

上证消费80交易型开放式指数证券投资基金

2013第一季度报告

2013年3月31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

报告送出日期：2013年4月20日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及监事会对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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同的约定，于2013年4月15日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

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。

基金的过往业绩并不代表其未来表现，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2013年1月1日起至2013年3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	上证消费80(场内简称：消费ETF)
基金代码	510150
基金份额总额	510150
基金运作方式	交易型开放式(ETF)
基金合同生效日	2010年12月8日
报告期末基金份额总额	489,931,500.00份
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。
投资策略	本基金主要投资于标的指数成份股，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进行股票投资，进行等比例指数化投资。投资在股票、债券、货币市场工具等金融工具上的资产不得超过基金资产净值的5%，现金以及到期日在一年以内（含一年）的政府债券的比例合计不得超过基金资产净值的5%。本基金为指数型基金，不进行资产配置，也不保留现金资产，但不保证基金一定盈利。
业绩比较基准	上证消费80指数
风险收益特征	本基金为股票型基金，风险收益特征与股票型基金相类，适合风险承受能力较强的投资者。
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 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元		报告期(2013年1月1日-2013年3月31日)			
1.本期实现收益		-12,120,872.71			
2.本期利润		58,860,891.62			
3.加权平均基金份额本期利润		0.1216			
4.期末基金份额净值		1,226,796,309.29			
5.期末份额净值		2,504			

注：1.上述基金业指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计算费用后实际可得收入将低于所列数字；

2.本期已实现收益指基金利润减去必要的费用后的余额，本期利润为本期实现收益加上本期利润分配金额。

3.2.3 基金份额净值增长及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注：1.上述基金业指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计算费用后实际可得收入将低于所列数字；

2.本期已实现收益指基金利润减去必要的费用后的余额，本期利润为本期实现收益加上本期利润分配金额。

3.2.4 上述报告期基金份额净值增长及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注：1.上述基金业指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计算费用后实际可得收入将低于所列数字；

2.本期已实现收益指基金利润减去必要的费用后的余额，本期利润为本期实现收益加上本期利润分配金额。

3.2.5 上述报告期基金份额净值增长及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注：1.上述基金业指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计算费用后实际可得收入将低于所列数字；

2.本期已实现收益指基金利润减去必要的费用后的余额，本期利润为本期实现收益加上本期利润分配金额。

3.2.6 上述报告期基金份额净值增长及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注：1.上述基金业指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计算费用后实际可得收入将低于所列数字；

2.本期已实现收益指基金利润减去必要的费用后的余额，本期利润为本期实现收益加上本期利润分配金额。

3.2.7 上述报告期基金份额净值增长及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注：1.上述基金业指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计算费用后实际可得收入将低于所列数字；

2.本期已实现收益指基金利润减去必要的费用后的余额，本期利润为本期实现收益加上本期利润分配金额。

3.2.8 上述报告期基金份额净值增长及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注：1.上述基金业指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计算费用后实际可得收入将低于所列数字；

2.本期已实现收益指基金利润减去必要的费用后的余额，本期利润为本期实现收益加上本期利润分配金额。

3.2.9 上述报告期基金份额净值增长及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注：1.上述基金业指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计算费用后实际可得收入将低于所列数字；

2.本期已实现收益指基金利润减去必要的费用后的余额，本期利润为本期实现收益加上本期利润分配金额。

3.2.10 上述报告期基金份额净值增长及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注：1.上述基金业指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计算费用后实际可得收入将低于所列数字；

2.本期已实现收益指基金利润减去必要的费用后的余额，本期利润为本期实现收益加上本期利润分配金额。

3.2.11 上述报告期基金份额净值增长及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注：1.上述基金业指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计算费用后实际可得收入将低于所列数字；

2.本期已实现收益指基金利润减去必要的费用后的余额，本期利润为本期实现收益加上本期利润分配金额。

3.2.12 上述报告期基金份额净值增长及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注：1.上述基金业指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计算费用后实际可得收入将低于所列数字；

2.本期已实现收益指基金利润减去必要的费用后的余额，本期利润为本期实现收益加上本期利润分配金额。

3.2.13 上述报告期基金份额净值增长及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注：1.上述基金业指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计算费用后实际可得收入将低于所列数字；

2.本期已实现收益指基金利润减去必要的费用后的余额，本期利润为本期实现收益加上本期利润分配金额。

3.2.14 上述报告期基金份额净值增长及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注：1.上述基金业指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计算费用后实际可得收入将低于所列数字；

2.本期已实现收益指基金利润减去必要的费用后的余额，本期利润为本期实现收益加上本期利润分配金额。

3.2.15 上述报告期基金份额净值增长及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注：1.上述基金业指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计算费用后实际可得收入将低于所列数字；

2.本期已实现收益指基金利润减去必要的费用后的余额，本期利润为本期实现收益加上本期利润分配金额。

3.2.16 上述报告期基金份额净值增长及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注：1.上述基金业指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计算费用后实际可得收入将低于所列数字；

2.本期已实现收益指基金利润减去必要的费用后的余额，本期利润为本期实现收益加上本期利润分配金额。

3.2.17 上述报告期基金份额净值增长及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注：1.上述基金业指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计算费用后实际可得收入将低于所列数字；

2.本期已实现收益指基金利润减去必要的费用后的余额，本期利润为本期实现收益加上本期利润分配金额。

3.2.18 上述报告期基金份额净值增长及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注：1.上述基金业指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计算费用后实际可得收入将低于所列数字；

2.本期已实现收益指基金利润减去必要的费用后的余额，本期利润为本期实现收益加上本期利润分配金额。

3.2.19 上述报告期基金份额净值增长及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注：1.上述基金业指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计算费用后实际可得收入将低于所列数字；

2.本期已实现收益指基金利润减去必要的费用后的余额，本期利润为本期实现收益加上本期利润分配金额。

3.2.20 上述报告期基金份额净值增长及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注：1.上述基金业指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计算费用后实际可得收入将低于所列数字；

2.本期已实现收益指基金利润减去必要的费用后的余额，本期利润为本期实现收益加上本期利润分配金额。

3.2.21 上述报告期基金份额净值增长及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注：1.上述基金业指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计算费用后实际可得收入将低于所列数字；

2.本期已实现收益指基金利润减去必要的费用后的余额，本期利润为本期实现收益加上本期利润分配金额。

3.2.22 上述报告期基金份额净值增长及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注：1.上述基金业指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计算费用后实际可得收入将低于所列数字；

2.本期已实现收益指基金利润减去必要的费用后的余额，本期利润为本期实现收益加上本期利润分配金额。

3.2.23 上述报告期基金份额净值增长及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注：1.上述基金业指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计算费用后实际可得收入将低于所列数字；

2.本期已实现收益指基金利润减去必要的费用后的余额，本期利润为本期实现收益加上本期利润分配金额。

3.2.24 上述报告期基金份额净值增长及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注：1.上述基金业指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计算费用后实际可得收入将低于所列数字；

2.本期已实现收益指基金利润减去必要的费用后的余额，本期利润为本期实现收益加上本期利润分配金额。

3.2.25 上述报告期基金份额净值增长及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注：1.上述基金业指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计算费用后实际可得收入将低于所列数字；

2.本期已实现收益指基金利润减去必要的费用后的余额，本期利润为本期实现收益加上本期利润分配金额。

3.2.26 上述报告期基金份额净值增长及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注：1.上述基金业指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计算费用后实际可得收入将低于所列数字；

2.本期已实现收益指基金利润减去必要的费用后的余额，本期利润为本期实现收益加上本期利润分配金额。

3.2.27 上述报告期基金份额净值增长及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注：1.上述基金业指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计算费用后实际可得收入将低于所列数字；

2.本期已实现收益指基金利润减去必要的费用后的余额，本期利润为本期实现收益加上本期利润分配金额。

3.2.28 上述报告期基金份额净值增长及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注：1.上述基金业指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计算费用后实际可得收入将低于所列数字；

2.本期已实现收益指基金利润减去必要的费用后的余额，本期利润为本期实现收益加上本期利润分配金额。

3.2.29 上述报告期基金份额净值增长及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注：1.上述基金业指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计算费用后实际可得收入将低于所列数字；

2.本期已实现收益指基金利润减去必要的费用后的余额，本期利润为本期实现收益加上本期利润分配金额。

3.2.30 上述报告期基金份额净值增长及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注：1.上述基金业指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计算费用后实际可得收入将低于所列数字；

2.本期已实现收益指基金利润减去必要的费用后的余额，本期利润为本期实现收益加上本期利润分配金额。

3.2.31 上述报告期基金份额净值增长及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注：1.上述基金业指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计算费用后实际可得收入将低于所列数字；

2.本期已实现收益指基金利润减去必要的费用后的余额，本期利润为本期实现收益加上本期利润分配金额。

3.2.32 上述报告期基金份额净值增长及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注：1.上述基金业指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计算费用后实际可得收入将低于所列数字；

2.本期已实现收益指基金利润减去必要的费用后的余额，本期利润为本期实现收益加上本期利润分配金额。

3.2.33 上述报告期基金份额净值增长及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注：1.上述基金业指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计算费用后实际可得