

B054 信息披露 Disclosure

(上接B053版)

5.招商转债A份额、招商转债B份额申报价格最小变动单位为0.001元人民币；

6.招商转债A份额、招商转债B份额在上海交易所(深圳证券交易所证券投资基金上市规则)、《深圳证券交易所交易规则》及相关规定。

7.4 上市交易的费用
招商转债A份额、招商转债B份额上市交易的费用按照深圳证券交易所相关规定及有关规则执行。

7.5 上市交易行情提示
招商转债A份额、招商转债B份额在深圳交易所挂牌交易,交易行情通过交易系统发布。行情发布系统按照提示前一日收盘的基金份额净值。

如条件允许,招商转债A份额、招商转债B份额上市后可通过提示交易日内基金份额参考价格,并详细规则见相关公告。

7.6 上市交易的费用
招商转债A份额、招商转债B份额的申购、赎回、上市、恢复上市和终止上市按照相关证券法律法规、中国证监会及深圳证券交易所相关规定执行。

7.7 相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所相关规定执行,且此修改须经召开基金份额持有人大会。

8.5 基金的份额配对转换
本基金基金合同生效后,基金份额持有人可将基金份额转入办理份额配对转换业务。

8.1 份额配对转换是指,基金份额持有人将招商转债A份额、招商转债B份额之间的配对转换,包括分拆和合并两个方面。

8.2 份额配对转换业务办理时间
招商转债A份额、招商转债B份额的申购、赎回、上市、恢复上市和终止上市按照相关证券法律法规、中国证监会及深圳证券交易所相关规定执行,且此修改须经召开基金份额持有人大会。

8.3 份额配对转换的业务办理时间
份额配对转换自招商转债A份额、招商转债B份额上市交易后不超过6个月的时间内开始办理,基金管理人应在开始办理份额配对转换的具体日期前2日在指定媒介公告。

8.4 份额配对转换的公告
1. 份额配对转换的公告
2. 申请进行分拆的招商可转债份额场内份额必须是相关业务公告规定份额的正整数倍。

8.5 份额配对转换的公告
3. 申请进行合并的招商转债A份额与招商转债B份额必须同时提出申请,且招商转债A份额与招商转债B份额的份额数必须分别为相关业务公告规定的正整数倍、份额数比例为7:3。

8.6 招商可转债份额的场内份额申请进行分析,须经系统委托招商可转债份额的场内份额后方可进行。

8.7 份额配对转换的公告
8.8 招商可转债的公告

8.9 投资决策
1. 决策依据
2. 申请进行分拆的招商可转债份额场内份额必须是相关业务公告规定份额的正整数倍。

8.10 招商可转债的公告
8.11 投资决策
8.12 招商可转债的公告

8.13 招商可转债的公告
8.14 招商可转债的公告

8.15 招商可转债的公告
8.16 招商可转债的公告

8.17 招商可转债的公告
8.18 招商可转债的公告

8.19 招商可转债的公告
8.20 招商可转债的公告

8.21 招商可转债的公告
8.22 招商可转债的公告

8.23 招商可转债的公告
8.24 招商可转债的公告

8.25 招商可转债的公告
8.26 招商可转债的公告

8.27 招商可转债的公告
8.28 招商可转债的公告

8.29 招商可转债的公告
8.30 招商可转债的公告

8.31 招商可转债的公告
8.32 招商可转债的公告

8.33 招商可转债的公告
8.34 招商可转债的公告

较低,信用利差收益相对较大的优质品种。具体的分析内容及指标包括但不限于债券发行人所处行业发展前景、发行人业务发展状况、企业市场地位、财务状况、管理水平及其债务水平等。

本基金综合运用发行人各方面分析结果,确定信用风险的合理水平,利用市场的相对失衡,选择溢价较高的品种进行投资。

(2) 信用风险评估
本基金在信用评级基础上,加上反映信用风险的信用溢价,根据收益水平主要受宏观经济环境的影响,而信用利差收益主要受宏观经济和信用水平的市场信用利差以及该信用本身信用变化的影响。债券发行人自身素质的变化,包括公司资产构成、法人治理结构、管理水平、经营状况、财务状况、抗风险能力的变化将对信用级别产生影响。

本基金管理人将通过定性分析、定量打分以及条款分析等多个不同层面信用风险进行管理,其定性分析主要关注股权结构、股东实力、行业地位、历史违约记录或负债等;定量分析系统主要考察发行人财务实力。

5.资产证券化产品投资策略
证券化是将缺乏流动性的资产通过一定的结构化安排,对资产中的风险与收益进行分离组合,进而转换成可以出售、流通,并带有固定收入的证券的过程。

资产证券化产品的主要风险为信用风险、发行条款、标的资产的构成及质量、提前偿还率等多种因素影响。本基金将在基本分析的基础上,通过分析发行条款、资产证券化产品的交易结构、信用风险、提前偿还风险和利率风险等进行分析,采取组合配置策略,信用利差曲线跟踪、预期利率变动策略等积极主动的投资策略,投资于资产证券化产品。

6.中小企业私募债券投资策略
中小企业私募债券具有信用评级较低、信用风险较大、二级市场流动性较差等特点,因此本基金将严格控制中小企业私募债券的投资比例。

中小企业私募债券收益率由基准利率与信用利差加成,信用风险表现在信用水平的变化上;信用水平主要受两方面影响,一是系统性信用风险,即该信用使用信用水平的市场信用利差曲线变化;二是非系统性信用风险,即该信用使用自身的信用变化。

针对市场系统性信用风险,本基金主要通过调整中小企业私募债券类资产的配置比例,寻求超额收益。因为经济周期的复苏或过渡期是中小企业私募债券表现的最佳阶段,而过热降温则是中小企业私募债券表现的最差阶段。本基金运用探测的基本面研究,力求准确把握经济周期,在宏观经济复苏初期配置中小企业私募债券,在宏观经济过热时减持中小企业私募债券,在宏观经济下行时增持中小企业私募债券,在宏观经济复苏后期减持中小企业私募债券,在宏观经济下行后期增持中小企业私募债券。

7.固定收益投资策略
本基金不参与二级市场权证交易,但可以通过与股票资产(包括中小板、创业板及其它经中国证监会核准上市股票)的新股申购或增发新股,并可通过可转债转股所形成的股票,因所持股票所派发的权证以及因投资可分离债券而产生的权证等,因上述原因持有的股票和权证等资产,本基金可在其可交易之日起的3个月内卖出。

8.1 决策依据
1. 决策依据
2. 申请进行分拆的招商可转债份额场内份额必须是相关业务公告规定份额的正整数倍。

8.2 招商可转债的公告
8.3 招商可转债的公告

8.4 招商可转债的公告
8.5 招商可转债的公告

8.6 招商可转债的公告
8.7 招商可转债的公告

8.8 招商可转债的公告
8.9 招商可转债的公告

8.10 招商可转债的公告
8.11 招商可转债的公告

8.12 招商可转债的公告
8.13 招商可转债的公告

8.14 招商可转债的公告
8.15 招商可转债的公告

8.16 招商可转债的公告
8.17 招商可转债的公告

8.18 招商可转债的公告
8.19 招商可转债的公告

序号	名称	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	存出保证金	6,723.86	0.02
2	应收证券清算款	237,387.61	0.74
3	应收股利	-	-
4	应收利息	93,649.14	0.29
5	其他应收款	69,394.04	0.21
6	其他资产	-	-
7	预收款项	-	-
8	其他	-	-
9	合计	407,154.65	1.26

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	125018	03三峡债1	3,183,483.20	6.62
2	110063	03国债16	1,689,280.00	3.53
3	110045	03国债15	2,197,857.80	4.61
4	110048	03国债16	1,969,626.50	4.17
5	128036	16国债04	1,649,102.20	3.47
6	130008	16国债04	1,949,192.30	4.09
7	128068	16国债04	1,361,940.00	2.86
8	110063	03国债16	382,762.00	0.81
9	130022	03国债16	1,173,216.20	2.46
10	113534	招商转债	1,158,526.30	2.43
11	113020	招商转债	1,124,220.00	2.38
12	110063	03国债16	1,689,280.00	3.53
13	120245	03国债16	1,051,626.40	2.23
14	128019	16国债04	1,000,525.60	2.10
15	113543	招商转债	891,876.30	1.87
16	110062	03国债16	888,490.00	1.86
17	110063	03国债16	889,161.10	1.86
18	113013	招商转债	823,494.30	1.75
19	110069	招商转债	773,024.00	1.60
20	113011	光大转债	710,503.80	1.49
21	120235	招商转债	683,362.60	1.46
22	110069	招商转债	677,911.80	1.42
23	110042	招商转债	597,168.30	1.26
24	120081	招商转债	528,698.30	1.11
25	128076	招商转债	519,048.00	1.09
26	120054	招商转债	514,502.70	1.08
27	128084	招商转债	467,643.00	0.98
28	113019	招商转债	428,534.00	0.90
29	128083	招商转债	382,548.00	0.80
30	113021	招商转债	374,702.00	0.79
31	113557	招商转债	374,166.80	0.79
32	128020	招商转债	249,520.00	0.52
33	113020	招商转债	246,110.60	0.51
34	127013	招商转债	246,236.40	0.51
35	110064	招商转债	237,962.40	0.50
36	110062	招商转债	234,464.80	0.49
37	120038	招商转债	144,266.60	0.30

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。

16 基金的费用与转收
本基金管理人依据恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产,但投资者购买本基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构,本基金管理人不能保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资者有风险,投资者应认真阅读投资决策后应仔细阅读本基金的招募说明书。

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-③
2014/07/31-2014/12/31	66.00%	1.56%	28.23%	0.92%	38.77%
2015/01/1-2015/12/31	-12.01%	2.56%	-11.87%	1.80%	-0.14%
2016/01/1-2016/12/31	-8.53%	0.47%	-6.98%	0.43%	-1.04%
2017/01/1-2017/12/31	-8.88%	0.52%	-2.13%	0.29%	-4%
2018/01/1-2018/12/31	1.88%	0.26%	1.09%	0.27%	0.93%
2019/01/1-2019/12/31	8.91%	0.16%	14.91%	0.40%	-6.04%
2020/01/1-2020/06/30	-0.10%	0.62%	-0.29%	0.42%	0.13%

注:1.本基金合同生效日为2014年7月31日。
2.本基金管理人依据恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产,但投资者购买本基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构,本基金管理人不能保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资者有风险,投资者应认真阅读投资决策后应仔细阅读本基金的招募说明书。

17 基金的投资组合
1.1 定期开放策略
本基金管理人依据恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产,但投资者购买本基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构,本基金管理人不能保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资者有风险,投资者应认真阅读投资决策后应仔细阅读本基金的招募说明书。

1.2 招商可转债的公告
1.3 招商可转债的公告

1.4 招商可转债的公告
1.5 招商可转债的公告

1.6 招商可转债的公告
1.7 招商可转债的公告

1.8 招商可转债的公告
1.9 招商可转债的公告

1.10 招商可转债的公告
1.11 招商可转债的公告

1.12 招商可转债的公告
1.13 招商可转债的公告

1.14 招商可转债的公告
1.15 招商可转债的公告

1.16 招商可转债的公告
1.17 招商可转债的公告

1.18 招商可转债的公告
1.19 招商可转债的公告

定期开放策略后招商可转债份额的份额数 = 定期开放前招商可转债份额的份额数 + 招商可转债A份额持有人新增的可转债份额数 - 赎回的可转债份额数。
注:1.本基金合同生效日为2014年7月31日。
2.本基金管理人依据恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产,但投资者购买本基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构,本基金管理人不能保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资者有风险,投资者应认真阅读投资决策后应仔细阅读本基金的招募说明书。

招商可转债的场外份额经折算后的份额数采用四舍五入保留小数点后两位;招商可转债的场内份额经折算后的份额数,以及招商转债A份额折算成招商可转债份额的场内份额均以取整计算(最小单位为1份),余额计入基金财产。
(7) 基金份额折算期间的基金业务办理
为保证基金份额折算期间本基金正常运作,基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司相关业务规定暂停招商转债A份额与招商转债B份额的上市交易和招商可转债份额的申购或赎回等相关业务,具体见基金管理人届时发布的相关公告。

(8) 基金份额折算结果的公告
基金份额折算结束后,基金管理人应按照《信息披露办法》在指定媒介公告,并和中国证监会备案。
(9) 特殊情形的处理
若在基金份额折算日发生《基金合同》约定的本基金不定期份额折算的情形时,按照不定期份额折算的规则进行份额折算。

17.2 不定期份额折算
除以上定期份额折算外,本基金还将在以下两种情况进行不定期份额折算:当招商可转债份额的基金份额净值达到1.400元,当招商转债B份额的基金份额参考净值达到0.450元。
【1】当招商可转债份额的基金份额净值达到1.400元,本基金将按照以下规则进行份额折算。
(1) 基金份额折算基准日
当招商可转债份额的基金份额净值达到1.400元,基金管理人可根据市场情况确定折算基准日。
(2) 基金份额折算对象
基金份额折算基准日登记在册的招商转债A份额、招商转债B份额和招商可转债份额。
(3) 基金份额折算方式
当招商可转债份额的基金份额净值达到1.400元后,本基金将分别对招商转债A份额、招商转债B份额和招商可转债份额进行折算,份额折算后本基金将确保招商转债A份额和招商转债B份额的比例为7:3,份额折算后招商可转债份额的基金份额参考净值均调整为1元。

当招商可转债份额的基金份额净值达到1.400元后,招商转债A份额、招商转债B份额和招商可转债份额三类将按照如下公式进行份额折算:
1. 招商可转债份额:
场外份额折算:折回不再改变招商可转债份额持有人的资产净值,其持有的招商可转债份额持有人份额折算调整后基金份额持有人份额折算后招商可转债份额,场外招商可转债份额持有人份额折算后获得新增场外招商可转债份额,场内招商可转债份额持有人份额折算后获得新增场内招商可转债份额。
场内份额折算:折回不再改变招商可转债份额持有人的资产净值,其持有的招商可转债份额持有人份额折算后招商可转债份额,场内招商可转债份额持有人份额折算后获得新增场内招商可转债份额。
场外份额折算:折回不再改变招商可转债份额持有人的资产净值,其持有的招商可转债份额持有人份额折算后招商可转债份额,场外招商可转债份额持有人份额折算后获得新增场外招商可转债份额,场内招商可转债份额持有人份额折算后获得新增场内招商可转债份额。
场内份额折算:折回不再改变招商可转债份额持有人的资产净值,其持有的招商可转债份额持有人份额折算后招商可转债份额,场内招商可转债份额持有人份额折算后获得新增场内招商可转债份额。

2. 招商转债A份额:
场外份额折算:折回不再改变招商转债A份额持有人的资产净值,其持有的招商转债A份额持有人份额折算后招商转债A份额,场外招商转债A份额持有人份额折算后获得新增场外招商转债A份额,场内招商转债A份额持有人份额折算后获得新增场内招商转债A份额。
场内份额折算:折回不再改变招商转债A份额持有人的资产净值,其持有的招商转债A份额持有人份额折算后招商转债A份额,场内招商转债A份额持有人份额折算后获得新增场内招商转债A份额。
场外份额折算:折回不再改变招商转债A份额持有人的资产净值,其持有的招商转债A份额持有人份额折算后招商转债A份额,场外招商转债A份额持有人份额折算后获得新增场外招商转债A份额,场内招商转债A份额持有人份额折算后获得新增场内招商转债A份额。
场内份额折算:折回不再改变招商转债A份额持有人的资产净值,其持有的招商转债A份额持有人份额折算后招商转债A份额,场内招商转债A份额持有人份额折算后获得新增场内招商转债A份额。

3. 招商转债B份额:
场外份额折算:折回不再改变招商转债B份额持有人的资产净值,其持有的招商转债B份额持有人份额折算后招商转债B份额,场外招商转债B份额持有人份额折算后获得新增场外招商转债B份额,场内招商转债B份额持有人份额折算后获得新增场内招商转债B份额。
场内份额折算:折回不再改变招商转债B份额持有人的资产净值,其持有的招商转债B份额持有人份额折算后招商转债B份额,场内招商转债B份额持有人份额折算后获得新增场内招商转债B份额。
场外份额折算:折回不再改变招商转债B份额持有人的资产净值,其持有的招商转债B份额持有人份额折算后招商转债B份额,场外招商转债B份额持有人份额折算后获得新增场外招商转债B份额,场内招商转债B份额持有人份额折算后获得新增场内招商转债B份额。
场内份额折算:折回不再改变招商转债B份额持有人的资产净值,其持有的招商转债B份额持有人份额折算后招商转债B份额,场内招商转债B份额持有人份额折算后获得新增场内招商转债B份额。

4. 招商可转债的公告
4.1 招商可转债的公告

4.2 招商可转债的公告
4.3 招商可转债的公告

4.4 招商可转债的公告
4.5 招商可转债的公告

4.6 招商可转债的公告
4.7 招商可转债的公告

4.8 招商可转债的公告
4.9 招商可转债的公告

4.10 招商可转债的公告
4.11 招商可转债的公告

4.12 招商可转债的公告
4.13 招商可转债的公告

4.14 招商可转债的公告
4.15 招商可转债的公告

4.16 招商可转债的公告
4.17 招商可转债的公告

H为每日应计提的基金管理费
L为前一日的基金资产净值
基金管理人每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送划款指令,基金托管人根据指令于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、公休日等,可顺延支付。
上述18.1条基金费用的项目下列列内列入基金费用:
1. 基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;
2. 基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;
3. 基金合同生效前的相关费用;
4. 其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。
18.4 基金管理费和基金托管费
基金管理人和基金托管人协商一致,可根据基金发展情况调整基金管理费、基金托管费等相关费率。
调整基金管理费、基金托管费费率等,需召开基金份额持有人大会审议;调整基金管理费费率、基金托管费费率等,无需召开基金份额持有人大会。
基金管理费必须最迟于新的费率实施日前日在指定媒介公告。
18.5 赎回费
本基金赎回费按赎回及赎回的基金份额,其赎回费又按国家税收法律法规执行。
18.6 申购、赎回及转换的费用
1. 招商可转债份额的申购费用由基金申购人承担,并在投资者申购基金份额时收取,不计入基金财产,主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。
2. 招商可转债份额的赎回费用按照赎回基金份额的赎回费率确定如下:
(1) 招商可转债份额的场外申购费率按照申购金额设定如下:

申购金额(M)	申购费率
M<100万	0.7%
100万≤M<500万	0.4%
M≥500万	每笔1000元

(2) 招商可转债份额的场内申购费率由基金代销机构比照场外申购费率执行。
2. 招商可转债份额的赎回费率
(1) 招商可转债份额的场内赎回费率按基金份额持有人持有该部分基金份额的时间分段设定如下:

持有时间	赎回费率
N<7日	1.5%
7日≤N<30日	0.75%
1月≤N<3月	0.50%
N≥3月	-

(2) 招商可转债份额的场内赎回费率由基金代销机构比照场外赎回费率执行。

招商可转债份额的申购费用由基金申购人承担,并在投资者申购基金份额时收取,扣除赎回费后的余额计入基金财产,赎回费计入基金财产的部分不低于赎回总额的25%,其中对持续持有少于7日的投资者收取的赎回费全额计入基金财产。
基金管理人可以根据基金合同的约定调整费率或收费方式,基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施前在指定媒介公告。
对于特定交易方式(如网上交易、电话交易等),基金管理人履行适当程序后可以降低基金申购和赎回费率。
基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划,针对投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间,经相关监管部门要求履行相关手续后基金管理人可以适当调低招商可转债份额的申购费率和基金托管费率。
基金管理人可以对特定投资者(如养老金客户等)开展费率优惠活动,届时提前公告。

19 对招商可转债公告更新后的说明
本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的规定,对本基金管理人于2020年3月14日修订的《招商丰盈积极配置混合型证券投资基金基金合同》进行了更新,并依据相关法律法规在前次招募说明书刊登后对基金的经营活动进行了内容扩充和数据更新。
本次更新后的内容如下:
1. 更新了“重要提示”;
2. 在“基金管理人”部分,更新了“主要人员情况”;
3. 在“基金托管人”部分,更新了“基金托管人基本情况”,更新了“基金托管业务经营情况”;
4. 在“相关服务机构”部分,更新了“会计师事务所和法定验资机构”;
5. 在“基金的投资”部分,更新了“基金投资组合报告”;
6. 更新了“基金的业绩”;
7. 在“托管协议的内容摘要”部分,更新了“托管协议当事人”;
8. 更新了“其他应披露事项”。

招商丰盈积极配置混合型证券投资基金
2020年7月30日
公告送出日期:2020年7月30日

1. 公募基金基本信息

基金名称	招商丰盈积极配置混合型证券投资基金
基金简称	招商丰盈积极配置混合
基金代码	009362
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年7月31日
基金管理人名称	招商基金管理有限公司
基金托管人名称	中国银行股份有限公司
公告依据	《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》
下级公募基金名称	招商可转债A份额、招商可转债B份额
下级公募基金的代码	009362 009363

注:自基金合同生效之日起,本基金管理人正式开始管理本基金。

2. 基金募集情况

基金募集申请经中国证监会核准的日期	证监会文件(2014)943号
2014年07月16日	证监许可[2014]943号
2014年07月24日	证监许可[2014]943号
2014年07月24日	证监许可[2014]943号

3. 基金业绩

招商丰盈积极配置混合A	招商丰盈积极配置混合B	合计
6,417,366,738.00	1,827,556,160.00	8,244,924,898.00
1,716,444.07	278,384.02	2,094,828.09
6,417,368,442.07	1,827,556,160.00	8,244,924,602.07
1,716,444.07	278,384.02	2,094,828.09
6,419,083,182.87	1,827,556,360.02	8,246,639,542.89

4. 基金管理人

招商丰盈积极配置混合A	招商丰盈积极配置混合B	合计
6,417,366,738.00	1,827,556,160.00	8,244,924,898.00
1,716,444.07	278,384.02	2,094,828.09
6,417,368,442.07	1,827,556,160.00	8,244,924,602.07