

基金管理人:招商基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
送出日期:2018年7月19日

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:中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018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。

本报告期从2018年4月1日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 招商制造业转型灵活配置混合型证券投资基金

基金代码 001699

交易代码 001699

基金运作方式 到期开放型

基金合同生效日 2016年10月14日

报告期末基金份额总额 994,024,432.00份

投资目标 本基金在追求资产流动性管理,在保证流动性、本金安全的前提下,本基金将通过资产配置,在严格控制风险的前提下,追求超越业绩基准的收益。

投资策略 本基金在追求资产流动性管理,在保证流动性、本金安全的前提下,本基金将通过资产配置,在严格控制风险的前提下,追求超越业绩基准的收益。

业绩比较基准 60%×中证制造业指数+40%×中证中证债券指数

风险收益特征 本基金在追求资产流动性管理,在保证流动性、本金安全的前提下,本基金将通过资产配置,在严格控制风险的前提下,追求超越业绩基准的收益。

基金管理人 招商基金管理有限公司

基金托管人 中国银行股份有限公司

下属分级基金的基金名称 招商制造业转型灵活配置混合型证券投资基金

下属分级基金的交易代码 001699

报告期末下属分级基金的份额总额 944,013,967.19份

单位:人民币元

3.1 主要财务指标

报告期(2018年4月1日-2018年6月30日)

年初至报告期期末 3,114,100.03元 1,416.05

本期利润 -104,719,314.04元 -4,197.47

加权平均基金份额本期利润 -0.0323 -0.0064

期末可供分配基金份额利润 106,177,747.40元 11,194.26

注:1.以上基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际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

招商制造业转型灵活配置混合型证券投资基金

阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 收益率差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -10.46% 1.26% -5.62% 0.60% -4.94% 0.67%

招商制造业混合C

阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 收益率差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -10.06% 1.20% -5.62% 0.60% -4.04% 0.68%

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:1.以上基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际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.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。

本报告期从2018年4月1日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 招商制造业转型灵活配置混合型证券投资基金

基金代码 001699

交易代码 001699

基金运作方式 到期开放型

基金合同生效日 2016年10月14日

报告期末基金份额总额 67,062,224.00份

单位:人民币元

3.1 主要财务指标

报告期(2018年4月1日-2018年6月30日)

年初至报告期期末 -72,000,792.22元 -0.0896

加权平均基金份额本期利润 0.0003

期末可供分配基金份额利润 923,121,000.00元 0.0001

注:1.以上基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际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.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。

本报告期从2018年4月1日起至2018年6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 招商制造业转型灵活配置混合型证券投资基金

基金代码 001699

交易代码 001699

基金运作方式 到期开放型

基金合同生效日 2016年10月14日

报告期末基金份额总额 67,062,224.00份

单位:人民币元

3.1 主要财务指标

报告期(2018年4月1日-2018年6月30日)

年初至报告期期末 -97,000,690.00元 -0.0896

加权平均基金份额本期利润 0.0003

期末可供分配基金份额利润 64,674,071.26元 0.0062

注:1.以上基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际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.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。

本报告期从2018年4月1日起至2018年6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 招商制造业转型灵活配置混合型证券投资基金

基金代码 001699

交易代码 001699

基金运作方式 到期开放型

基金合同生效日 2016年10月14日

报告期末基金份额总额 67,062,224.00份

单位:人民币元

3.1 主要财务指标

报告期(2018年4月1日-2018年6月30日)

年初至报告期期末 -373,046.19元 -0.0896

加权平均基金份额本期利润 0.0003

期末可供分配基金份额利润 64,674,071.26元 0.0062

注:1.以上基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际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.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。

本报告期从2018年4月1日起至2018年6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 招商制造业转型灵活配置混合型证券投资基金

基金代码 001699

交易代码 001699

基金运作方式 到期开放型

基金合同生效日 2016年10月14日

报告期末基金份额总额 67,062,224.00份

单位:人民币元

3.1 主要财务指标

报告期(2018年4月1日-2018年6月30日)

年初至报告期期末 -359,599.36元 -0.0896

加权平均基金份额本期利润 0.0003

期末可供分配基金份额利润 64,674,071.26元 0.0062

注:1.以上基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际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.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。

本报告期从2018年4月1日起至2018年6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 招商制造业转型灵活配置混合型证券投资基金

基金代码 001699

交易代码 001699

基金运作方式 到期开放型

基金合同生效日 2016年10月14日

报告期末基金份额总额 67,062,224.00份

单位:人民币元

3.1 主要财务指标

报告期(2018年4月1日-2018年6月30日)

年初至报告期期末 -373,046.19元 -0.0896

加权平均基金份额本期利润 0.0003

期末可供分配基金份额利润 64,674,071.26元 0.0062

注:1.以上基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际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.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。

本报告期从2018年4月1日起至2018年6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 招商制造业转型灵活配置混合型证券投资基金

基金代码 001699

交易代码 001699

基金运作方式 到期开放型

基金合同生效日 2016年10月14日

报告期末基金份额总额 67,062,224.00份

单位:人民币元

3.1 主要财务指标

报告期(2018年4月1日-2018年6月30日)

年初至报告期期末 -373,046.19元 -0.0896

加权平均基金份额本期利润 0.0003

期末可供分配基金份额利润 64,674,071.26元 0.0062

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