

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
基金合同生效日期: 2011年09月25日
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。

基金管理人招商基金管理有限公司根据本基金合同约定,于2011年8月23日复核了本报告中的财务资料、净值表现和利润分配情况,并对其中涉及投资运作数据等内容,保证真实、准确、完整,不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

本半年度报告所载数据自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,请阅读半年度报告正文。
本报告材料未经审计。
本报告日期自2011年1月1日起至2011年6月30日止。

2.1 基金基本情况
招商上证消费80ETF
基金代码: 510150
交易代码: 510150
基金运作方式: 契约开放式(ETF)

2.2 基金产品说明
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的构成比例进行投资,构建基金投资组合,进行被动式跟踪,力求跟踪偏离度及跟踪误差最小化。

2.3 基金管理人及基金托管人
名称: 招商基金管理有限公司
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

3.1 主要会计数据和财务指标
3.1.1 本期数据
3.1.2 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准的对比
3.1.3 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准的历史对比

3.2 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准的历史对比图
注:1. 本基金业绩比较基准为上证消费80指数收益率。
2. 本基金业绩比较基准为上证消费80指数收益率。

3.3 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准的历史对比图
注:1. 根据基金合同第十四条(四)投资策略的规定,本基金完全按照标的指数的构成比例及其权重构建基金投资组合,进行被动式跟踪投资。

4.1 基金管理人及基金托管人
4.1.1 基金管理人及基金托管人的基本情况
4.1.2 基金管理人及基金托管人的主要人员情况

4.2 基金管理人及基金托管人的内部控制制度
4.2.1 基金管理人内部控制制度
4.2.2 基金托管人内部控制制度

4.3 基金管理人及基金托管人的投资策略
4.3.1 基金管理人投资策略
4.3.2 基金托管人投资策略

4.4 基金管理人及基金托管人的风险管理
4.4.1 基金管理人风险管理
4.4.2 基金托管人风险管理

4.5 基金管理人及基金托管人的其他重要事项
4.5.1 基金管理人其他重要事项
4.5.2 基金托管人其他重要事项

上证消费80交易型开放式指数证券投资基金

2011 半年度报告摘要

2011年6月30日

6.1 资产负债表
6.2 利润表
6.3 所有者权益变动表
6.4 现金流量表

6.1 资产负债表
单位:人民币元
资产: 银行存款 8,343,457.01
交易性金融资产 301,865,607.44
其他金融资产 301,865,607.44

6.2 利润表
单位:人民币元
一、收入: -135,863,884.66
二、费用: 272,039,411.92
三、利润总额: -135,863,884.66

6.3 所有者权益变动表
单位:人民币元
一、所有者权益: 3,404,268.38
二、未分配利润: 3,404,268.38

6.4 现金流量表
单位:人民币元
经营活动产生的现金流量: 3,404,268.38
投资活动产生的现金流量: -141,482,907.76

6.5 基金份额持有人户数及持有人结构
6.6 基金管理人及基金托管人
6.7 基金管理人及基金托管人的内部控制制度

6.8 基金管理人及基金托管人的投资策略
6.9 基金管理人及基金托管人的风险管理

6.10 基金管理人及基金托管人的其他重要事项
6.11 基金管理人其他重要事项
6.12 基金托管人其他重要事项

6.13 基金管理人及基金托管人的其他重要事项
6.14 基金管理人其他重要事项
6.15 基金托管人其他重要事项

6.16 基金管理人及基金托管人的其他重要事项
6.17 基金管理人其他重要事项
6.18 基金托管人其他重要事项

C8 医药、生物制品 441,822,250.01 24.66
D9 其他制造业 -- --
D 电力、煤气及水和热力生产业 -- --

7.1 期末投资组合行业分类的股票投资组合
7.2 期末投资组合行业分类的债券投资组合
7.3 期末投资组合行业分类的资产支持证券投资组合

7.4 期末投资组合行业分类的资产支持证券投资组合
7.5 期末投资组合行业分类的衍生品投资组合

7.6 期末投资组合行业分类的衍生品投资组合
7.7 期末投资组合行业分类的衍生品投资组合

7.8 期末投资组合行业分类的衍生品投资组合
7.9 期末投资组合行业分类的衍生品投资组合

7.10 期末投资组合行业分类的衍生品投资组合
7.11 期末投资组合行业分类的衍生品投资组合

7.12 期末投资组合行业分类的衍生品投资组合
7.13 期末投资组合行业分类的衍生品投资组合

7.14 期末投资组合行业分类的衍生品投资组合
7.15 期末投资组合行业分类的衍生品投资组合

7.16 期末投资组合行业分类的衍生品投资组合
7.17 期末投资组合行业分类的衍生品投资组合

7.18 期末投资组合行业分类的衍生品投资组合
7.19 期末投资组合行业分类的衍生品投资组合

7.20 期末投资组合行业分类的衍生品投资组合
7.21 期末投资组合行业分类的衍生品投资组合

7.22 期末投资组合行业分类的衍生品投资组合
7.23 期末投资组合行业分类的衍生品投资组合