

招商安裕保本混合型证券投资基金

[2016] 第四季度报告

基金管理人:招商基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

报告送出日期:2017年1月20日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事局及监事会对本基金所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其实质性、准确性、完整性和及时性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据基金合同约定，于2017年1月19日核发了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等信息，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

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。

基金过往业绩并不代表其未来表现。投资人须充分了解基金的风险，投资人应在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中的财务数据未经审计。

本基金报告期自2016年10月1日起至2016年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 招商安裕保本混合

基金主代码 002687

交易代码 002687

基金运作方式 灵动开放型

基金份额生效日 2016年07月20日

报告期基金净值增长率 2.91% 502 422560

投资目标 本基金主要投资于股票、债券、货币市场工具等金融资产，通过资产配置和积极管理，力争在风险控制的前提下实现基金资产的保值增值。

投资策略 本基金将综合运用多种分析方法，通过深入研究宏观经济、政策环境、行业趋势、公司基本面、估值水平、流动性等因素，精选具有投资价值的股票，同时结合对宏观经济、利率、收益率曲线变化的研究，动态调整组合中股票、债券、货币市场工具的配置比例，以达到分散投资风险、提高收益的目的。

业绩比较基准 人民币计价的恒生综合指数(股票)×40%+招商稳健债基C的份额净值×50%+银行存款利息收入×10%

风险收益特征 本基金为保本混合型基金，风险收益特征与招商稳健债基C相似，属于中低风险品种。

基金管理人 中国工商银行股份有限公司

基金托管人 招商基金管理有限公司

基金合同生效日 2016年07月20日

报告期基金净值增长率 2.91% 502 422560

报告期基金净值增长率标准差 0.00%

报告期基金净值增长率最大回撤 -0.05%

报告期基金净值增长率夏普比率 0.00%

报告期基金净值增长率标准差/夏普比率 0.00%

报告期基金净值增长率/夏普比率 0.00%