

(上接 D298 版)

2017年,本基金上述持续以公允价值计量的资产和负债金融工具的第一层次与第二层次之间没有发生重大转换...

(b) 第二层次的公允价值计量 对于本基金投资的证券交易所上市的证券,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)...

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具 于2017年12月31日,本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(2016年12月31日:无)。

7.4.10.1.2 其他金融工具的公允价值 (年末非以公允价值计量的项目) 其他金融工具主要包括买入返售金融资产、应收款项和其他金融负债...

8.1 期末基金资产组合情况

Table with 5 columns: 序号, 项目, 金额, 占基金总资产的比例(%), 备注. Lists asset categories like 权益投资, 固定收益投资, etc.

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 本基金本报告期末未持有股票。 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合 本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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 本基金本报告期末未持有股票。

8.4 报告期末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

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额 8.4.4 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 5 columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值比例(%), 备注. Lists bond types like 国家债券, 央行票据, etc.

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 金额单位:人民币元

Table with 5 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(%). Lists specific bond holdings.

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 本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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 本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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 本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 8.10.1 本期国债期货投资政策

8.1.1 期末基金资产组合情况 金额单位:人民币元

Table with 5 columns: 序号, 项目, 金额, 占基金总资产的比例(%), 备注. Lists asset categories like 权益投资, 固定收益投资, etc.

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购 本基金本报告期末持有的债券中无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项 (a)公允价值计量的金融工具

Table with 5 columns: 资产, 第一层次, 第二层次, 第三层次, 合计. Lists asset categories and their fair value levels.

7.4.9.2 期末按行业分类的股票投资组合 8.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

Table with 5 columns: 代码, 行业类别, 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Lists industry-based stock investments.

8.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合 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 5 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(%). Lists top 10 stock holdings.

8.2 报告期末按行业分类的债券投资组合 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

Table with 5 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(%). Lists top 5 bond holdings.

8.4 报告期末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

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

8.4.4 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

杆操作等特点,提高投资组合效率,有管理市场风险。

8.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细 本基金本报告期末未持有国债期货合约。 8.10.3 本期国债期货投资评价

8.11 投资组合报告附注 8.11.1 报告期内本基金投资的前十名证券除17长发集团MTN003(证券代码101759051)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。

8.11.2 根据基金合同规定,本基金的投资范围不包括股票。 8.11.3 期末其他各项资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额. Lists other assets like 存出保证金, 应收证券清算款, etc.

8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细 本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明 本基金本报告期末未持有股票。

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 金额单位:份

Table with 5 columns: 份额级别, 持有人户数(户), 持有基金份额, 机构投资者持有份额, 个人投资者持有份额. Shows shareholder structure.

注:分级基金机构投资者/个人投资者持有份额占基金份额比例计算中,对下属分级基金,比例的分母采用各自级别的份额,对合计数,比例的分母采用下属分级基金份额的合计数(即期末基金总份额)。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

Table with 3 columns: 项目, 份额级别, 持有基金份额总数, 占基金总份额比例. Shows manager's holdings.

注:分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中,对下属分级基金,比例的分母采用各自级别的份额,对合计数,比例的分母采用下属分级基金份额的合计数(即期末基金总份额)。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金基金份额总量的区间的情况

Table with 3 columns: 项目, 份额级别, 持有基金份额总量的数量区间(万份). Shows manager's holding intervals.

8.10 开放式基金份额变动 单位:份

Table with 3 columns: 项目, 招商招悦纯债 A, 招商招悦纯债 C. Shows fund share changes.

8.11 重大事件揭示 11.1 基金份额持有人大会决议

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 基金管理人监事会主席丁安华先生因工作调动原因辞去公司监事会主席职务。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变 本报告期基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 本报告期本基金的审计事务所无变化,目前毕马威华振会计师事务所

(特殊普通合伙)已为本基金提供审计服务2年,本报告期应支付毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)审计报酬为人民币50,000.00元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 本报告期,基金管理人没有受到监管部门的稽查或处罚,亦未收到关于基金管理人的高级管理人员、托管人及其高级管理人员受到监管部门的稽查或处罚的书面通知或文件。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

Table with 5 columns: 券商名称, 交易单元数量, 股票交易, 佣金, 备注. Lists broker usage.

注:基金交易佣金根据券商季度综合评分结果给与分配,券商综合评分根据研究报告质量、路演质量、联合调研质量以及销售服务质量打分,从多家券商中选取符合法律法规及经营的综合能力最强的券商给与佣金分配,季度评分和佣金分配分别由专人负责。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况 金额单位:人民币元

Table with 5 columns: 券商名称, 债券交易, 债券回购交易, 权证交易. Lists other investment details.

8.12 影响投资者决策的其他重要信息 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

Table with 5 columns: 投资者类别, 持有基金份额比例达到或超过20%的期间, 期初份额, 申购份额, 赎回份额, 持有份额, 份额占比. Shows large shareholder info.

注:本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况,可能会出现集中赎回基金份额从而引发基金净值剧烈波动,甚至引发基金的流动性风险,基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请,基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。

招商基金管理有限公司 2018年3月30日

(上接 D297 版)

Table with 10 columns: 证券代码, 证券名称, 成功认购日期, 可流通日期, 受限类型, 认购价格, 期末估值价格, 数量(单位:股), 期末成本总额, 期末估值总额, 备注. Lists restricted securities.

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票 金额单位:人民币元

Table with 10 columns: 股票代码, 股票名称, 停牌日期, 停牌原因, 期末估值价格, 复牌开盘日期, 数量(股), 期末成本总额, 期末估值总额, 备注. Lists suspended stocks.

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购 本基金本报告期末持有的债券中无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项 (a)公允价值计量的金融工具

Table with 5 columns: 资产, 第一层次, 第二层次, 第三层次, 合计. Lists asset categories and their fair value levels.

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 8.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

Table with 5 columns: 代码, 行业类别, 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Lists industry-based stock investments.

8.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合 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 5 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(%). Lists top 10 stock holdings.

8.2 报告期末按行业分类的债券投资组合 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

Table with 5 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(%). Lists top 5 bond holdings.

8.4 报告期末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

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

8.4.4 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注:1,卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及权证减少的股票;

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”按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额 单位:人民币元

Table with 2 columns: 买入股票成本(成交)总额, 卖出股票收入(成交)总额. Shows buy/sell totals.

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;

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(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 金额单位:人民币元

Table with 5 columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Lists bond holdings.

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股票投资明细 金额单位:人民币元

Table with 5 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(%). Lists top 5 stock holdings.

8.2 报告期末按行业分类的债券投资组合 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

Table with 5 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(%). Lists top 5 bond holdings.

8.4 报告期末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

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

8.4.4 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注:1,卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及权证减少的股票;

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”按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额 单位:人民币元

Table with 2 columns: 买入股票成本(成交)总额, 卖出股票收入(成交)总额. Shows buy/sell totals.

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;

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(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 金额单位:人民币元

Table with 5 columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Lists bond holdings.

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股票投资明细 金额单位:人民币元

Table with 5 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(%). Lists top 5 stock holdings.

8.2 报告期末按行业分类的债券投资组合 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

Table with 5 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(%). Lists top 5 bond holdings.

8.4 报告期末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

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

8.4.4 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

Table with 5 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(%). Lists top 5 bond holdings.

8.2 报告期末按行业分类的债券投资组合 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

Table with 5 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(%). Lists top 5 bond holdings.

8.4 报告期末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

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

8.4.4 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额