

招商招元纯债债券型证券投资基金 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:兴业银行股份有限公司 报告送出日期:2017年4月21日

5.1 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。

5.2 基金概况 招商招元纯债 002992 002992 招商基金管理有限公司 兴业银行股份有限公司

5.3 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

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2017年1月1日-2017年3月31日)

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31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

Table with 7 columns: 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

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

Table with 2 columns: 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

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

Table with 5 columns: 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(%)

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

Table with 5 columns: 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(%)

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

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

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11 投资组合报告附注

5.12 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。

5.13 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.14 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.15 报告期末持有的资产支持证券明细

5.16 报告期末持有的其他权证

5.17 报告期末持有的买入国债期货合约

5.18 报告期末持有的买入股指期货合约

5.19 报告期末持有的其他衍生品

5.20 报告期末持有的其他衍生品

5.21 报告期末持有的其他衍生品

5.22 报告期末持有的其他衍生品

5.23 报告期末持有的其他衍生品

5.24 报告期末持有的其他衍生品

5.25 报告期末持有的其他衍生品

5.26 报告期末持有的其他衍生品

5.27 报告期末持有的其他衍生品

5.28 报告期末持有的其他衍生品

5.29 报告期末持有的其他衍生品

5.30 报告期末持有的其他衍生品

5.31 报告期末持有的其他衍生品

5.32 报告期末持有的其他衍生品

5.33 报告期末持有的其他衍生品

5.34 报告期末持有的其他衍生品

5.35 报告期末持有的其他衍生品

5.36 报告期末持有的其他衍生品

5.37 报告期末持有的其他衍生品

5.38 报告期末持有的其他衍生品

5.39 报告期末持有的其他衍生品

5.40 报告期末持有的其他衍生品

5.41 报告期末持有的其他衍生品

5.42 报告期末持有的其他衍生品

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。

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。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析 宏观经济企稳复苏,房地产市场企稳,基建投资的环比改善,2月固定资产投资增速8.9%,其中房地产领域销售继续回落,但补库存效应下,房地产投资同比反弹到8.9%。

4.5 报告期内基金的投资表现 报告期内,本基金A类份额净值增长率为-0.27%,C类份额净值增长率为-0.38%,同期业绩比较基准增长率为-0.33%。

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。

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

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

5.2.2 报告期末按行业分类的香港股票投资组合

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

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

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

Table with 5 columns: 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(%)

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

Table with 5 columns: 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(%)

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

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

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11 投资组合报告附注

5.12 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。

5.13 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.14 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.15 报告期末持有的资产支持证券明细

5.16 报告期末持有的其他权证

5.17 报告期末持有的买入国债期货合约

5.18 报告期末持有的买入股指期货合约

5.19 报告期末持有的其他衍生品

5.20 报告期末持有的其他衍生品

5.21 报告期末持有的其他衍生品

5.22 报告期末持有的其他衍生品

5.23 报告期末持有的其他衍生品

5.24 报告期末持有的其他衍生品

5.25 报告期末持有的其他衍生品

5.26 报告期末持有的其他衍生品

5.27 报告期末持有的其他衍生品

5.28 报告期末持有的其他衍生品

5.29 报告期末持有的其他衍生品

5.30 报告期末持有的其他衍生品

5.31 报告期末持有的其他衍生品

5.32 报告期末持有的其他衍生品

5.33 报告期末持有的其他衍生品

5.34 报告期末持有的其他衍生品

5.35 报告期末持有的其他衍生品

5.36 报告期末持有的其他衍生品

5.37 报告期末持有的其他衍生品

5.38 报告期末持有的其他衍生品

5.39 报告期末持有的其他衍生品

5.40 报告期末持有的其他衍生品

5.41 报告期末持有的其他衍生品

5.42 报告期末持有的其他衍生品

5.43 报告期末持有的其他衍生品

5.44 报告期末持有的其他衍生品

5.45 报告期末持有的其他衍生品

招商招顺纯债债券型证券投资基金 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:交通银行股份有限公司 报告送出日期:2017年4月21日

5.1 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。

5.2 基金概况 招商招顺纯债 003809 003809 招商基金管理有限公司 交通银行股份有限公司

5.3 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

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2017年1月1日-2017年3月31日)

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12月7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

Table with 7 columns: 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

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

Table with 2 columns: 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

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

Table with 5 columns: 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(%)

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

Table with 5 columns: 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(%)

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

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

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11 投资组合报告附注

5.12 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。

5.13 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.14 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.15 报告期末持有的资产支持证券明细

5.16 报告期末持有的其他权证

5.17 报告期末持有的买入国债期货合约

5.18 报告期末持有的买入股指期货合约

5.19 报告期末持有的其他衍生品

5.20 报告期末持有的其他衍生品

5.21 报告期末持有的其他衍生品

5.22 报告期末持有的其他衍生品

5.23 报告期末持有的其他衍生品

5.24 报告期末持有的其他衍生品

5.25 报告期末持有的其他衍生品

5.26 报告期末持有的其他衍生品

5.27 报告期末持有的其他衍生品

5.28 报告期末持有的其他衍生品

5.29 报告期末持有的其他衍生品

5.30 报告期末持有的其他衍生品

5.31 报告期末持有的其他衍生品

5.32 报告期末持有的其他衍生品

5.33 报告期末持有的其他衍生品

5.34 报告期末持有的其他衍生品

5.35 报告期末持有的其他衍生品

5.36 报告期末持有的其他衍生品

5.37 报告期末持有的其他衍生品

5.38 报告期末持有的其他衍生品

5.39 报告期末持有的其他衍生品

5.40 报告期末持有的其他衍生品

5.41 报告期末持有的其他衍生品

5.42 报告期末持有的其他衍生品

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。

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

Table with 5 columns: 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(%)

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

Table with 5 columns: 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(%)

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

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

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11 投资组合报告附注

5.12 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。

5.13 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.14 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.15 报告期末持有的资产支持证券明细

5.16 报告期末持有的其他权证

5.17 报告期末持有的买入国债期货合约

5.18 报告期末持有的买入股指期货合约

5.19 报告期末持有的其他衍生品

5.20 报告期末持有的其他衍生品

5.21 报告期末持有的其他衍生品

5.22 报告期末持有的其他衍生品

5.23 报告期末持有的其他衍生品

5.24 报告期末持有的其他衍生品

5.25 报告期末持有的其他衍生品

5.26 报告期末持有的其他衍生品

5.27 报告期末持有的其他衍生品

5.28 报告期末持有的其他衍生品

5.29 报告期末持有的其他衍生品

5.30 报告期末持有的其他衍生品

5.31 报告期末持有的其他衍生品

5.32 报告期末持有的其他衍生品

5.33 报告期末持有的其他衍生品

5.34 报告期末持有的其他衍生品

5.35 报告期末持有的其他衍生品

5.36 报告期末持有的其他衍生品

5.37 报告期末持有的其他衍生品

5.38 报告期末持有的其他衍生品

5.39 报告期末持有的其他衍生品

5.40 报告期末持有的其他衍生品

5.41 报告期末持有的其他衍生品

5.42 报告期末持有的其他衍生品

5.43 报告期末持有的其他衍生品

5.44 报告期末持有的其他衍生品

5.45 报告期末持有的其他衍生品

5.46 报告期末持有的其他衍生品

5.47 报告期末持有的其他衍生品

5.48 报告期末持有的其他衍生品

5.49 报告期末持有的其他衍生品

5.50 报告期末持有的其他衍生品