

招商安荣灵活配置混合型证券投资基金  
2018 年年度报告  
(原招商安荣保本混合型证券投资基金)

2018 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：中国民生银行股份有限公司

送出日期：2019 年 3 月 28 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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 3 月 27 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。

招商安荣灵活配置混合型证券投资基金由招商安荣保本混合型证券投资基金于 2018 年 7 月 17 日转型而来。根据《招商安荣保本混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金每两年为一个保本周期，本基金第一个保本周期到期日为 2018 年 7 月 16 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，即招商安荣灵活配置混合型证券投资基金。招商安荣保本混合型证券投资基金的保本周期到期日，即 2018 年 7 月 16 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 2018 年 7 月 17 日，招商安荣保本混合型证券投资基金转型为招商安荣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 2018 年度无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告中招商安荣灵活配置混合型证券投资基金的报告期自 2018 年 7 月 17 日（转型生效日）起至 2018 年 12 月 31 日止，招商安荣保本混合型证券投资基金的报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 2018 年 7 月 16 日止。

## 1.2 目录

|  |           |
|--|-----------|
| <b>§1 重要提示及目录</b> .....                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示.....                                | 2         |
| 1.2 目录.....                                  | 3         |
| <b>§2 基金简介</b> .....                         | <b>5</b>  |
| 2.1 基金基本情况（转型后）.....                         | 5         |
| 2.1 基金基本情况（转型前）.....                         | 5         |
| 2.2 基金产品说明（转型后）.....                         | 5         |
| 2.2 基金产品说明（转型前）.....                         | 6         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人.....                         | 6         |
| 2.4 信息披露方式.....                              | 6         |
| 2.5 其他相关资料.....                              | 6         |
| <b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....         | <b>7</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标.....                         | 7         |
| 3.2 基金净值表现（转型后）.....                         | 8         |
| 3.2 基金净值表现（转型前）.....                         | 12        |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况.....                       | 16        |
| <b>§4 管理人报告</b> .....                        | <b>17</b> |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况.....                        | 17        |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....              | 19        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....                 | 20        |
| 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.....             | 21        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....             | 22        |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....                 | 23        |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....                | 23        |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....                 | 24        |
| 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.....       | 24        |
| <b>§5 托管人报告</b> .....                        | <b>25</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....                  | 25        |
| 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..... | 25        |
| 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.....      | 25        |
| <b>§6 审计报告（转型后）</b> .....                    | <b>25</b> |
| <b>§6 审计报告（转型前）</b> .....                    | <b>27</b> |
| <b>§7 年度财务报表（转型后）</b> .....                  | <b>30</b> |
| 7.1 资产负债表（转型后）.....                          | 30        |
| 7.2 利润表.....                                 | 31        |
| 7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....                      | 32        |
| 7.4 报表附注.....                                | 33        |
| <b>§7 年度财务报表（转型前）</b> .....                  | <b>52</b> |
| 7.1 资产负债表（转型前）.....                          | 52        |
| 7.2 利润表.....                                 | 53        |
| 7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....                      | 54        |
| 7.4 报表附注.....                                | 55        |
| <b>§8 投资组合报告（转型后）</b> .....                  | <b>76</b> |

|  |           |
|--|-----------|
| 8.1 期末基金资产组合情况.....                        | 76        |
| 8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....                    | 77        |
| <b>§8 投资组合报告（转型前）.....</b>                 | <b>82</b> |
| 8.1 期末基金资产组合情况.....                        | 82        |
| 8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....                    | 82        |
| 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.....     | 82        |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                   | 82        |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                  | 84        |
| 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.....    | 84        |
| 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..... | 85        |
| 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..... | 85        |
| 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.....    | 85        |
| 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....             | 85        |
| 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....             | 85        |
| 8.12 投资组合报告附注.....                         | 85        |
| <b>§9 基金份额持有人信息（转型后）.....</b>              | <b>87</b> |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....                 | 87        |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....              | 87        |
| 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.....     | 87        |
| <b>§9 基金份额持有人信息（转型前）.....</b>              | <b>88</b> |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....                 | 88        |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....              | 88        |
| 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.....     | 88        |
| <b>§10 开放式基金份额变动(转型后).....</b>             | <b>89</b> |
| <b>§10 开放式基金份额变动(转型前).....</b>             | <b>90</b> |
| <b>§11 重大事件揭示.....</b>                     | <b>91</b> |
| 11.1 基金份额持有人大会决议.....                      | 91        |
| 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.....      | 91        |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....           | 91        |
| 11.4 基金投资策略的改变.....                        | 91        |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....                 | 91        |
| 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.....         | 92        |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型后）.....           | 92        |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前）.....           | 92        |
| 11.9 其他重大事件（转型后）.....                      | 93        |
| 11.9 其他重大事件（转型前）.....                      | 94        |
| <b>§12 备查文件目录.....</b>                     | <b>96</b> |

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况（转型后）

|                 |                   |                |
|-----------------|-------------------|----------------|
| 基金名称            | 招商安荣灵活配置混合型证券投资基金 |                |
| 基金简称            | 招商安荣混合            |                |
| 基金主代码           | 002776            |                |
| 基金运作方式          | 契约型开放式            |                |
| 基金合同生效日         | 2018 年 7 月 17 日   |                |
| 基金管理人           | 招商基金管理有限公司        |                |
| 基金托管人           | 中国民生银行股份有限公司      |                |
| 报告期末基金份额总额      | 105,440,988.50 份  |                |
| 基金合同存续期         | 不定期               |                |
| 下属分级基金的基金简称     | 招商安荣混合 A          | 招商安荣混合 C       |
| 下属分级基金的交易代码     | 002776            | 002777         |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 98,122,515.55 份   | 7,318,472.95 份 |

### 2.1 基金基本情况（转型前）

|                 |                    |                 |
|-----------------|--------------------|-----------------|
| 基金名称            | 招商安荣保本混合型证券投资基金    |                 |
| 基金简称            | 招商安荣保本混合           |                 |
| 基金主代码           | 002776             |                 |
| 基金运作方式          | 契约型开放式             |                 |
| 基金合同生效日         | 2016 年 7 月 15 日    |                 |
| 基金管理人           | 招商基金管理有限公司         |                 |
| 基金托管人           | 中国民生银行股份有限公司       |                 |
| 报告期末基金份额总额      | 1,178,643,194.49 份 |                 |
| 基金合同存续期         | 不定期                |                 |
| 下属分级基金的基金简称     | 招商安荣保本混合 A         | 招商安荣保本混合 C      |
| 下属分级基金的交易代码     | 002776             | 002777          |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 1,129,017,584.39 份 | 49,625,610.10 份 |

### 2.2 基金产品说明（转型后）

|        |  |
|--------|--|
| 投资目标   | 本基金通过将基金资产在不同投资资产类别之间灵活配置，在控制下行风险的前提下为投资人获取稳健回报。   |
| 投资策略   | 本基金在大类资产配置过程中，注重平衡投资的收益和风险水平，以实现基金份额净值的稳定增长。<br>具体包括：1、资产配置策略；2、股票投资策略；3、债券（不含可转换公司债）投资策略；4、可转换公司债投资策略；5、资产支持证券投资策略；6、权证投资策略；7、期货投资策略。 |
| 业绩比较基准 | 50%×沪深 300 指数收益率+50%×中债综合指数收益率   |
| 风险收益特征 | 本基金是混合型基金，预期收益和预期风险高于  |

|  |                       |
|--|-----------------------|
|  | 货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。 |
|--|-----------------------|

## 2.2 基金产品说明（转型前）

|        |  |
|--------|--|
| 投资目标   | 通过运用投资组合保险技术，力争控制本金损失的风险，并寻求组合资产的稳定增值。   |
| 投资策略   | 本基金将投资品种分为风险资产和保本资产两类，采用恒定比例投资组合保险（Constant Proportion Portfolio Insurance，以下简称“CPPI”）策略。本基金在保本周期内将严格遵守保本策略，实现对风险资产和保本资产的优化动态调整和资产配置，力争投资本金的安全性。同时，本基金通过积极稳健的风险资产投资策略，竭力为基金资产获取稳定增值。具体包括：资产配置策略、债券（不含可转换公司债）投资策略、可转换公司债投资策略、中小企业私募债券投资策略、国债期货投资策略、股票投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、权证投资策略。 |
| 业绩比较基准 | 人民银行公布的两年期银行定期存款利率（税后）   |
| 风险收益特征 | 本基金是保本混合型基金，属于证券市场中的低风险品种。   |

## 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目      |      | 基金管理人                 | 基金托管人                 |
|---------|------|-----------------------|-----------------------|
| 名称      |      | 招商基金管理有限公司            | 中国民生银行股份有限公司          |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 潘西里                   | 罗菲菲                   |
|         | 联系电话 | 0755-83196666         | 010-58560666          |
|         | 电子邮箱 | cmf@cmfchina.com      | tgbfxjdzx@cmbc.com.cn |
| 客户服务电话  |      | 400-887-9555          | 95568                 |
| 传真      |      | 0755-83196475         | 010-58560798          |
| 注册地址    |      | 深圳市福田区深南大道 7088 号     | 北京市西城区复兴门内大街 2 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 2 号      |
| 邮政编码    |      | 518040                | 100031                |
| 法定代表人   |      | 李浩                    | 洪崎                    |

## 2.4 信息披露方式

|                     |   |
|---------------------|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 中国证券报、证券时报、上海证券报  |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | <a href="http://www.cmfchina.com">http://www.cmfchina.com</a> |
| 基金年度报告备置地点          | 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 | 中国上海市延安东路 222 号外滩中心 30 |

|        |            |                       |
|--------|------------|-----------------------|
|        | 合伙)        | 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 | 2018 年 7 月 17 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日 |              |
|---------------|--|--------------|
|               | 招商安荣混合 A                                   | 招商安荣混合 C     |
| 本期已实现收益       | -2,249,173.32                              | -171,334.84  |
| 本期利润          | -11,659,796.39                             | -759,112.16  |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.0948                                    | -0.0949      |
| 本期加权平均净值利润率   | -9.57%                                     | -9.78%       |
| 本期基金份额净值增长率   | -4.20%                                     | -6.08%       |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2018 年 12 月 31 日                           |              |
| 期末可供分配利润      | -4,120,924.50                              | -445,311.39  |
| 期末可供分配基金份额利润  | -0.0420                                    | -0.0608      |
| 期末基金资产净值      | 94,001,591.05                              | 6,873,161.56 |
| 期末基金份额净值      | 0.9580                                     | 0.9392       |
| 3.1.3 累计期末指标  | 2018 年 12 月 31 日                           |              |
| 基金份额累计净值增长率   | -8.41%                                     | -8.64%       |

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、招商安荣灵活配置混合型证券投资基金由招商安荣保本混合型证券投资基金于 2018 年 7 月 17 日转型而来。本基金对应的本期基金份额净值增长率及基金份额累计净值增长率的计算起始日为本基金转型日期 2018 年 7 月 17 日，截至 2018 年 12 月 31 日转型未满一年，本报告期为非完整会计期间。

转型前

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 7 月 16 日 |            | 2017 年     |            | 2016 年     |            |
|---------------|---------------------------------|------------|------------|------------|------------|------------|
|               | 招商安荣保本混合 A                      | 招商安荣保本混合 C | 招商安荣保本混合 A | 招商安荣保本混合 C | 招商安荣保本混合 A | 招商安荣保本混合 C |
|               |                                 |            |            |            |            |            |



|                      |                  |               |                  |               |                  |                |
|----------------------|------------------|---------------|------------------|---------------|------------------|----------------|
| 本期已实现收益              | 15,967,788.14    | 538,534.59    | 45,817,997.34    | 3,009,532.11  | 2,688,397.53     | -515,923.98    |
| 本期利润                 | 28,091,268.97    | 1,271,080.30  | 39,912,925.84    | 2,544,910.68  | 4,014,959.58     | -1,346,021.30  |
| 加权平均基金份额本期利润         | 0.0231           | 0.0167        | 0.0259           | 0.0169        | -0.0023          | -0.0060        |
| 本期加权平均净值利润率          | 2.22%            | 1.63%         | 2.56%            | 1.69%         | -0.23%           | -0.60%         |
| 本期基金份额净值增长率          | 2.25%            | 1.78%         | 2.51%            | 1.61%         | -0.20%           | -0.60%         |
| <b>3.1.2 期末数据和指标</b> | 2018年7月16日       |               | 2017年末           |               | 2016年末           |                |
| 期末可供分配利润             | 4,127,672.06     | 87,144.49     | 30,227,273.98    | 897,943.94    | 4,036,754.95     | 1,342,752.83   |
| 期末可供分配基金份额利润         | 0.0037           | 0.0018        | 0.0232           | 0.0102        | -0.0024          | -0.0064        |
| 期末基金资产净值             | 1,180,817,847.03 | 51,032,300.23 | 1,332,610,810.38 | 88,738,805.78 | 1,694,627,921.60 | 209,857,153.45 |
| 期末基金份额净值             | 1.0460           | 1.0280        | 1.0230           | 1.0100        | 0.9980           | 0.9940         |
| <b>3.1.3 累计期末指标</b>  | 2018年7月16日       |               | 2017年末           |               | 2016年末           |                |
| 基金份额累计净值增长率          | 4.60%            | 2.80%         | 2.30%            | 1.00%         | -0.20%           | -0.60%         |

注：1、基金业绩指标不包括持有人认（申）购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

3、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数；

4、根据《招商安荣保本混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，2018年7月16日为招商安荣保本混合型证券投资基金的第一个保本周期到期日，自2018年7月17日招商安荣保本混合型证券投资基金转型为招商安荣灵活配置混合型证券投资基金，因此上表本报告期间的结束日为2018年7月16日。

## 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

招商安荣混合 A

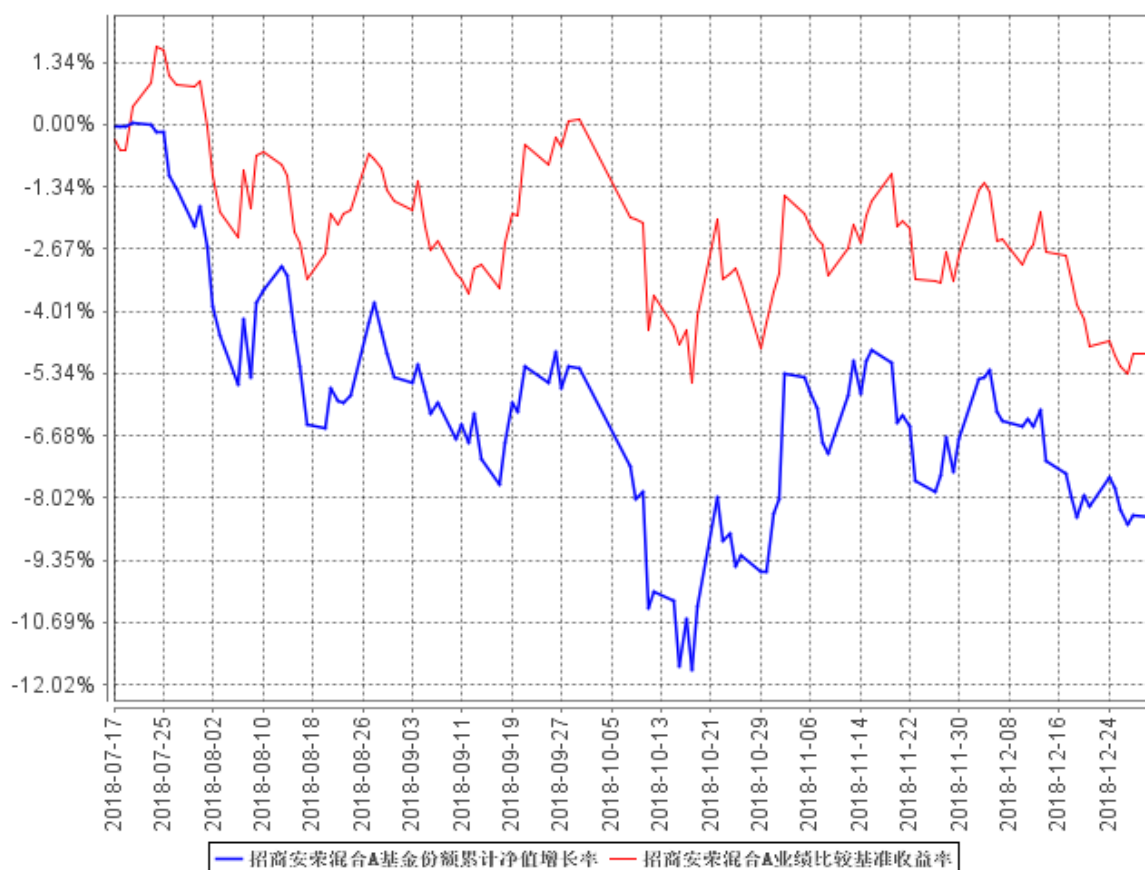
| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 自基金合同生效起至今 | -8.41%   | 0.87%       | -4.90%     | 0.74%         | -3.51% | 0.13% |

## 招商安荣混合 C

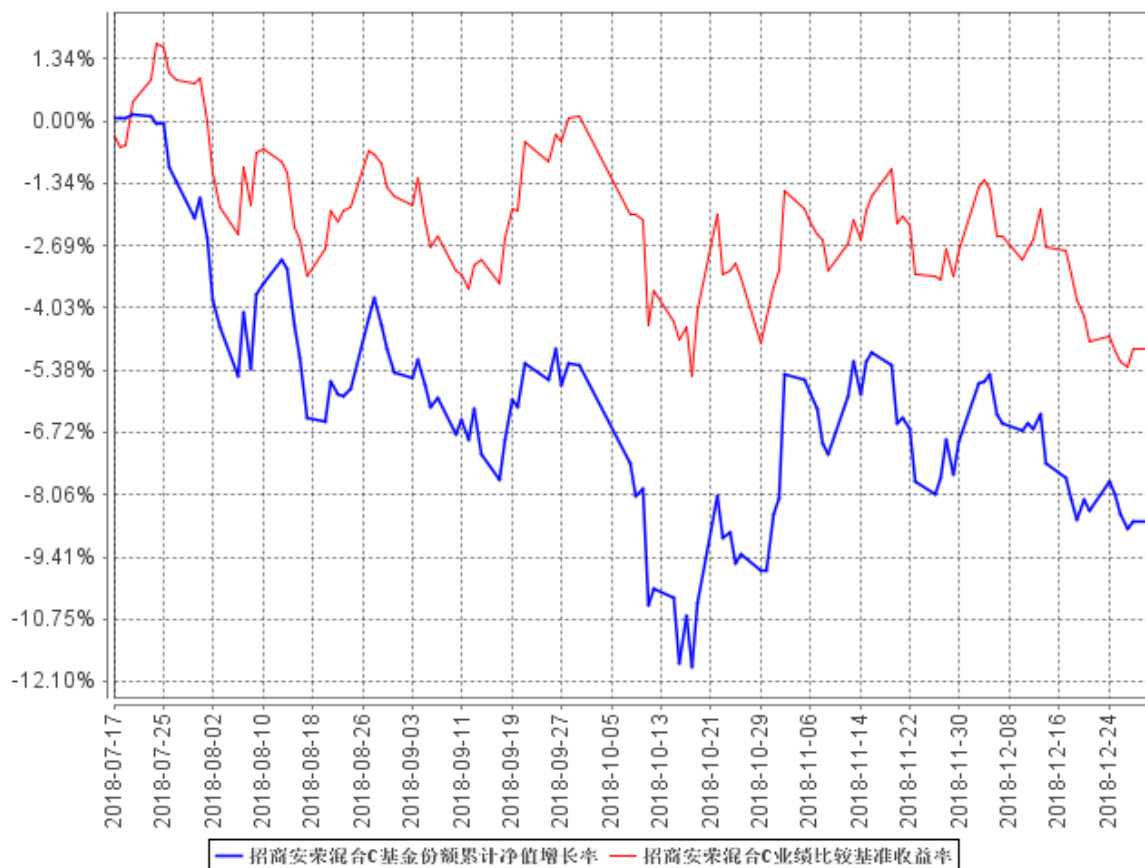
| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 自基金合同生效起至今 | -8.64%   | 0.87%       | -4.90%     | 0.74%         | -3.74% | 0.13% |

### 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

招商安荣混合A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



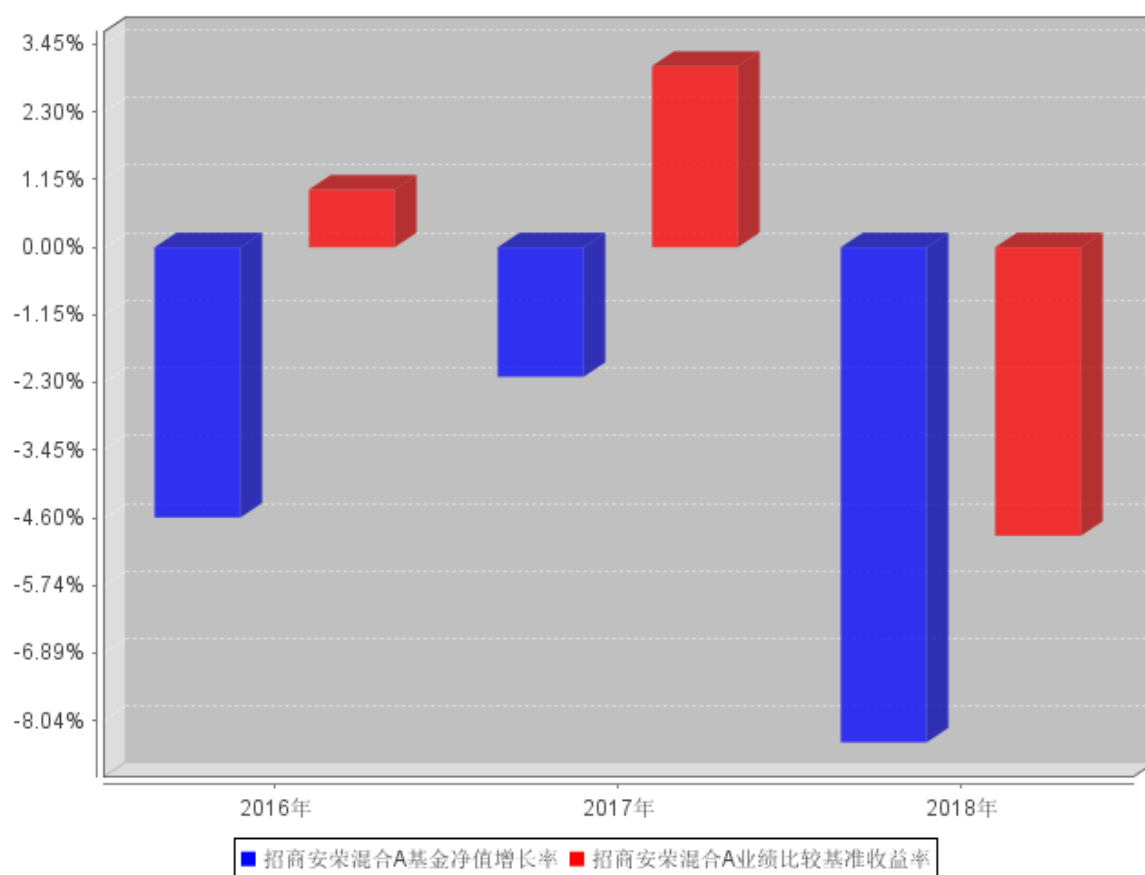
### 招商安荣混合C基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



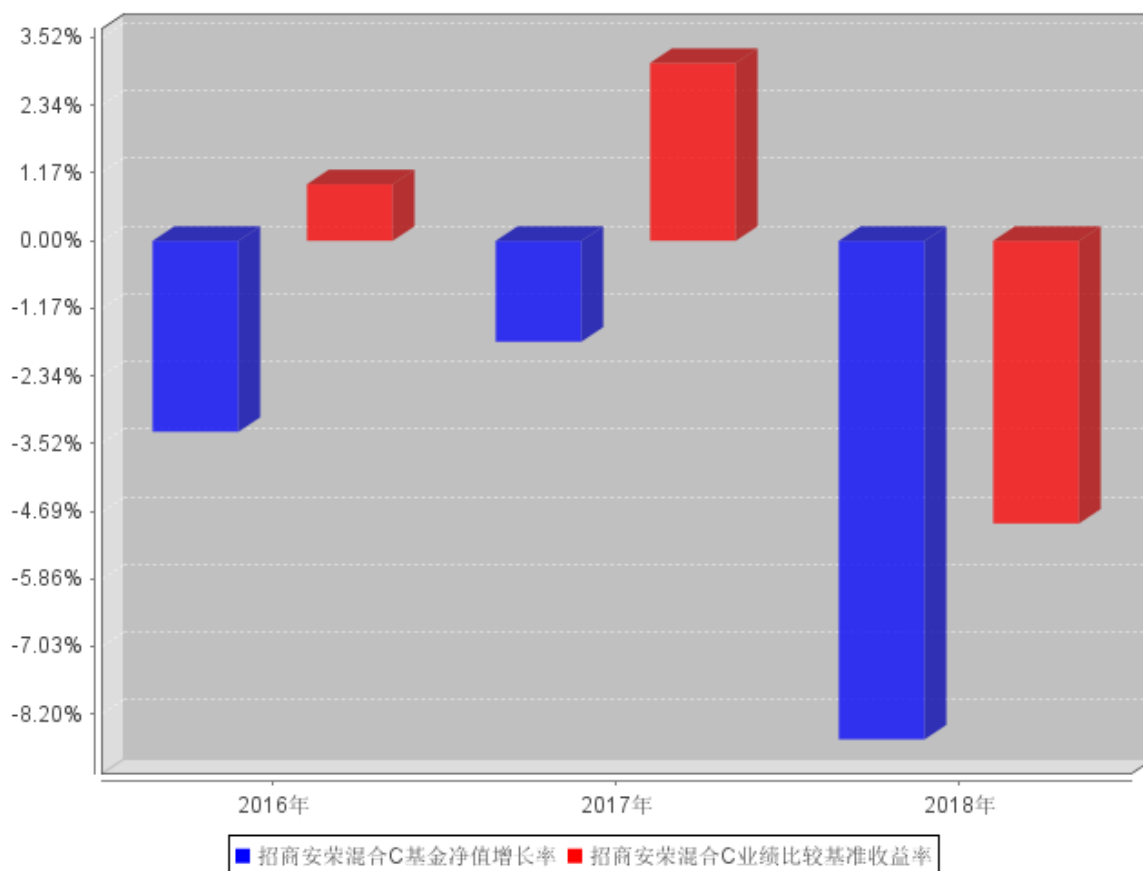
注：本基金转型日期为2018年7月17日，截止报告期末，本基金转型后基金合同生效未满一年；自基金成立日起6个月内为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

### 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

招商安荣混合A自基金合同生效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对比图



## 招商安荣混合C自基金合同生效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对比图



注：本基金转型日期为2018年7月17日，本基金转型后基金合同生效未满1年，故本报告期净值增长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

招商安荣保本混合 A

| 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      | 0.10%    | 0.03%       | 0.09%      | 0.00%         | 0.01% | 0.03% |
| 过去六个月      | 0.67%    | 0.05%       | 0.62%      | 0.01%         | 0.05% | 0.04% |
| 过去一年       | 2.55%    | 0.07%       | 1.66%      | 0.01%         | 0.89% | 0.06% |
| 自基金合同生效起至今 | 4.60%    | 0.06%       | 4.21%      | 0.01%         | 0.39% | 0.05% |

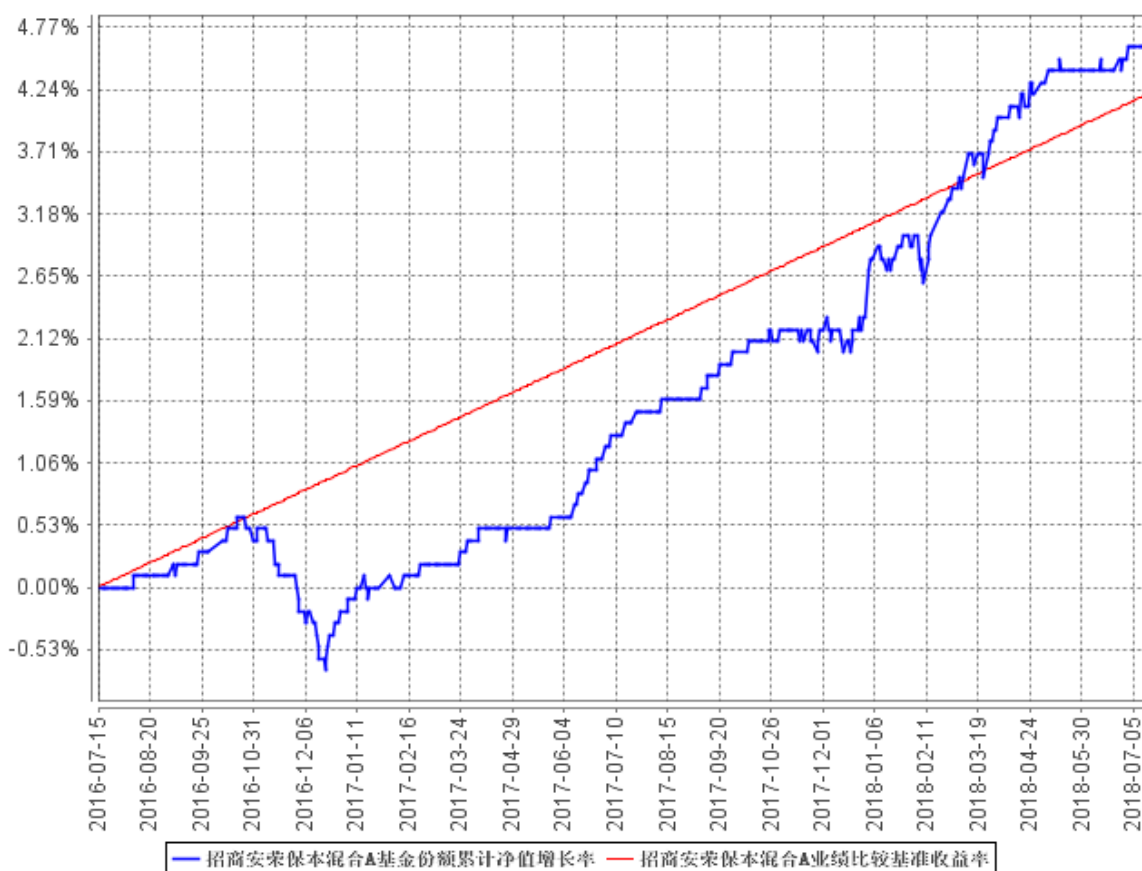
招商安荣保本混合 C

| 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 | ③ ③   | ④ ④   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|-------|-------|
| 过去三个月      | 0.10%    | 0.03%       | 0.09%      | 0.00%         | 0.01% | 0.03% |
| 过去六个月      | 0.67%    | 0.05%       | 0.62%      | 0.01%         | 0.05% | 0.04% |
| 过去一年       | 2.55%    | 0.07%       | 1.66%      | 0.01%         | 0.89% | 0.06% |
| 自基金合同生效起至今 | 4.60%    | 0.06%       | 4.21%      | 0.01%         | 0.39% | 0.05% |

|            |       |       |       |       |        |       |
|------------|-------|-------|-------|-------|--------|-------|
| 过去三个月      | 0.00% | 0.00% | 0.09% | 0.00% | -0.09% | 0.00% |
| 过去六个月      | 0.39% | 0.05% | 0.62% | 0.01% | -0.23% | 0.04% |
| 过去一年       | 1.88% | 0.07% | 1.66% | 0.01% | 0.22%  | 0.06% |
| 自基金合同生效起至今 | 2.80% | 0.06% | 4.21% | 0.01% | -1.41% | 0.05% |

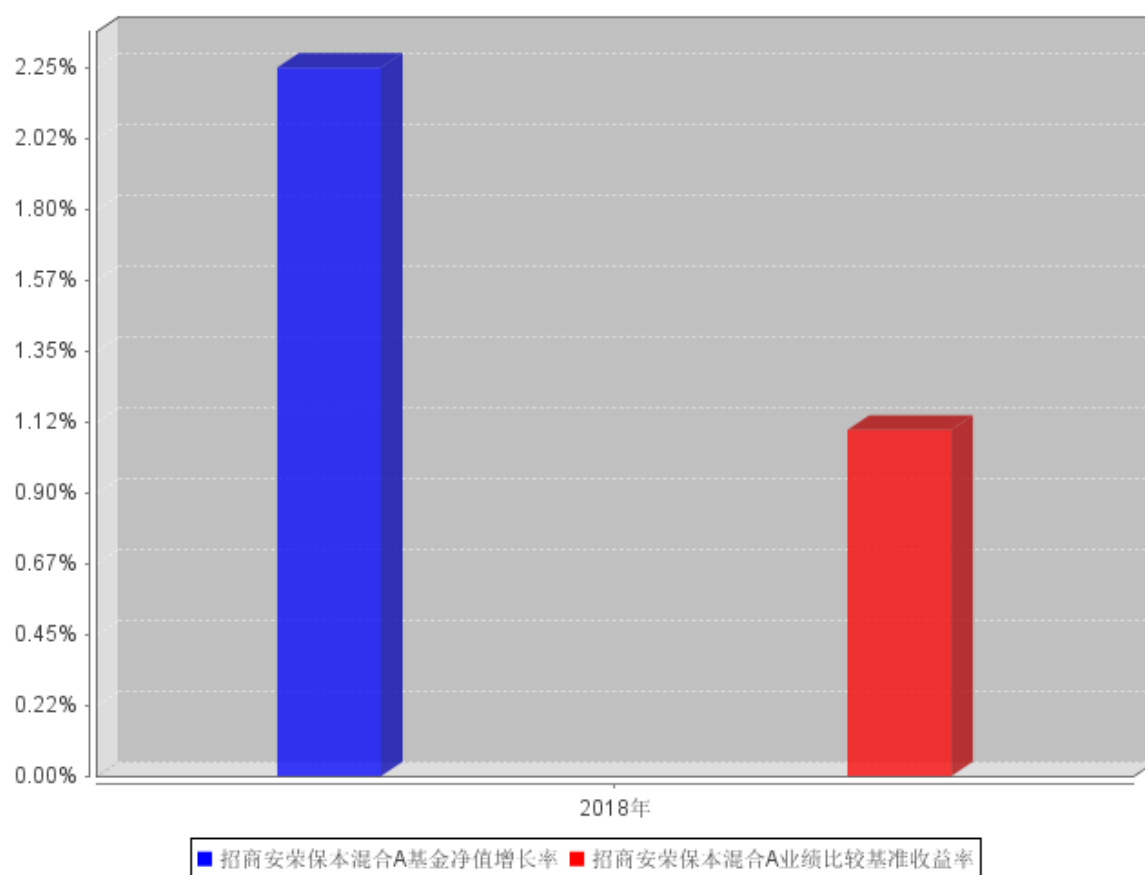
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

招商安荣保本混合A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

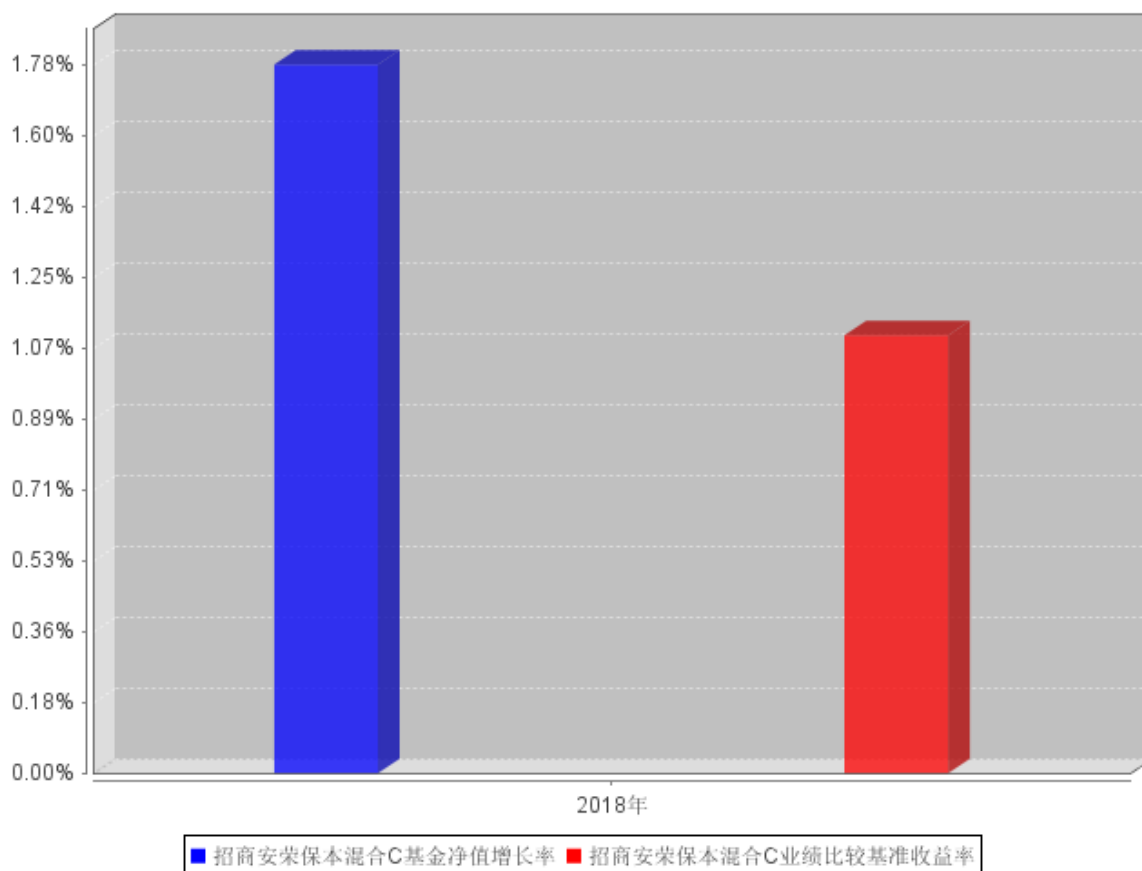


### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

招商安荣保本混合A自基金合同生效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对比图



## 招商安荣保本混合C自基金合同生效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对比图



注：根据《招商安荣保本混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，2018年7月16日为招商安荣保本混合型证券投资基金的第一个保本周期到期日，自2018年7月17日招商安荣保本混合型证券投资基金转型为招商安荣灵活配置混合型证券投资基金，因此上图本报告期间的结束日为2018年7月17日。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

招商安荣保本混合型证券投资基金于2016年7月15日成立，自基金合同生效日以来未进行利润分配；自2018年7月17日招商安荣保本混合型证券投资基金转型为招商安荣灵活配置混合型证券投资基金，自基金转型以来未进行利润分配。



## §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，公司注册资本为人民币 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。

2018 年获奖情况如下：

债券投资能力五星基金公司·海通证券

英华奖公募基金 20 年特别评选·公募基金 20 年最佳回报债券型基金（二级债）（招商安瑞进取债券）《中国基金报》

英华奖公募基金 20 年特别评选·公募基金 20 年最佳回报债券型基金（纯债）（招商安心收益债券）《中国基金报》

英华奖公募基金 20 年特别评选·公募基金 20 年最佳回报债券型基金（纯债）（招商信用添利债券（LOF））《中国基金报》

英华奖公募基金 20 年特别评选·公募基金 20 年“最佳固定收益基金管理人”《中国基金报》

明星基金奖·五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·五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·2017 年度绝对收益明星基金（招商丰融混合）《证券时报》

Morningstar 晨星(中国)2018 年度普通债券型基金奖提名（招商安心收益债券）

金牛奖·五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》

金基金奖·五年期债券基金奖（招商产业债券）《上海证券报》

公募基金 20 周年·“金基金”债券投资回报基金管理公司奖《上海证券报》

公募基金 20 周年·“金基金”行业领军人物奖（金旭）《上海证券报》

致敬基金 20 年·基金行业领军人物奖（金旭）《新浪》

致敬基金 20 年·最受投资者欢迎基金公司奖《新浪》

致敬基金 20 年·区域影响力奖《新浪》

金牛奖·三年期海外金牛私募投资经理（多策略）《中国证券报》

中国金融科技先锋榜·2018 中国 AI 金融先锋榜《证券时报》

中国金融科技先锋榜·2018 年中国智能投顾新锐榜《证券时报》

金帆奖·2018 年度基金管理公司《21 世纪经济报道》

2018 年度教育扶贫先锋企业《国际金融报》  
 金鼎奖·最具潜力基金公司《每日经济新闻》  
 离岸中资基金大奖·最具创意产品·香港中资基金业协会、彭博  
 中国网金融扶贫先锋榜·中国网精准扶贫先锋机构《中国网》  
 金砖奖·最佳资产配置奖《南方都市报》  
 金禧奖·2018 最佳基金投研团队《投资时报》  
 腾讯理财通金企鹅奖·最佳债券基金奖·腾讯、晨星  
 中国金融金领带奖·年度卓越海外投资基金《华尔街见闻》  
 公募基金 20 周年行业特别评选·卓越影响力基金公司《界面·财联社》  
 公募基金 20 周年行业特别评选·最佳互联网金融服务基金公司《界面·财联社》  
 金蝉奖·2018 年度基金管理公司《华夏时报》  
 基情 20 年最受欢迎基金公司·东方财富、天天基金  
 天天基金 6 周年定投榜·东方财富、天天基金  
 2018 年东方风云榜连续三年稳回报基金·东方财富、天天基金

#### 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<br>(助理) 期限   |                        | 证券<br>从业<br>年限 | 说明  |
|----|--------------------------|------------------------|------------------------|----------------|---|
|    |                          | 任职日期                   | 离任日期                   |                |   |
| 侯杰 | 本基金<br>基金经<br>理          | 2018 年<br>10 月 30<br>日 | -                      | 16             | 男，经济学硕士。2002 年 7 月加入北京首创融资担保有限公司，历任首创担保资本运营部职员、部门副经理、主管副总经理（主持工作），曾负责宏观经济研究、公司股票投资、债券投资及基金投资等工作。2017 年 9 月加入招商基金管理有限公司，现任固定收益投资部总监助理兼招商安荣灵活配置混合型证券投资基金、招商安裕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、招商安德保本混合型证券投资基金基金经理。 |
| 马龙 | 本基金<br>基金经<br>理（已<br>离任） | 2016 年 7<br>月 15 日     | 2018 年<br>12 月 21<br>日 | 9              | 男，经济学博士。2009 年 7 月加入泰达宏利基金管理有限公司，任研究员，从事宏观经济、债券市场策略、股票市场策略研究工作，2012 年 11 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，招商招利 1 个月期理财债券型证券投资基金、招商安盈保本混合型证券投资基金、招商可转债分级债券型证券投资基金、招商安益灵活配置混合型证券投资基金、招商安德保本混合型证券投资基金、                   |

|    |              |                 |                 |    |  |
|----|--------------|-----------------|-----------------|----|--|
|    |              |                 |                 |    | 招商安荣灵活配置混合型证券投资基金、招商定期宝六个月期理财债券型证券投资基金、招商招利一年期理财债券型证券投资基金基金经理，现任固定收益投资部副总监兼招商安心收益债券型证券投资基金、招商产业债券型证券投资基金、招商安弘保本混合型证券投资基金、招商睿祥定期开放混合型证券投资基金、招商招丰纯债债券型证券投资基金、招商 3 年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、招商添利两年定期开放债券型证券投资基金、招商稳祯定期开放混合型证券投资基金、招商金鸿债券型证券投资基金基金经理。   |
| 王景 | 本基金基金经理（已离任） | 2016 年 7 月 15 日 | 2018 年 2 月 28 日 | 15 | 女，经济学硕士。曾任职于中国石化乌鲁木齐石油化工总厂物资装备公司及国家环境保护总局对外合作中心；2003 年起，先后于金鹰基金管理有限公司、中信基金管理有限公司及华夏基金管理有限公司工作，任行业研究员；2009 年 8 月起，任东兴证券股份有限公司资产管理部投资经理；2010 年 8 月加入招商基金管理有限公司，曾任招商安瑞进取债券型证券投资基金、招商安本增利债券型证券投资基金、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、招商康泰灵活配置混合型证券投资基金、招商安博保本混合型证券投资基金、招商安荣保本混合型证券投资基金基金经理，现任总经理助理兼投资管理一部总监、招商制造业转型灵活配置混合型证券投资基金、招商境远灵活配置混合型证券投资基金、招商安弘保本混合型证券投资基金、招商丰茂灵活配置混合型发起式证券投资基金、招商中国机遇股票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；

3、报告截止日至批准送出日期间，自 2019 年 02 月 22 日起王刚先生新任本基金的基金经理。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

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。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，在指数型投资组合与主动型投资组合之间发生过五次，原因是指数型投资组合为满足投资策略需要而发生反向交易。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

宏观经济回顾：

报告期内，国内经济面临内外部的压力，增速有所放缓，全年GDP增速6.6%，四个季度GDP增速分别为6.8%，6.7%，6.5%和6.4%，呈现阶梯型下行的态势。分产业看，第一产业增加值64734亿元，同比增长3.5%，增速较上年降低0.4%；第二产业增加值366001亿元，同比增长5.8%，增速较上年降低0.3%；第三产业增加值469575亿元，增长7.6%，增速较上年降低0.4%。投资方面，2018年全国投资增长缓中趋稳，制造业投资和民间投资增速加快。全年全国固定资产投资（不含农户）635636亿元，比上年增长5.9%，增速比前三季度加快0.5%。其中，民间投资394051亿元，增长8.7%，比上年加快2.7%。分产业看，第一产业投资增长12.9%，比上年加快1.1%；第二产业投资增长6.2%，加快3.0%，其中制造业投资增长9.5%，加快4.7%，是2018年为数不多的亮点；第三产业投资增长5.5%，其中基础设施投资增长3.8%。生产方面，2018年全国工业生产平稳增长，新产业增长较快。全年全国规模以上工业增加值同比实际增长6.2%，增速缓中趋稳。分三大门类看，采矿业增加值增长2.3%，制造业增长6.5%，电力、热力、燃气及水生产和供应业增长9.9%。高技术制造业、战略性新兴产业和装备制造业增加值分别比上年增长11.7%、8.9%和8.1%，增速分别比规模以上工业快5.5%、2.7%和1.9%，新的经济动能规模较小，但增速较快。消费方面，全年社会消费品零售总额380987亿元，同比增长9.0%，创下2003年以来的新低，除了整体消费的疲弱，原油价格大幅下降和汽车消费显著下滑也是拖累消费同比增速的重要因素。

2018年社会融资规模增量累计19.26万亿元，比上年少增3.14万亿元。社融增速从年初开始持续萎缩，增速持续创下新低，一方面受到融资需求不振的影响，另一方面也与监管政策对融资渠道的限制有关。从结构来看，2018年对实体经济发放的人民币贷款增加15.67万亿元，同比多增1.83万亿元；委托贷款、信托贷款和未贴现的银行承兑汇票等非标融资近年来首次净减少，其中委托贷款较上年减少1.61万亿元，同比多减2.38万亿元；信托贷款减少6901亿元，同比多减2.95万亿元；未贴现的银行承兑汇票减少6343亿元，同比多减1.17万亿元；债券融资方面，得益于二季度以来债券市场整体利率下行和市场风险偏好的回升，债券融资较上年有大幅增长，全年企业债券净融资2.48万亿元，同比多增2.03万亿元。“宽信用”是2018年四季度以来的政策的着力点，其重要观测指标即社融增速，目前从财政政策到货币政策都在为“宽信用”服务，但效果有限，社融增速何时触底将值得关注。

债券市场回顾：

2018 年债券市场行情整体呈现牛市行情。1 月上旬由于监管政策频发、海外利率快速上行，导致债券收益率冲高，创本轮收益率高点。但随后由于央行积极操作，通过临时降准等操作使得资金面维持整体宽松局面，收益率出现了一定幅度的下行。3 月由于资金超预期宽松，叠加中美贸易摩擦引发风险偏好下降，触发了一轮收益率下行。4 月份央行降准，市场收益率出现快速下行，但是此后资金面超预期收紧，导致债市出现明显回调。进入 6 月份之后，由于信用收缩格局日益明显、信用风险集中爆发引发风险偏好下降，债市行情出现显著分化，利率债收益率明显下行，信用利差尤其是中低等级信用利差显著走阔。8 月份-9 月份中下旬，由于政策转向宽信用，叠加滞胀预期扰动，债市再度出现回调，此后由于基本面下行迹象愈加显著、宽信用乐观预期出现预期差以及股市下跌引发风险偏好显著回落，导致债券收益率再次下行，在海外市场出现波动和 10 月社融不及预期的影响下，四季度债券收益率加速下行。

#### 股票市场回顾：

2018 年股票市场震荡下行，主要受中美贸易摩擦、经济下行预期、金融去杠杆等因素叠加影响，各行业板块估值持续回落。当前来看，部分负面因素影响减弱，但经济下行压力仍在，压制指数表现的中期隐忧仍需观察，同时当前市场整体估值已处于历史低位，展现一定程度的安全边际。

#### 基金操作回顾：

回顾 2018 年的基金操作，我们严格遵照基金合同的相关约定，按照既定的投资流程进行了规范运作。在具体投资上，根据市场行情的节奏变化及时进行了合理的组合调整。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

转型前，本基金 A 类份额净值增长率为 2.55%，同期业绩基准增长率为 0.07%，C 类份额净值增长率为 1.88%，同期业绩基准增长率为 0.07%。转型后，本基金 A 类份额净值增长率-8.41%，同期业绩基准增长率为-4.90%，C 类份额净值增长率为-8.64%，同期业绩基准增长率为-4.90%

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2019 年，我们预计未来经济增长仍有进一步下行压力。主要有以下两个逻辑：首先，地产部门未来趋于回落。今年以来地产开发商为回笼资金加快开工对经济形成支撑，但是当前地产销量增速回落迹象日趋明显，棚改货币化政策调整、PSL 投放量明显回落意味着三四线城市失去了房地产销售的重要支撑，2019 年地产部门的回落尤其是施工端的回落将对经济形成下行压力。其次，出口增速可能回落。除了中美贸易摩擦这一不确定性之外，海外主要经济体逐渐步入经济下行周期，需求增速面临放缓，对中国外需这是不利因素。通胀方面，我们认为通胀压力可控。由于通胀从根本上由总需求所决定，经济回落过程中，通胀压力总体可控，主要是对市场预期形成阶段性扰动。

政策面方面，在宽信用取得明显成效之前，当前的政策立场不会发生根本变化。货币政策将维持中性偏宽松的立场，为宽信用创造相对有利的货币环境，但资金利率大幅下行概率也不大，预计将维持流动性的相对宽松。

从市场本身来看，我们认为债券收益率仍有进一步下行空间，预计未来伴随着基本面压力的进一步加大，银行体系资产可得性下降，期限利差仍有压缩空间。

展望 2019 年，预期市场仍需时间对负面因素消化整理，股票市场未来震荡筑底概率加大。

#### 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，包括不定期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，咨询会计师事务所的专业意见，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，本基金报告期末未进行利润分配。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

本报告期内，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，依法安全保管了基金财产，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 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，按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

本报告期内，本基金未进行利润分配。

### 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

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

## §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   | 招商安荣灵活配置混合型证券投资基金全体持有人  |
| 审计意见      | <p>我们审计了招商安荣灵活配置混合型证券投资基金的财务报表，包括 2018 年 12 月 31 日的资产负债表，2018 年 7 月 17 日(基金合同生效日)至 2018 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，公允反映了招商安荣灵活配置混合型证券投资基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况、2018 年 7 月 17 日(基金合同生效日)至 2018 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，我们独立于招商安荣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</p>  |

|                      |  |
|----------------------|--|
|                      | 的，为发表审计意见提供了基础。  |
| 强调事项                 | -  |
| 其他事项                 | -  |
| 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荣灵活配置混合型证券投资基金 2018 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>   |
| 基金管理人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荣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荣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荣灵活配置混合型证券投资基金的财务报告过程。</p>  |
| 注册会计师的责任             | <p>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。</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>(1) 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>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程</p> |

|           |  |
|-----------|--|
|           | <p>序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 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>(4) 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，就可能导致对招商安荣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荣灵活配置混合型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 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)   |
| 会计师事务所的地址 | 中国上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼   |
| 审计报告日期    | 2019 年 3 月 25 日  |
| 注册会计师的姓名  | 汪芳 吴凌志   |

## §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   | 招商安荣灵活配置混合型证券投资基金全体持有人  |
| 审计意见      | <p>我们审计了招商安荣保本混合型证券投资基金的财务报表，包括 2018 年 7 月 16 日(基金合同失效前日)的资产负债表，2018 年 1 月 1 日至 2018 年 7 月 16 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关规定编制，公允反映了招商安荣保本混合型证券投资基金 2018 年 7 月 16 日(基金合同失效前日)的财务状况、2018 年 1 月 1 日至 2018 年 7 月 16 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。</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，我们独立于招商安荣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，</p>  |

|                      |   |
|----------------------|---|
|                      | 为发表审计意见提供了基础。   |
| 强调事项                 | -   |
| 其他事项                 | -   |
| 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荣保本混合型证券投资基金 2018 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。</p>   |
| 基金管理人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荣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荣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。</p> <p>基金管理人治理层负责监督招商安荣保本混合型证券投资基金的财务报告过程。</p>   |
| 注册会计师的责任             | <p>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。</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>(1) 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>(2) 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>(3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和做</p> |

|           |   |     |
|-----------|---|-----|
|           | <p>出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 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，就可能导致对招商安荣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荣保本混合型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 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。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)  |     |
| 会计师事务所的地址 | 中国上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼  |     |
| 审计报告日期    | 2019 年 3 月 25 日   |     |
| 注册会计师的姓名  | 汪芳  | 吴凌志 |

## §7 年度财务报表（转型后）

## 7.1 资产负债表（转型后）

会计主体：招商安荣灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2018年12月31日

单位：人民币元

| 资产              | 附注号        | 本期末<br>2018年12月31日         |
|-----------------|------------|----------------------------|
| <b>资产：</b>      |            |                            |
| 银行存款            | 7.4.7.1    | 19,629,883.91              |
| 结算备付金           |            | 53,083.64                  |
| 存出保证金           |            | 71,129.76                  |
| 交易性金融资产         | 7.4.7.2    | 80,446,876.99              |
| 其中：股票投资         |            | 39,614,877.50              |
| 基金投资            |            | -                          |
| 债券投资            |            | 40,831,999.49              |
| 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    | 12,000,000.00              |
| 应收证券清算款         |            | -                          |
| 应收利息            | 7.4.7.5    | 1,195,029.53               |
| 应收股利            |            | -                          |
| 应收申购款           |            | 80,295.57                  |
| 递延所得税资产         |            | -                          |
| 其他资产            | 7.4.7.6    | -                          |
| 资产总计            |            | 113,476,299.40             |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2018年12月31日</b> |
| <b>负债：</b>      |            |                            |
| 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       |            | -                          |
| 应付证券清算款         |            | 12,000,000.00              |
| 应付赎回款           |            | 42,172.96                  |
| 应付管理人报酬         |            | 130,902.34                 |
| 应付托管费           |            | 21,817.04                  |
| 应付销售服务费         |            | 4,713.31                   |
| 应付交易费用          | 7.4.7.7    | 31,914.43                  |
| 应交税费            |            | 1.64                       |
| 应付利息            |            | -                          |

|               |          |                |
|---------------|----------|----------------|
| 应付利润          |          | -              |
| 递延所得税负债       |          | -              |
| 其他负债          | 7.4.7.8  | 370,025.07     |
| 负债合计          |          | 12,601,546.79  |
| <b>所有者权益:</b> |          |                |
| 实收基金          | 7.4.7.9  | 105,440,988.50 |
| 未分配利润         | 7.4.7.10 | -4,566,235.89  |
| 所有者权益合计       |          | 100,874,752.61 |
| 负债和所有者权益总计    |          | 113,476,299.40 |

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，招商安荣混合 A 份额净值 0.9580 元，基金 A 份额总额 98,122,515.55 份；招商安荣混合 C 份额净值 0.9392 元，基金 C 份额总额 7,318,472.95 份；总份额合计 105,440,988.50 份。

## 7.2 利润表

会计主体：招商安荣灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 7 月 17 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目                    | 附注号        | 本期  |
|------------------------|------------|---|
|                        |            | 2018 年 7 月 17 日(基金合同生效日)至<br>2018 年 12 月 31 日 |
| <b>一、收入</b>            |            | -10,930,895.08                                |
| 1. 利息收入                |            | 749,131.63                                    |
| 其中：存款利息收入              | 7.4.7.11   | 186,453.96                                    |
| 债券利息收入                 |            | 524,187.26                                    |
| 资产支持证券利息收入             |            | -   |
| 买入返售金融资产收入             |            | 38,490.41                                     |
| 其他利息收入                 |            | -   |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      |            | -1,688,898.53                                 |
| 其中：股票投资收益              | 7.4.7.12   | -1,762,392.77                                 |
| 基金投资收益                 |            | -   |
| 债券投资收益                 | 7.4.7.13   | -245,050.12                                   |
| 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   | 318,544.36                                    |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.18   | -9,998,400.39                                 |
| 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   | 7,272.21                                      |
| <b>减：二、费用</b>          |            | 1,488,013.47                                  |
| 1. 管理人报酬               | 7.4.10.2.1 | 908,368.03                                    |

|                            |            |                |
|----------------------------|------------|----------------|
| 2. 托管费                     | 7.4.10.2.2 | 151,394.67     |
| 3. 销售服务费                   | 7.4.10.2.3 | 29,013.35      |
| 4. 交易费用                    | 7.4.7.20   | 213,960.99     |
| 5. 利息支出                    |            | -              |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | -              |
| 6. 税金及附加                   |            | 413.05         |
| 7. 其他费用                    | 7.4.7.21   | 184,863.38     |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | -12,418,908.55 |
| 减：所得税费用                    |            | -              |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | -12,418,908.55 |

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：招商安荣灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018年7月17日(基金合同生效日)至2018年12月31日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2018年7月17日(基金合同生效日)至2018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）                        | 1,178,643,194.49                      | 53,206,952.77  | 1,231,850,147.26  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                     | -12,418,908.55 | -12,418,908.55    |
| 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）      | -1,073,202,205.99                     | -45,354,280.11 | -1,118,556,486.10 |
| 其中：1. 基金申购款                            | 1,137,287.08                          | -19,040.69     | 1,118,246.39      |
| 2. 基金赎回款（以“-”号填列）                      | -1,074,339,493.07                     | -45,335,239.42 | -1,119,674,732.49 |
| 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）                        | 105,440,988.50                        | -4,566,235.89  | 100,874,752.61    |

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

招商安荣灵活配置混合型证券投资基金(原名招商安荣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》、《招商安荣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[2016]795号文准予公开募集注册。本基金为契约型开放式基金,存续期限为不定期。本基金根据认购费、申购费、赎回费、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为A类基金份额和C类基金份额。本基金首次设立募集基金份额为1,983,041,091.58份,经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了编号为德师报(验)字(16)第0423号验资报告。基金合同于2016年7月15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,基金托管人为中国民生银行股份有限公司(以下简称“中国民生”)。

本基金第一个保本周期自2016年7月15日起至2018年7月16日止,根据本基金管理人于2018年6月27日发布的《招商安荣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荣灵活配置混合型证券投资基金相关业务规则公告》,在本基金保本周期到期日的次日,即2018年7月17日起“招商安荣保本混合型证券投资基金”将更名为“招商安荣灵活配置混合型证券投资基金”,原基金合同自该日起失效,《招商安荣灵活配置混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)及托管协议于该日同时生效。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及截至报告期末最新公告的《招商安荣灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》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股票(包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会允许基金投资的股票)、债券(含国债、金融债、企业(公司)债、次级债、中小企业私募债、可转换债券(含分离交易可转债)、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产以及现金、权证、国债期货、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的投资组合比例为:投资于股票的比例为基金资产的0%-95%,投资于权证的比例为基金资产净值的0%-3%,本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为沪深300指数收益率 $\times$ 50%+中债综合指数收益率 $\times$ 50%。

### 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 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年 7 月 17 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日止期间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。本财务报表的实际编制期间为 2018 年 7 月 17 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日止期间。

#### 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。

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

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

3) 对存在活跃市场的其他投资品种，如估值日无市价且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

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

程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 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、基金托管费和销售服务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

- 1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为12次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的10%，若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配；
- 2) 基金收益分配方式分两种：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；
- 3) 基金收益分配后各类基金份额的基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额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；
- 4) 基金两类基金份额在费用收取上不同，其对应的可供分配利润可能有所不同；本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；
- 5) 法律法规或监管机关另有规定的，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

本基金本报告期内无需要说明的重大会计估计变更。

### 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[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<br>2018 年 12 月 31 日 |
|----------------|-------------------------|
| 活期存款           | 19,629,883.91           |
| 定期存款           | -                       |
| 其中：存款期限 1-3 个月 | -                       |
| 其他存款           | -                       |
| 合计：            | 19,629,883.91           |

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2018 年 12 月 31 日 |               |                |
|---------------|-------------------------|---------------|----------------|
|               | 成本                      | 公允价值          | 估值增值           |
| 股票            | 50,720,488.71           | 39,614,877.50 | -11,105,611.21 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                       | -             | -              |
| 债券            | 交易所市场                   | 38,999.49     | 38,999.49      |
|               | 银行间市场                   | 40,732,910.00 | 40,793,000.00  |
|               | 合计                      | 40,771,909.49 | 40,831,999.49  |
| 资产支持证券        | -                       | -             | -              |
| 基金            | -                       | -             | -              |
| 其他            | -                       | -             | -              |
| 合计            | 91,492,398.20           | 80,446,876.99 | -11,045,521.21 |

### 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

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2018年12月31日 |           |
|-------|--------------------|-----------|
|       | 账面余额               | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 12,000,000.00      | -         |
| 银行间市场 | -                  | -         |
| 合计    | 12,000,000.00      | -         |

##### 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<br>2018年12月31日 |
|------------|--------------------|
| 应收活期存款利息   | 3,752.17           |
| 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  | 23.80              |
| 应收债券利息     | 1,191,221.56       |
| 应收资产支持证券利息 | -                  |
| 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         | 32.00              |
| 合计         | 1,195,029.53       |

#### 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<br>2018年12月31日 |
|-------------|--------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 30,639.43          |
| 银行间市场应付交易费用 | 1,275.00           |
| 合计          | 31,914.43          |

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2018年12月31日 |
|----|--------------------|
|----|--------------------|



|             |            |
|-------------|------------|
| 应付券商交易单元保证金 |            |
| 应付赎回费       | 25.07      |
| 预提费用        | 370,000.00 |
| 合计          | 370,025.07 |

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 招商安荣混合 A      |  |                   |
|---------------|--|-------------------|
| 项目            | 本期<br>2018 年 7 月 17 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日 |                   |
|               | 基金份额(份)  | 账面金额              |
| 基金合同生效日       | 1,129,017,584.39                                 | 1,129,017,584.39  |
| 本期申购          | 151,218.58                                       | 151,218.58        |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -1,031,046,287.42                                | -1,031,046,287.42 |
| 本期末           | 98,122,515.55                                    | 98,122,515.55     |

金额单位：人民币元

| 招商安荣混合 C      |  |                |
|---------------|--|----------------|
| 项目            | 本期<br>2018 年 7 月 17 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日 |                |
|               | 基金份额(份)  | 账面金额           |
| 基金合同生效日       | 49,625,610.10                                    | 49,625,610.10  |
| 本期申购          | 986,068.50                                       | 986,068.50     |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -43,293,205.65                                   | -43,293,205.65 |
| 本期末           | 7,318,472.95                                     | 7,318,472.95   |

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

| 招商安荣混合 A       |                |               |                |
|----------------|----------------|---------------|----------------|
| 项目             | 已实现部分          | 未实现部分         | 未分配利润合计        |
| 基金合同生效日        | 50,313,219.14  | 1,487,043.50  | 51,800,262.64  |
| 本期利润           | -2,249,173.32  | -9,410,623.07 | -11,659,796.39 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -45,563,159.95 | 1,301,769.20  | -44,261,390.75 |
| 其中：基金申购款       | 4,539.91       | -7,676.57     | -3,136.66      |
| 基金赎回款          | -45,567,699.86 | 1,309,445.77  | -44,258,254.09 |
| 本期已分配利润        | -              | -             | -              |
| 本期末            | 2,500,885.87   | -6,621,810.37 | -4,120,924.50  |

金额单位：人民币元

| 招商安荣混合 C |              |           |              |
|----------|--------------|-----------|--------------|
| 项目       | 已实现部分        | 未实现部分     | 未分配利润合计      |
| 基金合同生效日  | 1,344,523.46 | 62,166.67 | 1,406,690.13 |

|                |               |             |               |
|----------------|---------------|-------------|---------------|
| 本期利润           | -171,334.84   | -587,777.32 | -759,112.16   |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -1,132,784.73 | 39,895.37   | -1,092,889.36 |
| 其中：基金申购款       | 16,307.61     | -32,211.64  | -15,904.03    |
| 基金赎回款          | -1,149,092.34 | 72,107.01   | -1,076,985.33 |
| 本期已分配利润        | -             | -           | -             |
| 本期末            | 40,403.89     | -485,715.28 | -445,311.39   |

#### 7.4.7.11 存款利息收入

| 项目        | 本期 2018 年 7 月 17 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日 |
|-----------|---|
| 活期存款利息收入  | 179,558.32                                    |
| 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 | 6,291.84                                      |
| 其他        | 603.80  |
| 合计        | 186,453.96                                    |

#### 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 2018 年 7 月 17 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日 |
|------------|---|
| 卖出股票成交总额   | 52,155,756.29                                 |
| 减：卖出股票成本总额 | 53,918,149.06                                 |
| 买卖股票差价收入   | -1,762,392.77                                 |

#### 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<br>2018年7月17日至2018年12月31日 |
|------------------------|------------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 390,940,851.32               |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 379,304,151.11               |
| 减：应收利息总额               | 11,881,750.33                |
| 买卖债券差价收入               | -245,050.12                  |

#### 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 2018 年 7 月 17 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日 |
|-------------|---|
| 股票投资产生的股利收益 | 318,544.36                                    |

|             |            |
|-------------|------------|
| 基金投资产生的股利收益 | -          |
| 合计          | 318,544.36 |

**7.4.7.18 公允价值变动收益**

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期 2018 年 7 月 17 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日 |
|------------------------|---|
| 1. 交易性金融资产             | -9,998,400.39                                 |
| ——股票投资                 | -11,105,611.21                                |
| ——债券投资                 | 1,107,210.82                                  |
| ——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                  | -   |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | -   |
| 合计                     | -9,998,400.39                                 |

**7.4.7.19 其他收入**

单位：人民币元

| 项目      | 本期 2018 年 7 月 17 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日 |
|---------|---|
| 基金赎回费收入 | 7,257.41                                      |
| 转换费收入   | 14.80   |
| 合计      | 7,272.21                                      |

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 2018 年 7 月 17 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日 |
|-----------|---|
| 交易所市场交易费用 | 212,110.99                                    |
| 银行间市场交易费用 | 1,850.00                                      |
| 合计        | 213,960.99                                    |

**7.4.7.21 其他费用**

单位：人民币元

| 项目    | 本期 2018 年 7 月 17 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日 |
|-------|---|
| 审计费用  | 32,219.34                                     |
| 信息披露费 | 138,083.73                                    |

|      |            |
|------|------------|
| 电汇费  | 5,260.31   |
| 其他费用 | 9,300.00   |
| 合计   | 184,863.38 |

#### 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，本基金无需要在财务报表附注中说明的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，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       |
| 中国民生银行                   | 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(以下简称“招商财富”) | 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   |
|-----------------|--|
|                 | 2018 年 7 月 17 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 908,368.03                                 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 174,146.64                                 |

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：

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

### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期   |
|----------------|--|
|                | 2018 年 7 月 17 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 151,394.67                                 |

注：支付基金托管人中国民生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：

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

### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期   |           |           |
|----------------|--|-----------|-----------|
|                | 2018 年 7 月 17 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日 |           |           |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                           |           |           |
|                | 招商安荣混合 A                                   | 招商安荣混合 C  | 合计        |
| 招商基金管理有限公司     | -  | 133.93    | 133.93    |
| 招商银行           | -  | 15,456.17 | 15,456.17 |
| 招商证券           | -  | -         | -         |
| 民生银行           | -  | 2,583.78  | 2,583.78  |
| 合计             | -  | 18,173.88 | 18,173.88 |

注：根据基金合同的规定，招商安荣混合 A 不收取销售服务费，招商安荣混合 C 的销售服务费按 C 类基金份额前一日基金资产净值×0.80%的年费率来计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{招商安荣混合 C 的日销售服务费} = \text{前一日招商安荣混合 C 资产净值} \times 0.80\% \div \text{当年天数}。$$

**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固有资金投资本基金的情况**

本报告期内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<br>2018年7月17日(基金合同生效日)至2018年12月31日 |            |
|--------|---------------------------------------|------------|
|        | 期末余额                                  | 当期利息收入     |
| 中国民生银行 | 19,629,883.91                         | 179,558.32 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国民生银行保管，按约定利率计息。

**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（2018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**

金额单位：人民币元

| 7.4.12.1.1 受限证券类别：债券 |      |            |            |        |        |        |              |           |           |    |
|----------------------|------|------------|------------|--------|--------|--------|--------------|-----------|-----------|----|
| 证券代码                 | 证券名称 | 成功认购日      | 可流通日       | 流通受限类型 | 认购价格   | 期末估值单价 | 数量<br>(单位：张) | 期末成本总额    | 期末估值总额    | 备注 |
| 110049               | 海尔转债 | 2018-12-20 | 2019-01-18 | 新债未上市  | 100.00 | 100.00 | 390          | 38,999.49 | 38,999.49 | -  |

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。

**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 | 期末估值单价 | 复牌日期 | 复牌开盘单价 | 数量<br>(股) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
|------|------|------|------|--------|------|--------|-----------|--------|--------|----|
|------|------|------|------|--------|------|--------|-----------|--------|--------|----|

|        |          |                     |      |       |                    |       |         |              |              |  |
|--------|----------|---------------------|------|-------|--------------------|-------|---------|--------------|--------------|--|
| 600030 | 中信证<br>券 | 2018 年 12<br>月 25 日 | 重大事项 | 16.01 | 2019 年 1<br>月 10 日 | 17.15 | 304,974 | 5,263,372.59 | 4,882,633.74 |  |
|--------|----------|---------------------|------|-------|--------------------|-------|---------|--------------|--------------|--|

### 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股票投资、债券投资等。与这些金融工具有关的风险，以及本基金的基金管理人管理这些风险所采取的风险管理政策如下所述。

#### 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、存出保证金及其他。

本基金的银行存款存放于本基金的基金托管人中国民生银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在证券交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并采用券款对付交割方式，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 7.4.13.2.6 列示了于本报告期末本基金所持有的债券投资的信用评级，该信用评级不包括本基金所持有的国债、央行票据、政策性金融债。

#### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的债券投资。

#### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

#### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

| 长期信用评级 | 本期末 2018 年 12 月 31 日 |
|--------|----------------------|
| AAA    | 38,999.49            |
| AAA 以下 | -                    |
| 未评级    | -                    |
| 合计     | 38,999.49            |

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。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

### 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的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人在基金合同约定巨额赎回条款，设计了非常情况下赎回资金的处理模式，控制因开放模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。日常流动性风险管理中，本基金的基金管理人每日监控和预测本基金的流动性指标，通过对



投资品种的流动性指标来持续地评估、选择、跟踪和控制基金投资的流动性风险。同时，本基金通过预留一定的现金头寸，并且在需要时可通过卖出回购金融资产方式融入短期资金，以缓解流动性风险。

#### 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、债券投资及买入返售金融资产；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<br>2018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               | 19,629,883.91 | -     | -             | -             | -         | -             | 19,629,883.91  |
| 结算备付金              | 53,083.64     | -     | -             | -             | -         | -             | 53,083.64      |
| 存出保证金              | 71,129.76     | -     | -             | -             | -         | -             | 71,129.76      |
| 交易性金融资产            | -             | -     | 10,032,000.00 | 30,761,000.00 | 38,999.49 | 39,614,877.50 | 80,446,876.99  |
| 买入返售金融资产           | 12,000,000.00 | -     | -             | -             | -         | -             | 12,000,000.00  |
| 应收利息               | -             | -     | -             | -             | -         | 1,195,029.53  | 1,195,029.53   |
| 应收申购款              | -             | -     | -             | -             | -         | 80,295.57     | 80,295.57      |
| 资产总计               | 31,754,097.31 | -     | 10,032,000.00 | 30,761,000.00 | 38,999.49 | 40,890,202.60 | 113,476,299.40 |
| 负债                 |               |       |               |               |           |               |                |
| 应付证券清算款            | -             | -     | -             | -             | -         | 12,000,000.00 | 12,000,000.00  |
| 应付赎回款              | -             | -     | -             | -             | -         | 42,172.96     | 42,172.96      |
| 应付管理人报酬            | -             | -     | -             | -             | -         | 130,902.34    | 130,902.34     |
| 应付托管费              | -             | -     | -             | -             | -         | 21,817.04     | 21,817.04      |
| 应付销售服务费            | -             | -     | -             | -             | -         | 4,713.31      | 4,713.31       |
| 应付交易费用             | -             | -     | -             | -             | -         | 31,914.43     | 31,914.43      |
| 应交税费               | -             | -     | -             | -             | -         | 1.64          | 1.64           |
| 其他负债               | -             | -     | -             | -             | -         | 370,025.07    | 370,025.07     |
| 负债总计               | -             | -     | -             | -             | -         | 12,601,546.79 | 12,601,546.79  |
| 利率敏感度缺口            | 31,754,097.31 | -     | 10,032,000.00 | 30,761,000.00 | 38,999.49 | 28,288,655.81 | 100,874,752.61 |

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<br>影响金额（单位：人民币元） |
|    |                        | 本期末（2018 年 12 月 31 日）           |
|    |                        | 1. 市场利率平行上升 50 个基点              |
|    | 2. 市场利率平行下降 50 个基点     | 343,451.27                      |

#### 7.4.13.4.2 其他价格风险

其他价格风险是指以交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险，该风险可能与特定投资品种相关，也有可能与整体投资品种相关。本基金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<br>2018 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  | 39,614,877.50           | 39.27        |
| 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            | 39,614,877.50           | 39.27        |

##### 7.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

|    |                             |                                 |
|----|-----------------------------|---------------------------------|
| 假设 | 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% |                                 |
|    | 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<br>影响金额（单位：人民币元） |
|    |                             | 本期末（2018 年 12 月 31 日）           |
|    |                             | 1. 权益性投资的市场价格上升 5%              |
|    | 2. 权益性投资的市场价格下降 5%          | -1,980,743.88                   |

**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。

| 资产      | 本期末(2018 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    | 34,732,243.76         | 4,882,633.74  | -         | 39,614,877.50 |
| 债券投资    | -                     | 40,793,000.00 | 38,999.49 | 40,831,999.49 |
| 合计      | 34,732,243.76         | 45,675,633.74 | 38,999.49 | 80,446,876.99 |

## (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于本基金投资的证券，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，确定相关证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：招商安荣保本混合型证券投资基金

报告截止日：2018年7月16日

单位：人民币元

| 资产              | 附注号        | 本期末<br>2018年7月16日         | 上年度末<br>2017年12月31日         |
|-----------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| <b>资产：</b>      |            |                           |                             |
| 银行存款            | 7.4.7.1    | 555,521,298.64            | 14,633,579.82               |
| 结算备付金           |            | 3,209,310.93              | 1,571,327.37                |
| 存出保证金           |            | 76,687.49                 | 19,772.14                   |
| 交易性金融资产         | 7.4.7.2    | 328,467,000.00            | 1,449,578,701.60            |
| 其中：股票投资         |            | -                         | 68,575,933.60               |
| 基金投资            |            | -                         | -                           |
| 债券投资            |            | 328,467,000.00            | 1,381,002,768.00            |
| 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         |            | 350,286,424.64            | -                           |
| 应收利息            | 7.4.7.5    | 11,192,361.57             | 33,434,404.35               |
| 应收股利            |            | -                         | -                           |
| 应收申购款           |            | -                         | 1,541,000.00                |
| 递延所得税资产         |            | -                         | -                           |
| 其他资产            | 7.4.7.6    | -                         | -                           |
| 资产总计            |            | 1,248,753,083.27          | 1,500,778,785.28            |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2018年7月16日</b> | <b>上年度末<br/>2017年12月31日</b> |
| <b>负债：</b>      |            |                           |                             |
| 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       |            | -                         | 67,000,000.00               |
| 应付证券清算款         |            | -                         | 3,973,159.39                |
| 应付赎回款           |            | 15,784,718.70             | 6,327,731.75                |
| 应付管理人报酬         |            | 660,835.86                | 1,473,887.34                |
| 应付托管费           |            | 110,139.29                | 245,647.91                  |
| 应付销售服务费         |            | 19,158.47                 | 64,481.15                   |
| 应付交易费用          | 7.4.7.7    | 15,558.25                 | 90,914.51                   |
| 应交税费            |            | 892.23                    | -                           |
| 应付利息            |            | -                         | 77,306.76                   |

|               |          |                  |                  |
|---------------|----------|------------------|------------------|
| 应付利润          |          | -                | -                |
| 递延所得税负债       |          | -                | -                |
| 其他负债          | 7.4.7.8  | 311,633.21       | 176,040.31       |
| 负债合计          |          | 16,902,936.01    | 79,429,169.12    |
| <b>所有者权益:</b> |          |                  |                  |
| 实收基金          | 7.4.7.9  | 1,178,643,194.49 | 1,390,224,398.24 |
| 未分配利润         | 7.4.7.10 | 53,206,952.77    | 31,125,217.92    |
| 所有者权益合计       |          | 1,231,850,147.26 | 1,421,349,616.16 |
| 负债和所有者权益总计    |          | 1,248,753,083.27 | 1,500,778,785.28 |

注：报告截止日 2018 年 7 月 16 日，招商安荣保本混合 A 份额净值 1.046 元，基金 A 份额总额 1,129,017,584.39 份；招商安荣保本混合 C 份额净值 1.028 元，基金 C 份额总额 49,625,610.10 份；总份额合计 1,178,643,194.49 份。

## 7.2 利润表

会计主体：招商安荣保本混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 7 月 16 日

单位：人民币元

| 项目                     | 附注号      | 本期<br>2018 年 1 月 1 日至<br>2018 年 7 月 16 日 | 上年度可比期间<br>2017 年 1 月 1 日至<br>2017 年 12 月 31 日 |
|------------------------|----------|--|--|
| <b>一、收入</b>            |          | 40,583,841.76                            | 71,240,541.34                                  |
| 1. 利息收入                |          | 28,394,208.14                            | 72,314,522.12                                  |
| 其中：存款利息收入              | 7.4.7.11 | 353,209.35                               | 5,518,953.74                                   |
| 债券利息收入                 |          | 25,614,598.27                            | 61,503,458.54                                  |
| 资产支持证券利息收入             |          | -  | -  |
| 买入返售金融资产收入             |          | 2,426,400.52                             | 5,292,109.84                                   |
| 其他利息收入                 |          | -  | -  |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      |          | -1,593,058.12                            | 3,543,631.44                                   |
| 其中：股票投资收益              | 7.4.7.12 | 4,524,994.26                             | 568,118.59                                     |
| 基金投资收益                 |          | -  | -  |
| 债券投资收益                 | 7.4.7.13 | -6,368,810.82                            | 2,975,512.85                                   |
| 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 | 250,758.44                               | -  |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.18 | 12,856,026.54                            | -6,369,692.93                                  |
| 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 | 926,665.20                               | 1,752,080.71                                   |

|                            |            |               |               |
|----------------------------|------------|---------------|---------------|
| 填列)                        |            |               |               |
| <b>减：二、费用</b>              |            | 11,221,492.49 | 28,782,704.82 |
| 1. 管理人报酬                   | 7.4.10.2.1 | 8,689,228.60  | 20,550,190.39 |
| 2. 托管费                     | 7.4.10.2.2 | 1,448,204.72  | 3,425,031.70  |
| 3. 销售服务费                   | 7.4.10.2.3 | 334,021.56    | 1,213,294.15  |
| 4. 交易费用                    | 7.4.7.20   | 359,859.56    | 119,375.55    |
| 5. 利息支出                    |            | 149,053.88    | 3,060,960.12  |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | 149,053.88    | 3,060,960.12  |
| 6. 税金及附加                   |            | 5,420.97      | -             |
| 7. 其他费用                    | 7.4.7.21   | 235,703.20    | 413,852.91    |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | 29,362,349.27 | 42,457,836.52 |
| 减：所得税费用                    |            | -             | -             |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | 29,362,349.27 | 42,457,836.52 |

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：招商安荣保本混合型证券投资基金

本报告期：2018年1月1日至2018年7月16日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2018年1月1日至2018年7月16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）                        | 1,390,224,398.24                 | 31,125,217.92  | 1,421,349,616.16 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                | 29,362,349.27  | 29,362,349.27    |
| 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）      | -211,581,203.75                  | -7,280,614.42  | -218,861,818.17  |
| 其中：1. 基金申购款                            | 368,776,470.23                   | 8,617,962.86   | 377,394,433.09   |
| 2. 基金赎回款                               | -580,357,673.98                  | -15,898,577.28 | -596,256,251.26  |
| 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）                        | 1,178,643,194.49                 | 53,206,952.77  | 1,231,850,147.26 |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2017年1月1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）                        | 1,909,864,582.83 | -5,379,507.78 | 1,904,485,075.05 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                | 42,457,836.52 | 42,457,836.52    |
| 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）      | -519,640,184.59  | -5,953,110.82 | -525,593,295.41  |
| 其中：1. 基金申购款                            | 248,649,017.43   | 1,727,647.60  | 250,376,665.03   |
| 2. 基金赎回款                               | -768,289,202.02  | -7,680,758.42 | -775,969,960.44  |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | -                | -             | -                |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 1,390,224,398.24 | 31,125,217.92 | 1,421,349,616.16 |

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

招商安荣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》、《招商安荣保本混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关法律法规的规定,经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]795 号文准予公开募集注册。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 2 年。本基金根据认购费、申购费、赎回费、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为 A 类基金份额和 C 类基金份额。本基金首次设立募集基金份额为 1,983,041,091.58 份,经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了编号为德师报(验)字(16)第 0423 号验资报告。基金合同于 2016 年 7 月 15 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,基金托管人为中国民生银行股份有限公司(以下简称“中国民生银行”)。

本基金的第一个保本周期由北京首创融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本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，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“招商安荣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。本基金第一个保本周期自2016年7月15日起至2018年7月16日止，根据本基金管理人于2018年6月27日发布的《招商安荣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荣灵活配置混合型证券投资基金相关业务规则公告》，在本基金保本周期到期日的次日，即2018年7月17日起“招商安荣保本混合型证券投资基金”将更名为“招商安荣灵活配置混合型证券投资基金”，《招商安荣灵活配置混合型证券投资基金基金合同》及托管协议于该日同时生效。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及截至报告期末最新公告的《招商安荣保本混合型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具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(含国债、金融债、企业(公司)债、次级债、中小企业私募债、可转换债券(含分离交易可转债)、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产以及现金、权证、国债期货、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的投资组合比例为：股票、权证、股指期货等风险资产占基金资产的比例不高于40%；债券、国债期货、资产支持证券、债券回购、银行存款等保本资产占基金资产的比例不低于60%，本基金每个交易日日终应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为人民银行公布的2年期银行定期存款利率(税后)。

#### 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 2018 年 7 月 16 日(基金合同失效前日)的财务状况以及 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 7 月 16 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。

### 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。本财务报表的实际编制期间为 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 7 月 16 日(基金合同失效前日)止期间。

#### 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。本基金主要金融工具的估值方法如下：

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，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

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、基金托管费和销售服务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

1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%，若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2) 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；

基金转型为“招商安荣灵活配置混合型证券投资基金”后：基金收益分配方式分两种：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；

3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4) 本基金两类基金份额在费用收取上不同，其对应的可供分配利润可能有所不同；本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

5) 法律法规或监管机关另有规定的，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

本基金本报告期内无需要说明的重大会计估计变更。

### 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[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<br>2018年7月16日 | 上年度末<br>2017年12月31日 |
|--------------|-------------------|---------------------|
| 活期存款         | 555,521,298.64    | 14,633,579.82       |
| 定期存款         | -                 | -                   |
| 其中：存款期限1-3个月 | -                 | -                   |
| 其他存款         | -                 | -                   |
| 合计：          | 555,521,298.64    | 14,633,579.82       |

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2018年7月16日 |      |      |
|----|-------------------|------|------|
|    | 成本                | 公允价值 | 估值增值 |
| 股票 | -                 | -    | -    |

|               |             |                  |                  |                |
|---------------|-------------|------------------|------------------|----------------|
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |             | -                | -                | -              |
| 债券            | 交易所市场       | 9,997,190.00     | 10,006,000.00    | 8,810.00       |
|               | 银行间市场       | 319,516,930.82   | 318,461,000.00   | -1,055,930.82  |
|               | 合计          | 329,514,120.82   | 328,467,000.00   | -1,047,120.82  |
| 资产支持证券        |             | -                | -                | -              |
| 基金            |             | -                | -                | -              |
| 其他            |             | -                | -                | -              |
| 合计            |             | 329,514,120.82   | 328,467,000.00   | -1,047,120.82  |
| 项目            | 上年度末        |                  |                  |                |
|               | 2017年12月31日 |                  |                  |                |
|               |             | 成本               | 公允价值             | 估值增值           |
| 股票            |             | 69,011,222.17    | 68,575,933.60    | -435,288.57    |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |             | -                | -                | -              |
| 债券            | 交易所市场       | 86,097,370.07    | 85,470,768.00    | -626,602.07    |
|               | 银行间市场       | 1,308,373,256.72 | 1,295,532,000.00 | -12,841,256.72 |
|               | 合计          | 1,394,470,626.79 | 1,381,002,768.00 | -13,467,858.79 |
| 资产支持证券        |             | -                | -                | -              |
| 基金            |             | -                | -                | -              |
| 其他            |             | -                | -                | -              |
| 合计            |             | 1,463,481,848.96 | 1,449,578,701.60 | -13,903,147.36 |

#### 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

本基金本报告期末及上年度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<br>2018年7月16日 | 上年度末<br>2017年12月31日 |
|------------|-------------------|---------------------|
| 应收活期存款利息   | 150,868.89        | 5,102.51            |
| 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  | 2,987.70          | 707.10              |
| 应收债券利息     | 11,038,417.53     | 33,428,585.84       |
| 应收资产支持证券利息 | -                 | -                   |
| 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         | 87.45         | 8.90          |
| 合计         | 11,192,361.57 | 33,434,404.35 |

#### 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<br>2018年7月16日 | 上年度末<br>2017年12月31日 |
|-------------|-------------------|---------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 12,841.76         | 86,376.21           |
| 银行间市场应付交易费用 | 2,716.49          | 4,538.30            |
| 合计          | 15,558.25         | 90,914.51           |

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2018年7月16日 | 上年度末<br>2017年12月31日 |
|-------------|-------------------|---------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                 | -                   |
| 应付赎回费       | 111,936.28        | 26,040.31           |
| 预提费用        | 199,696.93        | 150,000.00          |
| 合计          | 311,633.21        | 176,040.31          |

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 招商安荣保本混合 A    |                            |                  |
|---------------|----------------------------|------------------|
| 项目            | 本期<br>2018年1月1日至2018年7月16日 |                  |
|               | 基金份额(份)                    | 账面金额             |
| 上年度末          | 1,302,383,536.40           | 1,302,383,536.40 |
| 本期申购          | 551,935.80                 | 551,935.80       |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -173,917,887.81            | -173,917,887.81  |
| 本期末           | 1,129,017,584.39           | 1,129,017,584.39 |

金额单位：人民币元

| 招商安荣保本混合 C |                            |      |
|------------|----------------------------|------|
| 项目         | 本期<br>2018年1月1日至2018年7月16日 |      |
|            | 基金份额(份)                    | 账面金额 |



|               |                 |                 |
|---------------|-----------------|-----------------|
| 上年度末          | 87,840,861.84   | 87,840,861.84   |
| 本期申购          | 368,224,534.43  | 368,224,534.43  |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -406,439,786.17 | -406,439,786.17 |
| 本期末           | 49,625,610.10   | 49,625,610.10   |

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

| 招商安荣保本混合 A     |               |                |               |
|----------------|---------------|----------------|---------------|
| 项目             | 已实现部分         | 未实现部分          | 未分配利润合计       |
| 上年度末           | 41,027,708.95 | -10,800,434.97 | 30,227,273.98 |
| 本期利润           | 15,967,788.14 | 12,123,480.83  | 28,091,268.97 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -6,682,277.95 | 163,997.64     | -6,518,280.31 |
| 其中：基金申购款       | 19,755.91     | -484.02        | 19,271.89     |
| 基金赎回款          | -6,702,033.86 | 164,481.66     | -6,537,552.20 |
| 本期已分配利润        | -             | -              | -             |
| 本期末            | 50,313,219.14 | 1,487,043.50   | 51,800,262.64 |

金额单位：人民币元

| 招商安荣保本混合 C     |               |             |               |
|----------------|---------------|-------------|---------------|
| 项目             | 已实现部分         | 未实现部分       | 未分配利润合计       |
| 上年度末           | 1,620,704.36  | -722,760.42 | 897,943.94    |
| 本期利润           | 538,534.59    | 732,545.71  | 1,271,080.30  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -814,715.49   | 52,381.38   | -762,334.11   |
| 其中：基金申购款       | 8,944,999.69  | -346,308.72 | 8,598,690.97  |
| 基金赎回款          | -9,759,715.18 | 398,690.10  | -9,361,025.08 |
| 本期已分配利润        | -             | -           | -             |
| 本期末            | 1,344,523.46  | 62,166.67   | 1,406,690.13  |

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期                   | 上年度可比期间               |
|-----------|----------------------|-----------------------|
|           | 2018年1月1日至2018年7月16日 | 2017年1月1日至2017年12月31日 |
| 活期存款利息收入  | 340,819.21           | 202,744.82            |
| 定期存款利息收入  | -                    | 5,295,833.33          |
| 其他存款利息收入  | -                    | -                     |
| 结算备付金利息收入 | 11,790.83            | 19,319.38             |
| 其他        | 599.31               | 1,056.21              |
| 合计        | 353,209.35           | 5,518,953.74          |

**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<br>2018年1月1日至2018<br>年7月16日 | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至<br>2017年12月31日 |
|------------|--------------------------------|--------------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 140,338,103.78                 | 12,152,380.85                        |
| 减：卖出股票成本总额 | 135,813,109.52                 | 11,584,262.26                        |
| 买卖股票差价收入   | 4,524,994.26                   | 568,118.59                           |

**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<br>2018年1月1日至2018年7<br>月16日 | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至2017年12月<br>31日 |
|-------------------------|--------------------------------|--------------------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额   | 1,592,951,912.90               | 1,228,807,477.57                     |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 1,543,232,275.97               | 1,196,221,187.29                     |
| 减：应收利息总额                | 56,088,447.75                  | 29,610,777.43                        |
| 买卖债券差价收入                | -6,368,810.82                  | 2,975,512.85                         |

**7.4.7.14 资产支持证券投资收益**

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

**7.4.7.15 贵金属投资收益**

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

**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<br>2018年1月1日至2018年7<br>月16日 | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至2017年12月<br>31日 |
|-------------|--------------------------------|--------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 250,758.44                     | -                                    |
| 基金投资产生的股利收益 | -                              | -                                    |
| 合计          | 250,758.44                     | -                                    |

**7.4.7.18 公允价值变动收益**

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期<br>2018年1月1日至2018年7<br>月16日 | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至2017年<br>12月31日 |
|------------|--------------------------------|--------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | 12,856,026.54                  | -6,369,692.93                        |
| ——股票投资     | 435,288.57                     | -435,288.57                          |
| ——债券投资     | 12,420,737.97                  | -5,934,404.36                        |

|                        |               |               |
|------------------------|---------------|---------------|
| ——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                  | -             | -             |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | -             | -             |
| 合计                     | 12,856,026.54 | -6,369,692.93 |

#### 7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期                   | 上年度可比期间               |
|---------|----------------------|-----------------------|
|         | 2018年1月1日至2018年7月16日 | 2017年1月1日至2017年12月31日 |
| 基金赎回费收入 | 911,213.22           | 1,711,919.45          |
| 转换费收入   | 15,451.98            | 38,658.24             |
| 其他收入    | -                    | 1,503.02              |
| 合计      | 926,665.20           | 1,752,080.71          |

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                   | 上年度可比期间               |
|-----------|----------------------|-----------------------|
|           | 2018年1月1日至2018年7月16日 | 2017年1月1日至2017年12月31日 |
| 交易所市场交易费用 | 351,684.56           | 106,756.55            |
| 银行间市场交易费用 | 8,175.00             | 12,619.00             |
| 合计        | 359,859.56           | 119,375.55            |

#### 7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

| 项目    | 本期                   | 上年度可比期间               |
|-------|----------------------|-----------------------|
|       | 2018年1月1日至2018年7月16日 | 2017年1月1日至2017年12月31日 |
| 审计费用  | 37,780.66            | 50,000.00             |
| 信息披露费 | 161,916.27           | 300,000.00            |
| 电汇费   | 8,106.27             | 26,652.91             |
| 其他费用  | 27,900.00            | 37,200.00             |
| 合计    | 235,703.20           | 413,852.91            |

## 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，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

除附注 7.4.1 所述，本基金于 2018 年 7 月 17 日自招商安荣保本混合型证券投资基金转换为招商安荣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       |
| 中国民生银行                   | 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(以下简称“招商财富”) | 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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 7 月 16 日 | 上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日 |
|------------------------------|------------------------------------|--|
| 当期发生的基金应支付的管理费               | 8,689,228.60                       | 20,550,190.39                            |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 <sup>1</sup> | 3,507,331.77                       | 7,639,239.29                             |

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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 7 月 16 日 | 上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日 |
|----------------|------------------------------------|--|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,448,204.72                       | 3,425,031.70                             |

注：支付基金托管人中国民生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。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 7 月 16 日<br>当期发生的基金应支付的销售服务费       |               |            |
|----------------|---|---------------|------------|
|                | 招商安荣保本混合<br>A   | 招商安荣保本混合<br>C | 合计         |
|                | 招商基金管理有限公司  | -             | 398.05     |
| 招商银行           | -   | 208,020.27    | 208,020.27 |
| 招商证券           | -   | -             | -          |
| 民生银行           | -   | 13,617.02     | 13,617.02  |
| 合计             | -   | 222,035.34    | 222,035.34 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日<br>当期发生的基金应支付的销售服务费 |               |            |
|                | 招商安荣保本混合<br>A   | 招商安荣保本混合<br>C | 合计         |
|                |   |               |            |

|            |   |              |              |
|------------|---|--------------|--------------|
| 招商基金管理有限公司 | - | 928.83       | 928.83       |
| 招商银行       | - | 1,006,054.27 | 1,006,054.27 |
| 招商证券       | - | -            | -            |
| 民生银行       | - | 44,141.37    | 44,141.37    |
| 合计         | - | 1,051,124.47 | 1,051,124.47 |

注：根据基金合同的规定，招商安荣保本混合 A 不收取销售服务费，招商安荣保本混合 C 的销售服务费按 C 类基金份额前一日基金资产净值×0.80%的年费率来计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

招商安荣保本混合 C 的日销售服务费=前一日招商安荣保本混合 C 资产净值×0.80%÷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

本报告期内及上年度可比期间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。

#### 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<br>2018年1月1日至2018年7月16日 |                | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至2017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        |
|       | 中国民生银行                     | 555,521,298.64 | 340,819.21                       | 14,633,579.82 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国民生银行保管，按约定利率计息。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间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（2018 年 7 月 16 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**

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

### **7.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票**

本基金本报告期末无因暂时停牌而流通受限的股票。

### **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股票投资、债券投资等。与这些金融工具有关的风险，以及本基金的基金管理人管理这些风险所采取的风险管理政策如下所述。

### **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确保保本周期到期时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、存出保证金及其他。

本基金的银行存款存放于本基金的基金托管人中国民生银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在证券交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款

项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并采用券款对付交割方式，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 至 7.4.13.2.6 列示了于本报告期末本基金所持有的债券投资的信用评级，该信用评级不包括本基金所持有的国债、央行票据、政策性金融债。

#### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

#### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

#### 7.4.13.2.4 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<br>2018 年 7 月 16 日 | 上年度末<br>2017 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| AAA    | -                      | 121,426,691.70           |
| AAA 以下 | 18,646,000.00          | 55,989,076.30            |
| 未评级    | -                      | -                        |
| 合计     | 18,646,000.00          | 177,415,768.00           |

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。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

| 长期信用评级 | 本期末 2018 年 7 月 16 日(基金合<br>同失效前日) | 上年度末<br>2017 年 12 月 31 日 |
|--------|-----------------------------------|--------------------------|
| AAA    | 299,815,000.00                    | 532,804,000.00           |
| AAA 以下 | -                                 | 581,629,000.00           |
| 未评级    | -                                 | -                        |
| 合计     | 299,815,000.00                    | 1,114,433,000.00         |

注：同业存单投资评级以其主体评级进行列示。

### 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的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息。

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

#### 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、债券投资及买入返售金融资产；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<br>2018年7月16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              | 555,521,298.64 | -     | -      | -             | -    | -               | 555,521,298.64 |
| 结算备付金             | 3,209,310.93   | -     | -      | -             | -    | -               | 3,209,310.93   |
| 存出保证金             | 76,687.49      | -     | -      | -             | -    | -               | 76,687.49      |
| 交易性金融资产           | 309,821,000.00 | -     | -      | 18,646,000.00 | -    | -               | 328,467,000.00 |
| 应收证券清算款           | -              | -     | -      | -             | -    | -350,286,424.64 | 350,286,424.64 |
| 应收利息              | -              | -     | -      | -             | -    | 11,192,361.57   | 11,192,361.57  |

|                          |                |                |                |                |               |                 |                  |
|--------------------------|----------------|----------------|----------------|----------------|---------------|-----------------|------------------|
| 其他资产                     | -              | -              | -              | -              | -             | -               | -                |
| 资产总计                     | 868,628,297.06 | -              | -              | 18,646,000.00  | -             | -361,478,786.21 | 1,248,753,083.27 |
| 负债                       | -              | -              | -              | -              | -             | -               | -                |
| 应付赎回款                    | -              | -              | -              | -              | -             | 15,784,718.70   | 15,784,718.70    |
| 应付管理人报酬                  | -              | -              | -              | -              | -             | 660,835.86      | 660,835.86       |
| 应付托管费                    | -              | -              | -              | -              | -             | 110,139.29      | 110,139.29       |
| 应付销售服务费                  | -              | -              | -              | -              | -             | 19,158.47       | 19,158.47        |
| 应付交易费用                   | -              | -              | -              | -              | -             | 15,558.25       | 15,558.25        |
| 应交税费                     | -              | -              | -              | -              | -             | 892.23          | 892.23           |
| 其他负债                     | -              | -              | -              | -              | -             | 311,633.21      | 311,633.21       |
| 负债总计                     | -              | -              | -              | -              | -             | 16,902,936.01   | 16,902,936.01    |
| 利率敏感度缺口                  | 868,628,297.06 | -              | -              | 18,646,000.00  | -             | -344,575,850.20 | 1,231,850,147.26 |
| 上年度末<br>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                     | 14,633,579.82  | -              | -              | -              | -             | -               | 14,633,579.82    |
| 结算备付金                    | 1,571,327.37   | -              | -              | -              | -             | -               | 1,571,327.37     |
| 存出保证金                    | 19,772.14      | -              | -              | -              | -             | -               | 19,772.14        |
| 交易性金融资产                  | 105,479,000.00 | 238,715,000.00 | 850,059,000.00 | 158,498,616.30 | 28,251,151.70 | 68,575,933.60   | 1,449,578,701.60 |
| 买入返售金融资产                 | -              | -              | -              | -              | -             | -               | -                |
| 应收证券清算款                  | -              | -              | -              | -              | -             | -               | -                |
| 应收利息                     | -              | -              | -              | -              | -             | 33,434,404.35   | 33,434,404.35    |
| 应收申购款                    | -              | -              | -              | -              | -             | 1,541,000.00    | 1,541,000.00     |
| 其他资产                     | -              | -              | -              | -              | -             | -               | -                |
| 资产总计                     | 121,703,679.33 | 238,715,000.00 | 850,059,000.00 | 158,498,616.30 | 28,251,151.70 | 103,551,337.95  | 1,500,778,785.28 |
| 负债                       |                |                |                |                |               |                 |                  |
| 卖出回购金融资产款                | 67,000,000.00  | -              | -              | -              | -             | -               | 67,000,000.00    |
| 应付证券清算款                  | -              | -              | -              | -              | -             | 3,973,159.39    | 3,973,159.39     |
| 应付赎回款                    | -              | -              | -              | -              | -             | 6,327,731.75    | 6,327,731.75     |
| 应付管理人报酬                  | -              | -              | -              | -              | -             | 1,473,887.34    | 1,473,887.34     |
| 应付托管费                    | -              | -              | -              | -              | -             | 245,647.91      | 245,647.91       |
| 应付销售服务费                  | -              | -              | -              | -              | -             | 64,481.15       | 64,481.15        |
| 应付交易费用                   | -              | -              | -              | -              | -             | 90,914.51       | 90,914.51        |
| 应付利息                     | -              | -              | -              | -              | -             | 77,306.76       | 77,306.76        |
| 其他负债                     | -              | -              | -              | -              | -             | 176,040.31      | 176,040.31       |
| 负债总计                     | 67,000,000.00  | -              | -              | -              | -             | 12,429,169.12   | 79,429,169.12    |
| 利率敏感度缺口                  | 54,703,679.33  | 238,715,000.00 | 850,059,000.00 | 158,498,616.30 | 28,251,151.70 | 91,122,168.83   | 1,421,349,616.16 |

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（2018年7月16日）             | 上年度末（2017年12月31日） |
|                  | 1. 市场利率平行上升50个基点       | -254,357.59                 | -4,853,724.33     |
| 2. 市场利率平行下降50个基点 | 259,810.67             | 4,927,493.67                |                   |

#### 7.4.13.4.2 其他价格风险

其他价格风险是指以交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险，该风险可能与特定投资品种相关，也有可能与整体投资品种相关。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<br>2018年7月16日 |              | 上年度末<br>2017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  | -                 | -            | 68,575,933.60       | 4.82         |
| 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            | -                 | -            | 68,575,933.60       | 4.82         |

##### 7.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

|                |                            |                             |                   |
|----------------|----------------------------|-----------------------------|-------------------|
| 假设             | 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% |                             |                   |
|                | 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（2018年7月16日）             | 上年度末（2017年12月31日） |
|                | 权益性投资的市场价格上升5%             | -                           | 3,428,796.68      |
| 权益性投资的市场价格下降5% | -                          | -3,428,796.68               |                   |

#### 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。

单位：人民币元

| 资产      | 本期末(2018年7月16日(基金合同失效前日)) |                  |      |                  |
|---------|---------------------------|------------------|------|------------------|
|         | 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    | -                         | -                | -    | -                |
| 债券投资    | -                         | 328,467,000.00   | -    | 328,467,000.00   |
| 合计      | -                         | 328,467,000.00   | -    | 328,467,000.00   |
| 资产      | 上年度末(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    | 68,575,933.60             | -                | -    | 68,575,933.60    |
| 债券投资    | 798,376.70                | 1,380,204,391.30 | -    | 1,381,002,768.00 |
| 合计      | 69,374,310.30             | 1,380,204,391.30 | -    | 1,449,578,701.60 |

## (ii)公允价值所属层次间的重大变动

对于本基金投资的证券，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，确定相关证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   | 39,614,877.50 | 34.91         |
|    | 其中：股票  | 39,614,877.50 | 34.91         |
| 2  | 基金投资   | -             | -             |
| 3  | 固定收益投资 | 40,831,999.49 | 35.98         |

|   |                   |                |        |
|---|-------------------|----------------|--------|
|   | 其中：债券             | 40,831,999.49  | 35.98  |
|   | 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          | 12,000,000.00  | 10.57  |
|   | 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      | 19,682,967.55  | 17.35  |
| 8 | 其他各项资产            | 1,346,454.86   | 1.19   |
| 9 | 合计                | 113,476,299.40 | 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<br>(%) |
|----|------------------|---------------|------------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | 5,333,206.34  | 5.29             |
| B  | 采矿业              | -             | -                |
| C  | 制造业              | 17,555,064.91 | 17.40            |
| 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      | 4,430,305.94  | 4.39             |
| H  | 住宿和餐饮业           | -             | -                |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 7,413,666.57  | 7.35             |
| J  | 金融业              | 4,882,633.74  | 4.84             |
| 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        | -             | -                |
| S  | 综合               | -             | -                |
|    | 合计               | 39,614,877.50 | 39.27            |

### 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  | 300498 | 温氏股份 | 203,713 | 5,333,206.34 | 5.29         |
| 2  | 600030 | 中信证券 | 304,974 | 4,882,633.74 | 4.84         |
| 3  | 300316 | 晶盛机电 | 460,503 | 4,614,240.06 | 4.57         |
| 4  | 300408 | 三环集团 | 269,400 | 4,558,248.00 | 4.52         |
| 5  | 601021 | 春秋航空 | 139,274 | 4,430,305.94 | 4.39         |
| 6  | 600114 | 东睦股份 | 704,807 | 4,419,139.89 | 4.38         |
| 7  | 300166 | 东方国信 | 407,607 | 4,222,808.52 | 4.19         |
| 8  | 002624 | 完美世界 | 114,573 | 3,190,858.05 | 3.16         |
| 9  | 002008 | 大族激光 | 86,261  | 2,618,883.96 | 2.60         |
| 10 | 600566 | 济川药业 | 40,100  | 1,344,553.00 | 1.33         |

#### 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  | 300316 | 晶盛机电 | 10,400,299.78 | 10.31          |
| 2  | 600030 | 中信证券 | 9,852,838.00  | 9.77           |
| 3  | 002624 | 完美世界 | 9,547,243.00  | 9.46           |
| 4  | 600114 | 东睦股份 | 9,540,425.17  | 9.46           |
| 5  | 300166 | 东方国信 | 9,296,117.36  | 9.22           |
| 6  | 300498 | 温氏股份 | 9,226,454.00  | 9.15           |
| 7  | 601021 | 春秋航空 | 8,922,206.04  | 8.84           |
| 8  | 002008 | 大族激光 | 7,898,922.20  | 7.83           |
| 9  | 300408 | 三环集团 | 7,871,886.00  | 7.80           |
| 10 | 603638 | 艾迪精密 | 7,142,748.47  | 7.08           |
| 11 | 600201 | 生物股份 | 6,703,888.00  | 6.65           |
| 12 | 300054 | 鼎龙股份 | 5,721,531.34  | 5.67           |
| 13 | 300373 | 扬杰科技 | 4,511,069.40  | 4.47           |
| 14 | 603799 | 华友钴业 | 4,053,794.00  | 4.02           |
| 15 | 600583 | 海油工程 | 3,959,265.00  | 3.92           |
| 16 | 603877 | 太平鸟  | 2,841,959.00  | 2.82           |
| 17 | 002531 | 天顺风能 | 2,833,715.00  | 2.81           |
| 18 | 600438 | 通威股份 | 2,833,041.00  | 2.81           |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 19 | 600566 | 济川药业 | 2,805,873.00 | 2.78 |
| 20 | 600498 | 烽火通信 | 2,794,337.00 | 2.77 |
| 21 | 600031 | 三一重工 | 2,725,647.00 | 2.70 |
| 22 | 601699 | 潞安环能 | 2,714,408.60 | 2.69 |
| 23 | 002013 | 中航机电 | 2,707,222.18 | 2.68 |
| 24 | 600970 | 中材国际 | 2,706,054.00 | 2.68 |
| 25 | 601899 | 紫金矿业 | 2,705,064.00 | 2.68 |

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<br>(%) |
|----|--------|------|--------------|--------------------|
| 1  | 600201 | 生物股份 | 7,452,198.32 | 7.39               |
| 2  | 002624 | 完美世界 | 5,810,693.83 | 5.76               |
| 3  | 600583 | 海油工程 | 4,701,684.80 | 4.66               |
| 4  | 600030 | 中信证券 | 4,428,344.80 | 4.39               |
| 5  | 300498 | 温氏股份 | 4,346,305.37 | 4.31               |
| 6  | 601021 | 春秋航空 | 3,855,237.76 | 3.82               |
| 7  | 300316 | 晶盛机电 | 3,285,433.13 | 3.26               |
| 8  | 002008 | 大族激光 | 2,518,227.28 | 2.50               |
| 9  | 600114 | 东睦股份 | 2,314,593.44 | 2.29               |
| 10 | 300166 | 东方国信 | 2,271,489.96 | 2.25               |
| 11 | 002294 | 信立泰  | 1,619,534.00 | 1.61               |
| 12 | 600566 | 济川药业 | 1,293,750.00 | 1.28               |
| 13 | 002262 | 恩华药业 | 1,289,209.00 | 1.28               |
| 14 | 300408 | 三环集团 | 1,276,024.60 | 1.26               |
| 15 | 600183 | 生益科技 | 1,191,882.00 | 1.18               |
| 16 | 300124 | 汇川技术 | 1,118,356.00 | 1.11               |
| 17 | 601111 | 中国国航 | 1,095,885.00 | 1.09               |
| 18 | 300144 | 宋城演艺 | 1,070,203.00 | 1.06               |
| 19 | 603885 | 吉祥航空 | 554,527.00   | 0.55               |
| 20 | 600115 | 东方航空 | 538,136.00   | 0.53               |

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

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 | 171,440,525.12 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 52,155,756.29  |

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      | 40,793,000.00 | 40.44        |
|    | 其中：政策性金融债 | 40,793,000.00 | 40.44        |
| 4  | 企业债券      | -             | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | -             | -            |
| 6  | 中期票据      | -             | -            |
| 7  | 可转债（可交换债） | 38,999.49     | 0.04         |
| 8  | 同业存单      | -             | -            |
| 9  | 其他        | -             | -            |
| 10 | 合计        | 40,831,999.49 | 40.48        |

### 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  | 180203 | 18 国开 03 | 200,000 | 20,578,000.00 | 20.40        |
| 2  | 180208 | 18 国开 08 | 100,000 | 10,183,000.00 | 10.09        |
| 3  | 180209 | 18 国开 09 | 100,000 | 10,032,000.00 | 9.95         |
| 4  | 110049 | 海尔转债     | 390     | 38,999.49     | 0.04         |

### 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。

## 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

为了更好地实现投资目标,本基金在注重风险管理的前提下,以套期保值为目的,适度运用股指期货、国债期货等金融衍生品。本基金利用金融衍生品合约流动性好、交易成本低和杠杆操作等特点,提高投资组合运作效率。

本基金采取套期保值的方式参与股指期货、国债期货的投资交易,以管理市场风险和调节仓位为主要目的。

## 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

为了更好地实现投资目标,本基金在注重风险管理的前提下,以套期保值为目的,适度运用股指期货、国债期货等金融衍生品。本基金利用金融衍生品合约流动性好、交易成本低和杠杆操作等特点,提高投资组合运作效率。

本基金采取套期保值的方式参与股指期货、国债期货的投资交易,以管理市场风险和调节仓位为主要目的。

### 8.11.2 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。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

## 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。

### 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 其他资产构成

单位:人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|----|----|
|----|----|----|

|   |         |              |
|---|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金   | 71,129.76    |
| 2 | 应收证券清算款 | -            |
| 3 | 应收股利    | -            |
| 4 | 应收利息    | 1,195,029.53 |
| 5 | 应收申购款   | 80,295.57    |
| 6 | 其他应收款   | -            |
| 7 | 待摊费用    | -            |
| 8 | 其他      | -            |
| 9 | 合计      | 1,346,454.86 |

#### 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  | 600030 | 中信证券 | 4,882,633.74 | 4.84          | 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              | -                | -             |
|    | 其中：股票             | -                | -             |
| 2  | 基金投资              | -                | -             |
| 3  | 固定收益投资            | 328,467,000.00   | 26.30         |
|    | 其中：债券             | 328,467,000.00   | 26.30         |
|    | 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      | 558,730,609.57   | 44.74         |
| 8  | 其他资产              | 361,555,473.70   | 28.95         |
| 9  | 合计                | 1,248,753,083.27 | 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

本基金本报告期末未持有股票。

#### 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

本基金本报告期末未持有股票

### 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  | 600030 | 中信证券 | 9,852,838.00 | 0.69            |
| 2  | 002624 | 完美世界 | 9,547,243.00 | 0.67            |
| 3  | 300316 | 晶盛机电 | 9,545,094.78 | 0.67            |
| 4  | 600114 | 东睦股份 | 9,540,425.17 | 0.67            |
| 5  | 300498 | 温氏股份 | 9,226,454.00 | 0.65            |
| 6  | 601021 | 春秋航空 | 8,922,206.04 | 0.63            |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 7  | 300166 | 东方国信 | 8,547,808.36 | 0.60 |
| 8  | 002008 | 大族激光 | 7,898,922.20 | 0.56 |
| 9  | 603638 | 艾迪精密 | 7,142,748.47 | 0.50 |
| 10 | 300054 | 鼎龙股份 | 5,580,168.34 | 0.39 |
| 11 | 300373 | 扬杰科技 | 4,511,069.40 | 0.32 |
| 12 | 603799 | 华友钴业 | 4,053,794.00 | 0.29 |
| 13 | 600583 | 海油工程 | 3,959,265.00 | 0.28 |
| 14 | 603877 | 太平鸟  | 2,841,959.00 | 0.20 |
| 15 | 002531 | 天顺风能 | 2,833,715.00 | 0.20 |
| 16 | 600438 | 通威股份 | 2,833,041.00 | 0.20 |
| 17 | 600498 | 烽火通信 | 2,794,337.00 | 0.20 |
| 18 | 600031 | 三一重工 | 2,725,647.00 | 0.19 |
| 19 | 601699 | 潞安环能 | 2,714,408.60 | 0.19 |
| 20 | 002013 | 中航机电 | 2,707,222.18 | 0.19 |

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  | 600031 | 三一重工 | 7,722,684.00 | 0.54           |
| 2  | 603638 | 艾迪精密 | 7,252,831.12 | 0.51           |
| 3  | 601899 | 紫金矿业 | 6,122,555.00 | 0.43           |
| 4  | 600585 | 海螺水泥 | 5,945,369.00 | 0.42           |
| 5  | 300188 | 美亚柏科 | 5,824,931.94 | 0.41           |
| 6  | 603799 | 华友钴业 | 5,807,253.44 | 0.41           |
| 7  | 300054 | 鼎龙股份 | 5,773,366.06 | 0.41           |
| 8  | 300373 | 扬杰科技 | 5,544,009.90 | 0.39           |
| 9  | 600507 | 方大特钢 | 4,686,707.76 | 0.33           |
| 10 | 600138 | 中青旅  | 4,571,615.94 | 0.32           |
| 11 | 002310 | 东方园林 | 4,149,140.00 | 0.29           |
| 12 | 000823 | 超声电子 | 4,147,395.00 | 0.29           |
| 13 | 601636 | 旗滨集团 | 3,863,034.04 | 0.27           |
| 14 | 002013 | 中航机电 | 3,798,290.54 | 0.27           |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 15 | 601877 | 正泰电器 | 3,664,909.93 | 0.26 |
| 16 | 000717 | 韶钢松山 | 3,593,382.00 | 0.25 |
| 17 | 600388 | 龙净环保 | 3,543,180.99 | 0.25 |
| 18 | 600801 | 华新水泥 | 3,496,166.00 | 0.25 |
| 19 | 002001 | 新和成  | 3,440,107.00 | 0.24 |
| 20 | 603877 | 太平鸟  | 3,154,779.66 | 0.22 |

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 | 66,801,887.35  |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 140,338,103.78 |

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      | 10,006,000.00  | 0.81         |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | -              | -            |
|    | 其中：政策性金融债 | -              | -            |
| 4  | 企业债券      | 18,646,000.00  | 1.51         |
| 5  | 企业短期融资券   | -              | -            |
| 6  | 中期票据      | -              | -            |
| 7  | 可转债（可交换债） | -              | -            |
| 8  | 同业存单      | 299,815,000.00 | 24.34        |
| 9  | 其他        | -              | -            |
| 10 | 合计        | 328,467,000.00 | 26.66        |

### 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  | 111781301 | 17 南京银行 CD139 | 1,400,000 | 133,854,000.00 | 10.87        |

|   |           |               |           |               |      |
|---|-----------|---------------|-----------|---------------|------|
| 2 | 111810174 | 18 兴业银行 CD174 | 1,000,000 | 99,020,000.00 | 8.04 |
| 3 | 111713073 | 17 浙商银行 CD073 | 700,000   | 66,941,000.00 | 5.43 |
| 4 | 1680384   | 16 哈密国资债      | 200,000   | 18,646,000.00 | 1.51 |
| 5 | 019571    | 17 国债 17      | 100,000   | 10,006,000.00 | 0.81 |

### 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。

### 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

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

本基金的股指期货投资将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

### 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

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

#### 8.11.2 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。

#### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

## 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。

### 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   | 76,687.49      |
| 2  | 应收证券清算款 | 350,286,424.64 |
| 3  | 应收股利    | -              |
| 4  | 应收利息    | 11,192,361.57  |
| 5  | 应收申购款   | -              |
| 6  | 其他应收款   | -              |
| 7  | 待摊费用    | -              |
| 8  | 其他      | -              |
| 9  | 合计      | 361,555,473.70 |

### 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

本基金本报告期末未持有股票。

## §9 基金份额持有人信息（转型后）

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别     | 持有人户数(户) | 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  |
| 招商安荣混合 A | 1,165    | 84,225.34 | 0.00% | 0.00%  | 98,122,515.55  | 100.00% |
| 招商安荣混合 C | 239      | 30,621.23 | 0.00% | 0.00%  | 7,318,472.95   | 100.00% |
| 合计       | 1,404    | 75,100.42 | 0.00% | 0.00%  | 105,440,988.50 | 100.00% |

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

### 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 | 招商安荣混合 A | 0         | 0        |
|                  | 招商安荣混合 C | 0         | 0        |
|                  | 合计       | 0         | 0        |

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

### 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                           | 份额级别     | 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 | 招商安荣混合 A | 0                 |
|                              | 招商安荣混合 C | 0                 |
|                              | 合计       | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金              | 招商安荣混合 A | 0                 |
|                              | 招商安荣混合 C | 0                 |
|                              | 合计       | 0                 |



## §9 基金份额持有人信息（转型前）

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别       | 持有人户数(户) | 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  |
| 招商安荣保本混合 A | 7,501    | 150,515.61 | 0     | 0.00%  | 1,129,017,584.39 | 100.00% |
| 招商安荣保本混合 C | 534      | 92,931.85  | 0     | 0.00%  | 49,625,610.10    | 100.00% |
| 合计         | 8,035    | 146,688.64 | 0     | 0.00%  | 1,178,643,194.49 | 100.00% |

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

### 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 | 招商安荣保本混合 A | 0         | 0        |
|                  | 招商安荣保本混合 C | 0         | 0        |
|                  | 合计         | 0         | 0        |

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

### 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                             | 份额级别       | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 招商安荣保本混合 A | 0                 |
|                                | 招商安荣保本混合 C | 0                 |
|                                | 合计         | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 招商安荣保本混合 A | 0                 |
|                                | 招商安荣保本混合 C | 0                 |
|                                | 合计         | 0                 |

## § 10 开放式基金份额变动(转型后)

单位：份

| 项目                                     | 招商安荣混合 A         | 招商安荣混合 C      |
|--|------------------|---------------|
| 基金合同生效日（2018 年 7 月 17 日）基金份额总额         | 1,129,017,584.39 | 49,625,610.10 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额                  | 151,218.58       | 986,068.50    |
| 减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额                | 1,031,046,287.42 | 43,293,205.65 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额<br>(份额减少以“-”填列) | -                | -             |
| 本报告期期末基金份额总额                           | 98,122,515.55    | 7,318,472.95  |

## § 10 开放式基金份额变动(转型前)

单位：份

| 项目                             | 招商安荣保本混合 A       | 招商安荣保本混合 C     |
|--------------------------------|------------------|----------------|
| 基金合同生效日(2016 年 7 月 15 日)基金份额总额 | 1,743,425,761.56 | 239,615,330.02 |
| 本报告期期初基金份额总额                   | 1,302,383,536.40 | 87,840,861.84  |
| 本报告期期初基金份额总额                   | 551,935.80       | 368,224,534.43 |
| 本报告期基金总申购份额                    | 173,917,887.81   | 406,439,786.17 |
| 减:本报告期基金总赎回份额                  | -                | -              |
| 本报告期末基金份额总额                    | 1,129,017,584.39 | 49,625,610.10  |

## §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

招商基金第五届监事会监事周松先生因工作原因辞任公司监事会监事职务。2018 年 2 月 12 日，经招商基金管理有限公司股东会 2018 年第一次会议审议通过，选举彭家文先生担任公司第五届监事会监事。2018 年 7 月 23 日，经招商基金管理有限公司第五届董事会 2018 年第五次会议审议通过，增选金旭女士为公司第五届董事会副董事长。本基金托管人中国民生银行股份有限公司于 2018 年 4 月 19 日公告，根据工作需要，任命张庆先生担任本公司资产托管部总经理，主持资产托管部相关工作。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期无涉及基金管理人、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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 7 月 16 日）

本基金将投资品种分为风险资产和保本资产两类，采用恒定比例投资组合保险（Constant Proportion Portfolio Insurance，以下简称“CPPI”）策略。本基金在保本周期内将严格遵守保本策略，实现对风险资产和保本资产的优化动态调整和资产配置，力争投资本金的安全性。同时，本基金通过积极稳健的风险资产投资策略，竭力为基金资产获取稳定增值。具体包括：资产配置策略、债券（不含可转换公司债）投资策略、可转换公司债投资策略、中小企业私募债券投资策略、国债期货投资策略、股票投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、权证投资策略。转型后的投资策略：（报告期间：2018 年 7 月 17 日至 2018 年 12 月 31 日）

本基金在大类资产配置过程中，注重平衡投资的收益和风险水平，以实现基金份额净值的稳定增长。

具体包括：1、资产配置策略；2、股票投资策略；3、债券（不含可转换公司债）投资策略；4、可转换公司债投资策略；5、资产支持证券投资策略；6、权证投资策略；7、期货投资策略。

### 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 3 年，本报告期应支付德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为人民币

50,000.00 元。

## 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（转型后）

### 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 |    |
| 方正证券 |        | 289,003,852.65 | 56.76%       | 82,889.40 | 56.76%     | -  |
| 东吴证券 |        | 239,505,508.41 | 25.20%       | 36,791.86 | 25.20%     | -  |
| 瑞银证券 |        | 228,285,033.00 | 18.04%       | 26,342.32 | 18.04%     | -  |
| 国盛证券 | 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。

### 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 |
| 方正证券 | 20,175,256.71 | 98.58%       | -             | -              | -    | -            |
| 东吴证券 | -             | -            | -             | -              | -    | -            |
| 瑞银证券 | 289,755.30    | 1.42%        | 72,000,000.00 | 100.00%        | -    | -            |
| 国盛证券 | -             | -            | -             | -              | -    | -            |

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前）

### 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 |    |

|      |   | 例              |         |            |         |
|------|---|----------------|---------|------------|---------|
| 方正证券 | 2 | 207,139,991.13 | 100.00% | 192,909.44 | 100.00% |
| 瑞银证券 | 2 | -              | -       | -          | -       |
| 国盛证券 | 1 | -              | -       | -          | -       |
| 东吴证券 | 2 | -              | -       | -          | -       |

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 |
| 方正证券 | 45,689,840.25 | 100.00%      | 2,016,900,000.00 | 100.00%        | -    | -            |
| 瑞银证券 | -             | -            | -                | -              | -    | -            |
| 国盛证券 | -             | -            | -                | -              | -    | -            |
| 东吴证券 | -             | -            | -                | -              | -    | -            |

### 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  | 招商安荣保本混合型证券投资基金更新的招募说明书（二零一八年第二号）          | 中国证券报、<br>证券时报、<br>上海证券报 | 2018-8-27 |
| 2  | 招商安荣保本混合型证券投资基金更新的招募说明书摘要（二零一八年第二号）        | 中国证券报、证<br>券时报、上海证<br>券报 | 2018-8-27 |
| 3  | 招商安荣保本混合型证券投资基金 2018 年半年度报告摘要              | 中国证券报、证<br>券时报、上海证<br>券报 | 2018-8-28 |
| 4  | 招商安荣保本混合型证券投资基金 2018 年半年度报告                | 中国证券报、证<br>券时报、上海证<br>券报 | 2018-8-28 |
| 5  | 关于招商基金旗下部分基金增加万得为代销机构并参与其费率优惠活动的公告         | 中国证券报、证<br>券时报、上海证<br>券报 | 2018-9-18 |
| 6  | 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 | 中国证券报、证<br>券时报、上海证       | 2018-9-29 |

|    |  |                  |            |
|----|--|------------------|------------|
|    | 购及定期定额投资手续费率优惠的公告                                | 券报               |            |
| 7  | 招商安荣灵活配置混合型证券投资基金 2018 年第 3 季度报告                 | 中国证券报、证券时报、上海证券报 | 2018-10-24 |
| 8  | 关于招商安荣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 | 2018-10-30 |
| 9  | 关于招商安荣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 | 2018-12-21 |
| 10 | 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“2019 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 | 2018-12-28 |
| 11 | 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 | 2018-12-28 |

### 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旗下产品缴纳增值税的提示性公告                  | 中国证券报、证券时报、上海证券报 | 2018-01-02 |
| 2  | 招商安荣保本混合型证券投资基金 2017 年第 4 季度报告               | 中国证券报、证券时报、上海证券报 | 2018-01-19 |
| 3  | 招商基金旗下部分基金增加万家财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 | 2018-01-24 |
| 4  | 招商安荣保本混合型证券投资基金更新的招募说明书摘要（二零一八年第一号）          | 中国证券报、证券时报、上海证券报 | 2018-02-27 |
| 5  | 招商安荣保本混合型证券投资基金更新的招募说明书（二零一八年第一号）            | 中国证券报、证券时报、上海证券报 | 2018-02-27 |
| 6  | 关于招商安荣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 | 2018-02-28 |
| 7  | 招商基金旗下基金参加上海长量定期定额投资手续费优惠活动的公告               | 中国证券报、证券时报、上海证券报 | 2018-03-08 |
| 8  | 关于招商安荣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、      | 2018-03-22 |

|    |  |                          |            |
|----|--|--------------------------|------------|
|    |  | 上海证券报                    |            |
| 9  | 招商安荣保本混合型证券投资基金托管协议（2018年3月22日修订）                          | 中国证券报、<br>证券时报、<br>上海证券报 | 2018-03-22 |
| 10 | 招商安荣保本混合型证券投资基金基金合同（2018年3月22日修订）                          | 中国证券报、<br>证券时报、<br>上海证券报 | 2018-03-22 |
| 11 | 关于招商安荣保本混合型证券投资基金赎回费收取的公告                                  | 中国证券报、<br>证券时报、<br>上海证券报 | 2018-03-24 |
| 12 | 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、<br>证券时报、<br>上海证券报 | 2018-03-28 |
| 13 | 招商安荣保本混合型证券投资基金 2017 年度报告                                  | 中国证券报、<br>证券时报、<br>上海证券报 | 2018-03-30 |
| 14 | 招商安荣保本混合型证券投资基金 2017 年度报告摘要                                | 中国证券报、<br>证券时报、<br>上海证券报 | 2018-03-30 |
| 15 | 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、<br>证券时报、<br>上海证券报 | 2018-03-31 |
| 16 | 招商基金旗下部分基金增加植信基金为代销机构及参与其费率优惠活动的公告                         | 中国证券报、<br>证券时报、<br>上海证券报 | 2018-04-11 |
| 17 | 招商安荣保本混合型证券投资基金 2018 年第 1 季度报告                             | 中国证券报、<br>证券时报、<br>上海证券报 | 2018-04-23 |
| 18 | 招商基金管理有限公司关于降低旗下基金在招商银行定期定额投资最低限额的公告                       | 中国证券报、<br>证券时报、<br>上海证券报 | 2018-05-29 |
| 19 | 招商基金旗下部分基金增加腾安基金为代销机构并参与其费率优惠活动的公告                         | 中国证券报、<br>证券时报、<br>上海证券报 | 2018-05-30 |
| 20 | 招商安荣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荣灵活配置混合型 证券投资基金的第一次提示性公告     | 中国证券报、<br>证券时报、<br>上海证券报 | 2018-06-25 |
| 21 | 关于暂停招商安荣保本混合型证券投资基金申购（含定期定额投资）和转换转入业务的公告                   | 中国证券报、<br>证券时报、<br>上海证券报 | 2018-06-26 |
| 22 | 招商安荣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荣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、<br>证券时报、<br>上海证券报 | 2018-06-26 |
| 23 | 招商安荣保本混合型证券投资基金保本期到期安排及转                                   | 中国证券报、                   | 2018-06-27 |



|    |  |                          |            |
|----|--|--------------------------|------------|
|    | 型为招商安荣灵活配置混合型证券投资基金相关业务规则公告                                | 证券时报、<br>上海证券报           |            |
| 24 | 招商安荣灵活配置混合型证券投资基金基金合同摘要                                    | 中国证券报、<br>证券时报、<br>上海证券报 | 2018-06-27 |
| 25 | 招商安荣灵活配置混合型证券投资基金招募说明书                                     | 中国证券报、<br>证券时报、<br>上海证券报 | 2018-06-27 |
| 26 | 招商安荣灵活配置混合型证券投资基金托管协议                                      | 中国证券报、<br>证券时报、<br>上海证券报 | 2018-06-27 |
| 27 | 招商安荣灵活配置混合型证券投资基金基金合同                                      | 中国证券报、<br>证券时报、<br>上海证券报 | 2018-06-27 |
| 28 | 招商基金管理有限公司关于招商安荣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、<br>证券时报、<br>上海证券报 | 2018-06-27 |
| 29 | 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、<br>证券时报、<br>上海证券报 | 2018-06-30 |
| 30 | 招商基金旗下部分基金增加恒天明泽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、<br>证券时报、<br>上海证券报 | 2018-07-04 |
| 31 | 招商基金旗下部分基金增加济安财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、<br>证券时报、<br>上海证券报 | 2018-07-10 |
| 32 | 招商基金管理有限公司关于招商安荣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、<br>证券时报、<br>上海证券报 | 2018-07-13 |
| 33 | 招商安荣保本混合型证券投资基金 2018 年第 2 季度报告                             | 中国证券报、<br>证券时报、<br>上海证券报 | 2018-07-19 |

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会批准设立招商基金管理有限公司的文件；
- 2、中国证券监督管理委员会准予招商安荣保本混合型证券投资基金设立的文件；
- 3、《招商安荣保本混合型证券投资基金基金合同》；
- 4、《招商安荣保本混合型证券投资基金托管协议》；
- 5、《招商安荣保本混合型证券投资基金招募说明书》；
- 6、《招商安荣灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；

- 7、《招商安荣灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 8、《招商安荣灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》
- 9、基金管理人业务资格批件、营业执照。

## 12.2 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

## 12.3 查阅方式

上述文件可在招商基金管理有限公司互联网站 <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

2019 年 3 月 28 日