

招商沪深300高贝塔指数分级证券投资基金

2015 第四季度 报告

2015年12月31日

基金管理人:招商基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2016年1月22日
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,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...

基金产品概况
招商沪深300高贝塔指数分级证券投资基金(招商沪深300)
基金代码:647178
基金运作方式:契约型开放式
基金存续期限:长期存续

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
1.本期利润总额:608,085.26
2.本期净利润:7,828,092.29
3.本期加权平均基金份额净利润:0.1947



注:本基金投资股指期货的不高于基金资产的10%,投资于沪深300股指期货合约和国债期货合约的资产不高于基金资产净值的5%...

5.1 投资组合报告
截止2015年12月31日,本基金资产组合情况如下:
股票投资:64,316,349.01元,占基金资产净值的95.17%
债券投资:3,281,874.82元,占基金资产净值的4.83%

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
1.农林牧渔:43,253,678.82, 67.25%
2.医药生物:8,200,425.70, 12.75%
3.计算机:2,901,276.91, 4.36%

5.3 主要资产组合及公允价值
单位:人民币元
1.本期利润总额:3,218,874.84
2.本期净利润:43,753,972.14
3.本期加权平均基金份额净利润:0.1482

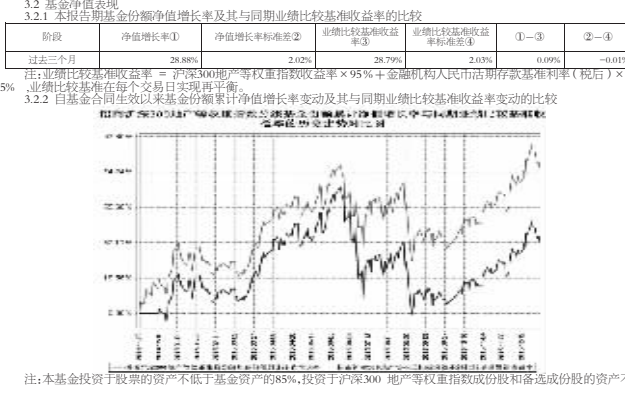
注:本基金投资股指期货的不高于基金资产的10%,投资于沪深300股指期货合约和国债期货合约的资产不高于基金资产净值的5%...

招商基金管理人招商基金管理有限公司
招商基金托管人中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2016年1月22日

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,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...

基金产品概况
招商沪深300地产等权重指数分级证券投资基金
基金代码:647171
基金运作方式:契约型开放式
基金存续期限:长期存续

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
1.本期利润总额:3,218,874.84
2.本期净利润:43,753,972.14
3.本期加权平均基金份额净利润:0.1482



注:本基金投资股指期货的不高于基金资产的10%,投资于沪深300股指期货合约和国债期货合约的资产不高于基金资产净值的5%...

招商基金管理人招商基金管理有限公司
招商基金托管人中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2016年1月22日

投资组合报告
截止2015年12月31日,本基金资产组合情况如下:
股票投资:64,316,349.01元,占基金资产净值的95.17%
债券投资:3,281,874.82元,占基金资产净值的4.83%

5.1 投资组合报告
截止2015年12月31日,本基金资产组合情况如下:
股票投资:64,316,349.01元,占基金资产净值的95.17%
债券投资:3,281,874.82元,占基金资产净值的4.83%

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
1.农林牧渔:43,253,678.82, 67.25%
2.医药生物:8,200,425.70, 12.75%
3.计算机:2,901,276.91, 4.36%

5.3 主要资产组合及公允价值
单位:人民币元
1.本期利润总额:3,218,874.84
2.本期净利润:43,753,972.14
3.本期加权平均基金份额净利润:0.1482

5.4 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股票投资明细
1. 600729 宁德时代 26,401 396,042.20 1.39

5.5 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债券投资明细
1. 1000000 国债 22,999 467,280.48 1.13

5.6 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明细
招商基金本报告期末未持有权证投资

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
招商基金本报告期末未持有贵金属投资

5.8 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股指期货投资明细
招商基金本报告期末未持有股指期货

招商基金管理人招商基金管理有限公司
招商基金托管人中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2016年1月22日

招商可转债分级债券型证券投资基金

2015 第四季度 报告

2015年12月31日

基金管理人:招商基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2016年1月22日
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,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...

基金产品概况
招商可转债分级债券型证券投资基金
基金代码:647179
基金运作方式:契约型开放式
基金存续期限:长期存续

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
1.本期利润总额:2,448,837.70
2.本期净利润:51,847,843.91
3.本期加权平均基金份额净利润:0.0736



注:本基金投资股指期货的不高于基金资产的10%,投资于沪深300股指期货合约和国债期货合约的资产不高于基金资产净值的5%...

5.1 投资组合报告
截止2015年12月31日,本基金资产组合情况如下:
股票投资:64,316,349.01元,占基金资产净值的95.17%
债券投资:3,281,874.82元,占基金资产净值的4.83%

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
1.农林牧渔:43,253,678.82, 67.25%
2.医药生物:8,200,425.70, 12.75%
3.计算机:2,901,276.91, 4.36%

5.3 主要资产组合及公允价值
单位:人民币元
1.本期利润总额:2,448,837.70
2.本期净利润:51,847,843.91
3.本期加权平均基金份额净利润:0.0736

注:本基金投资股指期货的不高于基金资产的10%,投资于沪深300股指期货合约和国债期货合约的资产不高于基金资产净值的5%...

招商基金管理人招商基金管理有限公司
招商基金托管人中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2016年1月22日

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,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...

基金产品概况
招商可转债分级债券型证券投资基金
基金代码:647179
基金运作方式:契约型开放式
基金存续期限:长期存续

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
1.本期利润总额:2,448,837.70
2.本期净利润:51,847,843.91
3.本期加权平均基金份额净利润:0.0736



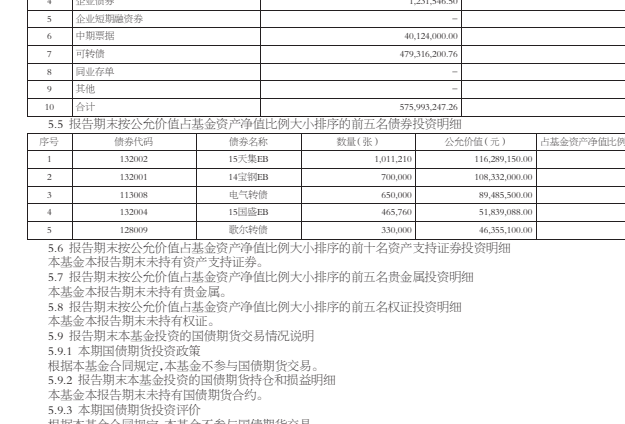
注:本基金投资股指期货的不高于基金资产的10%,投资于沪深300股指期货合约和国债期货合约的资产不高于基金资产净值的5%...

招商基金管理人招商基金管理有限公司
招商基金托管人中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2016年1月22日

基金管理人:招商基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2016年1月22日
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,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...

基金产品概况
招商可转债分级债券型证券投资基金
基金代码:647179
基金运作方式:契约型开放式
基金存续期限:长期存续

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
1.本期利润总额:2,448,837.70
2.本期净利润:51,847,843.91
3.本期加权平均基金份额净利润:0.0736



注:本基金投资股指期货的不高于基金资产的10%,投资于沪深300股指期货合约和国债期货合约的资产不高于基金资产净值的5%...

5.1 投资组合报告
截止2015年12月31日,本基金资产组合情况如下:
股票投资:64,316,349.01元,占基金资产净值的95.17%
债券投资:3,281,874.82元,占基金资产净值的4.83%

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
1.农林牧渔:43,253,678.82, 67.25%
2.医药生物:8,200,425.70, 12.75%
3.计算机:2,901,276.91, 4.36%

5.3 主要资产组合及公允价值
单位:人民币元
1.本期利润总额:2,448,837.70
2.本期净利润:51,847,843.91
3.本期加权平均基金份额净利润:0.0736

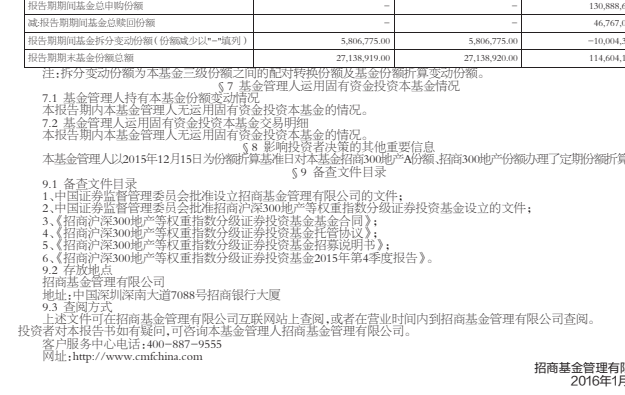
注:本基金投资股指期货的不高于基金资产的10%,投资于沪深300股指期货合约和国债期货合约的资产不高于基金资产净值的5%...

招商基金管理人招商基金管理有限公司
招商基金托管人中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2016年1月22日

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,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...

基金产品概况
招商可转债分级债券型证券投资基金
基金代码:647179
基金运作方式:契约型开放式
基金存续期限:长期存续

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
1.本期利润总额:2,448,837.70
2.本期净利润:51,847,843.91
3.本期加权平均基金份额净利润:0.0736



注:本基金投资股指期货的不高于基金资产的10%,投资于沪深300股指期货合约和国债期货合约的资产不高于基金资产净值的5%...

招商基金管理人招商基金管理有限公司
招商基金托管人中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2016年1月22日