

信息披露 Disclosure

招商丰茂灵活配置混合型发起式证券投资基金

2018年第三季度报告

增长率为0.69%，同期业绩比较基准增长率为0.46%。
4.6 报告期内本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况。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	38,712,173.00	14.06
其中:股票	38,712,173.00	14.06	
2	固定收益投资	—	—
3	固定收益投资	203,676,763.20	73.98
其中:国债	203,676,763.20	73.98	
中期票据	—	—	
资产支持证券	—	—	
4	买入返售金融资产	—	—
5	银行存款和结算备付金合计	11,150,329.02	4.06
6	其他资产	2,789,442.36	1.01
9	合计	427,367,286.78	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	4,798,433,229.00	1.29
C	制造业	47,648,318.00	0.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	589,477,013.00	0.16
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	611,330,000.00	0.25
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	21,538,243,000.00	5.84
J	金融业	2,709,431,000.00	0.73
K	房地产业	—	—
L	科学研究和技术服务业	—	—
M	医药制造业	—	—
N	医药批发和零售业	—	—
O	其他制造业	—	—
P	其他金融业	—	—
Q	其他行业	—	—
合计		38,712,173.00	14.12

5.3 报告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

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	601288	农业银行	1,546,300	6,017,441.00	2.20
2	601009	南航航空	864,300	5,759,400.00	2.11
3	600919	江苏银行	792,900	5,587,284.00	2.04
4	600036	招商银行	628,300	3,862,020.00	1.42
5	601011	中信银行	8,200	3,022,120.00	1.10
6	600919	江苏银行	3,000	2,774,000.00	1.02
7	601226	农业银行	163,400	1,421,580.00	0.52
8	600048	保利地产	114,300	1,391,031.00	0.51
9	000022	万科A	56,600	1,356,380.00	0.50
10	300065	艾美生物	21,300	1,368,531.00	0.50

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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	86,727,288.70	5.98
B	采矿业	31,675,466.46	2.21
C	制造业	627,368,122.66	4.32
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	29,697,981.94	2.07
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	—	—
J	金融业	26,221,063.11	1.83
K	房地产业	—	—
L	科学研究和技术服务业	—	—
M	医药制造业	—	—
N	医药批发和零售业	—	—
O	其他制造业	—	—
P	其他金融业	—	—
Q	其他行业	—	—
合计		836,262,316.60	58.39

5.2 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合

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	—	—
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	—	—
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—
L	科学研究和技术服务业	—	—
M	医药制造业	—	—
N	医药批发和零售业	—	—
O	其他制造业	—	—
P	其他金融业	—	—
Q	其他行业	—	—
合计		—	—

5.3 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债券投资明细

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	396,591,476.00	25.53
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
4	其中:政策性金融债	43,936,968.00	3.07
5	企业债	—	—
6	中期票据	9,521,000.00	0.69
7	可转换(可交换)债	—	—
8	回购证券	—	—
9	其他	—	—
10	合计	410,419,476.00	29.26

5.4 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债券投资明细

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	396,591,476.00	25.53
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
4	其中:政策性金融债	43,936,968.00	3.07
5	企业债	—	—
6	中期票据	9,521,000.00	0.69
7	可转换(可交换)债	—	—
8	回购证券	—	—
9	其他	—	—
10	合计	410,419,476.00	29.26

5.5 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债券投资明细

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	396,591,476.00	25.53
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
4	其中:政策性金融债	43,936,968.00	3.07
5	企业债	—	—
6	中期票据	9,521,000.00	0.69
7	可转换(可交换)债	—	—
8	回购证券	—	—
9	其他	—	—
10	合计	410,419,476.00	29.26

5.6 报告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

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	603299	今创集团	4,424,436	88,491,720.00	6.17
2	002714	亿联网络	3,442,883	88,277,288.70	6.38
3	600919	江苏银行	114,000	82,200,000.00	5.93
4	000909	西南药业	1,702,622	74,460,012.60	5.42
5	600996	六国化工	898,000	71,890,720.00	5.20
6	000661	长春高新	250,016	68,263,792.00	4.13
7	300476	胜华科技	3,528,884	54,203,197.44	3.78
8	002304	洋河股份	387,042	49,471,000.00	3.46
9	002422	科陆电子	1,362,516	39,071,676.06	2.82
10	601898	中国银河	516,200	35,043,904.00	2.46

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	396,591,476.00	25.53
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
4	其中:政策性金融债	43,936,968.00	3.07
5	企业债	—	—
6	中期票据	9,521,000.00	0.69
7	可转换(可交换)债	—	—
8	回购证券	—	—
9	其他	—	—
10	合计	410,419,476.00	29.26

5.8 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债券投资明细

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	396,591,476.00	25.53
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
4	其中:政策性金融债	43,936,968.00	3.07
5	企业债	—	—
6	中期票据	9,521,000.00	0.69
7	可转换(可交换)债	—	—
8	回购证券	—	—
9	其他	—	—
10	合计	410,419,476.00	29.26

5.9 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债券投资明细

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	396,591,476.00	25.53
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
4	其中:政策性金融债	43,936,968.00	3.07
5	企业债	—	—
6	中期票据	9,521,000.00	0.69
7	可转换(可交换)债	—	—
8	回购证券	—	—
9	其他	—	—
10	合计	410,419,476.00	29.26

5.10 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债券投资明细

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	396,591,476.00	25.53
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
4	其中:政策性金融债	43,936,968.00	3.07
5	企业债	—	—
6	中期票据	9,521,000.00	0.69
7	可转换(可交换)债	—	—
8	回购证券	—	—
9	其他	—	—
10	合计	410,419,476.00	29.26

5.11 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债券投资明细

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	396,591,476.00	25.53
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
4	其中:政策性金融债	43,936,968.00	3.07
5	企业债	—	—
6	中期票据	9,521,000.00	0.69
7	可转换(可交换)债	—	—
8	回购证券	—	—
9	其他	—	—
10	合计	410,419,476.00	29.26

5.12 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债券投资明细

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	396,591,476.00	25.53
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
4	其中:政策性金融债	43,936,968.00	3.07
5	企业债	—	—
6	中期票据	9,521,000.00	0.69
7	可转换(可交换)债	—	—
8	回购证券	—	—
9	其他	—	—
10	合计	410,419,476.00	29.26

5.13 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债券投资明细

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	396,591,476.00	25.53
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
4	其中:政策性金融债	43,936,968.00	3.07
5	企业债	—	—
6	中期票据	9,521,000.00	0.69
7	可转换(可交换)债	—	—
8	回购证券	—	—
9	其他	—	—
10	合计	410,419,476.00	29.26

5.14 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债券投资明细

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	396,591,476.00	25.53
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
4	其中:政策性金融债	43,936,968.00	3.07
5	企业债	—	—
6	中期票据	9,521,000.00	0.69
7	可转换(可交换)债	—	—
8	回购证券	—	—
9	其他	—	—
10	合计	410,419,476.00	29.26

5.15 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债券投资明细

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	396,591,476.00	25.53
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
4	其中:政策性金融债	43,936,968.00	3.07
5	企业债	—	—
6	中期票据	9,	