

招商安达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:中国农业银行股份有限公司
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、监事、高级管理人员和其他人员在编制报告时未存在虚假记载、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和连带责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年4月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

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。

本报告所载财务数据未经审计。

本报告期自2017年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称		招商安达保本混合
基金代码	217020	
交易代码	217020	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2011年1月1日	
报告期末基金份额总额	760,496,981.66份	
报告期末可供分配利润	0.00元	
报告期末可供分配利润总额	760,496,981.66份	
投资目标	通过投资于资产配置策略和有效的组合管理，在确保本周期内实现本金安全的前提下，力争获得超越基准收益的最大化。	
投资策略	本基金主要通过资产配置策略，对资产进行动态调整，以达到在确保本金安全的前提下，力争获得超越基准收益的最大化。 本基金将通过资产配置策略，对资产进行动态调整，以达到在确保本金安全的前提下，力争获得超越基准收益的最大化。	
业绩比较基准	三期限定期存款收益率(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	中国农业银行股份有限公司	
基金销售代理人	武汉信用风险管理有限公司	

§ 3 主要财务指标和净值表现

单位:人民币元

报告期(2017年1月1日 - 2017年3月31日)

1.本期已实现收益 -2,315,962.13

2.本期利润 -9,364,423.12

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0117

4.期末基金份额净值 902,562.0267

5.期末基金份额净值 1.1897

注:1.本基金的利润不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计算费用后实际收益水平要低于所列数字；

2.本期已实现收益不包含持有人认购、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。

3.22 日常估值表

32.1 本期报告期基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

单位:人民币元

报告期(2017年1月1日 - 2017年3月31日)

1.阶段 净值增长(%) 0.92%

2.阶段 净值增长率标准差(%) 0.08%

3.阶段 业绩比较基准收益率(%) 0.01%

4.阶段 标准差(%) -1.60%

5.阶段 ①-③ -1.60%

6.阶段 ②-④ 0.24%

7.阶段 过去三个月 -0.92%

8.阶段 ①-③ 0.26%

9.阶段 ②-④ 0.08%

10.阶段 ①-③ 0.01%

11.阶段 ②-④ -1.60%

12.阶段 ①-③ -1.60%

13.阶段 ②-④ 0.24%

14.阶段 ①-③ -1.60%

15.阶段 ②-④ 0.24%

16.阶段 ①-③ -1.60%

17.阶段 ②-④ 0.24%

18.阶段 ①-③ -1.60%

19.阶段 ②-④ 0.24%

20.阶段 ①-③ -1.60%

21.阶段 ②-④ 0.24%

22.阶段 ①-③ -1.60%

23.阶段 ②-④ 0.24%

24.阶段 ①-③ -1.60%

25.阶段 ②-④ 0.24%

26.阶段 ①-③ -1.60%

27.阶段 ②-④ 0.24%

28.阶段 ①-③ -1.60%

29.阶段 ②-④ 0.24%

30.阶段 ①-③ -1.60%

31.阶段 ②-④ 0.24%

32.阶段 ①-③ -1.60%

33.阶段 ②-④ 0.24%

34.阶段 ①-③ -1.60%

35.阶段 ②-④ 0.24%

36.阶段 ①-③ -1.60%

37.阶段 ②-④ 0.24%

38.阶段 ①-③ -1.60%

39.阶段 ②-④ 0.24%

40.阶段 ①-③ -1.60%

41.阶段 ②-④ 0.24%

42.阶段 ①-③ -1.60%

43.阶段 ②-④ 0.24%

44.阶段 ①-③ -1.60%

45.阶段 ②-④ 0.24%

46.阶段 ①-③ -1.60%

47.阶段 ②-④ 0.24%

48.阶段 ①-③ -1.60%

49.阶段 ②-④ 0.24%

50.阶段 ①-③ -1.60%

51.阶段 ②-④ 0.24%

52.阶段 ①-③ -1.60%

53.阶段 ②-④ 0.24%

54.阶段 ①-③ -1.60%

55.阶段 ②-④ 0.24%

56.阶段 ①-③ -1.60%

57.阶段 ②-④ 0.24%

58.阶段 ①-③ -1.60%

59.阶段 ②-④ 0.24%

60.阶段 ①-③ -1.60%

61.阶段 ②-④ 0.24%

62.阶段 ①-③ -1.60%

63.阶段 ②-④ 0.24%

64.阶段 ①-③ -1.60%

65.阶段 ②-④ 0.24%

66.阶段 ①-③ -1.60%

67.阶段 ②-④ 0.24%

68.阶段 ①-③ -1.60%

69.阶段 ②-④ 0.24%

70.阶段 ①-③ -1.60%

71.阶段 ②-④ 0.24%

72.阶段 ①-③ -1.60%

73.阶段 ②-④ 0.24%

74.阶段 ①-③ -1.60%

75.阶段 ②-④ 0.24%

76.阶段 ①-③ -1.60%

77.阶段 ②-④ 0.24%

78.阶段 ①-③ -1.60%

79.阶段 ②-④ 0.24%

80.阶段 ①-③ -1.60%

81.阶段 ②-④ 0.24%

82.阶段 ①-③ -1.60%

83.阶段 ②-④ 0.24%

84.阶段 ①-③ -1.60%

85.阶段 ②-④ 0.24%

86.阶段 ①-③ -1.60%

87.阶段 ②-④ 0.24%

88.阶段 ①-③ -1.60%

89.阶段 ②-④ 0.24%

90.阶段 ①-③ -1.60%

91.阶段 ②-④ 0.24%

92.阶段 ①-③ -1.60%

93.阶段 ②-④ 0.24%

94.阶段 ①-③ -1.60%

95.阶段 ②-④ 0.24%

96.阶段 ①-③ -1.60%

97.阶段 ②-④ 0.24%

98.阶段 ①-③ -1.60%

99.阶段 ②-④ 0.24%

100.阶段 ①-③ -1.60%

101.阶段 ②-④ 0.24%

102.阶段 ①-③ -1.60%

103.阶段 ②-④ 0.24%

104.阶段 ①-③ -1.60%

105.阶段 ②-④ 0.24%

106.阶段 ①-③ -1.60%

107.阶段 ②-④ 0.24%

108.阶段 ①-③ -1.60%

109.阶段 ②-④ 0.24%

110.阶段 ①-③ -1.60%

111.阶段 ②-④ 0.24%

112.阶段 ①-③ -1.60%

113.阶段 ②-④ 0.24%</p