招商中证大宗商品股票指数分级证券投资基金招募说明书

基金管理人:招商基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
二〇一二年五月

重要提示

招商中证大宗商品股票指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会2012年3月5日《关于核准招商中证大宗商品股票指数分级证券投资基金募集的批复》(证监许可〔2012〕283号文)核准公开募集。

招商基金管理有限公司(以下称“本基金管理人”或“管理人”)保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准,但中国证监会对本基金募集的核准,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

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。当投资人赎回时,所得或会高于或低于投资人先前所支付的金额。如对本招募说明书有任何疑问,应寻求独立及专业的财务意见。

本基金为股票型指数基金,具有较高风险、较高预期收益的特征。本基金基金合同生效之日起五年内为分级运作期,本基金分离为预期收益与风险不同的两种份额类别,招商中证商品A份额具有低风险、收益相对稳定的特征;招商中证商品B份额具有高风险、高预期收益的特征。本基金基金合同生效满五年后,即分级运作期届满,本基金直接转换为上市开放式基金(LOF),基金名称变更为“招商中证大宗商品股票指数证券投资基金(LOF)”。

在募集期内,通过代销机构场外认购本基金份额,单笔最低金额为50,000元人民币(含认购费)。通过本公司电子商务网上交易平台办理本基金认购的,最低认购金额为等值50,000元。通过其有基金代销资格的证券公司营业部场内认购本基金,单笔最低认购份额为50,000份。本基金合同生效后,投资者在申购开放日办理招商中证商品份额申赎时,单笔申购的最低金额为50,000元人民币。

投资有风险,过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人所管理的其它基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。投资人在认购(或申购)本基金时应认真阅读本招募说明书。

基金招募说明书自基金合同生效日起,每六个月更新一次,并于每六个月结束之日后的45日内公告,更新内容截至每六个月的最后一日。

一、绪言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)等相关法律法规和《招商中证大宗商品股票指数分级证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)编写。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息,或对本招募说明书作任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写,经经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自使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》、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。

二、释义

在本基金合同中,除非文意另有所指,下列词语或简称具有如下含义:

基金或本基金	依据基金合同所募集的招商中证大宗商品股票指数分级证券投资基金
基金合同	《招商中证大宗商品股票指数分级证券投资基金基金合同》及对本合同的任何有效的修订和补充
招募说明书	《招商中证大宗商品股票指数分级证券投资基金招募说明书》及其定期的更新
托管协议	基金管理人与基金托管人签订的《招商中证大宗商品股票指数分级证券投资基金托管协议》及其任何有效修订和补充
发售公告	《招商中证大宗商品股票指数分级证券投资基金基金份额发售公告》
上市交易公告书	《招商中证大宗商品股票指数分级证券投资基金之招商中证商品A份额与招商中证商品B份额上市交易公告书》
中国	中华人民共和国(《为基金合同目的不包括香港特别行政区、澳门特别行政区及台湾地区》)
法律法规	中国现时有效并公布实施的法律、行政法规、部门规章及规范性文件
《基金法》	《中华人民共和国证券投资基金法》
《销售办法》	《证券投资基金销售管理办法》
《运作办法》	《证券投资基金运作管理办法》
《信息披露办法》	《证券投资基金信息披露管理办法》
元	中国法定货币人民币元
招商中证商品份额	招商中证大宗商品股票指数分级证券投资基金之基础份额
招商中证商品A份额	招商中证大宗商品股票指数分级证券投资基金之稳健收益类份额
招商中证商品B份额	招商中证大宗商品股票指数分级证券投资基金之积极收益类份额
基金份额分级	本基金的基金份额包括招商中证大宗商品股票指数证券投资基金之基础份额、招商中证大宗商品股票指数证券投资基金之稳健收益类份额、招商中证大宗商品股票指数证券投资基金之积极收益类份额
年基准收益率	招商中证商品A份额约定年基准收益率为一月期银行人民币一年期定期存款利率(税后)+3.5%,同期银行人民币一年期定期存款利率以当年1月1日中国人民银行公布的金融机构人民币一年期存款基准利率为准。基金合同生效日所在年度的年基准收益率为基金合同生效日中国人民银行公布的金融机构人民币一年期存款基准利率(税后)+3.5%。每份招商中证商品A份额年基准收益均以1.00元为基准进行计算,但基金管理人并不承诺或保证招商中证商品A份额持有人的该等收益,如在某一会计年度内本基金资产出现极端损失情况下,招商中证商品A份额的基金份额持有人可能会面临无法取得约定应得收益的风险甚至损失本金的风险
中国证监会	中国证券监督管理委员会
银行监管机构	中国银行业监督管理委员会或其他经国务院授权的机构
基金管理人	招商基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金份额持有人	根据基金合同及相关文件合法取得本基金基金份额的投资者
基金代销机构	符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件,取得基金代销业务资格,并与基金管理人签订基金销售与服务代理协议,代为办理本基金发售、申购、赎回和其他基金业务的代理机构
会员单位	指深圳证券交易所会员单位
销售机构	基金管理人及基金代销机构
基金销售网点	基金管理人的直销网点及基金代销机构的代销网点
注册登记业务	基金登记、存管、清算和交收业务,具体内容包括投资者基金账户管理、基金份额注册登记、清算及基金交易确认、发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等
基金注册登记机构	指办理注册登记业务的机构。本基金的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司
基金合同当事人	受基金合同约束,根据基金合同享受权利并承担义务的法律主体,包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人
个人投资者	符合法律法规规定的条件可以投资开放式证券投资基金的自然人
机构投资者	符合法律法规规定可以投资开放式证券投资基金的在中国合法注册登记并存续或经政府有关部门批准设立的并存续的企业法人、事业法人、社会团体和其他组织
合格境外机构投资者	符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理办法》及相关法律法规规定的可投资于中国境内合法募集的证券投资基金的中国境外的基金管理机构、保险公司、证券公司以及其他资产管理机构
投资者	个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和法律法规或中国证监会允许购买开放式证券投资基金的其他投资者的总称
基金合同生效日	基金募集达到法律规定及基金合同约定的条件,基金管理人聘请法定机构验资并办理完毕基金备案手续,获得中国证监会书面确认之日
募集期	自基金份额发售之日起不超过3个月的期限
基金存续期	基金合同生效后合法存续的不定期之期间
日/天	公历日
月	公历月
工作日	上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日
开放日	销售机构办理本基金份额申购、赎回等业务的工作日
T日	申购、赎回或办理其他基金业务的申请日
T+n日	自T日起第n个工作日(不包含T日),n为自然数
销售场所	场外销售场所和场内销售场所,分别简称“场外”和“场内”
场外	通过深圳证券交易所交易系统外的销售机构办理本基金基金份额的认购(场外认购的全部份额将确认为招商中证商品份额),招商中证商品份额的申购和赎回的场所
场内	通过深圳证券交易所内具有相应业务资格的会员单位利用深圳证券交易所交易系统办理本基金基金份额的认购(场内认购的全部份额将按1:1的比率确认为招商中证商品A份额与招商中证商品B份额),招商中证商品A份额与招商中证商品B份额上市交易,招商中证商品份额的申购和赎回的场所
认购	在本基金募集期内投资者通过场内或场外购买本基金基金份额的行为
发售	在本基金募集期内,销售机构向投资者销售本基金份额的行为
申购	基金投资者根据基金销售网点规定的手续,通过场内或场外购买招商中证商品份额的行为。招商中证商品份额的日常申购自基金合同生效后不超过3个月的时间开始办理
赎回	基金份额持有人根据基金销售网点规定的手续,通过场内或场外向基金管理人卖出招商中证商品份额的行为。招商中证商品份额的日常赎回自基金合同生效后不超过3个月的时间开始办理
巨额赎回	在单个开放日,招商中证商品份额的基金份额净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后)扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额,超过上一开放日本基金总份额(包括招商中证商品份额、招商中证商品A份额、招商中证商品B份额)的10%时的情形
上市交易	投资者通过场内会员单位以集中竞价的方式买卖招商中证商品A份额、招商中证商品B份额的行为
基金账户	基金注册登记机构给投资者开立的用于记录投资者持有基金管理人管理的开放式基金份额情况的账户
交易账户	各销售机构为投资者开立的记录投资者通过该销售机构办理基金交易所引起的基金份额的变动及结余情况的账户
注册登记系统	中国证券登记结算有限责任公司开放式基金注册登记系统,通过场外销售机构认购、申购的基金份额登记在注册登记系统
证券登记结算系统	中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记结算系统,通过场内会员单位认购、申购或买入的基金份额登记在证券登记结算系统
场外份额	登记在注册登记系统下的基金份额
场内份额	登记在证券登记结算系统下的基金份额
系统内转托管	基金份额持有人将其持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构(网点)之间或证券登记结算系统内不同会员单位(席位)之间进行转托管的行为
跨系统转托管	基金份额持有人将其持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统之间进行转登记的行为
份额配对转换	根据基金合同的约定,本基金的招商中证商品份额与招商中证商品A份额、招商中证商品B份额之间的配对转换,包括分拆与合并两个方面
分拆	根据基金合同的约定,基金份额持有人将其持有的每两份招商中证商品份额的场内份额申请转换成一份招商中证商品A份额与一份招商中证商品B份额的行为
合并	根据基金合同的约定,基金份额持有人将其持有的每一份招商中证商品A份额与一份招商中证商品B份额进行配对申请转换成两份招商中证商品份额的场内份额的行为
标的指数	中证大宗商品股票指数
基金收益	基金投资所得红利、股息、债券利息、证券投资收益、证券持有期间的公允价值变动、银行存款利息以及其他收入
基金资产总值	基金所拥有的各类证券及票据价值、银行存款本息和本基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和
基金资产净值	基金资产总值扣除负债后的净资产值
分级运作期	指基金合同生效日至基金合同生效日满五年的对应日之期间,如该对应日为非工作日,则顺延至下一个工作日。分级运作期内,本基金分离为预期收益与风险不同的两种份额类别,招商中证商品A份额和招商中证商品B份额。
基金份额净值	指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数
虚拟清算	即假定T日为本基金在分级运作期内的提前终止日,本基金按照基金合同约定的份额收益分配和资产分配规则进行资产分配从而计算得到T日本基金两级基金份额的估算价值
基金份额参考净值	在T日基金资产净值计算的基础上,采用“虚拟清算”原则计算得到T日本基金两级基金份额的估算价值。基金份额参考净值是对两类基金份额价值的一个估算,并不代表基金份额持有人可获得的实际价值
基金资产估值	计算评估基金资产和负债的价值,以确定基金资产净值的过程
货币市场工具	现金一年以内(含一年)的银行定期存款、大额存单;剩余期限在三百九十七天以内(含三百九十七天)的债券;期限在一年以内(含一年)的债券回购;期限在一年以内(含一年)的中央银行票据;中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的金融工具
指定媒体	中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊和互联网网站
不可抗力	本合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

三、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:深圳市深南大道7088号招商银行大厦28楼
设立日期:2002年12月27日
注册资本:人民币2.1亿元
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
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)增加为人民币三亿元(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旗下金融企业,经过二十年创业发展,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,投资业务遍及60多个国家。

公司本着“敬信、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)目前所管理基金的基本情况

本基金管理公司目前管理二十四只共同基金,包括:招商安泰系列开放式证券投资基金(含招商安泰股票基金、招商安泰平衡型基金、招商安泰债券基金)、招商现金增值开放式证券投资基金、招商先锋混合型证券投资基金、招商优质成长股票型证券投资基金(LOF)、招商安本增利债券型证券投资基金、招商核心价值混合型证券投资基金、招商大盘蓝筹股票型证券投资基金、招商安心收益债券型证券投资基金、招商行业领先股票型证券投资基金、招商中小盘精选股票型证券投资基金、招商全球资源股票型证券投资基金(QDII)、招商深证100指数型证券投资基金、招商信用添利债券型证券投资基金、上证消费80交易型开放式指数证券投资基金、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、招商金砖四国指数型证券投资基金(QDII)、招商安瑞进取债券型证券投资基金、深证电子信息传媒交易型开放式指数证券投资基金、招商电子信息传媒交易型开放式指数证券投资基金联接基金、招商安达保本混合型证券投资基金、招商优势企业灵活配置混合型证券投资基金、招商产业债券型证券投资基金。

(三)主要人员情况

1、基金管理人董事、监事及高级管理人员介绍:

马蔚华,男,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,任中国人民银行沈阳分行副主任;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,任中国人民银行南南省分行行长兼国家外汇管理局南南分局局长;1999年3月至今任招商银行行长。现任本公司董事长。

斐利佳(Grant Bailey),男,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济参赞;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(澳洲)总经理及投资总监;1999年11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(纽约)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。现任本公司副董事长。

邓晓力,女,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,分管财务部、风险控制部、清算中心、培训中心。现任本公司董事。

许小松,男,经济学博士。历任深圳证券交易所综合研究所副所长,南方基金管理有限公司首席经济学家、副总经理,国联安基金管理有限公司总经理,?2011年加入招商基金管理有限公司,现任公司总经理、董事。

郑文光,男,美国海险管理学会海险管理院士,香港中文大学工商管理硕士。1973年至1984年间先后担任美国友邦保险有限公司香港区副总裁助理、市场拓展部经理、副总裁(营业部)等职务;1984年至2000年间先后担任安泰人寿保险(百慕达)有限公司助理总经理、总经理、执行董事等职务;2000年至2009年间担任ING集团亚太区香港、澳门地区总经理。1988年至今担任香港海港扶轮社社员;1999年至今担任香港童军总会荣誉秘书及公共关系委员会主席。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,巨田证券监事主席,巨田基金管理有限公司董事等职务。2006年至2007年,任职于中集集团,出任南美战略发展项目负责人。2008年至今,出任招商局中国基金有限公司(HK0133)之董事及招商局中国投资管理有限公司的董事总经理。现任公司独立董事。

张卫华,女,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董事;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,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月起任招商银行总行计划财务部负责人,现任本公司监事。

林嘉丽,女,香港地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。

路明,男,中南财经政法大学金融学硕士。1999年加入银华基金管理公司,担任交易主管职务;2005年加入东方基金管理公司,担任交易总监职务;2006年7月加入招商基金管理有限公司,曾任交易部高级交易员、首席交易员,现任交易部总监,公司监事。

庄东亩,男,清华大学工学硕士。1996年加入中国人民银行深圳市中心支行科技处;1997年加入招商银行总行电脑部;2002年起参与招商基金管理有限公司筹备,公司成立后曾任信息技术部高级经理、副总监,现任信息技术部总监,公司监事。

杨荣,男,芝加哥大学商学院MBA优异毕业生。杨荣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兼投资经理,现任公司副总经理兼投资经理。

王晓东,女,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。

赵生辉,男,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任项目经理、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,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。

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处从事风险管理工作;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、总监,现任公司督察长兼董事会秘书。

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指数证券投资基金基金经理(管理时间:2010年6月22日至今)、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(TMT50)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)。

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、总经理助理兼固定收益投资部负责人张国强、总经理助理兼股票投资部负责人袁野、专户资产投资部总监杨静、国际业务部负责人刘冬、研究部总监陈玉辉、交易部总监路明。

4、上述人员之间均不存在近亲属关系。

(四)基金管理人职责

根据《基金法》、基金管理人必须履行以下职责:

1.按法募集基金,办理或者委托经国务院证券监督管理机构认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜;

2.办理基金备案手续;

3.对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账,进行证券投资;

4.按照基金合同的约定确定基金收益分配方案,及时向基金份额持有人分配收益;

5.进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;

6.编制中期和年度基金报告;

7.计算并公告基金资产净值,确定基金份额申购、赎回及转换价格;

8.办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项;

9.召集基金份额持有人大会;

10.保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料;

11.以基金管理人名义,代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为;

12.国务院证券监督管理机构规定的其他职责。

(下转D10版)

招商中证大宗商品股票指数分级证券投资基金份额发售公告

基金管理人:招商基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
注册登记人:中国证券登记结算有限责任公司
销售机构:招商基金管理有限公司
中国工商银行股份有限公司　　招商银行股份有限公司
招商证券股份有限公司
及招商基金管理有限公司授权的其他代销机构

重要提示

1.招商中证大宗商品股票指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”、“招商中证大宗商品股票指数分级证券投资基金”)的发售已获中国证监会证监许可〔2012〕283号文批准。

2.本基金类型为契约型开放式。

3.本基金的管理人为招商基金管理有限公司(以下简称“招商基金”或“本公司”),托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称“中国工商银行”),注册登记人为中国证券登记结算有限责任公司。

4.本基金自2012年5月21日到2012年6月21日公开发售,其中,场外通过基金管理人的直销中心、网上电子商务交易系统和本基金管理人委托的其他代销机构发售;场内通过具有基金代销资格的深圳证券交易所会员单位发售。基金管理人可根据募集情况适当延长或缩短本基金的募集期限并及时公告。

5.本基金的发售对象是中国境内的个人投资者和机构投资者(法律法规禁止投资证券投资基金的除外),合格境外机构投资者及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者。

6.投资者可通过场外认购和场内认购两种方式进行认购。本基金通过场外发售的销售机构包括直销机构和代销机构。其中,直销机构包括本基金管理人的直销中心和电子商务网上交易平台,代销机构包括中国工商银行股份有限公司(以下简称“工商银行”)、招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)、招商证券股份有限公司(以下简称“招商证券”)及招商基金管理有限公司授权的其他代销机构。办理本基金场内认购的销售机构为具有基金代销业务资格的深圳证券交易所会员单位,具体名单可在深交所网站查询。销售机构认购业务的办理网点、办理日期和时间等事项照各销售机构的具体规定。

7.若投资者欲通过场外认购本基金,须开立中国证券登记结算有限责任公司的深圳开放式基金账户。若已经在中国证券登记结算有限责任公司开立深圳开放式基金账户的,则不需要再次办理开户手续。募集期内本公司直销机构的直销中心、电子商务网上交易平台和指定的基金销售代理机构网点同时为投资者办理场外认购的开户和认购手续。

若投资人欲通过场内认购本基金,需持有深圳证券账户(即投资者在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开立的深圳证券交易所人民币普通股票账户(以下简称“深圳A股账户”)或证券投资基金账户),已有该类账户的投资者无须另行开立,尚无该类账户的投资者可通过中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司的开户代理机构开立账户。募集期内具有基金代销资格的深交所会员单位可同时为投资者办理场内认购的开户和认购手续。

除法律法规另有规定外,一个投资者只能开设和使用一个基金账户。

8.在募集期内,通过代销机构场外认购本基金份额,单笔最低金额为50,000元人民币(含认购费)。通过本公司直销中心首次认购的最低金额为50万元人民币(含认购费)。通过招商证券股份有限公司电子商务网上交易平台办理本基金认购的,最低认购金额为单笔50,000元人民币。通过其有基金代销资格的深交所会员单位场内认购本基金,单笔最低认购份额为50,000份,超过50,000份的须为1,000份的整数倍,且每笔认购最大不超过99,999,000份基金份额。本基金募集期间对单个基金份额持有人不设置最高累计认购金额限制。

9.销售机构(包括各代销机构及我公司直销中心)对认购的受理并不代表该申请一定成功,而仅代表销售机构接受了认购申请,申请的成功与否应以基金管理人的确认结果为准。投资者在发售期内可以多次认购基金份额,已经正式受理的认购申请不得撤销。投资者可以在基金合同生效后到原认购网点查询成交确认情况。

10.投资者认购款项在基金合同生效前的利息折合成基金份额记入投资者账户,具体份额数以注册登记人的记录为准。

11.本公告仅对本基金发售的有关事项和规定予以说明。投资者欲了解本基金的详细情况,请详细阅读刊登在2012年5月16日的《证券时报》和《上海证券报》上的《招商中证大宗商品股票指数分级证券投资基金招募说明书》。

12.本基金的招募说明书及本公告将同时发布在本公司网站(www.cmfchina.com)。投资者亦可通过本公司网站下载基金业务申请表格和了解本基金发售的相关事宜。

13.中国工商银行、招商证券、等代销机构的代销网点以及开户和认购等事项详见各代销机构在各代销城市当地主要媒体刊登的公告或在各代销网点发布的公告。

14.对位于未开设销售网点地区的投资者,可按打本公司的客户服务电话(400-887-9555(免长途费))垂询认购事宜。

15.在发售期间,除本公告所列的代销机构外,如增加其他代销机构,或已有代销机构增加新的代销网点,本公司将及时公告。请留意近期本公司及各代销机构的公告,或按打本公司及各代销机构客户服务电话咨询。

16.投资人应当通过本公司或本公司授权的其他代销机构购买和赎回基金,基金代销机构名单详见本基金《招募说明书》以及相关公告。

17.本公司可综合各种情况对发售安排做适当调整,并可根据基金销售情况适当延长或缩短基金发售时间,并及时公告。

18.风险提示

(1)证券投资基金(以下简称“基金”)是一种长期投资工具,其主要功能是分散投资,降低投资单一证券所带来的个别风险。基金不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具。投资人购买基金,既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益,也可能承担基金投资所带来的损失。

(2)基金在投资运作过程中可能面临各种风险,既包括市场风险,也包括基金自身的管理风险、技术风险和合规风险等,也包括本基金的指数投资风险、杠杆机制风险、折溢价交易风险、以及份额配对转换及基金份额折算等业务办理过程中特定风险等等。

(3)基金分为股票基金、混合基金、债券基金、货币市场基金等不同类型,投资人投资不同类型的基金将获得不同的收益预期,也将承担不同程度的风险。一般来说,基金的收益预期越高,投资人承担的风险也越大。

(4)投资人应当认真阅读《基金合同》、《招募说明书》等基金法律文件,了解基金的风险收益特征,并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断本基金是否与投资人的风险承受能力相适应。

(5)本基金为股票型指数基金,具有较高风险、较高预期收益的特征。从本基金所分离的两类基金份额来看,招商中证商品A份额具有低风险、收益相对稳定的特征;招商中证商品B份额具有高风险、高预期收益的特征。招商中证商品A份额和招商中证商品B份额上市交易后,由于受市场供求关系的影响,基金份额的交易价格与基金份额参考净值可能发生偏离而出现折溢价交易风险。基金管理人不承诺或保证招商中证商品A份额的约定收益,如在本基金存续期内基金资产出现极端损失的情况下,招商中证商品A份额的基金份额持有人可能会面临无法取得约定收益甚至损失本金的风险。

(6)基金管理人建议基金投资者在选择本基金之前,通过正规的途径,如:招商基金客户服务热线(400887955),招商基金公司网站(www.cmfchina.com)或者通过其他代销机构,对本基金进行充分、详细的了解。在对自己的资金状况、投资期限、收益预期和风险承受能力做出客观合理的评估后,再做出是否投资的决定。投资者应确保在投资本基金后,即使出现短期的亏损也不会给自己的正常生活带来很大的影响。

(7)投资人应当充分了解基金定期定额投资和零存整取等储蓄方式的区别。定期定额投资是引导投资人进行长期投资、平均投资成本的一种简单易行的投资方式。但是定期定额投资并不能规避基金投资所固有的风险,不能保证投资人获得收益,也不是替代储蓄的等效理财方式。

(8)基金管理人提请投资人特别注意,因基金份额拆分、分红等行为导致基金份额净值变化,不会改变基金的风险收益特征,也不是特别会降低基金投资风险或提高基金投资收益。因基金份额拆分、分红等行为导致基金份额净值调整至1元初始面值,在市场波动等因素的影响下,基金投资仍有可能出现亏损或基金份额净值仍有可能低于初始面值。

(9)基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。请投资者正确认识和对待本基金未来可能的收益和风险。基金管理人管理的其他基金的业绩不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则,在做出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资人自行负担。

一、本次基金发售的基本情况

(一)基金名称

基金名称:招商中证大宗商品股票指数分级证券投资基金。
基金简称:招商中证大宗商品指数分级
场内简称:大宗商品。
基金代码:161715。

(二)基金类别

股票型证券投资基金。

(三)基金存续期限

不定期。

(四)基金份额初始面值

基金份额初始面值为1.00元人民币。

(五)募集目标

本基金不设募集目标上限。

(六)发售对象

中国境内的个人投资者和机构投资者(法律法规禁止投资证券投资基金的除外),合格境外机构投资者及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者。

(七)发售时间安排

本基金的发售期自2012年5月21日至2012年6月21日。如遇突发事件,发售时间可适当调整。

(八)办理认购的销售机构与销售地点

1、场外发售机构

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)
招商基金电子商务平台“基金易”
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:李海
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 66290510
联系人:孔鹏
招商基金养老金业务部
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:付小彬
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

②代销机构:工商银行、招商银行、招商证券、中银万国证券、中航证券、华融证券、国信证券、平安证券、安信证券、国海证券、广州证券、华泰证券、国泰君安证券、光大证券、中银国际、东海证券、华宝证券、华安证券、国元证券、东吴证券、齐鲁证券、山西证券、中国银河证券、中信建投证券、中信证券、宏源证券、信达证券、民生证券、中信证券(浙江)(原中信金通证券)、中信万通证券、华西证券、万和证券(排名不分先后)。

在基金募集期内新增加的代销机构将另行公告。

上述代销机构在各代销城市的销售网点及联系方式等具体事项详见各销售机构的相关公告。

2、场内发售机构

本基金的场内发售机构为具有基金代销业务资格的深圳证券交易所会员单位。包括:爱建证券、安信证券、渤海证券、财达证券、财富证券、财通证券、长城证券、长江证券、大通证券、大同证券、德邦证券、第一创业、东北证券、东方证券、东海证券、东莞证券、东吴证券、高华证券、方正证券、光大证券、华福证券、广发证券、广州证券、国都证券、国海证券、国金证券、国开证券、国联证券、国盛证券、国泰君安、国信证券、国元证券、海通证券、恒泰证券、红塔证券、宏源证券、华安证券、华宝证券、华创证券、华林证券、华龙证券、华融证券