招商上证消费80交易型开放式指数证券投资基金联接基金更新的招募说明书摘要

（二零一七年第一号）

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

重要提示

投资有风险，投资入认购（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12月8日，有关财务和业绩表现数据截止日为2016年9月30日，财务和业绩表现数据未经审计。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：招商基金管理有限公司

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21亿元

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）83076874

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33%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，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；中信公司对外部国际金融处干部、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；联办投股有限公司董事总经理等。现任公司独立董事。

何玉慧，女，加拿大皇后大学采登商学士，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。

孙凌，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室主任研究员；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，历任招商局集团证券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月任创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人事风险管理工作；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。

杨静，男，中国国籍，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

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、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），招商稳荣定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理（管理时间：2016年10月27日至今）及招商财经大数据策略股票型证券投资基金基金经理（管理时间：2016年11月2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、副总经理杨静、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

1、基金托管人基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号

成立时间：1984年1月1日

法定代表人：易会满

注册资本：人民币35,640,625.71万元

联系电话：010-66105799

联系人：洪渊

2、主要人员情况

截至2016年9月末，中国工商银行资产托管部共有员工210人，平均年龄30岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

3、基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自1998年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、企业年金基金、QFII资产、QDII资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII专户资产、ESCROW等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至2016年9月，中国工商银行共托管证券投资基金624只。自2003 年以来，本行连续十一年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的51项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

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）

招商基金网上交易平台

交易网站：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：陈祥

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）38577378

联系人：秦向东

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：贾晓帆

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：伊泽厦

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：易会满

电话：95588

传真：010-66107914

联系人：杨菲

3.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

4.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

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：江奇勇

6.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

7.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

8.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：王丽

9.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：孙建一

电话：95511-3

传真：（021）50979507

联系人：张莉

10.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

11.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

12.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

13.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：邓鹏

14.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

15.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

16.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

17.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：林炤珊

18.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 68 号

法定代表人：陆向阳

电话：0519-80589939

传真：0519-89995066

联系人：包静

19.代销机构：渤海银行股份有限公司

注册地址：天津市河东区海河东路218号

法定代表人：李伏安

电话：95541

传真：022 5831 6569

联系人：陈玮

20.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

21.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

22.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

23.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

24.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

25.代销机构：平安证券股份有限公司

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

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：财富证券有限责任公司

注册地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22－24层

法定代表人：何如

电话：0755-82130833

传真：0755-82133952

联系人：齐晓燕

30.代销机构：兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路99号

法定代表人：兰荣

电话：（021）38565785

传真：（021）38565955

联系人：谢高得

31.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

32.代销机构：中银国际证券有限责任公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层

法定代表人：许刚

电话：（021）20328000

传真：（021）50372474

联系人：王铁哲

33.代销机构：华福证券有限责任公司

注册地址：福州市五四路157号新天地大厦7、8层

法定代表人：黄金琳

电话：021-20655175

传真：021-20655196

联系人：郭相兴

34.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

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：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

37.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

38.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：刘闯川

39.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

40.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

41.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：权丽

42.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

43.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：祝健忠

电话：010-85556100

传真：010- 85556153

联系人：李慧灵

44.代销机构 ：华融证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区月坛北街 26 号

法定代表人：宋德清

电话：010-58568235

传真：010-58568062

联系人：黄恒

45.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

46.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

47.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

48.代销机构：红塔证券股份有限公司

注册地址：云南省昆明市北京路155号附1号红塔大厦9楼

法定代表人：祝雨林

电话：0871-3577398

传真：0871-3578827

联系人：高国泽

49.代销机构：东兴证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层

法定代表人：徐勇力

电话：010-66555316

传真：010-66555246

联系人：汤漫川

50.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

51.代销机构：西藏同信证券有限责任公司

注册地址：西藏自治区拉萨市北京中路101号

法定代表人：贾绍君

电话：021-36533016

传真：021-36533017

联系人：汪尚斌

52.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

53.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

54.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

55.代销机构：华龙证券股份有限公司

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、0931-8784656

传真：0931-4890628

联系人：范坤、杨力

56.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

57.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：朱冶理

电话：0755-82830333

传真：0755-25161630

联系人：黎元春

58.代销机构：东吴证券股份有限公司

注册地址：苏州工业园区星湖街5号

法定代表人：吴永敏

电话：0512-65581136

传真：0512-65588021

联系人：方晓丹

59.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

联系人：王鹏宇

电话：0755- 83219194

传真：0755-82545500

60.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

61.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

62.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：0755-82028539

联系人：刘毅

63.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：刘靖毅、贾鹏

64.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：张澄

65.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

66.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

67.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：王廷富

电话：400-821-0203

联系人：徐亚丹

网址：http://www.520fund.com.cn/

108.代销机构：上海华信证券有限责任公司

注册地址：上海浦东新区世纪大道100号环球金融中心9楼

法定代表人：郭林

电话：400-820-5999

联系人：陈斌

网址：www.shhxzq.com

109.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

110.代销机构：天津国美基金销售有限公司

注册地址：天津经济技术开发区南港工业区综合服务区办公楼D座二层202-124室

法定代表人：丁东华

电话：400-111-0889

联系人：郭宝亮

网址：www.gomefund.com

111.代销机构：南京途牛金融信息服务有限公司

注册地址：南京市玄武区玄武大道699-1号

法定代表人：宋时琳

电话：400-799-9999

联系人：贺杰

网址：http://jr.tuniu.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：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）83076445

传真：（0755）83196436

联系人：宋宇彬

（三）律师事务所和经办律师

名称：北京市高朋律师事务所

注册地址：北京市朝阳区东三环北路2号南银大厦26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）63235177

经办注册会计师：陶坚、吴凌志

联系人：陶坚

四、基金的名称：招商上证消费80交易型开放式指数证券投资基金联接基金

五、基金类型：指数型开放式

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

七、投资方向

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

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

八、基金的投资策略

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

1、资产配置策略

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

2、目标ETF投资策略

本基金对基金的投资仅限于目标ETF，目前目标ETF仅指上证消费80ETF。

（1）基金组合的构建

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

（2）目标ETF的投资方式

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

（3）基金组合的调整

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

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

3、股票投资策略

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

4、债券投资策略

本基金基于流动性管理及策略性投资的需要，将投资于国债、金融债等期限在一年期以下的债券，债券投资的目的是保证基金资产流动性和有效利用基金资产。

5、其他金融工具投资策略

在法律法规许可时，本基金可基于谨慎原则运用权证、股票指数期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以提高投资效率，管理基金投资组合风险水平，以更好地实现本基金的投资目标。本基金的基金管理人运用上述金融衍生工具必须是出于追求基金充分投资、减少交易成本、降低跟踪误差的目的，不得用于投机交易目的。

6、跟踪误差、跟踪偏离度控制策略

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

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

（二）投资程序

1、投资决策依据

（1）须符合国家有关法律法规，严格遵守基金合同及公司章程；

（2）维护基金份额持有人利益作为基金投资的最高准则。

2、投资程序

（1）投资决策委员会定期召开会议，提出资产配置比例的指导意见；

（2）基金经理根据投资决策委员会的指导意见确定具体的资产配置方案；

（3）基金经理依据目标ETF基金以及目标指数成份股的名单及权重，进行投资组合构建；

（4）基金经理及风险管理部定期对投资组合的偏离度和跟踪误差进行跟踪和评估，并对风险隐患提出预警；

（5）基金经理根据基金的申购赎回等状况，适时进行投资组合调整；

（6）在投资决策过程中，风险管理部负责对各决策环节的事前及事后风险、操作风险等投资风险进行监控，并在整个投资流程完成后，对投资风险及绩效做出评估，提供给投资决策委员会、投资总监、基金经理等相关人员，以供决策参考。

九、业绩比较基准：

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

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

十、投资组合报告：

招商上证消费80交易型开放式指数证券投资基金联接基金管理人－招商基金管理有限公司的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

本投资组合报告所载数据截至2016年9月30日，来源于《招商上证消费80交易型开放式指数证券投资基金联接基金2016年第3季度报告》。

1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例(%)