招商招诚半年定期开放债券型发起式证券投资基金

2019 第二季度 报告

2019年6月30日

基金管理人:招商基金管理有限公司
基金托管人:浙商银行股份有限公司
送出日期:2019年7月19日

§1 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。

基金托管人浙商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年7月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	招商招诚半年定开债发起式
基金主代码	005719
交易代码	005719
基金运作方式	契约型、定期开放式
基金合同生效日	2018年9月20日
报告期末基金份额总额	507,579,858.30份
投资目标	在严格控制风险的前提下,力争基金资产长期稳健增值,为基金份额持有人提供超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金以封闭期为周期进行投资运作。本基金在封闭期与开放期采取不同的投资策略。 1.封闭期投资策略 本基金封闭期的投资组合久期与封闭期剩余期限进行适当匹配的基础上,基金管理人将视债券、银行存款、债券回购等大类资产的市场环境确定债券投资组合管理策略,确定部分债券采取持有到期策略,部分债券将采取积极的投资策略,以获取较高的债券组合投资收益。 本基金的具体投资策略包括:①久期配置策略;②久期策略;③期限结构策略;④纯属配置策略;⑤短用债投资策略;⑥杠杆投资策略;⑦资产支持证券的投资策略;⑧可转债投资策略;⑨个券挖掘策略;⑩其中小企业私募债券投资策略。 2.开放期投资策略 开放期内,本基金为保持较高的组合流动性,方便投资人安排投资,在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下,将主要投资于高流动性的投资品种,防范高流性风险,满足开放期流动性的需求。
业绩比较基准	中证全债指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金,预期收益和预期风险高于货币市场基金,但低于混合型基金、股票型基金。
基金管理人	招商基金管理有限公司
基金托管人	浙商银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期 (2019年4月1日-2019年6月30日)
1.本期已实现收益	3,669,362.82
2.本期利润	3,137,496.87
3.加权平均基金份额本期利润	0.0066
4.期末基金资产净值	513,360,296.86
5.期末基金份额净值	1.0114

注:1.上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实购收益水平要低于所列数字;

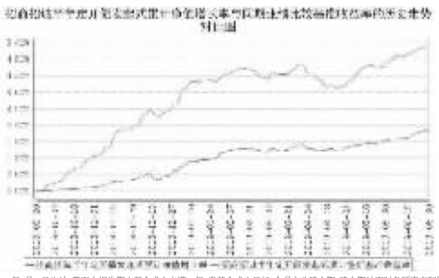
2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.52%	0.03%	0.63%	0.06%	-0.11%	-0.03%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:本基金合同于2018年9月20日生效,截至本报告期末基金成立未满一年;自基金成立日起6个月内为建仓期,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
许强	本基金基金经理	2018年9月20日	-	8	男,管理学学士。2008年9月加入华信威华证券股份有限公司,从事审计工作;2010年9月加入招商基金管理有限公司,曾任基金核算部基金会计、固定收益投资部研究员。招商招利纯债债券型证券投资基金、招商招裕纯债债券型证券投资基金、招商招悦纯债债券型证券投资基金、招商招利纯债债券型证券投资基金、招商招义纯债债券型证券投资基金、招商招瑞纯债债券型证券投资基金、招商招通纯债债券型证券投资基金、招商招盛纯债债券型证券投资基金、招商招益纯债债券型证券投资基金、招商招利纯债债券型证券投资基金、招商招利纯债债券型证券投资基金、招商招利