

(二零一四年第二号)

| 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 | 25,675,623.34 | 0.96         |
| B  | 采矿业      |               |              |

|   |                  |                  |       |
|---|------------------|------------------|-------|
| C | 制造业              | 1,100,740,066.49 | 40.98 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 26,944,355.67    | 1.00  |
| E | 建筑业              | 13,378,519.80    | 0.50  |
| F | 批发和零售业           | 40,301,284.20    | 1.50  |
| G | 交通运输、仓储和邮政业      | -                | -     |
| H | 住宿和餐饮业           | -                | -     |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 90,013,449.04    | 3.33  |

|   |               |  |                  |       |
|---|---------------|--|------------------|-------|
| J | 金融业           |  | 31,894,000.00    | 1.19  |
| K | 房地产业          |  | 21,855,000.00    | 0.81  |
| L | 租赁和商务服务业      |  | -                | -     |
| M | 科学研究和技术服务业    |  | 19,519,380.00    | 0.73  |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 |  | -                | -     |
| 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     |  | 110,209,400.00   | 4.10  |
| S | 综合            |  | -                | -     |
|   | 合计            |  | 1,480,531,029.64 | 55.13 |

3.报告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

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量 (股)     | 公允价值 (元)       | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|------------|----------------|---------------|
| 1  | 600525 | 汇川技术 | 18,499,910 | 182,195,000.40 | 6.78          |
| 2  | 300124 | 长虹精密 | 5,200,000  | 162,240,000.00 | 6.04          |
| 3  | 600885 | 宝发股份 | 4,000,000  | 87,880,000.00  | 3.27          |
| 4  | 600080 | 金花股份 | 7,500,000  | 75,150,000.00  | 2.80          |
| 5  | 002020 | 新源新材 | 3,299,974  | 59,399,532.00  | 2.21          |
| 6  | 600420 | 现代制药 | 3,200,000  | 59,360,000.00  | 2.21          |
| 7  | 000793 | 华闻传媒 | 5,000,000  | 58,750,000.00  | 2.19          |
| 8  | 601098 | 中南传媒 | 3,200,000  | 46,208,000.00  | 1.72          |

|                    |         |               |                |               |      |
|--------------------|---------|---------------|----------------|---------------|------|
| 9                  | 000051  | 五洲电力          | 1,500,000      | 44,175,000.00 | 1.64 |
| 10                 | 600998  | 九州通           | 3,000,000      | 40,175,000.00 | 1.50 |
| 4. 期末长期债券品种公允价值按品种 |         |               |                |               |      |
| 序号                 | 债券品种    | 公允价值 (元)      | 占基金净资产净值比例 (%) |               |      |
| 1                  | 国家债券    | 58,134,000.00 | 2.16           |               |      |
| 2                  | 央行票据    | -             | -              |               |      |
| 3                  | 金融债券    | -             | -              |               |      |
| 4                  | 资产支持证券  | -             | -              |               |      |
| 5                  | 企业短期融资券 | -             | -              |               |      |

|   |      |                |      |
|---|------|----------------|------|
| 6 | 中期票据 | -              | -    |
| 7 | 可转债  | -              | -    |
| 8 | 其他   | -              | -    |
| 9 | 合计   | \$8,124,000.00 | 2.16 |

| 5. 报告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                           |        |          |         |               |               |
|---------------------------------------------------------------|--------|----------|---------|---------------|---------------|
| 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 (%) |
| 1                                                             | 120010 | 12附息国债10 | 600,000 | 58,134,000.00 | 2.16          |
| 6. 报告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<br>本基金本报告期末未持有资产支持证券。 |        |          |         |               |               |
| 7. 报告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                          |        |          |         |               |               |

9.1 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明  
9.1.1 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。  
9.2 本基金投资股指期货的投资政策

10. 报告期内本基金投资的股指期货交易情况说明

10.1 报告期内股指期货投资政策

根据《基金合同》约定，本基金不参与股指期货交易。

10.2 报告期内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。

10.3 未来拟开展股指期货投资计划

根据《基金合同》约定，本基金不参与股指期货交易。

11. 报告期内合规管理情况

11.1 报告期内合规管理的主要工作

中国证监会日前发布《证券投资基金管理人内部控制指导意见》，存在内控缺陷的目前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

11.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同约定的备选股票库。本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先从库内买入。

11.3 治理结构完善

| 序号 | 名称       | 金额 (元)       |
|----|----------|--------------|
| 1  | 存出保证金    | 1,923,792.27 |
| 2  | 应收取证券清算款 | --           |
| 3  | 应收股利     | --           |
| 4  | 应收利息     | 655,751.00   |
| 5  | 应收中融款    | 8,296.92     |
| 6  | 其他应收款    | --           |
| 7  | 待摊费用     | --           |
| 8  | 其他       | --           |
| 9  | 合计       | 2,587,839.19 |

11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

115 报告期内期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明  
本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

**十一、基金的投资**

本基金管理人依照合同约定，诚信经营，谨慎地执行投资策略和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资者在做出投资决定前应仔细阅读本基金的风险揭示书。

本报告期内基金份额净值增长率及其与同期比较基准收益率的比较

| 阶段 | 净值增长率<br>① | 净值增长<br>率标准差<br>② | 净值增长<br>率基准收<br>益率③ | 净值增长<br>率基准收<br>益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|----|------------|-------------------|---------------------|------------------------|-----|-----|
|----|------------|-------------------|---------------------|------------------------|-----|-----|

| 2008.01.01-2008.12.31 | 2009.01.01-2009.12.31 | 2010.01.01-2010.12.31 | 2011.01.01-2011.12.31 | 2012.01.01-2012.12.31 | 2013.01.01-2013.12.31 |
|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|
| -54.52%               | 2.14%                 | -47.40%               | 1.97%                 | -7.12%                | 0.17%                 |
| 51.07%                | 1.84%                 | 57.67%                | 1.33%                 | -6.60%                | 0.51%                 |
| -0.91%                | 1.48%                 | -6.78%                | 1.02%                 | 5.87%                 | 0.46%                 |
| -27.10%               | 1.23%                 | -15.40%               | 0.85%                 | -11.70%               | 0.38%                 |
| 3.22%                 | 1.18%                 | 6.51%                 | 0.83%                 | -3.29%                | 0.35%                 |
| 2.40%                 | 1.33%                 | 6.21%                 | 0.94%                 | 7.34%                 | 0.40%                 |

|                      |         |       |        |       |         |       |
|----------------------|---------|-------|--------|-------|---------|-------|
| 2014年1月1日至2014年6月30日 | -3.76%  | 1.17% | -3.58% | 0.68% | -0.18%  | 0.49% |
| 基金成立日至2014年6月30日     | -11.25% | 1.58% | -0.92% | 1.23% | -10.33% | 0.35% |

**十二、基金的费用**

(一)与基金运作有关的费用

1、与基金运作有关的费用列示:

- (1) 基金管理人的管理费;
- (2) 基金托管人的托管费;
- (3) 基金合同生效后至与基金相关的信息披露费用;
- (4) 基金合同生效后至与基金相关的会计师事务所和律师事务所;
- (5) 基金份额持有人大会费用;
- (6) 基金的证券交易费用;
- (7) 银行汇兑费用;

(8) 本基金按照国家有关规定和基金合同约定,可在法律法规许可范围内进行其他用途。

(9) 根据有关法律和基金合同约定,按约定支出从基金财产中列支的费用。

2、 基金管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。计算方法如下:

$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

3、 基金托管费

[illegible][illegible]

并依法履行信息披露义务。其符合有关法律法规的要求,对本基金管理人于2014年7月12日修订的《基金招募说明书》进行了更新,并依法履行了信息披露义务。其符合有关法律法规的要求,对本基金的投资范围和投资运作进行了补充完善。

本次主要更新的內容如下:

- 1、在“三、基金管理人”部分,更新了“(一)前所管理基金的基本情况”、“(二)主要人员情况”。
- 2、在“四、基金的投资”部分,更新了“(一)投资目标”、“(二)投资范围”、“(三)基金业绩比较基准”。
- 3、在“五、基金的风险控制”部分,更新了“(一)基金的投资风险分析”、“(二)基金流动性风险分析”。
- 4、在“六、基金的募集”部分,更新了“(一)基金募集概况”。
- 5、在“九、基金的投资”部分,更新了“(十)基金投资组合报告”。
- 6、更新了“(十一、基金的投资”部分,更新了“(三)基金资产的账户”。
- 7、更新了“(十二、对基金业绩持有人的服务”。
- 8、更新了“(十三、其他应披露的事项”。

招商基金资产管理有限公司

# 招商基金管理有限公司 关于旗下基金估值变更的公告

风险提示：  
基金管理人承诺以诚实、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，也不保证最低收益。投资者投资于本公司管理的基金时应认真阅读基金合同和招募说明书。  
特此公告并提示。

招商基金管理有限公司  
2014年11月12日

**关于暂停招商安瑞进取债券型  
证券投资基金大额申购、定期定额投资和  
转换转入业务的公告**

| 1 公告基本信息 |                                                      |
|----------|------------------------------------------------------|
| 基金名称     | 招商安远进取债券型证券投资基金                                      |
| 基金简称     | 招商安远进取债券                                             |
| 基金代码     | 217018                                               |
| 基金管理人名称  | 招商基金管理有限公司                                           |
| 公告依据     | 根据法律法规、《招商安远进取债券型证券投资基金合同》、《招商安远进取债券型证券投资基金招募说明书》和《安 |
| 基金申购开始日期 | 2014年1月1日                                            |

|                                                                                                       |             |                                 |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------|---------------------------------|
| 智得大顺转融通转入金额(人民币)                                                                                      | 2014年11月14日 |                                 |
| 智得大顺转融通 转出(人民币)                                                                                       |             | 10,000,000.00                   |
| 智得大顺转融通 转入(人民币)                                                                                       |             |                                 |
| 智得大顺 转出 智得大顺 转入 智得大顺 转出                                                                               |             |                                 |
| 智得大顺转融通 转出(人民币)                                                                                       |             | 为了基金资产的平稳运作,防止套利交易,保护基金份额持有人的利益 |
| 智得大顺定期转融通转出日期:2014年11月14日                                                                             |             |                                 |
| 智得大顺定期转融通转入金额:10,000,000.00元                                                                          |             |                                 |
| 本基金依法正常申购、定期定额申购,转融通业务的时间与业务内容均与持有人利益无关。                                                              |             |                                 |
| 2 其他重要事项                                                                                              |             |                                 |
| 为了保障基金资产的安全,防止套利交易,保护基金份额持有人的利益,招商基金资产管理有限公司于2014年11月14日起暂停智得大顺定期转融通业务(以下简称“转融通”)。定期转融通业务和转融通业务,具体包括: |             |                                 |

本公司将根据该笔申请请求款,在以下任一情形发生时,将不超过1000万元的,对其申请请求款按照从小到大的顺序,依次按照以下顺序予以清偿:

1. 若该笔申请请求款≤(单只基金)单只基金资产净值×1000万元的,则其申请请求款全额予以清偿;
2. 若该笔申请请求款>(单只基金)单只基金资产净值×1000万元的,则其申请请求款全额予以清偿,但单只基金资产净值×1000万元≤该笔申请请求款<1000万元的,本公司将根据该笔申请请求款,在以下任一情形发生时,将不超过1000万元的,对其申请请求款按照从小到大的顺序,依次按照以下顺序予以清偿:
3. 若该笔申请请求款≤(单只基金)单只基金资产净值×1000万元的,则其申请请求款全额予以清偿;
4. 若该笔申请请求款>(单只基金)单只基金资产净值×1000万元的,则其申请请求款全额予以清偿,但单只基金资产净值×1000万元≤该笔申请请求款<1000万元的,本公司将根据该笔申请请求款,在以下任一情形发生时,将不超过1000万元的,对其申请请求款按照从小到大的顺序,依次按照以下顺序予以清偿:

上述清偿期不得超过7个工作日(含)假期(即顺延至下一个工作日),其余金额款项仍照常处理。

在正常赎回的交易日,基金持有人可及时获得其赎回款项,赎回等款项仍照常处理。

如有疑问,请拨打客户服务电话:400-887-8555(免长途费),或登陆网站[www.cmfund.com](http://www.cmfund.com)获取相关信息。

特此公告。

招商基金管理有限公司  
2014年11月22日

---