

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
报告送出日期:2009年01月21日
§1 重要提示
基金管理人的董事会及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责任。

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2009年01月16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仔细阅读本基金的招股说明书。

本报告自2009年10月22日起生效,至2009年12月31日止。

§2 基金产品概况
基金简称:招商安心收益
交易代码:217011
基金运作方式:契约型开放式

Table with 2 columns: Item and Value. Includes details like 基金简称, 交易代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, 报告期末基金份额总额, 投资目标, 投资策略, 业绩比较基准, 风险收益特征, 基金管理人, 基金托管人.

§3 主要财务指标和基金净值表现
3.1 主要财务指标
单位:人民币元

Table with 2 columns: 主要财务指标 and 报告期(2008年10月22日-2008年12月31日). Rows include 1.本期已实现收益, 2.本期利润, 3.加权平均基金份额本期利润, 4.期末基金资产净值, 5.期末基金份额净值.

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.于2008年10月22日本基金合同开始生效,截至2008年12月31日未满一季报。

3.2 基金净值表现
3.2.1 本基金报告期内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

Table with 6 columns: 阶段, 净值增长率①, 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. Rows for 过去三个月 and 过去六个月.

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金累计份额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

招商安心收益债券型证券投资基金

2008 第四季度报告

2008年12月31日

法定存款准备金率,合计下调贷款基准利率189bps,下调存款准备金率225bps。央行连续降息使得债券收益率大幅度下行,以国债为例,12月份各期限收益率相比9月份大幅度下降,平均下降100bps以上,其中以超长期下降幅度最大,3年期下降幅度超过200bps以上,而长期下降幅度较小,呈现陡峭化的趋势。本基金于10月底正式成立,正处于央行降息周期之内,有幸分享了债券收益率下行的机会。

国债各期限收益率变化情况

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%).

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%).

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.8.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票。

5.8.3 其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元).

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分无。

§6 开放式基金份额变动
单位:份

Table with 2 columns: 基金合同生效日基金份额总额, 基金合同生效日至报告期末基金份额总额.

注:本基金合同生效日为2008年10月22日。

§7 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录
1.中国证监会批准招商安心收益债券型证券投资基金设立的文件;

8.2 存放地点
招商基金管理有限公司
地址:中国深圳深南路7088号招商银行大厦

8.3 查阅方式
基金选定的信息披露报纸名称:上海证券报,证券时报

8.4 网址
招商基金管理有限公司
2009年01月21日

注:1.根据基金合同的规定,本基金对债券等固定收益类品种的投资比例不低于基金资产的80% (其中,企业债投资比例为0-40%,可转债投资比例为0-40%)。股票等权益类品种的投资比例不高于基金资产的20%。现金或到期日在一年以内的政府债券不低于5%。截至2008年12月31日,本基金投资于债券等固定收益类品种的投资比例为117.800% (其中,企业债投资比例为21.94%,可转债投资比例为0.15%)。股票等权益类品种的投资比例为0%。现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例为7.02%。上述各项投资比例均符合基金合同的规定。

2.本基金于2008年10月22日成立,至2008年12月31日未满一年。

3.本基金的建仓期为2008年10月22日至2009年4月21日。

4.1 基金经理 (或基金经理小组) 简介

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理期限(任职日期, 离任日期), 证券从业年限, 说明.

4.2 管理人及基金经理承诺
4.2.1 公平交易制度的执行情况

4.2.2 投资管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

4.2.3 公平交易专项说明

4.2.4 公平交易制度的执行情况

4.2.5 投资管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

4.2.6 公平交易专项说明

4.2.7 公平交易制度的执行情况

4.2.8 投资管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

4.2.9 公平交易专项说明

4.2.10 公平交易制度的执行情况

4.2.11 投资管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

4.2.12 公平交易专项说明

4.2.13 公平交易制度的执行情况

4.2.14 投资管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

4.2.15 公平交易专项说明

4.2.16 公平交易制度的执行情况

4.2.17 投资管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

4.2.18 公平交易专项说明

4.2.19 公平交易制度的执行情况

4.2.20 投资管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

4.2.21 公平交易专项说明

4.2.22 公平交易制度的执行情况

4.2.23 投资管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

4.2.24 公平交易专项说明

4.2.25 公平交易制度的执行情况

4.2.26 投资管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

4.2.27 公平交易专项说明

4.2.28 公平交易制度的执行情况

4.2.29 投资管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

4.2.30 公平交易专项说明

4.2.31 公平交易制度的执行情况

4.2.32 投资管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

4.2.33 公平交易专项说明

4.2.34 公平交易制度的执行情况

4.2.35 投资管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

4.2.36 公平交易专项说明

4.2.37 公平交易制度的执行情况

4.2.38 投资管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

4.2.39 公平交易专项说明

4.2.40 公平交易制度的执行情况

4.2.41 投资管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

4.2.42 公平交易专项说明

4.2.43 公平交易制度的执行情况

4.2.44 投资管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

4.2.45 公平交易专项说明

4.2.46 公平交易制度的执行情况

4.2.47 投资管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

4.2.48 公平交易专项说明

4.2.49 公平交易制度的执行情况

4.2.50 投资管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

4.2.51 公平交易专项说明

4.2.52 公平交易制度的执行情况

4.2.53 投资管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

4.2.54 公平交易专项说明

4.2.55 公平交易制度的执行情况

4.2.56 投资管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

4.2.57 公平交易专项说明

4.2.58 公平交易制度的执行情况

4.2.59 投资管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

4.2.60 公平交易专项说明

4.2.61 公平交易制度的执行情况

4.2.62 投资管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

4.2.63 公平交易专项说明

4.2.64 公平交易制度的执行情况

4.2.65 投资管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

4.2.66 公平交易专项说明

4.2.67 公平交易制度的执行情况

4.2.68 投资管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

4.2.69 公平交易专项说明

4.2.70 公平交易制度的执行情况

4.2.71 投资管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

4.2.72 公平交易专项说明

4.2.73 公平交易制度的执行情况

4.2.74 投资管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

4.2.75 公平交易专项说明

4.2.76 公平交易制度的执行情况

4.2.77 投资管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

4.2.78 公平交易专项说明

4.2.79 公平交易制度的执行情况

4.2.80 投资管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

4.2.81 公平交易专项说明

4.2.82 公平交易制度的执行情况

4.2.83 投资管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

4.2.84 公平交易专项说明

4.2.85 公平交易制度的执行情况

4.2.86 投资管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

4.2.87 公平交易专项说明

4.2.88 公平交易制度的执行情况

4.2.89 投资管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

4.2.90 公平交易专项说明

4.2.91 公平交易制度的执行情况

4.2.92 投资管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

4.2.93 公平交易专项说明

4.2.94 公平交易制度的执行情况

4.2.95 投资管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

4.2.96 公平交易专项说明

4.2.97 公平交易制度的执行情况

4.2.98 投资管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

4.2.99 公平交易专项说明

4.2.100 公平交易制度的执行情况

4.2.101 投资管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

4.2.102 公平交易专项说明

4.2.103 公平交易制度的执行情况

4.2.104 投资管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

4.2.105 公平交易专项说明

4.2.106 公平交易制度的执行情况

4.2.107 投资管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

4.2.108 公平交易专项说明

4.2.109 公平交易制度的执行情况

4.2.110 投资管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

4.2.111 公平交易专项说明

4.2.112 公平交易制度的执行情况

4.2.113 投资管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

4.2.114 公平交易专项说明

4.2.115 公平交易制度的执行情况

4.2.116 投资管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

4.2.117 公平交易专项说明

4.2.118 公平交易制度的执行情况

4.2.119 投资管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

4.2.120 公平交易专项说明

4.2.121 公平交易制度的执行情况

4.2.122 投资管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

4.2.123 公平交易专项说明

4.2.124 公平交易制度的执行情况

4.2.125 投资管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

4.2.126 公平交易专项说明

4.2.127 公平交易制度的执行情况

4.2.128 投资管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

4.2.129 公平交易专项说明

4.2.130 公平交易制度的执行情况

4.2.131 投资管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

4.2.132 公平交易专项说明

4.2.133 公平交易制度的执行情况

4.2.134 投资管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

4.2.135 公平交易专项说明

4.2.136 公平交易制度的执行情况

4.2.137 投资管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

4.2.138 公平交易专项说明

4.2.139 公平交易制度的执行情况

4.2.140 投资管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

4.2.141 公平交易专项说明

4.2.142 公平交易制度的执行情况

4.2.143 投资管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

4.2.144 公平交易专项说明

4.2.145 公平交易制度的执行情况

4.2.146 投资管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

4.2.147 公平交易专项说明

4.2.148 公平交易制度的执行情况

4.2.149 投资管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

4.2.150 公平交易专项说明

4.2.151 公平交易制度的执行情况

4.2.152 投资管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

4.2.153 公平交易专项说明

4.2.154 公平交易制度的执行情况

4.2.155 投资管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

4.2.156 公平交易专项说明

4.2.157 公平交易制度的执行情况

4.2.158 投资管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

4.2.159 公平交易专项说明

4.2.160 公平交易制度的执行情况

4.2.161 投资管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

4.2.162 公平交易专项说明

4.2.163 公平交易制度的执行情况

4.2.164 投资管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

4.2.165 公平交易专项说明

4.2.166 公平交易制度的执行情况

4.2.167 投资管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

4.2.168 公平交易专项说明

4.2.169 公平交易制度的执行情况

4.2.170 投资管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

4.2.171 公平交易专项说明

4.2.172 公平交易制度的执行情况

4.2.173 投资管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

4.2.174 公平交易专项说明

4.2.175 公平交易制度的执行情况

4.2.176 投资管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

4.2.177 公平交易专项说明

4.2.178 公平交易制度的执行情况

4.2.179 投资管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

4.2.180 公平交易专项说明

4.2.181 公平交易制度的执行情况

4.2.182 投资管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

4.2.183 公平交易专项说明

4.2.184 公平交易制度的执行情况

4.2.185 投资管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

4.2.186 公平交易专项说明

4.2.187 公平交易制度的执行情况

4.2.188 投资管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明