招商沪深300高贝塔指数分级证券投资基金之300高贝A、300高贝B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　　上市时间:2013年9月2日
上市地点:深圳证券交易所　　公告时间:2013年8月28日

一、重要声明与提示

招商沪深300高贝塔指数分级证券投资基金(以下简称"本基金")之300高贝A、300高贝B上市交易公告书依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称"《基金法》")、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号<上市交易公告书的内容与格式>》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制,本基金管理人的董事会及董事保证本上市交易公告书(以下简称"本公告书")所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,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、准确性和完整性,承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

本公告书第七节"基金财务状况"未经审计。

凡本公告未涉及的有关内容,请投资者详细查阅刊登在2013年7月4日《中国证券报》、《上海证券报》及招商基金管理有限公司网站(www.cmfchina.com)上公告的《招商沪深300高贝塔指数分级证券投资基金招募说明书》。

二、基金概览

1、基金名称:招商沪深300高贝塔指数分级证券投资基金
2、基金类型:股票型
3、基金运作方式:契约型开放式
4、本基金的基金份额包括招商沪深300高贝塔指数分级证券投资基金之基础份额(简称"招商300高贝塔份额",场内简称"300高贝",基金代码:161718)、招商沪深300高贝塔指数分级证券投资基金之稳健收益类份额(简称"招商300高贝塔A份额",场内简称"300高贝A",基金代码:150145)与招商沪深300高贝塔指数分级证券投资基金之积极收益类份额(简称"招商300高贝塔B份额",场内简称"300高贝B",基金代码:150146)。其中,招商300高贝塔A份额、招商300高贝塔B份额的基金份额配比始终保持1:1的比例不变。
5、基金存续期限:不定期
6、招商300高贝塔份额的申购与赎回:本基金合同生效后,投资人可通过场外或场内两种方式对招商300高贝塔份额进行申购与赎回。招商300高贝塔A份额、招商300高贝塔B份额只上市交易,不接受申购与赎回。招商300高贝塔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,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,通过基金管理人、场外代销机构办理场外申购、赎回业务。招商300高贝塔份额的场内申购与赎回的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,投资者可使用深圳证券账户(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或证券投资基金账户)通过深圳证券交易所交易系统办理场内申购、赎回业务。
7、份额配对转换:份额配对转换是指本基金的招商300高贝塔份额与招商300高贝塔A份额、招商300高贝塔B份额之间的配对转换,包括分拆和合并两个方面。分拆是指基金份额持有人将其持有的每两份招商300高贝塔份额的场内份额申请转换成一份招商300高贝塔A份额与一份招商300高贝塔B份额的行为。合并是指基金份额持有人将其持有的每一份招商300高贝塔A份额与一份招商300高贝塔B份额进行配对申请转换成两份招商300高贝塔份额的场内份额的行为。
8、定期份额折算:在存续期内的每个会计年度(基金合同生效不足六个月的除外)的12月15日(遇节假日顺延),招商300高贝塔A份额和招商300高贝塔B份额按照基金合同中规定的净值计算规则进行净值计算。对于招商300高贝塔A份额期末的约定应得收益,即招商300高贝塔A份额每个会计年度基金份额折算基准日的份额净值超出1.000元部分,将折算为场内招商300高贝塔份额分配给招商300高贝塔A份额持有人。招商300高贝塔份额持有人持有的每2份招商300高贝塔份额将按1份招商300高贝塔A份额获得新增招商300高贝塔份额的分配。持有场外招商300高贝塔份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外招商300高贝塔份额的分配;持有场内招商300高贝塔份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内招商300高贝塔份额的分配。经过上述份额折算,招商300高贝塔A份额的参考净值和招商300高贝塔份额的基金份额净值将相应调整。在基金份额折算前与折算后,招商300高贝塔A份额和招商300高贝塔B份额的份额配比保持1:1的比例。
9、不定期份额折算:当招商300高贝塔份额的基金份额净值达到 1.500 元后,本基金将分别对招商300高贝塔A份额、招商300高贝塔B份额和招商300高贝塔份额进行份额折算,份额折算后本基金将确保招商300高贝塔A份额和招商300高贝塔B份额的比例为1:1,份额折算后招商300高贝塔A份额和招商300高贝塔B份额的参考净值、招商300高贝塔份额的基金份额净值均调整为1元。

当招商300高贝塔B份额的基金份额参考净值达到0.250元后,本基金将分别对招商300高贝塔A份额、招商300高贝塔B份额和招商300高贝塔份额进行份额折算,份额折算后本基金将确保招商300高贝塔A份额和招商300高贝塔B份额的比例为1:1,份额折算后招商300高贝塔份额的基金份额净值、招商300高贝塔A份额和招商300高贝塔B份额的基金份额参考净值均调整为1元。
9、基金份额总额:截至2013年8月26日,本基金的基金份额总额为546,488,920.70份,其中,招商300高贝塔份额为276,649,843.70份,招商300高贝塔A份额为134,919,538.00份,招商300高贝塔B份额为134,919,539.00份。
10、基金份额参考净值:截至2013年8月26日,招商300高贝塔份额的基金份额净值为1.004元,招商300高贝塔A份额的基金份额参考净值为1.005元,招商300高贝塔B份额的基金份额参考净值为1.003元。
11、本次上市交易的基金份额场内简称及其基金代码:300高贝A(基金代码:150145),300高贝B(基金代码:150146)
12、本次上市交易的基金份额总额:300高贝A为134,919,538.00份;300高贝B为134,919,539.00(截至2013 年8月26日)
13、上市交易的证券交易所:深圳证券交易所
14、上市交易日期:2013年9月2日
15、基金管理人:招商基金管理有限公司
16、基金托管人:中国银行股份有限公司
17、本次上市交易的基金份额注册登记机构:中国证券登记结算有限责任公司

三、基金的募集与上市交易

(一)上市前基金募集情况
1、基金募集申请的核准机构和核准文号:中国证券监督管理委员会证监许可【2013】764号
2、基金合同生效日:2013年8月1日
3、基金运作方式:契约型开放式
4、基金合同期限:不定期
5、发售日期:2013年7月8日至2013年7月26日
6、发售价格:1.00元人民币
7、发售方式:场内和场外
8、发售机构:
(1)场内发售机构:
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(具体名单可在深圳证券交易所网站查询)。
(2)场外发售机构:
1)直销机构包括本公司的招商基金电子商务网上交易平台、招商基金华东机构理财中心、招商基金华南机构理财中心、招商基金养老金及华北机构理财中心等。
2)代销机构:中国银行、招商银行、招商证券、申银万国证券、中航证券、华融证券、国信证券、平安证券、国海证券、广州证券、国泰君安证券、光大证券、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、中信证券(浙江)、中信万通证券、中国中投证券、国金证券、国都证券、财富证券、华鑫证券(排名不分先后)。
9、验资机构名称:毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)
10、募集资金总额及入账情况
本基金于2013年7月8日起公开募集,基金募集工作已于2013年7月26日顺利结束。经毕马威华振会计师事务所验资,本次募集的有效认购资金人民币546,406,226.00元,基金注册登记机构记录的有效认购资金利息转份额人民币82,694.70,共计人民币546,488,920.70元。上述资金及利息折合546,488,920.70份基金份额。有效认购资金人民币546,406,226.00元已于2013年8月1日划入本基金在基金托管人中国银行股份有限公司开立的基金托管专户。此外,经中国证券登记结算有限责任公司确认,上述有效认购资金利息转份额中对应的应收利息人民币82,694.70元将于招商沪深300高贝塔指数分级证券投资基金成立之后的下一银行季度结息日(即2013年9月20日)后结转入相关账户。本次募集有效认购总户数为2,897户。
11、本基金募集备案情况
根据《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》以及《招商沪深300高贝塔指数分级证券投资基金基金合同》、《招商沪深300高贝塔指数分级证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金募集符合有关条件,本基金管理人已向中国证监会办理基金备案手续,并于2013年8月1日获书面确认,基金合同自该日起正式生效。自基金合同生效之日起,本基金管理人开始正式管理本基金。
12、基金合同生效日的基金份额总额:546,488,920.70份
13、本基金管理人及基金从业人员持有基金份额的情况:

份额级别		招商300高贝塔A份额	招商300高贝塔B份额	招商300高贝塔份额
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(单位:份)	-	-	-
	占基金总份额比例	-	-	-
	其他需要说明的事项	-	-	-
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(单位:份)	-	-	-
	占基金总份额比例	-	-	-

本基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人、基金经理未持有本基金。
(二)本基金上市交易的主要内容
1、基金上市交易的核准机构和核准文号:深圳证券交易所深证上[2013]290号
2、上市交易日期:2013年9月2日
3、上市交易的证券交易所:深圳证券交易所。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。
4、基金简称:招商300高贝塔A份额、招商300高贝塔B份额
基金场内简称:300高贝A、300高贝B
5、交易代码:300高贝A:150145、300高贝B:150146
6、本次上市交易份额:300高贝A:134,919,538.00份、300高贝B:134,919,539.00份
7、未上市交易份额的流通规定:对于托管在场内的招商300高贝塔份额,基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下,将其分拆为300高贝A和300高贝B即可上市流通;对于托管在场外的招商300高贝塔份额,基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下,将其跨系统转托管至深圳证券交易所场内后分拆为300高贝A和300高贝B即可上市流通。
8、基金资产净值的披露:在招商300高贝塔A份额、招商300高贝塔B份额上市交易前或者开始办理招商300高贝塔份额申购或者赎回后,基金管理人应当在每个开放日的次日,通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介,披露开放日招商300高贝塔份额的基金份额净值和基金份额累计净值、招商300高贝塔A份额与招商300高贝塔B份额的基金份额参考净值。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人情况

(一)持有人户数
截至2013年8月26日,场外招商300高贝塔份额持有人户数为1,817户,平均每户持有的基金份额为152,256.38份;场内招商300高贝塔份额持有人户数为0户,平均每户持有的基金份额为0份;300高贝A为1,080户,平均每户持有的基金份额为124,925.50份;300高贝B为1,080户,平均每户持有的基金份额为124,925.50份。
(二)持有人结构
截至2013年8月26日,机构投资者持有的本次上市交易的300高贝A基金份额为44,182,299.00份,占本次300高贝A上市交易基金份额比例为32.75%;个人投资者持有的本次上市交易的300高贝A基金份额为90,737,239.00份,占本次300高贝A上市交易基金份额比例为67.25%。
机构投资者持有的本次上市交易的300高贝B基金份额为44,182,301.00份,占本次300高贝B上市交易基金份额比例为32.75%;个人投资者持有的本次上市交易的300高贝B基金份额为90,737,238.00份,占本次300高贝B上市交易基金份额比例为67.25%。
(三)前十名场内基金份额持有人情况(截至2013年8月26日)

序号	持有人名称(全称)	持有300高贝A	占300高贝A的比例(%)	持有300高贝B	占300高贝B的比例(%)
1	安徽江淮汽车股份有限公司	10,000,583	7.41	10,000,583	7.41
2	宏源证券股份有限公司	7,500,437	5.56	7,500,437	5.56
3	长城人寿保险股份有限公司-分红-个人分红	5,000,146	3.71	5,000,145	3.71
4	邹瀚枢	5,000,145	3.71	5,000,146	3.71
5	中国银河证券股份有限公司	5,000,145	3.71	5,000,146	3.71
6	徐建堂	4,500,131	3.34	4,500,131	3.34
7	兴业证券股份有限公司	4,500,131	3.34	4,500,131	3.34
8	中信证券股份有限公司	4,000,116	2.96	4,000,117	2.96
9	张心彤	3,500,204	2.59	3,500,204	2.59
10	北京华源经典装饰有限公司	2,561,575	1.90	2,561,574	1.90
合计		51,563,613	38.22	51,563,614	38.22

注:以上信息依据中国证券登记结算有限公司深圳分公司提供的持有人信息编制。

五、基金主要当事人简介

(一)基金管理人
1、公司概况
名称:招商基金管理有限公司
法定代表人:马蔚华
总经理:许小松
设立日期:2002年12月27日
注册地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦28楼
注册资本:人民币2.1亿元
办公地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦28楼
设立批准文号:中国证监会证监基金字[2002]100号
工商登记注册的法人营业执照文号:企合国字第000976
经营范围:基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。
存续期间:持续经营
电话:(0755)83196351
传真:(0755)83076974
联系人:曾倩
2、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	33.4%
招商证券股份有限公司	33.3%
ING Asset Management B.V.	33.3%

3、内部组织结构及职能
公司具体经营管理由总经理负责,公司根据经营运作需要设置董事会办公室、股票投资部、固定收益投资部、交易部、研究部、专户资产投资部、量化投资部、渠道管理部、市场部、产品研发部、国际业务部、华东机构理财中心、华南机构理财中心、招商基金养老金及华北机构理财中心、信息技术部、基金核算部、基金事务部、法律合规部、风险管理部、总经理办公室、人力资源部、财务部等21个职能部门,并设有北京分公司、上海分公司等分支机构。
各部门主要职能如下:
董事会办公室:负责公司董事会相关工作。
股票投资部:根据投资决策委员会制定的原则进行投资股票投资。
固定收益投资部:负责固定收益产品的投资。
交易部:负责公司所有产品的交易管理工作。
研究部:负责宏观、策略、行业和公司研究。
专户资产投资部:负责专户产品的投资。
量化投资部:负责量化产品和指数产品的投资。
渠道管理部:负责基金的渠道销售工作。
市场部:负责营销策划、客户服务、市场推广等工作。
产品研发部:负责产品研发、申报等工作。
国际业务部:负责海外基金产品的投研究。
华东机构理财中心、华南机构理财中心、招商基金养老金及华北机构理财中心:负责机构销售业务。
信息技术部:负责公司电脑信息技术的开发、维护及基金后台运作支持工作。
基金核算部:负责公司基金的会计核算、估值。
基金事务部:负责公司基金的注册登记、资金清算。
法律合规部:负责对公司和基金运作合规性监察、稽核审计、法务支持及日常信息披露事宜。
风险管理部:负责对公司日常营运进行风险管理及风险检查;负责投资业绩评价。
总经理办公室:负责文档、印鉴管理,公司品牌建设、市场调研以及其他行政工作。
人力资源部:负责公司人力资源管理工作。
财务部:负责公司财务管理、会计核算等相关工作。
各分公司:负责所辖区域内销售渠道的开发、维护。
4、人员情况
截至2013年4月30日,公司共有员工204人,其中191人通过中国证券业协会组织的证券从业资格考试,具有基金从业资格。
5、信息披露负责人及咨询电话:
欧志明,(0755)83196401。
6、基金管理业务情况
本基金管理公司目前管理33只基金,其中封闭式基金1只;招商信用添利债券型证券投资基金;开放式基金32只。
7、本基金基金经理简介
罗毅,男,中国国籍,经济学硕士。2007年加入华润(深圳)有限公司,从事商业地产投资项目分析及营运管理工作;2008年4月加入招商基金管理有限公司,从事养老金产品设计研发、基金市场研究、量化选股研究及指数基金运作管理工作,曾任高级经理、ETF专员,现任上证消费80交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、深证电子信息传媒产业(TMT)50交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理。
(二)基金托管人
1、基金托管人概况
名称:中国银行股份有限公司(简称"中国银行")
住所及办公地址:北京市西城区复兴门内大街1号
首次注册登记日期:1983年10月31日
变更注册登记日期:2004年8月26日
注册资本:人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾玖万叁仟壹佰玖拾伍元整
法定代表人:田国立
基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字【1998】24 号
托管及投资者服务部总经理:李爱华
托管部门信息披露联系人:唐州徽
电话:(010)66594855
传真:(010)66594942
2、主要人员情况
中国银行于1998年设立基金托管部,为进一步树立以投资者为中心的服务理念,中国银行于2005年3月23日正式将基金托管部更名为托管及投资者服务部,现有员工120余人。另外,中国银行在重点分行已开展托管业务。
3、证券投资基金托管情况
截至2013年6月末,中国银行已托管214只证券投资基金,覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金,满足了不同客户多元化的投资理财需求,基金托管规模位居同业前列。
(三)基金验资机构
名称:毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)
注册地址:北京市东长安街1号东方广场东二办公楼八层
法定代表人:姚建华
电话:(0755)2547 1000
传真:(0755)8266 8930
经办注册会计师:王国蓓、黄小熠
联系人:蔡正轩

六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件。

七、基金财务状况

(一)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、会计师费、律师费以及其他费用,不从基金资产中支付。
(二)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。
(三)基金资产负债表
截至公告前两个工作日即2013年8月26日,本基金的资产负债表如下:
资产负债表
会计主体:招商沪深300高贝塔指数分级证券投资基金
报告截止日:2013年8月26日　　单位:人民币元

资产	本报告期末 2013年8月26日
资产:	
银行存款	27,471,485.14
结算备付金	-
存出保证金	-
交易性金融资产	129,250,992.68
其中:股票投资	129,250,992.68
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	392,500,000.00
应收证券清算款	3,049,333.28
应收利息	54,991.82
应收股利	70,157.50
应收申购款	-
其他资产	83,345.51
资产合计	552,480,305.93
负债和所有者权益	
负债:	
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	-
应付证券清算款	3,023,657.93
应付赎回款	-
应付管理人报酬	374,736.01
应付托管费	74,947.18
应付销售服务费	-
应付交易费用	115,946.06
应付税费	-
应付利息	-
应付利润	-
其他负债	31,285.79
负债合计	3,620,572.97
所有者权益:	
实收基金	546,488,920.70
未分配利润	2,370,812.26
所有者权益合计	548,859,732.96
负债与持有人权益总计	552,480,305.93

注:截至2013年8月26日,招商300高贝塔份额净值1.004元、招商300高贝塔A份额净值1.005、招商300高贝塔B份额净值1.003元,招商300高贝塔份额276,649,843.70份、招商300高贝塔A份额134,919,538.00份、招商300高贝塔B份额134,919,539.00份。

八、基金投资组合

截至公告前两个工作日即2013年8月26日(以下称"报告期末"),本基金的投资组合如下:
(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	129,250,992.68	23.39
	其中:股票	129,250,992.68	23.39
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	392,500,000.00	71.04
	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	27,471,485.14	4.97
6	其他资产	3,257,828.11	0.59
7	合计	552,480,305.93	100.00

(二)报告期末按行业分类的股票投资组合
1、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	882,857.44	0.16
B	采矿业	17,959,384.70	3.27
C	制造业	30,212,210.01	5.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	4,249,571.80	0.77
F	批发和零售业	2,563,613.72	0.47
G	交通运输、仓储和邮政业	423,500.00	0.08
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	63,560,137.35	11.58
K	房地产业	3,881,409.66	0.71
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	1,208,403.00	0.22
	合计	124,941,087.68	22.76

2、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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	43,440.00	0.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	1,065,344.00	0.19
K	房地产业	3,201,121.00	0.58
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	4,309,905.00	0.79

(三)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
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	600016	民生银行	1,003,200	9,359,856.00	1.71
2	601166	兴业银行	844,800	9,014,016.00	1.64
3	601318	中国平安	170,010	5,858,544.60	1.07
4	601601	中国太保	278,385	4,765,951.20	0.87
5	600030	中信证券	418,300	4,626,398.00	0.84
6	600837	海通证券	368,600	4,183,610.00	0.76
7	000001	平安银行	363,200	3,958,880.00	0.72
8	000776	广发证券	271,109	3,228,908.19	0.59
9	600111	包钢稀土	110,500	3,224,390.00	0.59
10	600585	海螺水泥	183,407	2,989,534.10	0.54

2、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

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	600048	保利地产	296,950	3,201,121.00	0.58
2	601009	南京银行	131,200	1,065,344.00	0.19
3	000923	河北宣工	8,000	43,440.00	0.01

(四)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。
(五)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。
(六)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。
(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权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
(八)投资组合报告附注
1、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,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、其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	3,049,333.28
3	应收股利	70,157.50
4	应收利息	54,991.82
5	应收申购款	-
6	其他应收款	83,345.51
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,257,828.11

(九)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。
(十)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。

九、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。

十、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:
1、严格遵守《基金法》及其他法律法规、基金合同的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。
2、真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件,披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息,并接受中国证监会、证券交易所的监督管理。
3、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,将及时予以公开澄清。

(下转B70版)

关于开放招商沪深300高贝塔指数分级证券投资基金日常申购、赎回及定期定额投资业务的公告

公告送出日期:2013年8月28日
1 公告基本信息

基金名称	招商沪深300高贝塔指数分级证券投资基金	
基金简称	招商沪深300高贝塔指数分级	
基金主代码	161718	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年8月1日	
基金管理人名称	招商基金管理有限公司	
基金托管人名称	中国银行股份有限公司	
基金注册登记机构名称	招商基金管理有限公司	
公告依据	《招商沪深300高贝塔指数分级证券投资基金基金合同》和《招商沪深300高贝塔指数分级证券投资基金招募说明书》	
申购起始日	2013年9月2日	
赎回起始日	2013年9月2日	
转换转入起始日	-	
转换转出起始日	-	
定期定额投资起始日	2013年9月2日	
下属分级基金的基金简称	300高贝A	300高贝B
下属分级基金的交易代码	150145	150146
下属分级基金的前端交易代码	-	-
下属分级基金的后端交易代码	-	-
该分级基金是否开放申购、赎回(转换、定期定额投资)	否	否

注:本基金的基金份额包括基础份额和分级份额。基础份额为"招商300高贝塔份额"(场内简称"300高贝",基金代码"161718"),分为场外和场内两部分;分级份额包括招商300高贝塔A份额(场内简称"300高贝A",基金代码"150145")和招商300高贝塔B份额(场内简称"300高贝B",基金代码"150146")。基金合同生效后,投资者可以通过场外或场内方式申购赎回招商300高贝塔份额。招商300高贝塔A份额和招商300高贝塔B份额不接受投资者的申购赎回。
投资者范围:符合法律法规规定的个人投资者、机构投资者及合格境外机构投资者以及法律法规及中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者。
2 日常申购、赎回(定期定额投资)业务的办理时间
投资人在开放日办理招商300高贝塔份额的申购和赎回,具体办理时间为证券交易所的正常交易日的交易时间,但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。
基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理招商300高贝塔份额的申购或者赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回申请且登记机构确认接收的,其基金份额申购、赎回价格为下一开放日招商300高贝塔份额申购、赎回的价格。
基金合同生效后,若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况,基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整,但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。
3 日常申购业务
3.1 申购金额限制
投资者在办理招商300高贝塔份额场内申购时,单笔申购的最低金额为50,000元人民币。投资者办理招商300高贝塔份额场外申购时,单笔最低金额为1,000元人民币(含申购费)。通过直销中心首次申购的最低金额为50万元人民币(含申购费),追加申购单笔最低金额为1,000元人民币(含申购费)。通过本公司电子商务网上交易系统办理招商300高贝塔份额申购,最低申购金额为单笔1,000元。本基金直销中心及电子商务网上交易系统的单笔申购最低金额可由基金管理人酌情调整。
本基金不对单个投资人累计持有的招商300高贝塔份额上限进行限制。
基金管理人可根据市场情况,在法律法规允许的情况下,调整上述对申购金额的数量限制,基金管理人必须在调整生效前依照《证券投资基金信息披露管理办法》的有关规定至少在一家指定媒体公告并报中国证监会备案。
3.2 申购费率
-
3.2.1 前端收费

申购金额(M)	申购费率	备注
M<500000	1.00%	-
500000<=M<1000000	0.50%	-
1000000<=M	300元/笔	-

注:招商300高贝塔份额的场外申购费率根据申购金额如上表设定,申购费按申购金额进行分档,投资者在一天之内如果有多笔申购,适用费率按单笔分别计算。招商300高贝塔份额的场内申购费率由基金代销机构比照场外申购费率执行。
3.2.2 后端收费

持有期限(N)	申购费率	备注

注:-
3.3 其他与申购相关的事项
招商300高贝塔份额申购份额的计算:
基金的申购金额包括申购费用和净申购金额,其中:
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
申购份额= 净申购金额/ T日招商300高贝塔份额的份额净值
申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后,以当日招商300高贝塔份额的基金份额净值为基准计算,其中,通过场外方式进行申购的,申购份额计算结果保留到小数点后2位,小数点后两位以后的部分四舍五入,由此误差产生的收益或损失计入基金财产;通过场内方式申购的,申购份额计算结果采用截尾法保留到整数位,整数位后小数部分的份额对应的资金返还投资者。
招商300高贝塔份额的申购费用由基金申购人承担,并应在投资者申购基金份额时收取,不列入基金财产,主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。
4 日常赎回业务
4.1 赎回份额限制
基金份额持有人办理招商300高贝塔份额场外赎回时,每笔赎回申请的最低份额为1000份基金份额;基金份额持有人办理招商300高贝塔份额场内赎回时,每笔赎回申请的最低份额为1000份基金份额,同时赎回份额必须是整数份额。招商300高贝塔份额持有人每个交易账户的最低份额余额为1000 份,份额持有人赎回时或赎回后将导致在销售机构(网点)保留的招商300高贝塔份额余额不足1000 份的,需一并全部赎回。
本基金不对单个投资人累计持有的招商300高贝塔份额上限进行限制。
基金管理人可根据市场情况,在法律法规允许的情况下,调整上述对赎回的份额的数量限制,基金管理人必须在调整生效前依照《证券投资基金信息披露管理办法》的有关规定至少在一家指定媒体公告并报中国证监会备案。
4.2 赎回费率

持有期限(N)	赎回费率
N<365天	0.50%
365天<=N<730天	0.25%
730天<=N	0.00%

注:招商300高贝塔份额的场外赎回费率按基金份额持有人持有该部分基金份额的时间分段如上表设定。招商300高贝塔份额的场内赎回费率为固定0.5%。
招商300高贝塔份额的赎回费用由基金赎回人承担,在投资者赎回基金份额时收取。扣除赎回手续费后的余额归基金财产,赎回费归入基金财产的部分不低于赎回费总额的25%。基金管理人可以根据基金合同的相关约定调整费率或收费方式,基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前在至少一种指定媒体及基金管理人网站公告。
对特定交易方式(如网上交易、电话交易等),基金管理人履行适当程序后可以调低基金申购费率和基金赎回费率。
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,针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招商300高贝塔份额的申购费率和基金赎回费率。
4.3 其他与赎回相关的事项
采用"份额赎回"方式,赎回价格以T 日的招商300高贝塔份额的份额净值为基准进行计算,计算公式:
赎回总金额= 赎回份额×T 日招商300高贝塔份额的份额净值
赎回费用= 赎回总金额×赎回费率
净赎回金额= 赎回总金额-赎回费用
各计算结果均按照四舍五入方法,保留至小数点后2 位,由此误差产生的收益或损失计入基金财产。
5 日常转换业务
5.1 转换费率
日常转换业务暂时不予开通,若今后开通,请以相关公告为准。
5.2 其他与转换相关的事项
-
6 定期定额投资业务
"定期定额投资业务"是投资者可通过本公司指定的基金销售机构提交申请,约定每期扣款日、扣款金额及扣款方式,由销售机构于每期约定扣款日在投资者指定银行账户内自动完成扣款及基金申购申请的一种投资方式。投资者在办理相关基金"定期定额投资业务"的同时,仍然可以进行日常申购、赎回业务。
投资者可与销售机构就本基金申请定期定额投资业务约定每期固定扣款金额,定期定额申购每期最低扣款金额不少于人民币1000元。具体最低扣款金额遵循投资者所开户的销售机构的规定。
定期定额申购业务的申购费率等同于正常申购费率,计费方式等同于正常的申购业务,如有费率优惠以销售机构相关公告为准。
7 基金销售机构
7.1 场外销售机构
7.1.1 直销机构
招商基金客户服务中心电话:400-887-9555(免长途话费)
(1)招商基金电子商务网上交易平台
交易网站:www.cmfchina