

## 招商安盈保本混合型证券投资基金

### 2015 第四季度 报告

2015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：中国工商银行股份有限公司  
报告送出日期：2016年1月22日

**§1 重要提示**

基金管理人、基金托管人及基金销售机构均不存在虚假记载、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。

基金管理人招商基金管理有限公司根据基金合同约定，于2016年1月18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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失，投资者投资于本基金存在相应风险。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年10月1日起至12月31日止。

**§2 基金产品概况**

基金名称	招商安盈保本混合
基金代码	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
报告期末基金份额总额	4,015,490.520121
投资目标	通过采用投资组合策略，在控制本金损失风险的前提下，追求基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金为保本混合型证券投资基金，将深入的研究，将严谨、规范化的基本分析研究与科学合理的资产配置相结合，合理运用组合投资、分散投资等投资方法，在严格控制基金资产投资风险的前提下，实现基金资产在保本基础上的增值目标。
业绩比较基准	三年期银行定期存款利率+0.5%
风险收益特征	本基金为保本混合型基金，属于证券市场中的低风险品种。
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
基金销售人	招商基金管理有限公司

**§3 主要财务指标和基金净值表现**

单位：人民币元

项目	本报告期(2015年10月1日至2015年12月31日)
1.本期利润总额	21,965,053.56
2.本期费用	87,955,764.24
3.期末基金净值	0.0215
4.期末基金资产净值	4,106,469,415.76
5.期末基金份额净值	1.0215

**§3.1 主要财务指标**

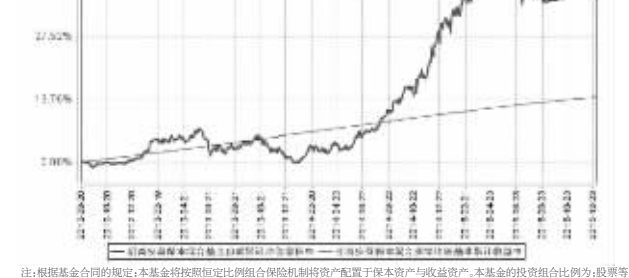
项目	本报告期(2015年10月1日至2015年12月31日)
1.本期利润总额	21,965,053.56
2.本期费用	87,955,764.24
3.期末基金净值	0.0215
4.期末基金资产净值	4,106,469,415.76
5.期末基金份额净值	1.0215

**§3.2 基金净值表现**

本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比

期间	净值增长率	业绩比较基准收益率	①-②
过去三个月	2.30%	0.07%	0.71%
过去六个月	0.07%	0.01%	1.49%
过去一年	0.06%	0.01%	0.06%

注：根据基金合同的约定，本基金投资于权益类资产的比例不高于基金资产的30%，其中投资于股票资产的比例不高于基金资产的20%。截至本报告期末，本基金权益类资产占基金资产净值的比例为1.02%，其中股票资产占基金资产净值的比例为0.02%。



注：根据基金合同的约定，本基金投资于权益类资产的比例不高于基金资产的30%，其中投资于股票资产的比例不高于基金资产的20%。截至本报告期末，本基金权益类资产占基金资产净值的比例为1.02%，其中股票资产占基金资产净值的比例为0.02%。

**§4 基金经理**

姓名	职务	任本基金基金经理时间	证券从业年限	说明
马亮	本基金的基金经理	2014年12月15日	6	男，中国国籍，经济学博士。2009年7月加入泰达基金管理公司，任研究员，从事宏观经济、债券市场研究。2011年加入招商基金管理有限公司，任研究员，从事宏观经济、债券市场研究。2014年12月15日起担任招商安盈保本混合型证券投资基金基金经理。2015年12月31日，招商安盈保本混合型证券投资基金基金经理。
付晓	本基金的基金经理	2015年3月17日	7	男，中国国籍，理学硕士。2008年7月加入泰达基金管理公司，任研究员，从事宏观经济、债券市场研究。2011年加入招商基金管理有限公司，任研究员，从事宏观经济、债券市场研究。2015年3月17日起担任招商安盈保本混合型证券投资基金基金经理。2015年12月31日，招商安盈保本混合型证券投资基金基金经理。

注：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任职日期为公司相关会议作出的决议生效日期。

2.基金经理变更须经中国证监会核准。基金经理变更须经中国证监会核准。基金经理变更须经中国证监会核准。

3.基金经理变更须经中国证监会核准。基金经理变更须经中国证监会核准。基金经理变更须经中国证监会核准。

4.基金经理变更须经中国证监会核准。基金经理变更须经中国证监会核准。基金经理变更须经中国证监会核准。

5.基金经理变更须经中国证监会核准。基金经理变更须经中国证监会核准。基金经理变更须经中国证监会核准。

6.基金经理变更须经中国证监会核准。基金经理变更须经中国证监会核准。基金经理变更须经中国证监会核准。

7.基金经理变更须经中国证监会核准。基金经理变更须经中国证监会核准。基金经理变更须经中国证监会核准。

8.基金经理变更须经中国证监会核准。基金经理变更须经中国证监会核准。基金经理变更须经中国证监会核准。

9.基金经理变更须经中国证监会核准。基金经理变更须经中国证监会核准。基金经理变更须经中国证监会核准。

10.基金经理变更须经中国证监会核准。基金经理变更须经中国证监会核准。基金经理变更须经中国证监会核准。

11.基金经理变更须经中国证监会核准。基金经理变更须经中国证监会核准。基金经理变更须经中国证监会核准。

12.基金经理变更须经中国证监会核准。基金经理变更须经中国证监会核准。基金经理变更须经中国证监会核准。

13.基金经理变更须经中国证监会核准。基金经理变更须经中国证监会核准。基金经理变更须经中国证监会核准。

14.基金经理变更须经中国证监会核准。基金经理变更须经中国证监会核准。基金经理变更须经中国证监会核准。

15.基金经理变更须经中国证监会核准。基金经理变更须经中国证监会核准。基金经理变更须经中国证监会核准。

16.基金经理变更须经中国证监会核准。基金经理变更须经中国证监会核准。基金经理变更须经中国证监会核准。

17.基金经理变更须经中国证监会核准。基金经理变更须经中国证监会核准。基金经理变更须经中国证监会核准。

18.基金经理变更须经中国证监会核准。基金经理变更须经中国证监会核准。基金经理变更须经中国证监会核准。

19.基金经理变更须经中国证监会核准。基金经理变更须经中国证监会核准。基金经理变更须经中国证监会核准。

20.基金经理变更须经中国证监会核准。基金经理变更须经中国证监会核准。基金经理变更须经中国证监会核准。

21.基金经理变更须经中国证监会核准。基金经理变更须经中国证监会核准。基金经理变更须经中国证监会核准。

22.基金经理变更须经中国证监会核准。基金经理变更须经中国证监会核准。基金经理变更须经中国证监会核准。

23.基金经理变更须经中国证监会核准。基金经理变更须经中国证监会核准。基金经理变更须经中国证监会核准。

24.基金经理变更须经中国证监会核准。基金经理变更须经中国证监会核准。基金经理变更须经中国证监会核准。

25.基金经理变更须经中国证监会核准。基金经理变更须经中国证监会核准。基金经理变更须经中国证监会核准。

**§4 投资组合报告**

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	-	-
B	矿业	-	-
C	制造业	20,749,531.27	0.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	8,213,070.40	0.20
F	批发和零售业	24,677,930.44	0.63
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	2,997,649.30	0.08
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
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	-	-
O	医药、卫生和医药制造业	-	-
P	教育	-	-
Q	公用事业	-	-
R	文化、体育和娱乐业	982,724.40	0.02
S	合计	37,220,886.11	1.39

**§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	600122	宏图高科	1,239,300	24,455,000.00	0.60
2	002484	华信股份	377,300	10,400,430.00	0.24
3	600702	华信软件	431,400	9,865,612.89	0.24
4	002028	思源电气	201,345	7,661,566.65	0.19
5	603818	欧陆通	14,465	11,843,821.30	0.03
6	603999	读者传媒	16,713	982,724.40	0.02
7	300406	中科创达	6,500	918,405.60	0.02
8	300495	奥海电子	6,375	596,223.75	0.01
9	300493	润科科技	7,248	299,632.12	0.01
10	002786	耀世达	9,420	263,478.80	0.01

**§6 报告期末按品种分类的债券投资组合**

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	200,160,000.00	4.87
2	金融债	209,780,000.00	5.11
3	企业债	209,780,000.00	5.11
4	可转债	729,225,298.30	17.76
5	央行票据	1,143,453,000.00	27.84
6	中期票据	783,044,000.00	19.07
7	短期融资券	9,192,155.95	0.22
8	其他	-	-
9	合计	3,074,854,454.23	74.88

**§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十名固定收益投资明细**

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	150208	15国债08	2,000,000	200,780,000.00	5.11
2	1502033	15央行票据03	2,000,000	205,440,000.00	5.00
3	011599809	15国债09	2,000,000	200,720,000.00	4.89
4	0109527	15国债27	2,000,000	200,160,000.00	4.87
5	011599741	15国债04	1,700,000	170,578,000.00	4.15

注：本基金本报告期末持有“支持证券”。

注：本基金本报告期末持有“支持证券”。

注：本基金本报告期末持有“支持证券”。

注：本基金本报告期末持有“支持证券”。

注：本基金本报告期末持有“支持证券”。

注：本基金本报告期末持有“支持证券”。

注：本基金本报告期末持有“支持证券”。

注：本基金本报告期末持有“支持证券”。

注：本基金本报告期末持有“支持证券”。

注：本基金本报告期末持有“支持证券”。

注：本基金本报告期末持有“支持证券”。

注：本基金本报告期末持有“支持证券”。

注：本基金本报告期末持有“支持证券”。

注：本基金本报告期末持有“支持证券”。

注：本基金本报告期末持有“支持证券”。

注：本基金本报告期末持有“支持证券”。

注：本基金本报告期末持有“支持证券”。

注：本基金本报告期末持有“支持证券”。

注：本基金本报告期末持有“支持证券”。

注：本基金本报告期末持有“支持证券”。

注：本基金本报告期末持有“支持证券”。

注：本基金本报告期末持有“支持证券”。

注：本基金本报告期末持有“支持证券”。

注：本基金本报告期末持有“支持证券”。

注：本基金本报告期末持有“支持证券”。

注：本基金本报告期末持有“支持证券”。

注：本基金本报告期末持有“支持证券”。

注：本基金本报告期末持有“支持证券”。

注：本基金本报告期末持有“支持证券”。

注：本基金本报告期末持有“支持证券”。

## 招商保证金快线货币市场基金

### 2015 第四季度 报告

2015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：中国工商银行股份有限公司  
报告送出日期：2016年1月22日

**§1 重要提示**

基金管理人、基金托管人及基金销售机构均不存在虚假记载、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。

基金管理人招商基金管理有限公司根据基金合同约定，于2016年1月18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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失，投资者投资于本基金存在相应风险。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年10月1日起至12月31日止。

**§2 基金产品概况**

基金名称	招商保证金快线货币市场基金
基金代码	159003
交易代码	159003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年1月12日
报告期末基金份额总额	32,366,458,007.25
投资目标	在法律法规允许的范围内，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金主要投资于货币市场工具，在严格控制风险的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
业绩比较基准	人民币活期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为货币市场基金，属于证券市场中的低风险品种，本基金的风险收益特征与货币市场基金相似。
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
基金销售人	招商基金管理有限公司

**§3 主要财务指标和基金净值表现**

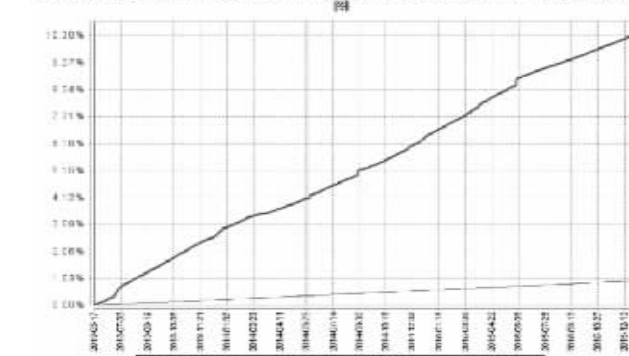
项目	本报告期(2015年10月1日至2015年12月31日)
1.本期利润总额	4,429,984.43
2.本期费用	5,429,984.43
3.期末基金净值	787,500,000.00
4.期末基金资产净值	2,449,136,000.00

**§3.1 主要财务指标**

项目	本报告期(2015年10月1日至2015年12月31日)
1.本期利润总额	4,429,984.43
2.本期费用	5,429,984.43
3.期末基金净值	787,500,000.00
4.期末基金资产净值	2,449,136,000.00

**§3.2 基金净值表现**

期间	净值增长率	业绩比较基准收益率	①-②
过去三个月	0.7016%	0.0011%	0.0098%
过去六个月	0.0011%	0.0011%	0.0000%
过去一年	0.0011%	0.0011%	0.0000%



注：本基金本报告期末持有“支持证券”。

注：本基金本报告期末持有“支持证券”。

注：本基金本报告期末持有“支持证券”。

注：本基金本报告期末持有“支持证券”。

注：本基金本报告期末持有“支持证券”。

注：本基金本报告期末持有“支持证券”。

注：本基金本报告期末持有“支持证券”。

注：本基金本报告期末持有“支持证券”。

注：本基金本报告期末持有“支持证券”。

注：本基金本报告期末持有“支持证券”。

注：本基金本报告期末持有“支持证券”。

注：本基金本报告期末持有“支持证券”。

注：本基金本报告期末持有“支持证券”。

注：本基金本报告期末持有“支持证券”。

注：本基金本报告期末持有“支持证券”。

注：本基金本报告期末持有“支持证券”。

注：本基金本报告期末持有“支持证券”。

注：本基金本报告期末持有“支持证券”。

注：本基金本报告期末持有“支持证券”。

注：本基金本报告期末持有“支持证券”。

注：本基金本报告期末持有“支持证券”。

注：本基金本报告期末持有“支持证券”。

注：本基金本报告期末持有“支持证券”。

注：本基金本报告期末持有“支持证券”。

注：本基金本报告期末持有“支持证券”。

注：本基金本报告期末持有“支持证券”。

注：本基金本报告期末持有“支持证券”。

注：本基金本报告期末持有“支持证券”。

注：本基金本报告期末持有“支持证券”。

2015年四季度，利率收益整体呈下行，长端下幅幅度比短端更大，由线性趋于扁平。四季度总体经济数据超预期，央行10月份降准降准，维持了较为宽松的货币环境，短期收益率有所回落，信用风险事件频发，在信用利差有所扩大的情况下，本基金坚持一贯的稳健风格，安全性为投资原则，在提供充足流动性保障的前提下，充分利用市场的机会，提高组合收益率，为持有人创造了良好的收益。

**§4.2 投资组合报告**

本基金本报告期末持有“支持证券”。

**§4.1 基金投资组合**

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	银行存款	1,750,390,150.69	54.00
2	债券	1,750,390,150.69	54.00
3	买入返售金融资产	850,002,315.00	26.22
4	其他	625,837,083.39	19.41
5	合计	3,241,347,302.88	100.00

**§4.2 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债券投资明细**

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	159003	招商保证金快线货币市场基金	32,366,458,007.25	787,500,000.00	2.66

**§4.3 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	159003	招商保证金快线货币市场基金	32,366,458,007.25	787,500,000.00	2.66

注：本基金本报告期末持有“支持证券”。

注：本基金本报告期末持有“支持证券”。

注：本基金本报告期末持有“支持证券”。

注：本基金本报告期末持有“支持证券”。

注：本基金本报告期末持有“支持证券”。

注：本基金本报告期末持有“支持证券”。

注：本基金本报告期末持有“支持证券”。

注：本基金本报告期末持有“支持证券”。

注：本基金本报告期末持有“支持证券”。

注：本基金本报告期末持有“支持证券”。

注：本基金本报告期末持有“支持证券”。

注：本基金本报告期末持有“支持证券”。

注：本基金本报告期末持有“支持证券”。

注：本基金本报告期末持有“支持证券”。

注：本基金本报告期末持有“支持证券”。

注：本基金本报告期末持有“支持证券”。

注：本基金本报告期末持有“支持证券”。