

基金管理人:招商基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
成立日期:2011年8月26日

重要提示
基金管理人招商基金管理有限公司的董事会、监事会对本报告期内信息披露内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

基金管理人招商基金管理有限公司根据中国证监会规定,于2011年8月23日发布了本报告中的财务数据、净值表现、利润分配、基金份额净值、投资组合等相关信息,保证信息披露内容的真实性、准确性和完整性,并承担相应法律责任。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,请阅读半年度报告正文。
本招募说明书未经注册。
本报告自2011年2月11日基金合同生效日起至2011年6月30日止。

2.1 基金基本情况
基金名称: 招商标普金砖四国指数(QDII-LOF)
基金代码: 161714
基金简称: 161714
基金运作方式: 上市契约型开放式(LOF)

2.2 基金产品说明
投资目标: 本基金采用指数化投资方式,通过跟踪标的指数和量化风险管理力求实现对标的指数的有效跟踪,获得与标的指数收益相近的回报。
投资策略: 本基金至少90%以上的资产采用完全复制法进行指数化投资,即按照标的指数成分股及其权重构建投资组合。

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
基金托管人: 中国银行股份有限公司

2.4 财务指标
项目: 基金管理人 基金托管人
名称: 招商基金管理有限公司 中国银行股份有限公司

3.1 主要会计数据和财务指标
3.1.1 期间数据和指标
3.1.2 期末数据和指标

3.2 主要财务指标
3.2.1 基金业绩比较基准及与同期业绩比较基准率数的比较

3.3 主要财务指标和财务指标
3.3.1 期间数据和指标
3.3.2 期末数据和指标

3.4 基金管理人及基金托管人
3.4.1 基金管理人
3.4.2 基金托管人

3.5 基金业绩比较基准
3.5.1 基金业绩比较基准
3.5.2 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准率数的比较

3.6 基金管理人及基金托管人
3.6.1 基金管理人
3.6.2 基金托管人

3.7 基金业绩比较基准
3.7.1 基金业绩比较基准
3.7.2 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准率数的比较

3.8 基金管理人及基金托管人
3.8.1 基金管理人
3.8.2 基金托管人

3.9 基金业绩比较基准
3.9.1 基金业绩比较基准
3.9.2 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准率数的比较

3.10 基金管理人及基金托管人
3.10.1 基金管理人
3.10.2 基金托管人

3.11 基金业绩比较基准
3.11.1 基金业绩比较基准
3.11.2 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准率数的比较

3.12 基金管理人及基金托管人
3.12.1 基金管理人
3.12.2 基金托管人

3.13 基金业绩比较基准
3.13.1 基金业绩比较基准
3.13.2 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准率数的比较

3.14 基金管理人及基金托管人
3.14.1 基金管理人
3.14.2 基金托管人

3.15 基金业绩比较基准
3.15.1 基金业绩比较基准
3.15.2 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准率数的比较

3.16 基金管理人及基金托管人
3.16.1 基金管理人
3.16.2 基金托管人

3.17 基金业绩比较基准
3.17.1 基金业绩比较基准
3.17.2 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准率数的比较

3.18 基金管理人及基金托管人
3.18.1 基金管理人
3.18.2 基金托管人

3.19 基金业绩比较基准
3.19.1 基金业绩比较基准
3.19.2 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准率数的比较

3.20 基金管理人及基金托管人
3.20.1 基金管理人
3.20.2 基金托管人

3.21 基金业绩比较基准
3.21.1 基金业绩比较基准
3.21.2 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准率数的比较

3.22 基金管理人及基金托管人
3.22.1 基金管理人
3.22.2 基金托管人

3.23 基金业绩比较基准
3.23.1 基金业绩比较基准
3.23.2 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准率数的比较

3.24 基金管理人及基金托管人
3.24.1 基金管理人
3.24.2 基金托管人

3.25 基金业绩比较基准
3.25.1 基金业绩比较基准
3.25.2 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准率数的比较

3.26 基金管理人及基金托管人
3.26.1 基金管理人
3.26.2 基金托管人

3.27 基金业绩比较基准
3.27.1 基金业绩比较基准
3.27.2 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准率数的比较

3.28 基金管理人及基金托管人
3.28.1 基金管理人
3.28.2 基金托管人

3.29 基金业绩比较基准
3.29.1 基金业绩比较基准
3.29.2 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准率数的比较

3.30 基金管理人及基金托管人
3.30.1 基金管理人
3.30.2 基金托管人

3.31 基金业绩比较基准
3.31.1 基金业绩比较基准
3.31.2 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准率数的比较

3.32 基金管理人及基金托管人
3.32.1 基金管理人
3.32.2 基金托管人

招商标普金砖四国指数证券投资基金(LOF)

2011 半年度 报告摘要

2011年6月30日

5.3 受托人对半年度报告中财务信息内容的真实性、准确性和完整性发表意见。
5.4 受托人对半年度报告中财务信息内容的真实性、准确性和完整性发表意见。
5.5 受托人对半年度报告中财务信息内容的真实性、准确性和完整性发表意见。

6.1 资产负债表
资产负债表(人民币元)
单位:人民币元

资产
2011年6月30日
银行存款 12,056,017.19
其他货币资金 206,476.18

负债和所有者权益
2011年6月30日
应付赎回款 1,263.63
应付管理费 807,877.40

净资产
2011年6月30日
净资产 177,170,085.06

6.2 利润表
利润表(人民币元)
单位:人民币元

营业收入
2011年6月30日
利息收入 1,281,427.47
其他收入 117,782.49

营业支出
2011年6月30日
基金管理费 246,419.53
基金托管费 364,174.94

净利润
2011年6月30日
净利润 1,148,625.43

6.3 所有者权益变动表
所有者权益变动表(人民币元)
单位:人民币元

期初余额
2011年6月30日
基金份额 177,170,085.06
未分配利润 -8,549,504.97

本期增加
2011年6月30日
本期增加 168,620,880.09

期末余额
2011年6月30日
期末余额 345,245,460.18

6.4 现金流量表
现金流量表(人民币元)
单位:人民币元

经营活动产生的现金流量
2011年6月30日
经营活动产生的现金流量净额 1,148,625.43

投资活动产生的现金流量
2011年6月30日
投资活动产生的现金流量净额 -1,148,625.43

筹资活动产生的现金流量
2011年6月30日
筹资活动产生的现金流量净额 0

现金及现金等价物净增加额
2011年6月30日
现金及现金等价物净增加额 0

6.5 公允价值变动损益
公允价值变动损益(人民币元)
单位:人民币元

公允价值变动损益
2011年6月30日
公允价值变动损益 0

6.6 其他综合收益
其他综合收益(人民币元)
单位:人民币元

其他综合收益
2011年6月30日
其他综合收益 0

6.7 其他
其他(人民币元)
单位:人民币元

其他
2011年6月30日
其他 0

6.8 其他
其他(人民币元)
单位:人民币元

其他
2011年6月30日
其他 0

6.9 其他
其他(人民币元)
单位:人民币元

其他
2011年6月30日
其他 0

6.10 其他
其他(人民币元)
单位:人民币元

其他
2011年6月30日
其他 0

6.11 其他
其他(人民币元)
单位:人民币元

其他
2011年6月30日
其他 0

6.12 其他
其他(人民币元)
单位:人民币元

其他
2011年6月30日
其他 0

6.13 其他
其他(人民币元)
单位:人民币元

其他
2011年6月30日
其他 0

6.14 其他
其他(人民币元)
单位:人民币元

其他
2011年6月30日
其他 0

6.15 其他
其他(人民币元)
单位:人民币元

其他
2011年6月30日
其他 0

6.16 其他
其他(人民币元)
单位:人民币元

其他
2011年6月30日
其他 0

6.17 其他
其他(人民币元)
单位:人民币元

注:1.本基金对以上证券均采用当地市场报价。
2.投资者要了解本基金主要投资的证券权益投资情况,应阅读刊载于招商基金管理有限公司http://www.cmfchina.com的基金定期报告。

7.1 本基金对以上证券均采用当地市场报价。
7.2 投资者要了解本基金主要投资的证券权益投资情况,应阅读刊载于招商基金管理有限公司http://www.cmfchina.com的基金定期报告。

7.3 本基金对以上证券均采用当地市场报价。
7.4 投资者要了解本基金主要投资的证券权益投资情况,应阅读刊载于招商基金管理有限公司http://www.cmfchina.com的基金定期报告。

7.5 本基金对以上证券均采用当地市场报价。
7.6 投资者要了解本基金主要投资的证券权益投资情况,应阅读刊载于招商基金管理有限公司http://www.cmfchina.com的基金定期报告。

7.7 本基金对以上证券均采用当地市场报价。
7.8 投资者要了解本基金主要投资的证券权益投资情况,应阅读刊载于招商基金管理有限公司http://www.cmfchina.com的基金定期报告。

7.9 本基金对以上证券均采用当地市场报价。
7.10 投资者要了解本基金主要投资的证券权益投资情况,应阅读刊载于招商基金管理有限公司http://www.cmfchina.com的基金定期报告。

7.11 本基金对以上证券均采用当地市场报价。
7.12 投资者要了解本基金主要投资的证券权益投资情况,应阅读刊载于招商基金管理有限公司http://www.cmfchina.com的基金定期报告。

7.13 本基金对以上证券均采用当地市场报价。
7.14 投资者要了解本基金主要投资的证券权益投资情况,应阅读刊载于招商基金管理有限公司http://www.cmfchina.com的基金定期报告。

7.15 本基金对以上证券均采用当地市场报价。
7.16 投资者要了解本基金主要投资的证券权益投资情况,应阅读刊载于招商基金管理有限公司http://www.cmfchina.com的基金定期报告。

7.17 本基金对以上证券均采用当地市场报价。
7.18 投资者要了解本基金主要投资的证券权益投资情况,应阅读刊载于招商基金管理有限公司http://www.cmfchina.com的基金定期报告。

7.19 本基金对以上证券均采用当地市场报价。
7.20 投资者要了解本基金主要投资的证券权益投资情况,应阅读刊载于招商基金管理有限公司http://www.cmfchina.com的基金定期报告。

7.21 本基金对以上证券均采用当地市场报价。
7.22 投资者要了解本基金主要投资的证券权益投资情况,应阅读刊载于招商基金管理有限公司http://www.cmfchina.com的基金定期报告。

7.23 本基金对以上证券均采用当地市场报价。
7.24 投资者要了解本基金主要投资的证券权益投资情况,应阅读刊载于招商基金管理有限公司http://www.cmfchina.com的基金定期报告。

7.25 本基金对以上证券均采用当地市场报价。
7.26 投资者要了解本基金主要投资的证券权益投资情况,应阅读刊载于招商基金管理有限公司http://www.cmfchina.com的基金定期报告。

7.27 本基金对以上证券均采用当地市场报价。
7.28 投资者要了解本基金主要投资的证券权益投资情况,应阅读刊载于招商基金管理有限公司http://www.cmfchina.com的基金定期报告。

7.29 本基金对以上证券均采用当地市场报价。
7.30 投资者要了解本基金主要投资的证券权益投资情况,应阅读刊载于招商基金管理有限公司http://www.cmfchina.com的基金定期报告。

7.31 本基金对以上证券均采用当地市场报价。
7.32 投资者要了解本基金主要投资的证券权益投资情况,应阅读刊载于招商基金管理有限公司http://www.cmfchina.com的基金定期报告。

7.33 本基金对以上证券均采用当地市场报价。
7.34 投资者要了解本基金主要投资的证券权益投资情况,应阅读刊载于招商基金管理有限公司http://www.cmfchina.com的基金定期报告。

7.35 本基金对以上证券均采用当地市场报价。
7.36 投资者要了解本基金主要投资的证券权益投资情况,应阅读刊载于招商基金管理有限公司http://www.cmfchina.com的基金定期报告。

7.37 本基金对以上证券均采用当地市场报价。
7.38 投资者要了解本基金主要投资的证券权益投资情况,应阅读刊载于招商基金管理有限公司http://www.cmfchina.com的基金定期报告。

7.39 本基金对以上证券均采用当地市场报价。
7.40 投资者要了解本基金主要投资的证券权益投资情况,应阅读刊载于招商基金管理有限公司http://www.cmfchina.com的基金定期报告。

7.41 本基金对以上证券均采用当地市场报价。
7.42 投资者要了解本基金主要投资的证券权益投资情况,应阅读刊载于招商基金管理有限公司http://www.cmfchina.com的基金定期报告。

7.43 本基金对以上证券均采用当地市场报价。
7.44 投资者要了解本基金主要投资的证券权益投资情况,应阅读刊载于招商基金管理有限公司http://www.cmfchina.com的基金定期报告。

7.45 本基金对以上证券均采用当地市场报价。
7.46 投资者要了解本基金主要投资的证券权益投资情况,应阅读刊载于招商基金管理有限公司http://www.cmfchina.com的基金定期报告。

7.47 本基金对以上证券均采用当地市场报价。
7.48 投资者要了解本基金主要投资的证券权益投资情况,应阅读刊载于招商基金管理有限公司http://www.cmfchina.com的基金定期报告。

7.49 本基金对以上证券均采用当地市场报价。
7.50 投资者要了解本基金主要投资的证券权益投资情况,应阅读刊载于招商基金管理有限公司http://www.cmfchina.com的基金定期报告。

7.51 本基金对以上证券均采用当地市场报价。
7.52 投资者要了解本基金主要投资的证券权益投资情况,应阅读刊载于招商基金管理有限公司http://www.cmfchina.com的基金定期报告。

7.53 本基金对以上证券均采用当地市场报价。
7.54 投资者要了解本基金主要投资的证券权益投资情况,应阅读刊载于招商基金管理有限公司http://www.cmfchina.com的基金定期报告。

7.55 本基金对以上证券均采用当地市场报价。
7.56 投资者要了解本基金主要投资的证券权益投资情况,应阅读刊载于招商基金管理有限公司http://www.cmfchina.com的基金定期报告。

7.57 本基金对以上证券均采用当地市场报价。
7.58 投资者要了解本基金主要投资的证券权益投资情况,应阅读刊载于招商基金管理有限公司http://www.cmfchina.com的基金定期报告。

7.59 本基金对以上证券均采用当地市场报价。
7.60 投资者要了解本基金主要投资的证券权益投资情况,应阅读刊载于招商基金管理有限公司http://www.cmfchina.com的基金定期报告。

7.61 本基金对以上证券均采用当地市场报价。
7.62 投资者要了解本基金主要投资的证券权益投资情况,应阅读刊载于招商基金管理有限公司http://www.cmfchina.com的基金定期报告。

7.63 本基金对以上证券均采用当地市场报价。
7.64 投资者要了解本基金主要投资的证券权益投资情况,应阅读刊载于招商基金管理有限公司http://www.cmfchina.com的基金定期报告。

7.65 本基金对以上证券均采用当地市场报价。
7.66 投资者要了解本基金主要投资的证券权益投资情况,应阅读刊载于招商基金管理有限公司http://www.cmfchina.com的基金定期报告。

7.67 本基金对以上证券均采用当地市场报价。
7.68 投资者要了解本基金主要投资的证券权益投资情况,应阅读刊载于招商基金管理有限公司http://www.cmfchina.com的基金定期报告。

7.69 本基金对以上证券均采用当地市场报价。
7.70 投资者要了解本基金主要投资的证券权益投资情况,应阅读刊载于招商基金管理有限公司http://www.cmfchina.com的基金定期报告。

7.71 本基金对以上证券均采用当地市场报价。
7.72 投资者要了解本基金主要投资的证券权益投资情况,应阅读刊载于招商基金管理有限公司http://www.cmfchina.com的基金定期报告。

7.73 本基金对以上证券均采用当地市场报价。
7.74 投资者要了解本基金主要投资的证券权益投资情况,应阅读刊载于招商基金管理有限公司http://www.cmfchina.com的基金定期报告。

7.75 本基金对以上证券均采用当地市场报价。
7.76 投资者要了解本基金主要投资的证券权益投资情况,应阅读刊载于招商基金管理有限公司http://www.cmfchina.com的基金定期报告。

7.77 本基金对以上证券均采用当地市场报价。
7.78 投资者要了解本基金主要投资的证券权益投资情况,应阅读刊载于招商基金管理有限公司http://www.cmfchina.com的基金定期报告。

7.79 本基金对以上证券均采用当地市场报价。
7.80 投资者要了解本基金主要投资的证券权益投资情况,应阅读刊载于招商基金管理有限公司http://www.cmfchina.com的基金定期报告。

7.81 本基金对以上证券均采用当地市场报价。
7.82 投资者要了解本基金主要投资的证券权益投资情况,应阅读刊载于招商基金管理有限公司http://www.cmfchina.com的基金定期报告。

7.83 本基金对以上证券均采用当地市场报价。
7.84 投资者要了解本基金主要投资的证券权益投资情况,应阅读刊载于招商基金管理有限公司http://www.cmfchina.com的基金定期报告。

7.85 本基金对以上证券均采用当地市场报价。
7.86 投资者要了解本基金主要投资的证券权益投资情况,应阅读刊载于招商基金管理有限公司http://www.cmfchina.com的基金定期报告。

7.87 本基金对以上证券均采用当地市场报价。
7.88 投资者要了解本基金主要投资的证券权益投资情况,应阅读刊载于招商基金管理有限公司http://www.cmfchina.com的基金定期报告。

7.89 本基金对以上证券均采用当地市场报价。
7.90 投资者要了解本基金主要投资的证券权益投资情况,应阅读刊载于招商基金管理有限公司http://www.cmfchina.com的基金定期报告。

7.91 本基金对以上证券均采用当地市场报价。
7.92 投资者要了解本基金主要投资的证券权益投资情况,应阅读刊载于招商基金管理有限公司http://www.cmfchina.com的基金定期报告。