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

招商基金管理有限公司
二〇一一年二月二十二日

一、重要声明与提示

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"）上市交易公告书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号〈上市交易公告书的内容与格式〉》和《上海证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，招商基金管理有限公司（以下简称"本基金管理人"）的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，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。本基金托管人中国工商银行股份有限公司保证本报告书中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证券监督管理委员会（以下简称"中国证监会"）和上海证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。凡本上市交易公告书未涉及的有关内容，请投资者详细查阅2010年11月1日刊登在《上海证券报》及招商基金管理有限公司网站（www.cmfchina.com）上的《上证消费80交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》（以下简称"招募说明书"）。

二、基金概览

1、基金二级市场交易简称：消费ETF。
2、二级市场交易代码：510150。
3、基金申购、赎回简称：消费申赎。
4、申购、赎回代码：510151。
5、2011年2月18日基金份额总额：225,931,550份。
6、2011年2月18日基金份额净值：3.070元。
7、本次上市交易份额：225,931,550份。
8、上市交易的证券交易所：上海证券交易所。
9、上市交易日期：2011年2月25日。
10、基金管理人：招商基金管理有限公司。
11、基金托管人：中国工商银行股份有限公司。
12、上市推荐人：招商证券股份有限公司。
13、申购赎回代办券商（以下简称"一级交易商"）：招商证券股份有限公司、平安证券有限责任公司、西藏同信证券有限责任公司、中航证券有限公司、国海证券有限责任公司、齐鲁证券有限公司、华宝证券有限责任公司、山西证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、东海证券有限责任公司、东吴证券股份有限公司、东兴证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、光大证券股份有限公司。

三、基金的募集与上市交易

（一）本基金上市前基金募集情况
1、基金募集申请的核准机构和核准文号：中国证监会证监许可［2010］1360号文。
2、基金运作方式：交易型、开放式。
3、基金合同期限：不定期。
4、发售日期：本基金自2010年11月4日至2010年12月2日通过销售机构公开发售。其中，网下现金认购的日期为2010年11月4日至2010年12月2日，网下股票认购的日期为2010年11月26日至2010年12月2日，网上现金认购的日期为2010年11月30日至2010年12月2日
5、发售价格：1.00 元人民币。
6、发售期限：网下现金认购为21个工作日，网上现金认购为3个工作日，通过发售代理机构和基金管理人进行网下股票认购为5个工作日。
7、发售方式：投资者可选择网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购3种方式。
8、发售机构
（1）直销机构
网下现金认购直销机构：招商基金管理有限公司。
（2）代销机构
本基金网下现金认购和网下股票认购的发售代理机构包括：招商证券、国泰君安证券、华泰联合证券、海通证券、申银万国证券、广发证券、国信证券、安信证券、平安证券、华泰证券、兴业证券、光大证券、长江证券、中银国际证券、中信万通证券、国海证券、广发华福证券、东方证券、中航证券、华宝证券、方正证券、银河证券、华融证券、中信建投证券、中信证券、信达证券等。

本基金网上现金发售代理机构包括具有基金代销业务资格及上海证券交易所会员资格的证券公司：爱建证券有限责任公司、安信证券股份有限公司、渤海证券股份有限公司、财达证券有限责任公司、财富里昂证券有限责任公司、财富证券有限责任公司、财通证券有限责任公司、长城证券有限责任公司、长江证券股份有限公司、大通证券股份有限公司、大同证券经纪有限责任公司、德邦证券有限责任公司、第一创业证券有限责任公司、东北证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、东海证券有限责任公司、东吴证券股份有限公司、东兴证券股份有限公司、东莞证券有限责任公司、方正证券有限责任公司、光大证券股份有限公司、广发华福证券有限责任公司、广发证券股份有限公司、广州证券有限责任公司、国都证券有限责任公司、国海证券有限责任公司、国金证券股份有限公司、国联证券股份有限公司、国盛证券有限责任公司、国泰君安证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、国元证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、恒泰长财证券有限责任公司、恒泰证券股份有限公司、红塔证券股份有限公司、华安证券有限责任公司、华宝证券有限责任公司、华创证券有限责任公司、华林证券有限责任公司、华龙证券有限责任公司、华融证券股份有限公司、华泰联合证券有限责任公司、华泰证券股份有限公司、华西证券有限责任公司、华鑫证券有限责任公司、江海证券有限公司、金元证券股份有限公司、联讯证券有限责任公司、民生证券有限责任公司、南京证券有限责任公司、平安证券有限责任公司、齐鲁证券有限公司、日信证券有限责任公司、瑞银证券有限责任公司、山西证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、申银万国证券股份有限公司、世纪证券有限责任公司、天风证券有限责任公司、天源证券经纪有限公司、万联证券有限责任公司、五矿证券经纪有限责任公司、西部证券股份有限公司、西藏同信证券有限责任公司、西南证券股份有限公司、厦门证券有限公司、湘财证券有限责任公司、新时代证券有限责任公司、信达证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、银泰证券有限责任公司、英大证券有限责任公司、招商证券股份有限公司、浙商证券有限责任公司、中国建银投资证券有限责任公司、中国民族证券有限责任公司、中国银河证券股份有限公司、中航证券有限公司、中山证券有限责任公司、中天证券有限责任公司、中信建投证券有限责任公司、中信金通证券有限责任公司、中信万通证券有限责任公司、中信证券股份有限公司、中银国际证券有限责任公司、中原证券股份有限公司、中国国际金融有限公司等。

（二）基金合同生效

本基金自2010年11月4日起向社会公开募集，截至2010年12月2日募集工作已顺利结束。经德勤华永会计师事务所验资，本次募集的募集金额总额为685,503,886.00元人民币（含募集股票市值）；经基金注册登记机构确认结转为基金份额的认购资金利息共计26,394.00元人民币。上述资金已于2010年12月8日全额划入本基金在基金托管人中国工商银行股份有限公司开立的基金托管专户；所募集股票已于2010年12月7日过户至本基金在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司开立的证券帐户。

本次募集有效认购总户数为4,221户。按照每份基金份额1.00元人民币计算，设立募集期间募集及利息结转的基金份额共计685,530,280.00份，已全部计入基金投资者账户，归基金投资者所有。其中招商基金管理有限公司（以下简称"本公司"或"本基金管理人"）及本公司的基金从业人员没有认购本基金。本次募集期间所发生与本基金有关的律师费、会计师费、信息披露费等费用由基金管理人承担，不另从基金资产中支付。

根据《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》以及《上证消费80交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》、《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"）的有关规定，本基金募集结果符合有关条件，本基金管理人已向中国证监会办理完毕基金备案手续，并于2010年12月8日获书面确认，基金合同自该日起正式生效。自基金合同生效之日起，本基金管理人正式开始管理本基金。

（三）基金份额折算

根据《上证消费80交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《上证消费80交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金管理人确定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（以下简称"本基金"）的基金份额折算日，折算后的基金份额净值与2011年2月11日标的指数收盘值的千分之一基本一致。2011年2月11日，上证消费80指数收盘值为3037.22点，本基金的基金资产净值为686,211,008.32元，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。

根据《上证消费80交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》中约定的基金份额折算公式，基金份额折算比例为0.32957540（以四舍五入的方法保留到小数点后8位），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。

本基金管理人已根据上述折算比例，对各基金份额持有人认购的基金份额进行了折算，并由中国证券登记结算有限责任公司上海分公司于2011年2月14日进行了变更登记。折算后的基金份额保留到整数位（小数点后面的部分舍去，舍去部分计入基金财产）。投资者可以自2011年2月15日起在其上海证券交易所证券账户指定的销售机构查询折算后其持有的基金份额。

本基金管理人和基金托管人已根据折算后的基金份额总额进行了相应的会计处理，并互相核对。

（四）基金上市交易
1、基金上市交易的核准机构和核准文号：上海证券交易所上证债字［2011］30号。
2、上市交易日期：2011年2月25日。
3、上市交易的证券交易所：上海证券交易所。
4、基金二级市场交易简称：消费ETF。
5、二级市场交易代码：510150。
投资者在上海证券交易所各会员单位证券营业部均可参与本基金的二级市场交易。
6、基金申购、赎回简称：消费申赎。
7、申购、赎回代码：510151。
投资者应当在本基金指定的一级交易商办理本基金申购和赎回业务的营业场所或按一级交易商提供的其他方式办理本基金的申购和赎回。

目前本基金的一级交易商包括：招商证券股份有限公司、平安证券有限责任公司、西藏同信证券有限责任公司、中航证券有限公司、国海证券有限责任公司、齐鲁证券有限公司、华宝证券有限责任公司、山西证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、东海证券有限责任公司、东吴证券股份有限公司、东兴证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、光大证券股份有限公司。
8、本次上市交易份额：225,931,550份。
9、未上市交易份额的流通规定：本基金上市交易后，所有的基金份额均可进行交易，不存在未上市交易的基金份额。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

（一）持有人户数

截至2011年2月18日，本基金份额持有人户数为4221户，平均每户持有的基金份额为53,526份。

（二）持有人结构

截至2011年2月18日，本基金份额持有人结构如下：

机构投资者持有的基金份额为153,122,296份，占基金总份额的67.77%；个人投资者持有的基金份额为72,809,254份，占基金总份额的32.23%。

（三）前十名基金份额持有人的情况

截至2011年2月18日，前十名基金份额持有人的情况如下表。

序号	基金份额持有人名称	持有基金份额（份）	占基金总份额的比例
1	中国平安人寿保险股份有限公司－分红－个险分红	19,776,567	8.75%
2	华西证券－建行－华西证券融诚1号集合资产管理计划	16,478,770	7.29%
3	东兴证券－光大－东兴1号优选基金集合资产管理计划	13,183,016	5.83%
4	中国太平洋人寿保险股份有限公司－分红－个人分红	9,888,316	4.38%
5	太平人寿保险有限公司	9,887,920	4.38%
6	华安财产保险股份有限公司	9,887,920	4.38%
7	信达证券－建行－信达满堂红基金优选集合资产管理计划	6,592,298	2.92%
8	泰康人寿保险股份有限公司－万能－个险万能	6,591,837	2.92%
9	中国人民人寿保险股份有限公司－分红－个险分红	6,591,837	2.92%
10	华宝投资有限公司	6,591,508	2.92%

五、基金主要当事人简介

（一）基金管理人
1、名称：招商基金管理有限公司
2、法定代表人：马蔚华
3、总经理：成保良
4、注册资本：2.1亿元人民币
5、注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦28楼
6、批准设立机关及设立批准文号：中国证监会证监基金字［2002］100号
7、工商登记注册的法人营业执照文号：企合国字第000976
8、经营范围：基金管理业务，发起设立基金，中国证监会批准的其他业务
9、股权结构

持股单位	持股占总股本比例
招商银行股份有限公司	33.4%
招商证券股份有限公司	33.3%
ING Asset Management B.V.（荷兰投资）	33.3%

10、内部组织结构及职能

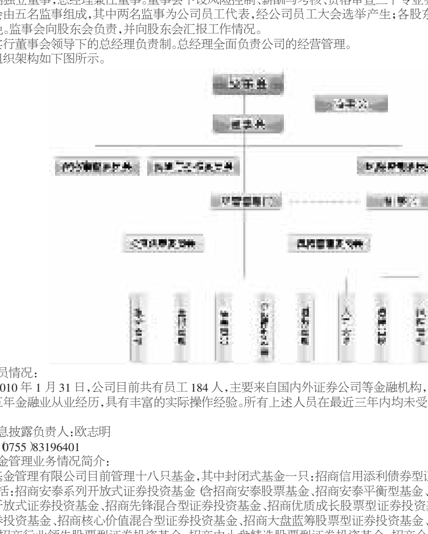
公司按照建立和完善公司治理结构的要求，设立董事会和监事会。

董事会决定公司的战略规划，强化各项审计稽核监察职能，充分保障公司基金持有人的利益，为公司的健康发展提供最佳的资源支持，并且为保护基金持有人的利益提供最佳保障。董事会由七名董事组成，其中三家股东单位分别推荐一名董事及一名独立董事，总经理兼任董事。董事会下设风险控制、薪酬与考核、资格审查三个专业委员会。

监事会由五名监事组成，其中两名监事为公司员工代表，经公司员工大会选举产生；各股东推荐一名监事，由股东会审议其任免。监事会向股东会负责，并向股东会汇报工作情况。

公司实行董事会领导下的总经理负责制。总经理全面负责公司的经营管理。

公司组织架构如下图所示。



11、人员情况：

截至2010年1月31日，公司目前共有员工184人，主要来自国内外证券公司等金融机构，其中有70%以上具有三年证券业或五年金融业从业经历，具有丰富的实际操作经验。所有上述人员在最近三年内均未受到所在单位及有关管理部门的处罚。

12、信息披露负责人：欧志明
电话：（0755）83196401
13、基金管理业务情况简介：

招商基金管理有限公司目前管理十八只基金，其中封闭式基金一只：招商信用添利债券型证券投资基金；开放式基金十七只，包括：招商安泰系列开放式证券投资基金（含招商安泰股票基金、招商安泰平衡型基金、招商安泰债券基金）、招商现金增值开放式证券投资基金、招商先锋证券投资基金、招商优质成长股票型证券投资基金（LOF）、招商安本增利债券型证券投资基金、招商核心价值混合型证券投资基金、招商大盘蓝筹股票型证券投资基金、招商安心收益债券型证券投资基金、招商行业领先股票型证券投资基金、招商中小盘精选股票型证券投资基金、招商全球资源股票型证券投资基金、招商深证100指数证券投资基金、上证消费80交易型开放式证券投资基金、招商上证消费80ETF联接基金、招商标普金砖四国指数证券投资基金（LOF）。

14、本基金基金经理

王平，男，中南大学管理科学与工程专业硕士。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，主要从事投资风险管理、金融工程与数量化投资策略研究、股指期货投资策略研究等工作。王平先生同时兼任我司招商深证100指数证券投资基金的基金经理，管理时间为2009年6月22日至今。

（二）基金托管人
1、名称：中国工商银行股份有限公司
2、住所：北京市西城区复兴门内大街55号
3、办公地址：北京市西城区复兴门内大街55号
4、成立时间：1984年1月1日
5、法定代表人：姜建清
6、批准设立机关和设立文号：国务院《关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》（国发［1983］146号）
7、注册资本：人民币334,018,850,026元
8、存续期间：持续经营
9、联系人：蒋松云
10、联系电话：（010）66105799
11、基金托管部人员情况

截至2010年9月末，中国工商银行资产托管部共有员工121人，平均年龄30岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有硕士以上学位或高级职称。

12、基金托管业务经营情况

作为中国首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国工商银行始终坚持"诚实信用、勤勉尽责"的原则，严格履行着资产托管人的责任和义务，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的业务管理模式、健全的托管业务系统、强大的市场营销能力，为广大基金份额持有人和众多资产管理机构提供安全、高效、专业的托管服务，取得了优异业绩。截至2010年6月，托管证券投资基金165只，其中封闭式9只，开放式156只。至今已形成包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社保基金、企业年金、股权基金、QFII资产、QDII资产等产品在内的托管业务体系。2010年初，中国工商银行凭借在2009年国内外托管领域的杰出表现和品牌影响力，先后被英国《全球托管人》和香港《财资》评选为"2009年度中国最佳托管银行"，本届《财资》评选首次设立了在亚太地区证券和基金服务领域有突出贡献的年度行业领导者奖项，中国工商银行资产托管部周月秋总经理荣获"年度最佳托管银行家"称号，是仅有的两位获奖人之一。自2004年以来，中国工商银行资产托管服务已经获得23项国内外大奖。

（三）上市推荐人
注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层
法定代表人：宫少林
电话：（0755）82960223
传真：（0755）82960141
联系人：林生迎
客户服务电话：95565
网址：www.newone.com.cn
（四）一级交易商

本基金申购赎回代办券商（一级交易商）名单如下：招商证券股份有限公司、平安证券有限责任公司、西藏同信证券有限责任公司、中航证券有限公司、国海证券有限责任公司、齐鲁证券有限公司、华宝证券有限责任公司、山西证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、东海证券有限责任公司、东吴证券股份有限公司、东兴证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、光大证券股份有限公司。

（五）基金验资机构
名称：德勤华永会计师事务所有限公司
注册地址：上海市延安东路222号30楼
法定代表人：卢伯卿
电话：（021）61418888
传真：（021）63350177
经办注册会计师：陶坚、汪芳
联系人：陶坚

六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要请见附件：基金合同摘要。

七、基金财务状况

本基金截止2011年2月18日的资产负债表如下：

资产	本报告期末
资产：	
银行存款	3,735,577.92
结算备付金	2,020,918.64
存出保证金	–
交易性金融资产	688,093,814.36
其中：股票投资	688,093,814.36
债券投资	–
资产支持证券投资	–
基金投资	–
衍生金融资产	–
买入返售金融资产	–
应收证券清算款	–
应收利息	343,623.79
应收股利	–
应收申购款	–
其他资产	–
资产合计	694,193,934.71
负债和所有者权益	
负债：	
短期借款	–
交易性金融负债	–
衍生金融负债	–
卖出回购金融资产款	–
应付证券清算款	–
应付赎回款	–
应付管理人报酬	166,417.13
应付托管费	33,283.43
应付指数使用费	–
应付交易费用	324,278.30
应付税费	–
应付利息	–
应付利润	–
其他负债	127,899.43
负债合计	651,878.29
所有者权益：	–
实收基金	685,530,280.00
未分配利润	8,011,776.42
所有者权益合计	693,542,056.42
负债与持有人权益总计	694,193,934.71

注：1、截至2011年2月18日，基金份额净值3.070元，基金份额总额225,931,550.00份。

2、本报告期自2010年12月8日起至2011年2月18日止。本基金合同于2010年12月8日生效，截至本报告期末本基金合同生效未满半年。

八、基金投资组合

截止2011年2月18日，本基金的投资组合情况如下：

（一）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	688,093,814.36	99.12
	其中：股票	688,093,814.36	99.12
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	5,756,496.56	0.83
6	其他资产	343,623.79	0.05
7	合计	694,193,934.71	100.00

（二）按行业分类的股票投资组合

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	28,366,856.10	4.09
B	采掘业	–	–
C	制造业	504,408,141.48	72.73
C0	食品、饮料	172,250,563.70	24.84
C1	纺织、服装、皮毛	33,782,221.33	4.87
C2	木材、家具	4,584,465.99	0.66
C3	造纸、印刷	–	–
C4	石油、化学、塑胶、塑料	–	–
C5	电子	11,519,867.63	1.66
C6	金属、非金属	13,986,507.36	2.02
C7	机械、设备、仪表	107,764,667.40	15.54
C8	医药、生物制品	160,519,848.07	23.14
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	4,227,428.96	0.61
H	批发和零售贸易	50,762,415.78	7.32
I	金融、保险业	–	–
J	房地产业	–	–
K	社会服务业	14,936,457.28	2.15
L	传播与文化产业	18,683,990.34	2.69
M	综合类	66,708,524.42	9.62
	合计	688,093,814.36	99.21

（三）按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

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	600519	贵州茅台	326,175	59,357,326.50	8.56
2	600104	上海汽车	1,584,992	29,243,102.40	4.22
3	600887	伊利股份	682,928	24,469,310.24	3.53
4	600518	康美药业	1,347,221	20,989,703.18	3.03
5	600690	青岛海尔	691,612	19,600,284.08	2.83
6	600415	小商品城	587,746	18,331,797.74	2.64
7	600276	恒瑞医药	323,260	16,654,355.20	2.40
8	600132	重庆啤酒	245,344	15,697,109.12	2.26
9	600664	哈药股份	630,705	14,386,381.05	2.07
10	601607	上海医药	691,157	14,106,514.37	2.03

（四）按券种分类的债券投资组合
本基金本报告期末未持有债券。
（五）按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细
本基金本报告期末未持有债券。
（六）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。
（七）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。
（八）投资组合报告附注
1、报告期内基金投资的前十名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。
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。
3、其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	–
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	343,623.79
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	343,623.79

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、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	600104	上海汽车	29,243,102.40	4.22	重大资产重组

九、重大事件揭示

以2011年2月11日为基金份额折算日，本基金进行了基金份额折算，具体内容详见第三章的"（三）基金份额折算"。

十、基金管理人承诺

基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出以下承诺：
（一）严格遵守《基金法》及其他法律法规、基金合同的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。
（二）真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件，披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息，并接受中国证监会、证券交易所的监督管理。
（三）在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后，将及时予以公开澄清。

十一、基金托管人承诺

基金托管人就本基金上市交易后履行托管人职责做出如下承诺：
（一）严格遵守《基金法》及其他法律法规、《基金合同》的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则安全保管基金财产。
（二）根据《基金法》、《运作办法》、《基金合同》和有关法律法规的规定，对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金申购赎回对价的复核、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金费用的支付、基金申购与赎回过程中的组合证券交割、现金替代和现金差额的划付、基金收益分配、基金的融资条件等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

基金托管人发现基金管理人的违反《基金法》、《运作办法》、《基金合同》和有关法律法规规定的行为，将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后将及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人将报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人有重大违规行为，将立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

十二、基金上市推荐人意见

本基金上市推荐人为招商证券股份有限公司。
上市推荐人就基金上市交易事宜出具如下意见：
1、本基金上市符合《基金法》、《上海证券交易所证券投资基金上市规则》规定的相关条件；
2、基金上市文件真实、准确、完整，符合相关规定要求，文件内所载的资料均经过核实。

十三、备查文件目录

投资者如果需了解更详细的信息，可向基金管理人、基金托管人或销售代理人申请查阅以下文件：
1、中国证监会核准上证消费80交易型开放式指数证券投资基金设立的文件
2、《上证消费80交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

（下转D23版）

招商基金管理有限公司关于增加东兴证券股份有限公司为旗下相关基金代销机构的公告

根据招商基金管理有限公司（以下简称"本公司"）与东兴证券股份有限公司（以下简称"东兴证券"）签署的《开放式基金销售和服务代理协议》及《开放式证券投资基金销售代理补充协议》，自2011年2月23日起东兴证券开始代理招商安泰股票证券投资基金（代码：217001）、招商安泰平衡型证券投资基金（代码：217002）、招商安泰债券证券投资基金A类（代码：217003）、招商安泰债券证券投资基金B类（代码：217203）、招商现金增值开放式证券投资基金A（代码：217004）、招商现金增值开放式证券投资基金B（代码：217014）、招商先锋证券投资基金（代码：217005）、招商优质成长股票型证券投资基金（前端）（代码：161706）、招商安本增利债券型证券投资基金（代码：217008）、招商核心价值混合型证券投资基金（代码：217009）、招商大盘蓝筹股票型证券投资基金（代码：217010）、招商安心收益债券型证券投资基金（代码：217011）、招商行业领先股票型证券投资基金（代码：217012）、招商中小盘精选股票型证券投资基金（代码：217013）、招商全球资源股票型证券投资基金（代码：217015）、招商深证100指数证券投资基金（代码：217016）、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（基金代码：217017）的销售业务。东兴证券全国各网点均可为投资者办理以上各基金的账户开户、申购、赎回及转换等业务。具体业务类型及办理程序请遵循东兴证券的相关规定。投资者欲了解详细信息请仔细阅读相关基金的基金合同和招募说明书等法律文件。

一、基金转换业务

基金转换是指开放式基金份额持有人将其持有某只基金的部分或全部份额转换为同一基金管理人管理的另一只开放式基金的份额。

招商优质成长股票型证券投资基金（前端）（代码：161706）、招商全球资源股票型证券投资基金（基金代码：217015）目前暂未开通转换业务，具体开通时间另行公告，其他基金均已开通转换业务。

注：招商安泰债券证券投资基金A类（代码：217003）、招商安泰债券证券投资基金B类（代码：217203）二者之间不能相互转换；招商现金增值开放式证券投资基金B（代码：217014）仅开通由招商现金增值开放式证券投资基金A（代码：217004）的转入业务（且最低转入金额为1000万元）和转换至除招商全球资源股票型证券投资基金（代码：217015）、招商优质成长股票型证券投资基金（前端）（代码：161706）以外的所有基金的转出业务。

具体业务类型及办理程序请遵循东兴证券的相关规定。

二、投资者可通过以下途径咨询有关详情：
1、招商基金管理有限公司网站：www.cmfchina.com
2、招商基金管理有限公司客户服务中心电话：4008879555（免长途费）
3、东兴证券网站：www.dxzq.net
4、东兴证券服务热线：400-8888-993

三、风险提示：

投资人应当认真阅读拟投资基金的《基金合同》、《招募说明书》等法律文件及东兴证券基金业务规则等信息，了解所投资基金的风险收益特征，并根据自身投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资人的风险承受能力相匹配。

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，也不保证最低收益。敬请投资人注意投资风险。

特此公告。

招商基金管理有限公司
2011年2月22日

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

公告送出日期：2011年2月22日

1 公告基本信息

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	消费ETF
基金主代码	510150
前端交易代码	–
后端交易代码	–
基金运作方式	交易型、开放式
基金合同生效日	2010年12月8日
基金管理人名称	招商基金管理有限公司
基金托管人名称	中国工商银行股份有限公司
基金注册登记机构名称	中国证券登记结算有限责任公司
公告依据	《上证消费80交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《上证消费80交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》及相关公告等
申购起始日	2011年2月25日
赎回起始日	2011年2月25日

注：此处基金主代码指二级市场交易代码，本基金的申购、赎回代码为510151。

2 日常申购、赎回（、转换、定期定额投资）业务的办理时间

投资者可办理申购、赎回等业务的开放日为上海证券交易所的交易日，开放时间为上午9:30-11:30和下午1:00-3:00。在此时间之外不办理基金份额的申购、赎回。但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

若上海证券交易所交易时间更改或出现其他特殊情况，基金管理人可对申购、赎回时间进行调整，但此项调整应在实施日2日前在指定媒体公告。

3 日常申购业务

3.1 申购金额限制

投资者申购的基金份额需为最小申购单位的整数倍。

本基金最小申购单位为40万份，基金管理人有权对其进行更改，并在更改前至少3个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

3.2 申购费率

投资者在申购基金份额时，申购赎回代理券商可按照不超过申购份额0.5%的标准收取佣金，其中包含证券交易所、注册登记机构等收取的相关费用。

3.3 其他与申购相关的事项

（一）申购的场所

基金投资者应当在申购赎回代理券商办理基金申购业务的营业场所或按申购赎回代理券商提供的其他方式办理基金份额的申购。基金管理人在开始申购业务前公告申购赎回代理券商的名单，并可根据情况变更或增减申购赎回代理券商的名单。

（二）申购的原则
1、本基金采用份额申购和份额赎回的方式，即申购和赎回均以份额申请；
2、本基金的申购对价包括组合证券、现金替代、现金差额及其他对价；
3、申购申请提交后不得撤销；
4、申购应遵守《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》的规定；
5、基金管理人可根据基金运作的实际情况，在不损害基金份额持有人实质利益的前提下调整上述原则，但应在新的原则实施前依照有关规定在指定媒体上予以公告。

（三）申购的程序

1、申购的申请方式

基金投资者必须根据申购赎回代理券商规定的程序，在开放日的业务办理时间提出申购的申请。投资者在申购本基金时须根据申购赎回清单备足相应数量的股票和现金。

2、申购申请的确认

投资者申购申请在受理当日进行确认。如投资者未能提供符合要求的申购对价，则申购申请失败。

3、申购的清算交收与登记

投资者T日申购成功后，注册登记机构在T日收市后为投资者办理基金份额与组合证券的清算交收以及现金替代等的清算，在T+1日办理现金替代等的交收以及现金差额的清算，在T+2日办理现金差额的交收，并将结果发送给申购赎回代理券商、基金管理人和基金托管人。如果注册登记机构在清算交收时发现不能正常履约的情形，则依据《中国证券登记结算有限责任公司交易型开放式指数基金登记结算业务实施细则》的有关规定进行处理。

注册登记机构可在法律法规允许的范围内，对清算交收和登记的办理时间、方式进行调整，并最迟于开始实施日的3个工作日前在指定媒体公告。

（四）申购的对价及用途

1、申购对价根据申购赎回清单和投资者申购的基金份额数额确定。申购对价是指投资者申购基金份额时应交付的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。

2、申购赎回清单由基金管理人编制。T日的申购赎回清单在当日上海证券交易所开市前公告。T日的基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日公告，计算公式为计算日基金资产净值除以计算日发售在外的基金份额总数。如遇特殊情况，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。申购赎回清单的内容与格式见本基金招募说明书。

4 日常赎回业务

4.1 赎回份额限制

投资者赎回的基金份额需为最小赎回单位的整数倍。

本基金最小赎回单位为40万份，基金管理人有权对其进行更改，并在更改前至少3个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

4.2 赎回费率

投资者在赎回基金份额时，申购赎回代理券商可按照不超过赎回份额0.5%的标准收取佣金，其中包含证券交易所、注册登记机构等收取的相关费用。

持有期限（N）	赎回费率
–	–

注：–

4.3 其他与赎回相关的事项

（一）赎回的场所

基金投资者应当在申购赎回代理券商办理基金赎回业务的营业场所或按申购赎回代理券商提供的其他方式办理基金份额的赎回。基金管理人在开始赎回业务前公告申购赎回代理券商的名单，并可根据情况变更或增减申购赎回代理券商的名单。

（二）赎回的原则
1、本基金采用份额申购和份额赎回的方式，即申购和赎回均以份额申请；
2、本基金的赎回对价包括组合证券、现金替代、现金差额及其他对价；
3、赎回申请提交后不得撤销；
4、赎回应遵守《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》的规定；
5、基金管理人可根据基金运作的实际情况，在不损害基金份额持有人实质利益的前提下调整上述原则，但应在新的原则实施前依照有关规定在指定媒体上予以公告。

（三）赎回的程序

1、赎回的申请方式

基金投资者必须根据申购赎回代理券商规定的程序，在开放日的业务办理时间提出赎回的申请。投资者在提交赎回申请时，必须有足够的基金份额余额和现金。

2、赎回申请的确认

投资者赎回申请在受理当日进行确认。如投资者持有的符合要求的基金份额不足或未能根据要求准备足额的现金，或本基金投资组合内不具备足额的符合要求的赎回对价，则赎回申请失败。

3、赎回的清算交收与登记

投资者T日赎回成功后，注册登记机构在T日收市后为投资者办理基金份额与组合证券的清算交收以及现金替代等的清算，在T+1日办理现金替代等的交收以及现金差额的清算，在T+2日办理现金差额的交收，并将结果发送给申购赎回代理券商、基金管理人和基金托管人。如果注册登记机构在清算交收时发现不能正常履约的情形，则依据《中国证券登记结算有限责任公司交易型开放式指数基金登记结算业务实施细则》的有关规定进行处理。

注册登记机构可在法律法规允许的范围内，对清算交收和登记的办理时间、方式进行调整，并最迟于开始实施日的3个工作日前在指定媒体公告。

（四）赎回的对价及用途

1、赎回对价根据申购赎回清单和投资者赎回的基金份额数额确定。赎回对价是指投资者赎回基金份额时，基金管理人应交付给赎回人的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。

2、申购赎回清单由基金管理人编制。T日的申购赎回清单在当日上海证券交易所开市前公告。T日的基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日公告，计算公式为计算日基金资产净值除以计算日发售在外的基金份额总数。如遇特殊情况，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。申购赎回清单的内容与格式见本基金招募说明书。

5 日常转换业务

5.1 转换费率

–

5.2 其他与转换相关的事项

–

6 定期定额投资业务

–

7 基金销售机构

7.1 场外销售机构

7.1.1 直销机构

–

7.1.2 场外代销机构

–

7.2 场内销售机构

本基金的申购赎回代办券商（亦称"一级交易商"）为：

招商证券股份有限公司、平安证券有限责任公司、西藏同信证券有限责任公司、中航证券有限公司、国海证券有限责任公司、齐鲁证券有限公司、华宝证券有限责任公司、山西证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、东海证券有限责任公司、东吴证券股份有限公司、东兴证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、光大证券股份有限公司。

8 基金份额净值公告/基金收益公告的披露安排

基金合同生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定媒体上。

9 其他需要提示的事项

（一）申购赎回清单的内容与格式

1、申购赎回清单的内容

T日申购赎回清单公告内容包括最小申购、赎回单位所对应的组合证券内各成份证券数据、现金替代、T日预估现金部分、T-1日现金差额、基金份额净值及其他相关内容。

2、组合证券相关内容

组合证券是指本基金标的指数所包含的全部或部分证券。申购赎回清单将公告最小申购赎回单位所对应的各成份证券名称、证券代码及数量。

3、现金替代相关内容

现金替代是指申购、赎回过程中，投资者按基金合同和招募说明书的规定，用于替代组合证券中部分证券的一定数量的现金。

（1）现金替代的类型

现金替代分为3种类型：禁止现金替代（标志为"禁止"）、可以现金替代（标志为"允许"）和必须现金替代（标志为"必须"）。

禁止现金替代是指在申购、赎回基金份额时，该成份证券不允许使用现金作为替代。

可以现金替代是指在申购基金份额时，允许使用现金作为全部或部分该成份证券的替代，但在赎回基金份额时，该成份证券不允许使用现金作为替代。

必须现金替代是指在申购、赎回基金份额时，该成份证券必须使用现金作为替代。

（2）可以现金替代

①适用情形：可以现金替代的证券一般是由于停牌等原因导致投资者无法在申购时买入的证券。

②替代金额：对于可以现金替代的证券，替代金额的计算公式为：

替代金额=替代证券数量×该证券参考价格×（1+现金替代溢价比例）

其中，"该证券参考价格"目标确定原则为：

（i）该证券正常交易时，采用最新成交价；

（ii）该证券正常交易中出现涨停/跌停时，采用涨停/跌停价格；

（iii）该证券停牌且当日有成交时，采用最新成交价；

（iv）该证券停牌且当日无成交时，采用前收盘价（考虑当日的除权除息等因素）。

收取现金替代溢价的原因是，对于使用现金替代的证券，基金管理人需在证券恢复交易后买入，而实际买入价格加上相关交易费用后与申购时的最新价格可能有所差异。为便于操作，基金管理人在申购、赎回清单中预先确定现金替代溢价比例，并据此收取替代金额。如果预先收取的金额高于基金购入该部分证券的实际成本，则基金管理人将退还多收取的差额；如果预先收取的金额低于基金购入该部分证券的实际成本，则基金管理人将向投资者收取欠缺的差额。

③替代金额的处理程序

T日，基金管理人在申购、赎回清单中公布现金替代溢价比例，并据此收取替代金额。

在T日后被替代的成份证券有正常交易的2个交易日（简称为T+2日）内，基金管理人将以收到的替代金额买入被替代的部分证券。

T+2日日终，若已购入全部被替代的证券，则以替代金额与被替代证券的实际购入成本（包括买入价格与交易费用）的差额，确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项；若未能购入全部被替代的证券，则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本加上按照T+2日收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项。

特例情况：若自T日起，上海证券交易所正常交易日已达到20日而该证券正常交易日低于2日，则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本加上按照最近一次收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项。

若现金替代日（T日）后至T+2日（若在特例情况下，则为T日起第20个交易日）期间发生除息、送股（转增）、配股以及由于股权分置改革等发生的权益变动，则进行相应调整。

T+2日后第1个工作日（若在特例情况下，则为T日起第21个交易日），基金管理人将应退款和补款的明细及汇总数据发送给相关申购赎回代理券商和基金托管人，相关款项的清算交收将于此后3个工作日内完成。

④替代限制：为有效控制基金的跟踪偏离度和跟踪误差，基金管理人可规定投资者使用可以现金替代的比例合计不得超过申购基金份额资产净值的一定比例。现金替代比例的计算公式为：

（3）必须现金替代

①适用情形：必须现金替代的证券一般是由于标的指数调整，即将被剔除的成份证券，或基金管理人出于保护持有人利益等原因认为有必要实行必须现金替代的成份证券。

②替代金额：对于必须现金替代的证券，基金管理人将在申购、赎回清单中公告替代的一定数量的现金，即"固定替代金额"。固定替代金额的计算方法为申购、赎回清单中该证券的数量乘以其T日预计开盘价。

4、预估现金部分相关内容

预估现金部分是指为便于计算基金份额参考净值及申购赎回代理券商预先冻结申请申购、赎回的投资者的相应资金，由基金管理人计算的现金数额。

T日申购、赎回清单中公告T日预估现金部分。其计算公式为：

T日预估现金部分=T-1日最小申购赎回单位的基金资产净值-（申购赎回清单中必须用现金替代的固定替代金额+申购赎回清单中可以用现金替代成份证券的数量与T日预计开盘价相乘之和+申购赎回清单中禁止用现金替代成份证券的数量与T日预计开盘价相乘之和）

其中，T日预计开盘价主要根据上海证券交易所提供的标的指数成份证券的预计开盘价确定。另外，若T日为基金分红除息日，则计算公式中的"T-1日最小申购、赎回单位的基金资产净值"需扣减相应的收益分配数额。预估现金部分的数值可能为正、为负或为零。

5、现金差额相关内容

T日现金差额在T+1日的申购、赎回清单中公告，其计算公式为：

T日现金差额=T日最小申购赎回单位的基金资产净值-（申购赎回清单中必须用现金替代的固定替代金额+申购赎回清单中可以用现金替代成份证券的数量与T日收盘价相乘之和+申购赎回清单中禁止用现金替代成份证券的数量与T日收盘价相乘之和）

T日投资者申购、赎回基金份额时，需按T+1日公告的T日现金差额进行资金的清算交收。

现金差额的数值可能为正、为负或为零。在投资者申购时，如现金差额为正数，则投资者应根据其申购的基金份额支付相应的现金，如现金差额为负数，则投资者将根据其申购的基金份额获得相应的现金；在投资者赎回时，如现金差额为正数，则投资者将根据其赎回的基金份额获得相应的现金，如现金差额为负数，则投资者应根据其赎回的基金份额支付相应的现金。

6、申购赎回清单的格式

申购、赎回清单的格式举例如下：

基本信息	
最新公告日期	2011年2月21日
基金名称	上证消费80交易型开放式指数证券投资基金
基金管理公司名称	招商基金管理有限公司
一级市场基金代码	510151
2011年2月18日信息内容	
现金差额（单位：元）	¥0.00
最小申购赎回单位资产净值（单位：元）	¥1,227,879.96
基金份额净值（单位：元）	¥3.0700
2011年2月21日信息内容	
预估现金部分（单位：元）	¥1,893.96
可以现金替代比例上限	30%
是否需要公布IOPV	是
最小申购赎回单位（单位：份）	400,000
申购、赎回的允许情况	允许申购和赎回

2011年2月21日成份股信息内容

股票代码	股票简称	股票数量	现金替代标志	现金替代溢价比率	固定替代金额
600006	东风汽车	1200	允许	10%	
600037	歌华有线	1000	允许	10%	
600059	古越龙山	600	允许	10%	
600060	海信电器	700	允许	10%	
600062	双鹤药业	500	允许	10%	
600066	宇通客车	600	允许	10%	
600079	人福医药	700	允许	10%	
600085	同仁堂	400	允许	10%	
600104	上海汽车	2800	必须		51660.000
600108	亚盛集团	2100	允许	10%	
600122	宏图高科	500	允许	10%	
600127	金健米业	700	允许	10%	
600132	重庆啤酒	400	允许	10%	
600138	中青旅	600	允许	10%	
600161	天坛生物	400	允许	10%	
600166	福田汽车	1000	允许	10%	
600177	雅戈尔	2000	允许	10%	
600195	中牧股份	300	允许	10%	
600196	复星医药	1500	允许	10%	
600197	伊力特	300	允许	10%	
600199	金种子酒	600	允许	10%	
600216	浙江医药	400	允许	10%	
600220	江苏阳光	1900	允许	10%	
600251	冠农股份	300	允许	10%	
600252	中恒集团	700	允许	10%	
600267	海正药业	400	允许	10%	
600276	恒瑞医药	600	允许	10%	
600295	鄂尔多斯	400	允许	10%	
600300	维维股份	1300	允许	10%	
600311	荣华实业	1000	允许	10%	
600332	广州药业	400	允许	10%	
600351	亚宝药业	1000	允许	10%?	
600359	新农开发	200	允许	10%?	
600380	健康元	800	允许	10%?	
600415	小商品城	1000	允许	10%?	
600418	江淮汽车	1200	允许	10%?	
600439	瑞贝卡	800	允许	10%?	
600467	好当家	600	允许	10%?	
600482	风帆股份	500	允许	10%?	
600511	国药股份	400	允许	10%	
600518	康美药业	2400	允许	10%	
600519	贵州茅台	600	允许	10%	
600535	天士力	400	允许	10%	
600597	光明乳业	600	允许	10%	
600598	北大荒	1100	允许	10%	
600600	青岛啤酒	500	允许	10%	
600628	新世界	700	允许	10%	
600631	百联股份	1000	允许	10%	
600651	飞乐音响	900	允许	10%	
600653	申华控股	2700	允许	10%	
600655	豫园商城	1800	允许	10%	
600660	福耀玻璃	2100	允许	10%	
600664	哈药股份	1100	允许	10%	
600690	青岛海尔	1200	允许	10%	
600694	大商股份	400	允许	10%	
600737	中粮屯河	800	允许	10%	
600741	华域汽车	1600	必须		20496.000
600754	锦江股份	300	允许	10%	
600779	水井坊	500	允许	10%	
600790	轻纺城	800	允许	10%	
600809	山西汾酒	200	允许	10%	
600811	东方集团	2000	允许	10%	
600812	华北制药	1300	允许	10%	
600824	益民集团	800	允许	10%	
600825	新华传媒	600	允许	10%	
600831	广电网络	600	允许	10%	
600832	东方明珠	2400	允许	10%	
600838	上海九百	600	允许	10%	
600839	四川长虹	3000	允许	10%	
600866	星湖科技	800	允许	10%	
600867	通化东宝	600	允许	10%	
600872	中炬高新	1200	允许	10%	
600877	中国嘉陵	700	允许	10%	
600880	博瑞传播	700	允许	10%	
600884	杉杉股份	400	允许	10%	
600887	伊利股份	1200	允许	10%	
600978	宜华木业	1200	允许	10%	
601607	上海医药	1200	允许	10%	
601801	皖新传媒	300	允许	10%	
601888	中国国旅	400	允许	10%	

（二）暂停申购赎回的情形

发生下列情况时，基金管理人可暂停接受基金投资者的申购、赎回申请：
1、因不可抗力导致基金无法接受申购、赎回；
2、因证券交易所决定临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；
3、发生基金合同规定的暂停基金资产估值的情况
4、上海证券交易所、申购赎回代理券商、注册登记机构因异常情况无法办理申购、赎回；
5、基金管理人开市前未能公布申购赎回清单；
6、法律法规、上海证券交易所规定或中国证监会认定的其他情形。

在发生上述暂停申购或赎回的情形之一时，本基金的申购和赎回可能同时暂停。

发生上述情形之一时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，并及时公告。已接受的赎回申请，基金管理人应当足额兑付。在暂停申购、赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购、赎回业务的办理，并予以公告。

（三）基金份额折算与变更登记和其他服务

基金份额折算由基金管理人办理，并由注册登记机构进行基金份额的变更登记。折算后的基金份额净值与折算日标的指数收盘值的千分之一基本一致。

基金份额折算后，本基金的基金份额总额与基金份额持有人持有的基金份额数额将发生调整，但调整后的基金份额持有人持有的基金份额占基金份额总额的比例不发生变化。基金份额折算对基金份额持有人的权益无实质性影响。基金份额折算后，基金份额持有人将按照折算后的基金份额享有权利并承担义务。

1、基金份额折算的计算公式

（1）基金管理人确定基金份额折算日（T日），并提前公告。

（2）T日收市后，基金管理人计算当日的基金资产净值X、基金份额总额Y，并与基金托管人进行核对。

（3）假设T日标的指数收盘值为I，则T日的目标基金份额净值为I/1000，基金份额折算比例的计算公式为：折算比例 =（X/Y）/（I/1000），以四舍五入的方法保留小数点后8位。

（4）基金管理人根据上述折算比例，对各基金份额持有人认购的基金份额进行折算，折算后的基金份额保留到整数位（小数点后面的部分舍去，舍去部分计入基金财产），加总得到折算后的基金份额总额。

2、基金份额折算的举例

假设某投资者在基金募集期内认购了1,000份上证消费80交易型开放式指数证券投资基金，基金份额折算日的基金资产净值为3,127,000,230.95元，折算前的基金份额总额为3,013,057,000份，当日标的指数收盘值为2481.82。

（1）折算比例 =（3,127,000,230.95/3,013,057,000）/（2481.82/1000）=0.41816751

（2）该投资者折算后的基金份额 = 1,000×0.41816751 = 418

（四）基金的非交易过户等其他业务

注册登记机构可依据其业务规则，受理基金份额的非交易过户、冻结与解冻等业务，并收取一定的手续费用。

（五）其他

1、本公告仅对本基金开放日常申购与赎回业务的有关事项和规定予以说明。投资者欲了解本基金的详细情况，请详细阅读刊登在2010年11月1日《上海证券报》上的《上证消费80交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》。

2、对希望了解本基金其它有关信息的投资者，可拨打本公司的客户服务电话400-887-9555（免长途费）垂询相关事宜。

3、有关本基金开放申购和赎回的具体规定若有变化，本基金管理人将另行公告。

4、风险提示：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，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，敬请投资人认真阅读基金的相关法律文件，并选择适合自身风险承受能力的投资品种进行投资。

特此公告。

招商基金管理有限公司
2011年2月22日