

(上接B252版)

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]103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3年。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1,005,036,918.40份,经德勤华永会计师事务所特殊普通合伙验证,并出具了编号为德勤验字(16)第0201号验资报告。基金合同于2016年2月18日正式生效。本基金的基金管理人为主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”)。

本基金的第一个保本周期由北京首创融资产担保有限公司作为担保人,担保人对基金管理人和本基金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的赎回费。基金份额赎回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其他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基金合同约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“招商安福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。本基金第二个保本周期自2016年2月18日起至2019年2月18日止,根据本基金管理人于2019年1月18日发布的《招商安福保本混合型证券投资基金保本周期到期安排及转型为招商安福灵活配置混合型证券投资基金相关业务规则的公告》,在本基金保本周期到期日的次日,即2019年2月19日起“招商安福保本混合型证券投资基金”将更名为“招商安福灵活配置混合型证券投资基金”,《招商安福灵活配置混合型证券投资基金基金合同》及托管协议亦于该日同时生效。

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《招商安福保本混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的基金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和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、股指期货等权益类资产占基金资产的比例不高于40%;债券、国债期货、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%,其中,现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为人民币银行公布的三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,同时就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2019年2月18日(基金保本周期到期日)的财务状况以及自2019年1月1日至2019年2月18日(基金保本周期到期日)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

本基金在本报告期内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政策变更

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《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《关于实施全国中小型企业股份转让系统挂牌公司股票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经营辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]6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,以基金管理人增值税纳税人,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取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入、股息、红利收入、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缴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2.10%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。

6.4.7 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相关方

| 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 |
| 招商证券股份有限公司 | 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

| 关联方名称 | 本报告2019年1月1日至2019年2月18日成交金额 | 上年度可比期间2016年2月18日至2016年2月18日成交金额 | 本报告2019年1月1日至2019年2月18日成交金额占当期股票成交金额的比例(%) | 上年度可比期间2016年2月18日至2016年2月18日成交金额占当期股票成交金额的比例(%) |
|-------|-----------------------------|----------------------------------|--------------------------------------------|-------------------------------------------------|
| 招商证券 | 959,389.00 | 4,494,388.26 | 4.96% | 12.94% |

6.4.8.1.2 债券交易

| 关联方名称 | 本报告2019年1月1日至2019年2月18日成交金额 | 上年度可比期间2016年2月18日至2016年2月18日成交金额 | 本报告2019年1月1日至2019年2月18日成交金额占当期债券成交金额的比例(%) | 上年度可比期间2016年2月18日至2016年2月18日成交金额占当期债券成交金额的比例(%) |
|-------|-----------------------------|----------------------------------|--------------------------------------------|-------------------------------------------------|
| 招商证券 | 477,235.69 | 477,235.69 | 0.46% | — |

6.4.8.1.3 债券回购交易

| 关联方名称 | 本报告2019年1月1日至2019年2月18日成交金额 | 上年度可比期间2016年2月18日至2016年2月18日成交金额 | 本报告2019年1月1日至2019年2月18日成交金额占当期债券回购成交金额的比例(%) | 上年度可比期间2016年2月18日至2016年2月18日成交金额占当期债券回购成交金额的比例(%) |
|-------|-----------------------------|----------------------------------|----------------------------------------------|---------------------------------------------------|
| 招商证券 | 84,400,000.00 | 84,400,000.00 | 69.04% | — |

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

| 关联方名称 | 本报告2019年1月1日至2019年2月18日佣金 | 上年度可比期间2016年2月18日至2016年2月18日佣金 | 本报告2019年1月1日至2019年2月18日佣金占当期佣金总额的比例(%) | 上年度可比期间2016年2月18日至2016年2月18日佣金占当期佣金总额的比例(%) |
|-------|---------------------------|--------------------------------|----------------------------------------|---------------------------------------------|
| 招商证券 | 393.24 | — | 46% | — |

注:1、本基金与关联方交易均在正常业务范围内在一般业务协议订立;

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

| 项目 | 本报告2019年1月1日至2019年2月18日 | 上年度可比期间2016年2月18日至2016年2月18日 |
|--------------------------|-------------------------|------------------------------|
| 支付给基金管理人招商基金管理有限公司的基金管理费 | 1,480,373.94 | 6,235,333.89 |
| 支付主承销招商证券的资产管理费 | 486,281.29 | 1,769,772.93 |

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×1.20%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×1.20%/当年天数

6.4.8.2.2 基金托管费

| 项目 | 本报告2019年1月1日至2019年2月18日 | 上年度可比期间2016年2月18日至2016年2月18日 |
|--------------------|-------------------------|------------------------------|
| 支付给基金托管人中国银行的基金托管费 | 246,762.31 | 1,036,746.28 |

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×0.20%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×0.20%/当年天数

6.4.8.2.3 销售服务费

本基金A类基金份额不收取销售服务费,C类基金份额的销售服务费年费率为0.50%,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

C类日销售服务费=前一日C类基金资产净值×0.50%-当年天数。

由于招商安福保本混合C从基金成立至2019年2月18日无份额,因此本基金本报告期内无销售服务费。

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

本报告期内及上年度末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

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

| 关联方名称 | 本报告2019年1月1日至2019年2月18日期末余额 | 上年度可比期间2016年2月18日至2016年2月18日期末余额 | 本报告2019年1月1日至2019年2月18日当期利息收入 | 上年度可比期间2016年2月18日至2016年2月18日当期利息收入 |
|-------|-----------------------------|----------------------------------|-------------------------------|------------------------------------|
| 招商证券 | 915,739,000.21 | 286,200.26 | 10,221,736.04 | 109,007.16 |

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,按银行约定利率计息。

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无可承销行在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.9 期末(2019年2月18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

本基金本报告期内无因认购新发/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

6.4.9.3 期末持有的债券回购交易作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期内未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

本基金本报告期内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(转型后)

| 序号 | 投资组合 | 持仓 | 占基金资产净值比例(%) |
|-----|----------|---------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 4,729,486.68 | 7.76% |
| 1.1 | 其中:股票 | 4,729,486.68 | 7.76% |
| 2 | 固定收益投资 | — | — |
| 3 | 权益类投资 | 50,102,400.00 | 77.31% |
| 3.1 | 其中:股票 | 50,102,400.00 | 77.31% |
| 4 | 资产支持证券 | — | — |
| 5 | 金融衍生品投资 | — | — |
| 6 | 其他资产 | — | — |
| 7 | 买入返售金融资产 | — | — |
| 8 | 其他金融资产 | — | — |
| 9 | 合计 | 54,831,886.68 | 90.07% |

注:本基金本报告期末无因公允价值变动而产生的未实现损益。

7.1 期末基金资产组合情况

| 序号 | 投资组合 | 持仓 | 占基金资产净值比例(%) |
|-----|----------|---------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 4,729,486.68 | 7.76% |
| 1.1 | 其中:股票 | 4,729,486.68 | 7.76% |
| 2 | 固定收益投资 | — | — |
| 3 | 权益类投资 | 50,102,400.00 | 77.31% |
| 3.1 | 其中:股票 | 50,102,400.00 | 77.31% |
| 4 | 资产支持证券 | — | — |
| 5 | 金融衍生品投资 | — | — |
| 6 | 其他资产 | — | — |
| 7 | 买入返售金融资产 | — | — |
| 8 | 其他金融资产 | — | — |
| 9 | 合计 | 54,831,886.68 | 90.07% |

| 序号 | 投资组合 | 持仓 | 占基金资产净值比例(%) |
|-----|----------|---------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 4,729,486.68 | 7.76% |
| 1.1 | 其中:股票 | 4,729,486.68 | 7.76% |
| 2 | 固定收益投资 | — | — |
| 3 | 权益类投资 | 50,102,400.00 | 77.31% |
| 3.1 | 其中:股票 | 50,102,400.00 | 77.31% |
| 4 | 资产支持证券 | — | — |
| 5 | 金融衍生品投资 | — | — |
| 6 | 其他资产 | — | — |
| 7 | 买入返售金融资产 | — | — |
| 8 | 其他金融资产 | — | — |
| 9 | 合计 | 54,831,886.68 | 90.07% |

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

| 序号 | 投资组合 | 持仓 | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------|--------------|--------------|
| 1 | 医药生物 | 1,207,491.00 | 1.94% |

| 序号 | 投资组合 | 持仓 | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------------------|--------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | — | — |
| B | 采矿业 | — | — |
| C | 制造业 | 4,403,534.68 | 6.72% |
| 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 | 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 | 建筑业、房地产业、信息服务业 | — | — |
| P | 其他 | — | — |
| Q | 其他非金融行业 | 219,399.63 | 0.40% |
| R | 合计 | 4,729,486.68 | 7.24% |

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

| 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 | 003114 | 华鲁股份 | 991,432 | 2,474,487.28 | 3.79% |
| 2 | 300848 | 三昌新材 | 99,540 | 1,897,543.00 | 2.93% |
| 3 | 000661 | 皖通物流 | 98,240 | 1,876,240.00 | 2.88% |
| 4 | 000750 | 华海药业 | 240 | 24,460.00 | 0.04% |
| 5 | 300667 | 精伦电子 | 500 | 5,360.00 | 0.01% |
| 6 | 002021 | 生物股份 | 100 | 1,560.00 | 0.00% |

7.4 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。

7.5 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

本基金拟自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 | 600034 | 盐湖钾肥 | 800,430 | 9,454,407.90 | 9.90 |