招商安盈债券型证券投资基金 2018年年度报告摘要

（原招商安盈保本混合型证券投资基金）

基金管理人:招商基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
送出日期:2019年3月28日

§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。

基金托管人中国工商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。

招商安盈债券型证券投资基金由招商安盈保本混合型证券投资基金于2018年9月22日转型而来。根据《招商安盈保本混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,2018年9月21日为招商安盈保本混合型证券投资基金的第二个保本周期到期日。依据《招商安盈保本混合型证券投资基金基金合同》的约定,招商安盈保本混合型证券投资基金第二个保本周期到期后,未能符合保本基金存续条件,招商安盈保本混合型证券投资基金变更为“招商安盈债券型证券投资基金”。在招商安盈保本混合型证券投资基金保本周期到期日,即2015年9月21日基金接受赎回、转换转出申请,不接受申购和转换转入申请。自2018年9月22日招商安盈保本混合型证券投资基金转型为招商安盈债券型证券投资基金。转型后的基金投资目标、投资范围、投资策略以及风险收益特征与转型前差异较大。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

相关公告刊登于《中国证券报》及本公司网站。

本报告财务资料已经审计,毕马威华振会计师事务所（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。本报告中招商安盈债券型证券投资基金的报告期自2018年9月22日（转型生效日）起至2018年12月31日止,招商安盈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9月21日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况（转型后）

基金简称	招商安盈债券
基金主代码	217024
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年9月22日
基金管理人	招商基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	218,231,083.20份
基金合同存续期	不定期

2.1 基金基本情况（转型前）

基金简称	招商安盈保本混合
基金主代码	217024
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年8月20日
基金管理人	招商基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,243,171,477.92份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明（转型后）

投资目标	在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求持续稳健的投资收益。
投资策略	1.资产配置策略:本基金依据宏观经济数据和金融运行数据、货币政策、财政政策、以及债券市场和股票市场风险收益特征，分析判断市场利率水平变动趋势和股票市场走势，并根据宏观经济、基准利率水平、股票市场整体估值水平，预期债券、可转债、新股申购等大类资产下一阶段的预期收益率水平，结合各类别资产的波动性以及流动性状况分析，进行大类资产配置。 2.债券（不含可转换公司债）投资策略:本基金在债券投资中主要基于对国家财政政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济的动态跟踪，采用久期匹配下的主动性投资策略，主要包括:久期匹配、期限结构配置、信用策略、相对价值判断、期权策略、动态优化等管理手段，对债券市场、债券收益率曲线以及各种债券价格的变化进行预测，相机而动，积极调整。 3.可转换公司债投资策略:由于可转债兼具债性和股性，本基金通过对可转债相对价值的分析，确定不同市场环境下可转债股性和债性的相对价值，把握可转债的价值走向，选择相应券种，从而获取较高投资收益。 4.股票投资策略:本基金充分发挥基金管理人的研究优势，将严谨、规范化的选股方法与积极主动的投资风格相结合，在分析和判断宏观经济运行和行业景气变化，以及上市公司成长潜力的基础上，通过优选具有良好成长性、质量优良、定价相对合理的股票进行投资，以谋求超额收益。
业绩比较基准	中债综合全价(总值)指数收益率
风险收益特征	本基金预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于一般混合型基金和股票型基金。

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，控制本金损失的风险，寻求组合资产的稳定增值。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的研究优势，将严谨、规范化的基本面研究分析与积极主动的投资风格相结合，利用组合保险技术，动态调整保本资产与收益资产的投资比例，以确保基金在保本期期间即时，实现基金资产在保本基础上的保值增值目的。
业绩比较基准	三年期银行定期存款收益率（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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	潘西里	郭明
	联系电话	0755-83196666	（010）66105798
	电子邮箱	cmf@cmfchina.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-887-9555	95588
传真		0755-83196475	（010）66105799

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.cmfchina.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

§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9月22日(基金合同生效日)至2018年12月31日
本期已实现收益	-514,370.37
本期利润	122,604.75
加权平均基金份额本期利润	0.0005
本期基金份额净值增长率	5.49%
3.1.2 期末数据和指标	2018年12月31日
期末可供分配基金份额利润	0.3162
期末基金资产净值	230,202,458.49
期末基金份额净值	1.0549

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、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、招商安盈债券型证券投资基金由招商安盈保本混合型证券投资基金于2018年9月22日转型而来。本基金对应的本期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9月22日,截至本报告期末成立未满1年,本报告期为非完整会计年度。

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9月21日	2017年	2016年
本期已实现收益	-2,237,734.78	34,721,408.94	98,599,786.16
本期利润	12,824,020.93	45,528,875.55	14,359,958.16
加权平均基金份额本期利润	0.0084	0.0179	0.0037
本期基金份额净值增长率	0.57%	2.15%	0.10%
3.1.2 期末数据和指标	2018年9月21日	2017年末	2016年末
期末可供分配基金份额利润	0.0857	0.3066	0.2854
期末基金资产净值	1,307,480,839.19	1,853,371,450.70	3,327,338,232.22
期末基金份额净值	1.052	1.046	1.024

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、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。

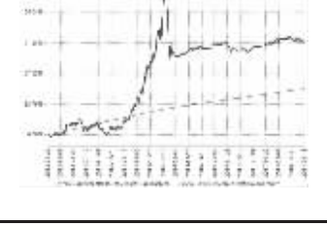
4、根据《招商安盈保本混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,2018年9月21日为招商安盈保本混合型证券投资基金的第二个保本周期到期日，自2018年9月22日招商安盈保本混合型证券投资基金转型为招商安盈债券型证券投资基金,因此上表本报告期间的结束日为2018年9月21日。

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

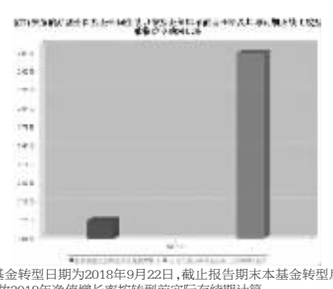
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.13%	0.45%	2.67%	0.05%	-2.54%	0.40%
自基金合同生效起至今	0.28%	0.44%	2.91%	0.05%	-2.63%	0.39%

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



注：本基金转型日期为2018年9月22日,截止报告期末本基金转型后基金合同生效未满一年;自基成立日起6个月内为建仓期,截至报告期末基尚未完成建仓。

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



注：本基金转型日期为2018年9月22日,截止报告期末本基金转型后基金合同生效未满一年,故2018年净值增长率按转型前实际存续期计算。

3.2 基金净值表现（转型前）

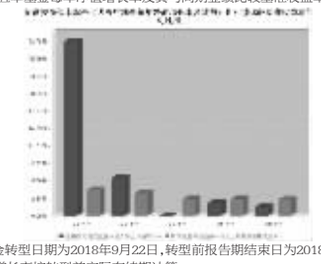
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-0.28%	0.12%	0.63%	0.01%	-0.91%	0.11%
过去六个月	-0.66%	0.12%	1.31%	0.01%	-1.97%	0.11%
过去一年	1.54%	0.14%	2.68%	0.01%	-1.14%	0.13%
过去三年	5.09%	0.11%	8.20%	0.01%	-3.11%	0.10%
过去五年	36.63%	0.43%	16.15%	0.01%	20.48%	0.42%
自基金合同生效起至今	42.37%	0.41%	20.88%	0.01%	21.49%	0.40%

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

注：本基金转型日期为2018年9月22日,截止报告期末本基金转型后基金合同生效未满一年;自基成立日起6个月内为建仓期,截至报告期末基尚未完成建仓。

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



注：本基金转型日期为2018年9月22日,转型前报告期结束日为2018年9月21日,故2018年净值增长率按转型前实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

招商安盈保本混合型证券投资基金过去三年未进行利润分配;自2018年9月22日招商安盈保本混合型证券投资基金转型为招商安盈债券型证券投资基金,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A1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

中国风金融扶贫先锋榜·中国风精准扶贫先锋机构《中国风》

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（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
尹晓红	本基金基金经理	2017年12月30日	-	5	女,硕士。2013年7月加入招商基金管理有限公司,曾任交易部交易员;2015年2月工作调动至招商财富资产管理有限公司（招商基金全资子公司）,任投资经理;2016年4月加入招商基金管理有限公司投资支持与创新部,曾任高级研究员,现任招商安瑞进取债券型证券投资基金、招商安盈债保本混合型证券投资基金、招商安盈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）基金经理。
姚爽	本基金基金经理	2017年8月8日	-	7	男,经济学硕士。2011年7月加入国泰基金管理有限公司研究部,任宏观策略研究员;2013年12月加入北京弘毅远方投资顾问有限公司,任分析师、投资经理;2015年7月加入招商基金管理有限公司，曾任研究部高级研究员,招商睿彬混合型证券投资基金及招商丰庆灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理,现任招商安盈债券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。

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

本基金2018年经历了从避险策略基金向二级债基的转型。转型前,组合按照避险策略运行,股票部分在维持合位基本稳定的基础上进行结构调整。转型后,大幅增加了转债的配置比例。债券方面在避险策略的情况下久期较短,后转型成二级债基后久期逐渐增加,以中高等级为主要配置标的。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至转型后报告期末,本报告期（2018年9月22日-2018年12月31日）招商安盈债券份额净值增长率为0.28%,同期业绩基准增长率为2.91%;

截至转型前报告期末,本报告期（2018年1月1日-2018年9月21日）招商安盈保本混合份额净值增长率为1.54%,同期业绩基准增长率为2.68%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前内外部宏观环境均面临深刻变革。相较于2018年的大多数时间而言,当前的内外环境均有不同程度的改善。一方面美国经济和市场回落,导致加息预期降低,对新兴市场压力有所减轻;另一方面国内逆周期调节政策陆续出台,经济下行压力有望逐步缓解。经过2018年大幅下跌后,A股市场估值回落到历史低位,开始具备长期投资价值。从短期驱动因素来看,预计企业盈利仍有下调压力,但流动性已处于合理充裕的状态,市场有望进入结构市、震荡市的阶段。我们将维持股票仓位基本稳定,同时着力于精选行业和个股,重点配置以金融、地产、交运为代表的低估值、高股息品种,以建筑等为代表的稳增长受益品种和光伏、部分TMT等新兴产业。同时,我们还将积极挖掘转债市场的投资机会,重点配置信用等级较高、静态收益率合理的转债品种。债券方面目前主要的策略是利用杠杆来赚取息差,今年要重点关注中等评级的相关投资机会。

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设定特别估值方案,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,本基金托管人在对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的有关规定,不存在任何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,本基金的管理人招商基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何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

本托管人依法对招商基金管理有限公司编制和披露的本基金2018年年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

§6 审计报告（转型后）

毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）审计了招商安盈债券型证券投资基金2018年的财务报表，包括2018年12月31日的资产负债表、2018年9月22日至2018年12月31日的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注,并出具了无保留意见的审计报告。

投资者欲了解详细内容,可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§6 审计报告（转型前）

毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）审计了招商安盈保本混合型证券投资基金2018年的财务报表,包括2018年9月11日的资产负债表、2018年1月1日至2018年9月21日的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注,并出具了无保留意见的审计报告。

投资者欲了解详细内容,可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表（转型后）

7.1 资产负债表（转型后）

会计主体:招商安盈债券型证券投资基金

报告截止日：2018年12月31日

单位:人民币元

资 产	本期末 2018年12月31日
资 产:	
银行存款	6,041,828.58
结算备付金	1,128,614.03
存出保证金	76,331.90
交易性金融资产	233,860,187.01
其中:股票投资	22,238,223.35
基金投资	-
债券投资	211,621,963.66
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	1,471,661.16
应收利息	1,430,565.94
应收股利	-
应收申购款	1,142.80
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	244,010,331.42
负债和所有者权益	本期末 2018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	11,000,000.00
应付证券清算款	-
应付赎回款	469,219.52
应付管理人报酬	143,288.38
应付托管费	40,939.54
应付销售服务费	-
应付交易费用	119,128.95
应交税费	1,638,336.70
应付利息	-3,042.08
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	400,001.92
负债合计	13,807,872.93
所有者权益:	
实收基金	161,198,017.98
未分配利润	69,004,440.51
所有者权益合计	230,202,458.49
负债和所有者权益总计	244,010,331.42

注:1、报告截止日2018年12月31日,基金份额净值1.0549元,基金份额总额218,231,083.20份;

2、本期财务报表的实际编制期间为2018年9月22日(基金合同生效日）至2018年12月31日。

7.2 利润表

会计主体:招商安盈债券型证券投资基金

本报告期:2018年9月22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 2018年9月22日(基金合同生效日)至2018年12月31日
一、收入	1,321,985.40
1.利息收入	1,809,667.96
其中:存款利息收入	204,604.47
债券利息收入	1,283,380.10
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	321,683.39
其他利息收入	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-1,129,301.95
其中:股票投资收益	-1,856,983.48
基金投资收益	-
债券投资收益	740,476.34
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	-12,794.81
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	636,975.12
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	4,645.27
减:二、费用	1,199,381.65
1. 管理人报酬	610,761.62
2. 托管费	174,503.34
3. 销售服务费	-
4. 交易费用	225,016.91
5. 利息支出	59,972.99
其中:卖出回购金融资产支出	59,972.99
6.税金及附加	2,978.71
7. 其他费用	126,148.08
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	122,604.75
减:所得税费用	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	122,604.75

注:本期财务报表的实际编制期间为2018年9月22日（基金合同生效日）至2018年12月31日。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体:招商安盈债券型证券投资基金

本报告期:2018年9月22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 2018年9月22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）	918,685,613.45	388,795,225.74	1,307,480,839.19
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	122,604.75	122,604.75
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）	-757,487,595.47	-319,913,389.98	-1,077,400,985.45
其中:1.基金申购款	315,546.82	134,889.01	450,435.83
2.基金赎回款(以“-”号填列)	-757,803,142.29	-320,048,278.99	-1,077,851,421.28
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）	161,198,017.98	69,004,440.51	230,202,458.49

注:本期财务报表的实际编制期间为2018年9月22日（基金合同生效日）至2018年12月31日。

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

招商安盈债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）系由招商安盈保本混合型证券投资基金转型而来。根据原《招商安盈保本混合型证券投资基金基金合同》的约定,2018年9月21日，本基金第二个保本周期到期后，未能符合保本基金存续条件,自2018年9月22日起本基金转型为招商安盈债券型证券投资基金，同时，基金的投资目标、投资范围、投资策略以及基金费率等相关内容根据《招商安盈保本混合型证券投资基金基金合同》的相关约定作相应修改。自2018年9月22日起,原基金合同失效,《招商安盈债券型证券投资基金合同》于同一日生效。本基金为契约型开放式基金,存续期不定。本基金的基金管理人为招商基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司（以下简称“中国工商银行”）。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《招商安盈债券型证券投资基金基金合同》及截至报告期末最新公告的《招商安盈债券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债券（包括可转换债券及可分离转债、国债、央行票据、公司债、企业债、短期融资券、政府机构债、政策性金融机构金融债、商业银行金融债、资产支持证券等）、股票、权证、货币市场工具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相关规定）。本基金可参与一级市场新股申购或增发新股,也可在二级市场上投资股票、权证等权益类证券。如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金投资组合比例为:股票等收益资产占基金资产的比例不高于40%;债券、货币市场工具等保本资产占基金资产的比例不低于60%,其中基金保留不低于基金资产净值5%的现金或者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:三年期银行定期存款收益率（税后）。

根据《招商安盈保本混合型证券投资基金基金合同》的约定,2018年9月21日,本基金第二个保本周期到期后,未能符合保本基金存续条件,自2018年9月22日起本基金转型为招商安盈债券型证券投资基金,同时，基金的投资目标、投资范围、投资策略以及基金费率等相关内容根据《招商安盈保本混合型证券投资基金基金合同》的相关约定作相应修改。修改后的《招商安盈债券型证券投资基金基金合同》自2018年9月22日起生效,本基金合同自同一日起失效。

7.4.2 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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注7.4.2中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求,真实、完整地反映了本基金2018年12月31日的财务状况、自2018年9月22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

本基金的会计年度自公历1月1日起至12月31日止,本期财务报表的实际编制期间为自2018年9月22日（基金合同生效日）至2018年12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币,编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的,把金融资产和金融负债分为不同类别:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。本基金现无金融资产分类为持有至到期投资和可供出售金融资产。本基金现无金融负债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。

本基金目前持有的[股票投资]和[债券投资]分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

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

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时,于资产负债表内确认。

在初始确认时,金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债,相关交易费用直接计入当期损益;对于其他类别的金融资产或金融负债,相关交易费用计入初始确认金额。

初始确认后,金融资产和金融负债的后续计量如下:

–以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值计量,公允价值变 动形成的利得或损失计入当期损益。

–应收款项以实际利率法按摊余成本计量。

–除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债采用实际利率法按摊余成本进行后续计量。

满足下列条件之一时,本基金终止确认该金融资产:

–收取该金融资产现金流量的合同权利终止;

–该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方;

–该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬,但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的,本基金将下列两项金额的差额计入当期损益:

–所转移金融资产的账面价值

–因转移而收到的对价

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的,本基金终止确认该金融负债或其一部分。

7.4.4.5 金融资产和金