招商中证大宗商品股票指数分级证券投资基金之商品粤、商品月上市交易公告书

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
注册登记人：中国证券登记结算有限责任公司
上市地点：深圳证券交易所
上市时间：圆园员圆年苑月圆缘日
公告时间：圆园员圆年苑月圆园日

一、重要声明与提示

招商中证大宗商品股票指数分级证券投资基金渊以下简称野本基金冶冤之商品粤尧商品月上市交易公告书依据叶中华人民共和国证券投资基金法曳渊以下简称野叶基金法曳冶冤尧叶证券投资基金信息披露内容与格式准则第员号约上市交易公告书的内容与格式曳和叶深圳证券交易所证券投资基金上市规则曳的规定编制袁本基金管理人的董事会及董事保证本上市交易公告书渊以下简称野本公告书冶冤所载资料不存在虚假记载尧误导性陈述或者重大遗漏袁并对其内容的真实性尧准确性和完整性承担个别及连带责任遥

本基金托管人保证本公告中基金财务会计资料等内容的真实性尧准确性和完整性袁承诺其中不存在虚假记载尧误导性陈述或者重大遗漏遥

中国证监会尧证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见袁均不表明对本基金的任何保证遥

本公告书第七节野基金财务状况冶未经审计遥

凡本公告未涉及的有关内容袁请投资者详细查阅刊登在圆园员圆年缘月员缘日叶证券时报曳尧叶上海证券报曳及招商基金管理有限公司网站渊www.cmfchina.com冤上的叶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曳遥

二尧基金概览

员尧基金名称院招商中证大宗商品股票指数分级证券投资基金

圆尧基金类型院股票型

猿尧基金运作方式院契约型开放式

源尧本基金的基金份额包括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渊简称野招商中证商品份额冶袁场内简称野大宗商品冶袁基金代码院员远员苑员缘冤尧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渊简称野招商中证商品粤份额冶袁场内简称野商品粤冶袁基金代码院员缘园园怨远冤与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渊简称野招商中证商品月份额冶袁场内简称野商品月冶袁基金代码院员缘园园怨苑冤遥其中袁招商中证商品粤份额尧招商中证商品月份额的基金份额配比始终保持员颐员的比例不变遥

缘尧本基金合同生效满五年后袁在满足基金合同约定的存续条件下袁本基金无需召开基金份额持有人大会袁直接转换为上市开放式基金渊蕴韵云冤袁基金名称变更为野招商中证大宗商品股票指数证券投资基金渊蕴韵云冤冶袁原招商中证商品粤份额和招商中证商品月份额终止运作袁全部转换成招商中证大宗商品股票指数证券投资基金渊蕴韵云冤的基金份额遥

远尧基金存续期限院不定期

苑尧招商中证商品份额的申购与赎回院本基金合同生效后袁投资人可通过场外或场内两种方式对招商中证商品份额进行申购与赎回遥招商中证商品粤份额尧招商中证商品月份额只上市交易袁不接受申购与赎回遥招商中证商品份额的场外申购与赎回的场所包括基金管理人和基金管理人委托的场外代销机构袁投资者可使用中国证券登记结算有限责任公司开放式基金账户袁通过基金管理人或场外代销机构办理场外申购与赎回业务遥招商中证商品份额的场内申购与赎回场所为具有基金代销业务资格且符合深圳证券交易所风险控制要求的深圳证券交易所会员单位袁投资者可使用深圳证券账户袁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或证券投资基金账户袁通过深圳证券交易所交易系统办理场内申购与赎回业务遥

愿尧份额配对转换院份额配对转换是指本基金的招商中证商品份额与招商中证商品粤份额尧招商中证商品月份额之间的配对转换袁包括分拆和合并两个方面遥分拆是指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粤份额与一份招商中证商品月份额的行为遥合并是指基金份额持有人将其持有的每一份招商中证商品粤份额与一份招商中证商品月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遥

怨尧定期份额折算院在分级运作期内的每个会计年度渊除基金合同生效日所在会计年度外冤第一个工作日袁招商中证商品粤份额和招商中证商品月份额按基金合同中规定的净值计算规则进行净值计算遥对于招商中证商品粤份额期末的约定应得收益袁即招商中证商品粤份额每个会计年度员圆月猿员日份额净值超出员援园园园元部分袁将折算为场内招商中证商品份额分配给招商中证商品粤份额持有人遥招商中证商品份额持有人持有的每圆份招商中证商品份额将按员份招商中证商品粤份额获得新增招商中证商品份额的分配遥在基金份额折算前与折算后袁招商中证商品粤份额和招商中证商品月份额的份额配比保持员颐员的比例遥

员园尧不定期份额折算院当招商中证商品份额的基金份额净值达到圆援园园园元后袁本基金将分别对招商中证商品粤份额尧招商中证商品月份额和招商中证商品份额进行份额折算袁份额折算后本基金将确保招商中证商品粤份额和招商中证商品月份额的比例为员颐员袁份额折算后招商中证商品粤份额和招商中证商品月份额的参考净值尧招商中证商品份额的基金份额净值均调整为员援园园园元遥

当招商中证商品月份额的基金份额参考净值达到园援圆缘园元后袁本基金将分别对招商中证商品粤份额尧招商中证商品月份额和招商中证商品份额进行份额折算袁份额折算后本基金将确保招商中证商品粤份额和招商中证商品月份额的比例为员颐员袁份额折算后招商中证商品份额的基金份额净值尧招商中证商品粤份额和招商中证商品月份额的基金份额参考净值均调整为员援园园园元遥

员员尧基金份额总额院截至圆园员圆年苑月员愿日袁本基金的基金份额总额为[illegible]份袁其中袁招商中证商品份额为[illegible]份袁招商中证商品粤份额为[illegible]份袁招商中证商品月份额为[illegible]份遥

员圆尧基金份额参考净值院截至圆园员圆年苑月员愿日袁招商中证商品份额的基金份额净值为[illegible]元袁招商中证商品粤份额的基金份额参考净值为[illegible]元袁招商中证商品月份额的基金份额参考净值为[illegible]元遥

员猿尧本次上市交易的基金份额场内简称及其基金代码院商品粤袁基金代码院员缘园园怨远曰商品月袁基金代码院员缘园园怨苑遥

员源尧本次上市交易的基金份额总额院商品粤为[illegible]份袁商品月为[illegible]份渊截至圆园员圆年苑月员愿日冤

员缘尧上市交易的证券交易所院深圳证券交易所

员远尧上市交易日期院圆园员圆年苑月圆缘日

员苑尧基金管理人院招商基金管理有限公司

员愿尧基金托管人院中国工商银行股份有限公司

员怨尧本次上市交易的基金份额注册登记机构院中国证券登记结算有限责任公司

三尧基金的募集与上市交易

渊一冤上市前基金募集情况

员尧基金募集申请的核准机构和核准文号院中国证券监督管理委员会证监许可揖圆园员圆铱[illegible]号

圆尧基金合同生效日院圆园员圆年远月圆苑日

猿尧基金运作方式院契约型开放式

源尧基金合同期限院不定期

缘尧发售日期院圆园员圆年缘月圆员日到圆园员圆年远月圆圆日

远尧发售价格院员援园园元人民币

苑尧发售方式院场内和场外

愿尧发售机构院

渊员冤场内发售机构院

本基金的场内发售机构为具有基金代销资格的深圳证券交易所会员单位渊具体名单可在深圳证券交易所网站查询冤遥

渊圆冤场外发售机构院

员冤直销机构包括本公司的招商基金电子商务平台野基金易冶袁招商基金华东机构理财中心尧招商基金华南机构理财中心尧招商基金华北机构理财中心尧招商基金养老金业务部等遥

圆冤代销机构院工商银行尧招商银行尧招商证券尧申银万国证券尧中航证券尧华融证券尧国信证券尧平安证券尧安信证券尧国海证券尧广州证券尧华泰证券尧国泰君安证券尧光大证券尧中银国际尧东海证券尧华宝证券尧华安证券尧国元证券尧东吴证券尧齐鲁证券尧山西证券尧中国银河证券尧中信建投证券尧中信证券尧宏源证券尧信达证券尧民生证券尧中信证券渊浙江冤尧中信金通证券尧中信万通证券尧西部证券尧万和证券渊排名不分先后冤遥

怨尧验资机构名称院毕马威华振会计师事务所

员园尧募集资金总额及入账情况

本基金于圆园员圆年缘月圆员日起公开募集袁基金募集工作已于圆园员圆年远月圆圆日顺利结束遥经毕马威华振会计师事务所验资袁本次募集的净认购金额为[illegible]元人民币袁认购资金在募集期间产生的利息共计[illegible]元人民币遥募集资金已于圆园员圆年远月圆苑日划入本基金在基金托管人中国工商银行股份有限公司开立的基金托管专户遥

本次募集有效认购总户数为[illegible]户遥按照每份基金份额发售面值员援园园元人民币计算袁募集期募集金额渊含所募集股票市值冤及利息结转的基金份额共计[illegible]份袁已全部计入投资者账户袁归投资者所有遥

员员尧本基金募集备案情况

根据叶中华人民共和国证券投资基金法曳尧叶证券投资基金运作管理办法曳以及叶招商中证大宗商品股票指数分级证券投资基金基金合同曳尧叶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曳的有关规定袁本基金募集符合有关条件袁本基金管理人已向中国证监会办理基金备案手续袁并于圆园员圆年远月圆苑日获书面确认袁基金合同自该日起正式生效遥自基金合同生效之日起袁本基金管理人开始正式管理本基金遥

员圆尧基金合同生效日的基金份额总额院[illegible]份

员猿尧本基金管理人及基金从业人员持有基金份额的情况院

份额级别		招商中证商品粤	招商中证商品月	招商中证大宗商品指数分级
募集期间基金管理人运用固有资金认购本基金情况	认购的基金份额渊单位院份冤	原	原	原
	占基金总份额比例	原	原	原
	其他需要说明的事项	原	原	原
募集期间基金管理人的从业人员认购本基金情况	认购的基金份额渊单位院份冤	原	原	[illegible]
	占基金总份额比例	原	原	[illegible]

本基金管理人的高级管理人员尧基金投资和研究部门负责人未持有本基金袁本基金的基金经理持有该只基金份额总量的数量区间为员万份至缘万份遥

渊二冤基金上市交易的主要内容

员尧基金上市交易的核准机构和核准文号院深圳证券交易所深证上揖圆园员圆铱[illegible]号

圆尧上市交易日期院圆园员圆年苑月圆缘日

猿尧上市交易的证券交易所院深圳证券交易所遥投资者在深圳证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金交易遥

源尧基金简称院招商中证商品粤份额尧招商中证商品月份额

基金场内简称院商品粤尧商品月

缘尧交易代码院商品粤院员缘园园怨远曰商品月院员缘园园怨苑

远尧本次上市交易份额院商品粤院[illegible]份曰商品月院[illegible]份

苑尧本上市交易份额的流通规定院对于托管在场内的招商中证商品份额袁基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下袁将其分拆为商品粤和商品月即可上市流通曰对于托管在场外的招商中证商品份额袁基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下袁将其跨系统转托管至深圳证券交易所场内后分拆为商品粤和商品月即可上市流通遥

愿尧基金资产净值的披露院在招商中证商品粤份额尧招商中证商品月份额上市交易前或者开始办理招商中证商品份额申购或者赎回后袁基金管理人应当在每个开放日的次日袁通过网站尧基金份额发售网点以及其他媒介袁披露开放日招商中证商品份额的基金份额净值和基金份额累计净值尧招商中证商品粤份额与招商中证商品月份额的基金份额参考净值遥分级运作期到期后袁本基金转换为上市开放式基金渊蕴韵云冤袁基金管理人应当在每个开放日的次日袁通过网站尧基金份额发售网点以及其他媒介袁披露本基金的基金份额净值和基金份额累计净值遥

四尧持有人户数尧持有人结构及前十名持有人情况

渊一冤持有人户数

截至圆园员圆年苑月员愿日袁场外招商中证商品份额持有人户数为[illegible]户袁平均每户持有的基金份额为[illegible]份曰场内招商中证商品份额持有人户数为[illegible]户袁平均每户持有的基金份额为[illegible]份曰商品月为[illegible]户袁平均每户持有的基金份额为[illegible]份遥

渊二冤持有人结构

截至圆园员圆年苑月员愿日袁机构投资者持有的本次上市交易的商品粤基金份额为[illegible]份袁占本次商品粤上市交易基金份额比例为[illegible]曰个人投资者持有的本次上市交易的商品粤基金份额为[illegible]份袁占本次商品粤上市交易基金份额比例为[illegible]遥

机构投资者持有的本次上市交易的商品月基金份额为[illegible]份袁占本次商品月上市交易基金份额比例为[illegible]曰个人投资者持有的本次上市交易的商品月基金份额为[illegible]份袁占本次商品月上市交易基金份额比例为[illegible]遥

渊三冤前十名场内基金份额持有人情况渊截至圆园员圆年苑月员愿日冤

序号	持有人名称渊全称冤	持有商品粤	占商品粤的比例渊豫冤	持有商品月	占商品月的比例渊豫冤
员	丁碧霞	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]
圆	兴业证券股份有限公司	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]
猿	国泰君安证券股份有限公司	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]
源	浙商证券－农行－浙商汇金员号集合资产管理计划	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]
缘	红塔证券股份有限公司	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]
远	华泰证券股份有限公司	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]
苑	长城证券有限责任公司	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]
愿	光大证券股份有限公司	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]
怨	华融证券股份有限公司	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]
员园	恒泰证券股份有限公司	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]
合计		[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]

注院以上信息依据中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司提供的持有人信息编制遥

五尧基金主要当事人简介

渊一冤基金管理人

员尧公司概况

名称院招商基金管理有限公司

法定代表人院马蔚华

总经理院许小松

设立日期院圆园园圆年员圆月圆苑日

注册地址院深圳市深南大道苑园愿愿号招商银行大厦圆愿楼

注册资本院人民币圆亿元

办公地址院深圳市深南大道苑园愿愿号招商银行大厦圆愿楼

设立批准文号院中国证监会证监基金字揖圆园园圆铱员园园号

工商登记注册的法人营业执照文号院企合国字第[illegible]号

经营范围院基金募集尧基金销售尧资产管理及中国证监会许可的其他业务遥

存续期间院持续经营

电话院[illegible]

传真院[illegible]

联系人院赖倩

圆尧股东及其出资比例

管理人股东名称	占注册资本比例
招商银行股份有限公司	[illegible]
招商证券股份有限公司	[illegible]
[illegible]	[illegible]

猿尧内部组织结构及职能

公司具体经营管理由总经理负责袁公司根据经营运作需要设置董事会办公室尧股票投资部尧固定收益投资部尧交易部尧研究部尧专户资产投资部尧量化投资部尧渠道管理部尧市场部尧产品研发部尧国际业务部尧华东机构理财中心尧华南机构理财中心尧华北机构理财中心尧养老金业务部尧信息技术部尧基金核算部尧基金事务部尧法律合规部尧风险管理部尧总经理办公室尧人力资源部尧财务部等圆愿个职能部门袁并设有北京分公司尧上海分公司等分支机构遥

各部门主要职能如下院

董事会办公室院负责公司董事会相关工作遥

股票投资部院根据投资决策委员会制定的原则进行股票投资遥

固定收益投资部院负责固定收益产品的投资遥

交易部院负责公司所有产品的交易管理工作遥

研究部院负责宏观尧策略尧行业和公司研究遥

专户资产投资部院负责专户产品的投资遥

量化投资部院负责量化产品和指数产品的投资遥

渠道管理部院负责基金的渠道销售工作遥

市场部院负责营销策划尧客户服务尧市场推广等工作遥

产品研发部院负责产品研发尧申报等工作遥

国际业务部院负责海外基金产品的投资研究遥

华东机构理财中心尧华南机构理财中心尧华北机构理财中心尧养老金业务部院负责机构销售业务遥

信息技术部院负责公司电脑信息技术的开发尧维护及基金后台运作支持工作遥

基金核算部院负责公司基金的会计核算尧估值遥

基金事务部院负责基金的注册登记尧资金清算遥

法律合规部院负责对公司和基金运作合规性监察尧稽核审计尧法务支持及日常信息披露事宜遥

风险管理部院负责对公司日常营运进行风险管理及风险检查曰负责投资业绩评价遥

总经理办公室院负责文档尧印鉴管理尧公司品牌建设尧市场调研以及其他行政工作遥

人力资源部院负责公司人力资源管理工作遥

财务部院负责公司财务管理尧会计核算等相关工作遥

各分公司院负责所辖区域内销售渠道的开发尧维护遥

源尧人员情况

截至圆园员圆年远月猿园日袁公司共有员工员愿远人袁其中员缘远人具有硕士学历袁源人具有博士学历遥公司主要业务部门人员大部分具有基金从业资格遥

缘尧信息披露负责人及咨询电话院

欧志明袁[illegible]

远尧基金管理业务情况

本基金管理公司目前管理二十五只基金袁其中封闭式基金一只院招商信用添利债券型证券投资基金曰开放式基金二十四只遥

苑尧本基金基金经理简介

王平先生袁中南大学管理科学与工程专业硕士遥圆园园远年加入招商基金管理有限公司袁历任投资风险管理部助理数量分析师尧风险管理部数量分析师尧高级风控经理尧副总监袁主要从事投资风险管理尧金融工程与数量化投资策略研究尧指数期货投资策略研究等工作遥现任招商深证[illegible]指数证券投资基金基金经理渊管理时间为[illegible]至今冤尧招商上证消费[illegible]交易型开放式指数证券投资基金及联接基金基金经理渊管理时间为[illegible]至今冤尧深证电子信息传媒产业渊[illegible]冤交易型开放式指数证券投资基金及联接基金基金经理渊管理时间为[illegible]至今冤尧招商中证大宗商品股票指数分级证券投资基金基金经理渊管理时间为圆园员圆年远月圆苑日至今冤遥

渊二冤基金托管人

员尧基金托管人概况

名称院中国工商银行股份有限公司渊简称野中国工商银行冶冤

注册地址院北京市西城区复兴门内大街缘缘号

办公地址院北京市西城区复兴门内大街缘缘号

法定代表人院姜建清

设立日期院员怨愿源年员月员日

注册资本院人民币[illegible]元

批准设立机关和设立文号院国务院叶关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定曳渊国发揖员怨愿猿铱员源远号冤

存续期间院持续经营

基金托管资格批文及文号院中国证监会证监基字揖员怨怨愿铱猿号

电话院[illegible]

联系人院赵会军

圆尧主要人员情况

截至圆园员圆年猿月末袁中国工商银行资产托管部共有员工[illegible]人袁平均年龄猿园岁袁[illegible]豫以上员工拥有大学本科以上学历袁高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称遥

猿尧证券投资基金托管情况

作为中国大陆托管服务的先行者袁中国工商银行自员怨怨愿年在国内首家提供托管服务以来袁秉承野诚实信用尧勤勉尽责冶的宗旨袁依靠严密科学的风险管理和内部控制体系尧规范的管理模式尧先进的营运系统和专业的服务团队袁严格履行资产托管人职责袁为境内外广大投资者尧金融资产管理机构和企业客户提供安全尧高效尧专业的托管服务袁展现优异的市场形象和影响力遥建立了国内托管银行中最丰富尧最成熟的产品线遥拥有包括证券投资基金尧信托资产尧保险资产尧社会保障基金尧安心账户资金尧企业年金基金尧[illegible]资产尧[illegible]资产尧股权投资基金尧证券公司集合资产管理计划尧证券公司定向资产管理计划尧商业银行信贷资产证券化尧基金公司特定客户资产管理尧[illegible]专户资产尧[illegible]等门类齐全的托管产品体系袁同时在国内率先开展绩效评估尧风险管理等增值服务袁可以为各类客户提供个性化的托管服务遥截至圆园员圆年猿月袁中国工商银行共托管证券投资基金[illegible]只袁其中封闭式[illegible]只袁开放式[illegible]只遥自圆园园源年以来袁本行连续八年获得香港叶亚洲货币曳尧英国叶全球托管人曳尧香港叶财资曳尧美国叶环球金融曳及内地叶证券时报曳尧叶上海证券报曳等境内外权威财经媒体评选的员怨项最佳托管银行大奖曰是获得奖项最多的国内托管银行袁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遥

渊三冤基金验资机构

名称院毕马威华振会计师事务所

注册地址院北京市东长安街员号东方广场东二办公楼八层

法定代表人院姚建华

电话院[illegible]

传真院[illegible]

经办注册会计师院郭琼尧林高攀

联系人院郭琼

六尧基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件遥

七尧基金财务状况

渊一冤基金募集期间费用

本次基金募集期间所发生的信息披露费尧会计师费尧律师费以及其他费用袁不从基金资产中支付遥

渊二冤基金上市前重要财务事项

本基金发售后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生遥

渊三冤基金资产负债表

截至公告前两个工作日即圆园员圆年苑月员愿日袁本基金的资产负债表如下院

资产负债表

会计主体院招商中证大宗商品股票指数分级证券投资基金

报告截止日院圆园员圆年苑月员愿日　单位院人民币元

资产	本报告期末 圆园员圆年苑月员愿日
资产院	
银行存款	[illegible]
结算备付金	[illegible]
存出保证金	[illegible]
交易性金融资产	[illegible]
其中院股票投资	[illegible]
债券投资	原
资产支持证券投资	原
基金投资	原
衍生金融资产	原
买入返售金融资产	[illegible]
应收证券清算款	[illegible]
应收利息	[illegible]
应收股利	[illegible]
应收申购款	原
其他资产	[illegible]
资产合计	[illegible]
负债和所有者权益	
负债院	
短期借款	原
交易性金融负债	原
衍生金融负债	原
卖出回购金融资产款	原
应付证券清算款	原
应付赎回款	原
应付管理人报酬	[illegible]
应付托管费	[illegible]
应付销售服务费	原
应付交易费用	[illegible]
应付税费	原
应付利息	原
应付利润	原
其他负债	[illegible]
负债合计	[illegible]
所有者权益院	
实收基金	[illegible]
未分配利润	[illegible]
所有者权益合计	[illegible]
负债与持有人权益总计	[illegible]

注院截至圆园员圆年苑月员愿日袁招商中证商品份额净值[illegible]元尧招商中证商品粤份额净值[illegible]元尧招商中证商品月份额净值[illegible]元曰招商中证商品份额[illegible]份尧招商中证商品粤份额[illegible]份尧招商中证商品月份额[illegible]份遥

八尧基金投资组合

截至公告前两个工作日即圆园员圆年苑月员愿日渊以下称野报告期末冶冤袁本基金的投资组合如下院

渊一冤报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额渊元冤	占基金总资产的比例渊豫冤
员	权益投资	[illegible]	[illegible]
	其中院股票	[illegible]	[illegible]
圆	固定收益投资	原	原
	其中院债券	原	原
	资产支持证券	原	原
猿	金融衍生品投资	原	原
源	买入返售金融资产	[illegible]	[illegible]
	其中院买断式回购的买入返售金融资产	原	原
缘	银行存款和结算备付金合计	[illegible]	[illegible]
远	其他资产	[illegible]	[illegible]
苑	合计	[illegible]	[illegible]

渊二冤报告期末按行业分类的股票投资组合

员尧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	公允价值渊元冤	占基金资产净值比例渊豫冤
粤	农尧林尧牧尧渔业	[illegible]	[illegible]
月	采掘业	[illegible]	[illegible]
悦	制造业	[illegible]	[illegible]
悦园	食品尧饮料	[illegible]	[illegible]
悦员	纺织尧服装尧皮毛	[illegible]	[illegible]
悦圆	木材尧家具	原	原
悦猿	造纸尧印刷	[illegible]	[illegible]
悦源	石油尧化学尧塑胶尧塑料	[illegible]	[illegible]
悦缘	电子	[illegible]	[illegible]
悦远	金属尧非金属	[illegible]	[illegible]
悦苑	机械尧设备尧仪表	[illegible]	[illegible]
悦愿	医药尧生物制品	原	原
悦怨怨	其他制造业	原	原
阅	电力尧煤气及水的生产和供应业	[illegible]	[illegible]
耘	建筑业	原	原
云	交通运输尧仓储业	原	原
郧	信息技术业	原	原
匀	批发和零售贸易	原	原
陨	金融尧保险业	原	原
允	房地产业	原	原
运	社会服务业	原	原
蕴	传播与文化产业	原	原
酝	综合类	[illegible]	[illegible]
	合计	[illegible]	[illegible]

圆尧报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票遥

渊三冤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

员尧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	数量渊股冤	公允价值渊元冤	占基金资产净值比例渊豫冤
员	[illegible]	大北农	[illegible]	[illegible]	[illegible]
圆	[illegible]	兰花科创	[illegible]	[illegible]	[illegible]
猿	[illegible]	亚盛集团	[illegible]	[illegible]	[illegible]
源	[illegible]	新希望	[illegible]	[illegible]	[illegible]
缘	[illegible]	鲁西化工	[illegible]	[illegible]	[illegible]
远	[illegible]	包钢稀土	[illegible]	[illegible]	[illegible]
苑	[illegible]	阳泉煤业	[illegible]	[illegible]	[illegible]
愿	[illegible]	辰州矿业	[illegible]	[illegible]	[illegible]
怨	[illegible]	隆平高科	[illegible]	[illegible]	[illegible]
员园	[illegible]	中国神华	[illegible]	[illegible]	[illegible]

圆尧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十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资的股票遥

渊四冤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遥

渊五冤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遥

渊六冤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遥

渊七冤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遥

渊八冤投资组合报告附注

员尧报告期末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袁不存在报告编制日前一年内受到公开谴责尧处罚的情形遥

圆尧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袁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遥

猿尧其他各项资产构成

序号	名称	金额渊元冤
员	存出保证金	[illegible]
圆	应收证券清算款	[illegible]
猿	应收股利	[illegible]
源	应收利息	[illegible]
缘	应收申购款	原
远	其他应收款	[illegible]
苑	待摊费用	原
愿	其他	原
怨	合计	[illegible]

渊九冤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遥

渊十冤报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况遥

九尧重大事件揭示

本基金自合同生效至上市交易期间未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件遥

十尧基金管理人承诺

本基金管理人就本基金上市交易之后履行管理人职责做出如下承诺院

员尧严格遵守叶基金法曳及其他法律法规尧基金合同的规定袁以诚实信用尧勤勉尽责的原则管理和运用基金资产遥

圆尧真实尧准确尧完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件袁披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息袁并接受中国证监会尧证券交易所的监督管理遥

猿尧在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后袁将及时予以公开澄清遥

十一尧基金托管人承诺

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺院

员尧严格遵守叶基金法曳及其他证券法律法规尧基金合同的规定袁设立专门的基金托管部袁配备足够的尧合格的熟悉基金托管业务的专职人员负责基金财产托管事宜遥

圆尧根据叶基金法曳及其他证券法律法规尧基金合同的规定袁对基金的投资范围尧基金资产的投资组合比例尧基金资产净值的计算尧基金管理人报酬的计提和支付尧基金托管人报酬的计提和支付等行为进行监督和核查遥

猿尧基金托管人发现基金管理人的行为违反叶基金法曳及其他证券法律法规尧基金合同的规定袁将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正袁督促基金管理人改正遥

源尧基金托管人发现基金管理人有重大违规行为袁将立即报告中国证监会袁同时通知基金管理人限期纠正袁并将纠正结果报告中国证监会遥

十二尧备查文件目录

投资者如果需了解更详细的信息袁可向基金管理人尧基金托管人或销售代理人申请查阅以下文件院

员尧中国证监会批准招商中证大宗商品股票指数分级证券投资基金募集的文件

圆尧叶招商中证大宗商品股票指数分级证券投资基金基金合同曳

猿尧叶招商中证大宗商品股票指数分级证券投资基金托管协议曳

源尧叶招商中证大宗商品股票指数分级证券投资基金代销协议曳

缘尧律师事务所法律意见书曳

远尧招商基金管理有限公司业务资格批件尧营业执照和公司章程

苑尧中国工商银行股份有限公司业务资格批件和营业执照

招商基金管理有限公司
圆园员圆年苑月圆园日

附件院基金合同摘要

渊一冤基金合同当事人及其权利义务

员尧基金管理人的权利

根据叶基金法曳尧叶运作办法曳及其他有关规定袁基金管理人的权利包括但不限于院

渊员冤依法募集基金曰

渊圆冤自基金合同生效之日起袁根据法律法规和基金合同独立运用并管理基金财产曰

渊猿冤依照基金合同收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用曰

渊源冤销售基金份额曰

渊缘冤召集基金份额持有人大会曰

渊远冤依据基金合同及有关法律规定监督基金托管人袁如认为基金托管人违反了基金合同及国家有关法律规定袁应呈报中国证监会和其他监管部门袁并采取必要措施保护基金投资者的利益曰

渊苑冤在基金托管人更换时袁提名新的基金托管人曰

渊愿冤选择尧更换基金代销机构袁对基金代销机构的相关行为进行监督和处理曰

渊怨冤担任或委托其他符合条件的机构担任基金注册登记机构办理基金注册登记业务并获得基金合同规定的费用曰

渊员园冤依据基金合同及有关法律规定决定基金收益的分配方案曰

渊员员冤在基金合同约定的范围内袁拒绝或暂停受理申购与赎回申请曰

渊员圆冤依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利袁为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利曰

渊员猿冤在法律法规允许的前提下袁为基金的利益依法为基金进行融资曰

渊员源冤以基金管理人的名义袁代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为曰

渊员缘冤选择尧更换律师事务所尧会计师事务所尧证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构曰

渊员远冤法律法规和基金合同规定的其他权利遥

圆尧基金管理人的义务

根据叶基金法曳尧叶运作办法曳及其他有关规定袁基金管理人的义务包括但不限于院

渊员冤依法募集基金袁办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售尧申购尧赎回和登记事宜曰

渊圆冤办理基金备案手续曰

渊猿冤自基金合同生效之日起袁以诚实信用尧谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产曰

渊源冤配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析尧决策袁以专业化的经营方式管理和运作基金财产曰

渊缘冤建立健全内部风险控制尧监察与稽核尧财务管理及人事管理等制度袁保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立袁对所管理的不同基金分别管理袁分别记账袁进行证券投资曰

渊远冤除依据叶基金法曳尧基金合同及其他有关规定外袁不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益袁不得委托第三人运作基金财产曰

渊苑冤依法接受基金托管人的监督曰

渊愿冤采取适当合理的措施使计算基金份额认购尧申购尧赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定袁按有关规定计算并公告基金资产净值袁确定基金份额申购尧赎回的价格曰

渊怨冤进行基金会计核算并编制基金财务会计报告曰

渊员园冤编制半年度和年度基金报告曰

渊员员冤严格按照叶基金法曳尧基金合同及其他有关规定袁履行信息披露及报告义务曰

渊员圆冤保守基金商业秘密袁不泄露基金投资计划尧投资意向等遥除叶基金法曳尧基金合同及其他有关规定另有规定外袁在基金信息公开披露前应予保密袁不向他人泄露曰

渊员猿冤按基金合同的约定确定基金收益分配方案袁及时向基金份额持有人分配基金收益曰

渊员源冤按规定受理招商中证商品份额的申购与赎回申请袁及时尧足额支付赎回款项曰

渊员缘冤依据叶基金法曳尧基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人尧基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会曰

渊员远冤按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册尧报表尧记录和其他相关资料员缘年以上曰

渊员苑冤确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出袁并且保证投资者能够按照基金合同规定的时间和方式袁随时查阅到与基金有关的公开资料袁并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件曰

渊员愿冤组织并参加基金财产清算小组袁参与基金财产的保管尧清理尧估价尧变现和分配曰

渊员怨冤面临解散尧依法被撤销或者被依法宣告破产时袁及时报告中国证监会并通知基金托管人曰

渊圆园冤因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时袁应当承担赔偿责任袁其赔偿责任不因其退任而免除曰

渊圆员冤监督基金托管人按法律法规和基金合同规定履行自己的义务袁基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时袁基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿曰

渊圆圆冤当基金管理人将其义务委托第三方处理时袁应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任曰但因第三方责任导致基金财产或基金份额持有人利益受到损失袁而基金管理人首先承担了责任的情况下袁基金管理人有权向第三方追偿曰

渊圆猿冤以基金管理人名义袁代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为曰

渊圆源冤基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件袁基金合同不能生效袁基金管理人承担全部募集费用袁将已募集资金并加计银行同期存款利息在基金募集期结束后猿园日内退还基金认购人曰

渊圆缘冤执行生效的基金份额持有人大会的决定曰

渊圆远冤建立并保存基金份额持有人名册袁定期或不定期向基金托管人提供基金份额持有人名册曰

渊圆苑冤法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务遥

猿尧基金托管人的权利

根据叶基金法曳尧叶运作办法曳及其他有关规定袁基金托管人的权利包括但不限于院

渊员冤自基金合同生效之日起袁依法律法规和基金合同的规定安全保管基金财产曰

渊圆冤依基金合同约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入曰

渊猿冤监督基金管理人对本基金的投资运作袁如发现基金管理人有违反基金合同及国家法律法规行为袁对基金财产尧其他当事人的利益造成重大损失的情形袁应呈报中国证监会袁并采取必要措施保护基金投资者的利益曰

渊源冤以基金托管人和基金联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司和深圳分公司开设证券账户曰

渊缘冤以基金托管人名义开立证券交易资金账户袁用于证券交易资金清算曰

渊远冤以基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司开设银行间债券托管账户袁负责基金投资债券的后台匹配及资金的清算曰

渊苑冤提议召开或召集基金份额持有人大会曰

渊愿冤在基金管理人更换时袁提名新的基金管理人曰

渊怨冤法律法规和基金合同规定的其他权利遥

源尧基金托管人的义务

根据叶基金法曳尧叶运作办法曳及其他有关规定袁基金托管人的义务包括但不限于院

渊员冤以诚实信用尧勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产曰

渊圆冤设立专门的基金托管部门袁具有符合要求的营业场所袁配备足够的尧合格的熟悉基金托管业务的专职人员袁负责基金财产托管事宜曰

渊猿冤建立健全内部风险控制尧监察与稽核尧财务管理及人事管理等制度袁确保基金财产的安全袁保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立曰对所托管的不同的基金分别设置账户袁独立核算袁分账管理袁保证不同基金之间在名册登记尧账户设置尧资金划拨尧账册记录等方面相互独立曰

渊源冤除依据叶基金法曳尧基金合同及其他有关规定外袁不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益袁不得委托第三人托管基金财产曰

渊缘冤保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证曰

渊远冤按规定开设基金财产的资金账户和证券账户袁按照基金合同的约定袁根据基金管理人的投资指令袁及时办理清算尧交割事宜曰

渊苑冤保守基金商业秘密袁除叶基金法曳尧基金合同及其他有关规定另有规定外袁在基金信息公开披露前予以保密袁不得向他人泄露曰

渊愿冤复核尧审查基金管理人计算的基金资产净值袁招商中证商品份额的基金份额净值尧招商中证商品粤份额与招商中证商品月份额的基金份额参考净值袁招商中证商品粤份额与招商中证商品月份额终止运作后的份额转换比例曰

渊怨冤办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项曰

渊员园冤对基金财务会计报告尧季度尧半年度和年度基金报告出具意见袁说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行曰如果基金管理人有未执行基金合同规定的行为袁还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施曰

渊员员冤保存基金托管业务活动的记录尧账册尧报表和其他相关资料员缘年以上曰

渊员圆冤建立并保存基金份额持有人名册曰

渊员猿冤按规定制作相关账册并与基金管理人核对曰

渊员源冤依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项曰

渊员缘冤依据规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会曰

渊员远冤按照法律法规尧基金合同和托管协议的规定监督基金管理人的投资运作曰

渊员苑冤参加基金财产清算小组袁参与基金财产的保管尧清理尧估价尧变现和分配曰

渊员愿冤面临解散尧依法被撤销或者被依法宣告破产时袁及时报告中国证监会和银行监管机构袁并通知基金管理人曰

渊员怨冤因违反基金合同导致基金财产损失时袁应承担赔偿责任袁其赔偿责任不因其退任而免除曰

渊圆园冤按规定监督基金管理人按法律法规和基金合同规定履行自己的义务袁基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时袁应为基金利益向基金管理人追偿曰

渊圆员冤执行生效的基金份额持有人大会的决定曰

渊圆圆冤法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务遥

缘尧基金份额持有人的权利

根据叶基金法曳尧叶运作办法曳及其他有关规定袁基金份额持有人的权利包括但不限于院

渊员冤分享基金财产收益曰

渊圆冤参与分配清算后的剩余基金财产曰

渊猿冤依照法律法规及基金合同的规定袁依法转让其持有的招商中证商品粤份额与招商中证商品月份额袁依法申请赎回其持有的招商中证商品份额曰

渊源冤按照规定要求召开基金份额持有人大会曰

渊缘冤出席或者委派代表出席基金份额持有人大会袁对基金份额持有人大会审议事项行使表决权曰

渊远冤查阅或者复制公开披露的基金信息资料曰

渊苑冤监督基金管理人的投资运作曰

渊愿冤对基金管理人尧基金托管人尧基金销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼曰

渊怨冤法律法规和基金合同规定的其他权利遥

远尧基金份额持有人的义务

根据叶基金法曳尧叶运作办法曳及其他有关规定袁基金份额持有人的义务包括但不限于院

渊员冤遵守基金合同曰

渊圆冤缴纳基金认购尧申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用曰

渊猿冤在其持有的基金份额范围内袁承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任曰

渊源冤不从事任何有损基金及其他基金合同当事人合法权益的活动曰

渊缘冤返还在基金交易过程中因任何原因袁自基金管理人尧基金托管人及代销机构处获得的不当得利曰

渊远冤执行生效的基金份额持有人大会的决定曰

渊苑冤法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务遥

渊二冤基金份额持有人大会召集尧议事及表决的程序和规则

员尧基金份额持有人大会由基金份额持有人或基金份额持有人的合法授权代表共同组成遥基金份额持有人大会的审议事项应分别由招商中证商品份额尧招商中证商品粤份额与招商中证商品月份额的基金份额持有人独立进行表决遥基金份额持有人持有的每一基金份额在其对应的份额级别内拥有平等的投票权遥

圆尧有以下情形之一时袁应召开基金份额持有人大会院

渊员冤终止基金合同曰

渊圆冤更换基金管理人曰

渊猿冤更换基金托管人曰

渊源冤转换基金运作方式曰

渊缘冤提高基金管理人尧基金托管人的报酬标准曰

渊远冤变更基金类别渊法律法规和中国证监会另有规定及本合同另有约定的除外冤曰

渊苑冤本基金与其他基金的合并曰

渊愿冤变更基金投资目标尧范围或策略渊法律法规和中国证监会另有规定及本合同另有约定的除外冤曰

渊怨冤变更基金份额持有人大会程序曰

渊员园冤对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项曰

渊员员冤法律法规尧基金合同或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项遥

猿尧有以下情形之一的袁不需召开基金份额持有人大会院

渊员冤调低基金管理费尧基金托管费曰

渊圆冤法律法规要求增加的基金费用的收取曰

渊猿冤在法律法规和基金合同规定的范围内调整招商中证商品份额的申购费率尧调低赎回费率曰

渊源冤因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改曰

渊缘冤对基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化曰

渊远冤经中国证监会允许袁基金推出新业务或服务曰

渊苑冤经中国证监会允许袁基金管理人尧基金注册登记机构尧代销机构在法律法规规定的范围内调整有关基金交易尧非交易过户尧转托管等业务规则曰

渊愿冤本基金基金合同生效满五年后袁在满足基金合同约定的存续条件下袁本基金无需召开基金份额持有人大会袁直接转换为上市开放式基金渊蕴韵云冤袁基金名称变更为野招商中证大宗商品股票指数证券投资基金渊蕴韵云冤冶袁原招商中证商品粤份额和招商中证商品月份额终止运作袁全部转换成招商中证大宗商品股票指数证券投资基金渊蕴韵云冤的基金份额曰

渊怨冤按照法律法规和基金合同规定应当召开基金份额持有人大会的以外的其他情形遥

源尧召集方式院

渊员冤除法律法规规定或基金合同另有约定外袁基金份额持有人大会由基金管理人召集曰

渊圆冤基金管理人未按规定召集或不能召集时袁由基金托管人召集曰

渊猿冤基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的袁应当向基金管理人提出书面提议遥基金管理人应当自收到书面提议之日起员园日内决定是否召集袁并书面告知基金托管人遥基金管理人决定召集的袁应当自出具书面决定之日起远园日内召开曰基金管理人决定不召集或在规定时间内未能作出书面答复袁基金托管人仍认为有必要召开的袁应当由基金托管人自行召集遥

渊源冤单独或合计代表招商中证商品份额尧招商中证商品粤份额与招商中证商品月份额各自基金份额员园豫以上渊含员园豫冤的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会袁应当向基金管理人提出书面提议遥基金管理人应当自收到书面提议之日起员园日内决定是否召集袁并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人遥基金管理人决定召集的袁应当自出具书面决定之日起远园日内召开曰基金管理人决定不召集或在规定时间内未能作出书面答复袁单独或合计代表招商中证商品份额尧招商中证商品粤份额与招商中证商品月份额各自基金份额员园豫以上渊含员园豫冤的基金份额持有人仍认为有必要召开的袁应当向基金托管人提出书面提议遥基金托管人应当自收到书面提议之日起员园日内决定是否召集袁并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人曰基金托管人决定召集的袁应当自出具书面决定之日起远园日内召开遥

渊缘冤单独或合计代表招商中证商品份额尧招商中证商品粤份额与招商中证商品月份额各自基金份额员园豫以上渊含员园豫冤的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会袁而基金管理人尧基金托管人都不召集的或在规定时间内未能作出书面答复袁单独或合计代表招商中证商品份额尧招商中证商品粤份额与招商中证商品月份额各自基金份额员园豫以上渊含员园豫冤的基金份额持有人有权自行召集袁并至少提前猿园日报中国证监会备案遥基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的袁基金管理人尧基金托管人应当配合袁不得阻碍尧干扰遥

渊远冤基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间尧地点尧方式和权益登记日遥

缘尧通知

召开基金份额持有人大会袁召集人应于会议召开前猿园天袁在至少一家指定媒体公告遥基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容院

渊员冤会议召开的时间尧地点尧方式和会议形式曰

渊圆冤会议拟审议的事项尧议事程序和表决形式曰

渊猿冤有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日曰

渊源冤授权委托书的内容要求渊包括但不限于代理人身份袁代理权限和代理有效期限等冤尧送达时间和地点曰

渊缘冤会务常设联系人姓名及联系电话曰

远尧开会方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式或通讯开会方式召开遥

会议的召开方式由会议召集人确定袁但更换基金管理人和基金托管人必须以现场开会方式召开遥

现场开会遥由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托书委派代表出席袁现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会袁基金管理人或托管人不派代表列席的袁不影响表决效力遥现场开会同时符合以下条件时袁可以进行基金份额持有人大会议程院

渊员冤亲自出席会议者持有基金份额的凭证尧受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托书符合法律法规尧基金合同和会议通知的规定袁并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符曰

渊圆冤经核对袁汇总到会者出示的在权利登记日持有基金份额的凭证显示袁有效的招商中证商品份额尧招商中证商品粤份额与招商中证商品月份额的基金份额不少于在权益登记日各自基金总份额的缘园豫渊含缘园豫冤遥

通讯开会遥通讯方式开会指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式或会议通知等相关公告中指定的其他形式在表决截至日以前送达至召集人指定的地址遥通讯开会应以书面方式或会议通知等相关公告中指定的其他形式进行表决遥

在同时符合以下条件时袁通讯开会的方式视为有效院

渊员冤会议召集人按基金合同规定公布会议通知后袁在圆个工作日内连续公布相关提示性公告曰

渊圆冤会议召集人按基金合同规定通知基金托管人渊如果基金托管人为召集人袁则为基金管理人冤到指定地点对表决意见的计票进行监督遥会议召集人在基金托管人渊如果基金托管人为召集人袁则为基金管理人冤和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的表决意见曰基金托管人或基金管理人经通知不参加收取表决意见的袁不影响表决效力曰

渊猿冤本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的袁基金份额持有人所持有的招商中证商品份额尧招商中证商品粤份额与招商中证商品月份额不小于在权益登记日各自基金份额的缘园豫渊含缘园豫冤曰

渊源冤上述第渊猿冤项中直接出具表决意见的基金份额持有人或受托代表他人出具表决意见的代理人袁同时提交的持有基金份额的凭证尧受托出具表决意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托书符合法律法规尧基金合同和会议通知的规定袁并与基金登记注册机构记录相符袁并且委托人出具的代理投票授权委托书符合法律法规尧基金合同和会议通知的规定曰

渊缘冤会议通知公布前报中国证监会备案遥

苑尧议事内容与程序

渊员冤议事内容及提案权

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项袁如基金合同的重大修改尧决定终止基金合同尧更换基金管理人尧更换基金托管人尧与其他基金合并尧法律法规及基金合同规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项遥

基金管理人尧基金托管人尧单独或合并持有权益登记日招商中证商品份额尧招商中证商品粤份额与招商中证商品月份额各自基金份额员园豫渊含员园豫冤以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案曰也可以在会议通知发出后向大会召集人提交临时提案袁临时提案应当在大会召开日至少猿缘天前提交召集人并由召集人公告遥

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后袁对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开日猿园天前公告遥

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决遥

召集人对于基金管理人尧基金托管人和基金份额持有人提交的临时提案进行审核袁符合条件的应当在大会召开日猿园天前公告遥大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核院

员尧关联性遥大会召集人对于提案涉及事项与基金有直接关系袁并且不超出法律法规和基金合同规定的基金份额持有人大会职权范围的袁应提交大会审议曰对于不符合上述要求的袁不提交基金份额持有人大会审议遥如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决袁应当在该次基金份额持有人大会上进行解释和说明遥

圆尧程序性遥大会召集人可以对提案涉及的程序性问题做出决定遥如将提案进行分拆或合并表决袁需征得原提案人同意曰原提案人不同意变更的袁大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会做出决定袁并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议遥

单独或合并持有权利登记日招商中证商品份额尧招商中证商品粤份额与招商中证商品月份额各自基金份额员园豫渊含员园豫冤以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案袁或者基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案袁未获基金份额持有人大会审议通过袁就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议袁其时间间隔不少于远个月遥法律法规另有规定除外遥

基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后袁如果需要对原有提案进行修改袁应当最迟在基金份额持有人大会召开前猿园日公告遥否则袁会议的召开日期应当顺延并保证至少与公告日期有猿园日的间隔期遥

渊圆冤议事程序

员尧现场开会

在现场开会的方式下袁首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人袁然后由大会主持人宣读提案袁经讨论后进行表决袁并形成大会决议遥大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表袁在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下袁由基金托管人授权其出席会议的代表主持曰如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会袁则由出席大会的招商中证商品份额尧招商中证商品粤份额与招商中证商品月份额各自基金份额持有人和代理人所持表决权合计缘园豫以上渊含缘园豫冤选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人遥基金管理人和基金托管人不出席或主持基金份额持有人大会袁不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力遥

会议召集人应当制作出席会议人员的签名册遥签名册载明参加会议人员姓名渊或单位名称冤尧身份证号码尧住所地址尧持有或代表有表决权的基金份额尧委托人姓名渊或单位名称冤等事项遥

圆尧通讯开会

在通讯开会的情况下袁首先由召集人提前猿园日公布提案袁在所通知的表决截止日期后圆个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决袁在公证机关监督下形成决议遥

愿尧表决

招商中证商品份额尧招商中证商品粤份额与招商中证商品月份额的基金份额持有人所持每份基金份额在其对应份额级别内享有平等的表决权遥

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议院

渊员冤一般决议袁一般决议须经参加大会的招商中证商品份额尧招商中证商品粤份额与招商中证商品月份额的各自基金份额持有人或其代理人所持表决权的缘园豫以上渊含缘园豫冤通过方为有效曰除下列第渊圆冤项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过遥

渊圆冤特别决议袁特别决议应当经参加大会的招商中证商品份额尧招商中证商品粤份额与招商中证商品月份额的各自基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上渊含三分之二冤通过方可做出遥转换基金运作方式尧更换基金管理人或者基金托管人尧终止基金合同以特别决议通过方为有效遥

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决遥

采取通讯方式进行表决时袁除非在计票时有充分的相反证据证明袁提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者袁符合会议通知规定的表决意见视为有效表决袁表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决袁但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数遥

基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议尧逐项表决遥

怨尧计票

渊员冤现场开会

员尧如大会由基金管理人或基金托管人召集袁基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人曰如大会由基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集袁但是基金管理人或基金托管人未出席大会的袁基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人遥基金管理人或基金托管人不出席大会的袁不影响计票的效力遥

圆尧监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果遥

猿尧如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有怀疑袁可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点遥监票人应当进行重新清点袁重新清点以一次为限遥重新清点后袁大会主持人应当当场公布重新清点结果遥

源尧计票过程应由公证机关予以公证袁基金管理人或基金托管人拒不出席大会的袁不影响计票的效力遥

渊圆冤通讯开会

在通讯开会的情况下袁计票方式为院由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表渊若由基金托管人召集袁则为基金管理人授权代表冤的监督下进行计票袁并由公证机关对其计票过程予以公证遥基金管理人或基金托管人拒派代表对表决意见的计票进行监督的袁不影响计票和表决结果遥

渊三冤基金收益与分配

员尧基金利润的构成

基金利润是指基金利息收入尧投资收益尧公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额袁基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额遥

圆尧基金可供分配利润

基金可供分配利润指截至收益分配基准日渊即可供分配利润计算截止日冤基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数遥

猿尧收益分配原则

在基金合同生效后缘年内袁本基金渊包括招商中证商品份额尧招商中证商品粤份额尧招商中证商品月份额冤不进行收益分配遥

在基金合同生效后缘年后袁如果终止招商中证商品粤份额尧招商中证商品粤份额与招商中证商品月份额的运作袁本基金将调整基金的收益分配原则袁具体收益分配原则参见基金管理人届时发布的相关公告遥

渊四冤基金费用与税收

员尧基金费用的种类

渊员冤基金管理人的管理费曰

渊圆冤基金托管人的托管费曰

渊猿冤基金的指数使用费曰

渊源冤基金上市费用曰

渊缘冤基金合同生效后与基金相关的信息披露费用曰

渊远冤基金合同生效后与基金相关的会计师费尧律师费和诉讼费曰

渊苑冤基金份额持有人大会费用曰

渊愿冤基金的证券交易费用曰

渊怨冤基金的银行汇划费用曰

渊员园冤按照国家有关规定和基金合同约定袁可以在基金财产中列支的其他费用遥

本基金终止清算时所发生费用袁按实际支出额从基金财产中扣除遥

圆尧基金费用计提方法尧计提标准和支付方式

渊员冤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员豫年费率计提遥管理费的计算方法如下院

匀越耘伊员豫衣当年天数

匀为每日应计提的基金管理费

耘为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算袁逐日累计至每月月末袁按月支付袁由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令袁基金托管人复核后于次月前圆个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人遥若遇法定节假日尧公休假等袁支付日期顺延遥

渊圆冤基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的园援圆圆豫的年费率计提遥托管费的计算方法如下院

匀越耘伊园援圆圆豫衣当年天数

匀为每日应计提的基金托管费

耘为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算袁逐日累计至每月月末袁按月支付袁由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令袁基金托管人复核后于次月前圆个工作日内从基金财产中一次性支取遥若遇法定节假日尧公休日等袁支付日期顺延遥

渊猿冤基金的指数使用费

本基金作为指数基金袁需根据与中证指数有限公司签署的指数使用许可协议的约定向中证指数有限公司支付指数使用费遥通常情况下袁指数使用费按照前一日基金资产净值的园援园圆豫的年费率进行计提袁且收取下限为每季人民币缘万元渊即不足缘万元部分按照缘万元收取冤遥

计算方法如下院

匀越耘伊园援园圆豫衣当年天数

匀为每日应计提的标的指数使用费

耘为前一日的基金资产净值

指数使用费每日计算袁逐日累计袁每季支付一次袁由基金管理人向基金托管人发送指数使用费划付指令袁经基金托管人复核后于每年员月尧源月尧苑月尧员园月的前十个工作日内从基金财产中一次性支付给中证指数有限公司上一季度的指数使用费遥

渊源冤基金份额转换后基金的费用

本基金基金合同生效满五年后袁即分级运作期届满袁本基金直接转换为上市开放式基金渊蕴韵云冤袁基金名称变更为野招商中证大宗商品股票指数证券投资基金渊蕴韵云冤冶遥

基金份额转换后袁本基金的管理费按前一日基金资产净值的员豫年费率计提遥管理费的计算方法不变遥

基金份额转换后袁本基金的托管费按前一日基金资产净值的园援圆圆豫的年费率计提遥托管费的计算方法不变遥

猿尧不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用院

渊员冤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曰

渊圆冤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曰

渊猿冤基金合同生效前的相关费用袁包括但不限于验资费尧会计师和律师费尧信息披露费用等费用曰

渊源冤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遥

源尧费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后袁可根据基金发展情况调整基金管理费率尧基金托管费率尧基金销售费率等相关费率遥

调高基金管理费率尧基金托管费率或基金销售费率等费率袁须召开基金份额持有人大会审议曰调低基金管理费率尧基金托管费率或基金销售费率等费率袁无须召开基金份额持有人大会遥

基金管理人必须最迟于新的费率实施日前圆日在至少一种指定媒体上公告遥

缘尧基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体袁其纳税义务按国家税收法律尧法规执行遥

渊五冤基金的投资

员尧投资目标

本基金进行被动式指数化投资袁通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段袁实现对标的指数的有效跟踪袁获得与标的指数收益相似的回报遥本基金的投资目标是保持基金净值收益率与业绩基准日均跟踪偏离度的绝对值不超过园援猿缘豫袁年跟踪误差不超过源豫遥

圆尧投资范围

本基金投资于具有良好流动性的金融工具袁包括中证大宗商品股指数的成份股尧备选成份股尧新股渊含首次公开发行和增发冤尧股指期货尧债券尧债券回购等固定收益投资品种以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具渊但须符合中国证监会的相关规定冤遥本基金投资于股票的资产不低于基金资产的愿缘豫袁投资于中证大宗商品股票指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的怨园豫曰现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的缘豫遥

如法律法规或中国证监会以后允许基金投资其他金融工具袁基金管理人在履行适当程序后袁可以将其纳入投资范围遥

猿尧投资禁止行为与限制

渊员冤禁止用本基金财产从事以下行为

员尧承销证券曰

圆尧向他人贷款或者提供担保曰

猿尧从事承担无限责任的投资曰

源尧买卖其他基金份额袁但是国务院另有规定的除外曰

缘尧向基金管理人尧基金托管人出资或者买卖基金管理人尧基金托管人发行的股票或者债券曰

远尧买卖与基金管理人尧基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人尧基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券曰

苑尧从事内幕交易尧操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动曰

愿尧当时有效的法律法规尧中国证监会及基金合同规定禁止从事的其他行为遥

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定袁本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制遥

渊圆冤基金投资组合比例限制

员尧本基金参与股票发行申购袁本基金所申报的金额不超过本基金的总资产袁本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量曰

圆尧本基金在任何交易日日终袁持有的买入股指期货合约价值袁不得超过基金资产净值的员园豫曰本基金在任何交易日日终袁持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和袁不得超过基金资产净值的员园园豫袁其中袁有价证券指股票尧债券渊不含到期日在一年以内的政府债券冤尧权证尧资产支持证券尧买入返售金融资产渊不含质押式回购冤等曰本基金在任何交易日日终袁持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的圆园豫曰本基金在任何交易日内交易渊不包括平仓冤的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的圆园豫曰本基金所持有的股票市值和买入尧卖出股指期货合约价值袁合计渊轧差计算冤应不低于基金资产净值的愿缘豫且不得超过基金资产净值的怨缘豫曰本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后袁应当保持不低于基金资产净值缘豫的现金或到期日在一年以内的政府债券曰

猿尧本基金投资权证袁在任何交易日买入的总金额不得超过上一交易日基金资产净值的园援缘豫袁基金持有的全部权证的市值不得超过基金资产净值的猿豫袁本基金管理人管理的基金托管的全部基金持有同一权证的比例不得超过该权证的员园豫遥投资于其他权证的投资比例袁遵从法律法规或监管部门的相关规定曰

源尧本基金持有一家公司发行的流通受限证券袁其市值不得超过基金资产净值的圆豫曰本基金持有的所有流通受限证券袁其市值不得超过该基金资产净值的员园豫曰经基金管理人和托管人协商袁可对以上比例进行调整曰

缘尧本基金不得违反基金合同中有关投资范围尧投资比例的规定曰

远尧法律法规尧基金合同规定的其他比例限制

本基金管理人应当按照中国金融期货交易所要求的内容尧格式与时限向交易所报告所交易和持有的卖出期货合约情况尧交易目的及对应的证券资产情况等曰

如法律法规或监管部门取消上述限制性规定袁履行适当程序后袁本基金不受上述规定的限制遥

渊六冤基金的财产

员尧基金资产总值

基金资产总值是指购买的各类证券及票据价值尧银行存款本息和基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和遥

其构成主要有院

渊员冤银行存款及其应计利息曰

渊圆冤结算备付金及其应计利息曰

渊猿冤根据有关规定缴纳的保证金及其应收利息曰

渊源冤应收证券交易清算款曰

渊缘冤应收申购款曰

渊远冤股票投资及其估值调整曰

渊苑冤债券投资及其估值调整和应计利息曰

渊愿冤权证投资及其估值调整曰

渊怨冤其他投资及其估值调整曰

渊员园冤其他资产等遥

圆尧基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值遥

猿尧基金财产的账户

本基金以基金托管人的名义开立资金结算账户和托管专户用于基金的资金结算业务袁并以基金托管人和本基金联名的方式开立基金证券账户尧以本基金的名义开立银行间债券托管账户并报中国人民银行备案遥开立的基金专用账户与基金管理人尧基金托管人尧基金代销机构和基金注册登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立遥

源尧基金财产的保管和处分

本基金财产独立于基金管理人尧基金托管人和基金代销机构的财产袁并由基金托管人保管遥基金管理人尧基金托管人不得将基金财产归入其固有财产曰基金管理人尧基金托管人因基金财产的管理尧运用或其他情形而取得的财产和收益袁归入基金财产曰基金管理人尧基金托管人尧基金注册登记机构和基金代销机构以其自有的财产承担其自身的法律责任袁其债权人不得对本基金财产行使请求冻结尧扣押或其他权利遥除依法律法规和基金合同的规定处分外袁基金财产不得被处分遥

基金管理人管理运作基金财产所产生的债权袁不得与其固有资产产生的债务相互抵消曰基金管理人管理运作不同基金的基金财产所产生的债权债务不得相互抵消遥

渊七冤基金合同的变更和终止

员尧基金合同的变更

渊员冤更换基金管理人曰

渊圆冤更换基金托管人曰

渊猿冤转换基金运作方式曰

渊源冤提高基金管理人尧基金托管人的报酬标准曰

渊缘冤变更基金类别渊法律法规和中国证监会另有规定及本合同另有约定的除外冤曰

渊远冤变更基金投资目标尧范围或策略渊法律法规和中国证监会另有规定及本合同另有约定的除外冤曰

渊苑冤本基金与其他基金的合并曰

渊愿冤变更基金份额持有人大会召开程序曰

渊怨冤终止基金合同曰

渊员园冤其他可能对基金当事人权利和义务产生重大影响的事项遥

圆尧基金合同的终止

有下列情形之一的袁本基金合同应当终止院

渊员冤基金份额持有人大会决定终止的曰

渊圆冤基金管理人尧基金托管人职责终止袁在远个月内没有新基金管理人尧新基金托管人承接的曰

渊猿冤基金合同约定的其他情形曰

渊源冤相关法律法规和中国证监会规定的其他情况遥

渊八冤争议的处理和适用的法律

各方当事人同意袁因基金合同而产生的或与基金合同有关的一切争议袁如经友好协商未能解决的袁应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁袁仲裁地点为北京袁仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力袁仲裁费由败诉方承担遥

基金合同受中国法律管辖遥

渊九冤基金合同的存放和获得方式

基金合同可印制成册袁供投资者在基金管理人尧基金托管人尧代销机构的办公场所和营业场所查阅曰投资者也可按工本费购买基金合同复制件或复印件袁但内容以基金合同正本为准遥

关于开通招商中证大宗商品股票指数分级证券投资基金份额配对转换业务的公告

根据叶招商中证大宗商品股票指数分级证券投资基金基金合同曳的约定袁招商基金管理有限公司将自2012年7月25日起袁开通招商中证大宗商品股票指数分级证券投资基金的场内份额配对转换业务遥

渊一冤场内份额配对转换

场内份额配对转换是指根据基金合同约定袁场内的基础份额与分级份额之间进行转换的行为袁即招商中证商品基础份额渊简称"大宗商品"袁代码"161715"冤与招商中证商品A份额渊简称"商品A"袁代码"150096"冤和招商中证商品B份额渊简称"商品B"袁代码"150097"冤之间进行转换的行为袁包括分拆与合并遥

1尧分拆院分拆指基金份额持有人将其持有的每2份招商中证商品基础份额按照1颐1的份额配比转换成1份招商中证商品A份额与1份招商中证商品B份额的行为遥

2尧合并院合并指基金份额持有人将其持有的每1份招商中证商品A份额与1份招商中证商品B份额按照1颐1的基金份额配比转换成2份招商中证商品基础份额的行为遥

场外的招商中证商品基础份额不进行份额配对转换遥在场外的招商中证商品基础份额通过跨系统转托管至场内后袁可按照场内份额配对转换规则进行操作遥

渊二冤业务办理机构

投资人可以通过依据中国证券登记结算有限责任公司渊以下简称"中登"冤有关规定获得业务办理资格的深圳证券交易所会员单位办理份额配对转换业务袁按照中登有关规定获得业务办理资格的深圳证券交易所会员单位名单可向本公司咨询袁中登网站2012年4月24日公告的具有配对转换业务资格的深圳证券交易所会员单位为院国泰君安证券尧中信建投证券尧国信证券尧招商证券尧广发证券尧中信证券尧银河证券尧海通证券尧华泰联合证券尧申银万国证券尧兴业证券尧长江证券尧安信证券尧西南证券尧湘财证券尧民生证券尧国元证券尧渤海证券尧华泰证券尧山西证券尧中信万通证券尧兴业证券尧东吴证券尧信达证券尧东方证券尧长城证券尧光大证券尧广州证券尧南京证券尧上海证券尧新时代证券尧国联证券尧浙商证券尧平安证券尧华安证券尧国海证券尧财富证券尧东莞证券尧中原证券尧国都证券尧东海证券尧中银国际证券尧恒泰证券尧国盛证券尧宏源证券尧齐鲁证券尧世纪证券尧第一创业证券尧江南证券尧华林证券尧德邦证券尧西部证券尧广发华福证券尧中金公司尧财通证券尧华鑫证券尧瑞银证券尧中国建银投资证券尧红塔证券尧西藏证券尧日信证券尧联讯证券尧江海证券尧国金证券尧中国民族证券尧华宝证券尧厦门证券尧天风证券尧大通证券遥

渊三冤业务办理时间

深圳证券交易所交易日上午9院30-11院30和下午1院00-3院00渊基金管理人公告暂停份额配对转换业务时除外冤遥

若深圳证券交易所交易时间更改或实际情况需要袁基金管理人将对份额配对转换业务的办理时间进行相应调整并公告遥

渊四冤场内份额配对转换的原则

1尧投资人以中登深圳分公司A股账户或证券投资基金账户渊以下简称"深市证券账户"冤申报份额配对转换业务中的"分拆"或"合并"指令袁申报前需备足对价袁即投资人提出"合并"申请时袁其所申报的深市证券账户上须有足够的尧可交易的商品A份额与商品B份额曰投资人提出"分拆"申请时袁其所申报的深市证券账户上须有足够的尧可交易的大宗商品份额遥

2尧投资人通过业务办理机构提出份额配对转换申请的袁统一以招商中证商品份额渊场内简称"大宗商品"冤的交易代码"161715"作为申请指令的证券代码袁以份额为单位进行"合并"或"分拆"申报遥

3尧"合并"或"分拆"每笔申请的份额数不得低于2份袁且必须是2份的整数倍遥基金管理人可根据市场情况调整"合并"或"分拆"每笔申报的最低份额数量限制袁基金管理人必须在调整生效前依照有关规定进行公告遥

4尧如果申请场内份额的合并袁商品A份额与商品B份额必须同时配对申请袁且商品A份额与商品B份额的份额数必须分别为相关业务公告规定份额的正整数倍袁份额数配比为1颐1遥

5尧办理份额配对转换业务的深圳证券交易所会员单位应对投资人每笔"分拆"或"合并"申请的可用份额数量进行检查并对相应基金份额进行预冻结遥

6尧在交易时间内袁份额配对转换业务办理机构通过深证通FDEP消息传输系统将份额配对转换申报指令发送给中登的基金业务系统遥正常情况下袁中登深圳分公司在T日收市后对投资人T日交易时间内提交的份额配对转换业务申请进行有效性确认袁并进行份额变更处理袁办理转出基金份额的扣除以及转入基金份额的登记遥自T+1日起渊以该日为第一日冤袁投资人可查询基金份额配对转换的成交情况遥

7尧投资人T日提出的M份份额"分拆"申请被确认成功后袁中登深圳分公司将在投资人所申报的深市证券账户上扣减M份大宗商品份额袁同时增加M/2份商品A与M/2份商品B遥正常情况下袁自T+1日渊含该日冤起新增的商品A与商品B份额可进行交易遥

8尧投资人T日提出的N份份额"合并"申请被确认成功后袁中登深圳分公司将在投资人所申报的深市证券账户上扣减N/2份商品A和N/2份商品B袁同时增加N份大宗商品份额遥正常情况下袁自T+1日渊含该日冤起新增的大宗商品份额可进行赎回等交易遥

9尧场外大宗商品份额如需申请进行"分拆"袁须跨系统转托管为场内大宗商品份额后方可进行遥

10尧投资人提出的份额配对转换申请袁在当日交易时间结束前可以撤销袁交易时间结束后不得撤销遥

11尧份额配对转换应遵循届时发布的相关业务规则遥

渊五冤份额配对转换的业务办理费用

投资人申请办理份额配对转换业务时袁份额配对转换业务办理机构暂不收取业务办理费用遥

渊六冤重要提示

1尧基金管理人尧注册登记机构或深圳证券交易所可视情况对上述"场内份额配对转换的原则"作出调整袁并在正式实施前在至少一家指定媒体公告遥

2尧投资者可拨打客户服务热线院400-887-9555渊免长话费冤袁或登陆网站www.cmfchina.com获取相关信息遥

3尧风险提示院基金管理人依照恪尽职守尧诚实信用尧谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产袁但不保证投资本基金一定盈利袁也不保证基金份额持有人的最低收益遥敬请投资人注意投资风险遥

特此公告

招商基金管理有限公司
2012年7月20日