

# 上证消费 80 交易型开放式指数证券投资基金 2011 年半年度报告

2011年6月30日

基金管理人：招商基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期： 2011年8月26日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人招商基金管理有限公司的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2011 年 8 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2011 年 1 月 1 日起至 2011 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

|  |           |
|--|-----------|
| <b>§1 重要提示及目录</b> .....                      | <b>1</b>  |
| 1.1 重要提示.....                                | 1         |
| 1.2 目录.....                                  | 2         |
| <b>§2 基金简介</b> .....                         | <b>4</b>  |
| 2.1 基金基本情况.....                              | 4         |
| 2.2 基金产品说明.....                              | 4         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人.....                         | 4         |
| 2.4 信息披露方式.....                              | 5         |
| 2.5 其他相关资料.....                              | 5         |
| <b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....                | <b>5</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标.....                         | 5         |
| 3.2 基金净值表现.....                              | 6         |
| <b>§4 管理人报告</b> .....                        | <b>7</b>  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况.....                        | 7         |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....              | 9         |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....                 | 9         |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....             | 9         |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....             | 10        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....                | 10        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....                 | 11        |
| <b>§5 托管人报告</b> .....                        | <b>12</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....                  | 12        |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明..... | 12        |
| 5.3 托管人对半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....      | 12        |
| <b>§6 半年度财务报表(未经审计)</b> .....                | <b>13</b> |
| 6.1 资产负债表.....                               | 13        |
| 6.2 利润表.....                                 | 14        |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....                      | 15        |
| 6.4 报表附注.....                                | 15        |
| <b>§7 投资组合报告</b> .....                       | <b>36</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况.....                          | 36        |
| 7.2 期末按行业分类的股票指数投资组合.....                    | 36        |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....       | 37        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                     | 39        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                    | 41        |
| 7.6 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.....      | 41        |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....   | 41        |
| 7.8 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.....      | 42        |
| 7.9 投资组合报告附注.....                            | 42        |
| <b>§8 基金份额持有人信息</b> .....                    | <b>43</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....                   | 43        |
| 8.2 期末上市基金前十名持有人.....                        | 43        |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况.....             | 43        |

|                                       |           |
|---------------------------------------|-----------|
| <b>§9 开放式基金份额变动</b> .....             | <b>43</b> |
| <b>§10 重大事件揭示</b> .....               | <b>44</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议.....                 | 44        |
| 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动..... | 44        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....      | 44        |
| 10.4 基金投资策略的改变.....                   | 44        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....            | 44        |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....    | 44        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....           | 44        |
| 10.8 其他重大事件.....                      | 45        |
| <b>§11 备查文件目录</b> .....               | <b>46</b> |
| 11.1 备查文件目录.....                      | 46        |
| 11.2 存放地点.....                        | 46        |
| 11.3 查阅方式.....                        | 46        |

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|              |                        |
|--------------|------------------------|
| 基金名称         | 上证消费 80 交易型开放式指数证券投资基金 |
| 基金简称         | 招商上证消费 80ETF           |
| 基金主代码        | 510150                 |
| 交易代码         | 510150                 |
| 基金运作方式       | 契约型开放式(ETF)            |
| 基金合同生效日      | 2010 年 12 月 8 日        |
| 基金管理人        | 招商基金管理有限公司             |
| 基金托管人        | 中国工商银行股份有限公司           |
| 报告期末基金份额总额   | 635,531,550.00 份       |
| 基金合同存续期      | 不定期                    |
| 基金份额上市的证券交易所 | 上海证券交易所                |
| 上市日期         | 2011 年 2 月 25 日        |

### 2.2 基金产品说明

|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。   |
| 投资策略   | 本基金以上证消费 80 指数为标的指数，采用完全复制法，即完全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。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。 |
| 业绩比较基准 | 上证消费 80 指数  |
| 风险收益特征 | 本基金属于股票型基金，预期风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金，在证券投资基金中属于较高风险、较高收益的投资品种；并且本基金为被动式投资的指数基金，采用完全复制法紧密跟踪上证消费 80 指数，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。                            |

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目      |      | 基金管理人            | 基金托管人               |
|---------|------|------------------|---------------------|
| 名称      |      | 招商基金管理有限公司       | 中国工商银行股份有限公司        |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 吴武泽              | 赵会军                 |
|         | 联系电话 | 0755-83196666    | 010-66105799        |
|         | 电子邮箱 | cmf@cmfchina.com | custody@icbc.com.cn |

|        |                           |                   |
|--------|---------------------------|-------------------|
| 客户服务电话 | 400-887-9555              | 95588             |
| 传真     | 0755-83196405             | 010-66105798      |
| 注册地址   | 中国深圳深南大道 7088 号<br>招商银行大厦 | 北京市西城区复兴门内大街 55 号 |
| 办公地址   | 中国深圳深南大道 7088 号<br>招商银行大厦 | 北京市西城区复兴门内大街 55 号 |
| 邮政编码   | 518040                    | 100140            |
| 法定代表人  | 马蔚华                       | 姜建清               |

## 2.4 信息披露方式

|                      |  |
|----------------------|--|
| 本基金选定的信息披露报纸名称       | 中国证券报、上海证券报、证券时报   |
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | <a href="http://www.cmfchina.com">http://www.cmfchina.com</a>                            |
| 基金半年度报告备置地点          | (1) 招商基金管理有限公司<br>地址：中国深圳深南大道 7088 号招商银行大厦<br>(2) 中国工商银行股份有限公司<br>地址：中国北京市西城区复兴门内大街 55 号 |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称             | 办公地址             |
|--------|----------------|------------------|
| 注册登记机构 | 中国证券登记结算有限责任公司 | 北京市西城区太平桥大街 17 号 |

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期( 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日 ) |
|---------------|--|
| 本期已实现收益       | -27,406,025.67                         |
| 本期利润          | -141,482,907.76                        |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.2476                                |
| 本期加权平均净值利润率   | -10.02%                                |
| 本期基金份额净值增长率   | -6.25%                                 |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末( 2011 年 6 月 30 日 )                |
| 期末可供分配利润      | -136,473,960.51                        |
| 期末可供分配基金份额利润  | -0.2147                                |
| 期末基金资产净值      | 1,791,880,537.32                       |
| 期末基金份额净值      | 2.819                                  |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末( 2011 年 6 月 30 日 )                |
| 基金份额累计净值增长率   | -7.09%                                 |

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认（申）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、期末可供分配利润等于未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数；

4、本基金合同于 2010 年 12 月 8 日生效，至 2011 年 6 月 30 日成立未满 1 年。

### 3.2 基金净值表现

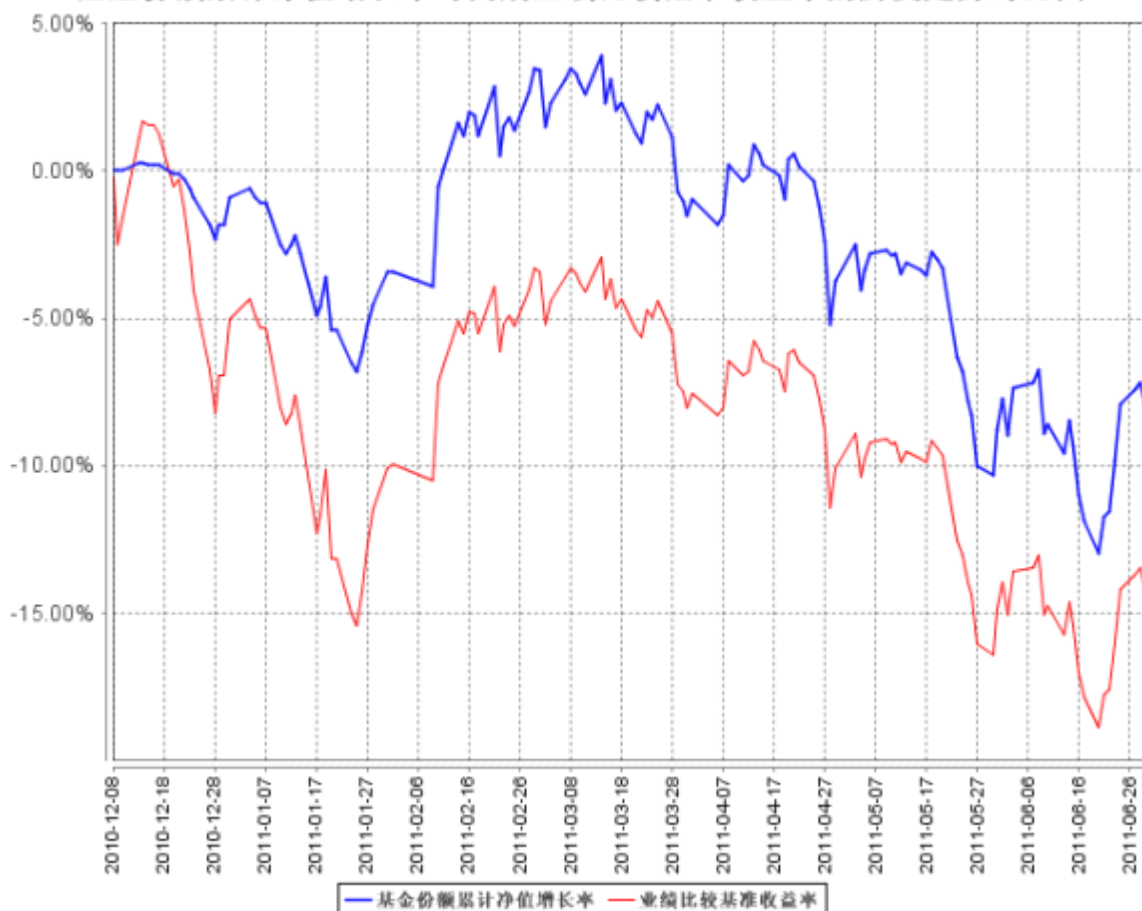
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月      | 1.81%    | 1.28%       | 1.85%      | 1.30%         | -0.04% | -0.02% |
| 过去三个月      | -5.66%   | 1.15%       | -5.72%     | 1.16%         | 0.06%  | -0.01% |
| 过去六个月      | -6.25%   | 1.10%       | -8.72%     | 1.26%         | 2.47%  | -0.16% |
| 自基金合同生效起至今 | -7.09%   | 1.04%       | -13.31%    | 1.29%         | 6.22%  | -0.25% |

注：业绩比较基准收益率 = 上证消费 80 指数收益率。

#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

基金份额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



注：1、根据基金合同第十四部分（四）投资策略的规定：本基金完全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。本基金跟踪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%。本基金于 2010 年 12 月 8 日成立，自基金成立日起 3 个月内为建仓期，截至建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同的规定。

2、本基金合同于 2010 年 12 月 8 日生效，截至本报告期末本基金成立未满一年。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

招商基金管理有限公司于 2002 年 12 月 27 日经中国证监会（2002）100 号文批准设立，是中国第一家中外合资基金管理公司。目前招商基金管理有限公司的股东股权结构为：招商银行股份有限公司持有公司全部股权的 33.4%，招商证券股份有限公司持有公司全部股权的 33.3%，ING Asset Management B.V.（荷兰投资）持有公司全部股权的 33.3%。公司注册资本为 2.1 亿元人民币。



截至 2011 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理二十一共同基金，具体如下：从 2003 年 4 月 28 日起管理招商安泰系列开放式证券投资基金（含招商安泰股票证券投资基金、招商安泰平衡型证券投资基金、招商安泰债券投资基金）；从 2004 年 1 月 14 日起管理招商现金增值开放式证券投资基金；从 2004 年 6 月 1 日起开始管理招商先锋证券投资基金；从 2005 年 11 月 17 日起开始管理招商优质成长股票型证券投资基金（LOF）；从 2006 年 7 月 11 日起开始管理招商安本增利债券型证券投资基金；从 2007 年 3 月 30 日起开始管理招商核心价值混合型证券投资基金；从 2008 年 6 月 19 日起开始管理招商大盘蓝筹股票型证券投资基金；从 2008 年 10 月 22 日起开始管理招商安心收益债券型证券投资基金；从 2009 年 6 月 19 日起开始管理招商行业领先股票型证券投资基金；从 2009 年 12 月 25 日起开始管理招商中小盘精选股票型证券投资基金；从 2010 年 3 月 25 日起开始管理招商全球资源股票型证券投资基金（QDII）；从 2010 年 6 月 22 日起开始管理招商深证 100 指数证券投资基金；从 2010 年 6 月 25 日起开始管理招商信用添利债券型证券投资基金；从 2010 年 12 月 8 日开始管理上证消费 80 交易型开放式指数证券投资基金及招商上证消费 80 交易型开放式指数证券投资基金联接基金；从 2011 年 2 月 11 日开始管理招商标普金砖四国指数证券投资基金（LOF）；从 2011 年 3 月 17 日开始管理招商安瑞进取债券型证券投资基金；从 2011 年 6 月 27 日开始管理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及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。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务   | 任本基金的基金经理（助理）期限 |      | 证券从业年限 | 说明  |
|----|--|-----------------|------|--------|---|
|    |  | 任职日期            | 离任日期 |        |   |
| 王平 | 本基金、本基金的联接基金、招商深证 100 指数证券投资基金及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及其联接基金的基金经理 | 2010 年 12 月 8 日 | -    | 5      | 王平，男，中国国籍，管理学硕士，FRM。2006 年加入招商基金管理有限公司，历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、副总监，主要负责公司投资风险管理、金融工程研究等工作，现任招商深证 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及其联接基金及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及其联接基金基金经理。 |

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》的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遵规守信情况的说明

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》、《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《上证消费 80 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》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、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

基金管理人（以下简称“公司”）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。公司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。公司拥有健全的投资授权制度，明确投资决策委员会、投资总监、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。公司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。公司交易部在报告期内，对所有组合的各条指令，均在中央交易员的统一分派下，本着持有人利益最大化的原则执行了公平交易。

### 4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

报告期内，本组合不存在与本基金管理人旗下的其他投资组合投资风格相似的情况。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

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，未发现重大异常交易行为。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，受国内通胀高企、货币政策不断紧缩的影响，2011 上半年 A 股市场呈现震荡下行的态势，消费 80 指数下跌了 8.72%，从全市场行业来看，其中建材、钢铁、房地产开发、铁路运

输等行业涨幅居前，软件与服务、计算机硬件、医疗器械等行业跌幅居前。

关于本基金的运作，今年以来我们对市场走势保持了相对中性的看法，认为市场震荡的概率较大，前期股票仓位较低，后期逐渐加仓到 99.5%左右的水平，较好的完成了对基准的跟踪，并获取了一定的超额收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 2.819 元，本报告期份额净值增长率为-6.25%，同期业绩比较基准增长率为-8.72%，基金净值表现超越业绩比较基准，幅度为 2.47%。主要原因是在一季度前期消费 80 指数下跌的阶段，本基金维持了相对较低的仓位，获取了部分超额收益，而在中期消费 80 指数的上涨阶段，本基金维持了相对较高的仓位，完成了对基准的跟踪。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

1、上半年全球经济复苏不如预期，下半年复苏的力度预计将会强劲一些，从欧美日等发达经济体的领先指标来看，其下半年的经济增长情况应该会好于上半年。但同时需要密切关注的是欧洲主权债务危机的解决进程，另外，美国国债上限问题及量化宽松货币政策问题还有待进一步跟踪。总体上来说，若欧洲主权债务危机能有效解决，下半年外围环境会好于上半年。

2、国内经济在货币紧缩政策的影响下，实体经济预计会在本年度三季度或四季度达到低点，但经济硬着陆的概率较小。下半年受总需求下滑、输入性通胀压力减小、粮食价格回落等因素的影响通胀水平会逐月回落，因此货币政策进一步紧缩的概率大幅降低。在信贷控制方面应会有保有控，信贷政策对保障房建设项目、水利工程项目及中小企业等可能会有一定的倾斜。因此，我们判断国内经济基本面已经度过最为艰难的一段，下半年将会逐渐好转。

3、2011 年下半年，我们预计大消费行业及节能环保、新一代信息技术、新材料、新能源等行业会有不错的表现，一方面这些行业经过了前期比较充分的调整，另一方面它们确实代表了未来中国经济结构调整的方向，因此，我们相对看好新兴产业及消费产业下半年的表现。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金的估值业务严格按照相关的法律法规、基金合同以及《招商基金管理有限公司基金估值委员会管理制度》进行。基金核算部负责日常的基金资产的估值业务，执行基金估值政策。另外，公司设立由股票投资部、专户资产投资部、固定收益投资部、研究部、风险管理部、基金核算部、法律合规部负责人和基金经理代表组成的估值委员会。公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历。公司估值委员会主要负责制定、修订和完

善基金估值政策和程序，定期评价现有估值政策和程序的适用性及对估值程序执行情况进行监督。

股票投资部、专户资产投资部、固定收益投资部、研究部和基金核算部共同负责关注相关投资品种的动态，评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种；股票投资部、专户资产投资部和固定收益投资部定期审核公允价值的确认和计量；研究部提出合理的数量分析模型对需要进行估值测算或者调整的投资品种进行公允价值定价与计量并定期对估值政策和程序进行评价，以保证其持续适用；基金核算部定期审核估值政策和程序的一致性，并负责与托管行沟通估值调整事项；风险管理部负责估值委员会工作流程中的风险控制；法律合规部负责日常的基金估值调整结果的事后复核监督工作；法律合规部与基金核算部共同负责估值调整事项的信息披露工作。

基金经理代表向估值委员会提供估值参考信息，参与估值政策讨论；对需采用特别估值程序的证券，基金及时启动特别估值程序，由公司估值委员会集体讨论议定特别估值方案并与托管行沟通后由基金核算部具体执行。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。截止报告期末本基金管理人未与任何外部估值定价服务机构签约。

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

根据相关法律法规的规定和基金合同的约定，以及本基金的实际运作情况，本基金报告期无需进行利润分配。本基金已实现尚未分配的可供分配收益部分，将严格按照基金合同的约定适时向投资者予以分配。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2011 年上半年，本基金托管人在对上证消费 80 交易型开放式指数证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2011 年上半年，上证消费 80 交易型开放式指数证券投资基金的管理人——招商基金管理有限公司在上证消费 80 交易型开放式指数证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，上证消费 80 交易型开放式指数证券投资基金未进行利润分配。

### 5.3 托管人对半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对招商基金管理有限公司编制和披露的上证消费 80 交易型开放式指数证券投资基金 2011 年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

中国工商银行股份有限公司

## § 6 半年度财务报表(未经审计)

### 6.1 资产负债表

会计主体：上证消费 80 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产              | 附注号        | 本期末<br>2011年6月30日         | 上年度末<br>2010年12月31日         |
|-----------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| <b>资产：</b>      |            |                           |                             |
| 银行存款            | 6.4.7.1    | 8,343,457.01              | 390,440,018.10              |
| 结算备付金           |            | 2,182.10                  | -                           |
| 存出保证金           |            | 125,000.01                | -                           |
| 交易性金融资产         | 6.4.7.2    | 1,777,530,911.95          | 301,865,607.44              |
| 其中：股票投资         |            | 1,777,530,911.95          | 301,865,607.44              |
| 基金投资            |            | -                         | -                           |
| 债券投资            |            | -                         | -                           |
| 资产支持证券投资        |            | -                         | -                           |
| 衍生金融资产          | 6.4.7.3    | -                         | -                           |
| 买入返售金融资产        | 6.4.7.4    | -                         | -                           |
| 应收证券清算款         |            | 7,510,102.57              | -                           |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 1,721.11                  | 99,090.14                   |
| 应收股利            |            | 88,499.97                 | -                           |
| 应收申购款           |            | -                         | -                           |
| 递延所得税资产         |            | -                         | -                           |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | 30,065.20                 | -                           |
| 资产总计            |            | 1,793,631,939.92          | 692,404,715.68              |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2011年6月30日</b> | <b>上年度末<br/>2010年12月31日</b> |
| <b>负债：</b>      |            |                           |                             |
| 短期借款            |            | -                         | -                           |
| 交易性金融负债         |            | -                         | -                           |
| 衍生金融负债          | 6.4.7.3    | -                         | -                           |
| 卖出回购金融资产款       |            | -                         | -                           |
| 应付证券清算款         |            | 31,703.22                 | 12,516,425.78               |
| 应付赎回款           |            | -                         | -                           |
| 应付管理人报酬         |            | 678,132.42                | 215,063.52                  |
| 应付托管费           |            | 135,626.50                | 43,012.71                   |
| 应付销售服务费         |            | -                         | -                           |
| 应付交易费用          | 6.4.7.7    | 344,913.44                | 256,708.58                  |
| 应交税费            |            | -                         | -                           |
| 应付利息            |            | -                         | -                           |
| 应付利润            |            | -                         | -                           |

|               |          |                  |                |
|---------------|----------|------------------|----------------|
| 递延所得税负债       |          | -                | -              |
| 其他负债          | 6.4.7.8  | 561,027.02       | 50,000.00      |
| 负债合计          |          | 1,751,402.60     | 13,081,210.59  |
| <b>所有者权益：</b> |          |                  |                |
| 实收基金          | 6.4.7.9  | 1,928,354,497.83 | 685,530,280.00 |
| 未分配利润         | 6.4.7.10 | -136,473,960.51  | -6,206,774.91  |
| 所有者权益合计       |          | 1,791,880,537.32 | 679,323,505.09 |
| 负债和所有者权益总计    |          | 1,793,631,939.92 | 692,404,715.68 |

注：报告截止日 2011 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.819 元，基金份额总额 635,531,550.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：上证消费 80 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目                     | 附注号        | 本期<br>2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日 |
|-------------------------|------------|---------------------------------------|
| <b>一、收入</b>             |            | -135,863,884.66                       |
| 1. 利息收入                 |            | 272,039.41                            |
| 其中：存款利息收入               | 6.4.7.11   | 272,039.41                            |
| 债券利息收入                  |            | -                                     |
| 资产支持证券利息收入              |            | -                                     |
| 买入返售金融资产收入              |            | -                                     |
| 其他利息收入                  |            | -                                     |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）       |            | -22,139,612.86                        |
| 其中：股票投资收益               | 6.4.7.12   | -28,965,239.10                        |
| 基金投资收益                  |            | -                                     |
| 债券投资收益                  | 6.4.7.13   | -                                     |
| 资产支持证券投资收益              | 6.4.7.14   | -                                     |
| 衍生工具收益                  | 6.4.7.15   | -                                     |
| 股利收益                    | 6.4.7.16   | 6,825,626.24                          |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）  | 6.4.7.17   | -114,076,882.09                       |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）      |            | -                                     |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）      | 6.4.7.18   | 80,570.88                             |
| <b>二、费用</b>             |            | 5,619,023.10                          |
| 1. 管理人报酬                | 6.4.10.2.1 | 3,404,268.58                          |
| 2. 托管费                  | 6.4.10.2.2 | 680,853.78                            |
| 3. 销售服务费                |            | -                                     |
| 4. 交易费用                 | 6.4.7.19   | 1,135,387.70                          |
| 5. 利息支出                 |            | -                                     |
| 其中：卖出回购金融资产支出           |            | -                                     |
| 6. 其他费用                 | 6.4.7.20   | 398,513.04                            |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号</b> |            | -141,482,907.76                       |

|                          |  |                 |
|--------------------------|--|-----------------|
| 填列)                      |  |                 |
| 减：所得税费用                  |  | -               |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b> |  | -141,482,907.76 |

注：本基金的基金合同于 2010 年 12 月 8 日生效，截止报告期末成立未满一年，上年度无可比期间。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：上证消费 80 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日 |                 |                  |
|--|---------------------------------------|-----------------|------------------|
|  | 实收基金                                  | 未分配利润           | 所有者权益合计          |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 685,530,280.00                        | -6,206,774.91   | 679,323,505.09   |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                     | -141,482,907.76 | -141,482,907.76  |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）      | 1,242,824,217.83                      | 11,215,722.16   | 1,254,039,939.99 |
| 其中：1. 基金申购款                            | 1,986,819,576.09                      | 20,207,603.75   | 2,007,027,179.84 |
| 2. 基金赎回款                               | -743,995,358.26                       | -8,991,881.59   | -752,987,239.85  |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | -                                     | -               | -                |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 1,928,354,497.83                      | -136,473,960.51 | 1,791,880,537.32 |

注：本基金的基金合同于 2010 年 12 月 8 日生效，截止报告期末成立未满一年，上年度无可比期间。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

杨奕（代）

赵生章

李扬

基金管理公司负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

### 6.4 报表附注

#### 6.4.1 基金基本情况



上证消费 80 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人招商基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《上证消费 80 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规的规定,经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2010]1360 号文批准公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限为不定期,首次设立募集基金份额为 685,530,280.00 份,经德勤华永会计师事务所有限公司验证,并出具了编号为德师报(验)字(10)第 0089 号验资报告。《上证消费 80 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)于 2010 年 12 月 8 日正式生效。本基金的基金管理人为招商基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称“中国工商银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及最新公告的《上证消费 80 交易型开放式指数证券投资基金更新的招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括上证消费 80 指数的成份股及其备选成份股、一级市场新发股票、债券、权证以及经中国证监会批准的允许本基金投资的其它金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金投资于上证消费 80 指数的成份股及其备选成份股的资产比例不低于该基金资产净值的 90%。为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于部分非成份股、一级市场新发股票、债券、权证及中国证监会允许基金投资的其他金融工具,该部分资产比例不高于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准采用:上证消费 80 指数。

#### **6.4.2 会计报表的编制基础**

本基金执行财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)、基金合同及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定。

#### **6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金 2011 年 6 月 30 日的财务状况以及 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

#### **6.4.4 重要会计政策和会计估计**

##### **6.4.4.1 会计年度**

本基金的会计年度为公历年度,即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### **6.4.4.2 记账本位币**

本基金以人民币为记账本位币。

### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

#### 1) 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和贷款及应收款项，暂无金融资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的各类应收款项、买入返售金融资产等在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产分类为贷款及应收款项。

#### 2) 金融负债的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

#### 1) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

##### -股票投资

买入股票于交易日按股票的公允价值入账，相关交易费用直接计入当期损益。

因投资者申购本 ETF 基金获得的股票按申购日股票的最新价入账。

因股权分置改革而获得的非流通股股东支付的现金对价，于股权分置实施复牌日冲减股票投资成本；股票持有期间获得的股票股利（包括送红股和公积金转增股本）以及因股权分置改革而获得的股票，于除息日按股权登记日持有的股数及送股或转增比例，计算确定增加的股票数量。

卖出股票于交易日确认股票投资收益。卖出股票按移动加权平均法结转成本。

##### -债券投资

买入债券于交易日按债券的公允价值入账，相关交易费用直接计入当期损益，上述公允价值

不包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息(作为应收利息单独核算)。

配售及认购新发行的分离交易可转债, 于实际取得日按照估值方法对分离交易可转债的认购成本进行分摊, 确认应归属于债券部分的成本。

买入央行票据和零息债券视同到期一次还本付息的附息债券, 根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后, 逐日确认债券利息收入。

卖出债券于交易日确认债券投资收益。卖出债券按移动加权平均法结转成本。

#### -资产支持证券投资

买入资产支持证券于交易日确认为资产支持证券投资。资产支持证券投资成本按取得时资产支持证券的公允价值确认, 取得时发生的相关交易费用直接计入当期损益, 上述公允价值不包含资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息(作为应收利息单独核算)。收到资产支持证券支付的款项时, 区分属于资产支持证券投资本金部分和证券投资收益部分, 并将收到的本金部分冲减资产支持证券投资成本。

卖出资产支持证券于交易日确认资产支持证券投资收益。卖出资产支持证券按移动加权平均法结转成本。

#### -权证投资

权证投资于交易日按公允价值入账, 相关交易费用直接计入当期损益。

获赠的权证(包括配股权证), 在除权日按照持有的股数及获赠比例, 计算确定增加的权证数量, 成本为零。

配售及认购新发行的分离交易可转债而取得的权证, 于实际取得日按照估值方法对分离交易可转债的认购成本进行分摊, 确认应归属于权证部分的成本。

卖出权证于交易日确认权证投资收益。卖出权证的成本按移动加权平均法结转。

#### 2) 贷款及应收款

#### -买入返售金融资产

买入返售金融资产为本基金按照返售协议约定先买入再按固定价格返售证券等金融资产所融

出的资金。

买入返售金融资产按交易日应支付或实际支付的全部价款入账，相关交易费用计入初始成本。买入返售金融资产于返售日按账面余额结转。

### 3) 其他金融负债

#### - 卖出回购金融资产款

卖出回购金融资产款为本基金按照回购协议先卖出再按固定价格买入票据、证券等金融资产所融入的资金。

卖出回购金融资产款于交易日按照应收或实际收到的金额入账，相关交易费用计入初始成本。卖出回购金融资产款于回购日按账面余额结转。

## 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

1) 对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值。

2) 对存在活跃市场的投资品种，如估值日无市价且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

3) 当投资品种不再存在活跃市场，基金管理人估值委员会认为必要时，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。

具体投资品种的估值方法如下：

#### - 股票投资

交易所上市流通的股票以其估值日在证券交易所挂牌的收盘价为公允价值。

由于上市公司送股、转增股、配股和公开增发新股等形成的流通暂时受限制的股票投资，按交易所上市的同一股票的市场交易收盘价作为公允价值。

首次公开发行但未上市的股票按采用估值技术确定的公允价值估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下按成本计量。首次公开发行有明确锁定期的股票，于同一股票上市后按交易所上市的同一股票的市场交易收盘价作为公允价值。

非公开发行有明确锁定期的股票，若在证券交易所上市的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票初始投资成本，以估值日证券交易所上市的同一股票的市场交易收盘价为公允价值；若在证券交易所上市的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票初始投资成本，按交易所上市的同一股票市场交易收盘价为基础进行估值确定其公允价值。

#### -债券投资

交易所上市实行净价交易的债券按估值日证券交易所上市的收盘价为公允价值。交易所上市但未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含债券应收利息后的净价为公允价值。未上市流通的债券按采用估值技术确定的公允价值估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下按成本估值。

全国银行间同业市场交易的债券采用估值技术确定公允价值。

同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，一般按债券所处的市场分别确定公允价值。

#### -资产支持证券投资

可在证券交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券按采用估值技术确定的公允价值估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下按成本估值。

银行间同业市场交易的资产支持证券按采用估值技术确定的公允价值估值。

#### -权证投资

交易所上市流通的权证以其估值日在证券交易所上市的收盘价为公允价值。

首次发行但尚未上市的权证在上市交易前，采用估值技术确定公允价值，如估值技术难以可靠计量，则以成本计量。

配售及认购分离交易可转债所获得的权证自实际取得日至在交易所上市交易前，采用估值技术确定公允价值。如估值技术难以可靠计量，则按成本计量。

因持有股票而享有的配股权，以及停止交易但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值。

如有确凿证据表明按上述方法不能客观反映交易性金融工具的公允价值，基金管理人将根据具体情况与基金托管人商定后确定最能反映公允价值的价格。

本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值确定公允价值计量层级。公允价值计量层级可分为：

第 1 层级：同类资产或负债在活跃市场上（未经调整）的报价；

第 2 层级：直接（比如取自价格）或间接（比如根据价格推算的）可观察到的、除市场报价以外的有关资产或负债的输入值估值；

第 3 层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值（不可观察输入值）估值。

#### **6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### **6.4.4.7 实收基金**

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。

#### **6.4.4.8 损益平准金**

损益平准金指申购、赎回等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配（未分配利润）已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配（未分配利润）。

#### **6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量**

-利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除

适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。

资产支持证券利息收入在持有期内，按资产支持证券的票面价值和预计收益率计算的利息逐日确认资产支持证券利息收入。在收到资产支持证券支付的款项时，其中属于证券投资收益的部分冲减应计利息(若有)后的差额，确认资产支持证券利息收入。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

#### -投资收益

股票投资收益为卖出股票、投资者赎回本 ETF 基金所支付的股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认。

债券投资收益为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认。

资产支持证券投资收益为卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

#### -公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产/负债的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产/负债卖出或到期时转出计入投资收益。

### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值×0.50%的年费率逐日计提。

本基金的基金托管费按前一日基金资产净值×0.10%的年费率逐日计提。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的交易费用发生时按照确定的金额计入交易费用。

卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率逐日计提。

#### **6.4.4.11 基金的收益分配政策**

1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 5%，基金的收益分配比例应当以期末可供分配利润为基准计算。若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2) 本基金收益分配方式采用现金分红；

3) 当基金净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1% 以上时，可进行收益分配；

4) 本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后可能低于面值；

5) 每一基金份额享有同等分配权；

6) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### **6.4.4.12 分部报告**

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策与计量基础一致。

#### **6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计**

本基金本报告期内无其他重要的会计政策和会计估计。

### **6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

#### **6.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金本报告期内无需说明的重大会计政策变更。

#### **6.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期内无需说明的重大会计估计变更。

#### **6.4.5.3 差错更正的说明**

本基金本报告期内无需说明的重大会计差错更正。

#### **6.4.6 税项**



根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102 号文《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2005]107 号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

- 1) 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不缴纳营业税。
- 2) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。
- 3) 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税，上市公司在代扣代缴时，减按 50% 计算应纳税所得额。
- 4) 对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。
- 5) 对于基金从事 A 股买卖，自 2008 年 9 月 19 日起，出让方按 0.10% 的税率缴纳证券(股票)交易印花税，对受让方不再缴纳印花税。
- 6) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免予缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目             | 本期末<br>2011 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 8,343,457.01           |
| 定期存款           | -                      |
| 其中：存款期限 1-3 个月 | -                      |
| 其他存款           | -                      |
| 合计：            | 8,343,457.01           |

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目     | 本期末<br>2011 年 6 月 30 日 |                  |                 |
|--------|------------------------|------------------|-----------------|
|        | 成本                     | 公允价值             | 公允价值变动          |
| 股票     | 1,897,546,131.00       | 1,777,530,911.95 | -120,015,219.05 |
| 债券     | 交易所市场                  | -                | -               |
|        | 银行间市场                  | -                | -               |
|        | 合计                     | -                | -               |
| 资产支持证券 | -                      | -                | -               |
| 基金     | -                      | -                | -               |
| 其他     | -                      | -                | -               |
| 合计     | 1,897,546,131.00       | 1,777,530,911.95 | -120,015,219.05 |

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融工具。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无因买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2011 年 6 月 30 日 |
|------------|------------------------|
| 应收活期存款利息   | 1,720.21               |
| 应收定期存款利息   | -                      |
| 应收其他存款利息   | -                      |
| 应收结算备付金利息  | 0.90                   |
| 应收债券利息     | -                      |
| 应收买入返售证券利息 | -                      |
| 应收申购款利息    | -                      |
| 其他         | -                      |
| 合计         | 1,721.11               |

#### 6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2011 年 6 月 30 日 |
|-------|------------------------|
| 其他应收款 | -                      |
| 待摊费用  | 30,065.20              |
| 合计    | 30,065.20              |

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2011 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 344,913.44             |
| 银行间市场应付交易费用 | -                      |
| 合计          | 344,913.44             |

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2011 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | 250,000.00             |
| 应付赎回费       | -                      |
| 预提费用        | 188,437.29             |
| 指数使用费       | 122,589.73             |
| 合计          | 561,027.02             |

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目                        | 本期<br>2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日 |                  |
|---------------------------|---------------------------------------|------------------|
|                           | 基金份额（份）                               | 账面金额             |
| 上年度末                      | 685,530,280.00                        | 685,530,280.00   |
| 本期申购                      | -                                     | -                |
| 本期赎回(以“-”号填列)             | -                                     | -                |
| 2011 年 2 月 11 日基金拆分/份额折算前 | 685,530,280.00                        | 685,530,280.00   |
| 基金拆分/份额折算变动份额             | -459,598,730.00                       | -                |
| 本期申购                      | 654,800,000.00                        | 1,986,819,576.09 |
| 本期赎回(以“-”号填列)             | -245,200,000.00                       | -743,995,358.26  |
| 本期末                       | 635,531,550.00                        | 1,928,354,497.83 |

注：2011 年 2 月 11 日为上证消费 80 交易型开放式指数证券投资基金的基金份额折算日，基金份

额折算比例为 0.32957540（以四舍五入的方法保留小数点后 8 位），折算前基金份额总额为 685,530,280 份，折算前基金份额净值为 1.001 元，折算后基金份额总额为 225,931,550 份，折算后基金份额净值为 3.037 元。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 项目             | 已实现部分          | 未实现部分           | 未分配利润合计         |
|----------------|----------------|-----------------|-----------------|
| 上年度末           | -268,437.95    | -5,938,336.96   | -6,206,774.91   |
| 本期利润           | -27,406,025.67 | -114,076,882.09 | -141,482,907.76 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 8,599,697.57   | 2,616,024.59    | 11,215,722.16   |
| 其中：基金申购款       | 11,076,637.37  | 9,130,966.38    | 20,207,603.75   |
| 基金赎回款          | -2,476,939.80  | -6,514,941.79   | -8,991,881.59   |
| 本期已分配利润        | -              | -               | -               |
| 本期末            | -19,074,766.05 | -117,399,194.46 | -136,473,960.51 |

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 263,485.93                            |
| 定期存款利息收入  | -                                     |
| 其他存款利息收入  | -                                     |
| 结算备付金利息收入 | 8,553.48                              |
| 其他        | -                                     |
| 合计        | 272,039.41                            |

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目               | 本期<br>2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日 |
|------------------|---------------------------------------|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | -28,034,022.27                        |
| 股票投资收益——赎回差价收入   | -931,216.83                           |
| 股票投资收益——申购差价收入   | -                                     |
| 合计               | -28,965,239.10                        |

##### 6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目         | 本期                              |
|------------|---------------------------------|
|            | 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日 |
| 卖出股票成交总额   | 243,806,199.97                  |
| 减：卖出股票成本总额 | 271,840,222.24                  |
| 买卖股票差价收入   | -28,034,022.27                  |

#### 6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

| 项目          | 本期                              |
|-------------|---------------------------------|
|             | 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日 |
| 赎回基金份额对价总额  | 752,987,239.85                  |
| 减：现金支付赎回款总额 | 2,332,629.85                    |
| 赎回股票成本总额    | 751,585,826.83                  |
| 赎回差价收入      | -931,216.83                     |

#### 6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

#### 6.4.7.14 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

| 项目          | 本期                              |
|-------------|---------------------------------|
|             | 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日 |
| 股票投资产生的股利收益 | 6,825,626.24                    |
| 基金投资产生的股利收益 | -                               |
| 合计          | 6,825,626.24                    |

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期                              |
|------------|---------------------------------|
|            | 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日 |
| 1. 交易性金融资产 | -114,076,882.09                 |

|            |                 |
|------------|-----------------|
| ——股票投资     | -114,076,882.09 |
| ——债券投资     | -               |
| ——资产支持证券投资 | -               |
| 2. 衍生工具    | -               |
| ——权证投资     | -               |
| 3. 其他      | -               |
| 合计         | -114,076,882.09 |

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期                   |
|---------|----------------------|
|         | 2011年1月1日至2011年6月30日 |
| 基金赎回费收入 | -                    |
| 替代损益    | 80,570.88            |
| 合计      | 80,570.88            |

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期                   |
|-----------|----------------------|
|           | 2011年1月1日至2011年6月30日 |
| 交易所市场交易费用 | 1,135,387.70         |
| 银行间市场交易费用 | -                    |
| 合计        | 1,135,387.70         |

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目    | 本期                   |
|-------|----------------------|
|       | 2011年1月1日至2011年6月30日 |
| 审计费用  | 39,671.58            |
| 信息披露费 | 148,765.71           |
| 上市初费  | 22,593.00            |
| 上市年费  | 19,934.80            |
| 银行费用  | 388.00               |
| 指数使用费 | 167,159.95           |
| 合计    | 398,513.04           |

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

本基金无需要披露的或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称      | 与本基金的关系 |
|------------|---------|
| 招商基金管理有限公司 | 基金管理人   |
| 中国工商银行     | 基金托管人   |

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的债券交易。

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

###### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内无应支付关联方的佣金，本报告期末无应支付关联方佣金余额。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2011年1月1日至2011年6月30日 |
|-----------------|----------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 3,404,268.58               |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | -                          |

注：支付基金管理人招商基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值×0.50%的年

费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日基金管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.50\% \div \text{当年天数。}$$

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期                              |  |
|----------------|---------------------------------|--|
|                | 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日 |  |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 680,853.78                      |  |

注：支付基金托管人中国工商银行的基金托管费按前一日基金资产净值×0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% \div \text{当年天数。}$$

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内无与关联方进行的银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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。

##### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称  | 本期                              |            |
|--------|---------------------------------|------------|
|        | 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日 |            |
|        | 期末余额                            | 当期利息收入     |
| 中国工商银行 | 8,343,457.01                    | 263,485.93 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2011 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券



本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

| 股票代码   | 股票名称 | 停牌日期       | 停牌原因        | 期末估值单价 | 复牌日期      | 复牌开盘单价 | 数量(股)   | 期末成本总额        | 期末估值总额        | 备注 |
|--------|------|------------|-------------|--------|-----------|--------|---------|---------------|---------------|----|
| 600216 | 浙江医药 | 2011年6月27日 | 审议非公开发行股票事项 | 31.39  | 2011年7月4日 | 32.60  | 653,612 | 21,272,422.92 | 20,516,880.68 | -  |

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

本基金为指数型基金，本基金的运作涉及的金融工具主要包括股票投资，少量投资于一级市场新发股票、债券、权证及中国证监会允许基金投资的其他金融工具等。与这些金融工具有关的风险，以及本基金的基金管理人管理这些风险所采取的风险管理政策如下所述。

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人从事风险管理的目标是提升本基金风险调整后收益水平，保证本基金的基金资产安全，维护基金份额持有人利益。基于该风险管理目标，本基金的基金管理人风险管理的基本策略是识别和分析本基金运作使本基金面临各种类型的风险，确定适当的风险容忍度，并及时可靠地对各种风险进行监督，将风险控制在限定的范围之内。本基金目前面临的主要风险包括：市场风险、信用风险和流动性风险。与本基金相关的市场风险主要包括市场价格风险和利率风险。

本基金的基金管理人建立了以全面、独立、互相制约以及定性和定量相结合为原则的，监事会、董事会及下设风险控制委员会、督察长、风险管理委员会、法律合规部和风险管理部等多层次的风险管理组织架构体系。

##### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指金融工具的一方到期无法履行约定义务致使本基金遭受损失的风险。本基金的信用风险主要存在于银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资、资产支持证券投资及其他。

本基金的银行存款存放于本基金的基金托管人中国工商银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在证券交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

对于与债券投资、资产支持证券投资等投资品种相关的信用风险，本基金的基金管理人通过对投资品种的信用等级评估来选择适当的投资对象，并限制单个投资品种的持有比例来管理信用风险。附注 6.4.13.2.1 及 6.4.13.2.2 列示了于本报告期末及上年度末本基金所持有的债券投资的信用评级，该信用评级不包括本基金所持有的国债、央行票据、政策性金融债。

#### **6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级的债券投资。

#### **6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资**

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级的债券投资。

#### **6.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指没有足够资金以满足到期债务支付的风险。本基金流动性风险来源于开放式基金每日兑付赎回资金的流动性风险，以及因部分投资品种交易不活跃而出现的变现风险以及因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理价格变现投资的风险。本基金所持有的交易性金融资产分别在证券交易所和银行间同业市场交易，除附注 6.4.12 所披露的流通受限不能自由转让的基金资产外，本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。本基金所持有的金融负债的合约到期日为一年以内且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人在基金合同约定巨额赎回条款，设计了非常情况下赎回资金的处理模式，控制因开放模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。日常流动性风险管理中，本基金的基金管理人每日监控和预测本基金的流动性指标，通过对投资品种的流动性指标来持续地评估、选择、跟踪和控制基金投资的流动性风险。同时，本基金通过预留一定的现金头寸，并且在需要时可通过卖出回购金融资产方式融入短期资金，以缓解流动性风险。

#### **6.4.13.4 市场风险**

##### **6.4.13.4.1 利率风险**

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风

险。本基金持有的利率敏感性资产主要是银行存款、债券投资、资产支持证券投资与买入返售金融资产。本基金的基金管理人日常通过对利率水平的预测、分析收益率曲线及优化利率重新定价日组合等方法对上述利率风险进行管理。

**6.4.13.4.1.1 利率风险敞口**

单位：人民币元

| 本期末<br>2011 年 6 月 30 日   | 1 个月以内         | 1-3<br>个月 | 3 个月<br>-1 年 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息              | 合计               |
|--------------------------|----------------|-----------|--------------|-------|-------|------------------|------------------|
| 资产                       |                |           |              |       |       |                  |                  |
| 银行存款                     | 8,343,457.01   | -         | -            | -     | -     | -                | 8,343,457.01     |
| 结算备付金                    | 2,182.10       | -         | -            | -     | -     | -                | 2,182.10         |
| 存出保证金                    | -              | -         | -            | -     | -     | 125,000.01       | 125,000.01       |
| 交易性金融资产                  | -              | -         | -            | -     | -     | 1,777,530,911.95 | 1,777,530,911.95 |
| 应收证券清算款                  | -              | -         | -            | -     | -     | 7,510,102.57     | 7,510,102.57     |
| 应收利息                     | -              | -         | -            | -     | -     | 1,721.11         | 1,721.11         |
| 应收股利                     | -              | -         | -            | -     | -     | 88,499.97        | 88,499.97        |
| 其他资产                     | -              | -         | -            | -     | -     | 30,065.20        | 30,065.20        |
| 资产总计                     | 8,345,639.11   | -         | -            | -     | -     | 1,785,286,300.81 | 1,793,631,939.92 |
| 负债                       |                |           |              |       |       |                  |                  |
| 应付管理人报酬                  | -              | -         | -            | -     | -     | 678,132.42       | 678,132.42       |
| 应付托管费                    | -              | -         | -            | -     | -     | 135,626.50       | 135,626.50       |
| 应付交易费用                   | -              | -         | -            | -     | -     | 344,913.44       | 344,913.44       |
| 应付证券清算款                  | -              | -         | -            | -     | -     | 31,703.22        | 31,703.22        |
| 其他负债                     | -              | -         | -            | -     | -     | 561,027.02       | 561,027.02       |
| 负债总计                     | -              | -         | -            | -     | -     | 1,751,402.60     | 1,751,402.60     |
| 利率敏感度缺口                  | 8,345,639.11   | -         | -            | -     | -     | 1,783,534,898.21 | 1,791,880,537.32 |
| 上年度末<br>2010 年 12 月 31 日 | 1 个月以内         | 1-3<br>个月 | 3 个月<br>-1 年 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息              | 合计               |
| 资产                       |                |           |              |       |       |                  |                  |
| 银行存款                     | 390,440,018.10 | -         | -            | -     | -     | -                | 390,440,018.10   |
| 交易性金融资产                  | -              | -         | -            | -     | -     | 301,865,607.44   | 301,865,607.44   |
| 应收利息                     | -              | -         | -            | -     | -     | 99,090.14        | 99,090.14        |
| 资产总计                     | 390,440,018.10 | -         | -            | -     | -     | 301,964,697.58   | 692,404,715.68   |
| 负债                       |                |           |              |       |       |                  |                  |
| 应付证券清算款                  | -              | -         | -            | -     | -     | 12,516,425.78    | 12,516,425.78    |
| 应付管理人报酬                  | -              | -         | -            | -     | -     | 215,063.52       | 215,063.52       |
| 应付托管费                    | -              | -         | -            | -     | -     | 43,012.71        | 43,012.71        |
| 应付交易费用                   | -              | -         | -            | -     | -     | 256,708.58       | 256,708.58       |
| 其他负债                     | -              | -         | -            | -     | -     | 50,000.00        | 50,000.00        |
| 负债总计                     | -              | -         | -            | -     | -     | 13,081,210.59    | 13,081,210.59    |
| 利率敏感度缺口                  | 390,440,018.10 | -         | -            | -     | -     | 288,883,486.99   | 679,323,505.09   |

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的利率敏感性资产主要是债券投资。基于本基金产品性质，生息资产占基金资产的比重较小，因此本基金并不存在重大的利率风险。本基金管理人日常通过对利率水平的预测、分析收益率曲线及优化利率重定价日组合等方法对上述利率风险进行管理。

#### 6.4.13.4.2 其他价格风险

其他价格风险是指以交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险，该风险可能与特定投资品种相关，也有可能与整体投资品种相关。本基金所持有的金融资产以公允价值计量，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金在构建资产配置和基金资产投资组合的基础上，通过建立事前和事后跟踪误差的方式，对基金资产的市场价格风险进行管理。

##### 6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目           | 本期末<br>2011年6月30日 |               | 上年度末<br>2010年12月31日 |               |
|--------------|-------------------|---------------|---------------------|---------------|
|              | 公允价值              | 占基金资产净值比例 (%) | 公允价值                | 占基金资产净值比例 (%) |
| 交易性金融资产-股票投资 | 1,777,530,911.95  | 99.20         | 301,865,607.44      | 44.44         |
| 交易性金融资产-基金投资 | -                 | -             | -                   | -             |
| 衍生金融资产-权证投资  | -                 | -             | -                   | -             |
| 其他           | -                 | -             | -                   | -             |
| 合计           | 1,777,530,911.95  | 99.20         | 301,865,607.44      | 44.44         |

##### 6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 1. 若对市场价格敏感的权益性投资的市场价格上升或下降 5% |                              |                     |
|----|--------------------------------|------------------------------|---------------------|
|    | 2. 其他市场变量保持不变                  |                              |                     |
| 分析 | 相关风险变量的变动                      | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位：人民币千元) |                     |
|    |                                | 本期末<br>2011年6月30日            | 上年度末<br>2010年12月31日 |
|    | 1. 权益性投资的市场价格上升 5%             | 88,877                       | 15,093              |

|                    |         |         |
|--------------------|---------|---------|
| 2. 权益性投资的市场价格下降 5% | -88,877 | -15,093 |
|--------------------|---------|---------|

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无需要说明有助于理解和分析会计报表的其他事项。

### § 7 投资组合报告

#### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额               | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|------------------|---------------|
| 1  | 权益投资              | 1,777,530,911.95 | 99.10         |
|    | 其中：股票             | 1,777,530,911.95 | 99.10         |
| 2  | 固定收益投资            | -                | -             |
|    | 其中：债券             | -                | -             |
|    | 资产支持证券            | -                | -             |
| 3  | 金融衍生品投资           | -                | -             |
| 4  | 买入返售金融资产          | -                | -             |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -                | -             |
| 5  | 银行存款和结算备付金合计      | 8,345,639.11     | 0.47          |
| 6  | 其他各项资产            | 7,755,388.86     | 0.43          |
| 7  | 合计                | 1,793,631,939.92 | 100.00        |

注：此处的股票投资项含可退替代款估值增值。

#### 7.2 期末按行业分类的股票指数投资组合

##### 7.2.1 指数投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别        | 公允价值             | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|-------------|------------------|---------------|
| A  | 农、林、牧、渔业    | 91,667,877.93    | 5.12          |
| B  | 采掘业         | -                | -             |
| C  | 制造业         | 1,369,421,791.66 | 76.42         |
| C0 | 食品、饮料       | 451,105,774.20   | 25.17         |
| C1 | 纺织、服装、皮毛    | 107,434,888.68   | 6.00          |
| C2 | 木材、家具       | -                | -             |
| C3 | 造纸、印刷       | -                | -             |
| C4 | 石油、化学、塑胶、塑料 | -                | -             |
| C5 | 电子          | 57,522,213.02    | 3.21          |

|     |                |                  |       |
|-----|----------------|------------------|-------|
| C6  | 金属、非金属         | 34,505,088.52    | 1.93  |
| C7  | 机械、设备、仪表       | 277,031,577.23   | 15.46 |
| C8  | 医药、生物制品        | 441,822,250.01   | 24.66 |
| C99 | 其他制造业          | -                | -     |
| D   | 电力、煤气及水的生产和供应业 | -                | -     |
| E   | 建筑业            | -                | -     |
| F   | 交通运输、仓储业       | -                | -     |
| G   | 信息技术业          | -                | -     |
| H   | 批发和零售贸易        | 141,598,721.71   | 7.90  |
| I   | 金融、保险业         | -                | -     |
| J   | 房地产业           | -                | -     |
| K   | 社会服务业          | 14,778,674.60    | 0.82  |
| L   | 传播与文化产业        | 43,928,860.82    | 2.45  |
| M   | 综合类            | 116,134,985.23   | 6.48  |
|     | 合计             | 1,777,530,911.95 | 99.20 |

## 7.2.2 积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

### 7.3.1 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所有股票投资明细

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           | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 600519 | 贵州茅台 | 860,097   | 182,882,425.11 | 10.21        |
| 2  | 600104 | 上海汽车 | 4,387,289 | 82,217,795.86  | 4.59         |
| 3  | 600887 | 伊利股份 | 3,828,346 | 63,741,960.90  | 3.56         |
| 4  | 600690 | 青岛海尔 | 1,930,973 | 53,970,695.35  | 3.01         |
| 5  | 600518 | 康美药业 | 3,691,656 | 48,582,192.96  | 2.71         |
| 6  | 600276 | 恒瑞医药 | 1,353,487 | 40,564,005.39  | 2.26         |
| 7  | 600132 | 重庆啤酒 | 686,734   | 39,418,531.60  | 2.20         |
| 8  | 600415 | 小商品城 | 3,200,186 | 39,330,285.94  | 2.19         |
| 9  | 600252 | 中恒集团 | 2,097,753 | 39,039,183.33  | 2.18         |
| 10 | 600660 | 福耀玻璃 | 3,330,607 | 34,505,088.52  | 1.93         |
| 11 | 601607 | 上海医药 | 1,891,190 | 31,771,992.00  | 1.77         |
| 12 | 600177 | 雅戈尔  | 3,122,360 | 30,817,693.20  | 1.72         |
| 13 | 600655 | 豫园商城 | 2,735,015 | 29,756,963.20  | 1.66         |
| 14 | 600832 | 东方明珠 | 3,772,695 | 29,238,386.25  | 1.63         |

|    |        |      |           |               |      |
|----|--------|------|-----------|---------------|------|
| 15 | 600600 | 青岛啤酒 | 824,680   | 28,154,575.20 | 1.57 |
| 16 | 600664 | 哈药股份 | 1,767,350 | 27,747,395.00 | 1.55 |
| 17 | 600741 | 华域汽车 | 2,440,533 | 27,163,132.29 | 1.52 |
| 18 | 600694 | 大商股份 | 698,034   | 26,685,839.82 | 1.49 |
| 19 | 600166 | 福田汽车 | 2,980,696 | 25,872,441.28 | 1.44 |
| 20 | 600535 | 天士力  | 611,007   | 25,130,717.91 | 1.40 |
| 21 | 600196 | 复星医药 | 2,238,270 | 24,352,377.60 | 1.36 |
| 22 | 600859 | 王府井  | 600,975   | 24,020,970.75 | 1.34 |
| 23 | 600418 | 江淮汽车 | 2,138,289 | 23,756,390.79 | 1.33 |
| 24 | 600598 | 北大荒  | 1,692,145 | 23,690,030.00 | 1.32 |
| 25 | 600631 | 百联股份 | 1,581,596 | 23,534,148.48 | 1.31 |
| 26 | 600267 | 海正药业 | 619,111   | 23,117,604.74 | 1.29 |
| 27 | 601118 | 海南橡胶 | 1,870,379 | 23,043,069.28 | 1.29 |
| 28 | 600812 | 华北制药 | 1,937,641 | 22,321,624.32 | 1.25 |
| 29 | 600811 | 东方集团 | 3,229,938 | 22,221,973.44 | 1.24 |
| 30 | 600085 | 同仁堂  | 617,316   | 22,013,488.56 | 1.23 |
| 31 | 600809 | 山西汾酒 | 306,230   | 21,451,411.50 | 1.20 |
| 32 | 600079 | 人福医药 | 943,498   | 20,813,565.88 | 1.16 |
| 33 | 600216 | 浙江医药 | 653,612   | 20,516,880.68 | 1.14 |
| 34 | 600062 | 双鹤药业 | 813,782   | 20,173,655.78 | 1.13 |
| 35 | 600066 | 宇通客车 | 865,744   | 20,033,316.16 | 1.12 |
| 36 | 600108 | 亚盛集团 | 3,289,541 | 19,967,513.87 | 1.11 |
| 37 | 600839 | 四川长虹 | 5,922,603 | 19,781,494.02 | 1.10 |
| 38 | 600779 | 水井坊  | 817,271   | 18,323,215.82 | 1.02 |
| 39 | 600060 | 海信电器 | 1,214,727 | 16,301,636.34 | 0.91 |
| 40 | 600199 | 金种子酒 | 930,402   | 15,574,929.48 | 0.87 |
| 41 | 600037 | 歌华有线 | 1,510,657 | 15,393,594.83 | 0.86 |
| 42 | 600220 | 江苏阳光 | 2,953,077 | 14,883,508.08 | 0.83 |
| 43 | 601888 | 中国国旅 | 625,420   | 14,778,674.60 | 0.82 |
| 44 | 600439 | 瑞贝卡  | 1,326,567 | 14,671,831.02 | 0.82 |
| 45 | 600651 | 飞乐音响 | 1,461,306 | 14,452,316.34 | 0.81 |
| 46 | 600251 | 冠农股份 | 427,948   | 14,190,755.68 | 0.79 |
| 47 | 600851 | 海欣股份 | 1,411,876 | 13,991,691.16 | 0.78 |
| 48 | 601718 | 际华集团 | 2,754,870 | 12,672,402.00 | 0.71 |
| 49 | 600872 | 中炬高新 | 1,885,705 | 12,671,937.60 | 0.71 |
| 50 | 600637 | 广电信息 | 1,008,794 | 12,559,485.30 | 0.70 |
| 51 | 600298 | 安琪酵母 | 369,479   | 12,266,702.80 | 0.68 |
| 52 | 600884 | 杉杉股份 | 671,059   | 12,260,247.93 | 0.68 |
| 53 | 601098 | 中南传媒 | 1,286,160 | 12,257,104.80 | 0.68 |

|    |        |      |           |               |      |
|----|--------|------|-----------|---------------|------|
| 54 | 600737 | 中粮屯河 | 1,187,044 | 12,167,201.00 | 0.68 |
| 55 | 600572 | 康恩贝  | 846,906   | 11,975,250.84 | 0.67 |
| 56 | 600351 | 亚宝药业 | 1,504,382 | 11,689,048.14 | 0.65 |
| 57 | 600482 | 风帆股份 | 764,216   | 11,631,367.52 | 0.65 |
| 58 | 600702 | 沱牌舍得 | 559,631   | 11,561,976.46 | 0.65 |
| 59 | 600380 | 健康元  | 1,246,330 | 11,478,699.30 | 0.64 |
| 60 | 600295 | 鄂尔多斯 | 566,485   | 10,927,495.65 | 0.61 |
| 61 | 600866 | 星湖科技 | 1,045,717 | 10,791,799.44 | 0.60 |
| 62 | 600467 | 好当家  | 905,589   | 10,776,509.10 | 0.60 |
| 63 | 600867 | 通化东宝 | 1,283,452 | 10,755,327.76 | 0.60 |
| 64 | 600877 | 中国嘉陵 | 1,305,543 | 10,601,009.16 | 0.59 |
| 65 | 600195 | 中牧股份 | 465,696   | 10,594,584.00 | 0.59 |
| 66 | 600511 | 国药股份 | 684,007   | 10,383,226.26 | 0.58 |
| 67 | 600161 | 天坛生物 | 611,589   | 10,366,433.55 | 0.58 |
| 68 | 600300 | 维维股份 | 1,985,702 | 10,226,365.30 | 0.57 |
| 69 | 600122 | 宏图高科 | 1,609,801 | 10,093,452.27 | 0.56 |
| 70 | 600831 | 广电网络 | 930,891   | 9,941,915.88  | 0.55 |
| 71 | 600086 | 东方金钰 | 501,137   | 9,882,421.64  | 0.55 |
| 72 | 600059 | 古越龙山 | 898,706   | 9,418,438.88  | 0.53 |
| 73 | 600707 | 彩虹股份 | 713,794   | 8,879,597.36  | 0.50 |
| 74 | 600332 | 广州药业 | 560,599   | 8,818,222.27  | 0.49 |
| 75 | 601933 | 永辉超市 | 363,417   | 8,791,057.23  | 0.49 |
| 76 | 600998 | 九州通  | 674,742   | 8,333,063.70  | 0.47 |
| 77 | 600597 | 光明乳业 | 996,943   | 7,905,757.99  | 0.44 |
| 78 | 601777 | 力帆股份 | 684,059   | 7,333,112.48  | 0.41 |
| 79 | 600873 | 梅花集团 | 553,718   | 7,220,482.72  | 0.40 |
| 80 | 601801 | 皖新传媒 | 434,883   | 6,336,245.31  | 0.35 |

### 7.3.2 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所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计买入金额      | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|---------------|-----------------|
| 1  | 600519 | 贵州茅台 | 33,235,814.81 | 4.89            |



|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 2  | 600859 | 王府井  | 24,029,954.64 | 3.54 |
| 3  | 601118 | 海南橡胶 | 22,899,276.15 | 3.37 |
| 4  | 600518 | 康美药业 | 16,855,547.19 | 2.48 |
| 5  | 600887 | 伊利股份 | 15,657,189.79 | 2.30 |
| 6  | 600104 | 上海汽车 | 14,481,093.57 | 2.13 |
| 7  | 600851 | 海欣股份 | 14,012,507.88 | 2.06 |
| 8  | 600132 | 重庆啤酒 | 13,233,139.10 | 1.95 |
| 9  | 600637 | 广电信息 | 12,492,846.65 | 1.84 |
| 10 | 601718 | 际华集团 | 12,432,699.15 | 1.83 |
| 11 | 600298 | 安琪酵母 | 12,382,039.10 | 1.82 |
| 12 | 601098 | 中南传媒 | 12,226,284.44 | 1.80 |
| 13 | 600572 | 康恩贝  | 12,052,533.90 | 1.77 |
| 14 | 600702 | 沱牌舍得 | 11,614,166.84 | 1.71 |
| 15 | 600690 | 青岛海尔 | 11,462,879.18 | 1.69 |
| 16 | 600415 | 小商品城 | 11,433,705.14 | 1.68 |
| 17 | 600276 | 恒瑞医药 | 9,916,177.23  | 1.46 |
| 18 | 600086 | 东方金钰 | 9,900,965.41  | 1.46 |
| 19 | 600664 | 哈药股份 | 9,072,138.84  | 1.34 |
| 20 | 600694 | 大商股份 | 8,887,438.11  | 1.31 |

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，不包括因投资者申购 ETF 基金份额导致的基金组合中股票的增加；

2、“累计买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计卖出金额      | 占期初基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------------|----------------|
| 1  | 600311 | 荣华实业 | 22,107,770.74 | 3.25           |
| 2  | 600519 | 贵州茅台 | 18,057,220.01 | 2.66           |
| 3  | 600880 | 博瑞传播 | 15,557,214.25 | 2.29           |
| 4  | 600653 | 申华控股 | 14,702,817.37 | 2.16           |
| 5  | 600138 | 中青旅  | 13,205,890.39 | 1.94           |
| 6  | 600628 | 新世界  | 11,194,682.14 | 1.65           |
| 7  | 600978 | 宜华木业 | 11,119,114.22 | 1.64           |
| 8  | 600790 | 轻纺城  | 10,272,409.76 | 1.51           |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 9  | 600127 | 金健米业 | 8,952,424.91 | 1.32 |
| 10 | 600006 | 东风汽车 | 8,576,298.49 | 1.26 |
| 11 | 600754 | 锦江股份 | 8,378,960.52 | 1.23 |
| 12 | 600838 | 上海九百 | 8,280,726.43 | 1.22 |
| 13 | 600824 | 益民集团 | 7,765,031.80 | 1.14 |
| 14 | 600825 | 新华传媒 | 6,932,991.00 | 1.02 |
| 15 | 600197 | 伊力特  | 6,896,566.80 | 1.02 |
| 16 | 600359 | 新农开发 | 5,449,583.44 | 0.80 |
| 17 | 600079 | 人福医药 | 4,288,041.18 | 0.63 |
| 18 | 600866 | 星湖科技 | 2,767,068.74 | 0.41 |
| 19 | 600276 | 恒瑞医药 | 2,361,890.32 | 0.35 |
| 20 | 600252 | 中恒集团 | 2,305,369.48 | 0.34 |

注：1、卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，不包括因投资者赎回基金份额导致的基金组合中股票的减少；

2、“累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

|              |                |
|--------------|----------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 615,219,909.58 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 243,806,199.97 |

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，买入卖出均不包括因投资者申购赎回基金份额导致的基金组合中股票的增减；

2、“买入股票成本（成交）总额”、“卖出股票收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.5 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。

#### 7.6 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。

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

#### 7.8 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。

## 7.9 投资组合报告附注

**7.9.1** 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

**7.9.2** 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。

### 7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额           |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存出保证金   | 125,000.01   |
| 2  | 应收证券清算款 | 7,510,102.57 |
| 3  | 应收股利    | 88,499.97    |
| 4  | 应收利息    | 1,721.11     |
| 5  | 应收申购款   | -            |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | 30,065.20    |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 7,755,388.86 |

### 7.9.4 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。

### 7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.9.5.1 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。

#### 7.9.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数 (户) | 户均持有的基金份额  | 持有人结构         |        |               |        |                 |        |
|-----------|------------|---------------|--------|---------------|--------|-----------------|--------|
|           |            | 机构投资者         |        | 个人投资者         |        | 招商上证消费 80ETF 联接 |        |
|           |            | 持有份额          | 占总份额比例 | 持有份额          | 占总份额比例 | 持有份额            | 占总份额比例 |
| 2,107     | 301,628.64 | 47,801,412.00 | 7.52%  | 27,751,260.00 | 4.37%  | 559,978,878.00  | 88.11% |

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

| 序号 | 持有人名称                    | 持有份额 (份)       | 占上市总份额比例 |
|----|--------------------------|----------------|----------|
| 1  | 中国太平洋人寿保险股份有限公司—分红—个人分红  | 9,888,316.00   | 1.5559%  |
| 2  | 太平人寿保险有限公司               | 9,887,920.00   | 1.5559%  |
| 3  | 华安财产保险股份有限公司             | 9,887,920.00   | 1.5559%  |
| 4  | 泰康人寿保险股份有限公司—万能—一个险—万能   | 6,591,837.00   | 1.0372%  |
| 5  | 东海证券—兴业银行—东风 2 号集合资产管理计划 | 3,296,083.00   | 0.5186%  |
| 6  | 光大永明人寿保险有限公司             | 3,295,754.00   | 0.5186%  |
| 7  | 兵器装备集团财务有限责任公司           | 1,648,107.00   | 0.2593%  |
| 8  | 珠海万力达投资有限公司              | 988,726.00     | 0.1556%  |
| 9  | 华润深国投信托有限公司—百利安 1 期      | 855,703.00     | 0.1346%  |
| 10 | 王昆华                      | 809,766.00     | 0.1274%  |
| -  | 招商上证消费 80ETF 联接          | 559,978,878.00 | 88.1119% |

注：前十名持有人为除招商上证消费 80ETF 联接基金以外的前十名持有人。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

本报告期末基金管理人的从业人员未持有本开放式基金。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                                  |                 |
|----------------------------------|-----------------|
| 基金合同生效日 (2010 年 12 月 8 日) 基金份额总额 | 685,530,280.00  |
| 本报告期期初基金份额总额                     | 685,530,280.00  |
| 本报告期基金总申购份额                      | 654,800,000.00  |
| 减：本报告期基金总赎回份额                    | 245,200,000.00  |
| 本报告期基金拆分变动份额                     | -459,598,730.00 |

|             |                |
|-------------|----------------|
| 本报告期末基金份额总额 | 635,531,550.00 |
|-------------|----------------|

注：2011 年 2 月 11 日为上证消费 80 交易型开放式指数证券投资基金的基金份额折算日，基金份额折算比例为 0.32957540（以四舍五入的方法保留小数点后 8 位），折算前基金份额总额为 685,530,280 份，折算前基金份额净值为 1.001 元，折算后基金份额总额为 225,931,550 份，折算后基金份额净值为 3.037 元。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期没有举行基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、根据本基金管理人 2011 年 6 月 16 日的公告，经招商基金管理有限公司第二届董事会第四次会议审议并通过，同意成保良先生辞去公司总经理职务，由公司副总经理杨奕代理履行公司总经理职责。

2、本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金管理人没有受到监管部门的稽查或处罚，亦未收到关于基金管理人的高级管理人员、托管人及其高级管理人员受到监管部门的稽查或处罚的书面通知或文件。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单 | 股票交易 | 应支付该券商的佣金 | 备注 |
|------|-----|------|-----------|----|
|------|-----|------|-----------|----|

|              | 元数量 | 成交金额           | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金         | 占当期佣金总量的比例 |    |
|--------------|-----|----------------|--------------|------------|------------|----|
| 平安证券有限责任公司   | 1   | 858,446,469.55 | 100.00%      | 729,676.60 | 100.00%    | -  |
| 中信建投证券有限责任公司 | 1   | -              | -            | -          | -          | -  |
| 齐鲁证券有限公司     | 1   | -              | -            | -          | -          | 新增 |
| 西藏同信证券有限责任公司 | 1   | -              | -            | -          | -          | 新增 |

注：基金交易佣金根据券商季度综合评分结果给与分配，券商综合评分根据研究报告质量、路演质量、联合调研质量以及销售服务质量打分，从多家服务券商中选取符合法律规范经营的综合能力靠前的券商给与佣金分配，季度评分和佣金分配分别由专人负责。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期无租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况。

### 10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项   | 法定披露方式           | 法定披露日期     |
|----|--|------------------|------------|
| 1  | 招商基金管理有限公司关于旗下基金参加交通银行股份有限公司网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报、证券时报、上海证券报 | 2011年6月30日 |
| 2  | 招商基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告                            | 中国证券报、证券时报、上海证券报 | 2011年6月16日 |
| 3  | 上证消费 80 交易型开放式指数证券投资基金 2011 年第 1 季度报告              | 中国证券报、证券时报、上海证券报 | 2011年4月22日 |
| 4  | 招商基金管理有限公司关于网上直销平台基金易开展网上下单网下转账汇款支付费率优惠的公告         | 中国证券报、证券时报、上海证券报 | 2011年4月18日 |
| 5  | 关于上证消费 80 交易型开放式指数证券投资基金新增安信证券等代销机构为申购赎回代办证券公司的公告  | 中国证券报、证券时报、上海证券报 | 2011年4月8日  |
| 6  | 上证消费 80 交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书                      | 中国证券报、证券时报、上海证券报 | 2011年2月22日 |
| 7  | 关于开放上证消费 80 交易型开放式指数证券投资基金日常申购与赎回业务的公告             | 中国证券报、证券时报、上海证券报 | 2011年2月22日 |
| 8  | 招商基金管理有限公司关于上证消费 80 交易型开放式指数证券投资基金基金份额折算结果的公告      | 中国证券报、证券时报、上海证券报 | 2011年2月15日 |
| 9  | 招商基金管理有限公司关于上证消费 80 交易型开放式指数证券投资基金基金份额折算日的提示性公告    | 中国证券报、证券时报、上海证券报 | 2011年2月9日  |
| 10 | 招商基金管理有限公司关于上证消费 80 交易型开放式指数证券投资基金基金份额折算日的公告       | 中国证券报、证券时报、上海证券报 | 2011年2月1日  |
| 11 | 招商基金管理有限公司关于客户积分活动的公告                              | 中国证券报、证券时报、上海证券报 | 2011年1月29日 |

## § 11 备查文件目录

### 11.1 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上证消费 80 交易型开放式指数证券投资基金设立的文件；
- 3、《上证消费 80 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 4、《上证消费 80 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 5、《上证消费 80 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
- 6、《上证消费 80 交易型开放式指数证券投资基金 2011 年第 1 季度报告》；
- 7、《上证消费 80 交易型开放式指数证券投资基金 2011 年第 2 季度报告》；
- 8、《上证消费 80 交易型开放式指数证券投资基金 2011 年半年度报告》；
- 9、《上证消费 80 交易型开放式指数证券投资基金 2011 年半年度报告摘要》。

### 11.2 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

### 11.3 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  
2011 年 8 月 26 日