招商深证100指数证券投资基金

更新的招募说明书摘要

(二零一一年第一号)

招商深证100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2010年4月21日《关于核准招商深证100指数证券投资基金募集的批复》(证监许可[2010]513号文)核准公开募集。本基金的基金合同于2010年6月22日正式生效。本基金为契约型开放式。

重要提示

投资有风险,投资人认购(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2011年1月17日,有关财务和业绩表现数据截止日为2010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
住所:深圳市深南大道7088号招商银行大厦28楼
设立日期:2002年12月27日
法定代表人:马蔚华
办公地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦28楼
电话:(0755)83196351
传真:(0755)83076974
联系人:曾倩
注册资本:人民币2.1亿元
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。经公司股东会通过以及中国证监会批准,公司的注册资本金已经由人民币一亿元(RMB 100,000,000元)增加为人民币二亿一千万元(RMB 210,000,000元)。2007年5月22日,经公司股东会通过并由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3.3%的股权。目前招商基金管理有限公司的股东股权结构为: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%。

公司主要中方股东招商银行成立于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)。目前,招商银行注册资本为人民币215.77亿元,总资产超过人民币两万亿元。招商证券股份有限公司是百年招商局控股的证券公司,创立于1991年8月,注册资本35.85亿元。经过十八年创业发展,在国内33个城市设有71家营业网点,综合实力进入国内十强。2009年11月17日,招商证券在上海证券交易所上市(股票代码:600999)。

公司外方股东ING Asset Management B.V.(荷兰投资)是ING集团的专门从事资产管理业务的全资子公司。ING集团是全球最大的多元化金融集团之一,在2009年《财富》杂志500强排名第8位,在全球超过65个国家和地区拥有分支机构,员工11万多人。

公司本着“诚信、融合、创新、卓越”的经营理念,力争成为客户推崇、股东满意、员工热爱,并具有国际竞争力的专业化的资产管理公司。

(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:

马蔚华,男,1948年出生,西南财经大学经济学博士,美国南加州大学荣誉博士,高级经济师。1982年至1985年,在辽宁省计委工作,历任副处长、副秘书长;1985年至1986年,在辽宁省委办公厅工作;1986年至1988年,在中共安徽省委办公厅工作;1988年至1990年,任中国人民银行办公厅副主任;1990年至1992年,任中国人民银行计划资金司副司长;1992年至1998年,任中国人民银行海南省分行行长兼国家外汇管理局海南分局局长;1999年3月至今任招商银行行长。现任本公司董事长。

葛利佳(Grant Bailey),男,1952年出生,澳大利亚籍,澳大利亚阿得莱德大学经济学本科。1977年3月至1990年12月,任职澳大利亚财政部(1986年至1989年期间,在澳大利亚驻美国大使馆任经贸参赞);1991年1月至1996年9月,任花旗银行(澳大利亚)首席经济师;1996年10月至1998年12月,任花旗集团资产管理公司(澳纽)总经理及投资总监;1999年1月至2001年5月,任花旗集团资产管理公司(新加坡)总经理;2001年11月至2002年12月,任ING资产管理公司(澳大利亚)机构投资总监;2003年1月至2007年9月,任ING资产管理公司(澳大利亚)澳大利亚区域经理;2007年10月至2009年2月,任ING资产管理公司(迪拜)区域经理;2009年3月至今,任ING亚太资产管理公司首席执行官。现任本公司董事。

邓晓力,女,1967年出生,高级分析师。美国纽约州州立大学经济学博士。历任AT&T任市场科学决策部市场分析师,Providian Financial金融公司高级风险分析师,花旗银行风险管理部高级分析师。2001年11月加入招商证券,历任风险管理部副总经理、总经理,其间于2004年1月至9月被中国证监会借调至南方证券行政接管组工作。现任招商证券副总裁,分管风险管理部及协助总裁管理财务部。现任本公司董事。

成保良,男,1961年出生,经济学硕士,高级经济师。曾在北京经济学院任教;后就职于中国人民银行金融管理司;1993年起先后担任中国证券交易系统有限公司上市管理部副经理、经理;中国证监会发行部副处长、处长、稽查局处长;2001年9月起开始担任招商基金管理有限公司筹备组组长。自本公司成立后担任本公司总经理、董事。

李鹏飞,男,1940年出生,密歇根大学理学士(工程数学),香港太平绅士。1978年至1998年间先后担任香港立法局议员、香港行政局议员、首席立法局议员、香港特别行政区临时立法会议员、香港特别行政区推选委员会委员、筹备委员会委员、港事顾问、自由党主席,现任第九届全国人民代表大会香港特别行政区代表、香港特别行政区策略发展委员会委员。现任本公司独立董事。

陈春花,女,1964年出生,华南理工大学工商管理学院教授、博导,南京大学博士后。曾任华南理工大学工商管理学院副院长,现任北京大学客座研究员、新加坡国立大学客座教授、澳洲国立大学国际管理硕士课程客座教授、广东省企业管理协会常务理事、广东省企业文化协会常务理事和广东省精神文明协会理事。陈春花教授曾先后出任山东六和集团总裁、康佳集团、科龙集团、TCL集团、美的家电、南方航空、广东电信等公司管理顾问。讲授课程主要有《组织行为学》、《企业文化与跨文化管理》等。现任本公司独立董事。

周语菡,女,1968年出生,美国籍。美国加州州立大学索诺玛分校MBA。曾先后就职于丸红株氏会社(美国)公司产品部,Ananda(USA)亚洲业务部,美国ASI太平洋地区业务发展部副主任,美国iLink Global公司高级分析员以及咨询委员会委员。2001年初至2005年,就职于香港招商局中国投资管理有限公司,出任董事总经理一职,管理上市直接投资基金-招商中国直接投资基金(HK0133)。其间曾先后出任招商证券监事会主席,巨田证券监事会主席,巨田基金管理有限公司董事等职务。2006年至今,任职于中集集团,出任南美战略发展项目负责人。现任公司独立董事。

张卫华,女,1961年2月生,中国国籍,会计师。1981年07月——1983年11月,任江苏省连云港市汽车运输公司财务部会计;1983年11月——1988年08月,任中国银行连云港分行外汇会计部主任;1988年08月——1994年11月,历任招商银行总行国际部、会计部主任、证券业务部总经理助理;1994年11月——2006年02月,历任招银证券、国通证券及招商证券股份有限公司总裁助理兼稽核审计部总经理;2001年12月——2009年04月,任招商证券股份有限公司职工代表监事;2006年03月——2009年04月,任招商证券股份有限公司稽核监察总审计师;2009年04月起任招商证券股份有限公司合规总监,现任公司监事会主席。

周松,男,1972年4月出生,武汉大学世界经济本科专业,硕士学历。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月起担任招商银行总行计划财务部负责人,现任公司监事。

林嘉丽,女,1979年出生,香港城市大学法学专业毕业,香港执业律师。2003年1月至2003年8月在澳纽银行中小企业部任助理经理;2004年8月至2008年5月在富而德律师事务所任见习律师;2008年6月至今在ING投资管理(亚洲)有限公司任亚太区法律顾问。现任公司监事。

张冰,男,1966年出生,管理学硕士。1993年起在珠海恒通集团股份有限公司证券投资处工作;1994年加入招商证券股份有限公司,先后任研究发展中心高级研究员,资产管理部投资经理;2002年加入本公司,任基金经理至今。现任公司总经理助理,公司监事。

欧志明,男,1976年6月出生,中国国籍,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,现任法律合规部总监,公司监事。

杨奕,男,中国国籍,芝加哥大学商学院MBA优异毕业生。杨奕先生具有丰富的金融证券从业经验,拥有特许金融分析师(CFA)和中国注册会计师(CPA)资格。曾任职于深圳能源石油化工贸易有限公司和中国宝安集团股份有限公司。2003年加入招商基金管理有限公司,曾任基金管理部高级研究员,固定收益投资部副总监、专户资产投资部总监,现任副总经理兼投资经理。

王晓东,女,中国国籍,上海财经大学经济学硕士。曾任南方证券有限公司深南中路营业部总经理、深圳特区证券总经理助理、巨田基金管理有限公司(现摩根士丹利华鑫基金)副总经理、华林证券有限责任公司总裁,2007年加入招商证券股份有限公司。2007年9月至2010年3月任招商基金管理有限公司监事长,现任招商基金管理有限公司副总经理。

赵生章,男,中国国籍,中国人民大学经济学博士。曾任国信证券有限公司投资银行部项目经理、招商证券股份有限公司投资银行二部副经理、内核部经理(投行内核小组负责人)、公司董事会办公室经理(负责公司公开发行及上市等相关事宜),2002年起参与招商基金管理有限公司筹备,公司成立后曾任督察长、总经理助理,现任招商基金管理有限公司副总经理。

陈喆,男,1963年出生,经济学硕士。曾任美国富兰克林邓普顿基金集团中国代表,中银国际证券有限责任公司执行董事,南方证券股份有限公司投行部副总经理等职,具有近15年金融证券从业经验,持有证券发行、经纪和基金从业资格。2008年2月加入招商基金,现任公司副总经理。

吴武泽,男,1975年出生,华中科技大学管理学硕士,对外经济贸易大学经济学博士。从2000年6月开始在特华投资有限公司工作,从事行业研究;2001年2月加盟易方达基金管理有限公司,负责数量分析、基金研究、系统开发等方面的工作,先后任研究员、业务主管。2003年9月加入招商基金,一直从事数量研究和模型开发等工作,曾任公司投资风险管理部总监,现任公司督察长。

2、本基金基金经理介绍

王平,男,中国国籍,管理学硕士,FRM(金融风险管理师)。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,主要从事投资风险管理、金融工程与数量化投资策略研究、股指期货投资策略研究等工作。现任招商深证100指数证券投资基金、上证消费80交易型开放式指数证券投资基金及招商上证消费80交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。王平先生任本基金的基金经理,管理时间为2010年6月22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:副总经理杨奕、总经理助理张冰、固定收益投资部总监张国强、研究部总监陈玉辉、交易部总监路明、股票投资部副总监涂冰云、专户投资部副总监杨渺。

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

本基金之基金托管人为中国工商银行股份有限公司,基本情况如下:

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
办公地址:北京市西城区复兴门内大街55号
法定代表人:姜建清
设立日期:1984年1月1日
注册资本:人民币334,018,850,026元
联系电话:(010)66105799
联系人:蒋松云

2、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、安心账户资金、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2010年12月,中国工商银行共托管证券投资基金198只,其中封闭式8只,开放式190只。自2003年以来,本行连续七年获得香港《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23项最佳托管银行大奖;2010年,本行资产托管部总经理获得《财资》设立的年度中国最佳托管银行家个人大奖。本行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。

3、主要人员情况

截至2010年12月末,中国工商银行资产托管部共有员工133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。

三、相关服务机构

(一)基金份额发售机构

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)
招商基金电子商务网上交易平台
交易网站:www.cmfchina.com
交易电话:400-887-9555(免长途话费)
电话:(0755)83195018
传真:(0755)83199059
联系人:李涛
招商基金华东机构理财中心
地址:上海市浦东南路588号浦发大厦29楼AK单元
电话:(021)58796636
联系人:王雷
招商基金华南机构理财中心
地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦23楼
电话:(0755)83196377
联系人:苏菁
招商基金华北机构理财中心
地址:北京市西城区武定侯街6号卓著中心2001室
电话:(010)66290590
联系人:仇小彬
招商基金直销交易服务联系方式
地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦23层招商基金市场部客户服务中心
电话:(0755)83196359 83196358
传真:(0755)83196360
备用传真:(0755)83199266
联系人:贺军莉 刘航达

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:姜建清
电话:010-95588
传真:010-66107914
联系人:刘业伟

3、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:傅育宁
电话:(0755)83196223
传真:(0755)83195050
联系人:邓炯鹏

4、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:项俊波
电话:(010)85108229
传真:(010)85109219
联系人:张令玮

5、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:肖钢
电话:95566
传真:(010)66594853
联系人:张建伟

6、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:胡怀邦
电话:(021)58781234
传真:(021)58408483
联系人:曹榕

7、代销机构:深圳发展银行股份有限公司
注册地址:深圳市罗湖区深南东路5047号
法定代表人:肖遂宁
电话:(0755)82088888
传真:(0755)82080714
联系人:姜聘

8、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富华大厦C座
法定代表人:孔丹
电话:(010)65557048
传真:(010)65550828
联系人:郭伟

9、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)85238440
传真:(010)85238680
联系人:邓轼坡

10、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:徐伟

11、代销机构:中国民生银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区复兴门内大街2号
法定代表人:董文标
电话:(010)58351666
传真:(010)83914283
联系人:董云巍

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丙17号
办公地址:北京市西城区金融大街丙17号
法定代表人:闫冰竹
电话:(010)66223584
传真:(010)66226073
联系人:王曦

13、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

14、代销机构:申银万国证券股份有限公司
注册地址:上海市常熟路171号
法定代表人:丁国荣
电话:021-54033888
传真:021-54038844
联系人:曹晔

15、代销机构:安信证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路2222号安联大厦34层、28层A02单元
法定代表人:牛冠兴
电话:(0755)82558323
传真:(0755)82558355
联系人:余江

16、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:顾伟国
电话:(010)66568430
传真:(010)66568532
联系人:田薇

17、代销机构:国信证券股份有限公司
注册地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦六层
法人代表人:何如
电话:0755-82130833-1230,0755-82133066
传真:0755-82133952
联系人:齐晓燕

18、代销机构:华泰联合证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第五层(01A、02、03、04)、17A、18A、24A、25A、26A
法定代表人:马昭明
电话:0755-82492000
传真:0755-82492962
联系人:盛宗凌、庞晓芸

19、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:王志伟
电话:(020)87555888
传真:(020)87557985
联系人:黄岚

20、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

21、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

22、代销机构:光大证券股份有限责任公司
注册地址:上海市静安区新闸路1508号
法定代表人:徐浩明
电话:(021)22169999
传真:(021)22169134
联系人:刘晨

23、代销机构:湘财证券股份有限公司
注册地址:湖南省长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼
法定代表人:林俊波
电话:(021)68634518-8503
传真:(021)68865680
联系人:钟康莺

24、代销机构:平安证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼
法定代表人:杨宇翔
电话:(0755)22626391
传真:(0755)82400862
联系人:郑舒丽

25、代销机构:中信建投证券有限责任公司
注册地址:北京市安立路66号4号楼
法定代表人:张佑君
电话:4008888108
传真:(010)65182261
联系人:权唐

26、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:胡运钊
电话:(027)65799999
传真:(027)85481900
联系人:李良

27、代销机构:国海证券有限责任公司
注册地址:南宁市滨湖路46号
法定代表人:张雅锋
电话:(0755)83707413
传真:(0755)83700205
联系人:武斌

28、代销机构:广发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:(0591)87383623
传真:(0591)87383610
联系人:张腾

29、代销机构:国泰君安证券股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区商城路618号
法定代表人:祝幼一
电话:021-38676161
传真:021-38670161
联系人:芮敏祺

30、代销机构:信达证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区三里河东路5号中商大厦10层
法定代表人:张志刚
电话:(010)63081000
传真:(010)63080978
联系人:唐静

31、代销机构:宏源证券股份有限公司
注册地址:新疆乌鲁木齐市文艺路233号
法定代表人:冯戎
电话:(010)88085858
传真:(010)88085195
联系人:李巍

32、代销机构:华泰证券有限责任公司
注册地址:江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
法定代表人:吴万善
电话:(025)83290845
传真:(025)84579763
联系人:舒萌菲

33、代销机构:大通证券股份有限公司
注册地址:大连市中山区人民路24号
法定代表人:于宏民
电话:0411-39673202
传真:0411-39673219
联系人:谢立军

34、代销机构:江南证券有限责任公司
注册地址:南昌市抚河北路291号
法定代表人:杜航
电话:0791-6768763
传真:0791-6789414
联系人:余雅娜

35、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80号顺天国际财富中心26楼
法定代表人:周晖
电话:(0731)4403319
传真:(0731)4403439
联系人:郭磊

36、代销机构:东方证券股份有限公司
注册地址:上海市中山南路318号2号楼22层-29层
法定代表人:潘鑫军
电话:(021)63325888
传真:(021)63326173
联系人:吴宇

37、代销机构:华宝证券有限责任公司
注册地址:上海市陆家嘴环路166号未来资产大厦27层
法定代表人:陈林
电话:(021)50122222
传真:(021)50122200
联系人:陈康菲

38、代销机构:方正证券有限责任公司
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:雷杰
电话:0731-85832343
传真:0731-85832214
联系人:彭博

39、代销机构:华安证券有限责任公司
注册地址:安徽省合肥市长江中路357号法定代表人:李工
法定代表人:李工
电话:0551-5161666
传真:0551-5161600
联系人:甘霖

40、代销机构:齐鲁证券有限公司
注册地址:山东省济南市经十路20518号
法定代表人:李玮
电话:0531-68889155
传真:0531-68889752
联系人:吴阳

41、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:平岳
电话:(021)68604866
传真:(021)50372474
联系人:张静

42、代销机构:中信万通证券有限责任公司
注册地址:青岛市崂山区苗岭路29号澳柯玛大厦15层(1507-1510室)
法定代表人:张智河
电话:(0532)85022326
传真:(0532)85022605
联系人:吴忠超

43、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: 丁之锁
电话:(010)-58568007
传真:(010)-58568062
联系人: 梁宇

44、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)66045678
传真:(010)66045500
联系人:潘鸿

45、代销机构:中信证券股份有限公司
注册地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦A层
法定代表人:王东明
电话:(010)84683893
传真:(010)84865560
联系人:陈忠

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:深圳市深南大道7088号招商银行大厦28楼
法定代表人:马蔚华
成立日期:2002年12月27日
电话:(0755)83196445
传真:(0755)83196436
联系人:谢先斌、郝文高

(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28层
法定代表人:王磊
电话:(010)59241188
传真:(010)59241199
经办律师:王明涛、董文浩
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有限公司
注册地址:上海市延安东路222号30楼
法定代表人:卢伯卿
电话:(021)61418888
传真:(021)63350177
经办注册会计师:陶坚、汪芳
联系人:陶坚

四、基金的名称:招商深证100指数型证券投资基金

五、基金类型:契约型开放式

六、基金的投资目标: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,获得与标的指数收益相似的回报。

七、投资方向

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、债券、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%-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%。

八、基金的投资策略

(一)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%。

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%
债券及现金等固定收益类资产	5%	15%

(二)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入,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,以便实现对跟踪误差的有效控制:

a)预期标的指数成份股将调整;
b)标的指数成份股发生配股、增发、分红等行为;
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月的第一个交易日实施,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个交易日之后快速入选成份股,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,从而有效跟踪标的指数;

e)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入相关的替代性组合;

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0.35%,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。

(三)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。

(四)金融衍生产品投资策略

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。

(五)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:深证100指数收益率×95%+商业银行活期存款利率(税后)×5%。

十、基金投资组合报告

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2010年9月30日,来源于《招商深证100指数证券投资基金2010年第3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	378,107,472.62	93.64
	其中:股票	378,107,472.62	93.64
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	24,334,857.60	6.03
6	其他资产	1,331,159.25	0.33
7	合计	403,773,489.47	100.00

(二)报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

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	-	-
B	采掘业	27,736,400.00	6.94
C	制造业	180,777,086.55	45.23
C0	食品、饮料	31,765,590.75	7.95
C1	纺织、服装、皮毛	1,882,992.00	0.47
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	2,800,701.60	0.70
C4	石油、化学、塑胶、塑料	6,211,500.00	1.55
C5	电子	4,545,000.00	1.14
C6	金属、非金属	35,668,763.20	8.92
C7	机械、设备、仪表	53,683,635.00	13.43
C8	医药、生物制品	42,109,904.00	10.53
C99	其他制造业	2,109,000.00	0.53
D	电力、煤气及水的生产和供应业	6,838,300.00	1.71
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	1,800,000.00	0.45
G	信息技术业	17,792,700.00	4.45
H	批发和零售贸易	18,577,403.05	4.65
I	金融、保险业	26,942,318.02	6.74
J	房地产业	25,122,751.00	6.29
K	社会服务业	3,807,000.00	0.95
L	传播与文化产业	3,340,800.00	0.84
M	综合类	9,749,506.35	2.44
	合计	322,484,264.97	80.68

(三)报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

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	15,612,784.20	3.91
B	采掘业	-	-
C	制造业	9,108,510.63	2.28
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	3,756,000.00	0.94
C7	机械、设备、仪表	-	-
C8	医药、生物制品	5,352,510.63	1.34
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	19,567,509.94	4.90
I	金融、保险业	11,334,402.88	2.84
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	55,623,207.65	13.92

(四)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票投资明细

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	000858	五粮液	629,966	21,626,732.78	5.41
2	002024	苏宁电器	869,905	13,892,382.85	3.48
3	000002	万科A	1,579,925	13,271,370.00	3.32
4	000063	中兴通讯	500,000	12,325,000.00	3.08
5	000001	深发展A	700,000	11,354,000.00	2.84
6	000538	云南白药	150,000	10,452,000.00	2.61
7	002007	华兰生物	199,904	10,195,104.00	2.55
8	000983	西山煤电	400,000	8,320,000.00	2.08
9	000527	美的电器	499,950	7,649,235.00	1.91
10	000651	格力电器	530,000	7,515,400.00	1.88

(五)报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	000860	顺鑫农业	449,962	10,988,072.04	2.75
2	600327	大厦股份	524,401	6,733,308.84	1.68
3	600000	浦发银行	517,778	6,710,402.88	1.68
4	000987	广州友谊	185,600	5,822,272.00	1.46
5	600257	大湖股份	545,367	4,624,712.16	1.16

(六)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。

(七)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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

(八)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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

(九)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权证。

(十)投资组合报告附注

(1)报告期内基金投资的前十名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。

(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。

(3)其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	166,027.50
2	应收证券清算款	973,503.25
3	应收股利	-
4	应收利息	4,101.69
5	应收申购款	187,526.81
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,331,159.25

(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。

(5)报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

①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。

②报告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。

十一、基金的业绩

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,但不保证基金一定盈利,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	基金份额净值增长率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
自基金合同生效日起至2010.06.30	-0.30%	0.11%	-8.84%	1.74%	8.54%	-1.63%
自基金合同生效日起至2010.09.30	7.50%	0.85%	11.83%	1.47%	-4.33%	-0.62%

十二、基金的费用概览

(一)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、律师费和诉讼费;
(6)基金份额持有人大会费用;
(7)基金的证券交易费用;
(8)基金的银行汇划费用;
(9)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划款指令,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。

3、基金托管费

本基金的基金托管费年费率为0.15%,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托管费划款指令,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签署的指数使用许可协议的约定向深圳证券信息有限公司支付指数使用费。指数使用费自本基金合同生效之日起开始计提,每年计提标准为前一日基金资产净值的万分之二,若本基金当年使用指数满一个公历年度的,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不足一个公历年度的,应以H为准计算应支付的、基于当年实际使用日数的指数使用许可费。

指数使用费每日计提,逐日累计,按季支付,由基金管理人向基金托管人发送指数使用费划款指令,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、上述(3)到(9)项费用由基金托管人根据其它有关法规及相应协议的规定,按费用实际支出金额支付,列入当期基金费用。

6、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,包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用;
(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。

7、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日在至少一种指定媒体和基金管理人网站上公告。

(二)与基金销售有关的费用

1、基金的认购费用

本基金的认购费率水平、计算公式、收取方式和使用方式请参见本招募说明书“六、基金的募集”相应部分。

2、基金的申购费用

本基金的申购费率水平、计算公式、收取方式和使用方式请参见本招募说明书“九、基金份额的申购、赎回和转换”相应部分。

3、基金的赎回费用

本基金的赎回费率水平、计算公式、收取方式和使用方式请参见本招募说明书“九、基金份额的申购、赎回和转换”相应部分。

4、基金的转换费用

本基金的转换费率水平、计算公式、收取方式和使用方式请参见本招募说明书“九、基金份额的申购、赎回和转换”相应部分。

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个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

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,按相关监管部门要求履行相关手续后基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率,并不晚于优惠活动实施日公告。

十四、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》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《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2010年5月12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的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:

本次主要更新的内容如下:

1、在“三、基金管理人”部分,对“(一)基金管理人概况”的联系人信息进行了更新,对“(二)目前所管理基金的基本情况”进行了更新,对“(三)主要人员情况”部分,对基金管理人董事、监事及高级管理人员介绍、投资决策委员会成员等信息进行了更新。

2、在“四、基金托管人”部分,对“(二)主要人员情况”部分进行了更新,对“(三)基金托管业务经营情况”部分,对截至2010年12月中国工商银行基金托管业务的情况作了更新。

3、在“五、相关服务机构”部分,对“(一)基金份额发售机构”的直销机构和代销机构进行了更新;对“(三)律师事务所和经办律师”的经办律师进行了更新。

4、删除了原招募书中的“六、基金的募集”部分。

5、删除了原招募书中的“七、基金合同的生效”部分。

6、在“八、基金的投资”部分,增加了“(十一)基金投资组合报告”部分并补充了本基金最近一期投资组合报告的内容。

7、增加了“九、基金的业绩”部分并分别列示了本基金自基金合同生效之日起至2010年9月30日以来的业绩表现。

8、在“二十、对基金份额持有人的服务”部分,对“(五)客户服务中心(CALL-CENTER)电话服务”部分,对基金份额持有人进行信息查询的项目做了更新。

9、在“二十一、其他应披露事项”部分,列示了前次招募说明书刊登到本次招募说明书更新截止日之间的信息披露事项。

招商基金管理有限公司
2011年2月1日

招商基金管理有限公司关于上证消费80交易型开放式指数证券投资基金基金份额折算日的公告

根据《上证消费80交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《上证消费80交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定,我公司确定2011年2月11日为上证消费80交易型开放式指数证券投资基金的基金份额折算日。

特此公告。

招商基金管理有限公司
2011年2月1日