

[2012] 第一季度报告

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

基金管理人:招商基金管理有限公司

基金托管人:中国农业银行股份有限公司

报告送出日期:2012年4月24日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及高级管理人员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、完整性、及时性承担个别及连带责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2012年4月20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,保证复核结果不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人声明本基金投资于股票,可能面临股票投资风险,包括系统性风险、非系统性风险等,但不保证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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2012年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金产品情况

基金简称:招商深证电子信息传媒产业(TMT)50ETF联接

基金主代码:217019

交易代码:217019

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2011年6月27日

报告期末基金份额总额:373,888,900.63份

投资目标:通过主要投资于深证TMT50ETF,密切跟踪标的指数,进而跟踪偏股型和跟踪误差最小化。

本基金主要投资于TMT50ETF,主要通过投资于深证TMT50ETF,以求达到投资目标。

本基金投资于股票型基金,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,但低于股票型基金的过往业绩并代表其未来表现。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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2012年1月1日起至3月31日止。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2012年1月1日-2012年3月31日)

1.本期已实现收益 -1,497,573.70

2.本期利润 9,683,349.93

3.加权平均基金份额本期利润 0.0262

4.期末基金份额净值 282,630,443.76

5.期末基金份额总额 0.756

注:1.上表基金业绩指标不包括持有人认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.基金净值表现

4.2.1 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

过去三个月 3.99% 1.82% 4.27% 1.83% -0.28% -0.01%

注:业绩比较基准收益率=深证TMT50指数收益率*95%+商业银行活期存款利率(税后)*5%,业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

4.2.2 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

过去三个月 3.99% 1.82% 4.27% 1.83% -0.28% -0.01%

注:业绩比较基准收益率=深证TMT50指数收益率*95%+商业银行活期存款利率(税后)*5%,业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

4.2.3 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

过去三个月 3.99% 1.82% 4.27% 1.83% -0.28% -0.01%

注:业绩比较基准收益率=深证TMT50指数收益率*95%+商业银行活期存款利率(税后)*5%,业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

4.2.4 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

过去三个月 3.99% 1.82% 4.27% 1.83% -0.28% -0.01%

注:业绩比较基准收益率=深证TMT50指数收益率*95%+商业银行活期存款利率(税后)*5%,业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

4.2.5 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

过去三个月 3.99% 1.82% 4.27% 1.83% -0.28% -0.01%

注:业绩比较基准收益率=深证TMT50指数收益率*95%+商业银行活期存款利率(税后)*5%,业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

4.2.6 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

过去三个月 3.99% 1.82% 4.27% 1.83% -0.28% -0.01%

注:业绩比较基准收益率=深证TMT50指数收益率*95%+商业银行活期存款利率(税后)*5%,业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

4.2.7 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

过去三个月 3.99% 1.82% 4.27% 1.83% -0.28% -0.01%

注:业绩比较基准收益率=深证TMT50指数收益率*95%+商业银行活期存款利率(税后)*5%,业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

4.2.8 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

过去三个月 3.99% 1.82% 4.27% 1.83% -0.28% -0.01%

注:业绩比较基准收益率=深证TMT50指数收益率*95%+商业银行活期存款利率(税后)*5%,业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

4.2.9 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

过去三个月 3.99% 1.82% 4.27% 1.83% -0.28% -0.01%

注:业绩比较基准收益率=深证TMT50指数收益率*95%+商业银行活期存款利率(税后)*5%,业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

4.2.10 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

过去三个月 3.99% 1.82% 4.27% 1.83% -0.28% -0.01%

注:业绩比较基准收益率=深证TMT50指数收益率*95%+商业银行活期存款利率(税后)*5%,业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

4.2.11 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

过去三个月 3.99% 1.82% 4.27% 1.83% -0.28% -0.01%

注:业绩比较基准收益率=深证TMT50指数收益率*95%+商业银行活期存款利率(税后)*5%,业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

4.2.12 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

过去三个月 3.99% 1.82% 4.27% 1.83% -0.28% -0.01%

注:业绩比较基准收益率=深证TMT50指数收益率*95%+商业银行活期存款利率(税后)*5%,业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

4.2.13 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

过去三个月 3.99% 1.82% 4.27% 1.83% -0.28% -0.01%

注:业绩比较基准收益率=深证TMT50指数收益率*95%+商业银行活期存款利率(税后)*5%,业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

4.2.14 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

过去三个月 3.99% 1.82% 4.27% 1.83% -0.28% -0.01%

注:业绩比较基准收益率=深证TMT50指数收益率*95%+商业银行活期存款利率(税后)*5%,业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

4.2.15 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

过去三个月 3.99% 1.82% 4.27% 1.83% -0.28% -0.01%

注:业绩比较基准收益率=深证TMT50指数收益率*95%+商业银行活期存款利率(税后)*5%,业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

4.2.16 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

过去三个月 3.99% 1.82% 4.27% 1.83% -0.28% -0.01%

注:业绩比较基准收益率=深证TMT50指数收益率*95%+商业银行活期存款利率(税后)*5%,业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

4.2.17 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

过去三个月 3.99% 1.82% 4.27% 1.83% -0.28% -0.01%

注:业绩比较基准收益率=深证TMT50指数收益率*95%+商业银行活期存款利率(税后)*5%,业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

4.2.18 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

过去三个月 3.99% 1.82% 4.27% 1.83% -0.28% -0.01%

注:业绩比较基准收益率=深证TMT50指数收益率*95%+商业银行活期存款利率(税后)*5%,业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

4.2.19 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

过去三个月 3.99% 1.82% 4.27% 1.83% -0.28% -0.01%

注:业绩比较基准收益率=深证TMT50指数收益率*95%+商业银行活期存款利率(税后)*5%,业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

4.2.20 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

过去三个月 3.99% 1.82% 4.27% 1.83% -0.28% -0.01%

注:业绩比较基准收益率=深证TMT50指数收益率*95%+商业银行活期存款利率(税后)*5%,业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

4.2.21 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

过去三个月 3.99% 1.82% 4.27% 1.83% -0.28% -0.01%

注:业绩比较基准收益率=深证TMT50指数收益率*95%+商业银行活期存款利率(税后)*5%,业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

4.2.22 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

过去三个月 3.99% 1.82% 4.27% 1.83% -0.28% -0.01%

注:业绩比较基准收益率=深证TMT50指数收益率*95%+商业银行活期存款利率(税后)*5%,业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

4.2.23 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

过去三个月 3.99% 1.82% 4.27% 1.83% -0.28% -0.01%

注:业绩比较基准收益率=深证TMT50指数收益率