

招商安泰系列开放式证券投资基金之招商安泰债券投资基金

(本基金基金名称) 投资基金

2015年6月30日

重要提示

基金管理人的董事、监事、高级管理人员在虚假记载、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。本半年度报告经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签章。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年8月24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。

基金合同是约定基金投资人与基金管理人之间权利义务的法律文件。本文件不构成本基金的宣传资料，也不构成基金的要约文件。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。基金投资有风险，投资人作出投资决策前应仔细阅读基金的基本情况。

本年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期为2015年1月1日起至6月30日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称 招商安泰债券

基金代码 217003

交易方式 换购型开放式

基金合同生效日 2003年2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

报告期末基金资产净值 1,006,351,560,02份

报告期末基金份额总额 653,151,218,73份

报告期末基金资产净值 363,200,331,29份

2.2 基金产品说明

投资目标 将资金投资于固定收益类金融产品，获得与风险相配的收益，同时保证组合的流动性满足正常的现金需要。

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

业绩比较基准 95% × 中信标普国债指数 + 5% × 同业存款利率

风险收益特征 对外开放，在本系列基金中，本基金初期本产品安全性高，当期收益最好，长期资本增值低，整体投资风险低。

2.3 基金管理人和基金托管人

基金名称 招商安泰债券

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

名称 潘西丽

姓名 潘西丽

信息披露负责人 电子邮件 0755-83190666

电子邮件 em@cmfchina.com

客户服务电话 400-877-9556

传真 0755-83196475

报告期末基金资产净值 1,006,351,560,02份

报告期末基金份额总额 653,151,218,73份

报告期末基金资产净值 363,200,331,29份

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 http://www.cmfchina.com

(1) 所有基金管理人管理的公司地址:中国深圳深南大道7088号招商证券大厦25层

(2) 所有基金托管人管理的公司住所:招商银行总行:中国深圳深南大道3018号招商银行大厦

§ 3 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1 主要会计数据和财务指标

报告期 2015年1月1日 - 2015年6月30日

本期初所有者权益 41,603,950,30

本期实现收益 20,897,670,26

本期已实现收益 24,008,246,63

本期平均基金份额 0.0320

本期基金净值增长 0.0402

本期基金资产净值 3.15%

报告期 2015年6月30日

本期末所有者权益 0.0693

本期末基金份额 0.0681

本期末基金资产净值 771,237,488,10

报告期 2015年6月30日

本期末基金资产净值 427,489,194,23

报告期 2015年6月30日

本期末基金资产净值 1,198,212,013

注:1.本基金的业绩指标不包括所有买入认购或交易基的管理费用,计入费用后实际收益水平要低于所列示的收益。

2.本期已实现收益指本期利润减去本期公允价值变动收益(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后余额,本期已实现收益加上本期公允价值变动收益即为本期利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值

基金净值增长率为零且其与同期基准比较基准收益的比较

招商安泰债券A

阶段 分位数增长率 增长率标准差 业比较基准收益 标准差

过去一个月 -0.08% 0.08% 0.20% 0.06% -0.28% 0.02%

过去三个月 1.93% 0.09% 1.98% 0.10% 0.05% -0.01%

过去六个月 3.15% 0.16% 2.40% 0.10% 0.69% 0.08%

过去一年 13.41% 0.24% 5.41% 0.12% 8.00% 0.12%

过去三年 20.00% 0.16% 10.60% 0.10% 9.37% 0.08%

自基金合同生效 116.94% 0.16% 46.13% 0.11% 70.81% 0.07%

成立以来 116.94% 0.16% 46.13% 0.11% 70.81% 0.07%

注:1.本基金的业绩指标不包括所有买入认购或交易基的管理费用,计入费用后实际收益水平要低于所列示的收益。

2.本期已实现收益指本期利润减去本期公允价值变动收益(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后余额,本期已实现收益加上本期公允价值变动收益即为本期利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2.1 基金份额

基金份额净值增长率及其与同期基准比较基准收益的比较

招商安泰债券A

阶段 分位数增长率 增长率标准差 业比较基准收益 标准差

过去一个月 -0.11% 0.07% 0.20% 0.06% -0.31% 0.01%

过去三个月 1.94% 0.08% 1.88% 0.10% -0.04% -0.01%

过去六个月 3.15% 0.16% 2.40% 0.10% 0.69% 0.08%

过去一年 2.97% 0.16% 2.46% 0.10% 0.51% 0.08%

过去三年 12.98% 0.24% 6.41% 0.12% 7.57% 0.12%

过去五年 18.61% 0.16% 10.60% 0.10% 7.92% 0.08%

自基金合同生效 116.94% 0.16% 46.13% 0.11% 70.81% 0.07%

成立以来 116.94% 0.16% 46.13% 0.11% 70.81% 0.07%

注:1.本基金的业绩指标不包括所有买入认购或交易基的管理费用,计入费用后实际收益水平要低于所列示的收益。

2.本期已实现收益指本期利润减去本期公允价值变动收益(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后余额,本期已实现收益加上本期公允价值变动收益即为本期利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2.2 基金净值

基金净值增长率为零且其与同期基准比较基准收益的比较

招商安泰债券A

阶段 分位数增长率 增长率标准差 业比较基准收益 标准差

过去一个月 -0.11% 0.07% 0.20% 0.06% -0.31% 0.01%

过去三个月 1.93% 0.09% 1.98% 0.10% 0.05% -0.01%

过去六个月 3.15% 0.16% 2.40% 0.10% 0.69% 0.08%

过去一年 2.97% 0.16% 2.46% 0.10% 0.51% 0.08%

过去三年 12.98% 0.24% 6.41% 0.12% 7.57% 0.12%

过去五年 18.61% 0.16% 10.60% 0.10% 7.92% 0.08%

自基金合同生效 116.94% 0.16% 46.13% 0.11% 70.81% 0.07%

成立以来 116.94% 0.16% 46.13% 0.11% 70.81% 0.07%

注:1.本基金的业绩指标不包括所有买入认购或交易基的管理费用,计入费用后实际收益水平要低于所列示的收益。

2.本期已实现收益指本期利润减去本期公允价值变动收益(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后余额,本期已实现收益加上本期公允价值变动收益即为本期利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2.3 管理人报告

4.1 基金管理人及其管理基金的经营情况

招商基金管理有限公司于2002年12月21日经中国证监会(2002)100号文批准设立,目前,公司注册资本人民币5亿元,其中,招商银行股份有限公司持有公司全部股权95%,招商证券股份有限公司持有公司全部股权5%。

截至2015年6月30日,本基金管理人共管理53只共同基金,具体情况如下:

基金名称 基金类型 基金成立日

招商安泰债券A 普通型开放式 2003-4-28

招商安泰债券B 普通型开放式 2003-4-28

招商安泰货币基金 普通型开放式 2003-4-28