(上接 D279 版)

单位:人民币元

资产	上年度末(2016 年 12 月 31 日)			
	第一层次	第二层次	第三层次	合计
交易性金融资产				
股票投资	-	-	-	-
债券投资	-	1,424,656,000.00	-	1,424,656,000.00
合计	-	1,424,656,000.00	-	1,424,656,000.00

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

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

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	43,094,687.02	3.92
	其中:股票	43,094,687.02	3.92
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	976,385,000.00	88.81
	其中:债券	976,385,000.00	88.81
	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	52,680,259.52	4.79
	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	7,155,915.08	0.65
8	其他各项资产	20,073,014.42	1.83
9	合计	1,099,388,876.04	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	2,591,514.00	0.24
C	制造业	28,546,717.62	2.61
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	3,263,506.00	0.30
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,968,030.00	0.18
J	金融业	-	-
K	房地产业	4,556,526.40	0.42
L	租赁和商务服务业	2,168,393.00	0.20
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	43,094,687.02	3.94

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前十名股票投资明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600048	保利地产	322,016	4,556,526.40	0.42
2	600585	海螺水泥	135,000	3,959,550.00	0.36
3	000823	超声电子	272,800	3,696,440.00	0.34
4	600031	三一重工	392,500	3,559,975.00	0.33
5	601636	旗滨集团	548,500	3,422,640.00	0.31
6	000538	云南白药	33,478	3,407,725.62	0.31
7	002310	东方园林	161,800	3,263,506.00	0.30
8	600507	方大特钢	212,000	2,690,280.00	0.25
9	601899	紫金矿业	564,600	2,591,514.00	0.24
10	601222	林洋能源	230,200	2,334,228.00	0.21

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读刊登于招商基金管理有限公司网站 http://www.cmfchina.com 上的年度报告正文。

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	002042	华孚时尚	9,298,917.00	0.52
2	000823	超声电子	4,576,906.00	0.25
3	300188	美亚柏科	4,237,950.00	0.23
4	600048	保利地产	3,461,903.64	0.19
5	000538	云南白药	3,448,587.29	0.19
6	600585	海螺水泥	3,420,939.00	0.19
7	000830	鲁西化工	3,398,606.00	0.19
8	002310	东方园林	3,386,270.00	0.19
9	600031	三一重工	3,356,517.00	0.19
10	600507	方大特钢	3,351,623.00	0.19
11	601636	旗滨集团	3,350,844.00	0.19
12	601222	林洋能源	2,276,573.00	0.13
13	601899	紫金矿业	2,237,894.00	0.12
14	000717	韶钢松山	2,223,483.00	0.12
15	601877	正泰电器	2,188,569.00	0.12
16	600138	中青旅	2,184,257.00	0.12
17	000151	中成股份	1,162,765.00	0.06
18	603328	依顿电子	1,151,546.20	0.06
19	002531	天顺风能	1,092,284.00	0.06

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	002042	华孚时尚	10,115,696.94	0.56
2	000830	鲁西化工	3,855,365.00	0.21
3	300188	美亚柏科	2,396,574.28	0.13
4	603328	依顿电子	1,015,869.50	0.06
5	000151	中成股份	888,474.00	0.05

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	59,806,434.13
卖出股票收入(成交)总额	18,271,979.72

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	98,328,000.00	8.99
	其中:政策性金融债	98,328,000.00	8.99
4	企业债券	38,376,000.00	3.51
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	115,006,000.00	10.51
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	724,675,000.00	66.25
9	其他	-	-
10	合计	976,385,000.00	89.27

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(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	111713099	17 浙商银行 CD099	1,500,000	144,540,000.00	13.21
2	111709449	17 浦发银行 CD449	1,000,000	97,520,000.00	8.92
3	111712191	17 北京银行 CD191	1,000,000	96,430,000.00	8.82
4	111714243	17 江苏银行 CD243	1,000,000	96,400,000.00	8.81
5	170408	17 农发 08	600,000	59,820,000.00	5.47

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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和判断,并充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险特征,通过资产配置,谨慎进行投资,以调整债券组合的久期,降低投资组合的整体风险。

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

本基金本报告期内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除 17 北京银行 CD180(证券代码 111712180)、17 北京银行 CD191 (证券代码 111712191)、17 宁波银行 CD128 (证券代码 111781266)外其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查,不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

1、17 北京银行 CD180(证券代码 111712180)

根据 2017 年 8 月 18 日发布的相关公告,该证券发行人因违规经营被北京银监局处以罚款,并责令改正。

2、17 北京银行 CD191(证券代码 111712191)

根据 2017 年 8 月 18 日发布的相关公告,该证券发行人因违规经营被北京银监局处以罚款,并责令改正。

3、17 宁波银行 CD128(证券代码 111781266)

根据 2017 年 2 月 24 日及 2017 年 10 月 30 日发布的相关公告, 该证券发行人因违规经营被宁波银监局处以罚款。

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

8.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库,本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	23,724.07
2	应收证券清算款	3,029,632.88
3	应收股利	-
4	应收利息	17,019,657.47
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,073,014.42

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暂时停牌等流通受限股票。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

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
招商安博保本混合 A	2,868	363,415.19	600,296,000.00	57.59%	441,978,775.43	42.41%
招商安博保本混合 C	305	93,727.19	150,094.50	0.53%	28,436,698.15	99.47%
合计	3,173	337,491.83	600,446,094.50	56.07%	470,415,473.58	43.93%

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	招商安博保本混合 A	88.89	0.0000%
	招商安博保本混合 C	-	-
	合计	88.89	0.0000%

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	招商安博保本混合 A	0
	招商安博保本混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	招商安博保本混合 A	0
	招商安博保本混合 C	0
	合计	0

§10 开放式基金份额变动

单位:份

项目	招商安博保本混合 A	招商安博保本混合 C
基金合同生效日(2016 年 5 月 25 日)基金份额总额	1,783,370,129.58	71,165,584.95
本报告期期初基金份额总额	1,753,043,834.86	55,558,949.16
本报告期基金总申购份额	64,591.19	73,589.34
减:本报告期基金总赎回份额	710,833,650.62	27,045,745.85
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,042,274,775.43	28,586,792.65

§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

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

2、2017 年 8 月,陈四清先生担任中国银行股份有限公司董事长、执行董事、董事会战略发展委员会主席及委员等职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

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 2 年, 本报告期应支付给德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)的报酬为人民币 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、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员受到监管部门的稽查或处罚的书面通知或文件。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安	3	37,379,265.29	47.87%	34,811.25	48.78%	-
东兴证券	3	20,585,882.79	26.37%	19,171.93	26.87%	-
西藏东方财富	1	6,759,497.43	8.66%	4,943.31	6.93%	-
广发证券	1	4,613,449.84	5.91%	4,296.54	6.02%	-
中金公司	2	4,372,826.00	5.60%	4,072.59	5.71%	-
中信证券	2	3,351,623.00	4.29%	3,121.28	4.37%	-
银河证券	1	1,015,869.50	1.30%	946.08	1.33%	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
大通证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	3	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
第一创业证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	3	-	-	-	-	-
申万宏源	4	-	-	-	-	-
中银国际	3	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	6	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	3	-	-	-	-	-

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
国泰君安	-	-	25,000,000.00	0.44%	-	-
东兴证券	-	-	78,000,000.00	1.37%	-	-
西藏东方财富	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	100,000,000.00	1.76%	-	-
中金公司	-	-	49,000,000.00	0.86%	-	-
中信证券	-	-	145,000,000.00	2.55%	-	-
银河证券	-	-	220,000,000.00	3.87%	-	-
中泰证券	-	-	1,364,000,000.00	24.01%	-	-
海通证券	-	-	190,000,000.00	3.34%	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
第一创业证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	218,000,000.00	3.84%	-	-
国海证券	-	-	673,000,000.00	11.84%	-	-
长江证券	-	-	310,000,000.00	5.46%	-	-
天风证券	-	-	40,000,000.00	0.70%	-	-
中信建投	-	-	848,000,000.00	14.92%	-	-
华安证券	-	-	73,000,000.00	1.28%	-	-
招商证券	-	-	1,349,000,000.00	23.74%	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20170101-20171231	600,296,000.00	-	-	600,296,000.00	56.06%
	2	20170101-20170602	500,111,500.00	-	500,111,500.00	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况,可能会出现集中赎回甚至巨额赎回从而引发基金净值剧烈波动,甚至引发基金的流动性风险,基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请,基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。							

招商基金管理有限公司

2018 年 3 月 30 日

(上接 D281 版)

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

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

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

7.4.9.1.1 受限证券类别:股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
603161	科华控股	2017 年 12 月 28 日	2018 年 1 月 5 日	新股流通受限	16.75	16.75	1,239	20,753.25	20,753.25	-
603080	新疆火炬	2017 年 12 月 25 日	2018 年 1 月 3 日	新股流通受限	13.60	13.60	1,187	16,143.20	16,143.20	-
7.4.9.1.2 受限证券类别:债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
7.4.9.1.3 受限证券类别:权证										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:份)	期末成本总额	期末估值总额	备注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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。7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 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。

7.4.9.3.2 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。

7.4.10 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(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	82,793.40	36,896.45	-	119,689.85
债券投资	-	-	-	-
合计	82,793.40	36,896.45	-	119,689.85

单位:人民币元

资产	上年度末(2016 年 12 月 31 日)			
	第一层次	第二层次	第三层次	合计
交易性金融资产				
股票投资	48,307,431.70	237,710.29	-	48,545,141.99
债券投资	-	552,916,733.30	-	552,916,733.30
合计	48,307,431.70	553,154,443.59	-	601,461,875.29

(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

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	119,689.85	8.89
	其中:股票	119,689.85	8.89
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	1,209,065.46	89.76
7	其他各项资产	18,289.46	1.36
8	合计	1,347,044.77	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	85,588.71	8.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,143.20	1.52
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	17,957.94	1.69
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	119,689.85	11.24

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前十名股票投资明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	603477	振静股份	1,955	37,027.70	3.48
2	603161	科华控股	1,239	20,753.25	1.95
3	603283	赛腾股份	1,349	19,614.46	1.84
4	603329	上海雅仕	1,183	17,957.94	1.69
5	603080	新疆火炬	1,187	16,143.20	1.52
6	603655	朗博科技	881	8,193.30	0.77

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	601988	中国银行	12,999,189.00	1.64
2	600048	保利地产	8,994,272.00	1.13
3	600498	烽火通信	6,495,897.98	0.82
4	601166	兴业银行	6,359,183.00	0.80
5	601318	中国平安	6,358,410.00	0.80
6	600019	宝钢股份	4,499,607.00	0.57
7	600637	东方明珠	2,997,784.70	0.38
8	600028	中国石化	2,399,628.00	0.30
9	600030	中信证券	2,383,600.00	0.30
10	600919	江苏银行	1,589,860.00	0.20
11	601108	财通证券	129,049.20	0.02
12	601019	山东出版	128,320.80	0.02
13	600025	华能水电	73,988.32	0.01
14	603260	合盛硅业	54,577.92	0.01
15	601326	秦港股份	50,174.28	0.01
16	601949	中国出版	48,627.06	0.01
17	603661	恒林股份	47,210.40	0.01
18	603626	科森科技	47,049.60	0.01
19	603730	岱美股份	43,286.04	0.01
20	603619	中曼石油	39,793.60	0.01

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	601988	中国银行	14,193,225.00	1.79
2	601318	中国平安	13,257,413.06	1.67
3	600048	保利地产	10,266,708.92	1.29
4	600498	烽火通信	9,164,571.86	1.15
5	600030	中信证券	7,791,237.60	0.98
6	300070	碧水源	7,743,554.03	0.97
7	600398	海澜之家	6,711,982.00	0.84
8	000423	东阿阿胶	6,692,257.00	0.84
9	600518	康美药业	6,587,434.45	0.83
10	600018	上港集团	6,448,171.96	0.81
11	601166	兴业银行	6,078,956.88	0.77
12	601985	中国核电	6,010,841.00	0.76
13	600019	宝钢股份	4,828,746.22	0.61
14	600919	江苏银行	4,790,583.00	0.60
15	600637	东方明珠	2,496,595.40	0.31
16	600028	中国石化	2,244,935.00	0.28
17	601108	财通证券	239,727.60	0.03
18	601375	中原证券	239,454.15	0.03
19	601326	秦港股份	234,789.90	0.03
20	603260	合盛硅业	219,206.40	0.03

注:1、卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票;

2、基金持有的股票分类为交易性金融资产的,本项 “累计卖出金额”按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.3 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	57,256,952.17
卖出股票收入(成交)总额	122,336,093.11

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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,适度运用股指期货等金融衍生品。本基金利用股指期货合约流动性好、交易成本低和杠杆操作等特点,提高投资组合运作,有效管理市场风险。

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的原则,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	2,588.02
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	15,701.44
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	18,289.46

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	603161	科华控股	20,753.25	1.95	新股锁定
2	603080	新疆火炬	16,143.20	1.52	新股锁定

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

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
招商丰乐混合 A	67	14,990.22	1,000,000.00	99.57%	4,344.44	0.43%
招商丰乐混合 C	177	11.42	-	-	2,021.44	100.00%
合计	244	4,124.45	1,000,000.00	99.37%	6,365.88	0.63%

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	招商丰乐混合 A	4,243.64	0.4225%
	招商丰乐混合 C	1,640.92	81.1758%
	合计	5,884.56	0.5847%

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	招商丰乐混合 A	0-10
	招商丰乐混合 C	0-10
	合计	0-10
本基金基金经理持有本开放式基金	招商丰乐混合 A	0
	招商丰乐混合 C	0-10
	合计	0-10

§10 开放式基金份额变动

单位:份

项目	招商丰乐混合 A	招商丰乐混合 C
基金合同生效日(2016 年 8 月 25 日)基金份额总额	800,003,215.53	1,877.91
本报告期期初基金份额总额	800,003,215.53	1,874.94
本报告期基金总申购份额	2,869.18	158.38
减:本报告期基金总赎回份额	799,001,740.27	11.88
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,004,344.44	2,021.44

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期没有举行基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

2017 年 9 月 1 日,中国建设银行发布公告,聘任纪伟为中国建设银行资产托管业务部总经理。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未作改变。

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

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	
中泰证券	2	94,065,274.44	53.02%	87,602.62	53.02%	-
西部证券	1	64,270,128.98	36.23%	59,855.12	36.23%	-
广发证券	1	12,591,702.04	7.10%	11,726.69	7.10%	-
中银国际	2	6,486,419.33	3.66%	6,040.85	3.66%	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
安信证券	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
中泰证券	22,558,270.60	69.24%	1,912,000,000.00	65.35%	-	-
西部证券	9,982,418.40	30.64%	674,000,000.00	23.03%	-	-
广发证券	38,372.85	0.12%	321,000,000.00	10.97%	-	-
中银国际	-	-	3,000,000.00	0.10%	-	-
平安证券	-	-	16,000,000.00	0.55%	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20170101-20171231	799,999,500.00	-	798,999,500.00	1,000,000.00	99.37%
产品特有风险							
本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况,可能会出现集中赎回甚至巨额赎回从而引发基金净值剧烈波动,甚至引发基金的流动性风险,基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请,基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于 2018 年 3 月 9 日发布公告, 本基金自 2018 年 3 月 14 日起至 2018 年 4 月 9 日 17:00 止以通讯方式召开基金份额持有人大会,审议《关于终止招商丰乐灵活配置混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》。

招商基金管理有限公司

2018 年 3 月 30 日