信息披露DISCLOSURE

(上接 C92 版) 注册地址:上海市浦东新区东方路 1928 号东海 か会地址:上海市浦东新区东方路 1928 号京海 か会地址:上海市浦东新区东方路 1928 号 接近代表人海太正 展表:東京和 电话の21-6875710/21/3681957646 (梅真元 開始:www.gh168.com.cn 客観息:955311/4088895888 注册地址:北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 か会地址:北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 か会地址:北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 か会地址:北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 から地址:北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 から間が地址:北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 から地址:北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 から地址:北京市朝阳区建田路 88 号 9 号楼 15 から地址:北京市朝阳区建田路 88 号 9 号楼 15 から地址:北京市朝阳区建田路 88 号 9 号楼 15 から地址:北京市南阳区建田路 88 号 9 号楼 15 から地址:北京市南阳区建田路 88 号 9 号楼 16 北京市南阳区建田路 88 号 9 号楼 16 北京市南阳区建田路 88 号 9 号楼 16 北京市南田区 88 号 9 号楼 16 北京市南田区 88 号 9 号楼 16 北京市南田区 88 号 9 号 16 北京市南田田区 88 号 9 号 16 北京市南田田区 88 号 9 号 18 北京市南田田区 88 号 18 北京市南田区 88 号 18 北京市南田田区 88 号 18 北京市南田区 88 号 18 北京市南田田区 88 号 18 北京市南田区 88 号 18 北京市南田田区 88 号 18 北京市南田区 88 号 18 北京市南田区 88 号 18 北京市南田区 88 号 18 北京市南田田区 88 号	证券大厦 8 楼 东海证券大厦 8 楼
在放代表人孫太康 蘇高·美子用 电话。21-68757102/15681957646 传真,无 网丝www.d168.com.cn 客學起言,95331/4068885888 注册地址,北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 力分便性,北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 力分便性,北京市朝阳区建国路 88 号 5 COH 电流00-2541386 传真100-2542386 埃洛原地區;400-609-200 公司局站地址,www.yianfund.com 注册地址,深刻市福田区湾市大道 7088 号招商	东海业乔大厦8楼
注册地址,北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 办公地址,北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 办公地址,北京市朝阳区建国路 88 号 SOH 建址代表人,建成 电话,010-52413385 传系,010-83894285 聚长人,报偿 处一条报电话,400-6099-200 公司网络地址,www.ysmfund.com 注册地址,探圳市福田区深南大道 7088 号报商	
公司网站地址;www.yixinfund.com 注册地址;深圳市福田区深南大道 7088 号招商	
办金地上深刻市福田区落南大道 7088 号程 程在代表人,蒙昧军 联系人,王肇	银行大厦 40-42 层 招商银行大厦 40-42
电话。(755—83199599) 传来。(755—83199545) 使一彩雕电话。(4063232000 公司阿站地止,www.csco.com.cn 注册地址;辽宁省大准市沙河口区是海中龙园 办公地上,江宁省大准市沙河口区是海中龙园	3号 2回3号
	20 室
上海长量基金销售投资期间有限公司 电话:400~820~2899 传真:021-58737698 蒙杀人妻珍 注册地址:展到市罗湖区深南东路 5047 号发展:	銀行大厦 25 楼 I.J
學元 在世代表人,薛峰 电话:0755-33227950 传班:0755-82060798 要素人,重素學 注册地址:杭州市余杭区仓前街道海曙路东 2 号	<u>.</u>
郵収(軟州)基金銅售有限公司 ・ ・ ・ ・ ・ ・ ・ ・ ・ ・	
	号 205 室
适亚正行(上海)基金销售投资期间有限公司 也活:400~821~5399 传挥:(021)38589777 联系人:年期 注册地址;上海市虹口区场中路 685 弹 37 号 4:	号楼 449 室
上海籽买基金销售有限公司	1 幢 11 层
	层
上海天天基金销售有限公司 电话,400~1818—188 传真,021~64385308 京系人,通世友 注册地址,北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大	夏 10 层
起世代表人,王莉 电话,400~9200—022 传海,1075~82029055 联系人,延同時 注册地址,新江省杭州市文二西路一号元茂大原	₹ 903 室
遊址代表人。漫順学 电抗6571-8891181 传英,6571-8890123 原本人。如学 注册地址,上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号	14 楼 09 单元
上海路金所基金销售有限公司	号 3 层 310 室
上海菜奉资产管理有限公司 电点: 400~046~6788 增长(2): 2-5275279 菜香人, 透枝柱 注册能上:北市前阳区工人体育场北路甲 2 号 进证代表人, 海板柱	· 裙房 2 层 222 单元
北京紅点基金網售有限公司 电话-400-068-1176 传统-100-5588660 联系人工等等 注册地上探討相關区华强北路赛格科技图 4 进工代表人,体部	株 10 层 1006#
深刻市新兰德证券投资咨询有限公司 电话-400-166-1188 传典,410-8334072 联系人,文要 往册她:深知市前海海洛合作区前湾一路 1 位 进忙表人,刘鹏宇	FA栋 201 室
探測當游財富管理有限公司 电话。(755~83999913 传表。(755~8399926 联系人: 施弗本 注册地址:上海市浦滨新区世纪大道 8 号上海巨 46 层 400-710 单元	1金中心办公楼二期
臺玄財富管理有限公司 电话-400-021-8850 联系人:余注 	105 室 -3491
法定代表人, 自要 电话, 2003—806, 2006 联系人, 刘文红 网性, www.yingmi.cn 注册地址, 上海市中山南路 100 号金外滩国际/	- 场 19 楼
上海汇付金融服务有限公司	场 2 楼
注定代表人。李兴春 电信:400~921~7755 联系人: 注意简 网出: www.leadind.com.cn 注册地址:深圳市前海深路合作区:前旁-路 1* 注定代表人:TAN YIK KUAN	号 A 栋 201 室
南京东宁基金销售有限公司 电话-05-6699-6699-887226 联系人:王锋 网性:http://find.stming.com 注册地址:北京市高碇区北空环西路 58 号 906 法定代表人,不就	
北京新茂仓石基金销售有限公司	
北京校原财富投資管理有限公司 电话-400-893-6885 聚长、28.89 廃址: http://www.qinnjing.com/ 注册地址:北京中幕阳区最继东大街 1 号院 6 * 22507-18-18 4 小田市 4 小	号楼 2 单元 21 层
北京集卷基金销售有限公司 地方。4000—6185—188 联系人:前982题 開肚:由pt://www.adj.com/ 注册:地址:中国C上海/自由贸易试验区福山路: 法定代表人工基础	33号11楼B座
上离万得投资则向有限公司 电压-40-323 联系人-622 1-2033 联系人-622 1-2033 联系人-622 1-2033 联系人-622 1-2033 联系人-622 1-2033 1-203 1-2	企融中心9楼
上海华信证券有限责任公司 电压-00-820-5999 联系人; 徐璐 兴 胜, www.shbszq.com 注册地址, 天津總济技术开发区南港工业区综行 第二层 202-124 室	合服务区办公楼 D
天津国英基金销售有限公司	₹ 1108
北京江成基金销售有限公司 电话-400-619-9059 联系人了7回伸 网性上由pt/www.fandxone.cn 注册地比·南京市玄武区玄武大道 699-1 号 法正优表人、宋朝	
南京途牛金融信息服务有限公司 电话-400-799-9999 联系人, 密左 网址-http://jr.tunin.com 注册地址:宁夏回族自治区银川市金风区阅海> 路142号 14 是 1402	弯中央商务区万寿
及風金信(銀川)投資管理有限公司 电话-400-810-519 联系人,常旭 突性,www.fingd.com 注册地址上海市徐瓦区建附大道 2815 号 302	室
上海中正达广投货管理有限公司 电话-400~6767-523 联系,统建税	00号2号楼6153
第 (上海茶転送券及展区) 法定代表人工芸師 ・ 世話・40~820~539	15. 单元
中民財富基金销售(上海)有限公司 法定代表人,項批單 电话,440~457~5716 联系人,第旦青 网社,www.miwm.com 注册地址,北京市怀柔区人德河镇载坎村 735 年	
北京規模天下投資管理有限公司	
北京创金自富投资管理有限公司 电话-400~6202-818 联系人,编纂语 网址: www.sinch.com 注册地址;上海市浦东新区陆家嘴环路 333 号点	东方汇经中心 8 楼
送証代表人, 沙常明 电話: 400~600-6668 联系人, 唐露 関注: http://www.lzrq.com/ 注册地址上, 指前虹口区末大之路 687 号一幅 法定代表人, 字一梅	二楼 268 室
上海华夏财富投资管理有限公司	各799号5层01、
上海挖财金融信息服务有限公司 电话201—58816687 联系人,提聘等 网社: www.waziijin.com 注册地址.北京南海底区中关村东路 66 号 1号	楼 22 层 2603-06
· 法定代表人。江戸 电话-01089/189288 联系人;徐伯宇 网址,http://kenterni.jd.com/ 注册地址,上海市海东新瓦陆家嘴世纪金廸广本	
写樣 9 樣 连作表人,兰奇 电流 95156 转5 联系人,陈益岸 网址,www.tonghufind.com 注册地址,深圳市前海深港合作区前湾—格 1 **	
注册地址:深即前商海深港合作区 館湾一路 1 法正代表人。本管工作表人。 证证代表人。本管工作 证证代表人。本管工作 证证代表人。本管工作 证证代表人。本管工作 证证代表人。在证代表人。 证证代证代表人。 证证代是证代证代证代证代表人。 证证代证代证代证代证代证代证代证代证代证代证代证代证代证代证代证代证代证代证	
注册地址:天港自宣区(中心典券区/地类天庙) 题公第 2-2413毫 法证代表人,李鏊缔 电后:010-5901.842 聚系人;主商器 网班:http://www.wajjawealth.com	》。 100回时间 1

上海有鱼基金销售有限公司	注册地址:中国(上海)自由贸易试验区浦东大道 2123 号 3 层 3E-2655 玺 法定代表人,林琼 家服电泳:4007676298 联系人,徐琦峥 公司网址:www.youyufund.com
北京植信基金销售有限公司	注册地址:北京朝阳区四惠盛世龙原国食苑 10 号楼 注定代表人: 下龙之 宏联也话: 4006—802—123 蘇爾: servics@zhisin—inv.com 公司附述: https://www.shisin—inv.com/
腾安基金销售(深圳)有限公司	注册地址,深圳市商山区科技中一路腾讯大厦 11 楼 注定代表人;刘明军 案服社话;95017 转 1 转 6 或 0755-86013388 公司彻址,https://www.tenganximxi.com/
北京恒天明泽基金销售有限公司	注册地址:北京市北京经济技术开发区宏达北路 10 号 5 层 5122 室 注定代表人:周嵘 联系电运100-37756074 客服电话:400-786-8868 公司网址:http://www.chfind.com
济安财富(北京)基金销售有限公司	注册地址:北京市朝阳区太阳宫中路 16 号號 1 号楼冠捷大厦 3 层 达距代表人:杨健 联系人:李梅燕 联系电话:1350184929 客類电话:400-673-7010 公司网址:http://www.jimfortune.com/
民商基金销售(上海)有限公司	注册地址,上海市滨南区北京东路 666 号 H 区(东座)6 楼 A31 室 连定代表人,宾高罗 联系人,绥高罗 联系,连接线 联系电话:1812110537 客籍电话:202-5006003 公河网址;www.msfrc.com
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 1100 单元 法定代表人:申键 联系电话:18901685505 按跟电话:021~20292031 公司网址:https://www.wg.com.cn
北京百度百盈基金销售有限公司	注册地址:北京市海淀区上地十街 10 号 1 幢 1 层 101 注定代表人,张旭四 联系人,王语研 联系人王语研 联系电话:138107858-2 宏锡进语:95055-9 公河网址;https://www.baiyingfund.com/
阳光人寿保险股份有限公司	注用地址:海南省三亚市迎宾路 360—1 号三亚阳光金融广场 16 层 建定代表人,李料 联系人,王超 联系由话:010—59053660 客跟电话:95510 公司刚址:fund-sinosig.com
江苏江林傑大基金销售有限公司	注册地址: 南京市高淳区经济开发区占棚大道 47 号 进定代表人, 吳吉林 联系人, 林伊灵 联系人, 林伊灵 联系。4 伊灵 设立—56046166(分机号转 810) 客版也话:025—56046166(公机号转 810)
华瑞保险销售有限公司	注册地址:上海市浦东区向域路 288 号 8 楼 法定代表人,路吴 联系人,张奕爽 联系点,张奕爽 联系由话:021-6859576 宏阳电话:401115818 公司网址:www.huaruisles.com
玄元解除代理有限公司	注册地比;中国(上海)自由贸易试验区张畅路 707 号 1105 室 进定代表人。马朱语 联系人。广亚译 联系人:75225013 客报电话:1375252013 公司网址;http://www.xyinure.com/7100/kft_xybx
世纪证券有限责任公司	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 运定代表人;变蛛军 联系人工变 电话:055-8319999 传真,跟生话:4068323000 公司网及地址; www.sco.com.cn
泰诚财富基金销售(大進)有限公司	注册地址; 辽宁省大淮市沙河口区星海中龙园 3 号 办公地址; 辽宁省大淮市沙河口区星海中龙园 3 号 按定代表人, 林卓 联系人, 岭耳 电话,0411—8880[22-119 传真,0411—8896[36

3.2 任册宣记机构 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

3.3 年末東京東北市東京 名称:上海原泰律师東多所 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

注意代表人(负责人):廖海 电话:021-51150298 传真:021-51150298 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:021-6141 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 指数证券投资基金 8 5 基金类型 股票型证券投资基金 8 6 投资目标

》 0 权负目标 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, 获得与标的指数收益相似的回报。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

校贷氾阻 本基金投资限于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票、 。货币市场工具、权证及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工

饭券、该巾巾场工具、权证及法律法规或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证券品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。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%,其中现金及到期日在一年均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。

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。 具体资产配置比例如下表所示:

资产类别 资产配置低限 资产配置高限

股票等权益类资产 85% 95% 15% 2.股票投资策略 5% 15% 2.股票投资策略 本基金采取完全复制法构建股票指数组合,即按照深证 100 指数成份股及权重构建指数投资组合,并根据指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。 本基金在建仓期内,按照深证 100 指数各成份股的基准权重对其逐步买人,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人成本。当遇到训整,以便实现对跟踪误差的有效控制。 a)预期标的指数成份股份生殖形,增发,分红等行为;c)指数成份股份生配股,增发,分红等行为;c)指数成份股为生配股,增发,分红等行为;c)指数成份股为生配股,增发,分红等行为;c)指数成份股也现停牌限制,流动性问题等情况;d)其他影响指数复制的因素。 本基金指数组合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 指数对其成份股的调整而进行相应的跟踪调整。深证 100 指数成份股的定期调整定于每年 1 月和 7 月的第一个交易日卖船,通常在前一年的 12 月和当年的 6 月的第二个完整交易周的第一个交易日提前公布样本调整方案。 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样空间中排名位列前 10%之内,则于上市 15 个交易日产的,是成份股,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; b) 当成份股每停或终止上市的,相应成份股人指数中权重的行为时,本基

中值取小时以所以加入。 b) 当成份股暂停或终止上市的,相应成份胶外组或加升,不加加 相应调整; c) 当成份股发生增发、送配等情况而影响成份股在指数中权重的行为时,本基 金将根据指数公司在股权变动公告日次日发布的临时调整决定及其需调整的权重 比例,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 经知比数。

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,从而有双联标 标的指数; 。) 若个别成份股因停牌、流动性不足或法规限制等因素,使得基金管理人无法 按照其所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人相关的替代性组合; ,其他需要调整的事项。 3)跟踪误差的监控与管理 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"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,跟踪误差的核心监控指标。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 的偏离风险。

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 0.35%, 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。 3.债券投资策略 本基金债券投资策略 体低基金的跟踪误差为目的,在考虑流动性风险双重约束下的投资。本基金将以 降低基金的跟踪误差为目的,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 的流动性管理需要进行配置。

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,同时看重考虑基金的流动性管理需要进行配置。 4.金融行生产品投资策略本基金投资金融行生产品,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 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)维护基金份额特有人利益作为基金投资的最高准则。 2.投资程序 (1)投资决策未是全空期7五合议,提出资产和累达侧的扩导常见。

构建;

2. 农页程序 (1) 投资大维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

(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 评估,并对风险隐患提出预警; (5)基金经理根据指数成份股或权重变化情况、基金申购赎回情况、指数成份 股派息情况等,适时进行投资组合调整; 在投资决策过程中,风险管理部负责对各决策环节的事前及事后风险、操作风 险等投资风险进行贴挖,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。

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 (稅后)×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 风险收益特征 本基金属于股票型指数基金,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一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 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		
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	93.71
	其中:股票	85,502,613.28	93.71
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	买人返售金融资产	-	_
	其中:买断式回购的买人返售金融资产	-	_
7	银行存款和结算备付金合计	5,110,580.91	5.60
8	其他资产	628,913.38	0.69
9	会计	91 242 107 57	100.00

2	报告期末按行业分类的股票投资组合		
2.		内股票投资组合	
代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	4,474,611.20	4.95
В	采矿业	228,659.69	0.25
С	制造业	54,326,822.27	60.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	_	-
Е	建筑业	617,264.46	0.68
F	批发和零售业	1,538,173.18	1.70
G	交通运输、仓储和邮政业	512,680.00	0.57
Н	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,556,138.83	6.15
J	金融业	8,520,578.41	9.43
K	房地产业	5,924,971.91	6.56
L	租赁和商务服务业	1,120,097.88	1.24
М	科学研究和技术服务业	294,177.00	0.33
N	水利、环境和公共设施管理业	354,507.72	0.39
0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,469,895.73	1.63
R	文化、体育和娱乐业	366,291.92	0.41
s	综合	-	-
	合计	85,304,870.20	94.40
2.:	2 报告期末积极投资按行业分类的境内	内股票投资组合	
代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	_	_
В	采矿业	_	-
С	制造业	111,215.19	0.12
D	由力,执力,恢气及水牛产和供应业	_	_

建筑业

金融业 房地产业

住宿和餐饮业

且赁和商务服务

D生和社会工作 文化、体育和娱乐业

信息传输、软件和信息技术服务业

k利、环境和公共设施管理』 居民服务、修理和其他服务业

2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合本基金本报告期末未持有港股通投资股票。 3 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股票投资明细 3.1 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

261.84

32,902.94

53,363.11

於汉贝明细					
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	000651	格力电器	111,339	5,256,314.19	5.82
2	000333	美的集团	107,212	5,224,440.76	5.78
3	000002	万科 A	140,343	4,311,336.96	4.77
4	000858	五粮液	42,729	4,059,255.00	4.49
5	300498	温氏股份	88,537	3,594,602.20	3.98
6	002415	海康威视	81,502	2,858,275.14	3.16
7	000001	平安银行	195,290	2,503,617.80	2.77
8	000725	京东方 A	603,699	2,354,426.10	2.61
9	300059	东方财富	91,104	1,765,595.52	1.95
10	002304	洋河股份	13,146	1,714,501.32	1.90
3.2 报告	期末积极投资	按公允价值占	基金资产净值	直比例大小排	字的前五名股

耐又见明细					
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	300762	上海瀚讯	1,159	77,525.51	0.09
2	002949	华阳国际	1,877	53,363.11	0.06
3	300766	毎日互动	1,193	32,902.94	0.04
4	300757	罗博特科	500	32,250.00	0.04
5	002927	泰永长征	40	1,355.60	0.00

4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。 5 报告期末按公价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。 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十名资产支持证券 投资明细

^{仅时311} 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明

本基金本报告期末未持有贵金属。 客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权证投资明细本基金本报告期末未持有投证。 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交易情况说明 9.1 报告期末本基金投资的股指期货存合和损益明细 根据本基金合同规定,本基金不参与股指期货交易。 9.2 本基金投资的股指期货投资政策 根据本基金合同规定,本基金不参与股指期货交易。 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产易。 10.2 报告期末本基金投资的国债期货产易。 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 投资组合同规定,本基金不参与国债期货交易。 11 投资组合同规定,本基金不参与国债期货交易。 11 投资组合同规定,本基金不参与国债期货交易。 11 投资组合用规定,本基金不参与国债期货交易。

11.1 报告期内基金投资的前十名证券除平安银行(证券代码 000001)外其他证券的 发行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。 根据 2018 年 5 月 1 日发布的相关公告,该证券发行人因未依法履行职责被地方外管局处以罚款,并责令改正。 根据 2018 年 7 月 10 日发布的相关公告,该证券发行人因未依法履行职责被天 建银监局处以罚款。 根据 2018 年 8 月 3 日发布的相关公告,该证券发行人因违规经营、未依法履行 职责,内部制度不完善、偷税被多家机构处以罚款。 对上述证券的投资决策程序的说明:本基金为指数型基金,因复制指数被动持 有,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	存出保证金	3,382.54
2	应收证券清算款	548,641.18
3	应收股利	_
4	应收利息	1,104.71
5	应收申购款	75,784.95
6	其他应收款	_
7	待摊费用	_
8	其他	_
9	合计	628,913.38

11.4 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。 11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明 11.5 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的情况。 11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

个基金单级占别本核政权员则且在成宗中不特任而通文限的情况。 § 13 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 基金管理人不保证基金一定盈利,也不保证最低败益。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

本基金合同生效以来的投资业绩及与同期基准的比较如下表所示:

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
2010.06.22-2010.12.31	15.20%	1.39%	21.21%	1.66%	-6.01%	-0.27%
2011.01.01-2011.12.31	-29.69%	1.33%	-29.60%	1.34%	-0.09%	-0.01%
2012.01.01-2012.12.31	0.74%	1.36%	2.00%	1.38%	-1.26%	-0.02%
2013.01.01-2013.12.31	-2.21%	1.33%	-4.53%	1.35%	2.32%	-0.02%
2014.01.01-2014.12.31	30.95%	1.16%	30.59%	1.15%	0.36%	0.01%
2015.01.01-2015.12.31	19.04%	2.71%	21.11%	2.46%	-2.07%	0.25%
2016.01.01-2016.12.31	-12.06%	1.77%	-15.64%	1.57%	3.58%	0.20%
2017.01.01-2017.12.31	31.17%	0.87%	25.02%	0.86%	6.15%	0.01%
2018.01.01-2018.12.31	-31.70%	1.52%	-33.15%	1.48%	1.45%	0.04%
2019.01.01-2019.03.31	37.75%	1.64%	36.92%	1.64%	0.83%	0.00%
自基金成立起至 2019.03.31	35.01%	1.58%	26.86%	1.53%	8.15%	0.05%

注:本基金合同生效日为2010年6月22日。

招商深证 100 指数 C	:					
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
2017.08.18-2017.12.31	12.65%	0.95%	10.85%	0.94%	1.80%	0.01%
2018.01.01-2018.12.31	-31.99%	1.52%	-33.15%	1.48%	1.16%	0.04%
2019.01.01-2019.03.31	37.62%	1.63%	36.92%	1.64%	0.70%	-0.01%
自基金成立起至 2019.03.31	5.43%	1.45%	1.47%	1.42%	3.96%	0.03%

注: 本基金自 2017 年 3 月 1 日起新增 C 类份额,C 类份额自 2017 年 8 月 18 日 起存续。

起存续。 \$\(^14\) 基金的费用概览 14.1 与基金运作有关的费用 1、与基金运作有关的费用列示: (1)基金管理人的管理费; (2)基金托管人的托管费; (3)标的指数使用费; (4)基金销售服务费; (5)基金合同生效后与基金相关的信息披露费用; (6)基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费; (7)基金份额持有人大会费用; (8)基金的证券交易费用;

(7)基金份额持有人大会费用;
(8)基金的证券交易费用;
(9)基金的银行元划费用;
(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。
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。
2.基金管理费
本基金的基金管理费年费率为0.7%,即基金管理费按前一日基金资产净值的
0.7%年费率计提。计算方法如下:
H=E×0.7%+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
基金管理费每日计算,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切款指令,基金托管人复核后于次月首日起2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、不可抗力等,支付日期顺延。

基金管理费每日计算,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2个工作日内 付日期顺延。

3.基金托管费 本基金的基金托管费车势 20.15%,即基金托管费按前一日基金资产净值 的0.15%年费率计提。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 基金托管费创助指令,基金托管人复核后于次月首日起2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、不可抗力等,支付日期顺延。 4.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深圳证券信息有限公司数使用费。指管人发送基金托管费划款指令,基金托管人发域上或托管费日报公司与和数使用费。在数使用为分之 一.有本基金当年使用指数满一个人历年度的,则指数使用费收取下限为每年人民币 20 万元。即若不足人民币 20 万元则按照人民币 20 万元收取。 H = E×0.02%+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 若本基金当年使用指数市是一个公历年度的,应以 H 为准计算应支付的、基于 指数使用费到款指令,基金托管人复核后于次季初 10 个工作日内从基金财产中一次性 力倍给指数不足一个公历年度的,应以 H 为准计算应支付的、基于 指数使用费到款指令,基金托管人复核后于次季初 10 个工作日内从基金财产中一 次性支付给指数所有人。 5.基金销售服务费 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车费率 为 0.40%。本基金销售服务费符门用于本基金 C 类基金份额销售后基金份领 持有从服务,基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的刘支情况作专项说明。 销售服务费计量的计算公式如下: H=E×0.40%+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 类基金份额每日应计量的销售服务费 E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值 基金销售从基金财产中之次 11 基金管理人和基金托管数层上发现及相应协议规定,按费用实际支出金 额列人到期费用,由基金管理人和基金托管为是基金还有关身等致的费用支出或 是金尺值为量的的相关表面,不完全履行义务导致的费用支出或 第列人到期费用,由基金托管为从基金财产中支付。7、下列费用不列人基金费用, (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; (1)基金管理人和基金托管人及未履行或未完全的要册; (2)基金管理人和基金托管人及未履行或未完全履行义务导致的费用; (1)基金管理人和基金托管人处理与基金运产无效。等分,由加工的证据的,是

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,包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息 (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。
8.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、基金销售服务费率等相关费率。调高基金管理费率、基金托管费率或基金销售服务费率等费率,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服务费率等费率,须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最足于新的费率实施日前2日在指定媒介上公告。14.2 与基金销售有关的费用本基金根据销售费用收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为 A 类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为 C 类基金份额。1、中购费用本基金的由脑费按由脑金额进行分档由脑费用应在投资人由脑基金份额时

1、申购费用 本基金的申购费按申购金额进行分档,申购费用应在投资人申购基金份额时 以。投资人在一天之内如果有多笔申购,费率按单笔分别计算。费率如下:

A 类基金份额申购费				
申购费率				
1.2%				
0.8%				
0.4%				
每笔 1000 元				

申购费用的计算方法: 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 本基金 A 类基金份额的申购费用由申购该类基金份额的基金份额持有人承 担,不列人资金资产,用于基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。 本基金 C 类基金份额不收取申购费。

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) 1年≤N<2年 0.25% N≥2年

(注:1年指365天,2年为730天,依此类推) 赎回费用的计算方法: 赎回费用=赎回份额×赎回受理当日基金份额净值×

來基金 A 类基金份额的赎回费用由赎回该类基金份额的基金份额持有人承担。其中,对持续持有期少于7日的投资者收取的赎回费全额计人基金财产;除此之外,赎回费用的75%作为注册登记费及其他相关手续费,剩余25%归基金资产所之产

平	.// /1\:
连续持有时间(N)	赎回费率
N<7 ∃	1.5%
7 ⊟ ≤ N < 30 ⊟	0.5%
30 ∃ ≤ N	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,

回C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

广。
3、转换费用
(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,并根据上述规定按比例归人基金财产。
(3)每笔转换申请的转人基金端,从申购费率(费用)低向高的基金转换时,收取转人基金与转出基金的申购费用差额;申购款差费用按照转人基金逾新所对应的申购费率(费用)指次进行补差计算。从申购费率(费用)据域是基金转换时,不收取申购补差费用。
(4)基金转换采取单笔计算法,投资者当日多次转换的,单笔计算转换费用。
4.基金管理人官网交易平台交易。
www.cmfchina.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.基金管理人可以调整申购、赎回和转换费率或收费方式,并最迟将于新的费率或收费方式开始实施前2日在指定媒介公告。
6.基金管理人可以在不违责注法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划,对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,按相关监管率,并不晚于优惠活动实施日公告。
基金管理人可以针对特定投资人(如养老金客户等)开展费率优惠活动,届时按量的企

垂或具体之间。 将提前公告。 14.3 基金的税收 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

上田岳亚林园员士,开个呢了此志伯码太旭口石口。 甚会管理人可以针对特定投资人(如养老金客户等)开展费率优惠活动,届时

即學基並指揮於受發管活动进行了內容补充和數据更新。 本基金的投發發管活动进行了內容补充和數据更新。 本次主要更新的內容如下: 1、更新了"事要提示"。 2、更新了"基金管理人"。 4、更新了"基金管理人"。 5、更新了"基金份额的申购、赎回及转换"。 7、更新了"基金份额的申购、赎回及转换"。 7、更新了"基金的投资"。 8、更新了"基金的收资"。 8、更新了"基金的收益与分配"。 10、更新了"基金的的合价。 10、更新了"基金的信息按露"。 12、更新了"基金的信息按露"。 13、更新了"基金合同的变更,终止和基金财产的清算"。 14、更新了"基金拾管协议的内容摘要"。 15、更新了"基金托管协议的内容摘要"。 16、更新了"相察说明书的存放及查阅方式"。

招商基金管理有限公司 2020年2月28日