

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	2,536,500.00	0.08
B	采矿业	-	-
C	制造业	44,982,681.11	1.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,313,000.00	0.28
E	建筑业	8,408,206.60	0.26
F	批发和零售业	4,816,804.44	0.15
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	2,588,208.18	0.08
J	金融业	-	-
K	房地产业	2,706,000.00	0.08
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	109,392.21	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	2,068,000.00	0.06
O	国际服务、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	77,530,792.54	2.36

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300443	金鹰风电	65,566	12,675,219.12	0.39
2	300436	广生堂	94,594	7,891,977.42	0.24
3	002781	奇信股份	204,345	7,643,846.65	0.23
4	600687	南钢转债	220,000	5,187,600.00	0.16
5	300332	天能环境	200,000	4,880,000.00	0.15
6	002104	恒宝投资	200,000	4,798,000.00	0.15
7	603368	柳药医药	50,000	4,594,500.00	0.14
8	000890	卓尔数	200,000	2,754,000.00	0.08
9	002016	世华乳业	200,000	2,706,000.00	0.08
10	002077	维农农牧	150,000	2,536,500.00	0.08

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	011510102	15中电投SCP012	1,500,000	150,420,000.00	4.59
2	011517018	15广生堂SCP018	1,000,000	100,270,000.00	3.06
3	011519984	15广生堂SCP012	1,000,000	100,250,000.00	3.06
4	041515066	15三期CP01	1,000,000	100,230,000.00	3.06
5	011517010	15鲁高速SCP010	1,000,000	100,230,000.00	3.06

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	011510102	15中电投SCP012	1,500,000	150,420,000.00	4.59
2	011517018	15广生堂SCP018	1,000,000	100,270,000.00	3.06
3	011519984	15广生堂SCP012	1,000,000	100,250,000.00	3.06
4	041515066	15三期CP01	1,000,000	100,230,000.00	3.06
5	011517010	15鲁高速SCP010	1,000,000	100,230,000.00	3.06

序号	资产支持证券代码	资产支持证券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	160103	招商证券ABS2016年第一期	1,000,000	100,270,000.00	3.06
2	160104	招商证券ABS2016年第二期	1,000,000	100,250,000.00	3.06
3	160105	招商证券ABS2016年第三期	1,000,000	100,230,000.00	3.06
4	160106	招商证券ABS2016年第四期	1,000,000	100,210,000.00	3.04
5	160107	招商证券ABS2016年第五期	1,000,000	100,190,000.00	3.03

序号	贵金属名称	数量(克)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	黄金	100.00	10,000.00	0.03
2	白银	100.00	1,000.00	0.00
3	铂金	100.00	1,000.00	0.00
4	钯金	100.00	1,000.00	0.00
5	铑金	100.00	1,000.00	0.00

序号	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	南钢转债	220,000	5,187,600.00	0.16
2	恒宝转债	200,000	4,798,000.00	0.15
3	柳药转债	50,000	4,594,500.00	0.14
4	卓尔转债	200,000	2,754,000.00	0.08
5	世华转债	200,000	2,706,000.00	0.08

序号	股指期货名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	IF1604	100,000	10,000.00	0.03
2	IF1605	100,000	10,000.00	0.03
3	IF1606	100,000	10,000.00	0.03
4	IF1607	100,000	10,000.00	0.03
5	IF1608	100,000	10,000.00	0.03

序号	国债期货名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	T1604	100,000	10,000.00	0.03
2	T1605	100,000	10,000.00	0.03
3	T1606	100,000	10,000.00	0.03
4	T1607	100,000	10,000.00	0.03
5	T1608	100,000	10,000.00	0.03

序号	货币市场基金名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商现金	1,000,000	100,270,000.00	3.06
2	招商货币	1,000,000	100,250,000.00	3.06
3	招商理财	1,000,000	100,230,000.00	3.06
4	招商资管	1,000,000	100,210,000.00	3.04
5	招商财富	1,000,000	100,190,000.00	3.03

序号	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	南钢转债	220,000	5,187,600.00	0.16
2	恒宝转债	200,000	4,798,000.00	0.15
3	柳药转债	50,000	4,594,500.00	0.14
4	卓尔转债	200,000	2,754,000.00	0.08
5	世华转债	200,000	2,706,000.00	0.08

序号	股指期货名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	IF1604	100,000	10,000.00	0.03
2	IF1605	100,000	10,000.00	0.03
3	IF1606	100,000	10,000.00	0.03
4	IF1607	100,000	10,000.00	0.03
5	IF1608	100,000	10,000.00	0.03

序号	国债期货名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	T1604	100,000	10,000.00	0.03
2	T1605	100,000	10,000.00	0.03
3	T1606	100,000	10,000.00	0.03
4	T1607	100,000	10,000.00	0.03
5	T1608	100,000	10,000.00	0.03

序号	货币市场基金名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商现金	1,000,000	100,270,000.00	3.06
2	招商货币	1,000,000	100,250,000.00	3.06
3	招商理财	1,000,000	100,230,000.00	3.06
4	招商资管	1,000,000	100,210,000.00	3.04
5	招商财富	1,000,000	100,190,000.00	3.03

序号	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	南钢转债	220,000	5,187,600.00	0.16
2	恒宝转债	200,000	4,798,000.00	0.15
3	柳药转债	50,000	4,594,500.00	0.14
4	卓尔转债	200,000	2,754,000.00	0.08
5	世华转债	200,000	2,706,000.00	0.08

序号	股指期货名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	IF1604	100,000	10,000.00	0.03
2	IF1605	100,000	10,000.00	0.03
3	IF1606	100,000	10,000.00	0.03
4	IF1607	100,000	10,000.00	0.03
5	IF1608	100,000	10,000.00	0.03

序号	国债期货名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	T1604	100,000	10,000.00	0.03
2	T1605	100,000	10,000.00	0.03
3	T1606	100,000	10,000.00	0.03
4	T1607	100,000	10,000.00	0.03
5	T1608	100,000	10,000.00	0.03

序号	货币市场基金名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商现金	1,000,000	100,270,000.00	3.06
2	招商货币	1,000,000	100,250,000.00	3.06
3	招商理财	1,000,000	100,230,000.00	3.06
4	招商资管	1,000,000	100,210,000.00	3.04
5	招商财富	1,000,000	100,190,000.00	3.03

序号	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	南钢转债	220,000	5,187,600.00	0.16
2	恒宝转债	200,000	4,798,000.00	0.15
3	柳药转债	50,000	4,594,500.00	0.14
4	卓尔转债	200,000	2,754,000.00	0.08
5	世华转债	200,000	2,706,000.00	0.08

序号	股指期货名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	IF1604	100,000	10,000.00	0.03
2	IF1605	100,000	10,000.00	0.03
3	IF1606	100,000	10,000.00	0.03
4	IF1607	100,000	10,000.00	0.03
5	IF1608	100,000	10,000.00	0.03

序号	国债期货名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	T1604	100,000	10,000.00	0.03
2	T1605	100,000	10,000.00	0.03
3	T1606	100,000	10,000.00	0.03
4	T1607	100,000	10,000.00	0.03
5	T1608	100,000	10,000.00	0.03

序号	货币市场基金名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商现金	1,000,000	100,270,000.00	3.06
2	招商货币	1,000,000	100,250,000.00	3.06
3	招商理财	1,000,000	100,230,000.00	3.06
4	招商资管	1,000,000	100,210,000.00	3.04
5	招商财富	1,000,000	100,190,000.00	3.03

序号	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	南钢转债	220,000	5,187,600.00	0.16
2	恒宝转债	200,000	4,798,000.00	0.15
3	柳药转债	50,000	4,594,500.00	0.14
4	卓尔转债	200,000	2,754,000.00	0.08
5	世华转债	200,000	2,706,000.00	0.08

序号	股指期货名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	IF1604	100,000	10,000.00	0.03
2	IF1605	100,000	10,000.00	0.03
3	IF1606	100,000	10,000.00	0.03
4	IF1607	100,000	10,000.00	0.03
5	IF1608	100,000	10,000.00	