

招商富时中国 A-H50 指数型证券投资基金 (LOF) 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 06 月 15 日

重要提示

招商富时中国 A-H50 指数型证券投资基金 (LOF) (以下简称“本基金”) 经中国证券监督管理委员会 2018 年 8 月 22 日《关于准予招商富时中国 A-H50 指数型证券投资基金 (LOF) 注册的批复》(证监许可【2018】1360 号文) 注册公开募集。本基金的基金合同于 2018 年 12 月 3 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注册, 中国证监会对基金募集的注册审查以要件齐备和内容合规为基础, 以充分的信息披露和投资者适当性为核心, 以加强投资者利益保护和防范系统性风险为目标。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。投资者应当认真阅读基金招募说明书、基金合同等信息披露文件, 自主判断基金的投资价值, 自主做出投资决策, 自行承担投资风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产, 但不保证基金一定盈利, 也不保证最低收益。当投资人赎回时, 所得或会高于或低于投资人先前所支付的金额。如对本招募说明书有任何疑问, 应寻求独立及专业的财务意见。

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

本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化, 选择将部分基金资产投资于港股通标的股票或选择不将基金资产投资于港股通标的股票, 基金资产并非必然投资港股通标的股票。本基金主要投资于富时中国 A-H50 指数成分股和备选成分股, 基金净值会因为国内 A 股市场、香港股票市场波动及相关公司的经营风险和财务风险等因素产生波动, 上述因素的波动和变化可能会使基金资产面临潜在风险。

本基金的标的指数为富时中国 A-H50 指数, 基金主要采取完全复制法, 按照标的指数成分股及其权重, 采用直接投资和通过沪港通投资的方式构建股票组合。基金名称为“招

商富时中国 A-H50 指数型证券投资基金 (LOF) ”, 基金名称仅表明基金可以通过港股通机制投资于港股, 基金资产并非必然投资于港股, 存在不对港股进行投资的可能。如本基金资产投资于港股通标的股票, 会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险, 包括港股市场股价波动较大的风险(港股市场实行 T+0 回转交易, 且对个股不设涨跌幅限制, 港股股价可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动)、汇率风险(汇率波动可能对基金的投资收益造成损失)、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险(在内地开市香港休市的情形下, 港股通不能正常交易, 港股不能及时卖出, 可能带来一定的流动性风险)等。

本基金作为指数型基金, 存在以下特定风险: 由于标的指数并不能完全代表整个股票市场, 标的指数成份股的平均回报率与整个股票市场的平均回报率可能存在偏离; 标的指数成份股的价格可能受到政治因素、经济因素、上市公司经营状况、投资者心理和交易制度等各种因素的影响而波动, 产生标的指数波动的风险; 由于标的指数调整成份股或变更编制方法, 或指数成份股发生配股、增发等行为, 或成份股停牌、摘牌或流动性差等各种情况导致基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险。

本基金作为上市基金, 基金上市期间可能因信息披露等原因导致基金停牌, 投资者在停牌期间不能买卖基金, 从而产生风险; 同时, 可能因上市后交易对手不足导致基金流动性风险。基金份额上市交易后, 基金份额的交易价格与其基金份额净值之间可能发生偏离并出现折溢价交易风险。基金份额的交易价格将受到基金份额净值、市场供求情况、投资人心理预期等多种因素的影响, 造成交易价格出现折价或溢价的情况, 存在投资人不能按照基金份额净值买入或卖出基金份额的风险。

本基金作为开放式基金, 可能遇到利率风险、信用风险、流动性风险、管理风险、会计核算风险、税务风险、交易结算风险、法律风险和衍生品风险等。在特殊市场条件下, 如证券市场的成交量发生急剧萎缩、基金发生巨额赎回以及其他未能预见的特殊情形下, 可能导致基金资产变现困难或变现对证券资产价格造成较大冲击, 发生基金份额净值波动幅度较大、无法进行正常赎回业务、基金不能实现既定的投资决策等风险。

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具, 包括国内依法发行上市的股票、债券及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定), 在正常市场环境下本基金的流动性风险适中。

本基金投资范围包含股指期货, 股指期货采用保证金交易制度, 由于保证金交易具有杠杆性, 当出现不利行情时, 微小的变动就可能会使投资人权益遭受较大损失。同时, 股指期货采用每日无负债结算制度, 如果没有在规定的时间内补足保证金, 按规定将被强制平仓, 可能给基金净值带来重大损失。

本基金投资范围包含国债期货, 国债期货采用保证金交易制度, 由于保证金交易具有杠杆性, 当相应期限国债收益率出现不利变动时, 可能会导致投资人权益遭受较大损失。

国债期货采用每日无负债结算制度, 如果没有在规定的时间内补足保证金, 按规定将被强制平仓, 可能给投资带来重大损失。

本基金投资范围包含中小企业私募债券, 如果投资的中小企业私募债券之债务人出现违约, 或在交易过程中发生交收违约, 或由于中小企业私募债券信用质量降低导致价格下降, 可能造成基金财产损失。此外, 受市场规模及交易活跃程度的影响, 中小企业私募债券可能无法在同一价格水平上进行较大数量的买入或卖出, 存在一定的流动性风险, 从而对基金收益造成影响。

本基金投资范围包含资产支持证券, 可能带来以下风险: 基金所投资的资产支持证券之债务人出现违约, 或在交易过程中发生交收违约, 或由于资产支持证券信用质量降低导致证券价格下降, 造成基金财产损失; 市场利率波动会导致资产支持证券的收益率和价格的变动; 受资产支持证券市场规模及交易活跃程度的影响, 资产支持证券可能无法在同一价格水平上进行较大数量的买入或卖出, 存在一定的流动性风险; 债务人可能会由于利率变化等原因进行提前偿付, 从而使基金资产面临再投资风险。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人所管理的其它基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。投资人在认购 (或申购) 本基金时应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同。

《基金合同》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。基金终止运作的, 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 6 月 15 日, 有关财务和业绩表现数据截止日为 2020 年 3 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 7 月 10 日复核了本次更新的招募说明书。

§ 1 基金管理人

1.1 基金管理人概况

公司名称: 招商基金管理有限公司

注册地址: 深圳市福田区深南大道 7088 号

设立日期: 2002 年 12 月 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。1995 年 4 月加入招商银行股份有限公司，2010 年至 2013 年任招商银行计划财务部副总经理，2013 年至 2015 年任招商银行市场风险管理部总经理，2015 年至 2017 年任招商银行资产负债管理部总经理兼招商银行投资管理部总经理，2017 年 12 月起任招商银行投行与金融市场总部总裁兼招商银行资产管理部总经理。2019 年 4 月起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。现任公司董事长。

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，2015 年 4 月起任公司总经理、董事兼招商资产管理（香港）有限公司董事长，2018 年 7 月起任公司副董事长、总经理兼招商资产管理（香港）有限公司董事长，现任公司副董事长兼招商资产管理（香港）有限公司董事长。

杜凯先生，工商管理硕士。1992 年 8 月至 1993 年 11 月先后在蛇口工业区商业服务公司和蛇口集装箱码头有限公司工作。1993 年 12 月起在招商证券股份有限公司工作，历任证券营业部交易员、市场拓展部副主任、经理助理、负责人，深圳分公司总经理，渠道管理部总经理，财富管理及机构业务总部负责人。2019 年 5 月起兼任招商证券资产管理有限公司董事、招商期货有限公司董事、招商致远资本投资有限公司董事。现任公司董事。

王小青先生，复旦大学经济学博士。1992 年 7 月至 1994 年 9 月在中国农业银行江苏省海安支行工作。1997 年 7 月至 1998 年 5 月在海通证券股份有限公司基金管理部工作。1998

年 5 月至 2004 年 4 月在中国证监会上海专员办工作。2004 年 4 月至 2005 年 4 月在天一证券有限责任公司工作。2005 年 4 月至 2007 年 8 月历任中国人保资产管理有限公司风险管理部副总经理兼组合管理部副总经理、组合管理部副总经理、组合管理部总经理。2007 年 8 月至 2020 年 3 月历任中国人保资产管理有限公司总裁助理、副总裁，党委委员、党委副书记，投委会主任委员等职。2020 年 3 月加入招商基金管理有限公司，现任公司党委书记、董事、总经理。

何玉慧女士，加拿大皇后大学荣誉商学士。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。

张思宁女士，博士研究生。1989 年 8 月至 1992 年 11 月历任中国金融学院国际金融系助教、讲师。1992 年 11 月至 2012 年 6 月历任中国证监会发行监管部副处长、处长、副主任，中国证监会上市公司监管部副主任、正局级副主任，中国证监会创业板部主任。2012 年 6 月至 2014 年 6 月任上海证监局党委书记、局长。2014 年 6 月至 2017 年 4 月历任中国证监会创新部主任、打非局局长。2017 年 5 月起任证通股份有限公司董事长。现任公司独立董事。

邹胜先生，管理学硕士。1992 年 12 月至 1996 年 12 月在深圳证券登记有限公司历任电脑部经理、系统运行部经理。1996 年 12 月至 2017 年 2 月在深圳证券交易所历任系统运行部副总监、武汉中心主任、创业板存管结算部副总监、电脑工程部总监、总经理助理、副总经理，其中 2013 年 4 月至 2017 年 2 月兼任深圳证券通信有限公司董事长。2017 年 3 月起任深圳华锐金融技术股份有限公司董事长。此外，兼任深圳华锐金融技术股份有限公司下属公司上海华锐软件有限公司董事长、华锐分布式（北京）技术有限公司董事长、华锐分布式技术（长沙）有限公司董事长、华锐合胜数字科技（上海）有限公司董事长，同时兼任深圳协和信息技术企业（有限合伙）执行事务合伙人、深圳丰和技术投资企业（有限合伙）执行事务合伙人、深圳平和技术投资企业（有限合伙）执行事务合伙人、深圳泰和技术投资企业（有限合伙）执行事务合伙人，兼任深圳市金融科技协会联席会长，兼任深圳中云信链科技股份有限公司股东、董事。现任公司独立董事。

1.2.2 监事会成员

周语菡女士，硕士研究生，先后就读于中国人民大学及加州州立大学索诺玛分校。自 2008 年 3 月至 2014 年 9 月以及自 2002 年 3 月至 2005 年 9 月任招商局中国基金有限公司执

行董事；自 2008 年 2 月至 2014 年 5 月以及自 2002 年 2 月至 2005 年 7 月任招商局中国投资管理有限公司董事总经理；自 2007 年 9 月至 2013 年 11 月任招商基金独立董事；自 2008 年 5 月至 2014 年 5 月任江西世龙实业股份有限公司独立董事；自 2008 年 4 月至 2013 年 10 月任兴业银行股份有限公司监事。2014 年 7 月起任招商证券股份有限公司监事会主席。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 月加入招商银行股份有限公司。历任招商银行计划资金部经理、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 月起任招商银行零售金融总部副总经理、副总裁。2016 年 2 月起任招商银行零售金融总部副总裁兼招商银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 月起任招商银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，历任项目经理、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，公司成立后先后历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；2014 年 4 月加入招商基金管理有限公司，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

王小青先生，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、首席信息官、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）、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）、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）、招商创业板大盘交易型开放式指数证券投资基金基金经理（管理时间：2020 年 3 月 20 日至今）。

1.2.5 投资决策委员会成员

公司的投资决策委员会由如下成员组成：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 2020 年 3 月 31 日，中国银行已托管 780 只证券投资基金，其中境内基金 735 只，QDII 基金 45 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 场外销售机构

3.1.1.1 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

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

3.1.1.2 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：季平伟 |
| 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：95568 传真：(010) 58092611 联系人：穆婷 |
| 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 |
| 兴业银行股份有限公司 | 注册地址：上海市江宁路 168 号 法定代表人：高建平 电话：95561 传真：(021) 62569070 联系人：李博 |

| | |
|--------------|--|
| 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：陈涇渭 |
| 上海云湾基金销售有限公司 | 注册地址：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路 27 号、明月路 1257 号 1 幢 1 层 103-1、103-2 办公区 办公地址：上海市浦东新区锦康路 308 号陆家嘴世纪金融广场 6 号楼 6 层 法定代表人：冯轶明 电话：021-20538888 传真：021-20539999 联系人：范泽杰 客服电话：400-820-1515 公司网址：www.zhengtongfunds.com |
| 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 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：刘宏莹 电话：010-60833754 传真：010-57762999 客服电话：400-990-8826 公司网址：www.citicsf.com |
| 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 办公地址：上海市静安区新闸路 669 号博华广场 21 层 法定代表人：贺青 联系人：钟伟镇 电话：(021) 38032284 传真：(021) 38670666 客服电话：95521 公司网址：www.gtja.com |
| 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 办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号 |

| | |
|------------|--|
| | <p>国信证券大厦 法人代表人：何如 联系人：李颖 电话：0755-82130833 传真：0755-82133952 客服电话：95536 公司网址：www.guosen.com.cn</p> |
| 招商证券股份有限公司 | <p>注册地址：深圳市福田区福田街道福华一路 111 号 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 联系人：黄婵君 电话：(0755) 82960167 传真：(0755) 82960141 客服电话：95565 公司网址：www.newone.com.cn</p> |
| 广发证券股份有限公司 | <p>注册地址：广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街 2 号 618 室 办公地址：广东省广州天河北路大都会广场 5、18、19、36、38、39、41、42、43、44 楼 法定代表人：孙树明 联系人：黄岚 电话：(020) 87555888 传真：(020) 87555417 客服电话：95575 或 02095575 公司网址：www.gf.com.cn</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 联系人：马静懿 电话：010-60833889 传真：010-60833739 客服电话：95548 公司网址：www.citics.com</p> |
| 兴业证券股份有限公司 | <p>注册地址：福州市湖东路 268 号 办公地址：上海市浦东新区民生路 1199 弄</p> |

| | |
|------------|--|
| | <p>证大五道口广场 1 号楼 22 层 法定代表人：杨华辉 联系人：乔琳雪 电话：(021) 38565547 传真：(021) 38565955 客服电话：95562 或 4008-095-562 公司网址：www.xyzq.com.cn</p> |
| 安信证券股份有限公司 | <p>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 办公地址：深圳市福田区深南大道 2008 号 中国凤凰大厦 1 栋 9 层 法定代表人：黄炎勋 联系人：彭洁联 电话：0755-82558266 传真：0755-82558355 客服电话：95517 公司网址：www.essence.com.cn</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：甘蕾 电话：020-38286026 传真：020-38286588 客服热线：4008888133 公司网址：www.wlzq.com.cn</p> |
| 民生证券股份有限公司 | <p>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 办公地址：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：冯鹤年 电话：010-85127609 传真：010-85127917 联系人：韩秀萍 客服电话：95376 公司网址：www.msyzq.com</p> |
| 国元证券股份有限公司 | <p>注册地址：安徽省合肥市梅山路 18 号 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：俞仕新 联系人：米硕 电话：0551-68167601 传真：0551-62207773 客服电话：95578 公司网站：www.gyzq.com.cn</p> |
| 渤海证券股份有限公司 | <p>注册地址：天津经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室 办公地址：天津市南开区宾水西道 8 号 法定代表人：安志勇 电话：022-28451922 传真：022-28451892 联系人：王星 客服电话：400-651-5988 公司网址：www.ewww.com.cn</p> |
| 中信证券（山东）有限责任公司（原中信万通） | <p>注册地址：青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001 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 联系人：孙秋月 电话：（0532）85022026 传真：（0532）85022605 客服电话：95548 公司网址：sd.citics.com</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：肖林 电话：010-83252185 传真：010-63080978 联系人：付婷 客服电话：95321 公司网址：www.cindasc.com</p> |
| 长城证券股份有限公司 | <p>注册地址：深圳市福田区福田街道金田路 2026 号能源大厦南塔楼 10-19 层 办公地址：深圳福田区深南大道 6088 号特 区报业大厦 14、16、17 楼 法定代表人：曹宏</p> |

| | |
|----------------------|---|
| | <p>联系人: 纪毓灵 电话: 0755-83554486 传真: 0755-83515567 客服电话: 95514 或 4006666888 公司网址: www.cgws.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 联系人: 姚巍 电话: 021-22169502 传真: 021-22169134 客服电话: 95525 公司网址: www.ebscn.com</p> |
| 中信证券华南股份有限公司 (原广州证券) | <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 联系人: 梁微 电话: 020-88836999 传真: 020-88836984 客服电话: 95396 公司网址: www.gzs.com.cn</p> |
| 新时代证券股份有限公司 | <p>注册地址: 北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501 办公地址: 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: 叶顺德 电话: 010-83561146 传真: 010-83561001 联系人: 田芳芳 客户服务电话: 95399 公司网址: www.xsdzq.cn</p> |
| 大同证券有限责任公司 | <p>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 电话: 0351-4130322 传真: 0351-4130322</p> |

| | |
|------------|---|
| | <p>联系人：薛津 客服电话：4007-121212 公司网址：www.dtsbc.com.cn</p> |
| 东莞证券股份有限公司 | <p>注册地址：广东省东莞市莞城区可园南路一号 公司地址：广东省东莞市莞城区可园南路一号金源中心 法定代表人：陈照星 电话：0769-22112151 传真：0769-22115712 联系人：肖浩然 客服电话：95328 公司网址：www.dgzq.com.cn</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 公司网址：www.guodu.com</p> |
| 东海证券股份有限公司 | <p>注册地址：常州市延陵西路23号投资广场18层 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：钱俊文 电话：021-20333333 传真：021-50498825 联系人：王一彦 客服电话：95531 或 400-8888-588 公司网址：www.longone.com.cn</p> |
| 恒泰证券股份有限公司 | <p>注册地址：内蒙古自治区呼和浩特市新城区海拉尔东街满世尚都办公商业综合楼 办公地址：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：熊丽 电话：0471-4972675</p> |

| | |
|------------|--|
| | <p>传真: 0471-4961259 客服电话: 956088 或 400-196-6188 公司网址: www.cnht.com.cn</p> |
| 世纪证券有限责任公司 | <p>注册地址: 深圳市前海深港合作区南山街道桂湾五路 128 号前海深港基金小镇对冲基金中心 406 办公地址: 深圳市福田区深南大道招商银行大厦 40-42 层 法定代表人: 李强 联系人: 王雯 电话: 0755-83199599 传真: 0755-83199545 客服电话: 4008-323000 公司网址: www.cscs.com.cn</p> |
| 华福证券有限责任公司 | <p>注册地址: 福建省福州市鼓楼区鼓屏路 27 号 1#楼 3 层、4 层、5 层 办公地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路 1088 号招商银行大厦 18 楼 法定代表人: 黄金琳 电话: 021-20655183 传真: 021-20655196 联系人: 王虹 客服电话: 95547 公司网址: www.hfzq.com.cn</p> |
| 华龙证券股份有限公司 | <p>注册地址: 兰州市城关区东岗西路 638 号兰州财富中心 21 楼 办公地址: 甘肃省兰州市城关区东岗西路 638 号财富大厦 19 楼 法定代表人: 陈牧原 电话: 0931-4890208、0931-8784656 传真: 0931-4890628 联系人: 范坤、杨力 客服电话: 95368 或 400-6898888 公司网址: www.hlzqgs.com</p> |
| 华鑫证券有限责任公司 | <p>注册地址: 深圳市福田区莲花街道福中社区深南大道 2008 号中国凤凰大厦 1 栋 20C-1 房 办公地址: 上海市肇嘉浜路 750 号 法定代表人: 俞洋 电话: 021-54967552</p> |

| | |
|------------|--|
| | <p>传真: 021-64333051 联系人: 杨莉娟 客服电话: 95323 或 400-109-9918 公司网址: www.cfsc.com.cn</p> |
| 中山证券有限责任公司 | <p>注册地址: 深圳市南山区粤海街道蔚蓝海岸社区创业路 1777 号海信南方大厦 21 层、22 层 办公地址: 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: 林炳城 电话: 0755-82570586 传真: 0755-82940511 联系人: 罗艺琳 客服电话: 95329 公司网址: www.zszq.com</p> |
| 江海证券有限公司 | <p>注册地址: 黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号 办公地址: 黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号 法定代表人: 赵洪波 电话: 0451-87765732 传真: 0451-82287211 联系人: 姜志伟 客服电话: 956007 公司网址: www.jhzq.com.cn</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 公司网址: www.gjzq.com.cn</p> |
| 中天证券股份有限公司 | <p>注册地址: 辽宁省沈阳市和平区光荣街 23 甲 办公地址: 辽宁省沈阳市和平区光荣街 23 甲 法定代表人: 马功勋 联系人: 孙丹华 电话: 024-23255256</p> |

| | |
|------------------------|--|
| | 传真: 024-23255606 客服电话: 024-95346 公司网址: www.iztzq.com |
| 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 |
| 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 |
| 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 电话: (021) 58870011 传真: (021) 68596916 |

| | |
|----------------|--|
| | 联系人: 张茹 |
| 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 |
| 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 |
| 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: 刘宁 |
| 上海陆金所基金销售有限公司 | 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 |
| 北京唐鼎耀华基金销售有限公司 | 注册地址: 北京市延庆县延庆经济开发区百泉街 10 号 2 栋 236 室 法定代表人: 张冠宇 联系人: 孙书慧 电话: 010-85932884 客服电话: 400-819-9868 网址: http://www.tdyhfund.com |
| 上海联泰基金销售有限公司 | 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 |

| | |
|------------------|--|
| 北京虹点基金销售有限公司 | 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 |
| 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 |
| 深圳富济财富管理有限公司 | 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: 刘鹏宇 电话: 0755-83999913 传真: 0755-83999926 联系人: 陈勇军 |
| 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: www.harvestwm.cn |
| 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 |
| 上海汇付金融服务有限公司 | 注册地址: 上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼 法定代表人: 冯修敏 电话: 400-8213-999 联系人: 陈云卉 网址: https://tty.chinapnr.com/ |
| 上海利得基金销售有限公司 | 注册地址: 上海市浦东新区东方路 989 号 |

| | |
|------------------|--|
| | <p>中达广场 2 楼 法定代表人: 李兴春 电话: 400-921-7755 联系人: 王淼晶 网址: www.leadfund.com.cn</p> |
| 奕丰金融服务 (深圳) 有限公司 | <p>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: www.ifastps.com.cn</p> |
| 南京苏宁基金销售有限公司 | <p>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</p> |
| 北京新浪仓石基金销售有限公司 | <p>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: http://www.xincai.com/</p> |
| 北京蛋卷基金销售有限公司 | <p>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/</p> |
| 深圳前海微众银行股份有限公司 | <p>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: http://www.webank.com/</p> |
| 上海万得投资顾问有限公司 | <p>注册地址: 中国 (上海) 自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座 法定代表人: 王延富 电话: 400-821-0203</p> |

| | |
|--------------------|---|
| | <p>联系人: 徐亚丹 网址: http://www.520fund.com.cn/</p> |
| 上海华信证券有限责任公司 | <p>注册地址: 上海浦东新区世纪大道 100 号 环球金融中心 9 楼 法定代表人: 郭林 电话: 400-820-5999 联系人: 徐璐 网址: www.shhxzq.com</p> |
| 天津国美基金销售有限公司 | <p>注册地址: 天津经济技术开发区南港工业 区综合服务区办公楼 D 座二层 202-124 室 法定代表人: 丁东华 电话: 400-111-0889 联系人: 郭宝亮 网址: www.gomefund.com</p> |
| 北京汇成基金销售有限公司 | <p>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: http://www.fundzone.cn</p> |
| 凤凰金信 (银川) 投资管理有限公司 | <p>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: www.fengfd.com</p> |
| 上海基煜基金销售有限公司 | <p>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: www.jiyufund.com.cn</p> |
| 中民财富基金销售 (上海) 有限公司 | <p>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</p> |

| | |
|----------------|---|
| | <p>联系人: 茅旦青 网址: www.cmiwm.com</p> |
| 北京晟视天下投资管理有限公司 | <p>注册地址: 北京市怀柔区九渡河镇黄坎村 735 号 03 室 法定代表人: 蒋煜 电话: 400-818-8866 联系人: 尚瑾 网址: www.gscaifu.com</p> |
| 北京创金启富基金销售有限公司 | <p>注册地址: 北京市西城区民丰胡同 31 号 5 号楼 215A 法定代表人: 梁蓉 电话: 400-6262-818 联系人: 魏素清 网址: www.5irich.com</p> |
| 联储证券有限责任公司 | <p>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 法定代表人: 沙常明 电话: 400-620-6868 联系人: 唐露 网址: http://www.lczq.com/</p> |
| 上海华夏财富投资管理有限公司 | <p>注册地址: 上海市虹口区东大名路 687 号一幢二楼 268 室 法定代表人: 李一梅 电话: 13911253562 联系人: 吴振宇 网址: https://www.amcfortune.com/</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: www.wacaijijin.com</p> |
| 北京肯特瑞基金销售有限公司 | <p>注册地址: 北京市海淀区西三旗建材城中路 12 号 17 号平房 157 法定代表人: 王苏宁 电话: 01089189288 联系人: 邢锦超 网址: http://kenterui.jd.com/</p> |

| | |
|------------------|--|
| | 客服热线: 95118 |
| 通华财富(上海)基金销售有限公司 | 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: www.tonghuafund.com |
| 天津万家财富资产管理有限公司 | 注册地址: 天津自贸区(中心商务区)迎宾大道 1988 号滨海浙商大厦公寓 2-2413 室 法定代表人: 李修辞 电话: 010-59013842 联系人: 王茜蕊 网址: http://www.wanjiawealth.com |
| 上海有鱼基金销售有限公司 | 注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区浦东大道 2123 号 3 层 3E-2655 室 法定代表人: 林琼 客服电话: 4007676298 联系人: 徐海峥 公司网址: www.youyufund.com |
| 腾安基金销售(深圳)有限公司 | 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: https://www.tenganxinxi.com/ |
| 北京恒天明泽基金销售有限公司 | 注册地址: 北京市北京经济技术开发区宏达北路 10 号 5 层 5122 室 法定代表人: 周斌 联系人: 马鹏程 联系电话: 010-57756074 客服电话: 400-786-8868 公司网址: http://www.chtfund.com |
| 济安财富(北京)基金销售有限公司 | 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: http://www.jianfortune.com/ |
| 中欧钱滚滚基金销售(上海)有限公司 | 注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路 333 号 729S 室 法定代表人: 许欣 联系人: 从欣雨 联系电话: 021-68609600-5981 客服电话: 400-700-9700 公司网址: https://www.qiangungun.com/ |
| 民商基金销售(上海)有限公司 | 注册地址: 上海市黄浦区北京东路 666 号 H 区 (东座) 6 楼 A31 室 法定代表人: 贲惠琴 联系人: 董筱爽 联系电话: 18121169537 客服电话: 021-50206003 公司网址: www.msftec.com |
| 五矿证券有限公司 | 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: https://www.wkzq.com.cn/ |

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。

3.1.2 场内销售机构

本基金的场内发售机构为具有基金销售业务资格并经上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的会员单位 (具体名单可在上海证券交易所网站查询)。

本基金认购期结束前获得基金销售业务资格的会员单位也可代理场内基金份额的发售。

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

联系电话: (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：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

执行事务合伙人：付建超

电话：021-6141 8888

传真：021-6335 0003

经办注册会计师：汪芳、侯雯

联系人：汪芳

§ 4 基金名称

招商富时中国 A-H50 指数型证券投资基金（LOF）

§ 5 基金类型

股票型指数证券投资基金

§ 6 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，追求本基金净值增长率与业绩比较基准收益率之间跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争

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%，以实现对标的指数的有效跟踪。

§ 7 投资范围

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股及其备选成份股（包括国内依法发行上市的主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、港股通标的股票）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、企业债、公司债、次级债、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券、可分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可交换债券、中小企业私募债及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、金融衍生工具（包括国债期货、股指期货、权证）及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。

本基金可根据相关法律法规和基金合同的约定，参与融资业务和转融通证券出借业务。

基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%；每个交易日日终在扣除国债期货合约和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金投资于其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

若将来基金管理人推出以富时中国 A-H50 指数 (FTSE China A-H 50 Index) 为标的指数的交易型开放式指数基金 (ETF)，基金管理人在履行适当程序后，本基金可相应调整为该交易型开放式指数基金 (ETF) 的联接基金模式并对投资运作等相关内容进行调整。

如法律法规或中国证监会以后允许基金投资其他品种或变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围或调整上述投资品种的投资比例。

§ 8 投资策略

本基金采用完全复制标的指数的方法，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。

当标的指数编制方法调整、成份股及其权重发生变化（包括成份股发生配送股、增发、临时调入及调出等），或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因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, 从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。

1、大类资产配置

本基金管理人主要按照富时中国 A-H50 指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合, 并根据指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%; 每个交易日日终在扣除国债期货合约和股指期货合约需缴纳的交易保证金后, 现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%, 其中, 现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

2、股票投资策略

(1) 股票投资组合构建

本基金采用完全复制标的指数的方法, 按照标的指数成份股组成及其权重构建股票投资组合。由于跟踪组合构建与标的指数组合构建存在差异, 若出现较为特殊的情况(例如成份股停牌、股票流动性不足以及其他影响指数复制效果的因素), 本基金将采用替代性的方法构建组合, 使得跟踪组合尽可能近似于全复制组合, 以减少对标的指数的跟踪误差。本基金所采用替代法调整的股票组合应符合投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90% 的投资比例限制。

(2) 股票投资组合的调整

本基金所构建的股票投资组合原则上根据富时中国 A-H50 指数成份股组成及其权重的变动而进行相应调整, 本基金还将根据法律法规和基金合同中的投资比例限制、申购赎回变动情况、股票增发因素等变化, 对其进行实时调整, 以保证基金净值增长率与富时中国 A-H50 指数收益率之间的高度正相关和跟踪误差最小化。基金管理人应当自基金合同生效日起 6 个月内使本基金的股票投资组合比例符合基金合同的约定。

1) 定期调整

根据标的指数的调整规则和备选股票的预期, 对股票投资组合及时进行调整。

2) 不定期调整

A. 当成份股发生配送股、增发、临时调入及调出等情况而影响成份股在指数中权重的行为时, 本基金将根据各成份股的权重变化及时调整股票投资组合;

B. 根据本基金的申购和赎回情况, 对股票投资组合进行调整, 从而有效跟踪标的指数;

C. 根据法律、法规和基金合同的规定, 成份股在标的指数中的权重因其他特殊原因发生相应变化的, 本基金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。

3、债券投资策略

本基金进行债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上, 使基金资产得到更加合理有效的利用, 从而提高投资组合收益。为此, 本基金将以市场利率趋势研判为主, 基

于对宏观经济环境的深入研究和基金未来现金流的分析, 在保证流动性和风险可控的前提下, 灵活运用目标久期策略、收益率曲线策略和利差套利策略等对债券品种进行主动投资。

4、权证投资策略

本基金在进行权证投资时, 将通过对权证标的证券基本面的研究, 并结合权证定价模型寻求其合理估值水平, 主要考虑运用的策略包括: 价值挖掘策略、杠杆策略、获利保护策略、价差策略、双向权证策略、买入保护性的认沽权证策略、卖空保护性的认购权证策略等。

基金管理人将充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征, 通过资产配置、品种与类属选择, 谨慎进行投资, 追求较稳定的当期收益。

5、股指期货投资策略

本基金将根据风险管理的原则, 以套期保值为目的, 有选择地投资于流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金在进行股指期货投资时, 首先将基于对证券市场总体行情的判断和组合风险收益的分析确定投资时机, 并根据风险资产投资 (或拟投资) 的总体规模和风险系数决定股指期货的投资比例; 其次, 本基金将在综合考虑证券市场和期货市场运行趋势以及股指期货流动性、收益性、风险特征和估值水平的基础上进行投资品种选择, 以对冲风险资产组合的系统性风险和流动性风险。

6、国债期货投资策略

本基金参与国债期货投资是为了有效控制债券市场的系统性风险, 本基金将根据风险管理原则, 以套期保值为主要目的, 适度运用国债期货提高投资组合运作效率。在国债期货投资过程中, 基金管理人通过对宏观经济和利率市场走势的分析与判断, 并充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险特征, 通过资产配置, 谨慎进行投资, 以调整债券组合的久期, 降低投资组合的整体风险。

7、中小企业私募债券投资策略

中小企业私募债具有票面利率较高、信用风险较大、二级市场流动性较差等特点。因此本基金审慎投资中小企业私募债券。针对市场系统性信用风险, 本基金主要通过调整中小企业私募债类属资产的配置比例, 谋求避险增收。针对非系统性信用风险, 本基金通过分析发债主体的信用水平及个债增信措施, 量化比较判断估值, 精选个债, 谋求避险增收。

另外, 部分中小企业私募债内嵌转股选择权, 本基金将通过深入的基本面分析及定性定量研究, 自下而上地精选个债, 在控制风险的前提下, 谋求内嵌股权潜在的增强收益。

8、资产支持证券投资策略

资产支持类证券的定价受市场利率、流动性、发行条款、标的资产的构成及质量、提前偿还率及其它附加条款等多种因素的影响。本基金将在利率基本面分析、市场流动性分析和信用评级支持的基础上, 辅以与国债、企业债等债券品种的相对价值比较, 审慎投资资产支持证券类资产。

9、融资及转融通投资策略

为更好地实现投资目标，在加强风险防范并遵守审慎原则的前提下，本基金可根据投资管理的需要参与融资、转融通证券出借业务。参与融资业务时，本基金将力争利用融资的杠杆作用，降低因申购造成基金仓位较低带来的跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。参与转融通证券出借业务时，本基金将在分析市场情况、投资者类型与结构、基金历史申赎情况、出借证券流动性情况等因素的基础上，合理确定出借证券的范围、期限和比例。

§ 9 标的指数与业绩比较基准

本基金的标的指数为富时中国 A-H50 指数（FTSE China A-H 50 Index）。

如果标的指数编制单位变更或停止编制、发布或授权，或由其他指数替代，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。

本基金的业绩比较基准为：富时中国 A-H50 指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%。

如果本基金标的指数变化，则业绩比较基准中的标的指数将相应调整。业绩比较基准的调整根据标的指数的变更程序执行。

§ 10 风险收益特征

本基金属于股票型基金，其预期的风险和收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

本基金为指数基金，通过跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的市场相似的风险收益特征。同时，本基金除了投资于 A 股市场优质企业外，还可在法律法规规定的范围内投资港股通标的股票，将面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

§ 11 投资组合报告

招商富时中国 A-H50 指数型证券投资基金 (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 2020 年 3 月 31 日，来源于《招商富时中国 A-H50 指数型证券投资基金 (LOF) 2020 年第 1 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 | 25,640,930.24 | 91.78 |
| | 其中：股票 | 25,640,930.24 | 91.78 |
| 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 | 2,139,541.60 | 7.66 |
| 8 | 其他资产 | 157,818.30 | 0.56 |
| 9 | 合计 | 27,938,290.14 | 100.00 |

注：上表权益投资中通过港股通交易机制投资的港股金额人民币 12,665,438.04 元，占基金总资产比例 45.33%。

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 | 397,797.00 | 1.47 |

| | | | |
|---|------------------|---------------|-------|
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 8,536,584.20 | 31.54 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 326,781.00 | 1.21 |
| E | 建筑业 | 417,911.00 | 1.54 |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 155,892.00 | 0.58 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 224,931.00 | 0.83 |
| J | 金融业 | 2,194,090.00 | 8.11 |
| K | 房地产业 | 472,866.00 | 1.75 |
| L | 租赁和商务服务业 | 248,640.00 | 0.92 |
| 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 | 12,975,492.20 | 47.94 |

2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别 | 公允价值 (人民币元) | 占基金资产净值比例 (%) |
|------|---------------|---------------|
| 工业 | 219,598.66 | 0.81 |
| 信息技术 | 465,859.08 | 1.72 |
| 金融 | 10,181,000.94 | 37.62 |
| 能源 | 499,391.87 | 1.85 |
| 地产业 | 856,762.78 | 3.17 |
| 基础材料 | 442,824.71 | 1.64 |

| | | |
|----|---------------|-------|
| 合计 | 12,665,438.04 | 46.81 |
|----|---------------|-------|

注：以上分类采用全球行业分类标准 (GICS)。

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 (元) | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|---------|--------------|---------------|
| 1 | 02318 | 中国平安 | 44,500 | 3,096,232.35 | 11.44 |
| 2 | 600519 | 贵州茅台 | 2,100 | 2,333,100.00 | 8.62 |
| 3 | 03968 | 招商银行 | 57,500 | 1,838,821.25 | 6.79 |
| 4 | 601166 | 兴业银行 | 64,000 | 1,018,240.00 | 3.76 |
| 5 | 000651 | 格力电器 | 19,500 | 1,017,900.00 | 3.76 |
| 6 | 000858 | 五粮液 | 8,000 | 921,600.00 | 3.41 |
| 7 | 02202 | 万科企业 | 36,700 | 856,762.78 | 3.17 |
| 8 | 600276 | 恒瑞医药 | 9,140 | 841,154.20 | 3.11 |
| 9 | 06030 | 中信证券 | 64,000 | 830,370.56 | 3.07 |
| 10 | 01988 | 民生银行 | 155,000 | 815,751.36 | 3.01 |

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

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

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

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，有选择地投资于流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金在进行股指期货投资时，首先将基于对证券市场总体行情的判断和组合风险收益的分析确定投资时机，并根据风险资产投资（或拟投资）的总体规模和风险系数决定股指期货的投资比例；其次，本基金将在综合考虑证券市场和期货市场运行趋势以及股指期货流动性、收益性、风险特征和估值水平的基础上进行投资品种选择，以对冲风险资产组合的系统性风险和流动性风险。

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

本基金参与国债期货投资是为了有效控制债券市场的系统性风险，本基金将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，适度运用国债期货提高投资组合运作效率。在国债期货投资过程中，基金管理人通过对宏观经济和利率市场走势的分析与判断，并充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置，谨慎进行投资，以调整债券组合的久期，降低投资组合的整体风险。

10.2 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合约。

10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

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民生银行（证券代码 01988）、万科企业（证券代码 02202）、兴业银行（证券代码 601166）、招商银行（证券代码 03968）、中信证券（证券代码 06030）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、民生银行（证券代码 01988）

根据发布的相关公告，该证券发行人在报告期内因违规经营、内部制度不完善、违反反洗钱法、违规提供担保及财务资助、未依法履行职责等原因，多次受到监管机构的处罚。

2、万科企业（证券代码 02202）

根据 2019 年 6 月 26 日发布的相关公告，该证券发行人因涉嫌违反法律法规被国家外汇管理局深圳市分局处以罚款，并警告。

3、兴业银行（证券代码 601166）

根据发布的相关公告，该证券发行人在报告期内因违规经营、未依法履行职责、涉嫌违反法律法规等原因，多次受到监管机构的处罚。

4、招商银行（证券代码 03968）

根据发布的相关公告，该证券发行人在报告期内因违规经营、违反反洗钱法、未依法履行职责、财务会计报告违规等原因，多次受到监管机构的处罚。

5、中信证券（证券代码 06030）

根据 2019 年 4 月 2 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监局给予警示。

根据 2019 年 7 月 16 日发布的相关公告, 该证券发行人因内部制度不完善被中国证监会警示, 并责令改正。

根据 2019 年 11 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广东证监局责令改正。

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 | 36,906.59 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 611.09 |
| 5 | 应收申购款 | 120,300.62 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 157,818.30 |

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

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

§ 12 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：

招商富时 A-H50 指数 A：

| 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 |
|-----------------------|---------|-----------|------------|---------------|--------|--------|
| 2018.12.03-2018.12.31 | 0.10% | 0.01% | -5.50% | 1.08% | 5.60% | -1.07% |
| 2019.01.01-2019.12.31 | 29.27% | 1.07% | 33.64% | 1.07% | -4.37% | 0.00% |
| 2020.01.01-2020.03.31 | -11.24% | 1.96% | -10.92% | 1.87% | -0.32% | 0.09% |
| 自基金成立起至 2020.03.31 | 14.86% | 1.25% | 12.50% | 1.25% | 2.36% | 0.00% |

招商富时 A-H50 指数 C：

| 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 |
|-----------------------|---------|-----------|------------|---------------|--------|--------|
| 2018.12.03-2018.12.31 | 0.07% | 0.01% | -5.50% | 1.08% | 5.57% | -1.07% |
| 2019.01.01-2019.12.31 | 28.75% | 1.07% | 33.64% | 1.07% | -4.89% | 0.00% |
| 2020.01.01-2020.03.31 | -11.31% | 1.96% | -10.92% | 1.87% | -0.39% | 0.09% |
| 自基金成立起至 2020.03.31 | 14.27% | 1.25% | 12.50% | 1.25% | 1.77% | 0.00% |

注：本基金合同生效日为 2018 年 12 月 3 日。

§ 13 基金的费用概览

13.1 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、C类基金份额的销售服务费；
- 4、基金的标的指数许可使用费；
- 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、诉讼费和仲裁费；
- 7、基金份额持有人大会费用；
- 8、基金的证券、期货交易费用；
- 9、基金的银行汇划费用；
- 10、证券账户、期货结算账户开户费用、银行账户维护费用；
- 11、基金的上市费用及年费；
- 12、因投资港股通标的股票而产生的各项合理费用；
- 13、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。

13.2 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 0.8% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

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

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

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 2-5 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 0.15% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 2-5 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、C 类基金份额的销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%。本基金销售服务费将专门用于本基金 C 类基金份额的销售与基金份额持有人服务。销售服务费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构，由登记机构分别支付给各个基金销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

4、基金的标的指数许可使用费

本基金按照基金管理人与标的指数许可方所签订的指数使用许可协议中所规定的指数使用许可费计提方法计提指数使用许可费。基金合同生效后的指数使用许可费从基金财产中列支。本基金的指数使用许可费由许可使用固定费和许可使用基点费组成。许可使用固定费按照 37,640 美元/年收取，许可使用基点费计算方式如下：

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

H 为每日应计提的许可使用基点费

E 为前一日的基金资产净值

许可使用基点费用按日计提，按自然季度支付。

如果指数使用许可协议约定的标的指数许可使用费的计算方法、费率和支付方式等发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算标的指数许可使用费，而无需召开基金份额持有人大会。基金管理人将在更新的招募说明书或其他公告中披露本基金最新适用的标的指数许可使用费费率、具体计算方法及支付方式。

上述“13.1 基金费用的种类”中第 5—13 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。

13.3 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；

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。

13.4 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。

13.5 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、销售服务费率等相关费率。

调整基金管理费率、基金托管费率等费率，须召开基金份额持有人大会审议；调低销售服务费率等其他由基金份额持有人承担的费用，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。

13.6 与基金销售有关的费用

1、申购费用

本基金 A 类基金份额在申购时收取前端申购费用，C 类基金份额不收取申购费用。本基金 A 类基金份额的申购费率按申购金额进行分档。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。

(1) 本基金 A 类基金份额的场外申购费率如下：

| 申购金额 M (元) | 申购费率 |
|------------------|-----------|
| M < 50 万 | 0.80% |
| 50 万 ≤ M < 100 万 | 0.50% |
| M ≥ 100 万 | 每笔 1000 元 |

本基金的 A 类基金份额场外申购费用由场外申购 A 类基金份额的投资人承担，不列入基金资产，用于基金的市场推广、销售、登记等各项费用。

(2) 本基金 A 类基金份额的场内申购费率参照场外收取。

2、赎回费用

(1) 本基金 A 类基金份额的场外赎回费率如下：

| 连续持有时间 (N) | 赎回费率 |
|------------------|-------|
| N < 7 日 | 1.50% |
| 7 日 ≤ N < 30 日 | 0.75% |
| 30 日 ≤ N < 180 日 | 0.50% |

| | |
|-----------|----|
| N ≥ 180 日 | 0% |
|-----------|----|

A 类基金份额的赎回费用由赎回 A 类基金份额的基金份额持有人承担, 在基金份额持有人赎回 A 类基金份额时收取。对持续持有期少于 7 日的投资人收取 1.5% 的赎回费, 对持续持有期少于 30 日且不少于 7 日的投资人收取 0.75% 的赎回费, 并将上述赎回费全额计入基金财产; 对持续持有期少于 3 个月且不少于 30 日的投资人收取 0.5% 的赎回费, 并将赎回费总额的 75% 计入基金财产; 对持续持有期不少于 3 个月但少于 6 个月的投资人收取 0.5% 的赎回费, 并将赎回费总额的 50% 计入基金财产; 对持续持有期不少于 6 个月的投资人, 应当将赎回费总额的 25% 计入基金财产。如法律法规对赎回费的强制性规定发生变动, 本基金将依新法规进行修改, 不需召开持有人大会。

C 类基金份额的场外赎回费率如下:

| 连续持有时间 (N) | 赎回费率 |
|----------------|-------|
| N < 7 日 | 1.50% |
| 7 日 ≤ N < 30 日 | 0.5% |
| 30 日 ≤ N | 0 |

C 类基金份额的赎回费用由赎回 C 类基金份额的基金份额持有人承担, 在 C 类基金份额持有人赎回 C 类基金份额时收取, 并全部归入基金财产。

赎回费用的计算方法: 赎回费用 = 赎回份额 × T 日基金份额净值 × 赎回费率

赎回费用以人民币元为单位, 计算结果保留到小数点后第 2 位, 小数点后第 3 位四舍五入, 由此产生的收益或损失由基金财产承担。

如法律法规对赎回费的强制性规定发生变动, 本基金将依新法规进行修改, 不需召开持有人大会。

(2) 本基金的场内赎回费率及赎回费计入基金财产的比例参照场外收取。

3、转换费用

(1) 各基金间转换的总费用包括转出基金的赎回费和申购补差费两部分。

(2) 每笔转换申请的转出基金端, 收取转出基金的赎回费, 赎回费根据相关法律法规及基金合同、招募说明书的规定收取。

(3) 每笔转换申请的转入基金端, 从申购费率 (费用) 低向高的基金转换时, 收取转入基金与转出基金的申购费用差额; 申购补差费用按照转入基金金额所对应的申购费率 (费用) 档次进行补差计算。从申购费率 (费用) 高向低的基金转换时, 不收取申购补差费用。

(4) 基金转换采取单笔计算法, 投资者当日多次转换的, 单笔计算转换费用。

4、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。

5、基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

6、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定，并不对基金份额持有人权益产生实质性不利影响的情形下根据市场情况制定基金促销计划，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必要手续后，基金管理人可以适当调低本基金的申购费率和赎回费率。

7、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。

8、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。

§ 14 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“基本情况”，更新了“证券投资基金托管情况”。
- 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“基金份额的申购与赎回”部分，更新了“申购、赎回及转换的有关限制”。
- 6、在“基金的投资”部分，更新了“基金投资组合报告”。
- 7、更新了“基金的业绩”。
- 8、在“基金托管协议的内容摘要”部分，更新了“基金托管协议当事人”。
- 9、更新了“其他应披露事项”。

招商基金管理有限公司

2020 年 7 月 15 日