

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
基金合同生效日期:2012年3月27日
重要提示:基金管理人招商基金管理有限公司的董事会、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...

基金管理人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2012年3月23日发布了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告摘要、投资组合报告等内容,保证其中内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏...

本年度报告摘要摘自年度报告全文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告全文。
本报告中财务资料已经审计,瑞华会计师事务所为本基金财务出具了2011年度无保留意见的审计报告,请投资者注意意见。

本报告自2011年1月1日起至2012年3月31日止。
§2 基金简介

Table with 2 columns: Item (基金基本情况, 基金管理人, 基金托管人, etc.) and Content (招商安泰债券, 招商基金管理有限公司, etc.)

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

2.2 基金业绩
业绩比较基准:95%*中信标普国债指数+5%*上证国债指数
风险收益特征:在本系列基金中,本基金定期本金安全性高,当期收益最好,长期资本增值低,总体投资风险较低

Table with 2 columns: Item (基金管理人, 基金托管人) and Content (招商基金管理有限公司, 招商银行股份有限公司)

2.4 信息披露方式
信息披露网站:www.zsfund.com.cn
基金年度报告备置地点:招商基金管理有限公司
基金年度报告备置地址:中国深圳南山大道7088号招商大厦

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要财务指标
招商安泰债券A
单位:人民币元

Table with 5 columns: Item (1.1 期间数据指标, 2011年, 2010年, 2009年), Content (本期已实现收益, 本期利润, etc.)

Table with 5 columns: Item (3.1.2 期末数据指标, 2011年末, 2010年末, 2009年末), Content (期末可供分配基金份额总额, 期末基金份额净值, etc.)

Table with 5 columns: Item (2. 招商安泰债券B), Content (本期已实现收益, 本期利润, etc.)

Table with 5 columns: Item (3.1.2 期末数据指标, 2011年末, 2010年末, 2009年末), Content (期末可供分配基金份额总额, 期末基金份额净值, etc.)

Table with 5 columns: Item (2. 招商安泰债券B), Content (本期已实现收益, 本期利润, etc.)

Table with 5 columns: Item (3.1.2 期末数据指标, 2011年末, 2010年末, 2009年末), Content (期末可供分配基金份额总额, 期末基金份额净值, etc.)

Table with 5 columns: Item (2. 招商安泰债券B), Content (本期已实现收益, 本期利润, etc.)

Table with 5 columns: Item (3.1.2 期末数据指标, 2011年末, 2010年末, 2009年末), Content (期末可供分配基金份额总额, 期末基金份额净值, etc.)

Table with 5 columns: Item (2. 招商安泰债券B), Content (本期已实现收益, 本期利润, etc.)

Table with 5 columns: Item (3.1.2 期末数据指标, 2011年末, 2010年末, 2009年末), Content (期末可供分配基金份额总额, 期末基金份额净值, etc.)

Table with 5 columns: Item (2. 招商安泰债券B), Content (本期已实现收益, 本期利润, etc.)

Table with 5 columns: Item (3.1.2 期末数据指标, 2011年末, 2010年末, 2009年末), Content (期末可供分配基金份额总额, 期末基金份额净值, etc.)

Table with 5 columns: Item (2. 招商安泰债券B), Content (本期已实现收益, 本期利润, etc.)

Table with 5 columns: Item (3.1.2 期末数据指标, 2011年末, 2010年末, 2009年末), Content (期末可供分配基金份额总额, 期末基金份额净值, etc.)

Table with 5 columns: Item (2. 招商安泰债券B), Content (本期已实现收益, 本期利润, etc.)

Table with 5 columns: Item (3.1.2 期末数据指标, 2011年末, 2010年末, 2009年末), Content (期末可供分配基金份额总额, 期末基金份额净值, etc.)

Table with 5 columns: Item (2. 招商安泰债券B), Content (本期已实现收益, 本期利润, etc.)

Table with 5 columns: Item (3.1.2 期末数据指标, 2011年末, 2010年末, 2009年末), Content (期末可供分配基金份额总额, 期末基金份额净值, etc.)

Table with 5 columns: Item (2. 招商安泰债券B), Content (本期已实现收益, 本期利润, etc.)

Table with 5 columns: Item (3.1.2 期末数据指标, 2011年末, 2010年末, 2009年末), Content (期末可供分配基金份额总额, 期末基金份额净值, etc.)

Table with 5 columns: Item (2. 招商安泰债券B), Content (本期已实现收益, 本期利润, etc.)

Table with 5 columns: Item (3.1.2 期末数据指标, 2011年末, 2010年末, 2009年末), Content (期末可供分配基金份额总额, 期末基金份额净值, etc.)

Table with 5 columns: Item (2. 招商安泰债券B), Content (本期已实现收益, 本期利润, etc.)

Table with 5 columns: Item (3.1.2 期末数据指标, 2011年末, 2010年末, 2009年末), Content (期末可供分配基金份额总额, 期末基金份额净值, etc.)

Table with 5 columns: Item (2. 招商安泰债券B), Content (本期已实现收益, 本期利润, etc.)

Table with 5 columns: Item (3.1.2 期末数据指标, 2011年末, 2010年末, 2009年末), Content (期末可供分配基金份额总额, 期末基金份额净值, etc.)

Table with 5 columns: Item (2. 招商安泰债券B), Content (本期已实现收益, 本期利润, etc.)

Table with 5 columns: Item (3.1.2 期末数据指标, 2011年末, 2010年末, 2009年末), Content (期末可供分配基金份额总额, 期末基金份额净值, etc.)

Table with 5 columns: Item (2. 招商安泰债券B), Content (本期已实现收益, 本期利润, etc.)

Table with 5 columns: Item (3.1.2 期末数据指标, 2011年末, 2010年末, 2009年末), Content (期末可供分配基金份额总额, 期末基金份额净值, etc.)

Table with 5 columns: Item (2. 招商安泰债券B), Content (本期已实现收益, 本期利润, etc.)

Table with 5 columns: Item (3.1.2 期末数据指标, 2011年末, 2010年末, 2009年末), Content (期末可供分配基金份额总额, 期末基金份额净值, etc.)

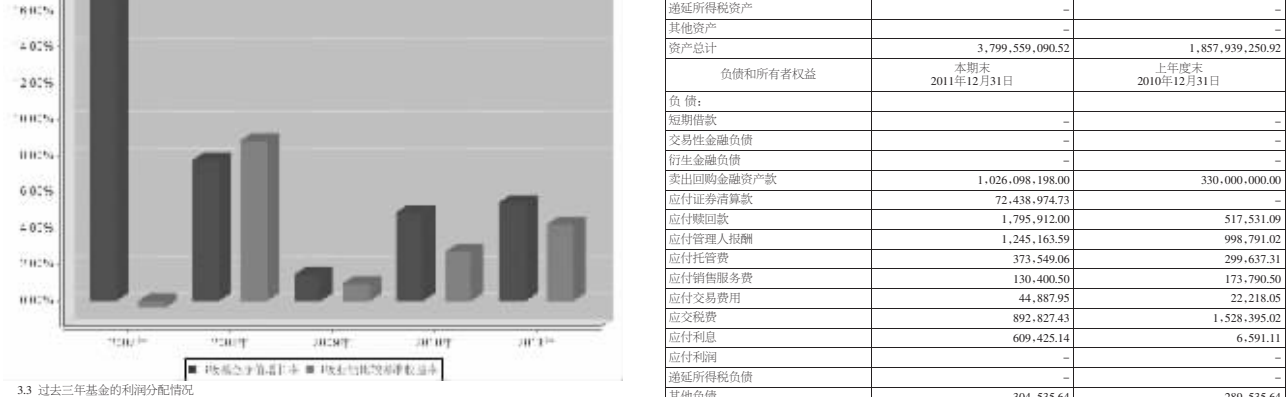
Table with 5 columns: Item (2. 招商安泰债券B), Content (本期已实现收益, 本期利润, etc.)

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
(本系列基金由招商安泰股票证券投资基金、招商安泰平衡证券投资基金和招商安泰债券投资基金组成)

2011 年度 报告摘要

2011年12月31日

回顾过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况
招商安泰债券A
单位:人民币元

Table with 5 columns: Year (2011, 2010, 2009), Content (基金份额, 现金形式发放总额, etc.)

Table with 5 columns: Year (2011, 2010, 2009), Content (基金份额, 现金形式发放总额, etc.)

Table with 5 columns: Year (2011, 2010, 2009), Content (基金份额, 现金形式发放总额, etc.)

Table with 5 columns: Year (2011, 2010, 2009), Content (基金份额, 现金形式发放总额, etc.)

Table with 5 columns: Year (2011, 2010, 2009), Content (基金份额, 现金形式发放总额, etc.)

Table with 5 columns: Year (2011, 2010, 2009), Content (基金份额, 现金形式发放总额, etc.)

Table with 5 columns: Year (2011, 2010, 2009), Content (基金份额, 现金形式发放总额, etc.)

Table with 5 columns: Year (2011, 2010, 2009), Content (基金份额, 现金形式发放总额, etc.)

Table with 5 columns: Year (2011, 2010, 2009), Content (基金份额, 现金形式发放总额, etc.)

Table with 5 columns: Year (2011, 2010, 2009), Content (基金份额, 现金形式发放总额, etc.)

Table with 5 columns: Year (2011, 2010, 2009), Content (基金份额, 现金形式发放总额, etc.)

Table with 5 columns: Year (2011, 2010, 2009), Content (基金份额, 现金形式发放总额, etc.)

Table with 5 columns: Year (2011, 2010, 2009), Content (基金份额, 现金形式发放总额, etc.)

Table with 5 columns: Year (2011, 2010, 2009), Content (基金份额, 现金形式发放总额, etc.)

Table with 5 columns: Year (2011, 2010, 2009), Content (基金份额, 现金形式发放总额, etc.)

Table with 5 columns: Year (2011, 2010, 2009), Content (基金份额, 现金形式发放总额, etc.)

Table with 5 columns: Year (2011, 2010, 2009), Content (基金份额, 现金形式发放总额, etc.)

Table with 5 columns: Year (2011, 2010, 2009), Content (基金份额, 现金形式发放总额, etc.)

Table with 5 columns: Year (2011, 2010, 2009), Content (基金份额, 现金形式发放总额, etc.)

Table with 5 columns: Year (2011, 2010, 2009), Content (基金份额, 现金形式发放总额, etc.)

Table with 5 columns: Year (2011, 2010, 2009), Content (基金份额, 现金形式发放总额, etc.)

Table with 5 columns: Year (2011, 2010, 2009), Content (基金份额, 现金形式发放总额, etc.)

Table with 5 columns: Year (2011, 2010, 2009), Content (基金份额, 现金形式发放总额, etc.)

Table with 5 columns: Year (2011, 2010, 2009), Content (基金份额, 现金形式发放总额, etc.)

Table with 5 columns: Year (2011, 2010, 2009), Content (基金份额, 现金形式发放总额, etc.)

Table with 5 columns: Year (2011, 2010, 2009), Content (基金份额, 现金形式发放总额, etc.)

Table with 5 columns: Year (2011, 2010, 2009), Content (基金份额, 现金形式发放总额, etc.)

Table with 5 columns: Year (2011, 2010, 2009), Content (基金份额, 现金形式发放总额, etc.)

Table with 5 columns: Year (2011, 2010, 2009), Content (基金份额, 现金形式发放总额, etc.)

Table with 5 columns: Year (2011, 2010, 2009), Content (基金份额, 现金形式发放总额, etc.)

Table with 5 columns: Year (2011, 2010, 2009), Content (基金份额, 现金形式发放总额, etc.)

Table with 5 columns: Year (2011, 2010, 2009), Content (基金份额, 现金形式发放总额, etc.)

Table with 5 columns: Year (2011, 2010, 2009), Content (基金份额, 现金形式发放总额, etc.)

Table with 5 columns: Year (2011, 2010, 2009), Content (基金份额, 现金形式发放总额, etc.)

Table with 5 columns: Year (2011, 2010, 2009), Content (基金份额, 现金形式发放总额, etc.)

Table with 5 columns: Year (2011, 2010, 2009), Content (基金份额, 现金形式发放总额, etc.)

Table with 2 columns: Item (招商基金管理有限公司, 招商银行股份有限公司), Content (514,038.81, 261,560.58, etc.)

注:基金的申购服务费及申购服务费分期收费方式:招商安泰债券A计入申购服务费,招商安泰债券B按前一日本基金资产净值0.30%的费率逐日计提申购服务费,其计算公式为:招商安泰债券B申购服务费=前一日本基金资产净值*0.30%*365

7.4.4.3 与关联方进行银行间债券市场的债券 回购/ 交易
7.4.4.4 报告期内本基金管理人及其他关联方投资本基金的情况
7.4.4.5 关联方投资本基金的情况

7.4.4.6 报告期内本基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
7.4.4.7 本报告期末及上年度末本基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
7.4.4.8 本报告期末及上年度末本基金管理人及其他关联方投资本基金的情况
7.4.4.9 本报告期末及上年度末本基金管理人及其他关联方投资本基金的情况

Table with 2 columns: Item (关联方名称, 招商银行), Content (2011年1月1日至2011年12月31日, 2010年1月1日至2010年12月31日)

注:本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管,按银行同期利率计息。
7.4.8.6 本基金在承销期间参与关联方承销证券的情况
7.4.8.7 本基金在承销期间及上年度末期间无承销期间与关联方承销证券的情况

7.4.9 期末 2011年12月31日 本基金持有的流通受限证券
7.4.9.1 报告期内被质押证券期末未持有流通受限证券
7.4.9.2 期末持有的暂时停牌股票流通受限证券
7.4.9.3 期末持有的暂时停牌股票流通受限证券
7.4.9.4 期末持有的暂时停牌股票流通受限证券

Table with 5 columns: Item (债券代码, 债券名称, 到期日期, 期末估值价值, 数量(张), 期末估值总额)

7.4.9.5 交易所市场债券正回购
截至本报告期末2011年12月31日,本基金从事债券正回购交易形成的卖出回购证券余额人民币518,100,000.00元,分别于2012年2月4日,3月1日,3月13日,3月16日和30日先后到期,该笔交易要求基金在回购期间持有的在新质押式回购下为质押的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他重要事项
本基金本报告期末与上年度末相比没有有助于理解和分析会计报表的其他重要事项。
§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况
单位:人民币元

Table with 5 columns: Item (序号, 权益投资, 金额, 占基金资产净值的比例), Content (1 权益投资, 2 其中:股票, etc.)

Table with 5 columns: Item (序号, 固定收益投资, 金额, 占基金资产净值的比例), Content (1 固定收益投资, 2 其中:债券, etc.)

Table with 5 columns: Item (序号, 买入返售金融资产, 金额, 占基金资产净值的比例), Content (1 买入返售金融资产, 2 其中:买入返售金融资产的买入返售金融资产)

Table with 5 columns: Item (序号, 银行存款和结算备付金合计, 金额, 占基金资产净值的比例), Content (1 银行存款和结算备付金合计, 2 其他货币资金)

Table with 5 columns: Item (序号, 期末资产净值及公允价值, 金额, 占基金资产净值的比例), Content (1 期末资产净值及公允价值, 2 其他货币资金)

Table with 5 columns: Item (序号, 期末负债合计, 金额, 占基金资产净值的比例), Content (1 期末负债合计, 2 其他货币资金)

Table with 5 columns: Item (序号, 期末基金份额持有人持有的基金份额, 金额, 占基金资产净值的比例), Content (1 期末基金份额持有人持有的基金份额, 2 其他货币资金)

Table with 5 columns: Item (序号, 期末基金份额持有人持有的基金份额, 金额, 占基金资产净值的比例), Content (1 期末基金份额持有人持有的基金份额, 2 其他货币资金)

Table with 5 columns: Item (序号, 期末基金份额持有人持有的基金份额, 金额, 占基金资产净值的比例), Content (1 期末基金份额持有人持有的基金份额, 2 其他货币资金)

Table with 5 columns: Item (序号, 期末基金份额持有人持有的基金份额, 金额, 占基金资产净值的比例), Content (1 期末基金份额持有人持有的基金份额, 2 其他货币资金)

Table with 5 columns: Item (序号, 期末基金份额持有人持有的基金份额, 金额, 占基金资产净值的比例), Content (1 期末基金份额持有人持有的基金份额, 2 其他货币资金)

Table with 5 columns: Item (序号, 期末基金份额持有人持有的基金份额, 金额, 占基金资产净值的比例), Content (1 期末基金份额持有人持有的基金份额, 2 其他货币资金)

Table with 5 columns: Item (序号, 期末基金份额持有人持有的基金份额, 金额, 占基金资产净值的比例), Content (1 期末基金份额持有人持有的基金份额, 2 其他货币资金)

Table with 5 columns: Item (序号, 期末基金份额持有人持有的基金份额, 金额, 占基金资产净值的比例), Content (1 期末基金份额持有人持有的基金份额, 2 其他货币资金)

Table with 5 columns: Item (序号, 期末基金份额持有人持有的基金份额, 金额, 占基金资产净值的比例), Content (1 期末基金份额持有人持有的基金份额, 2 其他货币资金)

Table with 5 columns: Item (序号, 期末基金份额持有人持有的基金份额, 金额, 占基金资产净值的比例), Content (1 期末基金份额持有人持有的基金份额, 2 其他货币资金)

Table with 5 columns: Item (序号, 期末基金份额持有人持有的基金份额, 金额, 占基金资产净值的比例), Content (1 期末基金份额持有人持有的基金份额, 2 其他货币资金)

Table with 5 columns: Item (序号, 期末基金份额持有人持有的基金份额, 金额, 占基金资产净值的比例), Content (1 期末基金份额持有人持有的基金份额, 2 其他货币资金)

Table with 5 columns: Item (序号, 期末基金份额持有人持有的基金份额, 金额, 占基金资产净值的比例), Content (1 期末基金份额持有人持有的基金份额, 2 其他货币资金)

Table with 5 columns: Item (序号, 期末基金份额持有人持有的基金份额, 金额, 占基金资产净值的比例), Content (1 期末基金份额持有人持有的基金份额, 2 其他货币资金)

Table with 5 columns: Item (序号, 期末基金份额持有人持有的基金份额, 金额, 占基金资产净值的比例), Content (1 期末基金份额持有人持有的基金份额, 2 其他货币资金)

Table with 5 columns: Item (序号, 期末基金份额持有人持有的基金份额, 金额, 占基金资产净值的比例), Content (1 期末基金份额持有人持有的基金份额, 2 其他货币资金)

Table with 5 columns: Item (序号, 期末基金份额持有人持有的基金份额, 金额, 占基金资产净值的比例), Content (1 期末基金份额持有人持有的基金份额, 2 其他货币资金)

Table with 5 columns: Item (序号, 期末基金份额持有人持有的基金份额, 金额, 占基金资产净值的比例), Content (1 期末基金份额持有人持有的基金份额, 2 其他货币资金)

Table with 5 columns: Item (序号, 期末基金份额持有人持有的基金份额, 金额, 占基金资产净值的比例), Content (1 期末基金份额持有人持有的基金份额, 2 其他货币资金)

Table with 5 columns: Item (序号, 期末基金份额持有人持有的基金份额, 金额, 占基金资产净值的比例), Content (1 期末基金份额持有人持有的基金份额, 2 其他货币资金)

Table with 5 columns: Item (序号, 期末基金份额持有人持有的基金份额, 金额, 占基金资产净值的比例), Content (1 期末基金份额持有人持有的基金份额, 2 其他货币资金)

Table with 5 columns: Item (序号, 期末基金份额持有人持有的基金份额, 金额, 占基金资产净值的比例), Content (1 期末基金份额持有人持有的基金份额, 2 其他货币资金)

Table with 5 columns: Item (序号, 期末基金份额持有人持有的基金份额, 金额, 占基金资产净值的比例), Content (1 期末基金份额持有人持有的基金份额, 2 其他货币资金)

Table with 5 columns: Item (序号, 期末基金份额持有人持有的基金份额, 金额, 占基金资产净值的比例), Content (1 期末基金份额持有人持有的基金份额, 2 其他货币资金)

Table with 5 columns: Item (序号, 期末基金份额持有人持有的基金份额, 金额, 占基金资产净值的比例), Content (1 期末基金份额持有人持有的基金份额, 2 其他货币资金)

Table with 5 columns: Item (序号, 期末基金份额持有人持有的基金份额, 金额, 占基金资产净值的比例), Content (1 期末基金份额持有人持有的基金份额, 2 其他货币资金)

Table with 5 columns: Item (序号, 期末基金份额持有人持有的基金份额, 金额, 占基金资产净值的比例), Content (1 期末基金份额持有人持有的基金份额, 2 其他货币资金)

Table with 5 columns: Item (序号, 期末基金份额持有人持有的基金份额, 金额, 占基金资产净值的比例), Content (1 期末基金份额持有人持有的基金份额, 2 其他货币资金)