

# 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

## 【2015】半年度报告摘要

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》中关于证券从业人员的有关规定。

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,在严格控制投资风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作整体合法合规,无损害基金份额持有人利益的行为。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约定。

4.3 公平交易制度的执行情况  
基金管理人(以下简称“公司”)已建立较完善的研究报告和投资决策流程,确保各投资组合享有公平的投资决策机会。公司已建立较完善的研究报告和投资决策流程,确保各投资组合享有公平的投资决策机会。公司已建立较完善的研究报告和投资决策流程,确保各投资组合享有公平的投资决策机会。公司已建立较完善的研究报告和投资决策流程,确保各投资组合享有公平的投资决策机会。

4.3.2 异常交易行为的专项说明  
公司严格执行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。期间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。期间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。期间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。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析  
报告期内,从国内宏观经济数据来看,经济呈现弱复苏企稳态势,但经济下行压力依然较大,央行仍旧实行宽松的货币政策,保持市场流动性持续宽松。TMT50指数报告期内上涨0.02%,从市场风格来看,报告期内为普涨行情,从行业来看,计算机、轻工制造、纺织服装、传媒、电子等行业板块涨幅居前,建筑材料、采掘、有色金属、银行、非银金融等行业板块涨幅落后。

4.5 报告期内基金业绩比较基准  
截至报告期末,本基金份额净值为2.038元,本报告期份额净值增长率为69.41%,同期业绩比较基准增长率为75.19%,基金净值表现强于业绩比较基准,幅度为5.78%。主要原因是组合日常申赎赎回导致仓位变动带来的业绩偏差。

1. 报告期内宏观经济、证券市场及行业走势的简要回顾  
报告期内美国制造业数据高于预期,订单单指数以及就业分项数据均创去年12月以来最高,美国制造业的复苏已有了明显的回暖迹象。6月ADP就业人数增加量好于市场预期,暗示就业市场进一步改善,预计美国3季度GDP的可能性较大。欧洲方面,欧元区2季度月度失业率PMI与预期持平,创2014年4月以来最高,经济企稳可能性加大,但前期债务违约问题如果不能很好解决,欧元区经济仍存在一定的风险。

2. 报告期内国内宏观经济、证券市场及行业走势的简要回顾  
报告期内国内宏观经济数据来看,经济呈现弱复苏企稳态势,但经济下行压力依然较大,央行仍旧实行宽松的货币政策,保持市场流动性持续宽松。TMT50指数报告期内上涨0.02%,从市场风格来看,报告期内为普涨行情,从行业来看,计算机、轻工制造、纺织服装、传媒、电子等行业板块涨幅居前,建筑材料、采掘、有色金属、银行、非银金融等行业板块涨幅落后。

3. 报告期内国内宏观经济、证券市场及行业走势的简要回顾  
报告期内国内宏观经济数据来看,经济呈现弱复苏企稳态势,但经济下行压力依然较大,央行仍旧实行宽松的货币政策,保持市场流动性持续宽松。TMT50指数报告期内上涨0.02%,从市场风格来看,报告期内为普涨行情,从行业来看,计算机、轻工制造、纺织服装、传媒、电子等行业板块涨幅居前,建筑材料、采掘、有色金属、银行、非银金融等行业板块涨幅落后。

4.6 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明  
报告期内,从国内宏观经济数据来看,经济呈现弱复苏企稳态势,但经济下行压力依然较大,央行仍旧实行宽松的货币政策,保持市场流动性持续宽松。TMT50指数报告期内上涨0.02%,从市场风格来看,报告期内为普涨行情,从行业来看,计算机、轻工制造、纺织服装、传媒、电子等行业板块涨幅居前,建筑材料、采掘、有色金属、银行、非银金融等行业板块涨幅落后。

4.7 报告期内基金业绩比较基准  
截至报告期末,本基金份额净值为2.038元,本报告期份额净值增长率为69.41%,同期业绩比较基准增长率为75.19%,基金净值表现强于业绩比较基准,幅度为5.78%。主要原因是组合日常申赎赎回导致仓位变动带来的业绩偏差。

4.8 报告期内基金投资策略和运作分析  
报告期内,从国内宏观经济数据来看,经济呈现弱复苏企稳态势,但经济下行压力依然较大,央行仍旧实行宽松的货币政策,保持市场流动性持续宽松。TMT50指数报告期内上涨0.02%,从市场风格来看,报告期内为普涨行情,从行业来看,计算机、轻工制造、纺织服装、传媒、电子等行业板块涨幅居前,建筑材料、采掘、有色金属、银行、非银金融等行业板块涨幅落后。

4.9 报告期内基金业绩比较基准  
截至报告期末,本基金份额净值为2.038元,本报告期份额净值增长率为69.41%,同期业绩比较基准增长率为75.19%,基金净值表现强于业绩比较基准,幅度为5.78%。主要原因是组合日常申赎赎回导致仓位变动带来的业绩偏差。

4.10 报告期内基金投资策略和运作分析  
报告期内,从国内宏观经济数据来看,经济呈现弱复苏企稳态势,但经济下行压力依然较大,央行仍旧实行宽松的货币政策,保持市场流动性持续宽松。TMT50指数报告期内上涨0.02%,从市场风格来看,报告期内为普涨行情,从行业来看,计算机、轻工制造、纺织服装、传媒、电子等行业板块涨幅居前,建筑材料、采掘、有色金属、银行、非银金融等行业板块涨幅落后。

4.11 报告期内基金业绩比较基准  
截至报告期末,本基金份额净值为2.038元,本报告期份额净值增长率为69.41%,同期业绩比较基准增长率为75.19%,基金净值表现强于业绩比较基准,幅度为5.78%。主要原因是组合日常申赎赎回导致仓位变动带来的业绩偏差。

4.12 报告期内基金投资策略和运作分析  
报告期内,从国内宏观经济数据来看,经济呈现弱复苏企稳态势,但经济下行压力依然较大,央行仍旧实行宽松的货币政策,保持市场流动性持续宽松。TMT50指数报告期内上涨0.02%,从市场风格来看,报告期内为普涨行情,从行业来看,计算机、轻工制造、纺织服装、传媒、电子等行业板块涨幅居前,建筑材料、采掘、有色金属、银行、非银金融等行业板块涨幅落后。

4.13 报告期内基金业绩比较基准  
截至报告期末,本基金份额净值为2.038元,本报告期份额净值增长率为69.41%,同期业绩比较基准增长率为75.19%,基金净值表现强于业绩比较基准,幅度为5.78%。主要原因是组合日常申赎赎回导致仓位变动带来的业绩偏差。

4.14 报告期内基金投资策略和运作分析  
报告期内,从国内宏观经济数据来看,经济呈现弱复苏企稳态势,但经济下行压力依然较大,央行仍旧实行宽松的货币政策,保持市场流动性持续宽松。TMT50指数报告期内上涨0.02%,从市场风格来看,报告期内为普涨行情,从行业来看,计算机、轻工制造、纺织服装、传媒、电子等行业板块涨幅居前,建筑材料、采掘、有色金属、银行、非银金融等行业板块涨幅落后。

4.15 报告期内基金业绩比较基准  
截至报告期末,本基金份额净值为2.038元,本报告期份额净值增长率为69.41%,同期业绩比较基准增长率为75.19%,基金净值表现强于业绩比较基准,幅度为5.78%。主要原因是组合日常申赎赎回导致仓位变动带来的业绩偏差。

4.16 报告期内基金投资策略和运作分析  
报告期内,从国内宏观经济数据来看,经济呈现弱复苏企稳态势,但经济下行压力依然较大,央行仍旧实行宽松的货币政策,保持市场流动性持续宽松。TMT50指数报告期内上涨0.02%,从市场风格来看,报告期内为普涨行情,从行业来看,计算机、轻工制造、纺织服装、传媒、电子等行业板块涨幅居前,建筑材料、采掘、有色金属、银行、非银金融等行业板块涨幅落后。

4.17 报告期内基金业绩比较基准  
截至报告期末,本基金份额净值为2.038元,本报告期份额净值增长率为69.41%,同期业绩比较基准增长率为75.19%,基金净值表现强于业绩比较基准,幅度为5.78%。主要原因是组合日常申赎赎回导致仓位变动带来的业绩偏差。

4.18 报告期内基金投资策略和运作分析  
报告期内,从国内宏观经济数据来看,经济呈现弱复苏企稳态势,但经济下行压力依然较大,央行仍旧实行宽松的货币政策,保持市场流动性持续宽松。TMT50指数报告期内上涨0.02%,从市场风格来看,报告期内为普涨行情,从行业来看,计算机、轻工制造、纺织服装、传媒、电子等行业板块涨幅居前,建筑材料、采掘、有色金属、银行、非银金融等行业板块涨幅落后。

4.19 报告期内基金业绩比较基准  
截至报告期末,本基金份额净值为2.038元,本报告期份额净值增长率为69.41%,同期业绩比较基准增长率为75.19%,基金净值表现强于业绩比较基准,幅度为5.78%。主要原因是组合日常申赎赎回导致仓位变动带来的业绩偏差。

4.20 报告期内基金投资策略和运作分析  
报告期内,从国内宏观经济数据来看,经济呈现弱复苏企稳态势,但经济下行压力依然较大,央行仍旧实行宽松的货币政策,保持市场流动性持续宽松。TMT50指数报告期内上涨0.02%,从市场风格来看,报告期内为普涨行情,从行业来看,计算机、轻工制造、纺织服装、传媒、电子等行业板块涨幅居前,建筑材料、采掘、有色金属、银行、非银金融等行业板块涨幅落后。

4.21 报告期内基金业绩比较基准  
截至报告期末,本基金份额净值为2.038元,本报告期份额净值增长率为69.41%,同期业绩比较基准增长率为75.19%,基金净值表现强于业绩比较基准,幅度为5.78%。主要原因是组合日常申赎赎回导致仓位变动带来的业绩偏差。

4.22 报告期内基金投资策略和运作分析  
报告期内,从国内宏观经济数据来看,经济呈现弱复苏企稳态势,但经济下行压力依然较大,央行仍旧实行宽松的货币政策,保持市场流动性持续宽松。TMT50指数报告期内上涨0.02%,从市场风格来看,报告期内为普涨行情,从行业来看,计算机、轻工制造、纺织服装、传媒、电子等行业板块涨幅居前,建筑材料、采掘、有色金属、银行、非银金融等行业板块涨幅落后。

4.23 报告期内基金业绩比较基准  
截至报告期末,本基金份额净值为2.038元,本报告期份额净值增长率为69.41%,同期业绩比较基准增长率为75.19%,基金净值表现强于业绩比较基准,幅度为5.78%。主要原因是组合日常申赎赎回导致仓位变动带来的业绩偏差。

4.24 报告期内基金投资策略和运作分析  
报告期内,从国内宏观经济数据来看,经济呈现弱复苏企稳态势,但经济下行压力依然较大,央行仍旧实行宽松的货币政策,保持市场流动性持续宽松。TMT50指数报告期内上涨0.02%,从市场风格来看,报告期内为普涨行情,从行业来看,计算机、轻工制造、纺织服装、传媒、电子等行业板块涨幅居前,建筑材料、采掘、有色金属、银行、非银金融等行业板块涨幅落后。

4.25 报告期内基金业绩比较基准  
截至报告期末,本基金份额净值为2.038元,本报告期份额净值增长率为69.41%,同期业绩比较基准增长率为75.19%,基金净值表现强于业绩比较基准,幅度为5.78%。主要原因是组合日常申赎赎回导致仓位变动带来的业绩偏差。

4.26 报告期内基金投资策略和运作分析  
报告期内,从国内宏观经济数据来看,经济呈现弱复苏企稳态势,但经济下行压力依然较大,央行仍旧实行宽松的货币政策,保持市场流动性持续宽松。TMT50指数报告期内上涨0.02%,从市场风格来看,报告期内为普涨行情,从行业来看,计算机、轻工制造、纺织服装、传媒、电子等行业板块涨幅居前,建筑材料、采掘、有色金属、银行、非银金融等行业板块涨幅落后。

4.27 报告期内基金业绩比较基准  
截至报告期末,本基金份额净值为2.038元,本报告期份额净值增长率为69.41%,同期业绩比较基准增长率为75.19%,基金净值表现强于业绩比较基准,幅度为5.78%。主要原因是组合日常申赎赎回导致仓位变动带来的业绩偏差。

4.28 报告期内基金投资策略和运作分析  
报告期内,从国内宏观经济数据来看,经济呈现弱复苏企稳态势,但经济下行压力依然较大,央行仍旧实行宽松的货币政策,保持市场流动性持续宽松。TMT50指数报告期内上涨0.02%,从市场风格来看,报告期内为普涨行情,从行业来看,计算机、轻工制造、纺织服装、传媒、电子等行业板块涨幅居前,建筑材料、采掘、有色金属、银行、非银金融等行业板块涨幅落后。

4.29 报告期内基金业绩比较基准  
截至报告期末,本基金份额净值为2.038元,本报告期份额净值增长率为69.41%,同期业绩比较基准增长率为75.19%,基金净值表现强于业绩比较基准,幅度为5.78%。主要原因是组合日常申赎赎回导致仓位变动带来的业绩偏差。

4.30 报告期内基金投资策略和运作分析  
报告期内,从国内宏观经济数据来看,经济呈现弱复苏企稳态势,但经济下行压力依然较大,央行仍旧实行宽松的货币政策,保持市场流动性持续宽松。TMT50指数报告期内上涨0.02%,从市场风格来看,报告期内为普涨行情,从行业来看,计算机、轻工制造、纺织服装、传媒、电子等行业板块涨幅居前,建筑材料、采掘、有色金属、银行、非银金融等行业板块涨幅落后。

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读刊登于招商基金管理有限公司网站http://www.cmfn.com.cn上的年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动  
7.4.8 买入卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值       | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|-------|------------|--------------|
| 1  | 000859 | 中兴通讯 | 8,500 | 200,346.00 | 0.17         |
| 2  | 300104 | 乐视网  | 2,800 | 144,920.00 | 0.12         |
| 3  | 000917 | 广电传媒 | 4,000 | 123,200.00 | 0.10         |
| 4  | 002016 | 东方明珠 | 6,400 | 108,336.00 | 0.09         |
| 5  | 002446 | 盛润控股 | 2,200 | 74,220.00  | 0.06         |
| 6  | 002226 | 大亚股份 | 1,800 | 57,460.00  | 0.05         |
| 7  | 300059 | 东方财富 | 800   | 50,472.00  | 0.04         |
| 8  | 300051 | 光线传媒 | 1,600 | 38,800.00  | 0.03         |
| 9  | 000503 | 海航控股 | 700   | 34,300.00  | 0.03         |
| 10 | 000793 | 华闻控股 | 2,000 | 33,760.00  | 0.03         |

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读刊登于招商基金管理有限公司网站http://www.cmfn.com.cn上的年度报告正文。

7.4.8 买入卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量(股)        | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|--------------|------|--------------|
| 1  | 000063 | 中兴通讯 | 2,966,840.00 | 4.34 |              |
| 2  | 300059 | 东方财富 | 2,740,460.00 | 4.04 |              |
| 3  | 000725 | 东方明珠 | 1,966,963.41 | 2.82 |              |
| 4  | 002446 | 盛润控股 | 2,491,247.20 | 3.64 |              |
| 5  | 300104 | 乐视网  | 2,133,000.00 | 3.12 |              |
| 6  | 002226 | 科大讯飞 | 1,985,726.00 | 2.91 |              |
| 7  | 300027 | 华闻控股 | 1,817,020.00 | 2.69 |              |
| 8  | 000917 | 广电传媒 | 1,708,532.00 | 2.50 |              |
| 9  | 300168 | 万达信息 | 1,616,060.00 | 2.37 |              |
| 10 | 000263 | 东软软件 | 1,506,997.28 | 2.20 |              |
| 11 | 002045 | 东华软件 | 1,575,049.00 | 2.34 |              |
| 12 | 002241 | 歌华有线 | 1,428,688.00 | 2.13 |              |
| 13 | 002045 | 东华软件 | 1,298,241.88 | 1.90 |              |
| 14 | 002226 | 科大讯飞 | 1,209,460.00 | 1.79 |              |
| 15 | 300002 | 神州泰丰 | 1,166,200.00 | 1.69 |              |
| 16 | 000070 | 中国卫宁 | 1,150,115.00 | 1.68 |              |
| 17 | 300068 | 蓝色光标 | 1,131,019.00 | 1.66 |              |
| 18 | 000029 | 中国国贸 | 1,120,465.00 | 1.64 |              |
| 19 | 002028 | 思源电气 | 1,110,280.00 | 1.64 |              |
| 20 | 002446 | 盛润控股 | 1,119,269.00 | 1.64 |              |

注:1、买入包括基金二级市场主动买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票,不包括因本基金申购赎回导致的基金组合中股票的比例变动。  
2、“累计买入金额”按买入成交金额(成交单乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。  
7.4.9 卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量(股)        | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|--------------|------|--------------|
| 1  | 000725 | 东方明珠 | 2,855,079.20 | 4.18 |              |
| 2  | 000416 | 海康威视 | 2,837,674.26 | 4.16 |              |
| 3  | 000063 | 中兴通讯 | 2,794,304.00 | 4.05 |              |
| 4  | 300059 | 东方财富 | 2,629,534.00 | 3.85 |              |
| 5  | 300104 | 乐视网  | 2,068,471.00 | 3.02 |              |
| 6  | 300027 | 华闻控股 | 1,910,111.89 | 2.79 |              |
| 7  | 300015 | 神州泰丰 | 1,866,963.41 | 2.72 |              |
| 8  | 300168 | 万达信息 | 1,676,669.00 | 2.49 |              |
| 9  | 002446 | 盛润控股 | 1,638,026.21 | 2.39 |              |
| 10 | 002241 | 歌华有线 | 1,566,626.00 | 2.28 |              |
| 11 | 002045 | 东华软件 | 1,543,040.00 | 2.24 |              |
| 12 | 002230 | 科大讯飞 | 1,530,171.00 | 2.20 |              |
| 13 | 000603 | 海航控股 | 1,512,361.00 | 2.19 |              |
| 14 | 300058 | 蓝色光标 | 1,315,065.00 | 1.92 |              |
| 15 | 000070 | 中国卫宁 | 1,156,346.00 | 1.69 |              |
| 16 | 002008 | 大秦铁路 | 1,116,754.20 | 1.63 |              |
| 17 | 000157 | 中联重科 | 1,096,216.00 | 1.60 |              |
| 18 | 002226 | 科大讯飞 | 1,080,162.00 | 1.58 |              |
| 19 | 300017 | 网宿科技 | 1,064,662.00 | 1.54 |              |
| 20 | 003410 | 广联达  | 1,046,700.00 | 1.53 |              |

注:1、卖出包括基金二级市场主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等获得的股票,不包括因本基金申购赎回导致的基金组合中股票的比例变动。  
2、“累计卖出金额”按卖出成交金额(成交单乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。  
7.4.10 买入返售的成交总额及卖出股票的成交总额

2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号文《关于股息红利个人所得税政策的通知》、财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税51107号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008年9月18日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印

注:1、买入包括基金二级市场主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票,卖出包括基金二级市场主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等获得的股票,不包括因本基金申购赎回导致的基金组合中股票的比例变动。  
2、“累计买入金额”按买入成交金额(成交单乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。  
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细  
本基金本报告期末持有债券:  
7.7 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。  
7.8 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。  
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细  
本基金本报告期末未持有基金。

| 序号 | 基金名称         | 基金类型 | 运作方式        | 管理人        | 公允价值           | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------------|------|-------------|------------|----------------|--------------|
| 1  | 招商深证TMT50ETF | 股票型  | 交易型开放式(ETF) | 招商基金管理有限公司 | 111,619,697.96 | 93.92        |

7.11 报告期末本基金投资的股指期货投资情况说明  
7.11.8 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细  
本基金本报告期末未持有股指期货合约。  
7.11.9 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明  
根据本基金合同规定,本基金不参与国债期货交易。  
7.12 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细  
根据本基金合同规定,本基金不参与国债期货交易。  
7.12.9 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细  
根据本基金合同规定,本基金不参与国债期货交易。  
7.13 投资组合报告附注

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未有被监管部门立案调查,不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。  
7.13.9 本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的备选股票库,本基金管理人已制度和流程上要求股票必须列入库内。  
7.13.10 期末其他各项资产构成

| 序号 | 基金名称         | 基金类型 | 运作方式        | 管理人        | 公允价值           | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------------|------|-------------|------------|----------------|--------------|
| 1  | 招商深证TMT50ETF | 股票型  | 交易型开放式(ETF) | 招商基金管理有限公司 | 111,619,697.96 | 93.92        |

7.11 报告期末本基金投资的股指期货投资情况说明  
7.11.8 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细  
本基金本报告期末未持有股指期货合约。  
7.11.9 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明  
根据本基金合同规定,本基金不参与国债期货交易。  
7.12 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细  
根据本基金合同规定,本基金不参与国债期货交易。  
7.12.9 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细  
根据本基金合同规定,本基金不参与国债期货交易。  
7.13 投资组合报告附注

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未有被监管部门立案调查,不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。  
7.13.9 本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的备选股票库,本基金管理人已制度和流程上要求股票必须列入库内。  
7.13.10 期末其他各项资产构成

| 序号 | 基金名称         | 基金类型 | 运作方式        | 管理人        | 公允价值           | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------------|------|-------------|------------|----------------|--------------|
| 1  | 招商深证TMT50ETF | 股票型  | 交易型开放式(ETF) | 招商基金管理有限公司 | 111,619,697.96 | 93.92        |

7.11 报告期末本基金投资的股指期货投资情况说明  
7.11.8 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细  
本基金本报告期末未持有股指期货合约。  
7.11.9 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明  
根据本基金合同规定,本基金不参与国债期货交易。  
7.12 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细  
根据本基金合同规定,本基金不参与国债期货交易。  
7.12.9 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细  
根据本基金合同规定,本基金不参与国债期货交易。  
7.13 投资组合报告附注

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未有被监管部门立案调查,不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。  
7.13.9 本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的备选股票库,本基金管理人已制度和流程上要求股票必须列入库内。  
7.13.10 期末其他各项资产构成

| 序号 | 基金名称         | 基金类型 | 运作方式        | 管理人        | 公允价值           | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------------|------|-------------|------------|----------------|--------------|
| 1  | 招商深证TMT50ETF | 股票型  | 交易型开放式(ETF) | 招商基金管理有限公司 | 111,619,697.96 | 93.92        |

7.11 报告期末本基金投资的股指期货投资情况说明  
7.11.8 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细  
本基金本报告期末未持有股指期货合约。  
7.11.9 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明  
根据本基金合同规定,本基金不参与国债期货交易。  
7.12 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细  
根据本基金合同规定,本基金不参与国债期货交易。  
7.12.9 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细  
根据本基金合同规定,本基金不参与国债期货交易。  
7.13 投资组合报告附注

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未有被监管部门立案调查,不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。  
7.13.9 本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的备选股票库,本基金管理人已制度和流程上要求股票必须列入库内。  
7.13.10 期末其他各项资产构成

| 序号 | 基金名称         | 基金类型 | 运作方式        | 管理人        | 公允价值           | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------------|------|-------------|------------|----------------|--------------|
| 1  | 招商深证TMT50ETF | 股票型  | 交易型开放式(ETF) | 招商基金管理有限公司 | 111,619,697.96 | 93.92        |

7.11 报告期末本基金投资的股指期货投资情况说明  
7.11.8 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细  
本基金本报告期末未持有股指期货合约。  
7.11.9 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明  
根据本基金合同规定,本基金不参与国债期货交易。  
7.12 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细  
根据本基金合同规定,本基金不参与国债期货交易。  
7.12.9 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细  
根据本基金合同规定,本基金不参与国债期货交易。  
7.13 投资组合报告附注

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未有被监管部门立案调查,不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。  
7.13.9 本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的备选股票库,本基金管理人已制度和流程上要求股票必须列入库内。  
7.13.10 期末其他各项资产构成

| 序号 | 基金名称         | 基金类型 | 运作方式        | 管理人        | 公允价值           | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------------|------|-------------|------------|----------------|--------------|
| 1  | 招商深证TMT50ETF | 股票型  | 交易型开放式(ETF) | 招商基金管理有限公司 | 111,619,697.96 | 93.92        |

7.11 报告期末本基金投资的股指期货投资情况说明  
7.11.8 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细  
本基金本报告期末未持有股指期货合约。  
7.11.9 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明  
根据本基金合同规定,本基金不参与国债期货交易。  
7.12 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细  
根据本基金合同规定,本基金不参与国债期货交易。  
7.12.9 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细  
根据本基金合同规定,本基金不参与国债期货交易。  
7.13 投资组合报告附注

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未有被监管部门立案调查,不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。  
7.13.9 本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的备选股票库,本基金管理人已制度和流程上要求股票必须列入库内。  
7.13.10 期末其他各项资产构成

| 序号 | 基金名称         | 基金类型 | 运作方式        | 管理人        | 公允价值           | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------------|------|-------------|------------|----------------|--------------|
| 1  | 招商深证TMT50ETF | 股票型  | 交易型开放式(ETF) | 招商基金管理有限公司 | 111,619,697.96 | 93.92        |

7.11 报告期末本基金投资的股指期货投资情况说明  
7.11.8 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细  
本基金本报告期末未持有股指期货合约。  
7.11.9 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明  
根据本基金合同规定,本基金不参与国债期货交易。  
7.12 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细  
根据本基金合同规定,本基金不参与国债期货交易。  
7.12.9 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细  
根据本基金合同规定,本基金不参与国债期货交易。  
7.13 投资组合报告附注

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未有被监管部门立案调查,不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。  
7.13.9 本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的备选股票库,本基金管理人已制度和流程上要求股票必须列入库内。  
7.13.10 期末其他各项资产构成

| 序号 | 基金名称         | 基金类型 | 运作方式        | 管理人        | 公允价值           | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------------|------|-------------|------------|----------------|--------------|
| 1  | 招商深证TMT50ETF | 股票型  | 交易型开放式(ETF) | 招商基金管理有限公司 | 111,619,697.96 | 93.92        |

7.11 报告期末本基金投资的股指期货