招商深证[illegible]指数证券投资基金更新的招募说明书摘要

（二零一二年第二号）

招商深证[illegible]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[illegible]年[illegible]月[illegible]日“关于核准招商深证[illegible]指数证券投资基金募集的批复”（证监许可[illegible]号文）核准公开募集。本基金的基金合同于[illegible]年[illegible]月[illegible]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[illegible]年[illegible]月[illegible]日，有关财务和业绩表现数据截止日为[illegible]年[illegible]月[illegible]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[illegible]号招商银行大厦[illegible]层

设立日期：[illegible]年[illegible]月[illegible]日

法定代表人：马蔚华

办公地址：深圳市深南大道[illegible]号招商银行大厦[illegible]层

电话：[illegible]

传真：[illegible]

联系人：曾倩

注册资本：人民币[illegible]亿元

股权结构和公司沿革：

招商基金管理有限公司于[illegible]年[illegible]月[illegible]日经中国证监会证监基金字[illegible]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、[illegible]（香港）有限公司（现更名为摩根士丹利华鑫基金管理有限公司，下称“摩根士丹利华鑫基金”）、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（[illegible]）增加为人民币二亿一千万元（[illegible]）增加为人民币二亿一千万元）。[illegible]年[illegible]月[illegible]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[illegible]、[illegible]、[illegible]及[illegible]的股权；公司外资股东[illegible]（香港）有限公司（现更名为摩根士丹利华鑫基金管理有限公司，下称“摩根士丹利华鑫基金”）受让招商证券股份有限公司持有的公司[illegible]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[illegible]，招商证券股份有限公司持有公司全部股权的[illegible]，[illegible]（香港）有限公司（现更名为摩根士丹利华鑫基金管理有限公司，下称“摩根士丹利华鑫基金”）持有公司全部股权的[illegible]。

公司主要中方股东招商银行成立于[illegible]年[illegible]月[illegible]日，总行设在深圳，业务以中国市场为主。招商银行于[illegible]年[illegible]月[illegible]日在上海证券交易所上市（股票代码：[illegible]）。[illegible]年[illegible]月[illegible]日，招商银行在香港联合交易所上市（股价代号：[illegible]）。目前，招商银行注册资本为人民币[illegible]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，经过多年创业发展，已成为拥有证券市场业务全牌照的一流券商。[illegible]年[illegible]月，招商证券在上海证券交易所上市（代码：[illegible]）。

公司外方股东[illegible]（香港）有限公司（现更名为摩根士丹利华鑫基金管理有限公司，下称“摩根士丹利华鑫基金”）是[illegible]集团的专门从事资产管理业务的全资子公司。[illegible]集团是全球最大的多元化金融集团之一，投资业务遍及[illegible]多个国家。

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

员基金管理人董事、监事及其他高级管理人员介绍：

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。[illegible]年至[illegible]年，在辽宁省计委工作，历任副处长、副秘书长；[illegible]年至[illegible]年，在辽宁省委办公厅工作；[illegible]年至[illegible]年，任中国人民银行办公厅副主任；[illegible]年至[illegible]年，任中国人民银行计划资金司副司长；[illegible]年至[illegible]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；[illegible]年至今任招商银行行长。现任本公司董事长。

荣利佳（[illegible]），男，澳大利亚阿得莱德大学经济学本科。[illegible]年至[illegible]年[illegible]月，任职澳大利亚财政部[illegible]年至[illegible]年期间，在澳大利亚驻美国大使馆任经贸参赞；[illegible]年[illegible]月至[illegible]年[illegible]月，任花旗银行（澳大利亚）首席经济师；[illegible]年[illegible]月至[illegible]年[illegible]月，任花旗集团资产管理公司（澳洲）总经理及投资总监；[illegible]年[illegible]月至[illegible]年[illegible]月，任花旗集团资产管理公司（新加坡）总经理；[illegible]年[illegible]月至[illegible]年[illegible]月，任[illegible]资产管理公司（澳大利亚）机构投资总监；[illegible]年[illegible]月至[illegible]年[illegible]月，任[illegible]资产管理公司（澳大利亚）澳大利亚区域经理；[illegible]年[illegible]月至[illegible]年[illegible]月，任[illegible]资产管理公司（迪拜）区域经理；[illegible]年[illegible]月至今，任[illegible]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[illegible]证市场科学决策部市场分析师、[illegible]（[illegible]）有限责任公司高级风险分析师，花旗银行[illegible]证券有限公司加入招商证券，历任风险管理部副总经理、总经理，其间于[illegible]年[illegible]月至今[illegible]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，[illegible]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，美国寿险管理学会寿险管理院士、香港中文大学工商管理硕士。[illegible]年至[illegible]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；[illegible]年至[illegible]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；[illegible]年至[illegible]年间担任[illegible]集团亚太区香港、澳门地区总经理。[illegible]年至今担任香港海港扶轮社社员；[illegible]年至今担任香港童军总会筲箕湾区会会长；[illegible]年至今担任交通康联人寿保险公司独立董事。现任本公司独立董事。

陈春花，女，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、[illegible]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，美国加州州立大学索诺玛分校[illegible]学士，曾先后就职于丸红株氏会社（英国）公司产品部，[illegible]（[illegible]）有限责任公司亚洲业务部，美国[illegible]证券公司高级分析师以及咨询委员会委员。[illegible]年初至[illegible]年[illegible]月，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[illegible]招商中国直接投资基金（[illegible]）。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。[illegible]年至今[illegible]年，任职于中集集团，出任南美战略发展项目负责人。[illegible]年至今，出任招商局中国基金有限公司（[illegible]）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。[illegible]年[illegible]月—[illegible]年[illegible]月，任江苏省连云港市汽车运输公司财务部经理；[illegible]年[illegible]月—[illegible]年[illegible]月，任中国银行连云港分行外汇会计部主任；[illegible]年[illegible]月—[illegible]年[illegible]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；[illegible]年[illegible]月—[illegible]年[illegible]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；[illegible]年[illegible]月—[illegible]年[illegible]月，任招商证券股份有限公司职工代表监事；[illegible]年[illegible]月—[illegible]年[illegible]月，任招商证券股份有限公司稽核监察总审计师；[illegible]年[illegible]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。[illegible]年[illegible]月加入招商银行，[illegible]年至[illegible]年[illegible]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，[illegible]年[illegible]月至[illegible]年[illegible]月任招商银行总行计划财务部副总经理，[illegible]年[illegible]月至今任[illegible]（[illegible]）有限责任公司对成都智溢塑胶制品有限公司在亚洲证券有限责任公司的证券投资款的（[illegible]）清算公告》存在重大遗漏；[illegible]五粮液在中国科技证券有限责任公司的证券投资信息披露不及时、不完整；[illegible]五粮液[illegible]年度报告存在录入差错未及时更正；[illegible]五粮液未及时披露董事被司法羁押事项。

对该股票的投资决策程序的说明：本基金管理人看好宜宾五粮液股份有限公司在白酒行业中的品牌实力、在中低端酒的营销渠道改革；经过与管理层的交流以及本基金管理人内部严格的投资决策流程，该股票被纳入本基金的实际投资组合。

[illegible]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。

[illegible]其他资产构成

序号	名称	金额（元）
[illegible]	存出保证金	[illegible]
[illegible]	应收证券清算款	[illegible]
[illegible]	应收股利	[illegible]
[illegible]	应收利息	[illegible]
[illegible]	应收申购款	[illegible]
[illegible]	其他应收款	[illegible]
[illegible]	待摊费用	[illegible]
[illegible]	其他	[illegible]
[illegible]	合计	[illegible]

[illegible]报告期未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。

[illegible]报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

[illegible]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。

报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限的说明

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。

十二、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
[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]
[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]
[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]
自基金合同生效日起至[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]

十三、基金的费用概览

（一）与基金运作有关的费用

员与基金运作有关的费用列示：

[illegible]基金管理人的管理费；

[illegible]基金托管人的托管费；

[illegible]标的指数使用费；

[illegible]基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；

[illegible]基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；

[illegible]基金份额持有人大会费用；

[illegible]基金的证券交易费用；

[illegible]基金的银行汇划费用；

[illegible]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。

[illegible]基金管理费

本基金的基金管理费年费率为[illegible]，即基金管理费按前一日基金资产净值的[illegible]年费率计提。计算方法如下：

[illegible]

[illegible]为年天数

[illegible]为每日应计提的基金管理费

[illegible]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[illegible]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。

[illegible]基金托管费

本基金的基金托管费年费率为[illegible]，即基金托管费按前一日基金资产净值的[illegible]年费率计提。计算方法如下：

[illegible]

[illegible]为年天数

[illegible]为每日应计提的基金托管费

[illegible]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[illegible]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。

[illegible]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[illegible]万元，即若不足人民币[illegible]万元则按照人民币[illegible]万元收取。

[illegible]

[illegible]为年天数

[illegible]为每日应计提的指数使用费

[illegible]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[illegible]为内准计算应支付的、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[illegible]工作日内从基金财产中一次性支付给指数所有人。

[illegible]上述[illegible]到[illegible]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。

[illegible]下列费用不列入基金费用：

[illegible]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；

[illegible]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；

[illegible]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；

[illegible]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。

[illegible]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[illegible]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

员基金的认购费用

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。

[illegible]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。

[illegible]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。

[illegible]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。

[illegible]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[illegible]工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

远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[illegible]年[illegible]月[illegible]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：

员在“三、基金管理人”部分，更新了“（一）基金管理人概况”、“（二）目前所管理基金的基本情况”、“（三）主要人员情况”。

[illegible]在“四、基金托管人”部分，更新了“（一）销售机构”、“（二）主要人员情况”、“（三）基金托管业务经营情况”及“四）基金托管人的内部控制制度”。

[illegible]在“五、相关服务机构”部分，更新了“（一）销售机构”、“（三）律师事务所和经办律师”。

[illegible]更新了“六、基金的募集与基金合同的生效”。

[illegible]在“七、基金份额的申购、赎回及转换”部分，更新了“四）申购、赎回及转换的原则”、“（四）申购、赎回及转换的有关限制”。

[illegible]在“九、基金的投资”部分，更新了“（十一）基金投资组合报告”。

[illegible]更新了“十、基金的业绩”。

[illegible]更新了“二十一、对基金份额持有人的服务”。

[illegible]更新了“二十二、其他应披露事项”。

招商基金管理有限公司

[illegible]年[illegible]月[illegible]日