

招商安达灵活配置混合型证券投资基金
2017 年年度报告
(原招商安达保本混合型证券投资基金)

2017 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

送出日期：2018 年 3 月 30 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。

基金托管人中国农业银行根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 29 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。

招商安达灵活配置混合型证券投资基金由招商安达保本混合型证券投资基金于 2017 年 10 月 10 日转型而来。根据《招商安达保本混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金每三年为一个保本周期，本基金第二个保本周期到期日为 2017 年 10 月 9 日，原基金保本周期到期时，由于未能符合保本基金存续条件，依照合同约定，本基金将转型为非避险策略型的混合型基金，即招商安达灵活配置混合型证券投资基金。招商安达保本混合型证券投资基金的保本周期到期日，即 2017 年 10 月 9 日当日，本基金接受赎回、转换转出申请、不接受申购和转换转入申请。自 2017 年 10 月 10 日，招商安达保本混合型证券投资基金转型为招商安达灵活配置混合型证券投资基金。转型后的基金投资目标、投资范围、投资策略、业绩基准及风险收益特征与转型前差异较大。

相关公告刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站。

本报告财务资料已经审计，德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了 2017 年度无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告中招商安达灵活配置混合型证券投资基金的报告期自 2017 年 10 月 10 日（转型生效日）起至 2017 年 12 月 31 日止，招商安达保本混合型证券投资基金的报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 2017 年 10 月 9 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§2 基金简介	4
2.1 基金基本情况（转型后）.....	4
2.1 基金基本情况（转型前）.....	4
2.2 基金产品说明（转型后）.....	4
2.2 基金产品说明（转型前）.....	5
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.....	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现（转型后）.....	7
3.2 基金净值表现（转型前）.....	9
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	11
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
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.....	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	18
4.9 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.....	18
§5 托管人报告	19
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	19
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.....	19
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	19
§6 审计报告（转型后）	20
§7 年度财务报表（转型后）	24
7.1 资产负债表（转型后）.....	24
7.2 利润表.....	25
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	26
7.4 报表附注.....	26
§7 年度财务报表（转型前）	45
7.1 资产负债表（转型前）.....	45
7.2 利润表.....	46
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	47
7.4 报表附注.....	48
§8 投资组合报告（转型后）	68
8.1 期末基金资产组合情况.....	68

8.2 期末按行业分类的股票投资组合	69
8.3 报告期内股票投资组合的重大变动	70
8.4 期末按债券品种分类的债券投资组合	72
8.5 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	73
8.6 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	73
8.7 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	73
8.8 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	73
8.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	73
8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	73
8.11 投资组合报告附注	73
§8 投资组合报告（转型前）	75
8.1 期末基金资产组合情况	75
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	75
8.3 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	76
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	76
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	78
8.6 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	79
8.7 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	79
8.8 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	79
8.9 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	79
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	79
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	79
8.12 投资组合报告附注	79
§9 基金份额持有人信息	80
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	80
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	80
9.3 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	81
§10 开放式基金份额变动	81
§11 重大事件揭示	81
11.1 基金份额持有人大会决议	81
11.2 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	81
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	81
11.4 基金投资策略的改变	81
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	82
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	82
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	82
11.9 其他重大事件（转型后）	83
11.9 其他重大事件（转型前）	84
§12 备查文件目录	88
13.1 备查文件目录	88
13.2 存放地点	88
13.3 查阅方式	88

§2 基金简介

2.1 基金基本情况（转型后）

基金名称	招商安达灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	招商安达灵活配置
基金主代码	217020
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 10 月 9 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
报告期末基金份额总额	241,132,902.01 份
基金合同存续期	不定期

2.1 基金基本情况（转型前）

基金名称	招商安达保本混合型证券投资基金
基金简称	招商安达保本混合
基金主代码	217020
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 9 月 1 日
基金管理人	招商基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	602,042,667.94 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明（转型后）

投资目标	通过灵活动态的资产配置，在股市和债市之间选择投资机会，精选股票和债券品种，适当集中投资，致力于在多种市场环境下为投资者创造超额收益。
投资策略	<p>资产配置方法：在资产配置方法上，投资组合管理人在借鉴国际先进投资技术的基础上，结合国内实际情况和自身的投资管理经验，建立了自己的资产配置体系。招商基金的资产配置体系分为战略资产配置和战术资产配置。</p> <p>股票投资策略：本基金的股票投资采取自下而上的方法，以深入的基本面研究为基础，精选具有一定核心优势的且成长性良好、价值被低估的上市公司股票，构建投资组合，以寻求超越业绩基准的超额收益。</p> <p>货币市场工具投资策略：在本基金的货币市场工具投资过程中，将以严谨的市场价值分析为基础，采用稳健的投资组合策略，通过对短期金融工具的组合操作，在保持资产流动性的同时，追求稳定的投资收益。</p> <p>债券投资策略：根据国内外宏观经济形势、财政、货币政策、市场资金与债券供求状况、央行公开市场操作等方面情况，采用定性与定量相结合的方式，确定债券投资的组合久期，并根据通胀预期确定浮息债与固定收益债比例；在满足组合久期设置的基础上，投资团队分析债券收益率</p>

	<p>曲线变动、各期限段品种收益率及收益率基差波动等因素，预测收益率曲线的变动趋势，并结合流动性偏好、信用分析等多种市场因素进行分析，综合评判个券的投资价值。在个券选择的基础上，投资团队构建模拟组合，并比较不同模拟组合之间的收益和风险匹配情况，确定风险、收益最佳匹配的组合。</p> <p>权证投资策略：本基金对权证资产的投资主要是通过分析影响权证内在价值最重要的两种因素——标的资产价格以及市场隐含波动率的变化，灵活构建避险策略，波动率差策略以及套利策略。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×55%+标普中国全债指数收益率×45%
风险收益特征	本基金是混合型基金，属于基金中的中高风险品种

2.2 基金产品说明（转型前）

投资目标	通过保本资产与风险资产的动态配置和有效的组合管理，在确保保本周期到期时安全的基础上，寻求组合资产的稳定增长和保本期间收益的最大化。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的研究优势，将严谨、规范化的基本面研究分析与积极主动的投资风格相结合，利用恒定比例组合保险（CPPI、Constant Proportion Portfolio Insurance）技术，动态调整保本资产与风险资产的投资比例，以确保保本周期到期时，实现基金资产在保本基础上的保值增值的目的。
业绩比较基准	三年期银行定期存款收益率（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。

注：

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	潘西里	贺倩
	联系电话	0755-83196666	010-66060069
	电子邮箱	cmf@cmfchina.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-887-9555	95599
传真		0755-83196475	010-68121816
注册地址		深圳市福田区深南大道 7088 号	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		中国深圳深南大道 7088 号招商银行大厦	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		518040	100031
法定代表人		李浩	周慕冰

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、上海证券报、证券时报
----------------	------------------

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.cmfchina.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）	中国上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

转型后

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2017 年 10 月 10 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日
本期已实现收益	6,088,633.97
本期利润	13,943,843.88
加权平均基金份额本期利润	0.0491
本期加权平均净值利润率	3.99%
本期基金份额净值增长率	4.37%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年 12 月 31 日
期末可供分配利润	121,685,536.30
期末可供分配基金份额利润	0.5046
期末基金资产净值	307,535,733.50
期末基金份额净值	1.2754
3.1.3 累计期末指标	2017 年 12 月 31 日
基金份额累计净值增长率	4.37%

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、本基金于 2017 年 10 月 9 日转型为招商安达灵活配置混合型证券投资基金，新基金合同于 2017 年 10 月 10 日生效，截至本报告期末成立未满一年，本报告期为非完整会计年度。

转型前

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2017 年 1 月 1 日至	2016 年	2015 年
---------------	-----------------	--------	--------

	2017 年 10 月 9 日		
本期已实现收益	4,209,992.48	39,129,397.44	611,983,683.41
本期利润	13,849,265.34	-58,035,431.41	613,555,953.84
加权平均基金份额本期利润	0.0190	-0.0614	0.2582
本期加权平均净值利润率	1.59%	-5.09%	20.77%
本期基金份额净值增长率	2.00%	-3.62%	13.00%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年 10 月 9 日	2016 年末	2015 年末
期末可供分配利润	134,562,825.52	354,760,761.40	641,347,003.43
期末可供分配基金份额利润	0.2235	0.4278	0.4725
期末基金资产净值	735,896,831.73	993,865,032.50	1,687,255,111.07
期末基金份额净值	1.222	1.198	1.243
3.1.3 累计期末指标	2017 年 10 月 9 日	2016 年末	2015 年末
基金份额累计净值增长率	58.60%	55.49%	61.34%

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、本基金自 2017 年 10 月 10 日转型，截止报告期末未满一年，本报告期末为非完整会计年度数据。

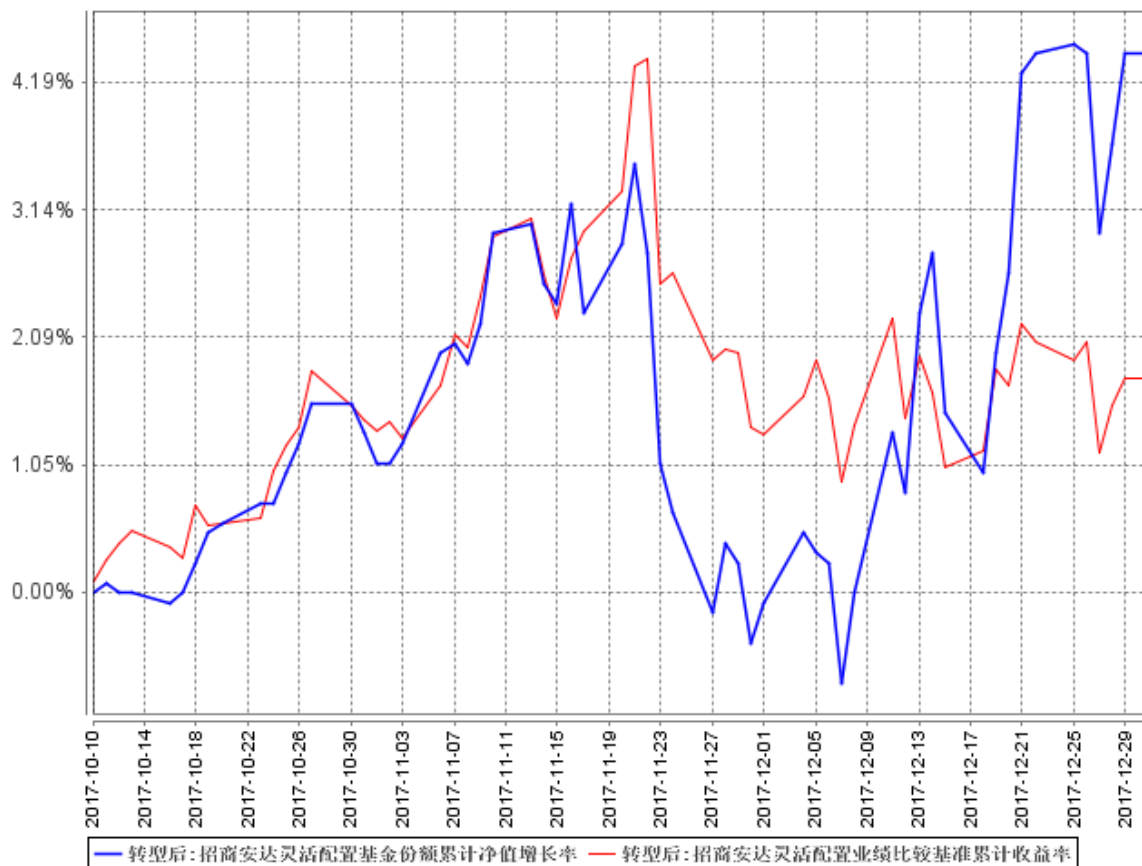
3.2 基金净值表现（转型后）

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
过去三个月	4.37%	0.63%	1.75%	0.45%	2.62%	0.18%
自新基金合同生效起至今	4.37%	0.63%	1.75%	0.45%	2.62%	0.18%

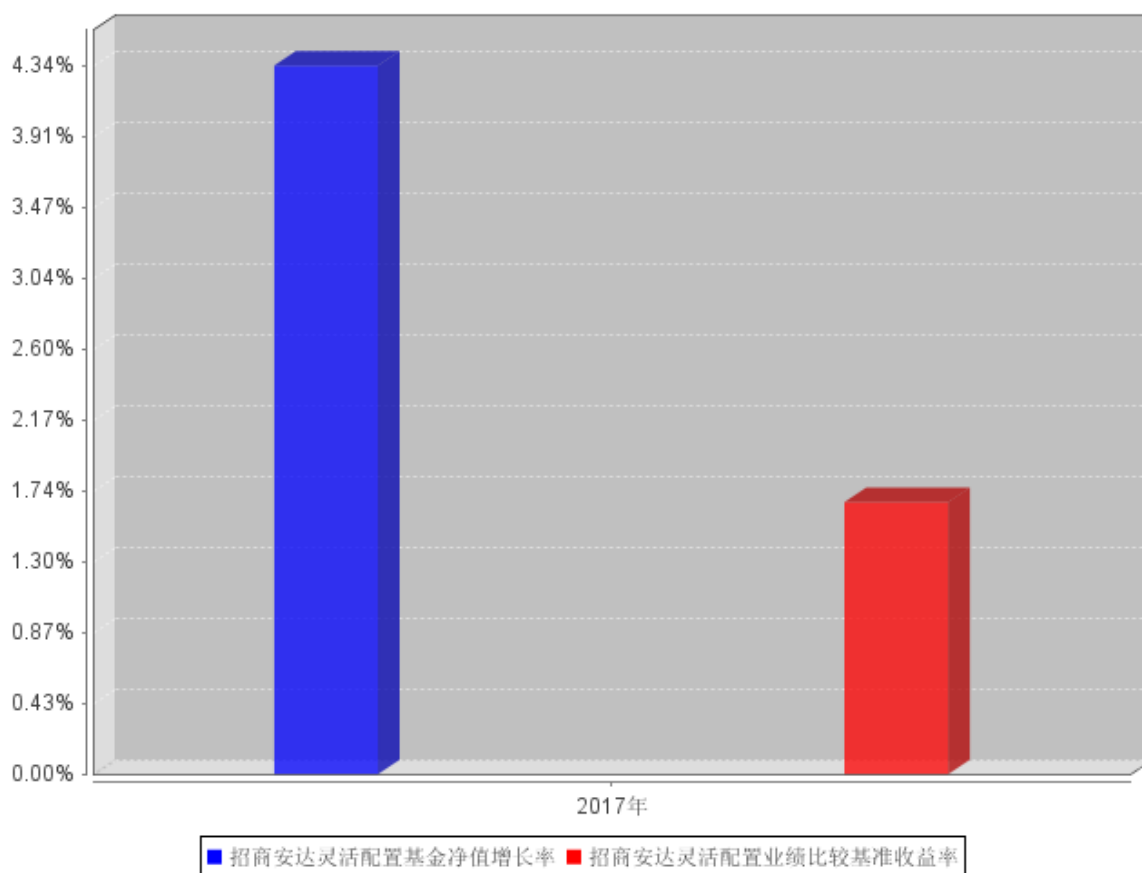
3.2.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

招商安达灵活配置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



3.2.3 自基金转型以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

招商安达灵活配置过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金由招商安达保本混合型证券投资基金转型而来，并于 2017 年 10 月 10 日生效，截至 2017 年 12 月 31 日未满一年，成立当年收益率按当年实际存续期计算。

3.2 基金净值表现（转型前）

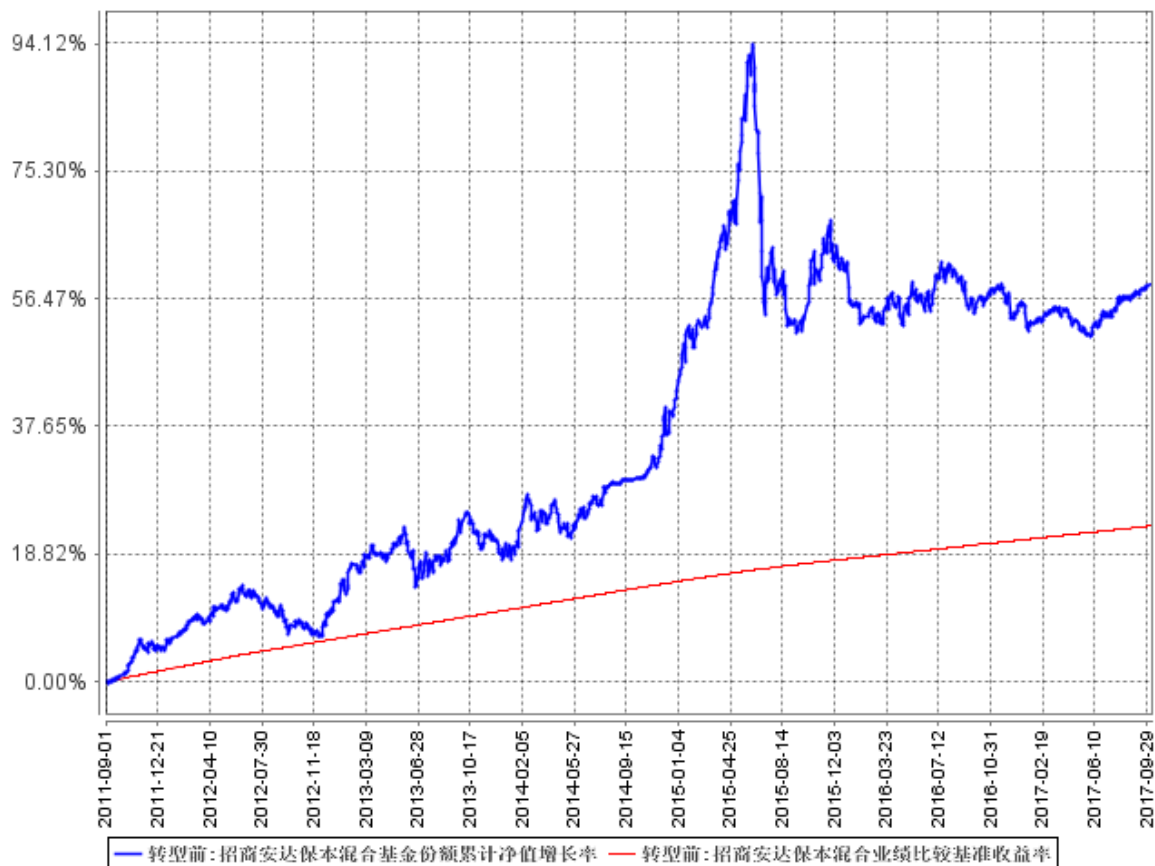
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	0.16%	0.00%	0.43%	0.01%	-0.27%	-0.01%
过去六个月	3.38%	0.21%	1.01%	0.01%	2.37%	0.20%
过去一年	1.92%	0.27%	2.34%	0.01%	-0.42%	0.26%
过去三年	22.08%	0.64%	8.07%	0.01%	14.01%	0.63%
过去五年	45.77%	0.59%	16.79%	0.01%	28.98%	0.58%
自基金合同生效起至今	58.60%	0.55%	22.99%	0.01%	35.61%	0.54%

注：自 2017 年 10 月 10 日，招商安达保本混合型证券投资基金转型为招商安达灵活配置混合型证券投资基金，因此上表的结束日期为 2017 年 10 月 9 日，本基金转型前以三年期定期存款税后利率作为本基金的业绩比较基准。

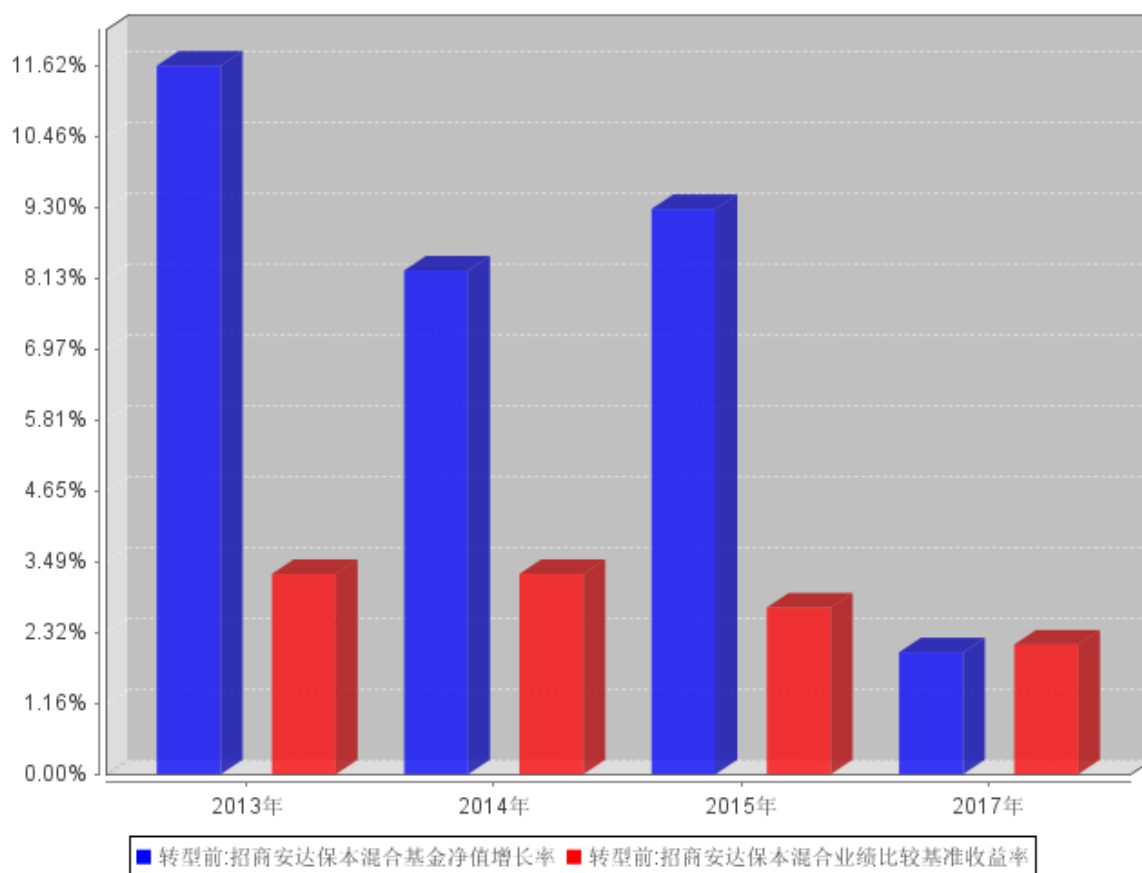
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

招商安达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



3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

招商安达保本混合过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金由于 2017 年 10 月 10 日转型为招商安达灵活配置混合型证券投资基金，因此上表报告期间的终止日为 2017 年 10 月 9 日。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

§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，公司新增注册资本金至人民币 13.1 亿元，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%。

招商基金管理有限公司首批获得企业年金基金投资管理人资格、基本养老保险基金投资管理资格；2004 年获得全国社保基金投资管理人资格；同时拥有 QDII(合格境内机构投资者)资格、专户理财（特定客户资产管理计划）资格。

2017 年度获奖情况如下：

Morningstar 晨星(中国)2017 年度普通债券型基金奖提名（招商安心收益债券）
 金牛奖·三年期开放式债券型持续优胜金牛基金（招商产业债券） 《中国证券报》
 金基金·股票投资回报基金管理公司奖 《上海证券报》
 金基金·一年期债券基金奖（招商双债增强（LOF）） 《上海证券报》
 金基金·三年期债券型基金奖（招商产业债券） 《上海证券报》
 明星基金奖·三年持续回报积极债券型明星基金（招商安瑞进取债券） 《证券时报》
 明星基金奖·三年持续回报普通债券型明星基金（招商产业债券） 《证券时报》
 明星基金奖·2016 年度平衡混合型明星基金（招商制造业混合） 《证券时报》
 明星基金奖·2016 年度绝对收益明星基金（招商丰融混合） 《证券时报》
 金帆奖·2017 年度基金管理公司 《21 世纪经济报道》
 金鼎奖·最佳公募基金公司品牌 《每日经济新闻》
 年度卓越公募基金 《华尔街见闻》
 年度十大风云基金产品奖（招商中证白酒指数分级） 《大众证券报》
 2017 年度最佳品牌形象公司 《东方财富网》
 杰出业绩表现基金产品（招商中证白酒指数分级）《东方财富网》
 年度指数投资奖 《华夏时报》
 基金电商平台杰出用户体验奖 《金融界》

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型后）

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		
滕越	本基金基金经理	2017年3月11日	-	8	女，硕士。2009年7月加入民生证券股份有限公司，曾任分析师；2014年9月加入华创证券有限责任公司，曾任高级分析师；2016年3月加入招商基金管理有限公司固定收益投资部，从事固定收益类产品研究及投资组合辅助管理相关工作，现任招商安达保本混合型证券投资基金基金经理。
王奇玮	本基金基金经理	2017年11月30日	-	6	男，硕士。2011年加入长江证券股份有限公司研究部，曾任分析师、高级分析师、资深分析师，食品饮料小组组长；2014年12月加入招商基金管理有限公司，曾任研究部高级研究员，现任招商安泰偏股混合型证券投资基金、招商安达灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
贾成东	离任本基金基金经理	2016年6月24日	2017年11月30日	9	男，理学硕士。2008年加入国泰基金管理有限公司，先后任宏观策略研究员、基金经理；2015年加入招商基金管理有限公司，现任投资管理四部副总监兼招商安达保本混合型证券投资基金、招商安盈保本混合型证券投资基金及招商行业精选股票型证券投资基金基金经理。
康晶	离任本基金基金经理	2016年8月20日	2017年9月26日	6	男，理学硕士。2009年加入魏斯曼资本公司交易部，任交易员；2011年1月加入中信证券股份有限公司债券资本市场部，任研究员；2012年3月加入招商基金管理有限公司固定收益投资部，曾任研究员，招商安本增利债券型证券投资基金、招商产业债券型证券投资基金、招商安达灵活配置混合型证券投资基金、招商招熹纯债债券型证券投资基金、招商安润保本混合型证券投资基金、招商安盈保本混合型证券投资基金基金经理，现任招商安泰债券投资基金、招商境远灵活配置混合型证券投资基金、招商招兴纯债债券型证券投资基金、招商安博保本混合型证券投资基金、招商安裕保本混合型证券投资基金、招商丰睿灵活配置混合型证券投资基金、招商丰达灵活配置混合型证券投资基金、招商稳祥定期开放灵活配置混合型证券投资基金、招商招坤纯债债券型证券投资基金、招商稳荣定期开放灵活配置混合型证券投资基金、招商招乾纯债债券型证券投资基金、招商招益两年定期开放债券型证券投资基金、招商稳乾定期开放灵活配置混合型证券投资基金、招商丰诚灵活配置混合型证券投资基金、

					招商稳泰定期开放灵活配置混合型证券投资基金、招商丰拓灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
张韵	离任本基金基金经理	2016 年 11 月 4 日	2017 年 12 月 27 日	5	女，理学硕士。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、招商增荣灵活配置混合型证券投资基金、招商安达保本混合型证券投资基金、招商兴福灵活配置混合型证券投资基金、招商兴华灵活配置混合型证券投资基金及招商丰德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本基金的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 公平交易制度和控制方法

基金管理人根据《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》和《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》（2011 年修订）的规定，制定了《招商基金管理有限公司公平交易管理办法》，对投资决策的内部控制、交易执行的内部控制、公平交易实施情况的监控与检查稽核、异常交易的监控等进行了规定。为保证各投资组合在投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会，基金管理人合理设置了各类资产管理业务之间以及各类资产管理业务内部的组织结构，建立了科学的投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

基金管理人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。基金管理人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。基金管理人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。基金管理人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。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

基金管理人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，基金管理人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，本基金管理人所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易不存在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。报告期内未发现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，GDP 同比自 2010 年以来首次回升，实体经济韧性较强。受益于海外经济持续向好，净出口对 GDP 的贡献率有所提升、且自两年来首次转正，投资增速继续收窄，消费保持稳定。

市场回顾：

在这种背景下中国股票市场迎来了久违的价值投资机会，整体上也基本延续了 2016 年下半年的投资风格，甄别基本面寻找确定性成为我们选取投资标的主要标准。另一方面，受益于供给侧改革，各个细分领域集中度呈现出加速集中的趋势，相关的龙头公司和蓝筹品种获得在估值和业绩的双升。

股票市场全年呈现结构性行情，且分化较为显著。以大盘股、白马股表现优异，截止年末，上证综指录得 6.56% 的涨幅。

债券市场方面，年初利率债小幅震荡，随着 4 月份流动性偏紧且同业存单成本快速上行，债券市场经历了第一波调整。9 月份市场普遍预期经济短期有下行压力，但实体经济的表现好于市

市场预期，债券市场出现了第二波调整。年末由于金融监管依然放在首位，市场对于一行三会陆续出台的监管政策普遍担忧，债券市场收益率上行较多。

基金操作回顾：

报告期内，本基金在上半年保持较低仓位，配置方面以食品饮料和消费建材为主，10月初正式转型为灵活配置型基金之后逐步提升仓位至中性水平，配置上以价值蓝筹为主，业绩有支撑和行业景气向上是必要条件，行业分布主要在食品饮料、建材、新能源和地产等方面。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

转型前，本基金份额净值增长率为 1.92%，同期业绩比较基准收益率为 2.34%；转型后，本基金份额净值增长率为 4.37%，同期业绩比较基准收益率为 1.75%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018 年，货币政策维持稳健中性，广义财政有所收紧，基于此，我们判断实体经济将稳中向下。结构方面，受益于海外经济延续复苏，净出口仍将成为经济亮点、贡献进一步抬升；投资受资金来源影响或继续增速收窄；消费继续保持稳定。

经济仍保持韧性的背景下，未来经济的发展质量重于速度；同时，受国内金融监管及全球货币边际收紧的影响，利率水平或继续维持高位，我们判断 18 年 A 股市场仍以结构性行情为主。食品饮料、医药和金融地产或仍将成为上半年市场追逐的热点，消费电子的过高预期有待进一步消化，当然从边际上也要防范创业板反弹的可能。

债券市场全年的机会依然不大，受金融监管延续的影响，短端收益率会维持在较高水平，长端收益率则受通胀预期及海外加息的影响也会有上行压力。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人本着诚实信用、勤勉尽责、合法经营和保障基金持有人利益的原则，经营管理和业务运作稳健、合规，基金的投资、交易、后台等运作规范有序。基金管理人的风险管理及合规控制部门依据独立、客观、公正的原则，主要从以下几个方面进一步加强了公司内部控制和基金投资风险管理工作：

1、公司实施了员工全面培训和形式多样的专题培训，包括每日推送监管动态和风险案例，持续整理风险点录入系统定期推送，定期或不定期组织法规考试，不定期开展各类合规主题培训等，丰富培训形式，不断提升员工合规与风控意识；

2、公司合规风控部门通过事中合规控制系统、事后投资风险管理系统、风险管理模型等对基金投资合规情况及风险情况进行严格的内部监控和管理；

3、定期稽核方面，除了每季度会对各业务领域进行一次全面的稽核，并向监管部门提交季

度监察稽核报告之外，公司合规部门还根据监察稽核计划，对公司的关键业务部门及业务流程进行了专项稽核和检查；

4、根据法律法规的更新及业务的发展变化情况，公司各业务部门对相关内部控制制度提出修改意见和建议，并关注内部控制制度的健全性和有效性，进一步完善了公司内控制度体系，更好的防范法律风险和合规风险。

报告期内，本基金的投资运作符合国家相关法律法规、监管部门的有关规定以及公司相关制度的规定。本基金的投资目标、投资决策依据和投资管理程序均符合相关基金合同和招募说明书的约定，未发现重大异常交易、利益输送、内幕交易及其他有损基金投资者利益的情形。报告期内，本基金若曾因市场波动、申购赎回等原因出现了相关投资比例限制被动突破的情形，均在法规规定的时间内完成了调整，符合法律法规和基金合同的规定和要求。报告期内，本基金未出现因权证未行权、可转债未及时卖出或转股等有损基金份额持有人利益的投资失误行为。本基金管理人承诺将一如既往本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产，在规范经营、控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。

4.7 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《招商基金管理有限责任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，咨询会计

事务所的专业意见，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，由其按约定提供相关债券品种、流通受限股票的估值参考数据。

4.8 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，本基金报告期未进行利润分配。在符合分红条件的前提下，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。

4.9 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

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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—招商基金管理有限公司 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，招商基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《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

本托管人认为，招商基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§6 审计报告（转型后）

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	招商安达灵活配置混合型证券投资基金全体持有人
审计意见	<p>我们审计了招商安达灵活配置混合型证券投资基金的财务报表，包括 2017 年 12 月 31 日的资产负债表，2017 年 10 月 10 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日止期间的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了招商安达灵活配置混合型证券投资基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况、2017 年 10 月 10 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于招商安达灵活配置混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
其他信息	<p>招商基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括招商安达灵活配置混合型证券投资基金 2017 年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估招商安达灵活配置混合型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算招商安达灵活配置混合型证券投资基金、终止经营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督招商安达灵活配置混合型证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致

任	<p>的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和做出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对招商安达灵活配置混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致招商安达灵活配置混合型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p>
会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	汪芳 吴凌志
会计师事务所的地址	中国·上海
审计报告日期	2018-3-27

6 审计报告(转型前)

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	招商安达保本混合型证券投资基金全体持有人
审计意见	<p>我们审计了招商安达保本混合型证券投资基金的财务报表，包括 2017 年 10 月 9 日(基金合同失效前日)的资产负债表，2017 年 1 月 1 日至 2017 年 10 月 9 日(基金合同失效前日)止期间的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有</p>

	关规定编制，公允反映了招商安达保本混合型证券投资基金 2017 年 10 月 9 日(基金合同失效前日)的财务状况、2017 年 1 月 1 日至 2017 年 10 月 9 日(基金合同失效前日)止期间的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于招商安达保本混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
其他信息	招商基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括招商安达保本混合型证券投资基金 2017 年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。 在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估招商安达保本混合型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算招商安达保本混合型证券投资基金、终止经营或别无其他现实的选择。 基金管理人治理层负责监督招商安达保本混合型证券投资基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪

	<p>造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和做出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对招商安达保本混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致招商安达保本混合型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	汪芳 吴凌志
会计师事务所的地址	中国·上海
审计报告日期	2018-3-27

§7 年度财务报表（转型后）

7.1 资产负债表（转型后）

会计主体：招商安达灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	7.4.7.1	19,841,351.25
结算备付金		1,018,291.89
存出保证金		180,723.14
交易性金融资产	7.4.7.2	301,002,384.47
其中：股票投资		211,938,399.37
基金投资		-
债券投资		89,063,985.10
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		8,580,403.90
应收利息	7.4.7.5	998,924.62
应收股利		-
应收申购款		84,472.80
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		331,706,552.07
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日
负债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		19,799,850.30
应付证券清算款		2,445,487.58
应付赎回款		1,007,223.03
应付管理人报酬		392,555.30
应付托管费		65,425.87
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	252,894.64
应交税费		6,858.28
应付利息		30,497.84

应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	170,025.73
负债合计		24,170,818.57
所有者权益：		-
实收基金	7.4.7.9	185,850,197.20
未分配利润	7.4.7.10	121,685,536.30
所有者权益合计		307,535,733.50
负债和所有者权益总计		331,706,552.07

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.2754 元，基金份额总额 241,132,902.01 份。

7.2 利润表

会计主体：招商安达灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 10 月 10 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2017 年 10 月 10 日至 2017 年 12 月 31 日
一、收入		15,770,589.10
1. 利息收入		3,047,478.16
其中：存款利息收入	7.4.7.11	106,664.67
债券利息收入		2,346,223.87
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		594,589.62
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		4,861,932.92
其中：股票投资收益	7.4.7.12	5,508,170.60
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-646,196.18
资产支持证券投资收益	7.4.7.14	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-
股利收益	7.4.7.17	-41.50
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	7,855,209.91
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	5,968.11
减：二、费用		1,826,745.22
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,190,355.20
2. 托管费	7.4.10.2.2	198,392.50
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	7.4.7.20	313,087.02

5. 利息支出		37,719.72
其中：卖出回购金融资产支出		37,719.72
6. 其他费用	7.4.7.21	87,190.78
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		13,943,843.88
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		13,943,843.88

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：招商安达灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 10 月 10 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 10 月 10 日至 2017 年 12 月 31 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）	463,947,323.50	271,949,508.23	735,896,831.73
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	13,943,843.88	13,943,843.88
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）	278,097,126.30	164,207,815.81	442,304,942.11
其中：1. 基金申购款	549,143.97	339,522.48	888,666.45
2. 基金赎回款（以“-”号填列）	-278,646,270.27	-164,547,338.29	-443,193,608.56
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）	185,850,197.20	121,685,536.30	307,535,733.50

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

招商安达灵活配置混合型证券投资基金(原名招商安达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》、《招商安达保本混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“原基金合同”)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[2011]966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。本基金首次设立募集基金份额为 1,032,286,589.43 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(11)第 0066 号验资报告。原基金合同于 2011 年 9 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,基金托管人为中国农业银行股份有限公司(以下简称“中国农业银行”)。

招商安达保本混合型证券投资基金根据 2014 年 10 月 9 日《招商基金管理有限公司关于招商安达保本混合型证券投资基金转入下一保本期过渡期折算结果及进入下一保本期的公告》,招商安达保本混合型证券投资基金在第一个保本期到期日和第二个保本期开始之间设置过渡期,过渡期最后一个工作日(2014 年 9 月 29 日)收市后进行基金份额折算,折算后基金份额净值调整为 1.000 元,依据合同规定的折算规则确定的折算比例为 1:1.297878557。

依据招商安达保本混合型证券投资基金基金管理人于 2017 年 9 月 20 日发布的《招商安达保本混合型证券投资基金保本期到期安排及转型为招商安达灵活配置混合型证券投资基金的第一次提示性公告》,自 2017 年 10 月 10 日起,“招商安达保本混合型证券投资基金”将更名为“招商安达灵活配置混合型证券投资基金”,《招商安达灵活配置混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“新基金合同”)及托管协议亦于该日同时生效。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、新基金合同及截至报告期末最新公告的招募说明书的有关规定,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债券、股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证、货币市场工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但需符合中国证监会的相关规定。本基金投资于股票的比例为基金资产的 30%-80%;债券、货币市场工具等固定收益类资产占基金资产的 20%-70%,其中,基金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。

本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数收益率 \times 55%+中信全债指数收益率 \times 45%;因指数发布机构进行调整,原中信全债指数名称变更为标普中国全债指数,2017 年 12 月 30 日起本基金的业绩比较基准变更为沪深 300 指数收益率 \times 55%+标普中国全债指数 \times 45%。

7.4.2 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”)以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。

7.4.3 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 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1) 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。

2) 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。

7.4.4.4 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。

7.4.4.5 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。

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。

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；对于发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行时股票公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，按照监管机构或行业协会的有关规定确定公允价值。

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，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。

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。

7.4.4.6 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。

7.4.4.7 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。

7.4.4.8 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的比例，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)。

7.4.4.9 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确认，由上市公司代扣代缴的个人所得税于卖出交易日按实际代扣代缴金额确认。

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，并于相关金融资产卖出或到期时转出计入投资收益。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬和基金托管费按基金合同及相关公告约定的费率和计算方法逐日计提。

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。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年最多分配 12 次，每次基金收益分配比例不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；

本基金收益分配方式：

基金收益分配方式分为现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

本基金的每份基金份额享有同等分配权；

基金收益分配后每一基金份额净值不能低于面值，即基金利润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；

法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

7.4.4.12 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。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

1) 对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》（中基协发[2017]6 号），在估值日按照该通知规定的流通受限股票公允价值计算模型进行估值。

2) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，根据《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（中国证监会公告[2017]13 号）及《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》（中基协发[2013]13 号）相关规定，本基金根据情况决定使用指数收益法、可比公司法、市场价格模型法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

3) 根据《关于发布〈中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收

益品种的估值处理标准》的通知》(中基协发[2014]24号),在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外),采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

确保证券投资基金估值的合理性和公允性,根据《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》(证监会公告[2017]13号)和中国证券投资基金业协会发布的《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(中基协发[2017]6号)相关规定,本基金自2017年12月5日起,对所持有的流通受限股票的估值方法进行调整,新的估值方法考虑了估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值以及该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣的影响。于2017年12月5日,相关会计估计调整对基金资产净值的影响不超过0.25%。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

1) 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;2018年1月1日起,公开募集证券投资基金运营过程中发生的其他增值税应税行为,以基金管理人为增值税纳税人,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳

增值税。

2) 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。

3) 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; 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, 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。

4) 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。

5) 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位: 人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日
活期存款	19,841,351.25
定期存款	-
其中: 存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计:	19,841,351.25

7.4.7.2 交易性金融资产

单位: 人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	估值增值	
股票	195,557,010.45	211,938,399.37	16,381,388.92	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	23,721,492.12	24,240,985.10	519,492.98
	银行间市场	64,877,300.96	64,823,000.00	-54,300.96
	合计	88,598,793.08	89,063,985.10	465,192.02
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	

合计	284,155,803.53	301,002,384.47	16,846,580.94
----	----------------	----------------	---------------

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融工具。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 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。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日
应收活期存款利息	4,894.55
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	458.20
应收债券利息	993,490.57
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	81.30
合计	998,924.62

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日
交易所市场应付交易费用	249,074.49
银行间市场应付交易费用	3,820.15
合计	252,894.64

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	25.73

预提费用	170,000.00
合计	170,025.73

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年10月10日至2017年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	602,042,667.94	463,947,323.50
本期申购	712,495.68	549,143.97
本期赎回（以“-”号填列）	-361,622,261.61	-278,646,270.27
本期末	241,132,902.01	185,850,197.20

注：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。

7.4.7.10 未分配利润

金额单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	326,845,105.57	-54,895,597.34	271,949,508.23
本期利润	6,088,633.97	7,855,209.91	13,943,843.88
本期基金份额交易产生的变动数	-196,851,704.69	32,643,888.88	-164,207,815.81
其中：基金申购款	396,972.06	-57,449.58	339,522.48
基金赎回款	-197,248,676.75	32,701,338.46	-164,547,338.29
本期已分配利润	-	-	-
本期末	136,082,034.85	-14,396,498.55	121,685,536.30

7.4.7.11 存款利息收入

项目	本期 2017年10月10日至2017年12月31日
	活期存款利息收入
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	56,395.68
其他	596.16
合计	106,664.67

7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年10月10日至2017年12月31日
	卖出股票成交总额
减：卖出股票成本总额	46,591,272.84
买卖股票差价收入	5,508,170.60

7.4.7.13 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期2017年10月10日至2017年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	202,703,515.92
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	198,505,371.31
减：应收利息总额	4,844,340.79
买卖债券差价收入	-646,196.18

7.4.7.14 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。

7.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

7.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年10月10日至2017年12月31日
股票投资产生的股利收益	-41.50
基金投资产生的股利收益	-
合计	-41.50

7.4.7.18 公允价值变动损益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年10月10日至2017年12月31日
1. 交易性金融资产	7,855,209.91
——股票投资	9,379,989.85
——债券投资	-1,524,779.94
——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	7,855,209.91

7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 10 月 10 日至 2017 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	5,885.69
转换费收入	82.42
合计	5,968.11

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，赎回费总额的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，其中赎回费总额的一定比例归入转出基金的基金资产。

7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 10 月 10 日至 2017 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	309,937.02
银行间市场交易费用	3,150.00
合计	313,087.02

7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 10 月 10 日至 2017 年 12 月 31 日
审计费用	464.44
信息披露费	68,221.38
其他费用	9,300.00
银行费用	9,204.96
合计	87,190.78

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

根据财政部和国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日和 2017 年 6 月 30 日联合颁布的《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》(财税[2016]140 号)和《关于资管产品增值税有关问题的通知》(财税[2017]56 号)的有关规定，自 2018 年 1 月 1 日起，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

7.4.9 关联方关系

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
中国农业银行	基金托管人
招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)	基金管理人的股东
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
招商财富资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司
招商资产管理(香港)有限公司	基金管理人的全资子公司

注：本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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。

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

7.4.10.1.4 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。

7.4.10.1.5 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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 10 月 10 日至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,190,355.20
其中：支付销售机构的客户维护费	407,902.10

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：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×1.50%/当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 10 月 10 日至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	198,392.50

注：支付基金托管人中国农业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：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

7.4.10.3 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。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人无运用自有资金投资本基金的情况。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 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 2017 年 10 月 10 日至 2017 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	19,841,351.25	49,672.83

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 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。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2017 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本报告期末本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 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	复牌日期	复牌开	数量	期末	期末	备注
------	------	------	------	-----	------	-----	----	----	----	----

				值单价		盘单价	(股)	成本总额	估值总额	
002507	涪陵榨菜	2017 年 12 月 4 日	重大事项	16.77	-	-	560,445	6,339,384.40	9,398,662.65	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券余额 19,799,850.30 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
170207	17 国开 07	2018 年 1 月 2 日	99.52	200,000	19,904,000.00
合计				200,000	19,904,000.00

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本报告期末本基金无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

7.4.13 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债券投资、股票投资等。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。

7.4.13.1 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、互相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。

7.4.13.2 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、债券投资及其他金融资产。

本基金的银行存款存放于本基金的基金托管人中国农业银行，定期存款分别存放于信用良好的股份制商业银行，与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，并由交易对手向中央国债登记结算公司提交充足的债券进行质押，以控制相应的信用风险。

对于与债券投资、资产支持证券投资等投资品种相关的信用风险，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 7.4.13.2.1 及 7.4.13.2.2 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及资产支持证券投资的信用评级，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。

7.4.13.2.1 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 2017 年 12 月 31 日
A-1	
A-1 以下	-
未评级	9,971,000.00
合计	9,971,000.00

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。

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

长期信用评级	本期末 2017 年 12 月 31 日
AAA	-
AAA 以下	59,188,985.10
合计	59,188,985.10

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。

7.4.13.3 流动性风险

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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 7.4.12 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无固定到期日或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，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

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。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末 2017年12月31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	19,841,351.25	-	-	-	-	-	19,841,351.25
结算备付金	1,018,291.89	-	-	-	-	-	1,018,291.89
存出保证金	180,723.14	-	-	-	-	-	180,723.14
交易性金融资产	-	-39,919,000.00	49,144,985.10	-	-	-211,938,399.37	301,002,384.47
应收证券清算款	-	-	-	-	-	8,580,403.90	8,580,403.90
应收利息	-	-	-	-	-	998,924.62	998,924.62
应收申购款	-	-	-	-	-	84,472.80	84,472.80
资产总计	21,040,366.28	-39,919,000.00	49,144,985.10	-	-	-221,602,200.69	331,706,552.07
负债							
卖出回购金融资产款	19,799,850.30	-	-	-	-	-	19,799,850.30

应付证券清算款	-	-	-	-	2,445,487.58	2,445,487.58
应付赎回款	-	-	-	-	1,007,223.03	1,007,223.03
应付管理人报酬	-	-	-	-	392,555.30	392,555.30
应付托管费	-	-	-	-	65,425.87	65,425.87
应付交易费用	-	-	-	-	252,894.64	252,894.64
应付利息	-	-	-	-	30,497.84	30,497.84
应交税费	-	-	-	-	6,858.28	6,858.28
其他负债	-	-	-	-	170,025.73	170,025.73
负债总计	19,799,850.30	-	-	-	4,370,968.27	24,170,818.57
利率敏感度缺口	1,240,515.98	-39,919,000.00	49,144,985.10	-	-217,231,232.42	307,535,733.50

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。

7.4.13.4.1.2 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		
	3、仅存在公允价值变动对基金资产净值的影响		
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（单位：人民币元）	
		本期末（2017年12月31日）	上年度末（2016年12月31日）
	1、市场利率平行上升 50 个基点	-535,126.40	-5,575,311.81
	2、市场利率平行下降 50 个基点	542,528.41	5,697,189.94

7.4.13.4.2 其他价格风险

其他价格风险是指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，也有可能与整体投资品种相关。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。

7.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产-股票投资	211,938,399.37	68.92
交易性金融资产-基金投资	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-

其他	-	-
合计	211,938,399.37	68.92

7.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1、若对市场价格敏感的权益性投资的市场价格上升或下降 5%		
	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（单位：人民币元）	
		本期末（2017 年 12 月 31 日）	上年度末（2016 年 12 月 31 日）
	1、权益性投资的市场价格上升 5%	10,596,919.97	14,932,341.63
	2、权益性投资的市场价格下降 5%	-10,596,919.97	-14,932,341.63

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

下表按公允价值三个层次列示了以公允价值计量的金融资产工具于 12 月 31 日的账面价值。

金额：人民币元

资产	本期末(2017 年 12 月 31 日)			
	第一层次	第二层次	第三层次	合计
交易性金融资产	-	-	-	-
股票投资	202,539,736.72	9,398,662.65	-	211,938,399.37
债券投资	2,426,400.00	86,637,585.10	-	89,063,985.10
合计	204,966,136.72	96,036,247.75	-	301,002,384.47

金额：人民币元

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次或第三层次。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 年度财务报表（转型前）

7.1 资产负债表（转型前）

会计主体：招商安达保本混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 10 月 9 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 10 月 9 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	35,359,936.89	51,336,383.35
结算备付金		3,394,050.96	2,614,335.64
存出保证金		75,635.06	354,620.61
交易性金融资产	7.4.7.2	197,181,214.77	938,733,752.51
其中：股票投资		44,088,358.27	298,646,832.61
基金投资		-	-
债券投资		153,092,856.50	640,086,919.90
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	503,000,125.50	-
应收证券清算款		7,529,337.85	-
应收利息	7.4.7.5	5,642,747.67	14,366,698.04
应收股利		-	-
应收申购款		-	11,759.99
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		752,183,048.70	1,007,417,550.14
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 10 月 9 日	上年度末 2016 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		7,627,472.90	10,008,594.43
应付赎回款		6,723,762.03	1,050,384.47
应付管理人报酬		993,092.08	1,021,341.24
应付托管费		165,515.38	170,223.51
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	467,524.72	995,547.78
应交税费		6,858.28	6,858.28
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	301,991.58	299,567.93
负债合计		16,286,216.97	13,552,517.64
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	463,947,323.50	639,104,271.10
未分配利润	7.4.7.10	271,949,508.23	354,760,761.40
所有者权益合计		735,896,831.73	993,865,032.50
负债和所有者权益总计		752,183,048.70	1,007,417,550.14

注：报告截止日 2017 年 10 月 9 日，基金份额净值 1.2220 元，基金份额总额 602,042,667.94 份。

7.2 利润表

会计主体：招商安达保本混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 10 月 9 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 10 月 9 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
一、收入		25,363,822.96	-37,374,905.21
1. 利息收入		26,421,114.80	46,149,817.12
其中：存款利息收入	7.4.7.11	230,367.37	512,199.75
债券利息收入		22,038,118.92	45,504,949.88
资产支持证券利息收入		-	8,870.82
买入返售金融资产收入		4,152,628.51	123,796.67
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-11,281,723.60	11,226,532.37
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-9,891,981.22	10,488,514.90
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-3,407,976.43	44,641.82
资产支持证券投资收益	7.4.7.14	-	11.22
贵金属投资收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-	-
股利收益	7.4.7.17	2,018,234.05	693,364.43
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	9,639,272.86	-97,164,828.85
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	585,158.90	2,413,574.15
减：二、费用		11,514,557.62	20,660,526.20

1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	8,051,604.98	13,725,073.27
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,341,934.25	2,287,512.22
3. 销售服务费			-
4. 交易费用	7.4.7.20	1,760,357.02	3,491,151.96
5. 利息支出		11,734.55	712,045.17
其中：卖出回购金融资产支出		11,734.55	712,045.17
6. 其他费用	7.4.7.21	348,926.82	444,743.58
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		13,849,265.34	-58,035,431.41
减：所得税费用			-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		13,849,265.34	-58,035,431.41

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：招商安达保本混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 10 月 9 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 10 月 9 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）	639,104,271.10	354,760,761.40	993,865,032.50
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	13,849,265.34	13,849,265.34
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）	-175,156,947.60	-96,660,518.51	-271,817,466.11
其中：1. 基金申购款	613,115.59	334,335.56	947,451.15
2. 基金赎回款	-175,770,063.19	-96,994,854.07	-272,764,917.26
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）	463,947,323.50	271,949,508.23	735,896,831.73
项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 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）	1,045,908,107.64	641,347,003.43	1,687,255,111.07
二、本期经营活动产生的基金	-	-58,035,431.41	-58,035,431.41

净值变动数（本期利润）			
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）	-406,803,836.54	-228,550,810.62	-635,354,647.16
其中：1. 基金申购款	1,430,554.81	807,131.41	2,237,686.22
2. 基金赎回款	-408,234,391.35	-229,357,942.03	-637,592,333.38
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）	639,104,271.10	354,760,761.40	993,865,032.50

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

招商安达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》、《招商安达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[2011]966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,保本周期为3年。本基金的第一个保本周期由中国投资担保有限公司作为担保人,担保人对基金管理人的保本义务提供不可撤销的连带责任保证;保证的范围为基金份额持有人认购并持有到期的基金份额的可赎回金额加上其认购并持有到期的基金份额累计分红款项之和计算的总金额低于其认购保本金额的差额部分。担保人保证期间为基金保本周期到期日之日起六个月。第一个保本周期内,担保人承担保证责任的最高限额不超过按基金合同生效之日确认的基金份额所计算的认购保本金额。保本周期届满时,担保人或基金管理人和基金托管人认可的其他机构继续与本基金管理人签订《保证合同》或《风险买断合同》,同时本基金满足法律法规和本合同规定的基金存续要求的,本基金将转入下一保本周期(本基金第一个保本周期内的担保人承诺继续对下一保本周期提供保证或风险买断保本保障的,本基金管理人与担保人另行签订保证合同或风险买断合同);否则,本基金变更为非保本的混合型基金,基金名称相应变更为“招商安达灵活配置混合型证券投资基金”,担保人不再为该基金承担保证责任。本基金首次设立募集基金份额为1,032,286,589.43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(11)第0066号验资报告。《招商安达保本混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合

同”)于 2011 年 9 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,基金托管人为中国农业银行股份有限公司(以下简称“中国农业银行”)。

本基金第一个保本周期自 2011 年 9 月 1 日至 2014 年 9 月 1 日,根据 2014 年 10 月 9 日《招商基金管理有限公司关于招商安达保本混合型证券投资基金转入下一保本期过渡期折算结果及进入下一保本期的公告》,根据《招商基金管理有限公司关于招商安达保本混合型证券投资基金保本期到期及转入下一保本期的相关规则公告》,本基金在第一个保本期到期日和第二个保本期开始之间设置过渡期,过渡期最后一个工作日(2014 年 9 月 29 日)收市后进行基金份额折算,折算后基金份额净值调整为 1.000 元。2014 年 9 月 29 日本基金折算前的基金份额净值为 1.298 元,依据合同规定的折算规则确定的折算比例为 1:1.297878557。折算后本基金的份额由 3,069,192,950.29 份调整为 3,983,439,717.48 份,基金份额净值调整为 1.000 元。第二个保本周期自 2014 年 9 月 30 日至 2017 年 10 月 9 日(2017 年 9 月 30 日-2017 年 10 月 8 日为非工作日)。依据本基金管理人于 2017 年 9 月 20 日发布的《招商安达保本混合型证券投资基金保本期到期安排及转型为招商安达灵活配置混合型证券投资基金的第一次提示性公告》,自 2017 年 10 月 10 日起,“招商安达保本混合型证券投资基金”将更名为“招商安达灵活配置混合型证券投资基金”,《招商安达灵活配置混合型证券投资基金基金合同》及托管协议于 2017 年 10 月 10 日生效,《招商安达保本混合型证券投资基金基金合同》自同一日起失效。

7.4.2 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”)以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。

7.4.3 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 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度,即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1) 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。

2) 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。

7.4.4.4 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。

7.4.4.5 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可观察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。

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。

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；对于发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时股票公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，按照监管机构或行业协会的有关规定确定公允价值。

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，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。

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。

7.4.4.6 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。

7.4.4.7 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。

7.4.4.8 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的比例, 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)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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确认, 由上市公司代扣代缴的个人所得税于卖出交易日按实际代扣代缴金额确认。

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, 并于相关金融资产卖出或到期时转出计入投资收益。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬和基金托管费按基金合同及相关公告约定的费率和计算方法逐日计提。

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。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

在符合有关基金分红条件的前提下, 本基金收益每年最多分配 12 次, 每次基金收益分配比例不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;

本基金收益分配方式：

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；

变更为“招商灵活配置混合型证券投资基金”后：基金收益分配方式分为现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

本基金的每份基金份额享有同等分配权；

基金收益分配后每一基金份额净值不能低于面值，即基金利润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；

法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

7.4.4.12 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。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

1) 对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》（中基协发[2017]6号），在估值日按照该通知规定的流通受限股票公允价值计算模型进行估值。

2) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，根据《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（中国证监会公告[2017]13号）及《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》（中基协发[2013]13号）相关规定，本基金根据情况决定使用指数收益法、可比公司法、市场价格模型法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

3) 根据《关于发布〈中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准〉的通知》（中基协发[2014]24号），在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

为确保证券投资基金估值的合理性和公允性,根据《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》(证监会公告[2017]13号)和中国证券投资基金业协会发布的《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(中基协发[2017]6号)相关规定,本基金自2017年12月5日起,对所持有的流通受限股票的估值方法进行调整,新的估值方法考虑了估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值以及该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣的影响。于2017年12月5日,相关会计估计调整对基金资产净值的影响不超过0.25%。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

1) 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;2018年1月1日起,公开募集证券投资基金运营过程中发生的其他增值税应税行为,以基金管理人为增值税纳税人,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。

2) 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。

3) 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；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，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。

4) 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。

税项 - 续

5) 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 10 月 9 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
活期存款	35,359,936.89	51,336,383.35
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	35,359,936.89	51,336,383.35

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 10 月 9 日			
	成本	公允价值	估值增值	
股票	37,086,959.20	44,088,358.27	7,001,399.07	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	31,318,974.54	32,532,856.50	1,213,881.96
	银行间市场	119,783,910.00	120,560,000.00	776,090.00
	合计	151,102,884.54	153,092,856.50	1,989,971.96
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	188,189,843.74	197,181,214.77	8,991,371.03	
项目	上年度末			

		2016 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	估值增值
股票		304,444,113.33	298,646,832.61	-5,797,280.72
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	140,379,600.73	143,731,919.90	3,352,319.17
	银行间市场	494,557,940.28	496,355,000.00	1,797,059.72
	合计	634,937,541.01	640,086,919.90	5,149,378.89
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		939,381,654.34	938,733,752.51	-647,901.83

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融工具。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 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 2017 年 10 月 9 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_交易所	492,000,000.00	-
买入返售证券_银行间	11,000,125.50	-
合计	503,000,125.50	-
项目	上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 10 月 9 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	19,282.25	5,135.01
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	2,749.14	1,176.40
应收债券利息	5,619,213.28	14,360,227.03
应收买入返售证券利息	1,441.62	-
应收申购款利息	-	-

应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	61.38	159.60
合计	5,642,747.67	14,366,698.04

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年10月9日	上年度末 2016年12月31日
交易所市场应付交易费用	464,480.12	991,251.43
银行间市场应付交易费用	3,044.60	4,296.35
合计	467,524.72	995,547.78

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年10月9日	上年度末 2016年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	677.40	9,567.93
预提费用	301,314.18	290,000.00
合计	301,991.58	299,567.93

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年10月9日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	829,332,776.58	639,104,271.10
本期申购	795,645.65	613,115.59
本期赎回（以“-”号填列）	-228,085,754.29	-175,770,063.19
本期末	602,042,667.94	463,947,323.50

注：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。

7.4.7.10 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
上年度末	441,690,734.55	-86,929,973.15	354,760,761.40
本期利润	4,209,992.48	9,639,272.86	13,849,265.34
本期基金份额交易产生的变动数	-119,055,621.46	22,395,102.95	-96,660,518.51

其中：基金申购款	415,635.28	-81,299.72	334,335.56
基金赎回款	-119,471,256.74	22,476,402.67	-96,994,854.07
本期已分配利润	-	-	-
本期末	326,845,105.57	-54,895,597.34	271,949,508.23

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 10 月 9 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	205,709.57	449,953.96
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	21,291.24	38,765.46
其他	3,366.56	23,480.33
合计	230,367.37	512,199.75

7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 10 月 9 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	670,754,459.07	1,186,902,436.47
减：卖出股票成本总额	680,646,440.29	1,176,413,921.57
买卖股票差价收入	-9,891,981.22	10,488,514.90

7.4.7.13 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 10 月 9 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	993,249,494.56	549,394,727.95
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	970,085,880.55	538,387,300.04
减：应收利息总额	26,571,590.44	10,962,786.09
买卖债券差价收入	-3,407,976.43	44,641.82

7.4.7.14 资产支持证券投资收益

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 10 月 9 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
卖出资产支持证券成交总额	-	1,597,013.90
减：卖出资产支持证券成本总额	-	1,575,988.78
减：应收利息总额	-	21,013.90
资产支持证券投资收益	-	11.22

7.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间内无贵金属投资收益。

7.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期内及上年度可比期间内无衍生工具收益。

7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 10 月 9 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	2,018,234.05	693,364.43
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	2,018,234.05	693,364.43

7.4.7.18 公允价值变动损益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 10 月 9 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	9,639,272.86	-97,164,828.85
——股票投资	12,798,679.79	-77,739,605.61
——债券投资	-3,159,406.93	-19,419,212.02
——资产支持证券投资		-6,011.22
——贵金属投资		-
——其他		-
2. 衍生工具		-
——权证投资		-
3. 其他		-
合计	9,639,272.86	-97,164,828.85

7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 10 月 9 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	582,408.74	2,406,062.13
转换费收入	2,750.16	7,512.02
合计	585,158.90	2,413,574.15

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，其中赎回费总额按一定比例归入转出基金的基金资产。

7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年10月9日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
交易所市场交易费用	1,755,182.02	3,490,201.96
银行间市场交易费用	5,175.00	950.00
合计	1,760,357.02	3,491,151.96

7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年10月9日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
审计费用	69,535.56	90,000.00
信息披露费	231,778.62	300,000.00
其他费用	27,950.00	37,350.00
银行费用	19,662.64	17,393.58
合计	348,926.82	444,743.58

7.4.7 或有事项、资产负债表日后事项的说明**7.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金无需说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

除附注 7.4.1 部分所述，本基金自招商安达保本混合型证券投资基金转换为招商安达灵活配置混合型证券投资基金外，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

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
中国农业银行	基金托管人
招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)	基金管理人的股东
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
招商财富资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司
招商资产管理(香港)有限公司	基金管理人的全资子公司

注：本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.5 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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年10 月9日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月 31日
当期发生的基金应支付的管理费	8,051,604.98	13,725,073.27
其中：支付销售机构的客户维护费 ¹	3,753,882.16	6,300,795.50

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×1.20%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：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×1.20%/当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年10 月9日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月 31日
当期发生的基金应支付	1,341,934.25	2,287,512.22

的托管费		
------	--	--

注：支付基金托管人中国农业银行的基金托管费按前一日基金资产净值*0.20%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：日基金托管费=前一日基金资产净值*0.20%/当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2017年1月1日至2017年10月9日		2016年1月1日至2016年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	35,359,936.89	205,709.57	51,336,383.35	449,953.96

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 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。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2017年10月9日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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	说明
603619	中曼石油	2017年8月4日	2017年11月17日	新股流通受限	22.61	22.61	1,760	39,793.60	39,793.60	-
002906	华阳集团	2017年9月29日	2017年10月13日	新股流	13.69	13.69	2,742	37,537.98	37,537.98	-

			日	通受限							
002905	金逸影视	2017年10月9日	2017年10月16日	新股流通受限	20.98	20.98	1,539	32,288.22	32,288.22		-
603103	横店影视	2017年9月26日	2017年10月12日	新股流通受限	15.45	15.45	2,021	31,224.45	31,224.45		-
002903	宇环数控	2017年9月28日	2017年10月13日	新股流通受限	12.78	12.78	928	11,859.84	11,859.84		-
300705	九典制药	2017年9月25日	2017年10月10日	新股流通受限	10.37	10.37	1,073	11,127.01	11,127.01		-
603110	东方材料	2017年9月28日	2017年10月13日	新股流通受限	13.04	13.04	847	11,044.88	11,044.88		-
603829	洛凯股份	2017年10月9日	2017年10月17日	新股流通受限	7.23	7.23	1,281	9,261.63	9,261.63		-
300708	聚灿光电	2017年10月9日	2017年10月16日	新股流通受限	2.82	2.82	2,742	7,732.44	7,732.44		-
603499	翔港科技	2017年9月29日	2017年10月16日	新股流通受限	9.24	9.24	812	7,502.88	7,502.88		-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本报告期末本基金无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本报告期末本基金无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

7.4.13 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债券投资、股票投资等。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。

7.4.13.1 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、互相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。

7.4.13.2 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、债券投资及其他金融资产。

本基金的银行存款存放于本基金的基金托管人农业银行，定期存款分别存放于信用良好的股份制商业银行，与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，并由交易对手向中央国债登记结算公司提交充足的债券进行质押，以控制相应的信用风险。

对于与债券投资、资产支持证券投资等投资品种相关的信用风险，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 7.4.13.2.1 及 7.4.13.2.2 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及资产支持证券投资的信用评级，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。

7.4.13.2.1 按短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 2017 年 10 月 9 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	29,670,000.00	-
合计	29,670,000.00	-

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。

7.4.13.2.2 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 2017 年 10 月 9 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
AAA	-	101,665,000.00
AAA 以下	83,414,856.50	428,544,197.40
未评级	-	-

合计	83,414,856.50	530,209,197.40
----	---------------	----------------

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。

7.4.13.3 流动性风险

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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 7.4.12 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。本基金所持有的全部金融负债无固定到期日或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，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

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。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 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、债券投资和买入返售金融资产。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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末 2017年10月9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	35,359,936.89	-	-	-	-	-	35,359,936.89

结算备付金	3,394,050.96	-	-	-	-	-	3,394,050.96
存出保证金	75,635.06	-	-	-	-	-	75,635.06
交易性金融资产	69,678,000.00	-	10,066,000.00	73,348,856.50	-	44,088,358.27	197,181,214.77
买入返售金融资产	503,000,125.50	-	-	-	-	-	503,000,125.50
应收证券清算款	-	-	-	-	-	7,529,337.85	7,529,337.85
应收利息	-	-	-	-	-	5,642,747.67	5,642,747.67
资产总计	611,507,748.41	-	10,066,000.00	73,348,856.50	-	57,260,443.79	752,183,048.70
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	7,627,472.90	7,627,472.90
应付赎回款	-	-	-	-	-	6,723,762.03	6,723,762.03
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	993,092.08	993,092.08
应付托管费	-	-	-	-	-	165,515.38	165,515.38
应付交易费用	-	-	-	-	-	467,524.72	467,524.72
应交税费	-	-	-	-	-	6,858.28	6,858.28
其他负债	-	-	-	-	-	301,991.58	301,991.58
负债总计	-	-	-	-	-	16,286,216.97	16,286,216.97
利率敏感度缺口	611,507,748.41	-	10,066,000.00	73,348,856.50	-	40,974,226.82	735,896,831.73
上年度末 2016 年 12 月 31 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	51,336,383.35	-	-	-	-	-	51,336,383.35
结算备付金	2,614,335.64	-	-	-	-	-	2,614,335.64
存出保证金	354,620.61	-	-	-	-	-	354,620.61
交易性金融资产	-	-	105,612,000.00	463,987,457.10	70,487,462.80	298,646,832.61	938,733,752.51
应收利息	-	-	-	-	-	14,366,698.04	14,366,698.04
应收申购款	-	-	-	-	-	11,759.99	11,759.99
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	54,305,339.60	-	105,612,000.00	463,987,457.10	70,487,462.80	313,025,290.64	1,007,417,550.14
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	10,008,594.43	10,008,594.43
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,050,384.47	1,050,384.47
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,021,341.24	1,021,341.24
应付托管费	-	-	-	-	-	170,223.51	170,223.51
应付交易费用	-	-	-	-	-	995,547.78	995,547.78
应交税费	-	-	-	-	-	6,858.28	6,858.28
其他负债	-	-	-	-	-	299,567.93	299,567.93
负债总计	-	-	-	-	-	13,552,517.64	13,552,517.64
利率敏感度缺口	54,305,339.60	-	105,612,000.00	463,987,457.10	70,487,462.80	299,472,773.00	993,865,032.50

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。

7.4.13.4.1.2 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		
	3、仅存在公允价值变动对基金资产净值的影响		
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（单位：人民币元）	
		本期末（2017 年 10 月 9 日）	上年度末（2016 年 12 月 31 日）
	1、市场利率平行上升 50 个基点	-645,740.47	-5,575,311.81
	2、市场利率平行下降 50 个基点	655,016.87	5,697,189.94

7.4.13.4.2 其他价格风险

其他价格风险是指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，也有可能与整体投资品种相关。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。

7.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 10 月 9 日		上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	44,088,358.27	5.99	298,646,832.61	30.05
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	44,088,358.27	5.99	298,646,832.61	30.05

7.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1、若对市场价格敏感的权益性投资的市场价格上升或下降 5%		
	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（单位：人民币元）	
		本期末（2017 年 10 月 9 日）	上年度末（2016 年 12 月 31 日）
	1、权益性投资的市场价格上升 5%	2,204,417.91	14,932,341.63
	2、权益性投资的市场价格下降 5%	-2,204,417.91	-14,932,341.63

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

下表按公允价值三个层次列示了以公允价值计量的金融资产工具于 10 月 9 日的账面价值。

金额：人民币元

资产	本期末(2017年10月9日)			
	第一层次	第二层次	第三层次	合计
交易性金融资产	-	-	-	-
股票投资	43,888,985.34	199,372.93	-	44,088,358.27
债券投资	-	153,092,856.50	-	153,092,856.50
合计	43,888,985.34	153,292,229.43	-	197,181,214.77

金额：人民币元

资产	上年度末(2016年12月31日)			
	第一层次	第二层次	第三层次	合计
交易性金融资产	-	-	-	-
股票投资	254,825,537.71	43,821,258.90	-	298,646,832.61
债券投资	557,740.30	639,529,179.60	-	640,086,919.90
合计	255,383,314.01	683,350,438.50	-	938,733,752.51

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次或第三层次。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告（转型后）

8.1 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	211,938,399.37	63.89
	其中：股票	211,938,399.37	63.89
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	89,063,985.10	26.85
	其中：债券	89,063,985.10	26.85
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	20,859,643.14	6.29
8	其他各项资产	9,844,524.46	2.97
9	合计	331,706,552.07	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	192,684,893.63	62.65
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	-	-
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	127,275.04	0.04
J	金融业	-	-
K	房地产业	14,505,612.70	4.72
L	租赁和商务服务业	4,620,618.00	1.50
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	211,938,399.37	68.92
----	----------------	-------

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

8.2.3 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

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	002531	天顺风能	2,147,840	17,397,504.00	5.66
2	002202	金风科技	873,980	16,474,523.00	5.36
3	600887	伊利股份	421,500	13,568,085.00	4.41
4	000858	五粮液	157,400	12,573,112.00	4.09
5	601636	旗滨集团	1,736,083	10,833,157.92	3.52
6	600176	中国巨石	646,800	10,536,372.00	3.43
7	000703	恒逸石化	440,800	9,508,056.00	3.09
8	002507	涪陵榨菜	560,445	9,398,662.65	3.06
9	600585	海螺水泥	318,600	9,344,538.00	3.04
10	600183	生益科技	527,300	9,101,198.00	2.96
11	601155	新城控股	291,539	8,542,092.70	2.78
12	600298	安琪酵母	247,500	8,098,200.00	2.63
13	002511	中顺洁柔	482,100	7,848,588.00	2.55
14	000063	中兴通讯	195,000	7,090,200.00	2.31
15	000895	双汇发展	239,898	6,357,297.00	2.07
16	600487	亨通光电	152,500	6,164,050.00	2.00
17	000002	万科A	192,000	5,963,520.00	1.94
18	600486	扬农化工	119,000	5,913,110.00	1.92
19	000910	大亚圣象	246,268	5,639,537.20	1.83
20	603008	喜临门	303,764	5,616,596.36	1.83
21	601012	隆基股份	152,521	5,557,865.24	1.81
22	000786	北新建材	218,212	4,909,770.00	1.60
23	600138	中青旅	221,400	4,620,618.00	1.50
24	603228	景旺电子	80,400	4,323,108.00	1.41
25	002132	恒星科技	572,350	3,119,307.50	1.01
26	000513	丽珠集团	44,100	2,930,445.00	0.95
27	002916	深南电路	3,068	267,621.64	0.09
28	603533	掌阅科技	1,691	76,636.12	0.02
29	002908	德生科技	1,751	50,638.92	0.02
30	002903	宇环数控	928	37,138.56	0.01
31	300731	科创新源	808	30,914.08	0.01

32	603829	洛凯股份	1,281	23,160.48	0.01
33	603683	晶华新材	1,095	22,776.00	0.01

8.3 报告期内股票投资组合的重大变动

8.3.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600197	伊力特	27,679,506.74	9.00
2	002507	涪陵榨菜	27,006,391.79	8.78
3	601636	旗滨集团	25,876,419.13	8.41
4	601888	中国国旅	20,705,657.78	6.73
5	000858	五粮液	19,482,983.10	6.34
6	002311	海大集团	16,632,976.88	5.41
7	601398	工商银行	16,499,720.69	5.37
8	600028	中国石化	16,413,700.00	5.34
9	601155	新城控股	16,145,285.20	5.25
10	002531	天顺风能	15,386,304.80	5.00
11	002493	荣盛石化	13,962,957.48	4.54
12	002202	金风科技	13,825,732.01	4.50
13	000895	双汇发展	13,191,556.00	4.29
14	600887	伊利股份	12,159,972.00	3.95
15	600816	安信信托	12,020,273.99	3.91
16	002372	伟星新材	11,914,222.79	3.87
17	000999	华润三九	11,397,272.49	3.71
18	600176	中国巨石	9,553,775.00	3.11
19	600585	海螺水泥	9,481,882.00	3.08
20	002450	康得新	9,149,036.05	2.97

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。

8.3.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
----	------	------	----------	-----------------

1	002507	涪陵榨菜	14,356,432.52	4.67
2	600197	伊力特	6,876,560.95	2.24
3	000895	双汇发展	4,601,430.80	1.50
4	300323	华灿光电	4,248,919.18	1.38
5	000672	上峰水泥	3,472,691.02	1.13
6	002132	恒星科技	3,066,330.00	1.00
7	000910	大亚圣象	2,536,053.50	0.82
8	603008	喜临门	2,155,704.00	0.70
9	000786	北新建材	2,148,572.50	0.70
10	600703	三安光电	1,993,686.00	0.65
11	601012	隆基股份	1,907,130.80	0.62
12	601636	旗滨集团	1,534,683.40	0.50
13	000063	中兴通讯	936,375.00	0.30
14	002511	中顺洁柔	920,361.00	0.30
15	300708	聚灿光电	98,773.42	0.03
16	002906	华阳集团	92,460.24	0.03
17	603106	恒银金融	90,205.82	0.03
18	603367	辰欣药业	87,283.95	0.03
19	002905	金逸影视	80,632.86	0.03
20	603103	横店影视	78,475.43	0.03

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。

8.3.3 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	618,350,610.25
卖出股票收入（成交）总额	722,853,902.51

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。

8.4 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	19,904,000.00	6.47
	其中：政策性金融债	19,904,000.00	6.47
4	企业债券	46,718,585.10	15.19
5	企业短期融资券	9,971,000.00	3.24
6	中期票据	10,044,000.00	3.27
7	可转债（可交换债）	2,426,400.00	0.79
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	89,063,985.10	28.96

8.5 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	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	112233	14 漳发债	200,000	20,424,000.00	6.64
2	170207	17 国开 07	200,000	19,904,000.00	6.47
3	1480561	14 黑重建债 02	200,000	14,922,000.00	4.85
4	1382249	13 钱水利 MTN1	100,000	10,044,000.00	3.27
5	1280379	12 晋汽运债	100,000	9,982,000.00	3.25

8.6 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。

8.7 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

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8.8 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。

8.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

根据本基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

8.9.2 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。

8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.10.1 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。

8.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

根据本基金合同规定, 本基金不参与国债期货交易。

8.10.3 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。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1

报告期内基金投资的前十名证券除 14 漳发债(证券代码 112233)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。

根据 2017 年 1 月 14 日发布的相关公告, 该证券发行人因财务会计报告违规, 未及时披露公司重大事件, 重大事项未履行审议程序被福建证监局处以警示。

对上述证券的投资决策程序的说明: 本基金投资上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

8.11.2

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。

8.11.3 其他资产构成

单位: 人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	180,723.14
2	应收证券清算款	8,580,403.90
3	应收股利	-
4	应收利息	998,924.62
5	应收申购款	84,472.80
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,844,524.46

8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110032	三一转债	2,426,400.00	0.79

8.11.5 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	002507	涪陵榨菜	9,398,662.65	3.06	重大事项

§8 投资组合报告（转型前）

8.1 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	44,088,358.27	5.86
	其中：股票	44,088,358.27	5.86
2	固定收益投资	153,092,856.50	20.35
	其中：债券	153,092,856.50	20.35
	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	503,000,125.50	66.87
	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	38,753,987.85	5.15
7	其他资产	13,247,720.58	1.76
8	合计	752,183,048.70	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	43,934,398.24	5.97
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	29,052.99	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	28,128.36	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	19,209.76	0.00
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	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	77,568.92	0.01
S	综合	-	-
	合计	44,088,358.27	5.99

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

8.3 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

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	002507	涪陵榨菜	1,381,900	21,170,708.00	2.88
2	000895	双汇发展	320,401	7,872,252.57	1.07
3	600887	伊利股份	263,400	7,319,886.00	0.99
4	600197	伊力特	300,000	7,041,000.00	0.96
5	603106	恒银金融	2,786	92,439.48	0.01
6	603367	辰欣药业	3,315	61,228.05	0.01
7	002901	大博医疗	1,834	54,121.34	0.01
8	300700	岱勒新材	833	47,789.21	0.01
9	603157	拉夏贝尔	2,150	41,925.00	0.01
10	603619	中曼石油	1,760	39,793.60	0.01
11	002906	华阳集团	2,742	37,537.98	0.01
12	603378	亚士创能	1,628	36,695.12	0.00
13	002905	金逸影视	1,539	32,288.22	0.00
14	603963	大理药业	999	32,057.91	0.00
15	603103	横店影视	2,021	31,224.45	0.00
16	601086	国芳集团	5,799	29,052.99	0.00
17	002902	铭普光磁	1,270	28,435.30	0.00
18	603813	原尚股份	741	28,128.36	0.00
19	603533	掌阅科技	1,691	19,209.76	0.00
20	300654	世纪天鸿	865	14,056.25	0.00
21	002903	宇环数控	928	11,859.84	0.00
22	300705	九典制药	1,073	11,127.01	0.00
23	603110	东方材料	847	11,044.88	0.00
24	603829	洛凯股份	1,281	9,261.63	0.00
25	300708	聚灿光电	2,742	7,732.44	0.00
26	603499	翔港科技	812	7,502.88	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	600197	伊力特	27,679,506.74	3.76
2	002507	涪陵榨菜	27,006,391.79	3.67
3	601888	中国国旅	20,705,657.78	2.81
4	002311	海大集团	16,632,976.88	2.26
5	601398	工商银行	16,499,720.69	2.24
6	600028	中国石化	16,413,700.00	2.23
7	000858	五粮液	16,383,161.10	2.23
8	601636	旗滨集团	14,032,117.00	1.91
9	002493	荣盛石化	13,962,957.48	1.90
10	600816	安信信托	12,020,273.99	1.63
11	002372	伟星新材	11,914,222.79	1.62
12	000999	华润三九	11,397,272.49	1.55
13	000895	双汇发展	10,666,148.00	1.45
14	600887	伊利股份	9,511,951.00	1.29
15	002450	康得新	9,149,036.05	1.24
16	600987	航民股份	9,029,047.85	1.23
17	000726	鲁泰A	9,025,315.09	1.23
18	601155	新城控股	8,667,785.00	1.18
19	002597	金禾实业	8,578,099.11	1.17
20	600779	水井坊	8,386,268.76	1.14

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。

8.4.2 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	600055	万东医疗	41,143,804.23	5.59
2	000926	福星股份	28,323,630.78	3.85

3	601888	中国国旅	23,281,728.00	3.16
4	600197	伊力特	23,251,951.00	3.16
5	002126	银轮股份	21,636,041.07	2.94
6	601398	工商银行	18,735,718.48	2.55
7	002420	毅昌股份	18,209,489.83	2.47
8	002311	海大集团	17,758,204.30	2.41
9	002026	山东威达	17,044,348.64	2.32
10	300295	三五五网	16,870,710.80	2.29
11	603085	天成自控	16,563,732.30	2.25
12	600028	中国石化	16,176,125.00	2.20
13	300147	香雪制药	15,425,605.72	2.10
14	002215	诺普信	14,117,703.76	1.92
15	002507	涪陵榨菜	13,907,879.56	1.89
16	601636	旗滨集团	12,857,420.82	1.75
17	002372	伟星新材	12,739,354.78	1.73
18	002493	荣盛石化	12,661,098.00	1.72
19	600816	安信信托	12,052,436.88	1.64
20	600716	凤凰股份	11,494,522.38	1.56

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。

8.4.3 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	413,289,286.16
卖出股票收入（成交）总额	670,754,459.07

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。

8.5 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	-	-

2	央行票据	-	-
3	金融债券	40,008,000.00	5.44
	其中：政策性金融债	40,008,000.00	5.44
4	企业债券	73,348,856.50	9.97
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	10,066,000.00	1.37
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	29,670,000.00	4.03
9	其他	-	-
10	合计	153,092,856.50	20.80

8.6 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	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	140225	14 国开 25	400,000	40,008,000.00	5.44
2	112233	14 漳发债	300,000	31,134,000.00	4.23
3	111780886	17 盛京银行 CD152	300,000	29,670,000.00	4.03
4	1280379	12 晋汽运债	200,000	20,430,000.00	2.78
5	1480561	14 黑重建债 02	200,000	20,386,000.00	2.77

8.7 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。

8.8 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投资。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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。

8.10.2 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

8.11.3 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

报告期内基金投资的前十名证券除 14 漳发债（证券代码 112233）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。

根据 2017 年 1 月 14 日发布的相关公告，该证券发行人因财务会计报告违规，未及时披露公司重大事件，重大事项未履行审议程序被福建证监局处以警示。

对上述证券的投资决策程序的说明：本基金投资上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

8.12.2

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。

8.12.3 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	75,635.06
2	应收证券清算款	7,529,337.85
3	应收股利	-
4	应收利息	5,642,747.67
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,247,720.58

8.12.4 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。

8.12.5 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	603619	中曼石油	39,793.60	0.01	新股锁定

§9 基金份额持有人信息

9.1 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
2,988	80,700.44	84,123.07	0.03%	241,048,778.94	99.97

9.2 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
基金管理人所有从业人员持有本基金	招商安达灵活配置	-	-
	合计	-	-

9.3 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

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金转型合同生效日的基金份额总额	602,042,667.94
本报告期期初基金份额总额	602,042,667.94
本报告期基金总申购份额	712,495.68
减:本报告期基金总赎回份额	361,622,261.61
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	
本报告期期末基金份额总额	241,132,902.01

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期没有举行基金份额持有人大会。

11.2 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

基金管理人监事会主席丁安华先生因工作调动原因辞任公司监事会主席职务。2017年9月15日,经招商基金管理有限公司第五届监事会2017年第二次会议审议通过,选举赵斌先生担任公司第五届监事会主席。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

转型前的投资策略：（报告期间：2017年1月1日至2017年10月10日）

本基金充分发挥基金管理人的研究优势，将严谨、规范化的基本面研究分析与积极主动的投资风格相结合，利用恒定比例组合保险（CPPI、Constant Proportion Portfolio Insurance）技术，动态调整保本资产与风险资产的投资比例，以确保保本周期到期时，实现基金资产在保本基础上的保值增值的目的。

转型后的投资策略：（报告期间：2017年10月10日至2017年12月31日）

资产配置方法：在资产配置方法上，投资组合管理人在借鉴国际先进投资技术的基础上，结合国内实际情况和自身的投资管理经验，建立了自己的资产配置体系。招商基金的资产配置体系分为战略资产配置和战术资产配置。

股票投资策略：本基金的股票投资采取自下而上的方法，以深入的基本面研究为基础，精选具有一定核心优势的且成长性良好、价值被低估的上市公司股票，构建投资组合，以寻求超越业绩基准的超额收益。

货币市场工具投资：在本基金的货币市场工具投资过程中，将以严谨的市场价值分析为基础，采用稳健的投资组合策略，通过对短期金融工具的组合操作，在保持资产流动性的同时，追求稳定的投资收益。

债券投资策略：根据国内外宏观经济形势、财政、货币政策、市场资金与债券供求状况、央行公开市场操作等方面情况，采用定性与定量相结合的方式，确定债券投资的组合久期，并根据通胀预期确定浮息债与固定收益债比例；在满足组合久期设置的基础上，投资团队分析债券收益率曲线变动、各期限品种收益率及收益率基差波动等因素，预测收益率曲线的变动趋势，并结合流动性偏好、信用分析等多种市场因素进行分析，综合评判个券的投资价值。在个券选择的基础上，投资团队构建模拟组合，并比较不同模拟组合之间的收益和风险匹配情况，确定风险、收益最佳匹配的组合。

权证投资策略：本基金对权证资产的投资主要是通过通过分析影响权证内在价值最重要的两种因素——标的资产价格以及市场隐含波动率的变化，灵活构建避险策略，波动率差策略以及套利策略。。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金的审计事务所无变化，目前德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）已为本

基金提供审计服务 7 年，本报告期应支付给德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为人民币 70,000.00 元。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
川财证券	2	139,760,323.47	10.47%	130,158.90	10.64%	-
天风证券	1	415,685,483.26	31.13%	387,129.04	31.64%	-
东方证券	1	232,933,984.08	17.45%	216,931.92	17.73%	-
西藏东方财富	1	99,385,424.10	7.44%	72,680.31	5.94%	-
中信建投	1	72,252,408.40	5.41%	67,289.21	5.50%	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	375,161,040.06	28.10%	349,387.27	28.55%	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	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。

11.7.2 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
川财证券	8,803,571.43	9.67%	985,800,000.00	9.57%	-	-
天风证券	183,532.47	0.20%	-	-	-	-
东方证券	10,001,139.73	10.98%	-	-	-	-
西藏东方财富	-	-	1,629,300,000.00	15.82%	-	-
中信建投	71,530,298.64	78.54%	566,200,000.00	5.50%	-	-

西南证券	-	-	-	-	-
方正证券	551,935.20	0.61%	7,118,500,000.00	69.11%	-
华泰证券	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-

11.9 其他重大事件（转型后）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	招商安达保本混合型证券投资基金更新的招募说明书（二零一七年第二号）	中国证券报、 证券时报、 上海证券报	2017年10月14日
2	招商安达保本混合型证券投资基金更新的招募说明书摘要（二零一七年第二号）	中国证券报、 证券时报、 上海证券报	2017年10月14日
3	关于招商基金旗下部分基金增加排排网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	2017年10月19日
4	关于招商基金管理有限公司北京分公司办公地址变更的公告	中国证券报、 证券时报、 上海证券报	2017年10月20日
5	招商安达灵活配置混合型证券投资基金 2017 年第 3 季度报告	中国证券报、 证券时报、 上海证券报	2017年10月26日
6	关于招商基金旗下部分基金增加通华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	2017年11月30日
7	关于招商安达灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更的公告	中国证券报、 证券时报、 上海证券报	2017年11月30日
8	招商基金管理有限公司关于旗下基金调整流通受限股票估值方法的公告	中国证券报、 证券时报、 上海证券报	2017年12月6日
9	关于招商安达灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更的公告	中国证券报、 证券时报、 上海证券报	2017年12月27日
10	关于招商基金管理有限公司参加中国邮储银行个人网上银行和手机银行基金前端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	2017年12月28日
11	招商基金关于旗下部分基金参加中国农业银行公募基金申购、基金组合购买、定投进行费率优惠活动的公告	中国证券报、 证券时报、 上海证券报	2017年12月28日
12	招商基金管理有限公司关于增加注册资本及修改公司章程的公告	中国证券报、 证券时报、 上海证券报	2017年12月28日

13	招商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国工商银行“2018 倾心回馈”基金定投优惠活动的公告	中国证券报、 证券时报、 上海证券报	2017 年 12 月 29 日
14	招商基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参加交通银行股份有限公司手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告	中国证券报、 证券时报、 上海证券报	2017 年 12 月 30 日
15	招商基金管理有限公司关于招商安达灵活配置混合型证券投资基金业绩比较基准名称变更的公告	中国证券报、 证券时报、 上海证券报	2017 年 12 月 30 日

11.9 其他重大事件（转型前）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	招商基金管理有限公司关于公司董事、监事、高级管理人员以及其他从业人员在子公司兼职情况变更的公告	中国证券报、 证券时报、 上海证券报	2017 年 1 月 7 日
2	招商基金管理有限公司关于参加蛋卷基金基金申(认)购费率优惠的公告	中国证券报、 证券时报、 上海证券报	2017 年 1 月 12 日
3	招商安达保本混合型证券投资基金 2016 年第 4 季度报告	中国证券报、 证券时报、 上海证券报	2017 年 1 月 20 日
4	招商基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参加交通银行股份有限公司手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告	中国证券报、 证券时报、 上海证券报	2017 年 2 月 23 日
5	关于招商安达保本混合型证券投资基金基金经理变更的公告	中国证券报、 证券时报、 上海证券报	2017 年 3 月 11 日
6	招商基金旗下部分基金增加创金启富为代销机构及开通定投和转换业务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	2017 年 3 月 17 日
7	关于招商基金旗下部分基金继续参加中国工商银行个人电子银行基金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	2017 年 3 月 31 日
8	招商安达保本混合型证券投资基金 2016 年年度报告	中国证券报、 证券时报、 上海证券报	2017 年 3 月 31 日
9	招商安达保本混合型证券投资基金 2016 年年度报告摘要	中国证券报、 证券时报、 上海证券报	2017 年 3 月 31 日
10	招商安达保本混合型证券投资基金更新的招募说明书（二零一七年第一号）	中国证券报、 证券时报、 上海证券报	2017 年 4 月 13 日
11	招商安达保本混合型证券投资基金更新的招募说明书摘要（二零一七年第一号）	中国证券报、 证券时报、 上海证券报	2017 年 4 月 13 日

12	招商安达保本混合型证券投资基金 2017 年第 1 季度报告	中国证券报、 证券时报、 上海证券报	2017 年 4 月 21 日
13	招商基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参加交通银行股份有限公司手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告	中国证券报、 证券时报、 上海证券报	2017 年 4 月 22 日
14	招商基金旗下部分基金增加上海挖财为代销机构及开通定投和转换业务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	2017 年 4 月 28 日
15	招商基金管理有限公司关于旗下基金估值变更的公告	中国证券报、 证券时报、 上海证券报	2017 年 5 月 6 日
16	招商基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参加交通银行股份有限公司网上银行基金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	2017 年 7 月 1 日
17	招商基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参加交通银行股份有限公司手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告	中国证券报、 证券时报、 上海证券报	2017 年 7 月 3 日
18	关于招商基金旗下部分基金增加基煜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	2017 年 7 月 17 日
19	招商安达保本混合型证券投资基金 2017 年第 2 季度报告	中国证券报、 证券时报、 上海证券报	2017 年 7 月 21 日
20	招商基金管理有限公司关于旗下部分基金参与华泰证券基金定投及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	2017 年 8 月 1 日
21	招商安达保本混合型证券投资基金 2017 年半年度报告	中国证券报、 证券时报、 上海证券报	2017 年 8 月 29 日
22	招商安达保本混合型证券投资基金 2017 年半年度报告摘要	中国证券报、 证券时报、 上海证券报	2017 年 8 月 29 日
23	招商基金管理有限公司关于旗下部分产品参加江南农村商业银行费率优惠活动的公告	中国证券报、 证券时报、 上海证券报	2017 年 9 月 19 日
24	招商基金管理有限公司关于招商安达保本混合型证券投资基金修订基金合同的公告	中国证券报、 证券时报、 上海证券报	2017 年 9 月 20 日
25	招商安达保本混合型证券投资基金保本期到期安排及转型为招商安达灵活配置混合型证券投资基金的第一次提示性公告	中国证券报、 证券时报、 上海证券报	2017 年 9 月 20 日
26	招商安达灵活配置混合基金托管协议	中国证券报、 证券时报、	2017 年 9 月 20 日

		上海证券报	
27	招商安达灵活配置混合基金基金合同	中国证券报、 证券时报、 上海证券报	2017 年 9 月 20 日
28	招商安达灵活配置混合型证券投资基金更新的招募说明书	中国证券报、 证券时报、 上海证券报	2017 年 9 月 20 日
29	招商安达灵活配置混合型证券投资基金基金合同摘要	中国证券报、 证券时报、 上海证券报	2017 年 9 月 20 日
30	招商安达保本混合型证券投资基金保本期到期安排及转型为招商安达灵活配置混合型证券投资基金的第二次提示性公告	中国证券报、 证券时报、 上海证券报	2017 年 9 月 21 日
31	招商安达保本混合型证券投资基金保本周期到期安排及转型为招商安达灵活配置混合型证券投资基金相关业务规则的公告	中国证券报、 证券时报、 上海证券报	2017 年 9 月 22 日
32	招商基金管理有限公司关于招商安达保本混合型证券投资基金暂停定期定额申购业务的公告	中国证券报、 证券时报、 上海证券报	2017 年 9 月 23 日
33	关于招商安达保本混合型证券投资基金基金经理变更的公告	中国证券报、 证券时报、 上海证券报	2017 年 9 月 26 日
34	招商基金管理有限公司关于招商安达灵活配置混合型证券投资基金开放申购（含定期定额投资及转换转入）业务的公告	中国证券报、 证券时报、 上海证券报	2017 年 9 月 27 日
35	招商基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中泰证券申购费率（含定投）优惠活动的公告	中国证券报、 证券时报、 上海证券报	2017 年 9 月 29 日
36	招商安达保本混合型证券投资基金更新的招募说明书摘要（二零一七年第二号）	中国证券报、 证券时报、 上海证券报	2017 年 10 月 14 日
37	关于招商基金旗下部分基金增加排排网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	2017 年 10 月 19 日
38	关于招商基金管理有限公司北京分公司办公地址变更的公告	中国证券报、 证券时报、 上海证券报	2017 年 10 月 20 日
39	招商安达灵活配置混合型证券投资基金 2017 年第 3 季度报告	中国证券报、 证券时报、 上海证券报	2017 年 10 月 26 日
40	关于招商基金旗下部分基金增加通华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	2017 年 11 月 30 日
41	关于招商安达灵活配置混合型证券投资基金基金	中国证券报、	2017 年 11 月 30 日

	经理变更的公告	证券时报、 上海证券报	日
42	招商基金管理有限公司关于旗下基金调整流通受限股票估值方法的公告	中国证券报、 证券时报、 上海证券报	2017 年 12 月 6 日
43	关于招商安达灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更的公告	中国证券报、 证券时报、 上海证券报	2017 年 12 月 27 日
44	关于招商基金管理有限公司参加中国邮储银行个人网上银行和手机银行基金前端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	2017 年 12 月 28 日
45	招商基金关于旗下部分基金参加中国农业银行公募基金申购、基金组合购买、定投进行费率优惠活动的公告	中国证券报、 证券时报、 上海证券报	2017 年 12 月 28 日
46	招商基金管理有限公司关于增加注册资本及修改公司章程的公告	中国证券报、 证券时报、 上海证券报	2017 年 12 月 28 日
47	招商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国工商银行“2018 倾心回馈”基金定投优惠活动的公告	中国证券报、 证券时报、 上海证券报	2017 年 12 月 29 日
48	招商基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参加交通银行股份有限公司手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告	中国证券报、 证券时报、 上海证券报	2017 年 12 月 30 日
49	招商基金管理有限公司关于招商安达灵活配置混合型证券投资基金业绩比较基准名称变更的公告	中国证券报、 证券时报、 上海证券报	2017 年 12 月 30 日

§12 备查文件目录

13.1 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准予招商安达灵活配置混合型证券投资基金设立的文件；
- 3、中国证券监督管理委员会准予招商安达灵活配置混合型证券投资基金设立的文件
- 4、《招商安达灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 5、《招商安达灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 6、《招商安达灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- 7、《招商安达保本混合型证券投资基金基金合同》；
- 8、《招商安达保本混合型证券投资基金托管协议》；
- 9、《招商安达保本混合型证券投资基金招募说明书》；

10、基金管理人业务资格批件、营业执照。

13.2 存放地点

招商基金管理有限公司

地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 28 层

13.3 查阅方式

上述文件可在招商基金管理有限公司互联网站 <http://www.cmfcchina.com> 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

2018 年 3 月 30 日