

招商标普金砖四国指数证券投资基金（LOF）更新的招募说明书摘要

重要提示

招商标普金砖四国指数证券投资基金（LOF）（以下简称本基金）经中国证券监督管理委员会 2010 年 9 月 9 日《关于核准招商标普金砖四国指数证券投资基金（LOF）募集的批复》（证监许可字

〔2010〕1244 号文）核准公开募集。本基金的基金合同于 2011 年 2 月 11 日正式生效。本基金为契约型开放式。

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核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

本基金投资于在全球四个发达证券市场股票交易所上市的金砖四国上市公司股票，基金净值会因为所投资证券市场波动、金砖四国经济波动等因素产生波动。投资者投资本基金可能面临的风险包括：一是全球投资风险，包括海外市场风险、新兴市场投资风险、政府管制风险、汇率风险、政治和法律风险、会计核算风险、税务风险等；二是本基金投资风险，包括投资标的风险、利率风险、衍生品风险、信用风险、流动性风险、交易结算风险、金融模型风险等；三是管理风险、操作和技术风险以及不可抗力风险。本基金属于具有较高风险和较高收益预期的证券投资基金品种，投资者在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出投资决策。

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。

投资有风险，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招募说明书。

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。

本更新招募说明书所载内容截止日为 2017 年 8 月 11 日，有关财务和业绩表现数据截止日为 2017 年 6 月 30 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

注册地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

成立日期：2002 年 12 月 27 日

注册资本：人民币 2.1 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）83076974

联系人：赖思斯

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。公司由招商证券股份有限公司、INGAssetManagementB.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。经公司股东会通过并经中国证监会批准，公司的注册资本金已经由人民币一亿元（RMB100,000,000 元）增加为人民币二亿一千万（RMB210,000,000 元）。

2007 年 5 月，经公司股东会通过并经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10%、10%、10%及3.4%的股权；公司外资股东INGAssetManagementB.V.（荷兰投资）受让招商证券股份有限公司持有的公司3.3%的股权。上述股权转让完成后，招商基金管理有限公司的股东及股权结构为：招商银行股份有限公司持有公司全部股权的33.4%，招商证券股份有限公司持有公司全部股权的33.3%，INGAssetManagementB.V.（荷兰投资）持有公司全部股权的33.3%。

2013年8月，经公司股东会审议通过，并经中国证监会证监许可[2013]1074号文批复同意，荷兰投资公司（INGAssetManagementB.V.）将其持有的招商基金管理有限公司21.6%股权转让给招商银行股份有限公司、11.7%股权转让给招商证券股份有限公司。上述股权转让完成后，招商基金管理有限公司的股东及股权结构为：招商银行股份有限公司持有全部股权的55%，招商证券股份有限公司持有全部股权的45%。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，总行设在深圳，业务以中国市场为主。招商银行于2002年4月9日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（股份代号：3968）。

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。2009年11月，招商证券在上海证券交易所上市（代码600999）。

公司将秉承诚信、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。

（二）主要人员情况

1、基金管理人董事、监事及高级管理人员介绍：

李浩，男，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。美国南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月起兼任深圳市招银前海金融资产交易中心有限公司副董事长。现任公司董事长。

邓晓力，女，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1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）风险管理部高级分析师。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、结算及培训工作；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，北京大学硕士研究生。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1月在宝盈基金管理有限公司任总经理。2006年1月至2007年5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2014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，现任公司总经理、董事兼招商资产管理（香港）有限公司董事长。

吴冠雄，男，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ColinNgPartners任中国法律顾问。1999年2月至今在北京市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月至今兼任北京市华远集团有限公司外部董事，2016年4月至今兼任北京墨迹风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。

王莉，女，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；国务院科技干部局二处干部；中信公司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；联办控股有限公司董事总经理等。现任公司独立董事。

何玉慧，女，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NationalTrustCompany和ErnstYoung，1995年4月加入香港毕马威会计师事务所，2015年9月退休前系香港毕马威会计师事务所金融业内部审计、风险管理和合规服务主管合伙人。2016年8月至今任泰康保险集团股份有限公司独立董事，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委员。现任公司独立董事。

孙谦，男，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、WilliamPatersonCollege和ArizonaStateUniversity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、厦门大学任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访问金融专家。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博士后工作站导师，科技部复旦科技园中小型科技企业创新型融资平台项目负责人。现任公司独立董事。

丁安华，男，毕业于华南理工大学工商管理学院，获硕士学位。1984年8月至1986年8月任人民交通出版社编辑；1989年10月至1992年10月任华南理工大学工商管理学院讲师；1992年10月至1994年12月任招商局集团研究部主任研究员；1995年1月至1998年8月，任美资企业高级管理人员；1998年8月至2001年2月，任职于加拿大皇家银行；2001年3月至2009年4月，历任招商局集团业务开发部总经理助理、副总经理、企业规划部副总经理、战略研究部总经理，2004年12月至2010年4月兼任招商轮船董事，2007年6月至2010年6月兼任招商银行董事，2007年8月至2011年4月兼任招商证券董事；2009年5月任招商证券首席经济学家，2011年10月任招商证券副总裁兼首席经济学家；2017年6月起任招商银行首席经济学家兼招银国际首席经济学家至今。现任公司监事会主席。

周松，男，武汉大学世界经济专业硕士研究生。1997年2月加入招商银行，1997年2月至2006年6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，2006年6月至2007年7月任招商银行总行计划财务部副总经理，2007年7月至2008年7月任招商银行武汉分行副行长。2008年7月至2010年6月任招商银行总行计划财务部副总经理（主持工作）。2010年6月至2012年9月任招商银行总行计划财务部总经理。2012年9月至2014年6月任招商银行总行业务总监兼总行计划财务部总经理。2014年6月至2014年12月任招商银行总行业务总监兼总行资产负债管理部总经理。2014年12月起任招商银行总行同业金融总部总裁兼总行资产管理部总经理。2016年1月起任招商银行总行投行与金融市场总部总裁兼总行资产管理部总经理。现任公司监事。

罗琳，女，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年起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推广部总监、公司监事。

鲁丹，女，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OracleERP系统实施顾问；2005年5月至2006年12月于韬睿惠悦咨询有限公司任咨询顾问；2006年12月至2011年2月于怡安翰威特咨询有限公司任咨询总监；2011年2月至2014年3月任倍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人力资源部总监、公司监事，兼任招商财富资产管理有限公司董事。

李扬，男，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，现任产品研发一部总监、公司监事。

钟文岳，男，厦门大学货币银行学硕士。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）公司国际业务部经理；1997年4月至2000年1月于申银万国证券股份有限公司任九江营业部总经理；2000年1月至2001年1月任厦门海发投资股份有限公司总经理；2001年1月至2004年1月任深圳二十一世纪风险投资公司副总经理；2004年1月至2008年11月任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，现任常务副总经理兼招商财富资产管理有限公司董事。

沙骏，男，中国国籍，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、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，投资总监兼基金经理，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。

欧志明，男，华中科技大学经济学及法学双学士、投资经济硕士；2002 年加入广发证券深圳业务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，男，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，男，硕士，1998 年加入大鹏证券有限责任公司法律部，负责法务工作；2001 年 10 月加入天同基金管理有限公司监察稽核部，任职主管；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，现任督察长。

2、本基金基金经理介绍：

白海峰，男，硕士。曾任职于新东方教育科技集团；2010 年 6 月加入国泰基金管理有限公司，历任管理培训生、宏观经济研究高级经理、首席经济学家助理、国际业务部负责人；2015 年加入招商基金管理有限公司，现任国际业务部总监兼招商资产管理（香港）有限公司执行董事兼总经理、招商标普金砖四国指数证券投资基金（LOF）基金经理（管理时间：2016 年 11 月 8 日至今）、招商中国信用债定期开放债券型证券投资基金（QDII）基金经理（管理时间：2016 年 11 月 8 日至今）、招商全球资源股票型证券投资基金（QDII）基金经理（管理时间：2016 年 11 月 8 日至今）及招商沪港深科技创新主题精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理（管理时间：2017 年 5 月 13 日至今）。

本基金历任基金经理包括：刘冬先生，管理时间为 2011 年 2 月 11 日至 2012 年 8 月 2 日；牛若磊先生，管理时间为 2011 年 12 月 24 日至 2015 年 7 月 3 日；邓栋先生，管理时间为 2015 年 7 月 3 日至 2016 年 11 月 8 日。

3、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、副总经理沙骏、副总经理杨渺、总经理助理兼量化投资部负责人吴武泽、总经理助理兼固定收益投资部负责人裴晓辉、交易部总监路明、国际业务部总监白海峰。

4、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（一）基金托管人的基本情况

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：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

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

托管部门信息披露联系人：王永民

传真：（010）66594942

中国银行客服电话：95566

（二）基金托管部门及主要人员情况

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，且具有海外工作、学习或培训经历，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、券商资产管理计划、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，中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务，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。

（三）证券投资基金托管情况

截至 2017 年 06 月 30 日，中国银行已托管 611 只证券投资基金，其中境内基金 574 只，QDII 基金 37 只，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。

（四）托管业务的内部控制制度

中国银行托管业务部风险管理与控制工作是中国银行全面风险控制工作的组成部分，秉承中国银行风险控制理念，坚持规范运作、稳健经营的原则。中国银行托管业务部风险控制工作贯穿业务各环节，通过风险识别与评估、风险控制措施设定及制度建设、内外部检查及审计等措施强化托管业务全员、全面、全程的风险管控。

2007 年起，中国银行连续聘请外部会计师事务所开展托管业务内部控制审阅工作。先后获得基于 SAS70、AAF01/06、ISAE3402 和 SSAE16 等国际主流内控审阅准则的无保留意见的审阅报告。2017 年，中国银行继续获得了基于 ISAE3402 和 SSAE16 双准则的内部控制审计报告。中国银行托管业务内控制度完善，内控措施严密，能够有效保证托管资产的安全。

（五）托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当拒绝执行，及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。

三、境外托管人

（一）中银香港概况

名称：[中国银行(香港)有限公司]

住所：[香港中环花园道 1 号中银大厦]

办公地址：[香港中环花园道 1 号中银大厦]

法定代表人：[岳毅总裁]

成立时间：[1964 年 10 月 16 日]

组织形式：[股份有限公司]

存续期间：[持续经营]

联系人：[黄晚仪副总经理托管业务主管]

联系电话：[852-3982-6753]

中国银行(香港)有限公司（中银香港）早于 1964 年成立，并在 2001 年 10 月 1 日正式重组为中国银行(香港)有限公司，是一家在香港注册的持牌银行。其控股公司-中银香港(控股)有限公司（中银香港(控股)）-则于 2001 年 2 日在香港注册成立，并于 2002 年 7 月 25 日开始在香港联合交易所主板上市，2002 年 12 月 2 日被纳入为恒生指数成分股。中银香港目前主要受香港金管局、证监会以及联交所等机构的监管。

截至 2016 年 12 月月底，中银香港(控股)有限公司的总资产超过 23,277 亿港元，资本总额超过 2,168 亿港元，总资本比率为 22.35%。中银香港的财务实力及双 A 级信用评级，可以媲美不少大型全球托管银行。中银香港(控股)最新信评如下(截至 2016 年 12 月 31 日):

穆迪投资服务 标准普尔 惠誉国际评级

评级展望 稳定 稳定 稳定

长期 Aa3 A+ A

短期 P-1 A-1 F1

展望 稳定 稳定 稳定

中银香港作为香港第二大银行集团，亦为三家本地发钞银行之一，拥有最庞大分行网络与广阔的客户基础。

托管服务是中银香港企业银行业务的核心产品之一，目前为超过六十万企业及工商客户提供一站式的证券托管服务。对于服务国内企业及机构性客户(包括各类 QDII 及其各类产品等)，亦素有经验，于行业处于领先地位，包括于 2006 年被委任为国内首只银行类 QDII 产品之境外托管行，于 2007 年被委任为国内首只券商类 QDII 集成计划之境外托管行，另于 2010 年服务市场首宗的跨境 QDII-ETF 等;至于服务境外机构客户方面亦成就显著:

在人民币合格境外机构投资者(RQFII)的领域=成为此类人民币产品的最大服务商

在离岸人民币 CNH 公募基金的领域=成为市场上首家服务商(2010 年 8 月)

=目前亦为最大的服务商

在港上市的交易所买卖基金(ETF)=中资发行商的最大服务商之一

在离岸私募基金的领域=新募长仓基金的最大服务商之一

在非上市的股权/债权投资领域=香港少有的服务商之一

其业务专长及全方位的配备，令中银香港成为目前本地唯一的中资全面性专业全球托管银行,亦是唯一获颁行业奖项的中资托管行:

专业杂志 所获托管奖项

亚洲投资人杂志(AsianInvestors)服务提供者奖项

-最佳跨境托管亚洲银行 (2012)

财资杂志(TheAsset)TripleA 托管专家系列奖项:

-最佳 QFII 托管行(2013)

-最佳中国区托管专家(2016)

财资杂志(TheAsset)TripleA 个人领袖奖项:

FannyWong-香港区年度托管银行家(2014)

截至 2016 年 12 月末，中银香港(控股)的托管资产规模达 8,560 亿港元。

(二) 托管部门人员配备、安全保管资产条件的说明

1、主要人员情况

托管业务是中银香港的核心产品之一，由管理委员会成员兼副总裁袁树先生直接领导。针对国内机构客户而设的专职托管业务团队现时有二十名骨干成员，职级均为经理或以上，分别主理结算、公司行动、账务(Billing)、对账(Reconciliation)、客户服务、产品开发、营销及网管理等方面。骨干人员均来自各大跨国银行，平均具备 15 年以上的专业托管工作经验(包括本地托管及全球托管)，并操流利普通话，可说是香港最资深的托管团队。

除配备专职的客户关系经理，中银香港更特设为内地及本地客户服务的专业托管业务团队，以提供同时区、同语言的高素质服务。

除上述托管服务外，若客户需要估值、会计、投资监督等增值性服务，则由中银香港的附属公司中银国际英国保诚信托有限公司(中银保诚)提供。作为「强制性公积金计划管理局」认可的信托公司，中银保诚多年来均提供国际水平的估值、会计、投资监督等服务，其专职基金会计与投资监督人员达 50 多名，人员平均具备 10 年以上相关经验。

中银香港的管理层对上述服务极为重视，有关方面的人员配置及系统提升正不断加强。另外，其它中/后

台部门亦全力配合及支持托管服务的提供，力求以最高水平服务各机构性客户。

关键人员简历

黄晚仪女士

托管业务主管

黄女士于香港大学毕业，并取得英国 Heriot-Watt University 的工商管理硕士及英国特许银行公会之会士资格。黄女士从事银行业务超过二十年，大部分时间专职于托管业务，服务企业及机构性客户。效力的机构包括曾为全球最大之金融集团-花旗集团-及本地两大发钞银行-渣打及中银香港。参加中银香港前，黄女士为花旗集团之董事及香港区环球托管业务总监。目前黄女士专职于领导中银香港的全球托管及基金服务发展，并全力配合中国合格境内机构投资者之境外投资及理财业务之所需，且担任中银香港集团属下多家代理人公司及信托公司的企业董事。黄女士亦热心推动行业发展，包括代表中银香港继续担任「香港信托人公会」行政委员会之董事一职；自 09 年 9 月至 2015 年 6 月期间，获「香港交易所」委任作为其结算咨询小组成员；另外，黄女士目前亦是香港证监会产品咨询委员会的委员之一。

郑丽华女士

托管运作主管

郑女士乃英国特许公认会计师公会之资深会员及香港会计师公会之会员。郑女士从事金融与银行业务超过二十年，其中十多年专职于托管业务，服务企业及机构性客户。曾经工作的机构包括全球最大之金融集团美国摩根大通银行与汇丰银行及本地银行-恒生银行，对托管业务操作、系统流程及有关之风险管理尤为熟悉。

阮美莲女士

财务主管

阮女士拥有超过二十年退休金及信托基金管理经验，管理工作包括投资估值、基金核算、投资合规监控及信托运作等。加入中银国际集团前，阮女士曾于百慕达银行任职退休金部门经理一职，以及于汇丰人寿任职会计经理，负责退休金基金会会计工作。阮女士是香港会计师公会及英国特许公认会计师公会资深会员，并持有英国列斯特大学硕士学位。

2、安全保管资产条件

在安全保管资产方面，为了清楚区分托管客户与银行拥有的资产，中银香港目前已以托管人身份在本港及海外存管或结算机构开设了独立的账户以持有及处理客户的股票、债券等资产交收。

除获得客户特别指令或法例要求外，所有实物证券均透过当地市场之次托管人以该次托管人或当地存管机构之名义登记过户，并存放于次托管人或存管机构内，以确保客户权益。

至于在异地市场进行证券交割所需之跨国汇款，除非市场/存托机构/次托管行等另有要求，否则中银香港会尽可能在交收日汇入所需款项，以减少现金停留于相关异地市场的风险。

先进的系统是安全保管资产的重要条件。

中银香港所采用的托管系统名为 CustodySecuritiesSystem 或简称 CSS，是中银香港聘用一支科技专家、并结合银行内部的专才，针对机构性客户的托管需求在原有的零售托管系统上重新组建而成的。CSS 整个系统构建在开放平台上，以 IBMP5 系列 AIX 运行。系统需使用两台服务器，主要用作数据存取及支持应用系统软件，另各自附有备用服务器配合。此外，一台窗口服务器已安装 NFS(NetworkFileSystem,forUnix)模块，负责与 AIX 服务器沟通。

新系统除了采用尖端科技开发，并融合机构性客户的需求与及零售层面的系统优势，不单符合 SWIFT-15022 之要求，兼容 filetransfer 等不同的数据传输，亦拥有庞大的容量(原有的零售托管系统就曾多次证实其在市场买卖高峰期均运作如常，反观部分主要银行的系统则瘫痪超过 1.5 小时)。

至于基金估值、会计核算以及投资监督服务，则采用自行研发的 FAMEX 系统进行处理，系统可相容多种货币、多种成本定价法及多种会计核算法，以满足不同机构客户及各类基金的需要。系统优势包括:多种货币；多种分类；实时更新；支持庞大数据量；简易操作,方便用户。系统所支持的核算方法包括:权重平均(WeightedAverage)；后入先出(LIFO)；先入先出(FIFO)；其它方法可与客户商讨后实施。系统所支持的

估值方法有:以市场价格标明(MarkintoMarket); 成本法; 成本或市场价的较低者; 入价与出价(Bidandoffer); 分期偿还(Amortization); 含息或除息(Clean/dirty); 及其它根据证券类别的例外估值等。

四、相关服务机构

(一) 基金份额销售机构

1. 场外销售机构

(1) 直销机构: 招商基金管理有限公司

招商基金客户服务中心电话: 400-887-9555 (免长途话费)

招商基金官网交易平台

交易网站: www.cmfchina.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 3 号楼 1801

电话: 13718159609

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塔 15 楼

电话: (021) 38577388

联系人: 胡祖望

招商基金机构理财部

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) 83190452

联系人: 刘刚

地址: 北京市西城区月坛南街 1 号院 3 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塔 15 楼

电话: (021) 38577379

联系人: 伊泽源

招商基金直销交易服务联系方式

地址: 深圳市南山区科苑路科兴科学园 A3 单元 3 楼招商基金客服中心直销柜台

电话: (0755) 8319635983196358

传真: (0755) 83196360

备用传真: (0755) 83199266

联系人: 冯敏

(2) 代销机构: 中国银行股份有限公司

注册地址: 北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人: 田国立

电话: 95566

传真: (010) 66594853

联系人: 张建伟

(3) 代销机构: 招商银行股份有限公司

注册地址: 深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：李建红

电话：（0755）83198888

传真：（0755）83195050

联系人：邓炯鹏

(4)代销机构：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：易会满

电话：95588

传真：010-66107914

联系人：杨菲

(5)代销机构：中国农业银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：周慕冰

电话：95599

传真：（010）85109219

联系人：张伟

(6)代销机构：交通银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：牛锡明

电话：（021）58781234

传真：（021）58408483

联系人：张宏革

(7)代销机构：中国光大银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心

法定代表人：唐双宁

电话：95595

传真：（010）63636248

联系人：朱红

(8)代销机构：上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区浦东南路 500 号

法定代表人：高国富

电话：（021）61618888

传真：（021）63604199

联系人：高天

(9)代销机构：中国民生银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：洪崎

电话：（010）57092619

传真：（010）58092611

联系人：穆婷

(10)代销机构：华夏银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

法定代表人：吴建

电话：（010）85238667

传真：（010）85238680

联系人：郑鹏

(11)代销机构：中国邮政储蓄银行股份有限公司

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：（010）68858117

联系人：王硕

(12)代销机构：江苏江南农村商业银行股份有限公司

注册地址：常州市天宁区延宁中路668号

法定代表人：陆向阳

电话：0519-80585939

传真：0519-89995066

联系人：包静

(13)代销机构：宁波银行股份有限公司

注册地址：宁波市鄞州区宁南南路700号

法定代表人：陆华裕

电话：0574-87050038

传真：0574-87050024

联系人：任巧超

(14)代销机构：东莞农村商业银行股份有限公司

注册地址：东莞市东城区鸿福东路2号

法定代表人：何沛良

电话：0769-961122

联系人：林培珊

(15)代销机构：招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38—45层

法定代表人：宫少林

电话：（0755）82960223

传真：（0755）82960141

联系人：林生迎

(16)代销机构：中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼

法定代表人：王常青

电话：4008888108

传真：（010）65182261

联系人：权唐

(17)代销机构：中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

法定代表人：陈有安

电话：010-83574507

传真：010-66568990

联系人：辛国政

(18)代销机构：安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

法定代表人：牛冠兴

电话：0755-82825551

传真：0755-82558355

联系人：余江

(19)代销机构：平安证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

法定代表人：谢永林

电话：（0755）22621866

传真：（0755）82400862

联系人：吴琼

(20)代销机构：国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人：何如

电话：0755-82130833

传真：0755-82133952

联系人：齐晓燕

(21)代销机构：申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人：李梅

电话：021-33389888

传真：021-33388224

联系人：曹晔

(22)代销机构：广发证券股份有限公司

注册地址：广州天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼（4301-4316 房）

法定代表人：孙树明

电话：（020）87555888

传真：（020）87555417

联系人：黄岚

(23)代销机构：申万宏源西部证券有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室

法定代表人：许建平

电话：（010）88085858

传真：（010）88085195

联系人：李巍

(24)代销机构：信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人：张志刚

电话：（010）63081000

传真：（010）63080978

联系人：唐静

(25)代销机构：华融证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 8 号

法定代表人：祝献忠

电话：010-85556048

传真：010-85556088

联系人：孙燕波

(26)代销机构：天相投资顾问有限公司

注册地址：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701

法定代表人：林义相

电话：010-66045608

传真：010-66045527

联系人：林爽

(27)代销机构：国泰君安证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路618号

法定代表人：杨德红

电话：021-38676666

传真：021-38670666

联系人：芮敏祺

(28)代销机构：华泰证券股份有限公司

注册地址：南京市江东中路228号

法定代表人：周易

电话：0755-82492193

传真：0755-82492962

联系人：庞晓芸

(29)代销机构：光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闻路1508号

法定代表人：薛峰

电话：（021）22169999

传真：（021）22169134

联系人：刘晨

(30)代销机构：长江证券股份有限公司

注册地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦

法定代表人：胡运钊

电话：（027）65799999

传真：（027）85481900

联系人：李良

(31)代销机构：国海证券股份有限公司

注册地址：广西桂林市辅星路13号

法定代表人：何春梅

电话：（0755）83709350

传真：（0755）83704850

联系人：牛孟宇

(32)代销机构：东方证券股份有限公司

注册地址：上海市中山南路318号2号楼22层-29层

法定代表人：潘鑫军

电话：（021）63325888

传真：（021）63326173

联系人：胡月茹

(33)代销机构：中航证券有限公司

注册地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼

法定代表人：王宜四

电话：010-64818301

传真：010-64818443

联系人：史江蕊

(34)代销机构：方正证券股份有限公司

注册地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦 22—24 层

法定代表人：雷杰

联系人：徐锦福

电话：010-57398062

传真：010-57308058

(35)代销机构：华宝证券有限责任公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号 57 层

法定代表人：陈林

电话：021-68777222

传真：021-20515593

联系人：刘闻川

(36)代销机构：中泰证券股份有限公司（原齐鲁证券）

注册地址：山东省济南市经七路

法定代表人：李玮

电话：0531-68889155

传真：0531-68889752

联系人：吴阳

(37)代销机构：中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座

法定代表人：王东明

电话：010-60838696

传真：010-60833739

联系人：顾凌

(38)代销机构：海通证券股份有限公司

注册地址：上海市淮海中路 98 号

法定代表人：王开国

电话：021-23219000

传真：021-23219100

联系人：金芸、李笑鸣

(39)代销机构：华福证券有限责任公司

注册地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层

法定代表人：黄金琳

电话：021-20655183、13764105212

传真：021-20655196

联系人：王虹、高文静

(40)代销机构：中信证券（山东）有限责任公司（原中信万通证券）

注册地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼 20 层

法定代表人：杨宝林

电话：（0532）85022326

传真：（0532）85022605

联系人：吴忠超

(41)代销机构：广州证券股份有限公司

注册地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层

法定代表人：邱三发

电话：020-88836999

传真：020-88836654

联系人：林洁茹

(42)代销机构：中山证券有限责任公司

注册地址：深圳市南山区科技中一路西华强高新大厦 7 层、8 层

法定代表人：黄扬录

电话：0755-82570586

传真：0755-82940511

联系人：罗艺琳

(43)代销机构：东海证券股份有限公司

注册地址：江苏省常州延陵西路 23 号投资广场 18 层楼

法定代表人：赵俊

电话：021-20333333

传真：021-50498825

联系人：王一彦

(44)代销机构：华龙证券股份有限公司

注册地址：兰州市城关区东岗西路 638 号财富大厦

法定代表人：李晓安

电话：0931-4890208、0931-8784656

传真：0931-4890628

联系人：范坤、杨力

(45)代销机构：恒泰证券股份有限公司

注册地址：内蒙古呼和浩特市新城区新华东街 111 号

法定代表人：庞介民

联系人：魏巍

电话：0471-4974437

传真：0471-4961259

(46)代销机构：大通证券股份有限公司

注册地址：辽宁省大连市沙河口区会展路 129 号大连国际金融中心 A 座-大连期货大厦 38、39 层

法定代表人：李红光

电话：0411-39991807

传真：0411-39673214

联系人：谢立军

(47)代销机构：民生证券有限责任公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16-18 层

法定代表人：岳献春

电话：010-85127622

传真：010-85127917

联系人：赵明

(48)代销机构：渤海证券股份有限公司

注册地址：天津市经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

法定代表人：王春峰

电话：022-28451861

传真：022-28451892

联系人：王兆权

(49)代销机构：万和证券有限责任公司

注册地址：海口市南沙路 49 号通信广场二楼

法定代表人：朱治理

电话：0755-82830333

传真：0755-25161630

联系人：黎元春

(50)代销机构：东吴证券股份有限公司

注册地址：苏州工业园区星阳街 5 号

法定代表人：吴永敏

电话：0512-65581136

传真：0512-65588021

联系人：方晓丹

(51)代销机构：五矿证券有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4028 号经贸中心 48 楼

法定代表人：赵立功

电话：0755-83219194

传真：0755-82545500

联系人：王鹏宇

(52)代销机构：中国中投证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18 层-21 层及第 04 层
01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23 单元

法定代表人：龙增来

电话：0755-82023442

传真：0755-82026539

联系人：刘毅

(53)代销机构：国金证券股份有限公司

注册地址：成都市青羊区东城根上街 95 号

法定代表人：冉云

电话：028-86690057、028-86690058

传真：028-86690126

联系人：刘婧漪、贾鹏

(54)代销机构：国都证券股份有限公司

注册地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

法定代表人：常喆

电话：010-84183333

传真：010-84183311

联系人：黄静

(55)代销机构：西南证券股份有限公司

注册地址：重庆市江北区桥北苑 8 号

法定代表人：余维佳

电话：023-63786141

传真：023-63786212

联系人：张煜

(56)代销机构：浙商证券股份有限公司

注册地址：浙江省杭州市杭大路 1 号

法定代表人：吴承根

电话：021-64718888

传真：021-64713795

联系人：李凌芳

(57)代销机构：英大证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层

法定代表人：吴骏

电话：0755-83007159

传真：0755-83007034

联系人：吴尔晖

(58)代销机构：东北证券股份有限公司

注册地址：长春市自由大路 1138 号

法定代表人：杨树财

联系电话：0431-85096517

传真：0431-85096795

联系人：安岩岩

(59)代销机构：华鑫证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01（b）单元

法定代表人：俞洋

联系人：陈敏

电话：021-54967552

传真：021-64333051

(60)代销机构：新时代证券股份有限公司

注册地址：北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501

法定代表人：刘汝军

联系人：田芳芳

电话：010-83561146

传真：010-83561094

(61)代销机构：中国民族证券有限责任公司

注册地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼

法定代表人：赵大建

电话：59355941

传真：56437030

联系人：李微

(62)代销机构：第一创业证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼

法定代表人：刘学民

联系人：李晓伟

电话：0755-23838076

传真：0755-25838701

(63)代销机构：九州证券股份有限公司（原天源证券）

注册地址：青海省西宁市长江路 53 号汇通大厦六楼

法定代表人：林小明

电话：010-57672224,17888805198

传真：0755-33329815

联系人：郭小璇

(64)代销机构：万联证券有限责任公司

注册地址：广东省广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 F 座 18、19 层

法定代表人：张建军

电话：020-38286588

传真：020-38286588

联系人：王鑫

(65)代销机构：大同证券有限责任公司

注册地址：大同市城区迎宾街 15 号桐城中央 21 层

法定代表人：董祥

联系电话：0351-4130322

传真：0351-4130322

联系人：薛津

(66)代销机构：太平洋证券股份有限公司

注册地址：云南省昆明市青年路 389 号志远大厦 18 层

法定代表人：李长伟

电话：010-88321613

传真：010-88321763

联系人：谢兰

(67)代销机构：联讯证券股份有限公司

注册地址：广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼

法定代表人：徐刚

电话：0752-2119700

联系人：彭莲

(68)代销机构：中国国际金融有限公司

注册地址：北京市建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

法定代表人：金立群

联系人：蔡宇洲

电话：010-65051166

传真：010-65051166

(69)代销机构：中信期货有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、14 层

法定代表人：张皓

联系人：韩钰

电话：010-60833754

传真：010-57762999

(70)代销机构：东海期货有限责任公司

注册地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦 8 楼

法定代表人：陈太康

联系人：李天雨

电话：021-68757102/13681957646

(71)代销机构：上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

法定代表人：张跃伟

电话：（021）58788678-8816

传真：（021）58787698

联系人：敖玲

(72)代销机构：深圳众禄基金销售有限公司

注册地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

法定代表人：薛峰

电话：（0755）33227950

传真：（0755）82080798

联系人：童彩平

(73)代销机构：蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

注册地址：杭州市余杭区仓前街道海曙路东 2 号

法定代表人：陈柏青

电话：（0571）28829790

传真：（0571）26698533

联系人：韩松志

(74)代销机构：北京展恒基金销售有限公司

注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号

法定代表人：闫振杰

电话：（010）62020088

传真：（010）62020088-8802

联系人：周文婕

(75)代销机构：诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市金山区廊下镇漕廊公路 7650 号 205 室

法定代表人：汪静波

电话：400-821-5399

传真：（021）38509777

联系人：李娟

(76)代销机构：上海好买基金销售有限公司

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：杨文斌

电话：（021）58870011

传真：（021）68596916

联系人：张茹

(77)代销机构：上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

法定代表人：其实

电话：400-1818-188

传真：021-64385308

联系人：潘世友

(78)代销机构：和讯信息科技有限公司

注册地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

法定代表人：王莉

电话：400-9200-022

传真：0755-82029055

联系人：吴阿婷

(79)代销机构：浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903 室

法定代表人：凌顺平

电话：0571-88911818

传真：0571-86800423

联系人：杨翼

(80)代销机构：上海联泰资产管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易区富特北路 277 号 3 层 310 室

法定代表人：燕斌

电话：400-046-6788

传真：021-52975270

联系人：凌秋艳

(81)代销机构：北京乐融多源投资咨询有限公司

注册地址：北京市朝阳区西大望路 1 号 1 号楼 1603

法定代表人：董浩

电话：400-068-1176

传真：010-56580660

联系人：于婷婷

(82)代销机构：上海陆金所资产管理有限公司

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：郭坚

电话：021-20665952

传真：021-22066653

联系人：宁博宇

(83)代销机构：深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006#

法定代表人：杨懿

电话：400-166-1188

传真：010-83363072

联系人：文雯

(84)代销机构：珠海盈米财富管理有限公司

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：刘文红

网址：www.yingmi.cn

(85)代销机构：北京蛋卷基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507

法定代表人：钟斐斐

电话：4000-618-518

联系人：戚晓强

网址：<http://www.ncfjj.com/>

(86)代销机构：南京苏宁基金销售有限公司

注册地址：南京市玄武区苏宁大道1-5号

法定代表人：钱燕飞

电话：025-66996699-887226

联系人：王锋

网址：<http://fund.suning.com>

(87)代销机构：中民财富管理（上海）有限公司

注册地址：上海市黄浦区中山南路100号7层05单元

法定代表人：弭洪军

电话：400-876-5716

联系人：茅旦青

网址：www.cmiwm.com

29 双方协议 5-JR-009-DBHi) 外 ang 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。

2.场内销售机构

本基金的场内认购通过深圳证券交易所内具有基金代销业务资格的会员单位（具体名单详见基金份额发售公告或相关业务公告）进行。本基金募集期结束前获得基金代销资格的证券公司也可代理场内基金份额的发售。尚未取得相应业务资格，但属于深圳证券交易所会员的其他机构，可在本基金上市后，代理投资者通过深圳证券交易所交易系统参与本基金的上市交易。

（二）注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街17号

办公地址：北京市西城区太平桥大街17号

法定代表人：周明

电话：（010）59378888

传真：（010）59378907

联系人：朱立元

（三）律师事务所和经办律师

名称：北京市高朋律师事务所

注册地址：北京市朝阳区东三环北路2号南银大厦28层

法定代表人：王磊

电话：（010）59241188

传真：（010）59241199

经办律师：王明涛、李勃

联系人：王明涛

（四）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：上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼

法定代表人：曾顺福

电话：（021）61418888

传真：（021）63350177

经办注册会计师：陶坚、吴凌志

联系人：陶坚

五、基金名称

招商标普金砖四国指数证券投资基金（LOF）

六、基金类型

股票型证券投资基金

七、投资目标

本基金采用指数化投资方式，通过投资纪律约束和量化风险管理，力求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。本基金控制目标为基金净值收益率与标的指数收益率之间的年跟踪误差不超过 6%。

八、投资范围及投资方向

本基金主要投资于全球证券市场中具有良好流动性的金融工具，包括普通股、优先股、存托凭证等权益类证券；银行存款、可转让存单、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；政府债券、公司债券、可转换债券等固定收益类证券；以及基金、ETFs、金融衍生品和中国证监会许可的其他金融工具。

本基金为股票型指数基金，股票等权益类资产的投资比例不低于基金资产的 90%，其中投资于标的指数成份股、备选成份股的资产占基金资产的比例不低于 80%。现金及到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。

如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种，基金管理人在控制跟踪误差的前提下，在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

在保证流动性的前提下，本基金现金头寸可存放于境内，满足基金赎回、支付管理费、托管费、手续费等需要，并可以投资货币市场工具。

九、投资策略

本基金至少 80% 以上的资产采用完全复制法进行指数化投资，即按照标准普尔金砖四国 40 指数成份股及其权重构建指数投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。在因特殊情况导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将采用优化方法构建最优投资组合的个股权重比例，以求尽可能贴近目标指数的表现。

1、股票投资策略

本基金尽可能追求基金资产在股票市场上的充分投资。本基金投资于股票等权益类资产的比例不低于基金资产的 90%，其中投资于标的指数成份股、备选成份股的资产占基金资产的比例不低于 80%。

（1）股票组合构建原则

本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产占基金资产的比例不低于 80%，该部分资产本基金将采取完全复制法复制指数进行投资，即按照标准普尔金砖四国 40 指数成份股及其权重构建指数投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。

（2）股票组合的构建和调整

本基金在建仓期内，按照标准普尔金砖四国 40 指数各成份股的基准权重对其逐步买入，在力求跟踪误差最小化的前提下，本基金可采取适当的方法降低买入成本。当遇到以下情况时，本基金管理人可以根据市场的具体情况，对指数投资部分进行适当调整，以便实现对跟踪误差的有效控制：

- a) 预期标的指数成份股将调整时；
- b) 标的指数成份股发生分拆、拆股、增发、分红、并购等公司行为时；
- c) 指数成份股出现流动性问题或者可能发生停牌、退市等情况时；
- d) 其他影响指数复制的因素。

本基金指数组合的调整按照定期调整和不定期调整的方式进行。

1) 定期调整

本基金所构建的指数化投资组合将定期根据所跟踪的标普金砖四国 40 指数对其成份股的调整而进行相应的跟踪调整。本基金在目标指数成份股定期调整信息公布前一个月内，根据对调整方案的预测以及成份股调整对股价影响的分析，在保持较小跟踪误差的前提下，决定采取提前调整还是事后调整的策略，增持可能进入目标指数的股票，剔除可能被调整出目标指数的股票。并在目标指数成份股定期调整信息公布后一个月内按照调整后的指数成份股及权重构建投资组合。

2) 不定期调整

在以下情况出现时，本基金将对指数投资组合进行调整：

- a) 当成份股发生分拆上市、拆股、增发、分红、并购等情况而影响成份股在指数中权重的行为时，本基金将根据指数公司的指数调整公告及时对指数投资组合进行相应调整；
- b) 根据本基金的申购和赎回情况，对股票投资组合进行相应调整，从而有效跟踪标的指数；
- c) 若个别成份股因停牌、流动性不足或受到法规限制等其他因素，使得基金管理人无法按照其所占标的指数的权重进行购买时，基金管理人将综合考虑跟踪误差最小化和投资者利益，决定部分持有现金或买入相关的替代性组合；
- d) 当成份股退市的，相应成份股从指数计算中剔除，本基金将做相应调整；
- e) 其他需要调整的事项。

3) 跟踪误差的监控与管理

本基金将采取事前预测和事后跟踪分析的方法来控制基金对于基准指数的跟踪效果，主要使用业界通用的指数基金业绩评价标准，即基金日跟踪偏离度和年化跟踪误差，以衡量基金日收益率相对基准指数日收益率的差值以及该差值在一段时间的波动性，控制的目标为追求上述两个评价指标的最小化。

事前预测：

每日，基金经理通过公司使用的投资风险模型软件对基金的风险因子和基金的跟踪误差进行估算：

其中， σ 是基金的预计跟踪误差， W_p 是基金组合中个股与比较基准的权重差异， F_s 和 $F_{x,F}$ 是风险模型软件测算的个股对风险因子的敞口和风险因子的协方差矩阵。基金经理和风险控制部门对基金的跟踪误差进行事前的估算，以确保基金不会在高于基金风险目标的操作运行，并监测主要的风险来源。

事后跟踪分析：

- (1) 每日，基金经理分析基金的跟踪偏离度。

其中， d_i 是每日跟踪偏离度， p_i 是基金每日价格收益， b_i 是指数每日价格收益。

- (2) 每月末，基金绩效与风险评估小组对本基金的运行情况进行量化评估。

其中， i 是基金最近一年的日跟踪误差， d_i 是每日跟踪偏离度， N 是最近一年交易天数。基金的年化跟踪误差将根据实际交易的天数进行计算。

基金经理将根据基金业绩和风险评估报告分析当月的投资操作、组合状况和跟踪误差等情况，重点分析基金的偏离度和跟踪误差产生原因、现金控制情况、标的指数成份股调整前后的操作、以及成份股未来可能发生的变化等。

在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 6.0%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

2、债券投资策略

作为股票型指数基金，本基金的债券投资仅为辅助性投资手段。本基金的债券投资以降低基金的跟踪误差、

管理基金的流动性为目的，同时考虑金融衍生品保证金管理的需要，通过采用主动投资策略构建海外债券投资组合，并且个券的选择不限于金砖四国市场。

3、金融衍生品投资策略

本基金使用金融衍生工具的目的是尽量实现在中国交易日的连续交易，减少指数的跟踪误差，在流动性较差时减少集中交易带来的冲击成本，而不是通过金融衍生工具来投机获利。可以不使用金融衍生工具时，尽量减少衍生工具的使用。任何金融衍生工具的使用将严格遵守指数跟踪的目标。金融工具的初始保证金不超过基金资产的 3%，基金运行不使用杠杆操作，即投资组合的杠杆比例最高不超过基金资产的 100%。本基金至少 80%以上的资产采用完全复制法来追踪标的指数。然而，考虑到实际投资操作的各种情况，我们将适当参与金融衍生产品的投资，金融衍生品的投资策略主要包括：

- (1) 利用金融衍生产品的跨市场交易的特点，减少因为限制投资、交易假期和时差对跟踪指数的拖累。
- (2) 利用金融衍生产品的杠杆作用，减少现金头寸或者某些成份股的交易流动性可能带来的跟踪误差；
- (3) 利用金融衍生产品来对冲一些外汇市场汇率的波动造成的跟踪误差；
- (4) 适当利用金融衍生产品组合的持有收益覆盖一定的基金固定费用。

本基金对金融衍生产品的投资将严格遵守法律法规及监管机构的相关规定。

十、投资决策

1、投资决策依据

- (1) 须符合国家有关法律法规，严格遵守基金合同及公司章程；
- (2) 维护基金份额持有人利益作为基金投资的最高准则。

2、投资决策程序

- (1) 投资决策委员会定期召开会议，提出资产配置比例的指导意见；
- (2) 基金经理根据投资决策委员会的指导意见确定具体的资产配置方案；
- (3) 基金经理依据指数编制单位公布的指数成份股名单及权重，进行投资组合构建；
- (4) 基金经理及风险管理部对投资组合的偏离度和跟踪误差进行持续跟踪和评估，风险管理部对风险隐患提出预警，基金经理采取措施控制投资组合的偏离度和跟踪误差；
- (5) 基金经理根据指数成份股或权重变化情况、基金申购赎回情况、指数成份股派息情况等，适时进行投资组合调整；
- (6) 在投资决策过程中，风险管理部负责对各决策环节的事前及事后风险、操作风险等投资风险进行监控，并在整个投资流程完成后，对投资风险及绩效做出评估，提供给投资决策委员会、投资总监、基金经理等相关人员，以供决策参考。

十一、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：

标准普尔金砖四国 40 总收益指数（SBRIC40Index（NetTR））收益率

十二、风险收益特征

本基金是被动管理的指数型基金，主要投资方向为标普金砖四国 40 指数的成份股及备选成份股，属于具有较高风险和收益预期的证券投资基金品种，其预期风险与收益水平高于债券型基金和混合型基金。并且，本基金主要投资于以金砖四国为代表的新兴市场，其风险收益水平高于投资于海外成熟市场的基金。

十三、投资组合报告

招商标普金砖四国指数证券投资基金（LOF）管理人—招商基金管理有限公司的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，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。

本投资组合报告所载数据截至 2017 年 6 月 30 日，来源于《招商标普金砖四国指数证券投资基金（LOF）2017 年第 2 季度报告》。

1.报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（人民币元）	占基金总资产的比例（%）
----	----	----------	--------------

1 权益投资 28,552,150.70 93.58
 其中：普通股 13,716,133.33 44.96
 优先股 --
 存托凭证 14,836,017.37 48.63
 房地产信托凭证 --
 2 基金投资 --
 3 固定收益投资 --
 其中：债券 --
 资产支持证券 --
 4 金融衍生品投资 --
 其中：远期 --
 期货 --
 期权 --
 权证 --
 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 货币市场工具 --
 7 银行存款和结算备付金合计 620,788.42 2.03
 8 其他资产 1,336,855.74 4.38
 9 合计 30,509,794.86 100.00

注：由于四舍五入的原因公允价值占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

2.报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家（地区） 公允价值（人民币元） 占基金资产净值比例（%）

香港 13,716,133.33 45.71
 美国 11,874,825.77 39.57
 英国 2,961,191.60 9.87
 合计 28,552,150.70 95.14

3.报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

1
 1.1
 2.1
 1
 2
 1.1
 1
 2
 3

3.1 报告期末指数投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别 公允价值（人民币元） 占基金资产净值比例（%）

必需消费品 998,244.42 3.33
 电信服务 1,449,432.87 4.83
 房地产 295,774.03 0.99
 非必需消费品 1,408,045.08 4.69
 工业 242,802.76 0.81

金融 10,265,780.59 34.21

能源 3,594,674.42 11.98

信息技术 9,796,001.51 32.64

原材料 501,395.02 1.67

合计 28,552,150.70 95.14

注：本基金对以上行业分类采用全球行业分类标准（GICS）。

3.2 报告期末积极投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的权益投资。

4. 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及存托凭证投资明细

4

4.1 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及存托凭证投资明细

序号 公司名称(英文) 公司名称(中文) 证券代码 所在证券市场 所属国家(地区) 数量(股) 公允价值(人民币元) 占基金资产净值比例(%)

1 ALIBABAGROUPHOLDING-SPADR - BABAUS 美国纽约证券交易所 美国 3,919 3,740,736.29 12.46

2 TENCENTHOLDINGSLTD 腾讯控股有限公司 700HK 香港联合交易所 香港 14,943 3,621,036.53 12.07

3 CHINA CONSTRUCTION BANK-H 中国建设银行股份有限公司 939HK 香港联合交易所 香港 471,125 2,473,837.80 8.24

4 INDCOMMBKOFCHINA-H 中国工商银行股份有限公司 1398HK 香港联合交易所 香港 402,073 1,839,057.13 6.13

5 CHINA MOBILE LTD 中国移动有限公司 941HK 香港联合交易所 香港 20,157 1,449,432.87 4.83

6 BAIDU INC-SPONADR - BIDUUS 纳斯达克证券交易所 美国 966 1,170,472.43 3.90

7 JD.COM INC-ADR - JDUS 纳斯达克证券交易所 美国 3,436 912,917.60 3.04

8 HDFC BANK LTD-ADR - HDBUS 美国纽约证券交易所 美国 1,486 875,505.98 2.92

9 ITAU UNIBANCO HLDNG-PREFADR - ITUBUS 美国纽约证券交易所 美国 11,577 866,620.88 2.89

10 PING AN INSURANCE GROUP CO-H - 2318HK 香港联合交易所 香港 18,648 832,716.82 2.77

注：以上证券代码采用当地市场代码。

4.2 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及存托凭证投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资的权益投资。

5. 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

6. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7. 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。

8. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

9. 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基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

10. 投资组合报告附注

5

6

7

8

9

10.1 本基金本期投资的前十名证券中发行主体未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，处罚的证券。

10.2 本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库的股票。

10.3 其他资产构成

序号 名称 金额（人民币元）

- 1 存出保证金 -
- 2 应收证券清算款 885,038.83
- 3 应收股利 248,389.43
- 4 应收利息 195.48
- 5 应收申购款 -
- 6 其他应收款 203,232.00
- 7 待摊费用 -
- 8 其他 -
- 9 合计 1,336,855.74

10.4 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转股期的可转换债券。

10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

10.5.1 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情况。

10.5.2 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

本基金本报告期末未持有积极投资的权益投资。

十四、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，但投资者购买本基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构，本基金管理人也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	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	—	—
2011.02.11-2011.12.31	-26.10%	1.39%	-19.01%	1.61%	-7.09%	-0.22%
2012.01.01-2012.12.31	9.34%	1.13%	13.13%	1.18%	-3.79%	-0.05%
2013.01.01-2013.12.31	-3.71%	1.01%	-1.60%	1.06%	-2.11%	-0.05%
2014.01.01-2014.12.31	-5.53%	1.04%	-3.14%	1.07%	-2.39%	-0.03%
2015.01.01-2015.12.31	-6.67%	1.32%	-6.47%	1.38%	-0.20%	-0.06%
2016.01.01-2016.12.31	15.89%	1.14%	18.79%	1.19%	-2.90%	-0.05%
2017.01.01-2017.06.30	11.45%	0.79%	14.37%	0.82%	-2.92%	-0.03%
基金成立起至 2017.06.30	-11.40%	1.15%	10.97%	1.23%	-22.37%	-0.08%

注：本基金合同生效日为 2011 年 2 月 11 日。

十五、基金的费用概览

（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（含境外资产托管人收取的费用）；
- 3、标的指数使用费；
- 4、因基金的证券交易或结算而产生的费用（包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、

证券经纪商佣金、权证交易的结算费及其他类似性质的费用等)；

5、基金合同生效以后的信息披露费用；

6、基金合同生效以后的会计师费和律师费；

7、基金份额持有人大会费用；

8、基金的资金汇划费用；

9、基金进行外汇兑换交易的相关费用；

10、与基金缴纳税收有关的手续费、汇款费等；

11、基金上市初费和上市年费；

12、按照国家有关规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。

(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

基金管理人的基金管理费（如基金管理人委托投资顾问，包括投资顾问费）按基金资产净值的 0.8% 年费率计提。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 0.8% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.8\% \times \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

2、基金托管人的托管费

基金托管人的基金托管费（如基金托管人委托境外资产托管人，包括向其支付的相应服务费）按基金资产净值的 0.25% 年费率计提。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \times \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

3. 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标准普尔指数公司签署的指数使用许可协议的约定向标准普尔指数公司支付指数使用费。指数使用费自基金合同生效之日起开始计提，按前一日基金资产净值的 0.06% 年费率计提，且指数使用费收取下限为每年 3 万美元，即若不足 3 万美元则按照 3 万美元收取。

$$H = E \times 0.06\% \times \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的指数使用费

E 为前一日的基金资产净值

标的指数使用费每日计提，逐日累计。基金合同生效日起及其后的 12 个月为第一个指数使用费的支付周期，依此类推。基金管理人将于基金合同生效后的 45 天内支付首个支付周期的指数使用费下限（3 万美元），在首个支付周期到期后，若根据上述公式计提的指数使用费大于 3 万美元，基金管理人在 45 天内向基金托管人发送指数使用费划款指令，将超出部分的指数使用费支付给指数所有人。以后各个支付周期的指数使用费支付方法依此类推。

如果指数使用费的计算方法和费率等发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算指数使用费。基金管理人应及时按照《信息披露管理办法》的规定在指定媒体进行公告。此项调整无需召开基金份额持有人大会。

4、本条第（一）款第 4 至第 12 项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入当期基金费用。

（三）不列入基金费用的项目

本条第（一）款约定以外的其他费用，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，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。

（四）基金费用调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费、基金托管费，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 3 个工作日予以披露。

（五）税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，依照国家法律法规和境外市场的规定履行纳税义务。

（六）与基金销售有关的费用

1、申购费用

本基金的申购费率按照申购金额逐级递减，投资人在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。费率如下：

申购金额（M） 申购费率

M < 100 万 1.6%

100 万 ≤ M < 300 万 1.0%

300 万 ≤ M < 500 万 0.8%

M ≥ 500 万 按笔收取，1000 元/笔

始份额部门申购费用由申购人承担，在投资者申购本基金份额时从申购金额中扣除，由基金管理人及代销机构收取，用于本基金的市场推广、销售、注册登记等发生的各项费用。

2、赎回费用

本基金的场外赎回费率按照基金份额持有时间逐级递减，费率如下：

连续持有时间（N） 赎回费率

N < 1 年 * 0.5%

1 年 ≤ N < 2 年 * 0.3%

N ≥ 2 年 * 0

注：1 年指 365 天，2 年为 730 天，依此类推。

本基金的场内赎回费率不区分基金份额的持有时间，而是为固定赎回费率 0.5%。

赎回费用由赎回人承担，在投资者赎回基金份额时收取，赎回费用的 75% 作为注册登记费及其他相关手续费，剩余 25% 归基金财产所有。

3、基金管理人官网交易平台交易

www.cmfchina.com 网上交易，详细费率标准或费率标准的调整请查阅官网交易平台及基金管理人公告。

4、基金管理人可以调整申购、赎回费率或收费方式，并最迟将于新的费率或收费方式开始实施前 3 日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

5、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情况下根据市场情况制定基金促销计划，经代销机构同意后，针对投资者定期和不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，基金管理人可以按中国证监会要求履行必要手续后，对投资者适当调整基金申购费率和赎回费率，并在不迟于促销活动开始日前公告。

基金管理人可以针对特定投资人（如养老金客户等）开展费率优惠活动，届时将提前公告。

十六、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》、《公开募集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 2017 年 3 月 25 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：

- 1、在四、基金的投资部分，更新了（十四）基金投资组合报告。
- 2、在五、基金管理人部分，更新了（二）主要人员情况。
- 3、在八、基金份额的申购与赎回部分，更新了（六）申购与赎回的费用。
- 4、更新了十、基金的业绩。
- 5、在十七、基金的托管人部分，更新了（三）证券投资基金托管情况、（四）托管业务的内部控制制度、（五）托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序。
- 6、更新了十八、境外托管人。
- 7、在十九、相关服务机构部分，更新了（一）基金份额销售机构。
- 8、在二十二、对基金份额持有人的服务部分，更新了（一）网上开户与交易服务。
- 9、更新了二十三、其他应披露事项。

招商基金管理有限公司

2017年9月23日