

招商瑞丰灵活配置混合型发起式证券投资基金

2015 第一季度 报告

2015年3月31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
报告送出日期:2015年4月22日

81 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2015年4月21日复核了本报告中的财务指标、净值数据和投资组合报告等内容的真实性,并未对基金净值核算及净值计算过程的正确性另行验证。
本报告中基金业绩指标的比较,如无特别说明,均以中国证监会规定的业绩比较基准或行业指数为基准。
本报告中所列的各项数据截至2015年3月31日止。

82 基金产品概况

基金简称	招商瑞丰灵活配置混合发起式
基金主代码	000314
交易代码	000314
交易方式	契约型开放式
报告期基金净值总额	2014年11月30日
报告期基金份额总额	3,522,426,950.00份

投资目标
通过灵活的资产配置和主动的投资管理,拓展大类资产配置空间,在精选个股、个券的基础上,适度集中投资,并通过超短期债券投资,在严格控制风险和追求基金资产长期增值的基础上,力争实现基金资产的长期增值。

投资策略
本基金采取主动管理投资策略,在严格控制风险的前提下,通过灵活的资产配置和主动的投资管理,拓展大类资产配置空间,在精选个股、个券的基础上,适度集中投资,并通过超短期债券投资,在严格控制风险和追求基金资产长期增值的基础上,力争实现基金资产的长期增值。

业绩比较基准	60%×沪深300指数收益率+40%×中债综合指数收益率
风险收益特征	本基金属于混合基金,在证券投资基金中属于预期风险和预期收益水平中等的投资品种,预期收益和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

31 主要财务指标

1.本期已实现收益	66,338,823.06
2.本期利润	72,995,112.12
3.加权平均基金份额本期利润	0.0584
4.期末基金资产净值	4,585,221,311.52
5.期末基金份额净值	1.302

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标准差③	①-③	②-④
过去三个月	4.92%	1.13%	9.12%	1.10%	-0.03%

姓名	李斌	任本基金基金经理期限	说明
李斌	2014年12月13日	-	7
姓名	邓栋	任本基金基金经理期限	说明
邓栋	2015年2月12日	-	5

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	88,976,572.53	1.94
2	其中:股票	88,976,572.53	1.94
3	债券投资	200,450,000.00	4.36
4	其中:国债	200,450,000.00	4.36
5	货币资金	4,300,375,133.02	93.59
6	其他资产	5,306,231.41	0.12
8	合计	4,595,107,936.96	100.00

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	88,976,572.53	1.94
2	其中:股票	88,976,572.53	1.94
3	债券投资	200,450,000.00	4.36
4	其中:国债	200,450,000.00	4.36
5	货币资金	4,300,375,133.02	93.59
6	其他资产	5,306,231.41	0.12
8	合计	4,595,107,936.96	100.00

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:2015年4月22日

81 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2015年4月21日复核了本报告中的财务指标、净值数据和投资组合报告等内容的真实性,并未对基金净值核算及净值计算过程的正确性另行验证。
本报告中基金业绩指标的比较,如无特别说明,均以中国证监会规定的业绩比较基准或行业指数为基准。
本报告中所列的各项数据截至2015年3月31日止。

82 基金产品概况

基金简称	招商可转债分级债券
场内简称	转债分级
基金主代码	161719
交易代码	161719
交易方式	契约型开放式
报告期基金净值总额	2014年11月30日
报告期基金份额总额	5,029,373,855.69份

投资目标
本基金采取主动管理投资策略,通过积极的投资管理,合理配置债券等固定收益类资产,在严格控制风险和追求基金资产长期增值的基础上,力争实现基金资产的长期增值。

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	88,976,572.53	1.94
2	其中:股票	88,976,572.53	1.94
3	债券投资	200,450,000.00	4.36
4	其中:国债	200,450,000.00	4.36
5	货币资金	4,300,375,133.02	93.59
6	其他资产	5,306,231.41	0.12
8	合计	4,595,107,936.96	100.00

姓名	孙海波	任本基金基金经理期限	说明
孙海波	2014年7月31日	-	16
姓名	吴莎莎	任本基金基金经理期限	说明
吴莎莎	2014年8月26日	-	4

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标准差③	①-③	②-④
过去三个月	7.0%	2.05%	0.03%	1.7%	0.88%

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	88,976,572.53	1.94
2	其中:股票	88,976,572.53	1.94
3	债券投资	200,450,000.00	4.36
4	其中:国债	200,450,000.00	4.36
5	货币资金	4,300,375,133.02	93.59
6	其他资产	5,306,231.41	0.12
8	合计	4,595,107,936.96	100.00

招商可转债分级债券型证券投资基金

2015 第一季度 报告

2015年3月31日

截至报告期末,本基金份额净值为1.003元,本报告期前净值增长率为7.10%,同期业绩比较基准增长率为0.03%,基金业绩领先于同期业绩比较基准。本基金主要投资于可转债,通过积极的投资管理,合理配置债券等固定收益类资产,在严格控制风险和追求基金资产长期增值的基础上,力争实现基金资产的长期增值。

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,005,207,529.01	15.88
2	其中:股票	1,005,207,529.01	15.88
3	债券投资	4,954,299,045.87	78.25
4	其中:国债	4,954,299,045.87	78.25
5	货币资金	47,919,433.27	0.76
6	其他资产	323,888,370.69	5.12
8	合计	6,331,244,378.84	100.00

姓名	孙海波	任本基金基金经理期限	说明
孙海波	2014年7月31日	-	16
姓名	吴莎莎	任本基金基金经理期限	说明
吴莎莎	2014年8月26日	-	4

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标准差③	①-③	②-④
过去三个月	7.0%	2.05%	0.03%	1.7%	0.88%

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,005,207,529.01	15.88
2	其中:股票	1,005,207,529.01	15.88
3	债券投资	4,954,299,045.87	78.25
4	其中:国债	4,954,299,045.87	78.25
5	货币资金	47,919,433.27	0.76
6	其他资产	323,888,370.69	5.12
8	合计	6,331,244,378.84	100.00

招商理财7天债券型证券投资基金

2015 第一季度 报告

2015年3月31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
报告送出日期:2015年4月22日

81 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2015年4月17日复核了本报告中的财务资料、净值数据和投资组合报告内容的真实性,并未对基金净值核算及净值计算过程的正确性另行验证。
本报告中基金业绩指标的比较,如无特别说明,均以中国证监会规定的业绩比较基准或行业指数为基准。
本报告中所列的各项数据截至2015年3月31日止。

82 基金产品概况

基金简称	招商理财7天债券
基金主代码	217025
交易代码	217025
交易方式	契约型开放式
报告期基金净值总额	2014年12月31日
报告期基金份额总额	283,034,183.67份

投资目标
通过主动管理,在严格控制风险和追求基金资产长期增值的基础上,力争实现基金资产的长期增值。

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	128,200,000.00	2.54
2	其中:股票	128,200,000.00	2.54
3	债券投资	461,551,481.23	9.15
4	其中:国债	461,551,481.23	9.15
5	货币资金	4,300,375,133.02	93.59
6	其他资产	5,306,231.41	0.12
8	合计	4,595,107,936.96	100.00

姓名	吴莎莎	任本基金基金经理期限	说明
吴莎莎	2014年8月26日	-	4

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标准差③	①-③	②-④
过去三个月	1.0879%	0.0031%	0.3375%	0.0000%	0.0031%

姓名	李斌	任本基金基金经理期限	说明
李斌	2013年12月27日	-	8

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标准差③	①-③	②-④
过去三个月	1.1604%	0.0031%	0.3375%	0.0000%	0.8229%

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:2015年4月22日

81 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2015年4月21日复核了本报告中的财务指标、净值数据和投资组合报告等内容的真实性,并未对基金净值核算及净值计算过程的正确性另行验证。
本报告中基金业绩指标的比较,如无特别说明,均以中国证监会规定的业绩比较基准或行业指数为基准。
本报告中所列的各项数据截至2015年3月31日止。

82 基金产品概况

基金简称	招商可转债分级债券
场内简称	转债分级
基金主代码	161719
交易代码	161719
交易方式	契约型开放式
报告期基金净值总额	2014年11月30日
报告期基金份额总额	5,029,373,855.69份

投资目标
本基金采取主动管理投资策略,通过积极的投资管理,合理配置债券等固定收益类资产,在严格控制风险和追求基金资产长期增值的基础上,力争实现基金资产的长期增值。

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	88,976,572.53	1.94
2	其中:股票	88,976,572.53	1.94
3	债券投资	200,450,000.00	4.36
4	其中:国债	200,450,000.00	4.36
5	货币资金	4,300,375,133.02	93.59
6	其他资产	5,306,231.41	0.12
8	合计	4,595,107,936.96	100.00

姓名	孙海波	任本基金基金经理期限	说明
孙海波	2014年7月31日	-	16
姓名	吴莎莎	任本基金基金经理期限	说明
吴莎莎	2014年8月26日	-	4

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标准差③	①-③	②-④
过去三个月	7.0%	2.05%	0.03%	1.7%	0.88%

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	88,976,572.53	1.94
2	其中:股票	88,976,572.53	1.94
3	债券投资	200,450,000.00	4.36
4	其中:国债	200,450,000.00	4.36
5	货币资金	4,300,375,133.02	93.59
6	其他资产	5,306,231.41	0.12
8	合计	4,595,107,936.96	100.00

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	99,966,666.55	32.81
2	其中:股票	99,966,666.55	32.81
3	债券投资	50,000,435.00	16.41
4	其中:国债	4,464,641.70	1.47
5	合计	304,683,094.69	100.00

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	报告期末债券融资余额	1.89	
2	报告期末债券回购余额	21,199,749.40	7.49

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标准差③	①-③	②-④
过去三个月	1.0879%	0.0031%	0.3375%	0.0000%	0.0031%

姓名	李斌	任本基金基金经理期限	说明
李斌	2013年12月27日	-	8

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标准差③	①-③	②-④
过去三个月	1.1604%	0.0031%	0.3375%	0.0000%	0.8229%

姓名	李斌	任本基金基金经理期限	说明
李斌	2013年12月27日	-	8

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金总资产比例(%)
1	140207	14国开07	200,000	20,001,211.21	7.07
2	041600009	14国债02	200,000	20,000,379.39	7.07
3	011499119	14国债11	200,000	20,000,204.86	7.07
4	041450443	14国债04	200,000	19,973,389.68	7.06
5	041600083	14国债12	200,000	10,000,201.29	3.53
6	041455030	14国债03	100,000	9,991,080.23	3.53

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标准差③	①-③	②-④
过去三个月	1.1604%	0.0031%	0.3375%	0.0000%	0.8229%

姓名	李斌	任本基金基金经理期限	说明
李斌	2013年12月27日	-	8

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标准差③	①-③	②-④
过去三个月	1.1604%	0.0031%	0.3375%	0.0000%	0.8229%

姓名	李斌	任本基金基金经理期限	说明
李斌	2013年12月27日	-	8

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标准差③	①-③	②-④
过去三个月	1.1604%	0.0031%	0.3375%	0.0000%	0.8229%

姓名	李斌	任本基金基金经理期限	说明
李斌	2013年12月27日	-	8

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标准差③	①-③	②-④
过去三个月	1.1604%	0.0031%	0.3375%	0.0000%	0.8229%

招商基金管理有限公司 2015年4月22日

招商基金管理有限公司 2015年4月22日