

招商丰益混合基金 2016 年第四季度报告

公告日期：2017-01-20

流水号：FB03201701200240

[目录全部展开](#) [目录全部收拢](#)

[重要提示](#)

[基金产品概况](#)

[基金基本情况](#)

[主要财务指标和基金净值表现](#)

[主要财务指标](#)

[基金净值表现](#)

[本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较](#)

[自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较](#)

[其他指标](#)

[管理人报告](#)

[基金经理（或基金经理小组）简介](#)

[报告期内本基金运作遵规守信情况说明](#)

[公平交易专项说明](#)

[公平交易专项说明](#)

[公平交易制度和控制方法](#)

[本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较](#)

[异常交易行为的专项说明](#)

[报告期内基金的投资策略和业绩表现说明](#)

[报告期内基金的业绩表现](#)

[报告期内基金投资策略和运作分析](#)

[报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明](#)

[投资组合报告](#)

[报告期末基金资产组合情况](#)

[报告期末按行业分类的股票投资组合](#)

[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](#)

[报告期末按债券品种分类的债券投资组合](#)

[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](#)

[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贵金属投资明细](#)

[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](#)

[报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明](#)

[报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细](#)

[本基金投资股指期货的投资政策](#)

[报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明](#)

[本期国债期货投资政策](#)

[报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细](#)

[本期国债期货投资评价](#)

[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](#)

投资组合报告附注

受到调查以及处罚情况

申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

其他资产构成

报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

投资组合报告附注的其他文字描述部分

开放式基金份额变动

基金管理人运用固有资金投资本基金情况

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

影响投资者决策的其他重要信息

备查文件目录

重要提示

基金管理人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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 1 月 19 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。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

基金基本情况

项目

数值

基金简称

招商丰益混合

场内简称

-

基金主代码

002514

基金运作方式

契约型开放式

基金合同生效日

2016-08-24

报告期末基金份额总额

1,197,034,327.23

投资目标

本基金通过将基金资产在不同投资资产类别之间灵活配置，在控制下行风险的前提下为投

资人获取稳健回报。

投资策略

1、资产配置策略

本基金的资产配置将根据宏观经济形势、金融要素运行情况、中国经济发展情况，在权益类资产、固定收益类资产和现金三大类资产类别间进行相对灵活的配置，并根据风险的评估和建议适度调整资产配置比例。

2、股票投资策略

本基金以价值投资理念为导向，采取“自上而下”的多主题投资和“自下而上”的个股精选方法，灵活运用多种股票投资策略，深度挖掘经济结构转型过程中具有核心竞争力和发展潜力的行业和公司，实现基金资产的长期稳定增值。

3、债券投资策略

本基金采用的固定收益品种主要投资策略包括：久期策略、期限结构策略和个券选择策略等。

4、权证投资策略

本基金对权证资产的投资主要是通过通过分析影响权证内在价值最重要的两种因素——标的资产价格以及市场隐含波动率的变化，灵活构建避险策略，波动率差策略以及套利策略。

5、股指期货、国债期货投资策略

为更好地实现投资目标，本基金在注重风险管理的前提下，以套期保值为目的，适度运用股指期货、国债期货等金融衍生品。本基金利用股指期货、国债期货合约流动性好、交易成本低和杠杆操作等特点，提高投资组合运作效率，有效管理市场风险。

6、中小企业私募债券投资策略

中小企业私募债具有票面利率较高、信用风险较大、二级市场流动性较差等特点。因此本基金审慎投资中小企业私募债券。

7、资产支持证券投资策略

本基金将在宏观经济和基本面分析的基础上，对资产支持证券的质量和构成、利率风险、信用风险、流动性风险和提前偿付风险等进行定性和定量的全方面分析，评估其相对投资价值并作出相应的投资决策，力求在控制投资风险的前提下尽可能的提高本基金的收益。

业绩比较基准

$50\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 50\% \times \text{中债综合指数收益率}$

风险收益特征

本基金是混合型基金，在证券投资基金中属于预期风险收益水平中等的投资品种，预期收益和预期风险高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

基金管理人

招商基金管理有限公司

基金托管人

中国建设银行股份有限公司

基金保证人

-

下属 2 级基金的基金简称

招商丰益混合 A

招商丰益混合 C

下属 2 级基金的场内简称

-

-

下属 2 级基金的交易代码
002514
002515
报告期末下属 2 级基金的份额总额
1197020662.75
13664.48

下属 2 级基金的风险收益特征

-
-

主要财务指标
单位：人民币元

项目

主基金(元)

A(元)

B(元)

本期已实现收益

-

3,658,107.14

30.77

本期利润

-

-12,952,689.62

-144.18

加权平均基金份额本期利润

-

-0.0119

-0.0106

期末基金资产净值

-

1,188,380,629.20

13,543.54

期末基金份额净值

-

0.993

0.991

期末还原后基金份额累计净值

-

-

-

注：1、所述基金业绩指标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，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

3、本基金合同于 2016 年 8 月 24 日生效，截至本报告期末基金成立未满一年。

基金净值表现

本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较阶段

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

业绩比较基准收益率标准差④

①-③

②-④

本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较 A 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

业绩比较基准收益率标准差④

①-③

②-④

过去三个月

-0.90%

0.11%

0.16%

0.38%

-1.06%

-0.27%

本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较 B 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

业绩比较基准收益率标准差④

①-③

②-④

过去三个月

-1.10%

0.12%

0.16%

0.38%

-1.26%

-0.26%

自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注：本基金合同于 2016 年 8 月 24 日生效，截至本报告期末基金成立未满一年；自基金成立日起 6 个月内为建仓期，截至报告期末基金尚未完成建仓。

自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的

比较 A

自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较 B

其他指标

单位：元

序号

其他指标

报告期（2016-10-01 至 2016-12-31）

序号

其他指标

报告期（2016-12-31）

基金经理（或基金经理小组）简介

姓名

职务

任本基金的基金经理期限

证券从业年限

说明

任职日期

离任日期

王宠

本基金的基金经理

2016-08-24

-

7

男，经济学硕士，2009年7月加入国信证券股份有限公司任研究员，从事食品饮料、农业研究的工作；2010年8月加入鹏华基金管理有限公司任研究员，从事食品饮料、农业行业研究的工作；2012年12月加入招商基金管理有限公司，曾任研究员、助理基金经理，从事行业研究并协助基金经理从事组合管理的工作，现任招商体育文化休闲股票型证券投资基金、招商丰和灵活配置混合型证券投资基金、招商丰嘉灵活配置混合型证券投资基金、招商丰益灵活配置混合型证券投资基金、招商丰乐灵活配置混合型证券投资基金、招商丰源灵活配置混合型证券投资基金、招商丰达灵活配置混合型证券投资基金及招商丰睿灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

何文韬

本基金的基金经理

2016-08-31

-

9

男，管理学硕士。2007年7月加入招商基金管理有限公司，曾任交易部交易员，专户资产投资部研究员、助理投资经理、投资经理。先后从事股票和债券交易、债券及新股研究、投资组合的投资管理等工作，现任招商丰盛稳定增长灵活配置混合型证券投资基金、招商丰利灵活配置混合型证券投资基金、招商丰裕灵活配置混合型证券投资基金、招商丰享灵活配置混合型证券投资基金、招商睿逸稳健配置混合型证券投资基金、招商丰凯灵活配置

混合型证券投资基金及招商丰益灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

注：1、本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告（生效）日期；

2、证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

报告期内本基金运作合规守信情况说明

基金管理人声明：在本报告期内，本基金管理人严格遵守《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》等有关法律法规及其各项实施准则的规定以及《招商丰益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》等基金法律文件的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的前提下，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围以及投资运作符合有关法律法规及基金合同的规定。

公平交易专项说明

公平交易制度的执行情况

基金管理人（以下简称“公司”）已建立较完善的研究方法和投资决策流程，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对象备选库，制定明确的备选库建立、维护程序。公司拥有健全的投资授权制度，明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限划分，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要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，在投资研究层面不存在各投资组合间不公平的问题。

公平交易制度和控制方法

-

本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

-

异常交易行为的专项说明

公司严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。确因投资组合的投资策略或流动性等需要而发生的同日反向交易，公司要求相关投资组合经理提供决策依据，并留存记录备查，完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合等除外。

本报告期内，本基金各项交易均严格按照相关法律法规、基金合同的有关要求执行，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易不存在成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形。报告期内未发现有可能会导致不公平交易和利益输送的重大异常交易行为。

报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，招商丰益混合 A 份额净值为 0.993 元，招商丰益混合 C 份额净值为 0.991 元。招商丰益混合 A 份额净值增长率为-0.90%，同期业绩基准增长率为 0.16%，基金业绩落后于同期比较基准，幅度为 1.06%；招商丰益混合 C 份额净值增长率为-1.10%，同期业绩基准增长率为 0.16%，基金业绩落后于同期比较基准，幅度为 1.26%。主要原因是 2016 年 4 季度债券和股票都大幅下跌，造成净值损失。

报告期内基金投资策略和运作分析

股票回顾与操作：

从 2016 年 12 月份的宏观经济数据看，经济指标表现平稳。消费方面，受到线上线下购物节的影响整体表现较好，2016 年 11 月份社会消费品零售总额同比增长 10.8%。投资方面，

2016年1-11月份固定资产投资同比增长8.3%，增速较1-10月份持平。受益人民币贬值和国外节日季到来，2016年11月出口同比上涨5.9%，前值-3.2%，预期3.6%，好于前值大幅高于预期值；此外，从PMI指标来看，16年12月中国制造业PMI为51.4%，比上月下降0.3个百分点。从市场表现来看，上证指数从3000点附近上行到3300点，随后大跌200点到3100点，总体来看上涨了3.29%。创业板从盘整到下跌，总体来看下跌了8.74%。从结构上来看，大盘蓝筹和部分主题表现了非常强的上涨势头，但其他板块普遍呈现下跌趋势，尤其是创业板几乎没有丝毫像样的反弹。总体而言，4季度股票市场是结构性行情，赚钱效用不突出。

操作上，组合降低了股票仓位，减少股票下跌对基金净值的影响。

股票展望与策略：

展望未来一个季度，国内外环境都有一些不确定性。国际上来看，特朗普上台后的具体施政方案与市场预期可能存在不一致。美联储加息的频率可能加快，美元继续走强的概率在上升。欧洲和日本依然增长乏力，各国间的货币政策分歧加大，人民币面临更加复杂的国际环境，贬值压力依旧存在。国内来看，经济增长和通胀可能继续走强，货币政策中性偏紧，加上春节效用，流动性在前期可能不会太松。具体到行业而言，从业绩增速以及业绩增速变动幅度来看，17年石油开采、半导体、通信、机械设备、化工、造纸等周期性行业业绩增速靠前，业绩增长确定性强，加上上游资源型企业国企多、混改预期会引发市场关注。一方面，小家电、轻工制造、医药、食品饮料、零售等行业盈利稳定增长，我们认为业绩增速持续，估值合理同时中长期逻辑不会被破坏的行业或者个股将是资金的首选；长期来看，虽然经济增速逐步放缓，但随着人口结构的变化以及消费升级，教育、娱乐、医疗、文化休闲等新型服务业必将收获长期稳定发展，这些行业将诞生一批值得投资的优秀公司。

策略上，未来一个月会增加对业绩增长预期确定行业的配置，着重布局年报估值切换，适当参与混改、石油价格上涨、超跌板块反弹等主题行情。

债券回顾与操作：

2016年4季度债券市场经历了显著的下落，收益率大幅上行，其中10年期国债从2.7%一直上升到3.4%，此后回落到3%附近，5年期AAA中票从3.1%上行到4.5%，此后回落到4.1%。5年期AA中票从3.5%上行到5%，此后回落到4.5%。背后的原因主要有以下几点：首先是货币政策收紧的预期，反应在银行间市场资金面就是7天回购利率从2.6%上行到4%以上，而且长期维持在3%以上。其次是部分证券公司债券代持业务爆出违约风险，金融去杠杆压力加大，机构赎回导致债券市场出现踩踏，债券收益率在短时间内大幅上行。此后在市场流动性恢复和证券公司代持警报暂时解除的驱动下，债券收益率有一定的下行和修复。

操作上，本组合减少了债券仓位，缩短了久期，最大程度上减轻了债券下跌对组合的影响，但仍然承受了一定的损失。

报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

根据证监会《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条的相关要求，基金合同生效后，连续二十个工作日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情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露。

报告期内，本基金未发生连续二十个工作日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的情形。

报告期末基金资产组合情况

金额单位：元

序号

项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1		
权益类投资		
	62,761,734.81	
5.28		
其中：股票		
	62,761,734.81	
5.28		
2		
固定收益投资		
	631,019,069.60	
53.05		
其中：债券		
	631,019,069.60	
53.05		
资产支持证券		
-		
-		
3		
贵金属投资		
-		
-		
4		
金融衍生品投资		
-		
-		
5		
买入返售金融资产		
	429,841,124.76	
36.14		
其中：买断式回购的买入返售金融资产		
-		
-		
6		
银行存款和结算备付金合计		
	49,952,280.05	
4.20		
7		
其他资产		
	15,916,386.81	
1.34		
8		

合计

1,189,490,596.03

100.00

报告期末按行业分类的股票投资组合

报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：元

序号

行业类别

公允价值（元）

占基金资产净值比例（%）

A

农、林、牧、渔业

8,986,464.00

0.76

B

采矿业

-

-

C

制造业

24,613,602.06

2.07

D

电力、热力、燃气及水生产和供应业

-

-

E

建筑业

15,592.23

0.00

F

批发和零售业

6,072,282.00

0.51

G

交通运输、仓储和邮政业

3,284,800.00

0.28

H

住宿和餐饮业

-

-

I

信息传输、软件和信息技术服务业

8,430,938.00

0.71

J

金融业

2,376,960.00

0.20

K

房地产业

5,291,619.48

0.45

L

租赁和商务服务业

121,626.00

0.01

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

3,567,851.04

0.30

R

文化、体育和娱乐业

-

-

S

综合

-

-

合计

62,761,734.81

5.28

报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

金额单位：元

行业类别

公允价值（元）

占基金资产净值比例（%）

注：本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

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：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

000930

中粮生化

421,094

5,659,503.36

0.48

2

002714

牧原股份

242,900

5,654,712.00

0.48

3

002246

北化股份

471,100

5,624,934.00

0.47

4

600074

保千里

416,500

5,514,460.00

0.46

5

600240

华业资本

492,702

5,291,619.48

0.45
6
600651
飞乐音响
468,600
4,934,358.00

0.42
7
600850
华东电脑
194,100
4,693,338.00

0.39
8
002609
捷顺科技
233,600
3,737,600.00

0.31
9
600763
通策医疗
106,376
3,567,851.04

0.30
10
601607
上海医药
175,200
3,426,912.00

0.29
报告期末按债券品种分类的债券投资组合
金额单位：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
53,547,069.60

4.51
2
央行票据

-

-

3

金融债券

577,472,000.00

48.59

其中：政策性金融债

577,472,000.00

48.59

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）

-

-

8

同业存单

-

-

9

其他

-

-

10

合计

631,019,069.60

53.10

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：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
160206
16 国开 06
3,100,000
302,064,000.00
25.42
2
160208
16 国开 08
2,800,000
275,408,000.00
23.17
3
010107
21 国债(7)
281,190
29,595,247.50
2.49
4
019539
16 国债 11
239,830
23,951,822.10
2.02

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

金额单位：元

序号

贵金属代码

贵金属名称

数量（份）

公允价值（元）

占基金资产净值比例（%）

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

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

金额单位：元

序号

权证代码

权证名称

数量（份）

公允价值（元）

占基金资产净值比例（%）

注：本基金本报告期末未持有权证。

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码

名称

持仓量（买/卖）

合约市值(元)

公允价值变动(元)

风险说明

公允价值变动总额合计(元)

-

股指期货投资本期收益(元)

-

股指期货投资本期公允价值变动(元)

-

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

本基金投资股指期货的投资政策

为更好地实现投资目标，本基金在注重风险管理的前提下，以套期保值为目的，适度运用股指期货、国债期货等金融衍生品。本基金利用股指期货、国债期货合约流动性好、交易成本低和杠杆操作等特点，提高投资组合运作效率，有效管理市场风险。

报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本期国债期货投资政策

为更好地实现投资目标，本基金在注重风险管理的前提下，以套期保值为目的，适度运用股指期货、国债期货等金融衍生品。本基金利用股指期货、国债期货合约流动性好、交易成本低和杠杆操作等特点，提高投资组合运作效率，有效管理市场风险。

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码

名称

持仓量（买/卖）

合约市值(元)

公允价值变动(元)

风险指标说明

公允价值变动总额合计(元)

-

国债期货投资本期收益（元）

-

国债期货投资本期公允价值变动(元)

-

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

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

单位：元

序号

证券代码

证券名称

数量（份）

公允价值（元）

占基金资产净值比例（%）

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

投资组合报告附注

受到调查以及处罚情况

报告期内基金投资的前十名证券除保千里（股票代码 600074）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。

保千里（股票代码 600074）

2016年12月29日公司公告其接到中国证监会通知，因公司涉嫌信息披露违法违规，证监会决定对公司立案调查，要求公司予以配合。

对该股票的投资决策程序的说明：本基金管理人认为目前还没有相关证据证明该调查会对公司经营造成较大影响，经过内部严格的投资决策流程，将该股票纳入实际投资组合。

申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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。

其他资产构成

单位：元

序号

名称

金额（元）

1

存出保证金

26,800.93

2

应收证券清算款

82,210.41

3

应收股利

-

4

应收利息

15,807,375.47

5

应收申购款

-

6

其他应收款

-

7

待摊费用

-

8

其他

-

9

合计

15,916,386.81

报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

单位：元

序号

债券代码

债券名称

公允价值（元）

占基金资产净值比例（%）

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

单位：

序号

股票代码

股票名称

流通受限部分的公允价值（元）

占基金资产净值比例（%）

流通受限情况说明

1

600763

通策医疗

3,567,851.04

0.30

重大事项

投资组合报告附注的其他文字描述部分

-

开放式基金份额变动（仅适用于开放式基金）

单位：份

项目

招商丰益混合

招商丰益混合 A

招商丰益混合 C

基金合同生效日的基金份额总额

-

-

-

报告期期初基金份额总额

-

600,007,719.55

13,669.43

报告期期间基金总申购份额

-

597,012,945.18

-
报告期期间总赎回份额
-
1.98
4.95
报告期期间基金拆分变动份额
-
-
-
报告期期末基金份额总额
1,197,034,327.23
1,197,020,662.75
13,664.48
基金管理人运用固有资金投资本基金情况
基金管理人持有本基金份额变动情况
项目
招商丰益混合
招商丰益混合 A
招商丰益混合 C
报告期期初管理人持有的本基金份额
-
-
-
报告期期间买入/申购总份额
-
-
-
报告期期间卖出/赎回总份额
-
-
-
报告期期末管理人持有的本基金份额
-
-
-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)
-
-
-
基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
单位：份
序号
交易方式
交易日期

交易份额（份）

交易金额（元）

适用费率

合计

-

注：本报告期内本基金管理人无运用自有资金投资本基金的情况。

影响投资者决策的其他重要信息

-

备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会批准设立招商基金管理有限公司的文件；
- 2、中国证券监督管理委员会批准招商丰益灵活配置混合型证券投资基金设立的文件；
- 3、《招商丰益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 4、《招商丰益灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 5、《招商丰益灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照。

存放地点

招商基金管理有限公司

地址：中国深圳深南大道 7088 号招商银行大厦

查阅方式

上述文件可在招商基金管理有限公司互联网站上查阅，或者在营业时间内到招商基金管理有限公司查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人招商基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-887-9555

网址：<http://www.cmfchina.com>