

信息披露 Disclosure

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、完整性、充分性和及时性承担个别及连带责任。
本基金托管人根据法律法规规定，对本报告的内容进行复核，确认不存在虚假记载、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基金的招募说明书。

基金定期报告在披露后应及时报告给中国证监会和地方证监局。

本报告期未发生巨额赎回。

§ 2 基金产品概况

序号	项目	金额(元)	占基金资产的比例(%)
1	股权投资	114,418,583.00	98.39
2	基金投资	-	0.00
3	固定收益投资	-	0.00
4	商品类投资	-	0.00
5	金融衍生品投资	-	0.00
6	买入返售金融资产	-	0.00
7	银行存款和结算备付金合计	1,876,293.34	1.61
8	其他资产	1,234.13	0.00
9	合计	116,296,103.37	100.00

注：此处的股权投资项不含退银代款估值增值。

§ 3 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	738,177.44	0.64
B	采矿业	-	0.00
C	制造业	98,107,958.56	74.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	0.00
E	建筑业	-	0.00
F	批发和零售业	11,311,833.84	9.76
G	交通运输、仓储和邮政业	-	0.00
H	住宿和餐饮业	391,818.00	0.34
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,881,238.42	4.21
J	金融行业	-	0.00
K	房地产业	3,054,303.75	2.61
L	租赁和商务服务业	2,771,052.70	2.30
M	科学研究、技术服务及地质勘查业	707,600.40	0.61
N	水利、环境和公共设施管理业	-	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	0.00
P	教育	166,517.00	0.14
Q	卫生和社会工作	-	0.00
R	文化、体育和娱乐业	4,229,082.96	3.65
S	综合	-	0.00
合计		114,418,583.00	98.37

注：此处的股权投资项不含退银代款估值增值。

§ 4.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	农、林、牧、渔业	738,177.44	0.64
2	采矿业	-	0.00
3	制造业	98,107,958.56	74.37
4	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	0.00
5	建筑业	-	0.00
6	批发和零售业	11,311,833.84	9.76
7	交通运输、仓储和邮政业	-	0.00
8	住宿和餐饮业	391,818.00	0.34
9	信息传输、软件和信息技术服务业	4,881,238.42	4.21
10	金融行业	-	0.00
11	房地产业	-	0.00
12	租赁和商务服务业	-	0.00
13	科学研究、技术服务及地质勘查业	-	0.00
14	水利、环境和公共设施管理业	-	0.00
15	居民服务、修理和其他服务业	-	0.00
16	教育	166,517.00	0.14
17	卫生和社会工作	-	0.00
18	文化、体育和娱乐业	4,229,082.96	3.65
19	综合	-	0.00
合计		114,418,583.00	98.37

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所列示的数字；

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

阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差
过去三个月	2.98%	0.01%	3.36%	0.00%

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所列示的数字；

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。

3.2.2 基金本期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	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差
过去三个月	2.98%	0.01%	3.36%	0.00%

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所列示的数字；

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。

3.2.3 基金净值表现

阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差
过去三个月	2.98%	0.01%	3.36%	0.00%

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所列示的数字；

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。

3.2.4 基金本期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	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差
过去三个月	2.98%	0.01%	3.36%	0.00%

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所列示的数字；

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。

3.2.5 基金净值表现

阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差
过去三个月	2.98%	0.01%	3.36%	0.00%

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所列示的数字；

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。

3.2.6 基金净值表现

阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差
过去三个月	2.98%	0.01%	3.36%	0.00%

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所列示的数字；

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。

3.2.7 基金净值表现

阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差
过去三个月	2.98%	0.01%	3.36%	0.00%

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所列示的数字；

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。

3.2.8 基金净值表现

阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差
过去三个月	2.98%	0.01%	3.36%	0.00%

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所列示的数字；

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。

3.2.9 基金净值表现

阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差
过去三个月	2.98%	0.01%	3	