

信息披露 disclosure

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

2013 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:中国银行股份有限公司
送出日期:2014年3月28日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会、基金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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年3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,德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了2013年度无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。
本报告自2013年1月1日起至12月31日止。

§ 2 基金简介

基金名称	招商深证TMT50联接
基金代码	270109
交易代码	270109
基金运作方式	契约开放式
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
报告期内基金份额总额	114,543,326.99份
基金合同存续期限	不定期

基金名称	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
基金代码	159099
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
基金上市的交易场所	深圳证券交易所
上市日期	2011年9月11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	中国银行股份有限公司

投资目标	通过主要投资于深证TMT50ETF,密切跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为深证TMT50ETF的联接基金,主要通过投资于深证TMT50ETF来跟踪标的指数。本基金对跟踪标的指数的跟踪目标是:在正常情况下,本基金相对于业绩比较基准的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%,年跟踪误差不得超过1%。
业绩比较基准	深证TMT50指数收益率×95%+商业银行活期存款利率×5%
风险收益特征	本基金为深证TMT50ETF的联接基金,属于股票型基金,预期风险与收益水平高于货币型基金。本基金为国内证券市场基金,在证券投资基金中属于较高风险、较高收益的投资品种;并且本基金为股票型基金,采用完全复制法紧密跟踪深证TMT50指数,具有与标的指数及标的指数所代表的股票相似的风险收益特征。

目标基金投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
目标基金投资策略	本基金以跟踪TMT50指数为标的指数,采用完全复制法,即完全复制标的指数的构成股票及其权重构建基金投资组合,进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重,将根据标的指数的构成及其权重变动进行相应调整,但在有特殊情况时,本基金可以选择其他证券或证券组合对标的指数的变动进行适当替代。
目标基金业绩比较基准	深证TMT50指数
目标基金风险收益特征	本基金为国内证券市场基金,预期风险与收益水平高于货币型基金,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;并且本基金为股票型基金,采用完全复制法紧密跟踪深证TMT50指数,具有与标的指数及标的指数所代表的股票相似的风险收益特征。

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
名称	招商基金管理有限公司
姓名	陈浩
联系电话	0755-8316666
电子邮箱	cmf@cmfchina.com
客户服务电话	400-887-9556
传真	0755-83166475

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
名称	招商基金管理有限公司
姓名	陈浩
联系电话	0755-8316666
电子邮箱	cmf@cmfchina.com
客户服务电话	400-887-9556
传真	0755-83166475

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
名称	招商基金管理有限公司
姓名	陈浩
联系电话	0755-8316666
电子邮箱	cmf@cmfchina.com
客户服务电话	400-887-9556
传真	0755-83166475

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
名称	招商基金管理有限公司
姓名	陈浩
联系电话	0755-8316666
电子邮箱	cmf@cmfchina.com
客户服务电话	400-887-9556
传真	0755-83166475

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
名称	招商基金管理有限公司
姓名	陈浩
联系电话	0755-8316666
电子邮箱	cmf@cmfchina.com
客户服务电话	400-887-9556
传真	0755-83166475

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
名称	招商基金管理有限公司
姓名	陈浩
联系电话	0755-8316666
电子邮箱	cmf@cmfchina.com
客户服务电话	400-887-9556
传真	0755-83166475

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
名称	招商基金管理有限公司
姓名	陈浩
联系电话	0755-8316666
电子邮箱	cmf@cmfchina.com
客户服务电话	400-887-9556
传真	0755-83166475

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
名称	招商基金管理有限公司
姓名	陈浩
联系电话	0755-8316666
电子邮箱	cmf@cmfchina.com
客户服务电话	400-887-9556
传真	0755-83166475

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
名称	招商基金管理有限公司
姓名	陈浩
联系电话	0755-8316666
电子邮箱	cmf@cmfchina.com
客户服务电话	400-887-9556
传真	0755-83166475

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
名称	招商基金管理有限公司
姓名	陈浩
联系电话	0755-8316666
电子邮箱	cmf@cmfchina.com
客户服务电话	400-887-9556
传真	0755-83166475

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
名称	招商基金管理有限公司
姓名	陈浩
联系电话	0755-8316666
电子邮箱	cmf@cmfchina.com
客户服务电话	400-887-9556
传真	0755-83166475

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
名称	招商基金管理有限公司
姓名	陈浩
联系电话	0755-8316666
电子邮箱	cmf@cmfchina.com
客户服务电话	400-887-9556
传真	0755-83166475

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
名称	招商基金管理有限公司
姓名	陈浩
联系电话	0755-8316666
电子邮箱	cmf@cmfchina.com
客户服务电话	400-887-9556
传真	0755-83166475

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
名称	招商基金管理有限公司
姓名	陈浩
联系电话	0755-8316666
电子邮箱	cmf@cmfchina.com
客户服务电话	400-887-9556
传真	0755-83166475

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
名称	招商基金管理有限公司
姓名	陈浩
联系电话	0755-8316666
电子邮箱	cmf@cmfchina.com
客户服务电话	400-887-9556
传真	0755-83166475

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
名称	招商基金管理有限公司
姓名	陈浩
联系电话	0755-8316666
电子邮箱	cmf@cmfchina.com
客户服务电话	400-887-9556
传真	0755-83166475

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
名称	招商基金管理有限公司
姓名	陈浩
联系电话	0755-8316666
电子邮箱	cmf@cmfchina.com
客户服务电话	400-887-9556
传真	0755-83166475

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
名称	招商基金管理有限公司
姓名	陈浩
联系电话	0755-8316666
电子邮箱	cmf@cmfchina.com
客户服务电话	400-887-9556
传真	0755-83166475

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
名称	招商基金管理有限公司
姓名	陈浩
联系电话	0755-8316666
电子邮箱	cmf@cmfchina.com
客户服务电话	400-887-9556
传真	0755-83166475

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
名称	招商基金管理有限公司
姓名	陈浩
联系电话	0755-8316666
电子邮箱	cmf@cmfchina.com
客户服务电话	400-887-9556
传真	0755-83166475

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
名称	招商基金管理有限公司
姓名	陈浩
联系电话	0755-8316666
电子邮箱	cmf@cmfchina.com
客户服务电话	400-887-9556
传真	0755-83166475

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
名称	招商基金管理有限公司
姓名	陈浩
联系电话	0755-8316666
电子邮箱	cmf@cmfchina.com
客户服务电话	400-887-9556
传真	0755-83166475

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
名称	招商基金管理有限公司
姓名	陈浩
联系电话	0755-8316666
电子邮箱	cmf@cmfchina.com
客户服务电话	400-887-9556
传真	0755-83166475

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
名称	招商基金管理有限公司
姓名	陈浩
联系电话	0755-8316666
电子邮箱	cmf@cmfchina.com
客户服务电话	400-887-9556
传真	0755-83166475

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
名称	招商基金管理有限公司
姓名	陈浩
联系电话	0755-8316666
电子邮箱	cmf@cmfchina.com
客户服务电话	400-887-9556
传真	0755-83166475

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
名称	招商基金管理有限公司
姓名	陈浩
联系电话	0755-8316666
电子邮箱	cmf@cmfchina.com
客户服务电话	400-887-9556
传真	0755-83166475

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
名称	招商基金管理有限公司
姓名	陈浩
联系电话	0755-8316666
电子邮箱	cmf@cmfchina.com
客户服务电话	400-887-9556
传真	0755-83166475

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
名称	招商基金管理有限公司
姓名	陈浩
联系电话	0755-8316666
电子邮箱	cmf@cmfchina.com
客户服务电话	400-887-9556
传真	0755-83166475

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
名称	招商基金管理有限公司
姓名	陈浩
联系电话	0755-8316666
电子邮箱	cmf@cmfchina.com
客户服务电话	400-887-9556
传真	0755-83166475

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
名称	招商基金管理有限公司
姓名	陈浩
联系电话	0755-8316666
电子邮箱	cmf@cmfchina.com
客户服务电话	400-887-9556
传真	0755-83166475

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
名称	招商基金管理有限公司
姓名	陈浩
联系电话	0755-8316666
电子邮箱	cmf@cmfchina.com
客户服务电话	400-887-9556
传真	0755-83166475

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
名称	招商基金管理有限公司
姓名	陈浩
联系电话	0755-8316666
电子邮箱	cmf@cmfchina.com
客户服务电话	400-887-9556
传真	0755-83166475

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
名称	招商基金管理有限公司
姓名	陈浩
联系电话	0755-8316666
电子邮箱	cmf@cmfchina.com
客户服务电话	400-887-9556
传真	0755-83166475

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
名称	招商基金管理有限公司
姓名	陈浩
联系电话	0755-8316666
电子邮箱	cmf@cmfchina.com
客户服务电话	400-887-9556
传真	0755-83166475

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
名称	招商基金管理有限公司
姓名	陈浩
联系电话	0755-8316666
电子邮箱	cmf@cmfchina.com
客户服务电话	400-887-9556
传真	0755-83166475

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
名称	招商基金管理有限公司
姓名	陈浩
联系电话	0755-8316666
电子邮箱	cmf@cmfchina.com
客户服务电话	400-887-9556
传真	0755-83166475

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
名称	招商基金管理有限公司
姓名	陈浩
联系电话	0755-8316666
电子邮箱	cmf@cmfchina.com
客户服务电话	400-887-9556
传真	0755-83166475

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
名称	招商基金管理有限公司
姓名	陈浩
联系电话	0755-8316666
电子邮箱	cmf@cmfchina.com
客户服务电话	400-887-9556
传真	0755-83166475

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
名称	招商基金管理有限公司
姓名	陈浩
联系电话	0755-8316666
电子邮箱	cmf@cmfchina.com
客户服务电话	400-887-9556
传真	0755-83166475

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
名称	招商基金管理有限公司
姓名	陈浩
联系电话	0755-8316666
电子邮箱	cmf@cmfchina.com
客户服务电话	400-887-9556
传真	0755-83166475

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
名称	招商基金管理有限公司
姓名	陈浩
联系电话	0755-8316666
电子邮箱	cmf@cmfchina.com
客户服务电话	400-887-9556
传真	0755-83166475

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
名称	招商基金管理有限公司
姓名	陈浩
联系电话	0755-8316666
电子邮箱	cmf@cmfchina.com
客户服务电话	400-887-9556
传真	0755-83166475

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
名称	招商基金管理有限公司
姓名	陈浩
联系电话	0755-8316666
电子邮箱	cmf@cmfchina.com
客户服务电话	400-887-9556
传真	0755-83166475

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
名称	招商基金管理有限公司
姓名	陈浩
联系电话	0755-8316666
电子邮箱	cmf@cmfchina.com
客户服务电话	400-887-9556
传真	0755-83166475

基金管理人的董事会、基金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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年3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,德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了2013年度无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。
本报告自2013年1月1日起至12月31日止。

§ 2 基金简介

基金运用的原则和运用基金决策程序,在严格控制风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告所讨论的治理原则和程序符合法律,无显著违背持有人利益的行为。基金的投资原则、投资比例及投资组合符合法律法规及基金合同的约定。

4.3 管理人应对报告期内基金运作情况的专项说明

4.3.1 公平交易控制制度和控制方法

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》、《证券投资基金销售管理办法》和《证券投资基金信息披露管理办法》等法律法规和《招商基金管理有限公司公平交易管理制度》(2011年修订)的规定,制定了对招商基金旗下所有公司公募基金理财办法,对投资决策的内部控制、交易执行中的内部控制、公平交易实施情况的检查与监督、异常交易的监控等进行了规定,为保证各投资组合投资权益,投资建在统一投资决策委员会和公平交易委员会,公平交易设置了各项控制措施以及各类基金“管理业务”层面的组织结构和流程,并建立了公平交易控制制度,并建立工作程序,类似如基金手段和流程,并建立公平交易控制制度的实施。同时,通过对基金投资组合的监控,分析评估和归并核算对公平交易和风险控制。