

招商安达保本混合型证券投资基金

[2014]第二季度报告

基金管理人：招商基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：2014年7月21日

基金管理人的董事会及监事会对本报告所载资料不承担虚假记载、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。

基金托管人对本报告所载资料不承担虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

基金的过往业绩不代为其未来表现，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。

本报告期无申购赎回费用。

本报告期无分红派息。

§ 2 基金产品概况

招商安达保本混合型基金

报告期未发生变动

基金代码 217020

交易代码 217020

基金运作方式 契约型开放式

基金合同生效日 2011年9月1日

报告期末基金份额总额 228,058,433.98份

投资目标 通过保本基金与风险资产的动态配置和有效的组合管理，在确保保本的前提下，追求基金资产的长期增值。

投资策略 本基金将充分考虑保本管理人的投资风格、风险承受能力、基本情况进行动态的资产配置和择时，利用恒定比例组合保险策略（CPPI, Constant Proportion Portfolio Insurance）动态调整保本资产在保本组合中的保本比例，实现本基金资产的保本增值。

业绩比较基准 本基金业绩表现应不低于同期银行定期存款利率（税后）。

风险收益特征 本基金是保本混合型基金，属于证券市场的低风险品种。

基金管理人 中国农业银行股份有限公司

基金托管人 中国农业银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标

报告期(2014年4月1日-2014年6月30日)

1.本期已实现收益 -3,134,054.72

2.本期利润 7,019,533.52

3.加权平均基金份额本期利润 0.0295

4.期末基金资产净值 208,652,754.78

5.期末基金份额净值 1.026

注：1.所列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将低于所列数字；

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）扣除相关费用后的金额，本期利润为本期已实现收益加上本期利润；

3.加权平均基金份额本期利润除以期末基金资产净值即为本期每份基金的平均收益；

4.期末基金资产净值除以期末基金份额的净值即为基金份额净值；

5.期末基金份额净值除以期末基金份额的净值即为基金份额净值。

注：业经本基金管理人审计。

3.22 保本基金合同生效以来基金资产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 净值增长标准差 业绩比较基准收益 业绩比较基准收益标准差 ①-③ ②-④

过去三个月 2.43% 0.44% 1.00% 0.01% 1.37% 0.43%

注：业经本基金管理人审计。

3.22 保本基金合同生效以来基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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 - -

B 采矿业 2,845,151.60 0.99

C 制造业 72,753,27,67 25.20

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 - -

E 建筑业 - -

F 批发零售业 1,795,426.76 0.63

G 交通运输、仓储和邮政业 5,490,000.00 1.90

H 住宿和餐饮业 - -

I 信息传输、软件和信息技术服务业 6,376,810.00 2.21

J 金融业 - -

K 房地产业 4,007,969.82 1.39

L 租赁和商务服务业 - -

M 科学研究、技术服务业 - -

N 水利、环境和公共设施管理业 2,768,000.00 0.96

O 国民服务业、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 - -

S 阶段 合计 96,037,025.85 33.27

注：3.22 保本基金合同生效以来基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

序号 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 国防军工 1,000,000.00 3.82

2 电子元件 1,802,576 975,193.61 3.38

3 通信设备 439,964 2,894,836.36 3.05

4 电源设备 500,000 8,150,000.00 2.82

5 有色金属 399,988 7,199,784.00 2.49

6 300017 闻泰科技 99,950 6,376,810.00 2.21

7 000667 三一重工 6,000,000.00 1.97

8 300240 金信诺 450,000 5,490,000.00 1.90

9 300049 亿联网络 150,000 4,320,000.00 1.50

10 600667 中国巨石 799,982 4,007,969.82 1.39

注：3.22 保本基金合同生效以来基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

序号 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 国防军工 20,000,000.00 6.93

2 电子元件 - -

3 通信设备 - -

4 电源设备 - -

5 有色金属 324,480,50.30 112.41

6 企事业单位 10,000,000.00 -

7 可转债 12,767,616.90 4.42

8 其他 - -

9 合计 357,254,07.20 123.77

注：3.22 保本基金合同生效以来基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

序号 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 国防军工 20,000,000.00 6.93

2 电子元件 - -

3 通信设备 - -

4 电源设备 - -

5 有色金属 324,480,50.30 112.41

6 企事业单位 10,000,000.00 -

7 可转债 12,767,616.90 4.42

8 其他 - -

9 合计 357,254,07.20 123.77

注：3.22 保本基金合同生效以来基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

序号 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 国防军工 20,000,000.00 6.93

2 电子元件 - -

3 通信设备 - -

4 电源设备 - -

5 有色金属 324,480,50.30 112.41

6 企事业单位 10,000,000.00 -

7 可转债 12,767,616.90 4.42

8 其他 - -

9 合计 357,254,07.20 123.77

注：3.22 保本基金合同生效以来基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

序号 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 国防军工 20,000,000.00 6.93

2 电子元件 - -

3 通信设备 - -

4 电源设备 - -

5 有色金属 324,480,50.30 112.41

6 企事业单位 10,000,000.00 -

7 可转债 12,767,616.90 4.42

8 其他 - -

9 合计 357,254,07.20 123.77

注：3.22 保本基金合同生效以来基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

序号 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 国防军工 20,000,000.00 6.93

2 电子元件 - -

3 通信设备 - -

4 电源设备 - -

5 有色金属 324,480,50.30 112.41

6 企事业单位 10,000,000.00 -

7 可转债 12,767,616.90 4.42

8 其他 - -

9 合计 357,254,07.20 123.77

注：3.22 保本基金合同生效以来基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

序号 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 国防军工 20,000,000.00 6.93

2 电子元件 - -

3 通信设备 - -

4 电源设备 - -

5 有色金属 324,480,50.30 112.41

6 企事业单位 10,000,000.00 -

7 可转债 12,767,616.90 4.42

8 其他 - -

9 合计 357,254,07.20 123.77

注：3.22 保本基金合同生效以来基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

序号 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 国防军工 20,000,000.00 6.93

2 电子元件 - -

3 通信设备 - -

4 电源设备 - -

5 有色金属 324,480,50.30 112.41

6 企事业单位 10,000,000.00 -

7 可转债 12,767,616.90 4.42

8 其他 - -

9 合计 357,254,07.20 123.77

注：3.22 保本基金合同生效以来基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

序号 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 国防军工 20,000,000.00 6.93

2 电子元件 - -

3 通信设备 - -

4 电源设备 - -

5 有色金属 324,480,50.30 112.41

6 企事业单位 10,000,000.00 -

7 可转债 12,767,616.90 4.42

8 其他 - -

9 合计 357,254,07.20 123.77