

招商安益保本混合型证券投资基金

[2017] 第一季度报告

基金管理人：招商基金管理有限公司
基金托管人：中国建设银行股份有限公司
报告送出日期：2017年4月21日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会对本基金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。

基金托管人因建设银行股份有限公司担任本基金合同约定，于2017年4月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配政策等事项，确认报告的内容真实准确，复核意见不构成保证。

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。

本报告书财务资料未经审计。

本基金报告期2017年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

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 建筑业	-	-	-
C 制造业	62,782,319.70	5.08	
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-	-
E 建筑装饰业	15,539,301.64	1.26	
F 批发和零售业	10,087,956.00	0.82	
G 交通运输、仓储和邮政业	-	-	-
H 在线旅游业	-	-	-
I 信息技术业、软件和信息技术服务业	3,068,800.00	0.41	
J 新能源	-	-	-
K 其他服务业	-	-	-
L 银行业金融服务业	16,930.16	0.00	
M 科学研究、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 卫生社会工作	-	-	-
R 文化、体育和娱乐业	-	-	-
S 综合	-	-	-
总计	93,498,307.50	7.56	

5.2 报告期末按行业分类的普通股投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通股票投资。

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	证券代码	证券名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002310	新纶科技	96,426	15,401,883.22	1.25
2	000628	深国商A	133,290	10,031,060.00	0.81
3	002250	歌美飒	603,247	9,520,433.51	0.77
4	600408	珠江啤酒	336,700	8,803,022.61	0.67
5	000623	东阳国际	120,000	7,672,000.00	0.64
6	600196	复星医药	722,400	7,563,826.00	0.61
7	000700	冀东水泥	775,000	6,586,400.00	0.52
8	300033	同花顺	800,000	5,500,000.00	0.43
9	000536	云天化	54,200	4,615,504.00	0.37
10	002771	东阳国际	149,000	4,002,330.00	0.32
合计			1,153,295,029.30	93.29	

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	79,904,000.00	6.46
2	金融债	-	-
3	企业债	-	-
4	公司债	-	-
5	短期融资券	-	-
6	资产支持证券	-	-
7	质押式回购	-	-
8	买断式回购	-	-
9	债券回购	-	-
10	合计	93,498,307.50	7.56

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	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	新一期国债	96,426	15,401,883.22	1.25
2	国债	新一期国债	133,290	10,031,060.00	0.81
3	国债	新一期国债	603,247	9,520,433.51	0.77
4	国债	新一期国债	336,700	8,803,022.61	0.67
5	国债	新一期国债	120,000	7,672,000.00	0.64
6	国债	新一期国债	722,400	7,563,826.00	0.61
7	国债	新一期国债	775,000	6,586,400.00	0.52
8	国债	新一期国债	54,200	4,615,504.00	0.37
9	国债	新一期国债	149,000	4,002,330.00	0.32
10	国债	新一期国债	93,498,307.50	93.29	

5.6 报告期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。

5.7 报告期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。

5.8 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证及衍生金融工具投资明细

本基金本报告期末未持有权证及衍生金融工具。

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十名股指期货投资明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

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十名国债期货投资明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.12 本报告期内基金的业绩表现

本基金的业绩评价见“附注四、基金的财务状况”中“（二）报告期利润”部分。

5.13 本报告期内基金的费用情况

本基金本报告期无费用。

5.14 本报告期内基金的税收情况

本基金本报告期无税收。

5.15 本报告期内基金的费用调整情况

本基金本报告期无费用调整。

5.16 本报告期内基金的关联交易

本基金本报告期无关联交易。

5.17 本报告期内基金的市场价格情况

本基金本报告期无市场价格。

5.18 本报告期内基金的估值政策

本基金本报告期无估值政策。

5.19 本报告期内基金的交易价格情况

本基金本报告期无交易价格。

5.20 本报告期内基金的停牌情况

本基金本报告期无停牌。

5.21 本报告期内基金的融资融券交易情况

本基金本报告期无融资融券交易。

5.22 本报告期内基金的其他重要信息

本基金本报告期无其他重要信息。

5.23 本报告期内基金的清算情况

本基金本报告期无清算。

5.24 本报告期内基金的会计政策

本基金本报告期无会计政策。

5.25 本报告期内基金的会计估计

本基金本报告期无会计估计。

5.26 本报告期内基金的资产减值准备

本基金本报告期无资产减值准备。

5.27 本报告期内基金的公平交易情况

本基金本报告期无公平交易。

5.28 本报告期内基金的关联交易定价政策

本基金本报告期无关联交易定价政策。

5.29 本报告期内基金的现金流量表

本基金本报告期无现金流量表。

5.30 本报告期内基金的财务报表

本基金本报告期无财务报表。

5.31 本报告期内基金的半年度报告

本基金本报告期无半年度报告。

5.32 本报告期内基金的年度报告

本基金本报告期无年度报告。

5.33 本报告期内基金的季度报告

本基金本报告期无季度报告。

5.34 本报告期内基金的半年度报告摘要

本基金本报告期无半年度报告摘要。

5.35 本报告期内基金的年度报告摘要

本基金本报告期无年度报告摘要。

5.36 本报告期内基金的季度报告摘要

本基金本报告期无季度报告摘要。

5.37 本报告期内基金的半年度报告附注

本基金本报告期无半年度报告附注。

5.38 本报告期内基金的年度报告附注

本基金本报告期无年度报告附注。

5.39 本报告期内基金的季度报告附注

本基金本报告期无季度报告附注。

5.40 本报告期内基金的半年度报告备查文件

本基金本报告期无半年度报告备查文件。

5.41 本报告期内基金的年度报告备查文件

本基金本报告期无年度报告备查文件。

5.42 本报告期内基金的季度报告备查文件