

招商丰乐灵活配置混合型证券投资基金 2017 年年度报告摘要

2017 年 12 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

重要提示:基金管理人、基金托管人及基金销售机构应当勤勉尽责,恪尽职守,确保基金资产的安全,维护基金份额持有人的合法权益。

2.1 基金基本情况:招商丰乐灵活配置混合型证券投资基金,基金代码:012821,基金运作方式为契约型开放式。

2.2 基金产品说明:基金的投资目标为在严格控制风险的前提下,力争实现基金资产的长期增值。投资策略包括资产配置、股票投资、债券投资和另类投资等。

业绩比较基准:50%×沪深300指数收益率+50%×中债综合财富指数收益率

2.3 基金管理人及基金托管人: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。

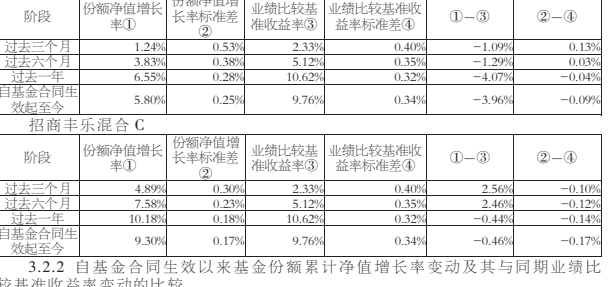
2.4 信息披露方式:基金年度报告正文的管理人互联网网址: http://www.cmfund.com.cn

3.1 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况:报告期内,基金净值表现良好,基金份额净值增长率为6.55%。

Table with 4 columns: 阶段, 份额净值增长率, 业绩比较基准收益率, ①-③, ②-④. Rows include 过去三个月, 过去六个月, 过去一年, 自基金合同生效以来.

注:1.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。

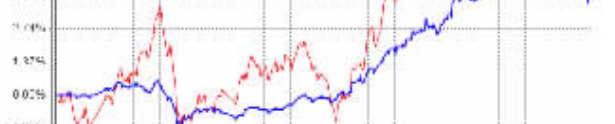
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较:招商丰乐混合 A 基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图。



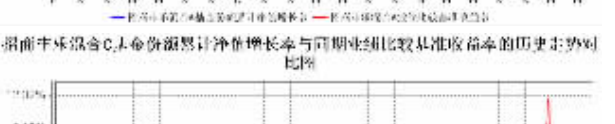
招商丰乐混合 A 基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图:招商丰乐混合 A 基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图。



招商丰乐混合 C 基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图:招商丰乐混合 C 基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图。



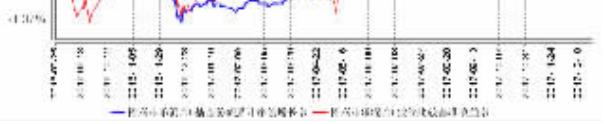
招商丰乐混合 C 基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图:招商丰乐混合 C 基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图。



招商丰乐混合 A 基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图:招商丰乐混合 A 基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图。



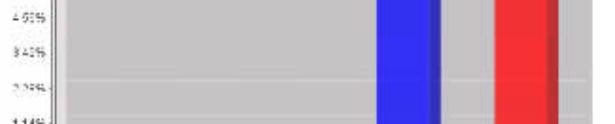
招商丰乐混合 C 基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图:招商丰乐混合 C 基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图。



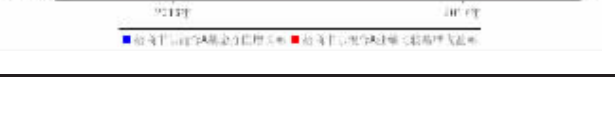
招商丰乐混合 C 基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图:招商丰乐混合 C 基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图。



招商丰乐混合 A 基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图:招商丰乐混合 A 基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图。

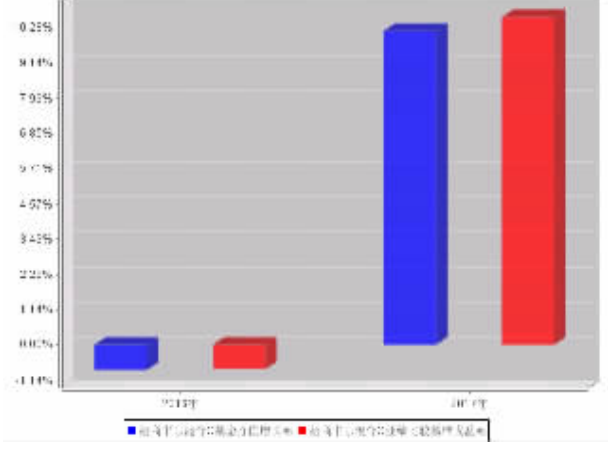


招商丰乐混合 C 基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图:招商丰乐混合 C 基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图。



招商丰乐混合 A 基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图:招商丰乐混合 A 基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图。

湖南丰乐混合 A 基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注:本基金合同于 2016 年 8 月 25 日生效,截至 2016 年 12 月 31 日成立未满 1 年,故成立当年净值增长率按当年实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况:本基金于 2016 年 8 月 25 日成立,自基金合同生效日以来未进行利润分配。

3.4 管理人报告:4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验:招商基金管理有限公司于 2002 年 12 月 27 日经中国证监会 [2002]100 号文批准设立。

4.1.2 基金管理人及其管理基金的经验:招商基金管理有限公司于 2002 年 12 月 27 日经中国证监会 [2002]100 号文批准设立。

4.1.3 基金管理人及其管理基金的经验:招商基金管理有限公司于 2002 年 12 月 27 日经中国证监会 [2002]100 号文批准设立。

4.1.4 基金管理人及其管理基金的经验:招商基金管理有限公司于 2002 年 12 月 27 日经中国证监会 [2002]100 号文批准设立。

4.1.5 基金管理人及其管理基金的经验:招商基金管理有限公司于 2002 年 12 月 27 日经中国证监会 [2002]100 号文批准设立。

4.1.6 基金管理人及其管理基金的经验:招商基金管理有限公司于 2002 年 12 月 27 日经中国证监会 [2002]100 号文批准设立。

4.1.7 基金管理人及其管理基金的经验:招商基金管理有限公司于 2002 年 12 月 27 日经中国证监会 [2002]100 号文批准设立。

4.1.8 基金管理人及其管理基金的经验:招商基金管理有限公司于 2002 年 12 月 27 日经中国证监会 [2002]100 号文批准设立。

4.1.9 基金管理人及其管理基金的经验:招商基金管理有限公司于 2002 年 12 月 27 日经中国证监会 [2002]100 号文批准设立。

4.1.10 基金管理人及其管理基金的经验:招商基金管理有限公司于 2002 年 12 月 27 日经中国证监会 [2002]100 号文批准设立。

4.1.11 基金管理人及其管理基金的经验:招商基金管理有限公司于 2002 年 12 月 27 日经中国证监会 [2002]100 号文批准设立。

4.1.12 基金管理人及其管理基金的经验:招商基金管理有限公司于 2002 年 12 月 27 日经中国证监会 [2002]100 号文批准设立。

4.1.13 基金管理人及其管理基金的经验:招商基金管理有限公司于 2002 年 12 月 27 日经中国证监会 [2002]100 号文批准设立。

4.1.14 基金管理人及其管理基金的经验:招商基金管理有限公司于 2002 年 12 月 27 日经中国证监会 [2002]100 号文批准设立。

4.1.15 基金管理人及其管理基金的经验:招商基金管理有限公司于 2002 年 12 月 27 日经中国证监会 [2002]100 号文批准设立。

4.1.16 基金管理人及其管理基金的经验:招商基金管理有限公司于 2002 年 12 月 27 日经中国证监会 [2002]100 号文批准设立。

4.1.17 基金管理人及其管理基金的经验:招商基金管理有限公司于 2002 年 12 月 27 日经中国证监会 [2002]100 号文批准设立。

4.1.18 基金管理人及其管理基金的经验:招商基金管理有限公司于 2002 年 12 月 27 日经中国证监会 [2002]100 号文批准设立。

4.1.19 基金管理人及其管理基金的经验:招商基金管理有限公司于 2002 年 12 月 27 日经中国证监会 [2002]100 号文批准设立。

4.1.20 基金管理人及其管理基金的经验:招商基金管理有限公司于 2002 年 12 月 27 日经中国证监会 [2002]100 号文批准设立。

4.1.21 基金管理人及其管理基金的经验:招商基金管理有限公司于 2002 年 12 月 27 日经中国证监会 [2002]100 号文批准设立。

4.1.22 基金管理人及其管理基金的经验:招商基金管理有限公司于 2002 年 12 月 27 日经中国证监会 [2002]100 号文批准设立。

4.1.23 基金管理人及其管理基金的经验:招商基金管理有限公司于 2002 年 12 月 27 日经中国证监会 [2002]100 号文批准设立。

4.1.24 基金管理人及其管理基金的经验:招商基金管理有限公司于 2002 年 12 月 27 日经中国证监会 [2002]100 号文批准设立。

4.1.25 基金管理人及其管理基金的经验:招商基金管理有限公司于 2002 年 12 月 27 日经中国证监会 [2002]100 号文批准设立。

基金的资产净值的计算、基金费用开支等方面进行了认真地复核,对本基金的投资运作进行了监督,未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见:本托管人复核了本年度报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

86 审计报告:德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)审计了招商丰乐灵活配置混合型证券投资基金的财务报表,包括 2017 年 12 月 31 日的资产负债表、2017 年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注,并出具了无保留意见的审计报告。

投资者欲了解详细情况,可通过年度报告正文查看审计报告全文。

7.1 资产负债表:单位:人民币元

Table with 4 columns: 资产, 2017 年 12 月 31 日, 上年度末 2016 年 12 月 31 日, 2017 年 12 月 31 日. Rows include 银行存款, 结算备付金, 存出保证金, 交易性金融资产, 其中:股票投资, 基金投资, 债券投资, 资产支持证券投资, 贵金属投资, 衍生金融资产, 买入返售金融资产, 应收证券清算款, 其他资产, 资产总计.

注:本报告截止日 2017 年 12 月 31 日,招商丰乐混合 A 份额净值 1.058 元,基金份额总额 1,004,344.44 份;招商丰乐混合 C 份额净值 1.093 元,基金份额总额 2,021.44 份,总份额合计 1,006,365.88 份。

7.2 利润表:单位:人民币元

Table with 4 columns: 项目, 本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日, 上年度可比期间 2016 年 8 月 25 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日, 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日. Rows include 一、收入, 利息收入, 其中:存款利息收入, 债券利息收入, 资产支持证券利息收入, 买入返售金融资产收入, 其他利息收入, 二、费用, 其中:销售费用, 三、利润总额(亏损总额), 四、净利润(净亏损).

注:本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.8.1 股票交易:本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.8.2 债券交易:本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

7.4.8.3 债券回购交易:本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

7.4.8.4 权证交易:本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.8.5 应支付关联方的佣金:本基金本报告期内及上年度可比期间无支付关联方的佣金。

7.4.8.6 关联方交易:本基金本报告期内及上年度可比期间无支付关联方的佣金。

7.4.8.7 基金管理人报酬:单位:人民币元

Table with 4 columns: 项目, 本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日, 上年度可比期间 2016 年 8 月 25 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日, 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日. Rows include 当期发生的基金应支付的佣金, 招商丰乐混合 A, 招商丰乐混合 C, 合计.

注:本基金管理人招商基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 x 0.25% 的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

7.4.8.8 基金管理人报酬:单位:人民币元

Table with 4 columns: 项目, 本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日, 上年度可比期间 2016 年 8 月 25 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日, 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日. Rows include 当期发生的基金应支付的销售服务费, 招商丰乐混合 A, 招商丰乐混合 C, 合计.

注:根据基金合同的约定,招商丰乐混合 A 不收取销售服务费,招商丰乐混合 C 的销售服务费按前一日基金资产净值 x 0.20% 的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

7.4.8.9 基金管理人报酬:单位:人民币元

Table with 4 columns: 项目, 本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日, 上年度可比期间 2016 年 8 月 25 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日, 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日. Rows include 当期发生的基金应支付的销售服务费, 招商丰乐混合 A, 招商丰乐混合 C, 合计.

注:根据基金合同的约定,招商丰乐混合 A 不收取销售服务费,招商丰乐混合 C 的销售服务费按前一日基金资产净值 x 0.20% 的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

7.4.8.10 基金管理人报酬:单位:人民币元

Table with 4 columns: 项目, 本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日, 上年度可比期间 2016 年 8 月 25 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日, 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日. Rows include 当期发生的基金应支付的销售服务费, 招商丰乐混合 A, 招商丰乐混合 C, 合计.

注:根据基金合同的约定,招商丰乐混合 A 不收取销售服务费,招商丰乐混合 C 的销售服务费按前一日基金资产净值 x 0.20% 的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

7.4.8.11 基金管理人报酬:单位:人民币元

注:根据基金合同的约定,招商丰乐混合 A 不收取销售服务费,招商丰乐混合 C 的销售服务费按前一日基金资产净值 x 0.20% 的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。