

**招商沪深 300 高贝塔指数分级证券投资基金招募说明书（更新）摘要**  
(2020 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：2020 年 02 月 28 日

## 重要提示

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”）经中国证券监督管理委员会 2013 年 6 月 6 日《关于核准招商沪深 300 高贝塔指数分级证券投资基金募集的批复》（证监许可〔2013〕764 号文）核准公开募集。本基金的基金合同于 2013 年 8 月 1 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。

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。

本基金为股票型指数基金，具有较高风险、较高预期收益的特征。本基金基金合同生效后，本基金分离为预期收益与风险不同的两种份额类别，招商 300 高贝塔 A 份额具有低风险、收益相对稳定的特征；招商 300 高贝塔 B 份额具有高风险、高预期收益的特征。

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。

《基金合同》生效后，基金招募说明书信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书，并登载在指定网站上。基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金合同终止的，基金管理人可以不再更新基金招募说明书。关于基金产品资料概要编制、披露与更新要求，自《信息披露办法》实施之日起一年后开始执行。

本更新招募说明书所载内容截止日为 2020 年 2 月 28 日，有关财务和业绩表现数据截止日为 2019 年 12 月 31 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 2020 年 3 月 13 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

成立日期：2002 年 12 月 27 日

注册资本：人民币 13.1 亿元

法定代表人：刘辉

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。目前公司注册资本为人民币十三亿一千万元（RMB1,310,000,000 元），股东及股权结构为：招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）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、中远财务有限责任公司各持有公司全部股权的 10%。

2005 年 4 月，经公司股东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元，股东及股权结构不变。

2007 年 5 月，经公司股东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元增加至人民币二亿一千万元。

2013 年 8 月，经公司股东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，经公司股东会审议通过并经报备中国证监会，公司股东招商银行和招商证券按原有股权比例向公司同比例增资人民币十一亿元。增资完成后，公司注册资本金由人民币二亿一千万元增加至人民币十三亿一千万元，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。招商银行始终坚持“因您而变”的经营服务理念，已成长为中国境内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（股份代号：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，已成为拥有证券市场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（股份代号：6099）。

公司以“为投资者创造更多价值”为使命，秉承诚信、理性、专业、协作、成长的核心价值观，努力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 主要人员情况

### 1.2.1 董事会成员

刘辉女士，经济学硕士，招商银行股份有限公司行长助理。1995 年 4 月加入招商银行，2010 年至 2013 年担任总行计划财务部副总经理，2013 年至 2015 年担任总行市场风险管理部总经理，2015 年至 2017 年担任总行资产负债管理部总经理兼总行投资管理部总经理，2017 年 12 月起担任总行投行与金融市场总部总裁兼总行资产管理部总经理。2019 年 4 月起担任招商银行行长助理兼招商银行资产管理部总经理，同时兼任招银理财有限责任公司董事长、招银金融租赁有限公司董事、招银国际金融有限公司董事。现任公司董事长。

邓晓力女士，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 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）信用风险高级分析师。现任招商证券股份有限公司副总裁，兼任招商资产管理有限公司董事长、招商致远资本投资有限公司董事长。现任公司副董事长。

金旭女士，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。

何玉慧女士，加拿大皇后大学荣誉商学士，30 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。目前兼任泰康保险集团股份有限公司、汇丰前海证券有限公司、建信金融科技有限公司、南顺（香港）集团的独立董事，同时兼任多个香港政府机构辖下委员会及审裁处的成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。

## 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1996年4月历任招商银行证券部员工、福田营业部交易室主任；1996年4月至2006年1月历任招商证券股份有限公司海口营业部、深圳龙岗证券营业部、深圳南山南油大道证券营业部负责人；2006年1月至2016年1月历任招商证券私人客户部总经理、零售经纪总部总经理。赵斌先生于2007年7月至2011年5月担任招商证券职工代表监事，2008年7月起担任招商期货有限公司董事，2015年7月起担任招商证券资产管理有限公司董事。2016年1月至2018年11月，担任招商证券合规总监、纪委书记，2018年11月起担任招商证券副总裁。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月起任零售金融总部副总经理、副总裁。2016年2月起任零售金融总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。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、市场推广部总监，现任首席市场官兼银行渠道业务总部总监、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；现任公司战略与人力资源总监兼人力资源部总监、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管理部负责人、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经理

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，现任公司常务副总经理兼招商财富资产管理有限公司董事。

沙骏先生，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、基金经理助理、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。

欧志明先生，副总经理，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，现任公司督察长。

#### 1.2.4 基金经理

苏燕青女士，硕士。2012 年 1 月加入招商基金管理有限公司量化投资部，曾任 ETF 专员，协助指数类基金产品的投资管理工作，现任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基金经理（管理时间：2017 年 1 月 13 日至今）、上证消费 80 交易型开放式指数证券投资基金基金经理（管理时间：2017 年 1 月 13 日至今）、招商上证消费 80 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（管理时间：2017 年 1 月 13 日至今）、招商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联接基金基金经理（管理时间：2017 年 1 月 13 日至今）、招商中证全指证券公司指数分级证券投资基金基金经理（管理时间：2017 年 7 月 1 日至今）、招商沪深 300 地产等权重指数分级证券投资基金基金经理（管理时间：2017 年 7 月 1 日至今）、招商沪深 300 高贝塔指数分级证券投资基金

基金经理（管理时间：2017 年 7 月 1 日至今）、招商富时中国 A-H50 指数型证券投资基金（LOF）基金经理（管理时间：2018 年 12 月 3 日至今）。

本基金历任基金经理包括：罗毅先生，管理时间为 2013 年 8 月 1 日至 2017 年 7 月 1 日。

### 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：副总经理沙骏、总经理助理兼固定收益投资部负责人裴晓辉、总经理助理兼投资管理一部总监王景、副总经理杨渺、基金经理白海峰、固定收益投资部副总监马龙、投资管理四部总监助理付斌。

### 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 基金托管人基本情况

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：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整

法定代表人：刘连舸

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：许俊

传真：（010）66594942

中国银行客服电话：95566

### 2.2 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。

## 2.3 证券投资基金托管情况

截至 2019 年 12 月 31 日，中国银行已托管 764 只证券投资基金，其中境内基金 722 只，QDII 基金 42 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

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.cmfchina.com](http://www.cmfchina.com)

客服电话：400-887-9555（免长途话费）

电话：（0755）83076995

传真：（0755）83199059

联系人：李璟

招商基金机构业务部

地址：北京市西城区月坛南街 1 号院 3 号楼 1801

电话：（010）56937404

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）38577388

联系人：胡祖望

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）83190401

联系人：任虹虹

招商基金直销交易服务联系方式



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
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：陈四清 电话：95588 传真：010-66107914 联系人：杨威
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
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：刘连舸 电话：95566 传真：（010）66594853 联系人：张建伟
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：贺倩
交通银行股份有限公司	注册地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号 法定代表人：任德奇 电话：（021）58781234 传真：（021）58408483 联系人：王菁
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 法定代表人：李晓鹏 电话：95595 传真：（010）63636248

	联系人：朱红
中信银行股份有限公司	注册地址：北京市东城区朝阳门北大街 9 号 法定代表人：李庆萍 电话：95558 传真：(010) 65550827 联系人：王晓琳
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：郑杨 电话：(021) 61618888 传真：(021) 63604199 联系人：赵守良
平安银行股份有限公司	注册地址：广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号 法定代表人：谢永林 电话：95511-3 传真：(021) 50979507 联系人：赵杨
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：印萍萍
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：王耀球 电话：0769-961122 传真：0769-22866282 联系人：李燕红
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：李仙
广发银行股份有限公司	住所地址：广州市越秀区东风东路 713 号 法定代表人：王滨 电话：020-38321497 传真：020-87310955 联系人：陈泾渭
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 办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层 法定代表人：霍达 电话：(0755) 82960223 传真：(0755) 82960141

	<p>联系人：林生迎  客户服务电话：95565  网址：www.newone.com.cn</p>
中国银河证券股份有限公司	<p>注册地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座  办公地址：北京市西城区金融街 35 号国企大厦 C 座 5 层  法定代表人：陈有安  电话：010-83574507  传真：010-66568990  联系人：辛国政  客服电话：4008-888-888  网址：www.chinastock.com.cn</p>
中信建投证券股份有限公司	<p>注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼  办公地址：北京市朝内大街 188 号  法定代表人：王常青  电话：4008888108  传真：(010) 65182261  联系人：权唐  客服电话：4008888108  网址：www.csc108.com</p>
国泰君安证券股份有限公司	<p>注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号  办公地址：上海市静安区南京西路 768 号国泰君安大厦  法定代表人：贺青  电话：021-38676666  传真：021-38670666  联系人：钟伟镇  网址：www.gtja.com  服务热线：95521 / 4008888666</p>
申万宏源证券有限公司（原申银万国证券）	<p>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：杨玉成  电话：021-33389888  传真：021-33388224  联系人：曹晔  客服电话：95523 或 4008895523  网址：www.swhysc.com</p>

平安证券股份有限公司	<p>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          办公地址：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：何之江          电话：(0755) 22621866          传真：(0755) 82400862          联系人：吴琼          客户服务电话：95511-8          网址：stock.pingan.com</p>
光大证券股份有限公司	<p>注册地址：上海市静安区新闸路 1508 号          办公地址：上海市静安区新闸路 1508 号          法定代表人：周健男          电话：(021) 22169999          传真：(021) 22169134          联系人：刘晨          客户服务热线：95525          网址：www.ebscn.com</p>
财富证券有限责任公司	<p>注册地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 楼          法定代表人：刘宛晨          电话：0731-84403347          传真：无          联系人：郭静          客服电话：(0731) 84403319          网址：www.cfzq.com</p>
中信证券（山东）有限责任公司（原中信万通证券）	<p>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          办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层          法定代表人：姜晓林          电话：(0532) 85022326          传真：(0532) 85022605          联系人：吴忠超          客服电话：95548          网址：www.citicssd.com</p>
国信证券股份有限公司	<p>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          办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号</p>

	<p>国信证券大厦          法定代表人：何如          电话：0755-82130833          传真：0755-82133952          联系人：齐晓燕          客户服务电话：95536          网址：www.guosen.com.cn</p>
国海证券股份有限公司	<p>注册地址：广西桂林市辅星路 13 号          办公地址：广西南宁市滨湖路 46 号          法定代表人：何春梅          电话：(0755)83709350          传真：(0755)83704850          联系人：牛孟宇          客服电话：95563          网址：www.ghzq.com.cn</p>
华泰证券股份有限公司	<p>注册地址：南京市江东中路 228 号          办公地址：南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场、深圳市福田区深南大道 4011 号港中旅大厦 18 楼          法定代表人：周易          电话：0755-82492193          传真：0755-82492962          联系人：庞晓芸          客服电话：95597          网址：www.htsc.com.cn</p>
申万宏源西部证券有限公司（原宏源证券）	<p>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          办公地址：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：李琦          电话：(010) 88085858          传真：(010) 88085195          联系人：李巍          客服电话：4008-000-562          网址：www.hysec.com</p>
中信证券股份有限公司	<p>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          办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦          法定代表人：张佑君          电话：010-60838696          传真：010-60833739          联系人：顾凌</p>

	<p>客服电话：95558 网址： <a href="http://www.cs.ecitic.com">www.cs.ecitic.com</a></p>
东方证券股份有限公司	<p>注册地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 22 层-29 层 办公地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 21 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 客服电话：95503 网址： <a href="http://www.dfzq.com.cn">www.dfzq.com.cn</a></p>
信达证券股份有限公司	<p>注册地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼 办公地址：北京市西城区宣武门西大街甲 127 号大成大厦 6 层 法定代表人：张志刚 电话：010-83252182 传真：(010) 63080978 联系人：唐静 客服电话：95321 网址： <a href="http://www.cindasc.com">www.cindasc.com</a></p>
中航证券有限公司	<p>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 办公地址：北京市朝阳区安立路 60 号润枫 德尚 6 号楼 3 层中航证券 法定代表人：王晓峰 电话：010-64818301 传真：010-64818443 联系人：史江蕊 客服电话：400-8866-567 网址： <a href="http://www.avicsec.com">www.avicsec.com</a></p>
华融证券股份有限公司	<p>注册地址：北京市西城区金融大街 8 号 办公地址：北京市朝阳区朝阳门北大街 18 号中国人保寿险大厦 12 层 法定代表人：张海文 电话：010-85556048 传真：010-85556088 联系人：孙燕波 客服电话：400-898-9999</p>

	网址： <a href="http://www.hrsec.com.cn">www.hrsec.com.cn</a>
华宝证券有限责任公司	<p>注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号 57 层</p> <p>办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号 57 层</p> <p>法定代表人：陈林</p> <p>电话：021-68777222</p> <p>传真：021-20515593</p> <p>联系人：刘闻川</p> <p>客服电话：4008209898</p> <p>网址：<a href="http://www.cnhbstock.com">www.cnhbstock.com</a></p>
方正证券股份有限公司	<p>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</p> <p>公司地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦 22—24 层</p> <p>法定代表人：施华</p> <p>联系人：徐锦福</p> <p>电话：010-57398062</p> <p>传真：010-57308058</p> <p>客服电话：95571</p> <p>网址：<a href="http://www.foundersc.com">www.foundersc.com</a></p>
华安证券股份有限公司	<p>注册地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号</p> <p>公司地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号财智中心 B1 座</p> <p>法定代表人：章宏韬</p> <p>电话：0551-5161666</p> <p>传真：0551-5161600</p> <p>联系人：孙懿</p> <p>客服电话：95318、400-80-96518</p> <p>网址：<a href="http://www.hazq.com">www.hazq.com</a></p>
中泰证券股份有限公司（原齐鲁证券）	<p>注册地址：山东省济南市经七路</p> <p>法定代表人：李玮</p> <p>电话：0531-68889155</p> <p>传真：0531-68889752</p> <p>联系人：吴阳</p> <p>客服电话：95538</p> <p>网址：<a href="http://www.zts.com.cn">www.zts.com.cn</a></p>
国元证券股份有限公司	<p>注册地址：中国安徽省合肥市梅山路 18 号</p> <p>办公地址：安徽省合肥市梅山路 18 号安徽国际金融中心 A 座国元证券</p>

	<p>法定代表人：蔡咏  联系人：陈琳琳  电话：0551-62246273  传真：0551—62207773  客服电话：95578  公司网站：www.gyzq.com.cn</p>
山西证券股份有限公司	<p>注册地址：山西省太原市府西街 69 号山西  国际贸易中心东塔楼  办公地址：山西省太原市府西街 69 号山西  国际贸易中心东塔楼  法定代表人：侯巍  电话：0351—8686659  传真：0351—8686619  联系人：郭熠  客服电话：400-666-1618  网址：www.i618.com.cn</p>
中信证券华南股份有限公司（广州证券）	<p>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  办公地址：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：胡伏云  电话：020-88836999  传真：020-88836654  联系人：林洁茹  客服电话：95396  网址：www.gzs.com.cn</p>
东海证券股份有限公司	<p>注册地址：江苏省常州延陵西路 23 号投资  广场 18 层楼  办公地址：上海市浦东新区东方路 1928 号  东海证券大厦  法定代表人：陈耀庭  电话：021-20333333  传真：021-50498825  联系人：王一彦  客服电话：95531；400-8888-588  网址：www.longone.com.cn</p>
东吴证券股份有限公司	<p>注册地址：苏州工业园区星阳街 5 号  法定代表人：范力  电话：0512-65581136  传真：0512-65588021  联系人：方晓丹</p>



	<p>客服电话：95330 网址： <a href="http://www.dwzq.com.cn">www.dwzq.com.cn</a></p>
中国中金财富证券有限公司（原中投证券）	<p>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 办公地址：深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 04、18 层至 21 层 法定代表人：高涛 联系人：刘毅 电话：0755-82023442 传真：0755-82026539 网址： <a href="http://www.china-invs.cn">www.china-invs.cn</a> 客服电话：400 600 8008，95532</p>
国金证券股份有限公司	<p>注册地址：成都市青羊区东城根上街 95 号 办公地址：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 客服电话：95310 网址： <a href="http://www.gjzq.com.cn">www.gjzq.com.cn</a></p>
国都证券股份有限公司	<p>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 办公地址：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：王少华 电话：010-84183333 传真：010-84183311 联系人：黄静 客服电话：400-818-8118 网址： <a href="http://www.guodu.com">www.guodu.com</a></p>
浙商证券股份有限公司	<p>注册地址：浙江省杭州市杭大路 1 号 办公地址：浙江省杭州市杭大路 1 号黄龙世纪广场 A 座 6-7 法定代表人：吴承根 电话：021-64718888 传真：021-64713795 联系人：李凌芳 客服电话：0571967777</p>

	网址： <a href="http://www.stocke.com.cn">www.stocke.com.cn</a>
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 办公地址：山西省太原市长治路 111 号山西世贸中心 A 座 F12、F13 法定代表人：董祥 联系人：薛津 联系电话：0351-4130322 传真：0351-4130322 客服电话：4007121212 网址： <a href="http://www.dtsbc.com.cn">www.dtsbc.com.cn</a>
东北证券股份有限公司	注册地址：长春市生态大街 6666 号 办公地址：长春市净月开发区生态大街 6666 号东北证券 503 室 法定代表人：李福春 联系电话：0431-85096517 传真：0431-85096795 联系人：安岩岩 客服电话：400-600-0686 网址： <a href="http://www.nesc.cn">www.nesc.cn</a>
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 办公地址：上海市肇嘉浜路 750 号 法定代表人：俞洋 联系人：陈敏 电话：021-54967552 传真：021-64333051 网站： <a href="http://www.cfsc.com.cn">www.cfsc.com.cn</a> 客服电话：021-32109999；029-68918888；4001099918
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 办公地址：广东省深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 15-20 楼 法定代表人：刘学民 地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 18 层 联系人：吴军 电话：0755-23838751 传真：0755-25838701 网址： <a href="http://www.fcsc.cn">www.fcsc.cn</a> 客服电话：400888188

中国国际金融股份有限公司	<p>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          办公地址：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：沈如军          联系人：蔡宇洲          电话：010-65051166          传真：010-65051166          网址：www.cicc.com.cn          客服电话：4009101166</p>
中国民族证券有限责任公司	<p>注册地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼          办公地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号盘古大观 A 座 40F-43F          法定代表人：陈琨          电话：59355941          传真：56437030          联系人：李微          客户服务电话：4008895618          网址：www.e5618.com</p>
万联证券股份有限公司	<p>注册地址：广东省广州市天河区珠江东路 11 号 18、19 楼全层          办公地址：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：罗钦城          联系人：王鑫          电话：020-38286588          传真：020-38286588          客服热线：4008888133          公司网址：www.wlzq.com.cn</p>
太平洋证券股份有限公司	<p>注册地址：云南省昆明市青年路 389 号志远大厦 18 层          办公地址：北京市西城区北展北街九号华远企业号 D 座三单元          法定代表人：李长伟          联系人：谢兰          电话：010-88321613          传真：010-88321763          客服电话：400-665-0999          网址：www.tpyzq.com</p>

<p>中信期货有限公司</p>	<p>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          办公地址：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          公司网址：www.citicsf.com          客服电话：400-990-8826</p>
<p>东海期货有限责任公司</p>	<p>注册地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦 8 楼          办公地址：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          传真：无          网址：www.qh168.com.cn          客服电话：95531/4008888588</p>
<p>五矿证券有限公司</p>	<p>注册地址：深圳市福田区金田路 4028 号经贸中心 48 楼          办公地址：深圳市福田区金田路 4028 号经贸中心 48 楼          法定代表人：黄海洲          联系人：王鹏宇          电话：0755- 83219194          传真：0755-82545500          客服电话：40018-40028          网站：www.wkzq.com.cn</p>
<p>宜信普泽投资顾问（北京）有限公司</p>	<p>注册地址：北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 层 1809          办公地址：北京市朝阳区建国路 88 号 SOHO 现代城 C1809          法定代表人：戎兵          电话：010-52413385          传真：010-85894285          联系人：魏晨          统一客服电话：400-6099-200</p>

	公司网站地址： <a href="http://www.yixinfund.com">www.yixinfund.com</a>
粤开证券股份有限公司（原联讯证券）	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 公司地址：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：严亦斌 电话：0752-2119700 传真：无 联系人：彭莲 客服电话：95564 网址： <a href="http://www.lxsec.com">www.lxsec.com</a>
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：400-820-2899 传真：021-58787698 联系人：敖玲
深圳众禄基金销售股份有限公司	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
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
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
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

	<p>电话：(021) 58870011          传真：(021) 68596916          联系人：张茹</p>
上海天天基金销售有限公司	<p>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</p>
浙江同花顺基金销售有限公司	<p>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：刘宁</p>
上海陆金所基金销售有限公司	<p>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</p>
上海联泰资产管理有限公司	<p>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</p>
北京虹点基金销售有限公司	<p>注册地址：北京市朝阳区工人体育场北路甲 2 号裙房 2 层 222 单元          法定代表人：郑毓栋          电话：400-068-1176          传真：010-56580660          联系人：于婷婷</p>
深圳市新兰德证券投资咨询有限公司	<p>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</p>

	联系人: 文雯
嘉实财富管理有限公司	注册地址: 上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心办公楼二期 46 层 4609-10 单元 法定代表人: 赵学军 电话: 400-021-8850 联系人: 余永健 网址: <a href="http://www.harvestwm.cn">www.harvestwm.cn</a>
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: <a href="http://www.yingmi.cn">www.yingmi.cn</a>
奕丰金融服务（深圳）有限公司	注册地址: 深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室 法定代表人: TAN YIK KUAN 电话: 400-684-0500 联系人: 陈广浩 网址: <a href="http://www.ifastps.com.cn">www.ifastps.com.cn</a>
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: <a href="http://fund.suning.com">http://fund.suning.com</a>
北京新浪仓石基金销售有限公司	注册地址: 北京市海淀区北四环西路 58 号 906 法定代表人: 张琪 电话: 010-62675369 联系人: 付文红 网址: <a href="http://www.xincai.com/">http://www.xincai.com/</a>
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: <a href="http://www.ncfjj.com/">http://www.ncfjj.com/</a>
深圳前海微众银行股份有限公司	注册地址: 深圳市南山区桃园路田厦金牛广

	场 37 楼 法定代表人：顾敏 电话：400-999-8877 联系人：罗曦 网址： <a href="http://www.webank.com/">http://www.webank.com/</a>
北京汇成基金销售有限公司	注册地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108 法定代表人：王伟刚 电话：400-619-9059 联系人：丁向坤 网址： <a href="http://www.fundzone.cn">http://www.fundzone.cn</a>
凤凰金信（银川）投资管理有限公司	注册地址：宁夏回族自治区银川市金凤区阅 海湾中央商务区万寿路 142 号 14 层 1402 法定代表人：程刚 电话：400-810-5919 联系人：张旭 网址： <a href="http://www.fengfd.com">www.fengfd.com</a>
上海中正达广投资管理有限公司	注册地址：上海市徐汇区龙腾大道 2815 号 302 室 法定代表人：黄欣 电话：400-6767-523 联系人：戴珉微 网址： <a href="http://www.zzwealth.cn">www.zzwealth.cn</a>
上海基煜基金销售有限公司	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：王翔 电话：400-820-5369 联系人：吴鸿飞 网址： <a href="http://www.jiyufund.com.cn">www.jiyufund.com.cn</a>
中民财富基金销售（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： <a href="http://www.cmiwm.com">www.cmiwm.com</a>
联储证券有限责任公司	注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 333 号东方汇经中心 8 楼



	<p>法定代表人：沙常明  电话：400-620-6868  联系人：唐露  网址：<a href="http://www.lczq.com/">http://www.lczq.com/</a></p>
上海挖财金融信息服务有限公司	<p>注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 层 01、02/03 室  法定代表人：胡燕亮  电话：021-50810687  联系人：樊晴晴  网址：<a href="http://www.wacaijijin.com">www.wacaijijin.com</a></p>
北京肯特瑞基金销售有限公司	<p>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：01089189288  联系人：邢锦超  网址：<a href="http://kenterui.jd.com/">http://kenterui.jd.com/</a></p>
通华财富(上海)基金销售有限公司	<p>注册地址：上海市浦东新区陆家嘴世纪金融广场杨高南路 799 号 3 号楼 9 楼  法定代表人：兰奇  电话：95156 转 5  联系人：陈益萍  网址：<a href="http://www.tonghuafund.com">www.tonghuafund.com</a></p>
腾安基金销售（深圳）有限公司	<p>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 或 0755-86013388  公司网址：<a href="https://www.tenganxinxi.com/">https://www.tenganxinxi.com/</a></p>
济安财富（北京）基金销售有限公司	<p>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：李海燕  联系电话：13501184929  客服电话：400-673-7010  公司网址：<a href="http://www.jianfortune.com/">http://www.jianfortune.com/</a></p>
上海大智慧基金销售有限公司	<p>注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 428 号 1 号楼 1102 单元  法定代表人：申健</p>

	<p>联系人：施燕华  联系电话：18901685505  客服电话：021-20292031  公司网址：<a href="https://www.wg.com.cn">https://www.wg.com.cn</a></p>
北京百度百盈基金销售有限公司	<p>注册地址：北京市海淀区上地十街 10 号 1 幢 1 层 101  法定代表人：张旭阳  联系人：王语妍  联系电话：13810785862  客服电话：95055-9  公司网址：<a href="https://www.baiyingfund.com/">https://www.baiyingfund.com/</a></p>
江苏汇林保大基金销售有限公司	<p>注册地址：南京市高淳区经济开发区古檀大道 47 号  法定代表人：吴言林  联系人：林伊灵  联系电话：025-66046166（分机号转 810）  客服电话：025-66046166  公司网址：<a href="http://www.huilinbd.com">www.huilinbd.com</a></p>
玄元保险代理有限公司	<p>注册地址：中国（上海）自由贸易试验区张杨路 707 号 1105 室  法定代表人：马永谱  联系人：卢亚博  联系电话：13752528013  客服电话：021-50701053  公司网址：  <a href="http://www.xyinsure.com:7100/kfit_xybx">http://www.xyinsure.com:7100/kfit_xybx</a></p>
五矿证券有限公司	<p>注册地址：深圳市福田区金田路 4028 号荣超经贸中心办公楼 47 层 01 单元  法定代表人：黄海洲  联系人：华然  联系电话：0755-82564033  客服电话：40018-40028  公司网址：<a href="https://www.wkzq.com.cn/">https://www.wkzq.com.cn/</a></p>

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。

### 3.2 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

### 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）51150298

传真：（021）51150398

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：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 号东方广场毕马威大楼 8 层

执行事务合伙人：邹俊

电话：（0755）2547 1000

传真：（0755）8266 8930

经办注册会计师：奚霞、高朋

联系人：蔡正轩

## § 4 基金名称

招商沪深 300 高贝塔指数分级证券投资基金

## § 5 基金类型

股票型证券投资基金

## § 6 基金份额的分类与净值计算规则

## 6.1 基金份额结构

本基金的基金份额包括招商沪深 300 高贝塔指数证券投资基金之基础份额（简称“招商 300 高贝塔份额”）、招商沪深 300 高贝塔指数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”）与招商沪深 300 高贝塔指数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”）。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 的比率不变。

## 6.2 基金份额的自动分离与分拆规则

基金发售结束后，本基金将投资者在场内认购的全部招商 300 高贝塔份额按照 1: 1 的比例自动分离为预期收益与风险不同的两种份额类别，即招商 300 高贝塔 A 份额和招商 300 高贝塔 B 份额。

根据招商 300 高贝塔 A 份额和招商 300 高贝塔 B 份额的基金份额比例，招商 300 高贝塔 A 份额在场内基金初始总份额中的份额占比为 50%，招商 300 高贝塔 B 份额在场内基金初始总份额中的份额占比为 50%，且两类基金份额的基金资产合并运作。

基金合同生效后，招商 300 高贝塔份额设置单独的基金代码，只可以进行场内与场外的申购和赎回，但不上市交易。招商 300 高贝塔 A 份额与招商 300 高贝塔 B 份额交易代码不同，只可在深圳证券交易所上市交易，不可单独进行申购或赎回。

投资者可在场内申购和赎回招商 300 高贝塔份额，投资者可选择将其场内申购的招商 300 高贝塔份额按 1: 1 的比例分拆成招商 300 高贝塔 A 份额和招商 300 高贝塔 B 份额。投资者可按 1: 1 的配比将其持有的招商 300 高贝塔 A 份额和招商 300 高贝塔 B 份额申请合并为招商 300 高贝塔份额后赎回。

投资者可在场外申购和赎回招商 300 高贝塔份额。场外申购的招商 300 高贝塔份额不进行分拆，但基金合同另有规定的除外。投资者可将其持有的场外招商 300 高贝塔份额跨系统转托管至场内并申请将其分拆成招商 300 高贝塔 A 份额和招商 300 高贝塔 B 份额后上市交易。投资者可按 1: 1 的配比将其持有的招商 300 高贝塔 A 份额和招商 300 高贝塔 B 份额合并为招商 300 高贝塔份额后赎回。

## 6.3 招商 300 高贝塔 A 份额和招商 300 高贝塔 B 份额的参考净值计算规则

本基金份额所分离的两类基金份额招商 300 高贝塔 A 份额和招商 300 高贝塔 B 份额具有不同的参考净值计算规则，即招商 300 高贝塔 A 份额和招商 300 高贝塔 B 份额的风险和收益特性不同。

在本基金的存续期内，本基金将在每个工作日按基金合同约定的净值计算规则对招商 300 高贝塔 A 份额和招商 300 高贝塔 B 份额分别进行参考净值计算，招商 300 高贝塔 A 份额为低风险且预期收益相对稳定的基金份额，本基金净资产优先确保招商 300 高贝塔 A 份额的本金及招商 300 高贝塔 A 份额累计约定日应得收益；招商 300 高贝塔 B 份额为高风险且预期收益相对较高的基金份额，本基金在优先确保招商 300 高贝塔 A 份额的本金及累计约定日应得收益后，将剩余净资产计为招商 300 高贝塔 B 份额的净资产。

在本基金的存续期内，招商 300 高贝塔 A 份额和招商 300 高贝塔 B 份额的参考净值计算规则如下：

1、招商 300 高贝塔 A 份额约定年基准收益率为“同期银行人民币一年期定期存款利率（税后）+3.5%”，同期银行人民币一年期定期存款利率以最近一次定期份额折算基准日次日中国人民银行公布的金融机构人民币一年期存款基准利率为准。同期利息税率以最近一次定期份额折算基准日次日执行的利息税率为准。基金合同生效日所在年度的年基准收益率为“基金合同生效日中国人民银行公布的金融机构人民币一年期存款基准利率（税后）+3.5%”。年基准收益均以 1.00 元为基准进行计算；

2、本基金每个工作日对招商 300 高贝塔 A 份额和招商 300 高贝塔 B 份额进行参考净值计算。在进行招商 300 高贝塔 A 份额和招商 300 高贝塔 B 份额各自的参考净值计算时，本基金净资产优先确保招商 300 高贝塔 A 份额的本金及招商 300 高贝塔 A 份额累计约定日应得收益，之后的剩余净资产计为招商 300 高贝塔 B 份额的净资产。招商 300 高贝塔 A 份额累计约定日应得收益按依据招商 300 高贝塔 A 份额约定年基准收益率计算的每日收益率和截至计算日招商 300 高贝塔 A 份额应计收益的天数确定；

3、每 2 份招商 300 高贝塔 B 份额所代表的 1 份招商 300 高贝塔 A 份额和 1 份招商 300 高贝塔 B 份额分别计入招商 300 高贝塔 A 份额总额和招商 300 高贝塔 B 份额总额进行参考净值计算，并将分别按分离后的招商 300 高贝塔 A 份额和招商 300 高贝塔 B 份额的份额数享有获得份额折算的权利，每 2 份招商 300 高贝塔 B 份额所代表的资产净值等于 1 份招商 300 高贝塔 A 份额和 1 份招商 300 高贝塔 B 份额的参考净值之和；

4、在本基金的基金合同生效日至参考净值计算日，若未发生基金合同规定的定期份额折算或不定期份额折算，则招商 300 高贝塔 A 份额在参考净值计算日应计收益的天数按自基金合同生效日至计算日的实际天数计算；若最近一次份额折算为基金合同规定的定期份额折算或不定期份额折算，则招商 300 高贝塔 A 份额在参考净值计算日应计收益的天数应按照最近一次基金份额折算基准日次日至计算日的实际天数计算。

基金管理人并不承诺或保证招商 300 高贝塔 A 份额的基金份额持有人的约定应得收益，如在某一会计年度内本基金资产出现极端损失情况下，招商 300 高贝塔 A 份额的基金份额持有人可能会面临无法取得约定应得收益甚至损失本金的风险。

## 6.4 本基金基金份额净值的计算

本基金作为分级基金，按照招商 300 高贝塔份额净值计算规则以及招商 300 高贝塔 A 份额和招商 300 高贝塔 B 份额的参考净值计算规则依据以下公式分别计算 T 日各基金份额的单位净值和参考净值：

### 1、招商 300 高贝塔份额的基金份额净值计算

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

T 日招商 300 高贝塔份额的基金份额净值 = T 日闭市后的基金资产净值 / T 日本基金基金份额的总数

T 日本基金基金份额的总数为招商 300 高贝塔 A 份额、招商 300 高贝塔 B 份额和招商 300 高贝塔份额的份额数之和。

### 2、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计算

$$NAV_A = 1 + R \times T \div 365$$

$$NAV_B = 2 \times NAV_{\text{基础}} - NAV_A$$

设 T 日为基金份额净值计算日， $T = \text{Min}\{\text{自基金合同生效日至 T 日，自最近一次基金份额折算基准日次日至 T 日}\}$ ； $NAV_{\text{基础}}$  为 T 日每份招商 300 高贝塔份额的基金份额净值；

$NAV_A$  为 T 日招商 300 高贝塔 A 份额的基金份额参考净值； $NAV_B$  为 T 日招商 300 高贝塔 B 份额的基金份额参考净值； $R$  为招商 300 高贝塔 A 份额约定年基准收益率。

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的计算，均保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

T 日的各基金份额的单位净值和参考净值在当天收市后计算，并按照基金合同的约定进行公告。如遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

## § 7 招商 300 高贝塔 A 份额与招商 300 高贝塔 B 份额的上市交易

本基金基金合同生效后，基金管理人将根据有关规定，申请招商 300 高贝塔 A 份额、招商 300 高贝塔 B 份额上市交易。

### 7.1 上市交易的地点

深圳证券交易所。

## 7.2 上市交易的时间

本基金《基金合同》生效后三个月内开始在深圳证券交易所上市交易。在确定上市交易时间后，基金管理人最迟在上市前 3 个工作日在至少一家指定媒介和基金管理人网站上公告。

## 7.3 市交易的规则

- 1、招商 300 高贝塔 A 份额、招商 300 高贝塔 B 份额分别采用不同的交易代码上市交易；
- 2、招商 300 高贝塔 A 份额、招商 300 高贝塔 B 份额上市首日的开盘参考价分别为各自前一交易日的基金份额参考净值；
- 3、招商 300 高贝塔 A 份额、招商 300 高贝塔 B 份额实行价格涨跌幅限制，涨跌幅比例为 10%，自上市首日起实行；
- 4、招商 300 高贝塔 A 份额、招商 300 高贝塔 B 份额买入申报数量为 100 份或其整数倍；
- 5、招商 300 高贝塔 A 份额、招商 300 高贝塔 B 份额申报价格最小变动单位为 0.001 元人民币；
- 6、招商 300 高贝塔 A 份额、招商 300 高贝塔 B 份额上市交易遵循《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》、《深圳证券交易所交易规则》及相关规定。

## 7.4 上市交易的费用

招商 300 高贝塔 A 份额、招商 300 高贝塔 B 份额上市交易的费用按照深圳证券交易所相关规则及有关规定执行。

## 7.5 上市交易的行情揭示

招商 300 高贝塔 A 份额、招商 300 高贝塔 B 份额在深圳交易所挂牌交易，交易行情通过行情发布系统揭示。行情发布系统同时揭示前一交易日的基金份额参考净值。

## 7.6 上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市

招商 300 高贝塔 A 份额、招商 300 高贝塔 B 份额的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市按照相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所的相关规定执行。

7.7 相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所对基金上市交易的规则等相关规定内容进行调整的，本基金《基金合同》相应予以修改，且此项修改无须召开基金份额持有人大会。

## § 8 基金的份额配对转换

本基金基金合同生效后，基金管理人将为基金份额持有人办理份额配对转换业务。

8.1 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。

1、分拆。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。

2、合并。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。

### 8.2 份额配对转换的业务办理机构

份额配对转换的业务办理机构见招募说明书或基金管理人届时发布的相关公告。

基金投资者应当在份额配对转换业务办理机构的营业场所或按其提供的其他方式办理份额配对转换。深圳证券交易所、基金登记结算机构或基金管理人可根据情况变更或增减份额配对转换的业务办理机构。

### 8.3 份额配对转换的业务办理时间

份额配对转换自招商 300 高贝塔 A 份额、招商 300 高贝塔 B 份额上市交易后不超过 6 个月的时间内开始办理，基金管理人应在开始办理份额配对转换的具体日期前 2 日在指定媒介上公告。

份额配对转换的业务办理日为深圳证券交易所交易日（基金管理人公告暂停份额配对转换时除外），具体的业务办理时间见招募说明书或基金管理人届时发布的相关公告。

若深圳证券交易所交易时间更改或实际情况需要，基金管理人可对份额配对转换业务的办理时间进行调整并公告。

### 8.4 份额配对转换的原则



- 1、份额配对转换以份额申请。
- 2、申请进行分拆的招商 300 高贝塔份额的场内份额必须是偶数。
- 3、申请进行合并的招商 300 高贝塔 A 份额与招商 300 高贝塔 B 份额必须同时配对申请，且基金份额数必须同为整数且相等。
- 4、招商 300 高贝塔份额的场外份额如需申请进行分拆，须跨系统转托管为招商 300 高贝塔份额的场内份额后方可进行。
- 5、份额配对转换应遵循届时相关机构发布的相关业务规则。深圳证券交易所、基金登记结算机构或基金管理人可视情况对上述规定作出调整，并在正式实施前 2 日在指定媒介上公告。

## 8.5 份额配对转换的程序

份额配对转换的程序遵循届时相关机构发布的最新业务规则，具体见相关业务公告。

## 8.6 暂停份额配对转换的情形

- 1、深圳证券交易所、基金登记结算机构、份额配对转换业务办理机构因异常情况无法办理份额配对转换业务。
  - 2、法律法规、深圳证券交易所规定或经中国证监会认定的其他情形。
- 发生前述情形的，基金管理人应当在指定媒介上刊登暂停份额配对转换业务的公告。
- 在暂停份额配对转换的情况消除时，基金管理人应及时恢复份额配对转换业务的办理，并依照有关规定在指定媒介上公告。

## 8.7 份额配对转换的业务办理费用

份额配对转换业务办理机构可对转换业务的办理酌情收取一定的佣金，具体见相关业务公告。

# § 9 基金份额折算

## 9.1 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），本基金将按照以下规则进行基金的定期份额折算。

- 1、基金份额折算基准日  
每个会计年度的的 12 月 15 日（遇节假日顺延）。

## 2、基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的招商 300 高贝塔 A 份额、招商 300 高贝塔份额。

## 3、基金份额折算频率

每年折算一次。

## 4、基金份额折算方式

招商 300 高贝塔 A 份额和招商 300 高贝塔 B 份额按照本基金基金合同中规定的净值计算规则进行净值计算，对招商 300 高贝塔 A 份额的约定应得收益进行定期份额折算，每 2 份招商 300 高贝塔份额将按 1 份招商 300 高贝塔 A 份额获得约定应得收益的新增折算份额。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。

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 1.0000 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。

每个会计年度的基金份额折算基准日，本基金将对招商 300 高贝塔 A 份额和招商 300 高贝塔份额进行应得收益的定期份额折算。

招商 300 高贝塔 A 份额本年度应得收益的定期份额折算时，有关计算公式如下：

### （1）招商 300 高贝塔 A 份额

定期份额折算后招商 300 高贝塔 A 份额的份额数 = 定期份额折算前招商 300 高贝塔 A 份额的份额数

$$NAV_{\text{基础}}^{\text{后}} = \frac{NAV_{\text{基础}}^{\text{前}} \times NUM_{\text{基础}}^{\text{前}} - (NAV_A^{\text{前}} - 1.0000) / 2 \times NUM_{\text{基础}}^{\text{前}}}{NUM_{\text{基础}}^{\text{前}}}$$

招商 300 高贝塔 A 份额持有人新增的场内招商 300 高贝塔份额数量 =

$$\frac{NUM_A^{\text{前}} \times (NAV_A^{\text{前}} - 1.0000)}{NAV_{\text{基础}}^{\text{后}}}$$

其中：

$NAV_A^{\text{前}}$  为折算前招商 300 高贝塔 A 份额参考净值

$NUM_A^{\text{前}}$  为折算前招商 300 高贝塔 A 份额的份额数

$NAV_{\text{基础}}^{\text{后}}$  为折算后招商 300 高贝塔份额净值

$NUM_{\text{基础}}^{\text{前}}$  为折算前招商 300 高贝塔份额的份额数

## (2) 招商 300 高贝塔 B 份额

每个会计年度的定期份额折算不改变招商 300 高贝塔 B 份额参考净值及其份额数。

## (3) 招商 300 高贝塔份额

$$NAV_{\text{基础}}^{\text{后}} = \frac{NAV_{\text{基础}}^{\text{前}} \times NUM_{\text{基础}}^{\text{前}} - (NAV_A^{\text{前}} - 1.0000) / 2 \times NUM_{\text{基础}}^{\text{前}}}{NUM_{\text{基础}}^{\text{前}}}$$

$$\text{招商 300 高贝塔份额持有人新增的招商 300 高贝塔份额} = \frac{NUM_{\text{基础}}^{\text{前}}}{2} \times \frac{NAV_A^{\text{前}} - 1.0000}{NAV_{\text{基础}}^{\text{后}}}$$

定期份额折算后招商 300 高贝塔份额的份额数 = 定期份额折算前招商 300 高贝塔份额的份额数 + 招商 300 高贝塔份额持有人新增的招商 300 高贝塔份额的份额数

其中：

$NAV_A^{\text{前}}$  为折算前招商 300 高贝塔 A 份额参考净值

$NAV_{\text{基础}}^{\text{后}}$  为折算后招商 300 高贝塔份额净值

$NUM_{\text{基础}}^{\text{前}}$  为折算前招商 300 高贝塔份额的份额数

招商 300 高贝塔份额的场外份额经折算后的份额数采用截尾法保留到小数点后两位；招商 300 高贝塔份额的场内份额经折算后的份额数，以及招商 300 高贝塔 A 份额折算成招商 300 高贝塔份额的场内份额数均取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金财产。

在实施基金份额折算时，折算日折算前招商 300 高贝塔份额的基金份额净值、招商 300 高贝塔 A 份额参考净值等具体见基金管理人届时发布的相关公告。

## 5、基金份额折算期间的基金业务办理

为保证基金份额折算期间本基金的平稳运作，基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停招商 300 高贝塔 A 份额与招商 300 高贝塔 B 份额的上市交易和招商 300 高贝塔份额的申购或赎回等相关业务，具体见基金管理人届时发布的相关公告。

## 6、基金份额折算结果的公告

基金份额折算结束后，基金管理人应按照《信息披露办法》在指定媒介公告。

#### 7、特殊情形的处理

若在定期份额折算日发生《基金合同》约定的本基金不定期份额折算的情形时，将按照不定期份额折算的规则进行份额折算。

## 9.2 不定期份额折算

除以上定期份额折算外，本基金还将在以下两种情况进行份额折算，即：当招商 300 高贝塔份额的基金份额净值达到 1.5000 元；当招商 300 高贝塔 B 份额的基金份额参考净值达到 0.2500 元。

1、当招商 300 高贝塔份额的基金份额净值达到 1.5000 元，本基金将按照以下规则进行份额折算。

#### （1）基金份额折算基准日

招商 300 高贝塔份额的基金份额净值达到 1.5000 元，基金管理人可根据市场情况确定折算基准日。

#### （2）基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的招商 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。

#### （3）基金份额折算频率

不定期。

#### （4）基金份额折算方式

当招商 300 高贝塔份额的基金份额净值达到 1.5000 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 高贝塔份额的份额净值达到 1.5000 元后，招商 300 高贝塔 A 份额、招商 300 高贝塔 B 份额、招商 300 高贝塔份额三类份额将按照如下公式进行份额折算：

#### 1) 招商 300 高贝塔 A 份额

份额折算原则：

① 份额折算前招商 300 高贝塔 A 份额的份额数与份额折算后招商 300 高贝塔 A 份额的份额数相等；

② 招商 300 高贝塔 A 份额持有人份额折算后获得新增的份额数，即参考净值超出 1 元以上的部分全部折算为场内招商 300 高贝塔份额。

$$NUM_A^{\text{后}} = NUM_A^{\text{前}}$$

招商 300 高贝塔 A 份额持有人新增的场内招商 300 高贝塔份额数量=

$$\frac{NUM_A^{\text{前}} \times (NAV_A^{\text{前}} - 1.0000)}{1.0000}$$

其中：

$NAV_A^{\text{前}}$  为折算前招商 300 高贝塔 A 份额参考净值

$NUM_A^{\text{前}}$  为折算前招商 300 高贝塔 A 份额的份额数

$NUM_A^{\text{后}}$  为折算后招商 300 高贝塔 A 份额的份额数

## 2) 招商 300 高贝塔 B 份额

份额折算原则：

① 份额折算后招商 300 高贝塔 B 份额与招商 300 高贝塔 A 份额的份额数保持 1: 1 配比；

② 份额折算前招商 300 高贝塔 B 份额的资产净值与份额折算后招商 300 高贝塔 B 份额的资产净值及新增场内招商 300 高贝塔份额的资产净值之和相等；

③ 份额折算前招商 300 高贝塔 B 份额的持有人在份额折算后将持有招商 300 高贝塔 B 份额与新增场内招商 300 高贝塔份额。

$$NUM_B^{\text{后}} = NUM_B^{\text{前}}$$

招商 300 高贝塔 B 份额持有人新增的场内招商 300 高贝塔份额数量

$$\frac{NUM_B^{\text{前}} \times (NAV_B^{\text{前}} - 1.0000)}{1.0000}$$

其中：

$NAV_B^{\text{前}}$  为折算前招商 300 高贝塔 B 份额参考净值

$NUM_B^{\text{前}}$  为折算前招商 300 高贝塔 B 份额的份额数

$NUM_B^{\text{后}}$  为折算后招商 300 高贝塔 B 份额的份额数

$NUM_A^{\text{后}}$  为折算后招商 300 高贝塔 A 份额的份额数

## 3) 招商 300 高贝塔份额

份额折算原则：

场外招商 300 高贝塔份额持有人份额折算后获得新增场外招商 300 高贝塔份额，场内招商 300 高贝塔份额持有人份额折算后获得新增场内招商 300 高贝塔份额。

$$NUM_{\text{基础}}^{\text{后}} = \frac{NAV_{\text{基础}}^{\text{前}} \times NUM_{\text{基础}}^{\text{前}}}{1.0000}$$

其中：

$NAV_{\text{基础前}}$  为折算前招商 300 高贝塔份额净值

$NUM_{\text{基础前}}$  为折算前招商 300 高贝塔份额的份额数

$NUM_{\text{基础后}}$  为折算后原招商 300 高贝塔份额持有人持有的招商 300 高贝塔份额的份额数

招商 300 高贝塔份额的场外份额经折算后的份额数采用截尾法保留到小数点后两位；招商 300 高贝塔份额的场内份额经折算后的份额数，以及招商 300 高贝塔 A 份额、招商 300 高贝塔 B 份额折算成招商 300 高贝塔份额的场内份额数均取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金财产。

在实施基金份额折算时，折算日折算前招商 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 份额的参考净值等具体见基金管理人届时发布的相关公告。

#### （5）基金份额折算期间的基金业务办理

为保证基金份额折算期间本基金的平稳运作，基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停招商 300 高贝塔 A 份额与招商 300 高贝塔 B 份额的上市交易和招商 300 高贝塔份额的申购或赎回等相关业务，具体见基金管理人届时发布的相关公告。

#### （6）基金份额折算结果的公告

基金份额折算结束后，基金管理人应按照《信息披露办法》在指定媒介公告。

2、当招商 300 高贝塔 B 份额的基金份额参考净值达到 0.2500 元，本基金将按照以下规则进行份额折算。

#### （1）基金份额折算基准日

招商 300 高贝塔 B 份额的基金份额参考净值达到 0.2500 元，基金管理人可根据市场情况确定折算基准日。

#### （2）基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的招商 300 高贝塔 A 份额、招商 300 高贝塔 B 份额、招商 300 高贝塔份额。

#### （3）基金份额折算频率

不定期。

#### （4）基金份额折算方式

当招商 300 高贝塔 B 份额的基金份额参考净值达到 0.2500 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。

当招商 300 高贝塔 B 份额参考净值达到 0.2500 元后，招商 300 高贝塔 A 份额、招商 300 高贝塔 B 份额、招商 300 高贝塔份额三类份额将按照如下公式进行份额折算。

1) 招商 300 高贝塔 B 份额

份额折算原则：

份额折算前招商 300 高贝塔 B 份额的资产净值与份额折算后招商 300 高贝塔 B 份额的资产净值相等。

$$NUM_B^{\text{后}} = \frac{NAV_B^{\text{前}} \times NUM_B^{\text{前}}}{1.0000}$$

其中：

$NAV_B^{\text{前}}$  为折算前招商 300 高贝塔 B 份额参考净值

$NUM_B^{\text{前}}$  为折算前招商 300 高贝塔 B 份额的份额数

$NUM_B^{\text{后}}$  为折算后招商 300 高贝塔 B 份额的份额数

2) 招商 300 高贝塔 A 份额

份额折算原则：

① 份额折算前后招商 300 高贝塔 A 份额与招商 300 高贝塔 B 份额的份额数始终保持 1:1 配比；

② 份额折算前招商 300 高贝塔 A 份额的资产净值与份额折算后招商 300 高贝塔 A 份额的资产净值及新增场内招商 300 高贝塔份额的资产净值之和相等；

③ 份额折算前招商 300 高贝塔 A 份额的持有人在份额折算后将持有招商 300 高贝塔 A 份额与新增场内招商 300 高贝塔份额。

$$NUM_A^{\text{后}} = NUM_B^{\text{后}}$$

$$NUM_{\text{基础}}^{\text{场内新增}} = \frac{NUM_A^{\text{前}} \times NAV_A^{\text{前}} - NUM_A^{\text{后}} \times 1.0000}{1.0000}$$

其中：

$NUM_A^{\text{后}}$  为折算后招商 300 高贝塔 A 份额的份额数

$NUM_B^{\text{后}}$  为折算后招商 300 高贝塔 B 份额的份额数

$NUM_{\text{基础}}^{\text{场内新增}}$  为份额折算前招商 300 高贝塔 A 份额持有人在份额折算后所持有的新增的场内招商 300 高贝塔份额的份额数

$NAV_A^{\text{前}}$  为折算前招商 300 高贝塔 A 份额参考净值

$NUM_A^{\text{前}}$  为折算前招商 300 高贝塔 A 份额的份额数

3) 招商 300 高贝塔份额：

份额折算原则：

份额折算前招商 300 高贝塔份额的资产净值与份额折算后招商 300 高贝塔份额的资产净值相等。

$$NUM_{\text{基础}}^{\text{后}} = \frac{NAV_{\text{基础}}^{\text{前}} \times NUM_{\text{基础}}^{\text{前}}}{1.0000}$$

其中：

$NAV_{\text{基础}}^{\text{前}}$  为折算前招商 300 高贝塔份额净值

$NUM_{\text{基础}}^{\text{前}}$  为折算前招商 300 高贝塔份额的份额数

$NUM_{\text{基础}}^{\text{后}}$  为折算后原招商 300 高贝塔份额持有人持有的招商 300 高贝塔份额的份额数

招商 300 高贝塔份额的场外份额经折算后的份额数采用截尾法保留到小数点后两位；招商 300 高贝塔份额的场内份额经折算后的份额数，以及招商 300 高贝塔 A 份额、招商 300 高贝塔 B 份额折算成招商 300 高贝塔份额的场内份额数均取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金财产。

在实施基金份额折算时，折算日折算前招商 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 份额的参考净值等具体见基金管理人届时发布的相关公告。

#### （5）基金份额折算期间的基金业务办理

为保证基金份额折算期间本基金的平稳运作，基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停招商 300 高贝塔 A 份额与招商 300 高贝塔 B 份额的上市交易和招商 300 高贝塔份额的申购或赎回等相关业务，具体见基金管理人届时发布的相关公告。

#### （6）基金份额折算结果的公告

基金份额折算结束后，基金管理人应按照《信息披露办法》在指定媒介公告。

## § 10 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%。

## § 11 投资范围



本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括沪深 300 高贝塔指数的成份股、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%，投资于沪深 300 高贝塔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%，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。

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。

## § 12 投资策略

本基金以沪深 300 高贝塔指数为标的指数，采用完全复制法，按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，进行被动式指数化投资。股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合复制标的指数，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，以复制和跟踪标的指数。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%。

当预期成份股发生调整，成份股发生配股、增发、分红等行为，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响，或因某些特殊情况导致流动性不足，导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。

基金管理人将对成份股的流动性进行分析，如发现流动性欠佳的个股将可能采用合理方法寻求替代。基金管理人运用以下策略构造替代股组合：

(1) 基本面替代：按照与被替代股票所属行业，基本面及规模相似的原则，选取一揽子标的指数成份股票作为替代股备选库；

(2) 相关性检验：计算备选库中各股票与被替代股票日收益率的相关系数并选取与被替代股票相关性较高的股票组成模拟组合，以组合与被替代股票的日收益率序列的相关系数最大化为优化目标，求解组合中替代股票的权重，并构建替代股组合。

本基金管理人每日跟踪基金组合与标的指数表现的偏离度，每月末、季度末定期分析基金的实际组合与标的指数表现的累计偏离度、跟踪误差变化情况及其原因，并优化跟踪偏离度管理方案。

本基金管理人可运用股指期货，以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，参与股指期货的投资，以改善组合的风险收益特性。本基金主要通过对现货和期货市场运

行趋势的研究，结合股指期货定价模型寻求其合理估值水平，采用流动性好、交易活跃的期货合约，达到有效跟踪标的指数的目的。此外，本基金还将运用股指期货来对冲特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理，如预期大额申购赎回、大量分红等，以及对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险。

## § 13 投资决策流程

本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理团队制。投资决策委员负责制定基金投资方面的整体投资计划与投资原则；决定有关标的指数重大调整应对决策、其他重大组合调整决策以及重大的单项投资决策；基金经理根据投资决策委员会的决策，负责投资组合的构建、调整和日常管理等工作。

1、投资决策委员会依据相关研究分析报告，定期召开或遇重大事项时召开投资决策会议，决策相关事项。基金经理根据投资决策委员会的决议，进行基金投资管理的日常决策。

2、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；

3、基金经理及风险管理部定期对投资组合的偏离度和跟踪误差进行跟踪和评估，并对风险隐患提出预警；

4、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；

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。

## § 14 业绩比较基准

### 1、标的指数

本基金股票资产的标的指数为沪深 300 高贝塔指数。

如果指数编制单位变更或停止沪深 300 高贝塔指数的编制、发布或授权，或沪深 300 高贝塔指数由其他指数替代、或由于指数编制方法的重大变更等事项导致沪深 300 高贝塔指数不宜继续作为标的指数，或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出，基金管理人认为有必要作相应调整时，本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，在履行适当程序后变更本基金的标的指数、业绩比较基准和基金名称。其中，若变更标的指数涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更，则基金管理人应就变更标的指数召开基金份额持有人大会，并报中国证监会备案且在指定媒介公告。若变更标的指数对基金投

资范围和投资策略无实质性影响（包括但不限于指数编制单位变更、指数更名等事项），则无需召开基金份额持有人大会，基金管理人应与基金托管人协商一致后，报中国证监会备案并及时公告。

## 2、业绩比较基准

本基金业绩比较基准：沪深 300 高贝塔指数收益率×95%+金融机构人民币活期存款基准利率（税后）×5%。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的股票指数时，本基金可以在与本基金托管人协商同意后变更业绩比较基准并及时公告。本基金由于上述原因变更标的指数和业绩比较基准，基金管理人应于变更前在中国证监会指定的媒介上公告。

## § 15 风险收益特征

本基金为股票型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征。从本基金所分离的两类基金份额来看，招商 300 高贝塔 A 份额具有低风险、收益相对稳定的特征；招商 300 高贝塔 B 份额具有高风险、高预期收益的特征。

## § 16 基金投资组合报告

招商沪深 300 高贝塔指数分级证券投资基金管理人—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 2019 年 12 月 31 日，来源于《招商沪深 300 高贝塔指数分级证券投资基金 2019 年第 4 季度报告》。

### 1 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	24,555,852.29	92.84
	其中：股票	24,555,852.29	92.84
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-

4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的 买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备 付金合计	1,587,547.96	6.00
8	其他资产	305,469.83	1.15
9	合计	26,448,870.08	100.00

## 2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 2.1 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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	9,750,834.61	37.74
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	194,064.80	0.75
G	交通运输、仓储和邮 政业	1,096,904.54	4.25
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信 息技术服务业	1,279,352.40	4.95
J	金融业	10,742,802.14	41.58
K	房地产业	590,141.15	2.28
L	租赁和商务服务业	665,524.00	2.58
M	科学研究和技术服 务业	-	-
N	水利、环境和公共设 施管理业	216,600.00	0.84
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	24,536,223.64	94.96

## 2.2 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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	15,679.53	0.06
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	-	-
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	3,949.12	0.02
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	19,628.65	0.08

## 2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

## 3 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

### 3.1 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	占基金资产
----	------	------	-------	------	-------

				(元)	净值比例 (%)
1	300033	同花顺	3,400	370,974.00	1.44
2	601878	浙商证券	31,100	346,143.00	1.34
3	601162	天风证券	47,000	345,920.00	1.34
4	601066	中信建投	11,300	343,520.00	1.33
5	601881	中国银河	27,795	322,699.95	1.25
6	600061	国投资本	20,700	313,398.00	1.21
7	300059	东方财富	19,846	312,971.42	1.21
8	002939	长城证券	22,500	311,850.00	1.21
9	601108	财通证券	26,900	305,046.00	1.18
10	000723	美锦能源	32,100	302,703.00	1.17

### 3.2 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	002972	科安达	537	10,756.11	0.04
2	603109	神驰机电	186	4,923.42	0.02
3	002973	侨银环保	688	3,949.12	0.02

### 4 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。

### 5 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。

### 6 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。

### 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五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 8 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。

## 9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

### 9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金管理人可运用股指期货，以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，参与股指期货的投资，以改善组合的风险收益特性。本基金主要通过对现货和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货定价模型寻求其合理估值水平，采用流动性好、交易活跃的期货合约，达到有效跟踪标的指数的目的。此外，本基金还将运用股指期货来对冲特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理，如预期大额申购赎回、大量分红等，以及对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险。

## 10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 10.1 本期国债期货投资政策

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

### 10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

### 10.3 本期国债期货投资评价

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

## 11 投资组合报告附注

## 11.1

报告期内基金投资的前十名证券除财通证券（证券代码 601108）、长城证券（证券代码 002939）、天风证券（证券代码 601162）、同花顺（证券代码 300033）、浙商证券（证券代码 601878）、中国银河（证券代码 601881）、中信建投（证券代码 601066）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、财通证券（证券代码 601108）

根据 2019 年 10 月 9 日发布的相关公告，该证券发行人因未依法履行职责被中国证监会给予警示。

### 2、长城证券（证券代码 002939）

根据 2019 年 1 月 22 日发布的相关公告，该证券发行人因内部制度不完善被深圳证监局给予警示。

根据 2019 年 3 月 7 日发布的相关公告，该证券发行人因内部制度不完善被深圳证券交易所会员管理部给予警示。

### 3、天风证券（证券代码 601162）

根据 2019 年 6 月 14 日发布的相关公告，该证券发行人因内部制度不完善被江苏证监局责令改正。

根据 2019 年 9 月 23 日发布的相关公告，该证券发行人因违规经营被湖北证监局责令改正。

根据 2019 年 11 月 8 日发布的相关公告，该证券发行人因未依法履行职责被上海证券交易所责令改正。

### 4、同花顺（证券代码 300033）

根据 2019 年 7 月 16 日发布的相关公告，该证券发行人因未依法履行职责被 App 专项治理工作组责令改正。

### 5、浙商证券（证券代码 601878）

根据 2019 年 12 月 20 日发布的相关公告，该证券发行人因未依法履行职责被中国证监会给予警示。

### 6、中国银河（证券代码 601881）

根据 2019 年 4 月 1 日发布的相关公告，该证券发行人因违规经营被广东证监局给予警示。

根据 2019 年 10 月 24 日发布的相关公告，该证券发行人因违规经营被新建证监局责令改正。

### 7、中信建投（证券代码 601066）



根据 2019 年 5 月 8 日发布的相关公告，该证券发行人因违规经营被黑龙江证监局责令改正。

根据 2019 年 7 月 17 日发布的相关公告，该证券发行人因财务会计报告违规，未依法履行职责被中国银行间市场交易商协会通报批评，并责令改正。

根据 2019 年 7 月 18 日发布的相关公告，该证券发行人因违规经营被北京证监局责令改正。

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。

## 11.2

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。

## 11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	15,796.22
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	309.71
5	应收申购款	289,363.90
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	305,469.83

## 11.4 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处于转股期的可转换债券。

## 11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

### 11.5.1 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的情况。

### 11.5.2 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	002973	侨银环保	3,949.12	0.02	新股锁定

## § 17 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，本基金管理人不能保证基金一定盈利，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①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
2013.08.01-2013.12.31	-4.80%	1.02%	3.06%	1.27%	-7.86%	-0.25%
2014.01.01-2014.12.31	41.15%	1.31%	53.69%	1.36%	-12.54%	-0.05%
2015.01.01-2015.12.31	7.33%	2.76%	11.46%	2.63%	-4.13%	0.13%
2016.01.01-2016.12.31	-13.86%	1.77%	-14.34%	1.78%	0.48%	-0.01%
2017.01.01-2017.12.31	-6.76%	0.86%	-4.16%	0.86%	-2.60%	0.00%
2018.01.01-2018.12.31	-33.98%	1.50%	-31.04%	1.52%	-2.94%	-0.02%
2019.01.01-2019.12.31	48.64%	1.52%	49.71%	1.51%	-1.07%	0.01%
自基金成立起至 2019.12.31	13.61%	1.68%	49.65%	1.67%	-36.04%	0.01%

注：本基金合同生效日为 2013 年 8 月 1 日。

## § 18 基金的费用与税收

### 18.1 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。

## 18.2 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：

$$H=E \times 1\% \div \text{当年天数}$$

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 3 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、基金托管人的基金托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

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 3 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：

$$H=E \times 0.02\% \div \text{当年天数}$$

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。

4、上述“17.1 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。

### 18.3 不列入基金费用的项目

- 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；
- 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。

### 18.4 费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后，可根据基金运作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 日在指定媒介上公告。

### 18.5 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。

### 18.6 申购费用和赎回费用

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。

- 1、招商 300 高贝塔份额的申购费率

(1) 招商 300 高贝塔份额的场外申购费率根据申购金额设定如下：

申购金额 (M)	申购费率
$M < 50$ 万	1.0%
$50 \text{ 万} \leq M < 100 \text{ 万}$	0.5%
$M \geq 100 \text{ 万}$	每笔 300 元

(2) 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。

## 2、招商 300 高贝塔份额的赎回费率

(1) 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设定如下：

持有期限	赎回费率
$N < 7$ 日	1.50%
$7 \text{ 日} \leq N < 1 \text{ 年}$	0.5%
$1 \text{ 年} \leq N < 2 \text{ 年}$	0.25%
$N \geq 2 \text{ 年}$	0%

(2) 招商 300 高贝塔份额的场内赎回对持续持有期少于 7 日的投资者收取 1.5% 的赎回费，并全额计入基金财产；除此之外赎回费率为固定 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，对持续持有期少于 7 日的投资者收取的赎回费全额计入基金财产，对持续持有期不少于 7 日的投资者收取的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指定媒介上公告。

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。

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。

## § 19 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》、《公开募集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 2020 年 2 月 28 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、更新了“重要提示。”
- 2、在“基金管理人”部分，更新了“基金管理人概况”，更新了“主要人员情况”。
- 3、在“基金托管人”部分，更新了“基金托管人基本情况”，更新了“证券投资基金托管情况”，更新了“托管业务的内部控制制度”。
- 4、在“相关服务机构”部分，更新了“基金份额销售机构”，更新了“会计师事务所和经办注册会计师”。
- 5、在“基金的投资”部分，更新了“基金投资组合报告”。
- 6、更新了“基金的业绩”。
- 7、在“基金托管协议的内容摘要”部分，更新了“托管协议当事人”。
- 8、更新了“其他应披露事项”。

招商基金管理有限公司  
2020 年 3 月 14 日