

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更新的招募说明书摘要

(二零一五年第二号)

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(以下简称“深证TMT50ETF”、“本基金”)经中国证券监督管理委员会2011年4月27日《关于核准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及联接基金募集的批复》(证监许可〔2011〕605号文)核准公开募集。本基金的基金合同于2011年6月27日正式生效。本基金为契约型开放式。

重要提示

投资有风险,投资人认购(或申购)本基金时应认真阅读本招募说明书。

本基金的过往业绩并不预示其未来表现。
本招募说明书摘要根据本基金的基金合同和招募说明书编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、《基金合同》及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

本更新招募说明书所载内容截止日为2015年6月27日,有关财务和业绩表现数据截止日为2015年3月31日,财务和业绩表现数据未经审计。

一、基金管理人

(一) 基金管理人概况

名称:招商基金管理有限公司
住所:深圳市深南大道7088号招商银行大厦28楼
设立日期:2002年12月27日
法定代表人:张光华
办公地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦28楼
电话:(0755) 83196351
传真:(0755) 83076974
联系人:曾倩
注册资本:人民币2.1亿元
股权结构和公司沿革:
招商基金管理有限公司于2002年12月27日经中国证监会证监基金字[2002]100号文批准设立,是中国第一家中外合资基金管理公司。公司由招商证券股份有限公司、ING Asset Management B.V.(荷兰投资)、中国电力财务有限公司、中国华能财务有限责任公司、中远财务有限责任公司共同投资组建。经公司股东大会并经中国证监会批准,公司的注册资本已由人民币一亿元(RMB100,000,000元)增加为人民币二亿一千万(RMB210,000,000元)。

2007年6月,经公司股东大会并经中国证监会批复同意,招商银行股份有限公司受让中国电力财务有限公司、中国华能财务有限责任公司、中远财务有限责任公司及招商证券股份有限公司外资股东分别持有的公司10%、10%、10%及3.4%的股权;公司外资股东ING Asset Management B.V.(荷兰投资)受让招商证券股份有限公司持有的公司33.3%的股权。上述股权转让完成后,招商基金管理有限公司的股东及股权结构为:招商银行股份有限公司持有公司全部股权的33.4%,招商证券股份有限公司持有公司全部股权的33.3%,ING Asset Management B.V.(荷兰投资)持有公司全部股权的33.3%。

2013年8月,经公司股东大会审议通过,并经中国证监会证监许可[2013]1074号文批复同意,荷兰投资公司(ING Asset Management B.V.)将其持有的招商基金管理有限公司21.6%股权转让给招商银行股份有限公司,11.7%股权转让给招商证券股份有限公司。上述股权转让完成后,招商基金管理有限公司的股东及股权结构为:招商银行股份有限公司持有全部股权的45%。

公司主要股东招商银行股份有限公司成立于1987年4月8日,总行设在深圳,业务以中国国内市场为主。招商银行于2002年4月9日在上海证券交易所上市(股票代码:600036)。2006年9月22日,招商银行在香港联合交易所上市(股份代号:3968)。

招商证券股份有限公司是百年招商局旗下金融企业,经过多年创业发展,已成为拥有证券市场业务全牌照的一流券商。2009年11月,招商证券在上海证券交易所上市(代码600999)。

公司本着“长期、稳健、优良、专业”的经营理念,力争为客户推崇、股东满意、员工热爱,并具有国际竞争力的专业化的资产管理公司。

(二) 主要人员情况

1.基金管理人董事、监事及其他高级管理人员介绍:
邓晓卢,女,毕业于美国纽约州立大学,获经济学博士学位。2001年加入招商证券,期间于2004年1月至2005年9月担任中国证监会借调至南方证券行政接管工作组,参与南方证券的清算;在加入招商证券前,曾在美国纽约花旗银行从事风险管理工作。现任招商证券股份有限公司副总裁、分管风险管理、公司财务、清算及培训工作;中国证券业协会、财务与风险管理委员会委员兼主任。现任公司副董事长。

金旭,女,北京大学硕士研究生。1993年7月至2001年11月在中国证监会工作。2001年11月至2004年7月在华夏基金管理有限公司任副总经理。2004年7月至2006年1月在宝盈基金管理有限公司任总经理。2006年1月至2007年5月在海隆全球投资有限公司北京代表处任首席代表。2007年6月至2014年12月担任国泰基金管理有限公司总经理。2015年1月加入招商基金管理有限公司,现任公司总经理、董事、代理董事长。

李俊江,男,经济学博士,教授、博士生导师。历任吉林大学经济学院副院长、德国不莱梅大学客座教授、美国印第安纳大学经济学高级访问学者。现任吉林大学经济学院院长、金融学院院长、社会科学学部学术委员会主任、国际研究所所长。兼任中国世界经济学会副秘书长、中国美国经济学会副秘书长、教育部经济学专业教学指导委员会委员、中共吉林省委决策咨询委员会委员、吉林省政府决策咨询委员会委员等。现任公司独立董事。

王莉,女,高级经济师。毕业于中国人民解放军外国语学院,历任中国工商银行昆明军区三局战士、助理研究员;国务院科技干部局二处干部;中信公司财务部国际金融处干部、银行部资金处副处长;中信银行(原中信实业银行)资本市场部总经理,行长助理、副行长等职。现任中国证券市场设计中心(联办)常务干事兼基金部总经理;联办控股有限公司董事总经理等。现任公司独立董事。

蔡廷基,男,毕业于香港理工学院(现为香港理工大学)会计系,历任香港毕马威会计师事务所审计部副经理、经理,毕马威会计师事务所上海办事处执行合伙人,毕马威华振会计师事务所上海首席合伙人,毕马威华振会计师事务所华东区首席合伙人。现为香港注册会计师公会资深会员、上海市静安区政协委员、上海市静安区归国华侨联合会名誉副主席。兼任中国石化上海石油化工有限公司等三家香港上市公司的非执行董事。现任公司独立董事。

孙谦,男,新加坡籍,经济学博士。1980年至1991年先后就读于北京大学、复旦大学、William Paterson College and Arizona State University并获学士、工商管理硕士和经济学博士学位。曾任新加坡南洋理工大学商学院副教授、厦门大学财务管理与会计研究院院长及特聘教授、上海证券交易所高级访问金融专家。现任复旦大学管理学院特聘教授和财务金融系主任。兼任上海证券交易所、中国金融期货交易所和上海期货交易所博士后工作站导师,科技部复旦科技园中小型科技企业创新创业融资平台项目负责人。现任公司独立董事。

张卫华,女,1981年07月—1988年8月,曾在江苏省连云港市汽车运输公司财务部门任职;1983年11月—1988年06月,任中国建设银行连云港分行外汇会计部主任;1988年08月—1994年11月,历任招商银行总行国际部、会计部主任、证券业务部总经理助理;1994年11月—2006年02月,历任招商银行、国通证券及招商证券股份有限公司总裁助理兼稽核审计部总经理;2006年03月—2009年04月,任招商证券股份有限公司稽核监察总审计师;2009年04月起任招商证券股份有限公司合规总监。现任公司监事会主席。

周松,男,武汉大学世界经济专业硕士研究生。1997年2月加入招商银行,1997年2月至2006年6月历任招商银行总行计划资金部经理、总经理助理、副总经理,2006年6月至2007年7月任招商银行总行计划财务部副总经理,2007年7月至2008年7月任招商银行武汉分行副行长。2008年7月至2010年6月任招商银行总行计划财务部副总经理(主持工作)。2010年6月至2012年9月任招商银行总行计划财务部总经理。2012年9月至2014年6月任招商银行总行业务总监兼总行计划财务部总经理。2014年6月至2014年12月任招商银行总行业务总监兼总行资产负债管理部总经理。2014年12月起任招商银行总行同业金融部总监兼总行资产管理部总经理。现任公司监事。

罗琳,女,厦门大学经济学硕士。1996年加入招商证券股

份有限公司投资银行部,先后担任项目经理、高级经理、业务董事,2002年起参与招商基金管理有限公司筹备,公司成立后先后担任基金核算部高级经理、产品研发部高级经理、副总监、总监,现任产品运营官兼市场推广部总监、公司监事。

鲁丹,女,中山大学国际工商管理硕士;2001年加入美的集团股份有限公司任Oracle ERP系统实施顾问;2005年5月至2006年12月于韬睿惠悦咨询有限公司任咨询顾问;2006年12月至2011年2月于怡安翰威特咨询有限公司任咨询总监;2011年2月至2014年3月任倍智人才管理咨询有限公司首席运营官;现任招商基金管理有限公司人力资源部总监、公司监事,兼任招商财富资产管理有限公司董事。

李杨,中央财经大学经济学硕士,2002年加入招商基金,历任基金核算部高级经理、副总监、总监,现任产品一部总监、公司监事。

钟文岳,男,厦门大学货币银行学硕士。1992年7月至1997年4月于中国农村发展信托投资公司任福建(集团)公司国际业务部经理;1997年4月至2000年1月任厦门万国证券股份有限公司历任九江营业部总经理;2000年1月至2001年1月任厦门海发投资股份有限公司总经理;2001年1月至2004年1月任厦门二十一世纪风险投资公司副总经理;2004年1月至2008年11月任浙江南投资有限公司副总经理,2008年11月至2015年6月任招商银行股份有限公司投资管理部总经理;2015年6月加入招商基金管理有限公司,现任副总经理。

欧志明,男,华中科技大学经济学及法学双学士,投资经济硕士;2002年加入广发证券深圳业务总部任机构客户经理;2003年4月至2004年7月于广发证券总部任风险控制岗从事风险管理工作;2004年7月加入招商基金管理有限公司,曾任法律合规部高级经理、副总监、总监、督察长,现任公司副总经理、董事会秘书兼投资督察长,兼任招商财富资产管理有限公司董事。

2、本基金基金经理介绍

王平,男,中国国籍,管理学硕士,FRM。2006年加入招商基金管理有限公司,历任投资风险管理部助理数量分析师、风险管理部数量分析师、高级风控经理、副总监,主要负责公司副总监兼招商深证100指数分级证券投资基金基金经理(管理时间:2010年6月22日至今)、上证消费80交易型开放式指数证券投资基金及联接基金基金经理(管理时间:2010年12月8日至今)、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及联接基金基金经理(管理时间:2011年6月27日至今)、招商中证大宗商品股票指数分级证券投资基金基金经理(管理时间:2012年6月28日至今)、招商央视财经50指数证券投资基金基金经理(管理时间:2013年2月6日至今)、招商中证银行指数分级证券投资基金基金经理(管理时间:2015年5月20日至至今)、招商中证煤炭等权指数分级证券投资基金基金经理(管理时间:2015年5月20日至至今)、招商中证白酒指数分级证券投资基金基金经理(管理时间:2015年5月27日至至今)、招商国证生物医药指数分级证券投资基金基金经理(管理时间:2015年5月27日至至今)。

罗毅,男,中国国籍,经济学硕士。2007年加入华润(深圳)有限公司,从事商业地产投资项目分析及运营管理工作;2008年4月加入招商基金管理有限公司,从事养老金产品设计研发、基金市场营销、量化选股研究及指数基金运作管理工作,曾任高级经理、ETF专员,现任上证消费80交易型开放式指数证券投资基金及联接基金基金经理(管理时间:2013年1月19日至今)、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及联接基金基金经理(管理时间:2013年1月19日至今)、招商沪深300高贝塔指数分级证券投资基金基金经理(管理时间:2013年8月10日至至今)、招商中证全指证券公司指数分级证券投资基金基金经理(管理时间:2014年11月13日至至今)、招商沪深300地产等权重指数分级证券投资基金基金经理(管理时间:2014年11月27日至至今)。

3、投资决策委员会成员

公司的投资决策委员会由如下成员组成:总经理金旭,总经理助理兼全球量化投资部负责人吴武斌,总经理助理兼投资管理二部负责人杨渺,总经理助理兼投资管理四部负责人王忠波、交易部总监路明。

4、上述人员之间均不存在近亲属关系。

(一) 基本情况

名称:中国银行银行股份有限公司(简称“中国银行”)住所及办公地址:北京市西城区复兴门内大街1号首次注册登记日期:1983年10月31日注册资本:人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟零玖拾玖元整
法定代表人:田国立
基金托管业务批准文号:中国证监会证监基金字【1998】24号

托管及投资者服务部总经理:李爱华
托管部门信息披露联系人:王永民
客服电话:95566
传真:(010)66594942

(二) 基金托管人及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于1998年,现有员工110余人,大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验,且具备海外工作、学习或培训经历,60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务,中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行,中国银行拥有证券投资基金、基金(一对多、一对一)、社保基金、保险资金、OFII、ROFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内,中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务,为各类客户提供个性化的托管增值服务,是国内领先的大型中资托管银行。

(三) 证券投资基金托管情况

截至2015年3月31日,中国银行已托管328只证券投资基金,其中境内基金303只,QDII基金25只,覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金,满足了不同客户多元化的投资理财需求,基金托管规模位居同业前列。

三、相关服务机构

(一) 场内申购、赎回代理机构

(1)代销机构:招商证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38—45层
法定代表人:宫少林
电话:(0755) 82960223
传真:(0755) 82960141
联系人:刘玉生
(2)代销机构:安信证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
法定代表人:牛冠兴
电话:0755-82825551
传真:0755-82585355
联系人:余江
(3)代销机构:国海证券股份有限公司
注册地址:广西柳州南厢盖路13号
法定代表人:何春梅
电话:(0755)83709350
传真:(0755)83704850
联系人:李孟宇
(4)代销机构:广州证券股份有限公司
注册地址:广州市天河区珠江西路6号广州国际金融中心主楼19层、20层
法定代表人:邱三达
电话:020-88836999
传真:020-88836654
联系人:林洁茹
(5)代销机构:海通证券股份有限公司
注册地址:上海市淮海中路90号
法定代表人:王开国
电话:021-23219000
传真:021-23219100
联系人:金芸、李笑鸣
(6)代销机构:华宝证券有限责任公司
注册地址:上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心67层
法定代表人:陈林
电话:021-68777222
传真:021-68777822
联系人:刘闻川

(7)代销机构:东吴证券股份有限公司
注册地址:苏州工业园区星阳街5号
法定代表人:吴永敏
电话:0512-65681136
传真:0512-65688021
联系人:方晓丹
(8)代销机构:东兴证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层
法定代表人:徐勇力
电话:010-66555316
传真:010-66555246
联系人:汤漫川
(9)代销机构:山西证券股份有限公司
注册地址:山西省太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼
法定代表人:侯巍
电话:0351-8686659
传真:0351-8686619
联系人:郭朔
(10)代销机构:中国银河证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
法定代表人:陈有安
电话:(010)66568450
传真:(010)66568990
联系人:宋明
(11)代销机构:申万宏源证券有限公司
注册地址:新疆乌鲁木齐高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2005室
法定代表人:许建平
电话:(010)88085858
传真:(010)88085195
联系人:李巍
(12)代销机构:红塔证券股份有限公司
注册地址:云南省昆明市北京路155号附1号红塔大厦9楼
法定代表人:苏雨林
电话:0871-3577398
传真:0871-3576827
联系人:高国泽
(13)代销机构:申万宏源证券有限公司
注册地址:上海市浦东新区东川路500号
法定代表人:李梅
电话:021-33388988
传真:021-33388224
联系人:曹晔
(14)代销机构:齐鲁证券有限公司
注册地址:山东省济南市经十路20518号
法定代表人:李玮
电话:0531-68889155
传真:0531-68889752
联系人:吴阳
(15)代销机构:国泰君安证券股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区商城路618号
法定代表人:万建华
电话:021-38676666
传真:021-38670666
联系人:芮敬祺
(二) 注册登记机构
名称:中国证券登记结算有限责任公司
住所:北京市西城区太平桥大街17号
办公地址:北京市西城区太平桥大街17号
法定代表人:周明
电话:(010)59378805
传真:(010)59378937
联系人:任瑞新
(三) 律师事务所和经办律师
名称:北京市高朋律师事务所
注册地址:北京市朝阳区东三环北路2号南银大厦28层
法定代表人:王磊
电话:(010)59241188
传真:(010)59241199
经办律师:王明涛、李勃
(四) 会计师事务所和经办注册会计师
名称:德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)
注册地址:上海市延安东路222号30楼
法定代表人:曾昭耀
电话:(021)61418888
传真:(021)63350177
经办注册会计师:曾浩、吴凌志
联系人:曾浩

四、基金的投资

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
股票型指数基金
五、基金类型
紧密跟踪标的指数,追求跟踪标的指数和投资误差最小化。
七、投资方向
本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括深证TMT50指数的成份股及其备选成份股、一级市场新发股票(包括主板市场、中小板市场和创业板市场的股票)、债券、权证、货币市场工具及经中国证监会批准的允许本基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许其投资范围的其他品种,基金管理人可在履行适当程序后,将其纳入本基金投资范围。

本基金投资于深证TMT50指数的成份股及其备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%。
八、基金的投资策略
本基金以深证TMT50指数为标的指数,采用完全复制法,即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合,进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整,但在特殊情况下,本基金可以选择其他证券或证券组合对标的指数的股票进行适当替代,这些情况包括但不限于:(1)法律法规的限制;(2)标的指数的成份股流动性严重不足;(3)标的指数的成份股票长期停牌;(4)其他原因导致本基金管理人对该标的指数的跟踪构成严重制约等。

在正常情况下,本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%,年跟踪误差不超过2%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围,基金管理人将采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

(一) 投资组合管理

1. 投资组合的构建
(1) 确定目标组合。主要采取完全复制法,即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合。
(2) 制定建仓策略。基金经理根据标的指数的流动性和交易成本等因素所做的分析,制定合理的建仓策略。
(3) 逐步调整组合。基金经理在规定时间内,采取适当的手段和措施,对实际投资组合进行动态调整,直至达到紧密跟踪标的指数的目标。

2. 日常投资组合管理
(1) 标的指数定期调整
根据标的指数的编制规则及调整公告,本基金在指数成份股调整生效前,分析并确定组合调整策略,及时进行投资组合的优化调整,减少流动性冲击,尽量减少标的指数成份股调整所带来的跟踪偏离度和跟踪误差。
(2) 标的指数成份股票临时调整
在标的指数成份股票调整期间,若出现成份股票临时调整的情形,本基金管理人将密切关注样本股票的调整,并及时制定相应的投资组合调整策略。

(3) 成份股公司行为信息的日常跟踪与分析
跟踪分析标的指数成份股公司行为等信息,如股本变化、分红、配股、增发、停牌、复牌等重大公司信息,分析这些信息对指数的影响,并根据这些信息确定基金投资组合每日交易策略。
(4) 每日申购赎回情况的跟踪与分析
跟踪分析每日基金申购和赎回现金流,结合基金的现金头寸管理,制定交易策略以应对基金的申购赎回。
(5) 投资组合持有证券、现金头寸及流动性分析
跟踪分析每日基金实际投资组合与目标组合的差异及差异产生的原因,并对拟调整的成份股的流动性进行分析。
(6) 投资组合调整

使用数量化分析模型,选择最优调整方案,制定组合交易调整策略;如标的指数成份股调整,成份股公司发生兼并等重大事件,可提请投资决策委员会召开会议,决定基金的操作策略;调整投资组合,达到所追求的目标组合的持仓结构。
(7) 制作管理基金每日申购赎回清单
以T-1日的指数成份股的结构及其权重为基础,并考虑T日将发生的上市公司变动等情况,制作T日基金申购赎回清单并公告。
(8) 跟踪偏离度的监控与管理
每日跟踪基金组合与标的指数表现的偏离度,每月末、季度末定期分析基金的实际组合与标的指数的累计偏离度、跟踪误差变化情况及其原因,并优化跟踪偏离度管理方案。在正常情况下,本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%,年跟踪误差不超过2%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围,基金管理人将采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

(二) 投资决策流程

1. 投资决策依据
(1) 须符合国家有关法律、法规,严格遵守基金合同及公司章程;
(2) 维护基金份额持有人利益作为基金投资的最高准则。
2. 投资决策流程
(1) 投资决策。投资决策委员会会定期不定期召开投资决策委员会会议,对相关重大事项做出决策。基金经理根据投资决策委员会的决议,做出基金投资管理的日常决策。
(2) 组合构建。基金经理采取完全复制法,即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合,并根据标的指数的成份股及其权重的变动而进行相应的调整。在追求跟踪误差和跟踪偏离度最小化的前提下,基金经理可采取适当的方法,提高投资效率,降低交易成本,控制投资风险。
(3) 交易执行。交易部负责基金的具体交易执行,同时履行一线监控的职责。
(4) 组合监控与调整。基金经理在指数编制方法发生变更、指数成份股定期或临时调整、指数成份股出现股本变化、配股等情形、成份股停牌、成份股流动性不足、基金申购赎回出现的现金流量等情况下,对投资组合进行动态监控和调整,密切跟踪标的指数。
(5) 绩效评估。基金经理及风险管理部定期不定期对投资组合各环节的事前及事后风险、操作风险等投资风险进行监控,并对投资风险及绩效做出评估,提供给投资决策委员会、投资总监、基金经理等相关人员。基金经理依据绩效评估报告对投资进行总结或检讨,如果需要,亦对投资组合进行调整。

基金管理人确保基金份额持有人利益的前提下,根据环境的变化和基金实际投资的需要,有权对上述投资程序做出调整,并将调整内容在基金招募说明书及招募说明书更新中予以公告。

九、业绩比较基准:

本基金的业绩比较基准为:深证TMT50指数。
如果指数编制单位变更或停止深证TMT50指数的编制、发布或授权,或深证TMT50指数由其他指数替代,或由于指数编制方法的重大变更等事项导致深证TMT50指数不宜继续作为标的指数,或目标ETF标的指数发生变更,基金管理人认为有必要作相应调整时,本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则,在履行适当程序后变更本基金的标的指数。业绩比较基准和基金名称。其中,若变更更标的指数涉及本基金投资策略或投资策略的实质性变更,则基金管理人应就变更标的指数召开基金份额持有人大会,并报中国证监会备案且在指定媒体公告。若变更更标的指数对基金投资组合和投资策略无实质性影响(包括但不限于指数编制单位变更、指数更名等事项),则无需召开基金份额持有人大会,基金管理人应与基金托管人协商一致后,报中国证监会备案并及时公告。

十、风险收益特征:

本基金属于股票型基金,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,在证券投资基金中属于较高风险、较高收益的投资品种;并且本基金为被动式投资的指数基金,采用完全复制法紧密跟踪深证TMT50指数,具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市值相似的风险收益特征。
十一、投资组合报告:
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管理人—招商基金管理有限公司的董事会及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责任。
本投资组合报告所载数据截至2015年03月31日,来源于《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2015年第1季度报告》。

1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	112,568,270.06	98.63
2	固定收益投资	112,568,270.06	98.63
3	其中:债券	-	-
4	资产支持证券	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
8	银行存款和结算备付金合计	1,661,197.12	1.27
9	其他资产	2,307.27	0.00
9	合计	114,231,774.54	100.00

注:此处的股票投资项可退替代估值增值。
2 报告期末按行业分类的股票投资组合
2.1 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	53,393,063.11	46.07
D	电力、热力、燃气及生产供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	45,056,190.85	39.04
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	5,656,961.50	4.98
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	国防军工、管理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社公业	-	-
R	文化、体育和娱乐业	8,462,046.54	7.44
S	综合	-	-
9	合计	112,568,270.06	98.02

2.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细
本基金本报告期末未持有积极投资的股票。
2.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细
本基金本报告期末未持有债券。
2.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有资产支持证券。
2.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属。
2.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

2.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细
本基金本报告期末未持有股指期货。
2.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债期货投资明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

2.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
2.10 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属。
2.11 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债期货投资明细
本基金本报告期末未持有国债期货。
2.12 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细
本基金本报告期末未持有股指期货。

2.13 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
2.14 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属。
2.15 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债期货投资明细
本基金本报告期末未持有国债期货。
2.16 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细
本基金本报告期末未持有股指期货。

2.17 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
2.18 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属。
2.19 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债期货投资明细
本基金本报告期末未持有国债期货。
2.20 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细
本基金本报告期末未持有股指期货。

2.21 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
2.22 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属。
2.23 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债期货投资明细
本基金本报告期末未持有国债期货。
2.24 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细
本基金本报告期末未持有股指期货。

2.25 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
2.26 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属。
2.27 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债期货投资明细
本基金本报告期末未持有国债期货。
2.28 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细
本基金本报告期末未持有股指期货。

2.29 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
2.30 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属。
2.31 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债期货投资明细
本基金本报告期末未持有国债期货。
2.32 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细
本基金本报告期末未持有股指期货。

2.33 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
2.34 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属。
2.35 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债期货投资明细
本基金本报告期末未持有国债期货。
2.36 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细
本基金本报告期末未持有股指期货。

2.37 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
2.38 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属。
2.39 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债期货投资明细
本基金本报告期末未持有国债期货。
2.40 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细
本基金本报告期末未持有股指期货。

2.41 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
2.42 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属。
2.43 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债期货投资明细
本基金本报告期末未持有国债期货。
2.44 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细
本基金本报告期末未持有股指期货。