

## 招商信用增强债券型证券投资基金

[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:中国银行股份有限公司

报告送出日期:2017年1月20日

§ 1 重要提示

基金管理人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，并对内容的真实性、准确性和完整性承担责任。本基金由基金管理人及基金托管人共同编制，于2016年1月10日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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。

本报告告期财务资料未经审计。

本报告告期自2016年10月1日起至12月31日止。

## § 2 基金产品概况

基金名称	招商信用增强债券
基金代码	217023
交易账户	217023
申购赎回方式	预约后开放式
基金的运作方式	定期开放式
基金的上市交易日	2012年7月20日
报告期末基金份额总额	609,022,885.18份
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

## § 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(2016年10月1日 - 2016年12月31日)
1.本期已实现收益	10,207,079.23
2.本期利润	952,396.65
3.加权平均基金份额本期利润	0.0017
4.期末基金份额净值	609,531,313.14
5.期末份额净值	1.038

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.本期三季应收利息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,本期利润为已实现收益加上本期公允价值变动收益;

3.2 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

阶段	净值增长(%)	②	净值增长(%)	③	业绩基准收益率(%)	④-③	⑤-④
过去三个月	0.10%	0.11%	-1.40%	0.10%	1.67%	-0.04%	

3.2.2 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



## § 4 管理人报告

姓名	职务	任本基金的基金经理期限	证券从业年限	说明
邓舸	本基金的基金经理	2015年4月11日	-	7

注:1.本基金任本基金的任期内均为本基金合同生效日至任本基金的任期内以及历任基金经理的任期内

基金经理的任期内本公司相关会议作出的公告、生效日期、任职日期。

2.证券从业人员是指根据《证券从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员的有关规定

较

3.2.3 本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



## § 5 报告期末基金资产组合情况

5.1 报告期末基金资产组合情况

5.1.1 投资组合情况

5.1.2 固定收益投资

5.1.3 其他资产构成

5.1.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券情况

5.1.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.1.6 报告期末投资组合情况分析

5.1.7 报告期内股票投资组合分析

5.1.8 报告期内债券投资组合分析

5.1.9 报告期内贵金属投资组合分析

5.1.10 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

5.1.11 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

5.1.12 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贵金属投资组合

5.1.13 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资组合

5.1.14 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他投资组合

5.1.15 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的组合类金融工具

5.1.16 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产

5.1.17 报告期末持有的处于转股期的可转换债券情况

5.1.18 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.1.19 报告期内股票投资组合分析

5.1.20 报告期内债券投资组合分析

5.1.21 报告期内贵金属投资组合分析

5.1.22 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股票投资组合

5.1.23 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债券投资组合

5.1.24 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贵金属投资组合

5.1.25 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资组合

5.1.26 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他投资组合

5.1.27 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的组合类金融工具

5.1.28 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产

5.1.29 报告期末持有的处于转股期的可转换债券情况

5.1.30 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.1.31 报告期内股票投资组合分析

5.1.32 报告期内债券投资组合分析

5.1.33 报告期内贵金属投资组合分析

5.1.34 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股票投资组合

5.1.35 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债券投资组合

5.1.36 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贵金属投资组合

5.1.37 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资组合

5.1.38 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他投资组合

5.1.39 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的组合类金融工具

5.1.40 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产

5.1.41 报告期末持有的处于转股期的可转换债券情况

5.1.42 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.1.43 报告期内股票投资组合分析

5.1.44 报告期内债券投资组合分析

5.1.45 报告期内贵金属投资组合分析

5.1.46 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组合

5.1.47 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组合

5.1.48 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贵金属投资组合

5.1.49 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资组合

5.1.50 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他投资组合

5.1.51 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的组合类金融工具

5.1.52 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产

5.1.53 报告期末持有的处于转股期的可转换债券情况

5.1.54 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.1.55 报告期内股票投资组合分析

5.1.56 报告期内债券投资组合分析

5.1.57 报告期内贵金属投资组合分析

5.1.58 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股票投资组合

5.1.59 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债券投资组合

5.1.60 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贵金属投资组合

5.1.61 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资组合

5.1.62 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他投资组合

5.1.63 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的组合类金融工具

5.1.64 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产

5.1.65 报告期末持有的处于转股期的可转换债券情况

5.1.66 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.1.67 报告期内股票投资组合分析

5.1.68 报告期内债券投资组合分析

5.1.69 报告期内贵金属投资组合分析

5.1.70 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股票投资组合

5.1.71 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债券投资组合

5.1.72 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贵金属投资组合

5.1.73 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资组合

5.1.74 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他投资组合

5.1.75 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的组合类金融工具

5.1.76 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产

5.1.77 报告期末持有的处于转股期的可转换债券情况

5.1.78 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.1.79 报告期内股票投资组合分析

5.1.80 报告期内债券投资组合分析

5.1.81 报告期内贵金属投资组合分析

5.1.82 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股票投资组合

5.1.83 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债券投资组合

5.1.84 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贵金属投资组合

5.1.85 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资组合