

招商安博保本混合型证券投资基金

[2016]第四季度报告

2016年10月1日起至12月31日止

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
报告送出日期:2017年1月20日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会在全面了解本基金所载资料后存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

本基金由招商基金管理有限公司担任基金管理人,于2017年1月10日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等信息,保证不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,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。

基金经理在履行职责时并不代表其本人、其管理的基金或其所在公司。投资人应当认真阅读基金招募说明书、本报吿书中的财务数据等定期报告。

本报告期期末至报告期末未满一年。

§ 2 基金产品概况

基金简称 招商安博保本混合

交易代码 000281

基金运作方式 灵活配置型

基金合同生效日 2016年1月20日

报告期末基金份额总额 1,800,602,784.02份

投资目标 通过运用组合投资技术,力争控制基金损失的风险,并寻求组合基金的稳定性。

投资策略 本基金将投资品种分为风险资产和风险本源资产,采用固定比例投资策略(即Constant Proportion Portfolio Insurance,CPI)进行投资操作。本基金在保本周期内将严格遵守保本策略,实现对风险资产和风险本源资产的动态优化配置,以期获得稳定的收益。本基金将通过严格的风险控制流程,努力为基金资产获取收益。

业绩比较基准 人民币银行公布的五年期定期存款利率(税后)

风险收益特征 本基金为保本混合型基金,属于证券市场中的低风险品种。

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

下属分级基金的基金简称 招商安博保本混合A 招商安博保本混合C

下属分级基金的交易代码 000281 000280

报告期末下属分级基金的份额总额 1,763,043,834.06份 56,568,949.16份

§ 3 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标		报告期(2016年10月1日 - 2016年12月31日)
年初基金份额总额	招商安博保本混合	招商安博保本混合
1. 本期已实现收益	4,626,476,222	90,483.12
2. 本期利润	-14,640,710.44	-579,566.00
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0062	-0.0006
4. 期末基金资产净值	1,748,500,938.01	56,240,444.68
5. 期末基金份额净值	0.994	0.994

(注:本基金业经审计的财务报表不包括持有人认购或申购基金产生的新增净资产或负债,以及持有人赎回或卖出基金产生的现金损失或负债,本期利润不包含期末至报告期末基金成立未满一年的余额,本期利润已实现收入加上本期公允价值变动收益,截至报告期末本基金成立未满一年。

3.2.2 基金报告期内基金净值增长率变化率与同期行业业绩比较基准收益率变动的比较

招商安博保本混合A 招商安博保本混合C

阶段 净值增长率① 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

过去三个月 -0.09% 0.02% 0.05% 0.01%

阶段 净值增长率① 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

过去六个月 -1.00% 0.09% 0.05% 0.01%

3.2.2 基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同行业业绩比较基准收益率变动的比较

招商安博保本混合A 招商安博保本混合C

阶段 净值增长率① 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

过去九个月 -1.00% 0.09% 0.05% 0.01%

3.2.3 报告期内基金的前十名股票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。

3.2.4 基金经理的近一年来没有受到过公开谴责、处罚。

3.2.5 基金经理的近一年来没有受到过公开谴责、处罚。

3.2.6 基金经理的近一年来没有受到过公开谴责、处罚。

3.2.7 基金经理的近一年来没有受到过公开谴责、处罚。

3.2.8 基金经理的近一年来没有受到过公开谴责、处罚。

3.2.9 基金经理的近一年来没有受到过公开谴责、处罚。

3.2.10 基金经理的近一年来没有受到过公开谴责、处罚。

3.2.11 基金经理的近一年来没有受到过公开谴责、处罚。

3.2.12 基金经理的近一年来没有受到过公开谴责、处罚。

3.2.13 基金经理的近一年来没有受到过公开谴责、处罚。

3.2.14 基金经理的近一年来没有受到过公开谴责、处罚。

3.2.15 基金经理的近一年来没有受到过公开谴责、处罚。

3.2.16 基金经理的近一年来没有受到过公开谴责、处罚。

3.2.17 基金经理的近一年来没有受到过公开谴责、处罚。

3.2.18 基金经理的近一年来没有受到过公开谴责、处罚。

3.2.19 基金经理的近一年来没有受到过公开谴责、处罚。

3.2.20 基金经理的近一年来没有受到过公开谴责、处罚。

3.2.21 基金经理的近一年来没有受到过公开谴责、处罚。

3.2.22 基金经理的近一年来没有受到过公开谴责、处罚。

3.2.23 基金经理的近一年来没有受到过公开谴责、处罚。

3.2.24 基金经理的近一年来没有受到过公开谴责、处罚。

3.2.25 基金经理的近一年来没有受到过公开谴责、处罚。

3.2.26 基金经理的近一年来没有受到过公开谴责、处罚。

3.2.27 基金经理的近一年来没有受到过公开谴责、处罚。

3.2.28 基金经理的近一年来没有受到过公开谴责、处罚。

3.2.29 基金经理的近一年来没有受到过公开谴责、处罚。

3.2.30 基金经理的近一年来没有受到过公开谴责、处罚。

3.2.31 基金经理的近一年来没有受到过公开谴责、处罚。

3.2.32 基金经理的近一年来没有受到过公开谴责、处罚。

3.2.33 基金经理的近一年来没有受到过公开谴责、处罚。

3.2.34 基金经理的近一年来没有受到过公开谴责、处罚。

3.2.35 基金经理的近一年来没有受到过公开谴责、处罚。

3.2.36 基金经理的近一年来没有受到过公开谴责、处罚。

3.2.37 基金经理的近一年来没有受到过公开谴责、处罚。

3.2.38 基金经理的近一年来没有受到过公开谴责、处罚。

3.2.39 基金经理的近一年来没有受到过公开谴责、处罚。

3.2.40 基金经理的近一年来没有受到过公开谴责、处罚。

3.2.41 基金经理的近一年来没有受到过公开谴责、处罚。

3.2.42 基金经理的近一年来没有受到过公开谴责、处罚。

3.2.43 基金经理的近一年来没有受到过公开谴责、处罚。

3.2.44 基金经理的近一年来没有受到过公开谴责、处罚。

3.2.45 基金经理的近一年来没有受到过公开谴责、处罚。

3.2.46 基金经理的近一年来没有受到过公开谴责、处罚。

3.2.47 基金经理的近一年来没有受到过公开谴责、处罚。

3.2.48 基金经理的近一年来没有受到过公开谴责、处罚。

3.2.49 基金经理的近一年来没有受到过公开谴责、处罚。

3.2.50 基金经理的近一年来没有受到过公开谴责、处罚。

3.2.51 基金经理的近一年来没有受到过公开谴责、处罚。

3.2.52 基金经理的近一年来没有受到过公开谴责、处罚。

3.2.53 基金经理的近一年来没有受到过公开谴责、处罚。

3.2.54 基金经理的近一年来没有受到过公开谴责、处罚。

3.2.55 基金经理的近一年来没有受到过公开谴责、处罚。

3.2.56 基金经理的近一年来没有受到过公开谴责、处罚。

3.2.57 基金经理的近一年来没有受到过公开谴责、处罚。

3.2.58 基金经理的近一年来没有受到过公开谴责、处罚。

3.2.59 基金经理的近一年来没有受到过公开谴责、处罚。

3.2.60 基金经理的近一年来没有受到过公开谴责、处罚。

3.2.61 基金经理的近一年来没有受到过公开谴责、处罚。

3.2.62 基金经理的近一年来没有受到过公开谴责、处罚。

3.2.63 基金经理的近一年来没有受到过公开谴责、处罚。

3.2.64 基金经理的近一年来没有受到过公开谴责、处罚。

3.2.65 基金经理的近一年来没有受到过公开谴责、处罚。

3.2.66 基金经理的近一年来没有受到过公开谴责、处罚。

3.2.67 基金经理的近一年来没有受到过公开谴责、处罚。

3.2.68 基金经理的近一年来没有受到过公开谴责、处罚。

3.2.69 基金经理的近一年来没有受到过公开谴责、处罚。

3.2.70 基金经理的近一年来没有受到过公开谴责、处罚。

3.2.71 基金经理的近一年来没有受到过公开谴责、处罚。

3.2.72 基金经理的近一年来没有受到过公开谴责、处罚。

3.2.73 基金经理的近一年来没有受到过公开谴责、处罚。

3.2.74 基金经理的近一年来没有受到过公开谴责、处罚。

3.2.75 基金经理的近一年来没有受到过公开谴责、处罚。

3.2.76 基金经理的近一年来没有受到过公开谴责、处罚。

3.2.77 基金经理的近一年来没有受到过公开谴责、处罚。

3.2.78 基金经理的近一年来没有受到过公开谴责、处罚。

3.2.79 基金经理的近一年来没有受到过公开谴责、处罚。

3.2.80 基金经理的近一年来没有受到过公开谴责、处罚。

3.2.81 基金经理的近一年来没有受到过公开谴责、处罚。

3.2.82 基金经理的近一年来没有受到过公开谴责、处罚。

3.2.83 基金经理的近一年来没有受到过公开谴责、处罚。

3.2.84 基金经理的近一年来没有受到过公开谴责、处罚。

3.2.85 基金经理的近一年来没有受到过公开谴责、处罚。

3.2.86 基金经理的近一年来没有受到过公开谴责、处罚。

3.2.87 基金经理的近一年来没有受到过公开谴责、处罚。

3.2.88 基金经理的近一年来没有受到过公开谴责、处罚。

3.2.89 基金经理的近一年来没有受到过公开谴责、处罚。

3.2.90 基金经理的近一年来没有受到过公开谴责、处罚。

<p