

# 招商中证大宗商品股票指数证券投资基金（LOF）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

登记机构：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：2017年7月14日

公告时间：2017年7月11日

目录

一、重要声明与提示 2

二、基金概览 2

三、基金的历史、转型、上市交易、日常申赎与转托管 3

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人情况 5

五、基金主要当事人简介 5

六、基金合同摘要 8

七、基金财务状况 9

八、基金投资组合 10

九、重大事件揭示 12

十、基金管理人承诺 12

十一、基金托管人承诺 13

十二、备查文件目录 13

附件：基金合同摘要 15

一、重要声明与提示

招商中证大宗商品股票指数证券投资基金（LOF）（以下简称本基金）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，请投资者详细查阅招商基金管理有限公司网站（[www.cmfchina.com](http://www.cmfchina.com)）上相关公告。

## 二、基金概览

1、基金名称：招商中证大宗商品股票指数证券投资基金（LOF）

基金简称：招商中证商品指数基金（LOF）

场内简称：大宗商品

基金代码：161715

2、基金类型：股票型

3、基金运作方式：上市契约型开放式

4、基金存续期限：不定期

5、基金份额总额：截至 2017 年 7 月 7 日，本基金的基金份额总额为 201,168,029.25 份。

6、基金份额净值：截至 2017 年 7 月 7 日，本基金的基金份额净值为 1.084 元。

7、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所

8、上市交易日期：2017 年 7 月 14 日

9、基金管理人：招商基金管理有限公司

10、基金托管人：中国工商银行股份有限公司

11、本次上市交易的基金份额登记机构：中国证券登记结算有限责任公司

## 三、基金的历史、转型、上市交易、日常申赎与转托管

### （一）本基金的历史

招商中证大宗商品股票指数证券投资基金（LOF）由招商中证大宗商品股票指数分级证券投资基金转型而来。招商中证大宗商品股票指数分级证券投资基金于 2012 年 3 月 5 日获中国证监会证监许可[2012]283 号文核准募集。

招商中证大宗商品股票指数分级证券投资基金的基金管理人为招商基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。基金管理人于 2012 年 6 月 28 日获中国证监会书面确认，《招商中证大宗商品股票指数分级证券投资基金基金合同》生效，基金募集规模 1,063,256,320.96 份（含利息结转的份额）。

### （二）本基金的转型

根据《招商中证大宗商品股票指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定，本

基金基金合同生效满五年后，在满足基金合同约定的存续条件下，本基金无需召开基金份额持有人大会，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）。原招商中证商品 A 份额和招商中证商品 B 份额终止运作，全部转换成招商中证大宗商品股票指数证券投资基金（LOF）的基金份额。

本基金管理人已于 2017 年 5 月 12 日和 2017 年 6 月 20 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及招商基金管理有限公司网站（www.cmfchina.com）发布《招商基金管理有限公司关于招商中证大宗商品股票指数分级证券投资基金分级运作期届满转型与基金份额转换的公告》和《关于招商中证大宗商品股票指数分级证券投资基金分级运作期届满转型后基金名称变更与转换基准日等事项的公告》。

本基金管理人已于 2017 年 6 月 28 日对招商中证大宗商品股票指数分级证券投资基金进行了分级运作期届满的转型与基金份额转换工作。经本基金基金管理人计算并经本基金基金托管人中国工商银行股份有限公司确认，具体转换结果如下表所示：

| 转换前的基金份额    | 转换前份额净值（元） | 转换前份额数量（份）    | 转换比例        | 转换后的基金份额            | 转换后份额净值（元） | 转换后的份额数量（份）   |
|-------------|------------|---------------|-------------|---------------------|------------|---------------|
| 招商中证商品 A 份额 | 1.025      | 83,184,142.00 | 1.004714479 | 招商中证大宗商品指数（LOF）场内份额 | 1.020      | 83,576,311.00 |
| 招商中证商品 B 份额 | 1.015      | 83,184,142.00 | 0.995285520 | 招商中证大宗商品指数（LOF）场内份额 | 1.020      | 82,791,972.00 |
| 招商中证商品场内份额  | 1.020      | 4,055,149.00  | 1.000000000 | 招商中证大宗商品指数（LOF）场内份额 | 1.020      | 4,055,149.00  |
| 招商中证商品场外份额  | 1.020      | 30,744,597.25 | 1.000000000 | 招商中证大宗商品指数（LOF）场外份额 | 1.020      | 30,744,597.25 |

转换后基金份额总额与基金份额持有人持有的基金份额数额发生调整，份额转换对基金份额持有人利益无实质性不利影响。本基金管理人已向中国证券登记结算有限责任公司提交份额变更登记申请并于 2017 年 6 月 30 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及招商基金管理有限公司网站（www.cmfchina.com）发布《关于招商中证大宗商品股票指数分级证券投资基金基金份额转换的结果公告》。

### （三）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【2017】438 号

- 2、上市交易日期：2017年7月14日
- 3、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所
- 4、基金场内简称：大宗商品
- 5、基金交易代码：161715
- 6、本次上市交易的基金份额总额：170,423,432份（截止2017年7月7日）
- 7、未上市交易份额的流通规定：托管在场外的未上市交易的基金份额，基金份额持有人将其转托管至深圳证券交易所场内即可上市流通。
- 8、基金份额净值的披露：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公布本基金基金份额净值和基金份额累计净值。基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定媒体上。

#### （四）本基金日常申购、赎回的主要内容

本基金管理人自2017年7月14日开始办理招商中证大宗商品股票指数证券投资基金（LOF）的日常申购、赎回业务。具体业务办理规则请见相关公告。

#### （五）本基金转托管的主要内容

为保证基金份额持有人的利益，本基金管理人已向中国证券登记结算有限责任公司提出申请，为本基金的基金份额持有人开通转托管业务的办理事宜。基金份额持有人自2017年7月14日起可以通过销售机构办理本基金基金份额的转托管业务，转托管的具体业务参照中国证券登记结算有限责任公司的相关规定办理。

### 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2017年7月7日，招商中证大宗商品股票指数证券投资基金（LOF）基金份额持有人户数为16,019户，其中，场内基金份额持有人户数为2,656户，平均每户持有的基金份额为64,165.45份；场外基金份额持有人户数为13,363户，平均每户持有的基金份额为2,300.73份。

#### （二）基金份额持有人结构

截至2017年7月7日，招商中证大宗商品股票指数证券投资基金（LOF）场内外份额合计201,168,029.25份，其中本次上市交易的场内基金份额总额为170,423,432.00份。机构投资者持有本次上市交易的场内基金份额为133,089,348.00份，占本次上市交易基金份额比例为78.09%；个人投资者持有的本次上市交易的场内基金份额为37,334,084.00份，占本次上市交易基金份额比例为21.91%。

(三) 截至 2017 年 7 月 7 日, 前十名场内基金份额持有人情况:

| 序号 | 持有人名称(全称)                        | 持有基金份额         | 占基金总份额的比例(%) |
|----|----------------------------------|----------------|--------------|
| 1  | 中意人寿保险有限公司                       | 48,145,127.00  | 28.25%       |
| 2  | 上海铂绅投资中心(有限合伙)-铂绅四号证券投资基金(私募)    | 28,664,955.00  | 16.82%       |
| 3  | 中国太平洋人寿保险股份有限公司-传统-普通保险产品        | 10,297,445.00  | 6.04%        |
| 4  | 新华人寿保险股份有限公司-新传统产品               | 8,037,780.00   | 4.72%        |
| 5  | 中国太平洋财产保险-传统-普通保险产品-013C-CT001 深 | 6,504,639.00   | 3.82%        |
| 6  | 上海铂绅投资中心(有限合伙)-铂绅二号证券投资基金(私募)    | 4,834,400.00   | 2.84%        |
| 7  | 上海铂绅投资中心(有限合伙)-铂绅一号证券投资基金(私募)    | 4,609,056.00   | 2.70%        |
| 8  | 上海铂绅投资中心(有限合伙)-铂绅六号证券投资私募基金      | 4,224,987.00   | 2.48%        |
| 9  | 中意人寿保险有限公司-万能-团体万能               | 3,987,487.00   | 2.34%        |
| 10 | 宋伟铭                              | 3,758,873.00   | 2.21%        |
|    | 合计                               | 123,064,749.00 | 72.21%       |

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: 李浩

总经理: 金旭

设立日期: 2002 年 12 月 27 日

注册地址: 深圳市福田区深南大道 7088 号

注册资本: 人民币 2.1 亿元

办公地址: 深圳市福田区深南大道 7088 号

设立批准文号: 中国证监会证监基金字[2002]100 号

营业执照统一社会信用代码: 9144030071093625X4

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）83199596

传真：（0755）83076974

联系人：赖思斯

## 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 55%

招商证券股份有限公司 45%

## 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、投资管理一部、投资管理二部、投资管理三部、投资管理四部、固定收益投资部、投资支持与创新部、全球量化投资部、国际业务部、交易部、研究部、产品研发一部、产品研发二部、渠道管理总部、渠道管理一部、渠道管理二部、战略客户部、机构理财部、市场推广部、互联网金融发展部、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 28 个职能部门，并设有北京分公司等分支机构。

## 4、人员情况

截止 2017 年 3 月 31 日，本公司共有员工 323 人，获得基金从业资格的有 309 人。

## 5、信息披露负责人及咨询电话：

潘西里，0755-83073119。

## 6、基金管理业务情况

截至 2017 年 3 月 31 日，本基金管理公司目前管理 129 只基金。

## 7、本基金基金经理简介

陈剑波，男，学士，2000 年 9 月起先后任职于无锡盛科信息技术有限公司、深圳市赢时胜信息技术有限公司，从事系统开发及产品研发相关工作；2006 年 1 月加入招商基金管理有限公司信息技术部，从事软件开发工作；2008 年 6 月加入广州安正软件科技有限公司，任副总经理；2012 年 9 月加入招商基金管理有限公司全球量化投资部，曾任数据分析师及投资经理，现任招商中证白酒指数分级证券投资基金基金经理（管理时间：2016 年 4 月 19 日至今），招商中证银行指数分级证券投资基金基金经理（管理时间：2016 年 4 月 19 日至今）、招商深证 100 指数证券投资基金基金经理（管理时间：2016 年 4 月 19 日至今）、招商国证生物医药指数分级证券投资基金基金经理（管理时间：2016 年 8 月 12 日至今）、招商中证煤炭等权指数分级证券投资基金基金经理（管理时间：2016 年 8 月 12 日

至今）、招商央视财经 50 指数证券投资基金基金经理（管理时间：2016 年 12 月 3 日至今）及招商中证大宗商品股票指数证券投资基金（LOF）基金经理（管理时间：2017 年 6 月 29 日至今）。

## （二）基金托管人

### 1、基金托管人概况

名称：中国工商银行股份有限公司（简称中国工商银行）

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：易会满

设立日期：1984 年 1 月 1 日

注册资本：人民币 35,640,625.71 万元

批准设立机关和批准设立文号国务院《关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》（国发[1983]146 号）

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字【1998】3 号

电话：010-66105799

联系人：郭明

### 2、主要人员情况

截至 2017 年 3 月末，中国工商银行资产托管部共有员工 205 人，平均年龄 30 岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

### 3、基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自 1998 年在国内首家提供托管服务以来，秉承诚实信用、勤勉尽责的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、基本养老保险、企业年金基金、QFII 资产、QDII 资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII 专户资产、ESCROW 等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至 2017 年 3 月，中国工商银行共托管证券投资基金

709 只。自 2003 年以来，本行连续十四年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的 53 项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，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。

### （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：邹俊

电话：(0755) 25471000

传真：(0755) 82668930

经办注册会计师：林高攀、周捷

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

本基金募集结束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

本基金截至 2017 年 7 月 7 日的资产负债表如下：

资产负债表

会计主体：招商中证大宗商品股票指数证券投资基金（LOF）

报告截止日：2017 年 7 月 7 日单位：人民币元

资产 期末余额 年初余额

资产：

银行存款 7,269,054.33 8,603,970.23

结算备付金 4,093,158.40 4,231,632.72

存出保证金 21,528.11 23,578.86

交易性金融资产 206,856,778.27 213,228,881.39

其中：股票投资 206,856,778.27 213,228,881.39

债券投资 --



|             |                |                |
|-------------|----------------|----------------|
| 资产支持证券投资    | --             |                |
| 贵金属投资       | --             |                |
| 衍生金融资产      | --             |                |
| 买入返售金融资产    | --             |                |
| 应收证券清算款     | 139,602.70     | 1,083,747.76   |
| 应收利息        | 3,900.61       | 5,348.86       |
| 应收股利        | --             |                |
| 应收申购款       | 19,550.92      |                |
| 其他资产        | --             |                |
| 资产合计        | --             |                |
| 负债和所有者权益    | 218,384,022.42 | 227,196,710.74 |
| 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     | --             |                |
| 应付赎回款       | 1,159,730.68   |                |
| 应付管理人报酬     | 30,072.08      | 217,585.76     |
| 应付托管费       | 6,014.41       | 47,868.88      |
| 应付销售服务费     | --             |                |
| 应付交易费用      | 483.19         | 150,677.50     |
| 应付税费        | --             |                |
| 应付利息        | --             |                |
| 应付利润        | --             |                |
| 其他负债        | 236,224.44     | 374,118.50     |
| 负债合计        | 272,794.12     | 1,949,981.32   |
| 所有者权益:      |                |                |
| 实收基金        | 172,782,426.53 | 192,093,227.84 |
| 未分配利润       | 45,328,801.77  | 33,153,501.58  |
| 所有者权益合计     | 218,111,228.30 | 225,246,729.42 |
| 负债与持有人权益总计: | 218,384,022.42 | 227,196,710.74 |

注:截止2017年7月7日,招商中证商品份额净值1.084元,招商中证商品份

额 201,168,029.25 份。

## 八、基金投资组合

截止 2017 年 7 月 7 日，本基金的投资组合如下（本公告书中的财务数据未经审计）：

### （一）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 206,856,778.27 94.7200%

其中：股票 206,856,778.27 94.7200%

2 固定收益投资

其中：债券

资产支持证券

3 贵金属投资

4 金融衍生品投资

5 买入返售金融资产

其中：买断式回购的买入返售金融资产

6 银行存款和结算备付金合计 11,362,212.73 5.20%

7 其他资产 165,031.42 0.08%

8 合计 218,384,022.42 100.00%

### （二）按行业分类的股票投资组合

报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

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 13,285,735.36 6.09

B 采掘业 68,683,804.55 31.49

C 制造业 118,814,077.09 54.47

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 3,967,570.86 1.82

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 --

K 房地产业 --

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 204,751,187.86 93.87

报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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 4,460.00 0.00  
 B 采掘业 1,634,977.50 0.75  
 C 制造业 452,833.03 0.21  
 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 13,319.88 0.01  
 J 金融业 --  
 K 房地产业 --  
 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 2,105,590.41 0.97

（三）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

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  | 600516 | 方大炭素 | 222,231.00 | 3,964,601.04 | 1.82 |
| 2  | 002460 | 赣锋锂业 | 77,155.00  | 3,919,474.00 | 1.80 |
| 3  | 600309 | 万华化学 | 130,483.00 | 3,739,642.78 | 1.71 |
| 4  | 601225 | 陕西煤业 | 409,200.00 | 3,470,016.00 | 1.59 |
| 5  | 002466 | 天齐锂业 | 58,924.00  | 3,461,785.00 | 1.59 |
| 6  | 603993 | 洛阳钼业 | 562,234.00 | 3,356,536.98 | 1.54 |
| 7  | 000488 | 晨鸣纸业 | 210,000.00 | 3,099,600.00 | 1.42 |
| 8  | 000830 | 鲁西化工 | 413,617.00 | 2,973,906.23 | 1.36 |
| 9  | 601088 | 中国神华 | 131,223.00 | 2,924,960.67 | 1.34 |
| 10 | 600426 | 华鲁恒升 | 257,165.00 | 2,890,534.60 | 1.33 |

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五名股票投资明  
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 | 000693 | *ST 华泽 | 128,675.00 | 1,608,437.50 | 0.74 |
| 2 | 300666 | 江丰电子   | 2,276.00   | 69,987.00    | 0.03 |
| 3 | 603799 | 华友钴业   | 1,000.00   | 65,080.00    | 0.03 |
| 4 | 603335 | 迪生力    | 2,230.00   | 40,073.10    | 0.02 |
| 5 | 002879 | 长缆科技   | 1,313.00   | 34,072.35    | 0.02 |

（四）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贵金属投资明  
细

本基金本报告期末未持有贵金属。

（八）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。

（九）本基金投资的国债期货交易情况说明

1、本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

2、报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

3、本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

（十）投资组合报告附注

1、报告期内基金投资的前十名证券除赣锋锂业（股票代码 002460），万华化学（股票代码 600309），洛阳钼业（股票代码 603993），晨鸣纸业（股票代码 000488）外，其他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。

（1）赣锋锂业（股票代码 002460）

赣锋锂业公司于 2017 年 7 月 8 日发布公告称，因公司 2016 年度经审计的净利润与业绩预告中披露的净利润存在较大差异，且未在规定期限内对业绩预告作出修正，同时未按规定在披露 2016 年度报告的同时披露社会责任报告，被深圳证券交易所监管关注。

赣锋锂业公司于 2016 年 9 月 23 日发布公告称，因其全资子公司深圳市美拜电子有限公司老化车间发生意外起火爆炸，被新区安全生产监督管理局处罚。

（2）万华化学（股票代码 600309）

万华化学公司于 2017 年 7 月 6 日发布公告称，因公司烟台工业园在大修停车处理过程中，MDI 装置光化工序一台 12.1 立方米粗 MDI 缓冲罐发生爆炸，造成 4 人死亡、4 人受伤，直接经济损失 573.62 万元，被烟台市安监局处罚。

万华化学公司于 2017 年 4 月 29 日发布公告称，因未及时履行信息披露义务，被上海证券交易所监管关注。

（3）洛阳钼业（股票代码 603993）

洛阳钼业公司于 2017 年 4 月 10 日发布公告称，其时任副总经理王斌因违规减持，被河南证监局诫勉谈话。

洛阳钼业公司于 2017 年 3 月 20 日发布公告称，其时任副总经理王斌因违规减持，被上海证券交易所通报批评。

（4）晨鸣纸业（股票代码 000488）

晨鸣纸业公司于 2017 年 6 月 16 日发布公告称，因禁制令被驳回及逾期未支付相关债务，被香港联交所上市委员会处罚。

对上述证券的投资决策程序的说明：本基金为指数型基金，因复制指数被动持有，上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

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 21,528.11
- 2 应收证券清算款 139,602.70
- 3 应收股利
- 4 应收利息 3,900.61
- 5 应收申购款
- 6 其他应收款
- 7 待摊费用
- 8 其他
- 9 合计 165,031.42

（十一）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债券。

（十二）报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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

序号 股票代码 股票名称 流通受限部分的公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

流通受限情况说明

- 1 601088 中国神华 2,924,960.67 1.34 重大事项

报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号 股票代码 股票名称 流通受限部分的公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

流通受限情况说明

- 1 000693 ST 华泽 1,608,437.50 0.74 重大事项

### 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。

#### 十一、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：

- 1、严格遵守《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，设立专门的基金托管部，配备足够的、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。
- 2、根据《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付等行为进行监督和核查。
- 3、基金托管人发现基金管理人的行为违反《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，督促基金管理人改正。
- 4、基金托管人发现基金管理人重大违规行为，将立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

#### 十二、备查文件目录

投资者如果需了解更详细的信息，可向基金管理人、基金托管人或销售机构申请查阅以下文件：

- 1、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
- 2、《招商中证大宗商品股票指数分级证券投资基金基金合同》
- 3、《招商中证大宗商品股票指数分级证券投资基金托管协议》
- 4、《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》
- 5、《律师事务所法律意见书》
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 8、中国证监会要求的其他文件。

招商基金管理有限公司

2017年7月11日

附件：基金合同摘要

#### 一、基金合同当事人及权利义务

## （一）基金管理人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

- （1）依法募集基金；
- （2）自基金合同生效之日起，根据法律法规和基金合同独立运用并管理基金财产；
- （3）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；
- （4）销售基金份额；
- （5）召集基金份额持有人大会；
- （6）依据基金合同及有关法律规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了基金合同及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- （7）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- （8）选择、委托、更换基金代销机构，对基金代销机构的相关行为进行监督和处理；
- （9）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；
- （10）依据基金合同及有关法律规规定决定基金收益的分配方案；
- （11）在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；
- （12）依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
- （13）在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资；
- （14）以基金管理人的名义，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；
- （15）选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；
- （16）法律法规和基金合同规定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

- （1）依法募集基金，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、申购、赎回和登记事宜；
- （2）办理基金备案手续；



- (3) 自基金合同生效之日起,以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产;
- (4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策,以专业化的经营方式管理和运作基金财产;
- (5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度,保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立,对所管理的不同基金分别管理,分别记账,进行证券投资;
- (6) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外,不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益,不得委托第三人运作基金财产;
- (7) 依法接受基金托管人的监督;
- (8) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定,按有关规定计算并公告基金资产净值,确定基金份额申购、赎回的价格;
- (9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;
- (10) 编制半年度和年度基金报告;
- (11) 严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定,履行信息披露及报告义务;
- (12) 保守基金商业秘密,不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外,在基金信息公开披露前应予保密,不向他人泄露;
- (13) 按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基金收益;
- (14) 按规定受理招商中证商品份额的申购与赎回申请,及时、足额支付赎回款项;
- (15) 依据《基金法》、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、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会;
- (16) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上;
- (17) 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,并且保证投资者能够按照基金合同规定的时间和方式,随时查阅到与基金有关的公开资料,并在支付合理成本的前提下得到有关资料的复印件;
- (18) 组织并参加基金财产清算小组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;

(19) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

(20) 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，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(21) 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，基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

(22) 当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；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，而基金管理人首先承担了责任的情况下，基金管理人有权向第三方追偿；

(23) 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实施其他法律行为；

(24) 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，基金合同不能生效，基金管理人承担全部募集费用，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 30 日内退还基金认购人；

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；

(26) 建立并保存基金份额持有人名册，定期或不定期向基金托管人提供基金份额持有人名册；

(27) 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。

## (二) 基金托管人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：

(1) 自基金合同生效之日起，依法律法规和基金合同的规定安全保管基金财产；

(2) 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；

(3) 监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人违反基金合同及国家法律法规行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

(4) 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公司上海分公司和深圳分公司开设证券账户；

(5) 以基金托管人名义开立证券交易资金账户，用于证券交易资金清算；

(6) 以基金的名义在中央国债登记结算有限公司开设银行间债券托管账户，负

责基金投资债券的后台匹配及资金的清算；

(7) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

(8) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

(9) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

(2) 设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、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；

(3) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，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；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

(4) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；

(5) 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；

(6) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户，按照基金合同的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

(7) 保守基金商业秘密，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；

(8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值，招商中证商品份额的基金份额净值、招商中证商品 A 份额与招商中证商品 B 份额的基金份额参考净值，招商中证商品 A 份额与招商中证商品 B 份额终止运作后的份额转换比例；

(9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

(10) 对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告出具意见，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；如果基金管理人未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

(11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；

(12) 建立并保存基金份额持有人名册；

(13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

(14) 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；

(15) 按照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；

(16) 按照法律法规、基金合同和托管协议的规定监督基金管理人的投资运作；

(17) 参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

(18) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行监管机构，并通知基金管理人；

(19) 因违反基金合同导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(20) 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，基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金利益向基金管理人追偿；

(21) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；

(22) 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。

(三) 基金份额持有人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：

(1) 分享基金财产收益；

(2) 参与分配清算后的剩余基金财产；

(3) 依照法律法规及基金合同的规定，依法转让其持有的招商中证商品 A 份额与招商中证商品 B 份额，依法申请赎回其持有的招商中证商品份额；

(4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会；

(5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；

(6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；

(7) 监督基金管理人的投资运作；

(8) 对基金管理人、基金托管人、基金销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；

(9) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：

(1) 遵守基金合同；

(2) 缴纳基金认购、申购、赎回款项及法律法规和基金合同所规定的费用；

(3) 在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；

- (4) 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；
- (5) 返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人、基金托管人及代销机构处获得的不当得利；
- (6) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；
- (7) 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。

## 二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

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。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、招商中证商品A份额与招商中证商品B份额的基金份额持有人独立进行表决。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。

### (一) 召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

- (1) 终止基金合同；
- (2) 更换基金管理人；
- (3) 更换基金托管人；
- (4) 转换基金运作方式；
- (5) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；
- (6) 变更基金类别（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）；
- (7) 本基金与其他基金的合并；
- (8) 变更基金投资目标、范围或策略（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）；
- (9) 变更基金份额持有人大会程序；
- (10) 对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；
- (11) 法律法规、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。

2、以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

- (1) 调低基金管理费、基金托管费；
- (2) 法律法规要求增加的基金费用的收取；
- (3) 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、调低赎回费率；
- (4) 因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改；

(5) 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；

(6) 经中国证监会允许，基金推出新业务或服务；

(7) 经中国证监会允许，基金管理人、基金注册登记机构、销售机构在法律法规规定的范围内调整有关基金交易、非交易过户、转托管等业务规则；

(8) 本基金基金合同生效满五年后，在满足基金合同约定的存续条件下，本基金无需召开基金份额持有人大会，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）。原招商中证商品 A 份额和招商中证商品 B 份额终止运作，全部转换成招商中证大宗商品股票指数证券投资基金（LOF）的基金份额；

(9) 除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。

## （二）会议召集人及召集方式

1、除法律法规规定或基金合同另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集；

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集；

3、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；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，基金托管人仍认为有必要召开的，应当由基金托管人自行召集。

4、单独或合计代表招商中证商品份额、招商中证商品 A 份额与招商中证商品 B 份额各自基金份额 10%以上（含 10%）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，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，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。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；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，单独或合计代表招商中证商品份额、招商中证商品 A 份额与招商中证商品 B 份额各自基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，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；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开。

5、单独或合计代表招商中证商品份额、招商中证商品 A 份额与招商中证商品

B 份额各自基金份额 10%以上（含 10%）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，而基金管理人、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，单独或合计代表招商中证商品份额、招商中证商品 A 份额与招商中证商品 B 份额各自基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

6、基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

（三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1、召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 40 天，在至少一家指定媒体公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

- （1）会议召开的时间、地点、方式和会议形式；
- （2）会议拟审议的事项、议事程序和表决形式；
- （3）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；
- （4）授权委托书的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；
- （5）会务常设联系人姓名及联系电话；

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定通讯方式和表决方式，并在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、表决意见寄交的截止时间和收取方式。在法律法规和监管机构允许的情况下，也可以采用网络、电话或其他方式进行表决或者授权他人表决。

3、如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。

（四）基金份额持有人出席会议的方式

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。

会议的召开方式由会议召集人确定，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。

1、现场开会。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，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，基金管理人或托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

（1）亲自出席会议者持有基金份额的凭证、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、基金合同和会议通知的规定，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；

（2）经核对，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，有效的招商中证商品份额、招商中证商品 A 份额与招商中证商品 B 份额的基金份额不少于在权益登记日各自基金总份额的 50%（含 50%）。

2、通讯开会。通讯方式开会指基金份额持有人将其对表决事项的表决意见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止日以前送达至召集人指定的地址。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。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

（1）会议召集人按基金合同规定公布会议通知后，在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告；

（2）会议召集人按基金合同规定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）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；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取表决意见的，不影响表决效力；

（3）本人直接出具表决意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的招商中证商品份额、招商中证商品 A 份额与招商中证商品 B 份额不小于在权益登记日各自基金份额的 50%（含 50%）；

（4）上述第（3）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，同时提交的持有基金份额的凭证、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、基金合同和会议通知的规定，并与基金登记注册机构记录相符，并且委托人出具的代理投票授权委托书符合法律法规、基金合同和会议通知的规定；

（5）会议通知公布前报中国证监会备案。

（五）议事内容与程序

1、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，如基金合同的重大修改、决定



终止基金合同、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、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。

基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日招商中证商品份额、招商中证商品 A 份额与招商中证商品 B 份额各自基金份额 10%（含 10%）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；也可以在会议通知发出后向大会召集人提交临时提案，临时提案应当在大会召开日至少 35 天前提交召集人并由召集人公告。

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开日 30 天前公告。

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。

召集人对于基金管理人、基金托管人和基金份额持有人提交的临时提案进行审核，符合条件的应当在大会召开日 30 天前公告。大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

（1）关联性。大会召集人对于提案涉及事项与基金有直接关系，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，应提交大会审议；对于不符合上述要求的，不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决，应当在该次基金份额持有人大会上进行解释和说明。

（2）程序性。大会召集人可以对提案涉及的程序性问题做出决定。如将提案进行分拆或合并表决，需征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，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，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

单独或合并持有权利登记日招商中证商品份额、招商中证商品 A 份额与招商中证商品 B 份额各自基金份额 10%（含 10%）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，或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，未获基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于 6 个月。法律法规另有规定除外。

基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后，如果需要对原有提案进行修改，应当最迟在基金份额持有人大会召开前 30 日公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少与公告日期有 30 日的间隔期。

## 2、议事程序

### （1）现场开会

在现场开会的方式下，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，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；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，则由出席大会的招商中证商品份额、招商中证商品 A 份额与招商中证商品 B 份额各自基金份额持有人和代理人所持表决权合计 50%以上（含 50%）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。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，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

会议召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名（或单位名称）、身份证号码、住所地址、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）等事项。

## （2）通讯开会

在通讯开会的情况下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期后 2 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，在公证机关监督下形成决议。

## （六）表决

招商中证商品份额、招商中证商品 A 份额与招商中证商品 B 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。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1、一般决议，一般决议须经参加大会的招商中证商品份额、招商中证商品 A 份额与招商中证商品 B 份额的各自基金份额持有人或其代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）通过方为有效；除下列第 2 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。

2、特别决议，特别决议应当经参加大会的招商中证商品份额、招商中证商品 A 份额与招商中证商品 B 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（含三分之二）通过方可做出。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止基金合同以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，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，符合会议通知规定的表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，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。

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、逐项表决。

#### （七）计票

##### 1、现场开会

（1）如大会由基金管理人或基金托管人召集，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；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，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，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。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力。

（2）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。

（3）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，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。监票人应当进行重新清点，重新清点以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。

（4）计票过程应由公证机关予以公证，基金管理人或基金托管人拒不出席大会的，不影响计票的效力。

##### 2、通讯开会

在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。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，不影响计票和表决结果。

#### （八）生效与公告

基金份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会核准或者备案。

基金份额持有人大会的决议自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起2个工作日内在至少一家指定媒体上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会

的决议。

生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。

### 三、基金的收益分配

#### （一）基金利润的构成

基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额，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。

#### （二）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（即可供分配利润计算截止日）基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

#### （三）收益分配原则

在基金合同生效后 5 年内，本基金（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）不进行收益分配。

在基金合同生效后 5 年后，如果终止招商中证商品 A 份额与招商中证商品 B 份额的运作，本基金将调整基金的收益分配原则。具体收益分配原则参见基金管理人届时发布的相关公告。

### 四、基金费用与税收

#### （一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金的指数使用费；
- 4、基金上市费用；
- 5、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；
- 6、基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 7、基金份额持有人大会费用；
- 8、基金的证券交易费用；
- 9、基金的银行汇划费用；
- 10、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中扣除。

#### （二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

##### 1、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 1%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E1\% \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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前 2 个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、公休假等，支付日期顺延。

## 2、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 0.22% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E0.22\% \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 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前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

## 3、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，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）。

基金份额转换后，本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.75% 年费率计提，管理费的计算方法不变。

基金份额转换后，本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。托管费的计算方法不变。

## 4、基金的指数使用费

本基金作为指数基金，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。通常情况下，指数使用费按照前一日基金资产净值的 0.02% 的年费率进行计提，且收取下限为每季人民币 5 万元（即不足 5 万元部分按照 5 万元收取）。

计算方法如下：

$$H=E0.02\% \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的标的指数使用费

E 为前一日的基金资产净值

指数使用费每日计算，逐日累计，每季支付一次，由基金管理人向基金托管人发

送指数使用费划付指令，经基金托管人复核后，于每年1月、4月、7月、10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。

上述（一）基金费用的种类中第4—10项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

### （三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、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；
- 2、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；
- 3、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；
- 4、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。

### （四）费用调整

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2日在至少一种指定媒体上公告。

### （五）基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

## 五、基金的投资

### （一）投资目标

本基金进行被动式指数化投资，通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段，实现对标的指数的有效跟踪，获得与标的指数收益相似的回报。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0.35%，年跟踪误差不超过4%。

### （二）投资范围

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括中证大宗商品股指指数的成份股、备选成份股、新股（含首次公开发行和增发）、股指期货、债券、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（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金投资于股票的资产不低于基金资产的90%，

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90%；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5%。

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，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

### （三）禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

- 1、承销证券；
- 2、向他人贷款或提供担保；
- 3、从事承担无限责任的投资；
- 4、买卖其他基金份额，但法律法规和中国证监会另有规定的除外；
- 5、向基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或债券；
- 6、买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、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；
- 7、从事内幕交易、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动；
- 8、当时有效的法律法规、中国证监会及基金合同规定禁止从事的其他行为。

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

### （四）投资组合限制

本基金的投资组合将遵循以下限制：

- 1、本基金参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，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；
- 2、本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的10%；本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的100%；其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；本基金在任何交易日日终，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20%；本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）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20%；本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）不低于基金资产净值的90%，且不得超过基金资产净值的95%；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，应当保持不低于基金资产净值5%的现金

或到期日在一年以内的政府债券；

3、本基金投资权证，在任何交易日买入的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，本基金管理人管理的基金托管人托管的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证 10%。

投资于其他权证的投资比例，遵从法律法规或监管部门的相关规定；

4、本基金持有一家公司发行的流通受限证券，其市值不得超过基金资产净值的 2%；本基金持有的所有流通受限证券，其市值不得超过该基金资产净值的 10%；经基金管理人和托管人协商，可对以上比例进行调整；

5、本基金不得违反基金合同关于投资范围和投资比例的约定；

6、法律法规、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、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、交易目的及对应的证券资产情况等；

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

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资比例的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例不在限制之内，但基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，以达到标准。法律法规另有规定的从其规定。

## 六、基金的财产

### （一）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、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。

其构成主要有：

- 1、银行存款及其应计利息；
- 2、结算备付金及其应计利息；
- 3、根据有关规定缴纳的保证金及其应收利息；
- 4、应收证券交易清算款；
- 5、应收申购款；
- 6、股票投资及其估值调整；
- 7、债券投资及其估值调整和应计利息；
- 8、权证投资及其估值调整；



9、其他投资及其估值调整；

10、其他资产等。

#### （二）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。

#### （三）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，并以基金托管人和本基金联名的方式开立基金证券账户、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。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、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。

#### （四）基金财产的保管和处分

本基金财产独立于基金管理人、基金托管人和基金代销机构的财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人不得将基金财产归入其固有财产；基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或其他情形而取得的财产和收益，归入基金财产。基金管理人、基金托管人、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，其债权人不得对本基金财产行使请求冻结、扣押或其他权利。除法律法规和基金合同的规定处分外，基金财产不得被处分。基金管理人管理运作基金财产所产生的债权，不得与其固有资产产生的债务相互抵消；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。

### 七、基金合同的变更和终止

#### （一）基金合同的变更

1、以下变更基金合同的事项应经基金份额持有人大会决议通过：

- （1）更换基金管理人；
- （2）更换基金托管人；
- （3）转换基金运作方式；
- （4）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；
- （5）变更基金类别（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）

；

（6）变更基金投资目标、范围或策略（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）；

- （7）本基金与其他基金的合并；
- （8）变更基金份额持有人大会召开程序；

(9) 终止基金合同；

(10) 其他可能对基金当事人权利和义务产生重大影响的事项。

但出现下列情况时，可不经基金份额持有人大会决议，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案：

(1) 调低基金管理费、基金托管费；

(2) 法律法规要求增加的基金费用的收取；

(3) 在法律法规和基金合同规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率；

(4) 因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改；

(5) 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；

(6) 除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。

2、关于基金合同变更的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准生效后方可执行，自基金合同生效之日起在至少一家指定媒体公告。

## (二) 基金合同的终止

有下列情形之一的，基金合同应当终止：

1、基金份额持有人大会决定终止的；

2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；

3、基金合同约定的其他情形；

4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

## 八、争议的处理和适用的法律

各方当事人同意，因基金合同而产生的或与基金合同有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，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，仲裁地点为北京，仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，仲裁费由败诉方承担。

基金合同受中国法律管辖。

## 九、基金合同的存放和获得方式

基金合同可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、代销机构的办公场所和营业场所查阅；投资者也可按工本费购买基金合同复制件或复印件，但内容应以基金合同正本为准。

