

招商安瑞进取债券型证券投资基金

2014 年第四季度报告

2014年12月31日

基金管理人:招商基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2015年1月20日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及监事会在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。
基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同,对本基金的财务指标、净值表现和投资组合报告等进行复核,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。
基金的过往业绩并不代表未来表现,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。
本报告告期为2014年10月1日起至12月31日止。

§ 2 基本产品概况

| 基金名称 | 招商安瑞进取债券型证券投资基金 |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------|
| 基金代码 | 217018 |
| 交易代码 | 217018 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2013年5月17日 |
| 报告期末基金份额总额 | 207,780,423.82份 |
| 投资目标 | 在锁定风险的前提下,通过积极主动的可转债投资管理,追求基金资产的长期稳健增值。 |
| 本基金主要投资于可转债,投资比例不低于基金资产的80%,其中可转债的投资比例不低于基金资产的50%。本基金投资于股票的比例不高于基金资产的20%,其中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,以保证基金一定的流动性。 | |
| 本基金的业绩比较基准为:中债企业债指数(全价)×40%+中债普全指数(全价)×60%。 | |
| 本基金的过往业绩并不代表未来表现,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。 | |
| 本报告告期为2014年10月1日起至12月31日止。 | |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

| 主要财务指标 | 报告期(2014年10月1日-2014年12月31日) | |
|----------------|-----------------------------|--|
| 1.本期已实现收益 | 38,180,306.97 | |
| 2.本期利润 | 51,393,425.43 | |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0330 | |
| 4.期末基金份额净值 | 294,270,765.50 | |
| 5.期末基金份额总值 | 1,1416 | |

注:本基金在估值日如果不维持持有入账金额及交易金额的各项目,以买入或卖出时的公允价值或成本价减去相关费用后的余额,本期利润为本期已实现的公允价值变动收益。

3.2 期末基金份额净值增长及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.3 本报告期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 | 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 |
|-------|--------|-----------|------------|---------------|
| 过去三个月 | 1.99% | 0.09% | 25.56% | 1.18% |

注:本基金在估值日如果不维持持有入账金额及交易金额的各项目,以买入或卖出时的公允价值或成本价减去相关费用后的余额,本期利润为本期已实现的公允价值变动收益。

3.2.2 期末基金份额净值增长及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.3 本报告期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

3.4 本期报告期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

3.5 本期报告期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

3.6 本期报告期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

3.7 本期报告期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

3.8 本期报告期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

3.9 本期报告期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

3.10 本期报告期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

3.11 本期报告期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

3.12 本期报告期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

3.13 本期报告期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

3.14 本期报告期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

3.15 本期报告期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

3.16 本期报告期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

3.17 本期报告期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

3.18 本期报告期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

3.19 本期报告期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

3.20 本期报告期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

3.21 本期报告期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

3.22 本期报告期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

3.23 本期报告期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

3.24 本期报告期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

3.25 本期报告期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

3.26 本期报告期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

3.27 本期报告期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

3.28 本期报告期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

3.29 本期报告期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

3.30 本期报告期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

3.31 本期报告期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

3.32 本期报告期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

3.33 本期报告期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

3.34 本期报告期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

3.35 本期报告期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

3.36 本期报告期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

3.37 本期报告期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

3.38 本期报告期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

3.39 本期报告期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

3.40 本期报告期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

3.41 本期报告期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

3.42 本期报告期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

3.43 本期报告期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

3.44 本期报告期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

3.45 本期报告期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

3.46 本期报告期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

3.47 本期报告期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

3.48 本期报告期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

3.49 本期报告期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

3.50 本期报告期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

3.51 本期报告期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

3.52 本期报告期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

3.53 本期报告期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

3.54 本期报告期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

3.55 本期报告期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

3.56 本期报告期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

3.57 本期报告期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

3.58 本期报告期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

3.59 本期报告期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

3.60 本期报告期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

3.61 本期报告期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

3.62 本期报告期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

3.63 本期报告期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

3.64 本期报告期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

3.65 本期报告期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

3.66 本期报告期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

3.67 本期报告期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

3.68 本期报告期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

3.69 本期报告期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

3.70 本期报告期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

3.71 本期报告期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

3.72 本期报告期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

3.73 本期报告期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

3.74 本期报告期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

3.75 本期报告期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

3.76 本期报告期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

3.77 本期报告期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

3.78 本期报告期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

3.79 本期报告期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

3.80 本期报告期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

3.81 本期报告期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

3.82 本期报告期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

3.83 本期报告期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

3.84 本期报告期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

3.85 本期报告期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

3.86 本期报告期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

3.87 本期报告期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

3.88 本期报告期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

3.89 本期报告期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

3.90 本期报告期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

3.91 本期报告期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

3.92 本期报告期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

3.93 本期报告期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

3.94 本期报告期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

3.95 本期报告期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

3.96 本期报告期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

3.97 本期报告期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

3.98 本期报告期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

3.99 本期报告期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

3.10 本期报告期基金份额