（上接B084版）

| | |
|---|---|
| 北京唐鼎耀华投资咨询有限公司 | 注册地址：北京市延庆县延庆经济开发区百泉街10号2栋236室<br>法定代表人：张鑫<br>电话：010-53570572<br>传真：010-59200800<br>联系人：刘美薇 |
| 上海联泰资产管理有限公司 | 注册地址：中国（上海）自由贸易区富特北路277号3层310室<br>法定代表人：燕斌<br>电话：400-046-6788<br>传真：021-52975270<br>联系人：凌秋艳 |
| 北京虹点基金销售有限公司 | 注册地址：北京市朝阳区工人体育场北路甲2号裙房2层222单元<br>法定代表人：郑毓栋<br>电话：400-068-1176<br>传真：010-56580660<br>联系人：于婷婷 |
| 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司 | 注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#<br>法定代表人：杨懿<br>电话：400-166-1188<br>传真：010-83363072<br>联系人：文雯 |
| 深圳富济财富管理有限公司 | 注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室<br>法定代表人：刘鹏宇<br>电话：0755-83999913<br>传真：0755-83999926<br>联系人：陈勇军 |
| 嘉实财富管理有限公司 | 注册地址：上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心办公楼二期46层4609-10单元<br>法定代表人：赵学军<br>电话：400-021-8850<br>联系人：余水健<br>网址：www.harvestwm.cn |
| 珠海盈米财富管理有限公司 | 注册地址：广东省珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491<br>法定代表人：肖雯<br>电话：020-80629066<br>联系人：刘文红<br>网址：www.yingmi.cn |
| 上海汇付金融服务有限公司 | 注册地址：上海市中山南路100号金外滩国际广场19楼<br>法定代表人：冯修敏<br>电话：400-8213-999<br>联系人：陈云卉<br>网址：https://tty.chinapnr.com/ |
| 上海利得基金销售有限公司 | 注册地址：上海市浦东新区东方路989号中达广场2楼<br>法定代表人：李兴春<br>电话：400-921-7755<br>联系人：王淼磊<br>网址：www.leadfund.com.cn |
| 奕丰金融服务（深圳）有限公司 | 注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室<br>法定代表人：TAN YIK KUAN<br>电话：400-684-0500<br>联系人：陈广浩<br>网址：www.ifastps.com.cn |
| 南京苏宁基金销售有限公司 | 注册地址：南京市玄武区苏宁大道1-5号<br>法定代表人：钱燕飞<br>电话：025-66996699-887226<br>联系人：王锋<br>网址：http://fund.suning.com |
| 北京新浪仓石基金销售有限公司 | 注册地址：北京市海淀区北四环西路58号906<br>法定代表人：张琪<br>电话：010-62675369<br>联系人：付文红<br>网址：http://www.xincai.com/ |
| 北京钱景财富投资管理有限公司 | 注册地址：北京市海淀区丹棱街丹棱soho10层<br>法定代表人：赵荣春<br>电话：400-893-6885<br>联系人：盛海娟<br>网址：http://www.qianjing.com/ |
| 北京蛋卷基金销售有限公司 | 注册地址：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507<br>法定代表人：钟斐斐<br>电话：4000-618-518<br>联系人：威晓强<br>网址：http://www.ncfjj.com/ |
| 上海万得投资顾问有限公司 | 注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路33号11楼B座<br>法定代表人：王延富<br>电话：400-821-0203<br>联系人：徐亚丹<br>网址：http://www.520fund.com.cn/ |
| 上海华信证券有限责任公司 | 注册地址：上海浦东新区世纪大道100号环球金融中心9楼<br>法定代表人：郭林<br>电话：400-820-5999<br>联系人：徐璐<br>网址：www.shhxzq.com |
| 天津国美基金销售有限公司 | 注册地址：天津经济技术开发区南港工业区综合服务区办公楼D座二层202-124室<br>法定代表人：丁东华<br>电话：400-111-0889<br>联系人：郭宝亮<br>网址：www.gomefund.com |
| 北京汇成基金销售有限公司 | 注册地址：北京市海淀区中关村大街11号11层1108<br>法定代表人：王伟刚<br>电话：400-619-9059<br>联系人：丁向坤<br>网址：http://www.fundzone.cn |
| 南京途牛金融信息服务有限公司 | 注册地址：南京市玄武区玄武大道699-1号<br>法定代表人：宋时琳<br>电话：400-799-9999<br>联系人：贺杰<br>网址：http://jr.tuniu.com |
| 凤凰金信（银川）投资管理有限公司 | 注册地址：宁夏回族自治区银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路142号14层1402<br>法定代表人：程刚<br>电话：400-810-5919<br>联系人：张旭<br>网址：www.fengfd.com |
| 上海中正达广投资管理有限公司 | 注册地址：上海市徐汇区龙腾大道2815号302室<br>法定代表人：黄欣<br>电话：400-6767-523<br>联系人：戴珉微<br>网址：www.zzwealth.cn |
| 上海基煜基金销售有限公司 | 注册地址：上海市崇明县长兴镇路潘园公路1800号2号楼6153室（上海泰和经济发展区）<br>法定代表人：王翔<br>电话：400-820-5369<br>联系人：吴鸿飞<br>网址：www.jiyufund.com.cn |
| 中民财富基金销售（上海）有限公司 | 注册地址：上海市黄浦区中山南路100号7层05单元<br>法定代表人：佟洪军<br>电话：400-876-5716<br>联系人：茅且青<br>网址：www.cmiwm.com |
| 北京晟视天下投资管理有限公司 | 注册地址：北京市怀柔区九渡河镇黄坎村735号03室<br>法定代表人：蒋煜<br>电话：400-818-8866<br>联系人：尚瑾<br>网址：www.gscaifu.com |
| 北京创金启富投资管理有限公司 | 注册地址：北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A<br>法定代表人：梁蓉<br>电话：400-6262-818<br>联系人：魏素清<br>网址：www.5irich.com |
| 联储证券有限责任公司 | 注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路333号东方汇经中心9楼<br>法定代表人：沙常明<br>电话：400-620-6868<br>联系人：唐露<br>网址：http://www.lczq.com/ |
| 上海华夏财富投资管理有限公司 | 注册地址：上海市虹口区东大名路687号一幢二楼268室<br>法定代表人：李一梅<br>电话：13911253562<br>联系人：吴振宇<br>网址：https://www.amcfortune.com/ |
| 上海挖财金融信息服务有限公司 | 注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02/03室<br>法定代表人：胡燕亮<br>电话：021-50810687<br>联系人：樊晴晴<br>网址：www.wacaijijin.com |
| 北京肯特瑞基金销售有限公司 | 注册地址：北京市海淀区中关村东路66号1号楼22层2603-06<br>法定代表人：江卉<br>电话：010891892288<br>联系人：徐伯宇<br>网址：http://kenterui.jd.com/ |
| 通华财富(上海)基金销售有限公司 | 注册地址：上海市浦东新区陆家嘴世纪金融广场杨高南路799号3号楼9楼<br>法定代表人：兰奇<br>电话：95156转5<br>联系人：陈益萍<br>网址：www.tonghuafund.com |
| 深圳市前海排排网基金销售有限责任公司 | 注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室<br>法定代表人：李春瑜<br>电话：400-630-3928<br>联系人：华荣杰<br>网址：www.simuwang.com |
| 天津万家财富资产管理有限公司 | 注册地址：天津自贸区（中心商务区）迎宾大道1989号滨海新商大厦公寓2-2413室<br>法定代表人：李修辞<br>电话：010-59013842<br>联系人：王茜蕊<br>网址：http://www.wanjiawealth.com |
| 上海有鱼基金销售有限公司 | 注册地址：中国（上海）自由贸易试验区浦东大道2123号3层3E-2655室<br>法定代表人：林琼<br>客服电话：4007676298<br>联系人：徐海峥<br>公司网址：www.youyufund.com |
| 北京植信基金销售有限公司 | 注册地址：北京朝阳区四惠盛世龙源国食苑10号楼<br>法定代表人：于龙之<br>客服电话：4006-802-123<br>邮箱：service@zhixin-inv.com<br>公司网址：https://www.zhixin-inv.com/ |
| 腾安基金销售（深圳）有限公司 | 注册地址：深圳市南山区科技中一路腾讯大厦11楼<br>法定代表人：刘明军<br>客服电话：95017转1转6或0755-86013388<br>公司网址：https://www.tenganxinxi.com/ |
| 北京恒天明泽基金销售有限公司 | 注册地址：北京市北京经济技术开发区宏达北路10号5层5122室<br>法定代表人：周斌<br>联系人：马鹏程<br>联系电话：010-57756074<br>客服电话：400-736-8868<br>公司网址：http://www.chtfund.com |
| 济安财富（北京）基金销售有限公司 | 注册地址：北京市朝阳区太阳宫中路16号院1号楼冠捷大厦9层307单元<br>法定代表人：杨健<br>联系人：李海燕<br>联系电话：13501184929<br>客服电话：400-673-7010<br>公司网址：http://www.jianfortune.com/ |
| 民商基金销售(上海)有限公司 | 注册地址：上海市黄浦区北京东路666号H区（东座）6楼A31室<br>法定代表人：贲惠琴<br>联系人：董筱爽<br>联系电话：18121169537<br>客服电话：021-50206003<br>公司网址：www.msftec.com |
| 上海大智慧基金销售有限公司 | 注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路428号1号楼1102单元<br>法定代表人：申健<br>联系人：施燕华<br>联系电话：18901685505<br>客服电话：021-20292031<br>公司网址：https://www.wg.com.cn |
| 北京百度百盈基金销售有限公司 | 注册地址：北京市海淀区上地十街10号1幢1层101<br>法定代表人：张旭阳<br>联系人：王语妍<br>联系电话：13810785862<br>客服电话：95055-9<br>公司网址：https://www.baiyingfund.com/ |

基金管理人可根据有关法律法规规定，选择其他符合要求的机构代理销售本基金。

3.2 注册登记机构

名称：招商基金管理有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道7088号

法定代表人：刘辉

成立日期：2002年12月27日

电话：（0755）83196445

传真：（0755）83196436

联系人：宋宇彬

3.3 律师事务所和经办律师

名称：上海源泰律师事务所

注册地址：上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦14楼

负责人：廖海

电话：（021）51150298

传真：（021）51150398

经办律师：刘佳、张雯娟

联系人：刘佳

3.4 会计师事务所和经办注册会计师

名称：德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）

注册地址：上海市延安东路222号外滩中心30楼

执行事务合伙人：曾顺福

电话：021-6141 8888

传真：021-6335 0177

经办注册会计师：汪芳、吴凌志

联系人：汪芳

## §4 基金名称

招商安泰系列开放式证券投资基金

## §5 基金类型

契约型开放式

## §6 投资目标

对投资者进行市场细分，为投资者提供适合其风险承受能力的基金投资品种，在既定的风险程度下争取获得较好的收益。

| 下属基金 | 短期本金安全性 | 当期收益 | 长期资本增值 | 总体投资风险 |
|---|---|---|---|---|
| 招商安泰偏股混合 | 低 | 不稳定 | 高 | 高 |
| 招商安泰平衡混合 | 适中 | 适中 | 适中 | 适中 |
| 招商安泰债券 | 很高 | 最好 | 低 | 低 |

■招商安泰偏股混合追求长期的资本增值。

■招商安泰平衡混合追求当期收益和长期资本增值的平衡。

■招商安泰债券追求较高水平和稳定的当期收益，保证长期本金的安全。

## §7 投资范围

本系列基金的投资范围界定为股票、债券以及中国证监会批准的其它投资品种。股票投资范围为所有在国内依法发行的，具有良好流动性的A股。债券投资的主要品种包括国债、金融债、公司债与可转换债等。

1、招商安泰偏股混合以股票投资为主，债券投资为辅，主要投资于流动性好的A股，国债、金融债、公司债与可转换债以及中国证监会批准的其它投资品种。

2、招商安泰平衡混合的债券和股票的比重保持平衡，主要投资于国债、金融债、公司债与可转换债和流动性好的A股市场发行的股票以及中国证监会批准的其它投资品种。

3、招商安泰债券主要投资于国债、金融债、公司债与可转换债以及中国证监会批准的其它投资品种。

## §8 投资策略

1、投资方法考虑

■引进和应用ING 的投资管理流程。

■投资理念与国外成熟的机构投资者更加趋同。

■引进ING的投资管理工具，并加以本土化，使之广泛应用于投资和研究实践。这些投资管理工具包括PPG数量选股模型、SRS股票评级系统、IRS行业评估系统、以及ING风险管理系统。

2、资产配置

本系列基金旗下包含三个不同资产配置的基金，均为股票/债券基金，其股票/债券的配置比例相对固定，一般不再做战术性的资产配置，只在操作上保证必要的灵活性。

| 下属基金 | 债券 | 股票 | 现金或到期日在一年期以内的政府债券 |
|---|---|---|---|
| 招商安泰偏股混合 | 20% | 75% | ≥5% |
| 招商安泰平衡混合 | 50% | 45% | ≥5% |
| 招商安泰债券 | 95% | – | ≥5% |

上表中所述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

考虑到股票市场可能出现极端情况以及基金管理时实际的操作需要，本系列基金允许下属基金的股票/债券配置比例以基准比例为中心在适当的范围内进行调整。以下是各基金的资产配置调整区间：

■招商安泰偏股混合可能的债券/股票配置为：债券20%—30%，股票65%—80%。

■招商安泰平衡混合可能的债券/股票配置为：债券40%—60%，股票35%—55%。

■招商安泰债券的投资不涉及债券和股票间的资产配置问题，其债券投资比例范围为不低于85%。

3、组合构建：

A、股票组合构建

本系列基金股票投资强调将定量的股票筛选和定性的公司研究有机结合，并实时应用行业评估方法和风险控制手段进行组合调整。其中，公司研究是整个股票投资流程的核心。通过研究，得出对公司盈利成长潜力和合理价值水平的评价，从而发掘出价值被市场低估并具有良好现金流成长性的股票。

本系列基金股票投资的主要过程包括：

（1）以流动性指标筛选，建立备选股票库

（2）对备选库内的股票用模型进行定量分析和评分筛选；

（3）以定性的股票评级系统全面考察上市公司的未来发展；

（4）行业分析模型和其他调整；

（5）建立模拟股票组合；

（6）运用风险控制模型进行组合调整和投资风险控制；

（7）模拟组合的执行。

B、债券组合构建

本系列基金对债券投资组合的方法借鉴了ING 在海外进行投资管理的经验，ING的债券投资采用主动的投资管理，获得与风险相匹配的收益率，同时保证组合的流动性满足正常的现金流的需要。债券投资过程按以下步骤执行：

（1）预测收益率的长期变动趋势

（2）久期管理

（3）债券组合管理

（4）债券组合风险控制

C、投资程序

（1）投资决策委员会审议投资策略、资产配置和其它重大事项；

（2）基金管理部通过股票投资周会和债券投资周会，确定拟投资的个股和个券；

（3）基金经理根据所管基金的特点，确定基金投资组合；

（4）基金经理发送投资指令；

（5）交易部审核与执行投资指令；

（6）数量分析人员对投资组合的分析与评估；

（7）基金经理对组合的检讨与调整。

在投资决策过程中，风险管理部门负责对各决策环节的合规性、事前及事后风险、操作风险等投资风险进行监控，并在整个投资流程完成后，对投资风险及绩效做出评估，提供给投资决策委员会、投资总监、基金经理等相关人员，以供决策参考。

## §9 投资限制

1、投资组合限制

（1）本基金持有一家公司的股票，不得超过基金资产净值的10%；

（2）本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的10%；本基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%。

（3）本系列基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过相应基金基金资产净值的15%；

因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资。

（4）本系列基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致。

（5）本基金参与股票发行申购，所申报的金额不得超过本基金的总资产，所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

（6）不得违反本基金合同关于投资范围、投资策略、和投资比例的约定；

（7）法律法规规定的其他限制。

本基金管理人应当自本基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合以上第1、2条规定比例或者基金合同约定的投资比例的，基金管理人应当在十个交易日内进行调整。

2、禁止行为

（1）承销证券；

（2）投资于其他基金；

（3）以基金的名义使用不属于基金名下的资金买卖证券；

（4）利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；

（5）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；

（6）将基金财产用于非法抵押、担保，资金拆借或者贷款；

（7）从事承担无限责任的投资；

（8）以基金财产进行房地产投资；

（9）向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；

（10）买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；

（11）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

（12）依照法律、行政法规有关规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

## §10 业绩比较基准

根据各基金资产配置比例以及市场现有的相关指数，各基金的业绩比较基准如下：

| 下属基金 | 业绩比较基准 |
|---|---|
| 招商安泰偏股混合 | 上证180指数收益率*75%+中证国债指数收益率*20%+同业存款利率*5% |
| 招商安泰平衡混合 | 中证国债指数收益率*50%+上证180指数收益率*45%+同业存款利率*5% |
| 招商安泰债券 | 中证国债指数收益率*95%+同业存款利率*5% |

## §11 风险收益特征

| 下属基金 | 短期本金安全性 | 当期收益 | 长期资本增值 | 总体投资风险 |
|---|---|---|---|---|
| 招商安泰偏股混合 | 低 | 不稳定 | 高 | 高 |
| 招商安泰平衡混合 | 适中 | 适中 | 适中 | 适中 |
| 招商安泰债券 | 很高 | 最好 | 低 | 低 |

## §12 投资组合报告

招商安泰系列开放式证券投资基金管理人——招商基金管理有限公司的董事会及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责任。

本投资组合报告所载数据截至2019年3月31日，来源于《招商安泰系列开放式证券投资基金2019年第1季度报告》。

1.招商安泰偏股混合型证券投资基金

1.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 324,149,099.78 | 66.66 |
| | 其中：股票 | 324,149,099.78 | 66.66 |
| 2 | 基金投资 | – | – |
| 3 | 固定收益投资 | 102,686,472.45 | 21.12 |
| | 其中：债券 | 102,686,472.45 | 21.12 |
| | 资产支持证券 | – | – |
| 4 | 贵金属投资 | – | – |
| 5 | 金融衍生品投资 | – | – |
| 6 | 买入返售金融资产 | – | – |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | – | – |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 53,612,122.18 | 11.02 |
| 8 | 其他资产 | 5,848,292.93 | 1.20 |
| 9 | 合计 | 486,296,987.34 | 100.00 |

1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

1.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 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 | 采矿业 | 24,975,792.00 | 5.17 |
| C | 制造业 | 167,735,276.58 | 34.71 |
| 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 | 24,064,822.24 | 4.98 |
| H | 住宿和餐饮业 | – | – |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 5,426,598.94 | 1.12 |
| J | 金融业 | 48,239,672.90 | 9.98 |
| K | 房地产业 | 17,179,365.28 | 3.56 |
| L | 租赁和商务服务业 | 17,144,481.84 | 3.55 |
| 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 | 居民服务、修理和其他服务业 | – | – |
| P | 教育 | – | – |
| Q | 卫生和社会工作 | 19,383,090.00 | 4.01 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | – | – |
| S | 综合 | – | – |
| | 合计 | 324,149,099.78 | 67.08 |

1.2.2 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。

1.3 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

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 | 601318 | 中国平安 | 375,959 | 28,986,438.90 | 6.00 |
| 2 | 600809 | 山西汾酒 | 348,600 | 21,079,842.00 | 4.36 |
| 3 | 600004 | 白云机场 | 1,306,808 | 19,314,622.24 | 4.00 |
| 4 | 601336 | 新华保险 | 358,600 | 19,253,234.00 | 3.98 |
| 5 | 600519 | 贵州茅台 | 17,715 | 15,128,432.85 | 3.13 |
| 6 | 000860 | 顺鑫农业 | 234,254 | 14,202,820.02 | 2.94 |
| 7 | 000401 | 冀东水泥 | 717,700 | 12,624,343.00 | 2.61 |
| 8 | 600383 | 金地集团 | 910,300 | 12,516,625.00 | 2.59 |
| 9 | 000661 | 长春高新 | 37,186 | 11,787,590.14 | 2.44 |
| 10 | 300347 | 泰格医药 | 177,300 | 11,754,990.00 | 2.43 |

1.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | 97,770,795.40 | 20.23 |
| 2 | 央行票据 | – | – |
| 3 | 金融债券 | – | – |
| | 其中：政策性金融债 | – | – |
| 4 | 企业债券 | – | – |
| 5 | 企业短期融资券 | – | – |
| 6 | 中期票据 | – | – |
| 7 | 可转债（可交换债） | 4,915,677.05 | 1.02 |
| 8 | 同业存单 | – | – |
| 9 | 其他 | – | – |
| 10 | 合计 | 102,686,472.45 | 21.25 |

1.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 019907 | 09国债07 | 350,000 | 35,035,000.00 | 7.25 |
| 2 | 010107 | 21国债(7) | 315,030 | 32,504,795.40 | 6.73 |
| 3 | 019519 | 15国债19 | 300,000 | 30,231,000.00 | 6.26 |
| 4 | 110053 | 苏银转债 | 21,940 | 2,193,990.38 | 0.45 |
| 5 | 128013 | 洪涛转债 | 9,510 | 938,161.50 | 0.19 |

1.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

1.7 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

1.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

1.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

根据本基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

1.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

1.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

1.10.1 本期国债期货投资政策

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

1.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

1.10.3 本期国债期货投资评价

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

1.11 投资组合报告附注

1.11.1

报告期内基金投资的前十名证券除新华保险（证券代码601336）外其他证券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。

1.11.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库，本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

1.11.3 其他资产构成

金额单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 196,747.95 |
| 2 | 应收证券清算款 | 4,059,787.78 |
| 3 | 应收股利 | – |
| 4 | 应收利息 | 1,184,184.33 |
| 5 | 应收申购款 | 407,572.87 |
| 6 | 其他应收款 | – |
| 7 | 待摊费用 | – |
| 8 | 其他 | – |
| 9 | 合计 | 5,848,292.93 |

1.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 128013 | 洪涛转债 | 938,161.50 | 0.19 |

1.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末投资前十名股票中不存在流通受限情况。

2.招商安泰平衡型证券投资基金

2.1报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 19,240,632.47 | 42.85 |
| | 其中：股票 | 19,240,632.47 | 42.85 |
| 2 | 基金投资 | – | – |
| 3 | 固定收益投资 | 24,052,128.19 | 53.57 |
| | 其中：债券 | 24,052,128.19 | 53.57 |
| | 资产支持证券 | – | – |
| 4 | 贵金属投资 | – | – |
| 5 | 金融衍生品投资 | – | – |
| 6 | 买入返售金融资产 | – | – |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | – | – |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 1,295,032.07 | 2.88 |
| 8 | 其他资产 | 314,579.08 | 0.70 |
| 9 | 合计 | 44,902,371.81 | 100.00 |

2.2报告期末按行业分类的股票投资组合

2.2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 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 | 12,662.00 | 0.03 |
| B | 采矿业 | 298,072.00 | 0.72 |
| C | 制造业 | 10,609,516.23 | 25.79 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | – | – |
| E | 建筑业 | 612.00 | 0.00 |
| F | 批发和零售业 | – | – |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 289,875.00 | 0.70 |
| H | 住宿和餐饮业 | – | – |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 9,985.00 | 0.02 |
| J | 金融业 | 6,696,028.24 | 16.27 |
| K | 房地产业 | 730,228.00 | 1.77 |
| L | 租赁和商务服务业 | 357,408.00 | 0.87 |
| 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 | 居民服务、修理和其他服务业 | – | – |
| P | 教育 | – | – |
| Q | 卫生和社会工作 | – | – |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 236,246.00 | 0.57 |
| S | 综合 | – | – |
| | 合计 | 19,240,632.47 | 46.77 |

2.2.2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。

2.3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

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 | 601318 | 中国平安 | 37,334 | 2,878,451.40 | 7.00 |
| 2 | 000333 | 美的集团 | 42,700 | 2,080,771.00 | 5.06 |
| 3 | 601939 | 建设银行 | 245,100 | 1,703,445.00 | 4.14 |
| 4 | 600309 | 万华化学 | 32,400 | 1,475,172.00 | 3.59 |
| 5 | 600519 | 贵州茅台 | 1,600 | 1,366,384.00 | 3.32 |
| 6 | 002142 | 宁波银行 | 62,741 | 1,332,618.84 | 3.24 |
| 7 | 603288 | 海天味业 | 11,152 | 966,878.40 | 2.35 |
| 8 | 000538 | 云南白药 | 7,700 | 658,350.00 | 1.60 |
| 9 | 002271 | 东方雨虹 | 21,900 | 461,433.00 | 1.12 |
| 10 | 600398 | 海澜之家 | 42,200 | 412,294.00 | 1.00 |

2.4报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | 7,046,980.30 | 17.13 |
| 2 | 央行票据 | – | – |
| 3 | 金融债券 | 2,631,516.60 | 6.40 |
| | 其中：政策性金融债 | 2,631,516.60 | 6.40 |
| 4 | 企业债券 | 14,164,635.50 | 34.43 |
| 5 | 企业短期融资券 | – | – |
| 6 | 中期票据 | – | – |
| 7 | 可转债（可交换债） | 208,995.79 | 0.51 |
| 8 | 同业存单 | – | – |
| 9 | 其他 | – | – |
| 10 | 合计 | 24,052,128.19 | 58.46 |

2.5报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 010107 | 21国债(7) | 41,890 | 4,322,210.20 | 10.51 |
| 2 | 136087 | 15保利01 | 24,000 | 2,398,560.00 | 5.83 |
| 3 | 136253 | 16中油03 | 23,140 | 2,302,430.00 | 5.60 |
| 4 | 136230 | 16宏桥05 | 19,000 | 1,959,090.00 | 4.76 |
| 5 | 122187 | 12旋纤债 | 19,340 | 1,955,467.40 | 4.75 |

2.6报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

2.7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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

2.8报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

2.9报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

2.9.1报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

根据本基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

2.9.2本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

2.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

2.10.1本期国债期货投资政策

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

2.10.2报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

2.10.3本期国债期货投资评价

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

2.11投资组合报告附注

2.11.1

报告期内基金投资的前十名证券除16中油03（证券代码136253）、建设银行（证券代码601939）外其他证券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。

1、16中油03（证券代码136253）

根据2018年5月31日发布的相关公告，该证券发行人因违规经营，被六合区安监局处以罚款。

根据2018年10月31日发布的相关公告，该证券发行人因未依法履行职责，被吉林省安监局处以罚款。

2、建设银行（证券代码601939）

根据发布的相关公告，该证券发行人在报告期内多次受到监管机构的处罚。

对上述证券的投资决策程序的说明：本基金投资上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

2.11.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库，本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

2.11.3其他资产构成

金额单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 11,599.22 |
| 2 | 应收证券清算款 | – |
| 3 | 应收股利 | – |
| 4 | 应收利息 | 294,763.41 |
| 5 | 应收申购款 | 8,216.45 |
| 6 | 其他应收款 | – |
| 7 | 待摊费用 | – |
| 8 | 其他 | – |
| 9 | 合计 | 314,579.08 |

2.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

2.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末投资前十名股票中不存在流通受限情况。

3.招商安泰债券基金

3.1报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | – | – |
| | 其中：股票 | – | – |
| 2 | 基金投资 | – | – |
| 3 | 固定收益投资 | 374,045,935.10 | 96.71 |
| | 其中：债券 | 374,045,935.10 | 96.71 |
| | 资产支持证券 | – | – |
| 4 | 贵金属投资 | – | – |
| 5 | 金融衍生品投资 | – | – |
| 6 | 买入返售金融资产 | – | – |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | – | – |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 4,044,850.73 | 1.05 |
| 8 | 其他资产 | 8,692,252.19 | 2.25 |
| 9 | 合计 | 386,783,038.02 | 100.00 |

3.2报告期末按行业分类的股票投资组合

3.2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

3.2.2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。

3.3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

本基金本报告期末未持有股票。

3.4报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | 2,000,000.00 | 0.66 |
| 2 | 央行票据 | – | – |
| 3 | 金融债券 | 71,573,000.00 | 23.48 |
| | 其中：政策性金融债 | 71,573,000.00 | 23.48 |
| 4 | 企业债券 | 97,213,154.10 | 31.89 |
| 5 | 企业短期融资券 | 30,202,000.00 | 9.91 |
| 6 | 中期票据 | 166,684,900.00 | 54.68 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 6,372,881.00 | 2.09 |
| 8 | 同业存单 | – | – |
| 9 | 其他 | – | – |
| 10 | 合计 | 374,045,935.10 | 122.71 |

3.5报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 1480344 | 14金坛国发债 | 400,000 | 25,004,000.00 | 8.20 |
| 2 | 180204 | 18国开04 | 200,000 | 20,950,000.00 | 6.87 |
| 3 | 180208 | 18国开08 |