

招商丰德灵活配置混合型证券投资基金招募说明书(更新)摘要

(2018年第2号)

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
截止日:2018年09月01日

基金管理人根据有关法律法规规定,选择其他符合要求的机构代理销售本基

金,并对本公司

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

基金管理人

的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

本投资组合所披露数据截至2018年6月30日,来源于《招商丰德灵活配置混合

型证券投资基金2018年第2季度报告》。

1 报告期未本基金资产配置情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产比例(%) |
|-------------|---------------|----------------|-------------|
| 1 | 权益投资 | 59,671,980.43 | 38.66 |
| 其中:股票 | 59,671,980.43 | 38.66 | |
| 2 | 固定收益投资 | - | - |
| 其中:债券 | 44,805,147.20 | 29.03 | |
| 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 | - | - |
| 6 | 其他投资 | - | - |
| 其中:买入返售金融资产 | - | - | |
| 其中:买入返售金融资产 | - | - | |
| 其中:买入返售金融资产 | - | - | |
| 其中:买入返售金融资产 | - | - | |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 28,754,598.43 | 18.63 |
| 8 | 其他资产 | 21,116,633.79 | 13.68 |
| 9 | 合计 | 154,348,359.85 | 100.00 |

2 报告期末按行业分类的债券投资组合

| 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 | 3,230,722.00 | 2.11 |
| C | 制造业 | 39,237,043.43 | 25.60 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 3,098,880.00 | 2.02 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | 5,057,379.00 | 3.30 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 3,467,500.00 | 2.26 |
| H | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 1,869,002.00 | 1.22 |
| I | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| M | 租赁和商务服务业 | - | - |
| N | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| O | 水利、环境和公共设施服务业 | - | - |
| P | 建筑业 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 3,711,454.00 | 2.42 |
| S | 综合 | - | - |
| 合计 | | 59,671,980.43 | 38.93 |

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有港股通投资股票。

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

| 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 | 603899 | 晨光文具 | 190,800 | 6,046,452.00 | 3.94 |
| 2 | 600519 | 贵州茅台 | 6,100 | 4,461,906.00 | 2.91 |
| 3 | 002088 | 鲁商置业 | 258,187 | 3,894,042.40 | 2.54 |
| 4 | 600906 | 航新航空 | 44,300 | 3,711,454.00 | 2.42 |
| 5 | 600858 | 海康威视 | 110,600 | 3,702,888.00 | 2.42 |
| 6 | 002372 | 伟星新材 | 21,600 | 3,569,877.28 | 2.33 |
| 7 | 600009 | 上海机场 | 62,500 | 3,467,500.00 | 2.26 |
| 8 | 600028 | 中国石化 | 497,800 | 3,230,722.00 | 2.11 |
| 9 | 603816 | 阿特斯阳光 | 43,451 | 3,194,083.01 | 2.08 |
| 10 | 600900 | 长电科技 | 192,000 | 3,098,880.00 | 2.02 |

4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 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 | 12,002,200.00 | 7.83 |
| 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(含分离债) | 4,102,947.20 | 2.68 |
| 8 | 同业拆借 | 28,700,000.00 | 18.72 |
| 9 | 其他 | 44,805,147.20 | 29.23 |
| 合计 | | 154,348,359.85 | 100.00 |

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

| 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 | 111894206 | 18国债(附息)CD208 | 200,000 | 19,130,000.00 | 12.48 |
| 2 | 170017 | 17国债逆回购17 | 100,000 | 10,002,000.00 | 6.54 |
| 3 | 111744292 | 17广发银行CD292 | 100,000 | 9,570,000.00 | 6.23 |
| 4 | 110031 | 银证通债 | 40,030 | 4,096,620.20 | 2.67 |
| 5 | 019571 | 17国债17 | 20,000 | 2,000,200.00 | 1.30 |

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

本基金本报告期末未有资产支持证券。

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有贵金属。

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

本基金本报告期末未有权证。

9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期末本基金未持有股指期货合约。

9.2 本基金投资股指期货的投资策略

本基金股指期货投资将遵循风险管理的原则,主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。

10 报告期末本基金投资的国债期货投资策略

本基金本报告期末未有国债期货合约。

10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未有国债期货合约。

11 投资组合报告附注

11.1 报告期内基金投资的前十名证券除17苏银债CD292(证券代码111714292)、18国债附息CD208(证券代码111894206)外其他证券的发行主体未

被监管部门立案调查,不存在报告编制前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

1.1717苏银债CD292(证券代码111714292)

该证券发行主体为江苏银行南京分行,于2017年12月29日发布公告,该证券发行人因被中国人民银行南京分行

行政处罚,被暂停发行。

2.1818国债附息CD208(证券代码111894206)

根据2017年12月27日发布的公告,该证券发行人因信息披露虚假或重大遗漏导致被监管部门立案调查,并暂停该证券的发行。

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。

11.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同约定的备选股票库,本基金管理人

在制度权限范围内要求股票卖出,并及时买入再行买入。

11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | 79,003.71 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收利息 | 20,085,523.75 |
| 4 | 应收股利 | - |
| 5 | 应收申购款 | 951,809.88 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 21,116,633.79 |

11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-------------|--------------|--------------|
| 1 | 110031 银证通债 | 4,096,620.20 | 2.67 |
| 2 | 123004 天钢转债 | 912.90 | 0.00 |
| 3 | 128030 天钢转债 | 912.50 | 0.00 |
| 4 | 113014 天钢转债 | 902.40 | 0.00 |
| 5 | 128018 天钢转债 | 867.70 | 0.00 |

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。

11.6 基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉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,也不能保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未

来表现,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金合同生效以来的投资业绩及与同期基准的比较如下表所示:

招商丰德混合A:

| 阶段 | 基金净值增长率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 |
|-----------------------|----------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 2017/03/01-2017/12/31 | 5.97% | 0.40% | 4.90% | 0.21% | 1.07% | 0.19% |
| 2018/01/01-2018/06/30 | -8.21% | 0.87% | -9.98% | 0.35% | -1.74% | 0.52% |
| 基金成立以来2018/06/30 | -2.67% | 0.62% | 3.87% | 0.27% | -6.50% | 0.35% |

招商丰德混合C:

| 阶段 | 基金净值增长率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 |
|-----------------------|----------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 2017/03/01-2017/12/31 | 4.53% | 0.49% | 4.90% | 0.21% | -0.37% | 0.19% |
| 2018/01/01-2018/06/30 | -8.39% | 0.87% | -9.98% | 0.35% | -1.72% | 0.52% |
| 基金成立以来2018/06/30 | 4.04% | 0.62% | 3.87% | 0.27% | -7.91% | 0.35% |

注:本基金合同生效日为2017年3月1日。

招商丰德灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会2016年6月13日《关于准予招商丰德灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2016]1232号)注册公开募集。本基金的基金合同于2017年3月1日生效,本基金基金管理人招商基金

招商基金管理有限公司(以下称“本基金管理人”或“管理人”)保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册,中国证监会对本基金募集的注册审查并不构成对基金管理人诚信、专业、勤勉尽责的认可,也不构成对基金募集行为的实质性判断和实质性保证。基金募集期间的信息披露、基金募集行为、基金资产净值、基金份额净值、基金资产净值、基金资产净值增长率、基金资产净值增长率、基金资产净值增长率、基金资产净值增长率