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更新的招募说明书摘要

(二零一二年第一号)

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(以下简称"深证TMT50ETF"、"本基金")经中国证券监督管理委员会2011年4月27日《关于核准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联接基金募集的批复》(证监许可[2011]605号文)核准公开募集。本基金的基金合同于2011年6月27日正式生效。本基金为指数型开放式。

重要提示

投资有风险,投资人认购(或申购)本基金时应认真阅读本招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本招募说明书摘要根据本基金的基金合同和招募说明书编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》,基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

本更新招募说明书所载内容截止日为2011年12月27日,有关财务和业绩表现数据截止日为2011年9月30日,财务和业绩表现数据未经审计。

一、基金管理人

(一)基金管理人概况

名称:招商基金管理有限公司

住所:深圳市深南大道7088号招商银行大厦28楼

设立日期:2002年12月27日

法定代表人:马蔚华

办公地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦28楼

电话:(0755)83196351

传真:(0755)83076974

联系人:曾倩

注册资本:人民币2.1亿元

股权结构和公司沿革:

招商基金管理有限公司于2002年12月27日经中国证监会证监基金字[2002]100号文批准设立,是中国第一家中外合资基金管理公司。公司由招商证券股份有限公司、ING Asset Management B.V.(荷兰投资)、中国电力财务有限公司、中国华能财务有限责任公司、中远财务有限责任公司共同投资组建。经公司股东会通过以及中国证监会批准,公司的注册资本金已经由人民币一亿元(RMB 100,000,000元)增加为人民币二亿一千万元(RMB 210,000,000元)。2007年5月22日,经公司股东会通过并由中国证监会批复同意,招商银行股份有限公司受让中国电力财务有限公司、中国华能财务有限责任公司、中远财务有限责任公司及招商证券股份有限公司分别持有的公司10%、10%、10%及3.4%的股权;公司外资股东ING Asset Management B.V.(荷兰投资)受让招商证券股份有限公司持有的公司3.3%的股权。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%。

公司主要中方股东招商银行成立于1987年4月8日,总行设在深圳,业务以中国市场为主。招商银行于2002年4月9日在上海证券交易所上市(股票代码:600036)。2006年9月22日,招商银行在香港联合交易所上市(股份代号:3968)。目前,招商银行注册资本为人民币215.77亿元,总资产超过人民币两万亿元。

招商证券股份有限公司是百年招商局旗下金融企业,经过多年创业发展,已成为拥有证券市场业务全牌照的一流券商。2009年11月,招商证券在上海证券交易所上市(代码600999)。

公司外方股东ING Asset Management B.V.(荷兰投资)是ING集团的专门从事资产管理业务的全资子公司。ING集团是全球最大的多元化金融集团之一,在2010年《财富》杂志500强排名第12位,投资业务遍及33个国家。

公司本着"诚信、融合、创新、卓越"的经营理念,力争成为客户推崇、股东满意、员工热爱,并具有国际竞争力的专业化的资产管理公司。

(二)主要人员情况

1、基金管理人董事、监事及其他高级管理人员介绍:

马蔚华,男,西南财经大学经济学博士,美国南加州大学荣誉博士,高级经济师。1982年至1985年,在辽宁省计委工作,历任副处长、副秘书长;1985年至1986年,在辽宁省委办公厅工作;1986年至1988年,在中共安徽省委办公厅工作;1988年至1990年,任中国人民银行办公厅副主任;1990年至1992年,任中国人民银行计划资金司副司长;1992年至1998年,任中国人民银行海南省分行行长兼国家外汇管理局海南分局局长;1999年3月至今任招商银行行长。现任本公司董事长。

葛利佳(Grant Bailey),男,澳大利亚阿得莱德大学经济学本科。1977年3月至1990年12月,任职澳大利亚财政部(1986年至1989年期间,在澳大利亚驻美国大使馆任经贸参赞);1991年1月至1996年9月,任花旗银行(澳大利亚)首席经济师;1996年10月至1998年12月,任花旗集团资产管理公司(澳纽)总经理及投资总监;1999年1月至2001年5月,任花旗集团资产管理公司(新加坡)总经理;2001年11月至2002年12月,任ING资产管理公司(澳大利亚)机构投资总监;2003年1月至2007年9月,任ING资产管理公司(澳大利亚)澳大利亚区域经理;2007年10月至2009年2月,任ING资产管理公司(迪拜)区域经理;2009年3月至今,任ING亚太资产管理公司首席执行官。现任本公司副董事长。

邓晓力,女,高级分析师。美国纽约州州立大学经济学博士。历任AT&T任市场科学决策部市场分析师,Providian Financial金融公司高级风险分析师,花旗银行风险管理部高级分析师。2001年11月加入招商证券,历任风险管理部副总经理、总经理,其间于2004年1月至9月被中国证监会借调至南方证券行政接管组工作。现任招商证券副总裁,分管财务部、风险控制部、清算中心、培训中心。现任本公司董事。

许小松,男,经济学博士。历任深圳证券交易所综合研究所副所长,南方基金管理有限公司首席经济学家、副总经理,国联安基金管理有限公司总经理,? 2011年加入招商基金管理有限公司,现任公司总经理、董事。

郑文光,男,美国寿险管理学会寿险管理院士、香港中文大学工商管理硕士。1973年至1984年间先后担任美国友邦保险有限公司香港区副总裁助理、市场拓展部经理、副总裁(营业部)等职务;1984年至2000年间先后担任安泰人寿保险(百慕达)有限公司助理总经理、总经理、执行董事等职务;2000年至2009年间担任ING集团亚太区香港、澳门地区总经理。1988年至今担任香港海港扶轮社社员;1999年至今担任香港童军总会筲箕湾区会会长;2010年至今担任交通康联人寿保险公司独立董事。现任本公司独立董事。

陈春花,女,华南理工大学工商管理学院教授、博导,南京大学博士后。曾任华南理工大学工商管理学院副院长,现任北京大学客座研究员、新加坡国立大学客座教授、澳洲国立大学国际管理硕士课程客座教授、广东省企业管理协会常务理事、广东省企业文化协会常务理事和广东省精神文明协会理事。陈春花教授曾先后出任山东六和集团总裁、康佳集团、科龙集团、TCL集团、美的家电、南方航空、广东电信等公司管理顾问。讲授课程主要有《组织行为学》、《企业文化与跨文化管理》等。现任本公司独立董事。

周语菡,女,美国加州州立大学索诺玛分校MBA。曾先后就职于丸红株氏会社(美国)公司产品部,Ananda(USA)亚洲业务部,美国ASI太平洋地区业务发展部副主任,美国iLink Global公司高级分析员以及咨询委员会委员。2001年初至2005年,就职于香港招商局中国投资管理有限公司,出任董事总经理一职,管理上市直接投资基金-招商中国直接投资基金(HK0133)。其间曾先后出任招商证券监事会主席,巨田证券监事会主席,巨田基金管理有限公司董事等职务。2006年至2007年,任职于中集集团,出任南美战略发展项目负责人。2008年至今,出任招商局中国基金有限公司(HK0133)之董事及招商局中国投资管理有限公司的董事总经理。现任公司独立董事。

张卫华,女,会计师。1981年07月——1983年11月,任江苏省连云港市汽车运输公司财务部会计;1983年11月——1988年08月,任中国银行连云港分行外汇会计部主任;1988年08月——1994年11月,历任招商银行总行国际部、会计部主任、证券业务部总经理助理;1994年11月——2006年02月,历任招银证券、国通证券及招商证券股份有限公司总裁助理兼稽核审计部总经理;2001年12月——2009年04月,任招商证券股份有限公司职工代表监事;2006年03月——2009年04月,任招商证券股份有限公司稽核监察总审计师;2009年04月起任招商证券股份有限公司合规总监,现任公司监事会主席。

周松,男,武汉大学世界经济本科专业,硕士学历。1997年2月加入招商银行,1997年2月至2006年6月历任招商银行总行计划资金部经理、副经理、总经理助理、副总经理,2006年6月至2007年7月任招商银行总行计划财务部副总经理,2007年7月至2008年11月任招商银行武汉分行副行长。2008年11月至2010年6月担任招商银行总行计划财务部副总经理(主持工作)。2010年6月起任招商银行总行计划财务部总经理,现任公司监事。

林嘉丽,女,香港城市大学法学专业毕业,香港执业律师。2003年1月至2003年8月在澳纽银行中小企业部任助理经理;2004年8月至2008年5月在富而德律师事务所任见习律师;2008年6月至今在ING投资管理(亚洲)有限公司任亚太区法律顾问。现任公司监事。

欧志明,男,华中科技大学经济学及法学双学士、投资经济硕士;2002年加入广发证券深圳业务总部任机构客户经理;2003年4月至2004年7月于广发证券总部任风险控制岗从事风险管理工作;2004年7月加入招商基金管理有限公司,曾任法律合规部高级经理、副总监,现任法律合规部总监、董事会秘书、公司监事。

路明,男,中南财经政法大学金融学硕士。1999年加入银华基金管理公司,担任交易主管职务;2005年加入东方基金管理公司,担任交易总监职务;2006年7月加入招商基金管理有限公司,曾任交易部高级交易员、首席交易员,现任交易部总监,公司监事。

杨奕,男,芝加哥大学商学院MBA优异毕业生。杨奕先生具有丰富的金融证券从业经验,拥有特许金融分析师(CFA)和中国注册会计师(CPA)资格。曾任职于深圳能源石油化工贸易有限公司和中国宝安集团股份有限公司。2003年加入招商基金管理有限公司,曾任基金管理部高级研究员、固定收益投资部副总监、专户资产投资部总监。现任公司副总经理兼投资经理。

王晓东,女,上海财经大学经济学硕士。曾任南方证券有限公司深南中路营业部总经理、深圳特区证券总经理助理、巨田基金管理有限公司(现摩根士丹利华鑫基金)副总经理、华林证券有限责任公司总裁,2007年加入招商证券股份有限公司。2007年9月至2010年3月任招商基金管理有限公司监事长,现任招商基金管理有限公司副总经理。

赵生章,男,中国人民大学经济学博士。曾任国信证券有限公司投资银行部任项目经理、招商证券股份有限公司投资银行二部副经理、内核部经理(投行内核小组负责人)、公司董事会办公室经理(负责公司公开发行及上市等相关事宜),2002年起参与招商基金管理有限公司筹备,公司成立后曾任督察长、总经理助理,现任招商基金管理有限公司副总经理。

陈喆,男,经济学硕士。曾任美国富兰克林邓普顿基金集团中国代表,中银国际证券有限责任公司执行董事,南方证券股份有限公司投行部副总经理等职,具有近15年金融证券从业经验,持有证券发行、经纪和基金从业资格。2008年2月加入招商基金,现任公司副总经理。

吴武泽,男,华中科技大学管理学硕士,对外经济贸易大学经济学博士。从2000年6月开始在特华投资有限公司工作,从事行业研究;2001年2月加盟易方达基金管理有限公司,负责数量分析、基金研究、系统开发等方面的工作,先后任研究员、业务主管。2003年9月加入招商基金,一直从事数量研究和模型开发等工作,曾任公司投资风险管理部总监,现任公司督察长。

2、本基金基金经理介绍

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。现任招商深证100指数证券投资基金基金经理(管理时间:2010年6月22日至今)、上证消费80交易型开放式指数证券投资基金及联接基金基金经理(管理时间:2010年12月8日至今)、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联接基金基金经理(管理时间:2011年6月27日至今)。

3、投资决策委员会成员

公司的投资决策委员会由如下成员组成:副总经理杨奕、总经理助理兼固定收益投资部负责人张国强、总经理助理兼股票投资部负责人袁野、专户资产投资部总监杨渺、研究部总监陈玉辉、交易部总监路明。

4、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

(一)基本情况

名称:中国银行股份有限公司(简称"中国银行")

住所及办公地址:北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期:1983年10月31日

变更注册登记日期:2004年8月26日

注册资本:人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

法定代表人:肖 钢

基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字【1998】24号

托管及投资者服务部总经理:李爱华

托管部门信息披露联系人:唐州徽

电话:(010)66594855

传真:(010)66594942

(二)基金托管部门及主要人员情况

中国银行于1998年设立基金托管部,为进一步树立以投资者为中心的服务理念,中国银行于2005年3月23日正式将基金托管部更名为托管及投资者服务部,下设覆盖集合类产品、机构类产品、全球托管产品、投资分析及监督服务、风险管理与内控、核算估值、信息技术、资金和证券交收等各层面的多个团队,现有员工110余人,其中,90%以上的员工具备本科以上学历。另外,中国银行在重点分行已开展托管业务。

目前,中国银行拥有证券投资基金、一对多专户、一对一专户、社保基金、保险资产、QFII资产、QDII资产、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、信托资产、年金资产、理财产品、海外人民币基金、私募基金等门类齐全的托管产品体系。在国内,中国银行率先开展绩效评估、风险管理等增值服务,为各类客户提供个性化的托管服务。2010年末中国银行在中国内地托管的资产突破万亿元,居同业前列。

(三)证券投资基金托管情况

截至2011年9月末,中国银行已托管长盛创新先锋混合、长盛同盛封闭、长盛同智优势混合(LOF)、大成2020生命周期混合、大成蓝筹稳健混合、大成优选封闭、大成景宏封闭、工银大盘蓝筹股票、工银核心价值股票、国泰沪深300指数、国泰金鹿保本混合、国泰金鹏蓝筹混合、国泰区位优势股票、国投瑞银稳定增利债券、海富通股票、海富通货币、海富通精选贰号混合、海富通收益增长混合、海富通中证100指数(LOF)、华宝兴业大盘精选股票、华宝兴业动力组合股票、华宝兴业先进成长股票、华夏策略混合、华夏大盘精选混合、华夏回报二号混合、华夏回报混合、华夏行业股票(LOF)、嘉实超短债债券、嘉实成长收益混合、嘉实服务增值行业混合、嘉实沪深300指数(LOF)、嘉实货币、嘉实稳健混合、嘉实研究精选股票、嘉实增长混合、嘉实债券、嘉实主题混合、嘉实回报混合、嘉实价值优势股票型、金鹰成份优选股票、金鹰行业优势股票、银河成长股票、易方达平稳增长混合、易方达策略成长混合、易方达策略成长二号混合、易方达积极成长混合、易方达货币、易方达稳健收益债券、易方达深证100ETF、易方达中小盘股票、易方达深证100ETF联接、万家180指数、万家稳健增利债券、银华优势企业混合、银华优质增长股票、银华领先策略股票、景顺长城动力平衡混合、景顺长城优选股票、景顺长城货币、景顺长城鼎益股票(LOF)、泰信天天收益货币、泰信优质生活股票、泰信蓝筹精选股票、泰信债券增强收益、招商先锋混合、泰达宏利精选股票、泰达宏利集利债券、泰达宏利中证财富大盘指数、华泰柏瑞盛世中国股票、华泰柏瑞积极成长混合、华泰柏瑞价值增长股票、华泰柏瑞货币、华泰柏瑞量化现行股票型、南方高增长股票(LOF)、国富潜力组合股票、国富强化收益债券、国富成长动力股票、宝盈核心优势混合、招商行业领先股票、东方核心动力股票、华安行业轮动股票型、摩根士丹利华鑫强收益债券型、诺德中小盘股票型、民生加银稳健成长股票型、博时宏观回报债券型、易方达岁丰添利债券型、富兰克林国海中小盘股票型、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金联接、上证中小盘交易型开放式指数、华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接、长城中小盘成长股票型、易方达医疗保健行业股票型、景顺长城稳定收益债券型、上证180金融交易型开放式指数、国泰上证180金融交易型开放式指数证券投资基金联接、诺德优选30股票型、泰达宏利聚利分级债券型、国联安优选行业股票型、长盛同鑫保本混合型、金鹰中证技术领先指数增强型、泰信中证200指数、大成内需增长股票型、银华永祥保本混合型、招商深圳电子信息传媒产业(TMT)50交易型开放式指数、招商深证TMT50交易型开放式指数证券投资基金联接、嘉实深证基本面120交易型开放式指数证券投资基金联接、深证基本面120交易型开放式指数、上证180成长交易型开放式指数、华宝兴业上证180成长交易型开放式指数证券投资基金联接、易方达资源行业股票型、华安深证300指数、嘉实信用债券型、平安大华行业先锋股票型、华泰柏瑞信用增利债券型、嘉实海外中国股票(QDII)、银华全球优选(QDII-FOF)、长盛环球景气行业大盘精选股票型(QDII)、华泰柏瑞亚洲领导企业股票型(QDII)、信诚金砖四国积极配置(QDII)、海富通大中华精选股票型(QDII)、招商标普金砖四国指数(LOF-QDII)、华宝兴业成熟市场动量优选(QDII)、大成标普500等权重指数(QDII)、长信标普100等权重指数(QDII)、博时抗通胀增强回报(QDII)、华安大中华升级股票型(QDII)、工银瑞信中国机会全球配置股票型(QDII)等128只证券投资基金,覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金,满足了不同客户多元化的投资理财需求,基金托管规模位居同业前列。

三、相关服务机构

(一)场内申购、赎回代理机构

(1)代销机构:招商证券股份有限公司

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

(2)代销机构:安信证券股份有限公司

注册地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元

法定代表人:牛冠兴

电话:0755-82825551

传真:0755-82558355

联系人:余江

(3)代销机构:国海证券有限责任公司

注册地址:南宁市滨湖路46号

法定代表人:张雅锋

电话:(0755)83709350

传真:(0755)83700205

联系人:牛孟宇

(4)代销机构:广州证券有限责任公司

注册地址:广州市先烈中路69号东山广场主楼十七楼

法定代表人:刘东

电话:020-88836999

传真:020-88836654

联系人:林洁茹

(5)代销机构:海通证券股份有限公司

注册地址:上海市淮海中路98号

法定代表人:王开国

电话:021-23219000

传真:021-23219100

联系人:金芸、李笑鸣

(6)代销机构:华宝证券有限责任公司

注册地址:上海市陆家嘴环路166号未来资产大厦27层

法定代表人:陈林

电话:(021)50122222

传真:(021)50122200

联系人:宋歌

(7)代销机构:东吴证券股份有限公司

注册地址:苏州工业园区翠园路181号商旅大厦18-21层

法定代表人:吴永敏

电话:0512-65581136

传真:0512-65588021

联系人:方晓丹

(8)代销机构:东兴证券股份有限公司

注册地址:北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层

法定代表人:徐勇力

电话:010-66555316

传真:010-66555246

联系人:汤漫川

(9)代销机构:山西证券股份有限公司

注册地址:太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼

法定代表人:侯巍

电话:0351-8686659

传真:0351-8686619

联系人:郭熠

(10)代销机构:中国银河证券股份有限公司

注册地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

法定代表人:顾伟国

电话:(010)66568430

传真:(010)66568532

联系人:田薇

(11)代销机构:宏源证券股份有限公司

注册地址:新疆乌鲁木齐市文艺路233号

法定代表人:冯戎

电话:(010)88085858

传真:(010)88085195

联系人:李巍

(12)代销机构:红塔证券股份有限公司

注册地址:云南省昆明市北京路155号附1号红塔大厦9楼

法定代表人:况雨林

电话:0871-3577398

传真:0871-3578827

联系人:高国泽

(二)注册登记机构

名称:中国证券登记结算有限责任公司

地址:北京市西城区太平桥大街17号

法定代表人:金颖

联系人:严峰

电话:(0755)25946013

传真:(0755)25987122

(三)律师事务所和经办律师

名称:北京市高朋律师事务所

注册地址:北京市朝阳区东三环北路2号南银大厦28层

法定代表人:王磊

电话:(010)59241188

传真:(010)59241199

经办律师:王明涛、董文浩

联系人:王明涛

(四)会计师事务所和经办注册会计师

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:曾浩、汪芳

联系人:曾浩

四、基金的名称: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

五、基金类型:指数型开放式

六、基金的投资目标:紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

七、投资方向

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括深证TMT50指数的成份股及其备选成份股、一级市场新发股票(包括主板市场、中小板市场和创业板市场的股票)、债券、权证、货币市场工具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。

本基金投资于深证TMT50指数的成份股及其备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%。

八、基金的投资策略

本基金以深证TMT50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,但在特殊情况下,本基金可以选择其他证券或证券组合对标的指数中的股票进行适当替代,这些情况包括但不限于:(1)法律法规的限制;(2)标的指数成份股流动性严重不足;(3)标的指数的成份股票长期停牌;(4)其他原因导致本基金管理人对标的指数的跟踪构成严重制约等。

在正常情况下,本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%,年跟踪误差不超过2%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围,基金管理人将采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

(一)投资组合管理

1、投资组合的构建

(1)确定目标组合。主要采取完全复制法,即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合。

(2)制定建仓策略。依据对标的指数成份股的流动性和交易成本等因素所做的分析,制定合理的建仓策略。

(3)逐步调整组合。基金经理在规定时间内,采取适当的手段和措施,对实际投资组合进行动态调整,直至达到紧密跟踪标的指数的目标。

2、日常投资组合管理

(1)标的指数定期调整

根据标的指数的编制规则及调整公告,本基金在指数成份股调整生效前,分析并确定组合调整策略,及时进行投资组合的优化调整,减少流动性冲击,尽量减少标的指数成份股变动所带来的跟踪偏离度和跟踪误差。

(2)标的指数成份股票临时调整

在标的指数成份股票调整周期内,若出现成份股票临时调整的情形,本基金管理人将密切关注样本股票的调整,并及时制定相应的投资组合调整策略。

(3)成份股公司行为信息的日常跟踪与分析

跟踪分析标的指数成份股公司行为等信息,如股本变化、分红、配股、增发、停牌、复牌等重大公司信息,分析这些信息对指数的影响,并根据这些信息确定基金投资组合每日交易策略。

(4)每日申购赎回情况的跟踪与分析

跟踪分析每日基金申购和赎回信息,结合基金的现金头寸管理,制定交易策略以应对基金的申购赎回。

(5)投资组合持有证券、现金头寸及流动性分析

跟踪分析每日基金实际投资组合与目标组合的差异及差异产生的原因,并对拟调整的成份股的流动性进行分析。

(6)投资组合调整

使用数量化分析模型,选择最优调整方案,制定组合交易调整策略;如标的指数成份股调整、成份股公司发生兼并等重大事件,可提请投资决策委员会召开会议,决定基金的操作策略;调整投资组合,达到所追求的目标组合的持仓结构。

(7)制作管理基金每日申购赎回清单

以T-1日标的指数成份股的构成及其权重为基础,并考虑T日将发生的上市公司变动等情况,制作T日基金申购赎回清单并公告。

(8)跟踪偏离度的监控与管理

每日跟踪基金组合与标的指数表现的偏离度,每月末、季度末定期分析基金的实际组合与标的指数表现的累计偏离度、跟踪误差变化情况及其原因,并优化跟踪偏离度管理方案。 在正常情况下,本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%,年跟踪误差不超过2%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围,基金管理人将采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

(二)投资决策流程

1、投资决策依据

(1)须符合国家有关法律法规,严格遵守基金合同及公司章程;

(2)维护基金份额持有人利益作为基金投资的最高准则。

2、投资决策流程

(1)投资决策。投资决策委员会定期不定期召开投资决策委员会议,对相关重大事项做出决策。基金经理根据投资决策委员会的决议,做出基金投资管理的日常决策。

(2)组合构建。基金经理采取完全复制法,即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应的调整。在追求跟踪误差和跟踪偏离度最小化的前提下,基金经理可采取适当的方法,提高投资效率,降低交易成本,控制投资风险。

(3)交易执行。交易部负责基金的具体交易执行,同时履行一线监控的职责。

(4)组合监控与调整。基金经理在指数编制方法发生变更、指数成份股定期或临时调整、指数成份股出现股本变化、增发、配股等情形、成份股停牌、成份股流动性不足、基金申购赎回出现的现金流量等情形下,对基金投资组合进行动态监控和调整,密切跟踪标的指数。

(5)绩效评估。基金经理及风险管理部定期不定期对投资组合的偏离度和跟踪误差进行跟踪和评估。风险管理部负责对各决策环节的事前及事后风险、操作风险等投资风险进行监控,并对投资风险及绩效做出评估,提供给投资决策委员会、投资总监、基金经理等相关人员。基金经理依据绩效评估报告对投资进行总结或检讨,如果需要,亦对投资组合进行相应的调整。

基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下,根据环境的变化和基金实际投资的需要,有权对上述投资程序做出调整,并将调整内容在基金招募说明书及招募说明书更新中予以公告。

九、业绩比较基准:

本基金的业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为深证TMT50指数。

如果指数编制单位变更或停止深证TMT50指数的编制、发布或授权,或深证TMT50指数由其他指数替代、或由于指数编制方法的重大变更等事项导致深证TMT50指数不宜继续作为标的指数,或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出,或目标ETF标的指数发生变更,基金管理人认为有必要作相应调整时,本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则,在履行适当程序后变更本基金的标的指数、业绩比较基准和基金名称。其中,若变更标的指数涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更,则基金管理人应就变更标的指数召开基金份额持有人大会,并报中国证监会备案且在指定媒体公告。若变更标的指数对基金投资范围和投资策略无实质性影响(包括但不限于指数编制单位变更、指数更名等事项),则无需召开基金份额持有人大会,基金管理人应与基金托管人协商一致后,报中国证监会备案并及时公告。

十、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深证TMT50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。

十一、投资组合报告:

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管理人-招商基金管理有限公司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。

本投资组合报告所载数据截至2011年09月30日,来源于《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2011年第3季度报告》。

1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	533,771,639.67	98.92
	其中:股票	533,771,639.67	98.92
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	5,275,137.83	0.98
6	其他资产	538,132.63	0.10
7	合计	539,584,910.13	100.00

注:此处的股票投资项含可退替代款估值增值。

2 报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1报告期末指数投资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	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	331,180,766.54	61.51
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	197,089,468.08	36.60
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	131,037,442.46	24.34
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	3,053,856.00	0.57
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	121,735,974.60	22.61
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	43,819,116.53	8.14
M	综合类	37,035,782.00	6.88
	合计	533,771,639.67	99.14

2.2报告期末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。

3报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

3.1报告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前十名股票投资明细

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	000651	格力电器	1,587,715	31,738,422.85	5.89
2	000063	中兴通讯	1,655,660	31,291,974.00	5.81
3	000527	美的电器	2,028,300	29,897,142.00	5.55
4	000725	京东方A	12,505,200	26,511,024.00	4.92
5	000100	TCL 集团	11,512,400	24,406,288.00	4.53
6	000970	中科三环	858,600	21,885,714.00	4.06
7	002106	莱宝高科	857,200	21,129,980.00	3.92
8	000839	中信国安	2,201,900	19,508,834.00	3.62
9	000917	电广传媒	774,744	18,632,593.20	3.46
10	002008	大族激光	1,736,075	15,190,656.25	2.82

3.2报告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前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

4报告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。

5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

6 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。

7 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。

8 投资组合报告附注

8.1 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。

8.2 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。

8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	500,000.00
2	应收证券清算款	227.85
3	应收股利	-
4	应收利息	1,104.78
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	36,800.00
8	其他	-
9	合计	538,132.63

8.4 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。

8.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.5.1报告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。

8.5.2报告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。

十二、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,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,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期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	净值增长率①	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
自基金成立起至2011.09.30	-16.60%	1.30%	-14.09%	1.53%	-2.51%	-0.23%

本基金合同生效日为2011年6月27日

十三、基金的费用与税收

(一)基金费用的种类

1、基金管理人的管理费;

2、基金托管人的托管费;

3、标的指数许可使用费;

4、基金合同生效以后与基金相关的信息披露费用;

5、基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费;

6、基金上市费及年费;

7、基金收益分配中发生的费用;

8、基金份额持有人大会费用;

9、基金的证券交易费用;

10、基金的银行汇划费用;

11、按照国家有关法律法规规定和基金合同约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金终止清算时所发生费用,按实际支出额从基金财产总值中扣除。

(二)基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.5%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×0.5%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.1%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.1%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

上述一、基金费用的种类中第3-11项费用,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

(三)不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;

3、基金合同生效前的相关费用,包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用;

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

(四)费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后,可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率等相关费率。

调高基金管理费率、基金托管费率等费率,须召开基金份额持有人大会审议;调低基金管理费率、基金托管费率等费率,无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日前2日在至少一种指定媒体和基金管理人网站上公告。

(五)基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《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》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求,对本基金管理人于2011年5月12日刊登的本基金招募说明书进行了更新,并根据本基金管理人在前次招募说明书刊登后,对本基金的投资经营活动进行了内容补充和数据更新。

本次主要更新的内容如下:

1、在"三、基金管理人"部分,对"(一)基金管理人概况"、"(二)目前所管理基金的基本情况"、"(三)主要人员情况"进行了更新。

2、在"四、基金托管人"部分,对"(一)基本情况"、"(二)基金托管部门及主要人员情况"、"(三)证券投资基金托管情况"截至2011年9月末中国银行基金托管业务的情况作了更新。

3、在"五、相关服务机构"部分,对"(一)场内申购、赎回代理券商"、"(二)注册登记机构"、"(四)会计师事务所和经办注册会计师"进行了更新。

4、删除了原招募书中的"六、基金的募集"部分。

5、删除了原招募书中的"七、基金合同的生效"部分。

6、在"八、基金份额的申购与赎回",对"(七)申购赎回清单的内容与格式"的"5、申购赎回清单的格式"进行了更新。

7、在"九、基金的投资"部分,增加了"(十二)基金投资组合报告"并补充了本基金最近一期投资组合报告的内容。

8、增加了"十、基金的业绩"部分,并分别列示了本基金自基金合同生效之日起至2011年9月30日以来的业绩表现。

9、对"二十一、对基金份额持有人的服务"进行了更新。

10、在"二十二、其他应披露事项"部分,列示了前次招募说明书刊登到本次招募说明书更新截止日之间的信息披露事项。

招商基金管理有限公司

2012年2月8日

证券代码:002224 证券简称:三力士 公告编号:2012-011

浙江三力士橡胶股份有限公司第四届董事会第二次会议决议公告

本公司及董事、监事、高级管理人员保证公告内容的真实、准确和完整,并对公告中的虚假记载、误导性陈述或重大遗漏承担责任。

重要内容提示:

● 本次非公开发行拟增资标的公司的审计、评估等工作正在进行中,待相关工作完成后,公司将再次召开董事会审议相关结果进行补充审议披露,并提交至公司股东大会审议表决。

● 本公司股票于2012年2月8日开市起复牌。

浙江三力士橡胶股份有限公司(以下简称"三力士"或"公司")第四届董事会第二次会议(以下简称:"本次会议")通知于2012年2月2日以电话、电子邮件等方式送达,会议于2012年2月7日15:30在公司一楼会议室召开。会议应到董事5人,实际参会董事5人,公司三名监事及全体高管列席会议。本次会议的参会人数、召集、召开程序、议事内容均符合《公司法》、《公司章程》和《董事会议事规则》的规定。

会议由董事长吴培生主持,经认真审议,与会董事通过记名投票方式表决,以5票同意、0票不同意、0票弃权形成如下决议:

一、审议通过《关于公司符合非公开发行股票条件的议案》

根据《中华人民共和国公司法》、《中华人民共和国证券法》和中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")颁布的《上市公司证券发行管理办法》、《上市公司非公开发行股票实施细则》等有关法律法规、规章和规范性文件的规定,公司董事会经过对公司实际情况及相关事项进行认真的自查论证,认为公司已经符合非公开发行境内上市人民币普通股(A股)的条件。

二、审议通过《关于公司非公开发行股票方案的议案》

本次非公开发行A股股票的具体方案如下:

(一)发行股票的种类和面值

本次非公开发行股票的种类为境内上市的人民币普通股(A股),每股面值为人民币1.00元。

(二)发行方式

本次发行股票采取向特定对象非公开发行股票的方式发行,在中国证监会核准后6个月内择机向特定对象发行股票。

(三)发行数量

本次向特定对象非公开发行的股票合计不超过5,800万股(含5,800万股),在上述范围内,具体发行数量将提请股东大会授权公司董事会与保荐机构(主承销商)协商确定。

若公司股票在定价基准日至发行日期间发生派息、送红股、资本公积金转增股本等除权除息事项,本次发行的数量将作相应调整。

(四)发行对象及认购方式

本次非公开发行的发行对象不超过十名特定投资者,包括境内注册的证券投资基金管理公司、证券公司、财务公司、资产管理公司、保险机构、信托投资公司(以其自有资金)、QFII以及其他合格的投资者等。证券投资基金管理公司以多个投资账户持有股份的,视为一个发行对象,信托投资公司作为发行对象的,只能以自有资金认购。发行对象应符合法律、法规的规定(在本次董事会决议公告后至本次非公开发行工作结束之前,若监管部门对非公开发行股票的认购对象数量的上限进行调整,则本次非公开发行的认购对象数量上限相应调整为届时监管部门规定的非公开发行认购对象的数量上限)。在上述范围内,公司在取得中国证监会本次发行核准批文后,按照《上市公司非公开发行股票实施细则》的规定以竞价方式确定发行对象。

本次非公开发行的股份由认购对象以现金方式认购。

(五)发行价格和定价原则

本次非公开发行的定价基准日为本次董事会决议公告日(2012年2月8日),发行价格不低于定价基准日前二十个交易日公司股票交易均价的百分之九十,即发行价格不低于6.78元/股。

(注:定价基准日前20个交易日股票交易均价=定价基准日前20个交易日股票交易总额/定价基准日前20个交易日股票交易总量)。

若公司股票在董事会决议公告日至发行日期间有派息、送股、资本公积金转增股本等除权除息事项,将对发行底价进行相应调整。最终发行价格将在公司取得中国证监会本次发行核准批文后,按照《上市公司非公开发行股票实施细则》等相关规定,根据竞价结果由公司董事会与保荐机构(主承销商)协商确定。

(六)锁定期

本次向特定对象发行的股份,自本次发行结束之日起12个月内不得转让。

(七)募集资金用途及数额

本次非公开发行募集资金总额不超过39,000万元,扣除发行费用后拟投资于如下项目:

序号	项目名称	项目总投资(万元)	拟投入募集资金(万元)
1	新建年产3,000万Am高性能特种传动V带生产线	11,200	11,000
2	年产特种橡胶带骨架材料13,500吨建设项目	40,000	28,000
	合计	51,200	39,000

如果本次非公开发行募集资金不能满足公司项目的资金需要,公司将利用自筹资金解决差额部分。如果本次非公开发行募集资金超过公司项目的实际资金需要,剩余部分的募集资金将用于补充公司流动资金。

本次发行募集资金将按上述项目顺序投入,在不改变本次募集资金投资项目的前提下,公司董事会可根据项目的实际需求,对上述项目的募集资金投入顺序和金额进行适当调整。本次非公开发行募集资金到位之前,公司将根据项目进度的实际情况以银行贷款、自有资金等自筹资金先行投入,并在募集资金到位之后予以置换。

公司已就新建年产3,000万Am高性能特种传动V带生产线项目开展前期筹划准备工作。

年产特种橡胶带骨架材料13,500吨建设项目将通过浙江三达工业用布有限公司(以下简称"浙江三达")实施,浙江三达现为台州亚达聚氨酯有限公司(以下简称"亚达聚氨酯")全资子公司,公司已与亚达聚氨酯就增资并控股浙江三达事宜达成一致性意向,但尚需按照相关规定办理审计、评估及内部审议等手续。首次增资完成后,公司将持有浙江三达70%股权;后续增资时,浙江三达各方股东将同比例增资,按照4亿元的项目总投资规模及70%持股比例,公司将总投入2.8亿元。

(八)上市地点

本次非公开发行的股份将申请在深圳证券交易所上市交易。

(九)本次发行前滚存未分配利润的处置方案

为兼顾新老股东的利益,本次发行前滚存的未分配利润将由本次发行完成后的新老股东按照持股比例共享。

(十)决议的有效期

与本议案有关的决议自公司股东大会审议通过之日起十二个月内有效。

三、审议通过《关于公司非公开发行股票预案的议案》

《浙江三力士橡胶股份有限公司非公开发行股票预案》全文详见公司指定信息披露网站巨潮资讯网(http://www.cninfo.com.cn)。

四、审议通过《关于与亚达聚氨酯、浙江三达签署<增资协议>的议案》

本次非公开发行募集的部分资金将部分用于增资浙江三达工业用布有限公司,首次增资完成后公司将持有其70%股权;后续增资时,将由浙江三达各方股东同比例增资。

公司于2012年2月7日与亚达聚氨酯、浙江三达就前述增资及同比例增资事宜签订《增资协议》。亚达聚氨酯、浙江三达为公司非关联方,本事项亦不构成关联交易。

本次交易的标的资产尚未完成审计和评估,因此本次增资价格尚未最终确定,最终金额将以评估机构的评估结果为基准协商确定。待审计、评估相关工作完成后,公司将重新召开董事会和股东大会审议,并予以披露。

五、审议通过《关于提请股东大会授权董事会全权办理本次非公开发行股票相关事宜的议案》

为保证公司本次非公开发行股票工作的顺利进行,公司董事会提请公司股东大会授权董事会全权办理本次非公开发行股票相关事宜,具体内容包括:

1、授权公司董事会依据国家法律法规、证券监管部门的有关规定和股东大会决议,制定和实施本次非公开发行股票的具体方案,其中包括发行时机、发行数量和募集资金规模、发行起止时间、发行价格、发行对象的选择,具体申购办法以及其他与发行和上市有关的事宜;

2、授权董事会根据有关部门对具体项目的审核、相关市场条件变化、募集资金项目实施条件变化等因素综合判断,并在本次非公开发行股票前调整本次募集资金投资项目;

3、授权公司董事会聘请参与本次非公开发行股票的保荐机构(主承销商)等中介机构,修改、补充、签署、递交、呈报、执行本次非公开发行股票有关的一切协议和文件;

4、授权公司董事会依据国家法律法规、证券监管部门的有关规定办理本次非公开发行股票的申报及上市事宜,包括签署相关申报文件及其他法律文件;

5、授权公司董事会在本次非公开发行股票结束后,根据发行后的公司股本、股份总数及构成变动情况修改公司章程相关条款,并办理相关工商变更登记;

6、授权公司董事会在监管部门关于非公开发行股票政策发生变化或市场条件发生变化时,对本次非公开发行股票方案进行调整;

7、授权公司董事会办理募集资金专项存储账户设立事宜,以及根据有关管理部门要求和证券市场的实际情况,在股东大会决议范围内对募集资金项目具体安排进行相应的调整;

8、在法律、法规、有关规范性文件及《公司章程》允许范围内,授权公司董事会办理与本次非公开发行股票的发行、申报、上市、登记等相关的其他事项。

本授权自公司股东大会批准之日起十二个月内有效。

六、审议通过《关于本次董事会后暂不召集股东大会的议案》

本次董事会后,暂不立即召开股东大会。根据本次董事会审议通过的相关决议内容,公司将积极进行相应的准备工作,待上述募集资金拟投入项目所涉及的审计、评估等事项完成,并编制《董事会关于本次募集资金使用的可行性分析》及《董事会关于前次募集资金使用情况的报告》后,本公司将再次召开董事会,对相关事项做出补充决议,并公告股东大会召开时间。

本次非公开发行股票的方案需通过公司股东大会审议,并报中国证监会核准后方可实施。

备查文件:

(一)经与会董事签字并加盖董事会印章的董事会决议;

(二)增资协议;

(三)深交所要求的其他文件。

浙江三力士橡胶股份有限公司董事会

二〇一二年二月八日