

招商安泰系列开放式证券投资基金之

招商安泰平衡型证券投资基金

2016 年半年度报告摘要

（本系列基金由招商安泰偏股混合型证券投资基金、招商安泰平衡型证券投资基金和招商安泰债券投资基金组成）

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：招商银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 24 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。

基金托管人招商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 2016 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	招商安泰平衡混合
基金主代码	217002
交易代码	217002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003 年 4 月 28 日
基金管理人	招商基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	70,947,368.06 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	追求当期收益和长期资本增值的平衡。
投资策略	资产配置方面，本基金股票/债券的配置比例相对固定，一般不再做战术性的资产配置，只在操作上保证必要的灵活性。即，考虑到基金管理时实际的操作需要，本基金允许股票/债券配置比例以基准比例为中心在适当的范围内进行调整。股票投资方面，强调将定量的股票筛选和定性的公司研究有机结合，并实时应用行业评估方法和风险控制手段进行组合调整。其中，公司研究是整个股票投资流程的核心。通过研究，得出对公司盈利成长潜力和合理价值水平的评价，从而发掘出价值被市场低估并具有良好现金流成长性的股票。债券投资方面，采用主动的投资管理，获得与风险相匹配的收益率，同时保证组合的流动性满足正常的现金流需要。
业绩比较基准	中证国债指数收益率*50%+上证 180 指数收益率*45%+同业存款利率*5%
风险收益特征	相对而言，在本系列基金中，本基金短期本金安全性适中，当期收益适中，长期资本增值适中，总体投资风险适中。

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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	潘西里	张燕
	联系电话	0755-83196666	0755-83199084
	电子邮箱	cmf@cmfchina.com	yan_zhang@cmbchina.com

客户服务电话	400-887-9555	95555
传真	0755-83196475	0755-83195201

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) 招商银行股份有限公司资产托管部 地址：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1月1日 - 2016年6月30日)
本期已实现收益	-1,798,770.93
本期利润	-8,065,725.50
加权平均基金份额本期利润	-0.1111
本期基金份额净值增长率	-9.15%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0757
期末基金资产净值	76,321,220.68
期末基金份额净值	1.0757

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认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、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

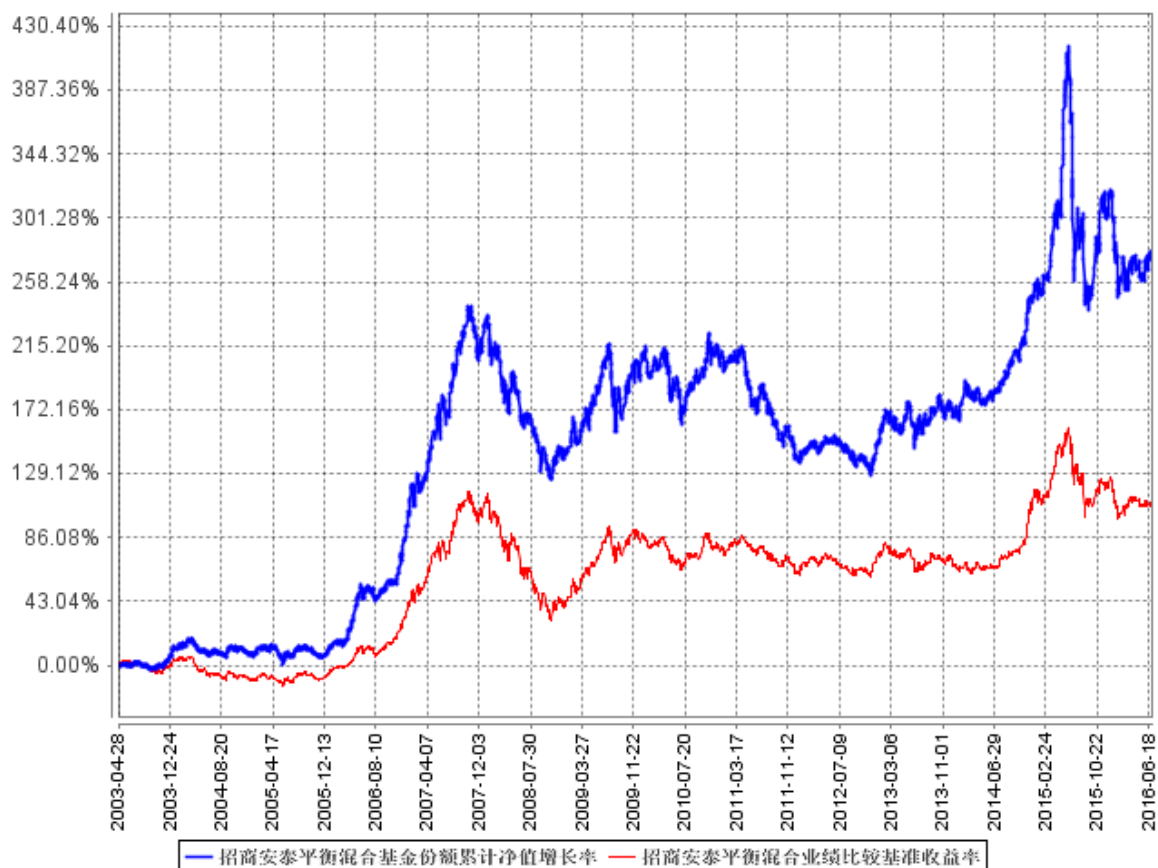
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	2.74%	0.87%	-0.27%	0.40%	3.01%	0.47%

过去三个月	2.01%	0.75%	-1.19%	0.43%	3.20%	0.32%
过去六个月	-9.15%	1.27%	-6.07%	0.81%	-3.08%	0.46%
过去一年	-11.66%	1.43%	-12.33%	1.03%	0.67%	0.40%
过去三年	48.27%	1.13%	27.22%	0.84%	21.05%	0.29%
自基金合同生效起至今	277.64%	0.95%	109.91%	0.81%	167.73%	0.14%

注：业绩比较基准收益率=中证国债指数收益率*50%+上证 180 指数收益率*45%+同业存款利率*5%，业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

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

招商安泰平衡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：招商安泰平衡混合的债券/股票配置范围为：债券 40%—60%，股票 35%—55%。根据本系列基金合同规定，本基金设立后，投资建仓期为三个月，特殊情况下不超过六个月。本基金于 2003 年 4 月 28 日成立，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。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		
李崑	本基金基金经理	2016 年 2 月 3 日	-	13	男，硕士。2002 年 7 月加入中国工商银行股份有限公司；2003 年 9 月加入长盛基金管理有限公司，曾任交易部总监、行业研究员以及投资经理；2013 年 12 月加入国投财务有限公司，任权益投资总监；2015 年 12 月加入招商基金管理有限公司，现任招商安泰平衡型证券投资基金及招商安润保本混合型证券投资基金基金经理。
李恭敏	离任本基金基金经理	2015 年 6 月 11 日	2016 年 2 月 3 日	6	男，经济学硕士。2008 年加入中国出口信用保险公司，任研究员，2010 年 2 月加入招商基金管理有限公司，曾任研究部高级研究员，固定收益投资部高级研究员，投资管理三部高级研究员，从事上市公司证券研究，曾任招商安润保本混合型证券投资基金及招商安泰平衡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合规守信情况的说明

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《招商安泰系列开放式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

报告期内，在改革创新深入推进和宏观政策效应不断释放的共同作用下，国民经济保持了总

体平稳、稳中有进、稳中有好的发展态势。第三产业继续保持较快发展，民间投资下降较快，需求结构继续改善，内需仍是支撑中国经济稳定增长的决定因素，消费的贡献在提升。从区域结构来看，中西部地区工业增加值增速普遍要高于东部。上半年股市下跌 17.22%，计算机、传媒等行业跌幅较大。

报告期内本基金仓位保持市场较高水平，行业配置偏向高端装备制造及新能源汽车产业链等方向。

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 1.0757 元，本报告期份额净值增长率为-9.15%，同期业绩比较基准增长率为-6.07%，基金净值表现弱于业绩比较基准，幅度为 3.08%，主要原因是：一月份市场大幅度下挫，由于最低仓位限制较高，不能减仓导致净值损失。其二，一月份持仓以中小盘股票为主，跌幅比大盘股大。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

外围经济总体上仍呈现低位徘徊态势，虽然欧美股市均创出近期新高，但投资者对未来并不十分乐观。英国脱欧，又给世界经济增加了一个风险因素，使得美国加息预期进一步减弱。

展望国内经济，宏观经济逐渐走出低谷，供给侧改革持续推进，结构性改革初见成效，国内消费持续增长，预计未来在经济运行中会出现更多的亮点。

尽管经历上半年的大幅度下跌，但对国内股市中长期乐观判断保持不变。未来将从行业景气度，估值等多方面综合选择投资标的。

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

托管人声明，在本报告期内，基金托管人一招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同，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

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、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，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§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：招商安泰平衡型证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	2,952,428.41	6,707,820.12
结算备付金	232,156.39	483,722.88
存出保证金	30,826.41	96,752.40
交易性金融资产	71,368,313.38	78,377,955.21
其中：股票投资	39,927,105.48	32,005,766.91
基金投资	-	-
债券投资	31,441,207.90	46,372,188.30
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	2,200,000.00	-
应收证券清算款	4,396,061.71	3,000,002.22
应收利息	347,793.03	1,139,479.27
应收股利	-	-
应收申购款	13,002.00	27,728.22
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	81,540,581.33	89,833,460.32
负债和所有者权益	本期末	上年度末

	2016 年 6 月 30 日	2015 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	-	-
应付证券清算款	3,823,906.74	1,752,797.82
应付赎回款	1,107,850.22	58,515.98
应付管理人报酬	94,936.18	115,405.39
应付托管费	15,822.71	19,234.26
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	81,706.06	256,825.20
应交税费	5,466.40	5,466.40
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	89,672.34	120,000.00
负债合计	5,219,360.65	2,328,245.05
所有者权益:		
实收基金	70,947,368.06	73,907,607.38
未分配利润	5,373,852.62	13,597,607.89
所有者权益合计	76,321,220.68	87,505,215.27
负债和所有者权益总计	81,540,581.33	89,833,460.32

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0757 元，基金份额总额 70,947,368.06 份。

6.2 利润表

会计主体：招商安泰平衡型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2016 年 1 月 1 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
一、收入	-7,087,900.42	39,270,326.05
1.利息收入	946,502.86	2,369,861.46
其中：存款利息收入	26,000.89	64,464.18
债券利息收入	913,382.19	2,284,708.14
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	7,119.78	20,689.14
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-1,778,202.69	46,286,059.20
其中：股票投资收益	-2,912,498.74	45,588,162.79

基金投资收益	-	-
债券投资收益	1,023,511.11	570,838.00
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	110,784.94	127,058.41
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-6,266,954.57	-9,609,230.54
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	10,753.98	223,635.93
减：二、费用	977,825.08	3,367,620.92
1. 管理人报酬	571,256.15	1,415,331.91
2. 托管费	95,209.32	235,888.67
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	234,500.17	1,565,244.52
5. 利息支出	7,777.10	86,170.26
其中：卖出回购金融资产支出	7,777.10	86,170.26
6. 其他费用	69,082.34	64,985.56
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-8,065,725.50	35,902,705.13
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-8,065,725.50	35,902,705.13

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：招商安泰平衡型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 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）	73,907,607.38	13,597,607.89	87,505,215.27
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-8,065,725.50	-8,065,725.50
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-2,960,239.32	-158,029.77	-3,118,269.09

(净值减少以“-”号填列)			
其中：1.基金申购款	10,218,703.57	636,864.30	10,855,567.87
2.基金赎回款	-13,178,942.89	-794,894.07	-13,973,836.96
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)	70,947,368.06	5,373,852.62	76,321,220.68
项目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015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)	207,474,778.91	37,646,316.93	245,121,095.84
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	35,902,705.13	35,902,705.13
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)	-126,406,561.27	-38,009,858.70	-164,416,419.97
其中：1.基金申购款	59,485,563.46	24,114,693.23	83,600,256.69
2.基金赎回款	-185,892,124.73	-62,124,551.93	-248,016,676.66
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)	81,068,217.64	35,539,163.36	116,607,381.00

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：

金旭

欧志明

何剑萍

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

招商安泰平衡型证券投资基金(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》、《招商安泰系列开放式证券投资基金基金合同》及其

他有关法律法規的规定，经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2003]35 号文批准公开发售。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 899,398,583.28 份，经德勤华永会计师事务所有限公司验证，并出具了编号为德师报(验)字(03)第 024 号验资报告。《招商安泰系列开放式证券投资基金基金合同》于 2003 年 04 月 28 日正式生效。本基金因自 2007 年 07 月 01 日起执行财政部于 2006 年 02 月 15 日颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)，于 2007 年 09 月 28 日公告了修改后的基金合同(以下简称“修改后的基金合同”)。本基金的基金管理人为招商基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、修改后的基金合同及截至报告期末最新公告的《招商安泰系列开放式证券投资基金更新的招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为股票、债券以及中国证监会批准的其他投资品种。股票投资范围为所有在国内依法发行的，具有良好流动性的 A 股。债券投资的主要品种包括国债、金融债、公司债与可转换债等。本基金的投资组合为：股票投资占基金资产的比例为 35%至 55%，债券投资占基金资产的比例为 40%至 60%，现金或者到期日在一年期以内的政府债券占基金资产的比率 \geq 5%。本基金的业绩比较基准采用：中证国债指数收益率*50%+上证 180 指数收益率*45%+同业存款利率*5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 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 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》、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 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

本报告期不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。

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
招商银行	基金托管人、基金管理人的股东

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

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的股票交易。

6.4.8.1.2 债券交易

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的债券交易。

6.4.8.1.3 债券回购交易

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的债券回购交易。

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的权证交易。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间内无应支付关联方的佣金。

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 2016年1月1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
当期发生的基金应支付的管理费	571,256.15	1,415,331.91
其中：支付销售机构的客户维护费	14,286.44	21,664.58

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×1.50%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：

$$\text{日基金管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.50\% \div 365$$

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	95,209.32	235,888.67

注：支付基金托管人招商银行的基金托管费按前一日基金资产净值×0.25%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：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% \div 365$$

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内无与关联交易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自有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间内基金管理人无运用自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		上年度可比期间	
	2016年1月1日至2016年6月30日		2015年1月1日至2015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
招商银行	2,952,428.41	23,825.08	3,159,547.98	50,894.35

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，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内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.9 期末（2016 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
000926	福星股份	2016 年 1 月 21 日	2017 年 1 月 23 日	非公开发行流通受限	12.66	11.73	236,967	3,000,002.22	2,779,622.91	-

注：以上“可流通日”中，部分证券的日期是根据上市公司公告估算的流通日期。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
000638	万方发展	2016 年 1 月 5 日	重大事项	23.65	2016 年 7 月 25 日	24.75	93,433	1,964,347.64	2,209,690.45	-
300362	天翔环境	2016 年 1 月 11 日	重大事项	53.51	2016 年 7 月 28 日	17.60	27,850	1,758,580.00	1,490,253.50	-

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

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。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末持有的债券中无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

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	39,927,105.48	48.97
	其中：股票	39,927,105.48	48.97
2	固定收益投资	31,441,207.90	38.56
	其中：债券	31,441,207.90	38.56
	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	2,200,000.00	2.70
	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	3,184,584.80	3.91
7	其他各项资产	4,787,683.15	5.87
8	合计	81,540,581.33	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	-	-
B	采矿业	3,572,599.91	4.68
C	制造业	21,429,552.95	28.08
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	2,209,690.45	2.90
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	2,991,296.00	3.92
J	金融业	6,944,343.26	9.10
K	房地产业	2,779,622.91	3.64
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	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	39,927,105.48	52.31
--	----	---------------	-------

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	601318	中国平安	120,800	3,870,432.00	5.07
2	600893	中航动力	103,000	3,568,950.00	4.68
3	600391	成发科技	91,301	3,510,523.45	4.60
4	000738	中航动控	119,000	3,141,600.00	4.12
5	000911	南宁糖业	119,800	3,004,584.00	3.94
6	600547	山东黄金	77,101	2,999,999.91	3.93
7	600570	恒生电子	44,800	2,991,296.00	3.92
8	000926	福星股份	236,967	2,779,622.91	3.64
9	601336	新华保险	57,100	2,306,840.00	3.02
10	000638	万方发展	93,433	2,209,690.45	2.90

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	601318	中国平安	7,331,091.97	8.38
2	600893	中航动力	3,871,219.00	4.42
3	600391	成发科技	3,849,646.36	4.40
4	000738	中航动控	3,670,435.97	4.19
5	600547	山东黄金	3,064,646.02	3.50
6	600259	广晟有色	3,007,203.00	3.44
7	000926	福星股份	3,000,002.22	3.43
8	600570	恒生电子	2,991,668.00	3.42
9	000911	南宁糖业	2,958,922.00	3.38
10	002108	沧州明珠	2,654,096.00	3.03
11	600019	宝钢股份	2,614,590.41	2.99
12	603308	应流股份	2,610,652.27	2.98

13	601336	新华保险	2,300,870.00	2.63
14	601628	中国人寿	2,300,346.50	2.63
15	601225	陕西煤业	2,293,500.00	2.62
16	002547	春兴精工	2,245,509.00	2.57
17	002355	兴民钢圈	2,180,395.00	2.49
18	600435	北方导航	1,913,348.50	2.19
19	300014	亿纬锂能	1,883,808.40	2.15
20	000018	神州长城	1,882,607.00	2.15
21	300496	中科创达	1,879,764.00	2.15

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	601318	中国平安	3,479,471.50	3.98
2	002108	沧州明珠	3,342,119.10	3.82
3	603308	应流股份	2,863,552.45	3.27
4	600259	广晟有色	2,646,284.04	3.02
5	300014	亿纬锂能	2,507,963.00	2.87
6	600019	宝钢股份	2,475,980.00	2.83
7	601225	陕西煤业	2,472,089.02	2.83
8	002650	加加食品	2,239,028.00	2.56
9	000018	神州长城	2,113,490.00	2.42
10	002355	兴民钢圈	2,061,778.62	2.36
11	002547	春兴精工	2,048,921.61	2.34
12	002445	中南文化	1,996,888.00	2.28
13	603799	华友钴业	1,909,500.31	2.18
14	600986	科达股份	1,838,904.58	2.10
15	000567	海德股份	1,810,224.00	2.07
16	600312	平高电气	1,794,198.17	2.05
17	300496	中科创达	1,781,045.95	2.04
18	600406	国电南瑞	1,773,944.00	2.03
19	600765	中航重机	1,757,050.00	2.01

20	002414	高德红外	1,745,181.62	1.99
----	--------	------	--------------	------

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	88,663,379.47
卖出股票收入（成交）总额	72,815,053.42

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	18,103,080.20	23.72
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	9,229,825.20	12.09
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	4,108,302.50	5.38
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	31,441,207.90	41.20

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	010107	21 国债(7)	131,610	14,224,408.80	18.64

2	122833	11 赣城债	72,730	7,623,558.60	9.99
3	110031	航信转债	37,250	4,108,302.50	5.38
4	019533	16 国债 05	38,810	3,878,671.40	5.08
5	122912	10 鄂国资	16,220	1,606,266.60	2.10

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 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

根据本基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

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除恒生电子（股票代码 600570.SH）外其他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。

恒生电子股份有限公司关于控股子公司杭州恒生网络技术服务有限公司拟受到中国证监会行政处罚的公告：

恒生网络开发具有开立证券交易子账户、接受证券交易委托、查询证券交易信息、进行证券和资金的交易结算清算等多种证券业务属性功能的系统。通过该系统，投资者不履行实名开户程序即可进行证券交易。恒生网络在明知客户的经营方式的情况下，仍向不具有经营证券业务资质的客户销售系统、提供相关服务，并获取非法收益，严重扰乱证券市场秩序。恒生网络的上述行为违反了《证券法》第一百二十二条的规定，构成《证券法》第一百九十七条所述非法经营证券业务的行为。

对该股票的投资决策程序的说明：本基金管理人认为公司是区块链+金融的龙头，具备独特优势，此外，恒生电子在券商、基金、私募、银行、交易所等客户中具有极高的粘性与市场占有率，具备较高的产品议价能力，维持推荐评级。

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	30,826.41
2	应收证券清算款	4,396,061.71
3	应收股利	-
4	应收利息	347,793.03
5	应收申购款	13,002.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,787,683.15

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	110031	航信转债	4,108,302.50	5.38

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	000926	福星股份	2,779,622.91	3.64	非公开发行
2	000638	万方发展	2,209,690.45	2.90	重大事项

§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
4,919	14,423.13	19,519,856.24	27.51%	51,427,511.82	72.49%

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	72,731.13	0.1025%

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、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	0~10
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(2003年4月28日)基金份额总额	899,398,583.28
本报告期期初基金份额总额	73,907,607.38
本报告期基金总申购份额	10,218,703.57
减:本报告期基金总赎回份额	13,178,942.89
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-
本报告期末基金份额总额	70,947,368.06

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

本基金本报告期末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	
中信证券	1	86,209,811.75	54.40%	80,287.28	54.40%	-
申银万国	1	72,268,618.92	45.60%	67,303.50	45.60%	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	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
中信证券	31,103,052.56	100.00%	95,100,000.00	100.00%	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-

招商基金管理有限公司
2016年8月24日