

招商双债增强债券型证券投资基金(LOF)

[2016]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:中国农业银行股份有限公司

报告送出日期:2017年1月20日

§ 1 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年1月19日核对了本报告中的数据指标、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当仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告为财务资料未经审计。

本报告期自2016年10月1日起至2016年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金名称	招商双债增强(LOF)
基金代码	161716
交易方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年3月1日
报告期末基金总资产	101,546,575.22元

本基金在追求基金额定资产实现的基础上，力求获得高于业绩比较基准的回报收益。

本基金前10名持有人户数为1,571户，占基金总户数的比例为2.31%，基金总份额净值低于五万元情形的，基金管理人应当定期报告予以披露。

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
1	权益投资
2	固定收益
3	货币市场工具
4	银行存款
5	应收保证金
6	买入返售金融资产
7	其他资产
8	其他负债
9	合计

本基金在追求基金额定资产实现的基础上，力求获得高于业绩比较基准的回报收益。

本基金前10名持有人户数为1,571户，占基金总户数的比例为2.31%，基金总份额净值低于五万元情形的，基金管理人应当定期报告予以披露。

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不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

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. 本期本期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. 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。

4. 报告期内，本基金未发生持有期未满一年的股东股息。

5. 报告期内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

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债券投资明细

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十名权证投资明细

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十名资产支持证券投资明细

9. 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黄金等贵金属投资明细

10. 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组合情况

11. 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债券投资组合情况

12. 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权证投资组合情况

13. 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组合情况

14. 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黄金等贵金属投资组合情况

15. 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

16. 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债券投资明细

17. 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权证投资明细

18. 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

19. 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黄金等贵金属投资明细

20. 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组合情况

21. 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债券投资组合情况

22. 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权证投资组合情况

23. 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组合情况

24. 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黄金等贵金属投资组合情况

25. 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

26. 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债券投资明细

27. 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

28. 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

29. 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资产支持证券投资明细

30. 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黄金等贵金属投资明细

31. 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组合情况

32. 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债券投资组合情况

33. 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权证投资组合情况

34. 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组合情况

35. 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黄金等贵金属投资组合情况

36. 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

37. 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债券投资明细

38. 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权证投资明细

39. 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

40. 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黄金等贵金属投资明细

41. 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组合情况

42. 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债券投资组合情况

43. 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权证投资组合情况

44. 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组合情况

45. 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黄金等贵金属投资组合情况

46. 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

47. 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债券投资明细

48. 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权证投资明细

49. 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

50. 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黄金等贵金属投资明细

51. 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组合情况

52. 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债券投资组合情况

53. 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权证投资组合情况

54. 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组合情况

55. 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黄金等贵金属投资组合情况

56. 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

57. 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债券投资明细

58. 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权证投资明细

59. 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

60. 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黄金等贵金属投资明细

61. 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组合情况

62. 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债券投资组合情况

63. 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权证投资组合情况

64. 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组合情况

65. 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黄金等贵金属投资组合情况

66. 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

67. 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债券投资明细

68. 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权证投资明细

69. 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

70. 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黄金等贵金属投资明细

71. 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组合情况

72. 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债券投资组合情况

73. 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权证投资组合情况

74. 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组合情况

75. 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黄金等贵金属投资组合情况

76. 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

77. 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债券投资明细

78. 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权证投资明细

79. 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

80. 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黄金等贵金属投资明细

81. 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组合情况

82. 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债券投资组合情况

83. 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权证投资组合情况

84. 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组合情况

85. 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黄金等贵金属投资组合情况

86. 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

87. 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债券投资明细

88. 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权证投资明细

89. 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

90. 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黄金等贵金属投资明细

91. 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组合情况

92. 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债券投资组合情况

93. 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权证投资组合情况

94. 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组合情况

95. 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黄金等贵金属投资组合情况

96. 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

97. 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债券投资明细

98. 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权证投资明细

99. 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

100. 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黄金等贵金属投资明细

101. 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组合情况

102. 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债券投资组合情况

103. 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权证投资组合情况

104. 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组合情况

105. 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黄金等贵金属投资组合情况

106. 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

107. 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债券投资明细

108. 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权证投资明细