

---

# 招商安元保本混合型证券投资基金 2016 年半年度报告

2016 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：中国银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 24 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 23 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 3 月 1 日（基金合同生效日）起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>1</b>
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>4</b>
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>5</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>7</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	13
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	14
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>14</b>
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>34</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	34
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	35
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	35
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	35
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.....	35
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	36
7.8 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.....	36
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.....	36
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	36
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	36
7.12 投资组合报告附注.....	37

<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>37</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	37
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	38
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的情况.....	38
<b>§9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>38</b>
<b>§10 重大事件揭示</b> .....	<b>39</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	39
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.....	39
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	39
10.4 基金投资策略的改变.....	39
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	39
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.....	39
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	39
10.8 其他重大事件.....	42
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>43</b>
<b>§12 备查文件目录</b> .....	<b>44</b>
12.1 备查文件目录.....	44
12.2 存放地点.....	44
12.3 查阅方式.....	44

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	招商安元保本混合型证券投资基金
基金简称	招商安元保本混合
基金主代码	002456
交易代码	002456
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 3 月 1 日
基金管理人	招商基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,958,326,037.26 份
基金合同存续期	不定期

注：由于本基金 C 类份额从成立至报告期末未有新增份额，报告中披露的内容均为本基金 A 类份额的情况。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过运用投资组合保险技术，力争控制本金损失的风险，并寻求组合资产的稳定增值。
投资策略	本基金将投资品种分为风险资产和保本资产两类，采用恒定比例投资组合保险（Constant Proportion Portfolio Insurance，以下简称“CPPI”）策略。本基金在保本周期内将严格遵守保本策略，实现对风险资产和保本资产的优化动态调整和资产配置，力争投资本金的安全性。同时，本基金通过积极稳健的风险资产投资策略，竭力为基金资产获取稳定增值。资产配置原则是：在有效控制风险的基础上，根据类别资产市场相对风险度，按照 CPPI 策略动态调整保本资产和风险资产的比例。固定收益品种主要投资策略包括：久期策略、期限结构策略和个券选择策略等。通过对可转债相对价值的分析，确定不同市场环境下可转债股性和债性的相对价值，把握可转债的价值走向，选择相应券种，从而获取较高投资收益。对于中小企业私募债券，主要采取买入持有到期策略；当预期发债企业的基本面情况出现恶化时，采取“尽早出售”策略，控制投资风险。根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，适度运用国债期货提高投资组合运作效率。以价值投资理念为导向，采取“自上而下”的多主题投资和“自下而上”的个股精选方法，灵活运用多种股票投资策略，深度挖掘经济结构转型过程中具有核心竞争力和发展潜力的行业和公司，实现基金资

	产的长期稳定增值。
业绩比较基准	人民银行公布的三年期银行定期存款利率（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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	潘西里	王永民
	联系电话	0755-83196666	010-66594896
	电子邮箱	cmf@cmfchina.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-887-9555	95566
传真		0755-83196475	010-66594942
注册地址		深圳市福田区深南大道 7088 号	北京西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		中国深圳深南大道 7088 号 招商银行大厦	北京西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		518040	100818
法定代表人		李浩	田国立

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、证券时报、上海证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.cmfchina.com">http://www.cmfchina.com</a>
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) 中国银行股份有限公司 地址: 北京市复兴门内大街 1 号

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	招商基金管理有限公司	中国深圳深南大道 7088 号招商银行大厦

# § 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(2016 年 3 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
---------------	---------------------------------------

本期已实现收益	9,692,856.18
本期利润	11,881,261.44
加权平均基金份额本期利润	0.0060
本期加权平均净值利润率	0.60%
本期基金份额净值增长率	0.60%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>报告期末(2016年6月30日)</b>
期末可供分配利润	9,613,645.42
期末可供分配基金份额利润	0.0049
期末基金资产净值	1,970,118,316.57
期末基金份额净值	1.006
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2016年6月30日)</b>
基金份额累计净值增长率	0.60%

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。

4、本基金合同于 2016 年 3 月 1 日生效，截至本报告期末成立未满一年。

## 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

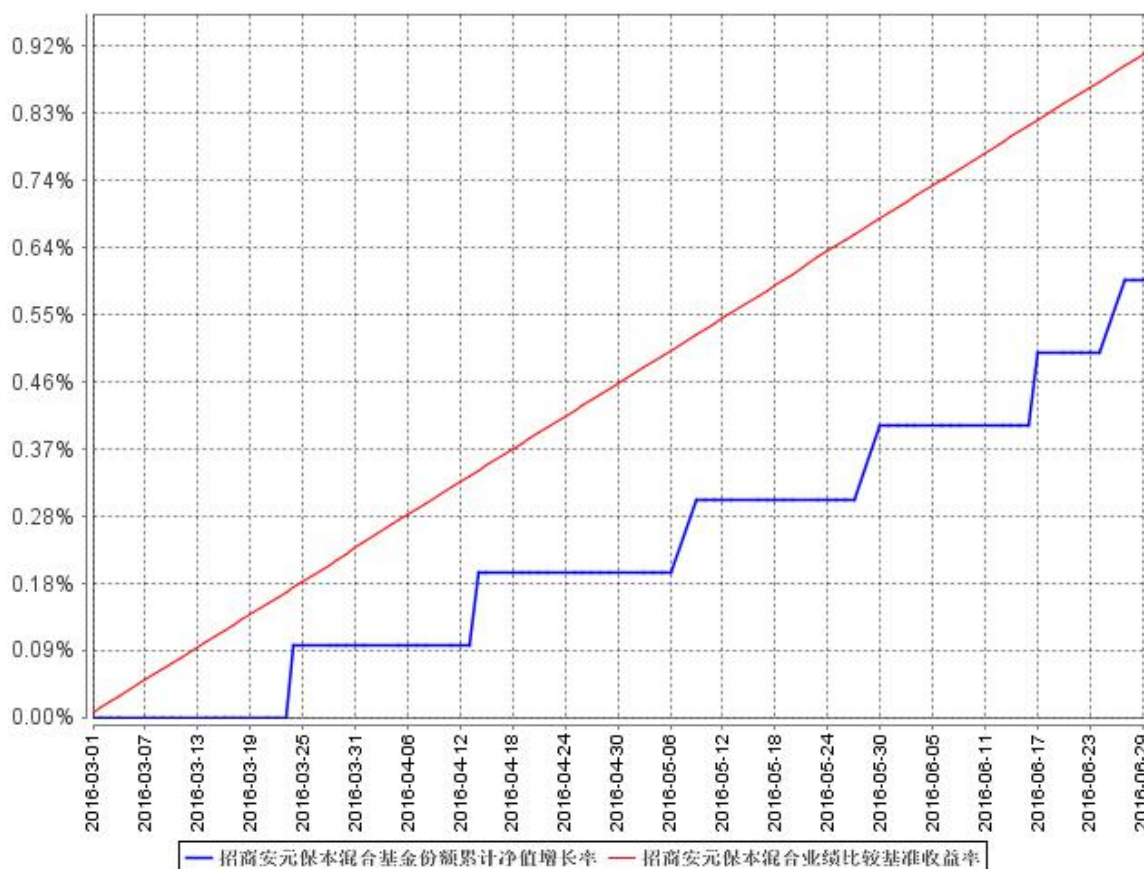
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.20%	0.03%	0.23%	0.01%	-0.03%	0.02%
过去三个月	0.50%	0.03%	0.68%	0.01%	-0.18%	0.02%
自基金合同生效起至今	0.60%	0.03%	0.92%	0.01%	-0.32%	0.02%

注：1、业绩比较基准收益率=人民银行公布的三年期银行定期存款利率（税后），业绩比较基准在每个交易日实现再平衡；

2、本基金合同于 2016 年 3 月 1 日生效，截止本报告期末基金成立未满一年。

### 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

招商安元保本混合基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、根据基金合同第十三条（二）投资范围的规定：本基金股票、权证等权益类资产占基金资产的比例不高于 40%；债券、货币市场工具等固定收益类资产占基金资产的比例不低于 60%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值 5%。本基金于 2016 年 3 月 1 日成立，自基金成立日起 6 个月内为建仓期，截至报告期末建仓期未结束；

2、本基金合同于 2016 年 3 月 1 日生效，截至本报告期末基金成立未满一年；

3、自基金成立至今，招商安元保本混合 C 未有份额，因此上图仅显示招商安元保本混合 A 自基金合同生效以来基金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。

## § 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。目前，



公司注册资本为 2.1 亿元人民币，其中，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%。

截至 2016 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 76 只共同基金，具体如下：

基金名称	基金类型	基金成立日
招商安泰偏股混合型证券投资基金	混合型基金	2003-04-28
招商安泰平衡型证券投资基金	混合型基金	2003-04-28
招商安泰债券投资基金	债券型基金	2003-04-28
招商现金增值开放式证券投资基金	货币市场型基金	2004-01-14
招商先锋证券投资基金	混合型基金	2004-06-01
招商优质成长混合型证券投资基金	混合型基金	2005-11-17
招商安本增利债券型证券投资基金	债券型基金	2006-07-11
招商核心价值混合型证券投资基金	混合型基金	2007-03-30
招商大盘蓝筹混合型证券投资基金	混合型基金	2008-06-19
招商安心收益债券型证券投资基金	债券型基金	2008-10-22
招商行业领先混合型证券投资基金	混合型基金	2009-06-19
招商中小盘精选混合型证券投资基金	混合型基金	2009-12-25
招商全球资源股票型证券投资基金	国际(QDII)基金	2010-03-25
招商深证 100 指数证券投资基金	股票型基金	2010-06-22
招商信用添利债券型证券投资基金(LOF)	债券型基金	2010-06-25
上证消费 80 交易型开放式指数证券投资基金	股票型基金	2010-12-08
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	股票型基金	2010-12-08
招商标普金砖四国指数证券投资基金(LOF)	国际(QDII)基金	2011-02-11
招商安瑞进取债券型证券投资基金	债券型基金	2011-03-17
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	股票型基金	2011-06-27
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	股票型基金	2011-06-27
招商安达保本混合型证券投资基金	混合型基金	2011-09-01
招商优势企业灵活配置混合型证券投资基金	混合型基金	2012-02-01
招商产业债券型证券投资基金	债券型基金	2012-03-21
招商中证大宗商品股票指数分级证券投资基金	股票型基金	2012-06-28
招商信用增强债券型证券投资基金	债券型基金	2012-07-20
招商安盈保本混合型证券投资基金	混合型基金	2012-08-20
招商理财 7 天债券型证券投资基金	货币市场型基金	2012-12-07
招商央视财经 50 指数证券投资基金	股票型基金	2013-02-05
招商双债增强债券型证券投资基金(LOF)	债券型基金	2013-03-01
招商安润保本混合型证券投资基金	混合型基金	2013-04-19
招商保证金快线货币市场基金	货币市场型基金	2013-05-17
招商沪深 300 高贝塔指数分级证券投资基金	股票型基金	2013-08-01
招商瑞丰灵活配置混合型发起式证券投资基金	混合型基金	2013-11-06

招商标普高收益红利贵族指数增强型证券投资基金	国际(QDII)基金	2013-12-11
招商丰盛稳定增长灵活配置混合型证券投资基金	混合型基金	2014-03-20
招商招钱宝货币市场基金	货币市场型基金	2014-03-25
招商招金宝货币市场基金	货币市场型基金	2014-06-18
招商可转债分级债券型证券投资基金	债券型基金	2014-07-31
招商丰利灵活配置混合型证券投资基金	混合型基金	2014-08-12
招商行业精选股票型证券投资基金	股票型基金	2014-09-03
招商招利 1 个月理财债券型证券投资基金	货币市场型基金	2014-09-25
招商中证全指证券公司指数分级证券投资基金	股票型基金	2014-11-13
招商沪深 300 地产等权重指数分级证券投资基金	股票型基金	2014-11-27
招商医药健康产业股票型证券投资基金	股票型基金	2015-01-30
招商丰泰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)	混合型基金	2015-04-17
招商中证煤炭等权指数分级证券投资基金	股票型基金	2015-05-20
招商中证银行指数分级证券投资基金	股票型基金	2015-05-20
招商国证生物医药指数分级证券投资基金	股票型基金	2015-05-27
招商中证白酒指数分级证券投资基金	股票型基金	2015-05-27
招商丰泽灵活配置混合型证券投资基金	混合型基金	2015-06-11
招商移动互联网产业股票型证券投资基金	股票型基金	2015-06-19
招商国企改革主题混合型证券投资基金	混合型基金	2015-06-29
招商安益保本混合型证券投资基金	混合型基金	2015-07-14
招商丰庆灵活配置混合型发起式证券投资基金	混合型基金	2015-07-31
招商体育文化休闲股票型证券投资基金	股票型基金	2015-08-18
招商丰融灵活配置混合型证券投资基金	混合型基金	2015-11-17
招商丰裕灵活配置混合型证券投资基金	混合型基金	2015-11-17
招商丰享灵活配置混合型证券投资基金	混合型基金	2015-11-17
招商制造业转型灵活配置混合型证券投资基金	混合型基金	2015-12-02
招商境远保本混合型证券投资基金	混合型基金	2015-12-15
招商招益一年定期开放债券型证券投资基金	债券型基金	2015-12-25
招商安弘保本混合型证券投资基金	混合型基金	2015-12-29
招商康泰养老灵活配置混合型证券投资基金	混合型基金	2016-02-04
招商安德保本混合型证券投资基金	混合型基金	2016-02-18
招商安元保本混合型证券投资基金	混合型基金	2016-03-01
招商招瑞纯债债券型发起式证券投资基金	债券型基金	2016-03-09
招商量化精选股票型发起式证券投资基金	股票型基金	2016-03-15
招商睿逸稳健配置混合型证券投资基金	混合型基金	2016-04-13
招商招兴纯债债券型证券投资基金	债券型基金	2016-05-18
招商安博保本混合型证券投资基金	混合型基金	2016-05-25
招商招盈 18 个月定期开放债券型证券投资基金	债券型基金	2016-06-01
招商增荣灵活配置混合型证券投资基金	混合型基金	2016-06-03
招商招恒纯债债券型证券投资基金	债券型基金	2016-06-08
招商安裕保本混合型证券投资基金	混合型基金	2016-06-20
招商财富宝交易型货币市场基金	货币型基金	2016-06-30

#### 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（助理） 期限		证券 从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
张韵	本基 基金 经 理	2016年3月1日	-	4	女，硕士。2012年9月加入国泰基金管理有限公司，曾任研究员、基金经理助理；2015年加入招商基金管理有限公司，现任招商安瑞进取债券型证券投资基金、招商安润保本混合型证券投资基金、招商安元保本混合型证券投资基金及招商增荣灵活配置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》、《公开募集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《招商安元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，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两次，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

2016 年上半年，国内经济增速平稳运行，一季度在地产投资、基建投资的拉动下经济企稳，二季度地产投资依然较强但动能减弱，成为拉动经济的主要动力。其余固定资产投资中民间投资需求及制造业投资增速持续下滑，国内消费数据受至于居民加杠杆及薪资数据走弱影响也呈现出疲软态势，带动经济下行。进出口数据在二季度开始出现好转，这与海外经济的复苏与人民币贬值一致。亮点来自于进出口数据受益于人民币贬值及外需回暖有小幅改善，对 GDP 形成正向拉动。

通胀数据上半年前高后低，符合我们的预期，一季度受极端天气影响及猪肉价格影响通胀走高，随着二季度这两个因素的消除，CPI 呈现回落的趋势。PPI 方面，大宗价格的底部反弹带动工业品价格上涨，同比数据大幅改善。

货币政策方面，央行上半年保持中性偏松的货币政策，通过公开市场操作及定向工具等持续对市场投放流动性，维持较为宽松的资金面。随着领导层对金融杠杆的重视程度提升，货币政策可操作的空间与方式受限。

市场回顾：

上半年债券市场收益率整体收平，年初在对经济的悲观预期及配置压力下，收益率出现大幅下行。随着预期的修正及经济企稳的压力，收益率出现反弹，而四月份信用风险的爆发引起部分流动性风险带动收益率短期上行较多。之后的经济数据走弱及英国脱欧又再次带动收益率下行。

上半年股票市场年初大跌后，市场底部小幅反弹呈现震荡行情。截止半年末，上证综指录得-17.22%的跌幅，创业板下跌-17.92%。

基金操作回顾：

本基金目前主要配置资产为信用债。2016 年上半年，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。由于基金新成立，我们积极进行债券配置以尽快达到合同规定标准，并严格遵守 CPPI 策略在成立初期控制风险资产比例。

#### 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 1.006 元，本报告期份额净值增长率为 0.60%，同期业绩基准增长率为 0.92%，基金业绩略低于同期比较基准，幅度为 0.32%。本报告期内业绩表现低于基准的主要原因在于新成立基金建仓需要时间，因此前期仓位轻净值增长慢于基准。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们观察到最新 PMI 数据，中国经济环比改善动能减弱，刚好在荣枯线附近，我们预期未来此数据可能会继续小幅下滑。在地产销售下滑、投资出现拐点，制造业、民间投资持续下滑的情况下，中国经济在下半年环比走弱的概率较大。然而我们认为经济不会出现失速的风险，政府依然有能力通过财政政策维持经济平稳下滑。

下半年，我们认为权益市场依然会有结构性行情，而债券市场在目前位置继续下行的空间不大，而下半年信用债的集中到期压力会对中低等级信用债造成一定冲击。

#### 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验。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已与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供在银行间同业市场和交易所市场交易的债券品种的估值数据。

#### **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。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。

#### **4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

根据证监会《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条的相关要求，基金合同生效后，连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露。

报告期内，本基金未发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## **§ 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**

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对招商安元保本混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

### **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**

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、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：招商安元保本混合型证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日
<b>资产：</b>		
银行存款	6.4.7.1	40,155,081.33
结算备付金		-
存出保证金		48.41
交易性金融资产	6.4.7.2	1,536,716,757.12
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		1,536,716,757.12
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	389,401,584.10
应收证券清算款		-
应收利息	6.4.7.5	6,809,120.38
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		1,973,082,591.34
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016 年 6 月 30 日</b>
<b>负债：</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		535,608.16
应付管理人报酬		1,941,288.95

应付托管费		323,548.14
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	48,722.77
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	115,106.75
负债合计		2,964,274.77
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	6.4.7.9	1,958,326,037.26
未分配利润	6.4.7.10	11,792,279.31
所有者权益合计		1,970,118,316.57
负债和所有者权益总计		1,973,082,591.34

注：1、报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.006 元，基金份额总额 1,958,326,037.26 份；

2、本期财务报表的实际编制期间为 2016 年 3 月 1 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日，上年度无可比期间。

## 6.2 利润表

会计主体：招商安元保本混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 3 月 1 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2016 年 3 月 1 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		21,183,651.27
1.利息收入		17,157,053.76
其中：存款利息收入	6.4.7.11	2,933,340.94
债券利息收入		4,999,301.80
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		9,224,411.02
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,475,214.10
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	1,475,214.10
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-
股利收益	6.4.7.17	-



3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	2,188,405.26
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	362,978.15
<b>减：二、费用</b>		<b>9,302,389.83</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	7,859,520.09
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,309,919.97
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-
4. 交易费用	6.4.7.20	7,923.41
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	6.4.7.21	125,026.36
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>11,881,261.44</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>11,881,261.44</b>

注：本期财务报表的实际编制期间为 2016 年 3 月 1 日（基金合同生效日）至 2016 年 6 月 30 日，上年度无可比期间。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：招商安元保本混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 3 月 1 日（基金合同生效日）至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 3 月 1 日（基金合同生效日）至 2016 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）	1,985,071,831.95	-	1,985,071,831.95
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	11,881,261.44	11,881,261.44
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）	-26,745,794.69	-88,982.13	-26,834,776.82
其中：1.基金申购款	1,842,076.27	5,569.27	1,847,645.54
2.基金赎回款	-28,587,870.96	-94,551.40	-28,682,422.36
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)	1,958,326,037.26	11,792,279.31	1,970,118,316.57

注：本期财务报表的实际编制期间为 2016 年 3 月 1 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日，上年度无可比期间。

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：

<u>金旭</u>	<u>欧志明</u>	<u>何剑萍</u>
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

招商安元保本混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人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》、《招商安元保本混合型证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规的规定，经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]258 号文批准公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限为不定期，首次设立募集基金份额为 1,985,071,831.95 份，经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证，并出具了编号为德师报(验)字(16)第 0202 号验资报告。本基金根据是否收取认购费、申购费和销售服务费，以及赎回费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别，即 A 类基金份额和 C 类基金份额。其中 A 类基金份额收取认购费、申购费、赎回费，但不从基金资产中计提销售服务费；C 类基金份额不收取认购费、申购费，收取赎回费，同时从基金资产中计提销售服务费。《招商安元保本混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)于 2016 年 3 月 1 日正式生效。本基金的基金管理人为招商基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及《招商安元保本混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金一般最长每 3 年为一个保本周期。在保本周期内，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、国债期货、货币市场工具、权证、股指期货，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具。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风险资产，其中保本资产为国内依法发行交易的债券、货币市场工具等，风险资产为股票、权证等。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合为：股票、权证等权益类资产占基金资产的比例不高于 40%；债券、货币市场工具等固定收益类资产占基金资产的比例不低于 60%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产

净值的 5%。本基金业绩比较基准为：人民银行公布的三年期银行定期存款利率(税后)。

## 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《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 2016 年 6 月 30 日的财务状况、自 2016 年 3 月 1 日（基金合同生效日）至 2016 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 重要会计政策和会计估计

### 6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2016 年 3 月 1 日（基金合同生效日）至 2016 年 6 月 30 日止。

### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

#### —金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和贷款及应收款项，暂无金融资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的各类应收款项、买入返售金融资产等在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产分类为贷款及应收款项。

#### —金融负债的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无分类为以公允价值计

量且其变动计入当期损益的金融负债。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。贷款及应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及金融负债按照公允价值进行后续计量，贷款及应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价（包括转出的非现金资产或承担的新金融负债）之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层次的输入值确定公允价值计量层次。第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

1) 对于银行间市场交易的固定收益品种，以及交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、资产支持证券和私募债券除外），按照第三方估值机构提供的估值确定公允价值。

2) 对存在活跃市场的其他投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值。

3) 对存在活跃市场的其他投资品种，如估值日无市价且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或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

4) 当投资品种不再存在活跃市场，基金管理人估值委员会认为必要时，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净值比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

##### -利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

##### -投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认。

债券投资收益为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本与应收利息(若有)后

的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

#### -公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产/负债的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产/负债卖出或到期时转出计入投资收益。

### 6.4.4.10 费用的确认和计量

根据《招商安元保本混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金基金管理人报酬按前一日基金资产净值的 1.2% 年费率逐日计提。

根据《招商安元保本混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金基金托管费按前一日基金资产净值的 0.2% 的年费率逐日计提。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的交易费用发生时按照确定的金额计入交易费用。

卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率逐日计提。

### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金在保本周期内仅采取现金分红一种收益分配方式，不进行红利再投资；本基金转型为“招商安元灵活配置混合型证券投资基金”后采用现金分红或红利再投资方式，基金份额持有人可选择现金分红或将现金红利自动转为基金份额进行再投资，基金份额持有人事先未做出选择的，本基金默认的收益分配方式为现金分红。在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%。若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

### 6.4.4.12 外币交易

本基金本报告期内无外币交易。

### 6.4.4.13 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策与计量基础一致。

#### 6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期内无其他重要的会计政策和会计估计。

#### 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

本基金本报告期内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

本基金本报告期内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》、财税[2014]48号《关于实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于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》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》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) 证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征营业税和增值税。
- 3) 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。
- 4) 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在收到相关扣收税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳；个人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，其中股权登记日在2015年9月8日之前的，暂减按25%计入应纳税所得额，股权登记日在2015年9月8日之后的，股息红利所得

暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

5) 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。

6) 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。

7) 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 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
活期存款	40,155,081.33
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	40,155,081.33

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	255,321,644.63	267,112.49
	银行间市场	1,279,206,707.23	1,921,292.77
	合计	1,534,528,351.86	2,188,405.26
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,534,528,351.86	1,536,716,757.12	2,188,405.26

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融工具。



**6.4.7.4 买入返售金融资产****6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间	389,401,584.10	-
合计	389,401,584.10	-

**6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

**6.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	8,321.02
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	6,483,407.61
应收买入返售证券利息	317,391.75
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	6,809,120.38

**6.4.7.6 其他资产**

本基金本报告期末无其他资产。

**6.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	48,722.77
合计	48,722.77

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2016 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	5,465.35
预提费用	109,641.40
合计	115,106.75

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016 年 3 月 1 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	1,985,071,831.95	1,985,071,831.95
本期申购	1,842,076.27	1,842,076.27
本期赎回(以“-”号填列)	-28,587,870.96	-28,587,870.96
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	1,958,326,037.26	1,958,326,037.26

注：1、本期申购含红利再投、转换入份(金)额，本期赎回含转换出份(金)额。

2、本基金自 2016 年 2 月 24 日起至 2016 年 3 月 4 日止期间公开发售，并提前于 2016 年 2 月 25 日募集完毕，有效净认购金额人民币 1,984,851,120.61 元，折算为 1,984,851,120.61 份基金份额。根据《招商安元保本混合型证券投资基金基金合同》的规定，经本基金注册登记人计算并确认，本基金认购资金在募集期内产生的利息人民币 220,711.34 元，折算为 220,711.34 份基金份额，划入基金持有人账户，两者合计 1,985,071,831.95 份基金份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	9,692,856.18	2,188,405.26	11,881,261.44
本期基金份额交易产生的变动数	-79,210.76	-9,771.37	-88,982.13
其中：基金申购款	5,286.72	282.55	5,569.27
基金赎回款	-84,497.48	-10,053.92	-94,551.40
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,613,645.42	2,178,633.89	11,792,279.31

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016年3月1日(基金合同生效日)至2016年6月30日
活期存款利息收入	274,769.07
定期存款利息收入	2,635,666.68
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	22,905.02
其他	0.17
合计	2,933,340.94

#### 6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期内无股票投资收益。

#### 6.4.7.13 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016年3月1日(基金合同生效日)至2016年6月30日
卖出债券(债转股及债券到期兑付)成交总额	82,258,821.28
减：卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	79,950,120.23
减：应收利息总额	833,486.95
买卖债券差价收入	1,475,214.10

#### 6.4.7.14 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 6.4.7.17 股利收益

本基金本报告期内无股利收益。

#### 6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2016年3月1日(基金合同生效日)至2016

	年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	2,188,405.26
——股票投资	-
——债券投资	2,188,405.26
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	2,188,405.26

#### 6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 3 月 1 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	362,663.70
转换转出收入	314.45
合计	362,978.15

注：1、本基金的赎回费率按基金持有人持有该部分基金份额的时间分段递减设定，于持有人赎回基金份额时收取，赎回费总额根据持有时间根据基金合同规定按一定比例归入基金资产

2、本基金的转换费由赎回费和申购费补差两部分组成，其中根据基金合同规定按一定比例归入转出基金的基金资产。

#### 6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 3 月 1 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	48.41
银行间市场交易费用	7,875.00
合计	7,923.41

#### 6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 3 月 1 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日
审计费用	19,934.80
信息披露费	89,706.60
银行费用	14,984.96

其他费用	400.00
合计	125,026.36

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 6.4.8.1 或有事项

本基金无需要披露的或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

### 6.4.9.1 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。

### 6.4.9.2 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
中国银行	基金托管人
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

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的股票交易。

#### 6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的债券交易。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年3月1日(基金合同生效日)至 2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015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	4,035,400,000.00	100.00%	-	-

#### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内无应支付关联方的佣金。

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2016年3月1日(基金合同生效日)至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	7,859,520.09
其中：支付销售机构的客户维护费	2,973,804.54

注：支付基金管理人招商基金管理有限公司的基金管理人报酬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。其计算公式为：

$$\text{日基金管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.2\% \div \text{当年天数}$$

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2016年3月1日(基金合同生效日)至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,309,919.97

注：支付基金托管人中国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。其计算公式为：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

根据基金合同的规定，招商安元保本混合 A 不收取销售服务费，招商安元保本混合 C 的销售服务费按基金前一日的资产净值×0.50%的年费率来计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{招商安元保本混合 C 的日销售服务费} = \text{前一日招商安元保本混合 C 资产净值} \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

由于招商安元保本混合 C 从基金成立至今无份额，因此本基金本报告期内无销售服务费。

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

**6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况****6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

**6.4.10.4.2 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。

**6.4.10.5 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 2016年3月1日(基金合同生效日)至2016年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行	40,155,081.33	274,769.07

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

**6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

**6.4.11 利润分配情况**

本基金本报告期内未进行利润分配。

**6.4.12 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券****6.4.12.1 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：人民币元

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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
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
127003	海印转债	2016年6月15日	2016年7月1日	新债流通受限	100.00	99.99	8,860	885,922.32	885,922.32	-
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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

本基金为混合型基金，本基金的运作涉及的金融工具主要包括股票投资、债券投资等。与这些金融工具有关的风险，以及本基金的基金管理人管理这些风险所采取的风险管理政策如下所述。

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人从事风险管理的目标是提升本基金风险调整后收益水平，保证本基金的基金资产安全，维护基金份额持有人利益。基于该风险管理目标，本基金的基金管理人风险管理的基本策略是识别和分析本基金运作使本基金面临各种类型的风险，确定适当的风险容忍度，并及时可靠地对各种风险进行监督，将风险控制在限定的范围之内。本基金目前面临的主要风险包括：市场风险、信用风险和流动性风险。与本基金相关的市场风险主要包括利率风险和市场价格风险。

本基金的基金管理人建立了以全面、独立、相互制约以及定性和定量相结合为原则的，监事会、董事会及下设风险控制委员会、督察长、风险管理委员会、法律合规部和风险管理部等多层次的风险管理组织架构体系。

##### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指金融工具的一方到期无法履行约定义务致使本基金遭受损失的风险。本基金的信用风险主要存在于银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资及其他。

本基金的银行存款存放于本基金的基金托管人中国银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在证券交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

对于与债券投资相关的信用风险，本基金的基金管理人通过对投资品种的信用等级评估来选



择适当的投资对象，并限制单个投资品种的持有比例来管理信用风险。附注 6.4.13.2.1 及 6.4.13.2.2 列示了于本报告期末及上年度末本基金所持有的债券投资的信用评级，该信用评级不包括本基金所持有的国债、央行票据、政策性金融债。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2016 年 6 月 30 日
A-1	470,469,000.00
A-1 以下	-
未评级	760,279,000.00
合计	1,230,748,000.00

注：上述评级均由经中国证监会核准从事证券市场资信评级业务的评级机构做出。

#### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2016 年 6 月 30 日
AAA	99,930,958.90
AA+	80,880,000.00
AA	3,653,875.90
AA-	885,922.32
未评级	-
合计	185,350,757.12

注：上述评级均由经中国证监会核准从事证券市场资信评级业务的评级机构做出。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指没有足够资金以满足到期债务支付的风险。本基金流动性风险来源于开放式基金每日兑付赎回资金的流动性风险，以及因部分投资品种交易不活跃而出现的变现风险以及因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理价格变现投资的风险。本基金所持有的交易性金融资产分别在证券交易所和银行间同业市场交易，除附注 6.4.12 所披露的流通受限不能自由转让的基金资产外，本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。除卖出回购金融资产款外，本基金所持有的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息。可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人在基金合同约定巨额赎回条款，设计

了非常情况下赎回资金的处理模式，控制因开放模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。日常流动性风险管理中，本基金的基金管理人每日监控和预测本基金的流动性指标，通过对投资品种的流动性指标来持续地评估、选择、跟踪和控制基金投资的流动性风险。同时，本基金通过预留一定的现金头寸，并且在需要时可通过卖出回购金融资产方式融入短期资金，以缓解流动性风险。

#### 6.4.13.4 市场风险

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的利率敏感性资产主要是银行存款、债券投资；持有的利率敏感性负债主要是卖出回购金融资产款。本基金的基金管理人日常通过对利率水平的预测、分析收益率曲线及优化利率重新定价日组合等方法对上述利率风险进行管理。

下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	40,155,081.33	-	-	-	-	-	40,155,081.33
存出保证金	48.41	-	-	-	-	-	48.41
交易性金融资产	-	-1,300,986,000.00	51,549,362.00	184,181,395.12	-	-	1,536,716,757.12
买入返售金融资产	389,401,584.10	-	-	-	-	-	389,401,584.10
应收利息	-	-	-	-	-	6,809,120.38	6,809,120.38
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	429,556,713.84	-1,300,986,000.00	51,549,362.00	184,181,395.12	6,809,120.38	-	1,973,082,591.34
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	535,608.16	535,608.16
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,941,288.95	1,941,288.95
应付托管费	-	-	-	-	-	323,548.14	323,548.14
应付交易费用	-	-	-	-	-	48,722.77	48,722.77
其他负债	-	-	-	-	-	115,106.75	115,106.75
负债总计	-	-	-	-	-	2,964,274.77	2,964,274.77
利率敏感度缺口	429,556,713.84	-1,300,986,000.00	51,549,362.00	184,181,395.12	3,844,845.61	-	1,970,118,316.57

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

**6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析**

假设	1.若市场利率平行上升或下降 50 个基点	
	2.其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额(人民币元)
		本期末 2016 年 6 月 30 日
	1.市场利率平行上升 50 个基点	-9, 326, 141. 66
	2.市场利率平行下降 50 个基点	9, 503, 074. 63

**6.4.13.4.2 其他价格风险**

其他价格风险是指以交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险，该风险可能与特定投资品种相关，也有可能与其他投资品种相关。本基金所持有的金融资产以公允价值计量，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金在构建资产配置和基金资产投资组合的基础上，通过建立事前和事后跟踪误差的方式，对基金资产的市场价格风险进行管理。

**6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口**

本基金本报告期末无股票投资、权证投资等权益性投资。

**6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析**

于本报告期末，本基金未持有股票投资、权证投资等权益性投资，若除市场利率和外汇汇率外的其他市场因素变化导致本基金所持有的权益性投资的市场价格上升或下降 5%且其他市场变量保持不变，对于本基金的基金资产净值无重大影响。

**6.4.14 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	-	-
	其中：股票	-	-

2	固定收益投资	1,536,716,757.12	77.88
	其中：债券	1,536,716,757.12	77.88
	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	389,401,584.10	19.74
	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	40,155,081.33	2.04
7	其他各项资产	6,809,168.79	0.35
8	合计	1,973,082,591.34	100.00

## 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

本基金本报告期内无股票投资变动。

## 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	70,238,000.00	3.57
2	央行票据	-	-
3	金融债券	50,380,000.00	2.56
	其中：政策性金融债	50,380,000.00	2.56
4	企业债券	180,810,958.90	9.18
5	企业短期融资券	1,230,748,000.00	62.47
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	4,539,798.22	0.23
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,536,716,757.12	78.00

## 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	041661012	16 渝两江 CP001	1,500,000	150,075,000.00	7.62
2	041653032	16 振华 CP001	1,200,000	120,444,000.00	6.11
3	011699859	16 津保税 SCP002	1,000,000	100,180,000.00	5.08
4	011699991	16 诚通控股 SCP001	1,000,000	100,040,000.00	5.08
5	011699765	16 中海运 SCP002	1,000,000	100,040,000.00	5.08

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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 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

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

本基金参与股指期货的投资应符合基金合同规定的保本策略和投资目标。本基金在股指期货投资中主要遵循有效管理投资策略，主要采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对现货和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货定价模型寻求其合理估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

本基金的股指期货投资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。

## 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

本基金参与国债期货投资是为了有效控制债券市场的系统性风险，本基金将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，适度运用国债期货提高投资组合运作效率。在国债期货投资过程中，基金管理人通过对宏观经济和利率市场走势的分析和判断，并充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置，谨慎进行投资，以调整债券组合的久期，降低投资组合的整体风险。

### 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

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

## 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	48.41
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	6,809,120.38
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,809,168.79

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

## § 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

份额 级别	持有人 户数	户均持有的基金份 额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	(户)		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
A类	7,966	245,835.56	400,052,000.00	20.43%	1,558,274,037.26	79.57%
C类	-	-	-	-	-	-
合计	7,966	245,835.56	400,052,000.00	20.43%	1,558,274,037.26	79.57%

注：分级基金机构投资者/个人投资者持有份额占总份额比例计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	A类	98,827.73	0.0050%
	C类	-	-
	合计	98,827.73	0.0050%

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

## 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的情况

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（2016年3月1日）基金份额总额	1,985,071,831.95
本报告期期初基金份额总额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	1,842,076.27
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	28,587,870.96
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	1,958,326,037.26

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

本基金本报告期未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

本基金本报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 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

本报告期基金投资策略无改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘用德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）为其审计机构，本报告所涵盖的审计期间为基金成立日（2016年3月1日）起至2016年12月31日止，本报告期应支付德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为人民币 50,000.00 元。

### 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	
招商证券	1	-	-	-	-	新增
华创证券	2	-	-	-	-	新增
中投证券	1	-	-	-	-	新增
东北证券	1	-	-	-	-	新增



民族证券	1	-	-	-	-	新增
方正证券	1	-	-	-	-	新增
大通证券	1	-	-	-	-	新增
华泰证券	2	-	-	-	-	新增
东海证券	1	-	-	-	-	新增
兴业证券	2	-	-	-	-	新增
太平洋证券	2	-	-	-	-	新增
信达证券	2	-	-	-	-	新增
国金证券	1	-	-	-	-	新增
第一创业证券	1	-	-	-	-	新增
海通证券	3	-	-	-	-	新增
国泰君安	3	-	-	-	-	新增
国盛证券	1	-	-	-	-	新增
银河证券	1	-	-	-	-	新增
长城证券	2	-	-	-	-	新增
中泰证券	2	-	-	-	-	新增
国信证券	2	-	-	-	-	新增
华安证券	1	-	-	-	-	新增
新时代证券	1	-	-	-	-	新增
安信证券	1	-	-	-	-	新增
光大证券	1	-	-	-	-	新增
东兴证券	3	-	-	-	-	新增
中信建投	6	-	-	-	-	新增
广发证券	1	-	-	-	-	新增
国海证券	1	-	-	-	-	新增
申万宏源	1	-	-	-	-	新增
中金公司	2	-	-	-	-	新增
长江证券	2	-	-	-	-	新增
红塔证券	2	-	-	-	-	新增
平安证券	1	-	-	-	-	新增
中信证券	2	-	-	-	-	新增
天风证券	2	-	-	-	-	新增
中银国际	3	-	-	-	-	新增

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
招商证券	-	-	4,035,400,000.00	100.00%	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
第一创业证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-

申万宏源	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-
中银国际	1,210,063.45	100.00%			

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	招商安元保本混合型证券投资基金基金合同	中国证券报、证券时报、上海证券报	2016年2月20日
2	招商安元保本混合型证券投资基金基金合同内容摘要	中国证券报、证券时报、上海证券报	2016年2月20日
3	招商安元保本混合型证券投资基金份额发售公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2016年2月20日
4	招商安元保本混合型证券投资基金招募说明书	中国证券报、证券时报、上海证券报	2016年2月20日
5	招商安元保本混合型证券投资基金托管协议	中国证券报、证券时报、上海证券报	2016年2月20日
6	招商基金管理有限公司关于养老金账户通过直销中心认购旗下招商安元保本混合型证券投资基金A类基金份额费率优惠的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2016年2月20日
7	关于招商安元保本混合型证券投资基金增加天天基金等公司为销售机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2016年2月24日
8	关于招商安元保本混合型证券投资基金提前结束募集的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2016年2月26日
9	关于招商安元保本混合型证券投资基金认购申请确认比例结果公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2016年2月29日
10	招商安元保本混合型证券投资基金基金合同生效公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2016年3月2日
11	招商基金旗下部分基金增加上海利得为代销机构并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2016年3月14日
12	关于开放招商安元保本混合型证券投资基金日常申购赎回及转换和定期定额投资业务的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2016年3月29日

13	招商基金管理有限公司关于参加深圳市新兰德证券投资咨询有限公司费率优惠的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2016年3月31日
14	招商基金关于招商安元保本混合型证券投资基金参加中国银行、交通银行、平安银行基金定投申购优惠活动、网上交易系统申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2016年4月1日
15	关于招商基金旗下部分基金增加钱景财富为代销机构并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2016年4月21日
16	关于淘宝基金理财平台和支付宝基金支付业务下线的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2016年4月26日
17	关于招商基金旗下部分基金增加新浪仓石为代销机构并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2016年4月27日
18	关于招商基金旗下部分基金增加苏宁为代销机构并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2016年5月13日
19	招商基金管理有限公司关于旗下部分产品增加宁波银行为代销机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2016年5月16日
20	招商基金旗下部分基金增加奕丰金融为代销机构并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2016年5月24日
21	招商基金管理有限公司关于旗下部分产品增加大连银行为代销机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2016年5月31日
22	招商基金管理有限公司关于旗下部分产品增加东莞农商银行作为代销机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2016年6月17日
23	招商基金旗下部分基金增加陆金所资管为代销机构及开通定投的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2016年6月28日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

由于本基金 C 类份额从成立至报告期末未有资金进入，本基金 XBRL 报送版本按照未分级的普通基金模板披露，报告中披露的内容均为本基金 A 类份额的情况。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会批准设立招商基金管理有限公司的文件；
- 2、中国证券监督管理委员会批准招商安元保本混合型证券投资基金设立的文件；
- 3、《招商安元保本混合型证券投资基金基金合同》；
- 4、《招商安元保本混合型证券投资基金托管协议》；
- 5、《招商安元保本混合型证券投资基金招募说明书》；
- 6、《招商安元保本混合型证券投资基金 2016 年第 2 季度报告》；
- 7、《招商安元保本混合型证券投资基金 2016 年半年度报告》；
- 8、《招商安元保本混合型证券投资基金 2016 年半年度报告摘要》。

### 12.2 存放地点

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

### 12.3 查阅方式

上述文件可在招商基金管理有限公司互联网站上查阅，或者在营业时间内到招商基金管理有限公司查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人招商基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-887-9555

网址：<http://www.cmfcchina.com>

招商基金管理有限公司  
2016 年 8 月 24 日