招商深证100交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）摘要

（2019年第1号）

基金管理人：招商基金管理有限公司
基金托管人：中国银行股份有限公司

重要提示

招商深证100交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会2019年7月22日《关于准予招商深证100交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》（证监许可【2019】1335号文）注册公开募集。

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，中国证监会对基金募集的注册审查以要件齐备和内容合规为基础，以充分的信息披露和投资者适当性为核心，以加强投资者利益保护和防范系统性风险为目标。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。投资者应当认真阅读基金招募说明书、基金合同等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。

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。

基金分为股票型基金、混合型基金、债券型基金、货币市场基金等不同类型，投资人投资不同类型的基金将获得不同的收益预期，也将承担不同程度的风险。一般来说，基金的收益预期越高，投资人承担的风险也越大。本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金。本基金为被动式投资的股票型指数基金，主要采用完全复制策略，跟踪深证100指数（价格），其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%，且不低于非现金基金资产的80%。本基金投资于证券市场，基金份额净值会因为证券市场波动等因素产生波动。投资人在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，并承担基金投资中出现的各类风险。投资本基金可能遇到的风险包括：市场风险、基金管理风险、流动性风险、本基金特有的风险等。本基金的具体风险详见“风险揭示”章节。

本基金可投资国债期货、股指期货等金融衍生品，金融衍生品是一种金融合约，其价值取决于一种或多种基础资产或指数，其评价主要源自于对挂钩资产的价格与价格波动的预期。投资于衍生品需承受市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险和法律风险等。

本基金可投资资产支持证券，资产支持证券是一种固定收益性质的金融工具，其向投资者支付的本息来自于基础资产池产生的现金流或剩余权益。与股票和一般债券不同，资产支持证券不是对某一经营实体的利益要求权，而是对基础资产池所产生的现金流和剩余权益的要求权，是一种以资产信用为支持的证券。资产支持证券存在信用风险、利率风险、提前偿付风险、操作风险和法律风险等。

基金的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。投资人在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》等信息披露文件，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、资产状况等判断本基金是否和自身的风险承受能力相适应。

《基金合同》生效后，基金招募说明书信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新招募说明书，并登载在指定网站上。基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金合同终止的，基金管理人可以不在更新基金招募说明书。

本次更新招募说明书主要根据深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的关于深圳市场ETF结算模式调整业务方案的规定和《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》对相关信息进行了更新，更新截止日为2019年12月5日，除非另有说明，本招募说明书其他所载内容截止日为2019年8月22日。

§1 基金管理人

1.1 基金管理人概况

公司名称：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
设立日期：2002年12月27日
注册资本：人民币13.1亿元
法定代表人：刘辉
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。目前公司注册资本金为人民币十三亿一千万元（RMB1,310,000,000元），股东及股权结构为：招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）持有公司全部股权的55%，招商证券股份有限公司（以下简称“招商证券”）持有公司全部股权的45%。

2002年12月，公司由招商证券、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，成立时注册资本金人民币一亿元，股东及股权结构为：招商证券持有公司全部股权的40%，ING Asset Management B.V.（荷兰投资）持有公司全部股权的30%，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各持有公司全部股权的10%。

2005年4月，经公司股东会审议通过并经中国证监会批复同意，公司注册资本金由人民币一亿元增加至人民币一亿六千万元，股东及股权结构不变。

2007年5月，经公司股东会审议通过并经中国证监会批复同意，招商银行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分别持有的公司10%、10%、10%及3.4%的股权；ING Asset Management B.V.（荷兰投资）受让招商证券持有的公司3.3%的股权。上述股权转让完成后，公司的股东及股权结构为：招商银行持有公司全部股权的33.4%，招商证券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%。同时，公司注册资本金由人民币一亿六千万元增加至人民币二亿一千万元。

2013年8月，经公司股东会审议通过并经中国证监会批复同意，ING Asset Management B.V.（荷兰投资）将其持有的公司21.6%股权转让给招商银行、11.7%股权转让给招商证券。上述股权转让完成后，公司的股东及股权结构为：招商银行持有全部股权的55%，招商证券持有全部股权的45%。

2017年12月，经公司股东会审议通过并经报备中国证监会，公司股东招商银行和招商证券按原有股权比例向公司同比例增资人民币十一亿元。增资完成后，公司注册资本金由人民币二亿一千万元增加至人民币十三亿一千万元，股东及股权结构不变。

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。招商银行始终坚持“因您而变”的经营服务理念，已成长为中国境内最具品牌影响力的商业银行之一。2002年4月9日，招商银行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集团旗下的证券公司，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17日，招商证券在上海证券交易所上市（代码600999）；2016年10月7日，招商证券在香港联合交易所上市（股份代号：6099）。

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。

1.2 主要人员情况

1.2.1主要人员情况

1、董事会成员

刘辉女士，经济学硕士，招商银行股份有限公司行长助理。1995年4月加入招商银行，2010年至2013年担任总行计划财务部副总经理，2013年至2015年担任总行市场风险管理部总经理，2015年至2017年担任总行资产负债管理部总经理兼总行投资管理部总经理，2017年12月起担任总行投行与金融市场总部总裁兼总行资产管理部总经理。2019年4月起担任招商银行行长助理兼招商银行资产管理部总经理，同时兼任招银金融租赁有限公司董事、招银国际金融有限公司董事。现任公司董事长。

邓晓力女士，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）信用风险高级分析师。现任招商证券股份有限公司副总裁，分管招商资产管理有限公司、招商致远资本投资有限公司；兼任中国证券业协会风险控制委员会副主任委员。现任公司副董事长。

金旭女士，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，现任公司副董事长、总经理兼招商资产管理（香港）有限公司董事长。

吴冠雄先生，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，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。

王莉女士，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。

何玉慧女士，加拿大皇后大学荣誉商学士，30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。目前兼任泰康保险集团股份有限公司，汇丰前海证券有限公司及建信金融科技有限公司的独立董事，同时兼任多个香港政府机构辖下委员会及审裁处的成员和香港会计师公会纪律评判小组成员。现任公司独立董事。

孙谦先生，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。

2、监事会成员

赵斌先生，毕业于深圳大学国际金融专业、格林威治大学项目管理专业，分别获经济学学士学位、理学硕士学位。1992年7月至1996年4月历任招商银行证券部员工、福田营业部交易室主任；1996年4月至2006年1月历任招商证券股份有限公司海口营业部、深圳龙岗证券营业部、深圳南山南油大道证券营业部负责人；2006年1月至2016年1月历任招商证券私人客户部总经理、零售经纪总部总经理。赵斌先生于2007年7月至2011年5月担任招商证券职工代表监事，2008年7月起担任招商期货有限公司董事，2015年7月起担任招商证券资产管理有限公司董事。2016年1月至2018年11月，担任招商证券合规总监、纪委书记，2018年11月起担任招商证券副总裁。现任公司监事会主席。

彭家文先生，中南财经大学国民经济计划学专业本科，武汉大学计算机软件专业本科。2001年9月加入招商银行。历任招商银行总行计划资金部经理、高级经理，计划财务部总经理助理、副总经理。2011年11月起任零售综合管理部副总经理、总经理。2014年6月起任零售金融总部副总经理、副总裁。2016年2月起任零售金融总部副总裁兼总行零售信贷部总经理。2017年3月起任招商银行郑州分行行长。2018年1月起任总行资产负债管理部总经理兼投资管理部总经理。现任公司监事。

罗琳女士，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、市场推广部总监，现任首席市场官兼银行渠道业务总部总监、渠道财富管理部总监、公司监事。

鲁丹女士，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战略与人力资源总监兼人力资源部总监、公司监事，兼任招商财富资产管理有限公司董事。

李扬先生，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，现任产品运营官兼产品管理部负责人、公司监事。

3、公司高级管理人员

金旭女士，总经理，简历同上。

钟文岳先生，常务副总经理，厦门大学经济学硕士。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，现任公司常务副总经理兼招商财富资产管理有限公司董事。

沙骏先生，副总经理，南京通信工程学院工学硕士。2000年11月加入宝盈基金管理有限公司，历任TMT行业研究员、基金经理助理、交易主管；2008年2月加入国泰基金管理有限公司，历任交易部总监、研究部总监，投资总监兼基金经理，量化&保本投资事业部总经理；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。

欧志明先生，副总经理，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。

杨渺先生，副总经理，经济学硕士。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。

潘西里先生，督察长，法学硕士。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，现任公司督察长。

4、本基金基金经理介绍

刘重杰先生，大学本科。曾任职于成都商报社、西南财经大学金融数据中心、南京大学金陵学院；2010年7月加入华西期货有限责任公司，历任金融工程部高级研究员、部门负责人；2014年3月加入西南证券股份有限公司，历任衍生品业务岗、平仓处置岗、策略研究岗、投资者教育及培训岗；2017年9月加入招商基金管理有限公司，现任招商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联接基金基金经理（管理时间：2018年5月5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基金经理（管理时间：2018年5月5日至今）、招商深证100交易型开放式指数证券投资基金基金经理（管理时间：2019年11月7日至今）、招商中证红利交易型开放式指数证券投资基金基金经理（管理时间：2019年11月28日至今）。

5、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：副总经理沙骏、总经理助理兼固定收益投资部负责人裴晓辉、总经理助理兼投资管理一部总监王景、副总经理杨渺、基金经理白海峰、固定收益投资部副总监马龙、投资管理四部总监助理付斌。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

§2 基金托管人

2.1 基本情况

公司法定中文名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）
公司法定英文名称：BANK OF COMMUNICATIONS CO.,LTD
法定代表人：彭纯
住　　所：中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号
办公地址：中国（上海）长宁区仙霞路18号
邮政编码：200336
注册时间：1987年3月30日
注册资本：742.63亿元
基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]25号
联系人：陆志俊
电话：95559

交通银行始建于1908年，是中国历史最悠久的银行之一，也是近代中国的发钞行之一。1987年重新组建后的交通银行正式对外营业，成为中国第一家全国性的国有股份制商业银行，总部设在上海。2005年6月交通银行在香港联合交易所挂牌上市，2007年5月在上海证券交易所挂牌上市。根据2018年英国《银行家》杂志发布的全球千家大银行报告，交通银行一级资本位列第11位，连续五年跻身全球银行20强；根据2018年美国《财富》杂志发布的世界500强公司排行榜，交通银行营业收入位列第168位，较上年提升3位。

截至2019年3月31日，交通银行资产总额为人民币97,857.47亿元。2019年1-3月，交通银行实现净利润(归属于母公司股东)人民币210.71亿元。

交通银行总行设资产托管业务中心（下文简称“托管中心”）。现有员工具有多年基金、证券和银行的从业经验，具备基金从业资格，以及经济师、会计师、工程师和律师等中高级专业技术职称，员工的学历层次较高，专业分布合理，职业技能优良，职业道德素质过硬，是一支诚实勤勉、积极进取、开拓创新、奋发向上的资产托管从业人员队伍。

2.2 主要人员情况

彭纯先生，董事长、执行董事，高级会计师。

彭先生2018年2月起任本行董事长、执行董事。2013年11月至2018年2月任本行副董事长、执行董事，2013年10月至2018年1月任本行行长；2010年4月至2013年9月任中国投资有限责任公司副总经理兼中央汇金投资有限责任公司执行董事、总经理；2005年8月至2010年4月任本行执行董事、副行长；2004年9月至2005年8月任本行副行长；2004年6月至2004年9月任本行董事、行长助理；2001年9月至2004年6月任本行行长助理；1994年至2001年历任本行乌鲁木齐分行副行长、行长，南宁分行行长，广州分行行长。彭先生1986年于中国人民银行研究生部获经济学硕士学位。

任德奇先生，副董事长、执行董事、行长，高级经济师。

任先生2018年8月起任本行副董事长、执行董事、行长；2016年12月至2018年6月任中国银行执行董事、副行长，其中：2015年10月至2018年6月兼任中银香港（控股）有限公司非执行董事，2016年9月至2018年6月兼任中国银行上海人民币交易业务总部总裁；2014年7月至2016年11月任中国银行副行长，2003年8月至2014年5月历任中国建设银行信贷审批部副总经理、风险监控部总经理、授信管理部总经理、湖北省分行行长、风险管理部总经理；1988年7月至2003年8月先后在中国建设银行岳阳长岭支行、岳阳市中心支行、岳阳分行，中国建设银行信贷管理委员会办公室、信贷风险管理部工作。任先生1988年于清华大学获工学硕士学位。

袁庆伟女士，资产托管业务中心总裁，高级经济师。

袁女士2015年8月起任本行资产托管业务中心总裁；2007年12月至2015年8月，历任本行资产托管部总经理助理、副总经理，本行资产托管业务中心副总裁；1999年12月至2007年12月，历任本行乌鲁木齐分行财务会计部副科长、科长、处长助理、副处长，会计结算部高级经理。袁女士1992年毕业于中国石油大学计算机科学系，获得学士学位，2005年于新疆财经学院获硕士学位。

2.3 证券投资基金托管情况

截至2019年3月31日，交通银行共托管证券投资基金418只。此外，交通银行还托管了基金公司特定客户资产管理计划、证券公司客户资产管理计划、银行理财产品、信托计划、私募投资基金、保险资金、全国社保基金、养老保障管理基金、企业年金基金、QFII证券投资资产、RQFII证券投资资产、QDII证券投资资产、RQDII证券投资资产和QDLP资金等产品。

§3 相关服务机构

3.1 场内申购、赎回代理机构

3.1.1 直销机构

直销机构：招商基金管理有限公司
招商基金机构业务部
地址：北京市西城区月坛南街1号院3号楼1801
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）38577388
联系人：胡祖望
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）83190401
联系人：任虹虹
招商基金直销交易服务联系方式
地址：深圳市福田区深南大道6019号金润大厦11层招商基金客户服务部直销柜台
电话：（0755）83196359 83196358
传真：（0755）83196360
备用传真：（0755）83199266
联系人：冯敏

3.1.2发售代理机构

基金管理人可以根据相关法律法规要求，选择符合要求的发售代理机构销售本基金，并及时公告。网下现金、网下股票发售代理机构具体名单详见本基金的基金份额发售公告及后续发布的新增发售代理机构公告。

本公司可以根据情况变化增加或减少基金份额发售机构。

3.2 注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司
住所：北京市西城区太平桥大街17号
办公地址：北京市西城区太平桥大街17号
法定代表人：周明
联系电话：（010）59378888
传真：（010）59378907
联系人：朱立元

3.3 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：刘佳、张雯倩
联系人：刘佳

3.4 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
执行事务合伙人：曾顺福
电话：021-6141 8888
传真：021-6335 0177
经办注册会计师：汪芳、侯雯
联系人：汪芳

§4 基金名称

招商深证100交易型开放式指数证券投资基金

§5 基金类型

股票型证券投资基金

§6 投资目标

紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

§7 投资范围

本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股。

为更好地实现基金的投资目标，本基金可能会少量投资于国内依法发行上市的非成份股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、货币市场工具、同业存单、债券回购、资产支持证券、银行存款、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金将根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。

基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%，且不低于非现金基金资产的80%；本基金每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。

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。

§8 投资策略

1、股票投资策略

本基金主要采用完全复制法，即按照标的指数成份股的构成及其权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。如遇特殊情况，例如因成份股发生调整、成份股长期停牌、成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因市场流动性不足时，以及因其他原因导致本基金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，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。

基金管理人每日跟踪基金组合与标的指数表现的偏离度，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。在正常情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%，年跟踪误差不超过2%。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，基金管理人将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

本基金管理人将基于对国内外宏观经济形势的深入分析、国内财政政策与货币市场政策等因素对债券市场的影响，进行合理的利率预期，判断债券市场的基本走势，制定久期控制下的资产类属配置策略。在债券投资组合构建和管理过程中，本基金管理人将具体采用期限结构配置、市场转换、信用利差和相对价值判断、信用风险评估、现金管理等管理手段进行个券选择。本基金债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，降低跟踪误差。

3、资产支持证券投资策略

本基金将在宏观经济和基本面分析的基础上，对资产支持证券标的资产的质量和构成、利率风险、信用风险、流动性风险和提前偿付风险等进行分析，评估其相对投资价值并作出相应的投资决策。

4、股指期货投资策略

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，有选择地投资于流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金在进行股指期货投资时，首先将基于对证券市场总体行情的判断和组合风险收益的分析确定投资时机，并根据风险资产投资（或拟投资）的总体规模和风险系数决定股指期货的投资比例；其次，本基金将在综合考虑证券市场和期货市场运行趋势以及股指期货流动性、收益性、风险特征和估值水平的基础上进行投资品种选择，以对冲风险资产组合的系统性风险和流动性风险。

5、国债期货投资策略

本基金参与国债期货投资是为了有效控制债券市场的系统性风险，本基金将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，适度运用国债期货提高投资组合运作效率。在国债期货投资过程中，基金管理人通过对宏观经济和利率市场走势的分析与判断，并充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置，谨慎进行投资，以调整债券组合的久期，降低投资组合的整体风险。

6、融资及转融通投资策略

本基金将在充分考虑风险和收益特征的基础上，审慎参与融资及转融通证券。本基金将基于对市场行情和组合风险收益的分析，确定投资时机、标的证券以及投资比例。若相关融资及转融通业务法律法规发生变化，本基金将从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。

§9 标的指数与业绩比较基准

本基金的标的指数：深证100指数（价格）
本基金的业绩比较基准：深证100指数（价格）收益率

深证100指数（价格）由深交所市值规模最大、成交最活跃的100家上市公司组成，是深市多层次市场指数体系的核心指数之一，也是中国成长型蓝筹指数的代表。基于本基金的投资目标和投资比例限制，选择该指数收益率作为业绩比较基准，能够真实反映本基金的风险收益特征。

如果指数发布机构变更或者停止上述标的指数编制及发布，或上述标的指数由其他指数代替，或由于指数编制方法等重大变更导致上述指数不宜继续作为标的指数，或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，通过适当的程序变更本基金的标的指数，并同时更换本基金的基金名称与业绩比较基准。

若标的指数变更对基金投资无实质性影响（包括但不限于编制机构变更、指数更名等），则无需召开基金份额持有人大会，基金管理人可在取得基金托管人同意后变更标的指数和业绩比较基准，报中国证监会备案并及时公告。若变更标的指数涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更，则基金管理人应就变更标的指数召开基金份额持有人大会，并报中国证监会备案且在指定媒介公告。

§10风险收益特征

本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金。

本基金为被动式投资的股票型指数基金，主要采用完全复制策略，跟踪深证100指数（价格），其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

§11基金的费用与税收

11.1 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、基金管理人与标的指数供应商签订的相应指数使用许可协议约定的指数许可使用费；
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、诉讼费和仲裁费；
6、基金份额持有人大会费用；
7、基金的证券/期货交易、结算费用；
8、基金的银行汇划费用、账户开户及维护费用；
9、基金上市费及年费；
10、按照国家有关规定和基金合同约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

11.2 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0.20%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×0.20%÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，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、公休日等，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0.10%年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.10%÷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，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5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、基金合同生效后的指数许可使用费

本基金按照基金管理人与标的指数许可方所签订的指数使用许可协议中所规定的指数许可使用费计提方法支付指数许可使用费。指数许可使用费按前一日的基金资产净值的0.03%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.03%÷当年天数
H为每日应计提的指数许可使用费
E为前一日的基金资产净值

指数许可使用费的收取下限为每季度人民币50,000元（大写：伍万圆），计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。

基金合同生效后的指数许可使用费按日计提，逐日累计至每个季季末，按季支付。由基金管理人向基金托管人发送指数许可使用费划付指令，经基金托管人复核后于每年1月，4月，7月，10月首日起3个工作日内将上季度指数许可使用费从基金财产中一次性支付给基金管理人，由基金管理人根据指数使用许可协议所规定的方式支付给标的指数许可方。

如果指数使用许可协议约定的指数许可使用费的计算方法、费率和支付方式等发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算指数使用费，而无需召开基金份额持有人大会。基金管理人应及时按照《信息披露办法》的规定在指定媒介进行公告。

上述“11.1、基金费用的种类”中第4－10项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入或摊入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

11.3 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。

11.4基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。基金财产投资的相关税收，由基金份额持有人承担，基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。

§12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》、《公开募集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2019年8月22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、更新了“重要提示”。
2、更新了“前言”。
3、更新了“释义”。
4、在“基金管理人”部分，更新了“基金管理人的职责”。
5、在“基金份额的申购与赎回”部分，更新了“申购和赎回场所”、“申购与赎回的程序”。
6、在“基金资产估值”部分，更新了“估值方法”，“估值程序”和“基金净值的确认”。
7、在“基金的收益与分配”部分，更新了“收益分配方案的确定、公告与实施”。
8、在“基金的会计与审计”部分，更新了“基金的年度审计”。
9、更新了“基金的信息披露”。
10、在“基金合同的变更、终止与基金财产的清算”部分，更新了“基金财产的清算”、“基金财产清算的公告”。
11、在“《基金合同》的内容摘要”部分，更新了“基金合同当事人及权利义务”，“基金的收益与分配”，“基金资产净值的计算方法和公告方式”，更新了“基金合同的变更、终止和基金财产的清算”。
12、在“《托管协议》的内容摘要”部分，更新了“基金资产净值计算和会计核算”。
13、更新了“招募说明书的存放及查阅方式”。

招商基金管理有限公司
2019年12月6日

招商基金管理有限公司关于旗下部分基金增加苏宁为销售机构的公告

根据招商基金管理有限公司（以下简称“本公司”）与南京苏宁基金销售有限公司（以下简称“苏宁”）签署的基金销售协议，自2019年12月6日起，本公司将增加苏宁为以下基金的销售机构并开通相关业务。投资者欲了解下述基金详细信息请仔细阅读下述基金的基金合同和招募说明书等法律文件。

基金名称	基金代码
招商招旭纯债债券型证券投资基金A	003859
招商招旭纯债债券型证券投资基金C	003860
招商双债增强债券型证券投资基金（LOF）E	003297
招商丰盛稳定增长灵活配置混合型证券投资基金C	002417
招商稳健优选股票型证券投资基金	004784
招商中国机遇股票型证券投资基金	001749
招商丰拓灵活配置混合型证券投资基金A	004932
招商丰拓灵活配置混合型证券投资基金C	004933
招商瑞庆灵活配置混合型证券投资基金A	002574
招商瑞庆灵活配置混合型证券投资基金C	007085
招商盛达灵活配置混合型证券投资基金A	002823
招商盛达灵活配置混合型证券投资基金C	002824
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C	004407
招商丰德灵活配置混合型证券投资基金A	003000
招商丰德灵活配置混合型证券投资基金C	003001
招商金鸡债券型证券投资基金A	006332
招商金鸡债券型证券投资基金C	006333

一、办理场所及业务类型

苏宁可为投资者办理本基金的账户开户、申购、赎回、定投和转换等业务。具体业务类型及办理程序等请遵循苏宁的相关规定。

二、投资者可通过以下途径了解或咨询相关情况

1、苏宁网站：http://fund.suning.com
2、苏宁客服电话：4008365365-9
3、招商基金管理有限公司网站：www.cmfchina.com
4、招商基金管理有限公司客服电话：400-887-9555

三、风险提示

投资者在投资基金前应认真阅读《基金合同》和《招募说明书》等基金法律文件，全面认识基金产品的风险收益特征，在了解产品情况及听取销售机构适当性意见的基础上，根据自身的风险承受能力、投资期限和投资目标，对基金投资作出独立决策，选择合适的基金产品。

基金管理人承诺以诚实信用、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。投资者投资于本基金时应认真阅读上述基金的基金合同、招募说明书等资料。敬请投资者留意投资风险。

特此公告。

招商基金管理有限公司
二〇一九年十二月六日

招商可转债分级债券型证券投资基金可能发生不定期份额折算的提示公告

根据《招商可转债分级债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）关于不定期份额折算的相关规定，当招商可转债分级债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）之招商转债B份额（场内简称：转债进取，交易代码：150189）的基金份额参考净值达到0.450元后，本基金招商转债份额（场内简称：转债分级，基金代码：161719）、招商转债A份额（场内简称：转债优先，交易代码：150188）及招商转债B份额将进行不定期份额折算。

由于近期可转债市场波动较大，截至2019年12月5日，招商转债B份额的基金份额净值接近基金合同规定的不定期份额折算的阀值，在此提请投资者密切关注招商转债B份额近期份额净值的波动情况。

针对不定期折算可能带来的风险，本基金管理人特别提示如下：

一、招商转债A份额、招商转债B份额折算前可能存在折溢交易情形，不定期份额折算后，招商转债A份额、招商转债B份额的折溢价率可能