（上接B637版）

会计主体:招商安博保本混合型证券投资基金
报告截止日：2018年5月25日

单位:人民币元

资 产	本期末 2018年5月25日	上年度末 2017年12月31日
资 产:		
银行存款	70,012,613.84	5,259,313.65
结算备付金	1,092,605.95	1,896,601.43
存出保证金	24,590.98	23,724.07
交易性金融资产	286,723,000.00	1,019,479,687.02
其中:股票投资	–	43,094,687.02
基金投资	–	–
债券投资	286,723,000.00	976,385,000.00
资产支持证券投资	–	–
贵金属投资	–	–
衍生金融资产	–	–
买入返售金融资产	480,000,000.00	52,680,259.52
应收证券清算款	185,105,711.90	3,029,632.88
应收利息	3,369,137.01	17,019,657.47
应收股利	–	–
应收申购款	–	–
递延所得税资产	–	–
其他资产	–	–
资产总计	1,026,327,659.68	1,099,388,876.04
负债和所有者权益	本期末 2018年5月25日	上年度末 2017年12月31日
负 债:		
短期借款	–	–
交易性金融负债	–	–
衍生金融负债	–	–
卖出回购金融资产款	–	–
应付证券清算款	–	1,964,496.23
应付赎回款	13,844,177.03	2,091,136.59
应付管理人报酬	859,007.03	1,128,421.12
应付托管费	143,167.83	188,070.19
应付销售服务费	7,911.29	12,849.48
应付交易费用	38,474.44	76,324.66
应交税费	1,222.59	–
应付利息	–	–
应付利润	–	–
递延所得税负债	–	–
其他负债	246,985.05	150,000.00
负债合计	15,140,945.26	5,611,298.27
所有者权益:		
实收基金	969,624,569.90	1,070,861,568.08
未分配利润	41,562,144.52	22,916,009.69
所有者权益合计	1,011,186,714.42	1,093,777,577.77
负债和所有者权益总计	1,026,327,659.68	1,099,388,876.04

注:报告截止日2018年5月25日,招商安博保本混合A基金份额净值1.0430元,基金份额总额950,560,304.76份;招商安博保本混合C基金份额净值1.0310元,基金份额总额19,064,265.14份;总份额合计969,624,569.90份。

6.2 利润表
会计主体:招商安博保本混合型证券投资基金
本报告期:2018年1月1日至2018年5月25日

单位:人民币元

项 目	本期 2018年1月1日至2018年5月25日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
一、收入	28,601,066.54	29,987,483.08
1.利息收入	17,340,236.49	27,455,571.93
其中:存款利息收入	180,880.34	212,290.90
债券利息收入	15,568,920.59	21,891,187.16
资产支持证券利息收入		
买入返售金融资产收入	1,590,435.56	5,352,093.87
其他利息收入	–	–
2.投资收益（损失以“-”填列）	3,511,976.44	-6,899,475.07
其中:股票投资收益	8,714,469.60	
基金投资收益		
债券投资收益	-5,202,493.16	-6,899,475.07
资产支持证券投资收益	–	–
贵金属投资收益		
衍生工具收益		
股利收益		
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7,489,819.96	7,470,964.53
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	–	–
5.其他收入（损失以“-”号填列）	259,033.65	1,960,421.69
减:二、费用	6,446,993.72	12,158,258.27
1、管理人报酬	5,071,939.76	10,112,024.93
2、托管费	845,323.23	1,685,337.56
3、销售服务费	50,803.92	122,588.97
4、交易费用	235,954.11	2,850
5、利息支出	64,583.83	29,882
其中:卖出回购金融资产支出	64,583.83	29,882
6、税金及附加	2,947.55	
7、其他费用	175,441.32	205,574.81
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	22,154,072.82	17,829,224.81
减:所得税费用	–	–
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	22,154,072.82	17,829,224.81

6.3 所有者权益（基金净值）变动表
会计主体:招商安博保本混合型证券投资基金
本报告期:2018年1月1日至2018年5月25日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年5月25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）	1,070,861,568.08	22,916,009.69	1,093,777,577.77
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	–	22,154,072.82	22,154,072.82
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）	-101,236,998.18	-3,507,937.99	-104,744,936.17
其中:1.基金申购款	323,538.25	8,189.21	331,727.46
2.基金赎回款	-101,560,536.43	-3,516,127.20	-105,076,663.63
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）	969,624,569.90	41,562,144.52	1,011,186,714.42
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,808,602,784.02	-4,861,101.43	1,803,741,682.59
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	–	17,829,224.81	17,829,224.81
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）	-600,757,104.81	-1,123,085.09	-601,880,189.90
其中:1.基金申购款	68,424.19	-150.04	68,274.15
2.基金赎回款	-600,825,529.00	-1,122,935.05	-601,948,464.05
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）	1,207,845,679.21	11,845,038.29	1,219,690,717.50

报表附注为财务报表的组成部分。
本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:
金 旭 欧 志 明 何剑萍
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注
6.4.1 基金基本情况
招商安博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》、《招商安博保本混合型证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规的规定,经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]645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,担保人或基金管理人和基金托管人认可的其他机构继续与本基金管理人签订《保证合同》或《风险买断合同》,同时本基金满足法律法规和本合同规定的基金存续要求的,本基金将转入下一保本周期（本基金第一个保本周期间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“招商安博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。本基金根据是否收取认购费、申购费和销售服务费,以及赎回费收取方式的不同,将基金份额分为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1,854,535,714.53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0204号验资报告。《招商安博保本混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”）于2016年5月25日正式生效。本基金的基金管理人为招商基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及截至报告期末最新公告的《招商安博保本混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围主要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(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括中小企业私募债等)、国债期货、货币市场工具、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的投资组合为:股票、权证等权益类资产占基金资产的比例不高于40%;债券、货币市场工具等固定收益类资产占基金资产的比例不低于60%,其中现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值5%。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)。

6.4.2 会计报表的编制基础
本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定（以下简称“企业会计准则”)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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明
本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金2017年5月25日(转型日)的财务状况以及自2018年1月1日至2018年5月25日(转型日）止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计
本报告期所采用的会计政策，会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明
6.4.5.1 会计政策变更的说明
本基金本报告期内无需说明的重大会计政策变更。
6.4.5.2 会计估计变更的说明
本基金本报告期内无需说明的重大会计估计变更。
6.4.5.3 差错更正的说明
本基金本报告期内无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项
根据财政部、国家税务总局财税[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。

6.4.8 关联方关系
6.4.8.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况
本报告期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。

6.4.8.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
招商基金管理有限公司	基金管理人
中国银行	基金托管人
招商证券股份有限公司（以下简称“招商证券”）	基金管理人的股东
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

6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易
6.4.9.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年5月25日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
招商证券	20,307,705.52	14.79%	–	–

6.4.9.1.2 债券交易
本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券交易。
6.4.9.1.3 债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年5月25日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
招商证券	750,000,000.00	44.83%	103,000,000.00	5.27%

6.4.9.1.4 权证交易
本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的权证交易。
6.4.9.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期2018年1月1日至2018年5月25日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
招商证券	18,912.05	15.04%	14,487.64	39.52%
关联方名称	上年度可比期间2017年1月1日至2017年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
招商证券	–	–	–	–

注:1、本基金与关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立;
2、基金对该类交易的佣金的计算方式是按合同约定的佣金率计算。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供研究成果和市场信息等证券综合服务,并不收取额外对价。

6.4.9.2 关联方报酬
6.4.9.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年5月25日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	5,071,939.76	10,112,024.93
其中:支付销售机构的客户维护费	881,310.57	1,886,484.19

注:支付基金管理人招商基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值× 1.50%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:
日基金管理人报酬＝前一日基金资产净值× 1.50%÷ 当年天数。

6.4.9.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年5月25日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	845,323.23	1,685,337.56

注:支付基金托管人中国银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:
日基金托管费＝前一日基金资产净值× 0.25%÷ 当年天数。

6.4.9.2.3 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1月1日至2018年5月25日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	招商安博保本混合A	招商安博保本混合C	合计
招商基金管理有限公司	–	1,235.57	1,235.57
招商银行	–	4,077.56	4,077.56
中国银行	–	38,697.73	38,697.73
合计	–	44,010.85	44,010.85
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	招商安博保本混合A	招商安博保本混合C	合计
招商基金管理有限公司	–	2,035.81	2,035.81
招商银行	–	20,852.95	20,852.95
中国银行	–	84,710.32	84,710.32
合计	–	107,599.08	107,599.08

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

6.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易
单位:人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年5月25日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
–	–	–	–	–	–	–
	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日					
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	19,999,552.05	–	–	–	–	–

6.4.9.4 各关联方投资本基金的情况
6.4.9.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
本报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。
6.4.9.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况
本报告期末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

6.4.9.5 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 2018年1月1日至2018年5月25日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	70,012,613.84	173,872.26	5,852,655.40	201,260.26

注:本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管,按银行同业利率计息。
6.4.9.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况
本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。
6.4.10 期末（2018年5月25日）本基金持有的流通受限证券
6.4.10.1 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。
6.4.10.2 期末持有的暂时停牌股票
本基金本报告期末无暂时停牌等流通受限股票。
6.4.10.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券
6.4.10.3.1 银行间市场债券正回购
本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。
6.4.10.3.2 交易所市场债券正回购
本基金本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。
6.4.11 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项
本基金本报告期内无需要说明有助于理解和分析财务报表的其他事项。

§ 7 投资组合报告（转型后）

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	22,467,797.56	27.72
	其中:股票	22,467,797.56	27.72
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	19,594,000.00	24.18
	其中:债券	19,594,000.00	24.18
	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	22,000,000.00	27.15
	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	16,309,788.97	20.12
8	其他各项资产	672,076.50	0.83
9	合计	81,043,663.03	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合
7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	1,068,254.00	1.38
C	制造业	16,755,879.56	21.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	740,300.00	0.96
F	批发和零售业	1,475,584.00	1.91
G	交通运输、仓储和邮政业	854,392.00	1.10
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	743,966.00	0.96
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	829,422.00	1.07
S	综合	–	–
	合计	22,467,797.56	29.02

7.2.2 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。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002024	苏宁易购	104,800	1,475,584.00	1.91
2	600271	航天信息	53,200	1,344,364.00	1.74
3	600519	贵州茅台	1,800	1,316,628.00	1.70
4	600872	中炬高新	44,700	1,251,600.00	1.62
5	600486	扬农化工	21,500	1,202,495.00	1.55
6	002475	立讯精密	53,300	1,201,382.00	1.55
7	002372	伟星新材	67,300	1,190,537.00	1.54
8	600196	复星医药	28,500	1,179,615.00	1.52
9	600276	恒瑞医药	15,200	1,151,552.00	1.49
10	600028	中国石化	164,600	1,068,254.00	1.38

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上的半年度报告正文。7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值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	600028	中国石化	1,783,213.00	2.30
2	601318	中国平安	1,674,765.00	2.16
3	600519	贵州茅台	1,564,343.00	2.01
4	002024	苏宁易购	1,533,472.00	1.98
5	601607	上海医药	1,385,732.00	1.79
6	600271	航天信息	1,384,974.00	1.79
7	601225	陕西煤业	1,355,085.00	1.75
8	600563	法拉电子	1,338,313.00	1.73
9	002372	伟星新材	1,318,043.00	1.70
10	002475	立讯精密	1,317,055.00	1.70
11	600196	复星医药	1,231,668.00	1.59
12	600872	中炬高新	1,227,828.00	1.59
13	600486	扬农化工	1,219,907.00	1.58
14	600276	恒瑞医药	1,212,676.00	1.57
15	002747	埃斯顿	961,265.00	1.24
16	600048	保利地产	921,618.00	1.19
17	002236	大华股份	916,422.00	1.18
18	600887	伊利股份	915,380.00	1.18
19	600009	上海机场	914,452.00	1.18
20	000651	格力电器	891,225.00	1.15

注:1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票;
2、基金持有的股票分类为交易性金融资产的,本项的“累计买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列,不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	601607	上海医药	1,331,065.00	1.72
2	601225	陕西煤业	1,265,772.00	1.63
3	601699	潞安环能	916,673.10	1.18
4	600563	法拉电子	854,370.00	1.10
5	002236	大华股份	826,089.00	1.07
6	601318	中国平安	805,586.00	1.04
7	600048	保利地产	785,700.00	1.01
8	600030	中信证券	772,912.00	1.00
9	600028	中国石化	696,051.00	0.90
10	600519	贵州茅台	144,000.00	0.19
11	002179	中航光电	120,776.00	0.16

注:1、卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票;
2、基金持有的股票分类为交易性金融资产的,本项 “累计卖出金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列,不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票成本（成交）总额	32,345,783.40
卖出股票收入（成交）总额	8,518,994.10

注:1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票,卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票;
2、“买入股票成本（成交）总额”、“卖出股票收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列,不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	–	–
2	央行票据	–	–
3	金融债券	–	–
	其中:政策性金融债	–	–
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）	–	–
8	同业存单	19,594,000.00	25.30
9	其他	–	–
10	合计	19,594,000.00	25.30

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	111899275	18广州农村商业银行CD042	100,000	9,797,000.00	12.65
1	111899626	18宁波银行CD117	100,000	9,797,000.00	12.65

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有股指期货合约。
7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策
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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
7.11.1 本期国债期货投资政策
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。
7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货合约。
7.11.3 本期国债期货投资评价
本基金本报告期末未持有国债期货合约。

7.12 投资组合报告附注
7.12.1
报告期内基金投资的前十名证券除18宁波银行CD117（证券代码111899626）外其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查,不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
根据2018年6月22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。
根据2017年10月27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。
根据2017年7月14日发布的相关公告，该证券发行人因未依法履行职责被银监会深圳监管局处以罚款。
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。
7.12.2
本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库,本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	36,040.70
2	应收证券清算款	565,303.20
3	应收股利	–
4	应收利息	65,740.08
5	应收申购款	4,992.52
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	672,076.50

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。
7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末投资前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 7 投资组合报告（转型前）

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	–	–
	其中:股票	–	–
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	286,723,000.00	27.94
	其中:债券	286,723,000.00	27.94
	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	480,000,000.00	46.77
	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	71,105,219.79	6.93
8	其他资产	188,499,439.89	18.37
9	合计	1,026,327,659.68	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合
7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合
本基金报告期末未持有股票。
7.2.2 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。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细
本基金报告期末未持有股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动
7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600114	东睦股份	8,978,657.56	0.82
2	300373	扬杰科技	3,724,145.00	0.34
3	603799	华友钴业	3,181,835.00	0.29
4	600031	三一重工	2,178,811.00	0.20
5	002013	中航机电	2,171,999.00	0.20
6	603538	艾迪精密	2,155,088.00	0.20
7	601688	华泰证券	2,129,967.00	0.19
8	600498	烽火通信	2,126,959.68	0.19
9	601699	潞安环能	2,126,751.00	0.19
10	300054	鼎龙股份	2,123,761.00	0.19
11	300298	三诺生物	1,476,616.66	0.14
12	603605	珀莱雅	1,079,394.00	0.10
13	300188	美亚柏科	1,068,238.00	0.10
14	603766	隆鑫通用	1,064,747.50	0.10
15	600970	中材国际	1,062,910.47	0.10
16	600138	中青旅	1,062,472.00	0.10
17	000426	兴业矿业	1,062,448.00	0.10
18	603338	浙江鼎力	1,061,391.00	0.10
19	601877	正泰电器	1,060,942.00	0.10
20	000425	徐工机械	1,060,800.00	0.10

注:1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票;
2、基金持有的股票分类为交易性金融资产的,本项的“累计买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列,不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600114	东睦股份	9,348,809.96	0.85
2	600031	三一重工	5,962,630.00	0.55
3	600048	保利地产	4,876,898.06	0.45
4	603799	华友钴业