

招商招乾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

招商招坤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:中国银行股份有限公司

81 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...

基金业绩表现 报告期内,本基金A类份额净值增长率为0.17%,C类份额净值增长率为0.07%,同期业绩比较基准增长率为-0.33%...

Table with columns: 基金简称, 招商招乾纯债; 基金代码, 003269; 交易代码, 003269; 基金运作方式, 契约型开放式; 基金合同生效日, 2016年10月26日; 报告期末基金份额总额, 42,052,568.69份; 投资目标, 在控制投资风险的前提下,力争长期内实现超越业绩比较基准的投资回报...

Table with columns: 主要财务指标, 报告期(2017年1月1日至2017年3月31日); 1.本期已实现收益, 113,304.32; 2.本期利润, 86,170.45; 3.加权平均基金份额本期利润, 0.0020; 4.期末基金资产净值, 50,197,079.32; 5.期末基金份额净值, 1.1940

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...

Table with columns: 招商招乾纯债A, 招商招乾纯债C; 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; 过去三个月, 0.17%, 0.02%, -0.33%, 0.07%, 0.50%, -0.05%

Table with columns: 招商招乾纯债C; 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; 过去三个月, 0.07%, 0.02%, -0.33%, 0.07%, 0.40%, -0.05%

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

注:本基金合同于2016年10月26日生效,截至本报告期末基金成立未满一年;自基金合同成立日起6个月内为建仓期,截至报告期末基金尚未完成建仓。

84 管理人报告 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with columns: 姓名, 康晶; 职务, 基金经理; 任本基金基金经理期限, 2016年10月26日; 证券从业年限, 6; 说明, 男,理学硕士,2009年加入魏斯曼资本...

注:1.本基金基金经理的任职日期为本基金合同生效日,后任基金经理的任职日期以中国证监会核准的日期为准; 2.证券从业年限的计算标准参照行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业年限的相关规定。

4.2 管理人报告期内本基金遵守法律法规的情况说明

4.3 公平交易制度的执行情况 基金管理人(以下简称“公司”)已建立较完善的研究报告和投资决策流程,确保各投资组合享有公平的投资决策机会...

4.4 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...

4.5 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

4.6 基金管理人内部控制制度的执行情况

4.7 基金管理人报告期内本基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.8 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.9 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.10 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.11 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.12 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.13 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.14 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.15 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.16 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.17 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.18 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.19 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.20 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.21 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.22 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.23 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.24 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.25 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.26 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析 宏观经济分析: 2017年1季度经济平稳复苏,房地产、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,但库存存底下,房地产投资同比反弹到8.9%,新开工的增速也超过过去2年的低速...

4.5 报告期内基金的业绩表现 报告期内,本基金A类份额净值增长率为0.17%,C类份额净值增长率为0.07%,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人数或基金资产净值预警说明

4.7 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.8 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.9 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.10 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.11 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.12 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.13 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.14 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.15 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.16 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.17 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.18 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.19 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.20 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.21 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.22 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.23 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.24 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.25 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.26 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.27 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.28 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.29 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.30 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.31 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.32 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.33 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.34 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.35 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.36 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.37 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.38 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.39 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.40 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.41 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.42 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.43 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.44 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.45 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.46 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.47 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.48 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.49 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.50 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.51 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.52 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.53 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.54 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.55 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.56 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.57 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.58 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.59 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.60 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.61 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

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

81 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...

基金业绩表现 报告期内,本基金A类份额净值增长率为0.01%,C类份额净值增长率为-0.11%,同期业绩比较基准增长率为-0.33%...

Table with columns: 基金简称, 招商招坤纯债; 基金代码, 003265; 交易代码, 003265; 基金运作方式, 契约型开放式; 基金合同生效日, 2016年10月18日; 报告期末基金份额总额, 699,163,111.66份; 投资目标, 在控制投资风险的前提下,力争长期内实现超越业绩比较基准的投资回报...

Table with columns: 主要财务指标, 报告期(2017年1月1日至2017年3月31日); 1.本期已实现收益, -547,106.65; 2.本期利润, 366,809.32; 3.加权平均基金份额本期利润, 0.0005; 4.期末基金资产净值, 687,723,446.01; 5.期末基金份额净值, 0.9926

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...

Table with columns: 招商招坤纯债A, 招商招坤纯债C; 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; 过去三个月, 0.01%, 0.07%, -0.33%, 0.07%, 0.34%, 0.00%

Table with columns: 招商招坤纯债C; 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; 过去三个月, -0.11%, 0.07%, -0.33%, 0.07%, 0.22%, 0.00%

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

注:本基金合同于2016年10月18日生效,截至本报告期末基金成立未满一年;自基金合同成立日起6个月内为建仓期,截至报告期末基金尚未完成建仓。

84 管理人报告 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with columns: 姓名, 康晶; 职务, 基金经理; 任本基金基金经理期限, 2016年10月18日; 证券从业年限, 6; 说明, 男,理学硕士,2009年加入魏斯曼资本...

注:1.本基金基金经理的任职日期为本基金合同生效日,后任基金经理的任职日期以中国证监会核准的日期为准; 2.证券从业年限的计算标准参照行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业年限的相关规定。

4.2 管理人报告期内本基金遵守法律法规的情况说明

4.3 公平交易制度的执行情况 基金管理人(以下简称“公司”)已建立较完善的研究报告和投资决策流程,确保各投资组合享有公平的投资决策机会...

4.4 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...

4.5 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

4.6 基金管理人内部控制制度的执行情况

4.7 基金管理人报告期内本基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.8 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.9 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.10 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.11 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.12 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.13 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.14 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.15 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.16 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.17 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.18 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.19 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.20 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.21 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.22 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.23 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.24 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.25 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.26 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.27 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

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

81 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...

基金业绩表现 报告期内,本基金A类份额净值增长率为0.01%,C类份额净值增长率为-0.11%,同期业绩比较基准增长率为-0.33%...

Table with columns: 基金简称, 招商招坤纯债; 基金代码, 003265; 交易代码, 003265; 基金运作方式, 契约型开放式; 基金合同生效日, 2016年10月18日; 报告期末基金份额总额, 699,163,111.66份; 投资目标, 在控制投资风险的前提下,力争长期内实现超越业绩比较基准的投资回报...

Table with columns: 主要财务指标, 报告期(2017年1月1日至2017年3月31日); 1.本期已实现收益, -547,106.65; 2.本期利润, 366,809.32; 3.加权平均基金份额本期利润, 0.0005; 4.期末基金资产净值, 687,723,446.01; 5.期末基金份额净值, 0.9926

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...

Table with columns: 招商招坤纯债A, 招商招坤纯债C; 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; 过去三个月, 0.01%, 0.07%, -0.33%, 0.07%, 0.34%, 0.00%

Table with columns: 招商招坤纯债C; 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; 过去三个月, -0.11%, 0.07%, -0.33%, 0.07%, 0.22%, 0.00%

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

注:本基金合同于2016年10月18日生效,截至本报告期末基金成立未满一年;自基金合同成立日起6个月内为建仓期,截至报告期末基金尚未完成建仓。

84 管理人报告 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with columns: 姓名, 康晶; 职务, 基金经理; 任本基金基金经理期限, 2016年10月18日; 证券从业年限, 6; 说明, 男,理学硕士,2009年加入魏斯曼资本...

注:1.本基金基金经理的任职日期为本基金合同生效日,后任基金经理的任职日期以中国证监会核准的日期为准; 2.证券从业年限的计算标准参照行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业年限的相关规定。

4.2 管理人报告期内本基金遵守法律法规的情况说明

4.3 公平交易制度的执行情况 基金管理人(以下简称“公司”)已建立较完善的研究报告和投资决策流程,确保各投资组合享有公平的投资决策机会...

4.4 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...

4.5 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

4.6 基金管理人内部控制制度的执行情况

4.7 基金管理人报告期内本基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.8 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.9 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.10 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.11 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.12 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.13 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.14 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.15 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.16 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.17 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.18 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.19 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.20 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.21 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.22 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.23 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.24 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.25 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.26 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

4.27 报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况