信达澳银转型创新股票型证券投资基金

2018年第三季度报告

基金管理人:信达澳银基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2018年10月24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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月23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2018年7月01日起至2018年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	信达澳银转型创新股票
基金主代码	001105
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年04月15日
报告期末基金份额总额	789,848,552.91份
投资目标	在有效控制风险的前提下,深度挖掘企业转型创新过程中产生的各类投资机遇,力争在中长期为投资者获取超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金采取自上而下和自下而上相结合的积极主动的投资策略,并对投资组合进行动态调整。由于本基金为股票型基金,核心投资策略为股票精选策略,同时辅以资产配置策略优化投资组合的风险收益,提升投资组合回报。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×85%+上证国债指数收益率×15%
风险收益特征	本基金是股票型基金,长期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金,属于风险及预期收益较高的证券投资基金产品。
基金管理人	信达澳银基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§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(2018年07月01日 – 2018年09月30日)
1.本期已实现收益	–32,105,835.38
2.本期利润	–38,312,095.07
3.加权平均基金份额本期利润	–0.0483
4.期末基金资产净值	508,706,953.85
5.期末基金份额净值	0.644

注:1、上述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用(例如,开放式基金的认购、申购及赎回费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

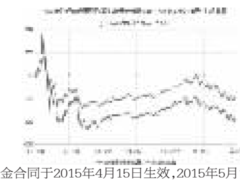
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

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	–6.94%	1.44%	–1.54%	1.16%	–5.40%	0.28%

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、本基金基金合同于2015年4月15日生效,2015年5月18日开始办理申购、赎回业务。

2、本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例为80%–95%,其中投资于本基金定义的转型创新主题相关的股票资产占非现金基金资产的比例不低于80%;债券(含中小企业私募债、可转换债券等)资产、现金、货币市场工具、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例为5%–20%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%;权证的投资比例不超过基金资产净值的3%;资产支持证券的投资比例不超过基金资产净值的20%。本基金按规定在合同生效后六个月内达到上述规定的投资比例。

§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		
冯士祯	本基金的基金经理、中小盘混合基金的基金经理、新目标混合基金的基金经理、新财富混合基金的基金经理	2016–09–14	–	7年	北京大学金融学硕士。2011年7月加入信达澳银基金公司,历任研究咨询部研究员、信达澳银精华灵活配置混合基金基金经理助理、信达澳银消费优选混合基金基金经理助理,现任领先增长混合基金基金经理(2015年5月9日起至2017年7月7日)、信达澳银中小盘混合基金基金经理(2015年7月1日起至今)、信达澳银消费优选混合基金基金经理(2015年8月19日起至2017年7月7日)、信达澳银转型创新股票基金基金经理(2016年9月14日起至今)、信达澳银新目标混合基金基金经理(2016年10月19日起至今)、信达澳银新财富混合基金基金经理(2016年11月10日起至今)。

注:1、基金经理的任职日期、离任日期为根据公司决定确定的任职或离任日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会从业人员资格管理办法的相关规定等。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产,在严格控制投资风险的基础上,为基金持有人谋求最大利益,没有发生损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人已经建立了投资决策及交易内控制度,确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合,维护投资者的利益。本基金管理人建立了严谨的公平交易机制,确保不同基金在买卖同一证券时,按照比例分配的原则在各基金间公平分配交易量。公司对报告期内公司所管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别(股票、债券)的收益率差异进行了分析;利用数据统计和重点审查价差原因相结合的方法,对连续四个季度内、不同时间窗口(日内、3日内、5日内)公司管理的不同投资组合同向交易价差进行了分析;对部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易进行了审核和监控,未发现公司所管理的投资组合存在违反公平交易原则的情形。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为,报告期内本公司所管理的投资组合未发生交易所公开竞价的同日反向交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

受到国内经济展望下行、外部环境恶化、国家政策托底等多重因素影响,三季度股票市场震荡向下并呈现出巨大的分化,上证综指基本持平,而深圳成指、创业板指分别下跌10.4%和12.2%,行业上金融、石油石化、建筑、钢铁等行业取得不错的正收益,而电子、医药、轻工等下跌超过10%。转型创新基金三季度保持较低仓位和适度均衡的配置,持有金融地产、食品饮料、医药、通信等行业,因重点持有的医药跌幅较大,单季度净值回撤6.9%,整体表现平平。

尽管中长期风险一直没有解除,包括全球经济放缓和贸易战带来出口压力、房地产走弱等,但短期政策面暖风频吹,考虑到市场下跌的幅度和时间,基金管理人认为当前股市处于底部区域。转型创新基金计划保持中性仓位和适当均衡的配置,积极寻找经济中结构性机会,继续重点配置高景气度的消费股、增长和估值匹配的成长股。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,本基金份额净值为0.644元,份额累计净值为0.644元,本报告期内,基金份额净值增长率为–6.94%,同期业绩比较基准收益率为–1.54%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	423,892,048.20	82.96
	其中:股票	423,892,048.20	82.96
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	–	–
	其中:债券	–	–
	资产支持证券	–	–
4	贵金属投资	–	–
5	金融衍生品投资	–	–
6	买入返售金融资产	–	–
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	–	–
7	银行存款和结算备付金合计	86,787,049.09	16.99
8	其他资产	282,945.61	0.06
9	合计	510,962,042.90	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	–	–
B	采矿业	–	–
C	制造业	284,375,695.20	55.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	18,397,400.00	3.62
G	交通运输、仓储和邮政业	–	–
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	16,112,000.00	3.17
J	金融业	58,384,000.00	11.48
K	房地产业	12,150,000.00	2.39
L	租赁和商务服务业	8,162,400.00	1.60
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	–	–
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	2,948,053.00	0.58
R	文化、体育和娱乐业	23,362,500.00	4.59
S	综合	–	–
	合计	423,892,048.20	83.33

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	601288	农业银行	7,000,000	27,230,000.00	5.35
2	300144	宋城演艺	1,050,000	23,362,500.00	4.59
3	601398	工商银行	3,800,000	21,926,000.00	4.31
4	600519	贵州茅台	30,000	21,900,000.00	4.31
5	002304	洋河股份	170,000	21,760,000.00	4.28
6	000661	长春高新	88,000	20,856,000.00	4.10
7	002223	鱼跃医疗	1,050,000	19,519,500.00	3.84
8	000963	华东医药	380,000	15,952,400.00	3.14
9	600872	中炬高新	460,000	14,996,000.00	2.95
10	002262	恩华药业	1,049,866	14,645,630.70	2.88

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券。

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

注:本基金本报告期末未持有债券。

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十名资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

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权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

注:本基金未参与投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

注:本基金未参与投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

注:本基金未参与投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体报告期内被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形及相关投资决策程序说明。

(1) 农业银行(601288)

农业银行于2018年5月收到证监会关于公司浙江、河北、陕西等分行未及时扣税、缴税的处罚决定。基金管理人分析认为,在监管机构的指导下,公司充分认识到了内部控制的不完善,已经着手进行积极整改。基金管理人经审慎分析,认为该事件对公司的经营和价值不会构成重大影响。

(2)长春高新(000661)

长春高新于2017年10月27日收到敦化市公安局对长春高新控股子公司吉林华康药业股份有限公司、金某某、张某某涉嫌生产、销售假药罪立案侦查。2011年至2013年期间,公司控股子公司吉林华康药业股份有限公司存在未报经原文号批准部门审核批准,改变生产工艺,用中药提取物“芦丁”替代“槐花”入药的违规行为,生产“血栓心脉宁片”和“血栓心脉宁胶囊”共计767批次,销售金额计420,014,307.86元。延边州食药监局对此进行调查时,前述产品均已在市场销售且部分已过效期。2013年10月25日,延边州食药监局将案件移交延边州公安局,延边州公安局于2014年1月3日指定敦化市公安局侦查。基金管理人经审慎分析,公司持有华康药业股权比例低,且事件已过去多年,对公司目前经营基本无影响。

(3)宋城演艺(300144)

宋城演艺(300144)2018年6月6日收到创业板公司管理部关注函,主要是对该公司2018年5月29日举行投资者交流会时发表的关于公司利润方面言论表示关注,同时要求该公司就相关事项进行核实并作出说明。

基金管理人分析认为,该公司在收到关注函后,对创业板公司管理部关注事项一一进行了解答回复,并于2018年6月6日进行了公告;同时认识对信息披露规则、制度和工作等方面存在学习与执行未到位的情形。该公司将采取措施进一步加强公司董事、监事、高级管理人员和涉及公司对外信息的部门与人员对相关法律法规的学习,依法依规对涉及上市公司法定或敏感信息按“三公”原则披露,保证有关信息的客观、真实和准确,做好信息披露工作。截至目前,基金管理人经审慎分析,认为该关注函对公司经营和价值应不会构成重大影响。

除农业银行(601288)、长春高新(000661)、宋城演艺(300144)外,其余的本基金投资的前十名证券的发行主体报告期内没有被监管部门立案调查,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 本基金投资的前十名股票中,没有投资超出基金合同规定备选股票库的情形

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	241,999.64
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	27,054.24
5	应收申购款	13,891.73
6	其他应收款	–
7	其他	–
8	合计	282,945.61

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	800,329,811.33
报告期期间基金总申购份额	2,663,101.77
减:报告期期间基金总赎回份额	13,144,360.19
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“–”填列)	–
报告期期末基金份额总额	789,848,552.91

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	14,162,889.52
报告期期间买入/申购总份额	–
报告期期间卖出/赎回总份额	–
报告期期末管理人持有的本基金份额	14,162,889.52
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	1.79

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:基金管理人本报告期未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

注:本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会核准基金募集的文件;
2、《信达澳银转型创新股票型证券投资基金基金合同》;
3、《信达澳银转型创新股票型证券投资基金托管协议》;
4、法律意见书;
5、基金管理人业务资格批件、营业执照;
6、基金托管人业务资格批件、营业执照;
7、本报告期内公开披露的基金资产净值、基金份额净值及其他临时公告。

9.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

9.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公场所、营业场所及网站免费查阅备查文件。在支付工本费后,投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

信达澳银基金管理有限公司
2018年10月24日

信达澳银健康中国灵活配置混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

基金管理人:信达澳银基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2018年10月24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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月23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2018年07月01日起至2018年09月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	信达澳银健康中国混合
基金主代码	003291
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年08月18日
报告期末基金份额总额	205,865,916.75份
投资目标	在有效控制组合风险并保持良好流动性的前提下,本基金通过股票与债券等资产的合理配置,并优选健康中国主题相关的优秀上市公司进行投资,力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金的投资策略主要包括资产配置策略和个股选择策略两部分。其中,资产配置策略主要是通过对宏观经济周期运行规律的研究,动态调整大类资产配置比例,以争取规避系统性风险。个股选择策略采用定性与定量相结合的方式,对健康中国主题上市公司的投资价值进行综合评估,精选具有较强竞争优势的上市公司作为投资标的。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%
风险收益特征	本基金是混合型基金产品,其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金,低于股票型基金,属于中高预期收益和预期风险水平的投资品种。
基金管理人	信达澳银基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§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(2018年07月01日 – 2018年09月30日)
1.本期已实现收益	–6,311,584.14
2.本期利润	–16,215,509.28
3.加权平均基金份额本期利润	–0.0771
4.期末基金资产净值	193,662,828.41
5.期末基金份额净值	0.941

注:1、上述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用(例如,开放式基金的认购、申购及赎回费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

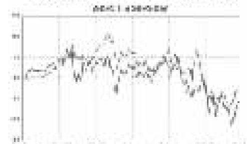
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

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	–7.75%	1.41%	–0.75%	0.82%	–7.00%	0.59%

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、本基金基金合同于2017年8月18日生效,2017年9月21日开始办理申购、赎回业务。

2、本基金的投资组合比例为:股票等权益类资产占基金资产的比例为0%–95%,其中投资于本基金定义的健康中国主题相关的证券资产不低于基金非现金资产的80%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%;股指期货、权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。本基金按规定在合同生效后六个月内达到上述规定的投资比例。

§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		
曾国富	本基金的基金经理、产业升级混合、消费优选混合的基金经理、权益投资总部副总监	2017年8月18日	–	19年	上海财经大学管理学硕士。1994年至2005年历任深圳大华会计师事务所审计部经理,大鹏证券有限责任公司投资银行部业务董事、内部审核委员会委员,平安证券有限责任公司资本市场事业部业务总监、内部审核委员会委员,国海富兰克林基金管理有限公司研究分析部分析员。2006年9月加入信达澳银基金,历任高级分析师、投资副总监、投资研究部下股票投资部总经理、研究副总监、研究总监、公募投资总部副总监、权益投资总部副总监,信达澳银精华配置混合基金基金经理(2008年7月30日至2011年12月16日)、信达澳银红利回报混合基金基金经理(2010年7月28日至2011年12月16日)、信达澳银中小盘混合基金基金经理(2009年12月1日至2014年2月22日)、信达澳银产业升级混合基金基金经理(2015年2月14日起至今)、信达澳银健康中国灵活配置混合型基金基金经理(2017年8月18日起至今)、信达澳银消费优选混合型基金基金经理(2018年3月8日起至今)
李朝伟	本基金的基金经理、领先增长混合基金的基金经理	2017年8月18日	–	7年	复旦大学经济学硕士。2011年7月至2013年7月在平安大华基金管理有限公司,任行业研究员;2013年7月至2015年4月在上投摩根基金管理有限公司,任研究员;2015年4月至2015年11月在大成基金管理有限公司,任基金经理助理;2015年11月加入信达澳银基金公司,历任股票投资部高级研究员、信达澳银精华灵活配置混合基金基金经理(2016年1月8日起至2017年12月30日)、信达澳银领先增长混合基金基金经理(2016年5月11日起至今)、信达澳银健康中国灵活配置混合型基金(2017年8月18日起至今)

注:1、基金经理的任职日期、离任日期为根据公司决定确定的任职或离任日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会从业人员资格管理办法的相关规定等。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产,在严格控制投资风险的基础上,为基金持有人谋求最大利益,没有发生损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人已经建立了投资决策及交易内控制度,确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合,维护投资者的利益。本基金管理人建立了严谨的公平交易机制,确保不同基金在买卖同一证券时,按照比例分配的原则在各基金间公平分配交易量。公司对报告期内公司所管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别(股票、债券)的收益率差异进行了分析;利用数据统计和重点审查价差原因相结合的方法,对连续四个季度内、不同时间窗口(日内、3日内、5日内)公司管理的不同投资组合同向交易价差进行了分析;对部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易进行了审核和监控,未发现公司所管理的投资组合存在违反公平交易原则的情形。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为,报告期内本公司所管理的投资组合未发生交易所公开竞价的同日反向交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2018年三季度,A股在内外部不利因素下继续抵抗式下跌。大小盘风格有所分化,代表新兴产业的云计算、自主可控、半导体等细分领域表现较好,受消费不振影响的大消费行业表现低迷。回顾市场表现的原因,主要来自内外部因素的负面冲击。内部方面,市场对改革决心有所疑虑,信心受挫,同时人民币经历一波较大幅度贬值。外部方面,贸易战继续升级,压制市场风险偏好。

本基金主要仓位集中在医药生物、食品饮料等与健康相关的消费行业。由于三季度爆发了毒疫苗事件,对本基金持仓较多的医疗板块造成负面冲击,使得净值受损较大。

展望四季度,经历这一波下跌后不少新兴行业的龙头公司估值已与其成长性匹配,持有一定时间相信会有较可观的收益。具体到投资方向上,仍然集中在医药生物、食品饮料、社会服务等健康消费类行业。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为0.941元,份额累计净值为0.941元;本报告期内,基金份额净值增长率为–7.75%,同期业绩比较基准收益率为–0.75%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	126,083,102.31	59.66
	其中:股票	126,083,102.31	59.66
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	–	–
	其中:债券	–	–
	资产支持证券	–	–
4	贵金属投资	–	–
5	金融衍生品投资	–	–
6	买入返售金融资产	14,500,000.00	6.86
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	–	–
7	银行存款和结算备付金合计	70,641,560.85	33.43
8	其他资产	115,914.21	0.05
9	合计	211,340,577.37	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	–	–
B	采矿业	1,199,008.00	0.62
C	制造业	86,007,208.01	44.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	19,772,810.89	10.21
G	交通运输、仓储和邮政业	811,026.00	0.42
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,566,217.64	1.84
J	金融业	1,347,291.00	0.70
K	房地产业	–	–
L	租赁和商务服务业	2,117,598.64	1.09
M	科学研究和技术服务业	1,841,745.00	0.95
N	水利、环境和公共设施管理业	–	–
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	6,011,939.13	3.10
R	文化、体育和娱乐业	3,408,258.00	1.76
S	综合	–	–
	合计	126,083,102.31	65.10

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	000661	长春高新	56,473	13,384,101.00	6.91
2	603939	益丰药房	155,869	8,954,674.05	4.62
3	300003	乐普医疗	284,982	8,649,203.70	4.47
4	600276	恒瑞医药	130,220	8,268,970.00	4.27
5	600436	片仔癀	76,490	7,745,377.40	4.00
6	601933	永辉超市	865,300	7,052,195.00	3.64
7	600519	贵州茅台	9,077	6,626,210.00	3.42
8	300122	智飞生物	133,737	6,547,763.52	3.38
9	600085	同仁堂	192,824	6,122,162.00	3.16
10	300529	健帆生物	134,203	5,857,960.95	3.02

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券。

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

注:本基金本报告期末未持有债券。

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十名资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

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权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

注:本基金未参与投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

注:本基金未参与投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

注:本基金未参与投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体报告期内被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形及相关投资决策程序说明。

(1)同仁堂(600085)

同仁堂于2018年1月29日收到国家食品药品监督管理局整改通知。同仁堂科技根据前述食药总局关于该批次产品不合格的通告,本着对消费者负责的态度,已对该批次产品实施召回,并全力配合药监部门的相关工作,积极采取措施,坚决杜绝类似事件再次发生。同仁堂科技生产的开胸顺气丸,2016年度销售收入为人民币1,316万元,占本公司2016年度经审计营业收入人民币1,209,074万元的0.11%;预计2017年度该产品销售收入占本公司营业收入的比例不会发生较大变化。经基金管理人分析,本次事件所致相关产品召回不影响公司正常经营和投资价值。

(2)长春高新(000661)

长春高新于2017年10月27日收到敦化市公安局对长春高新控股子公司吉林华康药业股份有限公司、金某某、张某某涉嫌生产、销售假药罪立案侦查。2011年至2013年期间,公司控股子公司吉林华康药业股份有限公司存在未报经原文号批准部门审核批准,改变生产工艺,用中药提取物“芦丁”替代“槐花”入药的违规行为,生产“血栓心脉宁片”和“血栓心脉宁胶囊”共计767批次,销售金额计420,014,307.86元。延边州食药监局对此进行调查时,前述产品均已在市场销售且部分已过效期。2013年10月25日,延边州食药监局将案件移交延边州公安局,延边州公安局于2014年1月3日指定敦化市公安局侦查。基金管理人经审慎分析,公司持有华康药业股权比例低,且事件已过去多年,对公司目前经营基本无影响。

除同仁堂(600085)、长春高新(000661)外,其余的本基金投资的前十名证券的发行主体报告期内没有被监管部门立案调查,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 本基金投资的前十名股票中,没有投资超出基金合同规定备选股票库的情形。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	100,923.36
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	10,915.24
5	应收申购款	4,075.61
6	其他应收款	–
7	其他	–
8	合计	115,914.21

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	223,056,894.14
报告期期间基金总申购份额	2,582,566.28
减:报告期期间基金总赎回份额	19,773,543.67
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“–”填列)	–
报告期期末基金份额总额	205,865,916.75

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注:基金管理人本报告期未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:基金管理人本报告期未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

注:本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

报告期期初基金份额总额

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会核准基金募集的文件;
2、《信达澳银健康中国灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;
3、《信达澳银健康中国灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;
4、法律意见书;
5、基金管理人业务资格批件、营业执照;
6、基金托管人业务资格批件、营业执照;
7、本报告期内公开披露的基金资产净值、基金份额净值及其他临时公告。

9.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

9.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公场所、营业场所及网站免费查阅备查文件。在支付工本费后,投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

信达澳银基金管理有限公司
2018年10月24日

招商中证白酒指数分级证券投资基金

2018年第三季度报告

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10月24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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月23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2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	招商中证白酒指数分级		
场内简称	白酒分级		
基金主代码	161725		
交易代码	161725		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2015年5月27日		
报告期末基金份额总额	5,733,943,989.19份		
投资目标	本基金进行被动式指数化投资,通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段,实现对标的指数的有效跟踪,获得与标的指数收益相似的回报。本基金的投资目标是保持基金净值收益率与业绩基准日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年跟踪误差不超过4%。		
投资策略	本基金以中证白酒指数为标的指数,采用完全复制法,按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合,进行被动式指数化投资。股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合复制标的指数,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整,以复制和跟踪标的指数。基金管理人将对成份股的流动性进行分析,如发现流动性欠佳的个股将可能采用基本面替代策略、相关性检验策略构造替代股组合。本基金管理人每日跟踪基金组合与标的指数表现的偏离度,每月末、季度末定期分析基金的实际组合与标的指数表现的累计偏离度、跟踪误差变化情况及其原因,并优化跟踪偏离度管理方案。可运用股指期货,以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。		
业绩比较基准	中证白酒指数收益率×95%+金融机构人民币活期存款基准利率(税后)×5%		
风险收益特征	本基金为股票型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征。		
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简称	招商中证白酒A	招商中证白酒B	招商中证白酒指数分级
下属分级基金的场内简称	白酒A	白酒B	白酒分级
下属分级基金的交易代码	150269	150270	161725
报告期末下属分级基金的份额总额	66,337,139.00份	66,337,140.00份	5,601,269,710.19份
下属分级基金的风险收益特征	招商中证白酒A份额具有低风险、收益相对稳定的特征。	招商中证白酒B份额具有高风险、高预期收益的特征。	本基金为股票型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征。

§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(2018年7月1日 – 2018年9月30日)
1.本期已实现收益	20,644,069.25
2.本期利润	–480,598,550.10
3.加权平均基金份额本期利润	–0.0895
4.期末基金资产净值	6,444,303,502.68
5.期末基金份额净值	1.1239

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

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	–8.63%	1.98%	–10.17%	2.00%	1.54%	–0.02%

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

§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		
侯昊	本基金基金经理	2017年8月22日	–	9	男,硕士。2009年7月加入招商基金管理有限公司,曾任风险管理部风控经理,量化投资部助理投资经理、投资经理,现任量化投资部副总监兼招商中证白酒指数分级证券投资基金、招商国证生物医药指数分级证券投资基金、招商深证100指数证券投资基金、招商央视财经50指数证券投资基金、招商中证大宗商品股票指数证券投资基金(LOF)、招商中证煤炭等权指数分级证券投资基金、招商中证银行指数分级证券投资基金基金经理。

注:1、本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日,后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告(生效)日期;

2、证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

基金管理人声明:在本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关法律法规及其各项实施准则的规定以及本基金的基金合同等基金法律文件的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的前提下,为基金持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作整体合法合规,无损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围以及投资运作符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

基金管理人已建立较完善的研究方法和投资决策流程,确保各投资组合享有公平的投资决策机会。基金管理人建立了所有组合适用的投资对象备选库,制定明确的备选库建立、维护程序。基金管理人拥有健全的投资授权制度,明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限划分,投资组合经理在授权范围内可以自主决策,超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。基金管理人的相关研究成果向内部所有投资组合开放,在投资研究层面不存在各投资组合间不公平的问题。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

基金管理人严格控制不同投资组合之间的同日反向交易,严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。确因投资组合的投资策略或流动性等需要而发生的同日反向交易,基金管理人要求相关投资组合经理提供决策依据,并留存记录备查,完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合等除外。

本报告期内,本基金各项交易均严格按照相关法律法规、基金合同的有关要求执行。报告期内,公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情形,在指数型投资组合与主动型投资组合之间发生过四次,原因是指数型投资组合为满足投资策略需要而发生反向交易。报告期内未发现有可能导致不公平交易和利益输送的重大异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内,国内经济增速放缓,货币政策偏松,受中美贸易战的影响,及国内金融严监管效应的持续,报告期内A股普跌,银行、非银金融、采掘、钢铁、国防军工五个行业获得正收益,其他行业收跌,其中家用电器、纺织服装、医药生物、电子、传媒跌幅居前。本基金的基准指数中证白酒指数报告期内跌10.75%。

关于本基金的运作,股票仓位维持在94.5%左右的水平,基本完成了对基准的跟踪。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金份额净值增长率为–8.63%,同期业绩基准增长率为–10.17%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内,本基金未发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	6,101,956,627.97	90.44
	其中:股票	6,101,956,627.97	90.44
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	–	–
	其中:债券	–	–
	资产支持证券	–	–
4	贵金属投资	–	–
5	金融衍生品投资	–	–
6	买入返售金融资产	–	–
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	–	–
7	银行存款和结算备付金合计	480,632,908.59	7.12
8	其他资产	164,380,323.25	2.44
9	合计	6,746,969,859.81	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位:人民币元

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	–	–
B	采矿业	–	–
C	制造业	6,101,832,250.41	94.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	–	–
G	交通运输、仓储和邮政业	–	–
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	–	–
J	金融业	–	–
K	房地产业	–	–
L	租赁和商务服务业	–	–
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	–	–
O	居民服务、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	6,101,832,250.41	94.69

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位:人民币元

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	–	–
B	采矿业	–	–
C	制造业	94,632.31	0.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,385.16	0.00
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	–	–
G	交通运输、仓储和邮政业	253.32	0.00
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	26,511.76	0.00
J	金融业	1,595.01	0.00
K	房地产业	–	–
L	租赁和商务服务业	–	–
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	–	–
O	居民服务、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	124,377.56	0.00

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

5.3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位:人民币元

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	600519	贵州茅台	1,376,344	1,004,731,120.00	15.59
2	002304	洋河股份	7,620,269	975,394,432.00	15.14
3	000858	五粮液	13,171,432	894,998,804.40	13.89
4	000568	泸州老窖	15,488,912	735,878,209.12	11.42
5	000860	顺鑫农业	9,021,144	411,364,166.40	6.38
6	603589	口子窖	6,770,706	348,691,359.00	5.41
7	600779	水井坊	7,719,518	315,728,286.20	4.90
8	600809	山西汾酒	5,861,457	277,188,301.53	4.30
9	603369	今世缘	11,328,762	226,575,240.00	3.52
10	000596	古井贡酒	2,599,112	216,324,091.76	3.36

5.3.2 报告期末积极投资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

金额单位:人民币元

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	002937	兴瑞科技	2,114	36,593.34	0.00
2	300749	顶固集创	1,317	30,857.31	0.00
3	300454	深信服	300	24,906.00	0.00
4	300748	金力永磁	2,008	22,810.88	0.00
5	300504	天邑股份	62	1,742.20	0.00

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金管理人可运用股指期货,以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,在风险可控的前提下,参与股指期货的投资,以改善组合的风险收益特性。本基金主要通过对现货和期货市场运行趋势的研究,结合股指期货定价模型寻求其合理估值水平,采用流动性好、交易活跃的期货合约,达到有效跟踪标的指数的目的。此外,本基金还将运用股指期货来对冲特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理,如预期大额申购赎回、大量分红等,以及对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

根据本基金合同规定,本基金不参与国债期货交易。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

根据本基金合同规定,本基金不参与国债期货交易。

5.10.3 本期国债期货投资评价

根据本基金合同规定,本基金不参与国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未有被监管部门立案调查,不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库,本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

5.11.3 其他资产构成

金额单位:人民币元

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	987,587.11
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	96,315.32
5	应收申购款	163,296,420.82
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	164,380,323.25

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	招商中证白酒A	招商中证白酒B	招商中证白酒指数分级
报告期期初基金份额总额	63,577,701.00	63,577,702.00	4,272,648,059.28
报告期期间基金总申购份额	–	–	4,594,892,999.74
减:报告期期间基金总赎回份额	–	–	3,260,752,472.83
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"–"填列)	2,759,438.00	2,759,438.00	–5,518,876.00
报告期期末基金份额总额	66,337,139.00	66,337,140.00	5,601,269,710.19

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证券监督管理委员会批准设立招商基金管理有限公司的文件;
2、中国证券监督管理委员会批准招商中证白酒指数分级证券投资基金设立的文件;
3、《招商中证白酒指数分级证券投资基金基金合同》;
4、《招商中证白酒指数分级证券投资基金托管协议》;
5、《招商中证白酒指数分级证券投资基金招募说明书》;
6、基金管理人业务资格批件、营业执照。

8.2 存放地点

招商基金管理有限公司
地址:中国深圳深南大道7088号招商银行大厦

8.3 查阅方式

上述文件可在招商基金管理有限公司互联网站上查阅,或者在营业时间内到招商基金管理有限公司查阅。

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人招商基金管理有限公司。

客户服务中心电话:400–887–9555

网址:http://www.cmfchina.com

招商基金管理有限公司
2018年10月24日