

信息披露 Disclosure

招商丰盛稳定增长灵活配置混合型证券投资基金

2017年第三季度报告

招商丰盛稳定增长混合型证券投资基金管理人招商基金管理有限公司关于旗下权益类基金业绩比较基准调整的公告

4.2 基金管理人(以下简称“公司”)已建立完善的基金投资决策流程,确保各投资组合享有公平的投资决策机会。公司建立了所有组合适用的投资决策流程,制定明确的投资决策标准,维护程序,公司拥有健全的投资授权机制,明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资主体的职责和权限划分,投资由投资组合经理在授权范围内自主决策,超过投资权限的操作需经过严格的审批程序。公司的相关研究成果向内部所有投资组合开放,投资决策过程不存在各投资组合间不公平的问题。

4.3 公平交易专项说明
 4.3.1 公平交易制度的执行情况
 基金管理人(以下简称“公司”)已建立完善的基金投资决策流程,确保各投资组合享有公平的投资决策机会。公司建立了所有组合适用的投资决策流程,制定明确的投资决策标准,维护程序,公司拥有健全的投资授权机制,明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资主体的职责和权限划分,投资由投资组合经理在授权范围内自主决策,超过投资权限的操作需经过严格的审批程序。公司的相关研究成果向内部所有投资组合开放,投资决策过程不存在各投资组合间不公平的问题。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析
 报告期内,股票市场上有所上涨,大盘指数跑赢小盘指数,其中沪深300指数上涨4.63%,上证50指数上涨4.80%,创业板指数下跌2.69%。行业上,受到G5前通胀回落,消费升级,汽车销量超预期支撑,食品饮料、医药行业的龙头蓝筹股受追捧价值投资。消费市场保持高景气,10年国债一直在3.6%左右波动,银行间7天回购大部分时间在3%到4%之间窄幅震荡,短久期债券受此影响较大,债市市场相对谨慎,以短久期、高等级债券为主。

报告期内,本基金基金份额净值增长率为-0.41%,C类份额净值增长率为-0.48%,同期业绩比较基准增长率为1.13%。

4.6 报告期内本基金参与的交易公平交易专项说明
 报告期内,本基金未发生基金资产净值前十个工作日内出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情况。

5 投资组合报告
 5.1 报告期末基金资产组合情况
 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
 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五名股票投资明细
 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
 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
 5.6 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资产支持证券投资明细
 5.7 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
 5.8 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权证投资明细
 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
 5.10 报告期末本基金投资的国债期货的投资和损益明细

招商基金管理有限公司
 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:2017年10月26日

1. 重要提示
 基金管理人、基金托管人、基金销售机构不存在虚假记载、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。
 基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年10月25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容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
 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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失或本金增值。
 基金的投资业绩并不预示其未来表现,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。
 本报告自2017年7月1日起至9月30日止。
 本报告日期:2017年7月1日至9月30日止

2 基金产品概况

招商丰盛稳定增长混合A		招商丰盛稳定增长混合C	
基金代码	000530	基金代码	000531
交易场所	场内场外	交易场所	场内
基金运作方式	契约型开放式	基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日期	2014年3月7日	基金合同生效日期	2014年3月7日
基金管理人	招商基金管理有限公司	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	基金托管人	中国银行股份有限公司
业绩比较基准	沪深300指数收益率*90%+上证国债指数收益率*10%	业绩比较基准	沪深300指数收益率*85%+上证国债指数收益率*15%
投资策略	本基金采取积极的投资策略,在严格控制风险和保持流动性资产的前提下,通过精选个股和债券,力争实现基金资产的长期增值。	投资策略	本基金采取积极的投资策略,在严格控制风险和保持流动性资产的前提下,通过精选个股和债券,力争实现基金资产的长期增值。
风险控制	本基金采取自上而下与自下而上相结合的方式进行资产配置,并采用分散化投资策略,力争将基金资产的波动率控制在较低水平,从而实现基金资产的长期增值。	风险控制	本基金采取自上而下与自下而上相结合的方式进行资产配置,并采用分散化投资策略,力争将基金资产的波动率控制在较低水平,从而实现基金资产的长期增值。
基金管理人承诺	本基金管理人将按照《基金合同》的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则,为基金份额持有人的利益,恪尽职守,切实履行受托管理职责。	基金管理人承诺	本基金管理人将按照《基金合同》的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则,为基金份额持有人的利益,恪尽职守,切实履行受托管理职责。

3.1 主要财务指标

指标	招商丰盛稳定增长混合A	招商丰盛稳定增长混合C
本期基金份额净值增长率	-0.41%	-0.48%
本期基金份额净值增长率标准差	0.80%	1.15%
同期业绩比较基准收益率	1.13%	0.00%
基金份额持有人数量及基金份额持有人户数	6079	1844

招商丰泰灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)

2017年第三季度报告

招商丰泰灵活配置混合型证券投资基金管理人招商基金管理有限公司关于旗下权益类基金业绩比较基准调整的公告

4.2 基金管理人(以下简称“公司”)已建立完善的基金投资决策流程,确保各投资组合享有公平的投资决策机会。公司建立了所有组合适用的投资决策流程,制定明确的投资决策标准,维护程序,公司拥有健全的投资授权机制,明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资主体的职责和权限划分,投资由投资组合经理在授权范围内自主决策,超过投资权限的操作需经过严格的审批程序。公司的相关研究成果向内部所有投资组合开放,投资决策过程不存在各投资组合间不公平的问题。

4.3 公平交易专项说明
 4.3.1 公平交易制度的执行情况
 基金管理人(以下简称“公司”)已建立完善的基金投资决策流程,确保各投资组合享有公平的投资决策机会。公司建立了所有组合适用的投资决策流程,制定明确的投资决策标准,维护程序,公司拥有健全的投资授权机制,明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资主体的职责和权限划分,投资由投资组合经理在授权范围内自主决策,超过投资权限的操作需经过严格的审批程序。公司的相关研究成果向内部所有投资组合开放,投资决策过程不存在各投资组合间不公平的问题。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析
 报告期内,股票市场上有所上涨,大盘指数跑赢小盘指数,其中沪深300指数上涨4.63%,上证50指数上涨4.80%,创业板指数下跌2.69%。行业上,受到G5前通胀回落,消费升级,汽车销量超预期支撑,食品饮料、医药行业的龙头蓝筹股受追捧价值投资。消费市场保持高景气,10年国债一直在3.6%左右波动,银行间7天回购大部分时间在3%到4%之间窄幅震荡,短久期债券受此影响较大,债市市场相对谨慎,以短久期、高等级债券为主。

报告期内,本基金基金份额净值增长率为-0.41%,C类份额净值增长率为-0.48%,同期业绩比较基准增长率为1.13%。

4.6 报告期内本基金参与的交易公平交易专项说明
 报告期内,本基金未发生基金资产净值前十个工作日内出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情况。

5 投资组合报告
 5.1 报告期末基金资产组合情况
 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
 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五名股票投资明细
 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
 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
 5.6 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资产支持证券投资明细
 5.7 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
 5.8 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权证投资明细
 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
 5.10 报告期末本基金投资的国债期货的投资和损益明细

招商基金管理有限公司
 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:2017年10月26日

1. 重要提示
 基金管理人、基金托管人、基金销售机构不存在虚假记载、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。
 基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年10月25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容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
 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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失或本金增值。
 基金的投资业绩并不预示其未来表现,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。
 本报告自2017年7月1日起至9月30日止。
 本报告日期:2017年7月1日至9月30日止

2 基金产品概况

招商丰泰灵活配置混合A		招商丰泰灵活配置混合C	
基金代码	001901	基金代码	001902
交易场所	场内场外	交易场所	场内
基金运作方式	契约型开放式	基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日期	2015年6月11日	基金合同生效日期	2015年6月11日
基金管理人	招商基金管理有限公司	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	基金托管人	中国银行股份有限公司
业绩比较基准	沪深300指数收益率*80%+上证国债指数收益率*20%	业绩比较基准	沪深300指数收益率*75%+上证国债指数收益率*25%
投资策略	本基金采取积极的投资策略,在严格控制风险和保持流动性资产的前提下,通过精选个股和债券,力争实现基金资产的长期增值。	投资策略	本基金采取积极的投资策略,在严格控制风险和保持流动性资产的前提下,通过精选个股和债券,力争实现基金资产的长期增值。
风险控制	本基金采取自上而下与自下而上相结合的方式进行资产配置,并采用分散化投资策略,力争将基金资产的波动率控制在较低水平,从而实现基金资产的长期增值。	风险控制	本基金采取自上而下与自下而上相结合的方式进行资产配置,并采用分散化投资策略,力争将基金资产的波动率控制在较低水平,从而实现基金资产的长期增值。
基金管理人承诺	本基金管理人将按照《基金合同》的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则,为基金份额持有人的利益,恪尽职守,切实履行受托管理职责。	基金管理人承诺	本基金管理人将按照《基金合同》的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则,为基金份额持有人的利益,恪尽职守,切实履行受托管理职责。

3.1 主要财务指标

指标	招商丰泰灵活配置混合A	招商丰泰灵活配置混合C
本期基金份额净值增长率	1.76%	0.15%
本期基金份额净值增长率标准差	0.75%	1.02%
同期业绩比较基准收益率	1.13%	0.00%
基金份额持有人数量及基金份额持有人户数	6079	1844

招商丰泽灵活配置混合型证券投资基金

2017年第三季度报告

招商丰泽灵活配置混合型证券投资基金管理人招商基金管理有限公司关于旗下权益类基金业绩比较基准调整的公告

4.2 基金管理人(以下简称“公司”)已建立完善的基金投资决策流程,确保各投资组合享有公平的投资决策机会。公司建立了所有组合适用的投资决策流程,制定明确的投资决策标准,维护程序,公司拥有健全的投资授权机制,明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资主体的职责和权限划分,投资由投资组合经理在授权范围内自主决策,超过投资权限的操作需经过严格的审批程序。公司的相关研究成果向内部所有投资组合开放,投资决策过程不存在各投资组合间不公平的问题。

4.3 公平交易专项说明
 4.3.1 公平交易制度的执行情况
 基金管理人(以下简称“公司”)已建立完善的基金投资决策流程,确保各投资组合享有公平的投资决策机会。公司建立了所有组合适用的投资决策流程,制定明确的投资决策标准,维护程序,公司拥有健全的投资授权机制,明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资主体的职责和权限划分,投资由投资组合经理在授权范围内自主决策,超过投资权限的操作需经过严格的审批程序。公司的相关研究成果向内部所有投资组合开放,投资决策过程不存在各投资组合间不公平的问题。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析
 报告期内,股票市场上有所上涨,大盘指数跑赢小盘指数,其中沪深300指数上涨4.63%,上证50指数上涨4.80%,创业板指数下跌2.69%。行业上,受到G5前通胀回落,消费升级,汽车销量超预期支撑,食品饮料、医药行业的龙头蓝筹股受追捧价值投资。消费市场保持高景气,10年国债一直在3.6%左右波动,银行间7天回购大部分时间在3%到4%之间窄幅震荡,短久期债券受此影响较大,债市市场相对谨慎,以短久期、高等级债券为主。

报告期内,本基金基金份额净值增长率为-0.41%,C类份额净值增长率为-0.48%,同期业绩比较基准增长率为1.13%。

4.6 报告期内本基金参与的交易公平交易专项说明
 报告期内,本基金未发生基金资产净值前十个工作日内出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情况。

5 投资组合报告
 5.1 报告期末基金资产组合情况
 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
 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五名股票投资明细
 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
 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
 5.6 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资产支持证券投资明细
 5.7 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
 5.8 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权证投资明细
 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
 5.10 报告期末本基金投资的国债期货的投资和损益明细

招商基金管理有限公司
 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:2017年10月26日

1. 重要提示
 基金管理人、基金托管人、基金销售机构不存在虚假记载、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。
 基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年10月25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容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
 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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失或本金增值。
 基金的投资业绩并不预示其未来表现,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。
 本报告自2017年7月1日起至9月30日止。
 本报告日期:2017年7月1日至9月30日止

2 基金产品概况

招商丰泽灵活配置混合A		招商丰泽灵活配置混合C	
基金代码	001903	基金代码	001904
交易场所	场内场外	交易场所	场内
基金运作方式	契约型开放式	基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日期	2015年6月11日	基金合同生效日期	2015年6月11日
基金管理人	招商基金管理有限公司	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	基金托管人	中国银行股份有限公司
业绩比较基准	沪深300指数收益率*80%+上证国债指数收益率*20%	业绩比较基准	沪深300指数收益率*75%+上证国债指数收益率*25%
投资策略	本基金采取积极的投资策略,在严格控制风险和保持流动性资产的前提下,通过精选个股和债券,力争实现基金资产的长期增值。	投资策略	本基金采取积极的投资策略,在严格控制风险和保持流动性资产的前提下,通过精选个股和债券,力争实现基金资产的长期增值。
风险控制	本基金采取自上而下与自下而上相结合的方式进行资产配置,并采用分散化投资策略,力争将基金资产的波动率控制在较低水平,从而实现基金资产的长期增值。	风险控制	本基金采取自上而下与自下而上相结合的方式进行资产配置,并采用分散化投资策略,力争将基金资产的波动率控制在较低水平,从而实现基金资产的长期增值。
基金管理人承诺	本基金管理人将按照《基金合同》的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则,为基金份额持有人的利益,恪尽职守,切实履行受托管理职责。	基金管理人承诺	本基金管理人将按照《基金合同》的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则,为基金份额持有人的利益,恪尽职守,切实履行受托管理职责。

3.1 主要财务指标

指标	招商丰泽灵活配置混合A	招商丰泽灵活配置混合C
本期基金份额净值增长率	1.76%	0.15%
本期基金份额净值增长率标准差	0.75%	1.02%
同期业绩比较基准收益率	1.13%	0.00%
基金份额持有人数量及基金份额持有人户数	6079	1844

招商丰益灵活配置混合型证券投资基金

2017年第三季度报告

招商基金管理有限公司
 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:2017年10月26日