

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
重要提示
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...

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

2011 半年度 报告摘要

2011年6月30日

1.1 基金基本情况
基金名称 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 217107
交易代码 217107
基金运作方式 契约型开放式
基金合同生效日期 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 1,788,252,798.99
基金合同存续期限 不定期

1.2 主要基金业绩指标
基金名称 招商上证消费80交易型开放式指数证券投资基金
基金代码 510150
基金运作方式 契约型开放式(ETF)
基金合同生效日期 2010年12月8日
基金上市交易所 上海证券交易所
上市日期 2011年2月25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

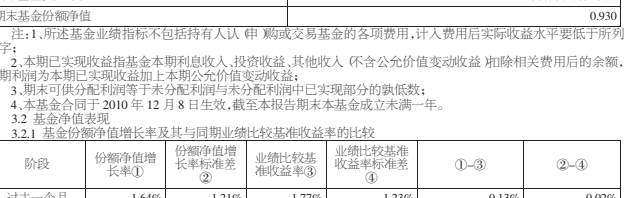
2.1 基金产品说明
投资目标 通过主要投资于上证消费80交易型开放式指数证券投资基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略 本基金主要投资于上证消费80ETF的联接基金,主要通过投资于上证消费80ETF,以实现对上证消费80ETF的间接投资。
业绩比较基准 上证消费80指数收益率*95%+商业银行活期存款利率(税后)5%

2.2 基金资产说明
资产 2011年6月30日 2010年12月31日
银行存款 78,449,655.84 672,961,626.28
结算备付金 1,663,972,136.97 1,663,972,136.97
存出保证金 125,082.60
交易性金融资产 1,578,889,558.08 1,049,656,272.25
其中:股票投资 309,096.00 1,049,656,272.25
基金投资 1,578,889,558.08
债券投资
资产支持证券投资
衍生金融资产
买入返售金融资产 700,001,490.00
应收证券清算款 6,403,411.53
应收利息 16,182.88
应收股利
其他资产 2,425,527,138.97
资产总计 4,257,138,972.13

2.3 基金资产净值
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 魏志军 魏志军
联系电话 0755-83196666 010-66105799
电子邮箱 cmf@cmfchina.com cmf@icbc.com.cn
客户服务电话 400-887-9555 95588
传真 0755-83196405 010-66105798

3.1 主要会计数据和财务指标
3.1.1 期间数据指标
报告期末(2011年6月30日)
本期累计实现收益 35,186,921.81
本期利润 -75,809,151.72
加权平均基金份额本期利润 -0.0427
本期基金份额净值增长率 -6.16%

3.1.2 基金净值表现
本基金自2010年12月8日成立以来,截至本报告期末本基金成立未满一年。
3.2 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:上证消费80指数收益率*95%+商业银行活期存款利率(税后)5%。
3.3 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益比较
阶段 上证消费80指数收益率 业绩比较基准收益 业绩比较基准收益与基金收益差



注:1、本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益比较
注:2、本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益比较
注:3、本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益比较

3.4 基金管理人及其基金经理
3.4.1 基金管理人及其基金经理
基金管理人 招商基金管理有限公司
基金管理人 魏志军
基金管理人 魏志军
基金管理人 魏志军

3.4.2 基金管理人及其基金经理
基金管理人 招商基金管理有限公司
基金管理人 魏志军
基金管理人 魏志军
基金管理人 魏志军

3.4.3 基金管理人及其基金经理
基金管理人 招商基金管理有限公司
基金管理人 魏志军
基金管理人 魏志军
基金管理人 魏志军

3.4.4 基金管理人及其基金经理
基金管理人 招商基金管理有限公司
基金管理人 魏志军
基金管理人 魏志军
基金管理人 魏志军

3.4.5 基金管理人及其基金经理
基金管理人 招商基金管理有限公司
基金管理人 魏志军
基金管理人 魏志军
基金管理人 魏志军

3.4.6 基金管理人及其基金经理
基金管理人 招商基金管理有限公司
基金管理人 魏志军
基金管理人 魏志军
基金管理人 魏志军

3.4.7 基金管理人及其基金经理
基金管理人 招商基金管理有限公司
基金管理人 魏志军
基金管理人 魏志军
基金管理人 魏志军

3.4.8 基金管理人及其基金经理
基金管理人 招商基金管理有限公司
基金管理人 魏志军
基金管理人 魏志军
基金管理人 魏志军

3.4.9 基金管理人及其基金经理
基金管理人 招商基金管理有限公司
基金管理人 魏志军
基金管理人 魏志军
基金管理人 魏志军

3.4.10 基金管理人及其基金经理
基金管理人 招商基金管理有限公司
基金管理人 魏志军
基金管理人 魏志军
基金管理人 魏志军

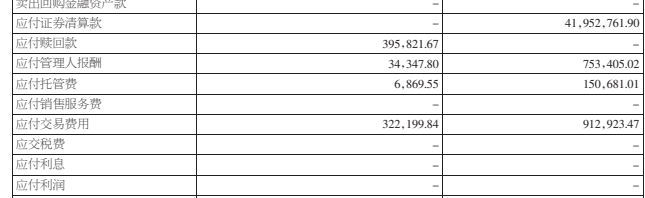
2.1 基金基本情况
基金名称 招商上证消费80交易型开放式指数证券投资基金联接基金
基金代码 217107
交易代码 217107
基金运作方式 契约型开放式
基金合同生效日期 2010年12月8日
基金管理人 招商基金管理有限公司
基金托管人 中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额 1,788,252,798.99
基金合同存续期限 不定期

2.2 基金资产说明
资产 2011年6月30日 2010年12月31日
银行存款 78,449,655.84 672,961,626.28
结算备付金 1,663,972,136.97 1,663,972,136.97
存出保证金 125,082.60
交易性金融资产 1,578,889,558.08 1,049,656,272.25
其中:股票投资 309,096.00 1,049,656,272.25
基金投资 1,578,889,558.08
债券投资
资产支持证券投资
衍生金融资产
买入返售金融资产 700,001,490.00
应收证券清算款 6,403,411.53
应收利息 16,182.88
应收股利
其他资产 2,425,527,138.97
资产总计 4,257,138,972.13

2.3 基金资产净值
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 魏志军 魏志军
联系电话 0755-83196666 010-66105799
电子邮箱 cmf@cmfchina.com cmf@icbc.com.cn
客户服务电话 400-887-9555 95588
传真 0755-83196405 010-66105798

3.1 主要会计数据和财务指标
3.1.1 期间数据指标
报告期末(2011年6月30日)
本期累计实现收益 35,186,921.81
本期利润 -75,809,151.72
加权平均基金份额本期利润 -0.0427
本期基金份额净值增长率 -6.16%

3.1.2 基金净值表现
本基金自2010年12月8日成立以来,截至本报告期末本基金成立未满一年。
3.2 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:上证消费80指数收益率*95%+商业银行活期存款利率(税后)5%。
3.3 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益比较
阶段 上证消费80指数收益率 业绩比较基准收益 业绩比较基准收益与基金收益差



注:1、本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益比较
注:2、本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益比较
注:3、本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益比较

3.4 基金管理人及其基金经理
3.4.1 基金管理人及其基金经理
基金管理人 招商基金管理有限公司
基金管理人 魏志军
基金管理人 魏志军
基金管理人 魏志军

3.4.2 基金管理人及其基金经理
基金管理人 招商基金管理有限公司
基金管理人 魏志军
基金管理人 魏志军
基金管理人 魏志军

3.4.3 基金管理人及其基金经理
基金管理人 招商基金管理有限公司
基金管理人 魏志军
基金管理人 魏志军
基金管理人 魏志军

3.4.4 基金管理人及其基金经理
基金管理人 招商基金管理有限公司
基金管理人 魏志军
基金管理人 魏志军
基金管理人 魏志军

3.4.5 基金管理人及其基金经理
基金管理人 招商基金管理有限公司
基金管理人 魏志军
基金管理人 魏志军
基金管理人 魏志军

3.4.6 基金管理人及其基金经理
基金管理人 招商基金管理有限公司
基金管理人 魏志军
基金管理人 魏志军
基金管理人 魏志军

3.4.7 基金管理人及其基金经理
基金管理人 招商基金管理有限公司
基金管理人 魏志军
基金管理人 魏志军
基金管理人 魏志军

3.4.8 基金管理人及其基金经理
基金管理人 招商基金管理有限公司
基金管理人 魏志军
基金管理人 魏志军
基金管理人 魏志军

3.4.9 基金管理人及其基金经理
基金管理人 招商基金管理有限公司
基金管理人 魏志军
基金管理人 魏志军
基金管理人 魏志军

3.4.10 基金管理人及其基金经理
基金管理人 招商基金管理有限公司
基金管理人 魏志军
基金管理人 魏志军
基金管理人 魏志军

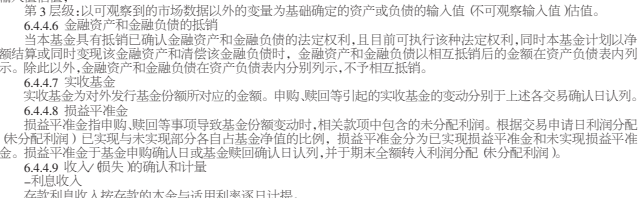
2.1 基金基本情况
基金名称 招商上证消费80交易型开放式指数证券投资基金联接基金
基金代码 217107
交易代码 217107
基金运作方式 契约型开放式
基金合同生效日期 2010年12月8日
基金管理人 招商基金管理有限公司
基金托管人 中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额 1,788,252,798.99
基金合同存续期限 不定期

2.2 基金资产说明
资产 2011年6月30日 2010年12月31日
银行存款 78,449,655.84 672,961,626.28
结算备付金 1,663,972,136.97 1,663,972,136.97
存出保证金 125,082.60
交易性金融资产 1,578,889,558.08 1,049,656,272.25
其中:股票投资 309,096.00 1,049,656,272.25
基金投资 1,578,889,558.08
债券投资
资产支持证券投资
衍生金融资产
买入返售金融资产 700,001,490.00
应收证券清算款 6,403,411.53
应收利息 16,182.88
应收股利
其他资产 2,425,527,138.97
资产总计 4,257,138,972.13

2.3 基金资产净值
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 魏志军 魏志军
联系电话 0755-83196666 010-66105799
电子邮箱 cmf@cmfchina.com cmf@icbc.com.cn
客户服务电话 400-887-9555 95588
传真 0755-83196405 010-66105798

3.1 主要会计数据和财务指标
3.1.1 期间数据指标
报告期末(2011年6月30日)
本期累计实现收益 35,186,921.81
本期利润 -75,809,151.72
加权平均基金份额本期利润 -0.0427
本期基金份额净值增长率 -6.16%

3.1.2 基金净值表现
本基金自2010年12月8日成立以来,截至本报告期末本基金成立未满一年。
3.2 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:上证消费80指数收益率*95%+商业银行活期存款利率(税后)5%。
3.3 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益比较
阶段 上证消费80指数收益率 业绩比较基准收益 业绩比较基准收益与基金收益差



注:1、本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益比较
注:2、本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益比较
注:3、本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益比较

3.4 基金管理人及其基金经理
3.4.1 基金管理人及其基金经理
基金管理人 招商基金管理有限公司
基金管理人 魏志军
基金管理人 魏志军
基金管理人 魏志军

3.4.2 基金管理人及其基金经理
基金管理人 招商基金管理有限公司
基金管理人 魏志军
基金管理人 魏志军
基金管理人 魏志军

3.4.3 基金管理人及其基金经理
基金管理人 招商基金管理有限公司
基金管理人 魏志军
基金管理人 魏志军
基金管理人 魏志军

3.4.4 基金管理人及其基金经理
基金管理人 招商基金管理有限公司
基金管理人 魏志军
基金管理人 魏志军
基金管理人 魏志军

3.4.5 基金管理人及其基金经理
基金管理人 招商基金管理有限公司
基金管理人 魏志军
基金管理人 魏志军
基金管理人 魏志军

3.4.6 基金管理人及其基金经理
基金管理人 招商基金管理有限公司
基金管理人 魏志军
基金管理人 魏志军
基金管理人 魏志军

3.4.7 基金管理人及其基金经理
基金管理人 招商基金管理有限公司
基金管理人 魏志军
基金管理人 魏志军
基金管理人 魏志军

3.4.8 基金管理人及其基金经理
基金管理人 招商基金管理有限公司
基金管理人 魏志军
基金管理人 魏志军
基金管理人 魏志军

3.4.9 基金管理人及其基金经理
基金管理人 招商基金管理有限公司
基金管理人 魏志军
基金管理人 魏志军
基金管理人 魏志军

3.4.10 基金管理人及其基金经理
基金管理人 招商基金管理有限公司
基金管理人 魏志军
基金管理人 魏志军
基金管理人 魏志军

Table with columns: 序号, 项目, 金额, 占基金总资产的比例(%)

Table with columns: 代码, 行业类别, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值

招商基金管理有限公司 2011年8月26日