

# 招商丰利灵活配置混合型证券投资基金 2023 年第 3 季度报告

2023 年 09 月 30 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

送出日期：2023 年 10 月 24 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 2023 年 10 月 23 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 2023 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	招商丰利灵活配置混合基金
基金主代码	000679
交易代码	000679
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 8 月 12 日
报告期末基金份额总额	36,012,302.81 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，并结合对个股、个券的精选策略，在控制风险的前提下力争为投资者带来绝对收益。
投资策略	<p>本基金以获取绝对收益为投资目的，从资产配置和精选个股个券两个方面来构建投资组合。</p> <p>资产配置策略：本基金主要投资于国内依法发行上市的 A 股股票、债券（含中小企业私募债）、资产支持证券、货币市场工具、权证、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。</p> <p>股票投资策略：本基金股票投资以定性和定量分析为基础进行股票投资。</p> <p>债券投资策略：根据国内外宏观经济形势、财政、货币政策、市场资金与债券供求状况、央行公开市场操作等方面情况，采用定性与定量相结合的方式，在确保流动性充裕和业绩考核期内可实现绝对收益的约束下设定债券投资的组合久期，并根据通胀预期确定浮息债与固定收益债比例。</p>

	<p>权证投资策略：本基金对权证资产的投资主要是通过通过分析影响权证内在价值最重要的两种因素——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>股指期货投资策略：本基金采取套期保值的方式参与股指期货的投资交易，以管理市场风险和调节股票仓位为主要目的。</p> <p>中小企业私募债券投资策略：中小企业私募债具有票面利率较高、信用风险较大、二级市场流动性较差等特点。因此本基金审慎投资中小企业私募债券。</p> <p>存托凭证投资策略：在控制风险的前提下，本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。</p>	
业绩比较基准	1 年期存款利率+3%(单利年化)	
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	招商丰利灵活配置混合基金 A	招商丰利灵活配置混合基金 C
下属分级基金的交易代码	000679	002416
报告期末下属分级基金的份额总额	31,301,374.79 份	4,710,928.02 份

注：本基金从 2016 年 2 月 29 日起新增 C 类份额，C 类份额自 2016 年 3 月 18 日起存续。

### § 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（2023 年 7 月 1 日—2023 年 9 月 30 日）	
	招商丰利灵活配置混合基金 A	招商丰利灵活配置混合基金 C
1. 本期已实现收益	-525,456.49	-123,312.54
2. 本期利润	-538,812.79	27,092.26
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0187	0.0045
4. 期末基金资产净值	45,184,575.93	6,585,709.68
5. 期末基金份额净值	1.444	1.398

注：1、上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)扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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、本基金从 2016 年 2 月 29 日起新增 C 类份额，C 类份额自 2016 年 3 月 18 日起存续。

### 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

招商丰利灵活配置混合基金 A

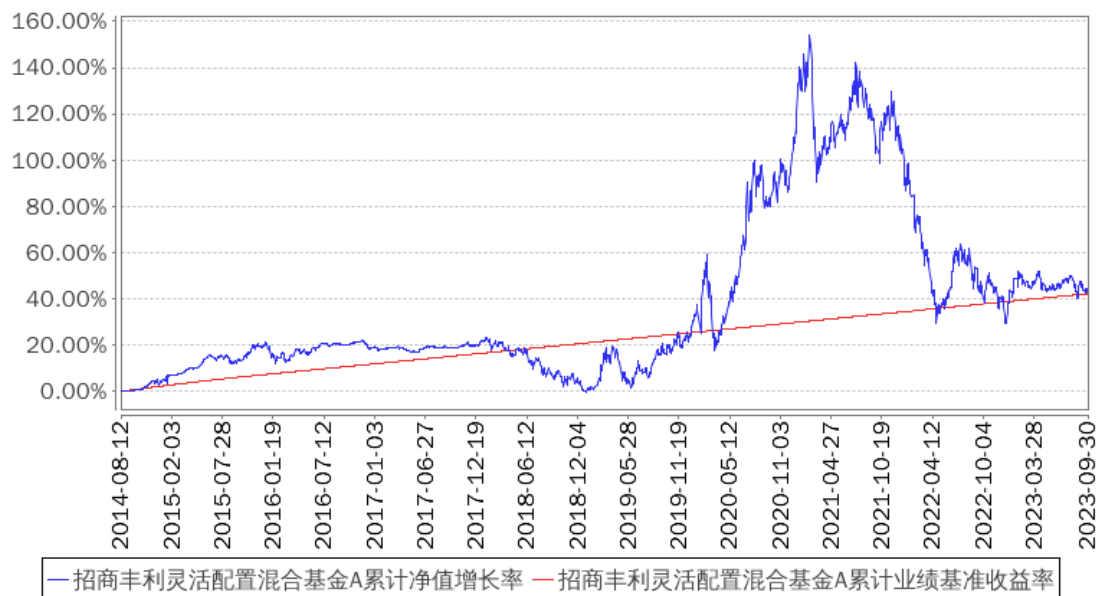
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.23%	0.75%	1.13%	0.01%	-2.36%	0.74%
过去六个月	-1.90%	0.70%	2.26%	0.01%	-4.16%	0.69%
过去一年	1.33%	0.94%	4.50%	0.01%	-3.17%	0.93%
过去三年	-21.31%	1.46%	13.50%	0.01%	-34.81%	1.45%
过去五年	32.60%	1.51%	22.50%	0.01%	10.10%	1.50%
自基金合同生效起至今	44.40%	1.15%	42.29%	0.01%	2.11%	1.14%

招商丰利灵活配置混合基金 C

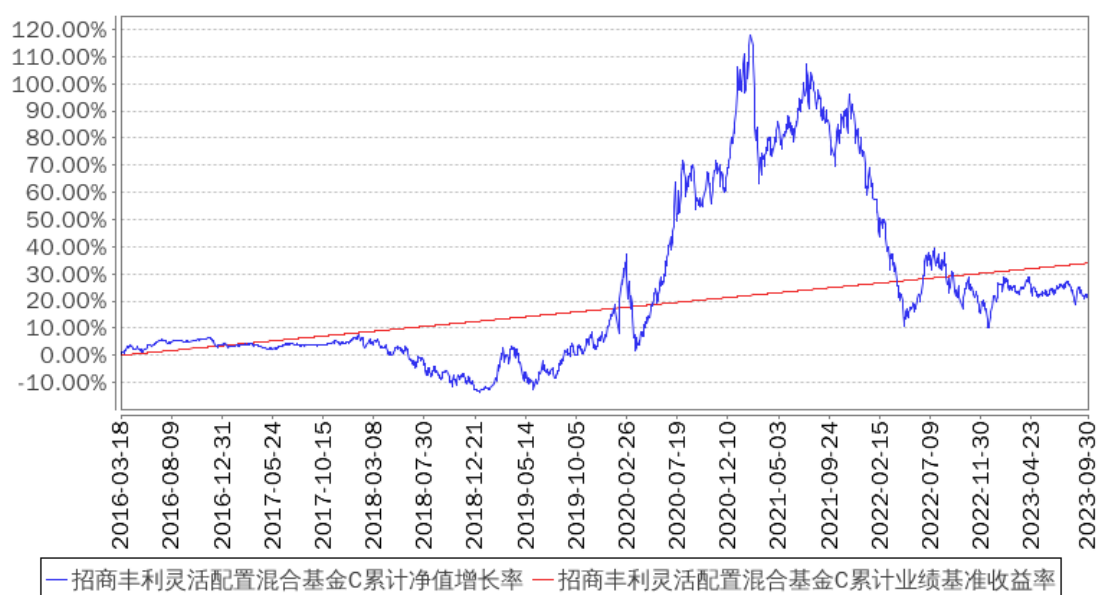
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.34%	0.74%	1.13%	0.01%	-2.47%	0.73%
过去六个月	-2.10%	0.69%	2.26%	0.01%	-4.36%	0.68%
过去一年	0.94%	0.94%	4.50%	0.01%	-3.56%	0.93%
过去三年	-22.42%	1.46%	13.50%	0.01%	-35.92%	1.45%
过去五年	29.44%	1.51%	22.50%	0.01%	6.94%	1.50%
自基金合同生效起至今	22.31%	1.26%	33.92%	0.01%	-11.61%	1.25%

#### 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

招商丰利灵活配置混合基金A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



招商丰利灵活配置混合基金C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：本基金从 2016 年 2 月 29 日起新增 C 类份额，C 类份额自 2016 年 3 月 18 日起存续。

## § 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		

况冲	本基金基金经理	2023 年 2 月 16 日	-	8	男，硕士。2012 年 8 月至 2014 年 2 月在陆家嘴金融发展有限公司工作，任战略发展部投资经理；2014 年 2 月至 2015 年 4 月在华宝信托有限公司工作，任产品部产品经理；2015 年 5 月至 2017 年 7 月在兴业国际信托有限公司工作，任证券信托总部团队负责人；2017 年 8 月至 2021 年 5 月在云南国际信托有限公司工作，任资本市场部业务副总监，从事可转债投资工作；2021 年 6 月至 2022 年 10 月在上海久期投资有限公司工作，任股票转债研究副总监。2022 年 11 月加入招商基金管理有限公司，现任招商丰利灵活配置混合型证券投资基金、招商安瑞进取债券型证券投资基金基金经理。
贾仁栋	本基金基金经理（已离任）	2019 年 6 月 21 日	2023 年 8 月 8 日	16	男，理学硕士。2006 年 10 月加入万家基金管理有限公司研究部，任研究员；2007 年 11 月加入光大保德信基金管理有限公司投资研究部，任研究员；2010 年 1 月加入国金证券股份有限公司研究所，任行业研究员；2010 年 12 月至 2012 年 12 月于平安养老保险股份有限公司年金投资部工作，任投资经理；2014 年 1 月加入万家共赢资产管理有限公司证券投资部，曾任投资经理；2015 年 7 月加入招商基金管理有限公司，曾任投资经理、招商增荣灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、招商睿祥定期开放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，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作出决定的公告（生效）日期；

2、证券从业年限计算标准遵从中国证监会《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》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本基金的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。基金管理人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。基金管理人拥有健全的投资授权制度，明确投资决策委员会、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。基金管理人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

基金管理人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，基金管理人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，公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 7 次，其中 4 次为旗下指数及量化组合因投资策略需要而发生反向交易，3 次为不同基金经理管理的基金因投资策略不同而发生的反向交易。报告期内未发现有可能会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

宏观经济回顾：

2023 年三季度，国内经济存在一定触底回升的趋势，但地产产业链表现依然相对疲弱。投资方面，最新的 8 月固定资产投资完成额累计同比增长 3.2%，其中 8 月房地产开发投资累计同比下降 8.8%，单月投资同比下降 19.1%，在地产销售持续较弱、民营房企信用环境仍不佳的状态下，房企整体拿地和新开工意愿仍相对低迷；8 月基建投资累计同比增长 9.0%，政府使用基建支持经济的能力和意愿依旧较强，基建投资具有一定韧性；8 月制造业投资累计同比增长 5.9%，较 7 月的 5.7% 有所回升，考虑到目前库存周期处于低位，加之 8 月工业企业利润当月同比回正，制造业投资表现相对较强。消费方面，8 月社会消费品零售总额当月同比增速为 4.6%，以 2021 年为基准考虑两年平均后的社零当月同比增速为 5.0%，较二季度的低位有所回升，反映疫情后消费的内在修复动能逐渐显现。对外贸易方面，8

月出口金额当月同比下降 8.8%，下行幅度有所收窄，可能与美国经济表现强劲、制造业周期出现企稳迹象有关。生产方面，9 月 PMI 指数为 50.2%，PMI 指数连续 4 个月回升，并于 9 月回到荣枯线以上，9 月的生产指数和新订单指数分别为 52.7%和 50.5%，反映经济有一定边际复苏动能，预计 2023 年四季度国内经济将处于筑底叠加弱修复的状态中，重点关注后续地产和化债等政策对经济增速的边际影响。

#### 转债市场回顾：

回顾 2023 年三季度的转债市场，整体显得比较疲软，出现了缩量下跌的局面。8 月以来，权益市场多重承压：外资持续卖出的压力下，经济仍处于弱修复状态，叠加政策不及预期，出现大幅下跌，转债跌幅小于权益，体现了一定的防御性。之后随着印花税、减持与再融资限制等一系列政策的出台，市场逐渐企稳，进入底部震荡。进入 9 月后，由于理财赎回债基，以及部分发行人强赎意愿提升，转债的溢价率有一定的压缩，部分交易日跌幅超过正股。纵观整个三季度，转债的跌幅依然小于正股，溢价率已经拉升到 50%左右，属于极高的位置，但是从中位数价格来看在 117.5 左右，已经接近今年年初水平。此时单纯看溢价率只能得到股票相比转债更具有配置价值，如果结合价格中位数和市场成交活跃度，转债也进入底部盘整期，也值得关注。展望四季度，一方面有持续的政策呵护，另一方面整体经济可能触底回升，转债市场有望跟随权益市场有一定的不错表现。

#### 股票市场回顾：

2023 年三季度，经济各项数据略有好转，可能已经度过了压力最大的阶段。9 月 PMI 站上荣枯线，近几个月一系列的稳增长政策对经济和企业信心有所提振。但是美国的通胀和增长预期上修，未来的降息预期继续弱化，美债收益率显著上升，对全球的资产价格造成扰动。全球地缘冲突仍然较多，俄乌冲突目前还没有明显好转，中东也爆发了较为激烈的冲突。影响了全球的风险偏好。

A 股 8 月以来转弱，明显下台阶。除了高分红和防御类公司有趋势性之外，其余行业表现较为普通。市场信心比较脆弱，即便是基本面向好的公司股价也没有好的体现。先进制造业的估值大多下行，许多是源于供给过剩，竞争更为激烈，而需求不足的预期导致的。消费整体相对疲软。市场整体估值继续下探，许多龙头公司估值低于去年 4 月低点。

#### 基金操作回顾：

回顾 2023 年三季度，我们严格遵照基金合同的相关约定，按照既定的投资流程进行了规范运作。本季度权益市场出现了大幅下跌，由于产品持有一定比例的可转债，因此本季度回撤幅度低于偏股类灵活配置基金。根据上季度的部署，本季度，本基金继续减持了部分可转债，增加股票配置。在转债投资方面看好上一季度左侧布局的芯片、精密制造、人工智能、创新药等未来有望转变为新的经济增长引擎的行业，继续看好受益于经济缓慢修复的顺周期行业，另外调整了转债的结构，重点关注了一些 8 月份上市的新债。在股票投资方面，在震荡过程中积极寻找个股机会，对组合适度分散、动态调整、优化配置结构，



持续关注估值和成长性匹配度较好的优质公司。此时正是从中长期视角发掘并配置一些竞争优势明确、未来空间较大的投资机会的好时机。如果把视野稍微放长一些，不难看到：制造业升级、老龄化社会、人工智能等都是比较确定的发展趋势。

展望四季度，我们依旧保持谨慎乐观，从第三季度的星星点点的高频数据以及我们自己的体感可以看到，经济正在触底慢慢回升，回到正常的轨道。太短期的情况不好判断，如果我们稍微把目光往远处看一看，则会看到更多的曙光就在前方，现在正是可以积极布局的时候。

#### 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-1.23%，同期业绩基准增长率为 1.13%，C 类份额净值增长率为-1.34%，同期业绩基准增长率为 1.13%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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	34,201,867.11	64.96
	其中：股票	34,201,867.11	64.96
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	16,473,702.02	31.29
	其中：债券	16,473,702.02	31.29
	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	-	-
	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	1,176,505.54	2.23
8	其他资产	795,228.85	1.51
9	合计	52,647,303.52	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

金额单位：人民币元

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	-	-
C	制造业	27,015,348.26	52.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	521,520.00	1.01
F	批发和零售业	91,884.00	0.18
G	交通运输、仓储和邮政业	2,927,068.00	5.65
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,187,121.00	4.22
J	金融业	1,520.00	0.00
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	10,597.00	0.02
M	科学研究和技术服务业	1,352,828.85	2.61
N	水利、环境和公共设施管理业	93,980.00	0.18
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	34,201,867.11	66.06

## 5.2.2 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持有港股通投资股票。

## 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

金额单位：人民币元

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	300858	科拓生物	116,870	2,198,324.70	4.25
2	688269	凯立新材	35,893	1,807,212.55	3.49
3	603613	国联股份	43,600	1,448,828.00	2.80
4	603666	亿嘉和	41,400	1,396,008.00	2.70
5	603885	吉祥航空	91,200	1,304,160.00	2.52
6	300138	晨光生物	85,900	1,288,500.00	2.49
7	601111	中国国航	154,700	1,249,976.00	2.41
8	002959	小熊电器	21,300	1,239,447.00	2.39
9	688123	聚辰股份	19,997	1,102,834.55	2.13

10	301029	怡合达	30,300	1,081,104.00	2.09
----	--------	-----	--------	--------------	------

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

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	2,838,535.67	5.48
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（可交换债）	13,635,166.35	26.34
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	16,473,702.02	31.82

#### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

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	019694	23 国债 01	28,000	2,838,535.67	5.48
2	111010	立昂转债	21,900	2,550,935.40	4.93
3	127045	牧原转债	9,939	1,168,037.82	2.26
4	118012	微芯转债	9,290	1,165,483.69	2.25
5	123169	正海转债	9,340	1,132,911.80	2.19

#### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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名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

本基金采取套期保值的方式参与股指期货的投资交易，以管理市场风险和调节股票仓位为主要目的。

## 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

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

### 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除国联股份（证券代码 603613）、亿嘉和（证券代码 603666）、中国国航（证券代码 601111）外其他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。

#### 1、国联股份（证券代码 603613）

根据 2023 年 8 月 8 日发布的相关公告，该证券发行人因财务会计报告违规，业绩预测结果不准确或不及时被上海证券交易所公开谴责。

#### 2、亿嘉和（证券代码 603666）

根据 2023 年 5 月 9 日发布的相关公告，该证券发行人因未依法履行职责被江苏省住房和城乡建设厅责令改正。

#### 3、中国国航（证券代码 601111）

根据发布的相关公告，该证券发行人在报告期内因未依法履行职责，多次受到监管机构的处罚。

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。

### 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

金额单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	13,230.77
2	应收清算款	780,348.64
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,649.44
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	795,228.85

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	111010	立昂转债	2,550,935.40	4.93
2	127045	牧原转债	1,168,037.82	2.26
3	118012	微芯转债	1,165,483.69	2.25
4	123169	正海转债	1,132,911.80	2.19
5	128137	洁美转债	1,064,400.84	2.06
6	118009	华锐转债	1,059,659.88	2.05
7	128121	宏川转债	1,011,160.24	1.95
8	113063	赛轮转债	982,954.10	1.90
9	123178	花园转债	876,019.80	1.69
10	123182	广联转债	751,980.19	1.45
11	128017	金禾转债	548,739.72	1.06
12	118027	宏图转债	234,246.40	0.45
13	127076	中宠转 2	159,046.11	0.31
14	118030	睿创转债	48,858.28	0.09
15	110060	天路转债	41,448.37	0.08
16	113648	巨星转债	13,180.91	0.03
17	113655	欧 22 转债	13,179.37	0.03
18	127005	长证转债	5,452.99	0.01
19	127074	麦米转 2	5,182.48	0.01
20	123159	崧盛转债	578.17	0.00

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末投资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	招商丰利灵活配置混合基金 A	招商丰利灵活配置混合基金 C
报告期期初基金份额总额	27,800,648.24	8,312,958.63
报告期期间基金总申购份额	4,407,944.26	36,688.03
减：报告期期间基金总赎回份额	907,217.71	3,638,718.64
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	31,301,374.79	4,710,928.02

## § 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

本报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的交易明细。

## § 8 备查文件目录

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

### 8.2 存放地点

招商基金管理有限公司

地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

### 8.3 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.cmfcchina.com>

招商基金管理有限公司

2023 年 10 月 24 日