

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  
送交日期:2014年3月28日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会、董事声明本基金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、完整性承担个别及连带的法律责任。本公司报告已经二分之一以上独立董事签署同意，并报监管机构备案。

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2014年3月26日核对了本基金报告中的财务指标、净值表现、利润分配、费用情况、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。

基金报告期自2013年1月1日起至2013年12月31日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称 深证TMT50ETF(场内简称:深TMT)

基金代码 159909

交易代码 159909

基金运作方式 指数型开放式(ETF)

基金合同生效日 2013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

报告期末基金资产净值 37,021,449.00份

基金份额净值 1.0000

基金净值增长率 4.00%

基金份额净值增长率标准差 0.89%

主要投资比例 99.99%

投资目标 本基金主要投资于深证TMT50指数成份股,在严格控制风险的前提下,追求超越业绩基准的收益。

投资策略 本基金主要投资于深证TMT50指数成份股,通过被动指数化投资,股票在投资组合中的权重根据深证TMT50指数成份股及其权重的变动而进行动态调整,但在投资操作中,本基金可以适当选择偏离度相对较大的股票进行投资。

业绩比较基准 深证TMT50指数

风险收益特征 本基金为股票型基金,预期风险和收益水平高于股票型基金,低于股票型基金平均收益。

风险收益特征 本基金为股票型基金,预期风险和收益水平高于股票型基金,低于股票型基金平均收益。

2.2 基金产品说明

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

姓名 欧志明 蔡旗

信息披露负责人 联系电话 0755-83196666 95566

电子邮箱 cmfcn@cmchina.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

基金年度报告正文的管理人互联网网址 <http://www.cmchina.com>

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要财务数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 利润数据和指标 2013年 2012年 2011年1月1日至2011年12月31日

本期末 可用资金余额 60,052,919.24 -46,188,198.38 -35,267,366.47

本期利润 114,394,400.24 12,333,140.48 -135,475,131.69

加权平均基金份额本期利润 1.6076 0.0917 -0.6417

基金份额净值增长率为 51.68% 2.27% -28.25%

3.1.2 利润数据和指标 2013年 2012年 2011年

期初可供基金份额余额 0.3671 -0.8658 -0.0186

期末可供基金份额余额 3,137,095,093.93 261,513,338.58 402,514,985.00

基金份额净值增长率为 3.619 2.36% 2.33%

注:基金管理人对本基金的基金分红不包括持有人(人) (申) 购买本基金的款项费用, 计入费用后实际收益水平要低于所列示的基金分红。

3.2.1 基金分红情况 本报告期内, 本基金利润总额为 0.3671 元, 扣除相关费用后的金额为 0.3671 元, 期末可供基金份额余额为 3,137,095,093.93 元, 基金份额净值增长率为 3.619, 基金分红不包括持有人(人) (申) 购买本基金的款项费用, 计入费用后实际收益水平要低于所列示的基金分红。

3.2.2 基金合同生效以来基金分红情况 本报告期内, 本基金利润总额为 0.3671 元, 扣除相关费用后的金额为 0.3671 元, 期末可供基金份额余额为 3,137,095,093.93 元, 基金份额净值增长率为 3.619, 基金分红不包括持有人(人) (申) 购买本基金的款项费用, 计入费用后实际收益水平要低于所列示的基金分红。

3.3 过去三年基金的利润分配情况 本报告期内, 本基金未进行利润分配。

4.1 基金管理人及其基本情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经

4.1.2 基金管理人概况 2012年1月21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, 公司的经营范围包括发起设立基金、基金管理业务和中国证监会批准的其它业务。

4.1.3 基金管理人对本基金的管理 本基金于2011年6月27日生效, 并经中国证监会监督委员会证监许可[2011]1074号文批准同意, 本公司原股东荷兰投资公司(ING Asset Management B.V.)将其持有的全部30%的股权转让给招商基金管理有限公司, 11.7%的股权转让给中国银行股份有限公司, 截止2013年1月21日, 本公司对本基金的管理权由招商基金管理有限公司接替。

4.1.4 基金管理人对本基金的管理 本基金于2011年6月27日生效, 截至2011年12月31日未满1年, 故2011年的数据和指标为非完全会计期间。

4.2 基金份额表现

4.2.1 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

4.2.2 基金合同生效以来基金的分红情况 本报告期内, 本基金未进行分红。

4.3 年度报告分析 本报告期内, 本基金未进行分红。

4.4 基金管理人对本基金的管理 本基金于2011年6月27日生效, 截至2011年12月31日未满1年, 故2011年的数据和指标为非完全会计期间。

4.5 基金管理人对本基金的管理 本基金于2011年6月27日生效, 截至2011年12月31日未满1年, 故2011年的数据和指标为非完全会计期间。

4.6 基金管理人对本基金的管理 本基金于2011年6月27日生效, 截至2011年12月31日未满1年, 故2011年的数据和指标为非完全会计期间。

4.7 基金管理人对本基金的管理 本基金于2011年6月27日生效, 截至2011年12月31日未满1年, 故2011年的数据和指标为非完全会计期间。

4.8 基金管理人对本基金的管理 本基金于2011年6月27日生效, 截至2011年12月31日未满1年, 故2011年的数据和指标为非完全会计期间。

4.9 基金管理人对本基金的管理 本基金于2011年6月27日生效, 截至2011年12月31日未满1年, 故2011年的数据和指标为非完全会计期间。

4.10 基金管理人对本基金的管理 本基金于2011年6月27日生效, 截至2011年12月31日未满1年, 故2011年的数据和指标为非完全会计期间。

4.11 基金管理人对本基金的管理 本基金于2011年6月27日生效, 截至2011年12月31日未满1年, 故2011年的数据和指标为非完全会计期间。

4.12 基金管理人对本基金的管理 本基金于2011年6月27日生效, 截至2011年12月31日未满1年, 故2011年的数据和指标为非完全会计期间。

4.13 基金管理人对本基金的管理 本基金于2011年6月27日生效, 截至2011年12月31日未满1年, 故2011年的数据和指标为非完全会计期间。

4.14 基金管理人对本基金的管理 本基金于2011年6月27日生效, 截至2011年12月31日未满1年, 故2011年的数据和指标为非完全会计期间。

4.15 基金管理人对本基金的管理 本基金于2011年6月27日生效, 截至2011年12月31日未满1年, 故2011年的数据和指标为非完全会计期间。

4.16 基金管理人对本基金的管理 本基金于2011年6月27日生效, 截至2011年12月31日未满1年, 故2011年的数据和指标为非完全会计期间。

4.17 基金管理人对本基金的管理 本基金于2011年6月27日生效, 截至2011年12月31日未满1年, 故2011年的数据和指标为非完全会计期间。

4.18 基金管理人对本基金的管理 本基金于2011年6月27日生效, 截至2011年12月31日未满1年, 故2011年的数据和指标为非完全会计期间。

4.19 基金管理人对本基金的管理 本基金于2011年6月27日生效, 截至2011年12月31日未满1年, 故2011年的数据和指标为非完全会计期间。

4.20 基金管理人对本基金的管理 本基金于2011年6月27日生效, 截至2011年12月31日未满1年, 故2011年的数据和指标为非完全会计期间。

4.21 基金管理人对本基金的管理 本基金于2011年6月27日生效, 截至2011年12月31日未满1年, 故2011年的数据和指标为非完全会计期间。

4.22 基金管理人对本基金的管理 本基金于2011年6月27日生效, 截至2011年12月31日未满1年, 故2011年的数据和指标为非完全会计期间。

4.23 基金管理人对本基金的管理 本基金于2011年6月27日生效, 截至2011年12月31日未满1年, 故2011年的数据和指标为非完全会计期间。

4.24 基金管理人对本基金的管理 本基金于2011年6月27日生效, 截至2011年12月31日未满1年, 故2011年的数据和指标为非完全会计期间。

4.25 基金管理人对本基金的管理 本基金于2011年6月27日生效, 截至2011年12月31日未满1年, 故2011年的数据和指标为非完全会计期间。

4.26 基金管理人对本基金的管理 本基金于2011年6月27日生效, 截至2011年12月31日未满1年, 故2011年的数据和指标为非完全会计期间。

4.27 基金管理人对本基金的管理 本基金于2011年6月27日生效, 截至2011年12月31日未满1年, 故2011年的数据和指标为非完全会计期间。

4.28 基金管理人对本基金的管理 本基金于2011年6月27日生效, 截至2011年12月31日未满1年, 故2011年的数据和指标为非完全会计期间。

4.29 基金管理人对本基金的管理 本基金于2011年6月27日生效, 截至2011年12月31日未满1年, 故2011年的数据和指标为非完全会计期间。

4.30 基金管理人对本基金的管理 本基金于2011年6月27日生效, 截至2011年12月31日未满1年, 故2011年的数据和指标为非完全会计期间。

4.31 基金管理人对本基金的管理 本基金于2011年6月27日生效, 截至2011年12月31日未满1年, 故2011年的数据和指标为非完全会计期间。

4.32 基金管理人对本基金的管理 本基金于2011年6月27日生效, 截至2011年12月31日未满1年, 故2011年的数据和指标为非完全会计期间。

4.33 基金管理人对本基金的管理 本基金于2011年6月27日生效, 截至2011年12月31日未满1年, 故2011年的数据和指标为非完全会计期间。

4.34 基金管理人对本基金的管理 本基金于2011年6月27日生效, 截至2011年12月31日未满1年, 故2011年的数据和指标为非完全会计期间。

4.35 基金管理人对本基金的管理 本基金于2011年6月27日生效, 截至2011年12月31日未满1年, 故2011年的数据和指标为非完全会计期间。

4.36 基金管理人对本基金的管理 本基金于2011年6月27日生效, 截至2011年12月31日未满1年, 故2011年的数据和指标为非完全会计期间。

4.37 基金管理人对本基金的管理 本基金于2011年6月27日生效, 截至2011年12月31日未满1年, 故2011年的数据和指标为非完全会计期间。

4.38 基金管理人对本基金的管理 本基金于2011年6月27日生效, 截至2011年12月31日未满1年, 故2011年的数据和指标为非完全会计期间。

4.39 基金管理人对本基金的管理 本基金于2011年6月27日生效, 截至2011年12月31日未满1年, 故2011年的数据和指标为非完全会计期间。

4.40 基金管理人对本基金的管理 本基金于2011年6月27日生效, 截至2011年12月31日未满1年, 故2011年的数据和指标为非完全会计期间。

4.41 基金管理人对本基金的管理 本基金于2011年6月27日生效, 截至2011年12月31日未满1年, 故2011年的数据和指标为非完全会计期间。

4.42 基金管理人对本基金的管理 本基金于2011年6月27日生效, 截至2011年12月31日未满1年, 故2011年的数据和指标为非完全会计期间。

4.43 基金管理人对本基金的管理 本基金于2011年6月27日生效, 截至2011年12月31日未满1年, 故2011年的数据和指标为非完全会计期间。

4.44 基金管理人对本基金的管理 本基金于2011年6月27日生效, 截至2011年12月31日未满1年, 故2011年的数据和指标为非完全会计期间。

4.45 基金管理人对本基金的管理 本基金于2011年6月27日生效, 截至2011年12月31日未满1年, 故2