

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
报告送出日期:2015年10月24日
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。
本基金在银行间市场进行交易,因此本基金管理人将根据《银行间债券市场交易流通规则》,在银行间债券市场进行交易,并根据该规则的规定披露信息。
基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人以及代销机构应当保证向基金份额持有人提供查阅或者复制本报告的途径。
本报告由基金管理人于2015年10月24日编制。

§ 2 基金产品概况

基金简称	招商中证白酒指数分级证券投资基金	
场内简称	白酒分级	
基金代码	161726	
交易代码	161726	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年6月27日	
报告期末基金份额总额	421,409,566.25份	
投资目标	本基金通过量化分析,通过严格的纪律控制和数据化的风险管理手段,实现对投资组合的有效管理,执行科学的资产配置,并结合对白酒行业的深入研究,把握白酒行业的投资机会,力争在风险调整后收益方面超越业绩基准。	
投资策略	本基金主要通过量化分析,实现完全复制法,按照所选的指数成分股及其权重和基金净值表现与基准指数的偏离度对组合的相对值不超过0.5%。年跟踪误差不超过4%。	
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%	
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	
下属分级基金简称	招商中证白酒A(场内简称:白酒A) 招商中证白酒B(场内简称:白酒B)	
下属分级基金交易代码	161726	
下属分级基金报告期基金总额	66,098,146.00份 289,243,966.37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。 本基金为招商白酒基金,具有低风险,较高预期收益的特征。	
§ 3 主要财务指标	基金净值表现	
主要财务指标	报告期:2015年7月1日 - 2015年9月30日	
1.本期已实现收益	-147,506,437.32	
2.本期利润	-292,217,491.98	
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0598	
4.期末基金份额净值	300,429,709.30	
5.期末基金份额净值	0.713	
注:本基金业绩报酬不包括持有认购或申购本基金的费用,计入费用后实际收益水平将低于业绩报酬。	本基金在银行间市场进行交易,因此本基金管理人将根据《银行间债券市场交易流通规则》,在银行间债券市场进行交易,并根据该规则的规定披露信息。	
3.2 基本情况	报告期未发生新增基金合同持有人的情况。	
3.3 主要财务指标	报告期未发生新增基金合同持有人的情况。	
3.4 资产负债情况	报告期未发生新增基金合同持有人的情况。	
3.5 主要财务指标	报告期未发生新增基金合同持有人的情况。	
3.6 基金净值表现	报告期未发生新增基金合同持有人的情况。	
3.7 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	报告期未发生新增基金合同持有人的情况。	
3.8 基金投资组合报告	报告期未发生新增基金合同持有人的情况。	
3.9 基金管理人对报告期内基金运作的总体评价	报告期未发生新增基金合同持有人的情况。	
3.10 基金管理人对宏观经济、证券市场及基金行业未来的简要展望	报告期未发生新增基金合同持有人的情况。	
3.11 其他需要说明的事项	报告期未发生新增基金合同持有人的情况。	

[2015] 第 三 季 度 报 告

招 商 中 证 白 酒 指 数 分 级 证 券 投 资 基 金

报告期:2015年7月1日 - 2015年9月30日

报告期:2015年7月1日 - 2015年9月