

## 招商安瑞进取债券型证券投资基金

## [2017]第一季度报告

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4月21日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及其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4月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告的内容，复核表明该报告在所有重大方面均不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

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及其更新。

本报告中财务数据未经审计。

本基金报告期2017年1月1日起至3月31日止。

## § 2 基金产品概况

## 6.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

## 6.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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 制造业	11,766,567.00	7.42	-
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,589,616.00	1.00	-
E 建筑业	-	-	-
F 批发和零售业	-	-	-
G 交通运输、仓储和邮政业	1,876,321.00	1.18	-
H 住宿和餐饮业	-	-	-
I 信息传输、软件和信息技术服务业	-	-	-
J 金融业	-	-	-
K 房地产业	-	-	-
L 租赁和商务服务业	-	-	-
M 科学研究、技术服务与地质勘查业	-	-	-
N 水利、环境和公共设施管理业	1,565,120.00	0.99	-
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	16,797,614.00	10.69	-

## 6.2.2 报告期末按行业分类的债券投资组合

## 6.2.3 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

## 6.3 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2017年1月1日 - 2017年3月31日)
1本期已实现收益	-224,183.04
2本期利润	-2,531,026.75
3期初现金及现金等价物余额	-10,025.00
4期末现金及现金等价物余额	168,597,613.11
5期末可供分配利润	1,066

注：1.上述基金的现金头寸的计算期为本基金合同生效日，即任本基金的现金头寸的计算期为公司相关会议作出决议之日起至下月一日止。

2.本基金从年度计算时点起从协议执行日至报告期末的期间内不考虑新股申购的股利收入。

3.报告期内已实现收益指本期利息收入、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，本期利润为期本期实现收益加上本期已实现收益。

4.2.3 基金的现金头寸

本基金的现金头寸是指本基金持有的货币资金、银行存款、存出保证金、买入返售金融资产、应收申购款以及其他可以随时用于支付的现金。

5.期末可供分配利润的金额以基金合同规定的收益分配原则为依据计算，不考虑垫付或预提的费用。

6.4.5 期末可供分配利润

本基金的可供分配利润指根据有关基金合同的规定，在扣除基金财产运营所发生的费用后，将剩余收益按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

7.4 管理人报告

基金管理人对以下项目进行了逐项说明，具体请参见本报告“二、基金产品概况”之“4.1 基金的基本情况”。

8.4.1 基金管理人的基本情况

基金管理人（以下简称“公司”）已建立较为完善的研究方法和投资决策流程，确保投资组合拥有公开的证券投资政策。公司设立独立的投资决策机构，制定科学的投资决策流程，投资决策由投资决策委员会负责，基金经理通过定期报告、季度报告、半年度报告和年度报告等形式向投资决策委员会汇报，基金经理定期向公司总经理汇报，总经理定期向公司董事长汇报，董事长定期向公司董事会汇报，公司设有独立董事，对基金投资运作进行监督。

8.4.2 基金管理人的投资管理

基金管理人对以下项目进行了逐项说明，具体请参见本报告“二、基金产品概况”之“4.2 基金管理人的投资管理”。

8.4.3 基金管理人的风险管理

基金管理人对以下项目进行了逐项说明，具体请参见本报告“二、基金产品概况”之“4.3 基金管理人的风险管理”。

8.4.4 基金管理人的内部控制

基金管理人对以下项目进行了逐项说明，具体请参见本报告“二、基金产品概况”之“4.4 基金管理人的内部控制”。

8.4.5 基金管理人的社会责任

基金管理人对以下项目进行了逐项说明，具体请参见本报告“二、基金产品概况”之“4.5 基金管理人的社会责任”。

8.4.6 基金管理人的公平交易制度

基金管理人对以下项目进行了逐项说明，具体请参见本报告“二、基金产品概况”之“4.6 基金管理人的公平交易制度”。

8.4.7 基金管理人的异常交易行为的专项说明

基金管理人对以下项目进行了逐项说明，具体请参见本报告“二、基金产品概况”之“4.7 基金管理人的异常交易行为的专项说明”。

8.4.8 基金管理人的信息披露

基金管理人对以下项目进行了逐项说明，具体请参见本报告“二、基金产品概况”之“4.8 基金管理人的信息披露”。

8.4.9 基金管理人的风险揭示

基金管理人对以下项目进行了逐项说明，具体请参见本报告“二、基金产品概况”之“4.9 基金管理人的风险揭示”。

8.4.10 基金管理人的其他情况

基金管理人对以下项目进行了逐项说明，具体请参见本报告“二、基金产品概况”之“4.10 基金管理人的其他情况”。

8.4.11 基金管理人对旗下基金的风险揭示

基金管理人对以下项目进行了逐项说明，具体请参见本报告“二、基金产品概况”之“4.11 基金管理人对旗下基金的风险揭示”。

8.4.12 基金管理人对旗下基金的声誉风险揭示

基金管理人对以下项目进行了逐项说明，具体请参见本报告“二、基金产品概况”之“4.12 基金管理人对旗下基金的声誉风险揭示”。

8.4.13 基金管理人对旗下基金的合规风险揭示

基金管理人对以下项目进行了逐项说明，具体请参见本报告“二、基金产品概况”之“4.13 基金管理人对旗下基金的合规风险揭示”。

8.4.14 基金管理人对旗下基金的法律风险揭示

基金管理人对以下项目进行了逐项说明，具体请参见本报告“二、基金产品概况”之“4.14 基金管理人对旗下基金的法律风险揭示”。

8.4.15 基金管理人对旗下基金的信用风险揭示

基金管理人对以下项目进行了逐项说明，具体请参见本报告“二、基金产品概况”之“4.15 基金管理人对旗下基金的信用风险揭示”。

8.4.16 基金管理人对旗下基金的流动性风险揭示

基金管理人对以下项目进行了逐项说明，具体请参见本报告“二、基金产品概况”之“4.16 基金管理人对旗下基金的流动性风险揭示”。

8.4.17 基金管理人对旗下基金的管理费计提方式

基金管理人对以下项目进行了逐项说明，具体请参见本报告“二、基金产品概况”之“4.17 基金管理人对旗下基金的管理费计提方式”。

8.4.18 基金管理人对旗下基金的托管费计提方式

基金管理人对以下项目进行了逐项说明，具体请参见本报告“二、基金产品概况”之“4.18 基金管理人对旗下基金的托管费计提方式”。

8.4.19 基金管理人对旗下基金的销售服务费计提方式

基金管理人对以下项目进行了逐项说明，具体请参见本报告“二、基金产品概况”之“4.19 基金管理人对旗下基金的销售服务费计提方式”。

8.4.20 基金管理人对旗下基金的其他费用

基金管理人对以下项目进行了逐项说明，具体请参见本报告“二、基金产品概况”之“4.20 基金管理人对旗下基金的其他费用”。

8.4.21 基金管理人对旗下基金的税收

基金管理人对以下项目进行了逐项说明，具体请参见本报告“二、基金产品概况”之“4.21 基金管理人对旗下基金的税收”。

8.4.22 基金管理人对旗下基金的费用

基金管理人对以下项目进行了逐项说明，具体请参见本报告“二、基金产品概况”之“4.22 基金管理人对旗下基金的费用”。

8.4.23 基金管理人对旗下基金的费用豁免

基金管理人对以下项目进行了逐项说明，具体请参见本报告“二、基金产品概况”之“4.23 基金管理人对旗下基金的费用豁免”。

8.4.24 基金管理人对旗下基金的估值

基金管理人对以下项目进行了逐项说明，具体请参见本报告“二、基金产品概况”之“4.24 基金管理人对旗下基金的估值”。

8.4.25 基金管理人对旗下基金的份额分级

基金管理人对以下项目进行了逐项说明，具体请参见本报告“二、基金产品概况”之“4.25 基金管理人对旗下基金的份额分级”。

8.4.26 基金管理人对旗下基金的收益分配

基金管理人对以下项目进行了逐项说明，具体请参见本报告“二、基金产品概况”之“4.26 基金管理人对旗下基金的收益分配”。

8.4.27 基金管理人对旗下基金的费用调整

基金管理人对以下项目进行了逐项说明，具体请参见本报告“二、基金产品概况”之“4.27 基金管理人对旗下基金的费用调整”。

8.4.28 基金管理人对旗下基金的重新定价

基金管理人对以下项目进行了逐项说明，具体请参见本报告“二、基金产品概况”之“4.28 基金管理人对旗下基金的重新定价”。

8.4.29 基金管理人对旗下基金的暂停赎回

基金管理人对以下项目进行了逐项说明，具体请参见本报告“二、基金产品概况”之“4.29 基金管理人对旗下基金的暂停赎回”。

8.4.30 基金管理人对旗下基金的巨额赎回

基金管理人对以下项目进行了逐项说明，具体请参见本报告“二、基金产品概况”之“4.30 基金管理人对旗下基金的巨额赎回”。

8.4.31 基金管理人对旗下基金的暂停申购

基金管理人对以下项目进行了逐项说明，具体请参见本报告“二、基金产品概况”之“4.31 基金管理人对旗下基金的暂停申购”。

8.4.32 基金管理人对旗下基金的恢复申购

基金管理人对以下项目进行了逐项说明，具体请参见本报告“二、基金产品概况”之“4.32 基金管理人对旗下基金的恢复申购”。

8.4.33 基金管理人对旗下基金的暂停转换

基金管理人对以下项目进行了逐项说明，具体请参见本报告“二、基金产品概况”之“4.33 基金管理人对旗下基金的暂停转换”。

8.4.34 基金管理人对旗下基金的恢复转换

基金管理人对以下项目进行了逐项说明，具体请参见本报告“二、基金产品概况”之“4.34 基金管理人对旗下基金的恢复转换”。

8.4.35 基金管理人对旗下基金的暂停赎回与转换

基金管理人对以下项目进行了逐项说明，具体请参见本报告“二、基金产品概况”之“4.35 基金管理人对旗下基金的暂停赎回与转换”。

8.4.36 基金管理人对旗下基金的恢复赎回与转换

基金管理人对以下项目进行了逐项说明，具体请参见本报告“二、基金产品概况”之“4.36 基金管理人对旗下基金的恢复赎回与转换”。

8.4.37 基金管理人对旗下基金的暂停申购与转换

基金管理人对以下项目进行了逐项说明，具体请参见本报告“二、基金产品概况”之“4.37 基金管理人对旗下基金的暂停申购与转换”。

8.4.38 基金管理人对旗下基金的恢复申购与转换

基金管理人对以下项目进行了逐项说明，具体请参见本报告“二、基金产品概况”之“4.38 基金管理人对旗下基金的恢复申购与转换”。

8.4.39 基金管理人对旗下基金的暂停申购