

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

2015 年度 报告 摘要

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
送出日期:2016年3月26日

基金管理人、董事、监事、高级管理人员均不存在虚假记载、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法律责任。
本年度报告经三分之二以上独立董事同意,并由董事长签署。
基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年3月24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投资风险提示,并全面了解基金情况。
本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细情况,应阅读年度报告正文。

本财务报告资料已经审计,德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了2015年度标准无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。
本财务报告自2016年1月1日起至12月31日止。
§ 2 基金简介

基金名称	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
基金代码	210017
交易代码	210017
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年12月29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
招商基金基金简称	139.572 522.234
基金合同存续期	不定期

2.1.1 目标基金基本情况	
基金名称	上证消费80交易型开放式指数证券投资基金
基金代码	515100
基金运作方式	交易型开放式(ETF)
上市日期(深圳证券交易所)	2010年12月29日
基金合同生效日	2010年12月29日
基金管理人名称	招商基金管理有限公司
基金托管人名称	中国工商银行股份有限公司

2.2 基金产品说明	
投资目标	本基金为上证消费80ETF的联接基金,主要投资于上证消费80ETF,追求跟踪标的基金份额净值的表现,力争实现日均跟踪偏离度不超过0.5%,年跟踪误差控制在1%以内。
投资策略	本基金为上证消费80ETF的联接基金,主要投资于上证消费80ETF,追求跟踪标的基金份额净值的表现,力争实现日均跟踪偏离度不超过0.5%,年跟踪误差控制在1%以内。
风险收益特征	本基金为上证消费80ETF的联接基金,属于股票型基金,风险收益特征与上证消费80ETF相似,但风险收益特征略低。

2.2.1 目标基金产品说明	
基金名称	上证消费80交易型开放式指数证券投资基金
基金代码	515100
基金运作方式	交易型开放式(ETF)
上市日期(深圳证券交易所)	2010年12月29日
基金合同生效日	2010年12月29日
基金管理人名称	招商基金管理有限公司
基金托管人名称	中国工商银行股份有限公司

2.3 基金管理人及基金托管人	
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
基金管理人名称	招商基金管理有限公司
基金托管人名称	中国工商银行股份有限公司

2.4 信息披露方式	
基金管理人网站	http://www.cmfchina.com
基金托管人网站	http://www.icbc.com.cn
基金管理人名称	招商基金管理有限公司
基金托管人名称	中国工商银行股份有限公司

3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	
基金净值表现	截至2015年12月31日,本基金资产净值为1,340.00元,基金份额净值为1.3400元。
基金净值表现	截至2015年12月31日,本基金资产净值为1,340.00元,基金份额净值为1.3400元。

3.1 主要会计数据和财务指标	
基金净值表现	截至2015年12月31日,本基金资产净值为1,340.00元,基金份额净值为1.3400元。
基金净值表现	截至2015年12月31日,本基金资产净值为1,340.00元,基金份额净值为1.3400元。

3.2 基金净值表现	
基金净值表现	截至2015年12月31日,本基金资产净值为1,340.00元,基金份额净值为1.3400元。
基金净值表现	截至2015年12月31日,本基金资产净值为1,340.00元,基金份额净值为1.3400元。

3.3 过去三年基金的利润分配情况	
基金净值表现	截至2015年12月31日,本基金资产净值为1,340.00元,基金份额净值为1.3400元。
基金净值表现	截至2015年12月31日,本基金资产净值为1,340.00元,基金份额净值为1.3400元。

3.4 管理人报告	
基金净值表现	截至2015年12月31日,本基金资产净值为1,340.00元,基金份额净值为1.3400元。
基金净值表现	截至2015年12月31日,本基金资产净值为1,340.00元,基金份额净值为1.3400元。

3.5 基金管理人及基金托管人	
基金净值表现	截至2015年12月31日,本基金资产净值为1,340.00元,基金份额净值为1.3400元。
基金净值表现	截至2015年12月31日,本基金资产净值为1,340.00元,基金份额净值为1.3400元。

3.6 基金管理人及基金托管人	
基金净值表现	截至2015年12月31日,本基金资产净值为1,340.00元,基金份额净值为1.3400元。
基金净值表现	截至2015年12月31日,本基金资产净值为1,340.00元,基金份额净值为1.3400元。

3.7 基金管理人及基金托管人	
基金净值表现	截至2015年12月31日,本基金资产净值为1,340.00元,基金份额净值为1.3400元。
基金净值表现	截至2015年12月31日,本基金资产净值为1,340.00元,基金份额净值为1.3400元。

3.8 基金管理人及基金托管人	
基金净值表现	截至2015年12月31日,本基金资产净值为1,340.00元,基金份额净值为1.3400元。
基金净值表现	截至2015年12月31日,本基金资产净值为1,340.00元,基金份额净值为1.3400元。

3.9 基金管理人及基金托管人	
基金净值表现	截至2015年12月31日,本基金资产净值为1,340.00元,基金份额净值为1.3400元。
基金净值表现	截至2015年12月31日,本基金资产净值为1,340.00元,基金份额净值为1.3400元。

3.10 基金管理人及基金托管人	
基金净值表现	截至2015年12月31日,本基金资产净值为1,340.00元,基金份额净值为1.3400元。
基金净值表现	截至2015年12月31日,本基金资产净值为1,340.00元,基金份额净值为1.3400元。

3.11 基金管理人及基金托管人	
基金净值表现	截至2015年12月31日,本基金资产净值为1,340.00元,基金份额净值为1.3400元。
基金净值表现	截至2015年12月31日,本基金资产净值为1,340.00元,基金份额净值为1.3400元。

3.12 基金管理人及基金托管人	
基金净值表现	截至2015年12月31日,本基金资产净值为1,340.00元,基金份额净值为1.3400元。
基金净值表现	截至2015年12月31日,本基金资产净值为1,340.00元,基金份额净值为1.3400元。

3.13 基金管理人及基金托管人	
基金净值表现	截至2015年12月31日,本基金资产净值为1,340.00元,基金份额净值为1.3400元。
基金净值表现	截至2015年12月31日,本基金资产净值为1,340.00元,基金份额净值为1.3400元。

3.14 基金管理人及基金托管人	
基金净值表现	截至2015年12月31日,本基金资产净值为1,340.00元,基金份额净值为1.3400元。
基金净值表现	截至2015年12月31日,本基金资产净值为1,340.00元,基金份额净值为1.3400元。

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

2015 年度 报告 摘要

基金名称	基金代码	基金合同生效日	基金管理人	基金托管人
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	210017	2010年12月29日	招商基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司

基金管理人	基金托管人	基金合同生效日	基金管理人	基金托管人
招商基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司	2010年12月29日	招商基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司

基金管理人	基金托管人	基金合同生效日	基金管理人	基金托管人
招商基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司	2010年12月29日	招商基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司

基金管理人	基金托管人	基金合同生效日	基金管理人	基金托管人
招商基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司	2010年12月29日	招商基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司

基金管理人	基金托管人	基金合同生效日	基金管理人	基金托管人
招商基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司	2010年12月29日	招商基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司

基金管理人	基金托管人	基金合同生效日	基金管理人	基金托管人
招商基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司	2010年12月29日	招商基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司

基金管理人	基金托管人	基金合同生效日	基金管理人	基金托管人
招商基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司	2010年12月29日	招商基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司

基金管理人	基金托管人	基金合同生效日	基金管理人	基金托管人
招商基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司	2010年12月29日	招商基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司

基金管理人	基金托管人	基金合同生效日	基金管理人	基金托管人
招商基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司	2010年12月29日	招商基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司

基金管理人	基金托管人	基金合同生效日	基金管理人	基金托管人
招商基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司	2010年12月29日	招商基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司

基金管理人	基金托管人	基金合同生效日	基金管理人	基金托管人
招商基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司	2010年12月29日	招商基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司

基金管理人	基金托管人	基金合同生效日	基金管理人	基金托管人
招商基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司	2010年12月29日	招商基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司

基金管理人	基金托管人	基金合同生效日	基金管理人	基金托管人
招商基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司	2010年12月29日	招商基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司

基金管理人	基金托管人	基金合同生效日	基金管理人	基金托管人
招商基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司	2010年12月29日	招商基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司

基金管理人	基金托管人	基金合同生效日	基金管理人	基金托管人
招商基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司	2010年12月29日	招商基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司

基金管理人	基金托管人	基金合同生效日	基金管理人	基金托管人
招商基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司	2010年12月29日	招商基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司

基金管理人	基金托管人	基金合同生效日	基金管理人	基金托管人
招商基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司	2010年12月29日	招商基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司

基金管理人	基金托管人	基金合同生效日	基金管理人	基金托管人
招商基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司	2010年12月29日	招商基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司

基金管理人	基金托管人	基金合同生效日	基金管理人	基金托管人
招商基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司	2010年12月29日	招商基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司

基金管理人	基金托管人	基金合同生效日	基金管理人	基金托管人
招商基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司	2010年12月29日	招商基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司

基金管理人	基金托管人	基金合同生效日	基金管理人	基金托管人
招商基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司	2010年12月29日	招商基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司

基金管理人	基金托管人	基金合同生效日	基金管理人	基金托管人
招商基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司	2010年12月29日	招商基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司

本托管人依法对招商基金管理有限公司编制的招商上证消费80交易型开放式指数证券投资基金联接基金2015年年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)审计了招商上证消费80交易型开放式指数证券投资基金联接基金的财务报表,包括2015年12月31日的资产负债表、2015年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注,并出具了无保留意见的审计报告。

投资者欲了解详细情况,可通过年度报告正文查看审计报告全文。
§ 7 年度财务报表

资产	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
货币资金	9,446,572,234.13	13,425,096,324.13
交易性金融资产	22,774,497.19	292,142,234.13
应收款项	165,095,794.96	569,594,423.83
其他资产	498,712,020.00	5,917,003,000.00
负债	165,107,072.26	543,079,163.30
所有者权益	16,989,160.87	19,996,000.00

资产	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
货币资金	9,446,572,234.13	13,425,096,324.13
交易性金融资产	22,774,497.19	292,142,234.13
应收款项	165,095,794.96	569,594,423.83
其他资产	498,712,020.00	5,917,003,000.00
负债	165,107,072.26	543,079,163.30
所有者权益	16,989,160.87	19,996,000.00

资产	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
货币资金	9,446,572,234.13	13,425,096,324.13
交易性金融资产	22,774,497.19	292,142,234.13
应收款项	165,095,794.96	569,594,423.83
其他资产	498,712,020.00	5,917,003,000.00
负债	165,107,072.26	543,079,163.30
所有者权益	16,989,160.87	19,996,000.00

资产	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
货币资金	9,446,572,234.13	13,425,096,324.13
交易性金融资产	22,774,497.19	292,142,234.13
应收款项	165,095,794.96	569,594,423.83
其他资产	498,712,020.00	5,917,003,000.00
负债	165,107,072.26	543,079,163.30
所有者权益	16,989,160.87	19,996,000.00

资产	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
货币资金	9,446,572,234.13	13,425,096,324.13
交易性金融资产	22,774,497.19	292,142,234.13
应收款项	165,095,794.96	569,594,423.83
其他资产	498,712,020.00	5,917,003,000.00
负债	165,107,072.26	543,079,163.30
所有者权益	16,989,160.87	19,996,000.00

资产	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
货币资金	9,446,572,234.13	13,425,096,324.13
交易性金融资产	22,774,497.19	292,142,234.13
应收款项	165,095,794.96	569,594,423.83
其他资产	498,712,020.00	5,917,003,000.00
负债	165,107,072.26	543,079,163.30
所有者权益	16,989,160.87	19,996,000.00

资产	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
货币资金	9,446,572,234.13	13,425,096,324.13
交易性金融资产	22,774,497.19	292,142,234.13
应收款项	165,095,794.96	569,594,423.83
其他资产	498,712,020.00	5,917,003,000.00
负债	165,107,072.26	543,079,163.30
所有者权益	16,989,160.87	19,996,000.00

资产	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
货币资金	9,446,572,234.13	13,425,096,324.13
交易性金融资产	22,774,497.19	292,142,234.13
应收款项	165,095,794.96	569,594,423.83
其他资产	498,712,020.00	5,917,003,000.00
负债	165,107,072.26	543,079,163.30
所有者权益	16,989,160.87	19,996,000.00

资产	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
货币资金	9,446,572,234.13	13,425,096,324.13
交易性金融资产	22,774,497.19	292,142,234.13
应收款项	165,095,794.96	569,594,423.83
其他资产	498,712,020.00	5,917,003,000.00
负债	165,107,072.26	543,079,163.30
所有者权益	16,989,160.87	19,996,000.00

资产	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
货币资金	9,446,572,234.13	13,425,096,324.13
交易性金融资产	22,774,497.19	292,142,234.13
应收款项	165,095,794.96	569,594,423.83
其他资产	498,712,020.00	5,917,003,000.00
负债	165,107,072.26	543,079,163.30
所有者权益	16,989,160.87	19,996,000.00

资产	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
货币资金	9,446,572,234.13	13,425,096,324.13
交易性金融资产	22,774,497.19	292,142,234.13
应收款项	165,095,794.96	569,594,423.83
其他资产	498,712,020.00	5,917,003,000.00
负债	165,107,072.26	543,079,163.30
所有者权益	16,989,160.87	19,996,000.00

资产	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
货币资金	9,446,572,234.13	13,425,096,324.