招商移动互联网产业股票型证券投资基金

【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

§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其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告财务资料已经审计,毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了2015年度无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。

本报告期自2015年6月19日(基金合同生效日)起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	招商移动互联网产业股票基金
基金主代码	001404
交易代码	001404
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年6月19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
报告期末基金份额总额	3,067,647,859.37份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金重点投资于与移动互联网产业相关的上市公司,通过精选个股和严格控制风险,谋求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金采取主动投资管理模式。在投资策略上,本基金从两个层次进行,首先是进行大类资产配置,尽可能地规避证券市场的系统性风险,把握市场波动中产生的投资机会;其次是采取自下而上的分析方法,从定量和定性两个方面,通过深入的基本面研究分析,精选移动互联网产业主题中基本面良好、具有较好发展前景且价值被低估的优质上市公司。基金投资组合中股票资产占基金资产的80%-95%,其中,投资于移动互联网产业主题相关的股票资产的比例不低于非现金基金资产的80%;权证投资占基金资产净值的0%-3%。
业绩比较基准	中证移动互联网指数收益率×80%+中债综合指数收益率×20%
风险收益特征	本基金是一只主动管理的股票型基金,属于证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的品种,其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	潘西里	洪渊
	联系电话	0755-83196666	010-66105799
	电子邮箱	cmf@cmfchina.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-887-9555	95588
传真		0755-83196475	010-66105798

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.cmfchina.com
基金年度报告备置地点	(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)中国工商银行股份有限公司 地址:中国北京市西城区复兴门内大街55号

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2015年6月19日(基金合同生效日)-2015年12月31日
本期已实现收益	50,865,628.87
本期利润	503,038,506.67
加权平均基金份额本期利润	0.0922
本期基金份额净值增长率	8.70%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末
期末可供分配基金份额利润	0.0374
期末基金资产净值	3,335,819,133.98
期末基金份额净值	1.087

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.对期末可供分配利润,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。

4.本基金合同于2015年6月19日生效,截至本报告期未成立未满1年,本报告期为非完整会计年度。

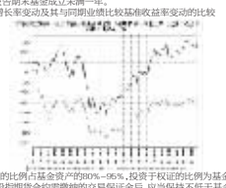
3.2 基金净值表现

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
过去三个月	36.73%	2.29%	27.14%	1.98%	9.59%	0.31%
过去六个月	9.69%	3.18%	-8.17%	2.94%	17.86%	0.24%
自基金合同生效起至今	8.70%	3.10%	-23.61%	3.09%	32.31%	0.01%

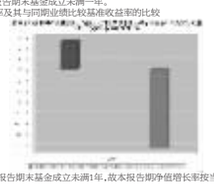
注:1.业绩比较基准收益率=中证移动互联网指数收益率×80%+中债综合指数收益率×20%,业绩比较基准在每个交易日实现再平衡;
2.本基金合同于2015年6月19日生效,截至本报告期末基金成立未满一年。

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:1.根据基金合同的规定:本基金投资于股票的比例占基金资产的80%-95%,投资于权证的比例为基金资产净值的0%-3%,股指期货的投资比例遵循国家相关法律法规,本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。本基金投资于移动互联网产业上市公司股票的投资比例不低于非现金基金资产的80%。本基金于2015年6月19日成立,目基金成立日起6个月内为建仓期,建仓期结束时相关比例均符合上述规定的要求;
2.本基金合同于2015年6月19日生效,截至本报告期末基金成立未满一年。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:本基金合同于2015年6月19日生效,截至本报告期末基金成立未满1年,故本报告期净值增长率按当年实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金于2015年6月19日成立,目基金合同生效日以来未进行利润分配。

§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。目前,公司注册资本金为2.1亿元人民币,其中,招商银行股份有限公司持有公司全部股权的55%,招商证券股份有限公司持有公司全部股权的45%。

截至2015年12月31日,本基金管理人共管理63只共同基金,具体如下:

基金名称	基金类型	基金成立日
招商安泰偏股混合型证券投资基金	混合型基金	2003-04-28
招商安泰平衡型证券投资基金	混合型基金	2003-04-28
招商安泰债券投资基金	债券型基金	2003-04-28
招商现金增值开放式证券投资基金	货币市场型基金	2004-01-14
招商先锋证券投资基金	混合型基金	2004-06-01
招商优质成长混合型证券投资基金(LOF)	混合型基金	2005-11-17
招商安本增利债券型证券投资基金	债券型基金	2006-07-11
招商核心价值混合型证券投资基金	混合型基金	2007-03-30
招商大盘蓝筹混合型证券投资基金	混合型基金	2008-06-19
招商安心收益债券型证券投资基金	债券型基金	2008-10-22
招商行业领先混合型证券投资基金	混合型基金	2009-06-19
招商中小盘精选混合型证券投资基金	混合型基金	2009-12-25
招商全球资源股票型证券投资基金	国际(QDII)基金	2010-03-25
招商深证100指数证券投资基金	股票型基金	2010-06-22
招商信用添利债券型证券投资基金(LOF)	债券型基金	2010-06-25
上证消费80交易型开放式指数证券投资基金	股票型基金	2010-12-08
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	股票型基金	2010-12-08
招商标普金砖四国指数证券投资基金(LOF)	国际(QDII)基金	2011-02-11
招商安瑞进取债券型证券投资基金	债券型基金	2011-03-17
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	股票型基金	2011-06-27
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	股票型基金	2011-06-27
招商安达保本混合型证券投资基金	混合型基金	2011-09-01
招商优势企业灵活配置混合型证券投资基金	混合型基金	2012-02-01
招商产业债券型证券投资基金	债券型基金	2012-03-21
招商中证大宗商品股票指数分级证券投资基金	股票型基金	2012-06-28
招商信用增强债券型证券投资基金	债券型基金	2012-07-20
招商安盈保本混合型证券投资基金	混合型基金	2012-08-20
招商理财7天债券型证券投资基金	货币市场型基金	2012-12-07
招商央视财经50指数证券投资基金	股票型基金	2013-02-06
招商双债增强债券型证券投资基金(LOF)	债券型基金	2013-03-01
招商安润保本混合型证券投资基金	混合型基金	2013-04-19
招商保证金快钱货币市场基金	货币市场型基金	2013-05-17
招商沪深300高贝塔指数分级证券投资基金	股票型基金	2013-08-01
招商瑞丰灵活配置混合型发起式证券投资基金	混合型基金	2013-11-06
招商标普高收益红利贵族指数增强型证券投资基金	国际(QDII)基金	2013-12-11
招商丰盛稳定增长灵活配置混合型证券投资基金	混合型基金	2014-03-20
招商招钱宝货币市场基金	货币市场型基金	2014-03-25
招商招金宝货币市场基金	货币市场型基金	2014-06-18
招商可转债分级债券型证券投资基金	债券型基金	2014-07-31
招商丰利灵活配置混合型证券投资基金	混合型基金	2014-08-12
招商行业精选股票型证券投资基金	股票型基金	2014-09-03
招商招利1个月理财债券型证券投资基金	货币市场型基金	2014-09-25
招商中证全指证券公司指数分级证券投资基金	股票型基金	2014-11-13
招商沪深300地产等权重指数分级证券投资基金	股票型基金	2014-11-27
招商医药健康产业股票型证券投资基金	股票型基金	2015-01-30
招商丰泰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)	混合型基金	2015-04-17
招商中证煤炭等权指数分级证券投资基金	股票型基金	2015-05-20
招商中证银行指数分级证券投资基金	股票型基金	2015-05-20
招商国证生物医药指数分级证券投资基金	股票型基金	2015-05-27
招商中证白酒指数分级证券投资基金	股票型基金	2015-05-27
招商丰泽灵活配置混合型证券投资基金	混合型基金	2015-06-11
招商移动互联网产业股票型证券投资基金	股票型基金	2015-06-19
招商国企改革主题混合型证券投资基金	混合型基金	2015-06-29
招商安益保本混合型证券投资基金	混合型基金	2015-07-14
招商丰庆灵活配置混合型发起式证券投资基金	混合型基金	2015-07-31
招商体育文化休闲股票型证券投资基金	股票型基金	2015-08-18
招商丰融灵活配置混合型证券投资基金	混合型基金	2015-11-17
招商丰裕灵活配置混合型证券投资基金	混合型基金	2015-11-17
招商丰享灵活配置混合型证券投资基金	混合型基金	2015-11-17
招商制造业转型灵活配置混合型证券投资基金	混合型基金	2015-12-02
招商瑞远保本混合型证券投资基金	混合型基金	2015-12-15
招商招益一年定期开放债券型证券投资基金	债券型基金	2015-12-25
招商安弘保本混合型证券投资基金	混合型基金	2015-12-29

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		
韩冰	本基金的基金经理	2015年6月19日	-	4	韩冰,男,中国国籍,管理学硕士。2006年7月加入上海文广新闻传媒集团任工程师,从事媒体资产管理的工作。2011年4月加入平安大华基金管理有限公司,任研究员,从事TMT行业研究的工作,2013年6月加入招商基金管理有限公司,管任研究员,助理基金经理,从事TMT行业研究,并协助基金经理进行组合管理,现任招商中小盘精选混合型证券投资基金及招商移动互联网产业股票型证券投资基金基金经理。
王忠波	本基金的基金经理	2015年6月19日	-	15	王忠波,男,中国国籍,博士,高级会计师。曾就职于山东省财政厅、山东证券有限责任公司及山东资产管理公司。2000年9月起加入民间证券交易所,从事证券研究工作。2002年4月加入银河基金管理有限公司,历任研究部宏观策略与行业研究员、副总监、总监等职务,曾担任银河稳健证券投资基金、银河行业优选基金经理。2010年12月加盟国联安基金管理有限公司,任总经理助理新设总监职务。2014年4月加盟招商基金管理有限公司,曾任招商行业领先混合型证券投资基金基金经理。现任总经理助理、投资管理部部副门负责人兼招商优质成长混合型证券投资基金(LOF)、招商行业精选股票型证券投资基金及招商移动互联网产业股票型证券投资基金基金经理。

注:1.本基金自任基金经理的任职日期为本基金合同生效日期,后任基金经理的任职日期为公司网站公告(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》的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》、《公开募集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《招商移动互联网产业股票型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 公平交易制度和控制方法

基金管理人(以下简称"公司")根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》(2011年修订)的规定,制定了《招商基金管理有限公司公平交易管理办法》,对投资决策的内控控制、交易执行的内控控制、公平交易实施情况的监控与检查稽核、异常交易的监控等进行了规定,为保证各投资组合在投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会,公司合理设置了各类资产管理业务之间以及各类资产管理业务内部的组织结构,建立了科学的投资决策体系,加强交易执行环节的内控控制,并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时,通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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,超过授权范围的操作需要经过严格的审批程序。公司的相关研究成果均面向所有投资组合开放,在投资研究层面不存在各投资组合间不公平的问题。公司交易室在执行指令时,对所有组合的各条指令,均在中央交易员的统一分配下,本着择有、利益最大化的原则执行了公平交易。

报告期内,公司按照法规要求,连续两个季度期间内,不同时期窗下(如日内、3日内、5日内)对公司管理的不同投资组合的同向交易的价格分布及成交数量进行分析,相关基金经理也对分析中发现的溢价率超过正常范围的情况进行了合理性解释。根据分析结果,公司旗下组合的同向交易情况基本正常,没有发现有明显异常并且无合理理由的同向交易异常情况。

4.3.3 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。确保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,本基金各笔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

宏观政策与分析:

2015年宏观经济保持震荡下行的态势,GDP增速在6.9%左右;主要原因是包括房地产、基建、制造业在内的固定资产投资持续下行,对经济的拉动效应持续下降;受全球经济增长乏力的影响,我国对外贸易的增速也在持续下降。整体上看,中国经济在相当长的时间内都将保持下行的压力。从经济结构上看,第三产业占比超过50%,大幅超越第二产业,经济结构转型依然在艰难的进行,也是未来中国经济持续稳定发展的必由之路。

受经济增速下行压力的影响,央行的货币政策保持了持续宽松的态势,连续降息降息。受美联储加息的影响,人民币汇率面临一定的压力,人民币贬值有力于国内的出口,但是对国内的货币持续宽松政策也带了一定的困难。

CPI数据维持低位震荡,PPI同比下降较多,通缩风险增加,通过财政和货币政策增加国内需求的必要性依然存在。

市场回顾:

2015年股市波动性非常大,宽松的货币政策加上居民资产加杠杆进入股市,指数在上半年大幅上涨;随着六月份去杠杆政策的实施,引发股市的暴跌,虽然国家队的救市在一定程度上稳定了市场,人民币贬值引发的市场对资本外流的担心导致了市场的第二轮下跌。在9月下旬市场逐步企稳,并在4季度有一轮小幅的反弹。

基金操作回顾:

本基金成立于2015年6月19日,建仓期遇到去杠杆引起的股市暴跌,仓位较低,在救市期间基金仓位提升至标准水平,之后维持仓位稳定;根据基金契约,本基金的标的以移动互联网和产业互联网的相关个股为主。

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1.087元,本报告期份额增长率为8.70%,同期业绩基准增长率为-23.61%,基金业绩高于同期比较基准,幅度为32.31%。本报告期内业绩表现高于基准的主要原因是股市大幅调整时本基金仓位控制在较低的水平;市场反弹时本基金的仓位较高,并且是以弹性较大的移动互联网的标的为主。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

中国经济进入调整期,在未来相当长的一段时间内保持较速增长的态势,大部分行业的增速不快;伴随着供给侧改革的推进,部分行业增长在短期内甚至面临持续下降的压力,为了维持经济的平稳,积极的财政政策和宽松的货币政策依然会继续维持,但是人民币持续贬值的压力也给此类政策的实施带了一定的困难。

伴随着去杠杆政策的实施和货币宽松政策的边际效应递减,A股市场经历了较大幅度的调整,从目前来看,中小板和创业板大部分公司的估值依然偏高,在整体宏观经济增速放缓的态势下,公司业绩不达预期的风险依然较大,市场依然面临继续调整的风险。未来在部分高景气度的子行业中选择确定性成长的个股是一种必要选择。

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,公司设立由投资研究部门、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。

投资和研究部门以及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;投资和研究部门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已与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司签署服务协议,由其按约定提供在银行间同业市场和交易所市场交易的债券品种的估值数据。

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。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

根据证监会《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条的相关要求,基金合同生效后,连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情形的,基金管理人应当在定期报告中予以披露。

报告期内,本基金未发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§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

2015年,本基金托管人在对招商移动互联网产业股票型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

2015年,招商移动互联网产业股票型证券投资基金的管理人——招商基金管理有限公司在招商移动互联网产业股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支及收入确认等方面,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,招商移动互联网产业股票型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对招商基金管理有限公司编制和披露的招商移动互联网产业股票型证券投资基金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。

§6 审计报告

毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)审计了招商移动互联网产业股票型证券投资基金的财务报表,包括2015年12月31日的资产负债表、自2015年6月19日(基金合同生效日)至2015年12月31日止期间的利润表,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。

投资者欲了解详细内容,可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:招商移动互联网产业股票型证券投资基金

报告截止日:2015年12月31日

单位:人民币元

资产	本期末 2015年12月31日
资 产:	
银行存款	429,247,764.20
结算备付金	5,330,734.42
存出保证金	3,332,018.15
交易性金融资产	2,878,311,104.43
其中:股票投资	2,878,311,104.43
基金投资	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	53,866,086.42
应收利息	119,330.12
应收股利	-
应收申购款	2,913,144.74
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	3,373,120,182.48
负债和所有者权益	**本期末 2015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	-
应付赎回款	26,312,676.78
应付管理人报酬	4,777,316.19
应付托管费	796,219.36
应付销售服务费	-
应付交易费用	5,172,624.98
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	242,211.31
负债合计	37,301,048.50
所有者权益:	
实收基金	3,067,647,859.37
未分配利润	268,171,274.61
所有者权益合计	3,335,819,133.98
负债和所有者权益总计	3,373,120,182.48

注:1.报告截止日2015年12月31日,基金份额净值1.087元,基金份额总额3,067,647,859.37份;
2.本期财务报表的实际编制期间为2015年6月19日(基金合同生效日)至2015年12月31日。

7.2 利润表

会计主体:招商移动互联网产业股票型证券投资基金

本报告期:2015年6月19日(基金合同生效日)至2015年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2015年6月19日(基金合同生效日)至2015年12月31日
一.收入	573,096,790.69
1.利息收入	12,612,561.76
其中:存款利息收入	4,970,360.84
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	7,642,200.92
其他利息收入	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	89,283,549.68
其中:股票投资收益	88,902,395.64
基金投资收益	-
债券投资收益	-
资产支持证券投资收益	-
贵金属投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	381,154.04
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	452,172,877.80
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	19,027,801.45
减:二.费用	70,058,284.02
1. 管理人报酬	41,460,592.20
2. 托管费	6,910,098.65
3. 销售服务费	-
4. 交易费用	21,467,141.51
5. 利息支出	-
其中:卖出回购金融资产支出	-
6. 其他费用	220,451.66
三.利润总额(亏损总额以"-"号填列)	503,038,506.67
减:所得税费用	-
四.净利润(净亏损以"-"号填列)	503,038,506.67

注:本期财务报表的实际编制期间为2015年6月19日(基金合同生效日)至2015年12月31日。

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:招商移动互联网产业股票型证券投资基金

本报告期:2015年6月19日(基金合同生效日)至2015年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2015年6月19日(基金合同生效日)至2015年12月31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)	8,051,259,120.87	-	8,051,259,120.87
二.本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	503,038,506.67	503,038,506.67
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)	-4,983,611,261.50	-234,867,232.06	-5,218,478,493.56
其中:1.基金申购款	755,818,179.96	-24,655,757.11	731,162,422.84
2.基金赎回款	-5,739,429,441.45	-210,211,474.95	-5,949,640,916.40
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)	3,067,647,859.37	268,171,274.61	3,335,819,133.98

注:本期财务报表的实际编制期间为2015年6月19日(基金合同生效日)至2015年12月31日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

_____金旭 _____欧志明_____ _____何剑萍____

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

招商移动互联网产业股票型证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")《关于准予招商移动互联网产业股票型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2015]876号文)批准,由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》及其他法律法规和《招商移动互联网产业股票型证券投资基金合同》发售,基金合同于2015年6月19日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集规模为8,051,259,120.87基金份额。本基金的基金管理人为招商基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司("中国工商银行")。

本基金于2015年6月12日至2015年6月23日募集,并提前于2015年6月16日募集完毕,募集期间净认购资金人民币8,049,551,535.51元,认购资金在募集期间产生的利息人民币1,707,585.36元,募集的有效认购份额及利息结转的基金份额合计8,051,259,120.87份。上述募集资金已由毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了毕马威华振验字第1500160号验资报告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则,《招商移动互联网产业股票型证券投资基金合同》及截至报告期末最新公告的《招商移动互联网产业股票型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,包括国内依法发行交易的A股股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会允许基金投资的股票),债券(含中小企业私募债),资产支持证券、货币市场工具、权证、股指期货,以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但需符合中国证监会的有关规定。在正常市场情况下,本基金投资组合的比例区间为:股票资产占基金资产的80%-95%,其中,投资于移动互联网产业主题相关的股票资产的比例不低于非现金基金资产的80%;权证投资占基金资产净值的0%-3%。其中基金保留不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为:中证移动互联网指数收益率×80%+中债综合指数收益率×20%。

7.4.2 会计科目的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称"财政部")颁布的企业会计准则的要求,同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号《年度报告和半年度报告》》以及中国证券投资基金业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本会计报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2015年12月31日的财务状况、自2015年6月19日(基金合同生效日)至2015年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为自2015年6月19日(基金合同生效日)至2015年12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币,编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金在初始确认时按取得投资产或承担负债的目的把金融资产和金融负债分为不同类别:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。

本基金目前持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时,于资产负债表内确认。

在初始确认时,金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债,相关交易费用直接计入当期损益;对于其他类别的金融资产或金融负债,相关交易费用计入初始确认金额。

初始确认后,金融资产和金融负债的后续计量如下:

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值计量,公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益;

应收款项以实际利率法按摊余成本计量。

当收取基项金融资产的现金流量的合同权利终止或将所有权上几乎所有的风险和报酬转移时,本基金终止确认该金融资产,终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

金融资产整体转移满足终止确认条件的,本基金将下列两项金额的差额计入当期损益:

-所转移金融资产的账面价值

-因转移而收到的对价

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的,本基金终止确认该金融负债或其一部分。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外,本基金按下述原则计量公允价值:

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中,出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金估计公允价值时,考虑市场参与者在计量日对相关资产或负债进行定价时考虑的特征(包括资产状况及所在位置、对资产出售或者使用的限制等),并采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易,但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

存在活跃市场的金融工具,如估值日无交易且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,参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素,调整最近交易市价以确定公允价值。

当金融工具不存在活跃市场,采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时,尽可能最大程度使用市场参数,减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示,没有相互抵销。但是,同时满足下列条件的,以相互抵销后的净额在资产负债表内列示:

-本基金具有抵销已确认金额的法定权利,且该种法定权利