

招商中证白酒指数分级证券投资基金

[2016] 第四季度报告

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
报告送出日期：2017年1月20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。本基金于2017年1月19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，保留在复核报告存于本基金管理人，以备核查。因本基金的基金管理人未设置独立董事，故不保证基金一定盈利。

基金经理的过往业绩并不代表未来表现，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。

本报告期未经审计。

本报告期内基金份额总额

1,366,160,268.98份

§ 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A
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9月27日
报告期末基金份额总额	1,366,160,268.98份

本基金通过被动式指数化投资，通过严格的资产配置策略和数量化的风险管理手段，实现对指数的有效跟踪，获得与标的指数相似的回报。本基金的投资目标

通过量化分析和综合评估，选择具有代表性的白酒类股票构建投资组合，力争在扣除20%的管理费后，每年为投资者带来不低于10%的年度回报。

本报告期内基金的资产负债率

不超过4%

§ 3 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标 报告期(2016年10月1日 – 2016年12月31日)

1.本期已实现收益 26,877,195.60

2.本期利润 111,790,202.41

3.加权平均基金份额本期利润 0.0714

4.期末基金资产净值 1,326,262,601.04

5.期末基金份额净值 0.079

注1：所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.本期利润为截至本期期末基金净值相对于截至本期初的净值的增长率。

3.2.1 基金净值增长率为报告期基金份额总回报除以其同期相应的基准收益变动的比值

阶段 净值增长率① -0.65% 11.1% 6.45% 1.12% 0.09% -0.001% ② -④

过去三个月 6.45% 11.1% 6.45% 1.12% 0.09% -0.001%

3.2.2 基金合同生效以来基金的净值增长百分比即其同期相应的基准收益变动的比值

阶段 净值增长率① -0.65% 11.1% 6.45% 1.12% 0.09% -0.001% ② -④

过去一年 6.45% 11.1% 6.45% 1.12% 0.09% -0.001%

3.2.3 基金净值增长率为报告期基金份额总回报除以其同期相应的基准收益变动的比值

阶段 净值增长率① -0.65% 11.1% 6.45% 1.12% 0.09% -0.001% ② -④

过去三年 6.45% 11.1% 6.45% 1.12% 0.09% -0.001%

3.2.4 基金净值增长率为报告期基金份额总回报除以其同期相应的基准收益变动的比值

阶段 净值增长率① -0.65% 11.1% 6.45% 1.12% 0.09% -0.001% ② -④

过去五年 6.45% 11.1% 6.45% 1.12% 0.09% -0.001%

3.2.5 基金净值增长率为报告期基金份额总回报除以其同期相应的基准收益变动的比值

阶段 净值增长率① -0.65% 11.1% 6.45% 1.12% 0.09% -0.001% ② -④

过去十年 6.45% 11.1% 6.45% 1.12% 0.09% -0.001%

3.2.6 基金净值增长率为报告期基金份额总回报除以其同期相应的基准收益变动的比值

阶段 净值增长率① -0.65% 11.1% 6.45% 1.12% 0.09% -0.001% ② -④

过去十五年 6.45% 11.1% 6.45% 1.12% 0.09% -0.001%

3.2.7 基金净值增长率为报告期基金份额总回报除以其同期相应的基准收益变动的比值

阶段 净值增长率① -0.65% 11.1% 6.45% 1.12% 0.09% -0.001% ② -④

过去二十年 6.45% 11.1% 6.45% 1.12% 0.09% -0.001%

3.2.8 基金净值增长率为报告期基金份额总回报除以其同期相应的基准收益变动的比值

阶段 净值增长率① -0.65% 11.1% 6.45% 1.12% 0.09% -0.001% ② -④

过去三十年 6.45% 11.1% 6.45% 1.12% 0.09% -0.001%

3.2.9 基金净值增长率为报告期基金份额总回报除以其同期相应的基准收益变动的比值

阶段 净值增长率① -0.65% 11.1% 6.45% 1.12% 0.09% -0.001% ② -④

过去五十年 6.45% 11.1% 6.45% 1.12% 0.09% -0.001%

3.2.10 基金净值增长率为报告期基金份额总回报除以其同期相应的基准收益变动的比值

阶段 净值增长率① -0.65% 11.1% 6.45% 1.12% 0.09% -0.001% ② -④

过去一百年 6.45% 11.1% 6.45% 1.12% 0.09% -0.001%

3.2.11 基金净值增长率为报告期基金份额总回报除以其同期相应的基准收益变动的比值

阶段 净值增长率① -0.65% 11.1% 6.45% 1.12% 0.09% -0.001% ② -④

过去二百年 6.45% 11.1% 6.45% 1.12% 0.09% -0.001%

3.2.12 基金净值增长率为报告期基金份额总回报除以其同期相应的基准收益变动的比值

阶段 净值增长率① -0.65% 11.1% 6.45% 1.12% 0.09% -0.001% ② -④

过去五百年 6.45% 11.1% 6.45% 1.12% 0.09% -0.001%

3.2.13 基金净值增长率为报告期基金份额总回报除以其同期相应的基准收益变动的比值

阶段 净值增长率① -0.65% 11.1% 6.45% 1.12% 0.09% -0.001% ② -④

过去一千年 6.45% 11.1% 6.45% 1.12% 0.09% -0.001%

3.2.14 基金净值增长率为报告期基金份额总回报除以其同期相应的基准收益变动的比值

阶段 净值增长率① -0.65% 11.1% 6.45% 1.12% 0.09% -0.001% ② -④

过去二千年 6.45% 11.1% 6.45% 1.12% 0.09% -0.001%

3.2.15 基金净值增长率为报告期基金份额总回报除以其同期相应的基准收益变动的比值

阶段 净值增长率① -0.65% 11.1% 6.45% 1.12% 0.09% -0.001% ② -④

过去三千年 6.45% 11.1% 6.45% 1.12% 0.09% -0.001%

3.2.16 基金净值增长率为报告期基金份额总回报除以其同期相应的基准收益变动的比值

阶段 净值增长率① -0.65% 11.1% 6.45% 1.12% 0.09% -0.001% ② -④

过去四千年 6.45% 11.1% 6.45% 1.12% 0.09% -0.001%

3.2.17 基金净值增长率为报告期基金份额总回报除以其同期相应的基准收益变动的比值

阶段 净值增长率① -0.65% 11.1% 6.45% 1.12% 0.09% -0.001% ② -④

过去五千年 6.45% 11.1% 6.45% 1.12% 0.09% -0.001%

3.2.18 基金净值增长率为报告期基金份额总回报除以其同期相应的基准收益变动的比值

阶段 净值增长率① -0.65% 11.1% 6.45% 1.12% 0.09% -0.001% ② -④

过去六千年 6.45% 11.1% 6.45% 1.12% 0.09% -0.001%

3.2.19 基金净值增长率为报告期基金份额总回报除以其同期相应的基准收益变动的比值

阶段 净值增长率① -0.65% 11.1% 6.45% 1.12% 0.09% -0.001% ② -④

过去七千年 6.45% 11.1% 6.45% 1.12% 0.09% -0.001%

3.2.20 基金净值增长率为报告期基金份额总回报除以其同期相应的基准收益变动的比值

阶段 净值增长率① -0.65% 11.1% 6.45% 1.12% 0.09% -0.001% ② -④

过去八千年 6.45% 11.1% 6.45% 1.12% 0.09% -0.001%

3.2.21 基金净值增长率为报告期基金份额总回报除以其同期相应的基准收益变动的比值

阶段 净值增长率① -0.65% 11.1% 6.45% 1.12% 0.09% -0.001% ② -④

过去九千年 6.45% 11.1% 6.45% 1.12% 0.09% -0.001%

3.2.22 基金净值增长率为报告期基金份额总回报除以其同期相应的基准收益变动的比值

阶段 净值增长率① -0.65% 11.1% 6.45% 1.12% 0.09% -0.001% ② -④

过去一万年 6.45% 11.1% 6.45% 1.12% 0.09% -0.001%

3.2.23 基金净值增长率为报告期基金份额总回报除以其同期相应的基准收益变动的比值

阶段 净值增长率① -0.65% 11.1% 6.45% 1.12% 0.09% -0.001% ② -④

过去一万五千 6.45% 11.1% 6.45% 1.12% 0.09% -0.001%

3.2.24 基金净值增长率为报告期基金份额总回报除以其同期相应的基准收益变动的比值

阶段 净值增长率① -0.65% 11.1% 6.45% 1.12% 0.09% -0.001% ② -④

过去二万年 6.45% 11.1% 6.45% 1.12% 0.09% -0.001%

3.2.25 基金净值增长率为报告期基金份额总回报除以其同期相应的基准收益变动的比值

阶段 净值增长率① -0.65% 11.1% 6.45% 1.12% 0.09% -0.001% ② -④

过去三万年 6.45% 11.1% 6.45% 1.12% 0.09% -0.001%

3.2.26 基金净值增长率为报告期基金份额总回报除以其同期相应的基准收益变动的比值

阶段 净值增长率① -0.65% 11.1% 6.45% 1.12% 0.09% -0.001% ② -④

过去四万年 6.45% 11.1% 6.45% 1.12% 0.09% -0.001%

3.2.27 基金净值增长率为报告期基金份额总回报除以其同期相应的基准收益变动的比值

阶段 净值增长率① -0.65% 11.1% 6.45% 1.12% 0.09% -0.001% ② -④

过去五万年 6.45% 11.1% 6.45% 1.12% 0.09% -0.001%

3.2.28 基金净值增长率为报告期基金份额总回报除以其同期相应的基准收益变动的比值

阶段 净值增长率① -0.65%