



招商中证500指数增强型证券投资基金招募说明书(更新)摘要

(2018年第2号)

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 截止日:2018年11月17日

重要提示

招商中证500指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会2016年12月16日《关于准予招商中证500指数增强型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2016]3114号文)注册并募集。本基金的基金合同于2017年5月17日正式生效。本基金为契约开放式。

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注册,中国证监会对本基金募集的注册审查以要件齐备和内容合规为基础,以充分的信息披露和投资者适当性为核心,以加强投资者利益保护和防范系统性风险为目标。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。投资者应当认真阅读基金招募说明书、基金合同等信息披露文件,自主判断基金的投资价值,自主做出投资决策,自行承担投资风险。

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。

本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动。投资者在本基金前,应全面了解本基金的产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,并承认基金投资中出现的各类风险,包括:因整体政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险,投资者申购、赎回失败的风险,基金管理人因基金实施过程中产生的基金管理风险,本基金的特有风险等。

基金的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基金的招募说明书和基金合同。

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。

本招募说明书所载内容截止日为2018年11月17日,有关财务和业绩表现数据截止日为2018年9月30日,财务和业绩表现数据未经审计。

本基金托管人中国银行股份有限公司已于2018年12月4日复核了本次更新的招募说明书。

1 基金管理人

1.1 基金管理人概况
公司名称:招商基金管理有限公司
注册地址:深圳市福田区深南大道7088号
设立日期:2002年12月17日
注册资本:人民币13.7亿元
法定代表人:李浩
办公地址:深圳市福田区深南大道7088号
电话:(0755)83199596
传真:(0755)83199674
联系人:韩思斯
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。目前公司注册资本为人民币十三亿元人民币(RMB1,310,000,000元),股东及股权结构为:招商银行持有公司全部股权的30%,中国电力财务有限公司持有公司全部股权的55%,招商证券股份有限公司(以下简称“招商证券”)持有公司全部股权的45%。

2002年12月,公司由招商证券、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,成立时注册资本人民币一亿元,股东及股权结构为:招商证券持有公司全部股权的40%,ING Asset Management B.V.(荷兰投资)持有公司全部股权的30%,中国电力财务有限公司、中国华能财务有限责任公司、中远财务有限公司各持有公司全部股权的10%。

2005年4月,经公司董事会审议通过并经中国证监会批复同意,公司注册资本由人民币一亿元增加至人民币一亿六千万,股东及股权结构不变。
2007年5月,经公司董事会审议通过并经中国证监会批复同意,招商银行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分别持有的公司10%、10%、10%及3.4%的股权,ING Asset Management B.V.(荷兰投资)受让招商证券持有的公司3.3%的股权。上述股权转让完成后,公司的股东及股权结构为:招商银行持有公司全部股权的33.4%,招商证券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%。同时,公司注册资本由人民币一亿六千万增加至人民币二亿一千万。

2013年8月,经公司董事会审议通过并经中国证监会批复同意,ING Asset Management B.V.(荷兰投资)将其持有的公司21.6%股权转让给招商银行,11.7%股权转让给招商证券。上述股权转让完成后,公司的股东及股权结构为:招商银行持有全部股权的55%,招商证券持有全部股权的45%。

2017年12月,经公司董事会审议通过并经中国证监会、公司股东招商银行和招商证券持有股权比例向同比例调整人民币一亿元。增资完成后,公司注册资本由人民币二亿一千万增加至人民币三亿一千万,股东及股权结构不变。
公司主要股东招商银行股份有限公司成立于1987年4月8日,招商银行始终恪守“因您而变”的经营理念,已成为中国内地最具品牌影响力的商业银行之一。2002年4月9日,招商银行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(股份代码:3968)。

招商证券股份有限公司是百年招商局集团旗下的证券公司,经过多年创业发展,已成为拥有证券业务全牌照的一流券商。2009年11月17日,招商证券在上海证券交易所上市(代码600999);2016年10月7日,招商证券在香港联合交易所上市(股份代码:6099)。

公司秉承“诚信、理性、专业、协作、成长”的理念,以“为投资者创造更多价值”为使命,力争成为中国资产管理行业具有“差异化竞争优势、一流品牌”的资产管理公司。
1.2.1 董事会成员
李浩先生,招商银行股份有限公司执行董事、常务副行长兼财务负责人。美国加州大学工商管理硕士学位,高级会计师。1997年5月加入招商银行任总行行长助理,2000年4月至2002年3月兼任招商银行上海分行行长,2001年12月起担任招商银行副行长,2007年3月起兼任财务负责人,2007年6月起担任招商银行执行董事,2013年5月起担任招商银行常务副行长,2016年3月起兼任深圳市招商银行金融资产管理交易中心常务副董事长。现任公司董事长。

邓晓女士,毕业于美国纽约州立大学,获经济学博士学位。2001年加入招商证券,并于2004年11月至2004年12月被中国证监会借调至南方证券行政接管组任接管组成员。在加入招商证券前,邓女士曾任Citigroup(花旗集团)风险管理高级分析师。现任招商证券股份有限公司副总裁兼首席风险官,分管风险管理、公司财务、招募及培训工作;兼任中国证券业协会财务与风险控制委员会副主任委员。现任公司副董事长。
金旭女士,北京大学金融学硕士研究生。1993年7月至2001年11月在中国证监会工作。2001年11月至2004年7月在华夏基金管理有限公司任副总经理。2004年7月至2006年11月在招商基金管理有限公司任总经理。2006年11月至2007年6月在梅隆全球投资有限公司北京代表处任首席代表,2007年6月至2010年12月担任国泰基金管理有限公司总经理。2015年1月加入招商基金管理有限公司,现任公司副董事长、总经理兼招商资产管理(香港)有限公司董事长。

吴冠雄先生,硕士研究生,22年法律从业经历。1994年8月至1997年9月在中国北方工业公司任法律事务部职员。1997年10月至1999年1月在新加坡Colin Ng & Partners任中国法律顾问。1999年2月至今在北京天元律师事务所工作,先后担任专职律师、事务所权益合伙人、事务所管理合伙人、事务所执行主任和管理委员会成员。2009年9月至今兼任北京中汇联合有限公司外部董事,2016年4月至今兼任北京墨迹云科技股份有限公司独立董事,2016年12月至今兼任新世纪医疗控股有限公司(香港联交所上市公司)独立董事,2016年11月至今任中国证券监督管理委员会第三届上市公司并购重组专家咨询委员会委员。现任公司独立董事。
王蔚女士,高级经济师,毕业于中国人民解放军外国语学院,历任中国人民解放军昆明军区三局战士、助理研究员,国务院科技干部二处干部;中信银行财务部国际金融处干部、银行部资金处副处长;中信银行(原中信实业银行)资本市场部总经理、行长助理、副行长等职。现任中国证券市场研究设计中心(联办)常务干事兼基金部总经理;联办秘书处上市公司董事总经理等。现任公司独立董事。

何玉慧女士,加拿大皇后大学荣誉商学士,26年会计从业经历,曾先后就职于加拿大National Trust Company和 Ernst & Young,1995年4月加入香港毕马威会计师事务所,2015年9月退休从事香港毕马威会计师事务所金融企业内部审计、风险管理和合规服务主管合伙人。2016年8月至任泰康养老保险集团(中国)有限公司独立董事,2017年9月至今任汇丰前海证券有限公司独立董事,同时兼任多个香港政府机构辖下委员会的委员和香港会计师公会纪律评判小组成员。现任公司独立董事。
孙谦先生,新加坡籍,经济学博士。1980年至1991年先后就读于北京大学、复旦大学、William Paterson College 和 Arizona State University 并获得学士、工商管理硕士和经济学博士学位。曾任新加坡南洋理工大学商学院副教授、厦门大学财务管理与会计研究院院长及特聘教授、上海证券交易所高级顾问金融专家。现任复旦大学管理学院特聘教授和财务金融系主任。兼任上海证券交易所、中国金融期货交易所和上海期货交易所项目工作指导师,科技部复旦科技园中小型科技企业创新创业融资平台项目负责人。现任公司独立董事。

1.2.2 监事会成员

赵斌先生,毕业于深圳大学国际金融专业、格林威治大学项目管理专业,分别获经济学学士学位、理学硕士学位。1992年7月至1998年12月,历任招商银行证券部员工、福田营业部主任、海口营业部助理经理。经理,1999年1月至2006年1月,历任招商证券经纪业务部总经理助理,深圳龙岗证券营业部副总经理(主持工作)、深圳南山南油大道营业部经理。2006年1月至2009年4月,担任招商证券私人客户部总经理;2008年4月至2016年1月,担任招商证券零售经纪总部总经理,期间于2015年4月至2016年1月兼任招商证券渠道管理部总经理。赵斌先生亦于2007年7月至2011年5月担任招商证券职工代表监事。2016年1月起至今,赵斌先生担任招商证券合规总监。同时,赵斌先生于2008年7月起担任招商期货有限公司董事,于2015年7月起担任招商证券资产管理有限公司董事。现任公司监事会主席。
彭家文先生,中南财经大学国民经济计划学专业本科,武汉大学计算

机软件专业本科。2001年9月加入招商银行,历任招商银行总行计划资金部经理、高级经理,计划财务部总经理助理、副总经理。2011年11月起任零售综合管理部副总经理、总经理。2014年6月起任零售金融部副总经理、副總裁。2016年2月起任零售金融部副总裁兼总行零售信贷部总经理。2017年3月起任招商银行郑州分行行长。2018年1月起任总行资产负债管理部总经理兼投资管理部总经理。现任公司监事。

罗琳女士,厦门大学经济学硕士。1996年加入招商证券股份有限公司投资银行部,先后担任项目经理、高级经理、业务董事;2002年参与招商基金管理有限公司筹备,公司成立后先后担任基金核算部高级经理、产品研发部高级经理、副总监、总监、产品运营官,现任首席市场官兼市场部总监、渠道财富管理部总监、公司监事。

鲁丹女士,中山大学国际工商管理硕士;2001年加入美的集团股份有限公司任Oracle ERP系统实施顾问;2005年5月至2006年12月于顺德惠悦咨询有限公司任咨询顾问;2006年12月至2011年2月于安翰威特咨询有限公司任咨询总监;2011年2月至2014年3月任信智人才管理咨询有限公司首席运营官;现任招商基金管理有限公司战略与人力资源总监兼人力资源部总监、人力资源部高级经理、副总监、总监,现任产品运营官兼产品研发一部总监、公司监事。

李扬先生,中央财经大学经济学硕士,2002年加入招商基金管理有限公司,历任基金核算部高级经理、副总监、总监,现任产品运营官兼产品研发一部总监、公司监事。

1.2.3 公司高级管理人员
金旭女士,总经理,简历同上。
钟文岳先生,常务副总经理,厦门大学经济学硕士。1992年7月至1997年4月于中国农村发展信托投资公司任福建(集团)公司国际业务部总经理;1997年4月至2000年1月于银华万国证券投资基金公司任九江营业部总经理;2000年1月至2001年1月任厦门海发投资有限公司副总经理;2001年1月至2004年1月任深圳二十一世纪投资投资公司副总经理;2004年1月至2008年11月任浙江新江南投资有限公司副总经理;2008年11月至2015年6月任招商银行股份有限公司投资管理部总经理,2015年6月加入招商基金管理有限公司,现任公司常务副总经理兼招商财富资产管理有限公司董事。

沙晓先生,副总经理,南京通信工程学院工学硕士。2000年11月加入宝盈基金管理有限公司,历任TMT行业研究员、基金助理助理、交易主管;2008年2月加入国泰基金管理有限公司,历任交易部总监,研究部总监,投资运营部基金经理、量化&保本投资事业部总经理;2015年加入招商基金管理有限公司,现任公司副总经理兼招商资产管理(香港)有限公司董事。

耿志明先生,副总经理,华中科技大学管理学及法学双学士,投资经济学硕士。2002年加入广发证券深圳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相关工作;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、督察长,现任公司副总经理、董事会秘书,兼任招商财富资产管理有限公司董事兼招商资产管理(香港)有限公司董事。

杨渺先生,副总经理,经济学硕士。2002年起先后就职于南方证券股份有限公司、巨田基金管理有限公司,历任金融工程研究员、行业研究员、助理基金经理。2005年加入招商基金管理有限公司,历任高级数量分析师,投资经理,投资管理二部(原专户资产投资部)负责人及总经理助理。现任公司副总经理。
潘西里先生,督察长,法学硕士。1998年加入大鹏证券有限责任公司法律部,负责法律工作;2001年10月加入天同基金管理有限公司督察长,任主任专员;2003年2月加入中国证券监督管理委员会深圳监管局,历任副主任科员、主任科员、副处长及处长;2015年加入招商基金管理有限公司,现任公司督察长。

1.2.4 基金经理
王平先生,管理学硕士,FRM。2006年加入招商基金管理有限公司,曾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,主要负责公司投资风险管理工作,金融工程研究等工作,现任量化投资部总监兼招商量化精选股票型发起式证券投资基金基金经理(管理时间:2016年3月15日至今)、招商稳骏定期开放混合型证券投资基金基金经理(管理时间:2016年10月27日至2017年11月21日至今)、招商沪深300指数增强型证券投资基金基金经理(管理时间:2017年2月10日至今)、招商中证1000指数增强型证券投资基金基金经理(管理时间:2017年3月3日至至今)、招商鑫合灵活配置混合型证券投资基金基金经理(管理时间:2017年4月29日至至今)及招商中证500指数增强型证券投资基金基金经理(管理时间:2017年5月17日至至今)。

1.2.5 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:总经理金旭、副总经理沙晓、副总经理杨渺、总经理助理固定收益权益投资部负责人裴晓晖、总经理助理兼资产管理一部总监王琛、交易及衍生品部总监陈晓明、国际业务部总监白海峰。
1.2.6 上述人员之间均不存在近亲属关系。

2 基金托管人

2.1 基本情况
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
注册资本:人民币贰仟玖百肆拾贰亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整
法定代表人:陈四清
基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字[1998]24号
托管部门信息披露联系人:王庆民
传真:(010)66594942
中国银行客服电话:95566

2.2 基金托管部及主要人员情况
中国银行托管业务部设立于1998年,现有员工110余人,大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验,且具备海外工作经历,60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务,中国银行已在境内、外分行开展托管业务。
作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行,中国银行拥有证券投资基金、基金(一对多、一对一)、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、对冲资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内,中国银行首家开展跨境评估、跨境资产管理等增值服务,为各类客户提供个性化的托管增值服务,是国内领先的大型中资托管银行。
2.3 证券投资基金托管情况
截至2018年9月30日,中国银行已托管679只证券投资基金,其中境内基金642只,QDII基金37只,覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型、FOF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。

3 相关服务机构

3.1 基金份额销售机构
3.1.1 直销机构
招商基金管理有限公司
招商基金客户服务热线:400-887-9555(免长途话费)
招商基金官网交易平台
交易网站:www.cmffund.com
客服电话:400-887-9555(免长途话费)
电话:(0755)83196437
传真:(0755)83199059
联系人:陈梓
招商基金战略客户部
地址:北京市西城区月坛南街1号院2号楼1801
联系人:莫然
地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1088号上海招商银行大厦南楼15楼
电话:(021)38877388
联系人:胡智思
招商基金机构销售组
地址:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦23楼
电话:(0755)83193041
联系人:任虹虹
地址:北京市西城区月坛南街1号院2号楼1801
电话:18600128666
联系人:贾晓航
地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1088号上海招商银行大厦南楼15楼
电话:(021)38877379
联系人:伊泽群
招商基金直销交易员服务联系方式
地址:深圳市福田区深南大道6019号金润大厦11层招商基金客户服务部直销柜台
电话:(0755)83196359 83196358
传真:(0755)83196360
备用传真:(0755)83199266
联系人:冯敏

3.1.2 代销机构

代销机构	代销机构信息
招商银行股份有限公司	注册地址:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦 法定代表人:李建强 电话:(0755)83198888 传真:(0755)83195050 联系人:邓鹏鹏
中国邮储银行股份有限公司	注册地址:北京市西城区金融大街3号 法定代表人:李国华 电话:95580 传真:(0755)810685117 联系人:王硕

注册地址:上海市徐汇区长乐路989号45层
办公地址:上海市徐汇区长乐路989号45层
法定代表人:李梅
电话:(021)33388888
传真:(021)33388224
联系人:曹蔚
客服电话:95532
4008895523
网址:www.whysc.com

注册地址:新疆乌鲁木齐高新区(新市区)深圳南路358号大成国际大厦20楼2005室
办公地址:新疆乌鲁木齐高新区(新市区)深圳南路358号大成国际大厦20楼2005室
法定代表人:许建标
电话:(010)88088588
传真:(010)88088195
联系人:李黎
客服电话:4008-000-562
网址:www.hsyc.com

注册地址:安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号
办公地址:安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号财智中心B1
1.2.3 公司高级管理人员
金旭女士,总经理,简历同上。
钟文岳先生,常务副总经理,厦门大学经济学硕士。1992年7月至1997年4月于中国农村发展信托投资公司任福建(集团)公司国际业务部总经理;1997年4月至2000年1月于银华万国证券投资基金公司任九江营业部总经理;2000年1月至2001年1月任厦门海发投资有限公司副总经理;2001年1月至2004年1月任深圳二十一世纪投资投资公司副总经理;2004年1月至2008年11月任浙江新江南投资有限公司副总经理;2008年11月至2015年6月任招商银行股份有限公司投资管理部总经理,2015年6月加入招商基金管理有限公司,现任公司常务副总经理兼招商财富资产管理有限公司董事。

沙晓先生,副总经理,南京通信工程学院工学硕士。2000年11月加入宝盈基金管理有限公司,历任TMT行业研究员、基金助理助理、交易主管;2008年2月加入国泰基金管理有限公司,历任交易部总监,研究部总监,投资运营部基金经理、量化&保本投资事业部总经理;2015年加入招商基金管理有限公司,现任公司副总经理兼招商资产管理(香港)有限公司董事。

耿志明先生,副总经理,华中科技大学管理学及法学双学士,投资经济学硕士。2002年加入广发证券深圳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相关工作;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、督察长,现任公司副总经理、董事会秘书,兼任招商财富资产管理有限公司董事兼招商资产管理(香港)有限公司董事。

杨渺先生,副总经理,经济学硕士。2002年起先后就职于南方证券股份有限公司、巨田基金管理有限公司,历任金融工程研究员、行业研究员、助理基金经理。2005年加入招商基金管理有限公司,历任高级数量分析师,投资经理,投资管理二部(原专户资产投资部)负责人及总经理助理。现任公司副总经理。
潘西里先生,督察长,法学硕士。1998年加入大鹏证券有限责任公司法律部,负责法律工作;2001年10月加入天同基金管理有限公司督察长,任主任专员;2003年2月加入中国证券监督管理委员会深圳监管局,历任副主任科员、主任科员、副处长及处长;2015年加入招商基金管理有限公司,现任公司督察长。

1.2.4 基金经理
王平先生,管理学硕士,FRM。2006年加入招商基金管理有限公司,曾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,主要负责公司投资风险管理工作,金融工程研究等工作,现任量化投资部总监兼招商量化精选股票型发起式证券投资基金基金经理(管理时间:2016年3月15日至今)、招商稳骏定期开放混合型证券投资基金基金经理(管理时间:2016年10月27日至2017年11月21日至今)、招商沪深300指数增强型证券投资基金基金经理(管理时间:2017年2月10日至今)、招商中证1000指数增强型证券投资基金基金经理(管理时间:2017年3月3日至至今)、招商鑫合灵活配置混合型证券投资基金基金经理(管理时间:2017年4月29日至至今)及招商中证500指数增强型证券投资基金基金经理(管理时间:2017年5月17日至至今)。

1.2.5 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:总经理金旭、副总经理沙晓、副总经理杨渺、总经理助理固定收益权益投资部负责人裴晓晖、总经理助理兼资产管理一部总监王琛、交易及衍生品部总监陈晓明、国际业务部总监白海峰。
1.2.6 上述人员之间均不存在近亲属关系。

2 基金托管人
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
注册资本:人民币贰仟玖百肆拾贰亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整
法定代表人:陈四清
基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字[1998]24号
托管部门信息披露联系人:王庆民
传真:(010)66594942
中国银行客服电话:95566

2.2 基金托管部及主要人员情况
中国银行托管业务部设立于1998年,现有员工110余人,大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验,且具备海外工作经历,60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务,中国银行已在境内、外分行开展托管业务。
作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行,中国银行拥有证券投资基金、基金(一对多、一对一)、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、对冲资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内,中国银行首家开展跨境评估、跨境资产管理等增值服务,为各类客户提供个性化的托管增值服务,是国内领先的大型中资托管银行。
2.3 证券投资基金托管情况
截至2018年9月30日,中国银行已托管679只证券投资基金,其中境内基金642只,QDII基金37只,覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型、FOF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。

3 相关服务机构
3.1 基金份额销售机构
3.1.1 直销机构
招商基金管理有限公司
招商基金客户服务热线:400-887-9555(免长途话费)
招商基金官网交易平台
交易网站:www.cmffund.com
客服电话:400-887-9555(免长途话费)
电话:(0755)83196437
传真:(0755)83199059
联系人:陈梓
招商基金战略客户部
地址:北京市西城区月坛南街1号院2号楼1801
联系人:莫然
地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1088号上海招商银行大厦南楼15楼
电话:(021)38877388
联系人:胡智思
招商基金机构销售组
地址:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦23楼
电话:(0755)83193041
联系人:任虹虹
地址:北京市西城区月坛南街1号院2号楼1801
电话:18600128666
联系人:贾晓航
地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1088号上海招商银行大厦南楼15楼
电话:(021)38877379
联系人:伊泽群
招商基金直销交易员服务联系方式
地址:深圳市福田区深南大道6019号金润大厦11层招商基金客户服务部直销柜台
电话:(0755)83196359 83196358
传真:(0755)83196360
备用传真:(0755)83199266
联系人:冯敏

注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元
法定代表人:邵健
电话:(021)20665952
传真:(021)20666553
联系人:李宇博

注册地址:上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室
法定代表人:杨文元
电话:(021)58870011
传真:(021)68596916
联系人:张茹

注册地址:上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室
法定代表人:杨文元
电话:(021)58870011
传真:(021)68596916
联系人:张茹

注册地址:上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室
法定代表人:杨文元
电话:(021)58870011
传真:(021)68596916
联系人:张茹

注册地址:浙江省杭州市文二西路一元茂大厦903室
法定代表人:朱顺平
电话:(0571)88911818
传真:(0571)88900423
联系人:刘宁

注册地址:浙江省杭州市文二西路一元茂大厦903室
法定代表人:朱顺平
电话:(0571)88911818
传真:(0571)88900423
联系人:刘宁

注册地址:广东省珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491
法定代表人:肖雯
电话:(020)80629066
联系人:刘文文
网址:www.yingmi.cn

注册地址:北京市朝阳区阜通东大街1号院9号楼2单元21层222507
法定代表人:钟奕奕
电话:4000-618-518
联系人:戚晓强
网址:http://www.ncjfm.com/

注册地址:深圳市南山区桃园路福田厦中心广场37楼
法定代表人:顾敏
电话:400-829-8877
联系人:罗敏
网址:http://www.webank.com/

注册地址:中国(上海)自由贸易试验区福山路33号11楼B座
法定代表人:王磊
电话:400-821-0203
联系人:徐亚平
网址:http://www.52indfund.com.cn/

注册地址:上海浦东新区世纪大道100号环球金融中心9楼
法定代表人:郭林
电话:400-820-5999
联系人:徐海飞
网址:www.shzq.com

注册地址:上海市崇明县长兴镇路潘园公路1800号2号楼6153室(上海泰和经济发展区)
法定代表人:王刚
电话:400-820-5369
联系人:李慧
网址:www.jiyufund.com.cn

注册地址:北京市海淀区中关村东路66号1号楼22层2603-06
法定代表人:江卉
电话:(010)89189288
联系人:徐雨平
网址:kenetunji.com/

注册地址:天津自贸区(中心商务区)迎宾大道1988号滨海浙商大厦公寓2-2413室
法定代表人:李修弟
电话:(010)-59013842
联系人:王西茜
网址:http://www.wanjiafund.com

注册地址:深圳市南山区科技中一路腾讯大厦11楼
法定代表人:刘明军
客服电话:95017转1转6
0755-86013388
公司网址:https://www.tianmuamc.com

注册地址:北京市北京经济技术开发区宏达北路10号5层5122室
法定代表人:周斌
联系人:马鹏程
联系电话:(010)57760604
客服电话:400-786-8868
公司网址:htmp://www.chfund.com

注册地址:北京市朝阳区太阳宫中路16号院1号楼冠捷大厦3层307单元
法定代表人:杨健
联系人:李海阔
联系电话:13501184929
客服电话:400-673-7010
公司网址:htp://www.jianfortune.com

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。
3.2 注册登记机构
名称:招商基金管理有限公司
地址:深圳市福田区深南大道7088号
法定代表人:李浩
电话:(0755)83196436
联系人:宋宇彬
3.3 律师事务所和经办律师
名称:上海源泰律师事务所
注册地址:上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦14楼
负责人:廖海
电话:(021)51015098
传真:(021)51015098
经办律师:刘佳、张雯倩
联系人:刘佳

3.4 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(特殊普通合伙)
注册地址:上海市延安路222号中融中心30楼
执行事务合伙人:曾顺福
电话:(021)6141 8888
传真:(021)6335 0177
经办注册会计师:汪芳、吴凌波
联系人:汪芳

5.4 基金名称
5.5 基金类型
股票型证券投资基金

5.6 投资目标
本基金为增强型股票指数基金,通过量化的投资方法与严谨的投资纪律,力争控制本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0.5%,年化跟踪误差不超过7.5%,同时力求实现超越标的指数的业绩表现,谋求基金资产的长期增值。
5.7 投资范围
本基金的投资范围为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(包括主板、中小板、创业板和其他经中国证监会核准上市股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、可转债(含可分离交易可转债)、可交换债、次级债、短期融资券、中期票据等)、债券回购、同业存单、银行存款、货币市场工具、资产支持证券、权证、股指期货、国债期货以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。
本基金可以参与融资和转融通证券出借业务。
如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人将在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。
基金的投资组合比例为:本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的80%,投资于中证500指数成份股及其备选成份股的资产不低于非现金基金资产的80%,每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约缴纳的保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的5%,其中,现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

5.8 投资策略
本基金为增强型指数产品,在标的指数成份股的基础上根据量化模型对行业配置及个股权重等进行主动调整,力争在控制跟踪误差的基础上获取超越标的指数的投资收益。
1. 股票投资策略
(1) 标的指数
如果中证500指数被停止编制及发布,或中证500指数由其他指数替代(单纯更名除外),或由于指数编制方法变更等重大变更导致该指数不宜继续作为标的指数,或证券市场出现其他更合适投资标的作为本基金的标的指数,本基金管理人可以依据审慎性原则,在充分考虑持有人利益及履行适当程序的前提下,更换本基金的标的指数和投资对象;并依据市场代表性、流动性、与原标的指数的相关性等诸多因素选择确定新的指数。基金管理人应在调整前在中国证监会指定媒介上公告,并在更新的招募说明书中列示。
(2) 多因子量化增强模型
1) 因子分析
本基金基于标的指数成份股及其他股票的各项历史数据,对价值、成长、趋势、情绪、分析师预期等方面因子在不同市场环境下的个股表现的影响进行统计分析,找到可能影响超额回报的因子。具体分析的因子包括以下几个类别:
价值指标:P/E、企业价值/EBITDA、P/B、PEG等;
盈利指标:主营业务利润率复合增长率等;
盈利指标:净资产报酬率、总资产报酬率等;
运营指标:存货周转率、总资产周转率等;
一致预期指标:分析师预期数据;
市场行为指标:动量、反转、换手率等。
2) 模型的构建
在按类别归并的基础上,本基金进一步利用统计方法建立单个因子与未来超额回报关系,即因子预测能力,筛选出针对不同市场环境的有效因子,并根据预测能力和因子间相关性来最终构建多因子量化增强模型。

3) 模型的应用与调整
在正常的市场情况下,本基金将主要依据多因子量化增强模型的运行结果来进行组合的构建。同时,基金管理人也会定期对模型的有效性进行检验和更新,以反映市场趋势的变化。在市场出现非正常波动或基金管理人预测市场可能出现重大非正常波动时,基金经理将根据公司研究团队结论及市场情况做出具有一定前瞻性的判断,临时调整各因子类别的具体构成及权重。
(3) 风险监控与组合优化
1) 风险监控模型
本基金为指数增强型基金。在追求超额收益的同时,本基金将建立专门的风险预算控制模型,力争将组合相对于中证500指数的跟踪误差控制在一定范围内。
2) 组合优化模型
在多因子量化增强模型和风险监控模型分析的基础上,基金管理人将根据预期收益、风险预算和交易成本的水平,采用风险优化模型对股票投资组合进行优化。
2. 债券投资策略
本基金根据风险管理的目的在保证基金资产流动性的基础上,使基金资产得到更加合理的利用,从而提高投资组合收益。为此,本基金将基于对市场利率趋势研判为,基于对宏观经济环境的深入研究和基金未来现金流的分析,在保证流动性和风险可控的前提下,灵活运用目标久期策略、收益曲线策略、相对价值策略和利差套利策略等对高流动性、低风险、低风险的债券品种进行主动投资。
3. 股指期货投资策略
本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,有选择地投资于流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金在进行股指期货投资时,首先将基于对证券市场趋势的判断和组合风险收益的分析确定投资时机,并根据风险资产投资(或拟投资)的总体规模和风险系数决定股指期货的投资比例;其次,本基金将在综合考虑证券市场和期货市场运行趋势以及股指期货流动性、收益性、风险特征和估值水平的基础上进行投资组合品种选择,以对冲风险资产组合的系统性风险和流动性风险。
4. 国债期货投资策略
本基金参与国债期货投资是为了有效控制债券市场的系统性风险,本基金将根据风险管理原则,以套期保值为主要目的,适度运用国债期货提高投资组合运作效率。在国债期货投资过程中,基金管理人通过对宏观经济和利率市场走势的分析与判断,并充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险特征,通过资产配置,谨慎进行投资,以调整债券组合的久期,降低投资组合的整体风险。
5. 权证投资策略
本基金管理人将以价值分析为基础,在采用权证定价模型分析其合理性的基础上,充分考量可权证品种的收益率、流动性及风险收益特征,通过资产配置、品种与类属选择,力求规避投资风险,追求风险调整后收益。
6. 资产支持证券投资策略
本基金将综合运用资产配置、久期管理、收益率曲线、信用管理和个券α策略等策略,在严格遵守法律法规和基金合同基础上,进行资产支持证券产品的投资。
7. 融资及转融通证券出借业务投资策略
本基金在参与融资、转融通证券出借业务时将根据风险管理的原则,在法律法规允许的范围内和比例内,风险可控的前提下,本着谨慎原则,参与融资和转融通证券出借业务。参与融资业务时,本基金将力争利用融资的杠杆作用,降低因申购造成基金仓位较低带来的跟踪误差,达到有效跟踪标的指数的目的。参与转融通证券出借业务时,本基金将从具备融券资格的股票中选择流动性好、交易活跃的个股作为转融通出借对象,力争为基金份额持有人增厚投资收益。

5.9 投资决策程序