

# 招商中证 1000 指数增强型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告

2021 年 12 月 31 日

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

送出日期：2022 年 1 月 21 日

## § 1 重要提示

基金管理人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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 1 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

|            |   |
|------------|---|
| 基金简称       | 招商中证 1000 指数增强  |
| 基金主代码      | 004194  |
| 交易代码       | 004194  |
| 基金运作方式     | 契约型开放式  |
| 基金合同生效日    | 2017 年 3 月 3 日  |
| 报告期末基金份额总额 | 119,827,604.79 份  |
| 投资目标       | 本基金为增强型股票指数基金，通过数量化的投资方法与严格的投资纪律约束，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%，同时力求实现超越标的指数的业绩表现，谋求基金资产的长期增值。   |
| 投资策略       | 本基金为增强型指数产品，在标的指数成份券权重的基础上根据量化模型对行业配置及个股权重等进行主动调整，力争在控制跟踪误差的基础上获取超越标的指数的投资收益。具体包括：<br>1、股票投资策略；<br>2、债券投资策略；<br>3、股指期货投资策略；<br>4、国债期货投资策略；<br>5、权证投资策略；<br>6、资产支持证券投资策略；<br>7、融资及转融通证券出借业务投资策略； |

|                 |  |                  |
|-----------------|--|------------------|
|                 | 8、存托凭证投资策略。  |                  |
| 业绩比较基准          | 中证 1000 指数收益率×95%+同期银行活期存款利率(税后)×5%                              |                  |
| 风险收益特征          | 本基金为股票指数增强型基金，属于较高风险、较高预期收益的基金品种，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。 |                  |
| 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   |                  |
| 下属分级基金的基金简称     | 招商中证 1000 指数增强 A   | 招商中证 1000 指数增强 C |
| 下属分级基金的交易代码     | 004194   | 004195           |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 65,556,018.07 份  | 54,271,586.72 份  |

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标         | 报告期（2021 年 10 月 1 日—2021 年 12 月 31 日） |                  |
|----------------|---------------------------------------|------------------|
|                | 招商中证 1000 指数增强 A                      | 招商中证 1000 指数增强 C |
| 1.本期已实现收益      | 4,247,349.61                          | 3,161,222.25     |
| 2.本期利润         | 6,118,270.36                          | 4,752,138.10     |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.1182                                | 0.1147           |
| 4.期末基金资产净值     | 107,639,184.42                        | 88,390,129.67    |
| 5.期末基金份额净值     | 1.6419                                | 1.6287           |

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

招商中证 1000 指数增强 A

| 阶段    | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差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    |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|-------|--------|
| 过去三个月 | 8.48%    | 0.96%       | 7.77%      | 1.00%         | 0.71% | -0.04% |
| 过去六个月 | 14.37%   | 1.14%       | 12.45%     | 1.19%         | 1.92% | -0.05% |

|            |         |       |        |       |        |        |
|------------|---------|-------|--------|-------|--------|--------|
| 过去一年       | 28.22%  | 1.10% | 19.52% | 1.15% | 8.70%  | -0.05% |
| 过去三年       | 152.13% | 1.35% | 76.35% | 1.44% | 75.78% | -0.09% |
| 自基金合同生效起至今 | 64.19%  | 1.32% | -4.52% | 1.38% | 68.71% | -0.06% |

招商中证 1000 指数增强 C

| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差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    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月      | 8.38%    | 0.96%       | 7.77%      | 1.00%         | 0.61%  | -0.04% |
| 过去六个月      | 14.15%   | 1.14%       | 12.45%     | 1.19%         | 1.70%  | -0.05% |
| 过去一年       | 27.72%   | 1.10%       | 19.52%     | 1.15%         | 8.20%  | -0.05% |
| 过去三年       | 149.15%  | 1.35%       | 76.35%     | 1.44%         | 72.80% | -0.09% |
| 自基金合同生效起至今 | 62.87%   | 1.32%       | -4.52%     | 1.38%         | 67.39% | -0.06% |

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

招商中证1000指数A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



招商中证1000指数C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务      | 任本基金的基金经理期限 |      | 证券从业年限 | 说明  |
|----|---------|-------------|------|--------|---|
|    |         | 任职日期        | 离任日期 |        |   |
| 蔡振 | 本基金基金经理 | 2021年11月5日  | -    | 7      | 男，硕士。2014年7月加入招商基金管理有限公司量化投资部，曾任ETF专员、研究员，主要从事量化投资策略的研究，现任招商安阳债券型证券投资基金、招商安盈债券型证券投资基金、招商中证1000指数增强型证券投资基金基金经理。  |
| 王平 | 本基金基金经理 | 2017年3月3日   | -    | 15     | 男，管理学硕士，FRM。2006年加入招商基金管理有限公司，曾任投资风险管理部助理数量分析师、风险管理部数量分析师、高级风控经理，主要负责公司投资风险管理、金融工程研究等工作，曾任招商深证100指数证券投资基金、上证消费80交易型开放式指数证券投资基金、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、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、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 |

|  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|
|  |  |  |  | <p>资基金联接基金、招商中证大宗商品股票指数证券投资基金（LOF）、招商央视财经 50 指数证券投资基金、招商中证煤炭等权指数分级证券投资基金、招商中证银行指数分级证券投资基金、招商国证生物医药指数分级证券投资基金、招商中证白酒指数分级证券投资基金、招商稳荣定期开放灵活配置混合型证券投资基金、招商财经大数据策略股票型证券投资基金、招商盛合灵活配置混合型证券投资基金基金经理，现任量化投资部副总监兼招商量化精选股票型发起式证券投资基金、招商沪深 300 指数增强型证券投资基金、招商中证 1000 指数增强型证券投资基金、招商中证 500 指数增强型证券投资基金、招商中证红利交易型开放式指数证券投资基金、招商中证 500 等权重指数增强型证券投资基金、招商中证光伏产业指数型证券投资基金、招商沪深 300 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理。</p> |
|--|--|--|--|--|

注：1、本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告（生效）日期；

2、证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

基金管理人声明：在本报告期内，本基金管理人严格遵守《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》等有关法律法规及其各项实施准则的规定以及本基金的基金合同等基金法律文件的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的前提下，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围以及投资运作符合有关法律法规及基金合同的规定。

## 4.3 公平交易专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

基金管理人已建立较完善的研究方法和投资决策流程，确保各投资组合享有公平的投资决策机会。基金管理人建立了所有组合适用的投资对象备选库，制定明确的备选库建立、维护程序。基金管理人拥有健全的投资授权制度，明确投资决策委员会、投资组合经理等各投

资决策主体的职责和权限划分，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。基金管理人的相关研究成果向内部所有投资组合开放，在投资研究层面不存在各投资组合间不公平的问题。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

基金管理人严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。确因投资组合的投资策略或流动性等需要而发生的同日反向交易，基金管理人要求相关投资组合经理提供决策依据，并留存记录备查，完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合等除外。

本报告期内，本基金各项交易均严格按照相关法律法规、基金合同的有关要求执行，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易不存在成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形。报告期内亦未发现其他有可能导致不公平交易和利益输送的重大异常交易行为。

#### 4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金为指数产品，在标的成份股权重基础上根据量化增强模型对行业配置及个股权重等进行主动调整，力争在控制跟踪误差的基础上获取超越标的指数的投资收益。本基金所使用的模型为多因子量化增强模型，具体分析的因子包含价值指标、成长指标、盈利指标、运营指标、一致预期指标和市场行为指标。模型构建过程中本基金在以上因子的基础上进一步利用统计分析筛选出针对不同市场环境的有效因子。本基金会定期对模型的有效性进行检验和更新，以反映市场趋势的变化。关于本基金的运作，报告期内投资运作较为稳定，股票仓位稳定在 94% 左右。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金 A 类份额净值增长率为 8.48%，同期业绩基准增长率为 7.77%，C 类份额净值增长率为 8.38%，同期业绩基准增长率为 7.77%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金未发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 5 投资组合报告

### 5.1 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              | 183,634,192.74 | 93.07        |
|    | 其中：股票             | 183,634,192.74 | 93.07        |
| 2  | 基金投资              | -              | -            |
| 3  | 固定收益投资            | 72,273.02      | 0.04         |
|    | 其中：债券             | 72,273.02      | 0.04         |
|    | 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      | 12,820,541.48  | 6.50         |
| 8  | 其他资产              | 788,383.44     | 0.40         |
| 9  | 合计                | 197,315,390.68 | 100.00       |

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 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         | 458,707.00     | 0.23         |
| B  | 采矿业              | 4,121,467.00   | 2.10         |
| C  | 制造业              | 115,793,666.56 | 59.07        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 2,675,376.00   | 1.36         |
| E  | 建筑业              | 4,637,151.00   | 2.37         |
| F  | 批发和零售业           | 2,600,361.00   | 1.33         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 2,389,718.00   | 1.22         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -              | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 13,084,645.82  | 6.67         |
| J  | 金融业              | 2,249,099.00   | 1.15         |
| K  | 房地产业             | 1,739,142.40   | 0.89         |
| L  | 租赁和商务服务业         | 2,393,286.00   | 1.22         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 1,445,520.00   | 0.74         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 4,783,636.00   | 2.44         |
| 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               | 158,371,775.78 | 80.79        |



## 5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 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         | 85,695.00     | 0.04         |
| B  | 采矿业              | -             | -            |
| C  | 制造业              | 17,590,209.67 | 8.97         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -             | -            |
| E  | 建筑业              | 8,057.22      | 0.00         |
| F  | 批发和零售业           | 832,236.65    | 0.42         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 3,639.92      | 0.00         |
| H  | 住宿和餐饮业           | 7,628.16      | 0.00         |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 4,398,257.37  | 2.24         |
| J  | 金融业              | 879,657.28    | 0.45         |
| K  | 房地产业             | 22,972.00     | 0.01         |
| L  | 租赁和商务服务业         | -             | -            |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 1,028,626.32  | 0.52         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 27,014.89     | 0.01         |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -             | -            |
| P  | 教育               | -             | -            |
| Q  | 卫生和社会工作          | 367,521.00    | 0.19         |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | 10,901.48     | 0.01         |
| S  | 综合               | -             | -            |
|    | 合计               | 25,262,416.96 | 12.89        |

## 5.2.3 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。

## 5.3 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

### 5.3.1 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

金额单位：人民币元

| 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  | 603599 | 广信股份 | 63,300  | 2,468,700.00 | 1.26         |
| 2  | 600590 | 泰豪科技 | 271,900 | 2,248,613.00 | 1.15         |
| 3  | 603610 | 麒盛科技 | 86,600  | 2,239,476.00 | 1.14         |
| 4  | 002436 | 兴森科技 | 159,000 | 2,226,000.00 | 1.14         |
| 5  | 300171 | 东富龙  | 43,300  | 2,188,382.00 | 1.12         |
| 6  | 300775 | 三角防务 | 43,400  | 2,121,826.00 | 1.08         |

|    |        |      |         |              |      |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 7  | 300110 | 华仁药业 | 426,000 | 2,044,800.00 | 1.04 |
| 8  | 300470 | 中密控股 | 45,700  | 2,041,419.00 | 1.04 |
| 9  | 300747 | 锐科激光 | 33,400  | 1,974,274.00 | 1.01 |
| 10 | 603025 | 大豪科技 | 74,700  | 1,971,333.00 | 1.01 |

### 5.3.2 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

金额单位：人民币元

| 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  | 002709 | 天赐材料 | 11,700  | 1,341,405.00 | 0.68         |
| 2  | 600756 | 浪潮软件 | 85,800  | 1,124,838.00 | 0.57         |
| 3  | 603613 | 国联股份 | 9,520   | 1,023,400.00 | 0.52         |
| 4  | 300217 | 东方电热 | 179,400 | 1,013,610.00 | 0.52         |
| 5  | 600884 | 杉杉股份 | 28,300  | 927,391.00   | 0.47         |

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值（元）   | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|-----------|--------------|
| 1  | 国家债券      | -         | -            |
| 2  | 央行票据      | -         | -            |
| 3  | 金融债券      | -         | -            |
|    | 其中：政策性金融债 | -         | -            |
| 4  | 企业债券      | -         | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | -         | -            |
| 6  | 中期票据      | -         | -            |
| 7  | 可转债（可交换债） | 72,273.02 | 0.04         |
| 8  | 同业存单      | -         | -            |
| 9  | 其他        | -         | -            |
| 10 | 合计        | 72,273.02 | 0.04         |

### 5.5 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称    | 数量（张） | 公允价值（元）   | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|---------|-------|-----------|--------------|
| 1  | 113635 | 升 21 转债 | 380   | 53,200.00 | 0.03         |
| 2  | 113632 | 鹤 21 转债 | 130   | 17,975.10 | 0.01         |
| 3  | 127046 | 百润转债    | 8     | 1,097.92  | 0.00         |

## 5.6 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。

## 5.7 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。

## 5.8 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。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.9.1 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。

### 5.9.2 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。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 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。

### 5.10.2 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。

### 5.10.3 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。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1

报告期内基金投资的前十名证券除泰豪科技（证券代码 600590）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。

根据 2021 年 8 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国家税务总局遵义经济技术开发区税务局上海路税务所处以罚款。

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。

### 5.11.2

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。

### 5.11.3 其他资产构成

金额单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额（元）      |
|----|---------|------------|
| 1  | 存出保证金   | 11,121.33  |
| 2  | 应收证券清算款 | -          |
| 3  | 应收股利    | -          |
| 4  | 应收利息    | 1,399.44   |
| 5  | 应收申购款   | 775,862.67 |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 其他      | -          |
| 8  | 合计      | 788,383.44 |

### 5.11.4 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。

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 5.11.5.1 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。

#### 5.11.5.2 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。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                        | 招商中证 1000 指数增强 A | 招商中证 1000 指数增强 C |
|---------------------------|------------------|------------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 46,062,578.10    | 36,497,946.85    |
| 报告期期间基金总申购份额              | 33,546,025.85    | 32,034,596.40    |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 14,052,585.88    | 14,260,956.53    |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | -                | -                |
| 报告期期末基金份额总额               | 65,556,018.07    | 54,271,586.72    |

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的交易明细。

## § 8 备查文件目录

### 8.1 备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会批准设立招商基金管理有限公司的文件；
- 2、中国证券监督管理委员会批准招商中证 1000 指数增强型证券投资基金设立的文件；
- 3、《招商中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 4、《招商中证 1000 指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 5、《招商中证 1000 指数增强型证券投资基金招募说明书》；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照。

### 8.2 存放地点

招商基金管理有限公司

地址：中国深圳深南大道 7088 号招商银行大厦

### 8.3 查阅方式

上述文件可在招商基金管理有限公司互联网站上查阅,或者在营业时间内到招商基金管理有限公司查阅。

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人招商基金管理有限公司。

客户服务中心电话: 400-887-9555

网址: <http://www.cmfcchina.com>

招商基金管理有限公司

2022 年 1 月 21 日