

(上接 C92 版)	注册地址:上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦 8 楼 办公地址:上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦 8 楼 联系人:李海婧 电话:021-68757102/13681957466 传真:021-68757102 网址:www.qh168.com.cn 客服电话:0551-40908888
东方财富证券股份有限公司	注册地址:上海市浦东新区东方路 88 号 9 楼 15 楼 1609 办公地址:上海市浦东新区世纪大道 88 号 5000 楼 15 楼 C1809 法定代表人:陈兵 电话:021-52341385 联系人:董晓 统一客服电话:400-6999-200 公司网站地址:www.eastfund.com
宜信普泽投资顾问(北京)有限公司	注册地址:深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 40-42 层 办公地址:深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 40-42 层 法定代表人:李海婧 电话:021-68757102/13681957466 传真:021-68757102 网址:www.qh168.com.cn 客服电话:0551-40908888
世纪证券有限责任公司	注册地址:上海市虹口区四川中路 100 号 10 楼 1010 室 办公地址:上海市虹口区四川中路 100 号 10 楼 1010 室 法定代表人:李海婧 电话:021-68757102/13681957466 传真:021-68757102 网址:www.qh168.com.cn 客服电话:0551-40908888
伊诺财富基金销售有限公司	注册地址:辽宁省大连市沙河口区星海广场 3 号 办公地址:辽宁省大连市沙河口区星海广场 3 号 法定代表人:李海婧 电话:021-68757102/13681957466 传真:021-68757102 网址:www.qh168.com.cn 客服电话:0551-40908888
上海晨星基金销售有限公司	注册地址:上海市浦东新区世纪大道 526 号 2 楼 220 室 办公地址:上海市浦东新区世纪大道 526 号 2 楼 220 室 法定代表人:李海婧 电话:021-68757102/13681957466 传真:021-68757102 网址:www.qh168.com.cn 客服电话:0551-40908888
上海长量基金销售有限公司	注册地址:上海市浦东新区世纪大道 526 号 2 楼 220 室 办公地址:上海市浦东新区世纪大道 526 号 2 楼 220 室 法定代表人:李海婧 电话:021-68757102/13681957466 传真:021-68757102 网址:www.qh168.com.cn 客服电话:0551-40908888
上海国金基金销售有限公司	注册地址:上海市浦东新区世纪大道 526 号 2 楼 220 室 办公地址:上海市浦东新区世纪大道 526 号 2 楼 220 室 法定代表人:李海婧 电话:021-68757102/13681957466 传真:021-68757102 网址:www.qh168.com.cn 客服电话:0551-40908888
蚂蚁(杭州)基金销售有限公司	注册地址:浙江省杭州市文二西路 1 号 903 室 办公地址:浙江省杭州市文二西路 1 号 903 室 法定代表人:李海婧 电话:021-68757102/13681957466 传真:021-68757102 网址:www.qh168.com.cn 客服电话:0551-40908888
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 办公地址:北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号 法定代表人:李海婧 电话:021-68757102/13681957466 传真:021-68757102 网址:www.qh168.com.cn 客服电话:0551-40908888
德邦证券股份有限公司	注册地址:上海市浦东新区世纪大道 526 号 2 楼 220 室 办公地址:上海市浦东新区世纪大道 526 号 2 楼 220 室 法定代表人:李海婧 电话:021-68757102/13681957466 传真:021-68757102 网址:www.qh168.com.cn 客服电话:0551-40908888
德邦证券股份有限公司	注册地址:上海市浦东新区世纪大道 526 号 2 楼 220 室 办公地址:上海市浦东新区世纪大道 526 号 2 楼 220 室 法定代表人:李海婧 电话:021-68757102/13681957466 传真:021-68757102 网址:www.qh168.com.cn 客服电话:0551-40908888
德邦证券股份有限公司	注册地址:上海市浦东新区世纪大道 526 号 2 楼 220 室 办公地址:上海市浦东新区世纪大道 526 号 2 楼 220 室 法定代表人:李海婧 电话:021-68757102/13681957466 传真:021-68757102 网址:www.qh168.com.cn 客服电话:0551-40908888
德邦证券股份有限公司	注册地址:上海市浦东新区世纪大道 526 号 2 楼 220 室 办公地址:上海市浦东新区世纪大道 526 号 2 楼 220 室 法定代表人:李海婧 电话:021-68757102/13681957466 传真:021-68757102 网址:www.qh168.com.cn 客服电话:0551-40908888
德邦证券股份有限公司	注册地址:上海市浦东新区世纪大道 526 号 2 楼 220 室 办公地址:上海市浦东新区世纪大道 526 号 2 楼 220 室 法定代表人:李海婧 电话:021-68757102/13681957466 传真:021-68757102 网址:www.qh168.com.cn 客服电话:0551-40908888
德邦证券股份有限公司	注册地址:上海市浦东新区世纪大道 526 号 2 楼 220 室 办公地址:上海市浦东新区世纪大道 526 号 2 楼 220 室 法定代表人:李海婧 电话:021-68757102/13681957466 传真:021-68757102 网址:www.qh168.com.cn 客服电话:0551-40908888
德邦证券股份有限公司	注册地址:上海市浦东新区世纪大道 526 号 2 楼 220 室 办公地址:上海市浦东新区世纪大道 526 号 2 楼 220 室 法定代表人:李海婧 电话:021-68757102/13681957466 传真:021-68757102 网址:www.qh168.com.cn 客服电话:0551-40908888
德邦证券股份有限公司	注册地址:上海市浦东新区世纪大道 526 号 2 楼 220 室 办公地址:上海市浦东新区世纪大道 526 号 2 楼 220 室 法定代表人:李海婧 电话:021-68757102/13681957466 传真:021-68757102 网址:www.qh168.com.cn 客服电话:0551-40908888
德邦证券股份有限公司	注册地址:上海市浦东新区世纪大道 526 号 2 楼 220 室 办公地址:上海市浦东新区世纪大道 526 号 2 楼 220 室 法定代表人:李海婧 电话:021-68757102/13681957466 传真:021-68757102 网址:www.qh168.com.cn 客服电话:0551-40908888
德邦证券股份有限公司	注册地址:上海市浦东新区世纪大道 526 号 2 楼 220 室 办公地址:上海市浦东新区世纪大道 526 号 2 楼 220 室 法定代表人:李海婧 电话:021-68757102/13681957466 传真:021-68757102 网址:www.qh168.com.cn 客服电话:0551-40908888
德邦证券股份有限公司	注册地址:上海市浦东新区世纪大道 526 号 2 楼 220 室 办公地址:上海市浦东新区世纪大道 526 号 2 楼 220 室 法定代表人:李海婧 电话:021-68757102/13681957466 传真:021-68757102 网址:www.qh168.com.cn 客服电话:0551-40908888
德邦证券股份有限公司	注册地址:上海市浦东新区世纪大道 526 号 2 楼 220 室 办公地址:上海市浦东新区世纪大道 526 号 2 楼 220 室 法定代表人:李海婧 电话:021-68757102/13681957466 传真:021-68757102 网址:www.qh168.com.cn 客服电话:0551-40908888
德邦证券股份有限公司	注册地址:上海市浦东新区世纪大道 526 号 2 楼 220 室 办公地址:上海市浦东新区世纪大道 526 号 2 楼 220 室 法定代表人:李海婧 电话:021-68757102/13681957466 传真:021-68757102 网址:www.qh168.com.cn 客服电话:0551-40908888

上海有鱼基金销售有限公司	注册地址:中国(上海)自由贸易试验区浦电路 2123 号 3 层 办公地址:中国(上海)自由贸易试验区浦电路 2123 号 3 层 法定代表人:林海婧 电话:021-68757102/13681957466 联系人:李海婧 公司网站:www.youyufund.com
北京慧信基金销售有限公司	注册地址:北京市朝阳区望京乡望花桥 10 号楼 办公地址:北京市朝阳区望京乡望花桥 10 号楼 法定代表人:林海婧 电话:021-68757102/13681957466 联系人:李海婧 公司网站:www.huixin.com.cn
腾安基金销售有限公司(深圳)有限公司	注册地址:深圳市福田区福安社区-福安大厦 11 楼 办公地址:深圳市福田区福安社区-福安大厦 11 楼 法定代表人:林海婧 电话:021-68757102/13681957466 联系人:李海婧 公司网站:www.tengan.com.cn
北京恒天明泽基金销售有限公司	注册地址:北京市丰台区科技园路 16 号院 1 号楼 1 层 5122 室 办公地址:北京市丰台区科技园路 16 号院 1 号楼 1 层 5122 室 法定代表人:林海婧 电话:021-68757102/13681957466 联系人:李海婧 公司网站:www.hengming.com.cn
济财财富(北京)基金销售有限公司	注册地址:北京市西城区永定门内大街 16 号院 1 号楼 3 层 307 单元 办公地址:北京市西城区永定门内大街 16 号院 1 号楼 3 层 307 单元 法定代表人:林海婧 电话:021-68757102/13681957466 联系人:李海婧 公司网站:www.jicai.com.cn
民生基金销售有限公司	注册地址:上海市浦东新区北京东路 666 号 H1 区(东楼)36 楼 A31 室 办公地址:上海市浦东新区北京东路 666 号 H1 区(东楼)36 楼 A31 室 法定代表人:林海婧 电话:021-68757102/13681957466 联系人:李海婧 公司网站:www.msh.com.cn
上海大智慧基金销售有限公司	注册地址:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路 428 号 1 号楼 1102 单元 办公地址:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路 428 号 1 号楼 1102 单元 法定代表人:林海婧 电话:021-68757102/13681957466 联系人:李海婧 公司网站:www.wisdom.com.cn
北京百盈基金销售有限公司	注册地址:北京市朝阳区望京乡望花桥 10 号楼 1 层 101 室 办公地址:北京市朝阳区望京乡望花桥 10 号楼 1 层 101 室 法定代表人:林海婧 电话:021-68757102/13681957466 联系人:李海婧 公司网站:www.baiying.com.cn
阳光人寿保险股份有限公司	注册地址:海南省三亚市崖州区 360-1 号三亚阳光金融广场 1 层 办公地址:海南省三亚市崖州区 360-1 号三亚阳光金融广场 1 层 法定代表人:林海婧 电话:021-68757102/13681957466 联系人:李海婧 公司网站:www.yangliao.com.cn
江苏汇林大鑫基金销售有限公司	注册地址:南京市建邺区江东中路 288 号 8 楼 办公地址:南京市建邺区江东中路 288 号 8 楼 法定代表人:林海婧 电话:021-68757102/13681957466 联系人:李海婧 公司网站:www.huilin.com.cn
华瑞锦华销售有限公司	注册地址:上海市浦东新区世纪大道 526 号 2 楼 220 室 办公地址:上海市浦东新区世纪大道 526 号 2 楼 220 室 法定代表人:林海婧 电话:021-68757102/13681957466 联系人:李海婧 公司网站:www.huairui.com.cn
友邦保险代理有限公司	注册地址:中国(上海)自由贸易试验区张杨路 707 号 1105 室 办公地址:中国(上海)自由贸易试验区张杨路 707 号 1105 室 法定代表人:林海婧 电话:021-68757102/13681957466 联系人:李海婧 公司网站:www.youbon.com.cn
世纪证券有限责任公司	注册地址:上海市浦东新区世纪大道 526 号 2 楼 220 室 办公地址:上海市浦东新区世纪大道 526 号 2 楼 220 室 法定代表人:林海婧 电话:021-68757102/13681957466 联系人:李海婧 公司网站:www.qh168.com.cn 客服电话:0551-40908888
新财富基金销售有限公司(大连)有限公司	注册地址:辽宁省大连市沙河口区星海广场 3 号 办公地址:辽宁省大连市沙河口区星海广场 3 号 法定代表人:林海婧 电话:021-68757102/13681957466 联系人:李海婧 公司网站:www.xincaifu.com.cn

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。

3.2 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:刘辉

电话:(0755)83196445

传真:(0755)83196436

联系人:宋宇彬

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

法定代表人(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

名称:勤勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)

注册地址:上海市延安路 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)6141 8888

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 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

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,获得与标的指数的投资收益相接近的回报。本基金的风险控制目标是追求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%。

7. 投资范围

本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市股票、债券、货币市场工具、权证及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金股票等权益类资产的投资比例为基金资产的 85%-95%,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、债券等固定收益类资产的投资比例为基金资产的 5%-15%,其中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%,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

8. 投资策略

1. 资产配置策略

本基金股票等权益类资产的投资比例为基金资产的 85%-95%,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、债券等固定收益类资产的投资比例为基金资产的 5%-15%,其中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%,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

2. 股票投资策略

本基金采用复制法构建股票投资组合,即按照深证 100 指数成份股及权重构建投资组合,并根据指数成份股及其权重的变动进行相应调整。

本基金在建仓期内,按照深证 100 指数成份股的权重对其逐步买入,在力求跟踪误差最小化的前提下,本基金可以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,以便更有效地跟踪标的指数:

a) 预期标的指数的成份股将调整;

b) 标的指数的成份股发生配股、增发、分红等情况;

c) 指数成份股出现停牌限制、流动性问题等情况;

d) 其他影响跟踪误差的因素。

本基金将根据通过控制跟踪误差等指标,按照定期调整和不定期调整的方式进行组合调整。

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深证 100 指数对其成份股的跟踪而进行相应的跟踪调整。深证 100 指数的成份股的定期调整将于每年 1 月和 7 月的第一个交易日当天实施,调整前一年的 12 月 31 日或前一年的 6 月的第二个完整交易日的第一个交易日提前公布样本调整清单。

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) 新上市股票,若前 5 个交易日平均流通市值在指数成份股选择空间中排名位于前 10%之内,则于上市 15 个交易日后调入成份股,同时从指数中剔除市值最小的原成份股,本基金将做相应调整;

b) 当成份股暂停或终止上市的,相应成份股从指数计算中剔除,本基金将做相应调整;

c) 当成份股发生增发、送配或回购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在股权登记公告日发布的临时调整决定及其需调整的股权比重,进行相应调整;

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

e) 若个别成份股停牌、流动性不足或法规限制等因素,使得基金管理人无法按照其占标的指数权重进行购买时,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资产;

f) 其他需要调整的事项。

3. 跟踪误差的监控与管理

本基金采用“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二级监控体系,即分别建立以 3%与 4%为阈值的跟踪误差,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散获取有效的降低跟踪误差的组合调整方法,以求有效制投资组合相对于目标指数的偏离风险。

本基金跟踪误差的监控目标为: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 0.35%,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。

4. 债券投资策略

本基金债券投资为在跟踪误差与流动性风险双重约束下的投资。本基金将以降低基金跟踪误差为目的,在考虑流动性风险的前提下,构建债券投资组合。本基金债券投资组合将采用自上而下的投资策略,根据宏观经济分析、资金面动向分析等判断未来利率变化,并利用债券定价技术,进行个券选择,同时着重考虑基金的流动性管理需要配置策略。

4. 金融衍生品投资策略

本基金投资金融衍生产品,主要采用市场公认的定价模型进行定价。

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。

9. 投资程序

(一) 符合有关法律法规,严格遵守基金合同及公司章程;

(二) 维护基金份额持有人利益作为基金投资的首要原则;

2. 投资决策

(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制定具体的资产配置方案;

(3) 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;

(4) 基金跟踪误差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) 基金经理根据跟踪误差及权重变化情况、基金申购赎回情况、指数成份股跟踪误差等,适时进行投资组合调整;

在投资决策过程中,风险管理部负责对投资决策环节的合规性和事后跟踪、操作风险等投资进行监控,并在整个投资流程完成后,对投资绩效和风险做出评估,提供投资绩效评估、投资总结、基金跟踪等相关文件,以供决策参考。

10. 业绩比较基准

本基金业绩比较基准:深证 100 指数收益率×95%+商业银行活期存款利率(税后)×5%。

如果深证 100 指数被停止编制及发布,或深证 100 指数由其他指数替代(单纯更名除外),或由于指数编制方法等重大变更导致深证 100 指数不宜继续作为业绩比较基准,本基金管理人可以依据审慎性原则和维护基金份额持有人合法权益的原则,变更本基金的业绩比较基准。

本基金由于上述原因变更业绩比较基准,基金管理人需报中国证监会核准后,应于正式实施变更前 2 日内在指定媒介上予以公告。

11. 风险提示

本基金属于股票型证券投资基金,在证券投资基金中属于较高风险、较高收益的品种,本基金主要采用指数复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数相似的风险收益特征。

12. 投资组合报告

招商深证 100 指数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 2019 年 3 月 31 日,来源于《招商深证 100 指数证券投资基金 2019 年第 1 季度报告》。

1. 报告期末基金资产组合情况

真实性、准确性和完整性承担个别及连带保证责任。

本报投资组合报告所载数据截至 2019 年 3 月 31 日,来源于《招商深证 100 指数证券投资基金 2019 年第 1 季度报告》。

一、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	85,502,613.28	93.7
	其中:股票	85,502,613.28	93.7
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	-	-
	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	5,110,580.91	5.6
8	其他资产	628,913.38	0.6
9	合计	91,242,107.57	100.0