

招商丰乐灵活配置混合型证券投资基金 2017年第1季度报告

2017年3月31日

招商财经大数据策略股票型证券投资基金 2017年第1季度报告

2017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:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2017年4月21日

重要提示
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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失或资产增值。

基金的投资业绩并不表示对未来业绩的保证。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2017年1月1日起至3月31日止。

基金产品概况
基金名称:招商丰乐混合
基金代码:002521

基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2016年8月25日

报告期末基金份额总额:800,004,092.41份
本报告期末基金份额总额:800,004,092.41份

投资目标
本基金的投资目标为:在严格控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

投资策略
本基金的投资策略包括:资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、衍生品投资策略。

业绩比较基准
50%*沪深300指数收益率+50%*中债综合指数收益率

风险收益特征
本基金属于中高风险的股票型基金,预期风险和预期收益高于货币型基金和债券型基金。

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

基金合同生效日:2016年8月25日
报告期末基金份额总额:800,004,092.41份

主要财务指标
1.本期已实现收益: -8,100,857.84
2.本期利润: 2,659,539.88

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。

注: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。

注:3.本基金合同于2016年8月25日生效,截至本报告期末基金成立未满一年。

注:4.本报告期基金业绩比较基准及其与同期业绩比较基准收益率的比较

招商丰乐混合C
阶段 净值增长 净值增长 业绩比较 业绩比较 ①-③ ②-④

过去三个月 0.30% 0.06% 2.03% 0.27% -1.73% -0.21%

招商丰乐混合A
阶段 净值增长 净值增长 业绩比较 业绩比较 ①-③ ②-④

过去三个月 0.30% 0.06% 2.03% 0.27% -1.73% -0.21%

注:1.本基金合同于2016年8月25日生效,截至本报告期末基金成立未满一年。

注:2.本基金合同于2016年8月25日生效,截至本报告期末基金成立未满一年。

注:3.本基金合同于2016年8月25日生效,截至本报告期末基金成立未满一年。

注:4.本报告期基金业绩比较基准及其与同期业绩比较基准收益率的比较

招商丰乐混合C
阶段 净值增长 净值增长 业绩比较 业绩比较 ①-③ ②-④

过去三个月 0.30% 0.06% 2.03% 0.27% -1.73% -0.21%

招商丰乐混合A
阶段 净值增长 净值增长 业绩比较 业绩比较 ①-③ ②-④

过去三个月 0.30% 0.06% 2.03% 0.27% -1.73% -0.21%

注:1.本基金合同于2016年8月25日生效,截至本报告期末基金成立未满一年。

注:2.本基金合同于2016年8月25日生效,截至本报告期末基金成立未满一年。

注:3.本基金合同于2016年8月25日生效,截至本报告期末基金成立未满一年。

注:4.本报告期基金业绩比较基准及其与同期业绩比较基准收益率的比较

招商丰乐混合C
阶段 净值增长 净值增长 业绩比较 业绩比较 ①-③ ②-④

过去三个月 0.30% 0.06% 2.03% 0.27% -1.73% -0.21%

招商丰乐混合A
阶段 净值增长 净值增长 业绩比较 业绩比较 ①-③ ②-④

过去三个月 0.30% 0.06% 2.03% 0.27% -1.73% -0.21%

注:1.本基金合同于2016年8月25日生效,截至本报告期末基金成立未满一年。

注:2.本基金合同于2016年8月25日生效,截至本报告期末基金成立未满一年。

注:3.本基金合同于2016年8月25日生效,截至本报告期末基金成立未满一年。

性板块也取得了非常好的收益。
在存量蓝筹格局不变的情况下,市场分化比较明显,成长性板块受高估值压制比较明显。

最终,上证指数收涨3.83%,深圳成指收涨3.47%,沪深300收涨4.41%,中小板收涨4.22%,创业板收涨2.79%。

回顾,一季度债券市场收益率整体走出一个震荡上行的态势,几方面的因素不利于债市环境。

配置方面,我们根据本组合的特点,挑选具有足够安全边际和空间的股票作为配置,而没有限制仓位,选股效率上起来有所损失,但是胜在长期稳健。

4.5 报告期内本基金业绩表现
报告期内,本基金A类份额净值增长率为0.30%,C类份额净值增长率为0.30%,同期业绩比较基准增长率为2.03%。

根据证监会《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条的相关规定,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元情形的,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元的情形。

5.1 报告期末基金资产组合情况
序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

1 权益投资 54,856,303.02 6.87
其中:股票 54,856,303.02 6.87

2 基金投资 419,370,264.17 52.56
其中:股票 419,370,264.17 52.56

3 债券投资 302,816,374.22 37.95
其中:央行票据及政府债券 302,816,374.22 37.95

4 资产支持证券 14,693,048.75 1.84
其中:资产支持证券 14,693,048.75 1.84

5 其他 6,191,981.22 0.78
其中:买入返售金融资产 6,191,981.22 0.78

6 合计 797,927,971.38 100.00

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

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 - -
B 采矿业 - -
C 制造业 13,334,363.96 1.67

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 5,999,664.08 0.76

E 建筑业 25,001.46 0.00

F 批发和零售业 - -
G 交通运输、仓储和邮政业 6,356,660.00 0.80

H 信息技术、软件和信息技术服务业 2,951,387.60 0.37

I 金融业 26,209,226.00 3.29

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 - -

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 - -

T 合计 54,856,303.02 6.88

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通股票投资组合
本基金本报告期末未持有沪港通股票。

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

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 600398 海南之家 713,900 7,474,533.00 0.94

2 600030 中信证券 431,300 6,948,243.00 0.87

3 601318 中国平安 180,000 6,661,800.00 0.84

4 601166 兴业银行 392,368 6,359,183.00 0.80

5 600018 上海银行 1,077,400 6,356,660.00 0.80

6 600919 江苏银行 624,000 6,240,000.00 0.78

7 601985 中国铁建 826,400 5,999,664.00 0.75

8 600518 国药控股 307,676 5,802,656.28 0.73

9 600637 东方明珠 130,940 2,951,387.60 0.37

10 603178 圣农发展 2,578 37,174.74 0.00

5.4 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 国债 26,057,356.20 3.27

2 央行票据 - -

3 金融债 - -

4 企业债 - -

5 企业短期融资券 - -

6 中期票据 - -

7 可转债(可交换债) - -

8 其他 299,874,000.00 37.42

9 合计 299,874,000.00 37.42

5.5 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 股票代码 债券名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 01169493 16华电能源SCP002 600,000 59,970,000.00 7.52

2 111698206 16兴业银行CD052 600,000 57,780,000.00 7.25

3 111712009 17北京银行CD009 500,000 48,985,000.00 6.14

4 111695890 16浦发银行CD046 500,000 48,290,000.00 6.06

5 111631321 16浙商CD121 500,000 48,270,000.00 6.06

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五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序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

本基金将根据风险管理原则,以套期保值为目的,适度运用股指期货进行套期保值。

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 本期国债期货投资持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内本基金投资的前十名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。

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事先入库再买入。

5.11.3 其他资产构成

序号 项目 金额(元)

1 应收利息 25,465.86

2 应收证券清算款 - -

3 应收股利 6,166,515.36

4 应收申购款 - -

5 预收账款 - -

6 其他应收款 - -

7 持有待售资产 - -

8 其他 - -

9 合计 6,191,981.22

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

56 开放式基金的投资情况

单位:份

报告期末基金份额总额 800,004,215.33 招商丰乐混合A 招商丰乐混合C

报告期末基金份额总额 800,004,215.33 1,874.94

报告期末基金份额总额 991.12 6.93

报告期末基金份额总额 800,002,224.41 1,868.01

57 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基金份额变动情况

本报告期基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

7.2 基金管理人持有本基金基金份额变动情况

本报告期基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

88 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

报告期末持有基金份额投资者情况

投资者类别 序号 持有基金份额比例 期初 申购 赎回 持有份额 份额占比

机构 1 20170101-20170331 799,999,500.00 - - 799,999,500.00 100.00%

个人 1 20170101-20170331 299,999,500.00 - - 299,999,500.00 37.51%

合计 1 20170101-20170331 799,999,500.00 - - 799,999,500.00 100.00%

9.1 备查文件目录

1、中国证监会核准注册招商丰乐灵活配置混合型证券投资基金的文件;

2、中国证监会核准注册招商丰乐灵活配置混合型证券投资基金设立的文件;

3、《招商丰乐灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

4、《招商丰乐灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》;

5、《招商丰乐灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

6、《招商丰乐灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

7、《招商丰乐灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

8、《招商丰乐灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

9、《招商丰乐灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

10、《招商丰乐灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

11、《招商丰乐灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

12、《招商丰乐灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

13、《招商丰乐灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

14、《招商丰乐灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

15、《招商丰乐灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

16、《招商丰乐灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

17、《招商丰乐灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

18、《招商丰乐灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

19、《招商丰乐灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

20、《招商丰乐灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

21、《招商丰乐灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

22、《招商丰乐灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

23、《招商丰乐灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

24、《招商丰乐灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

25、《招商丰乐灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

26、《招商丰乐灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

27、《招商丰乐灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

28、《招商丰乐灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

29、《招商丰乐灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

30、《招商丰乐灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

31、《招商丰乐灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

32、《招商丰乐灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

33、《招商丰乐灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

34、《招商丰乐灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

35、《招商丰乐灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

36、《招商丰乐灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

37、《招商丰乐灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

38、《招商丰乐灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

39、《招商丰乐灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

40、《招商丰乐灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

41、《招商丰乐灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

42、《招商丰乐灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

43、《招商丰乐灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

44、《招商丰乐灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

45、《招商丰乐灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

46、《招商丰乐灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

47、《招商丰乐灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

48、《招商丰乐灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

49、《招商丰乐灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

50、《招商丰乐灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

51、《招商丰乐灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

52、《招商丰乐灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

53、《招商丰乐灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

54、《招商丰乐灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

55、《招商丰乐灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

56、《招商丰乐灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

57、《招商丰乐灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

58、《招商丰乐灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

59、《招商丰乐灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

60、《招商丰乐灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

61、《招商丰乐灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

62、《招商丰乐灵活配置混合型证券投资基金托管协议