招商安盈保本混合型证券投资基金

2014 半年度报告摘要

2014年6月30日

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
送出日期:2014年8月27日

§1 重要提示

基金管理人的董事会、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，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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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2014年8月20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应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本半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 。

本报告期自2014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

基金简称	招商安盈保本混合
基金主代码	217024
交易代码	217024
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年8月20日
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
报告期末基金份额总额	2,014,807,999.80份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过运用投资组合保险技术，控制本金损失的风险，寻求组合资产的稳定增值。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的研究优势，将严谨、规范化的基本面研究分析与积极主动的投资风格相结合，利用组合保险技术，动态调整保本资产与收益资产的投资比例，以确保基金在保本周期到期时，实现基金资产在保本基础上的保值增值目的。本基金将按照恒定比例组合保险机制将资产配置于保本资产与收益资产。本基金投资的保本资产为国内依法发行交易的债券(包括国债、央行票据和企业债、金融债、短期融资券、资产支持证券等)、货币市场工具等。本基金投资的收益资产为股票、权证、股票指数期货等。
业绩比较基准	三年期银行定期存款收益率(税后)
风险收益特征	本基金是保本混合型基金，属于证券市场中的低风险品种。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	欧志明	赵会军
	联系电话	0755-83196666	010-66105799
	电子邮箱	cmf@cmfchina.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-887-9555	95588
传真		0755-83196475	010-66105798

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
基金半年度报告备置地点	(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)中国工商银行股份有限公司 地址：中国北京市西城区复兴门内大街55号

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2014年1月1日 - 2014年6月30日)
本期已实现收益	30,200,659.99
本期利润	125,572,636.04
加权平均基金份额本期利润	0.0530
本期基金份额净值增长率	5.34%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0511
期末基金资产净值	2,146,763,974.18
期末基金份额净值	1.065

注：1、基金业绩指标不包括持有人认(申)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、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	2.50%	0.33%	0.35%	0.01%	2.15%	0.32%
过去三个月	4.31%	0.27%	1.06%	0.01%	3.25%	0.26%
过去六个月	5.34%	0.30%	2.11%	0.01%	3.23%	0.29%
过去一年	4.00%	0.32%	4.25%	0.01%	-0.25%	0.31%
自基金合同生效起至今	6.50%	0.29%	7.91%	0.01%	-1.41%	0.28%

注：业绩比较基准收益率=三年期银行定期存款收益率(税后)。

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

注：根据基金合同的规定：本基金将按照恒定比例组合保险机制将资产配置于保本资产与收益资产。本基金的投资组合比例为：股票等收益资产占基金资产的的比例不高于40%；债券、货币市场工具等保本资产占基金资产的比例不低于60%，其中基金保留不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。本基金于2012年8月20日成立，自基金成立日起6个月内为建仓期，建仓期结束时相关比例均符合上述规定的要求。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

招商基金管理有限公司于2002年12月27日经中国证监会(2002)100号文批准设立，公司的经营范围包括发起设立基金、基金管理业务和中国证监会批准的其它业务。

目前，本公司的股东股权结构为：招商银行股份有限公司持有公司全部股权的55%，招商证券股份有限公司持有公司全部股权的45%。公司注册资本金为2.1亿元人民币。招商基金拥有两家全资子公司，分别为招商财富资产管理有限公司和招商资产管理(香港)有限公司。

截至2014年6月30日，本基金管理人共管理三十八只共同基金，具体如下：从2003年4月28日起管理招商安泰系列开放式证券投资基金(含招商安泰股票证券投资基金、招商安泰平衡型证券投资基金、招商安泰债券投资基金)；从2004年1月14日起管理招商现金增值开放式证券投资基金；从2004年6月1日起开始管理招商先锋混合型证券投资基金；从2005年11月17日起开始管理招商优质成长股票型证券投资基金(LOF)；从2006年7月11日起开始管理招商安本增利债券型证券投资基金；从2007年3月30日起开始管理招商核心价值混合型证券投资基金；从2008年6月19日起开始管理招商大盘蓝筹股票型证券投资基金；从2008年10月22日起开始管理招商安心收益债券型证券投资基金；从2009年6月19日起开始管理招商行业领先股票型证券投资基金；从2009年12月25日起开始管理招商中小盘精选股票型证券投资基金；从2010年3月25日起开始管理招商全球资源股票型证券投资基金(QDII)；从2010年6月22日起开始管理招商深证100指数证券投资基金；从2010年6月25日起开始管理招商信用添利债券型证券投资基金；从2010年12月8日开始管理上证消费80交易型开放式指数证券投资基金及招商上证消费80交易型开放式指数证券投资基金联接基金；从2011年2月11日起开始管理招商标普金砖四国指数证券投资基金(LOF)；从2011年3月17日起开始管理招商安瑞进取债券型证券投资基金；从2011年6月27日开始管理深证电子信息传媒产业(TMT)50交易型开放式指数证券投资基金及招商深证电子信息传媒产业(TMT)50交易型开放式指数证券投资基金联接基金；从2011年9月1日起开始管理招商安达保本混合型证券投资基金；从2012年2月1日起开始管理招商优势企业灵活配置混合型证券投资基金；从2012年3月21日起开始管理招商产业债券型证券投资基金；从2012年6月28日起开始管理招商中证大宗商品股票指数分级证券投资基金；从2012年7月20日起开始管理招商信用增强债券型证券投资基金；从2012年8月20日起开始管理招商安盈保本混合型证券投资基金；从2012年12月7日起开始管理招商理财7天债券型证券投资基金；从2013年2月5日起开始管理招商央视财经50指数证券投资基金；从2013年3月1日起开始管理招商双债增强分级债券型证券投资基金；从2013年4月19日起开始管理招商安润保本混合型证券投资基金；从2013年5月17日起开始管理招商保证金快线货币市场基金；从2013年8月1日起开始管理招商沪深300高贝塔指数分级证券投资基金；从2013年11月6日起开始管理招商瑞丰灵活配置混合型发起式证券投资基金；从2013年12月11日起开始管理招商标普高收益红利贵族指数增强型证券投资基金；从2014年3月20日开始管理招商丰盛稳定增长灵活配置混合型证券投资基金；从2014年3月25日开始管理招商招财宝货币市场证券投资基金；从2014年6月18日开始管理招商招金宝货币市场证券投资基金。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
孙海波	本基金的基金经理	2012年12月6日	-	15	孙海波，男，中国国籍，经济学硕士。曾任职于南开大学计算中心及泰康人寿保险股份有限公司；1999年加入光大证券股份有限公司，曾任职于投行部、债券投资部及自营部；2004年起先后任职于万家基金管理有限公司(原天同基金)及中国基金管理有限公司(现华夏基金)的投资管理部，均从事证券投资相关工作；2007年加入中国中投证券有限责任公司，担任证券投资部副总经理，全面负责公司证券投资业务；2012年加入招商基金管理有限公司固定收益投资部，曾任招商理财7天债券型证券投资基金基金经理，现任投资管理三部副总监兼招商安心收益债券型证券投资基金、招商安盈保本混合型证券投资基金及招商安达保本混合型证券投资基金基金经理。

注：1、本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告(生效)日期；

2、证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

基金管理人声明：在本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等有关法律法规及其各项实施准则的规定以及《招商安盈保本混合型证券投资基金基金合同》等基金法律文件的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的前提下，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围以及投资运作符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

基金管理人(以下简称"公司")已建立较完善的研究方法和投资决策流程，确保各投资组合享有公平的投资决策机会。公司建立了所有组合适用的投资对象备选库，制定明确的备选库建立、维护程序。公司拥有健全的投资授权制度，明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限划分，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。公司的相关研究成果向内部所有投资组合开放，在投资研究层面不存在各投资组合间不公平的问题。公司交易部在报告期内，对所有组合的各条指令，均在中央交易员的统一分派下，本着持有人利益最大化的原则执行了公平交易。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。确因投资组合的投资策略或流动性等需要而发生的同日反向交易，公司要求相关投资组合经理提供决策依据，并留存记录备查，完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合等除外。

本报告期内，本基金各项交易均严格按照相关法律法规、基金合同的有关要求执行。报告期内，公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情形，在某指数型投资组合与某主动型投资组合之间发生过一次，原因是指数型投资组合为满足指数复制比例要求的投资策略需要。报告期内未发现其他有可能导致不公平交易和利益输送的重大异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

宏观与政策分析：

2014年上半年，经济先出现下滑，之后触底回升。年初经济大幅下滑，融资增速持续回落，实体利率维持高位，造成了投资和消费增速下滑，库存水平原本不低，需求的下降促使企业主动去库存，经济呈现量价齐跌的衰退特征。除了需求和生产下滑之外，1季度风险事件频发，银行收紧房地产非标融资、房地产销售大幅下滑、人民币短期大幅贬值以及违约事件频繁发生等风险事件加剧了市场对经济的担忧。在此情况下，政府在2季度不断推出微刺激政策来稳增长，央行多次定向降准、银监会调整存贷比计算方法、部分地区解除房地产限购以及国务院督导地方政府要有所作为等。在一系列政策刺激作用下，二季度末期经济显示出一定的企稳信号，5、6月份贷款放量，社会融资增速企稳，PMI等先行指标触底反弹。

通胀方面小幅波动，猪肉价格的短期反弹并未形成趋势，虽然供给存在较大风险，但淡季阶段价格也难以明显上涨。PPI同比回升基本是基数贡献，海外大宗价格的强势被国内工业品价格的下跌所抵消。

债券市场回顾：

在流动性逐步放松的推动下，2014年上半年利率和信用产品收益率大幅下行。1-2月份经济数据不断恶化，春节前央行主动逆回购打消了市场对资金紧张的顾虑，收益率出现明显下行，后小幅回调；4月中下旬国开行获得再贷款的消息被市场确认，结合市场预期资金利率将平稳的维持在低位，推动长端收益率大幅下行；进入6月份央行的定向降准范围不断扩大，股份制银行纷纷发布公告确认定向降准，长端收益率再次下行。

信用债走势大致相似，中高等级信用债和城投债得到市场青睐，和利率产品收益率同时下行，信用利差大幅压缩。而部分产能过剩行业和民营企业债券收益率在年初不降反升，在二季度市场风险偏好回升时收益率出现下行。

基金操作回顾：

回顾2014年上半年的基金操作，我们严格遵照基金合同的相关约定，按照既定的投资流程进行了规范运作。我们严格按照保本基金投资策略投资，在债券投资上，根据市场行情的节奏变化及时进行了合理的组合调整，在股票投资上，以低估值的蓝筹股和部分成长股投资相结合，以个股的投资为主。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为1.065元，本报告期份额净值增长率为5.34%，同期业绩基准增长率为2.11%，基金业绩超越同期业绩比较基准，幅度为3.23%。主要原因是：股票投资以绝对收益为主，及时锁定收益，同时可转债有一定贡献。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经济增长方面，政府稳增长政策可能继续出台，社会融资增速有望继续回升，经济企稳的信号可能越来越清晰。但广义货币扩张的幅度仍存在不确定性，房地产领域的下行风险难以解除，这意味着投资拉动的稳增长能否取得明显效果存在不确定性。我们预计经济可能转入稳定，但出现明显回升的可能很小。通胀方面短期仍没有明显的风险，去年3季度食品价格涨幅较大造成今年同期基数较高，CPI增速可能维持在目前平台附近波动。

展望2014年下半年的债券市场，社会融资扩张程度以及经济增长强弱将成为主要驱动因素。贷款放量的力度能否对冲非标融资的压缩将决定社会融资增速回升的幅度和持续性，也决定了经济回升的强弱力度；而流动性的定向放松能否扩张到按揭贷款领域，决定了房地产的下行风险能否得到控制，这些因素的变化都将影响利率债的走势。对信用品种而言，在经济回升之前银行间市场资金大概率将维持宽松，无论是杠杆操作的息差空间和回购融资的容易程度都意味着信用债仍具备一定的配置价值。

对2014年下半年的股票投资相对乐观，中国经济在转型过程中蕴育新的投资机会，寻找能够穿越经济周期的股票，继续看好低估值，稳定增长的相关公司，以及持续维持高增长的成长性公司，对部分传统行业的投资机会适当关注，看好移动支付、新能源汽车相关投资标的，以及互联网发展对传统行业升级改造过程中所带来的投资机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金的估值业务严格按照相关的法律法规、基金合同以及《招商基金管理有限公司基金估值委员会管理制度》进行。基金核算部负责日常的基金资产的估值业务，执行基金估值政策。另外，公司设立由投资和研究部门、风险管理部、基金核算部、法律合规部负责人和基金经理代表组成的估值委员会 。公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历。公司估值委员会主要负责制定 、修订和完善基金估值政策和程序，定期评价现有估值政策和程序的适用性及对估值程序执行情况进行监督。

投资和研究部门以及基金核算部共同负责关注相关投资品种的动态，评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种；投资和研究部门定期审核公允价值的确认和计量；研究部提出合理的数量分析模型对需要进行估值测算或者调整的投资品种进行公允价值定价与计量并定期对估值政策和程序进行评价，以保证其持续适用；基金核算部定期审核估值政策和程序的一致性，并负责与托管行沟通估值调整事项；风险管理部负责估值委员会工作流程中的风险控制；法律合规部负责日常的基金估值调整结果的事后复核监督工作；法律合规部与基金核算部共同负责估值调整事项的信息披露工作。

基金经理代表向估值委员会提供估值参考信息，参与估值政策讨论；对需采用特别估值程序的证券，基金及时启动特别估值程序，由公司估值委员会集体讨论议定特别估值方案并与托管行沟通后由基金核算部具体执行。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。截止报告期末本基金管理人未与任何外部估值定价服务机构签约。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规的规定和基金合同的约定，以及本基金的实际运作情况，本基金报告期无需进行利润分配。在符合分红条件的前提下，本基金已实现尚未分配的可供分配收益部分，将严格按照基金合同的约定适时向投资者予以分配。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2014年上半年，本基金托管人在对招商安盈保本混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2014年上半年，招商安盈保本混合型证券投资基金的管理人——招商基金管理有限公司在招商安盈保本混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，招商安盈保本混合型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对招商基金管理有限公司编制和披露的招商安盈保本混合型证券投资基金2014年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：招商安盈保本混合型证券投资基金

报告截止日：2014年6月30日

单位：人民币元

资 产	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
资 产：		
银行存款	198,480,798.58	8,819,814.21
结算备付金	45,429,376.27	57,590,201.81
存出保证金	560,279.11	846,054.92
交易性金融资产	3,022,208,370.55	4,133,008,535.84
其中：股票投资	373,447,443.27	304,533,336.46
基金投资	-	-
债券投资	2,648,760,927.28	3,828,475,199.38
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	11,816,417.94
应收利息	76,579,459.73	52,990,959.92
应收股利	-	-
应收申购款	396.20	296.45
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	3,343,258,680.44	4,265,072,281.09
负债和所有者权益	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
负 债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	1,131,814,863.05	1,464,100,000.00
应付证券清算款	51,903,822.16	-
应付赎回款	7,047,285.89	8,343,389.53
应付管理人报酬	2,145,375.86	2,947,789.78
应付托管费	357,562.63	491,298.30
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	443,464.93	1,664,629.55
应交税费	1,631,800.00	1,631,800.00
应付利息	766,151.50	1,165,958.71
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	384,380.24	311,896.31
负债合计	1,196,494,706.26	1,480,656,762.18
所有者权益：	-	-
实收基金	2,014,807,999.80	2,754,786,309.39
未分配利润	131,955,974.38	29,629,209.52
所有者权益合计	2,146,763,974.18	2,784,415,518.91
负债和所有者权益总计	3,343,258,680.44	4,265,072,281.09

注：报告截止日2014年6月30日，基金份额净值1.065元，基金份额总额2,014,807,999.80份。

6.2 利润表

会计主体：招商安盈保本混合型证券投资基金

本报告期：2014年1月1日至2014年6月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
一、收入	173,013,879.46	151,244,112.39
1.利息收入	76,018,757.63	113,283,738.24
其中：存款利息收入	432,422.78	715,429.53
债券利息收入	75,566,340.31	112,305,013.09
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	19,994.54	263,295.62
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-1,440,757.52	117,648,804.15
其中：股票投资收益	14,261,480.81	42,392,781.91
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-18,125,671.23	69,999,085.97
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	2,423,432.90	5,256,936.27
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	95,371,976.05	-82,918,008.29
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	3,063,903.30	3,229,578.29
减：二、费用	47,441,243.42	76,116,057.88
1.管理人报酬	14,558,004.50	25,541,551.04
2.托管费	2,426,334.05	4,256,925.18
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	1,653,138.94	2,119,773.61
5.利息支出	28,561,490.07	43,955,577.45
其中：卖出回购金融资产支出	28,561,490.07	43,955,577.45
6.其他费用	242,275.86	242,230.60
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	125,572,636.04	75,128,054.51
减：所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	125,572,636.04	75,128,054.51

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：招商安盈保本混合型证券投资基金

本报告期：2014年1月1日至2014年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	2,754,786,309.39	29,629,209.52	2,784,415,518.91
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	125,572,636.04	125,572,636.04
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以"-"号填列)	-739,978,309.59	-23,245,871.18	-763,224,180.77
其中：1.基金申购款	2,034,795.76	83,186.45	2,117,982.21
2.基金赎回款	-742,013,105.35	-23,329,057.63	-765,342,162.98
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动 (净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	2,014,807,999.80	131,955,974.38	2,146,763,974.18
项目	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	4,397,243,025.82	43,359,702.16	4,440,602,727.98
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	75,128,054.51	75,128,054.51
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以"-"号填列)	-609,403,421.70	-28,354,864.41	-637,758,286.11
其中：1.基金申购款	7,778,368.30	377,451.22	8,155,819.52
2.基金赎回款	-617,181,790.00	-28,732,315.63	-645,914,105.63
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动 (净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	3,787,839,604.12	90,132,892.26	3,877,972,496.38

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

______ 许小松 ______　　______ 庄永亩 ______　　____ 李扬 ____
基金管理人负责人　　主管会计工作负责人　　会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

招商安盈保本混合型证券投资基金 (以下简称"本基金") 经中国证券监督管理委员会 (以下简称"中国证监会")《关于核准招商安盈保本混合型证券投资基金募集的批复》(证监许可［2012］1048号文) 批准，由招商基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《招商安盈保本混合型证券投资基金基金合同》发售，基金合同于2012年8月20日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集规模为4,560,080,069.90份基金份额。本基金的基金管理人为招商基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司 (以下简称"中国工商银行")。

本基金于2012年8月15日至2012年8月15日募集，募集期间净认购资金人民币4,559,459,445.07元，认购资金在募集期间产生的利息人民币620,624.83元，募集的有效认购份额及利息结转的基金份额合计4,560,080,069.90份。上述募集资金已由毕马威华振会计师事务所 (特殊普通合伙) 验证，并出具了毕马威华振验字第1200001号验资报告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《招商安盈保本混合型证券投资基金基金合同》和《招商安盈保本混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行交易的债券、股票 (包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票) 、权证、货币市场工具、股票指数期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的有关规定。在正常市场情况下，本基金投资组合的比例范围为：对股票等收益资产占基金资产的比例不高于40%；债券、货币市场工具等保本资产占基金资产的比例不低于60%，其中基金保留不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为：三年期银行定期存款收益率 (税后) 。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照中华人民共和国财政部 (以下简称"财政部") 于2006年2月15日颁布的《企业会计准则-基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定 (以下合称"企业会计准则") 的要求编制，同时亦按照中国证监会公告［2010］5号《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》以及中国证券投资基金业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2014年6月30日的财务状况、自2014年1月1日至2014年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008年9月18日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1) 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不缴纳营业税；

2) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税；

3) 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴个人所得税；对基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税，暂不征收企业所得税；

4) 对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税，暂不缴纳企业所得税；

5) 对于基金从事A股买卖，出让方按0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，对受让方不再缴纳印花税；

6) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免予缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
招商基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
中国工商银行	基金托管人、基金代销机构
招商证券股份有限公司(以下简称"招商证券")	基金管理人的股东、基金代销机构

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
招商证券	66,251,254.57	6.09%	22,788,156.32	1.54%

6.4.8.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
招商证券	132,121,244.89	23.41%	125,204,367.12	6.37%

6.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
招商证券	5,136,100,000.00	15.09%	4,476,800,000.00	10.15%

6.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
招商证券	60,314.68	6.09%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
招商证券	20,746.46	1.54%	-	-

注：1、上述交易佣金比率均在合理商业条件范围内收取，并符合行业标准。

2、根据《证券交易单元及证券综合服务协议》，本基金管理人在租用招商证券股份有限公司证券交易专用交易单元进行股票、债券及回购交易的同时，还从招商证券股份有限公司获得证券研究综合服务。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	14,558,004.50	25,541,551.04
其中：支付销售机构的客户维护费	6,687,060.32	11,863,117.81

注：支付基金管理人招商基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值1.2%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金管理费=前一日基金资产净值×1.2%÷当年天数

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,426,334.05	4,256,925.18

注：支付基金托管人工商银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.2%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.2%÷当年天数

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方进行银行间同业市场的债券 (含回购) 交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	198,480,798.58	159,736.00	41,196,065.79	417,737.70

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.9 期末(2014年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量	期末成本总额	期末估值总额	备注
6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000965	天保基建	2014年5月21日	2015年5月22日	非公开发行流通受限	4.46	4.65	2,300,000	10,258,000.00	10,695,000.00	-
002727	一心堂	2014年6月25日	2014年7月2日	新股流通受限	12.20	12.20	34,975	426,695.00	426,695.00	-
603168	莎普爱思	2014年6月24日	2014年7月2日	新股流通受限	21.85	21.85	9,892	216,140.20	216,140.20	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
6.4.12.1.3 受限证券类别：权证										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：份)	期末成本总额	期末估值总额	备注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末无持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2014年6月30日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币7,899,868.15元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
101361007	13湘新天地MTN001	2014年7月22日	101.11	79,000	7,987,690.00
合计				79,000	7,987,690.00

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2014年6月30日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币1,123,914,994.90元，在2014年7月1日至7月30日间先后到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券或在新质押式回购下转入质押库的债券，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。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无需要说明有助于理解和分析财务报表的其他事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	373,447,443.27	11.17
	其中：股票	373,447,443.27	11.17
2	固定收益投资	2,648,760,927.28	79.23
	其中：债券	2,648,760,927.28	79.23
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	243,910,174.85	7.30
7	其他各项资产	77,140,135.04	2.31
8	合计	3,343,258,680.44	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	9,786,000.00	0.46
B	采矿业	-	-
C	制造业	310,345,515.32	14.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	426,695.00	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	7,291,208.00	0.34
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,807,211.60	0.32
J	金融业	5,238,084.74	0.24
K	房地产业	19,713,462.13	0.92
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	13,839,266.48	0.64
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	373,447,443.27	17.40

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600525	长园集团	10,299,550	113,707,032.00	5.30
2	000885	同力水泥	10,282,114	55,626,236.74	2.59
3	000965	天保基建	3,771,201	19,713,462.13	0.92
4	000541	佛山照明	1,699,922	16,931,223.12	0.79
5	000903	云内动力	3,499,939	16,554,711.47	0.77
6	000400	许继电气	750,000	15,037,500.00	0.70
7	000978	桂林旅游	1,999,894	13,839,266.48	0.64
8	300221	银禧科技	1,424,615	12,807,288.85	0.60
9	002020	京新药业	699,932	12,598,776.00	0.59
10	002103	广博股份	1,187,364	10,603,160.52	0.49

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于招商基金管理公司网站http://www.cmfchina.com上的半年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000965	天保基建	28,869,197.47	1.04
2	000768	中航飞机	25,945,199.11	0.93
3	600525	长园集团	21,451,800.51	0.77
4	600109	国金证券	19,583,445.98	0.70
5	600192	长城电工	19,541,766.42	0.70
6	601169	北京银行	18,104,214.39	0.65
7	000541	佛山照明	16,945,983.86	0.61
8	000400	许继电气	16,891,091.52	0.61
9	000903	云内动力	16,344,868.11	0.59
10	600688	上海石化	14,637,958.00	0.53
11	002103	广博股份	14,609,145.35	0.52
12	000001	平安银行	13,253,633.16	0.48
13	000978	桂林旅游	13,241,607.77	0.48
14	300183	东软载波	13,126,712.05	0.47
15	002020	京新药业	12,445,187.57	0.45
16	002268	卫 士 通	11,962,052.88	0.43
17	601799	星宇股份	11,577,228.38	0.42
18	000885	同力水泥	11,557,380.02	0.42
19	601633	长城汽车	10,954,844.75	0.39
20	300221	银禧科技	10,434,172.35	0.37

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票；

2、基金持有的股票分类为交易性金融资产的，本项的"累计买入金额"按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600114	东睦股份	31,295,010.90	1.12
2	600525	长园集团	28,319,493.38	1.02
3	000768	中航飞机	25,941,350.69	0.93
4	002465	海格通信	23,934,243.14	0.86
5	600109	国金证券	18,892,520.52	0.68
6	601169	北京银行	18,230,932.13	0.65
7	002100	天康生物	17,293,497.01	0.62
8	002466	天齐锂业	16,552,499.25	0.59
9	300135	宝利沥青	15,493,117.62	0.56
10	600192	长城电工	14,661,718.68	0.53
11	600879	航天电子	13,659,028.00	0.49
12	601799	星宇股份	13,404,058.51	0.48
13	300045	华力创通	13,199,525.36	0.47
14	000001	平安银行	13,039,696.14	0.47
15	002637	赞宇科技	12,349,218.86	0.44
16	002268	卫 士 通	11,908,563.84	0.43
17	002407	多氟多	11,189,268.66	0.40
18	600688	上海石化	11,175,359.63	0.40
19	300183	东软载波	10,984,233.30	0.39
20	600886	国投电力	10,464,941.76	0.38

注：1、卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票；

2、基金持有的股票分类为交易性金融资产的，本项 "累计卖出金额"按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本(成交)总额	576,975,175.98
卖出股票收入(成交)总额	521,558,151.03

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票；

2、"买入股票成本(成交)总额"、"卖出股票收入(成交)总额"均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	134,574,075.00	6.27
2	央行票据	-	-
3	金融债券	49,993,150.68	2.33
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	1,601,371,324.00	74.59
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	377,576,000.00	17.59
7	可转债	485,246,377.60	22.60
8	其他	-	-
9	合计	2,648,760,927.28	123.38

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	1282515	12龙煤控MTN1	2,100,000	206,535,000.00	9.62
2	110017	中海转债	1,880,000	176,043,200.00	8.20
3	122518	12保利集	1,500,000	148,020,000.00	6.90
4	110018	国电转债	1,300,000	135,668,000.00	6.32
5	122585	12新海连	1,300,000	130,559,000.00	6.08

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

7.11.3 本期国债期货投资评价

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库，本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	560,279.11
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	76,579,459.73
5	应收申购款	396.20
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	77,140,135.04

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	110017	中海转债	176,043,200.00	8.20
2	110018	国电转债	135,668,000.00	6.32
3	110020	南山转债	112,298,313.60	5.23
4	113001	中行转债	61,236,864.00	2.85

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000965	天保基建	10,695,000.00	0.50	非公开发行

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
10,307	195,479.58	70,008,450.00	3.47%	1,944,799,549.80	96.53%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本基金	990.23	0.0000%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2012年8月20日)基金份额总额	4,560,080,069.90
本报告期期初基金份额总额	2,754,786,309.39
本报告期基金总申购份额	2,034,795.76
减：本报告期基金总赎回份额	742,013,105.35
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
本报告期期末基金份额总额	2,014,807,999.80

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期没有举行基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、根据本基金管理人2014年3月25日的公告，经招商基金管理有限公司第四届董事会2014年第一次会议审议并通过，因工作调动，赵生章先生不再担任招商基金管理有限公司副总经理职务，全职担任招商基金管理有限公司全资子公司招商财富资产管理有限公司总经理职务。 2、本报告期内，因中国工商银行股份有限公司(以下简称"本行")工作需要，周月秋同志不再担任本行资产托管部总经理。在新任资产托管部总经理李勇同志完成证券投资基金行业高级管理人员任职资格备案手续前，由副总经理王立波同志代为行使本行资产托管部总经理部分业务授权职责。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未作改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金管理人没有受到监管部门的稽查或处罚，亦未收到关于基金管理人的高级管理人员、托管人及其高级管理人员受到监管部门的稽查或处罚的书面通知或文件。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中银国际	1	177,354,772.48	16.31%	161,464.22	16.31%	-
东方证券	1	161,602,680.30	14.86%	147,122.85	14.86%	-
西南证券	3	119,005,710.23	10.94%	108,342.88	10.94%	-
东北证券	2	81,164,113.94	7.46%	73,891.60	7.46%	-
宏源证券	2	71,161,084.76	6.54%	64,785.24	6.54%	-
中投证券	1	67,577,251.08	6.21%	61,522.92	6.21%	-
招商证券	1	66,251,254.57	6.09%	60,314.68	6.09%	-
民生证券	1	60,986,953.90	5.61%	55,522.05	5.61%	-
国元证券	1	60,851,867.81	5.60%	55,399.49	5.60%	-
国金证券	1	57,741,998.02	5.31%	52,568.65	5.31%	-
国海证券	1	49,163,324.39	4.52%	44,759.05	4.52%	-
财富证券	1	35,803,395.09	3.29%	32,595.50	3.29%	-
中信建投	3	29,016,273.38	2.67%	26,416.53	2.67%	-
兴业证券	1	27,158,303.81	2.50%	24,724.93	2.50%	-
国都证券	1	22,503,912.04	2.07%	20,487.75	2.07%	-
齐鲁证券	3	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
万和证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	2	-	-	-	-	新增
天源证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
中邮证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	2	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	2	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-

注：基金交易佣金根据券商季度综合评分结果给与分配，券商综合评分根据研究报告质量、路演质量、联合调研质量以及销售服务质量打分，从多家服务券商中选取符合法律规范经营的综合能力靠前的券商给与佣金分配，季度评分和佣金分配分别由专人负责。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中银国际	222,759.00	0.04%	105,000,000.00	0.31%	-	-
东方证券	1,251,826.60	0.22%	7,670,500,000.00	22.54%	-	-
西南证券	40,499,801.10	7.18%	211,000,000.00	0.62%	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	26,840,734.38	4.76%	80,103,000.00	0.24%	-	-
中投证券	50,768,872.60	9.00%	2,236,000,000.00	6.57%	-	-
招商证券	132,121,244.89	23.41%	5,136,100,000.00	15.09%	-	-
民生证券	59,083,444.10	10.47%	4,315,100,000.00	12.68%	-	-
国元证券	14,952,806.00	2.65%	1,519,000,000.00	4.46%	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	5,511,000,000.00	16.20%	-	-
中信建投	225,493,947.96	39.96%	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	4,612,200,000.00	13.55%	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
万和证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
天源证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	13,060,779.40	2.31%	2,176,000,000.00	6.39%	-	-
广州证券	-	-	456,800,000.00	1.34%	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-

招商基金管理有限公司
2014年8月27日