

# 招商央视财经 50 指数证券投资基金

## 更新的招募说明书摘要

(二零一六年第二号)

招商央视财经50指数证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会2012年10月8日《关于核准招商央视财经50指数证券投资基金募集的批复》（证监许可〔2012〕1309号文）核准公开募集。本基金的基金合同于2013年2月5日正式生效。

### 重要提示

招商基金管理有限公司（以下称“本基金管理人”或“管理人”）保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

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。当投资人赎回时，所得或会高于或低于投资人先前所支付的金额。如对本招募说明书有任何疑问，应寻求独立及专业的财务意见。

投资有风险，过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人所管理的其它基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。投资人在认购（或申购）本基金时应认真阅读本招募说明书。

基金招募说明书自基金合同生效日起，每六个月更新一次，并于每六个月结束之日后的45日内公告，更新内容截至每六个月的最后一日。

本更新招募说明书所载内容截止日为2016年8月5日，有关财务和业绩表现数据截止日为2016年6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

**设立日期：**2002 年 12 月 27 日

**注册地址：**深圳市福田区深南大道 7088 号

**办公地址：**深圳市福田区深南大道 7088 号

**法定代表人：**李浩

**电话：**(0755) 83199596

**传真：**(0755) 83076974

**联系人：**赖思斯

**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。经公司股东会通过并经中国证监会批准，公司的注册资本金已经由人民币一亿元（RMB100,000,000 元）增加为人民币二亿一千万元（RMB210,000,000 元）。

2007 年 5 月，经公司股东会通过并经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。上述股权转让完成后，招商基金管理有限公司的股东及股权结构为：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%。

2013 年 8 月，经公司股东会审议通过，并经中国证监会证监许可[2013]1074 号文批复同意，荷兰投资公司（ING Asset Management B.V.）将其持有的招商基金管理有限公司 21.6%股权转让给招商银行股份有限公司、11.7%股权转让给招商证券股份有限公司。上述股权转让完成后，招商基金管理有限公司的股东及股权结构为：招商银行股份有限公司持有全部股权的 55%，招商证券股份有限公司持有全部股权的 45%。

公司主要股东招商银行股份有限公司成立于 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）。

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）。

公司将秉承“诚信、理性、专业、协作、成长”的理念，以“为投资者创造更多价值”为使命，力争成为中国资产管理行业具有“差异化竞争优势、一流品牌”的资产管理公司。

## （二）主要人员情况

### 1、基金管理人董事、监事及高级管理人员介绍：

李浩，男，工商管理硕士，高级会计师。1997年5月加入招商银行股份有限公司，曾任行长助理、上海分行行长、副行长，现任执行董事、党委副书记、常务副行长兼财务负责人。现任公司董事长。

邓晓力，女，毕业于美国纽约州立大学，获经济学博士学位。2001年加入招商证券，期间于2004年1月至2005年9月被中国证监会借调至南方证券行政接管组工作，参与南方证券的清算；在加入招商证券前，曾在美国纽约花旗银行从事风险管理工作。现任招商证券股份有限公司副总裁，分管风险管理、公司财务、清算及培训工作；中国证券业协会财务与风险控制委员会副主任。现任公司副董事长。

金旭，女，北京大学硕士研究生。1993年7月至2001年11月在中国证监会工作。2001年11月至2004年7月在华夏基金管理有限公司任副总经理。2004年7月至2006年1月在宝盈基金管理有限公司任总经理。2006年1月至2007年5月在梅隆全球投资有限公司北京代表处任首席代表。2007年6月至2014年12月担任国泰基金管理有限公司总经理。2015年1月加入招商基金管理有限公司，现任公司总经理、董事兼招商资产管理（香港）有限公司董事长。

吴冠雄，男，1972年1月生，硕士研究生，22年法律从业经历。1994年8月至1997年9月在中国北方工业公司任法律事务部职员。1997年10月至1999年1月在新加坡Colin Ng & Partners任中国法律顾问。1999年2月至今在北京市天元律师事务所工作，先后担任专职律师、事务所权益合伙人、事务所管理合伙人、事务所执行主任和管理委员会成员。2009年9月至今兼任北京市华远集团有限公司外部董事。2012年5月至今兼任中国证券监督管理委员会第四届、第五届并购重组审核委员会兼职委员。现任公司独立董事。

王莉，女，高级经济师。毕业于中国人民解放军外国语学院，历任中国人民解放军昆明军区三局战士、助理研究员；国务院科技干部局二处干部；中信公司财务部国际金融处干部、银行部资金处副处长；中信银行(原中信实业银行)资本市场部总经理、行长助理、副行长

等职。现任中国证券市场研究设计中心(联办)常务干事兼基金部总经理; 联办控股有限公司董事总经理等。现任公司独立董事。

蔡廷基, 男, 毕业于香港理工学院(现为香港理工大学)会计系。历任香港毕马威会计师事务所审计部副经理、经理, 毕马威会计师事务所上海办事处执行合伙人, 毕马威华振会计师事务所上海首席合伙人, 毕马威华振会计师事务所华东华西区首席合伙人。现为香港会计师公会资深会员、上海市静安区政协委员、上海市静安区归国华侨联合会名誉副主席。兼任中国石化上海石油化工股份有限公司等三家香港上市公司的非执行独立董事。现任公司独立董事。

孙谦, 男, 新加坡籍, 经济学博士。1980年至1991年先后就读于北京大学、复旦大学、William Paterson College 和 Arizona State University 并获得学士、工商管理硕士和经济学博士学位。曾任新加坡南洋理工大学商学院副教授、厦门大学任财务管理与会计研究院院长及特聘教授、上海证券交易所高级访问金融专家。现任复旦大学管理学院特聘教授和财务金融系主任。兼任上海证券交易所, 中国金融期货交易所和上海期货交易所博士后工作站导师, 科技部复旦科技园中小型科技企业创新型融资平台项目负责人。现任公司独立董事。

张卫华, 女, 1981年07月至1988年8月, 曾在江苏省连云港市汽车运输公司财务部门任职; 1983年11月至1988年08月, 任中国银行连云港分行外汇会计部主任; 1988年08月至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月至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; 2006年03月至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月至2016年1月任招商证券股份有限公司合规总监; 2016年1月起任招商证券股份有限公司高级顾问。现任公司监事会主席。

周松, 男, 武汉大学世界经济专业硕士研究生。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月至2010年6月任招商银行总行计划财务部副总经理(主持工作)。2010年6月至2012年9月任招商银行总行计划财务部总经理。2012年9月至2014年6月任招商银行总行业务总监兼总行计划财务部总经理。2014年6月至2014年12月任招商银行总行业务总监兼总行资产负债管理部总经理。2014年12月起任招商银行总行同业金融总部总裁兼总行资产管理部总经理。2016年1月起任招商银行总行投行与金融市场总部总裁兼总行资产管理部总经理。现任公司监事。

罗琳，女，厦门大学经济学硕士。1996 年加入招商证券股份有限公司投资银行部，先后担任项目经理、高级经理、业务董事；2002 年起参与招商基金管理有限公司筹备，公司成立后先后担任基金核算部高级经理、产品研发部高级经理、副总监、总监，现任产品运营官兼市场推广部总监、公司监事。

鲁丹，女，中山大学国际工商管理硕士；2001 年加入美的集团股份有限公司任 Oracle ERP 系统实施顾问；2005 年 5 月至 2006 年 12 月于韬睿惠悦咨询有限公司任咨询顾问；2006 年 12 月至 2011 年 2 月于怡安翰威特咨询有限公司任咨询总监；2011 年 2 月至 2014 年 3 月任倍智人才管理咨询有限公司首席运营官；现任招商基金管理有限公司人力资源部总监、公司监事，兼任招商财富资产管理有限公司董事。

李扬，男，中央财经大学经济学硕士，2002 年加入招商基金管理有限公司，历任基金核算部高级经理、副总监、总监，现任产品研发一部总监、公司监事。

钟文岳，男，厦门大学货币银行学硕士。1992 年 7 月至 1997 年 4 月于中国农村发展信托投资公司任福建（集团）公司国际业务部经理；1997 年 4 月至 2000 年 1 月于申银万国证券股份有限公司任九江营业部总经理；2000 年 1 月至 2001 年 1 月任厦门海发投资股份有限公司总经理；2001 年 1 月至 2004 年 1 月任深圳二十一世纪风险投资公司副总经理；2004 年 1 月至 2008 年 11 月任新江南投资有限公司副总经理；2008 年 11 月至 2015 年 6 月任招商银行股份有限公司投资管理部总经理；2015 年 6 月加入招商基金管理有限公司，现任副总经理兼招商财富资产管理有限公司董事。

沙骏，男，中国国籍，中欧国际工商学院 EMBA，曾任职于南京熊猫电子集团，任设计师；1998 年 3 月加入原君安证券南京营业部交易部，任经理助理；1999 年 11 月加入中国平安保险（集团）股份有限公司资金运营中心基金投资部，从事交易及证券研究工作；2000 年 11 月加入宝盈基金管理有限公司基金投资部，任交易主管；2008 年 2 月加入国泰基金管理有限公司量化投资事业部，任投资总监、部门总经理；2015 年加入招商基金管理有限公司，现任公司副总经理兼招商资产管理（香港）有限公司董事。

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、督察长，现任公司副总经理、董事会秘书，兼任招商财富资产管理有限公司董事兼招商资产管理（香港）有限公司董事。

潘西里，男，硕士，1998 年加入大鹏证券有限责任公司法律部，负责法务工作；2001

年 10 月加入天同基金管理有限公司监察稽核部，任职主管；2003 年 2 月加入中国证券监督管理委员会深圳监管局，历任副主任科员、主任科员、副处长及处长；2015 年加入招商基金管理有限公司，现任督察长。

## 2、本基金基金经理介绍

王平，男，中国国籍，管理学硕士，FRM。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，主要负责公司投资风险管理、金融工程研究等工作，现任全球量化投资部副总监兼招商深证 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）、招商央视财经 50 指数证券投资基金基金经理（管理时间：2013 年 2 月 5 日至今）、招商中证银行指数分级证券投资基金基金经理（管理时间：2015 年 5 月 20 日至今）、招商中证煤炭等权指数分级证券投资基金基金经理（管理时间：2015 年 5 月 20 日至今）、招商中证白酒指数分级证券投资基金基金经理（管理时间：2015 年 5 月 27 日至今）、招商国证生物医药指数分级证券投资基金基金经理（管理时间：2015 年 5 月 27 日至今）、招商量化精选股票型发起式证券投资基金基金经理（管理时间：2016 年 3 月 15 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：总经理金旭、副总经理沙骏、总经理助理及投资管理二部负责人杨渺、总经理助理兼投资管理四部负责人王忠波、总经理助理兼全球量化投资部负责人吴武泽、总经理助理裴晓辉、交易部总监路明、国际业务部总监白海峰。

4、上述人员之间均不存在近亲属关系。

## 二、基金托管人

### （一）基金托管人基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

首次注册登记日期：1983 年 10 月 31 日

注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

法定代表人：田国立

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

托管部门信息披露联系人：王永民

电话：95566

传真：(010) 66594942

## （二）基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于1998年，现有员工110余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内，中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务，为各类客户提供个性化的托管增值服务，是国内领先的大型中资托管银行。

## （三）证券投资基金托管情况

截至2016年06月30日，中国银行已托管475只证券投资基金，其中境内基金444只，QDII基金31只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

# 三、相关服务机构

## 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）

### 招商基金官网交易平台

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

客服电话：400-887-9555（免长途话费）

电话：(0755) 83196437

传真：(0755) 83199059

联系人：陈梓

招商基金战略客户部

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) 66290576

联系人：曾沂慧

**招商基金机构理财部**

地址：深圳市深南大道 7888 号东海国际中心 A 座 16 楼

电话：(0755) 83190452

联系人：刘刚

地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1088 号上海招商银行大厦南塔 15 楼

电话：(021) 38577378

联系人：秦向东

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) 66290510

联系人：莫然

**招商基金直销交易服务联系方式**

地址：深圳市南山区科苑路科兴科学园 A3 单元 3 楼招商基金客服中心直销柜台

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：田国立

电话：95566

传真：(010) 66594853

联系人：张建伟

**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：李建红

电话：(0755) 83198888

传真：(0755) 83195050

联系人：邓炯鹏



**4. 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 9 号

法定代表人：常振明

电话：95558

传真：(010) 65550827

联系人：赵骞

**5. 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：周慕冰

电话：95599

传真：(010) 85109219

联系人：张伟

**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：牛锡明

电话：(021) 58781234

传真：(021) 58408483

联系人：张宏革

**7. 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

**8. 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

法定代表人：闫冰竹

电话：95526

传真：010-66226045

联系人：赵姝

**9. 代销机构：包商银行股份有限公司**

注册地址：内蒙古包头市钢铁大街 6 号

法定代表人：李镇西

电话：0472-5189051

传真：0472-5189057

联系人：张建鑫

**10. 代销机构：宁波银行股份有限公司**

注册地址：宁波市鄞州区宁南南路 700 号

法定代表人：陆华裕

电话：0574-87050038

传真：0574-87050024

联系人：于波涛

**11. 代销机构：大连银行股份有限公司**

注册地址：辽宁省大连市中山区中山路 88 号

法定代表人：陈占维

电话：0411-82356695

传真：0411-82356594

联系人：朱珠

**12. 代销机构：东莞农村商业银行股份有限公司**

注册地址：东莞市东城区鸿福东路2号

法定代表人：何沛良

电话：0769-961122

联系人：林培珊

**13. 江苏江南农村商业银行股份有限公司**

注册地址：常州市天宁区延宁中路 668 号

法定代表人：陆向阳

电话：0519-80585939

传真：0519-89995066

联系人：包静

**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：申万宏源证券有限公司**

注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人：李梅

电话：021-33389888

传真：021-33388224

联系人：曹晔

**16. 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：王宜四

电话：010-64818301

传真：010-64818443

联系人：史江蕊

**17. 代销机构：华融证券股份有限公司**

注册地址：北京市西城区金融大街 8 号

法定代表人：祝献忠

电话：010-85556100

传真：010-85556153

联系人：李慧灵

**18. 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

**19. 代销机构：平安证券有限责任公司**

注册地址：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

法定代表人：谢永林

电话：(0755) 22621866

传真：(0755) 82400862

联系人：吴琼

**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：薛峰  
电话：(021) 22169999  
传真：(021) 22169134  
联系人：刘晨

**21. 代销机构：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 层楼  
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  
传真：021-50498825  
联系人：王一彦

**22. 代销机构：华宝证券有限责任公司**

注册地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 57 层  
法定代表人：陈林  
电话：021-68777222  
传真：021-68777822  
联系人：刘闻川

**23. 代销机构：华安证券股份有限公司**

注册地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号  
法定代表人：李工  
电话：0551-5161666  
传真：0551-5161600  
联系人：甘霖

**24. 代销机构：中泰证券股份有限公司（原齐鲁证券）**

注册地址：山东省济南市经七路  
法定代表人：李玮  
电话：0531-68889155  
传真：0531-68889752  
联系人：吴阳

**25. 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) 66568450

传真：(010) 66568990

联系人：宋明

**26. 代销机构：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

法定代表人：王常青

电话：4008888108

传真：(010) 65182261

联系人：权唐

**27. 代销机构：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

法定代表人：王东明

电话：010-60838696

传真：010-60833739

联系人：顾凌

**28. 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

**29. 代销机构：中信证券（浙江）有限责任公司**

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

法人代表：沈强

联系人：王霏霏

电话：0571-87112507

传真：0571-8571377

**30. 代销机构：中信万通证券有限责任公司**

注册地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼 20 层

法定代表人：杨宝林

电话：(0532) 85022326

传真：(0532) 85022605

联系人：吴忠超

**31. 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

联系人：刘毅

电话：0755-82023442

传真：0755-82026539

**32. 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：028-86690057、028-86690058

传真：028-86690126

联系人：刘婧漪、贾鹏

**33. 代销机构：国都证券股份有限公司**

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

联系人：黄静

**34. 代销机构：广州证券股份有限公司**

注册地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层

法定代表人：邱三发

电话：020-88836999

传真：020-88836654

联系人：林洁茹

**35. 代销机构：华泰证券股份有限公司**

注册地址：南京市江东中路 228 号

法定代表人：周易

电话：0755-82492193

传真：0755-82492962

联系人：庞晓芸

**36. 代销机构：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

法定代表人：杨德红

电话：021-38676666

传真：021-38670666

联系人：芮敏祺

**37. 代销机构：山西证券股份有限公司**

注册地址：山西省太原市府西街 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

**38. 代销机构：申万宏源西部证券有限公司**

注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005

室

法定代表人：许建平

电话：（010）88085858

传真：（010）88085195

联系人：李巍

**39. 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：何春梅

电话：（0755）83709350

传真：（0755）83704850

联系人：牛孟宇

**40. 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

**41. 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

**42. 代销机构：新时代证券股份有限公司**

注册地址：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：刘汝军

联系人：田芳芳

电话：010-83561146

传真：010-83561094

**43. 代销机构：中国国际金融有限公司**

注册地址：北京市建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

法定代表人：金立群

联系人：蔡宇洲

电话：010-65051166

传真：010-65051166

**44. 代销机构：中国民族证券有限责任公司**

注册地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼

法定代表人：赵大建

电话：59355941

传真：56437030

联系人：李微

**45. 代销机构：万联证券有限责任公司**

注册地址：广东省广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 F 座 18、19 层

法定代表人：张建军

电话：020-38286588

传真：020-38286588

联系人：王鑫

**46. 代销机构：大同证券经纪有限责任公司**

注册地址：大同市城区迎宾街 15 号桐城中央 21 层

法定代表人：董祥

联系电话：0351-4130322

传真：0351-4130322

联系人：薛津

**47. 代销机构：太平洋证券股份有限公司**

注册地址：云南省昆明市青年路 389 号志远大厦 18 层



法定代表人：李长伟

电话：010-88321613

传真：010-88321763

联系人：谢兰

**48. 代销机构：联讯证券股份有限公司**

注册地址：广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼

法定代表人：徐刚

电话：0752-2119700

联系人：彭莲

**49. 代销机构：第一创业证券股份有限公司**

注册地址：广东省深圳市福田区福华一路115号投行大厦20楼

法定代表人：刘学民

地址：深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25、26层

联系人：吴军

电话：0755-23838751

传真：0755-23838751

**50. 代销机构：中信期货有限公司**

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13层1301-1305室、14层

法定代表人：张皓

联系人：韩钰

电话：010-6083 3754

传真：010-5776 2999

**51. 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：敖玲

**52. 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：童彩平

**53. 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：韩松志

**54. 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：周文婕

**55. 代销机构：诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司**

注册地址：上海市金山区廊下镇漕廊公路 7650 号 205 室

法人代表：汪静波

电话：400-821-5399

传真：(021) 38509777

联系人：李娟

**56. 代销机构：上海好买基金销售有限公司**

注册地址：上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室

法人代表：杨文斌

电话：(021) 58870011

传真：(021) 68596916

联系人：张茹

**57. 代销机构：中期资产管理有限公司**

注册地址：北京市朝阳区建国门外光华路 16 号 1 幢 11 层

法人代表：路瑶

电话：400-8888-160

传真：010-59539866

联系人：朱剑林

**58. 代销机构：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

法人代表：其实

电话：400-1818-188

传真：021-64385308

联系人：潘世友

**59. 代销机构：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 号泛利大厦 10 层

法人代表：王莉

电话：400-9200-022

传真：0755-82029055

联系人：吴阿婷

**60. 代销机构：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

法人代表：凌顺平

电话：0571-88911818

传真：0571-86800423

联系人：刘宁

**61. 代销机构：上海陆金所资产管理有限公司**

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

法人代表：郭坚

电话：021-20665952

传真：021-22066653

联系人：宁博宇

**62. 代销机构：上海联泰资产管理有限公司**

注册地址：中国（上海）自由贸易区富特北路 277 号 3 层 310 室

法人代表：燕斌

电话：400-046-6788

传真：021-52975270

联系人：凌秋艳

**63. 代销机构：北京乐融多源投资咨询有限公司**

注册地址：北京市朝阳区西大望路 1 号 1 号楼 1603

法人代表：董浩

电话：400-068-1176

传真：010-56580660

联系人：于婷婷

**64. 代销机构：深圳市新兰德证券投资咨询有限公司**

注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006#

法人代表：杨懿

电话：400-166-1188

传真：010-83363072

联系人：文雯

**65. 代销机构：深圳富济财富管理有限公司**

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室

法人代表：齐小贺

电话：0755-83999913

传真：0755-83999926

联系人：陈勇军

**66. 代销机构：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

法人代表：赵学军

电话：400-021-8850

联系人：余永健

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

**67. 代销机构：珠海盈米财富管理有限公司**

注册地址：广东省珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491

法人代表：肖雯

电话：020-80629066

联系人：刘文红

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

**68. 代销机构：上海汇付金融服务有限公司**

注册地址：上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼

法人代表：冯修敏

电话：400-8213-999

联系人：陈云卉

网址：<https://tty.chinapnr.com/>

**69. 代销机构：上海利得基金销售有限公司**

注册地址：上海市浦东新区东方路 989 号中达广场 2 楼

法定代表人：盛大

电话：400-067-6266

联系人：王淼晶

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

**70. 代销机构：北京钱景财富投资管理有限公司**

注册地址：北京市海淀区丹棱街丹棱soho10层

法定代表人：赵荣春

电话：400-893-6885

联系人：盛海娟

网址：<http://www.qianjing.com/>

**71. 代销机构：北京新浪仓石基金销售有限公司**

注册地址：北京市海淀区北四环西路 58 号 906

法定代表人：张琪

电话：010-62675369

联系人：付文红

网址：<http://www.xincai.com/>

**72. 代销机构：南京苏宁基金销售有限公司**

注册地址：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

法定代表人：钱燕飞

电话：025-66996699-887226

联系人：王锋

网址：<http://fund.suning.com>

**73. 代销机构：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

法定代表人：TAN YIK KUAN

电话：400-684-0500

联系人：陈广浩

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

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：深圳市福田区深南大道 7088 号  
法定代表人：李浩  
电话：(0755) 83196445  
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：毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）  
注册地址：北京市东长安街 1 号东方广场东二办公楼八层  
法定代表人：邹俊  
电话：(0755) 25471000  
传真：(0755) 82668930  
经办注册会计师：程海良、吴钟鸣  
联系人：蔡正轩

**四、基金的名称：**招商央视财经 50 指数证券投资基金

**五、基金类型：**指数型证券投资基金

**六、基金的投资目标：**本基金进行被动式指数化投资，通过严格的投资纪律约束和数量

化的风险管理手段，实现对标的指数的有效跟踪，获得与标的指数收益相似的回报。本基金的投资目标是保持基金净值收益率与业绩基准日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%。

## 七、投资方向

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括央视财经 50 指数的成份股、备选成份股、新股（含首次公开发行和增发）、债券、债券回购、权证、股指期货、资产支持证券、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许本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）。

本基金投资于股票的资产比例为基金资产的 85%-95%，投资于央视财经 50 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 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%。

如法律法规或中国证监会以后允许基金投资其他金融工具，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

### （一）投资策略

本基金以央视财经 50 指数为标的指数，采用完全复制法，按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，进行被动式指数化投资。股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合复制标的指数，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，以复制和跟踪标的指数。本基金的投资目标是保持基金净值收益率与业绩基准日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。

当预期成份股发生调整，成份股发生配股、增发、分红等行为，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，导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。

基金管理人将对成份股的流动性进行分析，如发现流动性欠佳的个股将可能采用合理方法寻求替代。基金管理人运用以下策略构造替代股组合：

(1) 基本面替代：按照与被替代股票所属行业，基本面及规模相似的原则，选取一揽子标的指数成份股票作为替代股备选库；

(2) 相关性检验：计算备选库中各股票与被替代股票日收益率的相关系数并选取与被替

代股票相关性较高的股票组成模拟组合，以组合与被替代股票的日收益率序列的相关系数最大化为优化目标，求解组合中替代股票的权重，并构建替代股组合。

本基金管理人每日跟踪基金组合与标的指数表现的偏离度，每月末、季度末定期分析基金的实际组合与标的指数表现的累计偏离度、跟踪误差变化情况及其原因，并优化跟踪偏离度管理方案。

本基金债券投资为在跟踪误差与流动性风险双重约束下的投资。本基金将以降低基金的跟踪误差为目的，在考虑流动性风险的前提下，构建债券投资组合。本基金债券投资组合将采用自上而下的投资策略，根据宏观经济分析、资金面动向分析等判断未来利率变化，并利用债券定价技术，进行个券选择，同时着重考虑基金的流动性管理需要进行配置。

本基金管理人可运用股指期货，以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，参与股指期货的投资，以改善组合的风险收益特性。本基金主要通过对现货和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货定价模型寻求其合理估值水平，采用流动性好、交易活跃的期货合约，达到有效跟踪标的指数的目的。此外，本基金还将运用股指期货来对冲特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理，如预期大额申购赎回、大量分红等，以及对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险。

## （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

本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理团队制。投资决策委员负责制定基金投资方面的整体投资计划与投资原则；决定有关标的指数重大调整应对决策、其他重大组合调整决策以及重大的单项投资决策；基金经理根据投资决策委员会的决策，负责投资组合的构建、调整和日常管理等工作。

（1）投资决策委员会依据相关研究分析报告，定期召开或遇重大事项时召开投资决策会议，决策相关事项。基金经理根据投资决策委员会的决议，进行基金投资管理的日常决策。

（2）基金经理依据指数编制单位公布的指数成份股名单及权重，进行投资组合构建；

（3）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；

（4）基金经理根据指数成份股或权重变化情况、基金申购赎回情况、指数成份股派息



情况等，适时进行投资组合调整；

## 九、业绩比较基准

本基金业绩比较基准：央视财经 50 指数收益率×95%+金融机构人民币活期存款基准利率（税后）×5%

若本基金标的指数发生变更，基金业绩比较基准随之变更。如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出时，本基金基金管理人可以在与基金托管人协商同意后变更业绩比较基准的组成和权重。本基金由于上述原因变更业绩比较基准，无需召开基金份额持有人大会。基金管理人应于变更前在中国证监会指定的媒体上公告。

## 十、风险收益特征

本基金属于股票型指数基金，在证券投资基金中属于较高风险、较高收益的品种，本基金主要采用指数复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

## 十一、投资组合报告：

招商央视财经 50 指数证券投资基金管理人—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 2016 年 6 月 30 日，来源于《招商央视财经 50 指数证券投资基金 2016 年第 2 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     | 25,495,165.28 | 93.06        |
|    | 其中：股票    | 25,495,165.28 | 93.06        |
| 2  | 基金投资     | -             | -            |
| 3  | 固定收益投资   | -             | -            |
|    | 其中：债券    | -             | -            |
|    | 资产支持证券   | -             | -            |
| 4  | 贵金属投资    | -             | -            |
| 5  | 金融衍生品投资  | -             | -            |
| 6  | 买入返售金融资产 | -             | -            |

|   |                   |               |        |
|---|-------------------|---------------|--------|
|   | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -             | -      |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计      | 1,886,523.61  | 6.89   |
| 8 | 其他资产              | 14,319.69     | 0.05   |
| 9 | 合计                | 27,396,008.58 | 100.00 |

## 2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 2.1 报告期末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         | -             | -            |
| B  | 采矿业              | 427,108.92    | 1.59         |
| C  | 制造业              | 15,424,629.57 | 57.39        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -             | -            |
| E  | 建筑业              | -             | -            |
| F  | 批发和零售业           | -             | -            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 97,319.31     | 0.36         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -             | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 2,520,340.46  | 9.38         |
| J  | 金融业              | 4,497,490.24  | 16.73        |
| K  | 房地产业             | 1,111,528.60  | 4.14         |
| 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    | 636,901.04    | 2.37         |
| 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        | 45,911.45     | 0.17         |
| S  | 综合               | 176,004.36    | 0.65         |
|    | 合计               | 24,937,233.95 | 92.78        |

### 2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）   | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|-----------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -         | -            |
| B  | 采掘业              | -         | -            |
| C  | 制造业              | 39,896.42 | 0.15         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -         | -            |

|   |                 |            |      |
|---|-----------------|------------|------|
| E | 建筑业             | -          | -    |
| 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 | 6,043.65   | 0.02 |
| J | 金融业             | 507,819.00 | 1.89 |
| 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      | 4,172.26   | 0.02 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业   | -          | -    |
| 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              | 557,931.33 | 2.08 |

### 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

#### 3.1 报告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  | 000651 | 格力电器 | 126,578 | 2,793,576.46 | 10.39        |
| 2  | 600887 | 伊利股份 | 92,916  | 1,548,909.72 | 5.76         |
| 3  | 601318 | 中国平安 | 43,012  | 1,378,104.48 | 5.13         |
| 4  | 600016 | 民生银行 | 152,991 | 1,366,209.63 | 5.08         |
| 5  | 600519 | 贵州茅台 | 4,531   | 1,322,689.52 | 4.92         |
| 6  | 000002 | 万科A  | 61,073  | 1,111,528.60 | 4.14         |
| 7  | 300017 | 网宿科技 | 14,574  | 979,372.80   | 3.64         |
| 8  | 002415 | 海康威视 | 44,460  | 954,111.60   | 3.55         |
| 9  | 600104 | 上汽集团 | 43,938  | 891,502.02   | 3.32         |
| 10 | 000333 | 美的集团 | 33,741  | 800,336.52   | 2.98         |

#### 3.2 报告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

| 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  | 000001 | 平安银行 | 58,370 | 507,819.00 | 1.89         |
| 2  | 300515 | 三德科技 | 280    | 13,123.60  | 0.05         |
| 3  | 603131 | 上海沪工 | 210    | 12,747.00  | 0.05         |
| 4  | 002802 | 洪汇新材 | 422    | 6,363.76   | 0.02         |

|   |        |     |     |          |      |
|---|--------|-----|-----|----------|------|
| 5 | 300518 | 盛讯达 | 129 | 6,043.65 | 0.02 |
|---|--------|-----|-----|----------|------|

#### 4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金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序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 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

本基金本报告期末未持有权证。

#### 9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 9.1 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合约。

##### 9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。本基金还将运用股指期货来对冲特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理，如预期大额申购赎回、大量分红等，以及对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险。

## 10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 10.1 本期国债期货投资政策

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

### 10.2 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合约。

### 10.3 本期国债期货投资评价

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

## 11 投资组合报告附注

11.1 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。

11.2 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。

### 11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）     |
|----|---------|-----------|
| 1  | 存出保证金   | 10,580.79 |
| 2  | 应收证券清算款 | -         |
| 3  | 应收股利    | -         |
| 4  | 应收利息    | 864.13    |
| 5  | 应收申购款   | 2,874.77  |
| 6  | 其他应收款   | -         |
| 7  | 待摊费用    | -         |
| 8  | 其他      | -         |
| 9  | 合计      | 14,319.69 |

### 11.4 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。

### 11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 11.5.1 报告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 | 占基金资产净 | 流通受限 |
|----|------|------|------------|--------|------|
|----|------|------|------------|--------|------|

|   |        |      | 值(元)         | 值比例 (%) | 情况说明 |
|---|--------|------|--------------|---------|------|
| 1 | 000651 | 格力电器 | 2,793,576.46 | 10.39   | 重大事项 |
| 2 | 000002 | 万科A  | 1,111,528.60 | 4.14    | 重大事项 |

### 11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

## 十二、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，但投资者购买本基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构，本基金管理人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。

本基金合同生效以来的投资业绩及与同期基准的比较如下表所示：

| 阶段                    | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③    | ②—④    |
|-----------------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|--------|
| 2013.02.05-2013.12.31 | 0.50%  | 1.12%     | -3.57%     | 1.23%         | 4.07%  | -0.11% |
| 2014.01.01-2014.12.31 | 26.27% | 1.09%     | 25.29%     | 1.08%         | 0.98%  | 0.01%  |
| 2015.01.01-2015.12.31 | 14.18% | 2.41%     | 15.19%     | 2.30%         | -1.01% | 0.11%  |
| 2016.01.01-2016.06.30 | -8.07% | 1.80%     | -7.17%     | 1.60%         | -0.90% | 0.20%  |
| 基金成立起至 2016.6.30      | 33.20% | 1.69%     | 29.19%     | 1.64%         | 4.01%  | 0.05%  |

本基金合同生效日为 2013 年 2 月 5 日

## 十三、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、标的指数使用费；
- 4、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；

- 5、基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
  - 6、基金份额持有人大会费用；
  - 7、基金的证券交易费用；
  - 8、基金的银行汇划费用；
  - 9、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。

## （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0.75%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.75\% \div \text{当年天数}$$

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、公休假等，支付日期顺延。

### 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 0.15%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

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3个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

3、上述“（一）基金费用的种类”中第3—8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）费用调整

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、基金销售费率等相关费率。

调高基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费率，须召开基金份额持有人大会审议；调低基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费率，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和基金管理人网站上公告。

#### （五）基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，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《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》、《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 2016 年 3 月 19 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) 主要人员情况”。
- 2、在“四、基金托管人”部分，更新了“(一) 基金托管人基本情况”、“(二) 托管业务的内部控制制度”。
- 3、在“五、相关服务机构”部分，更新了“(一) 销售机构”、“(四) 会计师事务所和经办注册会计师”。



- 4、在“七、基金份额的申购、赎回及转换”部分，更新了“(四) 申购、赎回及转换的有关限制”。
- 5、在“八、基金的投资”部分，更新了“(十一) 基金投资组合报告”。
- 6、更新了“九、基金的业绩”。
- 7、更新了“二十二、其他应披露事项”。

招商基金管理有限公司  
2016年9月14日