

## 招商安泰债券投资基金

## [2010] 年度报告摘要

基金管理人：招商基金管理有限公司  
基金托管人：招商银行股份有限公司  
报告送出日期：2011年3月30日  
§ 1 重要提示  
基金管理人招致基金管理有限公司的董事会、监事会保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述和重大遗漏，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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字确认。

基金托管人招致银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2011年3月29日复核了本报告中的财务数据、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。投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书及其摘要。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自2010年1月1日起至2012月31日止。

## § 2 基金简介

基金简称	招商安泰债券	
基金代码	217003	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2003年4月28日	
基金管理人	招商基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期基金份额总额	1,319,320,501.46份	
基金合同延续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	招商安泰债券A	招商安泰债券B
下属分级基金的交易代码	217003	217203
报告期末下属分级基金的份额总额	1,029,088,779.65份	290,231,721.81份

## § 2.1 基金基本情况

基金简称	招商安泰债券
基金代码	217003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003年4月28日
基金管理人	招商基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期基金份额总额	1,319,320,501.46份
基金合同延续期	不定期

下属分级基金的基金简称：招商安泰债券A 招商安泰债券B

下属分级基金的交易代码：217003 217203

报告期末下属分级基金的份额总额：1,029,088,779.65份 290,231,721.81份

## § 2.2 基金产品说明

投资目标 追求相对水平和稳定的当期收益，保证基金的长期安全。

投资策略 采用主动的投资管理，获得与风险相匹配的收益，同时保证组合的流动性满足正常的资金需要。

业绩比较基准 95%×中债国开债指数+5%×同业存款利率

风险收益特征 相对而言，在本报告期内，本基金短期本金安全性高，当期收益最好，长期资本增值低，总体投资风险低。

## § 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	招商银行股份有限公司
姓名	吴武泽	张燕
信息披露负责人	0755-83199066	0755-83199084
电子邮箱	cmfcfchina.com	yan_zhang@cmfcfchina.com
客户服务电话	400-887-9555	0555
传真	0755-83196045	0755-83195201

## § 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告的管理人互联网网址：<http://www.cmfcfchina.com>

基金年度报告备置地点 (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) 招商银行股份有限公司资产托管部地址：中国深圳深南大道7088号招商银行大厦

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

## 1. 招商安泰债券A

金额单位：人民币元

3.1.1期间数据和指标	2010年	2009年	2008年
本期已实现收益	50,756,850.71	7,147,092.21	12,769,001.60
本期利润	31,869,020.09	-5,129,838.39	45,698,325.43
加权平均基金份额本期利润	0.0412	-0.0144	0.1208
本期基金份额净值增长率	5.41%	1.92%	8.27%

3.1.2期间的数据和指标

2010年末 2009年末 2008年末

期末可供分配基金份额利润 0.1116 0.1099 0.0752

期末基金资产净值 1,190,019,548.30 312,879,853.20 973,111,889.51

期末基金份额净值 1.1564 1.1571 1.1553

## 2. 招商安泰债券B

金额单位：人民币元

3.1.1期间数据和指标	2010年	2009年	2008年
本期已实现收益	31,317,607.89	-3,047,907.39	7,935,128.99
本期利润	23,442,418.77	-38,236,506.93	28,241,157.68
本期基金份额净值增长率	0.0431	-0.0678	0.1179
加权平均基金份额本期利润	4.86%	1.45%	7.76%

3.1.2期间的数据和指标

2010年末 2009年末 2008年末

期末可供分配基金份额利润 0.0775 0.0619 0.0328

期末基金资产净值 334,083,218.88 187,079,931.27 2,287,558,620.63

期末基金份额净值 1.1511 1.1378 1.1215

## 注：本基金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原始数据；

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.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本期利润的孰低数；

## 3.2 基金净值表现

3.2.1基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

注：本基金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原始数据；

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.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本期利润的孰低数；

## 3.2.2基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

注：本基金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原始数据；

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.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本期利润的孰低数；

## 3.2.3过去五年每年净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

注：本基金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原始数据；

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.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本期利润的孰低数；

## 3.2.4过去五年每年净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

注：本基金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原始数据；

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.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本期利润的孰低数；

## 3.2.5过去五年每年净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

注：本基金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原始数据；

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.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本期利润的孰低数；

## 3.2.6过去五年每年净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

注：本基金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原始数据；

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.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本期利润的孰低数；

## 3.2.7过去五年每年净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

注：本基金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原始数据；

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.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本期利润的孰低数；

## 3.2.8过去五年每年净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

注：本基金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原始数据；

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.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本期利润的孰低数；

## 3.2.9过去五年每年净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

注：本基金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原始数据；

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.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本期利润的孰低数；

## 3.2.10过去五年每年净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

注：本基金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原始数据；

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.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本期利润的孰低数；

## 3.2.11过去五年每年净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

注：本基金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原始数据；

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