

招商丰利灵活配置混合型证券投资基金 2024 年第 3 季度报告

2024 年 09 月 30 日

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

送出日期：2024 年 10 月 24 日

§ 1 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 10 月 23 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 2024 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 招商丰利灵活配置混合基金 |
| 基金主代码 | 000679 |
| 交易代码 | 000679 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2014 年 8 月 12 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 19,646,532.50 份 |
| 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，并结合对个股、个券的精选策略，在控制风险的前提下力争为投资者带来绝对收益。 |
| 投资策略 | 本基金以获取绝对收益为投资目的，从资产配置和精选个股个券两个方面来构建投资组合。 资产配置策略：本基金主要投资于国内依法发行上市的 A 股股票、债券（含中小企业私募债）、资产支持证券、货币市场工具、权证、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。 股票投资策略：本基金股票投资以定性和定量分析为基础进行股票投资。 债券投资策略：根据国内外宏观经济形势、财政、货币政策、市场资金与债券供求状况、央行公开市场操作等方面情况，采用定性与定量相结合的方式，在确保流动性充裕和业绩考核期内可实现绝对收益的约束下设定债券投资的组合久期，并根据通胀预期确定浮息债与固定收益债比例。 |

| | | |
|-----------------|---|----------------|
| | <p>权证投资策略：本基金对权证资产的投资主要是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。</p> <p>股指期货投资策略：本基金采取套期保值的方式参与股指期货的投资交易，以管理市场风险和调节股票仓位为主要目的。</p> <p>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。</p> <p>存托凭证投资策略：在控制风险的前提下，本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。</p> | |
| 业绩比较基准 | 1 年期存款利率+3%(单利年化) | |
| 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 | 中国银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 招商丰利灵活配置混合基金 A | 招商丰利灵活配置混合基金 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 000679 | 002416 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 18,597,294.98 份 | 1,049,237.52 份 |

注：本基金从 2016 年 2 月 29 日起新增 C 类份额，C 类份额自 2016 年 3 月 18 日起存续。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期 (2024 年 7 月 1 日 – 2024 年 9 月 30 日) | |
|----------------|--|----------------|
| | 招商丰利灵活配置混合基金 A | 招商丰利灵活配置混合基金 C |
| 1.本期已实现收益 | -2,801,939.77 | -155,266.57 |
| 2.本期利润 | 3,341,154.55 | 179,818.43 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.1776 | 0.1679 |
| 4.期末基金资产净值 | 23,800,213.02 | 1,294,489.61 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.280 | 1.234 |

注：1、上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)扣除相关费用和信用减值损失后的余额,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、本基金从 2016 年 2 月 29 日起新增 C 类份额, C 类份额自 2016 年 3 月 18 日起存续。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

招商丰利灵活配置混合基金 A

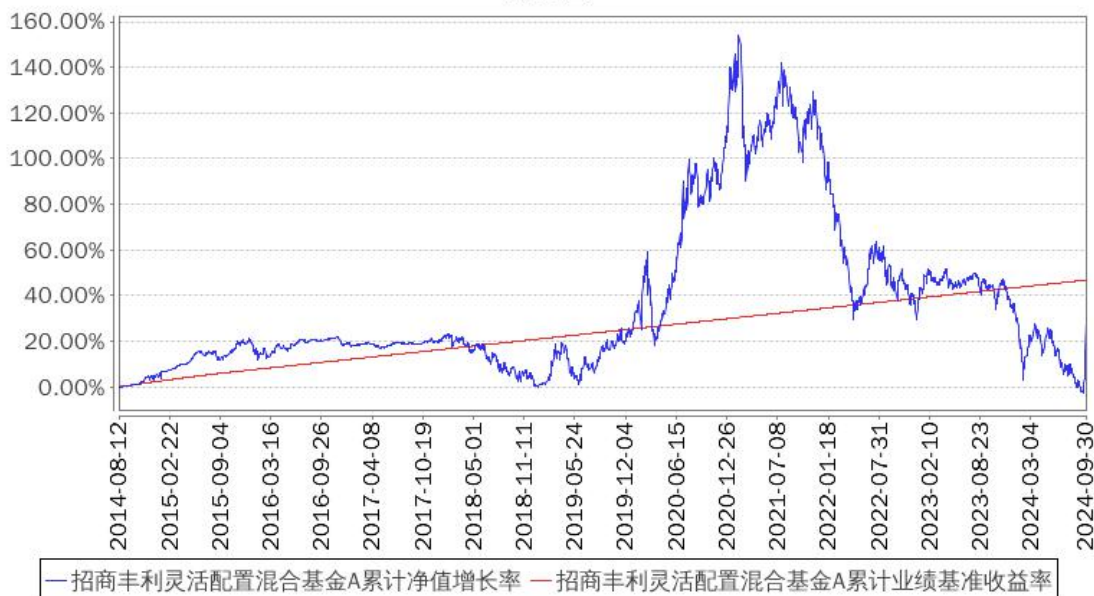
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去三个月 | 16.47% | 2.17% | 1.13% | 0.01% | 15.34% | 2.16% |
| 过去六个月 | 4.15% | 1.86% | 2.25% | 0.01% | 1.90% | 1.85% |
| 过去一年 | -11.36% | 1.68% | 4.50% | 0.01% | -15.86% | 1.67% |
| 过去三年 | -38.16% | 1.46% | 13.50% | 0.01% | -51.66% | 1.45% |
| 过去五年 | 10.06% | 1.61% | 22.50% | 0.01% | -12.44% | 1.60% |
| 自基金合同生效起至今 | 28.00% | 1.22% | 46.79% | 0.01% | -18.79% | 1.21% |

招商丰利灵活配置混合基金 C

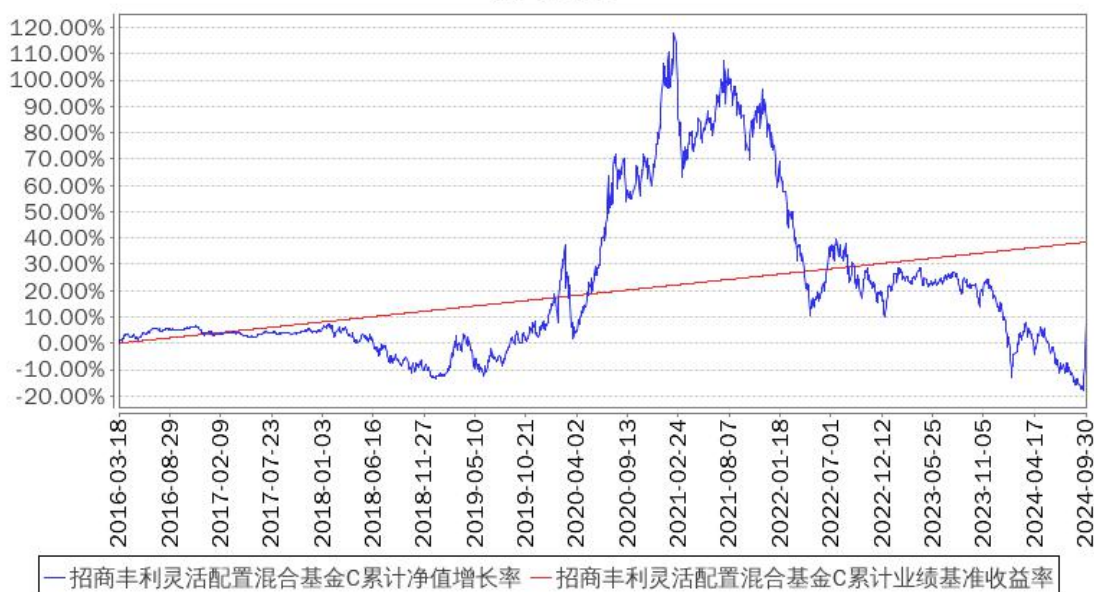
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去三个月 | 16.42% | 2.17% | 1.13% | 0.01% | 15.29% | 2.16% |
| 过去六个月 | 3.87% | 1.86% | 2.25% | 0.01% | 1.62% | 1.85% |
| 过去一年 | -11.73% | 1.68% | 4.50% | 0.01% | -16.23% | 1.67% |
| 过去三年 | -39.00% | 1.46% | 13.50% | 0.01% | -52.50% | 1.45% |
| 过去五年 | 7.59% | 1.61% | 22.50% | 0.01% | -14.91% | 1.60% |
| 自基金合同生效起至今 | 7.96% | 1.31% | 38.42% | 0.01% | -30.46% | 1.30% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计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

招商丰利灵活配置混合基金A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



招商丰利灵活配置混合基金C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金从 2016 年 2 月 29 日起新增 C 类份额，C 类份额自 2016 年 3 月 18 日起存续。

§ 4 管理人报告

4.1 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 | | |
| | | | | | |

| | | | | | |
|----|---------|-----------------|---|---|---|
| 况冲 | 本基金基金经理 | 2023 年 2 月 16 日 | - | 9 | 男，硕士。2012 年 8 月至 2014 年 2 月在陆家嘴金融发展有限公司工作，任战略发展部投资经理；2014 年 2 月至 2015 年 4 月在华宝信托有限公司工作，任产品部产品经理；2015 年 5 月至 2017 年 7 月在兴业国际信托有限公司工作，任证券信托总部团队负责人；2017 年 8 月至 2021 年 5 月在云南国际信托有限公司工作，任资本市场部业务副总监，从事可转债投资工作；2021 年 6 月至 2022 年 10 月在上海久期投资有限公司工作，任股票转债研究副总监。2022 年 11 月加入招商基金管理有限公司，现任招商丰利灵活配置混合型证券投资基金、招商安瑞进取债券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中国证监会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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本基金的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。

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。基金管理人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。基金管理人拥有健全的投资授权制度，明确投资决策委员会、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。基金管理人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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

基金管理人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, 基金管理人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, 公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 11 次, 为旗下指数及量化组合因投资策略需要而发生反向交易。报告期内未发现有可能导致不公平交易和利益输送的重大异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

宏观经济回顾:

2024 年三季度, 国内经济边际上继续走弱, 地产仍相对低迷, 基建投资有所弱化, 制造业和出口链条表现尚可。投资方面, 8 月固定资产投资完成额累计同比增长 3.4%, 投资端数据较二季度有所走弱, 其中 8 月房地产开发投资累计同比下降 10.2%, 地产投资表现较为一般, 随着 9 月底新一轮房地产新政出台, 持续关注后续地产销售表现; 8 月基建投资累计同比增长 7.9%, 不含电力口径下的基建投资累计同比增长 4.4%, 由于当前地方债务管控力度较强、新增项目审批严格, 基建增速略显颓势; 8 月制造业投资累计同比增长 9.1%, 表现相对较好, 考虑到重点领域技改及设备更新项目在持续推进、政策扶持力度大, 制造业投资韧性较强。消费方面, 8 月社会消费品零售总额同比增长 2.1%, 消费数据持续走弱, 显示出消费者信心有所不足。对外贸易方面, 8 月出口金额当月同比增速为 8.7%, 主要与外需表现较好和外贸结构持续优化有关。生产方面, 9 月 PMI 指数为 49.8%, 5 月以来连续五个月在荣枯线以下, 但较 8 月 PMI 指数回升 0.7%, 边际有所好转, 9 月的生产指数和新订单指数分别为 51.2% 和 49.9%, 生产表现好于需求。

股票市场回顾:

2024 年三季度市场震荡下行, 9 月底高层会议后快速上涨, 国庆节前连续跳空高开, 成交量扩大至历史极值。国庆节后市场冲高回落并寻找阶段性底部。在快速上涨过程中, 市场风格倾向于个人投资者的偏好, 互联网金融、券商, 以及半导体为代表的新质生产力板块反弹较多。港股在国庆节假期期间冲高, 节后有相应回调。

基金操作回顾:

回顾 2024 年三季度, 我们严格遵照基金合同的相关约定, 按照既定的投资流程进行了规范运作。在三季度中, 市场继续下跌, 在下跌的过程中, 本基金卖出了持有的可转债, 全部投资于 A 股, 并在底部位置, 结合公司的竞争优势, 估值, 重新审视并较大幅度调整了本基金的持仓, 将仓位更集中在有全球竞争力, 能看到中长期成长能力的公司上面, 同时这些公司的估值都相对比较便宜。

过去一段时间，本基金出现了较大幅度的回撤，作为基金的管理人，也是本基金的持有人，我进行了很多反思：我们从一个增量时代很快迈入了存量时代，在这个背景下，投资的难度比以往更高，对应着对公司治理的要求，也需要比以往更为严格。同时，还需要买的足够便宜，来尽量避免因为判断错误所带来的本金损失风险。

以相对长一些的维度看，一些能够走向全球市场的中国企业，未来依然有广阔的发展前景，一些能够顺应人口结构变化并引领行业的公司，未来的优势会更加突出。

展望四季度，宏观政策已经出现了明显的转向，市场情绪也开始好转，可能市场开始走出底部，如果我们加以耐心，相信未来会更美好。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金 A 类份额净值增长率为 16.47%，同期业绩基准增长率为 1.13%，C 类份额净值增长率为 16.42%，同期业绩基准增长率为 1.13%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，相关解决方案已经上报证监会。

自 2024 年 7 月 1 日起，本基金在迷你期间，如涉及信息披露费、审计费、基金份额持有人大会费、银行间账户维护费、IOPV 计算与发布费、注册登记费等相关固定费用，由管理人承担，不再从基金资产中列支。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|---------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 23,686,182.83 | 94.01 |
| | 其中：股票 | 23,686,182.83 | 94.01 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 1,226,505.21 | 4.87 |
| | 其中：债券 | 1,226,505.21 | 4.87 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |

| | | | |
|---|--------------|---------------|--------|
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 193,399.65 | 0.77 |
| 8 | 其他资产 | 88,635.94 | 0.35 |
| 9 | 合计 | 25,194,723.63 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|---------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 15,337,946.35 | 61.12 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | 1,972,696.00 | 7.86 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 3,934,228.48 | 15.68 |
| J | 金融业 | 1,263,680.00 | 5.04 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 1,177,632.00 | 4.69 |
| 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 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 23,686,182.83 | 94.39 |

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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十名股票投资明细

金额单位：人民币元

| 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 | 002311 | 海大集团 | 43,000 | 2,064,860.00 | 8.23 |
| 2 | 603939 | 益丰药房 | 77,300 | 1,972,696.00 | 7.86 |
| 3 | 601058 | 赛轮轮胎 | 110,100 | 1,766,004.00 | 7.04 |
| 4 | 300858 | 科拓生物 | 90,470 | 1,539,799.40 | 6.14 |

| | | | | | |
|----|--------|------|--------|--------------|------|
| 5 | 688083 | 中望软件 | 14,952 | 1,457,520.96 | 5.81 |
| 6 | 300161 | 华中数控 | 49,800 | 1,369,500.00 | 5.46 |
| 7 | 300775 | 三角防务 | 47,600 | 1,356,600.00 | 5.41 |
| 8 | 603613 | 国联股份 | 52,300 | 1,286,057.00 | 5.12 |
| 9 | 601688 | 华泰证券 | 71,800 | 1,263,680.00 | 5.04 |
| 10 | 688269 | 凯立新材 | 42,084 | 1,190,977.20 | 4.75 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 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 | 1,226,505.21 | 4.89 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 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 | 1,226,505.21 | 4.89 |

5.5 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：人民币元

| 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 | 019727 | 23 国债 24 | 12,000 | 1,226,505.21 | 4.89 |

5.6 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金采取套期保值的方式参与股指期货的投资交易,以管理市场风险和调节股票仓位为主要目的。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

根据本基金合同规定,本基金不参与国债期货交易。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

根据本基金合同规定,本基金不参与国债期货交易。

5.10.3 本期国债期货投资评价

根据本基金合同规定,本基金不参与国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

报告期内基金投资的前十名证券除国联股份(证券代码 603613)、华泰证券(证券代码 601688)、华中数控(证券代码 300161)、益丰药房(证券代码 603939)、中望软件(证券代码 688083)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。

1、国联股份(证券代码 603613)

根据 2023 年 12 月 26 日发布的相关公告,该证券发行人因财务会计报告违规被北京证监局给予警示。

2、华泰证券(证券代码 601688)

根据 2023 年 12 月 22 日发布的相关公告,该证券发行人因违反反洗钱法被央行江苏省分行处以罚款。

根据 2024 年 3 月 29 日发布的相关公告,该证券发行人因未依法履行职责被江苏证监局责令改正。

根据 2024 年 4 月 19 日发布的相关公告,该证券发行人因内部制度不完善被江苏证监局责令改正。

根据 2024 年 4 月 25 日发布的相关公告, 该证券发行人因未依法履行职责被深圳证监局给予警示。

根据 2024 年 5 月 15 日发布的相关公告, 该证券发行人因未依法履行职责被云南证监局给予警示。

3、华中数控 (证券代码 300161)

根据 2023 年 10 月 27 日发布的相关公告, 该证券发行人因未按期申报税款被国家税务总局北京市海淀区税务局第三税务所责令改正。

根据 2024 年 4 月 1 日发布的相关公告, 该证券发行人因未按期申报税款被国家税务总局北京市海淀区税务局花园路税务所责令改正。

4、益丰药房 (证券代码 603939)

根据发布的相关公告, 该证券发行人在报告期内因违规经营、未依法履行职责, 多次受到监管机构的处罚。

5、中望软件 (证券代码 688083)

根据 2024 年 7 月 30 日发布的相关公告, 该证券发行人因未依法履行职责被上海证券交易所科创板公司管理部给予警示。

对上述证券的投资决策程序的说明: 本基金投资上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

金额单位: 人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 (元) |
|----|-------|-----------|
| 1 | 存出保证金 | 4,443.31 |
| 2 | 应收清算款 | 74,048.40 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 10,144.23 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 88,635.94 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 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。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 招商丰利灵活配置混合基金 A | 招商丰利灵活配置混合基金 C |
|-------------------------------|-------------------|-------------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 19,298,872.47 | 1,073,949.99 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 171,174.93 | 70,801.40 |
| 减：报告期期间基金总赎回 份额 | 872,752.42 | 95,513.87 |
| 报告期期间基金拆分变动份 额（份额减少以“-”填列） | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 18,597,294.98 | 1,049,237.52 |

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的交易明细。

§ 8 备查文件目录

8.1 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利灵活配置混合型证券投资基金设立的文件；
- 3、《招商丰利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 4、《招商丰利灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 5、《招商丰利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。

8.2 存放地点

招商基金管理有限公司

地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

8.3 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.cmfcchina.com>

招商基金管理有限公司

2024 年 10 月 24 日