

## 招商核心价值混合型证券投资基金

## [2012] 第二季度报告

基金经理人: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

报告书出日期:2012年7月19日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事声明: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责任。

基金托管人声明:中国人寿财产保险有限公司根据本基金合同有关规定,于2012年7月17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。

基金净值在任何时候并不代表其真实价值,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、净值表现和投资组合报告等文件。

本报告期自2012年4月1日起至6月30日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	招的核心价值混合
基金主代码	217009
交易代码	510150
基金运作方式	契约型开放式(ETF)
基金合同生效日	2007年3月30日
报告期末基金份额总额	4,214,725,294.42份

投资目标 通过核心价值选股模型,发掘价值低估的投资品种进行积极投资,通过动态的资产配置,追求组合的长期增值。

本基金采用主动管理资产配置模式。在投资策略上,本基金从三个层面进行:首先通过资产配置,坚持风格转换选股;其次通过行业配置,坚持较优的股票仓位,保持股票、地产等行业的基本配置,增加金融配置,另外增加部分小盘次新股的配置。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2012年4月1日-2012年6月30日)

1.本期已实现收益 -45,682,294.00

2.本期利润 211,789,412.23

3.加权平均基金份额本期利润 0.0495

4.期末基金份额净值 3,491,553,665.12

5.期末可供分配基金份额利润 0.8284

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将低于所列示的净值。

2.本期所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.基金净值的表现指标

4.期末基金份额净值 3,491,553,665.12

5.期末可供分配基金份额利润 0.8284&lt;/div