

# 招商中证 1000 指数增强型证券投资基金 2017 年年度报告

2017 年 12 月 31 日

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 3 月 30 日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 3 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告财务资料已经审计，德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了 2017 年度无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2017 年 3 月 3 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>1</b>
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>4</b>
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>5</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	10
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	16
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	16
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>16</b>
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>18</b>
7.1 资产负债表.....	18
7.2 利润表.....	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	20
7.4 报表附注.....	21
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>43</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	43
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	43
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	44
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	56
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	58
8.6 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.....	58
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	58
8.8 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贵金属投资明细.....	58
8.9 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.....	58

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	58
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	58
8.12 投资组合报告附注.....	59
<b>§9 基金份额持有人信息.....</b>	<b>60</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	60
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	60
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	60
<b>§10 开放式基金份额变动.....</b>	<b>60</b>
<b>§11 重大事件揭示.....</b>	<b>61</b>
11.1 基金份额持有人大会决议.....	61
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	61
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	61
11.4 基金投资策略的改变.....	61
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	61
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	61
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	62
11.8 其他重大事件.....	64
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>66</b>
12.1 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.....	66
<b>§13 备查文件目录.....</b>	<b>67</b>
13.1 备查文件目录.....	67
13.2 存放地点.....	67
13.3 查阅方式.....	67

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	招商中证 1000 指数增强型证券投资基金	
基金简称	招商中证 1000 指数	
基金主代码	004194	
交易代码	004194	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 3 月 3 日	
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	
报告期末基金份额总额	167,979,226.37 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	招商中证 1000 指数 A	招商中证 1000 指数 C
下属分级基金的交易代码:	004194	004195
报告期末下属分级基金的份额总额	155,664,171.36 份	12,315,055.01 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型股票指数基金，通过数量化的投资方法与严格的投资纪律约束，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%，同时力求实现超越标的指数的业绩表现，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金为增强型指数产品，在标的指数成份股权重的基础上根据量化模型对行业配置及个股权重等进行主动调整，力争在控制跟踪误差的基础上获取超越标的指数的投资收益。具体包括： 1、股票投资策略； 2、债券投资策略； 3、股指期货投资策略； 4、国债期货投资策略； 5、权证投资策略； 6、资产支持证券投资策略； 7、融资及转融通证券出借业务投资策略。
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%。
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，属于较高风险、较高预期收益的基金品种，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		招商基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	潘西里	王永民
	联系电话	0755-83196666	010-66594896
	电子邮箱	cmf@cmfchina.com	fcid@bankofchina.com

客户服务电话	400-887-9555	95566
传真	0755-83196475	010-66594942
注册地址	深圳市福田区深南大道 7088 号	北京西城区复兴门内大街 1 号
办公地址	中国深圳深南大道 7088 号 招商银行大厦	北京西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	518040	100818
法定代表人	李浩	陈四清

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、证券时报、上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.cmfcchina.com">http://www.cmfcchina.com</a>
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）	中国上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼
注册登记机构	招商基金管理有限公司	中国深圳深南大道 7088 号招商银行大厦

## §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2017 年 3 月 3 日(基金合同生效日)-2017 年 12 月 31 日	
	招商中证 1000 指数 A	招商中证 1000 指数 C
本期已实现收益	-8,148,518.60	-192,705.51
本期利润	-11,889,528.37	-803,804.81
加权平均基金份额本期利润	-0.0773	-0.1904
本期加权平均净值利润率	-8.18%	-20.00%
本期基金份额净值增长率	-7.96%	-7.23%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末	
期末可供分配利润	-12,387,645.49	-890,427.44
期末可供分配基金份额利润	-0.0796	-0.0723
期末基金资产净值	143,276,525.87	11,424,627.57
期末基金份额净值	0.9204	0.9277
3.1.3 累计期末指标	2017 年末	
基金份额累计净值增长率	-7.96%	-7.23%

注：1、基金业绩指标不包括持有人认（申）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、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数；

4、本基金合同于 2017 年 3 月 3 日生效，截至 2017 年 12 月 31 日成立未满 1 年，故本报告期为非完整会计年度数据。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 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

招商中证 1000 指数 A

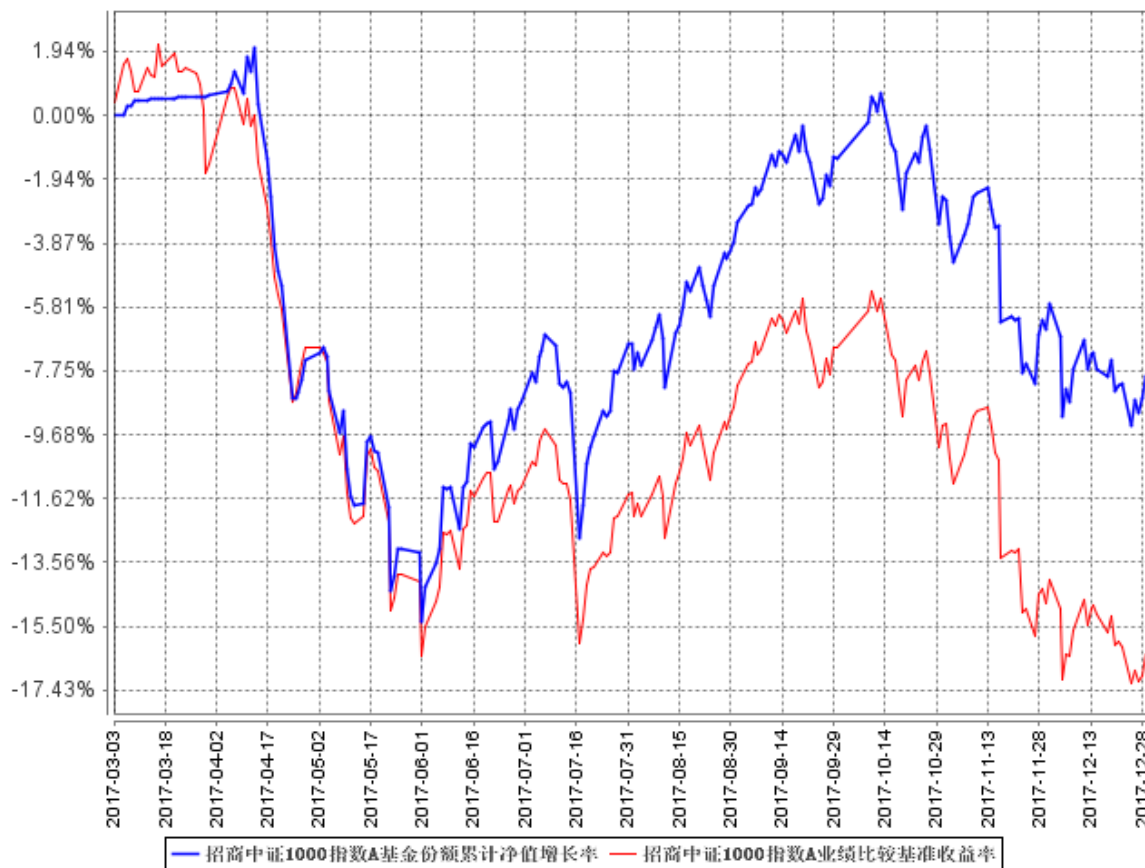
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-6.76%	0.93%	-10.01%	0.96%	3.25%	-0.03%
过去六个月	0.81%	0.93%	-5.68%	0.95%	6.49%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-7.96%	0.95%	-16.32%	0.97%	8.36%	-0.02%

招商中证 1000 指数 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	-6.84%	0.93%	-10.01%	0.96%	3.17%	-0.03%
过去六个月	1.99%	0.94%	-5.68%	0.95%	7.67%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-7.23%	0.95%	-16.32%	0.97%	9.09%	-0.02%

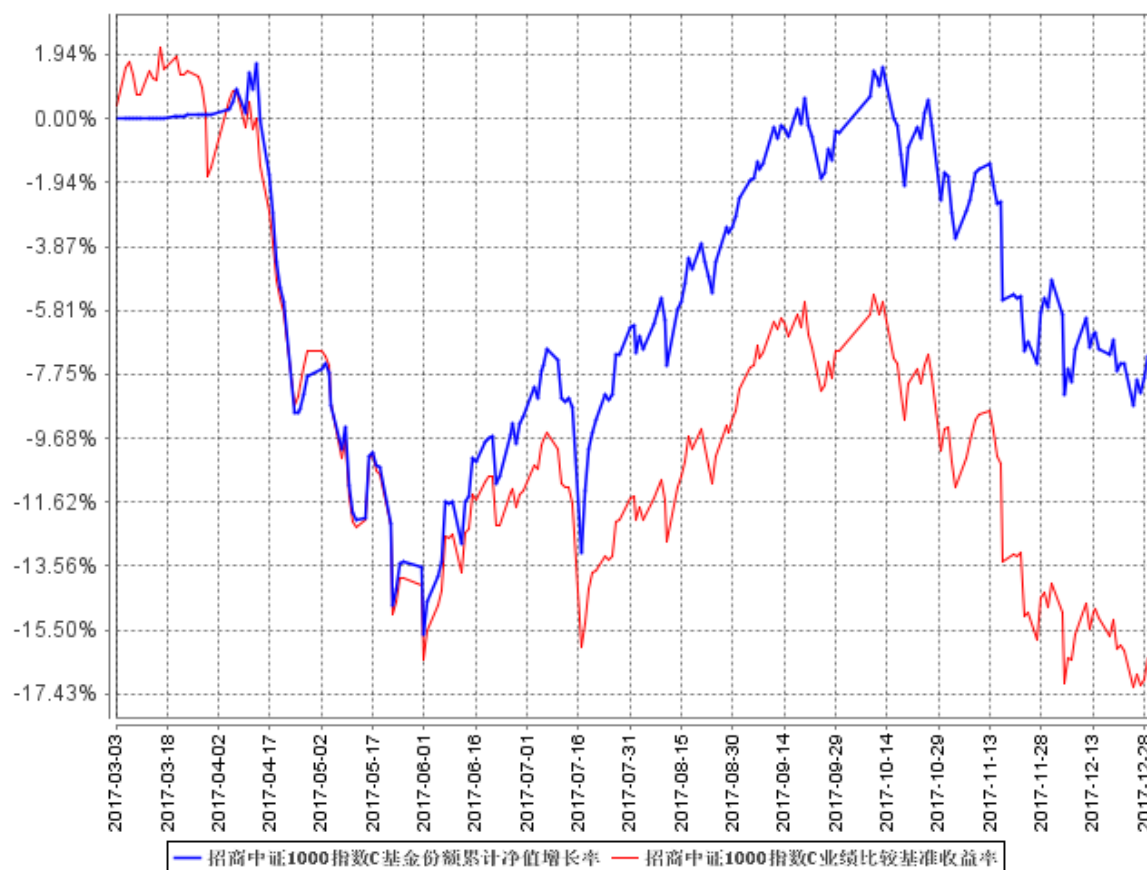
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

招商中证1000指数A基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图





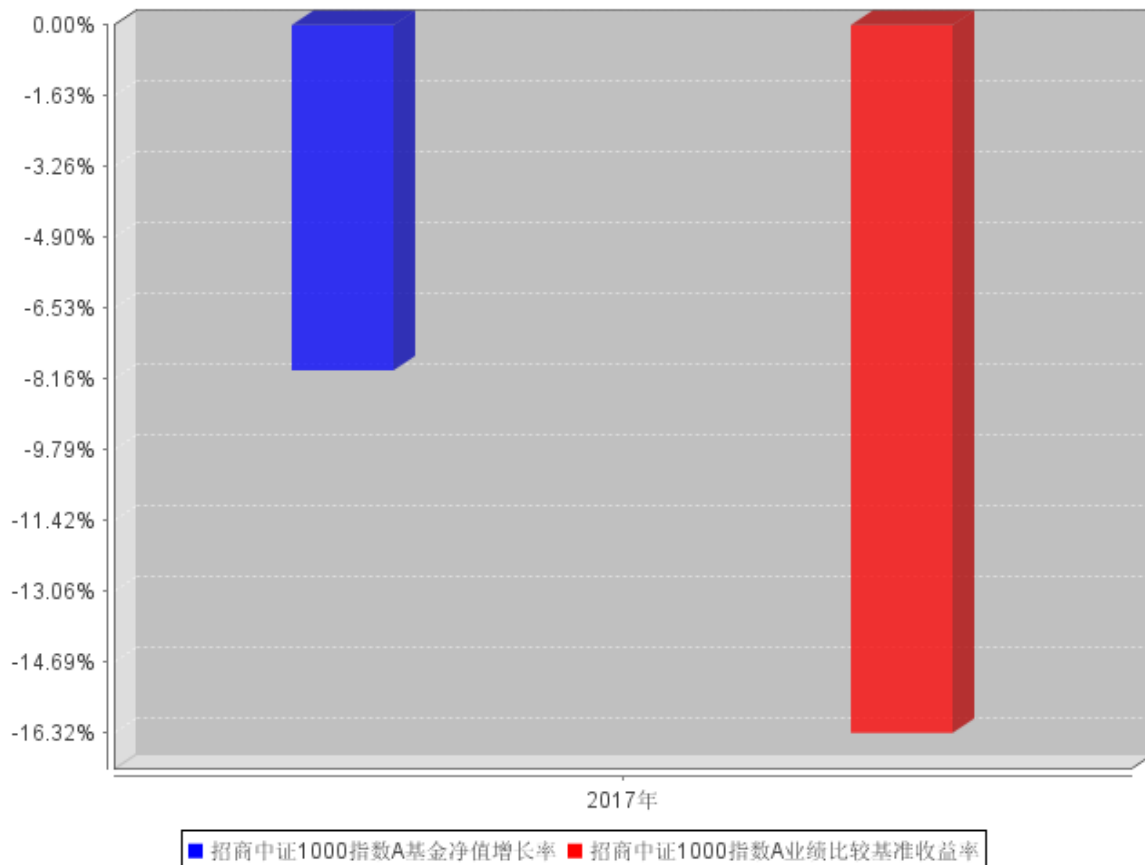
## 招商中证1000指数C基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



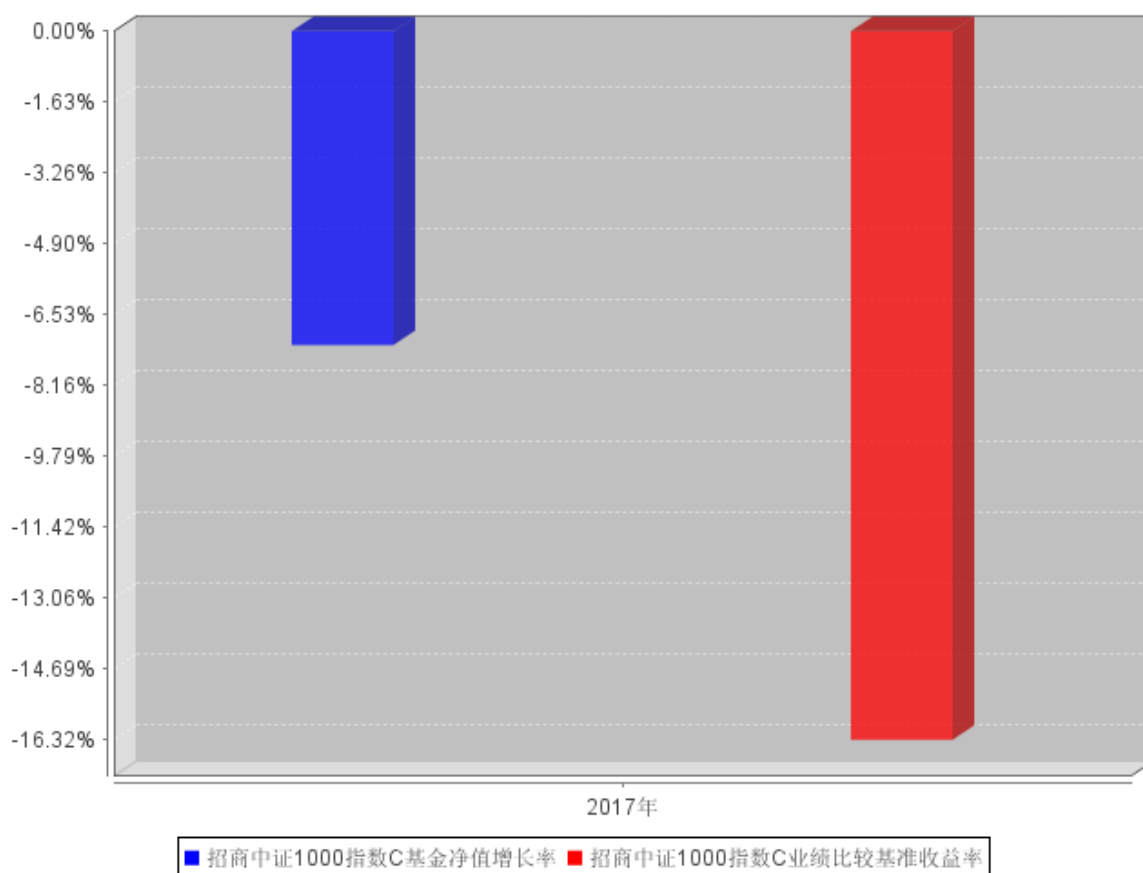
注：本基金合同于 2017 年 3 月 3 日生效，截至本报告期末基金成立未满一年；自基金成立日起 6 个月内为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

招商中证1000指数A自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 招商中证1000指数C自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同于 2017 年 3 月 3 日生效，截至本报告期末基金成立未满一年，故本报告期净值增长率按当年实际存续期计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金于 2017 年 3 月 3 日成立，自基金合同生效日以来未进行利润分配。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

招商基金管理有限公司于 2002 年 12 月 27 日经中国证监会【2002】100 号文批准设立。目前，公司新增注册资本金至人民币 13.1 亿元，招商银行股份有限公司持有公司全部股权的 55%，招商证券股份有限公司持有公司全部股权的 45%。

招商基金管理有限公司首批获得企业年金基金投资管理人资格、基本养老保险基金投资管理资格；2004 年获得全国社保基金投资管理人资格；同时拥有 QDII (合格境内机构投资者) 资格、专户理财（特定客户资产管理计划）资格。

2017 年度获奖情况如下：

Morningstar 晨星(中国)2017 年度普通债券型基金奖提名（招商安心收益债券）  
 金牛奖·三年期开放式债券型持续优胜金牛基金（招商产业债券） 《中国证券报》  
 金基金·股票投资回报基金管理公司奖 《上海证券报》  
 金基金·一年期债券基金奖（招商双债增强（LOF）） 《上海证券报》  
 金基金·三年期债券型基金奖（招商产业债券） 《上海证券报》  
 明星基金奖·三年持续回报积极债券型明星基金（招商安瑞进取债券） 《证券时报》  
 明星基金奖·三年持续回报普通债券型明星基金（招商产业债券） 《证券时报》  
 明星基金奖·2016 年度平衡混合型明星基金（招商制造业混合） 《证券时报》  
 明星基金奖·2016 年度绝对收益明星基金（招商丰融混合） 《证券时报》  
 金帆奖·2017 年度基金管理公司 《21 世纪经济报道》  
 金鼎奖·最佳公募基金公司品牌 《每日经济新闻》  
 年度卓越公募基金 《华尔街见闻》  
 年度十大风云基金产品奖（招商中证白酒指数分级） 《大众证券报》  
 2017 年度最佳品牌形象公司 《东方财富网》  
 杰出业绩表现基金产品（招商中证白酒指数分级） 《东方财富网》  
 年度指数投资奖 《华夏时报》  
 基金电商平台杰出用户体验奖 《金融界》

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王平	本基金基金经理	2017 年 3 月 3 日	-	11	男，管理学硕士，FRM。2006 年加入招商基金管理有限公司，曾任投资风险管理部助理数量分析师、风险管理部数量分析师、高级风控经理，主要负责公司投资风险管理、金融工程研究等工作，曾任招商中证银行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、招商国证生物医药指数分级证券投资基金、招商中证白酒指数分级证券投资基金、招商中证煤炭等权指数分级证券投资基金、上证消费 80 交易型开放式指数证券投资基金、深证电子信息传媒产业

				(TMT)50 交易型开放式指数证券投资基金、招商深证电子信息传媒产业(TMT)50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、招商上证消费 80 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，现任量化投资部副总监兼招商量化精选股票型发起式证券投资基金、招商稳荣定期开放灵活配置混合型证券投资基金、招商财经大数据策略股票型证券投资基金、招商沪深 300 指数增强型证券投资基金、招商中证 1000 指数增强型证券投资基金、招商盛合灵活配置混合型证券投资基金、招商中证 500 指数增强型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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

基金管理人根据《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》和《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》（2011 年修订）的规定，制定了《招商基金管理有限公司公平交易管理办法》，对投资决策的内部控制、交易执行的内部控制、公平交易实施情况的监控与检查稽核、异常交易的监控等进行了规定。为保证各投资组合在投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会，基金管理人合理设置了各类资产管理业务之间以及各类资产管理业务内部的组织结构，建立了科学的投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

### 4.3.2 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。

### 4.3.3 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，本基金管理人所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易不存在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。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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金为增强型指数产品，在标的成份股权重基础上根据量化增强模型对行业配置及个股权重等进行主动调整，力争在控制跟踪误差的基础上获取超越标的指数的投资收益。本基金所使用的模型为多因子量化增强模型，具体分析的因子包含价值指标、成长指标、盈利指标、运营指标、一致预期指标和市场行为指标。模型构建过程中本基金在以上因子的基础上进一步利用统计分析筛选出针对不同市场环境的有效因子。本基金会定期对模型的有效性进行检验和更新，以反映市场趋势的变化。

关于本基金的运作，报告期内投资运作较为稳定，股票仓位稳定在 93% 左右。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金 A 类份额净值增长率为-7.96%，C 类份额净值增长率为-7.23%，同期业绩基准增长率为-16.32%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

1、报告期内全球经济回暖，美国经济回升动力强，欧洲经济复苏强劲。从数据上看，美国

失业率已经下降至低位，12 月劳动参与率和失业率分别持平于前月的 62.7% 和 4.1%，12 月平均薪资的环比增速上升至 0.3%，未来薪资向核心通胀的传导是影响美联储中期加息节奏的重要因素。欧元区薪资增速偏低，一定程度上限制了核心通胀的回升。展望 2018 年，全球经济整体仍有望呈现复苏态势。

2、国内 2017 全年 GDP 增长 6.9%，比 2016 年提高 0.2%，社会消费品零售总额增长 10.2%，回落 0.2%，固定资产投资增长 7.2%，回落 0.9%，工业增加值增长 6.6%，回升 0.6%，出口额增长 7.9%，回升 15.6%。整体来讲报告期内投资与消费对经济增长的拉动有所下降，出口的回暖带来净出口对投资的拉动有所回升。后期伴随着固定资产投资增速的回升，及全球经济的回暖，2018 年国内经济有望继续保持平稳增长。

3、报告期内大小盘分化明显，核心大盘价值股涨幅较好，且随着 2017 年业绩快报及预警的发布，各行业的龙头仍旧有较强的配置价值，预计 2018 年的市场风格仍旧偏向大盘价值股，但需警惕金融监控政策变化对市场的影响。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人本着诚实信用、勤勉尽责、合法经营和保障基金持有人利益的原则，经营管理和业务运作稳健、合规，基金的投资、交易、后台等运作规范有序。基金管理人的风险管理及合规控制部门依据独立、客观、公正的原则，主要从以下几个方面进一步加强了公司内部控制和基金投资风险管理工作：

1、公司实施了员工全面培训和形式多样的专题培训，包括每日推送监管动态和风险案例，持续整理风险点录入系统定期推送，定期或不定期组织法规考试，不定期开展各类合规主题培训等，丰富培训形式，不断提升员工合规与风控意识；

2、公司合规风控部门通过事中合规控制系统、事后投资风险管理系统、风险管理模型等对基金投资合规情况及风险情况进行严格的内部监控和管理；

3、定期稽核方面，除了每季度会对各业务领域进行一次全面的稽核，并向监管部门提交季度监察稽核报告之外，公司合规部门还根据监察稽核计划，对公司的关键业务部门及业务流程进行了专项稽核和检查；

4、根据法律法规的更新及业务的发展变化情况，公司各业务部门对相关内部控制制度提出修改意见和建议，并关注内部控制制度的健全性和有效性，进一步完善了公司内控制度体系，更好的防范法律风险和合规风险。

报告期内，本基金的投资运作符合国家相关法律法规、监管部门的有关规定以及公司相关制度的规定。本基金的投资目标、投资决策依据和投资管理程序均符合相关基金合同和招募说明书

的约定，未发现重大异常交易、利益输送、内幕交易及其他有损基金投资者利益的情形。报告期内，本基金若曾因市场波动、申购赎回等原因出现了相关投资比例限制被动突破的情形，均在法规规定的时间内完成了调整，符合法律法规和基金合同的规定和要求。报告期内，本基金未出现因权证未行权、可转债未及时卖出或转股等有损基金份额持有人利益的投资失误行为。本基金管理人承诺将一如既往本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产，在规范经营、控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金的估值业务严格按照相关的法律法规、基金合同以及《招商基金管理有限公司基金估值委员会管理制度》进行。基金核算部负责日常的基金资产的估值业务，执行基金估值政策。另外，公司设立由投资和研究部门、风险管理部、基金核算部、法律合规部负责人和基金经理代表组成的估值委员会。公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历。公司估值委员会主要负责制定、修订和完善基金估值政策和程序，定期评价现有估值政策和程序的适用性及对估值程序执行情况进行监督。

投资和研究部门以及基金核算部共同负责关注相关投资品种的动态，评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种；投资和研究部门定期审核公允价值的确认和计量；研究部提出合理的数量分析模型对需要进行估值测算或者调整的投资品种进行公允价值定价与计量并定期对估值政策和程序进行评价，以保证其持续适用；基金核算部定期审核估值政策和程序的一致性，并负责与托管行沟通估值调整事项；风险管理部负责估值委员会工作流程中的风险控制；法律合规部负责日常的基金估值调整结果的事后复核监督工作；法律合规部与基金核算部共同负责估值调整事项的信息披露工作。

基金经理代表向估值委员会提供估值参考信息，参与估值政策讨论；对需采用特别估值程序的证券，基金及时启动特别估值程序，由公司估值委员会集体讨论议定特别估值方案，咨询会计事务所的专业意见，并与托管行沟通后由基金核算部具体执行。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。截止报告期末本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供相关债券品种、流通受限股票的估值参考数据。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规的规定和基金合同的约定，以及本基金的实际运作情况，本基金报告期未进行利润分配。在符合分红条件的前提下，本基金已实现尚未分配的可供分配收益部分，将严格



按照基金合同的约定适时向投资者予以分配。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在招商中证 1000 指数增强型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## §6 审计报告

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	招商中证 1000 指数增强型证券投资基金全体持有人
审计意见	我们审计了招商中证 1000 指数增强型证券投资基金的财务报表，包括 2017 年 12 月 31 日的资产负债表，2017 年 3 月 3 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日止期间的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了招商中证 1000 指数增强型证券投资基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况、2017 年 3 月 3 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于招商中证 1000 指数增强型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
其他信息	<p>招商基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括招商中证 1000 指数增强型证券投资基金 2017 年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估招商中证 1000 指数增强型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算招商中证 1000 指数增强型证券投资基金、终止经营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督招商中证 1000 指数增强型证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和做出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对招商中证 1000 指数增强型证券投资</p>

	<p>基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致招商中证 1000 指数增强型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	汪芳	吴凌志
会计师事务所的地址	中国·上海	
审计报告日期	2018-3-27	

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：招商中证 1000 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	7.4.7.1	9,833,153.80
结算备付金		39,793.28
存出保证金		11,221.36
交易性金融资产	7.4.7.2	145,033,892.80
其中：股票投资		145,033,892.80
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		247,680.07
应收利息	7.4.7.5	5,966.50
应收股利		-
应收申购款		91,946.69
递延所得税资产		-

其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		155,263,654.50
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017年12月31日</b>
<b>负 债:</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		67,383.28
应付管理人报酬		156,885.18
应付托管费		19,610.63
应付销售服务费		3,615.93
应付交易费用	7.4.7.7	64,988.59
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	250,017.45
负债合计		562,501.06
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	7.4.7.9	167,979,226.37
未分配利润	7.4.7.10	-13,278,072.93
所有者权益合计		154,701,153.44
负债和所有者权益总计		155,263,654.50

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，招商中证 1000 指数 A 基金份额净值 0.9204 元，基金份额总额 155,664,171.36 份；招商中证 1000 指数 C 基金份额净值 0.9277 元，基金份额总额 12,315,055.01 份；招商中证 1000 指数份额总额合计为 167,979,226.37 份。

## 7.2 利润表

会计主体：招商中证 1000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2017 年 3 月 3 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2017年3月3日(基金合同生效日)至 2017年12月31日
一、收入		-9,510,795.88
1.利息收入		550,207.94
其中：存款利息收入	7.4.7.11	99,848.49

债券利息收入		22.71
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		450,336.74
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-6,515,590.05
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-7,485,076.48
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	5,590.15
资产支持证券投资收益	7.4.7.14	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-
股利收益	7.4.7.17	963,896.28
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-4,352,109.07
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	806,695.30
<b>减：二、费用</b>		3,182,537.30
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,487,586.56
2. 托管费	7.4.10.2.2	185,948.35
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	13,214.32
4. 交易费用	7.4.7.20	1,056,096.51
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	7.4.7.21	439,691.56
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-12,693,333.18
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-12,693,333.18

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：招商中证 1000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2017 年 3 月 3 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2017 年 3 月 3 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	200,984,030.89	-	200,984,030.89

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-12,693,333.18	-12,693,333.18
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-33,004,804.52	-584,739.75	-33,589,544.27
其中：1. 基金申购款	33,108,532.22	-1,663,853.55	31,444,678.67
2. 基金赎回款	-66,113,336.74	1,079,113.80	-65,034,222.94
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	167,979,226.37	-13,278,072.93	154,701,153.44

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

_____金旭_____	_____欧志明_____	_____何剑萍_____
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

招商中证 1000 指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人招商基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《招商中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关法律法规的规定,经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]3117 号文准予公开募集注册。本基金为契约型开放式基金,存续期限为不定期。本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为 A 类基金份额和 C 类基金份额。本基金首次设立募集基金份额为 200,984,030.89 份,经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了编号为德师报(验)字(17)第 00081 号验资报告。基金合同于 2017 年 3 月 3 日正式生效。本基金的基金管理人为招商基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及截至报告期末最新公告的《招商中证 1000 指数增强型证券投资基金更新的招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括主板、中小板、创业板和其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转债(含可分离交易可转换债)、可交换债、次级债、短期融资券、中期票据等)、债券回购、同业存单、银行存款、货币市场工具、资产支持证券、权证、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会相关规定。本基金的投资组合为:投资于

股票的比例不低于基金资产的 80%，投资于中证 1000 指数成份股及其备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；本基金每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为中证 1000 指数收益率 $\times$ 95%+ 同期银行活期存款利率(税后)  $\times$ 5%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年 3 月 3 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2017 年 3 月 3 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日止期间。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### 1) 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和贷款及应收款项，暂无金融资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的各类应收款项、买入返售金融资产等在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产分类为贷款及应收款项。

###### 2) 金融负债的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公

允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。贷款及应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，贷款及应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价(包括转出的非现金资产或承担的新金融负债)之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层次的输入值确定公允价值计量层次。第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

1) 对于银行间市场交易的固定收益品种，以及交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照第三方估值机构提供的估值确定公允价值。

2) 对存在活跃市场的其他投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值；对于发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非



公开发行股票、首次公开发行时股票公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，按照监管机构或行业协会的有关规定确定公允价值。

3) 对存在活跃市场的其他投资品种，如估值日无市价且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

4) 当投资品种不再存在活跃市场，基金管理人估值委员会认为必要时，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

##### - 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日

确认债券利息收入。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

– 投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认。

债券投资收益为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额确认，由上市公司代扣代缴的个人所得税于卖出交易日按实际代扣代缴金额确认。

– 公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产卖出或到期时转出计入投资收益。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬、基金托管费和销售服务费按基金合同及相关公告约定的费率和计算方法逐日计提。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的交易费用发生时按照确定的金额计入交易费用。

卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率逐日计提。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%，若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3) 基金收益分配后各类基金份额的基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额的基金份额净值减去该类每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4) A 类基金份额和 C 类基金份额之间由于 A 类基金份额不收取而 C 类基金份额收取销售服务费将导致在可供分配利润上有所不同；本基金同一类别的每份基金份额享有同等分配权；

5) 基金可供分配利润为正的前提下，方可进行收益分配；

6) 法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 外币交易

本基金本报告期内无外币交易。

#### 7.4.4.13 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策与计量基础一致。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

1) 对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》(中基协发[2017]6号)，在估值日按照该通知规定的流通受限股票公允价值计算模型进行估值。

2) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，根据《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》(中国证监会公告[2017]13号)及《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》(中基协发[2013]13号)相关规定，本基金根据情况决定使用指数收益法、可比公司法、市场价格模型法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

3) 根据《关于发布〈中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准〉的通知》(中基协发[2014]24号)，在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)，采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无需说明的重大会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

为确保证券投资基金估值的合理性和公允性，根据《中国证券监督管理委员会关于证券投资

基金估值业务的指导意见》(证监会公告[2017]13号)和中国证券投资基金业协会发布的《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(中基协发[2017]6号)相关规定,本基金自2017年12月5日起,对所持有的流通受限股票的估值方法进行调整,新的估值方法考虑了估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值以及该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣的影响。于2017年12月5日,相关会计估计调整对基金资产净值的影响不超过0.25%。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需说明的重大会计差错更正。

### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008年9月18日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]48号《关于实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

1) 证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征营业税和增值税;2018年1月1日起,公开募集证券投资基金运营过程中发生的其他增值税应税行为,以基金管理人为增值税纳税人,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。

2) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不缴纳企业所得税。

3) 对基金取得的股票股息、红利收入,由上市公司在收到相关扣收税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳;从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

4) 对基金取得的债券利息收入, 由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税, 暂不缴纳企业所得税。

5) 对于基金从事 A 股买卖, 出让方按 0.10% 的税率缴纳证券(股票)交易印花税, 对受让方不再缴纳印花税。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位: 人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日
活期存款	9,833,153.80
定期存款	-
其中: 存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计	9,833,153.80

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位: 人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	149,386,001.87	145,033,892.80	-4,352,109.07
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	149,386,001.87	145,033,892.80	-4,352,109.07

##### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融工具。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	2,042.42
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	3,918.98
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	5.10
合计	5,966.50

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	64,988.59
银行间市场应付交易费用	-
合计	64,988.59

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	17.45
预提费用	200,000.00

应付指数使用费	50,000.00
合计	250,017.45

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

招商中证 1000 指数 A		
项目	本期 2017 年 3 月 3 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	200,198,706.99	200,198,706.99
本期申购	10,547,222.83	10,547,222.83
本期赎回(以“-”号填列)	-55,081,758.46	-55,081,758.46
本期末	155,664,171.36	155,664,171.36

金额单位：人民币元

招商中证 1000 指数 C		
项目	本期 2017 年 3 月 3 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	785,323.90	785,323.90
本期申购	22,561,309.39	22,561,309.39
本期赎回(以“-”号填列)	-11,031,578.28	-11,031,578.28
本期末	12,315,055.01	12,315,055.01

注：1、本期申购含红利再投、转换入份(金)额，本期赎回含转换出份(金)额；

2、本基金自 2017 年 1 月 17 日至 2017 年 2 月 28 日止期间公开发售，有效净认购金额人民币 200,973,859.23 元，折算为 200,973,859.23 份基金份额。根据《招商中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》的规定，经本基金注册登记人计算并确认，本基金认购资金在募集期内产生的利息人民币 10,171.66 元，折算为 10,171.66 份基金份额，划入基金持有人账户，两者合计 200,984,030.89 份基金份额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

招商中证 1000 指数 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-8,148,518.60	-3,741,009.77	-11,889,528.37
本期基金份额交易产生的变动数	-393,067.58	-105,049.54	-498,117.12
其中：基金申购款	-613,782.10	-109,870.40	-723,652.50
基金赎回款	220,714.52	4,820.86	225,535.38

本期已分配利润	-	-	-
本期末	-8,541,586.18	-3,846,059.31	-12,387,645.49

单位：人民币元

招商中证 1000 指数 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-192,705.51	-611,099.30	-803,804.81
本期基金份额交易产生的变动数	-395,397.74	308,775.11	-86,622.63
其中：基金申购款	-979,715.85	39,514.80	-940,201.05
基金赎回款	584,318.11	269,260.31	853,578.42
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-588,103.25	-302,324.19	-890,427.44

**7.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2017年3月3日(基金合同生效日)至2017年12月31日
活期存款利息收入	73,485.50
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	21,518.50
其他	4,844.49
合计	99,848.49

**7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2017年3月3日(基金合同生效日)至2017年12月31日
卖出股票成交总额	709,944,289.75
减：卖出股票成本总额	717,429,366.23
买卖股票差价收入	-7,485,076.48

**7.4.7.13 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2017年3月3日(基金合同生效日)至2017年12月31日



卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	147,212.86
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	141,596.97
减：应收利息总额	25.74
买卖债券差价收入	5,590.15

#### 7.4.7.14 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年3月3日(基金合同生效日)至2017年12月31日
股票投资产生的股利收益	963,896.28
基金投资产生的股利收益	-
合计	963,896.28

#### 7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年3月3日(基金合同生效日)至2017年12月31日
1. 交易性金融资产	-4,352,109.07
——股票投资	-4,352,109.07
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-4,352,109.07

### 7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 3 月 3 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	801,368.52
转换转出收入	5,326.78
合计	806,695.30

注：1、本基金的赎回费率按基金持有人持有该部分基金份额的时间分段递减设定，于持有人赎回基金份额时收取，赎回费总额按一定比例归入基金资产；

2、本基金的转换费由赎回费和申购费补差两部分组成，其中赎回费总额按一定比例归入转出基金的基金资产。

### 7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 3 月 3 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	1,056,096.51
银行间市场交易费用	-
合计	1,056,096.51

### 7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 3 月 3 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日
审计费用	50,000.00
信息披露费	225,000.00
指数使用费	151,967.22
银行费用	3,324.34
其他费用	9,400.00
合计	439,691.56

## 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

根据财政部和国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日和 2017 年 6 月 30 日联合颁布的《关于明

确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》(财税[2016]140号)和《关于资管产品增值税有关问题的通知》(财税[2017]56号)的有关规定,自2018年1月1日起,本基金运营过程中发生的增值税应税行为,以本基金管理人为增值税纳税人,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
招商基金管理有限公司	基金管理人
中国银行	基金托管人
招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)	基金管理人的股东
招商证券股份有限公司(以下简称“招商证券”)	基金管理人的股东
招商财富资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司
招商资产管理(香港)有限公司	基金管理人的全资子公司

注:本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 7.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行债券交易。

###### 7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2017年3月3日(基金合同生效日)至2017年12月31日	
	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例
招商证券	180,000,000.00	15.99%

###### 7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内无应支付关联方的佣金。

## 7.4.10.2 关联方报酬

### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 3 月 3 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,487,586.56
其中：支付销售机构的客户维护费	24,879.73

注：支付基金管理人招商基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值×1.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×1.20%÷当年天数

### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 3 月 3 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	185,948.35

注：支付基金托管人中国银行的基金托管费按前一日基金资产净值×0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.15%÷当年天数

### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2017 年 3 月 3 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	招商中证 1000 指数 A	招商中证 1000 指数 C	合计
招商基金管理有限公司	-	640.26	640.26
招商银行	-	1,002.10	1,002.10
中国银行	-	304.30	304.30
合计	-	1,946.66	1,946.66

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：招商中证 1000 指数 C 基金销售服务费=前一日基金资产净值×0.40% ÷ 当年天数

**7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

本基金本报告期内无与关联方进行的银行间同业市场的债券（含回购）交易。

**7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况****7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

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。

**7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况**

本报告期末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

**7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年3月3日(基金合同生效日)至2017年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行	9,833,153.80	73,485.50

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

**7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

**7.4.11 利润分配情况**

本基金本报告期内未进行利润分配。

**7.4.12 期末（2017年12月31日）本基金持有的流通受限证券****7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300664	鹏鹞环保	2017年12月28日	2018年1月5日	新股流通受限	8.88	8.88	3,640	32,323.20	32,323.20	-
603161	科华控股	2017年12月28日	2018年1月5日	新股流通受限	16.75	16.75	1,239	20,753.25	20,753.25	-
002923	润都	2017年	2018	新股流	17.01	17.01	954	16,227.54	16,227.54	-

	股份	12月28日	年1月5日	通受限						
603080	新疆火炬	2017年12月25日	2018年1月3日	新股流通受限	13.60	13.60	1,187	16,143.20	16,143.20	-
7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
7.4.12.1.3 受限证券类别：权证										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：份)	期末成本总额	期末估值总额	备注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

注：以上“可流通日”中，部分证券的日期是根据上市公司公告估算的流通日期；

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002130	沃尔核材	2017年12月25日	重大事项	5.76	2018年1月10日	6.15	175,500	994,035.00	1,010,880.00	-
300040	九洲电气	2017年12月18日	重大事项	9.67	2018年1月2日	9.67	102,096	1,092,575.58	987,268.32	-
000034	神州数码	2017年9月29日	重大事项	21.60	-	-	26,800	481,966.98	578,880.00	-
600960	渤海活塞	2017年12月7日	重大事项	7.37	-	-	56,600	414,190.30	417,142.00	-
300339	润和软件	2017年12月28日	重大事项	10.48	2018年1月5日	10.73	39,102	467,762.22	409,788.96	-
600328	兰太实业	2017年7月18日	重大事项	12.59	2018年1月9日	13.79	16,900	192,638.00	212,771.00	-
601003	柳钢股份	2017年10月17日	重大事项	7.98	2018年1月18日	7.50	21,400	101,712.02	170,772.00	-
300173	智慧松德	2017年12月26日	重大事项	7.90	-	-	15,100	126,923.00	119,290.00	-
300444	双杰电气	2017年11月20日	重大事项	17.00	-	-	5,779	125,168.15	98,243.00	-

000820	神雾节能	2017 年 7 月 17 日	重大事项	28.96	2018 年 1 月 17 日	26.06	2,900	106,612.00	83,984.00	-
002103	广博股份	2017 年 11 月 15 日	重大事项	9.45	-	-	8,759	100,258.93	82,772.55	-
000688	建新矿业	2017 年 9 月 6 日	重大事项	10.95	2018 年 2 月 7 日	9.86	5,500	41,941.69	60,225.00	-
300392	腾信股份	2017 年 10 月 11 日	重大事项	14.93	-	-	3,200	48,158.00	47,776.00	-
600257	大湖股份	2017 年 9 月 25 日	重大事项	7.40	-	-	5,700	40,597.00	42,180.00	-
002382	蓝帆医疗	2017 年 7 月 24 日	重大事项	12.19	2018 年 1 月 8 日	13.41	2,900	35,055.00	35,351.00	-
000971	高升控股	2017 年 10 月 16 日	重大事项	16.79	2018 年 1 月 9 日	16.89	1,900	33,963.85	31,901.00	-
002919	名臣健康	2017 年 12 月 28 日	重大事项	35.26	2018 年 1 月 2 日	38.79	821	10,311.76	28,948.46	-
300187	永清环保	2017 年 10 月 9 日	重大事项	11.20	2018 年 1 月 15 日	10.80	2,200	24,337.72	24,640.00	-
300152	科融环境	2017 年 9 月 25 日	重大事项	6.73	2018 年 1 月 30 日	6.06	3,500	25,821.00	23,555.00	-
000540	中天金融	2017 年 8 月 21 日	重大事项	7.77	-	-	600	4,352.00	4,662.00	-
600686	金龙汽车	2017 年 12 月 29 日	重大事项	13.03	2018 年 1 月 10 日	13.03	300	3,772.00	3,909.00	-
300483	沃施股份	2017 年 10 月 9 日	重大事项	33.13	2018 年 1 月 8 日	36.44	33	1,498.24	1,093.29	-
300013	新宁物流	2017 年 11 月 20 日	重大事项	12.95	2018 年 1 月 19 日	11.71	72	968.52	932.40	-
300730	科创信息	2017 年 12 月 25 日	重大事项	41.55	2018 年 1 月 2 日	45.71	21	175.56	872.55	-
300071	华谊嘉信	2017 年 11 月 30 日	重大事项	7.80	-	-	60	492.43	468.00	-
300455	康拓红外	2017 年 11 月 15 日	重大事项	11.24	-	-	40	445.02	449.60	-
600794	保税科技	2017 年 12 月 12 日	重大事项	4.45	-	-	100	406.80	445.00	-
300424	航新科技	2017 年 12 月 28 日	重大事项	23.43	2018 年 3 月 23 日	22.25	17	418.47	398.31	-
600162	香江控股	2017 年 11 月 10 日	重大事项	3.37	2018 年 1 月 12 日	3.71	100	342.36	337.00	-
603598	引力传媒	2017 年 11 月 8 日	重大事项	14.84	2018 年 3 月 7 日	14.88	22	359.44	326.48	-
600695	绿庭投资	2017 年 11 月	重大事	11.03	2018 年 2 月	9.97	5	38.87	55.15	-

		月 28 日	项		27 日					
--	--	--------	---	--	------	--	--	--	--	--

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

本基金是指数型基金，本基金的运作涉及的金融工具主要包括股票投资（主要是指数成份股、备选成份股）、债券投资等。与这些金融工具有关的风险，以及本基金的基金管理人管理这些风险所采取的风险管理政策如下所述。

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人从事风险管理的目标是提升本基金风险调整后收益水平，保证本基金的基金资产安全，维护基金份额持有人利益。基于该风险管理目标，本基金的基金管理人风险管理的基本策略是识别和分析本基金运作时本基金面临的各种类型的风险，确定适当的风险容忍度，并及时可靠地对各种风险进行监督，将风险控制在限定的范围之内。本基金目前面临的主要风险包括：市场风险、信用风险和流动性风险。与本基金相关的市场风险主要包括利率风险和市场价格风险。

本基金的基金管理人建立了以全面、独立、互相制约以及定性和定量相结合为原则的，监事会、董事会及下设风险控制委员会、督察长、风险管理委员会、法律合规部和风险管理部等多层次的风险管理组织架构体系。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指金融工具的一方到期无法履行约定义务致使本基金遭受损失的风险。本基金的信用风险主要存在于银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资及其他。

本基金的银行存款存放于本基金的基金托管人中国银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在证券交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并采用券款对付交割方式，以控制相应的信用风险。

对于与债券投资相关的信用风险，本基金的基金管理人通过对投资品种的信用等级评估来选



择适当的投资对象，并限制单个投资品种的持有比例来管理信用风险。附注 7.4.13.2.1 及 7.4.13.2.2 列示了于本报告期末本基金所持有的债券投资的信用评级，该信用评级不包括本基金所持有的国债、央行票据、政策性金融债。

#### **7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的债券投资。

#### **7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资**

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的债券投资。

### **7.4.13.3 流动性风险**

#### **7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析**

流动性风险是指没有足够资金以满足到期债务支付的风险。本基金流动风险来源于开放式基金每日兑付赎回资金的流动性风险，以及因部分投资品种交易不活跃而出现的变现风险以及因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理价格变现投资的风险。本基金所持有的大部分交易性金融资产在证券交易所上市，其余亦可银行间同业市场交易，除 7.4.12 所披露的流通受限不能自由转让的基金资产外，本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。本基金所持有的金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人在基金合同约定巨额赎回条款，设计了非常情况下赎回资金的处理模式，控制因开放模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。日常流动性风险管理中，本基金的基金管理人每日监控和预测本基金的流动性指标，通过对投资品种的流动性指标来持续的评估、选择、跟踪和控制基金投资的流动性风险。同时，本基金在需要时可通过卖出回购金融资产方式融入短期资金，以缓解流动性风险。

#### **7.4.13.4 市场风险**

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### **7.4.13.4.1 利率风险**

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的利率敏感性资产主要是银行存款、债券投资和买入返售金融资产。本基金的基金管理人日常通过对利率水平的预测、分析收益率曲线及优化利率重新定价日组合等方法对上述

利率风险进行管理。

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	9,833,153.80	-	-	-	-	-	9,833,153.80
结算备付金	39,793.28	-	-	-	-	-	39,793.28
存出保证金	11,221.36	-	-	-	-	-	11,221.36
交易性金融资产	-	-	-	-	-	145,033,892.80	145,033,892.80
应收证券清算款	-	-	-	-	-	247,680.07	247,680.07
应收利息	-	-	-	-	-	5,966.50	5,966.50
应收申购款	-	-	-	-	-	91,946.69	91,946.69
资产总计	9,884,168.44	-	-	-	-	145,379,486.06	155,263,654.50
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	67,383.28	67,383.28
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	156,885.18	156,885.18
应付托管费	-	-	-	-	-	19,610.63	19,610.63
应付销售服务费	-	-	-	-	-	3,615.93	3,615.93
应付交易费用	-	-	-	-	-	64,988.59	64,988.59
其他负债	-	-	-	-	-	250,017.45	250,017.45
负债总计	-	-	-	-	-	562,501.06	562,501.06
利率敏感度缺口	9,884,168.44	-	-	-	-	144,816,985.00	154,701,153.44

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末未持有债券投资及资产支持证券投资，因此市场利率变动而导致的利率敏感性资产的公允价值变动对基金资产净值的影响不重大。

#### 7.4.13.4.2 其他价格风险

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险，该风险可能与特定投资品种相关，也有可能与整体投资品种相关。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的债券和股票，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金在构建资产配置和基金资产投资组合的基础上，通过建立事前和事后跟踪误差的方式，对基金资产的市场价格风险进行管理。

## 7.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	145,033,892.80	93.75
衍生金融资产-权证投资	-	-
其他	-	-
合计	145,033,892.80	93.75

## 7.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 若对市场价格敏感的权益性投资的市场价格上升或下降 5%	
	2. 其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额 (单位: 人民币元)
		本期末 (2017 年 12 月 31 日)
	1. 权益性投资的市场价格上升 5%	7,251,694.64
2. 权益性投资的市场价格下降 5%	-7,251,694.64	

## 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

## (1) 公允价值

## (a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

## (b) 以公允价值计量的金融工具

## (i) 各层次金融工具公允价值

下表按公允价值三个层次列示了以公允价值计量的金融资产工具于 12 月 31 日的账面价值。

单位：人民币元

资产	本期末(2017 年 12 月 31 日)			
	第一层次	第二层次	第三层次	合计
交易性金融资产				
股票投资	140,468,128.54	4,565,764.26	-	145,033,892.80
债券投资	-	-	-	-
合计	140,468,128.54	4,565,764.26	-	145,033,892.80

## (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于本基金投资的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	145,033,892.80	93.41
	其中：股票	145,033,892.80	93.41
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	9,872,947.08	6.36
8	其他各项资产	356,814.62	0.23
9	合计	155,263,654.50	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,208.50	0.00
B	采矿业	5,942,278.60	3.84
C	制造业	70,675,966.30	45.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,007,406.42	2.59
E	建筑业	3,410,538.32	2.20
F	批发和零售业	8,414,417.68	5.44
G	交通运输、仓储和邮政业	1,421,974.78	0.92
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,770,507.30	6.32
J	金融业	1,027.54	0.00
K	房地产业	5,305,512.79	3.43
L	租赁和商务服务业	3,636,796.00	2.35
M	科学研究和技术服务业	1,388,889.00	0.90
N	水利、环境和公共设施管理业	1,042,427.00	0.67

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	1,654,443.02	1.07
S	综合	435,336.70	0.28
	合计	117,108,729.95	75.70

## 8.2.2 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	42,180.00	0.03
B	采矿业	123.90	0.00
C	制造业	15,114,373.29	9.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	778,910.71	0.50
E	建筑业	2,275,265.76	1.47
F	批发和零售业	2,428,589.11	1.57
G	交通运输、仓储和邮政业	653,559.26	0.42
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,522,014.45	0.98
J	金融业	3,595.15	0.00
K	房地产业	3,132,605.78	2.02
L	租赁和商务服务业	496,407.82	0.32
M	科学研究和技术服务业	265,601.00	0.17
N	水利、环境和公共设施管理业	466,895.20	0.30
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	745,041.42	0.48
S	综合	-	-
	合计	27,925,162.85	18.05

## 8.2.3 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。

## 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

### 8.3.1 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所有股票投资明细

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	占基金资产净值比例（%）
1	603116	红蜻蜓	92,830	1,431,438.60	0.93
2	002203	海亮股份	181,600	1,416,480.00	0.92
3	300184	力源信息	124,000	1,406,160.00	0.91
4	600708	光明地产	205,100	1,404,935.00	0.91
5	600096	云天化	194,800	1,394,768.00	0.90
6	600629	华建集团	90,400	1,388,544.00	0.90
7	000676	智度股份	121,414	1,350,123.68	0.87
8	000070	特发信息	143,300	1,338,422.00	0.87
9	002080	中材科技	49,200	1,296,420.00	0.84
10	600057	象屿股份	152,750	1,235,747.50	0.80
11	300036	超图软件	74,300	1,147,192.00	0.74
12	002496	辉丰股份	216,400	1,140,428.00	0.74
13	300349	金卡智能	28,700	1,136,520.00	0.73
14	000951	中国重汽	63,200	1,101,576.00	0.71
15	600782	新钢股份	163,001	1,072,546.58	0.69
16	000546	金圆股份	59,700	1,065,645.00	0.69
17	002430	杭氧股份	75,600	1,056,132.00	0.68
18	600279	重庆港九	178,700	1,048,969.00	0.68
19	600711	盛屯矿业	122,500	1,040,025.00	0.67
20	601015	陕西黑猫	99,400	1,036,742.00	0.67
21	002283	天润曲轴	180,900	1,034,748.00	0.67
22	601666	平煤股份	163,900	1,032,570.00	0.67
23	600123	兰花科创	112,500	1,031,625.00	0.67
24	603008	喜临门	55,600	1,028,044.00	0.66
25	000407	胜利股份	132,600	1,019,694.00	0.66
26	603609	禾丰牧业	114,815	1,019,557.20	0.66
27	603588	高能环境	80,100	1,018,872.00	0.66
28	601058	赛轮金宇	282,200	1,018,742.00	0.66
29	002443	金洲管道	113,100	1,017,900.00	0.66
30	000657	中钨高新	81,900	1,017,198.00	0.66
31	002564	天沃科技	123,860	1,015,652.00	0.66
32	000980	众泰汽车	84,800	1,012,512.00	0.65
33	002067	景兴纸业	171,900	1,012,491.00	0.65
34	002130	沃尔核材	175,500	1,010,880.00	0.65
35	601900	南方传媒	86,801	1,010,363.64	0.65
36	000789	万年青	95,900	1,007,909.00	0.65
37	600508	上海能源	82,800	1,004,364.00	0.65

38	002712	思美传媒	43,400	1,002,540.00	0.65
39	600567	山鹰纸业	228,900	993,426.00	0.64
40	002582	好想你	84,800	992,160.00	0.64
41	002449	国星光电	57,200	990,704.00	0.64
42	300226	上海钢联	26,400	990,000.00	0.64
43	600531	豫光金铅	152,600	988,848.00	0.64
44	002232	启明信息	93,400	988,172.00	0.64
45	000010	美丽生态	182,300	988,066.00	0.64
46	300485	赛升药业	34,300	987,840.00	0.64
47	002680	长生生物	68,694	987,819.72	0.64
48	000683	远兴能源	338,200	984,162.00	0.64
49	002781	奇信股份	41,600	982,176.00	0.63
50	300255	常山药业	155,000	981,150.00	0.63
51	600210	紫江企业	206,100	981,036.00	0.63
52	300083	劲胜精密	129,200	980,628.00	0.63
53	000011	深物业 A	58,300	978,857.00	0.63
54	002121	科陆电子	109,300	978,235.00	0.63
55	600310	桂东电力	188,900	976,613.00	0.63
56	300410	正业科技	27,900	976,500.00	0.63
57	300118	东方日升	80,500	976,465.00	0.63
58	603996	中新科技	52,800	972,576.00	0.63
59	002766	索菱股份	68,600	970,690.00	0.63
60	600569	安阳钢铁	206,500	970,550.00	0.63
61	300165	天瑞仪器	152,800	970,280.00	0.63
62	000921	海信科龙	69,600	968,832.00	0.63
63	600288	大恒科技	111,100	968,792.00	0.63
64	300157	恒泰艾普	105,700	963,984.00	0.62
65	600173	卧龙地产	166,100	963,380.00	0.62
66	600577	精达股份	256,000	962,560.00	0.62
67	000701	厦门信达	96,000	961,920.00	0.62
68	300269	联建光电	75,300	959,322.00	0.62
69	000639	西王食品	50,300	955,700.00	0.62
70	600507	方大特钢	74,600	946,674.00	0.61
71	600090	同济堂	119,400	942,066.00	0.61
72	603227	雪峰科技	163,700	938,001.00	0.61
73	600963	岳阳林纸	145,700	936,851.00	0.61
74	300209	天泽信息	50,300	919,484.00	0.59
75	300288	朗玛信息	38,400	915,456.00	0.59
76	600803	新奥股份	60,900	914,718.00	0.59



77	002279	久其软件	88,800	914,640.00	0.59
78	002102	冠福股份	207,400	891,820.00	0.58
79	600470	六国化工	154,400	876,992.00	0.57
80	603108	润达医疗	71,333	873,829.25	0.56
81	002788	鹭燕医药	28,900	857,174.00	0.55
82	600459	贵研铂业	38,100	845,058.00	0.55
83	600856	中天能源	67,800	792,582.00	0.51
84	000034	神州数码	26,800	578,880.00	0.37
85	600420	现代制药	35,760	454,867.20	0.29
86	601595	上海电影	22,200	452,658.00	0.29
87	600707	彩虹股份	61,000	450,790.00	0.29
88	000560	昆百大 A	47,000	448,380.00	0.29
89	002791	坚朗五金	22,500	444,825.00	0.29
90	002097	山河智能	58,300	438,999.00	0.28
91	000553	沙隆达 A	27,500	435,875.00	0.28
92	000881	中广核技	33,300	435,231.00	0.28
93	002419	天虹股份	28,500	434,910.00	0.28
94	002867	周大生	15,600	432,900.00	0.28
95	601366	利群股份	41,100	431,961.00	0.28
96	000899	赣能股份	72,804	431,727.72	0.28
97	603678	火炬电子	15,500	430,435.00	0.28
98	600067	冠城大通	65,600	427,712.00	0.28
99	300616	尚品宅配	2,700	426,654.00	0.28
100	300366	创意信息	35,200	423,104.00	0.27
101	002677	浙江美大	24,940	422,733.00	0.27
102	600185	格力地产	74,400	422,592.00	0.27
103	000767	漳泽电力	143,400	421,596.00	0.27
104	002376	新北洋	37,800	419,958.00	0.27
105	000965	天保基建	73,400	419,848.00	0.27
106	002821	凯莱英	7,000	418,950.00	0.27
107	603298	杭叉集团	26,200	418,938.00	0.27
108	603421	鼎信通讯	16,400	418,528.00	0.27
109	600063	皖维高新	111,600	417,384.00	0.27
110	000040	东旭蓝天	29,600	415,880.00	0.27
111	600602	云赛智联	60,500	413,820.00	0.27
112	603979	金诚信	40,315	412,825.60	0.27
113	600382	广东明珠	32,641	410,623.78	0.27
114	600824	益民集团	84,900	410,067.00	0.27
115	002658	雪迪龙	32,100	409,917.00	0.26

116	300339	润和软件	39,102	409,788.96	0.26
117	000055	方大集团	67,350	408,141.00	0.26
118	002108	沧州明珠	35,870	407,483.20	0.26
119	603508	思维列控	10,500	405,825.00	0.26
120	300516	久之洋	8,900	404,149.00	0.26
121	002287	奇正藏药	11,900	403,172.00	0.26
122	300219	鸿利智汇	35,750	401,472.50	0.26
123	000603	盛达矿业	33,000	396,660.00	0.26
124	600093	易见股份	36,790	394,388.80	0.25
125	600491	龙元建设	41,700	394,065.00	0.25
126	300432	富临精工	22,300	394,041.00	0.25
127	300447	全信股份	20,900	393,547.00	0.25
128	002539	云图控股	61,200	393,516.00	0.25
129	300484	蓝海华腾	18,200	393,120.00	0.25
130	002782	可立克	28,000	392,560.00	0.25
131	002298	中电鑫龙	43,286	388,708.28	0.25
132	600604	市北高新	53,600	385,920.00	0.25
133	603166	福达股份	48,200	385,600.00	0.25
134	300114	中航电测	37,450	383,862.50	0.25
135	002335	科华恒盛	12,500	382,625.00	0.25
136	600986	科达股份	34,884	382,328.64	0.25
137	300307	慈星股份	46,100	376,637.00	0.24
138	002537	海立美达	38,300	374,957.00	0.24
139	000429	粤高速 A	45,900	372,249.00	0.24
140	000875	吉电股份	93,700	364,493.00	0.24
141	603718	海利生物	32,600	359,904.00	0.23
142	600502	安徽水利	48,700	335,543.00	0.22
143	000976	春晖股份	40,900	333,744.00	0.22
144	601339	百隆东方	60,200	316,652.00	0.20
145	000795	英洛华	49,400	306,280.00	0.20
146	002145	中核钛白	50,600	303,094.00	0.20
147	000550	江铃汽车	17,100	275,652.00	0.18
148	300285	国瓷材料	13,500	270,000.00	0.17
149	600764	中电广通	9,600	266,976.00	0.17
150	300474	景嘉微	4,700	253,424.00	0.16
151	600246	万通地产	62,700	250,173.00	0.16
152	000801	四川九洲	43,200	247,104.00	0.16
153	600391	航发科技	12,400	244,404.00	0.16
154	000561	烽火电子	28,300	241,682.00	0.16

155	600114	东睦股份	14,200	224,786.00	0.15
156	300194	福安药业	38,600	221,950.00	0.14
157	603368	柳州医药	4,619	221,111.53	0.14
158	000967	盈峰环境	23,400	214,812.00	0.14
159	002364	中恒电气	20,100	214,266.00	0.14
160	600477	杭萧钢构	19,170	204,543.90	0.13
161	002790	瑞尔特	7,600	201,856.00	0.13
162	300463	迈克生物	8,200	196,554.00	0.13
163	603839	安正时尚	7,000	171,500.00	0.11
164	002550	千红制药	31,500	171,045.00	0.11
165	601003	柳钢股份	21,400	170,772.00	0.11
166	000719	大地传媒	17,457	158,160.42	0.10
167	600105	永鼎股份	22,800	148,656.00	0.10
168	002660	茂硕电源	15,301	146,583.58	0.09
169	002501	利源精制	11,900	123,403.00	0.08
170	300173	智慧松德	15,100	119,290.00	0.08
171	002224	三力士	11,400	98,952.00	0.06
172	000498	山东路桥	13,300	88,844.00	0.06
173	000820	神雾节能	2,900	83,984.00	0.05
174	300177	中海达	7,800	81,588.00	0.05
175	002724	海洋王	8,500	80,495.00	0.05
176	000688	建新矿业	5,500	60,225.00	0.04
177	300392	腾信股份	3,200	47,776.00	0.03
178	000558	莱茵体育	9,100	45,045.00	0.03
179	300303	聚飞光电	11,780	42,761.40	0.03
180	000882	华联股份	13,900	42,395.00	0.03
181	000665	湖北广电	3,200	32,256.00	0.02
182	000971	高升控股	1,900	31,901.00	0.02
183	300152	科融环境	3,500	23,555.00	0.02
184	300085	银之杰	1,500	20,400.00	0.01
185	002035	华帝股份	300	9,042.00	0.01
186	300077	国民技术	700	7,000.00	0.00
187	600172	黄河旋风	660	5,788.20	0.00
188	002497	雅化集团	400	5,332.00	0.00
189	002474	榕基软件	500	4,210.00	0.00
190	002355	兴民智通	400	4,192.00	0.00
191	300353	东土科技	300	3,945.00	0.00
192	603338	浙江鼎力	50	3,932.00	0.00
193	600686	金龙汽车	300	3,909.00	0.00

194	000036	华联控股	400	3,616.00	0.00
195	002157	正邦科技	600	3,438.00	0.00
196	000915	山大华特	80	2,411.20	0.00
197	002610	爱康科技	1,000	2,370.00	0.00
198	603900	莱绅通灵	80	2,319.20	0.00
199	300014	亿纬锂能	99	1,941.39	0.00
200	002756	永兴特钢	71	1,906.35	0.00
201	600622	光大嘉宝	90	1,617.30	0.00
202	300294	博雅生物	50	1,497.50	0.00
203	000901	航天科技	63	1,471.68	0.00
204	300300	汉鼎宇佑	85	1,432.25	0.00
205	300511	雪榕生物	50	1,208.50	0.00
206	600668	尖峰集团	75	1,188.00	0.00
207	002322	理工环科	62	1,164.36	0.00
208	600278	东方创业	95	1,130.50	0.00
209	300178	腾邦国际	83	1,103.90	0.00
210	600621	华鑫股份	83	1,027.54	0.00
211	300363	博腾股份	77	1,021.79	0.00
212	300336	新文化	88	1,004.96	0.00
213	300317	珈伟股份	62	970.92	0.00
214	600987	航民股份	86	970.08	0.00
215	300328	宜安科技	96	933.12	0.00
216	000819	岳阳兴长	71	890.34	0.00
217	300237	美晨科技	50	833.50	0.00
218	000038	深大通	40	830.80	0.00
219	002518	科士达	50	818.50	0.00
220	002326	永太科技	71	810.82	0.00
221	601038	一拖股份	95	794.20	0.00
222	603989	艾华集团	20	768.40	0.00
223	603128	华贸物流	90	737.10	0.00
224	600501	航天晨光	60	732.60	0.00
225	300496	中科创达	22	711.04	0.00
226	600995	文山电力	77	700.70	0.00
227	000666	经纬纺机	36	699.12	0.00
228	300310	宜通世纪	60	695.40	0.00
229	002091	江苏国泰	77	690.69	0.00
230	002363	隆基机械	79	677.82	0.00
231	002515	金字火腿	80	661.60	0.00
232	300350	华鹏飞	65	641.55	0.00

233	600876	洛阳玻璃	31	624.96	0.00
234	300377	赢时胜	50	618.00	0.00
235	000404	华意压缩	95	597.55	0.00
236	300242	明家联合	70	577.50	0.00
237	002135	东南网架	79	568.80	0.00
238	002196	方正电机	60	561.60	0.00
239	601799	星宇股份	11	544.50	0.00
240	002752	昇兴股份	50	541.50	0.00
241	002452	长高集团	88	539.44	0.00
242	002372	伟星新材	30	539.40	0.00
243	300221	银禧科技	32	492.48	0.00
244	002678	珠江钢琴	42	471.66	0.00
245	300071	华谊嘉信	60	468.00	0.00
246	002585	双星新材	70	462.70	0.00
247	002303	美盈森	63	441.00	0.00
248	000863	三湘印象	83	439.07	0.00
249	002534	杭锅股份	38	411.16	0.00
250	300424	航新科技	17	398.31	0.00
251	000811	烟台冰轮	50	394.00	0.00
252	002567	唐人神	50	387.00	0.00
253	603118	共进股份	40	350.80	0.00
254	300008	天海防务	50	345.00	0.00
255	002726	龙大肉食	30	342.60	0.00
256	600162	香江控股	100	337.00	0.00
257	002511	中顺洁柔	20	325.60	0.00
258	603398	邦宝益智	20	315.80	0.00
259	000042	中洲控股	18	292.14	0.00
260	601588	北辰实业	50	289.50	0.00
261	600730	中国高科	41	277.98	0.00
262	600400	红豆股份	30	215.70	0.00
263	002556	辉隆股份	27	206.01	0.00
264	300352	北信源	50	199.00	0.00
265	002185	华天科技	20	170.40	0.00
266	300497	富祥股份	4	145.88	0.00
267	600285	羚锐制药	14	130.20	0.00
268	600684	珠江实业	20	123.60	0.00
269	002483	润邦股份	21	114.45	0.00
270	600620	天宸股份	10	105.70	0.00
271	002446	盛路通信	10	102.70	0.00

272	600677	航天通信	8	88.72	0.00
273	600533	栖霞建设	12	58.20	0.00
274	002239	奥特佳	11	44.44	0.00
275	600676	交运股份	3	19.68	0.00
276	300262	巴安水务	2	18.12	0.00

### 8.3.2 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所有股票投资明细

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	占基金资产净值比例（%）
1	000338	潍柴动力	125,400	1,045,836.00	0.68
2	600755	厦门国贸	100,700	1,017,070.00	0.66
3	002601	龙蟠佰利	63,100	1,010,862.00	0.65
4	600743	华远地产	274,400	1,004,304.00	0.65
5	300040	九洲电气	102,096	987,268.32	0.64
6	600079	人福医药	55,200	984,768.00	0.64
7	600565	迪马股份	245,900	983,600.00	0.64
8	002482	广田集团	122,600	983,252.00	0.64
9	002416	爱施德	103,200	977,304.00	0.63
10	002092	中泰化学	73,400	976,954.00	0.63
11	600619	海立股份	84,100	958,740.00	0.62
12	300117	嘉寓股份	140,700	925,806.00	0.60
13	601717	郑煤机	140,700	925,806.00	0.60
14	600651	飞乐音响	100,720	921,588.00	0.60
15	002396	星网锐捷	39,500	852,805.00	0.55
16	600657	信达地产	134,200	748,836.00	0.48
17	600787	中储股份	56,500	621,500.00	0.40
18	600380	健康元	54,200	606,498.00	0.39
19	600126	杭钢股份	77,170	530,157.90	0.34
20	600808	马钢股份	120,500	497,665.00	0.32
21	300230	永利股份	31,800	444,564.00	0.29
22	600438	通威股份	35,800	433,538.00	0.28
23	000990	诚志股份	25,107	433,346.82	0.28
24	600475	华光股份	29,800	431,206.00	0.28
25	603556	海兴电力	11,700	425,880.00	0.28
26	600960	渤海活塞	56,600	417,142.00	0.27
27	601811	新华文轩	31,000	416,330.00	0.27
28	000030	富奥股份	51,300	416,043.00	0.27

29	600628	新世界	40,500	411,885.00	0.27
30	603869	北部湾旅	19,300	409,932.00	0.26
31	300297	蓝盾股份	42,800	408,312.00	0.26
32	002818	富森美	13,414	406,578.34	0.26
33	600073	上海梅林	49,900	405,188.00	0.26
34	300451	创业软件	17,800	384,836.00	0.25
35	600996	贵广网络	38,600	382,140.00	0.25
36	002620	瑞和股份	37,900	364,219.00	0.24
37	601199	江南水务	62,854	354,496.56	0.23
38	600289	ST 信通	34,600	343,924.00	0.22
39	600229	城市传媒	42,800	328,704.00	0.21
40	600396	金山股份	87,900	272,490.00	0.18
41	603698	航天工程	13,300	265,601.00	0.17
42	600328	兰太实业	16,900	212,771.00	0.14
43	300158	振东制药	12,800	176,640.00	0.11
44	600580	卧龙电气	21,900	175,419.00	0.11
45	600351	亚宝药业	21,100	156,562.00	0.10
46	603936	博敏电子	5,000	143,750.00	0.09
47	600510	黑牡丹	20,800	137,696.00	0.09
48	000605	渤海股份	7,300	130,086.00	0.08
49	600748	上实发展	17,000	108,970.00	0.07
50	000631	顺发恒业	23,400	100,854.00	0.07
51	300444	双杰电气	5,779	98,243.00	0.06
52	603569	长久物流	3,700	89,503.00	0.06
53	002103	广博股份	8,759	82,772.55	0.05
54	600077	宋都股份	12,127	43,172.12	0.03
55	600257	大湖股份	5,700	42,180.00	0.03
56	300735	光弘科技	2,860	41,155.40	0.03
57	002915	中欣氟材	1,085	38,181.15	0.02
58	603477	振静股份	1,955	37,027.70	0.02
59	002382	蓝帆医疗	2,900	35,351.00	0.02
60	300664	鹏鹞环保	3,640	32,323.20	0.02
61	002841	视源股份	400	29,000.00	0.02
62	002919	名臣健康	821	28,948.46	0.02
63	300187	永清环保	2,200	24,640.00	0.02
64	002922	伊戈尔	1,245	22,248.15	0.01
65	603161	科华控股	1,239	20,753.25	0.01
66	601010	文峰股份	5,021	20,335.05	0.01
67	603283	赛腾股份	1,349	19,614.46	0.01

68	603329	上海雅仕	1,183	17,957.94	0.01
69	002923	润都股份	954	16,227.54	0.01
70	603080	新疆火炬	1,187	16,143.20	0.01
71	300684	中石科技	827	11,528.38	0.01
72	603655	朗博科技	881	8,193.30	0.01
73	002916	深南电路	91	7,937.93	0.01
74	600317	营口港	2,100	7,119.00	0.00
75	600131	岷江水电	800	5,528.00	0.00
76	600152	维科精华	700	5,411.00	0.00
77	300314	戴维医疗	400	5,300.00	0.00
78	601777	力帆股份	700	5,082.00	0.00
79	000540	中天金融	600	4,662.00	0.00
80	600390	五矿资本	300	3,540.00	0.00
81	603225	新风鸣	65	2,327.00	0.00
82	603223	恒通股份	83	1,990.34	0.00
83	603519	立霸股份	93	1,971.60	0.00
84	002763	汇洁股份	139	1,902.91	0.00
85	002468	申通快递	74	1,827.06	0.00
86	002627	宜昌交运	96	1,787.52	0.00
87	603808	歌力思	70	1,610.00	0.00
88	002090	金智科技	71	1,590.40	0.00
89	002354	天神娱乐	92	1,573.20	0.00
90	300274	阳光电源	81	1,520.37	0.00
91	603309	维力医疗	63	1,156.68	0.00
92	300204	舒泰神	82	1,130.78	0.00
93	300197	铁汉生态	90	1,093.50	0.00
94	300483	沃施股份	33	1,093.29	0.00
95	300138	晨光生物	80	1,014.40	0.00
96	300233	金城医药	54	1,006.02	0.00
97	603998	方盛制药	89	995.91	0.00
98	600885	宏发股份	23	951.51	0.00
99	603020	爱普股份	76	940.12	0.00
100	300013	新宁物流	72	932.40	0.00
101	300730	科创信息	21	872.55	0.00
102	002454	松芝股份	75	859.50	0.00
103	002434	万里扬	78	819.00	0.00
104	002369	卓翼科技	79	817.65	0.00
105	603806	福斯特	22	750.20	0.00
106	600883	博闻科技	78	735.54	0.00



107	603168	莎普爱思	47	698.89	0.00
108	002698	博实股份	70	688.80	0.00
109	000023	深天地 A	32	656.96	0.00
110	600713	南京医药	98	609.56	0.00
111	603828	柯利达	60	593.40	0.00
112	000906	浙商中拓	80	583.20	0.00
113	300039	上海凯宝	90	572.40	0.00
114	002472	双环传动	52	509.08	0.00
115	600128	弘业股份	53	502.44	0.00
116	002615	哈尔斯	50	459.00	0.00
117	300455	康拓红外	40	449.60	0.00
118	600794	保税科技	100	445.00	0.00
119	300342	天银机电	26	420.16	0.00
120	603598	引力传媒	22	326.48	0.00
121	600468	百利电气	50	324.00	0.00
122	000570	苏常柴 A	57	318.06	0.00
123	601515	东风股份	28	274.40	0.00
124	002147	新光圆成	20	258.80	0.00
125	601677	明泰铝业	19	247.38	0.00
126	600302	标准股份	41	245.18	0.00
127	600287	江苏舜天	31	226.92	0.00
128	002359	齐星铁塔	10	225.50	0.00
129	600080	金花股份	26	212.42	0.00
130	300067	安诺其	34	202.98	0.00
131	603030	全筑股份	22	179.96	0.00
132	600589	广东榕泰	29	176.03	0.00
133	000531	穗恒运 A	21	166.95	0.00
134	300519	新光药业	8	158.00	0.00
135	600724	宁波富达	40	150.80	0.00
136	002065	东华软件	16	131.20	0.00
137	300370	安控科技	34	130.56	0.00
138	300351	永贵电器	9	127.80	0.00
139	601969	海南矿业	14	123.90	0.00
140	002062	宏润建设	23	121.90	0.00
141	600683	京投发展	18	102.06	0.00
142	000536	华映科技	20	98.80	0.00
143	603100	川仪股份	8	80.00	0.00
144	600180	瑞茂通	7	72.94	0.00
145	002084	海鸥卫浴	10	64.90	0.00

146	600695	绿庭投资	5	55.15	0.00
147	603507	振江股份	1	40.20	0.00
148	603566	普莱柯	1	22.19	0.00
149	601579	会稽山	1	11.81	0.00
150	002527	新时达	1	9.90	0.00
151	002540	亚太科技	1	7.60	0.00
152	601999	出版传媒	1	7.42	0.00

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	603116	红蜻蜓	3,151,444.45	2.04
2	600676	交运股份	3,089,936.00	2.00
3	600162	香江控股	2,956,039.50	1.91
4	000676	智度股份	2,924,766.56	1.89
5	000055	方大集团	2,911,665.08	1.88
6	600269	赣粤高速	2,909,194.00	1.88
7	601368	绿城水务	2,807,171.00	1.81
8	601636	旗滨集团	2,782,028.00	1.80
9	600824	益民集团	2,777,162.00	1.80
10	002102	冠福股份	2,706,144.00	1.75
11	600096	云天化	2,620,936.00	1.69
12	300495	美尚生态	2,598,374.00	1.68
13	002203	海亮股份	2,591,766.00	1.68
14	002452	长高集团	2,586,358.62	1.67
15	000498	山东路桥	2,573,445.35	1.66
16	600508	上海能源	2,567,910.88	1.66
17	002283	天润曲轴	2,500,317.00	1.62
18	600531	豫光金铅	2,499,248.00	1.62
19	600629	华建集团	2,486,632.67	1.61
20	600090	同济堂	2,480,621.00	1.60

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票；

2、基金持有的股票分类为交易性金融资产的，本项的“累计买入金额”按买卖成交金额

（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	600162	香江控股	3,118,083.00	2.02
2	600676	交运股份	2,945,021.95	1.90
3	601636	旗滨集团	2,919,801.00	1.89
4	600269	赣粤高速	2,845,054.00	1.84
5	300495	美尚生态	2,502,859.00	1.62
6	601368	绿城水务	2,469,327.00	1.60
7	300232	洲明科技	2,426,523.31	1.57
8	600273	嘉化能源	2,390,072.00	1.54
9	600323	瀚蓝环境	2,286,479.50	1.48
10	002540	亚太科技	2,255,996.74	1.46
11	600668	尖峰集团	2,232,392.65	1.44
12	002452	长高集团	2,205,334.00	1.43
13	000498	山东路桥	2,180,507.00	1.41
14	600824	益民集团	2,105,585.00	1.36
15	000055	方大集团	2,082,945.00	1.35
16	600467	好当家	2,058,142.00	1.33
17	600641	万业企业	2,041,170.78	1.32
18	600020	中原高速	2,002,153.00	1.29
19	002042	华孚时尚	1,980,892.00	1.28
20	600261	阳光照明	1,956,551.00	1.26

注：1、卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票；

2、基金持有的股票分类为交易性金融资产的，本项“累计卖出金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	866,815,368.10
卖出股票收入（成交）总额	709,944,289.75

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票；卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票；

2、“买入股票成本（成交）总额”、“卖出股票收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

## **8.5 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。

## **8.6 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**

本基金本报告期末未持有债券。

## **8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

## **8.8 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贵金属投资明细**

本基金本报告期末未持有贵金属。

## **8.9 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**

本基金本报告期末未持有权证。

## **8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

### **8.10.1 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。

### **8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，有选择地投资于流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金在进行股指期货投资时，首先将基于对证券市场总体行情的判断和组合风险收益的分析确定投资时机，并根据风险资产投资（或拟投资）的总体规模和风险系数决定股指期货的投资比例；其次，本基金将在综合考虑证券市场和期货市场运行趋势以及股指期货流动性、收益性、风险特征和估值水平的基础上进行投资品种选择，以对冲风险资产组合的系统性风险和流动性风险。

## **8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

### **8.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金参与国债期货投资是为了有效控制债券市场的系统性风险，本基金将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，适度运用国债期货提高投资组合运作效率。在国债期货投资过程中，基金管理人通过对宏观经济和利率市场走势的分析与判断，并充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置，谨慎进行投资，以调整债券组合的久期，降低投资组合的整体风险。

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

## 8.12 投资组合报告附注

**8.12.1** 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。

**8.12.2** 本基金及目标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。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	11,221.36
2	应收证券清算款	247,680.07
3	应收股利	-
4	应收利息	5,966.50
5	应收申购款	91,946.69
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	356,814.62

### 8.12.4 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。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 8.12.5.1 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。

#### 8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	300040	九洲电气	987,268.32	0.64	重大事项



## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
招商中证 1000 指数 A	1,167	133,388.32	-	-	155,664,171.36	100.00%
招商中证 1000 指数 C	4,285	2,873.99	-	-	12,315,055.01	100.00%
合计	5,452	30,810.57	-	-	167,979,226.37	100.00%

注：分级基金机构投资者/个人投资者持有份额占总份额比例计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	招商中证 1000 指数 A	9,227.78	0.0059%
	招商中证 1000 指数 C	1,253.42	0.0102%
	合计	10,481.20	0.0062%

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	招商中证 1000 指数 A	0~10
	招商中证 1000 指数 C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	招商中证 1000 指数 A	0
	招商中证 1000 指数 C	0
	合计	0

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	招商中证 1000 指数 A	招商中证 1000 指数 C
基金合同生效日（2017 年 3 月 3 日）	200,198,706.99	785,323.90
基金份额总额		
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	10,547,222.83	22,561,309.39
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	55,081,758.46	11,031,578.28
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	155,664,171.36	12,315,055.01

## §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期没有举行基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人监事会主席丁安华先生因工作调动原因辞任公司监事会主席职务。2017 年 9 月 15 日，经招商基金管理有限公司第五届监事会 2017 年第二次会议审议通过，选举赵斌先生担任公司第五届监事会主席；

2、2017 年 8 月，陈四清先生担任中国银行股份有限公司董事长、执行董事、董事会战略发展委员会主席及委员等职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘用德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）为其审计机构，本报告所涵盖的审计期间为基金成立日（2017 年 3 月 3 日）起至 2017 年 12 月 31 日止，本报告期应支付德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为人民币 50,000.00 元。



## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金管理人没有受到监管部门的稽查或处罚，亦未收到关于基金管理人的高级管理人员、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员受到监管部门的稽查或处罚的书面通知或文件。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
招商证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	3	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	3	-	-	-	-	-
大通证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	3	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	3	-	-	-	-	-
国泰君安	3	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	4	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	3	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-

中信建投	6	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
西藏东方财富	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	3	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	4	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
第一创业证券	2	1,573,276,351.44	100.00%	206,574.54	100.00%	-

注：基金交易佣金根据券商季度综合评分结果给与分配，券商综合评分根据研究报告质量、路演质量、联合调研质量以及销售服务质量打分，从多家服务券商中选取符合法律规范经营的综合能力靠前的券商给与佣金分配，季度评分和佣金分配分别由专人负责。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
招商证券	-	-	180,000,000.00	15.99%	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-

新时代证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
第一创业证券	147,212.86	100.00%	945,900,000.00	84.01%	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	招商中证 1000 指数增强型证券投资基金基金份额发售公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2017 年 1 月 14 日
2	招商中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同	中国证券报、证券时报、上海证券报	2017 年 1 月 14 日
3	招商中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同内容摘要	中国证券报、证券时报、上海证券报	2017 年 1 月 14 日
4	招商中证 1000 指数增强型证券投资基金托管协议	中国证券报、证券时报、上海证券报	2017 年 1 月 14 日
5	招商中证 1000 指数增强型证券投资基金招募说明书	中国证券报、证券时报、上海证券报	2017 年 1 月 14 日
6	招商基金管理有限公司关于养老金账户通过直销中心认购旗下招商中证 1000 指数增强型证券投资基金基金份额费率优惠的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2017 年 1 月 14 日
7	招商中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合	中国证券报、证券时	2017 年 3 月 4 日

	同生效公告	报、上海证券报	
8	关于开放招商中证 1000 指数增强型证券投资基金日常申购赎回及转换和定期定额投资业务的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2017 年 3 月 4 日
9	招商基金关于招商沪深 300 指数增强型证券投资基金、招商中证 1000 指数增强型证券投资基金参加中国银行、交通银行基金定投申购优惠活动、网上交易系统申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2017 年 3 月 17 日
10	招商基金管理有限公司关于招商中证 1000 指数增强型证券投资基金以及招商沪深 300 指数增强型证券投资基金增加招商银行为代销机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2017 年 4 月 14 日
11	招商基金旗下部分基金增加同花顺为代销机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2017 年 4 月 21 日
12	招商基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参加交通银行股份有限公司手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2017 年 4 月 22 日
13	招商基金管理有限公司关于降低旗下部分开放式基金在好买基金业务最低限额的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2017 年 6 月 2 日
14	招商基金旗下部分基金增加汇成基金为代销机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2017 年 6 月 29 日
15	招商基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参加交通银行股份有限公司网上银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2017 年 7 月 1 日
16	招商基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参加交通银行股份有限公司手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2017 年 7 月 3 日
17	招商基金旗下部分基金增加上海长量为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2017 年 7 月 18 日
18	招商中证 1000 指数增强型证券投资基金 2017 年第 2 季度报告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2017 年 7 月 21 日
19	招商基金旗下部分基金增加新兰德为代销机构及开通定投和转换业务的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2017 年 7 月 28 日
20	招商中证 1000 指数增强型证券投资基金 2017 年半年度报告摘要	中国证券报、证券时报、上海证券报	2017 年 8 月 29 日
21	招商中证 1000 指数增强型证券投资基金 2017 年半年度报告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2017 年 8 月 29 日
22	招商基金管理有限公司旗下基金增加华安证券为代销机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2017 年 9 月 4 日
23	招商基金管理有限公司关于旗下部分基金参与华安证券申购及定投费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2017 年 9 月 11 日
24	招商基金管理有限公司关于旗下基金估值变更的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2017 年 9 月 15 日
25	招商基金管理有限公司关于旗下部分产品参加江	中国证券报、证券时	2017 年 9 月 19 日

	南农村商业银行费率优惠活动的公告	报、上海证券报	
26	招商中证 1000 指数增强型证券投资基金更新的招募说明书 2017 年第 1 号	中国证券报、证券时报、上海证券报	2017 年 10 月 16 日
27	招商中证 1000 指数增强型证券投资基金更新的招募说明书摘要 2017 年第 1 号	中国证券报、证券时报、上海证券报	2017 年 10 月 16 日
28	关于招商基金管理有限公司北京分公司办公地址变更的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2017 年 10 月 20 日
29	招商中证 1000 指数增强型证券投资基金 2017 年第 3 季度报告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2017 年 10 月 26 日
30	招商基金管理有限公司关于旗下部分产品增加中国邮储银行为代销机构并参加中国邮储银行定投费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2017 年 11 月 20 日
31	招商基金旗下部分基金增加嘉实财富为代销机构及开通定投和转换业务的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2017 年 11 月 28 日
32	招商基金管理有限公司关于旗下招商央视财经 50 指数证券投资基金等指定开放式基金开展转换费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2017 年 11 月 29 日
33	招商基金管理有限公司关于旗下指数基金和指数分级基金开展直销柜台费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2017 年 11 月 29 日
34	招商基金管理有限公司关于旗下基金调整流通受限股票估值方法的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2017 年 12 月 6 日
35	招商基金旗下部分基金增加盈米财富为代销机构及开通定投和转换业务的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2017 年 12 月 7 日
36	关于招商基金旗下部分基金增加基煜为代销机构并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2017 年 12 月 28 日
37	关于招商基金管理有限公司参加中国邮储银行个人网上银行和手机银行基金前端申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2017 年 12 月 28 日
38	招商基金管理有限公司关于增加注册资本及修改公司章程的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2017 年 12 月 28 日
39	招商基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参加交通银行股份有限公司手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2017 年 12 月 30 日

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
个人	1	20170303-20171231	64,002,200.00	-	10,000,000.00	54,002,200.00	32.15%
个人	2	20170303-20171231	68,002,400.00	-	20,000,000.00	48,002,400.00	28.58%

个人	3	20170303-20171231	68,002,400.00	-	20,000,000.00	48,002,400.00	28.58%
产品特有风险							
本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况，可能会出现集中赎回甚至巨额赎回从而引发基金净值剧烈波动，甚至引发基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。							

## §13 备查文件目录

### 13.1 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准予招商中证 1000 指数增强型证券投资基金设立的文件；
- 3、《招商中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 4、《招商中证 1000 指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 5、《招商中证 1000 指数增强型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。

### 13.2 存放地点

招商基金管理有限公司

地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 28 层

### 13.3 查阅方式

上述文件可在招商基金管理有限公司互联网站 <http://www.cmfchina.com> 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 3 月 30 日