

# 招商丰凯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

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：2017 年 4 月 21 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 2017 年 4 月 20 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 2017 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

|            |  |
|------------|--|
| 基金简称       | 招商丰凯混合   |
| 基金主代码      | 002581   |
| 交易代码       | 002581   |
| 基金运作方式     | 契约型开放式   |
| 基金合同生效日    | 2016 年 8 月 24 日  |
| 报告期末基金份额总额 | 204,290,369.23 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，在控制下行风险的前提下为投资人获取稳健回报。   |
| 投资策略       | <p>1、大类资产配置策略</p> <p>本基金依据定期公布的宏观和金融数据以及投资部门对于宏观经济、股市政策、市场趋势的综合分析，重点关注包括、GDP 增速、固定资产投资增速、净出口增速、通胀率、货币供应、利率等宏观指标的变化趋势，同时强调金融市场投资者行为分析，关注资本市场资金供求关系变化等因素，在深入分析和充分论证的基础上评估宏观经济运行及政策对资本市场的影响方向和力度，形成资产配置的整体规划，灵活调整股票资产的仓位。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金主要采取自下而上的选股策略。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>本基金采用债券投资策略包括：久期策略、期限结构策略、个券选择策略和相对价值判断策略等，对于可转换公司债等特殊品种，将根据其特点采取相应的投资策略。</p> <p>4、权证投资策略</p> <p>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</p> |

|                 |  |                  |
|-----------------|--|------------------|
|                 | <p>要两种因素——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>5、股指期货投资策略<br/>本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，以实现管理市场风险和调节股票仓位的目的。</p> <p>6、资产支持证券投资策略<br/>在控制风险的前提下，本基金对资产支持证券从五个方面综合定价，选择低估的品种进行投资。五个方面包括信用因素、流动性因素、利率因素、税收因素和提前还款因素。而当前的信用因素是需要重点考虑的因素。</p> |                  |
| 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     | 招商丰凯混合 A   | 招商丰凯混合 C         |
| 下属分级基金的交易代码     | 002581   | 002582           |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 4,669,518.15 份   | 199,620,851.08 份 |

### § 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（2017年1月1日—2017年3月31日） |                |
|-----------------|---------------------------|----------------|
|                 | 招商丰凯混合 A                  | 招商丰凯混合 C       |
| 1. 本期已实现收益      | -11,249,082.19            | 334,106.83     |
| 2. 本期利润         | 5,249,854.76              | 1,214,022.93   |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0067                    | 0.0276         |
| 4. 期末基金资产净值     | 5,043,479.19              | 201,233,873.56 |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.080                     | 1.008          |

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；

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，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、本基金合同于 2016 年 8 月 24 日生效，截至本报告期末基金成立未满一年。

## 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

招商丰凯混合 A

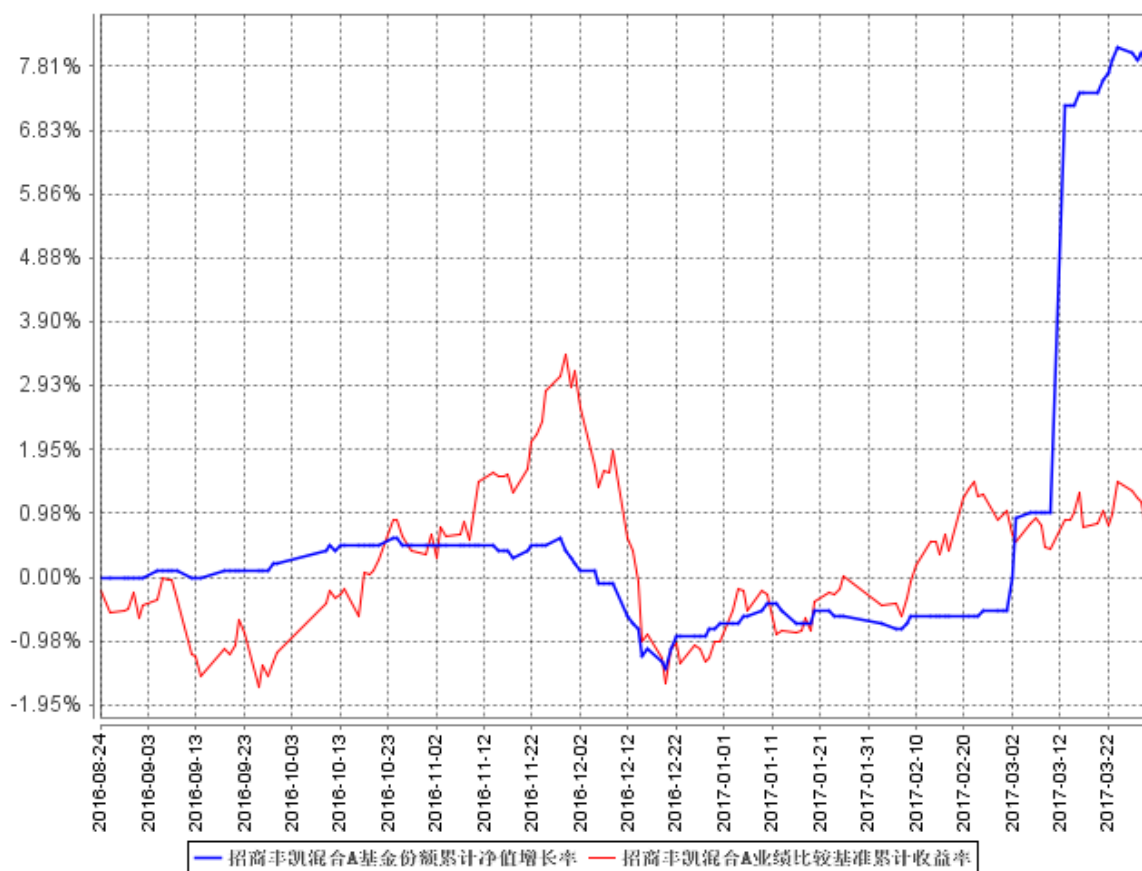
| 阶段    | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③   | ②—④   |
|-------|--------|-----------|------------|---------------|-------|-------|
| 过去三个月 | 8.76%  | 0.81%     | 2.03%      | 0.27%         | 6.73% | 0.54% |

招商丰凯混合 C

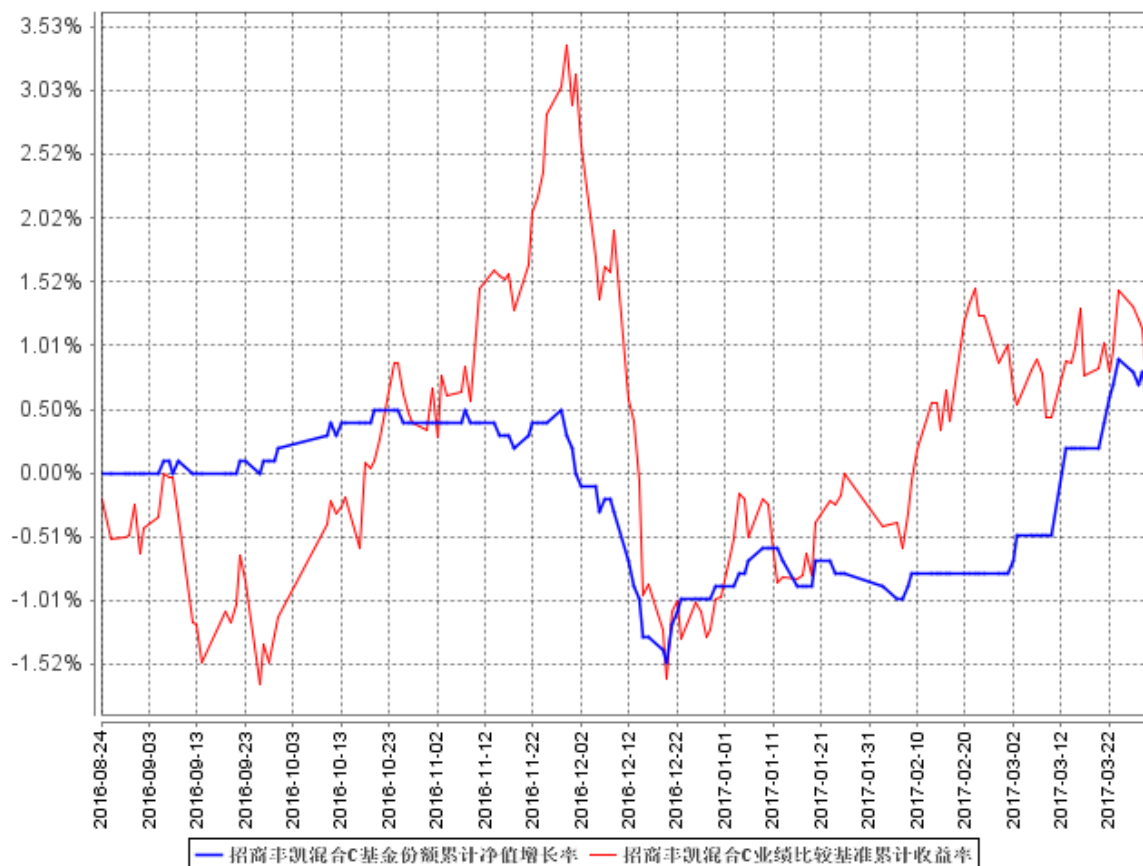
| 阶段    | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③    | ②—④    |
|-------|--------|-----------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月 | 1.72%  | 0.13%     | 2.03%      | 0.27%         | -0.31% | -0.14% |

### 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

招商丰凯混合A基金份额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



## 招商丰凯混合C基金份额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：本基金合同于 2016 年 8 月 24 日生效，截至本报告期末基金成立未满一年；自基金成立日起 6 个月内为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

## § 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 |        |  |
| 姚飞军 | 本基金基金经理 | 2016 年 8 月 24 日 | -    | 10     | 男，经济学硕士。2007 年 3 月加入国泰基金管理有限公司，曾任交易员及交易主管；2012 年 8 月加入长信基金管理有限公司，曾任交易总监及投资决策委员会委员；2015 年 7 月加入招商基金管理有限公司，现任投资支持与创新部总监兼招商增荣灵活配置混合型证券投资基金及招商丰凯灵活配置混合型证券投资基金基金经理。 |

|     |         |                 |   |   |  |
|-----|---------|-----------------|---|---|--|
| 何文韬 | 本基金基金经理 | 2016 年 8 月 31 日 | - | 9 | 男，管理学硕士。2007 年 7 月加入招商基金管理有限公司，曾任交易部交易员，专户资产投资部研究员、助理投资经理、投资经理。先后从事股票和债券交易、债券及新股研究、投资组合的投资管理等工作，现任投资管理二部总监助理兼招商丰盛稳定增长灵活配置混合型证券投资基金、招商丰利灵活配置混合型证券投资基金、招商丰裕灵活配置混合型证券投资基金、招商丰享灵活配置混合型证券投资基金、招商睿逸稳健配置混合型证券投资基金、招商丰凯灵活配置混合型证券投资基金、招商丰益灵活配置混合型证券投资基金以及招商丰诚灵活配置混合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期，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做出决定的公告（生效）日期；

2、证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》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《招商丰凯灵活配置混合型证券投资基金基金合同》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（以下简称“公司”）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。公司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。公司拥有健全的投资授权制度，明确投资决策委员会、投资总监、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。公司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

公司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，公司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，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易不存在成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形。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

##### (1) 股票市场回顾、操作、策略

消费方面，1-2 月社会消费品零售总额同比增长 9.5%，增速同比-0.6%，实际增长 8.1%，其中，汽车类消费增速由去年底的 14.4% 降至-1%，房地产相关消费也有小幅下滑，其他消费（旅游、教育等）去年以来呈上升趋势。

投资方面，17 年 1-2 月城镇固定资产投资同比增长 8.9%，回升到与去年 3、4 季度相当的水平，从当月同比来看，总投资增长主要受到基建投资拉动，房地产和制造业投资均较去年底有所回落，1-2 月基建投资同比蹿升至 21.3%，为 16 年下半年以来最高水平。房地产投资则不及预期强劲，1-2 月房地产开发投资同比小幅下降至 8.9%。

年初以来 A 股整体呈上涨态势，但是板块分化明显，一季度上证指数上涨 3.83%，创业板下跌 2.79%，建筑、建材、家电、钢铁、军工、白酒、交运等板块领涨。

操作上，组合在严格控制仓位的前提下，优先配置价值股，选择符合经济社会转型的板块。

策略上，主要增加对业绩增长预期确定行业的配置，以大消费板块为主，获得稳定成长的收益，同时择时把握部分成长个股回调后的买入机会，适当参与基建主题。

##### (2) 债券市场回顾、操作、策略

2017 年一季度债市继续调整，不过跌幅较去年四季度明显缩小。以国开债为例，2017 年一季度 1 年期和 10 年期品种分别上行 37BP 和 38BP，曲线平坦化上行。趋势来看，一季度的下跌主要归在 1 月，2 月和 3 月以震荡为主。受货币政策转向稳健中性，MLF 利率、OMO 利率上调超预期冲击，10 年国开从年初开始一路上行，最终在 2 月 7 日达到 4.19% 的短期高点。之后，在公

开市场再现净投放，TLF 等传言带动下，投资者对货币政策的悲观预期有所修正，国债期货大涨带动现券小幅回落，160213 在 2 月下旬回落到 4.04%左右的位置。进入 3 月后，市场情绪转弱，10 年国开再度触到 4.2%的高位。不过冲高的时间并不长，在 2 月 CPI 大幅低于预期、房地产调控升级等利好刺激下，现券再度小幅回落。

信用债方面，一季度 5 年 AA+中票信用利差上行 20BP，AA 级上行 4BP。与去年四季度相比，信用利差上行的幅度缩窄的更加明显。趋势来看，信用利差的扩大主要集中在 1 月中旬至 2 月上旬，2 月下旬至今，信用利差震荡略微下行。整体来看，信用利差小幅扩大，信用债依然表现为熊市。至于一季度信用利差调整幅度大幅缩窄，应与信用债收益率已经较接近贷款利率有关。

操作上，我们维持了防守型的总思路，组合以短久期利率债和高评级的信用债为主。

策略上，考虑到经济基本企稳，通胀温和，但金融去杠杆压力较大，我们整体以防守为主，以短久期、高等级债券做底仓，择时参与长久期利率债的资本利得机会。

#### 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 8.76%，C 类份额净值增长率为 1.72%，同期业绩基准增长率为 2.03%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

根据证监会《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条的相关要求，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 投资组合报告

### 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    | 60,577,623.91 | 29.29        |
|    | 其中：股票   | 60,577,623.91 | 29.29        |
| 2  | 基金投资    | -             | -            |
| 3  | 固定收益投资  | 78,560,970.58 | 37.98        |
|    | 其中：债券   | 78,560,970.58 | 37.98        |
|    | 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          | 4,000,000.00   | 1.93   |
|   | 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      | 63,278,923.25  | 30.60  |
| 8 | 其他资产              | 406,646.68     | 0.20   |
| 9 | 合计                | 206,824,164.42 | 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、渔业         | -             | -            |
| B  | 采矿业              | 6,718,343.00  | 3.26         |
| C  | 制造业              | 19,543,713.85 | 9.47         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 4,667,944.00  | 2.26         |
| E  | 建筑业              | 2,985,479.86  | 1.45         |
| F  | 批发和零售业           | 9,223,976.00  | 4.47         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 3,261,322.00  | 1.58         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -             | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 2,007,783.20  | 0.97         |
| J  | 金融业              | 8,339,593.00  | 4.04         |
| K  | 房地产业             | -             | -            |
| L  | 租赁和商务服务业         | 3,829,469.00  | 1.86         |
| 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               | -             | -            |
|    | 合计               | 60,577,623.91 | 29.37        |

### 5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

## 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

| 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  | 600511 | 国药股份 | 121,200 | 4,065,048.00 | 1.97         |

|    |        |      |         |              |      |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 2  | 601607 | 上海医药 | 152,100 | 3,545,451.00 | 1.72 |
| 3  | 600138 | 中青旅  | 144,000 | 3,143,520.00 | 1.52 |
| 4  | 601318 | 中国平安 | 71,300  | 2,638,813.00 | 1.28 |
| 5  | 600518 | 康美药业 | 89,500  | 1,687,970.00 | 0.82 |
| 6  | 600029 | 南方航空 | 203,400 | 1,639,404.00 | 0.79 |
| 7  | 600271 | 航天信息 | 77,900  | 1,635,900.00 | 0.79 |
| 8  | 601668 | 中国建筑 | 177,700 | 1,634,840.00 | 0.79 |
| 9  | 600009 | 上海机场 | 54,100  | 1,621,918.00 | 0.79 |
| 10 | 600887 | 伊利股份 | 85,400  | 1,614,914.00 | 0.78 |

#### 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  | 国家债券      | -             | -            |
| 2  | 央行票据      | -             | -            |
| 3  | 金融债券      | -             | -            |
|    | 其中：政策性金融债 | -             | -            |
| 4  | 企业债券      | 20,077,000.00 | 9.73         |
| 5  | 企业短期融资券   | -             | -            |
| 6  | 中期票据      | -             | -            |
| 7  | 可转债（可交换债） | 1,078,970.58  | 0.52         |
| 8  | 同业存单      | 57,405,000.00 | 27.83        |
| 9  | 其他        | -             | -            |
| 10 | 合计        | 78,560,970.58 | 38.09        |

#### 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 | 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  | 111793999 | 17 南京银行 CD056     | 300,000 | 28,707,000.00 | 13.92        |
| 2  | 111793983 | 17 广州农村商业银行 CD047 | 300,000 | 28,698,000.00 | 13.91        |
| 3  | 124602    | 14 国网 01          | 100,000 | 10,278,000.00 | 4.98         |
| 4  | 136469    | 16 联通 01          | 100,000 | 9,799,000.00  | 4.75         |
| 5  | 113011    | 光大转债              | 10,000  | 999,973.70    | 0.48         |

#### 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

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，以实现管理市场风险和调节股票仓位的目的。

## 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

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

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先入库再买入。

### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）     |
|----|---------|-----------|
| 1  | 存出保证金   | 39,437.53 |
| 2  | 应收证券清算款 | -         |

|   |       |            |
|---|-------|------------|
| 3 | 应收股利  | -          |
| 4 | 应收利息  | 367,209.15 |
| 5 | 应收申购款 | -          |
| 6 | 其他应收款 | -          |
| 7 | 待摊费用  | -          |
| 8 | 其他    | -          |
| 9 | 合计    | 406,646.68 |

#### 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情况。

### § 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                        | 招商丰凯混合 A         | 招商丰凯混合 C       |
|---------------------------|------------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 1,197,019,699.31 | 22,053.65      |
| 报告期期间基金总申购份额              | 4,663,246.26     | 199,598,802.38 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额            | 1,197,013,427.42 | 4.95           |
| 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               | 4,669,518.15     | 199,620,851.08 |

### § 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

本报告期内本基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

### § 8 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

| 投资者类别  | 报告期内持有基金份额变化情况 |                         |                  |                |                  | 报告期末持有基金情况     |        |
|--|----------------|-------------------------|------------------|----------------|------------------|----------------|--------|
|  | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额             | 申购份额           | 赎回份额             | 持有份额           | 份额占比   |
| 机构   | 1              | 20170314-20170331       | -                | 69,859,281.43  |                  | 69,859,281.43  | 34.20% |
| 机构   | 2              | 20170101-20170313       | 1,197,012,435.31 |                | 1,197,012,435.31 | -              | -      |
| 机构   | 3              | 20170314-20170331       | -                | 134,402,767.21 | -                | 134,402,767.21 | 65.79% |
| 产品特有风险   |                |                         |                  |                |                  |                |        |
| 本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况，可能会出现集中赎回甚至巨额赎回从而引发基金净值剧烈波动，甚至引发基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。 |                |                         |                  |                |                  |                |        |

## § 9 备查文件目录

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

### 9.2 存放地点

招商基金管理有限公司

地址：中国深圳深南大道 7088 号招商银行大厦

### 9.3 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.cmfchina.com>

招商基金管理有限公司  
2017 年 4 月 21 日