

上证消费80交易型开放式指数证券投资基金

【2016】第四季度报告

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
报告送出日期:2017年1月20日

§1 重要提示
基金管理人、基金托管人及基金销售机构在本报告期内不存在虚假记载、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法律责任。

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2017年1月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。投资者有风险,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。

本报告期内无基金份额持有人大会议案。
本报告期内无基金份额持有人大会议案。
本报告期内无基金份额持有人大会议案。

基金名称	招商上证消费80ETF(场内简称:消费ETF)
基金代码	510150
交易代码	510150
基金运作方式	交易型开放式(ETF)
基金合同生效日	2010年12月29日
报告期末基金份额总额	29,931,560.05份
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。
业绩比较基准	上证消费80指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金,预期风险和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,跟踪误差较大的投资品种,并且本基金为被动式指数投资证券投资基金,采用完全复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数以及标的指数所代表的股票证券市场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	中国工商银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期(2016年10月1日 - 2016年12月31日)
1.本期已实现收益	-2,406,610.02
2.本期利润	3,683,668.18
3.加权平均基金份额本期利润	0.1176
4.期末基金资产净值	115,901,144.39
5.期末基金份额净值	3.972

注:1.上述基金业绩指标不包括持有人认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上述所列数字;
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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	2.08%	0.68%	3.35%	0.69%	-0.37%	-0.01%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限	证券从业年限	说明
王平	本基金的基金经理	2010年12月28日	-	11
罗敏	本基金的基金经理	2013年1月19日	-	9

注:1.本基金基金经理的任职日期为本基金合同生效日,后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告(生效)日期;
2.证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定;
3.报告截止日至批准送出日期间,自2017年1月13日起王平先生离任本基金的基金经理;
4.报告截止日至批准送出日期间,自2017年1月13日起王平先生担任本基金的基金经理;
4.2 管理人对于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》等相关法律法规及各项监管规定,恪尽职守,勤勉尽责,不存在违法违规、损害基金份额持有人利益的行为。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》等相关法律法规及各项监管规定,恪尽职守,勤勉尽责,不存在违法违规、损害基金份额持有人利益的行为。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》等相关法律法规及各项监管规定,恪尽职守,勤勉尽责,不存在违法违规、损害基金份额持有人利益的行为。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	114,418,583.00	98.30
2	其中:股票	114,418,583.00	98.30
3	固定收益投资	-	-
4	其中:债券	-	-
5	资产支持证券	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其他投资	-	-
9	合计	114,418,583.00	100.00

注:此处的股票投资项下包含替代默认估值增值。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔业	798,127.44	0.64
B	采矿业	-	-
C	制造业	86,197,968.56	74.27
D	电力、热力、燃气及生产和服务供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	11,311,823.64	9.76
H	住宿和餐饮业	391,819.00	0.34
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,981,238.42	4.21
J	金融业	-	-
K	房地产业	3,024,303.78	2.61
L	租赁和商务服务业	2,771,062.70	2.39
M	科学研究和技术服务业	707,600.40	0.61
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	166,517.00	0.14
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	4,229,082.86	3.69
S	其他	-	-
合计	合计	114,418,583.00	98.72

本基金本报告期末未持有科创板股票。

5.3 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股票投资明细

5.3.1 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股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	36,713	12,287,698.98	10.58
2	600887	伊府股份	942,088	8,947,279.68	7.73
3	600104	上汽集团	274,203	6,434,515.85	5.56
4	600276	恒瑞医药	116,940	5,300,770.00	4.59
5	600618	康美药业	246,420	4,389,507.00	3.80
6	600037	东方明珠	108,195	2,539,360.50	2.19
7	600890	南方海科	263,150	2,501,122.00	2.16
8	600535	天士力	63,885	2,235,698.65	1.93
9	600066	宇通客车	110,255	2,159,495.45	1.86
10	600090	宁德时代	114,100	2,125,683.00	1.83

5.4 管理人报告

5.4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限	证券从业年限	说明
王平	本基金的基金经理	2010年12月28日	-	11
罗敏	本基金的基金经理	2013年1月19日	-	9

注:1.本基金基金经理的任职日期为本基金合同生效日,后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告(生效)日期;
2.证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定;
3.报告截止日至批准送出日期间,自2017年1月13日起王平先生离任本基金的基金经理;
4.报告截止日至批准送出日期间,自2017年1月13日起王平先生担任本基金的基金经理;
4.2 管理人对于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》等相关法律法规及各项监管规定,恪尽职守,勤勉尽责,不存在违法违规、损害基金份额持有人利益的行为。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》等相关法律法规及各项监管规定,恪尽职守,勤勉尽责,不存在违法违规、损害基金份额持有人利益的行为。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》等相关法律法规及各项监管规定,恪尽职守,勤勉尽责,不存在违法违规、损害基金份额持有人利益的行为。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	114,418,583.00	98.30
2	其中:股票	114,418,583.00	98.30
3	固定收益投资	-	-
4	其中:债券	-	-
5	资产支持证券	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其他投资	-	-
9	合计	114,418,583.00	100.00

注:此处的股票投资项下包含替代默认估值增值。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔业	798,127.44	0.64
B	采矿业	-	-
C	制造业	86,197,968.56	74.27
D	电力、热力、燃气及生产和服务供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	11,311,823.64	9.76
H	住宿和餐饮业	391,819.00	0.34
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,981,238.42	4.21
J	金融业	-	-
K	房地产业	3,024,303.78	2.61
L	租赁和商务服务业	2,771,062.70	2.39
M	科学研究和技术服务业	707,600.40	0.61
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	166,517.00	0.14
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	4,229,082.86	3.69
S	其他	-	-
合计	合计	114,418,583.00	98.72

本基金本报告期末未持有科创板股票。

5.3 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股票投资明细

5.3.1 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股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	36,713	12,287,698.98	10.58
2	600887	伊府股份	942,088	8,947,279.68	7.73
3	600104	上汽集团	274,203	6,434,515.85	5.56
4	600276	恒瑞医药	116,940	5,300,770.00	4.59
5	600618	康美药业	246,420	4,389,507.00	3.80
6	600037	东方明珠	108,195	2,539,360.50	2.19
7	600890	南方海科	263,150	2,501,122.00	2.16
8	600535	天士力	63,885	2,235,698.65	1.93
9	600066	宇通客车	110,255	2,159,495.45	1.86
10	600090	宁德时代	114,100	2,125,683.00	1.83

5.4 管理人报告

5.4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限	证券从业年限	说明
王平	本基金的基金经理	2010年12月28日	-	11
罗敏	本基金的基金经理	2013年1月19日	-	9

注:1.本基金基金经理的任职日期为本基金合同生效日,后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告(生效)日期;
2.证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定;
3.报告截止日至批准送出日期间,自2017年1月13日起王平先生离任本基金的基金经理;
4.报告截止日至批准送出日期间,自2017年1月13日起王平先生担任本基金的基金经理;
4.2 管理人对于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》等相关法律法规及各项监管规定,恪尽职守,勤勉尽责,不存在违法违规、损害基金份额持有人利益的行为。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》等相关法律法规及各项监管规定,恪尽职守,勤勉尽责,不存在违法违规、损害基金份额持有人利益的行为。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》等相关法律法规及各项监管规定,恪尽职守,勤勉尽责,不存在违法违规、损害基金份额持有人利益的行为。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	114,418,583.00	98.30
2	其中:股票	114,418,583.00	98.30
3	固定收益投资	-	-
4	其中:债券	-	-
5	资产支持证券	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其他投资	-	-
9	合计	114,418,583.00	100.00

注:此处的股票投资项下包含替代默认估值增值。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔业	798,127.44	0.64
B	采矿业	-	-
C	制造业	86,197,968.56	74.27
D	电力、热力、燃气及生产和服务供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	11,311,823.64	9.76
H	住宿和餐饮业	391,819.00	0.34
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,981,238.42	4.21
J	金融业	-	-
K	房地产业	3,024,303.78	2.61
L	租赁和商务服务业	2,771,062.70	2.39
M	科学研究和技术服务业	707,600.40	0.61
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	166,517.00	0.14
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	4,229,082.86	3.69
S	其他	-	-
合计	合计	114,418,583.00	98.72

本基金本报告期末未持有科创板股票。

5.3 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股票投资明细

5.3.1 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股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	36,713	12,287,698.98	10.58
2	600887	伊府股份	942,088	8,947,279.68	7.73
3	600104	上汽集团	274,203	6,434,515.85	5.56
4	600276	恒瑞医药	116,940	5,300,770.00	4.59
5	600618	康美药业	246,420	4,389,507.00	3.80
6	600037	东方明珠	108,195	2,539,360.50	2.19
7	600890	南方海科	263,150	2,501,122.00	2.16
8	600535	天士力	63,885	2,235,698.65	1.93
9	600066	宇通客车	110,255	2,159,495.45	1.86
10	600090	宁德时代	114,100	2,125,683.00	1.83

5.4 管理人报告

5.4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限	证券从业年限	说明
王平	本基金的基金经理	2010年12月28日	-	11
罗敏	本基金的基金经理	2013年1月19日	-	9

注:1.本基金基金经理的任职日期为本基金合同生效日,后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告(生效)日期;
2.证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定;
3.报告截止日至批准送出日期间,自2017年1月13日起王平先生离任本基金的基金经理;
4.报告截止日至批准送出日期间,自2017年1月13日起王平先生担任本基金的基金经理;
4.2 管理人对于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》等相关法律法规及各项监管规定,恪尽职守,勤勉尽责,不存在违法违规、损害基金份额持有人利益的行为。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》等相关法律法规及各项监管规定,恪尽职守,勤勉尽责,不存在违法违规、损害基金份额持有人利益的行为。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》等相关法律法规及各项监管规定,恪尽职守,勤勉尽责,不存在违法违规、损害基金份额持有人利益的行为。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	114,418,583.00	98.30
2	其中:股票	114,418,583.00	98.30
3	固定收益投资	-	-
4	其中:债券	-	-
5	资产支持证券	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其他投资	-	-
9	合计	114,418,583.00	100.00

注:此处的股票投资项下包含替代默认估值增值。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

######