

招商可转债分级债券型证券投资基金

[2015]第四季度报告

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：2016年1月22日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事、监事、高级管理人员及基金经理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、完整性承担个别连带法律责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据法律法规的要求，于2016年1月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配政策等信息，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当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。

本报告吉日期：2015年10月1日起至12月31日止。

§ 2 基本产品概况

基金简称 招商可转债分级债券

基金主代码 161719

交易代码 161719

基金运作方式 灵活配置型开放式

基金合同生效日 2011-01-11

报告期末基金份额总额 684,231,010.70份

在保持资产流动性的基础上，通过积极主动的运营管理，合理配臵债券等固定收益类

金融工具和类属产品，充分利用利率债券等具有较高流动性的品种，进

行组合管理，择机提升了利差收益段，提升提升收益组合的信用等级。

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当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。

本报告吉日期：2015年10月1日起至12月31日止。

§ 3 基本产品概况

基金简称 招商可转债分级债券

基金主代码 161719

交易代码 161719

基金运作方式 灵活配置型开放式

基金合同生效日 2011-01-11

报告期末基金份额总额 684,231,010.70份

在保持资产流动性的基础上，通过积极主动的运营管理，合理配臵债券等固定收益类

金融工具和类属产品，充分利用利率债券等具有较高流动性的品种，进

行组合管理，择机提升了利差收益段，提升提升收益组合的信用等级。

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当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。

本报告吉日期：2015年10月1日起至12月31日止。

§ 4 投资策略

基金名称 招商可转债分级债券

基金主代码 161719

交易代码 161719

基金运作方式 灵活配置型开放式

基金合同生效日 2011-01-11

报告期末基金份额总额 684,231,010.70份

在保持资产流动性的基础上，通过积极主动的运营管理，合理配臵债券等固定收益类

金融工具和类属产品，充分利用利率债券等具有较高流动性的品种，进

行组合管理，择机提升了利差收益段，提升提升收益组合的信用等级。

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当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。

本报告吉日期：2015年10月1日起至12月31日止。

§ 5 投资组合报告

基金名称 招商可转债分级债券

基金主代码 161719

交易代码 161719

基金运作方式 灵活配置型开放式

基金合同生效日 2011-01-11

报告期末基金份额总额 684,231,010.70份

在保持资产流动性的基础上，通过积极主动的运营管理，合理配臵债券等固定收益类

金融工具和类属产品，充分利用利率债券等具有较高流动性的品种，进

行组合管理，择机提升了利差收益段，提升提升收益组合的信用等级。

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当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。

本报告吉日期：2015年10月1日起至12月31日止。

§ 6 开放式基金净值变动

基金名称 招商可转债分级债券

基金主代码 161719

交易代码 161719

基金运作方式 灵活配置型开放式

基金合同生效日 2011-01-11

报告期末基金份额总额 684,231,010.70份

在保持资产流动性的基础上，通过积极主动的运营管理，合理配臵债券等固定收益类

金融工具和类属产品，充分利用利率债券等具有较高流动性的品种，进

行组合管理，择机提升了利差收益段，提升提升收益组合的信用等级。

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当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。

本报告吉日期：2015年10月1日起至12月31日止。

§ 7 主要财务指标

基金名称 招商可转债分级债券

基金主代码 161719

交易代码 161719

基金运作方式 灵活配置型开放式

基金合同生效日 2011-01-11

报告期末基金份额总额 684,231,010.70份

在保持资产流动性的基础上，通过积极主动的运营管理，合理配臵债券等固定收益类

金融工具和类属产品，充分利用利率债券等具有较高流动性的品种，进

行组合管理，择机提升了利差收益段，提升提升收益组合的信用等级。

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当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。

本报告吉日期：2015年10月1日起至12月31日止。

§ 8 备查文件目录

基金名称 招商可转债分级债券

基金主代码 161719

交易代码 161719

基金运作方式 灵活配置型开放式

基金合同生效日 2011-01-11

报告期末基金份额总额 684,231,010.70份

在保持资产流动性的基础上，通过积极主动的运营管理，合理配臵债券等固定收益类

金融工具和类属产品，充分利用利率债券等具有较高流动性的品种，进

行组合管理，择机提升了利差收益段，提升提升收益组合的信用等级。

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当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。

本报告吉日期：2015年10月1日起至12月31日止。

§ 9 备查文件

基金名称 招商可转债分级债券

基金主代码 161719

交易代码 161719

基金运作方式 灵活配置型开放式

基金合同生效日 2011-01-11

报告期末基金份额总额 684,231,010.70份

在保持资产流动性的基础上，通过积极主动的运营管理，合理配臵债券等固定收益类

金融工具和类属产品，充分利用利率债券等具有较高流动性的品种，进

行组合管理，择机提升了利差收益段，提升提升收益组合的信用等级。

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当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。

本报告吉日期：2015年10月1日起至12月31日止。

§ 10 备查文件

基金名称 招商可转债分级债券

基金主代码 161719

交易代码 161719

基金运作方式 灵活配置型开放式

基金合同生效日 2011-01-11

报告期末基金份额总额 684,231,010.70份

在保持资产流动性的基础上，通过积极主动的运营管理，合理配臵债券等固定收益类

金融工具和类属产品，充分利用利率债券等具有较高流动性的品种，进

行组合管理，择机提升了利差收益段，提升提升收益组合的信用等级。

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当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。

本报告吉日期：2015年10月1日起至12月31日止。

§ 11 备查文件

基金名称 招商可转债分级债券

基金主代码 161719

交易代码 161719

基金运作方式 灵活配置型开放式

基金合同生效日 2011-01-11

报告期末基金份额总额 684,231,010.70份

在保持资产流动性的基础上，通过积极主动的运营管理，合理配臵债券等固定收益类

金融工具和类属产品，充分利用利率债券等具有较高流动性的品种，进

行组合管理，择机提升了利差收益段，提升提升收益组合的信用等级。

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当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。

本报告吉日期：2015年10月1日起至12月31日止。

§ 12 备查文件

基金名称 招商可转债分级债券

基金主代码 161719

交易代码 161719

基金运作方式 灵活配置型开放式

基金合同生效日 2011-01-11

报告期末基金份额总额 684,231,010.70份

在保持资产流动性的基础上，通过积极主动的运营管理，合理配臵债券等固定收益类

金融工具和类属产品，充分利用利率债券等具有较高流动性的品种，进

行组合管理，择机提升了利差收益段，提升提升收益组合的信用等级。

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当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。

本报告吉日期：2015年10月1日起至12月31日止。

§ 13 备查文件

基金名称 招商可转债分级债券

基金主代码 161719

交易代码 161