

## 招商瑞丰灵活配置混合型发起式证券投资基金

## [2015] 第三季度报告

基金管理人：招商基金管理有限公司  
基金托管人：中国银行股份有限公司  
报告送出日期：2015年10月24日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及监事会在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。

基金托管人招行银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年10月22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内。除特别说明外，其他各项指标由基金管理人计算并由基金管理人复核后披露。

基金的过往业绩并不代表未来表现，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。

本基金报告期为2015年7月1日起至9月30日止。

## (2) 基金产品概况

基金简称	招商瑞丰灵活配置混合型发起式证券投资基金
基金主代码	000014
交易代码	000014
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年11月6日
报告期末基金份额总额	125,465,442.07份

通过本基金的配置和主动的资产配置，滋润大类资产配置空间，在精选个股的基础上，通过行业轮动和仓位的调整，把握市场趋势，从而实现收益。

本基金从以下几个方面，首先是对于大类资产的配置，在一定程度上可能能降低整体的风险。

其次是对于个股的精选，从行业和基本面两个方面，选择对应的头部公司，精选具有好质地的个股和行业龙头股。

最后是对于仓位的控制，通过仓位的调整，把握市场的节奏。

本基金的过往业绩不构成未来表现，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。

本基金报告期为2015年7月1日起至9月30日止。

## (3) 主要财务指标

单位：人民币元

报告期(2015年7月1日 - 2015年9月30日)

1.本期已实现收益 41,017,340.03

2.本期利润 -10,206,380.94

3.期末可供分配利润 -20,861.61

4.期末基金资产净值 440,425,514.07

5.期末基金份额净值 1.031

注:1.本基金的基金管理费不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字;

2.本期已实现收益指基金本期利息收入、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,本期利润为期初至本期末的当期利润;

3.2.1 本基金份额净值增长率为即时净值增长率与同期基准收益率的比较基准收益变动的比较

阶段 净值增长(%) 累计净值增长(%) 业绩比较基准收益(%) 业绩比较基准收益变动(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -0.02% 0.14% -0.74% 20.1% 365.0% -1.0%

注:本基金对现金的最低赎回比例为60%~70%,折算系数为40%~45%中位数的折算系数,赎回时本基金在每个交易日实现再平衡。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:本基金对现金的最低赎回比例为60%~70%,折算系数为40%~45%中位数的折算系数,赎回时本基金在每个交易日实现再平衡。

3.3 管理费和基金净值表现

单位:人民币元

报告期(2015年7月1日 - 2015年9月30日)

1.本期已实现收益 41,017,340.03

2.本期利润 -10,206,380.94

3.期末可供分配利润 -20,861.61

4.期末基金资产净值 440,425,514.07

5.期末基金份额净值 1.031

注:1.本基金的基金管理费不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字;

2.本期已实现收益指基金本期利息收入、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,本期利润为期初至本期末的当期利润;

3.2.1 本基金份额净值增长率为即时净值增长率与同期基准收益率的比较基准收益变动的比较

阶段 净值增长(%) 累计净值增长(%) 业绩比较基准收益(%) 业绩比较基准收益变动(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -0.02% 0.14% -0.74% 20.1% 365.0% -1.0%

注:本基金对现金的最低赎回比例为60%~70%,折算系数为40%~45%中位数的折算系数,赎回时本基金在每个交易日实现再平衡。

3.4 管理费费率

注:本基金的基金管理费不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字;

4.2 费用费率

注:本基金的基金管理费率为1.50%;基金管理费每日按应收未付的基金管理费金额乘以每日基金管理费的比率计算,并按日计提,按月支付;基金管理费的计算方法详见《基金合同》。

4.3 申购、赎回费用

注:本基金的申购费用由申购人承担,在申购时支付,不列入基金资产;赎回费用由赎回人承担,在赎回时支付,列入基金资产。

4.4 买卖、定期定额投资费用

注:本基金的买卖费用由买卖人承担,在买卖时支付,不列入基金资产;定期定额投资费用由定期定额投资人承担,在定期定额投资时支付,不列入基金资产。

4.5 其他费用

注:本基金的其他费用由基金管理人根据具体情况确定并公告,不列入基金资产。

4.6 托管费

注:本基金的托管费由基金托管人承担,在支付托管费时支付,不列入基金资产。

4.7 销售服务费

注:本基金的销售服务费由基金管理人承担,在支付销售服务费时支付,不列入基金资产。

4.8 其他费用

注:本基金的其他费用由基金管理人根据具体情况确定并公告,不列入基金资产。

4.9 合计

注:本基金的管理费、托管费、申购费、赎回费、定期定额投资费、销售服务费等费用不包含持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字;

5.1 重要提示

基金管理人的董事会及监事会在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。

基金托管人招行银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年10月22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内。除特别说明外,其他各项指标由基金管理人计算并由基金管理人复核后披露。

基金的过往业绩并不代表未来表现,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。

本基金报告期为2015年7月1日起至9月30日止。

## (5) 基金产品概况

注:本基金的基金管理费不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字;

5.2 基金收益

注:本基金的基金管理费率为1.50%;基金管理费每日按应收未付的基金管理费金额乘以每日基金管理费的比率计算,并按日计提,按月支付;基金管理费的计算方法详见《基金合同》。

5.3 申购赎回费用

注:本基金的申购费用由申购人承担,在申购时支付,不列入基金资产;赎回费用由赎回人承担,在赎回时支付,列入基金资产。

5.4 买卖、定期定额投资费用

注:本基金的买卖费用由买卖人承担,在买卖时支付,不列入基金资产;定期定额投资费用由定期定额投资人承担,在定期定额投资时支付,不列入基金资产。

5.5 其他费用

注:本基金的其他费用由基金管理人根据具体情况确定并公告,不列入基金资产。

5.6 托管费

注:本基金的托管费由基金托管人承担,在支付托管费时支付,不列入基金资产。

5.7 销售服务费

注:本基金的销售服务费由基金管理人承担,在支付销售服务费时支付,不列入基金资产。

5.8 其他费用

注:本基金的其他费用由基金管理人根据具体情况确定并公告,不列入基金资产。

5.9 合计

注:本基金的管理费、托管费、申购费、赎回费、定期定额投资费、销售服务费等费用不包含持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字;

5.10 重要提示

基金管理人的董事会及监事会在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。

基金托管人招行银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年10月22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内。除特别说明外,其他各项指标由基金管理人计算并由基金管理人复核后披露。

基金的过往业绩并不代表未来表现,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。

本基金报告期为2015年7月1日起至9月30日止。

## (6) 基金产品概况

注:本基金的基金管理费不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字;

5.2 基金收益

注:本基金的基金管理费率为1.50%;基金管理费每日按应收未付的基金管理费金额乘以每日基金管理费的比率计算,并按日计提,按月支付;基金管理费的计算方法详见《基金合同》。

5.3 申购赎回费用

注:本基金的申购费用由申购人承担,在申购时支付,不列入基金资产;赎回费用由赎回人承担,在赎回时支付,列入基金资产。

5.4 买卖、定期定额投资费用

注:本基金的买卖费用由买卖人承担,在买卖时支付,不列入基金资产;定期定额投资费用由定期定额投资人承担,在定期定额投资时支付,不列入基金资产。

5.5 其他费用

注:本基金的其他费用由基金管理人根据具体情况确定并公告,不列入基金资产。

5.6 托管费

注:本基金的托管费由基金托管人承担,在支付托管费时支付,不列入基金资产。

5.7 销售服务费

注:本基金的销售服务费由基金管理人承担,在支付销售服务费时支付,不列入基金资产。

5.8 其他费用

注:本基金的其他费用由基金管理人根据具体情况确定并公告,不列入基金资产。

5.9 合计

注:本基金的管理费、托管费、申购费、赎回费、定期定额投资费、销售服务费等费用不包含持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字;

5.10 重要提示

基金管理人的董事会及监事会在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。

基金托管人招行银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年10月22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内。除特别说明外,其他各项指标由基金管理人计算并由基金管理人复核后披露。

基金的过往业绩并不代表未来表现,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。

本基金报告期为2015年7月1日起至9月30日止。

## (7) 基金产品概况

注:本基金的基金管理费不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字;

5.2 基金收益

注:本基金的基金管理费率为1.50%;基金管理费每日按应收未付的基金管理费金额乘以每日基金管理费的比率计算,并按日计提,按月支付;基金管理费的计算方法详见《基金合同》。

5.3 申购赎回费用

注:本基金的申购费用由申购人承担,在申购时支付,不列入基金资产;赎回费用由赎回人承担,在赎回时支付,列入基金资产。

5.4 买卖、定期定额投资费用

注:本基金的买卖费用由买卖人承担,在买卖时支付,不列入基金资产;定期定额投资费用由定期定额投资人承担,在定期定额投资时支付,不列入基金资产。

5.5 其他费用

注:本基金的其他费用由基金管理人根据具体情况确定并公告,不列入基金资产。

5.6 托管费

注:本基金的托管费由基金托管人承担,在支付托管费时支付,不列入基金资产。

5.7 销售服务费

注:本基金的销售服务费由基金管理人承担,在支付销售服务费时支付,不列入基金资产。

5.8 其他费用

注:本基金的其他费用由基金管理人根据具体情况确定并公告,不列入基金资产。

5.9 合计

注:本基金的管理费、托管费、申购费、赎回费、定期定额投资费、销售服务费等费用不包含持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字;

5.10 重要提示

基金管理人的董事会及监事会在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。

基金托管人招行银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年10月22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内。除特别说明外,其他各项指标由基金管理人计算并由基金管理人复核后披露。

基金的过往业绩并不代表未来表现,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。

本基金报告期为2015年7月1日起至9月30日止。

## (8) 基金产品概况

注:本基金的基金管理费不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字;

5.2 基金收益

注:本基金的基金管理费率为1.50%;基金管理费每日按应收未付的基金管理费金额乘以每日基金管理费的比率计算,并按日计提,按月支付;