# 招商标普金砖四国指数证券投资基金(LOF)更新的招募说明书摘要

(二零一六年第一号)

重要提示

招商标普金砖四国指数证券投资基金(LOF)(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会2010年9月9日《关于核准招商标普金砖四国指数证券投资基金(LOF)募集的批复》(证监许可字〔2010〕1244号文)核准公开募集。本基金的基金合同于2011年2月11日正式生效。本基金为契约型开放式。

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2016年2月11日,有关财务和业绩表现数据截止日为2015年12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

住所:深圳市福田区深南大道7088号

设立日期:2002年12月27日

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

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、监事及其他高级管理人员介绍:

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。

李俊江,男,经济学博士,教授,博士生导师。历任吉林大学经济学院副院长、德国不莱梅大学客座教授、美国印第安纳大学经济系高级访问学者。现任吉林大学经济学院院长、金融学院院长、社会科学学部学术委员会主任、美国研究所所长。兼任中国世界经济学会副秘书长、中国美国经济学会副秘书长、教育部经济学专业教学指导委员会委员、中共吉林省委决策咨询委员会委员、吉林省政府决策咨询委员会委员等。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——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——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、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; 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。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7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长。

沙骎,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。

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。

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

邓栋,男,中国国籍,工学硕士。2008年加入毕马威华振会计师事务所,从事审计工作,2010年1月加入招商基金管理有限公司,曾任固定收益投资部研究员,招商信用添利债券型证券投资基金(LOF)基金经理(管理时间:2013年9月12日至2015年7月23日),现任固定收益投资部副总监、招商安达保本混合型证券投资基金基金经理 (管理时间:2013年3月9日至今)、招商安润保本混合型证券投资基金基金经理(管理时间:2013年4月19日至今)、招商瑞丰灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理(管理时间:2015年2月12日至今)、招商信用增强债券型证券投资基金基金经理 (管理时间:2015年4月1日至今)、招商丰泰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金经理(管理时间:2015年4月17日至今)、招商丰泽灵活配置混合型证券投资基金基金经理(管理时间:2015年6月11日至今)、招商全球资源股票型证券投资基金基金经理(管理时间:2015年7月3日至今)、招商标普金砖四国指数证券投资基金(LOF)基金经理(管理时间:2015年7月3日至今、招商标普高收益红利贵族指数增强型证券投资基金基金经理(管理时间:2015年7月3日至今)、招商安本增利债券型证券投资基金基金经理(管理时间:2015年7月23日至今)及招商丰融灵活配置混合型证券投资基金基金经理(管理时间:2015年11月17日至今)。

本基金历任基金经理包括:刘冬先生,管理时间为2011年2月11日至2012年8月2日;牛若磊先生,管理时间为2011年12月24日至2015年7月3日。

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、副总经理沙骎、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

1、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

客服电话:95566

传真:(010)66594942

2、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。

3、证券投资基金托管情况

截至2015年12月31日,中国银行已托管418只证券投资基金,其中境内基金390只,QDII基金28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、境外托管人

名称:中国银行(香港)有限公司

住所:香港花园道1号中银大厦

办公地址:香港花园道1号中银大厦

法定代表人:岳毅总裁

成立时间:1964年10月16日

组织形式:股份有限公司

存续期间:持续经营

联系人:黄晚仪 副总经理 托管业务主管

联系电话:852-3982-3753

中国银行(香港)有限公司("中银香港")早于1964年成立,并在2001年10月1日正式重组为中国银行(香港)有限公司,是一家在香港注册的持牌银行。其控股公司-中银香港(控股)有限公司("中银香港(控股)")-则于2001年2日在香港注册成立,并于2002年7月25日开始在香港联合交易所主板上市,2002年12月2日被纳入为恒生指数成分股。中银香港目前主要受香港金管局、证监会以及联交所等机构的监管。

截至2014年12月月底,中银香港(控股)有限公司的总资产超过21,893亿港元,资本总额超过1,815.7亿港元, 总资本比率为17.51%。中银香港的财务实力及双A级信用评级,可以媲美不少大型全球托管银行。中银香港(控股)最新信评如下(截至2014年12月31日):

| | 穆迪投资服务 | 标准普尔 | 惠誉国际评级 |
|---|---|---|---|
| 评级展望 | 稳定 | 稳定 | 稳定 |
| 长期 | Aa3 | A+ | A |
| 短期 | P-1 | A-1 | F1 |
| 展望 | 稳定 | 稳定 | 稳定 |

中银香港作为香港第二大银行集团,亦为三家本地发钞银行之一,拥有最庞大分行网络与广阔的客户基础。

托管服务是中银香港企业银行业务的核心产品之一,目前为超过六十万企业及工商客户提供一站式的全球托管服务。对于服务国内企业及机构性客户 (包括各类QDII及其理财产品等),亦素有经验,于行业处于领先地位,包括于2006年被委任为国内首只银行类QDII产品之境外托管行, 及于2007年被委任为国内首只券商类QDII集成计划之境外托管行等,其业务专长及全方位的配备,令中银香港成为目前本地唯一的中资全面性专业全球托管银行,亦是唯一荣获「亚洲投资人杂志」颁发奖项的中资托管行 (2012年服务提供者奖项 「最佳跨境托管亚洲银行奖」),并在2013年荣获《银行家》( The Banker ) 选为「香港区最佳银行奖」以及财资杂志(The Asset) 颁发资产服务奖项之「最佳QFII托管银行奖」。

截至2014年12日31日止,中银香港(控股)的托管资产规模为7353.28亿港元。

四、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)

招商基金官网交易平台

交易网站:www.cmfchina.com

交易电话: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)66290540

联系人:刘超

招商基金机构理财部

地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦23楼

电话:(0755)83190452

联系人:刘刚

地址:上海市浦东新区陆家嘴东路166号中国保险大厦1601室

电话:(021)68889916-116

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)83064741

联系人:张鹤

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:杨菲

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:刘士余

电话:95599

传真:(010)85109219

联系人:唐文勇

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: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:朱红

8.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

9.代销机构:中国民生银行股份有限公司

注册地址:北京市西城区复兴门内大街2号

法定代表人:洪崎

电话:(010)57092619

传真:(010)58092611

联系人:王继伟

10.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

11.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

12.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

13.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

14.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

15.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

16.代销机构:平安证券有限责任公司

注册地址: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:谢永林

电话:(0755)22621866

传真:(0755)82400862

联系人:吴琼

17.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

18.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

19.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

20.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

21.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

22.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

23.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

24.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

25.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

26.代销机构:光大证券股份有限公司

注册地址:上海市静安区新闸路1508号

法定代表人:薛峰

电话:(021)22169999

传真:(021)22169134

联系人:刘晨

27.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

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:何春梅

电话:(0755)83709350

传真:(0755)83704850

联系人:牛孟宇

29.代销机构:东方证券股份有限公司

注册地址:上海市中山南路318号2号楼22层-29层

法定代表人:潘鑫军

电话:(021)63325888

传真:(021)63326173

联系人:胡月茹

30.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

31.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

32.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

33.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

34.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

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:华福证券有限责任公司(原广发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:021-20655175

传真:021-20655196

联系人:郭相兴

37.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

38.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

39.代销机构:中山证券有限责任公司

注册地址:深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼7层、8层

法定代表人:黄扬录

电话:0755-82570586

传真:0755-82940511

联系人:罗艺琳

40.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18-19楼

法定代表人:朱科敏

电话:021-20333333

传真:021-50498851

联系人:王一彦

41.代销机构:华龙证券有限责任公司

注册地址:兰州市城关区东岗西路638号财富大厦

法定代表人:李晓安

电话:0931-4890208

传真:0931-4890628

联系人:邓鹏怡

42.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

联系人:魏巍

电话:0471-4974437

传真:0471-4961259

43.代销机构:大通证券股份有限公司

注册地址:辽宁省大连市沙河口区会展路129号大连国际金融中心A座-大连期货大厦38、39层

法定代表人:李红光

电话:0411-39991807

传真:0411-39673214

联系人:谢立军

44.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

45.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

46.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

47.代销机构: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

法定代表人:吴永敏

电话:0512-65581136

传真:0512-65588021

联系人:方晓丹

48.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:赵立功

电话:0755-83219194

传真:0755-82545500

联系人:王鹏宇

49.销机构:中信证券(浙江)有限责任公司

注册地址:浙江省杭州市解放东路29号迪凯银座22层

法人代表:沈强

电话:0571-87112507

传真:0571-85713771

联系人:王霈霈

50.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

51.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:028-86690070

传真:028-86690126

联系人:刘一宏

52.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:010-84183311-3142

联系人:张睿

53.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

54.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

55.代销机构:英大证券有限责任公司

注册地址:深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层

法定代表人:吴骏

电话:0755-83007159

传真:0755-83007034

联系人:吴尔晖

56.代销机构:东北证券股份有限公司

注册地址:长春市自由大路1138号

法定代表人:杨树财

联系电话:0431-85096517

传真:0431-85096795

联系人:安岩岩

57.代销机构:华鑫证券有限责任公司

注册地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01(b)单元

法定代表人:洪家新

联系人:陈敏

电话:021-64339000-807

传真:021-64333051

58.代销机构:新时代证券有限责任公司

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

59.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

60.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

电话:0755-23838751

传真:0755-23838751

联系人:吴军

61.代销机构:九州证券有限公司(原天源证券)

注册地址:青海省西宁市长江路53号汇通大厦六楼

法定代表人:林小明

电话:0755-33331188

传真:0755-33329815

联系人:聂晗

62.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

63.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

联系电话:0351-4130322

传真:0351-4130322

联系人:薛津

64.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

65.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

66.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

67.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

68.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:张裕

69.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:王婉秋

70.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:方成

71.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

72.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

73.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

74.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:杨翼

75.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

76.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

77.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

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。

3. 场内销售机构

本基金的场内认购通过深圳证券交易所内具有基金代销业务资格的会员单位(具体名单详见基金份额发售公告或相关业务公告)进行。本基金募集期结束前获得基金代销资格的证券公司也可代理场内基金份额的发售。尚未取得相应业务资格,但属于深圳证券交易所会员的其他机构,可在本基金上市后,代理投资者通过深圳证券交易所交易系统参与本基金的上市交易。

(二)注册登记机构

名称:中国证券登记结算有限责任公司

注册地址:北京西城区太平桥大街17号

法定代表人:周明

电话:(010)59378888

传真:(010)59378888

联系人:朱立元

(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(特殊普通合伙)

注册地址:上海市延安东路222号外滩中心30楼

法定代表人:曾顺福

电话:(021)61418888

传真:(021)63350177

经办注册会计师:陶坚、吴凌志

联系人: 陶坚

五、基金名称:招商标普金砖四国指数证券投资基金(LOF)

六、基金类型:股票型证券投资基金

七、基金的投资目标

本基金采用指数化投资方式,通过投资纪律约束和量化风险管理,力求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。本基金控制目标为基金净值收益率与标的指数收益率之间的年跟踪误差不超过6%。

八、投资方向

本基金主要投资于全球证券市场中具有良好流动性的金融工具, 包括普通股、优先股、存托凭证等权益类证券;银行存款、可转让存单、回购协议、短期政府债券等货币市场工具;政府债券、公司债券、可转换债券等固定收益类证券;以及基金、ETFs、金融衍生品和中国证监会许可的其他金融工具。

本基金为股票型指数基金, 股票等权益类资产的投资比例不低于基金资产的90%, 其中投资于标的指数成份股、备选成份股的资产占基金资产的比例不低于80%。现金及到期日在一年以内的政府债券的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本基金投资其他品种,基金管理人在控制跟踪误差的前提下,在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

在保证流动性的前提下,本基金现金头寸可存放于境内,满足基金赎回、支付管理费、托管费、手续费等需要,并可以投资货币市场工具。

九、基金的投资策略

本基金至少80%以上的资产采用完全复制法进行指数化投资,即按照标准普尔金砖四国40指数成份股及其权重构建指数投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。在因特殊情况导致无法获得足够数量的股票时,基金管理人将采用优化方法构建最优投资组合的个股权重比例,以求尽可能贴近目标指数的表现。

1、股票投资策略

本基金尽可能追求基金资产在股票市场上的充分投资。本基金投资于股票等权益类资产的比例不低于基金资产的90%,其中投资于标的指数成份股、备选成份股的资产占基金资产的比例不低于80%。

(1)股票组合构建原则

本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产占基金资产的比例不低于80%,该部分资产本基金将采取完全复制法复制指数进行投资,即按照标准普尔金砖四国40指数成份股及其权重构建指数投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。

(2)股票组合的构建和调整

本基金在建仓期内,按照标准普尔金砖四国40指数各成份股的基准权重对其逐步买入,在力求跟踪误差最小化的前提下,本基金可采取适当的方法降低买入成本。当遇到以下情况时,本基金管理人可以根据市场的具体情况,对指数投资部分进行适当调整,以便实现对跟踪误差的有效控制:

a)预期标的指数成份股将调整时;

b)标的指数成份股发生分拆、拆股、增发、分红、并购等公司行为时;

c)指数成份股出现流动性问题或者可能发生停牌、退市等情况时;

d)其他影响指数复制的因素。

本基金指数组合的调整按照定期调整和不定期调整的方式进行。

1)定期调整

本基金所构建的指数化投资组合将定期根据所跟踪的标普金砖四国40指数对其成份股的调整而进行相应的跟踪调整。本基金在目标指数成分股定期调整信息公布前一个月内, 根据对调整方案的分析预测以及成分股调整对股价影响的分析,在保持较小跟踪误差的前提下,决定采取提前调整还是事后调整的策略,增持可能进入目标指数的股票,剔除可能被调整出目标指数的股票。并在目标指数成分股定期调整信息公布后一个月内按照调整后的指数成分股及权重构建投资组合。

2)不定期调整

在以下情况出现时,本基金将对指数投资组合进行调整:

a)当成份股发生分拆上市、拆股、增发、分红、并购等情况而影响成份股在指数中权重的行为时,本基金将根据指数公司的指数调整公告及时对指数投资组合进行相应调整;

b)根据本基金的申购和赎回情况,对股票投资组合进行相应调整,从而有效跟踪标的指数;

c)若个别成份股因停牌、流动性不足或受到法规限制等其他因素,使得基金管理人无法按照其所占标的指数的权重进行购买时,基金管理人将综合考虑跟踪误差最小化和投资者利益,决定部分持有现金或买入相关的替代性组合;

d)当成份股退市的,相应成份股从指数计算中剔除,本基金将做相应调整;

e)其他需要调整的事项。

3)跟踪误差的监控与管理

本基金将采取事前预测和事后跟踪分析的方法来控制基金对于基准指数的跟踪效果,主要使用业界通用的指数基金业绩评价标准,即基金日跟踪偏离度和年化跟踪误差,以衡量基金日收益率相对基准指数日收益率的差值以及该差值在一段时间的波动性,控制的目标为追求上述两个评价指标的最小化。

① 事前预测:

每日,基金经理通过公司使用的投资风险模型软件对基金的风险因子和基金的跟踪误差进行估算:

[illegible]

其中,[illegible]是基金的预计跟踪误差,$W_p$是基金组合中个股与比较基准的权重差异,$F_s$ 和$\sum_{FxF}$ 是风险模型软件测算的个股对风险因子的敞口和风险因子的协方差矩阵。基金经理和风险控制部门对基金的跟踪误差进行事前的估算,以确保基金不会在高于基金风险目标的操作运行,并监测主要的风险来源。

② 事后跟踪分析:

(1)每日,基金经理分析基金的跟踪偏离度。

$$d_i = p_i - b_i$$

其中,$d_i$ 是每日跟踪偏离度,$p_i$ 是基金每日价格收益,$b_i$ 是指数每日价格收益。

(2)每月末,基金绩效与风险评估小组对本基金的运行情况进行量化评估。

[illegible]

其中,$\sigma_i$ 是基金最近一年的日跟踪误差,$d_i$ 是每日跟踪偏离度,N是最近一年交易天数。基金的年化跟踪误差$\sum$将根据实际交易的天数进行计算。

基金经理将根据基金业绩和风险评估报告分析当月的投资操作、组合状况和跟踪误差等情况,重点分析基金的偏离度和跟踪误差产生原因、现金控制情况、标的指数成份股调整前后的操作、以及成份股未来可能发生的变化等。

在正常市场情况下,本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年跟踪误差不超过6.0%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围,基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

2、债券投资策略

作为股票型指数基金,本基金的债券投资仅为辅助性投资手段。本基金的债券投资以降低基金的跟踪误差、管理基金的流动性为目的,同时考虑金融衍生品保证金管理的需要,通过采用主动投资策略构建海外债券投资组合,并且个券的选择不限于金砖四国市场。

3、金融衍生产品投资策略

本基金使用金融衍生工具的目的是尽量实现在中国交易日的连续交易,减少指数的跟踪误差,在流动性较差时减少集中交易带来的冲击成本,而不是通过金融衍生工具来投机获利。可以不使用金融衍生工具时,尽量减少衍生工具的使用。任何金融衍生工具的使用将严格遵守指数跟踪的目标。金融工具的初始保证金不超过基金资产的3%,基金运行不使用杠杆操作,即投资组合的杠杆比例最高不超过基金资产的100%。

本基金至少80%以上的资产采用完全复制法来追踪标的指数。然而,考虑到实际投资操作的各种情况,我们将适当参与金融衍生产品的投资,金融衍生品的投资策略主要包括:

(1)利用金融衍生产品的跨市场交易的特点,减少因为限制投资、交易假期和时差对跟踪指数的拖累。

(2)利用金融衍生产品的杠杆作用,减少现金头寸或者某些成份股的交易流动性可能带来的跟踪误差;

(3)利用金融衍生产品来对冲一些外汇市场汇率的波动造成的跟踪误差;

(4)适当利用金融衍生产品组合的持有收益覆盖一定的基金固定费用。

本基金对金融衍生产品的投资将严格遵守法律法规及监管机构的相关规定。

十、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:

标准普尔金砖四国40总收益指数(S&P BRIC 40 Index(Net TR))收益率

十一、基金的风险收益特征

本基金是被动管理的指数型基金,主要投资方向为标普金砖四国40指数的成份股及备选成份股,属于具有较高风险和收益预期的证券投资基金品种,其预期风险与收益水平高于债券型基金和混合型基金。并且,本基金主要投资于以金砖四国为代表的新兴市场,其风险收益水平高于投资于海外成熟市场的基金。

十二、投资组合报告

招商标普金砖四国指数证券投资基金(LOF)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2015年12月31日,来源于《招商标普金砖四国指数证券投资基金(LOF)2015年第4季度报告》。

1、报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(人民币元) | 占基金总资产的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 49,942,768.66 | 92.79 |
| | 其中:普通股 | 29,088,551.49 | 54.05 |
| | 优先股 | - | - |
| | 存托凭证 | 20,854,217.17 | 38.75 |
| | 房地产信托凭证 | - | - |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中:债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| | 其中:远期 | - | - |
| | 期货 | - | - |
| | 期权 | - | - |
| | 权证 | - | - |
| 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 | 货币市场工具 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 2,321,025.61 | 4.31 |
| 8 | 其他资产 | 1,558,660.14 | 2.90 |
| 9 | 合计 | 53,822,454.41 | 100.00 |

2、报告期末在各个国家(地区)证券市场的股票及存托凭证投资分布

| 国家(地区) | 公允价值(人民币元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|
| 香港 | 29,088,551.49 | 55.42 |
| 美国 | 15,128,697.72 | 28.82 |
| 英国 | 5,725,519.45 | 10.91 |
| 合计 | 49,942,768.66 | 95.15 |

3、报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资分布

(1)报告期末指数投资按行业分类的股票及存托凭证投资分布

| 行业类别 | 公允价值(人民币元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|
| 必需消费品 | 2,960,859.22 | 5.64 |
| 非必需消费品 | 1,109,905.59 | 2.11 |
| 材料 | 388,015.13 | 0.74 |
| 工业 | 614,131.18 | 1.17 |
| 保健 | - | - |
| 公用事业 | - | - |
| 电信服务 | 3,882,052.60 | 7.40 |
| 金融 | 21,095,889.33 | 40.19 |
| 能源 | 6,764,358.51 | 12.89 |
| 信息技术 | 13,127,557.10 | 25.01 |
| 合计 | 49,942,768.66 | 95.15 |

注:本基金对以上行业分类采用全球行业分类标准(GICS)。

(2)报告期末积极投资按行业分类的股票及存托凭证投资分布

本基金本报告期末未持有积极投资的权益投资。

4、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及存托凭证投资分布

(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及存托凭证投资分布

| 序号 | 公司名称(英文) | 公司名称(中文) | 证券代码 | 所在证券市场 | 所属国家(地区) | 数量(股) | 公允价值(人民币元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | TENCENT HOLDINGS LTD | 腾讯控股有限公司 | 700 HK | 香港证券交易所 | 香港 | 40,343 | 5,154,280.18 | 9.82 |
| 2 | CHINA CONSTRUC-TION BANK | 中国建设银行股份有限公司 | 939 HK | 香港证券交易所 | 香港 | 1,016,125 | 4,520,345.67 | 8.61 |
| 3 | IND & COMM BK OF CHINA | 中国工商银行股份有限公司 | 1398 HK | 香港证券交易所 | 香港 | 1,140,073 | 4,470,010.08 | 8.52 |
| 4 | CHINA MOBILE LTD | 中国移动有限公司 | 941 HK | 香港证券交易所 | 香港 | 52,957 | 3,882,052.60 | 7.40 |
| 5 | BAIDU INC | - | BIDU US | 纳斯达克全球精选交易所 | 美国 | 2,618 | 3,213,726.28 | 6.12 |
| 6 | INFOSYS TECHNOLO-GIES | - | INFY US | 美国纽约证券交易所 | 美国 | 18,544 | 2,016,990.08 | 3.84 |
| 7 | ALIBABA GROUP HOLDING | - | BABA US | 美国纽约证券交易所 | 美国 | 3,547 | 1,871,875.59 | 3.57 |
| 8 | PING AN INSURANCE GROUP CO | 中国平安保险(集团)股份有限公司 | 2318 HK | 香港证券交易所 | 香港 | 42,248 | 1,521,964.77 | 2.90 |
| 9 | HDFC BANK LTD | - | HDB US | 美国纽约证券交易所 | 美国 | 3,774 | 1,509,621.74 | 2.88 |
| 10 | GAZPROM OAO | - | OGZD LI | 伦敦证券交易所 | 英国 | 56,921 | 1,364,829.98 | 2.60 |

注:以上证券代码采用当地市场代码。

(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及存托凭证投资分布

本基金本报告期末未持有积极投资的权益投资。

5、报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

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五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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。

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金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

9、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

本基金本报告期末未持有基金。

10、投资组合报告附注

(1)本基金本期投资的前十名证券中发行主体未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,处罚的证券。

(2) 本基金投资的前十名股票中, 没有超出基金合同规定的备选股票库的股票。

(3)其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(人民币元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | 1,229,500.17 |
| 3 | 应收股利 | 110,784.52 |
| 4 | 应收利息 | 239.37 |
| 5 | 应收申购款 | 23,328.08 |
| 6 | 其他应收款 | 194,808.00 |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 1,558,660.14 |

(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

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情况。

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

本基金本报告期末未持有积极投资的权益投资。

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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 2011.02.11-2011.12.31 | -26.10% | 1.39% | -19.01% | 1.61% | -7.09% | -0.22% |
| 2012.01.01-2012.12.31 | 9.34% | 1.13% | 13.13% | 1.18% | -3.79% | -0.05% |
| 2013.01.01-2013.12.31 | -3.71% | 1.01% | -1.60% | 1.06% | -2.11% | -0.05% |
| 2014.01.01-2014.12.31 | -5.53% | 1.04% | -3.14% | 1.07% | -2.39% | -0.03% |
| 2015.01.01-2015.12.31 | -6.67% | 1.32% | -6.47% | 1.38% | -0.20% | -0.06% |
| 基金成立起至2015.12.31 | -31.40% | 1.18% | -18.32% | 1.27% | -13.08% | -0.09% |

注:本基金合同生效日为2011年2月11日

十四、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(含境外资产托管人收取的费用);

3、标的指数使用费;

4、因基金的证券交易或结算而产生的费用(包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、权证交易的结算费及其他类似性质的费用等);

5、基金合同生效以后的信息披露费用;

6、基金合同生效以后的会计师费和律师费;

7、基金份额持有人大会费用;

8、基金的资金汇划费用;

9、基金进行外汇兑换交易的相关费用;

10、与基金缴纳税收有关的手续费、汇款费等;

11、基金上市初费和上市年费;

12、按照国家有关规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

基金管理人的基金管理费(如基金管理人委托投资顾问,包括投资顾问费)按基金资产净值的0.8%年费率计提。

在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的0.8%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.8%÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起10个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

2、基金托管人的托管费

基金托管人的基金托管费(如基金托管人委托境外资产托管人,包括向其支付的相应服务费)按基金资产净值的0.25%年费率计提。

在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.25%÷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。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起10个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

3.标的指数使用费

本基金作为指数基金,需根据与指数所有人标准普尔指数公司签署的指数使用许可协议的约定向标准普尔指数公司支付指数使用费。指数使用费自基金合同生效之日起开始计提,按前一日基金资产净值的0.06%年费率计提,且指数使用费收取下限为每年3万美元,即若不足3万美元则按照3万美元收取。

H=E×0.06%÷当年天数

H为每日应计提的指数使用费

E为前一日的基金资产净值

标的指数使用费每日计提,逐日累计。基金合同生效日起及其后的12个月为第一个指数使用费的支付周期,依此类推。基金管理人将于基金合同生效后的45天内支付首个支付周期的指数使用费下限(3万美元),在首个支付周期到期后,若根据上述公式计提的指数使用费大于3万美元, 基金管理人在45天内向基金托管人发送指数使用费划款指令,将超出部分的指数使用费支付给指数所有人。以后各个支付周期的指数使用费支付方法依此类推。

如果指数使用费的计算方法和费率等发生调整,本基金将采用调整后的方法或费率计算指数使用费。基金管理人应及时按照《信息披露管理办法》的规定在指定媒体进行公告。此项调整无需召开基金份额持有人大会。

4、本条第(一)款第4至第12项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定,列入当期基金费用。

(三)不列入基金费用的项目

本条第(一)款约定以外的其他费用,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,以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。

(四)基金费用调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费、基金托管费,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3个工作日予以披露。

(五)税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,依照国家法律法规和境外市场的规定履行纳税义务。

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2015年9月23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的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"四、基金的投资"部分,更新了"(十四)基金投资组合报告"。

2、在"五、基金管理人"部分,更新了"(一)基金管理人概况"、"(二)目前所管理基金的基本情况"、"(三) 主要人员情况"。

3、在"八、基金份额的申购与赎回"部分,更新了"(五)申购与赎回的数额和价格"、"(六)申购与赎回的费用"。

4、更新了"十、基金的业绩"。

5、在"十七、基金的托管人"部分,更新了"(三)证券投资基金托管情况"。

6、在"十九、相关服务机构"部分,更新了"(一)销售机构"、"(二)注册登记机构"、"(四)会计师事务所和经办注册会计师"。

7、更新了"二十三、其他应披露事项"。

招商基金管理有限公司

2016年3月25日

# 关于调整招商现金增值开放式证券投资基金大额申购(含定期定额投资)和转换转入业务限额的公告

公告送出日期:2016年3月25日

1 公告基本信息

| | | | |
|---|---|---|---|
| 基金名称 | | 招商现金增值开放式证券投资基金 | |
| 基金简称 | | 招商现金增值货币 | |
| 基金主代码 | | 217004 | |
| 基金管理人名称 | | 招商基金管理有限公司 | |
| 公告依据 | | 根据法律法规及《招商现金增值开放式证券投资基金基金合同》、《招商现金增值开放式证券投资基金招募说明书》的相关规定。 | |
| 暂停相关业务的起始日、金额及原因说明 | 暂停大额申购起始日 | 2016年3月28日 | |
| | 暂停大额转换转入起始日 | 2016年3月28日 | |
| | 限制申购金额(单位:人民币元) | 30,000,000.00 | |
| | 限制转换转入金额(单位:人民币元) | 30,000,000.00 | |
| | 暂停(大额)申购(转换转入、赎回、转换转出、定期定额投资)的原因说明 | 为了保证基金的平稳运作,维护基金持有人利益。 | |
| 下属分级基金的基金简称 | | 招商现金增值货币A | 招商现金增值货币B |
| 下属分级基金的交易代码 | | 217004 | 217014 |
| 该分级基金是否暂停/恢复(大额)申购(转换转入、赎回、转换转出、定期定额投资) | | 是 | 是 |
| 下属分级基金的限制申购金额(单位:人民币元) | | 30,000,000.00 | 30,000,000.00 |
| 下属分级基金的限制转换转入金额(单位:人民币元) | | 30,000,000.00 | - |

注:暂停大额定期定额投资起始日:2016年3月28日

限制定期定额投资金额:30,000,000.00元。

2 其他需要提示的事项

招商基金管理有限公司(以下简称"本公司")曾于2016年3月15日发布公告,自2016年3月18日起调整招商现金增值开放式证券投资基金(以下简称"本基金")大额申购(含定期定额投资)和转换转入业务的限额,除招商基金网上交易平台以外的其他渠道的客户如单日单笔或累计申请金额超过3000万元, 本基金全部拒绝,招商基金网上交易平台的客户如单日单笔或累计申请金额超过3000万元,本基金有权部分或全部拒绝;为更好地保证基金的平稳运作,维护基金持有人利益,现自2016年3月28日起对本基金暂停大额申购(含定期定额投资)和转换转入业务的内容进行调整,如单日单笔或累计申请金额超过3000万元,本基金有权部分或全部拒绝。

在上述期间的交易日,本基金作为转出方的转换、赎回等其他业务仍照常办理。

如有疑问, 请拨打客户服务热线:400-887-9555 (免长话费), 或登陆网站www.cmfchina.com获取相关信息。

特此公告。

招商基金管理有限公司

2016年3月25日

# 招商基金旗下部分基金增加杭州数米为代销机构的公告

根据招商基金管理有限公司(以下简称"本公司")与杭州数米基金销售有限公司(以下简称"杭州数米")签署的《招商基金管理有限公司旗下开放式基金销售和服务代理协议》及《开放式证券投资基金代理销售补充协议》,自2016年3月25日起杭州数米开始代理以下各基金的账户开户、申购、赎回等业务。

| 基金名称 | 基金代码 |
|---|---|
| 招商丰裕灵活配置混合型证券投资基金A | 001501 |
| 招商丰裕灵活配置混合型证券投资基金C | 001502 |
| 招商制造业转型混合证券投资基金 | 001869 |
| 招商信用添利债券型证券投资基金(LOF) | 161713 |

具体的办理手续请遵循杭州数米的相关规定。各基金原费率请详见基金合同、招募说明书(更新)等法律文件,以及本公司发布的最新业务公告。

投资者可通过以下途径了解或咨询相关情况

| 机构名称 | 网址 | 客服热线 |
|---|---|---|
| 杭州数米基金销售有限公司 | www.fund123.cn | 4000-766-123 |
| 招商基金管理有限公司 | www.cmfchina.com | 400-887-9555 |

风险提示:

(一)投资人应当认真阅读《基金合同》、《招募说明书》等基金法律文件,了解基金的风险收益特征,并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资人的风险承受能力相适应。

(二)本公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。敬请投资人注意投资风险。投资者投资于上述基金前应认真阅读基金的基金合同、更新的招募说明书。

特此公告。

招商基金管理有限公司

2016年3月25日