招商丰泰灵活配置混合型证券投资基金(LOF) 2018年半年度报告摘要

基金管理人:招商基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
送出日期:2018年8月28日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年8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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年1月1日起至6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	招商丰泰灵活配置混合(LOF)
场内简称	招商丰泰
基金主代码	161722
交易代码	161722
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年4月17日
基金管理人	招商基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	53,570,938.12份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2015年7月22日

2.2 基金产品说明

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	资产配置策略:本基金的大类资产配置主要通过对宏观经济运行状况、国家财政和货币政策、国家产业政策以及资本市场资金环境、证券市场走势的分析,预测宏观经济的发展趋势,并据此评价未来一段时间股票、债券市场相对收益率,主动调整股票、债券类资产在给定区间内的动态配置,以使基金在保持总体风险水平相对稳定的基础上,优化投资组合。 股票投资策略:本基金通过定量和定性相结合的方法进行个股自下而上的选择。 债券投资策略:本基金采用的固定收益品种主要投资策略包括:久期策略、期限结构策略和个券选择策略等。 权证投资策略:本基金对权证资产的投资主要是通过分析影响权证内在价值最重要的两种因素——标的资产价格以及市场隐含波动率的变化,灵活构建避险策略,波动率差策略以及套利策略。 股指期货投资策略:本基金采取套期保值的方式参与股指期货的投资交易,以管理市场风险和调节股票仓位为主要目的。 中小企业私募债券投资策略:中小企业私募债具有票面利率较高、信用风险较大、二级市场流动性较差等特点。因此本基金审慎投资中小企业私募债券。
业绩比较基准	中国人民银行公布金融机构人民币一年期存款基准利率+3%(单利年化)
风险收益特征	本基金是混合型基金,在证券投资基金中属于预期风险收益水平中等的投资品种,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。

2.3 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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	潘西里	王永民
	联系电话	0755–83196666	010–66594896
	电子邮箱	cmf@cmfchina.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400–887–9555	95566
传真		0755–83196475	010–66594942

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.cmfchina.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年1月1日) – (2018年6月30日)
本期已实现收益	1,085,519.37
本期利润	–263,297.47
加权平均基金份额本期利润	–0.0043
本期基金份额净值增长率	–0.43%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.1706
期末基金资产净值	62,710,697.30
期末基金份额净值	1.171

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①–③	②–④
过去一个月	–2.25%	1.52%	0.37%	0.01%	–2.62%	1.51%
过去三个月	0.34%	1.21%	1.12%	0.01%	–0.78%	1.20%
过去六个月	–0.43%	1.26%	2.23%	0.01%	–2.66%	1.25%
过去一年	2.99%	0.90%	4.50%	0.01%	–1.51%	0.89%
过去三年	14.80%	0.54%	13.62%	0.01%	1.18%	0.53%
自基金合同生效起至今	17.10%	0.52%	14.71%	0.01%	2.39%	0.51%

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

§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,公司注册资本金为人民币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年上半年获奖情况如下:

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》

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
王刚	本基金基金经理	2017年7月28日	–	6	男,硕士。2011年7月加入中国人保资产管理股份有限公司,曾任助理组合经理、产品经理;2014年5月加入泰康资产管理有限责任公司,曾任资产管理部高级经理;2015年7月加入招商基金管理有限公司,曾任固定收益投资部研究员、招商丰嘉灵活配置混合型证券投资基金基金经理,现任招商可转债分级债券型证券投资基金、招商丰美灵活配置混合型证券投资基金、招商丰泽灵活配置混合型证券投资基金、招商丰泰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、招商丰融灵活配置混合型证券投资基金、招商瑞丰灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理。

注:1、本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日,后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告(生效)日期;

2、证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

基金管理人声明:在本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关法律法规及其各项实施准则的规定以及本基金的基金合同等基金法律文件的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的前提下,为基金持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作整体合法合规,无损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围以及投资运作符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

基金管理人严格控制不同投资组合之间的同日反向交易,严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。确因投资组合的投资策略或流动性等需要而发生的同日反向交易,基金管理人要求相关投资组合经理提供决策依据,并留存记录备查,完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合等除外。

本报告期内,本基金各项交易均严格按照相关法律法规、基金合同的有关要求执行,本基金管理人所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易不存在成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情形。报告期内未发现有可能导致不公平交易和利益输送的重大异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

宏观与政策分析:

2018年上半年,经济增长有所放缓,GDP同比增长6.8%,增速较2017年回落0.1%,其中投资、消费和净出口均有所下行。投资方面,年初以来固定资产投资增速持续下滑,上半年,全国固定资产投资297316亿元,同比增长6%,增速较2017年全年大幅回落1.2%。其中制造业固定资产投资增速加快2%至6.8%;房地产固定资产投资增速维持在7.7%的水平,与一季度持平;基建投资成为了拖累经济的主要因素,新口径下的基建投资(不含电力、热力、燃气及水生产和供应业)同比增长7.3%,增速比1月至5月回落2.1%,而电力、热力、燃气及水生产和供应业投资下降10.3%,较2017年全年0.8%的增速出现断崖式下滑。消费方面,年初以来社零增速继续徘徊在个位数增长,2018年1月至6月,全国社会消费品零售总额180018亿元,同比增长9.4%,社零增速创下近年来新低,房地产下游行业的疲弱是主要原因。净出口方面,上半年全国货物贸易进出口总值14.12万亿元人民币,同比增长7.9%。其中,出口75120亿元,同比增长4.9%;进口66107亿元,同比增长11.5%。实现贸易顺差9013亿元,比上年同期收窄26.7%,在中美贸易摩擦不断升级的背景下,未来净出口形势仍然不容乐观。

在经济增速回落的情况下,社会融资增速也呈现下行的趋势,6月末社会融资规模存量为183.27万亿元,同比增长9.8%,近年来增速首次回落到个位数。从结构上来看,表外非标融资继续萎缩,是拖累社融增速下滑的主要原因。6月末委托贷款余额占比7.2%,同比降低1.1%;信托贷款余额占比4.6%,同比净增加0.1%;未贴现的银行承兑汇票余额占比2.3%,同比降低0.4%;企业债券余额占比10.5%,同比降低0.1%。企业融资渠道的受阻对实体经济的影响目前已经逐步显现。尽管监管机构同时通过上浮存款利率上限、降准、MLF担保扩容等手段,支持实体贷款和债券融资。但在严监管的背景下,原有的非标融资转至表内贷款、债券的过程存在一定难度,整体社融增速仍将趋于下行。

2018年上半年通胀压力依旧不大,1至6月CPI同比增长2.0%,三季度随着夏季高温来临,鲜菜价格将季节性回落,猪肉进入消费淡季,预计食品CPI仍难有上行趋势,通胀水平温和可控。

股票市场回顾:

2018上半年股票市场震荡下行,指数权重板块震荡走低,成长板块反弹后回落,整体来看市场仅存结构性机会,防御板块表现相对较好。股票市场的持续低迷表现受经济去杠杆预期、中美贸易摩擦预期、市场情绪悲观预期等多方面因素共同作用,短期看,市场价格已对多重悲观预期有所反应。当前权益市场估值处于相对低位,部分行业景气度仍然较高,预期市场有望逐渐迎来企稳契机。

基金操作回顾:

回顾2018上半年的基金操作,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,根据市场行情的变化及时进行了组合调整。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金份额净值增长率为–0.43%,同期业绩基准增长率为2.23%。

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2018年下半年,经济持续回落概率较大,同时监管层面对去杠杆的表述也有所松动,预计货币政策将继续维持在相较去年偏松的水平,整体利率水平上行空间不大,但另一方面,目前利率债收益率已经下降到较低水平,受制于地方债的比价效应以及MLF利率、逆回购利率等政策利率的底部约束,长端利率债下行空间也难打开。信用债方面,低等级信用债的供需矛盾仍旧是未来信用债市场的主要矛盾,我们预计后续低等级信用债内部将进一步分化,资质相对较好的信用债将得到市场认可,摆脱目前被"一刀切"的困境。整体来看,我们预计下半年债券市场将呈现震荡格局,可以期待一定的交易性机会,并自下而上精选个券。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内,本基金的估值业务严格按照相关的法律法规、基金合同以及《招商基金管理有限公司基金估值委员会管理制度》进行。基金核算部负责日常的基金资产的估值业务,执行基金估值政策。另外,公司设立由投资和研究部门、风险管理部、基金核算部、法律合规部负责人和基金经理代表组成的估值委员会。公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历。公司估值委员会主要负责制定、修订和完善基金估值政策和程序,定期评价现有估值政策和程序的适用性及对估值程序执行情况进行监督。

投资和研究部门以及基金核算部共同负责关注相关投资品种的动态,评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件,从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种;投资和研究部门定期审核公允价值的确认和计量;研究部提出合理的数量分析模型对需要进行估值测算或者调整的投资品种进行公允价值定价与计量并定期对估值政策和程序进行评价,以保证其持续适用;基金核算部定期审核估值政策和程序的一致性,并负责与托管行沟通估值调整事项;风险管理部负责估值委员会工作流程中的风险控制;法律合规部负责日常的基金估值调整结果的事后复核监督工作;法律合规部与基金核算部共同负责估值调整事项的信息披露工作。

基金经理代表向估值委员会提供估值参考信息,参与估值政策讨论;对需采用特别估值程序的证券,基金及时启动特别估值程序,由公司估值委员会集体讨论议定特别估值方案,咨询会计事务所的专业意见,并与托管行沟通后由基金核算部具体执行。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。截止报告期末本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司签署服务协议,由其按约定提供相关债券品种、流通受限股票的估值参考数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规的规定和基金合同的约定,以及本基金的实际运作情况,本基金报告期未进行利润分配。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。

4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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,中国银行股份有限公司(以下称"本托管人")在招商丰泰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)(以下称"本基金")的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,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,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的"金融工具风险及管理"部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:招商丰泰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)

报告截止日:2018年6月30日

单位:人民币元

资产	本期末2018年6月30日	上年度末2017年12月31日
资产:		
银行存款	14,404,358.96	6,040,180.31
结算备付金	520,434.91	130,372.96
存出保证金	38,045.28	80,267.93
交易性金融资产	57,590,901.96	80,132,653.54
其中:股票投资	57,590,901.96	21,235,311.00
基金投资	–	–
债券投资	–	58,897,342.54
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	–	–
应收证券清算款	–	–
应收利息	4,128.02	1,210,163.80
应收股利	–	–
应收申购款	581.18	1,030.16
递延所得税资产	–	–
其他资产	–	–
资产总计	72,558,450.31	87,594,668.70
负债和所有者权益	本期末2018年6月30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	9,205,236.28	–
应付赎回款	128,275.81	207,402.32
应付管理人报酬	52,665.32	75,787.97
应付托管费	13,166.31	18,947.00
应付销售服务费	–	–
应付交易费用	245,092.63	30,108.06
应交税费	–	–
应付利息	–	–
应付利润	–	–
递延所得税负债	–	–
其他负债	203,316.66	150,000.00
负债合计	9,847,753.01	482,245.35
所有者权益:		
实收基金	53,570,938.12	74,102,334.83
未分配利润	9,139,759.18	13,010,088.52
所有者权益合计	62,710,697.30	87,112,423.35
负债和所有者权益总计	72,558,450.31	87,594,668.70

注:报告截止日2018年6月30日,基金份额净值1.171元,基金份额总额53,570,938.12份。

6.2 利润表

会计主体:招商丰泰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)

本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间2017年1月1日至2017年6月30日
一、收入	1,163,272.93	15,428,954.13
1.利息收入	219,958.84	5,380,368.95
其中:存款利息收入	49,730.28	126,158.59
债券利息收入	169,269.66	4,977,320.61
资产支持证券利息收入	–	–
买入返售金融资产收入	958.90	276,889.75
其他利息收入	–	–
2.投资收益(损失以"–"填列)	2,280,470.58	–2,890,532.57
其中:股票投资收益	1,898,747.08	5,945,181.91
基金投资收益	–	–
债券投资收益	–48,346.67	–9,015,714.48
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	430,070.17	180,000.00
3.公允价值变动收益(损失以"–"号填列)	–1,348,816.84	11,891,138.13
4.汇兑收益(损失以"–"号填列)	–	–
5.其他收入(损失以"–"号填列)	11,660.35	1,047,979.62
减:二、费用	1,426,570.40	2,890,258.56
1.管理人报酬	353,386.47	1,722,254.19
2.托管费	88,346.61	430,563.65
3.销售服务费	–	–
4.交易费用	757,483.77	150,176.94
5.利息支出	1,888.68	346,626.96
其中:卖出回购金融资产支出	1,888.68	346,626.96
6.税金及附加	16.86	–
7.其他费用	225,448.01	240,636.82
三、利润总额(亏损总额以"–"号填列)	–263,297.47	12,538,695.57
减:所得税费用	–	–
四、净利润(净亏损以"–"号填列)	–263,297.47	12,538,695.57

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:招商丰泰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)

本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期2018年1月1日至2018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)	74,102,334.83	13,010,088.52	87,112,423.35
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	–263,297.47	–263,297.47
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)	–20,531,396.71	–3,607,031.87	–24,138,428.58
其中:1.基金申购款	2,385,841.44	448,761.13	2,834,602.57
2.基金赎回款	–22,917,238.15	–4,055,793.00	–26,973,031.15
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)	53,570,938.12	9,139,759.18	62,710,697.30
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)	343,367,930.18	27,154,160.25	370,522,090.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	12,538,695.57	12,538,695.57
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)	–239,207,541.02	–25,467,495.29	–264,675,036.31
其中:1.基金申购款	217,491,960.05	17,624,845.19	235,116,805.24
2.基金赎回款	–456,699,501.07	–43,092,340.48	–499,791,841.55
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)	104,160,389.16	14,225,360.53	118,385,749.69

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

招商丰泰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)(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》、《招商丰泰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)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[2015] 436号文批准公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限为不定期,首次设立募集基金份额为7,094,136,239.15份,经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了编号为毕马威华振验字第1500162号验资报告。《招商丰泰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金合同》于2015年4月17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(以下简称"中国银行")。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及最新公告的《招商丰泰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)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A股股票(包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票)、债券(含中小企业私募债、地方政府债券等)、资产支持证券、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,但须符合中国证监会的相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金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,股指期货的投资比例遵循国家相关法律法规。本基金业绩比较基准为:中国人民银行公布金融机构人民币一年期存款基准利率+3%(单利年化)。

本基金于2015年7月22日开始在深圳证券交易所上市交易。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称"财政部")颁布的企业会计准则的要求,同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和半年度报告〉》以及中国证券投资基金业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

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2018年6月30日的财务状况以及自2018年1月1日至2018年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 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

本基金在本报告期间未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税 [2004] 78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2012] 85号文《财政部、国家税务总局、证监会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 [2015] 101号《财政部、国家税务总局、证监会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 [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》、上证交字 [2008] 16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《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 [2008] 1号文《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》、财税 [2016] 36号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税 [2016] 140号文《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] 2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税 [2017] 56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作,本基金适用的主要税项列示如下:

(a)证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。

(b)自2016年5月1日起,在全国范围内全面推开营业税改征增值税(以下称营改增)试点,建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人,纳入试点范围,由缴纳营业税改为缴纳增值税。

2018年1月1日(含)以后,资管产品管理人(以下称管理人)运营基金过程中发生的增值税应税行为,以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。对基金在2018年1月1日以前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入免征增值税。

(c)基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价,暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d)对基金取得的股票的股息、红利收入,由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起,对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额: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,股权登记日为自2013年1月1日起至2015年9月7日期间的,暂减按25%计入应纳税所得额,股权登记日在2015年9月8日及以后的,暂免征收个人所得税。

(e)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

(f)对投资者(包括个人和机构投资者)从基金分配中取得的收入,暂不征收企业所得税。

(g)对基金在2018年1月1日(含)以后运营过程中缴纳的增值税,按照证券投资基金管理人所在地适用的城市维护建设税税率,计算缴纳城市维护建设税。

(h)对基金在2018年1月1日(含)以后运营过程中缴纳的增值税,分别按照证券投资基金管理人所在地适用的费率计算缴纳教育费附加、地方教育费附加。

6.4.7 关联方关系

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

本报告期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。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
招商基金管理有限公司	基金管理人
中国银行股份有限公司	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

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期2018年1月1日至2018年6月30日 成交金额	占当期股票成交总额的比例	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
招商证券	88,079,816.26	17.24%	1,192,783.52	1.41%

6.4.8.1.2 债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期2018年1月1日至2018年6月30日 成交金额	占当期债券成交总额的比例	上年度可比期间2017年1月1日至2017年6月30日 成交金额	占当期债券成交总额的比例
招商证券	13,610,096.01	19.25%	–	–

6.4.8.1.3 债券回购交易

关联方名称	本期2018年1月1日至2018年6月30日 成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	上年度可比期间2017年1月1日至2017年6月30日 成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
招商证券	14,000,000.00	53.85%	58,000,000.00	27.80%

6.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期2018年1月1日至2018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	82,027.94	17.36%	38,459.65	15.69%
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	1,110.88	1.47%	944.54	2.66%

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。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期2018年1月1日至2018年6月30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	353,386.47	1,722,254.19
其中:支付销售机构的客户维护费	163,024.83	318,302.58

注:支付基金管理人招商基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值×1.00%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×1.00%÷当年天数

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期2018年1月1日至2018年6月30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	88,346.61	430,563.65

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

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固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固有资金投资本基金的情况。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期2018年1月1日至2018年6月30日 期末余额	当期利息收入	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
中国银行	14,404,358.96	45,705.40	8,070,576.08	118,607.82

注:本基金的银行存款由基金托管人中国银行股份有限公司保管,按银行同业利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.9 期末(2018年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.9.2 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。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无需要说明有助于理解和分析会计报表的其他事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	57,590,901.96	79.37
	其中:股票	57,590,901.96	79.37
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	14,924,793.87	20.57
7	其他资产	42,754.48	0.06
8	合计	72,558,450.31	100.00

7.2 报告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(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	–	–
B	采矿业	–	–
C	制造业	43,406,654.80	69.22
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	3,044,107.00	4.85
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,603,189.43	4.15
J	金融业	5,890,951.00	9.39
K	房地产业	–	–
L	租赁和商务服务业	2,645,999.73	4.22
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	57,590,901.96	91.84

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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300408	三环集团	135,667	3,188,174.50	5.08
2	002475	立讯精密	141,000	3,178,140.00	5.07
3	300316	晶盛机电	238,900	3,174,981.00	5.06
4	002241	歌尔股份	307,100	3,129,349.00	4.99
5	300258	精锻科技	225,600	3,102,000.00	4.95
6	601021	春秋航空	86,900	3,044,107.00	4.85
7	600030	中信证券	179,800	2,979,286.00	4.75
8	002273	水晶光电	230,876	2,971,374.12	4.74
9	002371	北方华创	59,300	2,945,431.00	4.70
10	002049	紫光国微	66,700	2,942,804.00	4.69

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	300433	蓝思科技	12,047,289.00	13.83
2	002273	水晶光电	11,669,966.70	13.40
3	002202	金风科技	7,296,379.90	8.38
4	600050	中国联通	7,267,306.00	8.34
5	600030	中信证券	7,267,269.00	8.34
6	000776	广发证券	7,197,319.00	8.26
7	600388	龙净环保	6,897,700.69	7.92
8	601989	中国重工	6,868,590.00	7.88
9	601688	华泰证券	6,703,393.00	7.70
10	600703	三安光电	6,657,511.00	7.64
11	002241	歌尔股份	6,582,282.00	7.56
12	300203	聚光科技	6,502,146.00	7.46
13	601021	春秋航空	6,422,843.80	7.37
14	600183	生益科技	6,403,932.05	7.35
15	601222	林洋能源	6,393,739.00	7.34
16	002475	立讯精密	5,823,026.70	6.68
17	002396	星网锐捷	5,807,399.09	6.67
18	300136	信维通信	5,091,419.61	5.84
19	600201	生物股份	4,716,828.20	5.41
20	600114	东睦股份	4,543,885.82	5.22
21	002027	分众传媒	4,524,152.00	5.19
22	300408	三环集团	4,484,138.00	5.15
23	601111	中国国航	3,799,745.00	4.36
24	300059	东方财富	3,796,743.00	4.36
25	600535	天士力	3,795,243.20	4.36
26	600566	济川药业	3,694,590.00	4.24
27	002624	完美世界	3,599,811.00	4.13
28	600900	长江电力	3,598,303.00	4.13
29	600570	恒生电子	3,497,606.00	4.02
30	600019	宝钢股份	3,497,575.20	4.02
31	300188	美亚柏科	3,494,196.00	4.01
32	002262	恩华药业	3,476,832.00	3.99
33	002522	浙江众成	3,447,489.20	3.96
34	600998	九州通	3,417,611.00	3.92
35	600837	海通证券	3,399,297.94	3.90
36	300498	温氏股份	3,398,352.00	3.90
37	600062	华润双鹤	3,398,160.00	3.90
38	000999	华润三九	3,397,693.99	3.90
39	002468	申通快递	3,397,550.00	3.90
40	603707	健友股份	3,397,219.00	3.90
41	600111	北方稀土	3,396,460.00	3.90
42	300258	精锻科技	3,263,786.00	3.75
43	000848	承德露露	3,197,360.60	3.67
44	600563	法拉电子	3,160,991.00	3.63
45	600029	南方航空	2,998,927.28	3.44
46	002236	大华股份	2,998,197.00	3.44
47	002025	航天电器	2,986,582.00	3.43
48	300316	晶盛机电	2,965,442.70	3.40
49	002371	北方华创	2,743,431.00	3.15
50	002049	紫光国微	2,736,787.00	3.14
51	300383	光环新网	2,647,649.80	3.04
52	601799	星宇股份	2,639,552.00	3.03
53	002460	赣锋锂业	2,498,982.08	2.87
54	300037	新宙邦	2,498,649.00	2.87
55	002456	欧菲科技	2,197,564.50	2.52

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	300433	蓝思科技	9,813,014.77	11.26
2	002273	水晶光电	8,604,564.86	9.88
3	600388	龙净环保	6,922,234.00	7.95
4	600998	九州通	6,907,163.06	7.93
5	300203	聚光科技	6,895,728.00	7.92
6	600050	中国联通	6,875,708.00	7.89
7	000776	广发证券	6,795,372.00	7.80
8	002202	金风科技	6,783,917.81	7.79
9	600703	三安光电	6,665,633.00	7.65
10	601021	春秋航空	6,658,500.94	7.64
11	601989	中国重工	6,355,514.16	7.30
12	601222	林洋能源	6,146,854.00	7.06
13	600201	生物股份	5,915,838.69	6.79
14	002624	完美世界	5,530,968.48	6.35
15	600566	济川药业	4,560,231.91	5.23
16	600535	天士力	4,331,751.50	4.97
17	603707	健友股份	4,208,385.90	4.83
18	300197	铁汉生态	4,042,601.00	4.64
19	002522	浙江众成	4,023,293.51	4.62
20	300059	东方财富	3,846,454.00	4.42
21	601111	中国国航	3,833,160.72	4.40
22	600570	恒生电子	3,816,006.00	4.38
23	002262	恩华药业	3,815,003.57	4.38
24	600183	生益科技	3,794,137.88	4.36
25	600062	华润双鹤	3,756,338.74	4.31
26	300498	温氏股份	3,681,957.84	4.23
27	601688	华泰证券	3,584,777.00	4.12
28	000848	承德露露	3,580,700.00	4.11
29	300188	美亚柏科	3,576,932.00	4.11
30	600900	长江电力	3,422,882.00	3.93
31	600030	中信证券	3,378,745.00	3.88
32	002460	赣锋锂业	3,317,114.00	3.81
33	600837	海通证券	3,290,312.99	3.78
34	002241	歌尔股份	3,261,379.00	3.74
35	002468	申通快递	3,245,224.14	3.73
36	002001	新和成	3,229,110.00	3.71
37	000999	华润三九	3,166,585.69	3.64
38	600029	南方航空	3,140,634.00	3.61
39	600111	北方稀土	3,139,036.00	3.60
40	002025	航天电器	3,063,462.99	3.52
41	600019	宝钢股份	2,990,445.96	3.43
42	002236	大华股份	2,960,205.00	3.40
43	600563	法拉电子	2,920,476.00	3.35
44	002396	星网锐捷	2,757,787.00	3.17
45	300037	新宙邦	2,544,732.00	2.92
46	002475	立讯精密	2,530,843.00	2.91
47	002027	分众传媒	2,226,727.47	2.56
48	002456	欧菲科技	2,195,222.50	2.52
49	600114	东睦股份	2,182,856.97	2.51
50	300408	三环集团	2,022,858.69	2.32
51	300136	信维通信	1,748,596.60	2.01

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

金额单位:人民币元

买入股票成本(成交)总额	273,383,653.17
卖出股票收入(成交)总额	237,520,084.08

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金合同规定,本基金不参与国债期货交易。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

根据本基金合同规定,本基金不参与国债期货交易。

7.11.3 本期国债期货投资评价

根据本基金合同规定,本基金不参与国债期货交易。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

报告期内基金投资的前十名证券除中信证券(证券代码600030)外其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查,不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

根据2017年9月21日发布的相关公告,该证券发行人因内部制度不完善,违规经营,被中国证监会地方监管机构责令改正。

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

金额单位:人民币元

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	38,045.28
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	4,128.02
5	应收申购款	581.18
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	42,754.48

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。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构 机构投资者 持有份额	占总份额比例	个人投资者 持有份额	占总份额比例
1,444	37,098.99	–	–	53,570,938.12	100.00%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	朱祥	93,501.00	51.74%
2	胡荣华	34,600.00	19.14%
3	林思特	10,066.00	5.57%
4	黄俊英	10,000.00	5.53%
5	曾亭曦	8,269.00	4.58%
6	董霞	6,560.00	3.63%
7	董霞	6,216.00	3.44%
8	吴婷婷	2,000.00	1.11%
9	赵风	1,900.00	1.05%
10	陈秀华	1,600.00	0.89%

注:以上数据由中国证券登记结算公司提供,持有人为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	40.23	0.0001%

8.4 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情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§9 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2015年4月17日)基金份额总额	7,094,136,239.15
本报告期期初基金份额总额	74,102,334.83
本报告期基金总申购份额	2,385,841.44
减:报告期基金总赎回份额	22,917,238.15
本报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"–"填列)	–
本报告期期末基金份额总额	53,570,938.12

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金本报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本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。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期,基金管理人没有受到监管部门的稽查或处罚,亦未收到关于基金管理人的高级管理人员、托管人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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易 成交金额	占当期股票成交总额的比例	应支付该券商的佣金 佣金	占当期佣金总量的比例	备注
招商证券	1	88,079,816.26	17.24%	82,027.94	17.36%	–
东兴证券	3	80,818,310.94	15.82%	75,265.89	15.93%	–
中信建投	6	76,468,533.46	14.97%	71,215.25	15.07%	–
国泰君安	3	47,571,594.62	9.31%	44,303.49	9.38%	–
东北证券	1	37,850,007.81	7.41%	35,249.76	7.46%	–
海通证券	3	36,867,561.66	7.22%	34,335.75	7.27%	–
广发证券	1	23,894,899.57	4.68%	22,253.36	4.71%	–
长城证券	2	23,187,935.00	4.54%	21,594.86	4.57%	–
华泰证券	3	21,630,973.97	4.23%	20,144.89	4.26%	–
申万宏源	4	18,708,179.47	3.66%	17,422.43	3.69%	–
中金公司	2	17,664,094.00	3.46%	16,450.54	3.48%	–
西藏东方财富	1	13,469,273.39	2.64%	9,850.21	2.08%	–
天风证券	2	13,275,330.83	2.60%	12,363.25	2.62%	–
中信证券	2	4,804,187.00	0.94%	4,474.17	0.95%	–
国信证券	2	3,471,056.31	0.68%	3,232.68	0.68%	–
中泰证券	2	3,141,982.96	0.61%	2,297.70	0.49%	–
兴业证券	2	–	–	–	–	–
银河证券	1	–	–	–	–	–
中投证券	1	–	–	–	–	–
中银国际	3	–	–	–	–	–
太平洋证券	2	–	–	–	–	–
新时代证券	1	–	–	–	–	–
第一创业证券	1	–	–	–	–	–
信达证券	2	–	–	–	–	–
西部证券	1	–	–	–	–	–
平安证券	3	–	–	–	–	–
民族证券	1	–	–	–	–	–
华安证券	1	–	–	–	–	–
红塔证券	1	–	–	–	–	–
国金证券	1	–	–	–	–	–
国海证券	1	–	–	–	–	–
光大证券	1	–	–	–	–	–
方正证券	3	–	–	–	–	–
东方证券	1	–	–	–	–	–
大通证券	1	–	–	–	–	–
长江证券	2	–	–	–	–	–
安信证券	1	–	–	–	–	–
华创证券	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。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易 成交金额	占当期债券成交总额的比例	债券回购交易 成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	权证交易 成交金额	占当期权证成交总额的比例
招商证券	13,610,096.01	19.25%	14,000,000.00	53.85%	–	–
东兴证券	15,512,460.51	21.94%	12,000,000.00	46.15%	–	–
中信建投	–	–	–	–	–	–
国泰君安	11,159,451.58	15.78%	–	–	–	–
东北证券	12,743,183.13	18.02%	–	–	–	–
海通证券	–	–	–	–	–	–
广发证券	3,169,500.00	4.48%	–	–	–	–
长城证券	140,663.64	0.20%	–	–	–	–
华泰证券	10,185,933.02	14.40%	–	–	–	–
申万宏源	–	–	–	–	–	–
中金公司	–	–	–	–	–	–
西藏东方财富	1,067,458.80	1.51%	–	–	–	–
天风证券	–	–	–	–	–	–
中信证券	–	–	–	–	–	–
国信证券	–	–	–	–	–	–
中泰证券	3,122,515.80	4.42%	–	–	–	–
兴业证券	–	–	–	–	–	–
银河证券	–	–	–	–	–	–
中投证券	–	–	–	–	–	–
中银国际	–	–	–	–	–	–
太平洋证券	–	–	–	–	–	–
新时代证券	–	–	–	–	–	–
第一创业证券	–	–	–	–	–	–
信达证券	–	–	–	–	–	–
西部证券	–	–	–	–	–	–
平安证券	–	–	–	–	–	–
民族证券	–	–	–	–	–	–
华安证券	–	–	–	–	–	–
红塔证券	–	–	–	–	–	–
国金证券	–	–	–	–	–	–
国海证券	–	–	–	–	–	–
光大证券	–	–	–	–	–	–
方正证券	–	–	–	–	–	–
东方证券	–	–	–	–	–	–
大通证券	–	–	–	–	–	–
长江证券	–	–	–	–	–	–
安信证券	–	–	–	–	–	–
华创证券	–	–	–	–	–	–

招商基金管理有限公司

2018年8月28日