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

2013 半年度 报告摘要

2013年6月30日

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
送出日期:2013年8月28日

§1 重要提示

基金管理人的董事会、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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年8月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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。投资有风险,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及其更新。

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,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计 。

本报告期自2013年1月1日起至6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	深证TMT50ETF
基金主代码	159909
交易代码	159909
基金运作方式	交易型开放式(ETF)
基金合同生效日	2011年6月27日
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
报告期末基金份额总额	71,521,449.00份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2011年9月1日

2.2 基金产品说明

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。
业绩比较基准	深证TMT50 指数。
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。

2.3 基金管理人和基金托管人

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
信息披露负责人	姓名	欧志明	唐州徽
	联系电话	0755－83196666	95566
	电子邮箱	cmf@cmfchina.com	tgxxpl@bank-of-china.com
客户服务电话		400-887-9555	95566
传真		0755－83196475	010－66594942

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.cmfchina.com
基金半年度报告备置地点	(1)招商基金管理有限公司 地址:中国深圳深南大道7088号招商银行大厦 (2)中国银行股份有限公司托管及投资者服务部 地址:北京市复兴门内大街1号

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2013年1月1日 － 2013年6月30日)
本期已实现收益	20,421,133.11
本期利润	77,333,499.92
加权平均基金份额本期利润	0.8162
本期基金份额净值增长率	29.17%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	−0.3352
期末基金资产净值	220,461,185.45
期末基金份额净值	3.082

注:1、基金业绩指标不包括持有人认(申)购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字;

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;

3、期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

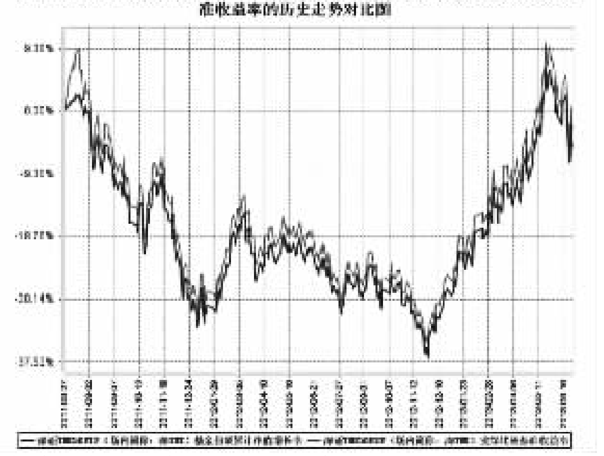
3.2 基金净值表现

3.2.1 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	−8.65%	2.42%	−9.15%	2.42%	0.50%	0.00%
过去三个月	8.18%	2.00%	7.96%	2.01%	0.22%	−0.01%
过去六个月	29.17%	1.79%	29.14%	1.79%	0.03%	0.00%
过去一年	23.87%	1.57%	23.78%	1.57%	0.09%	0.00%
自基金合同生效起至今	−5.22%	1.57%	−2.62%	1.60%	−2.60%	−0.03%

注:业绩比较基准收益率＝深证TMT50 指数收益率,业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:根据基金合同的规定: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允许本基金投资的其它金融工具。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%。本基金于2011年6月27日成立,自基金成立日起3个月内为建仓期,截至建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同的规定。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

招商基金管理有限公司于2002年12月27日经中国证监会(2002)100号文批准设立,是中国第一家中外合资基金管理公司。公司注册资本金为2.1亿元人民币。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%。

经招商基金管理有限公司股东会审议通过,并经中国证券监督管理委员会证监许可[2013]1074号文批复同意,荷兰投资公司(ING Asset Management B.V.)将其持有的招商基金管理有限公司21.6%股权转让给招商银行股份有限公司、11.7%股权转让给招商证券股份有限公司。

上述股权转让完成后,本基金管理人的股东及股权比例为:招商银行股份有限公司持有全部股权的55%,招商证券股份有限公司持有全部股权的45%。

截至2013年6月30日,本基金管理人共管理三十二只共同基金,具体如下:从2003年4月28日起管理招商安泰系列开放式证券投资基金(含招商安泰股票证券投资基金、招商安泰平衡型证券投资基金、招商安泰债券投资基金);从2004年1月14日起管理招商现金增值开放式证券投资基金;从2004年6月1日起开始管理招商先锋证券投资基金;从2005年11月17日起开始管理招商优质成长股票型证券投资基金(LOF);从2006年7月11日起开始管理招商安本增利债券型证券投资基金;从2007年3月30日起开始管理招商核心价值混合型证券投资基金;从2008年6月19日起开始管理招商大盘蓝筹股票型证券投资基金;从2008年10月22日起开始管理招商安心收益债券型证券投资基金;从2009年6月19日起开始管理招商行业领先股票型证券投资基金;从2009年12月25日起开始管理招商中小盘精选股票型证券投资基金;从2010年3月25日起开始管理招商全球资源股票型证券投资基金(QDII);从2010年6月22日起开始管理招商深证100指数证券投资基金;从2010年6月25日起开始管理招商信用添利债券型证券投资基金;从2010年12月8日开始管理上证消费80交易型开放式指数证券投资基金及招商上证消费80交易型开放式指数证券投资基金联接基金;从2011年2月11日起开始管理招商标普金砖四国指数证券投资基金(LOF);从2011年3月17日起开始管理招商安瑞进取债券型证券投资基金;从2011年6月27日开始管理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招商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联接基金;从2011年9月1日起开始管理招商安达保本混合型证券投资基金;从2012年2月1日起开始管理招商优势企业灵活配置混合型证券投资基金;从2012年3月21日起开始管理招商产业债券型证券投资基金;从2012年6月28日起开始管理招商中证大宗商品股票指数分级证券投资基金;从2012年7月20日起开始管理招商信用增强债券型证券投资基金;从2012年8月20日起开始管理招商安盈保本混合型证券投资基金;从2012年12月7日起开始管理招商理财7天债券型证券投资基金;从2013年2月5日起开始管理招商央视财经50指数证券投资基金;从2013年3月1日起开始管理招商双债增强分级债券型证券投资基金;从2013年4月19日起开始管理招商安润保本混合型证券投资基金;从2013年5月17日起开始管理招商保证金快线货币市场基金。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王平	本基金的基金经理	2011年6月27日	－	7	王平,男,中国国籍,管理学硕士,FRM。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,主要负责公司投资风险管理、金融工程研究等工作,现任招商深证100指数证券投资基金、上证消费80交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、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其联接基金、招商中证大宗商品股票指数分级证券投资基金及招商央视财经50指数证券投资基金基金经理。
罗毅	本基金的基金经理	2013年1月19日	－	4	罗毅,男,中国国籍,经济学硕士。2007年加入华润(深圳)有限公司,从事商业地产投资项目分析及营运管理工作;2008年4月加入招商基金管理有限公司,从事养老金产品设计研发、基金市场研究、量化选股研究及指数基金运作管理工作,曾任高级经理、ETF专员,现任上证消费80交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、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其联接基金的基金经理。

注:1、本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日,后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告(生效)日期;

2、证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

基金管理人声明:在本报告期内,本基金管理人严格遵守《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》等有关法律法规及其各项实施准则的规定以及《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基金合同》等基金法律文件的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的前提下,为基金持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作整体合法合规,无损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

基金管理人(以下简称"公司")已建立较完善的研究方法和投资决策流程,确保各投资组合享有公平的投资决策机会。公司建立了所有组合适用的投资对象备选库,制定明确的备选库建立、维护程序。公司拥有健全的投资授权制度,明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限划分,投资组合经理在授权范围内可以自主决策,超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。公司的相关研究成果向内部所有投资组合开放,在投资研究层面不存在各投资组合间不公平的问题。公司交易部在报告期内,对所有组合的各条指令,均在中央交易员的统一分派下,本着持有人利益最大化的原则执行了公平交易。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司严格控制不同投资组合之间的同日反向交易,严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。确因投资组合的投资策略或流动性等需要而发生的同日反向交易,公司要求相关投资组合经理提供决策依据,并留存记录备查,完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合等除外。

本报告期内,本基金各项交易均严格按照相关法律法规、基金合同的有关要求执行,本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易不存在成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情形。报告期内未发现有可能导致不公平交易和利益输送的重大异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

受国内经济复苏放缓和流动性阶段性紧张等因素影响,2013年上半年 A股在经历年初上涨后持续走低,沪深300指数累计下跌12.78%。TMT相关子行业受益于基本面改善,盈利增长相对稳定,因而相关股票在2013年上半年走势较好,深证TMT50价格指数累计涨幅达到29.14%。行业表现方面,信息服务、电子和信息设备等行业当季涨幅居前,有色金属、黑色金属和化工行业跌幅较大。

关于本基金的运作,作为交易型开放式指数基金,仓位维持在 99.3%左右的水平,较好地完成了对标的指数的跟踪。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为3.082元,本报告期份额净值增长率为29.17%,同期业绩比较基准增长率为29.14%。基金净值表现优于业绩比较基准,幅度为0.03%,主要原因为:年中成分股更换样本期间合理进行组合调整所带来部分超额收益。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

1、全球经济方面,2013年上半年美国经济稳步复苏,主要推动因素来自于房地产市场的复苏、美国就业市场的缓慢改善,资产价格的改善也促使居民消费信心持续提升。欧洲经济依旧低迷,欧央行近期宣布维持基准利率,宽松的货币政策及欧元贬值等因素,将对欧洲出口带来正面影响,下半年欧洲经济将略有好转。日本经济得益于日元贬值对出口的刺激,2013年上半年整体增速超过3%, 安倍政策的蜜月期在下半年有望持续。

2、国内经济方面,总需求疲软抑制经济复苏的步伐,中国经济增速放缓但未明显恶化,2013年上半年GDP同比增长7.60%,二季度GDP同比增长7.50%,环比增长1.70%。流动性方面,6月中下旬流动性阶段性紧张的局面,除了对市场情绪和预期产生影响外,后续可能通过抬升资金成本等方式对实体经济产生进一步影响。积极的方面在于,高层近期在多个场合表示,要防止经济滑出"下限",并强调稳增长和调结构的良性互动,完成全年经济社会发展的主要任务。因此,稳增长政策在下半年逐步推出是大概率事件。

3、市场方面,经济复苏不达预期及6月中下旬流动性冲击使得市场出现大幅度的快速下跌,市场情绪和预期在短期内可能难以反转,预计短期内市场走势将以区间震荡为主。随着投资者对于宏观流动性与经济增速预期的不断下调,只要未来不出现超预期恶化的因素,且在稳增长政策出台的预期逐步兑现后,市场将可能出现预期调整带来的修复上涨过程。在行业方面,相对看好行业景气度持续向好、业绩增长较为确定的部分TMT子行业,以及受益于经济结构转型及消费升级带来投资机会的部分消费子行业。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内,本基金的估值业务严格按照相关的法律法规、基金合同以及《招商基金管理有限公司基金估值委员会管理制度》进行。基金核算部负责日常的基金资产的估值业务,执行基金估值政策。另外,公司设立由股票投资部、专户资产投资部、固定收益投资部、研究部、风险管理部、基金核算部、法律合规部负责人和基金经理代表组成的估值委员会。公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历。公司估值委员会主要负责制定、修订和完善基金估值政策和程序,定期评价现有估值政策和程序的适用性及对估值程序执行情况进行监督。

股票投资部、专户资产投资部、固定收益投资部、研究部和基金核算部共同负责关注相关投资品种的动态,评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件, 从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种;股票投资部、专户资产投资部和固定收益投资部定期审核公允价值的确认和计量;研究部提出合理的数量分析模型对需要进行估值测算或者调整的投资品种进行公允价值定价与计量并定期对估值政策和程序进行评价,以保证其持续适用;基金核算部定期审核估值政策和程序的一致性,并负责与托管行沟通估值调整事项;风险管理部负责估值委员会工作流程中的风险控制;法律合规部负责日常的基金估值调整结果的事后复核监督工作;法律合规部与基金核算部共同负责估值调整事项的信息披露工作。

基金经理代表向估值委员会提供估值参考信息,参与估值政策讨论;对需采用特别估值程序的证券,基金及时启动特别估值程序,由公司估值委员会集体讨论议定特别估值方案并与托管行沟通后由基金核算部具体执行。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。截止报告期末本基金管理人未与任何外部估值定价服务机构签约。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规的规定和基金合同的约定,以及本基金的实际运作情况,本基金报告期无需进行利润分配。在符合分红条件的前提下,本基金已实现尚未分配的可供分配收益部分,将严格按照基金合同的约定适时向投资者予以分配。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称"本托管人")在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(以下称"本基金")的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的"金融工具风险及管理"部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

中国银行股份有限公司

§6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体: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
报告截止日: 2013年6月30日

单位:人民币元

资 产	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
资 产:		
银行存款	2,095,245.79	2,148,314.17
结算备付金	77,858.85	7,072.51
存出保证金	1,381.91	500,000.00
交易性金融资产	218,795,381.94	260,236,550.62
其中:股票投资	218,795,381.94	260,236,550.62
基金投资	－	－
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	－	－
应收证券清算款	71,807.79	31,473.92
应收利息	390.60	472.80
应收股利	－	－
应收申购款	－	－
递延所得税资产	－	－
其他资产	－	－
资产总计	221,042,066.88	262,923,884.02
负债和所有者权益	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
负 债:		
短期借款	－	－
交易性金融负债	－	－
衍生金融负债	－	－
卖出回购金融资产款	－	－
应付证券清算款	－	47,368.00
应付赎回款	－	－
应付管理人报酬	95,825.37	110,776.33
应付托管费	19,165.07	22,155.25
应付销售服务费	－	－
应付交易费用	54,688.23	39,486.38
应交税费	－	－
应付利息	－	－
应付利润	－	－
递延所得税负债	－	－
其他负债	411,202.76	788,764.48
负债合计	580,881.43	1,008,550.44
所有者权益:		
实收基金	232,570,866.59	356,950,836.17
未分配利润	−12,109,681.14	−95,035,502.59
所有者权益合计	220,461,185.45	261,915,333.58
负债和所有者权益总计	221,042,066.88	262,923,884.02

注:报告截止日2013年6月30日,基金份额净值3.082元,基金份额总额71,521,449.00份。

6.2 利润表

会计主体: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
本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

单位:人民币元

项 目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
一、收入	78,546,511.77	27,985,741.41
1.利息收入	8,251.76	10,570.49
其中:存款利息收入	8,251.76	10,570.49
债券利息收入	－	－
资产支持证券利息收入	－	－
买入返售金融资产收入	－	－
其他利息收入	－	－
2.投资收益(损失以"－"填列)	21,661,171.00	−21,680,587.24
其中:股票投资收益	20,002,923.66	−23,788,159.74
基金投资收益	－	－
债券投资收益	－	－
资产支持证券投资收益	－	－
衍生工具收益	－	－
股利收益	1,658,247.34	2,107,572.50
3.公允价值变动收益(损失以"－"号填列)	56,912,366.81	49,649,053.90
4.汇兑收益(损失以"－"号填列)	－	－
5.其他收入(损失以"－"号填列)	−35,277.80	6,704.26
减:二、费用	1,213,011.85	1,452,404.51
1. 管理人报酬	671,930.01	900,754.34
2. 托管费	134,385.99	180,150.84
3. 销售服务费	－	－
4. 交易费用	92,454.28	56,233.78
5. 利息支出	－	－
其中:卖出回购金融资产支出	－	－
6. 其他费用	314,241.57	315,265.55
三、利润总额(亏损总额以"－"号填列)	77,333,499.92	26,533,336.90
减:所得税费用	－	－
四、净利润(净亏损以"－"号填列)	77,333,499.92	26,533,336.90

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: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
本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	356,950,836.17	−95,035,502.59	261,915,333.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	－	77,333,499.92	77,333,499.92
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"－"号填列)	−124,379,969.58	5,592,321.53	−118,787,648.05
其中:1.基金申购款	163,401,136.69	−15,808,584.75	147,592,551.94
2.基金赎回款	−287,781,106.27	21,400,906.28	−266,380,199.99
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"－"号填列)	－	－	－
五、期末所有者权益(基金净值)	232,570,866.59	−12,109,681.14	220,461,185.45
项目	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	560,999,021.32	−158,484,036.32	402,514,985.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	－	26,533,336.90	26,533,336.90
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"－"号填列)	−125,192,910.26	29,639,591.84	−95,553,318.42
其中:1.基金申购款	19,510,583.46	−3,995,182.14	15,515,401.32
2.基金赎回款	−144,703,493.72	33,634,773.98	−111,068,719.74
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"－"号填列)	－	－	－
五、期末所有者权益(基金净值)	435,806,111.06	−102,311,107.58	333,495,003.48

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

______许小松______ ______赵生章______ ____李扬____
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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"本基金")系由基金管理人招商基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《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基金合同》及其他有关法律法规的规定,经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2011]605号文批准公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限为不定期,首次设立募集基金份额为347,195,545.00份,经德勤华永会计师事务所有限公司验证,并出具了编号为德师报(验)字(11)第0050号验资报告。《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基金合同》(以下简称"基金合同")于2011年6月27日正式生效。本基金的基金管理人为招商基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司(以下简称"中国银行")。

根据《招商基金管理有限公司关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基金份额折算日的提示性公告》,本基金的基金管理人于2011年8月10日对本基金进行基金份额折算。根据《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招募说明书》中约定的基金份额折算公式,基金份额折算比例为0.30752983(以四舍五入的方法保留小数点后8位),折算后基金份额总额为106,771,449.00份,折算后基金份额净值为3.000元。本基金管理人已根据上述折算比例,对各基金份额持有人认购的基金份额进行了折算, 并由中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司于2011年8月11日进行了变更登记。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及最新公告的《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招募说明书》的有关规定,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。本基金的投资组合为: 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%。本基金的业绩比较基准为标的指数。本基金的业绩比较基准采用:深证TMT50 指数。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称"企业会计准则")及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金2013年6月30日的财务状况以及2013年1月1日至2013年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号文《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2005]107号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008年9月18日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

1) 以发行基金方式募集资金,不属于营业税征收范围,不缴纳营业税。

2) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不缴纳企业所得税。

3) 对基金取得的股票股息、红利收入,由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税,上市公司在代扣代缴时,减按50%计算应纳税所得额。

4) 对基金取得的债券利息收入,由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税,暂不缴纳企业所得税。

5) 对于基金从事A股买卖,自2008年9月19日起,出让方按0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税,对受让方不再缴纳印花税。

6) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价,暂免予缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内, 本基金管理人招商基金管理有限公司新增设立全资子公司招商财富资产管理有限公司、招商资产管理(香港)有限公司。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
招商基金管理有限公司	基金管理人
中国银行	基金托管人
招商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联接基金(以下简称"招商深证TMT50ETF联接")	本基金的基金管理人管理的其他基金

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.8.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.8.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	671,930.01	900,754.34
其中:支付销售机构的客户维护费	－	－

注: 支付基金管理人招商基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值×0.50%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日基金管理人报酬＝前一日基金资产净值×0.50%÷当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	134,385.99	180,150.84

注:支付基金托管人中国银行的基金托管费按前一日基金资产净值×0.10%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日基金托管费＝前一日基金资产净值×0.10%÷当年天数。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

单位:人民币元

关联方名称	本期末 2013年6月30日		上年度末 2012年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
招商深证TMT50ETF联接	61,780,248.00	86.38%	96,230,248.00	87.66%

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日	
	期末余额	期末余额	期末余额	期末余额
中国银行	2,095,245.79	7,453.00	2,248,232.56	9,962.13

注:本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管,按银行同业利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.9 期末(2013年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300027	华谊兄弟	2013年6月5日	重大事项	28.55	2013年7月24日	31.41	230,440	3,999,536.11	6,579,062.00	－
000997	新 大 陆	2013年6月3日	重大事项	15.11	2013年8月23日	14.21	216,313	2,708,636.71	3,268,489.43	－

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无需要说明有助于理解和分析会计报表的其他事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	218,795,381.94	98.98
	其中:股票	218,795,381.94	98.98
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	2,173,104.64	0.98
6	其他各项资产	73,580.30	0.03
7	合计	221,042,066.88	100.00

注:此处的股票投资项目含可退替代款估值增值。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

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	采矿业	－	－
C	制造业	155,848,850.64	70.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	－	－
E	建筑业	－	－
F	批发和零售业	－	－
G	交通运输、仓储和邮政业	－	－
H	住宿和餐饮业	－	－
I	信息传输、软件和信息技术服务业	42,489,726.40	19.27
J	金融业	－	－
K	房地产业	－	－
L	租赁和商务服务业	5,799,010.50	2.63
M	科学研究和技术服务业	－	－
N	水利、环境和公共设施管理业	－	－
O	居民服务、修理和其他服务业	－	－
P	教育	－	－
Q	卫生和社会工作	－	－
R	文化、体育和娱乐业	14,666,458.40	6.65
S	综合	－	－
	合计	218,804,045.94	99.25

7.2.2 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。

7.3 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

7.3.1 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

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	002241	歌尔声学	373,231	13,544,552.99	6.14
2	000651	格力电器	530,711	13,299,617.66	6.03
3	000063	中兴通讯	1,039,356	13,251,789.00	6.01
4	000527	美的电器	1,004,681	12,478,138.02	5.66
5	002236	大华股份	272,284	10,409,417.32	4.72
6	002415	海康威视	289,489	10,230,541.26	4.64
7	000100	TCL 集团	4,259,270	9,668,542.90	4.39
8	002230	科大讯飞	191,116	8,829,559.20	4.01
9	000725	京东方 A	3,698,100	8,209,782.00	3.72
10	300027	华谊兄弟	230,440	6,579,062.00	2.98

注: 投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细, 应阅读登载于招商基金管理有限公司网站http://www.cmfchina.com的半年度报告正文。

7.3.2 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十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000725	京东方 A	8,549,091.91	3.26
2	300058	蓝色光标	5,950,590.41	2.27
3	000651	格力电器	3,621,935.55	1.38
4	300251	光线传媒	2,799,905.70	1.07
5	000527	美的电器	2,034,380.00	0.78
6	002308	威创股份	1,945,530.80	0.74
7	002138	顺络电子	1,926,339.15	0.74
8	002467	二六三	1,449,039.78	0.55
9	002241	歌尔声学	1,268,837.00	0.48
10	002005	德豪润达	683,719.06	0.26
11	000063	中兴通讯	504,538.00	0.19
12	002106	莱宝高科	237,126.00	0.09
13	002415	海康威视	148,937.00	0.06
14	000977	浪潮信息	121,928.00	0.05
15	000100	TCL 集团	65,790.00	0.03
16	000503	海虹控股	61,776.00	0.02
17	000917	电广传媒	51,102.00	0.02
18	002236	大华股份	32,570.00	0.01
19	000970	中科三环	22,184.00	0.01
20	000793	华闻传媒	21,924.00	0.01

注:1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票,不包括因投资者申购ETF基金份额导致的基金组合中股票的增加;

2、"累计买入金额"按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002236	大华股份	2,010,574.82	0.77
2	300077	国民技术	1,628,140.37	0.62
3	300088	长信科技	1,601,108.27	0.61
4	000901	航天科技	1,399,033.14	0.53
5	002261	拓维信息	1,213,250.57	0.46
6	002130	沃尔核材	1,206,240.32	0.46
7	000503	海虹控股	1,110,698.07	0.42
8	300104	乐视网	1,099,779.02	0.42
9	000917	电广传媒	1,097,886.53	0.42
10	002456	欧菲光	1,085,462.80	0.41
11	002008	大族激光	966,158.10	0.37
12	000063	中兴通讯	887,559.28	0.34
13	002218	拓日新能	858,580.46	0.33
14	002129	中环股份	736,931.44	0.28
15	002106	莱宝高科	721,222.09	0.28
16	002415	海康威视	705,369.48	0.27
17	002506	*ST超日	702,292.54	0.27
18	002065	东华软件	695,477.47	0.27
19	000839	中信国安	652,671.96	0.25
20	000970	中科三环	620,725.66	0.24

注:1、卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票,不包括因投资者赎回基金份额导致的基金组合中股票的减少;

2、"累计卖出金额"按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票成本(成交)总额	31,622,200.36
卖出股票收入(成交)总额	29,649,930.30

注:1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票,卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票,买入卖出均不包括因投资者申购赎回基金份额导致的基金组合中股票的增减;

2、"买入股票成本(成交)总额"、"卖出股票收入(成交)总额"均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.5 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。

7.6 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。

7.7 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。

7.8 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。

7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

7.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金合同规定,本基金不参与股指期货交易。

7.10 投资组合报告附注

7.10.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门调查,不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.10.2 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。

7.10.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,381.91
2	应收证券清算款	71,807.79
3	应收股利	－
4	应收利息	390.60
5	应收申购款	－
6	其他应收款	－
7	待摊费用	－
8	其他	－
9	合计	73,580.30

7.10.4 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。

7.10.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.10.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300027	华谊兄弟	6,579,062.00	2.98	重大事项

7.10.5.2 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。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		招商深证TMT50ETF联接	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
1,317	54,306.34	908,157.00	1.27%	8,833,044.00	12.35%	61,780,248.00	86.38%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	昆明八达实业有限公司	600,000.00	0.84%
2	罗宇平	522,873.00	0.73%
3	贺凡	395,406.00	0.55%
4	刘远帆	272,000.00	0.38%
5	夏祯	215,306.00	0.30%
6	居德森	184,584.00	0.26%
7	宋洁	184,545.00	0.26%
8	红塔证券股份有限公司	177,606.00	0.25%
9	何培光	161,300.00	0.23%
10	暨小颜	153,777.00	0.22%
－	招商深证TMT50ETF联接	61,780,248.00	86.38%

注:前十名持有人为除招商深证TMT50ETF联接基金以外的前十名持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本基金期末基金管理人的从业人员无持有本基金的情况。

§9 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2011年6月27日)基金份额总额	347,195,545.00
本报告期期初基金份额总额	109,771,449.00
本报告期基金总申购份额	50,250,000.00
减:本报告期基金总赎回份额	88,500,000.00
本报告期基金拆分变动份额	－
本报告期期末基金份额总额	71,521,449.00

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期没有举行基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、根据本基金管理人2013年4月17日的公告,经招商基金管理有限公司第三届董事会2013年第二次会议审议并通过,聘任张国强先生为公司副总经理。

2、根据本基金管理人2013年4月26日的公告,经招商基金管理有限公司第三届董事会2013年第二次会议审议并通过,聘任吕一凡先生为公司副总经理。

3、2013年3月17日,根据国家金融工作需要,肖钢先生辞去中国银行股份有限公司董事长职务。中国银行股份有限公司已于2013年3月17日公告上述事项。

4、2013年6月1日,中国银行股份有限公司发布公告,自2013年5月31日起,田国立先生就任本行董事长、执行董事、董事会战略发展委员会主席及委员。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未作改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期,基金管理人没有受到监管部门的稽查或处罚,亦未收到关于基金管理人的高级管理人员、托管人及其高级管理人员受到监管部门的稽查或处罚的书面通知或文件。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国海证券	1	－	－	－	－	－
中银国际	1	61,272,130.66	100.00%	55,751.67	100.00%	－

注:基金交易佣金根据券商季度综合评分结果给与分配,券商综合评分根据研究报告质量、路演质量、联合调研质量以及销售服务质量打分,从多家服务券商中选取符合法律规范经营的综合能力靠前的券商给与佣金分配,季度评分和佣金分配分别由专人负责。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期无租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况。

招商基金管理有限公司
2013年8月28日