

(上接 D288 版) 招商丰混合型 C 的日销售服务费=前一日招商丰混合 C 资产净值 x 0.20%/当年天数

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易 本基金本报告期及上年度可比期间无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况 7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况 7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

Table with columns: 关联方名称, 本期, 上期, 期末余额, 当期利息收入, 期末余额, 当期利息收入

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况 7.4.9 期末(2017年12月31日)本基金持有的流通受限证券 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

Table with columns: 资产, 第一层次, 第二层次, 第三层次, 合计

(四)公允价值所属层次的重大变动 对于本基金投资的证券,若出现重大事件停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金于非公开发行至交易恢复活跃日期间,交易不活跃期间及限售期间根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。

Table with columns: 序号, 项目, 金额, 占基金总资产的比例(%)

8.2 期末按行业分类的股票投资组合 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合 8.2.2 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期初基金资产净值比例(%)

8.3 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 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

Table with columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 8.7 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资产支持证券投资明细

Table with columns: 序号, 项目, 金额, 占基金总资产的比例(%)

8.8 投资组合报告 8.8.1 期末基金资产组合情况 8.8.2 期末按行业分类的股票投资组合 8.8.3 期末按行业分类的境内股票投资组合 8.8.4 期末按行业分类的港股投资股票投资组合

Table with columns: 序号, 项目, 金额, 占基金总资产的比例(%)

Table with columns: 代码, 行业类别, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

8.2.2 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合 8.3 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

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期初基金资产净值比例(%)

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 8.7 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资产支持证券投资明细

Table with columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

8.8 投资组合报告 8.8.1 期末基金资产组合情况 8.8.2 期末按行业分类的股票投资组合 8.8.3 期末按行业分类的境内股票投资组合 8.8.4 期末按行业分类的港股投资股票投资组合

Table with columns: 序号, 项目, 金额, 占基金总资产的比例(%)

8.9 期末按行业分类的股票投资组合 8.9.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合 8.9.2 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合

Table with columns: 序号, 项目, 金额, 占基金总资产的比例(%)

8.10 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合 8.11 投资组合报告附注 8.11.1 报告期内基金投资的前十名证券除 14 陕西煤业 MTN002(证券代码 101456024)、15 湖南债(证券代码 1580046)、17 北京银行 CD136(证券代码 11171213)外其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查,不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

1.14 煤炭股 MTN002(证券代码 101456024) 根据 2017 年 10 月 20 日发布的相关公告,该证券发行人因其他违法行为被陕西省国税局稽查局处以罚款。 根据 2017 年 7 月 11 日发布的相关公告,该证券发行人因涉嫌违反法律法规被陕西省国税局稽查局处以罚款。

2.基金持有的股票分类为交易性金融资产的,本项的“累计买入金额”按买入成交金额(成交均价乘以成交量)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计卖出金额, 占期初基金资产净值比例(%)

注:1.卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及授权减持等股票; 2.基金持有的股票分类为交易性金融资产的,本项“累计卖出金额”按卖出成交金额(成交均价乘以成交量)填列,不考虑相关交易费用。

Table with columns: 买入股票成本(成交)总额, 卖出股票收入(成交)总额

注:1.买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票,卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及授权减持等股票; 2.“买入股票成本(成交)总额”、“卖出股票收入(成交)总额”均按买卖成交金额(成交均价乘以成交量)填列,不考虑相关交易费用。

Table with columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 8.7 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资产支持证券投资明细

Table with columns: 序号, 名称, 金额

8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细 8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明 8.11.6 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

Table with columns: 序号, 名称, 金额

8.12.5 期末持有的处于转股期的可转换债券明细 8.12.6 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明 8.12.7 期末其他各项资产构成

Table with columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

8.12.8 期末持有的处于转股期的可转换债券明细 8.12.9 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明 8.12.10 期末其他各项资产构成

Table with columns: 序号, 项目, 金额

Table with columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

8.7 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 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 8.9 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

8.10 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 8.10.2 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 8.11.1 本期国债期货投资政策 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

8.11.3 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细 8.11.4 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细 8.11.5 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

Table with columns: 序号, 名称, 金额

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明 8.12.6 期末其他各项资产构成

Table with columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

8.12.7 期末持有的处于转股期的可转换债券明细 8.12.8 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明 8.12.9 期末其他各项资产构成

Table with columns: 序号, 名称, 金额

8.12.10 期末持有的处于转股期的可转换债券明细 8.12.11 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明 8.12.12 期末其他各项资产构成

Table with columns: 序号, 名称, 金额

8.12.13 期末持有的处于转股期的可转换债券明细 8.12.14 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明 8.12.15 期末其他各项资产构成

Table with columns: 序号, 名称, 金额

8.12.16 期末持有的处于转股期的可转换债券明细 8.12.17 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明 8.12.18 期末其他各项资产构成

Table with columns: 序号, 名称, 金额

8.12.19 期末持有的处于转股期的可转换债券明细 8.12.20 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明 8.12.21 期末其他各项资产构成

Table with columns: 序号, 名称, 金额

Table with columns: 项目, 份额级别, 持有份额总份数, 占基金总份额比例

注:分级基金管理人的从业人员持有本基金的情况 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

Table with columns: 项目, 份额级别, 持有基金份额总数量(万份)

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 9.3.1 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 9.3.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

Table with columns: 项目, 招商丰混合 A, 招商丰混合 C

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 9.4.1 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 9.4.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

Table with columns: 项目, 招商丰混合 A, 招商丰混合 C

9.5 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 9.5.1 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 9.5.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

Table with columns: 项目, 招商丰混合 A, 招商丰混合 C

9.6 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 9.6.1 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 9.6.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

Table with columns: 项目, 招商丰混合 A, 招商丰混合 C

9.7 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 9.7.1 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 9.7.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

Table with columns: 项目, 招商丰混合 A, 招商丰混合 C

9.8 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 9.8.1 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 9.8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

Table with columns: 项目, 招商丰混合 A, 招商丰混合 C

9.9 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 9.9.1 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 9.9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

Table with columns: 项目, 招商丰混合 A, 招商丰混合 C

9.10 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 9.10.1 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 9.10.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况