

# 招商中证全指证券公司指数分级证券投资基金 更新的招募说明书摘要

(二零一七年第一号)

招商中证全指证券公司指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会2014年1月27日《关于核准招商中证全指证券公司指数分级证券投资基金募集的批复》（证监许可〔2014〕155号文）注册公开募集。本基金的基金合同于2014年11月13日正式生效。本基金为契约型开放式。

## 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注册，但中国证监会对本基金募集的注册，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。

本基金为股票型指数基金，具有较高风险、较高预期收益的特征。本基金基金合同生效后，本基金分离为预期收益与风险不同的两种份额类别，招商中证证券公司A份额具有低风险、收益相对稳定的特征；招商中证证券公司B份额具有高风险、高预期收益的特征。

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2017年5月13日，有关财务和业绩表现数据截止日为2017年3月31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

**注册地址：**深圳市福田区深南大道 7088 号

**成立日期：**2002 年 12 月 27 日

**注册资本：**人民币 2.1 亿元

**法定代表人：**李浩

**办公地址：**深圳市福田区深南大道 7088 号

**电话：**(0755) 83199596

**传真：**(0755) 83076974

**联系人：**赖思斯

### **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，招商银行股份有限公司执行董事、常务副行长兼财务负责人。美国南加州大学工商管理硕士学位，高级会计师。1997年5月加入招商银行任总行行长助理，2000年4月至2002年3月兼任招商银行上海分行行长，2001年12月起担任招商银行副行长，2007年3月起兼任财务负责人，2007年6月起担任招商银行执行董事，2013年5月起担任招商银行常务副行长，2016年3月起兼任深圳市招银前海金融资产交易中心有限公司副董事长。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，并于2004年1月至2004年12月被中国证监会借调至南方证券行政接管组任接管组成员。在加入招商证券前，邓女士曾任Citigroup（花旗集团）风险管理部高级分析师。现任招商证券股份有限公司副总裁兼首席风险官，分管风险管理、公司财务、结算及培训工作；兼任中国证券业协会财务与风险控制委员会副主任委员。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，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，2016年4月至今兼任北京墨迹风云科技股份有限公司独立董事，2016

年12月至今兼任新世纪医疗控股有限公司（香港联交所上市公司）独立董事，2016年11月至今任中国证券监督管理委员会第三届上市公司并购重组专家咨询委员会委员。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。

何玉慧，女，加拿大皇后大学荣誉商学士，26年会计从业经历。曾先后就职于加拿大 National Trust Company 和 Ernst & Young，1995年4月加入香港毕马威会计师事务所，2015年9月退休前系香港毕马威会计师事务所金融业内部审计、风险管理和合规服务主管合伙人。2016年8月至今任泰康保险集团股份有限公司独立董事，同时兼任多个香港政府机构辖下委员会的委员和香港会计师公会纪律评判小组委员。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。

丁安华，男，毕业于华南理工大学工商管理学院，获硕士学位。1984年8月至1986年8月任人民交通出版社编辑；1989年10月至1992年10月任华南理工大学工商管理学院讲师；1992年10月至1994年12月任招商局集团研究部主任研究员；1995年1月至1998年8月，任美资企业高级管理人员；1998年8月至2001年2月，任职于加拿大皇家银行；2001年3月至2009年4月，历任招商局集团业务开发部总经理助理、副总经理，企业规划部副总经理，战略研究部总经理。2004年12月至2010年4月，兼任招商轮船董事；2007年6月至2010年6月，兼任招商银行董事；2007年8月至2011年4月兼任招商证券董事。2009年5月任招商证券首席经济学家，2011年10月起任招商证券副总裁。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、产品运营官，现任首席市场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，现任常务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。

杨渺，男，硕士，2002年起先后就职于南方证券股份有限公司、巨田基金管理有限公司，历任金融工程研究员、行业研究员、助理基金经理。2005年加入招商基金管理有限公司，历任高级数量分析师、投资经理、投资管理二部(原专户资产投资部)负责人及总经理助理，现任公司副总经理。

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：**

罗毅，男，中国国籍，经济学硕士。2007年加入华润（深圳）有限公司，从事商业地产投资项目分析及营运管理工作；2008年4月加入招商基金管理有限公司，从事养老金产品设计研发、基金市场研究、量化选股研究及指数基金运作管理工作，曾任高级经理、ETF专员，现任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其联接基金基金经理（管理时间：2013年1月19日至今）、上证消费80交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金基金经理（管理时间：2013年1月19日至今）、招商沪深300高贝塔指数分级证券投资基金基金经理（管理时间：2013年8月1日至今）、招商中证全指证券公司指数分级证券投资基金基金经理（管理时间：2014年11月13日至今）、招商沪深300地产等权重指数分级证券投资基金基金经理（管理时间：2014年11月27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、副总经理杨渺、总经理助理兼量化投资部负责人吴武泽、总经理助理兼固定收益投资部负责人裴晓辉、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

传真：（010）66594942

中国银行客服电话：95566

### **（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2017年03月31日，中国银行已托管576只证券投资基金，其中境内基金541只，QDII基金35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**

### **（一）基金份额销售机构**

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）

### **招商基金官网交易平台**

交易网站：[www.cmfchina.com](http://www.cmfchina.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）56937566

联系人：莫然

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）38577388

联系人：胡祖望

### **招商基金机构理财部**

地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 23 楼

电话：（0755）83190452

联系人：刘刚

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）56937404

联系人：贾晓航

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）38577379

联系人：伊泽源

### **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：冯敏

## **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

**5. 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：李庆萍

电话：95558

传真：(010) 65550827

联系人：王晓琳

**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：平安银行股份有限公司**

注册地址：广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号

法定代表人：谢永林

电话：95511-3

传真：(021) 50979507

联系人：黄炫

**8. 代销机构：中国光大银行股份有限公司**

注册地址：北京市西城区太平桥大街 25 号

法定代表人：唐双宁

电话：95595

传真：(010) 63636248

联系人：朱红

**9. 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：王硕

**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：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：任巧超

**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. 代销机构：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：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：010-66568292、010-83574507

传真：010-66568990

联系人：邓颜、辛国政

**16. 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

**17. 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：杨泽柱

电话：（027）65799999

传真：（027）85481900

联系人：奚博宇

**18. 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

**19. 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

**20. 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

**21. 代销机构：东海证券股份有限公司**

注册地址：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18 楼  
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：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：王春峰  
电话：022-28451861  
传真：022-28451892  
联系人：王兆权

**23. 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

**24. 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

**25. 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

**26. 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：010-8356109

**27. 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

**28. 代销机构：平安证券股份有限公司**

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

**29. 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

联系人：李若晨

电话：0755-23838762

传真：0755-23838751

**30. 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

**31. 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

**32. 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

**33. 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

**34. 代销机构：中信证券（山东）有限责任公司（原中信万通证券）**

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

**35. 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

**36. 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

**37. 代销机构：大同证券有限责任公司**

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

联系人：薛津

联系电话：0351-4130322

传真：0351-4130322

**38. 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

联系人：谢兰

电话：010-88321613

传真：010-88321763

**39. 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

**40. 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

**41. 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

联系人：徐锦福

电话：010-57398062

传真：010-57308058

**42. 代销机构：东海期货有限责任公司**

注册地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦 8 楼

法定代表人：陈太康

联系人：李天雨

电话：021-68757102/13681957646

**43. 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

法定代表人：其实

电话：400-1818-188

传真：021-64385308

联系人：潘世友

**44. 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

法定代表人：汪静波

电话：400-821-5399

传真：(021) 38509777

联系人：张裕

**45. 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

法定代表人：薛峰

电话：0755-33227950

传真：0755-82080798

联系人：童彩平

**46. 代销机构：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道海曙路东 2 号

法定代表人：陈柏青



电话：0571-28829790

传真：0571-26698533

联系人：韩松志

**47. 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

法定代表人：杨文斌

电话：(021) 58870011

传真：(021) 68596916

联系人：张茹

**48. 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

法定代表人：凌顺平

电话：0571-88911818

传真：0571-86800423

联系人：刘宁

**49. 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

法定代表人：燕斌

电话：400-046-6788

传真：021-52975270

联系人：凌秋艳

**50. 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

法定代表人：郭坚

电话：021-20665952

传真：021-22066653

联系人：宁博宇

**51. 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

法定代表人：董浩

电话：400-068-1176

传真：010-56580660

联系人：于婷婷

**52. 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#

法定代表人：杨懿

电话：400-166-1188

传真：010-83363072

联系人：文雯

**53. 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

法定代表人：肖雯

电话：020-80629066

联系人：刘文红

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

**54. 代销机构：北京蛋卷基金销售有限公司**

注册地址：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507

法定代表人：钟斐斐

电话：4000-618-518

联系人：戚晓强

网址：<http://www.ncfjj.com/>

**55. 代销机构：深圳前海微众银行股份有限公司**

注册地址：深圳市南山区桃园路田厦金牛广场37楼

法定代表人：顾敏

电话：400-999-8877

联系人：罗曦

网址：<http://www.webank.com/>

**56. 代销机构：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

法定代表人：王伟刚

电话：400-619-9059

联系人：丁向坤

网址：<http://www.fundzone.cn>

**57. 代销机构：凤凰金信（银川）投资管理有限公司**

注册地址：宁夏回族自治区银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路142号14层1402

法定代表人：程刚

电话：400-810-5919

联系人：张旭

网址：www.fengfd.com

**58. 代销机构：上海中正达广投资管理有限公司**

注册地址：上海市徐汇区龙腾大道 2815 号 302 室

法定代表人：黄欣

电话：400-6767-523

联系人：戴珉微

网址：www.zzwealth.cn

**59. 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>

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：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

电话：(010) 59378888

传真：(010) 59378907

联系人：朱立元

**(三) 律师事务所和经办律师**

名称：上海源泰律师事务所

注册地址：上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 楼

负责人：廖海

电话：(021) 51150298

传真：(021) 51150398

经办律师：廖海、刘佳

联系人：刘佳

#### **（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）2547 1000

传真：（0755）8266 8930

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**

招商中证全指证券公司指数分级证券投资基金

### **五、基金类型**

股票型证券投资基金

### **六、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、投资范围**

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括中证全指证券公司指数的成份股、备选成份股、股票、股指期货、债券、债券回购等固定收益投资品种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不低于基金资产的85%，投资于中证全指证券公司指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的90%，且不低于非现金资产的80%；本基金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。

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、投资策略

本基金以中证全指证券公司指数为标的指数，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，或因某些特殊情况导致流动性不足，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。

## 九、投资决策流程

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;

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。

## 十、业绩比较基准

本基金业绩比较基准:中证全指证券公司指数收益率 $\times 95\%$ +金融机构人民币活期存款基准利率(税后) $\times 5\%$

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,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的股票指数时,本基金可以在与本基金托管人协商同意后变更业绩比较基准并及时公告。本基金由于上述原因变更标的指数和业绩比较基准,基金管理人应于变更前在中国证监会指定的媒体上公告。

## 十一、风险收益特征

本基金为股票型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征。从本基金所分离的两类基金份额来看,招商中证证券公司A份额具有低风险、收益相对稳定的特征;招商中证证券公司B份额具有高风险、高预期收益的特征。

## 十二、投资组合报告

招商中证全指证券公司指数分级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2017年3月31日，来源于《招商中证全指证券公司指数分级证券投资基金2017年第1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	18,103,718,433.37	91.08
	其中：股票	18,103,718,433.37	91.08
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	208,476,760.22	1.05
	其中：债券	208,476,760.22	1.05
	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	300,000,000.00	1.51
	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	1,223,791,028.06	6.16
8	其他资产	40,833,047.14	0.21
9	合计	19,876,819,268.79	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境内股票投资组合

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	-	-
C	制造业	-	-
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	-	-
J	金融业	18,101,673,642.03	91.65
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	-	-
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	18,101,673,642.03	91.65

## 2.2. 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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	1,427,301.73	0.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	212,404.44	0.00
F	批发和零售业	130,984.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	131,314.89	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	79,131.20	0.00
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	16,930.16	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	46,724.92	0.00
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	2,044,791.34	0.01

## 2.3. 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。



### 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

#### 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	600030	中信证券	145,779,393	2,348,506,021.23	11.89
2	600837	海通证券	149,871,037	2,188,117,140.20	11.08
3	601211	国泰君安	84,718,146	1,546,106,164.50	7.83
4	601688	华泰证券	60,492,915	1,016,885,901.15	5.15
5	000776	广发证券	54,808,138	936,671,078.42	4.74
6	600958	东方证券	57,645,738	846,239,433.84	4.28
7	000166	申万宏源	111,430,193	690,867,196.60	3.50
8	600999	招商证券	42,369,567	689,352,855.09	3.49
9	601377	兴业证券	86,811,263	664,974,274.58	3.37
10	002736	国信证券	45,555,080	664,193,066.40	3.36

注：因本基金被动复制指数成分股需要，根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定要求，经本基金管理人董事会以及本基金托管行同意，报告期内，本基金参与投资了招商证券。

#### 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	603833	欧派家居	2,329	223,560.71	0.00
2	300618	寒锐钴业	1,600	172,544.00	0.00
3	601228	广州港	32,911	131,314.89	0.00
4	300623	捷捷微电	1,242	115,058.88	0.00
5	603768	常青股份	2,755	104,276.75	0.00

### 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	-	-
3	金融债券	199,400,000.00	1.01
	其中：政策性金融债	199,400,000.00	1.01
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	9,076,760.22	0.05
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-

10	合计	208,476,760.22	1.06
----	----	----------------	------

#### 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

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	170401	17 农发 01	2,000,000	199,400,000.00	1.01
2	113011	光大转债	89,980	8,997,763.34	0.05
3	113012	骆驼转债	790	78,996.88	0.00

#### 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

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序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。

#### 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除广发证券（股票代码000776）、国信证券（股票代码002736）、中信证券（股票代码600030）、海通证券（股票代码600837）、招商证券（股票代码600999）、国泰君安（股票代码601211）、兴业证券（股票代码601377）、华泰证券（股票代码601688）外其他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。

#### 1、广发证券（股票代码000776）

根据公司2016年11月28日的公告，公司因未按规定对客户的信息进行审查和了解，未实施有效的了解客户身份的回访、检查等程序未切实防范客户借用证券交易通道违规从事交易活动，受到证监会决定对公司责令改正，给予警告、没收违法所得并处以罚款等处罚。

2017年1月16日，全国股转公司认定公司违反了《非上市公众公司监督管理办法》第二十条、《全国中小企业股份转让系统业务规则（试行）》第1.5条、第1.7条的规定，对公司采取要求提交书面承诺的自律监管措施。

对该股票的投资决策程序的说明：因复制指数被动持有。

#### 2、国信证券（股票代码002736）

2016年6月29日，因公司作为武汉三灵科技产业股份有限公司收购人李江红聘请的财务顾问在《国信证券股份有限公司关于〈武汉三灵科技产业股份有限公司收购报告书〉之财务顾问报告》出具合法合规意见，违反相关规定，全国股转公司决定对公司采取约见谈话、要求提交书面承诺的自律监管措施。

2016年10月27日，因公司在提交的《国信证券股份有限公司关于深圳市捷佳伟创新能源装备股份有限公司尽职调查报告》等申请挂牌文件中存在未充分尽职履责的违规行为，全国股转公司决定对公司给予提交书面承诺的监管措施。

2016年11月30日，因公司在提交的《关于推荐南京臣功制药股份有限公司挂牌申请文件的反馈意见回复》等申请挂牌文件中存在信息披露遗漏的违规行为，全国股转公司决定对公司采取要求提交书面承诺的自律监管措施。

2016年11月2日，深圳证监局下发《深圳证监局关于对国信证券股份有限公司采取责令改正措施的决定》，因公司天津、江苏、青岛等地营业部在开展代销金融产品业务中违反相关规定，并被天津证监局、江苏证监局和青岛证监局责令改正，反映出公司对代销金融产品业务集中统一管理不到位、代销金融产品业务内部控制不完善，深圳证监局对公司采取责令

改正的监管措施。

对该股票的投资决策程序的说明：因复制指数被动持有。

### 3、 中信证券（股票代码600030）

2016年8月23日，全国股转公司查明2016年5月底以前公司在投资者适当性管理过程中，未依据委托代理协议签署日前一交易日日终的投资者名下证券类资产市值判断适当性，决定对公司采取责令改正的自律监管措施。

2017年2月8日，因北京好运街营业部未经公司审批同意擅自在公司官网和“券商中国”微信公众号发布“2016年双11活动宣传推介材料”，宣传推介材料部分表述片面强调收益，违反了《关于加强证券经纪业务管理的规定》相关规定，公司对分支机构合规管理存在缺陷，深圳证监局责令公司立即改正，并决定对公司采取责令增加内部合规检查次数的监督管理措施。

对该股票的投资决策程序的说明：因复制指数被动持有。

### 4、 海通证券（股票代码600837）

根据公司2016年11月28日公告，公司因未按规定对客户的信息进行审查和了解，未实施有效的了解客户身份的回访、检查等程序，在明知客户身份存疑的情况下为客户办理有关手续并且向其他客户推介配资业务，未采取有效措施规范疑似从事配资账户，未切实防范客户借用证券交易通道违规从事交易活动，受到证监会决定对公司责令改正，给予警告、没收违法所得并处以罚款等处罚。

2017年3月10日，全国股转公司查明海通证券在推荐天元宠物挂牌过程中存在天元宠物资金往来未披露事项、关联交易未披露事项，对公司采取要求提交书面承诺的自律监管措施。

对该股票的投资决策程序的说明：因复制指数被动持有。

### 5、 招商证券（股票代码600999）

2017年3月16日，由于公司在2016年12月28日接到全国股转公司电话通知并收到退出为翰博高新材料（合肥）股份有限公司（股票简称：翰博高新，股票代码：833994）股票做市的函后，未按规则要求于当天在全国股转公司官网公告，构成信息披露违规，全国股转公司决定对公司采取约见谈话的自律监管措施。

2017年3月17日，因公司在推荐安徽宣燃天然气股份有限公司挂牌过程中存在信息披露不完整的违规行为，全国股转公司决定对公司采取要求提交书面承诺的自律监管措施。

对该股票的投资决策程序的说明：因复制指数被动持有。

### 6、 国泰君安（股票代码601211）

2016年8月12日，全国股转公司认定公司违反了《全国中小企业股份转让系统业务规则（试行）》第1.7条，决定对公司给予约见谈话并提交书面承诺的监管措施。

2016年8月26日，证监会认定国泰君安在保荐金徽酒首发项目过程中，提交的会后事项承诺函中未如实说明发行人2015年利润分配情况，对发行人实施分红事项，未主动履行告知义务，决定对公司采取出具警示函的行政监管措施。

根据公司2016年12月27日公告，证监会认为公司在开展推荐业务过程中存在多项违规行为，反映出内部控制制度存在一定缺陷。按照相关规定，证监会拟责令公司改正、增加内部合规检查次数并提交合规检查报告。

对该股票的投资决策程序的说明：因复制指数被动持有。

#### 7、兴业证券（股票代码601377）

根据公司2016年7月9日公告，公司因在推荐欣泰电气申请首次公开发行股票并在创业板上市过程中，未审慎核查，受到证监会警告、没收违法所得并处以罚款等处罚。

对该股票的投资决策程序的说明：因复制指数被动持有。

#### 8、华泰证券（股票代码601688）

根据公司2016年11月28日公告，公司因对于杭州恒生网络技术服务有限公司和浙江核新同花顺网络信息股份有限公司外部接入的第三方交易终端软件，或者未进行软件认证许可，或者缺乏有效控制，未对外部系统接入实施有效管理，对相关客户身份情况缺乏了解，受到中国证监会责令改正，给予警告、没收违法所得并处以罚款的处罚。

2017年1月18日，证监会向公司发现公司营业部及资产管理子公司分别利用同名微信公众号、官方网站向不特定对象公开宣传推介私募资产管理产品，决定对公司采取责令改正的行政监督管理措施。

2017年3月28日，全国股转公司查明，公司在提交的《华泰证券股份有限公司关于江苏伊贝实业股份有限公司反馈意见的回复》等申请挂牌文件中存在信息违规行为，决定对华泰证券采取提交书面承诺的自律监管措施。

对该股票的投资决策程序的说明：因复制指数被动持有。

### 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	1,499,365.63
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,765,210.01
5	应收申购款	37,568,471.50
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	40,833,047.14

#### 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

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

##### 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的情况。

### 十三、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
2014.11.13-2014.12.31	16.30%	3.24%	85.82%	4.54%	-69.52%	-1.30%
2015.01.01-2015.12.31	-29.01%	3.49%	-25.93%	3.49%	-3.08%	0.00%
2016.01.01-2016.12.31	-17.91%	2.08%	-17.66%	2.13%	-0.25%	-0.05%
2017.01.01-2017.03.31	-3.46%	0.66%	-3.38%	0.68%	-0.08%	-0.02%
基金成立起至2017.03.31	-34.58%	2.75%	9.49%	2.91%	-44.07%	-0.16%

注：本基金合同生效日为2014年11月13日。

## 十四、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、基金的指数使用费；
- 4、基金上市费用；
- 5、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；
- 6、基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；
- 7、基金份额持有人大会费用；
- 8、基金的证券交易费用；
- 9、基金的银行汇划费用；
- 10、证券账户开户费用、银行账户维护费用；
- 11、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1%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1\% \div \text{当年天数}$$

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，经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起2-5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、基金托管人的基金托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人核

对一致后，由基金托管人于次月首日起2-5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、公休日等，支付日期顺延。

### 3、基金的指数使用费

本基金作为指数基金，需根据与中证指数有限公司签署的指数使用许可协议的约定向中证指数有限公司支付指数使用费。通常情况下，指数使用费按照前一日基金资产净值的0.02%的年费率进行计提，且收取下限为每季人民币5万元（即不足5万元部分按照5万元收取），计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。

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费

E为前一日的基金资产净值

指数使用费每日计算，逐日累计，每季支付一次，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月的前十个工作日内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指数使用费。

4、上述“（一）基金费用的种类”中第3—11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

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，可根据基金运作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、基金托管费率或基金销售费率等费率，须召开基金份额持有人大会审议（法律法规或中国证监会另有规定的除外）；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。

### （六）与基金销售有关的费用

招商中证证券公司份额的申购费用由基金申购人承担，并应在投资者申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

#### 1、招商中证证券公司份额的申购费率

（1）招商中证证券公司份额的场外申购费率根据申购金额设定如下：

申购金额（M）	申购费率
$M < 50$ 万	1.0%
$50 \text{ 万} \leq M < 100 \text{ 万}$	0.5%
$M \geq 100 \text{ 万}$	每笔 300 元

基金管理人可以针对特定投资人（如养老金客户等）开展费率优惠活动，届时将提前公告。

（2）招商中证证券公司份额的场内申购费率由基金代销机构比照场外申购费率执行。

#### 2、招商中证证券公司份额的赎回费率

（1）招商中证证券公司份额的场外赎回费率按基金份额持有人持有该部分基金份额的时间分段设定如下：

持有期限	赎回费率
$N < 1$ 年	0.5%
$1 \text{ 年} \leq N < 2 \text{ 年}$	0.25%
$N \geq 2 \text{ 年}$	0%

（2）招商中证证券公司份额的场内赎回费率为固定0.5%。

招商中证证券公司份额的赎回费用由基金赎回人承担，在投资者赎回基金份额时收取。扣除赎回手续费后的余额归基金财产，赎回费归入基金财产的部分不低于赎回费总额的25%。

基金管理人可以根据基金合同的相关约定调整费率或收费方式,基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前在至少一种指定媒体及基金管理人网站公告。

对特定交易方式(如网上交易、电话交易等),基金管理人履行适当程序后可以调低基金申购费率和基金赎回费率。

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,针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招商中证证券公司份额的申购费率和基金赎回费率。

基金管理人可以针对特定投资人(如养老金客户等)开展费率优惠活动,届时将提前公告。

## 十五、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12月26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“(三)证券投资基金托管情况”、“(四)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)基金份额销售机构”。
- 4、在“十二、基金的投资”部分,更新了“(十二)基金投资组合报告”。
- 5、更新了“十三、基金的业绩”。
- 6、在“二十五、对基金份额持有人的服务”部分,更新了“(三)信息发送服务”。
- 7、更新了“二十六、其他应披露事项”。

招商基金管理有限公司

2017年6月24日