

招商深证 100 指数证券投资基金 2014 年半年度报告

2014 年 6 月 30 日

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

送出日期：2014 年 8 月 27 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2014 年 8 月 20 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2014 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§ 2 基金简介	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	15
§ 7 投资组合报告	29
7.1 期末基金资产组合情况.....	29
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	29
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	30
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	33
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	35
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.....	35
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	35
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.....	35
7.9 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.....	35
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	35
7.11 投资组合报告附注.....	35
§ 8 基金份额持有人信息	36
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	36

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	36
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	36
§ 9 开放式基金份额变动.....	37
§ 10 重大事件揭示.....	37
10.1 基金份额持有人大会决议	37
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	37
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	37
10.4 基金投资策略的改变	37
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	38
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	38
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	38
10.8 其他重大事件	39
§ 11 备查文件目录.....	40
11.1 备查文件目录	40
11.2 存放地点	41
11.3 查阅方式	41

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	招商深证 100 指数证券投资基金
基金简称	招商深证 100 指数
基金主代码	217016
交易代码	217016
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010 年 6 月 22 日
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
报告期末基金份额总额	118,813,488.51 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段,实现对标的指数的有效跟踪,获得与标的指数收益相似的回报。本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%,年跟踪误差不超过 4%。
投资策略	本基金原则上采取完全复制法构建股票指数组合,即按照深证 100 指数成份股及权重构建指数投资组合,并根据指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。
业绩比较基准	深证 100 指数收益率×95%+商业银行活期存款利率(税后)×5%。
风险收益特征	本基金属于股票型指数基金,在证券投资基金中属于较高风险、较高收益的品种,本基金主要采用指数复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		招商基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	欧志明	赵会军
	联系电话	0755-83196666	010-66105799
	电子邮箱	cmf@cmfchina.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-887-9555	95588
传真		0755-83196475	010-66105798
注册地址		中国深圳深南大道 7088 号 招商银行大厦	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		中国深圳深南大道 7088 号 招商银行大厦	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		518040	100140
法定代表人		张光华	姜建清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.cmfchina.com
基金半年度报告备置地点	(1)招商基金管理有限公司 地址：中国深圳深南大道 7088 号招商银行大厦 (2)中国工商银行股份有限公司 地址：中国北京市西城区复兴门内大街 55 号

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	招商基金管理有限公司	中国深圳深南大道 7088 号招商银行大厦

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2014 年 1 月 1 日 - 2014 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-1,259,394.20
本期利润	-6,226,980.21
加权平均基金份额本期利润	-0.0517
本期加权平均净值利润率	-6.94%
本期基金份额净值增长率	-6.52%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-30,163,569.23
期末可供分配基金份额利润	-0.2539
期末基金资产净值	88,649,919.28
期末基金份额净值	0.746
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2014 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-25.40%

注：1、基金业绩指标不包括持有人认（申）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、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

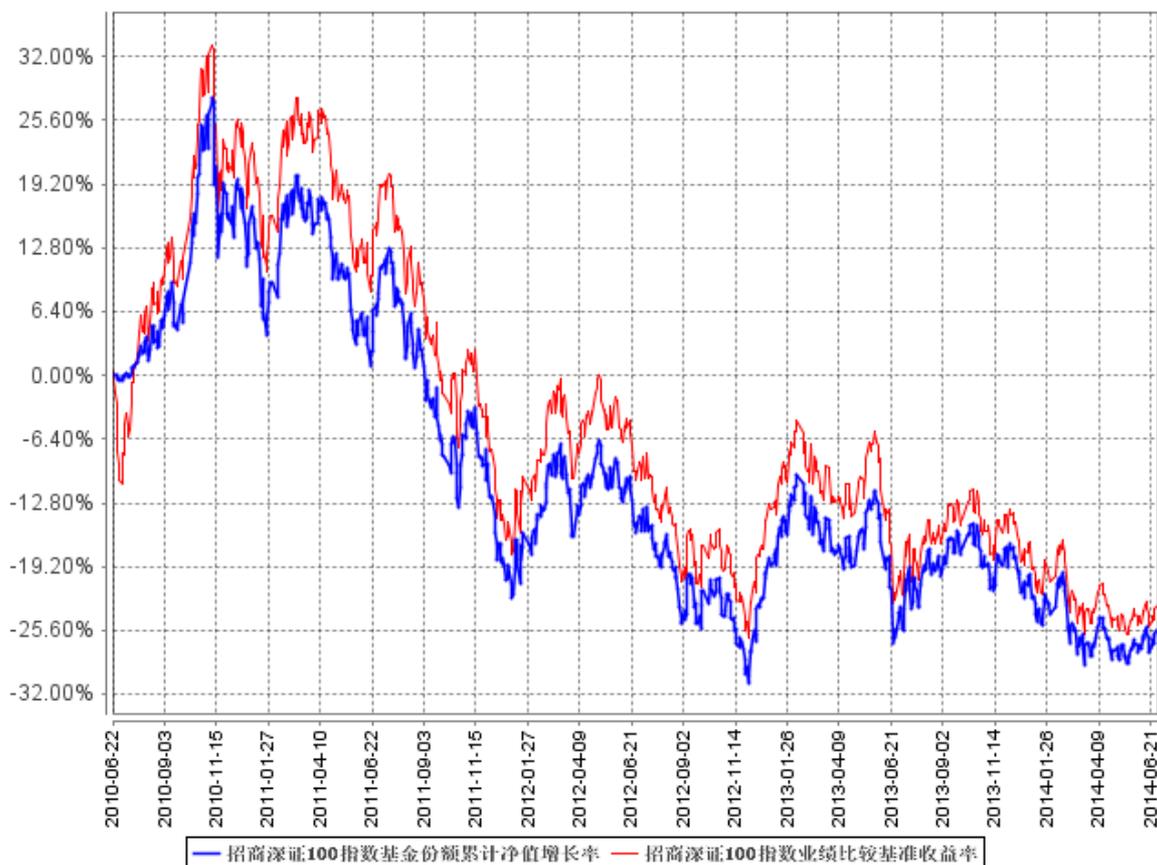
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	1.91%	0.87%	1.08%	0.88%	0.83%	-0.01%
过去三个月	3.90%	0.87%	2.28%	0.87%	1.62%	0.00%
过去六个月	-6.52%	1.10%	-7.45%	1.09%	0.93%	0.01%
过去一年	0.00%	1.16%	-1.98%	1.17%	1.98%	-0.01%
过去三年	-30.67%	1.31%	-33.57%	1.33%	2.90%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-25.40%	1.32%	-23.11%	1.37%	-2.29%	-0.05%

注：业绩比较基准收益率=深证 100 指数收益率×95%+商业银行活期存款利率（税后）×5%，业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

招商深证100指数基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：根据基金合同第十一条（四）投资策略的规定：本基金股票等权益类资产的投资比例为基金

资产的 85%-95%，其中投资于标的指数成份股、备选成份股的资产占基金资产的比例不低于 80%；现金、债券等固定收益类资产的投资比例为基金资产的 5%-15%，其中现金及到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。本基金于 2010 年 6 月 22 日成立，自基金成立日起 6 个月内为建仓期，建仓期结束时相关比例均符合上述规定的要求。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

招商基金管理有限公司于 2002 年 12 月 27 日经中国证监会（2002）100 号文批准设立，公司的经营范围包括发起设立基金、基金管理业务和中国证监会批准的其它业务。

目前，本公司的股东股权结构为：招商银行股份有限公司持有公司全部股权的 55%，招商证券股份有限公司持有公司全部股权的 45%。公司注册资本为 2.1 亿元人民币。招商基金拥有两家全资子公司，分别为招商财富资产管理有限公司和招商资产管理（香港）有限公司。

截至 2014 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理三十八只共同基金，具体如下：从 2003 年 4 月 28 日起管理招商安泰系列开放式证券投资基金（含招商安泰股票证券投资基金、招商安泰平衡型证券投资基金、招商安泰债券投资基金）；从 2004 年 1 月 14 日起管理招商现金增值开放式证券投资基金；从 2004 年 6 月 1 日起开始管理招商先锋混合型证券投资基金；从 2005 年 11 月 17 日起开始管理招商优质成长股票型证券投资基金（LOF）；从 2006 年 7 月 11 日起开始管理招商安本增利债券型证券投资基金；从 2007 年 3 月 30 日起开始管理招商核心价值混合型证券投资基金；从 2008 年 6 月 19 日起开始管理招商大盘蓝筹股票型证券投资基金；从 2008 年 10 月 22 日起开始管理招商安心收益债券型证券投资基金；从 2009 年 6 月 19 日起开始管理招商行业领先股票型证券投资基金；从 2009 年 12 月 25 日起开始管理招商中小盘精选股票型证券投资基金；从 2010 年 3 月 25 日起开始管理招商全球资源股票型证券投资基金（QDII）；从 2010 年 6 月 22 日起开始管理招商深证 100 指数证券投资基金；从 2010 年 6 月 25 日起开始管理招商信用添利债券型证券投资基金；从 2010 年 12 月 8 日开始管理上证消费 80 交易型开放式指数证券投资基金及招商上证消费 80 交易型开放式指数证券投资基金联接基金；从 2011 年 2 月 11 日起开始管理招商标普金砖四国指数证券投资基金（LOF）；从 2011 年 3 月 17 日起开始管理招商安瑞进取债券型证券投资基金；从 2011 年 6 月 27 日开始管理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；从 2011 年 9 月 1 日起开始管理招商安达保本混合型证券投资基金；从 2012 年 2 月 1 日起开始管理招商优势企业灵

活配置混合型证券投资基金；从 2012 年 3 月 21 日起开始管理招商产业债券型证券投资基金；从 2012 年 6 月 28 日起开始管理招商中证大宗商品股票指数分级证券投资基金；从 2012 年 7 月 20 日起开始管理招商信用增强债券型证券投资基金；从 2012 年 8 月 20 日起开始管理招商安盈保本混合型证券投资基金；从 2012 年 12 月 7 日起开始管理招商理财 7 天债券型证券投资基金；从 2013 年 2 月 5 日起开始管理招商央视财经 50 指数证券投资基金；从 2013 年 3 月 1 日起开始管理招商双债增强分级债券型证券投资基金；从 2013 年 4 月 19 日起开始管理招商安润保本混合型证券投资基金；从 2013 年 5 月 17 日起开始管理招商保证金快线货币市场基金；从 2013 年 8 月 1 日起开始管理招商沪深 300 高贝塔指数分级证券投资基金；从 2013 年 11 月 6 日起开始管理招商瑞丰灵活配置混合型发起式证券投资基金；从 2013 年 12 月 11 日起开始管理招商标普高收益红利贵族指数增强型证券投资基金；从 2014 年 3 月 20 日开始管理招商丰盛稳定增长灵活配置混合型证券投资基金；从 2014 年 3 月 25 日开始管理招商招财宝货币市场证券投资基金；从 2014 年 6 月 18 日开始管理招商招金宝货币市场证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理) 期限		证券从 业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王平	本基金的基金经理	2010 年 6 月 22 日	-	8	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，主要负责公司投资风险管理、金融工程研究等工作，现任招商深证 100 指数证券投资基金、上证消费 80 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、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其联接基金、招商中证大宗商品股票指数分级证券投资基金及招商央视财经 50 指数证券投资基金基金经理。
王立立	本基金的基金经理	2014 年 1 月 11 日	-	3	王立立，男，中国国籍，经济学硕士。曾任职于广东省志高空调股份有限公司及江西省景德镇学院，2010 年起先后任职于东兴期货有限责任公司及湘财祈年期货经纪有限公司，从事宏观研究、期指策略研

					究及量化策略研究工作，2012 年加入招商基金管理有限公司，任全球量化投资部高级研究员，从事量化策略研究工作，现任招商深证 100 指数证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：1、本基金首任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《证券业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。

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》、《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 100 指数证券投资基金基金合同》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，在严格控制风险的前提下，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围以及投资运作符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 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方法和投资决策流程，确保各投资组合享有公平的投资决策机会。公司建立了所有组合适用的投资对象备选库，制定明确的备选库建立、维护程序。公司拥有健全的投资授权制度，明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限划分，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。公司的相关研究成果向内部所有投资组合开放，在投资研究层面不存在各投资组合间不公平的问题。公司交易部在报告期内，对所有组合的各条指令，均在中央交易员的统一分派下，本着持有人利益最大化的原则执行了公平交易。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司严格控制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。确因投资组合的投资策略或流动性等需要而发生的同日反向交易，公司要求相关投资组合经理提供决策依据，并留存记录备查，完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合等除外。

本报告期内，本基金各项交易均严格按照相关法律法规、基金合同的有关要求执行。报告期

内，公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形，在某指数型投资组合与某主动型投资组合之间发生过一次，原因是指数型投资组合为满足指数复制比例要求的投资策略需要。报告期内未发现其他有可能导致不公平交易和利益输送的重大异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，在政策微刺激和外部经济复苏情况下，国内宏观经济呈现出低位企稳的迹象，市场流动性偏宽松。报告期内 A 股市场震荡筑底，深证 100 回报指数上半年下跌 6.68%，从市场风格来看，上半年为中小盘股行情，大盘蓝筹股跌幅较大，从行业来看，信息服务、信息设备、机械设备、电子等行业涨幅居前，采掘、农林牧渔、食品饮料、商业贸易等行业跌幅较大。

关于本基金的运作，上半年我们对市场走势保持中性的看法，股票仓位维持在 94.5% 左右的水平，基本完成了对基准的跟踪。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 0.746 元，本报告期份额净值增长率为 -6.52%，同期业绩比较基准增长率为 -7.45%，基金净值表现好于业绩比较基准，幅度为 0.93%。主要原因是报告期内归属于本指数样本但因关联方关系不能投资的标的在报告期内表现大幅落后于指数。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

1、美国 6 月份 Markit 制造业 PMI 终值为 57.3，虽略低于预期，但连续两个月回升，6 月美国新增非农就业远超预期，增长 28.8 万人，连续 5 个月就业新增 20 万人以上，失业率下调至 6.1%，创 2008 年 9 月以来新低，美国经济增长动力较为强劲，继续看好美国经济复苏；欧元区 6 月制造业 PMI 终值为 51.8，继续下滑，产出和新订单指数均创这半年以来新低，欧央行 QE 政策未明显改善欧元区流动性疲软状态，总体来讲，欧元区经济复苏缓慢。

2、国内，由于政府采取了一系列微刺激政策，二季度汇丰 PMI 指数逐月上行，实体经济增速下行的步伐有所放缓。三季度，投资增速下行的压力依旧存在，因此还需要政府进一步的政策安排，包括积极的财政政策、进一步的微刺激以及加大出口退税等，另外适时的调整货币供应也将对实体经济产生较大的影响。

3、我们预计在政府相关政策的刺激下，三季度 A 股市场会呈现震荡上行的格局，大盘蓝筹股可能会迎来一波估值修复的行情，小盘股的走势可能会出现分化，内生增长及外延式并购的公司将会获得市场的青睐。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金的估值业务严格按照相关的法律法规、基金合同以及《招商基金管理有限公司基金估值委员会管理制度》进行。基金核算部负责日常的基金资产的估值业务，执行基金估值政策。另外，公司设立由投资和研究部门、风险管理部、基金核算部、法律合规部负责人和基金经理代表组成的估值委员会。公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经验。公司估值委员会主要负责制定、修订和完善基金估值政策和程序，定期评价现有估值政策和程序的适用性及对估值程序执行情况进行监督。

投资和研究部门以及基金核算部共同负责关注相关投资品种的动态，评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种；投资和研究部门定期审核公允价值的确认和计量；研究部提出合理的数量分析模型对需要进行估值测算或者调整的投资品种进行公允价值定价与计量并定期对估值政策和程序进行评价，以保证其持续适用；基金核算部定期审核估值政策和程序的一致性，并负责与托管行沟通估值调整事项；风险管理部负责估值委员会工作流程中的风险控制；法律合规部负责日常的基金估值调整结果的事后复核监督工作；法律合规部与基金核算部共同负责估值调整事项的信息披露工作。

基金经理代表向估值委员会提供估值参考信息，参与估值政策讨论；对需采用特别估值程序的证券，基金及时启动特别估值程序，由公司估值委员会集体讨论议定特别估值方案并与托管行沟通后由基金核算部具体执行。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。截止报告期末本基金管理人未与任何外部估值定价服务机构签约。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规的规定和基金合同的约定，以及本基金的实际运作情况，本基金报告期无需进行利润分配。在符合分红条件的前提下，本基金已实现尚未分配的可供分配收益部分，将严格按照基金合同的约定适时向投资者予以分配。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2014 年上半年，本基金托管人在对招商深证 100 指数证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利

益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，招商深证 100 指数证券投资基金的管理人——招商基金管理有限公司在招商深证 100 指数证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，招商深证 100 指数证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对招商基金管理有限公司编制和披露的招商深证 100 指数证券投资基金 2014 年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：招商深证 100 指数证券投资基金

报告截止日：2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	4,846,854.52	5,351,467.54
结算备付金		14,178.38	2,837.14
存出保证金		4,102.52	5,491.32
交易性金融资产	6.4.7.2	84,158,869.39	92,666,413.39
其中：股票投资		84,158,869.39	92,666,413.39
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		52,420.46	139,628.21
应收利息	6.4.7.5	866.52	902.65
应收股利		-	-
应收申购款		15,546.26	55,258.85
递延所得税资产		-	-

其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		89,092,838.05	98,221,999.10
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		131,262.46	83,483.96
应付管理人报酬		50,486.28	59,634.18
应付托管费		10,818.48	12,778.75
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	16,843.77	21,661.62
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	233,507.78	309,557.92
负债合计		442,918.77	487,116.43
所有者权益:		-	-
实收基金	6.4.7.9	118,813,488.51	122,420,863.02
未分配利润	6.4.7.10	-30,163,569.23	-24,685,980.35
所有者权益合计		88,649,919.28	97,734,882.67
负债和所有者权益总计		89,092,838.05	98,221,999.10

注：报告截止日 2014 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.746 元，基金份额总额 118,813,488.51 份。

6.2 利润表

会计主体：招商深证 100 指数证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2014年1月1日至 2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013 年6月30日
一、收入		-5,663,468.76	-8,105,109.93
1. 利息收入		17,881.41	27,321.76
其中：存款利息收入	6.4.7.11	17,881.41	27,321.76
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-721,516.08	-7,510,699.58

其中：股票投资收益	6.4.7.12	-1,710,344.05	-8,419,271.15
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	988,827.97	908,571.57
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-4,967,586.01	-701,788.14
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	7,751.92	80,056.03
减：二、费用		563,511.45	924,916.16
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	311,602.09	519,242.67
2. 托管费	6.4.10.2.2	66,771.86	111,266.29
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.20	36,434.57	139,655.10
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.21	148,702.93	154,752.10
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-6,226,980.21	-9,030,026.09
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-6,226,980.21	-9,030,026.09

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：招商深证 100 指数证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	122,420,863.02	-24,685,980.35	97,734,882.67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-6,226,980.21	-6,226,980.21
三、本期基金份额交易产	-3,607,374.51	749,391.33	-2,857,983.18

生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)			
其中: 1. 基金申购款	13,690,790.94	-3,478,580.84	10,212,210.10
2. 基金赎回款	-17,298,165.45	4,227,972.17	-13,070,193.28
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	118,813,488.51	-30,163,569.23	88,649,919.28
	上年度可比期间		
	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日		
项目	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	211,535,483.94	-38,947,077.65	172,588,406.29
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-9,030,026.09	-9,030,026.09
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-65,863,564.00	10,952,689.74	-54,910,874.26
其中: 1. 基金申购款	24,013,867.12	-4,043,649.76	19,970,217.36
2. 基金赎回款	-89,877,431.12	14,996,339.50	-74,881,091.62
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	145,671,919.94	-37,024,414.00	108,647,505.94

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

许小松

庄永宙

李扬

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

招商深证 100 指数证券投资基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人招商基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《招商深证 100 指数证券投资基金基金合同》及其他

有关法律法规的规定,经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2010]513号文批准公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限为不定期,首次设立募集基金份额为661,815,306.06份,经德勤华永会计师事务所有限公司验证,并出具了编号为德师报(验)字(10)第0034号验资报告。《招商深证100指数证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)于2010年6月22日正式生效。本基金的基金管理人为招商基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称“中国工商银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及最新公告的《招商深证100指数证券投资基金招募说明书》的有关规定,包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的投资组合为:本基金股票等权益类资产的投资比例为基金资产的85%-95%,其中投资于标的指数成份股、备选成份股的资产占基金资产的比例不低于80%;现金、债券等固定收益类资产的投资比例为基金资产的5%-15%,其中现金及到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为:深证100指数收益率 \times 95%+商业银行活期存款利率(税后) \times 5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金2014年6月30日的财务状况以及2014年1月1日至2014年6月30日的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[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有关政策的通知》、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[2005]107 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花税征收方式调整工作的通知》、财税〔2012〕85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

- 1) 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不缴纳营业税；
- 2) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税；
- 3) 对基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税，暂不征收企业所得税；
- 4) 对基金取得债券的利息收入，由上市公司、发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税；
- 5) 对于基金从事 A 股买卖，自 2008 年 9 月 19 日起，出让方按 0.10% 的税率缴纳证券（股票）交易印花税，对受让方不再缴纳印花税；
- 6) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免于缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日
活期存款	4,846,854.52

定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	4,846,854.52

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	97,817,424.22	84,158,869.39	-13,658,554.83
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	97,817,424.22	84,158,869.39	-13,658,554.83

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融工具。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	859.14
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	5.76

应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	1.62
合计	866.52

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
交易所市场应付交易费用	16,843.77
银行间市场应付交易费用	-
合计	16,843.77

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	229.73
预提费用	228,929.92
应付指数使用费	4,348.13
合计	233,507.78

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	122,420,863.02	122,420,863.02
本期申购	13,690,790.94	13,690,790.94
本期赎回(以“-”号填列)	-17,298,165.45	-17,298,165.45
本期末	118,813,488.51	118,813,488.51

注：申购含红利再投、转换入份（金）额，赎回含转换出份（金）额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-7,629,514.98	-17,056,465.37	-24,685,980.35
本期利润	-1,259,394.20	-4,967,586.01	-6,226,980.21
本期基金份额交易产生的变动数	227,739.89	521,651.44	749,391.33
其中：基金申购款	-838,148.59	-2,640,432.25	-3,478,580.84
基金赎回款	1,065,888.48	3,162,083.69	4,227,972.17
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-8,661,169.29	-21,502,399.94	-30,163,569.23

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
活期存款利息收入	17,674.52
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	159.83
其他	47.06
合计	17,881.41

6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
卖出股票成交总额	12,584,594.20
减：卖出股票成本总额	14,294,938.25
买卖股票差价收入	-1,710,344.05

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具投资收益。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	988,827.97
基金投资产生的股利收益	-
合计	988,827.97

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-4,967,586.01
——股票投资	-4,967,586.01
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-4,967,586.01

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	3,783.95
转换费收入	3,967.97
合计	7,751.92

注：1、本基金的赎回费率按基金持有人持有该部分基金份额的时间分段递减设定，于持有人赎回基金份额时收取，赎回费总额的 25% 归入基金资产；

2、本基金的转换费由赎回费和申购费补差两部分组成，其中赎回费总额的 25% 归入转出基金

的基金资产。

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	36,434.57
银行间市场交易费用	-
合计	36,434.57

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	99,177.14
指数使用费	8,902.87
银行费用	1,470.14
其他	9,400.00
合计	148,702.93

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

本基金无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
招商基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
中国工商银行	基金托管人、基金代销机构
招商证券股份有限公司(以下简称“招商证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
招商证券	1,818,336.75	7.79%	1,387,283.50	1.86%

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
招商证券	1,655.41	7.79%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
招商证券	1,262.99	1.86%	1,262.99	2.12%

注：1、上述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立；

2、基金对该类交易佣金的计算方式是按合同约定的佣金率计算。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6 月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30 日
	当期发生的基金应支付	311,602.09

的管理费		
其中：支付销售机构的客户维护费	119,863.06	167,707.75

注：支付基金管理人招商基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值×0.70%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日基金管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.70\% \div \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2014年1月1日至2014年6月30日	2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	66,771.86	111,266.29

注：支付基金托管人中国工商银行的基金托管费按前一日基金资产净值×0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% \div \text{当年天数}。$$

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2014年1月1日至2014年6月30日		2013年1月1日至2013年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	4,846,854.52	17,674.52	6,066,918.28	26,976.52

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2014 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
000009	中国宝安	2014-5-28	重大事项	10.21	-	-	70,753	731,661.98	722,388.13	-
002570	贝因美	2014-6-19	重大事项	14.36	-	-	46,900	860,022.26	673,484.00	-
000960	锡业股份	2014-5-6	重大事项	12.44	2014-8-5	13.68	31,136	693,394.45	387,331.84	-
000878	云南铜业	2014-4-17	重大事项	7.61	2014-7-17	7.50	48,437	858,556.42	368,605.57	-
000562	宏源证券	2013-10-30	重大事项	7.51	2014-7-28	8.93	77,520	581,477.72	582,175.20	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金是股票型基金，本基金的运作涉及的金融工具主要包括股票投资（主要是指数成份股、备选成份股）、债券投资等。与这些金融工具有关的风险，以及本基金的基金管理人管理这些风险所采取的风险管理政策如下所述。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人从事风险管理的目标是提升本基金风险调整后收益水平，保证本基金的基金资产安全，维护基金份额持有人利益。基于该风险管理目标，本基金的基金管理人风险管理的基本策略是识别和分析本基金运作时本基金面临的各种类型的风险，确定适当的风险容忍度，并及时可靠地对各种风险进行监督，将风险控制在限定的范围之内。本基金目前面临的主要风险包括：市场风险、信用风险和流动性风险。与本基金相关的市场风险主要包括利率风险和市场价格风险。

本基金的基金管理人建立了以全面、独立、互相制约以及定性和定量相结合为原则的，监事会、董事会及下设风险控制委员会、督察长、风险管理委员会、法律合规部和风险管理部等多层次的风险管理组织架构体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指金融工具的一方到期无法履行约定义务致使本基金遭受损失的风险。本基金的信用风险主要存在于银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资及其他。

本基金的银行存款存放于本基金的基金托管人中国工商银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在证券交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

对于与债券投资相关的信用风险，本基金的基金管理人通过对投资品种的信用等级评估来选择适当的投资对象，并限制单个投资品种的持有比例来管理信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指没有足够资金以满足到期债务支付的风险。本基金流动风险来源于开放式基金每日兑付赎回资金的流动性风险，以及因部分投资品种交易不活跃而出现的变现风险以及因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理价格变现投资的风险。本基金所持有的大部分交易性金融资产在证券交易所上市，其余亦可银行间同业市场交易，除 6.4.12 所披露的流通受限不能自由转让的基金资产外，本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人在基金合同约定巨额赎回条款，设计了非常情况下赎回资金的处理模式，控制因开放模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。日常流动性风险管理中，本基金的基金管理人每日监控和预测本基金的流动性指标，通过对投资品种的流动性指标来持续的评估、选择、跟踪和控制基金投资的流动性风险。同时，本基金在需要时可通过卖出回购金融资产方式融入短期资金，以缓解流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的利率敏感性资产主要是银行存款，利率风险不重大。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2014年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	4,846,854.52	-	-	-	-	-	4,846,854.52
结算备付金	14,178.38	-	-	-	-	-	14,178.38
存出保证金	4,102.52	-	-	-	-	-	4,102.52
交易性金融资产	-	-	-	-	-	84,158,869.39	84,158,869.39
应收证券清算款	-	-	-	-	-	52,420.46	52,420.46
应收利息	-	-	-	-	-	866.52	866.52
应收申购款	99.29	-	-	-	-	15,446.97	15,546.26
资产总计	4,865,234.71	-	-	-	-	84,227,603.34	89,092,838.05
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	131,262.46	131,262.46
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	50,486.28	50,486.28
应付托管费	-	-	-	-	-	10,818.48	10,818.48
应付交易费用	-	-	-	-	-	16,843.77	16,843.77
其他负债	-	-	-	-	-	233,507.78	233,507.78
负债总计	-	-	-	-	-	442,918.77	442,918.77
利率敏感度缺口	4,865,234.71	-	-	-	-	83,784,684.57	88,649,919.28
上年度末 2013年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	5,351,467.54	-	-	-	-	-	5,351,467.54
结算备付金	2,837.14	-	-	-	-	-	2,837.14
存出保证金	5,491.32	-	-	-	-	-	5,491.32
交易性金融资产	-	-	-	-	-	92,666,413.39	92,666,413.39

应收证券清算款	-	-	-	-	139,628.21	139,628.21
应收利息	-	-	-	-	902.65	902.65
应收申购款	7,049.29	-	-	-	48,209.56	55,258.85
资产总计	5,366,845.29	-	-	-	92,855,153.81	98,221,999.10
负债	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	83,483.96	83,483.96
应付管理人报酬	-	-	-	-	59,634.18	59,634.18
应付托管费	-	-	-	-	12,778.75	12,778.75
应付交易费用	-	-	-	-	21,661.62	21,661.62
其他负债	-	-	-	-	309,557.92	309,557.92
负债总计	-	-	-	-	487,116.43	487,116.43
利率敏感度缺口	5,366,845.29	-	-	-	-92,368,037.38	97,734,882.67

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末未持有债券投资及资产支持证券投资，因此市场利率变动而导致的利率敏感性资产的公允价值变动对基金资产净值的影响不重大。

6.4.13.4.2 其他价格风险

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险，该风险可能与特定投资品种相关，也有可能与整体投资品种相关。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的债券和股票，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金在构建资产配置和基金资产投资组合的基础上，通过建立事前和事后跟踪误差的方式，对基金资产的市场价格风险进行管理。

6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日		上年度末 2013年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	84,158,869.39	94.93	92,666,413.39	94.81
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	84,158,869.39	94.93	92,666,413.39	94.81

6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1、若对市场价格敏感的权益性投资的市场价格上升或下降 5%		
	2、其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2014 年 6 月 30 日）	上年度末（2013 年 12 月 31 日）
	1、权益性投资的市场价格上升 5%	4,207,943.47	4,633,320.67
	2、权益性投资的市场价格下降 5%	-4,207,943.47	-4,633,320.67

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无需要说明有助于理解和分析会计报表的其他事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	84,158,869.39	94.46
	其中：股票	84,158,869.39	94.46
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	4,861,032.90	5.46
7	其他各项资产	72,935.76	0.08
8	合计	89,092,838.05	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

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	241,728.18	0.27
B	采矿业	1,998,582.06	2.25
C	制造业	49,993,425.51	56.39

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	765,970.99	0.86
E	建筑业	770,176.56	0.87
F	批发和零售业	1,687,776.48	1.90
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,746,438.92	7.61
J	金融业	8,912,824.21	10.05
K	房地产业	5,797,323.68	6.54
L	租赁和商务服务业	1,739,250.66	1.96
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,703,943.51	3.05
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	2,079,040.50	2.35
S	综合	722,388.13	0.81
	合计	84,158,869.39	94.93

7.2.2 期末积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

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	000002	万科A	531,056	4,391,833.12	4.95
2	000651	格力电器	143,946	4,239,209.70	4.78
3	000001	平安银行	316,369	3,135,216.79	3.54
4	000333	美的集团	115,325	2,228,079.00	2.51
5	000858	五粮液	113,036	2,026,735.48	2.29
6	000776	广发证券	183,687	1,800,132.60	2.03
7	002024	苏宁云商	257,283	1,687,776.48	1.90
8	000063	中兴通讯	117,182	1,537,427.84	1.73
9	000625	长安汽车	118,694	1,461,123.14	1.65
10	000895	双汇发展	39,119	1,400,069.01	1.58
11	000538	云南白药	25,850	1,349,370.00	1.52

12	000725	京东方 A	603,167	1,308,872.39	1.48
13	002415	海康威视	75,305	1,275,666.70	1.44
14	300027	华谊兄弟	50,850	1,216,332.00	1.37
15	002241	歌尔声学	44,993	1,199,513.38	1.35
16	000157	中联重科	265,767	1,177,347.81	1.33
17	000338	潍柴动力	65,845	1,171,382.55	1.32
18	002594	比亚迪	24,000	1,139,760.00	1.29
19	000423	东阿阿胶	33,782	1,125,616.24	1.27
20	000100	TCL 集团	484,742	1,105,211.76	1.25
21	000783	长江证券	108,870	1,045,152.00	1.18
22	002230	科大讯飞	39,184	1,042,294.40	1.18
23	002450	康得新	45,783	1,041,563.25	1.17
24	300070	碧水源	35,098	1,026,616.50	1.16
25	300104	乐视网	23,000	1,009,700.00	1.14
26	002065	东华软件	50,000	1,006,000.00	1.13
27	000069	华侨城 A	213,304	1,000,395.76	1.13
28	002353	杰瑞股份	24,513	986,648.25	1.11
29	002202	金风科技	100,092	949,873.08	1.07
30	000581	威孚高科	35,006	944,111.82	1.06
31	002236	大华股份	33,909	913,847.55	1.03
32	300024	机器人	30,920	909,048.00	1.03
33	000793	华闻传媒	73,422	862,708.50	0.97
34	002008	大族激光	49,705	861,884.70	0.97
35	002304	洋河股份	16,967	861,075.25	0.97
36	300058	蓝色光标	31,700	841,318.00	0.95
37	002456	欧菲光	39,000	835,770.00	0.94
38	300017	网宿科技	12,700	810,260.00	0.91
39	000400	许继电气	39,733	796,646.65	0.90
40	000831	五矿稀土	37,500	786,750.00	0.89
41	002081	金螳螂	54,391	770,176.56	0.87
42	000768	中航飞机	72,775	766,320.75	0.86
43	002038	双鹭药业	17,170	765,266.90	0.86
44	002465	海格通信	47,500	756,675.00	0.85
45	000402	金融街	135,701	739,570.45	0.83
46	300124	汇川技术	23,600	736,320.00	0.83
47	000568	泸州老窖	44,237	724,602.06	0.82
48	000009	中国宝安	70,753	722,388.13	0.81
49	000623	吉林敖东	45,899	712,352.48	0.80
50	000917	电广传媒	46,424	707,037.52	0.80

51	000826	桑德环境	29,625	676,931.25	0.76
52	002570	贝因美	46,900	673,484.00	0.76
53	000970	中科三环	55,774	662,595.12	0.75
54	000559	万向钱潮	63,052	648,174.56	0.73
55	300002	神州泰岳	40,700	641,025.00	0.72
56	002142	宁波银行	67,390	619,988.00	0.70
57	000792	盐湖股份	39,199	590,728.93	0.67
58	000562	宏源证券	77,520	582,175.20	0.66
59	000728	国元证券	60,388	570,062.72	0.64
60	000060	中金岭南	83,233	565,984.40	0.64
61	002422	科伦药业	14,061	560,330.85	0.63
62	000598	兴蓉投资	115,400	550,458.00	0.62
63	002385	大北农	48,100	546,416.00	0.62
64	300315	掌趣科技	29,900	534,014.00	0.60
65	002405	四维图新	31,400	521,868.00	0.59
66	000061	农产品	56,402	520,590.46	0.59
67	002007	华兰生物	19,521	509,498.10	0.57
68	000983	西山煤电	96,115	506,526.05	0.57
69	000012	南玻 A	73,545	502,312.35	0.57
70	000629	攀钢钒钛	240,985	501,248.80	0.57
71	000729	燕京啤酒	76,850	499,525.00	0.56
72	000800	一汽轿车	51,889	498,134.40	0.56
73	000778	新兴铸管	132,668	492,198.28	0.56
74	000425	徐工机械	70,539	483,192.15	0.55
75	000839	中信国安	62,400	474,240.00	0.53
76	000709	河北钢铁	247,630	460,591.80	0.52
77	000999	华润三九	24,365	448,072.35	0.51
78	002292	奥飞动漫	12,034	441,647.80	0.50
79	000686	东北证券	61,258	439,219.86	0.50
80	000876	新希望	37,938	428,320.02	0.48
81	000630	铜陵有色	47,147	422,437.12	0.48
82	000758	中色股份	39,653	394,150.82	0.44
83	000960	锡业股份	31,136	387,331.84	0.44
84	002073	软控股份	40,143	384,168.51	0.43
85	002001	新和成	30,777	381,327.03	0.43
86	002344	海宁皮城	30,260	377,342.20	0.43
87	000750	国海证券	39,736	375,505.20	0.42
88	000878	云南铜业	48,437	368,605.57	0.42
89	000825	太钢不锈	134,815	357,259.75	0.40

90	002106	莱宝高科	31,367	354,447.10	0.40
91	002146	荣盛发展	36,978	350,181.66	0.40
92	002500	山西证券	53,216	345,371.84	0.39
93	002155	辰州矿业	44,942	336,166.16	0.38
94	000046	泛海控股	70,635	315,738.45	0.36
95	000937	冀中能源	44,681	260,490.23	0.29
96	002069	獐子岛	17,291	241,728.18	0.27
97	000401	冀东水泥	28,598	232,501.74	0.26
98	000539	粤电力 A	45,563	215,512.99	0.24

7.3.2 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所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002065	东华软件	1,020,524.00	1.04
2	300058	蓝色光标	882,652.00	0.90
3	002465	海格通信	713,103.00	0.73
4	300017	网宿科技	695,043.00	0.71
5	002292	奥飞动漫	682,185.98	0.70
6	300124	汇川技术	669,545.50	0.69
7	300002	神州泰岳	558,402.00	0.57
8	002385	大北农	544,400.00	0.56
9	300315	掌趣科技	523,868.92	0.54
10	000651	格力电器	340,899.00	0.35
11	000915	山大华特	312,500.00	0.32
12	002456	欧菲光	220,758.00	0.23
13	000333	美的集团	217,185.00	0.22
14	000725	京东方 A	216,755.00	0.22
15	000002	万科 A	196,894.00	0.20
16	000686	东北证券	193,056.00	0.20
17	000625	长安汽车	177,973.00	0.18
18	000001	平安银行	143,746.00	0.15

19	300104	乐视网	128,928.00	0.13
20	000778	新兴铸管	124,160.00	0.13

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票；
2、基金持有的股票分类为交易性金融资产的，本项的“累计买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600276	恒瑞医药	2,900,656.41	2.97
2	600436	片仔癀	945,414.35	0.97
3	000915	山大华特	732,728.99	0.75
4	600763	通策医疗	602,554.94	0.62
5	000651	格力电器	472,744.00	0.48
6	000002	万科A	400,318.00	0.41
7	002051	中工国际	339,515.57	0.35
8	000776	广发证券	298,731.00	0.31
9	000333	美的集团	285,177.00	0.29
10	002292	奥飞动漫	284,625.00	0.29
11	002041	登海种业	280,296.96	0.29
12	600315	上海家化	276,826.17	0.28
13	000933	神火股份	256,490.95	0.26
14	002415	海康威视	248,907.00	0.25
15	000540	中天城投	237,807.09	0.24
16	000001	平安银行	214,382.11	0.22
17	000869	张裕A	188,198.88	0.19
18	002142	宁波银行	161,532.00	0.17
19	000961	中南建设	150,592.23	0.15
20	002244	滨江集团	147,377.67	0.15

注：1、卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票；
2、基金持有的股票分类为交易性金融资产的，本项“累计卖出金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	10,754,980.26
卖出股票收入（成交）总额	12,584,594.20

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票；

2、“买入股票成本（成交）总额”、“卖出股票收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 报告期内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、处罚的情形。

7.11.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库，本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	4,102.52
2	应收证券清算款	52,420.46
3	应收股利	-
4	应收利息	866.52
5	应收申购款	15,546.26
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	72,935.76

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
5,076	23,406.91	3,100,311.86	2.61%	115,713,176.65	97.39%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	315,300.43	0.2654%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
----	-------------------

本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2010年6月22日）基金份额总额	661,815,306.06
本报告期期初基金份额总额	122,420,863.02
本报告期基金总申购份额	13,690,790.94
减：本报告期基金总赎回份额	17,298,165.45
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	118,813,488.51

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期没有举行基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、根据本基金管理人 2014 年 3 月 25 日的公告，经招商基金管理有限公司第四届董事会 2014 年第一次会议审议并通过，因工作调动，赵生章先生不再担任招商基金管理有限公司副总经理职务，全职担任招商基金管理有限公司全资子公司招商财富资产管理有限公司总经理职务。

2、本报告期内，因中国工商银行股份有限公司（以下简称“本行”）工作需要，周月秋同志不再担任本行资产托管部总经理。在新任资产托管部总经理李勇同志完成证券投资基金行业高级管理人员任职资格备案手续前，由副总经理王立波同志代为行使本行资产托管部总经理部分业务授权职责。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金管理人没有受到监管部门的稽查或处罚，亦未收到关于基金管理人的高级管理人员、托管人及其高级管理人员受到监管部门的稽查或处罚的书面通知或文件。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中银国际	1	10,307,685.38	44.16%	9,383.97	44.16%	-
宏源证券	2	5,838,758.05	25.02%	5,315.64	25.02%	-
财富证券	1	2,570,493.67	11.01%	2,340.22	11.01%	-
西南证券	3	1,820,412.27	7.80%	1,657.32	7.80%	-
招商证券	1	1,818,336.75	7.79%	1,655.41	7.79%	-
东方证券	1	336,621.45	1.44%	306.46	1.44%	-
东北证券	2	312,500.00	1.34%	284.51	1.34%	-
中信建投	3	301,648.78	1.29%	274.65	1.29%	-
兴业证券	1	33,118.11	0.14%	30.15	0.14%	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	2	-	-	-	-	-
国都证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
天源证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	2	-	-	-	-	新增 2 个交易单元
齐鲁证券	3	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-

国元证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
万和证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	新增
广州证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
中邮证券	1	-	-	-	-	-

注：基金交易佣金根据券商季度综合评分结果给与分配，券商综合评分根据研究报告质量、路演质量、联合调研质量以及销售服务质量打分，从多家服务券商中选取符合法律规范经营的综合能力靠前的券商给与佣金分配，季度评分和佣金分配分别由专人负责。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期无租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露时间
1	招商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加华夏银行手机银行交易渠道基金申购费率优惠活动的公告	证券时报、上海证券报	2014-6-27
2	招商基金管理有限公司关于旗下相关基金增加万联证券有限公司为代销机构及参与其网上申购费率优惠活动的公告	证券时报、上海证券报	2014-6-18
3	招商基金管理有限公司关于旗下基金参与中山证券有限责任公司开放式基金申购费率优惠的公告	证券时报、上海证券报	2014-4-28

4	招商基金管理有限公司关于旗下基金参与中国国际金融有限公司申购场外开放式基金费率优惠的公告	证券时报、上海证券报	2014-4-24
5	招商深证 100 指数证券投资基金 2014 年第 1 季度报告	证券时报、上海证券报	2014-4-19
6	关于招商基金旗下部分基金继续参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	证券时报、上海证券报	2014-4-1
7	招商深证 100 指数证券投资基金 2013 年年度报告	证券时报、上海证券报	2014-3-28
8	招商深证 100 指数证券投资基金 2013 年年度报告摘要	证券时报、上海证券报	2014-3-28
9	招商基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证券时报、上海证券报	2014-3-25
10	招商基金管理有限公司关于旗下基金参与光大证券手机客户端申购场外开放式基金费率优惠的公告	证券时报、上海证券报	2014-3-17
11	招商基金管理有限公司关于旗下基金估值变更的公告	证券时报、上海证券报	2014-3-11
12	招商基金管理有限公司关于旗下相关基金增加天源证券有限公司为代销机构的公告	证券时报、上海证券报	2014-3-7
13	招商基金管理有限公司关于旗下相关基金增加第一创业证券股份有限公司为代销机构的公告	证券时报、上海证券报	2014-2-26
14	招商深证 100 指数证券投资基金更新的招募说明书摘要（二零一四年第一号）	证券时报、上海证券报	2014-1-30
15	招商深证 100 指数证券投资基金更新的招募说明书（二零一四年第一号）	证券时报、上海证券报	2014-1-30
16	招商深证 100 指数证券投资基金 2013 年第 4 季度报告	证券时报、上海证券报	2014-1-21
17	关于招商深证 100 指数证券投资基金基金经理变更的公告	证券时报、上海证券报	2014-1-11

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会批准设立招商基金管理有限公司的文件；
- 2、中国证券监督管理委员会批准招商深证 100 指数证券投资基金设立的文件；
- 3、《招商深证 100 指数证券投资基金基金合同》；
- 4、《招商深证 100 指数证券投资基金托管协议》；
- 5、《招商深证 100 指数证券投资基金招募说明书》；

- 6、《招商深证 100 指数证券投资基金 2014 年第 1 季度报告》；
- 7、《招商深证 100 指数证券投资基金 2014 年第 2 季度报告》；
- 8、《招商深证 100 指数证券投资基金 2014 年半年度报告》；
- 9、《招商深证 100 指数证券投资基金 2014 年半年度报告摘要》。

11.2 存放地点

招商基金管理有限公司

地址：中国深圳深南大道 7088 号招商银行大厦

11.3 查阅方式

上述文件可在招商基金管理有限公司互联网站上查阅，或者在营业时间内到招商基金管理有限公司查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人招商基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-887-9555

网址：<http://www.cmfchina.com>

招商基金管理有限公司
2014 年 8 月 27 日