

招商招旺纯债债券型证券投资基金招募说明书(更新)摘要

(2018年第1号)

基金管理人:招商基金管理有限公司 基金托管人:兴业银行股份有限公司 截止日:2018年05月02日

重要提示

招商招旺纯债债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证监会管理委员会议2016年10月9日《关于准予招商招旺纯债债券型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2016]2814号)注册。本基金的基金合同于2016年11月2日生效。本基金采用契约方式运作。

招商基金管理有限公司(以下简称“本基金管理人”或“管理人”)保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册,中国证监会对本基金募集申请的注册并不构成对本基金投资价值、收益及风险的保证,也不构成对本基金业绩表现的保证。本基金的过往业绩并不预示其未来表现,基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。投资者在认购(申购)本基金时应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同。

本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动,投资者在投资本基金前,应全面了解本基金的产品特性,充分认识本基金的风险收益特征,理性判断市场,并承担基金投资中出现的各类风险,包括:投资组合政治、经济、社会等环境因素变化导致的风险;利率风险和债券信用风险;流动性风险;资产估值风险;由于本基金资产净值波动引起的风险;基金管理人、基金托管人、基金销售机构、注册登记机构、基金份额持有人等各方当事人违约的风险;基金管理人、基金托管人、基金销售机构、注册登记机构、基金份额持有人等各方当事人过错导致的风险;基金管理人、基金托管人、基金销售机构、注册登记机构、基金份额持有人等各方当事人违法违规导致的风险。本基金可能无法卖出所持持有中小企业私募债,由此可能带来流动性风险和信用风险。

本基金为债券型基金,预期风险和预期收益高于货币型基金,低于股票型、混合型基金。关于本基金的风险收益特征,请投资者参阅本基金的招募说明书和本基金的过往业绩表现的相关内容。投资者在认购(申购)本基金时应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同。

1.1 基金管理人情况

招商基金管理有限公司
注册地址:深圳市南山区深圳大道7088号
成立时间:2002年12月27日
注册资本:人民币13.1亿元
法定代表人:李健
办公地址:深圳市南山区深圳大道7088号
电话:(0755)83195966
传真:(0755)83067974

1.2 基金托管人情况

招商招旺纯债债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证监会管理委员会议2016年10月9日《关于准予招商招旺纯债债券型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2016]2814号)注册。本基金的基金合同于2016年11月2日生效。本基金采用契约方式运作。

基金管理人:招商基金管理有限公司

基金托管人:兴业银行股份有限公司

截止日:2018年05月02日

备用传真:(0755)83196266
联系人:潘斌

3.1 代销机构
基金管理人可根据相关法律法规规定,选择其他符合要求的机构代理销售本基金,并另行公告。

3.2 注册代理机构
名称:招商基金管理有限公司
地址:深圳市福田区深南大道7088号
电话:(0755)83196446

3.3 律师事务所和经办律师
名称:上海源泰律师事务所
地址:上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦14楼
电话:(021)51150208

3.4 会计师事务所和经办注册会计师
名称:毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)
地址:北京东路1号1幢7楼广东办-办公楼八层
电话:(0755)21811000

4 基金名称

5 基金类型

6 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。

7 投资范围

本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具,包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、中小企业私募债、资产支持证券、次级债、可分离交易可转债的纯债品种、债券回购、银行存款、同业存单等法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

8 投资策略

本基金将在基金合同约定的投资范围内,通过对宏观经济状况、国家财政货币政策、财政收支、国家产业政策及资本市场环境分析,积极把握宏观经济发展趋势,利率走势、债券市场利率走势、券种的流动性以及信用水平,结合定量分析方法对利率期限结构、信用利差收益率、国债、中小企业私募债等信用风险和流动性风险之间的估值进行分析。

1.1 久期策略
本基金将参考市场利率的动态变化及预期变化,对引起利率变化的相关因素进行跟踪分析,积极主动地调整投资组合,以期降低利率波动带来的负面影响。

2.1 信用风险控制策略
本基金将根据信用评级机构对中小企业私募债的信用评级,结合中小企业私募债的发行主体、担保情况、增信措施、偿债能力、行业景气度、偿债资金来源、历史信用记录、与同行业其他企业对比等因素,对中小企业私募债的信用风险进行综合评估,以确定中小企业私募债的实际信用风险。

9 风险控制

本基金将严格执行基金合同约定的风险控制措施,确保基金资产的安全,防范和化解投资风险。本基金管理人将建立健全内部控制体系,加强对基金投资、运营、销售、客户服务等环节的风险管理,确保基金资产的安全,防范和化解投资风险。

10 基金的费用概況
本基金的费用包括基金管理费、基金托管费、销售服务费、申购费、赎回费等。本基金管理人将按照基金合同的约定,从基金财产中列支各项费用。

11 基金的投资业绩
本基金的投资业绩将受到市场波动、利率变化、信用风险等多种因素的影响。本基金管理人将根据基金合同约定的业绩比较基准,对基金的投资业绩进行跟踪分析和评价。

12 基金的信息披露
本基金管理人将按照相关法律法规的要求,及时、准确、完整地披露基金信息,确保投资者及时、准确地了解基金的投资状况。

13 基金的风险收益特征
本基金为债券型基金,预期风险和预期收益高于货币型基金,低于股票型、混合型基金。本基金的风险收益特征将根据基金合同约定的业绩比较基准进行衡量。

14 基金的募集情况
本基金经中国证监会核准,于2016年11月2日正式募集。截至2016年11月2日,本基金共募集基金份额1,318,472,291.10份,募集资金总额为1,318,472,291.10元。

15 基金的投资策略
本基金采用自上而下的投资策略,首先确定资产配置,然后进行债券品种的选择。本基金管理人将根据基金合同约定的投资策略,对债券市场进行深入研究,把握投资机会,优化投资组合。

16 基金的业绩比较基准
本基金的业绩比较基准为:中证全债指数收益率。

17 基金的风险收益特征
本基金为债券型基金,预期风险和预期收益高于货币型基金,低于股票型、混合型基金。本基金的风险收益特征将根据基金合同约定的业绩比较基准进行衡量。

18 基金的费用概況
本基金的费用包括基金管理费、基金托管费、销售服务费、申购费、赎回费等。本基金管理人将按照基金合同的约定,从基金财产中列支各项费用。

19 基金的投资业绩
本基金的投资业绩将受到市场波动、利率变化、信用风险等多种因素的影响。本基金管理人将根据基金合同约定的业绩比较基准,对基金的投资业绩进行跟踪分析和评价。

20 基金的信息披露
本基金管理人将按照相关法律法规的要求,及时、准确、完整地披露基金信息,确保投资者及时、准确地了解基金的投资状况。

21 基金的风险收益特征
本基金为债券型基金,预期风险和预期收益高于货币型基金,低于股票型、混合型基金。本基金的风险收益特征将根据基金合同约定的业绩比较基准进行衡量。

22 基金的募集情况
本基金经中国证监会核准,于2016年11月2日正式募集。截至2016年11月2日,本基金共募集基金份额1,318,472,291.10份,募集资金总额为1,318,472,291.10元。

23 基金的投资策略
本基金采用自上而下的投资策略,首先确定资产配置,然后进行债券品种的选择。本基金管理人将根据基金合同约定的投资策略,对债券市场进行深入研究,把握投资机会,优化投资组合。

24 基金的业绩比较基准
本基金的业绩比较基准为:中证全债指数收益率。

25 基金的风险收益特征
本基金为债券型基金,预期风险和预期收益高于货币型基金,低于股票型、混合型基金。本基金的风险收益特征将根据基金合同约定的业绩比较基准进行衡量。

26 基金的费用概況
本基金的费用包括基金管理费、基金托管费、销售服务费、申购费、赎回费等。本基金管理人将按照基金合同的约定,从基金财产中列支各项费用。

27 基金的投资业绩
本基金的投资业绩将受到市场波动、利率变化、信用风险等多种因素的影响。本基金管理人将根据基金合同约定的业绩比较基准,对基金的投资业绩进行跟踪分析和评价。

28 基金的信息披露
本基金管理人将按照相关法律法规的要求,及时、准确、完整地披露基金信息,确保投资者及时、准确地了解基金的投资状况。

29 基金的风险收益特征
本基金为债券型基金,预期风险和预期收益高于货币型基金,低于股票型、混合型基金。本基金的风险收益特征将根据基金合同约定的业绩比较基准进行衡量。

30 基金的募集情况
本基金经中国证监会核准,于2016年11月2日正式募集。截至2016年11月2日,本基金共募集基金份额1,318,472,291.10份,募集资金总额为1,318,472,291.10元。

31 基金的投资策略
本基金采用自上而下的投资策略,首先确定资产配置,然后进行债券品种的选择。本基金管理人将根据基金合同约定的投资策略,对债券市场进行深入研究,把握投资机会,优化投资组合。

32 基金的业绩比较基准
本基金的业绩比较基准为:中证全债指数收益率。

33 基金的风险收益特征
本基金为债券型基金,预期风险和预期收益高于货币型基金,低于股票型、混合型基金。本基金的风险收益特征将根据基金合同约定的业绩比较基准进行衡量。

12 基金资产组合报告

招商招旺纯债债券型证券投资基金管理人招商基金管理有限公司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。

本投资组合报告所载数据截至2018年5月31日,来源于《招商招旺纯债债券型证券投资基金2018年1季度报告》。

1 报告期未本基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例(%) |
|----|--------|----------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 400.00 | - |
| 2 | 固定收益投资 | 26,753,272.82 | 93.78 |
| 3 | 银行存款 | 465,889,000.00 | 8.92 |
| 4 | 应收款项 | 20,000,000.00 | 3.86 |
| 5 | 其他资产 | - | - |
| 6 | 其他负债 | 10,000,000.00 | 1.90 |
| 7 | 资产减值准备 | - | - |
| 8 | 其他项目 | 518,140,405.31 | 1.06 |

2 报告期未按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

3 报告期未按行业分类的港股投资

本基金本报告期末未持有港股。

4 报告期未按品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元) | 占基金总资产比例(%) |
|----|----------|----------------|-------------|
| 1 | 国债 | 400.00 | 0.00 |
| 2 | 金融债 | 88,788,000.00 | 17.15 |
| 3 | 企业债 | 88,788,000.00 | 17.15 |
| 4 | 公司债 | 37,099,400.00 | 65.12 |
| 5 | 可转债(可交换) | 30,166,000.00 | 5.83 |
| 6 | 中期票据 | 9,839,000.00 | 1.90 |
| 7 | 短期融资券 | - | - |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 465,889,000.00 | 90.00 |

5 报告期期末公允价值占基金总资产净值比例大小排序的前十名债券投资组合

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量(张) | 公允价值(元) | 占基金总资产净值比例(%) |
|----|--------|----------|---------|---------------|---------------|
| 1 | 162028 | 16国债附息08 | 50,000 | 49,399,000.00 | 8.54 |
| 2 | 162747 | 16国债附息07 | 400,000 | 39,580,000.00 | 7.65 |
| 3 | 141477 | 14国债附息07 | 300,000 | 29,333,000.00 | 5.67 |
| 4 | 130212 | 13国债附息12 | 300,000 | 28,266,000.00 | 5.46 |
| 5 | 127969 | 14国债附息09 | 300,000 | 24,465,000.00 | 4.73 |

6 报告期期末公允价值占基金总资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资

| 序号 | 证券代码 | 证券名称 | 数量(份) | 公允价值(元) | 占基金总资产净值比例(%) |
|----|---------|-------|--------|---------------|---------------|
| 1 | 14A2523 | 上农3A5 | 20,000 | 20,000,000.00 | 3.86 |

7 报告期期末公允价值占基金总资产净值比例大小排序的前五名国债投资组合

本基金本报告期末未持有国债。

8 报告期期末公允价值占基金总资产净值比例大小排序的前五名权证投资组合

本基金本报告期末未持有权证。

9 报告期期末本基金持有的回购交易情况

9.1 报告期末本基金投资的回购交易明细

9.2 报告期末本基金投资的回购交易损益

10 报告期末本基金投资的国债期货交易损益

11 报告期末本基金投资的股指期货交易损益

12 报告期末本基金投资的期权交易损益

13 本报告期末公允价值占基金总资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资

14 本报告期末持有的处于转股期的可转换债券

15 本报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

16 基金本报告期末持有的衍生品

13 基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不预示其未来表现,投资者不应将基金业绩作为投资决策的唯一依据。

本基金自合同生效以来的投资业绩及与同期业绩比较基准比较如下表所示:

| 阶段 | 基金份额净值增长率 | 业绩比较基准增长率 | 超额收益 |
|-----------------------|-----------|-----------|--------|
| 2016.11.02-2018.01.31 | -0.38% | 0.05% | -2.26% |
| 2018.01.31-2018.03.31 | 1.92% | 0.40% | 0.60% |
| 2018.01.31-2018.03.31 | 1.00% | 0.16% | 0.05% |
| 自基金合同生效以来至2018.03.31 | 3.46% | 0.40% | -0.20% |

招商招旺纯债C:

| 阶段 | 基金份额净值增长率 | 业绩比较基准增长率 | 超额收益 |
|-----------------------|-----------|-----------|--------|
| 2016.11.02-2018.01.31 | -0.38% | 0.05% | -2.26% |
| 2018.01.31-2018.03.31 | 1.75% | 0.04% | 0.06% |
| 2018.01.31-2018.03.31 | 1.85% | 0.09% | -0.14% |
| 自基金合同生效以来至2018.03.31 | 3.19% | 0.64% | -0.04% |

注:本基金合同生效日为2016年11月2日。

14 基金的费用概況

14.1 基金管理人的管理费

14.2 基金托管人的托管费

14.3 销售服务费的计提

14.4 基金申购费

14.5 基金赎回费

14.6 基金转换费

14.7 基金的其他费用

14.8 基金的信息披露费

14.9 基金的其他费用

14.10 基金的其他费用

14.11 基金的其他费用

14.12 基金的其他费用

14.13 基金的其他费用

14.14 基金的其他费用

14.15 基金的其他费用

14.16 基金的其他费用

14.17 基金的其他费用

14.18 基金的其他费用

14.19 基金的其他费用

14.20 基金的其他费用

14.21 基金的其他费用

14.22 基金的其他费用

14.23 基金的其他费用

14.24 基金的其他费用

14.25 基金的其他费用

14.26 基金的其他费用

14.27 基金的其他费用

14.28 基金的其他费用

14.29 基金的其他费用

14.30 基金的其他费用

申万菱信基金管理有限公司 关于申万菱信中证申万医药卫生指数 分级证券投资基金办理定期份额折算 业务期间暂停申购、赎回、转换转入、 转换转出及定期定额投资业务的公告

1.公告基本信息

| 基金名称 | 申万菱信中证申万医药卫生指数分级证券投资基金 |
|-------------------|---|
| 基金简称 | 申万菱信中证申万医药卫生指数分级证券投资基金(简称“申万医药”) |
| 基金代码 | 161818 |
| 基金管理人名称 | 申万菱信基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 招商银行股份有限公司 |
| 公告依据 | 《证券投资基金信息披露管理办法》、《申万菱信中证申万医药卫生指数分级证券投资基金招募说明书(更新)》、《申万菱信中证申万医药卫生指数分级证券投资基金基金合同》 |
| 暂停申购起始日 | 2018年6月20日 |
| 暂停申购截止日 | 2018年6月20日 |
| 暂停赎回起始日 | 2018年6月20日 |
| 暂停赎回截止日 | 2018年6月20日 |
| 暂停转换转入起始日 | 2018年6月20日 |
| 暂停转换转入截止日 | 2018年6月20日 |
| 暂停转换转出起始日 | 2018年6月20日 |
| 暂停转换转出截止日 | 2018年6月20日 |
| 定期定额投资业务暂停起始日 | 2018年6月20日 |
| 定期定额投资业务暂停截止日 | 2018年6月20日 |
| 暂停申购赎回期限 | 自2018年6月20日至2018年6月21日 |
| 定期定额投资业务暂停期限 | 自2018年6月20日至2018年6月21日 |
| 暂停申购赎回期间,申购赎回业务 | 正常办理 |
| 暂停申购赎回期间,转换业务 | 正常办理 |
| 暂停申购赎回期间,定期定额投资业务 | 正常办理 |

二、其他重要提示的事项

(1) 根据本基金基金合同的相关规定,本基金申购份额仅可在场内与场外的申购和赎回,但上市交易、场内份额申购、场内份额赎回、场内份额转换等业务不受影响。

(2) 本公告仅对本基金办理定期份额折算业务期间内申万医药的暂停申购、赎回、转换转入、转换转出及定期定额投资业务的情况进行说明,投资者若需要了解本基金的定期份额折算业务期间的申购、赎回、转换转入、转换转出及定期定额投资业务的详细情况,请查阅本基金定期公告、招募说明书及本基金经理人发布的相关公告,或者通过以下任一途径查询:

- 1) 申万菱信基金管理有限公司网站:www.swsmu.com;
- 2) 申万菱信基金管理有限公司客户服务电话:400 880 8888(免长途话费)或021-962299。

(3) 风险提示:本公司承诺以诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但本基金基金合同并不保证最低收益,敬请投资者注意投资风险。投资者投资于上述基金前应当认真阅读基金的基金合同、更新的招募说明书。

特此公告

申万菱信基金管理有限公司
2018年6月14日

申万菱信基金管理有限公司 关于申万菱信中证申万医药卫生指数 分级证券投资基金办理定期份额折算 业务的公告

1.公告基本信息

| 基金名称 | 申万菱信中证申万医药卫生指数分级证券投资基金 |
|-------------------|---|
| 基金简称 | 申万菱信中证申万医药卫生指数分级证券投资基金(简称“申万医药”) |
| 基金代码 | 161818 |
| 基金管理人名称 | 申万菱信基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 招商银行股份有限公司 |
| 公告依据 | 《证券投资基金信息披露管理办法》、《申万菱信中证申万医药卫生指数分级证券投资基金招募说明书(更新)》、《申万菱信中证申万医药卫生指数分级证券投资基金基金合同》 |
| 暂停申购起始日 | 2018年6月20日 |
| 暂停申购截止日 | 2018年6月20日 |
| 暂停赎回起始日 | 2018年6月20日 |
| 暂停赎回截止日 | 2018年6月20日 |
| 暂停转换转入起始日 | 2018年6月20日 |
| 暂停转换转入截止日 | 2018年6月20日 |
| 暂停转换转出起始日 | 2018年6月20日 |
| 暂停转换转出截止日 | 2018年6月20日 |
| 定期定额投资业务暂停起始日 | 2018年6月20日 |
| 定期定额投资业务暂停截止日 | 2018年6月20日 |
| 暂停申购赎回期限 | 自2018年6月20日至2018年6月21日 |
| 定期定额投资业务暂停期限 | 自2018年6月20日至2018年6月21日 |
| 暂停申购赎回期间,申购赎回业务 | 正常办理 |
| 暂停申购赎回期间,转换业务 | 正常办理 |
| 暂停申购赎回期间,定期定额投资业务 | 正常办理 |

二、其他重要提示的事项

(1) 根据本基金基金合同的相关规定,本基金申购份额仅可在场内与场外的申购和赎回,但上市交易、场内份额申购、场内份额赎回、场内份额转换等业务不受影响。

(2) 本公告仅对本基金办理定期份额折算业务期间内申