

(上接B079版)

票投资组合					
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	603260	合盛硅业	1,447,426	35,635,603.60	3.77
2	601088	中国神华	1,872,700	30,412,646.00	3.22
3	601085	中国核电	6,032,354	26,541,477.60	2.81
4	600028	中国石化	5,896,428	25,363,073.18	2.76
5	601288	农业银行	3,696,496	18,804,960.00	2.01
6	600299	招商局	747,560	8,729,279.00	0.92
7	601111	中国国航	687,500	6,475,626.00	0.67
8	601668	邮储银行	796,576	4,126,274.04	0.44
9	600029	南方航空	773,200	3,974,770.00	0.42
10	600741	华域汽车	181,300	3,946,126.00	0.42

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	国债债券	--	--
2	央行票据	--	--
3	金融债券	56,230,500.00	5.94
	其中:政策性金融债	56,230,500.00	5.94
4	企业债券	60,230,000.00	6.38
5	企业短期融资券	180,803,000.00	19.12
6	中期票据	264,611,000.00	27.92
7	可转债(可交换债)	6,287,362.80	0.66
8	同业存单	117,061,000.00	12.38
9	其他	--	--
10	合计	682,762,362.80	72.30

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五名债券投资组合明细					
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	101000222	19 中 农 集 MTN003	500,000	51,100,000.00	5.40
2	101753014	17 开 明 集 MTN005	500,000	50,710,000.00	5.36
3	111005090	10 晋 煤 债 MTN009	500,000	48,690,000.00	5.15
4	101556029	15 橡 维 债 MTN001	400,000	40,432,000.00	4.20
5	200051	20国债01	400,000	40,196,000.00	4.26

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组合明细

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组合明细

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

本基金采取套期保值的方式参与股指期货的投资交易,以管理市场风险和调节股票仓位为主要目的。

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

根据本基金合同规定,本基金不参与国债期货交易。

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

1. 报告期内基金投资的前十名证券除15穗地债MTN001(证券代码101556029)、19建设银行CD090(证券代码1113065090)、19农业银行CD223(证券代码111903223)、19中油股MTN003(证券代码101900222)、20国开01(证券代码200201)、中国神华(证券代码601088)外其他证券的投资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。

1.15 穗地债MTN001(证券代码101556029)

根据发布的相关公告,该证券发行人在报告期内因非法占地、违反法律法规等原因,多次受到监管机构的处罚。

1.19 建设银行CD090(证券代码1113065090)

根据发布的相关公告,该证券发行人在报告期内因违规经营、内部控制不完善、未依法履行职务等原因,多次受到监管机构的处罚。

1.19 农业银行CD223(证券代码111903223)

根据发布的相关公告,该证券发行人在报告期内因违规经营、内部控制不完善、违反反洗钱法、未依法履行职务等原因,多次受到监管机构的处罚。

4.19 中油股MTN003(证券代码101900222)

根据发布的相关公告,该证券发行人在报告期内因违规经营、环境污染、未依法履行职务等原因,多次受到监管机构的处罚。

5.20 国开01(证券代码200201)

根据发布的相关公告,该证券发行人在报告期内因违规经营、未依法履行职务,多次受到监管机构的处罚。

6. 中国神华(证券代码601088)

根据2019年5月31日发布的公告公告,该证券发行人因未依法履行职务被国家税务总局处以补缴税款及罚款。

对上述证券的投资决策程序的说明:本基金投资上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

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	存保证金	26,336.27
2	应收证券清算款	—
3	应收利息	—
4	应收股利	10,360,071.92
5	应收申购款	8,821.82
6	其他应收款	—
7	预付款项	—
8	其他	—
9	合计	10,386,240.01

11.4 报告期末处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110046	海航转债	3,091,346.00	0.30

11.5 报告期末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	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	601056	海航集团	4,126,274.04	0.44	新股锁定

§ 13 基金业绩

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,本基金管理人不能保证基金一定盈利,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。

本基金组合自成立以来的投资业绩及与同期基准的比较如下表所示:

招商瑞丰混合发起式A:

阶段	净值增长	净值增长率	业绩比较基准增长率	业绩比较基准收益差	①-③	②-④
2015.11.19-2015.12.31	0.06%	0.21%	-1.77%	0.21%	-3.27%	-0.05%
2016.01.01-2016.12.31	22.48%	0.27%	36.12%	0.27%	-10.64%	0.00%
2017.01.01-2017.12.31	11.26%	0.07%	5.09%	1.40%	3.26%	-0.02%
2018.01.01-2018.12.31	21.67%	0.13%	-5.70%	0.84%	0.37%	-0.71%
2019.01.01-2019.12.31	8.26%	0.13%	12.29%	0.20%	-4.53%	-0.26%
2020.01.01-2020.12.31	-6.56%	0.06%	-12.89%	0.80%	6.33%	-0.14%
2020.01.01-2019.12.31	36.12%	0.24%	23.06%	0.74%	-6.93%	-0.40%
2020.01.01-2020.03.31	0.36%	0.24%	-4.09%	1.15%	5.26%	-0.01%
自基金成立起至	67.08%	0.40%	56.12%	0.90%	12.96%	-0.42%

注:本基金合同生效日为2013年11月6日。

招商瑞丰混合发起式C:

阶段	净值增长	净值增长率	业绩比较基准增长率	业绩比较基准收益差	①-③	②-④
2015.11.19-2015.12.31	0.36%	0.04%	-1.11%	1.01%	-0.75%	-0.07%
2016.01.01-2016.12.31	20.26%	0.17%	-5.70%	0.84%	7.72%	-0.01%
2017.01.01-2017.12.31	7.73%	0.13%	12.29%	0.20%	-5.06%	-0.26%
2018.01.01-2018.12.31	-7.07%	0.06%	-12.89%	0.80%	5.82%	-0.10%
2019.01.01-2019.12.31	15.58%	0.03%	23.06%	0.74%	-7.47%	-0.29%
2020.01.01-2020.03.31	0.21%	0.24%	-4.09%	1.15%	5.11%	-0.01%
自基金成立起至	18.73%	0.27%	9.63%	0.70%	9.10%	-0.38%

注:本基金自2015年11月18日起新增C类份额,C类份额自2015年11月19日起生效。

§ 14 基金的费用概览

14.1 基金费用的种类

1. 基金管理人的管理费;

2. 基金的销售服务费;

3. 基金托管费;

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事务所、律师费、仲裁费和诉讼费;

6. 基金份额持有人大会费用;

7. 基金的交易费用;

8. 基金的银行汇划费用;

9. 证券账户开户费用、银行账户维护费用;

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。

14.2 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0.60%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×0.60%÷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,逐日累计至每个月月末,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. 基金托管人的托管费

本基金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×0.15%÷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,逐日累计至每个月月末,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。

3. 销售服务费

本基金A类基金份额不收取销售服务费,C类基金份额的销售服务费率为0.50%。本基金销售服务费将专用于本基金的销售与基金份额持有人服务,基金管理人将在基金年度报告中对于该项费用的列支情况作专项说明。销售服务费计提的计算公式如下:

H=E×0.50%÷当年天数

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计算,逐日累计至每个月月末,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。

上述“14.1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约定,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。

14.3 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。

14.4 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日在指定媒介上公告。

14.5 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。

14.6 与基金销售有关的费用

本基金根据销售服务费及赎回费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别,不从本类基金份额资产中计提销售服务费的基金份额,称为A类基金份额;从本类基金份额资产中计提销售服务费的基金份额,称为C类基金份额。

1. 申购费用

本基金申购采用金额申购方式,申购费率如下表。申购费用应在投资人申购基金份额时收取。投资者在一天之内如果有多笔申购,费率按单笔分别计算。

A类基金份额申购费率

申购金额(M)	申购费率
M<100万	1.5%
100万≤M<200万	1.0%
200万≤M<500万	0.6%
M≥500万	每笔1000元

本基金的申购费用由申购人承担,不列入基金资产,用于基金的市场推广、销售、登记等各项费用。

申购费用的计算公式:

净申购金额=申购金额/(1+申购费率)

申购费用=申购金额-净申购金额

申购费用以人民币元为单位,计算结果保留到小数点后第2位,小数点后第3位开始舍去,舍去部分归基金财产。

本基金C类份额不收取申购费用。

2. 赎回费用

本基金A类基金份额的赎回费率按基金份额持有期限递减,费率如下:

连续持有时间(N)	赎回费率
N<7日	1.5%
7日≤N<30日	0.75%
30日≤N<180日	0.5%
180日≤N<365日	0.25%
N≥365日	0%

(注:1指指365天,2年为730天,依此类推)

赎回费用的计算公式:赎回费用=赎回份额×赎回受理当日基金份额净值×赎回费率

赎回费用以人民币元为单位,计算结果保留到小数点后第2位,小数点后第3位开始舍去,舍去部分归基金财产。

赎回费用由赎回A类基金份额的基金份额持有人承担,在基金份额持有人赎回A类基金份额时收取,对C类基金份额持有人收取的赎回费全额计入基金财产。

3. 转换费率

(1) 各基金间转换的总费用包括转出基金的赎回费和申购补差费两部分。

(2) 每笔转换申请的转出基金端,收取转出基金的赎回费,对持续持有期少于7天的投资人收取1.5%的赎回费,对持续持有期少于30日的投资人收取0.75%的赎回费,并将上述赎回费全额计入基金财产;对持续持有期少于30日的投资人收取0.5%的赎回费,并将赎回费总额的75%计入基金财产;对持续持有期长于3个月但少于6个月的投资人收取0.5%的赎回费;对持续持有期长于6个月但少于12个月的投资人收取0.5%的赎回费;对持续持有期长于12个月的投资人,应当将赎回费总额的25%计入基金财产。如法律法规对赎回费的强制性规定发生变动,本基金将按新法规进行修订,不需召开持有人大会。本基金A类基金份额的赎回费率如下表所示:

连续持有时间(N)	赎回费率
N<7日	1.5%
7日≤N<30日	0.75%
30日≤N<180日	0.5%
180日≤N<365日	0.25%
N≥365日	0%

赎回费用由赎回C类基金份额的基金份额持有人承担,在基金份额持有人赎回C类基金份额时收取,对A类基金份额持有人收取的赎回费全额计入基金财产。

4. 基金管理人官网交易平台

www.cmfcchina.com网上交易,详细费率标准或费率标准的调整请查阅官网交易平台及基金管理人公告。

5. 基金管理人可以在履行相关手续后,在基金合同约定的范围内调整申购费率、调低赎回费率或调整收费方式,基金管理人依照有关监管部门规定的费率或收费方式实施日前在指定媒介上公告。

6. 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况下根据市场情况制定基金促销计划,针对基金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,基金管理人可以按中国证监会要求履行必要手续后,针对基金投资者适当调低基金销售费用,并不同于优惠活动的实施公告。

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

§ 15 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2020年2月28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. 在“基金管理人”部分,更新了“基金管理人概况”,更新了“主要人员情况”;

3. 在“基金托管人”部分,更新了“基本情况”,更新了“证券投资基金托管情况”;

4. 在“相关服务机构”部分,更新了“基金份额销售机构”,更新了“会计师事务所和经办注册会计师”;

5. 在“基金份额的申购、赎回及转换”部分,更新了“申购、赎回及转换的有关限制”;

6. 在“基金的投资”部分,更新了“基金投资组合报告”;

7. 更新了“基金的业绩”;

8. 在“基金托管协议的内容摘要”部分,更新了“托管协议当事人”;

9. 更新了“其他应披露事项”。

招商基金管理有限公司

2020年6月17日

关于开放招商深证100交易型开放式指数证券投资基金联接基金日常申购赎回及转换和定期定额投资业务的公告

公告送出日期:2020年6月17日

1. 公告基本信息

基金名称	招商深证100交易型开放式指数证券投资基金联接基金
基金简称	招商深证100ETF联接
基金代码	002029
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020年6月12日
基金管理人名称	招商基金管理有限公司
基金托管人名称	交通银行股份有限公司
基金注册登记机构名称	招商基金管理有限公司

《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》以及《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“基金合同”)、《招商深证100交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》(以下简称“招募说明书”)

申购赎回日期:2020年6月18日

赎回赎回日期:2020年6月18日

转换转换日期:2020年6月18日

定期定额投资起始日:2020年6月18日

下属基金基金名称简称

招商深证100ETF联接A

招商深证100ETF联接C

招商深证100ETF联接E

招商深证100ETF联接F

招商深证100ETF联接G

招商深证100ETF联接H</