公休假、不可抗力等，支付日期顺延。

## 3、基金托管费

本基金基金财产中目标ETF 的部分不收取托管费。在通常情况下，按前一日基金资产净值扣除基金财产中目标ETF份额所对应资产净值后的剩余部分（若为负数，则取0）的0.1%年费率计提托管费。托管费的计算方法如下：

$$H = \text{MAX} (E \times 0.1\% \div \text{当年天数}, 0)$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值扣除基金财产中目标ETF 份额所对应资产净值后剩余部分的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起2个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日、不可抗力等，支付日期顺延。

4、上述（3）到（8）项费用由基金托管人根据其它有关法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付，列入当期基金费用。

5、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，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用；

(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。

6、基金管理人和基金托管人协商一致后，可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率等相关费率。

调高基金管理费率、基金托管费率等费率，须召开基金份额持有人大会审议；调低基金管理费率、基金托管费率等费率，无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日前 2 日在至少一种指定媒体上公告。

## **(二) 与基金销售有关的费用**

1、基金的申购费用

本基金的申购费率水平、计算公式、收取方式和使用方式请参见本招募说明书“九、基金份额的申购、赎回和转换”相应部分。

2、基金的赎回费用

本基金的赎回费率水平、计算公式、收取方式和使用方式请参见本招募说明书“九、基金份额的申购、赎回和转换”相应部分。

3、基金的转换费用

本基金的转换费率水平、计算公式、收取方式和使用方式请参见本招募说明书“九、基金份额的申购、赎回和转换”相应部分。

4、基金管理人可以调整申购、赎回和转换费率或收费方式，并最迟将于新的费率或收费方式开始实施前在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

5、基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，对投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行相关手续后基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率，并不晚于优惠活动实施日公告。

#### 十四、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《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》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求，对本基金管理人于 2012 年 7 月 21 日刊登的本基金招募说明书进行了更新，并根据本基金管理人在前次招募说明书刊登后，对本基金的投资经营活动进行了内容补充和数据更新。

本次主要更新的内容如下：

1、在“三、基金管理人”部分，更新了“(二) 目前所管理基金的基本情况”、“(三) 主要人员情况”。

2、在“四、基金托管人”部分，更新了“(一) 基金托管人的基本情况”、“(二) 主要人员情况”、“(三) 基金托管业务经营情况”。

3、在“五、相关服务机构”部分，更新了“(一) 基金份额销售机构”。

4、在“九、基金的投资”部分，更新了“(十一) 基金投资组合报告”。

5、更新了“十、基金的业绩”。

6、更新了“二十二、其他应披露事项”。

**招商基金管理有限公司**  
**2013 年 1 月 21 日**