招商沪深300指数增强型证券投资基金2018年度报告

2018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：2019年3月28日

§1 重要提示及目录

1.1 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 2019 年 3 月 27 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 2018 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 2018 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....1
1.1 重要提示.....1
1.2 目录.....2
§2 基金简介.....4
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
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....5
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
§4 管理人报告.....10
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遵规守信情况的说明.....12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....13
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.....14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....15
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.....16
4.9 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....16
§5 托管人报告.....16
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....17
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.....17
§6 审计报告.....17
§7 年度财务报表.....19
7.1 资产负债表.....19
7.2 利润表.....21
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....22
7.4 报表附注.....24
§8 投资组合报告.....48
8.1 期末基金资产组合情况.....48
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....48
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.....49
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....53
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....55
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.....55
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.....56

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.....56
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.....56
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....56
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....56
8.12 投资组合报告附注.....57
§9 基金份额持有人信息.....58
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....58
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....59
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情况.....59
§10 开放式基金份额变动.....59
§11 重大事件揭示.....60
11.1 基金份额持有人大会决议.....60
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.....60
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....60
11.4 基金投资策略的改变.....60
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....60
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.....61
11.8 其他重大事件.....63
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....66
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
§13 备查文件目录.....66
13.1 备查文件目录.....66
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	招商沪深 300 指数增强型证券投资基金	
基金简称	招商沪深 300 指数	
基金主代码	004190	
交易代码	004190	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 2 月 10 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	122,041,593.92 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	招商沪深 300 指数 A	招商沪深 300 指数 C
下属分级基金的交易代码	004190	004191
报告期末下属分级基金的份额总额	78,005,694.08 份	44,035,899.84 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	沪深 300 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	http://www.cmfchina.com
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

1、招商沪深 300 指数 A

单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018 年	2017 年 2 月 10 日(基金合同生效日)-2017 年 12 月 31 日
本期已实现收益	13,395,840.73	11,068,476.36
本期利润	-9,810,037.04	38,247,014.03
加权平均基金份额本期利润	-0.1151	0.1806
本期加权平均净值利润率	-10.23%	16.94%

本期基金份额净值增长率	-22.25%	17.63%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末	2017 年末
期末可供分配利润	-6,658,290.14	11,392,393.47
期末可供分配基金份额利润	-0.0854	0.0502
期末基金资产净值	71,347,403.94	266,915,890.98
期末基金份额净值	0.9146	1.1763
3.1.3 累计期末指标	2018 年末	2017 年末
基金份额累计净值增长率	-8.54%	17.63%

2、招商沪深 300 指数 C

单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018 年	2017 年
本期已实现收益	1,453,517.40	746,712.70
本期利润	-10,516,427.61	1,315,233.12
加权平均基金份额本期利润	-0.2799	0.1459
本期加权平均净值利润率	-26.40%	12.61%
本期基金份额净值增长率	-22.54%	17.51%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末	2017 年末
期末可供分配利润	-3,954,187.47	1,431,425.21
期末可供分配基金份额利润	-0.0898	0.0491
期末基金资产净值	40,081,712.37	34,289,920.21
期末基金份额净值	0.9102	1.1751
3.1.3 累计期末指标	2018 年末	2017 年末
基金份额累计净值增长率	-8.98%	17.51%

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、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。

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

招商沪深 300 指数 A

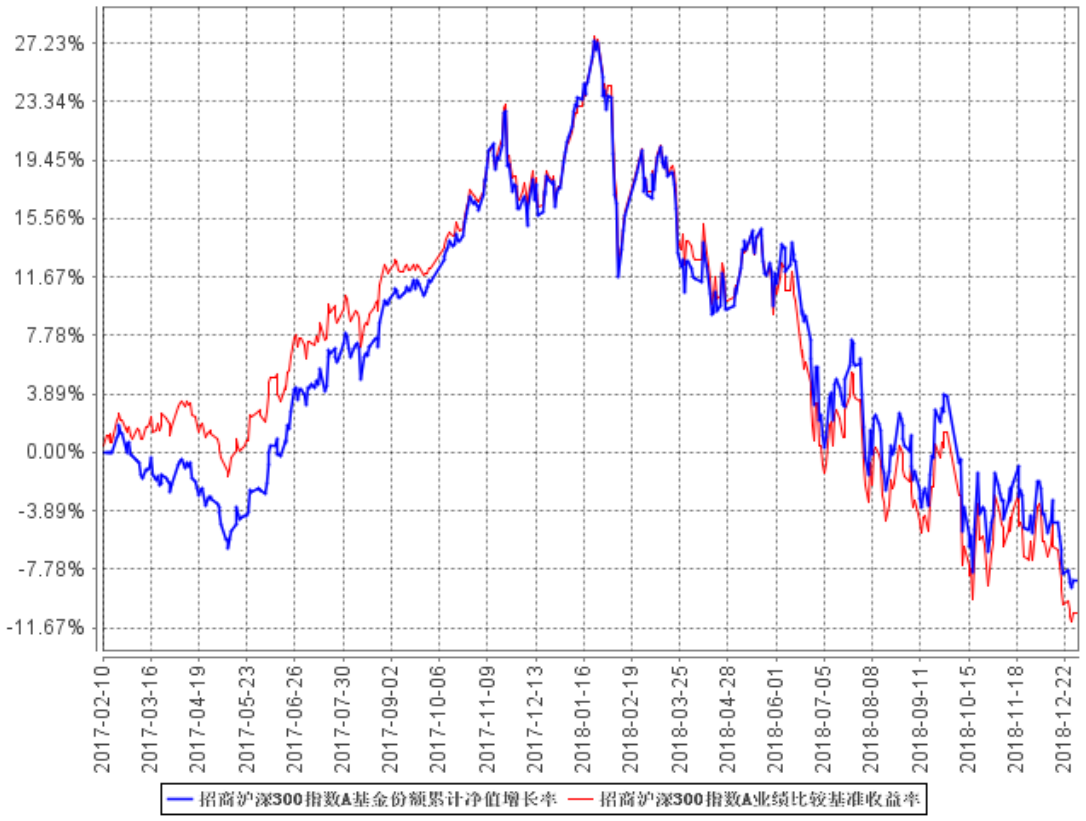
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-11.85%	1.55%	-11.83%	1.56%	-0.02%	-0.01%
过去六个月	-13.41%	1.45%	-13.52%	1.42%	0.11%	0.03%
过去一年	-22.25%	1.31%	-24.12%	1.27%	1.87%	0.04%
自基金合同生效起至今	-8.54%	1.05%	-10.67%	1.02%	2.13%	0.03%

招商沪深 300 指数 C

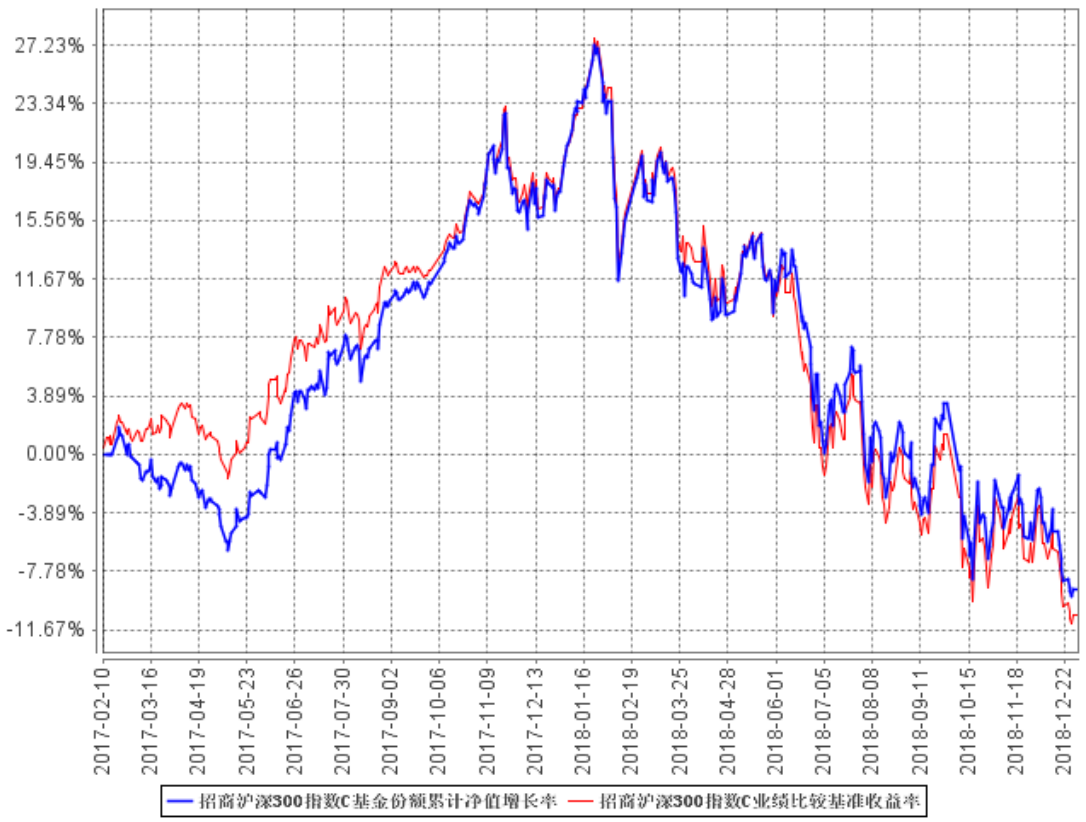
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-11.95%	1.55%	-11.83%	1.56%	-0.12%	-0.01%
过去六个月	-13.58%	1.45%	-13.52%	1.42%	-0.06%	0.03%
过去一年	-22.54%	1.31%	-24.12%	1.27%	1.58%	0.04%
自基金合同生效起至今	-8.98%	1.05%	-10.67%	1.02%	1.69%	0.03%

3.2.2 自基金合同生效/自基金转型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

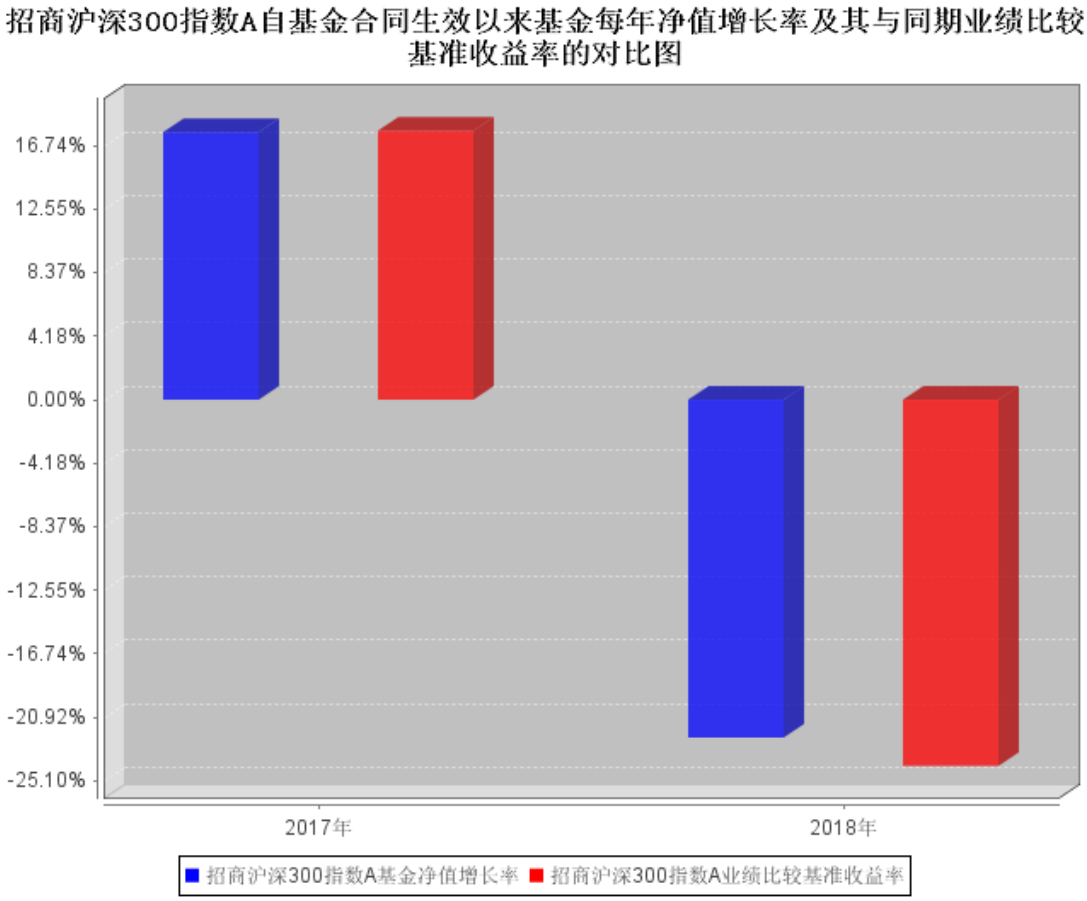
招商沪深300指数A基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

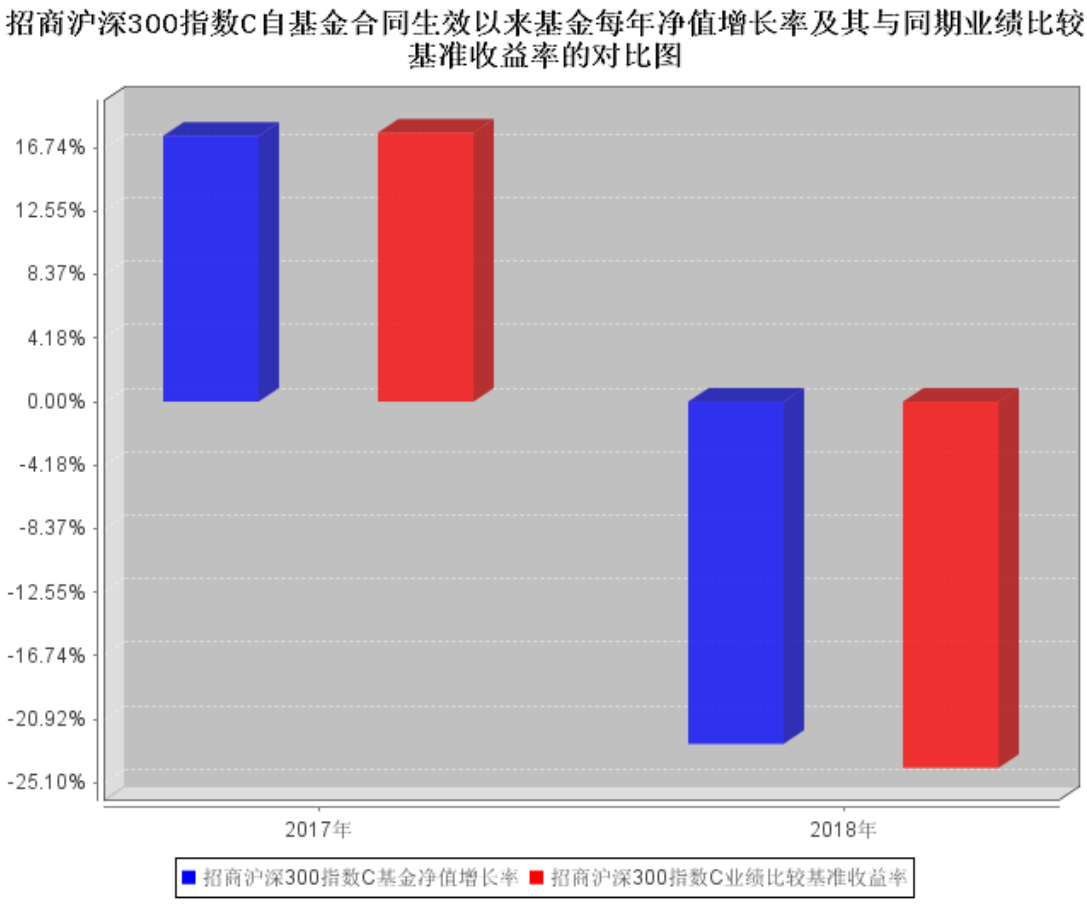


招商沪深300指数C基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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





注：本基金于 2017 年 2 月 10 日成立，截至 2017 年 12 月 31 日基金成立未满 1 年，故成立当年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 2 月 10 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，公司注册资本金为人民币 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。

2018 年获奖情况如下：

债券投资能力五星基金公司·海通证券

英华奖公募基金 20 年特别评选·公募基金 20 年最佳回报债券型基金（二级债）（招商安瑞进取债券） 《中国基金报》

英华奖公募基金 20 年特别评选·公募基金 20 年最佳回报债券型基金（纯债）（招商安心收益债券） 《中国基金报》

英华奖公募基金 20 年特别评选·公募基金 20 年最佳回报债券型基金（纯债）（招商信用添利债券（LOF）） 《中国基金报》

英华奖公募基金 20 年特别评选·公募基金 20 年“最佳固定收益基金管理人” 《中国基金报》

明星基金奖·五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·五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·2017 年度绝对收益明星基金（招商丰融混合）《证券时报》

Morningstar 晨星(中国)2018 年度普通债券型基金奖提名（招商安心收益债券）

金牛奖·五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》

金基金奖·五年期债券基金奖（招商产业债券） 《上海证券报》

公募基金 20 周年·“金基金”债券投资回报基金管理公司奖《上海证券报》

公募基金 20 周年·“金基金”行业领军人物奖（金旭）《上海证券报》

致敬基金 20 年·基金行业领军人物奖（金旭）《新浪》

致敬基金 20 年·最受投资者欢迎基金公司奖《新浪》

致敬基金 20 年·区域影响力奖 《新浪》

金牛奖·三年期海外金牛私募投资经理（多策略）《中国证券报》

中国金融科技先锋榜·2018 中国 AI 金融先锋榜《证券时报》

中国金融科技先锋榜·2018 年中国智能投顾新锐榜《证券时报》

金帆奖·2018 年度基金管理公司《21 世纪经济报道》

2018 年度教育扶贫先锋企业《国际金融报》

金鼎奖·最具潜力基金公司《每日经济新闻》

离岸中资基金大奖·最具创意产品·香港中资基金业协会、彭博

中国网金融扶贫先锋榜·中国网精准扶贫先锋机构《中国网》

金砖奖·最佳资产配置奖《南方都市报》

金禧奖·2018 最佳基金投研团队《投资时报》

腾讯理财通金企鹅奖·最佳债券基金奖·腾讯、晨星

中国金融金领带奖·年度卓越海外投资基金《华尔街见闻》

公募基金 20 周年行业特别评选·卓越影响力基金公司《界面·财联社》

公募基金 20 周年行业特别评选·最佳互联网金融服务基金公司《界面·财联社》

金蝉奖·2018 年度基金管理公司《华夏时报》

基情 20 年最受欢迎基金公司·东方财富、天天基金

天天基金 6 周年定投榜·东方财富、天天基金

2018 年东方风云榜连续三年稳回报基金·东方财富、天天基金

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 2 月 10 日	-	12	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，曾任招商深证 100 指数证券投资基金、上证消费 80 交易型开放式指数证券投资基金、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、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、招商央视财经 50 指数证券投资基金、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、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。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五次

，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 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

报告期内，受内部金融去杠杆及外部贸易摩擦的影响，市场大幅下跌，总体而言价值股跌幅稍微小些，从因子角度来看，价值类因子占优，回顾全年行情，沪深 300 指数下跌 25.31%，中证 500 下跌 33.32%，创业板指下跌 28.65%，中证 1000 下跌 36.87%。

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。

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 94.5%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-22.25%，同期业绩基准增长率为-24.12%，C 类份额净值增长率为-22.54%，同期业绩基准增长率为-24.12%。

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、报告期欧洲经济增速放缓，美国经济逐步见顶。从数据上看，美国 12 月制造业 PMI 回落至 54.1%，大幅低于预期，新订单指数显著回落，显示出企业部门面临较大的下行压力。欧元区通胀小幅下行，制造业 PMI 连续五个月下跌，制造业整体在 2018 年以弱势收尾。展望 2019 年，在贸易摩擦可能蔓延、地缘局势面临升级的背景下，全球经济面临下行压力。

2、国内 2018 全年 GDP 增长 6.6%，比 2017 年下行 0.2%，分季度来看，GDP 一季度同比增长 6.8%，二季度同比增长 6.7%，三季度同比增长 6.5%，四季度同比增长 6.4%，全年经济增速缓慢下行。分项来看，拉动经济的三驾马车中投资增速放缓，消费延续下行，进出口受中美贸易摩擦影响增速低于 2017 年，当前经济仍旧面临下行压力，政策效果暂未显现。展望 2019 年，房地产投资与消费仍有下行压力，出口依然受牵制，在此背景下，经济进一步下滑的压力依然存在，后续期待财政政策进一步发挥作用。

3、报告期内受国内金融去杠杆的影响，资本市场的信用风险持续上升，高杠杆及融资依赖型公司股价显著回落，而另一方面在中美贸易摩擦影响下，电子行业受较大影响全年跌幅较大，有色金属板块则受到国内经济下行压力的影响，跌幅靠前。整体来看 2018 年 A

股普跌，并多次探底，当前 A 股整体估值水平处于底部区域，横向与国际比较亦有较大优势，长期来看具有较大配置价值。

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，包括不定期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 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”）在招商沪深 300 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	招商沪深 300 指数增强型证券投资基金全体持有人
审计意见	我们审计了招商沪深 300 指数增强型证券投资基金的财务报表，包括 2018 年 12 月 31 日的资产负债表，2018 年度的利润表、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，公允反映了招商沪深 300 指数增强型证券投资基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况、2018 年度的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	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，我们独立于招商沪深 300 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。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	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。其他信息包括招商沪深 300 指数增

	强型证券投资基金 2018 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。 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。 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。 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。
管理层和治理层对财务报表的责任	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。 在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估招商沪深 300 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沪深 300 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。 基金管理人治理层负责监督招商沪深 300 指数增强型证券投资基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	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。 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： (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。 (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。 (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。 (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，就可能导致对招商沪深 300 指数增强型证券投资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沪深 300 指数增强型证券投资基金不能持续经营。 (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。 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。	
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	中国上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼	
审计报告日期	2019 年 3 月 25 日	

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：招商沪深 300 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	5,929,541.96	17,481,677.05
结算备付金		765,265.47	6,030,238.57
存出保证金		29,105.77	1,126,016.01
交易性金融资产	7.4.7.2	105,396,519.16	276,768,842.91
其中：股票投资		105,378,519.24	276,768,842.91
基金投资		-	-
债券投资		17,999.92	-
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		40,161.00	256,220.75
应收利息	7.4.7.5	1,963.02	10,004.35
应收股利		-	-
应收申购款		115,953.61	260,705.72
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		112,278,509.99	301,933,705.36
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
负债：			
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		253,209.00	93,021.50
应付管理人报酬		116,197.31	305,884.69
应付托管费		14,524.67	38,235.58
应付销售服务费		13,966.87	11,983.03
应付交易费用	7.4.7.7	23,969.65	18,765.73
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	427,526.18	260,003.64
负债合计		849,393.68	727,894.17
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	122,041,593.92	256,091,119.55
未分配利润	7.4.7.10	-10,612,477.61	45,114,691.64
所有者权益合计		111,429,116.31	301,205,811.19
负债和所有者权益总计		112,278,509.99	301,933,705.36

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，招商沪深 300 指数 A 份额净值 0.9146 元，基金份额总额 78,005,694.08 份；招商沪深 300 指数 C 份额净值 0.9102 元，基金份额总额 44,035,899.84 份；总份额合计 122,041,593.92 份。

7.2 利润表

会计主体：招商沪深 300 指数增强型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 2 月 10 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日
一、收入		-17,246,988.79	44,590,003.76
1.利息收入		96,810.67	243,377.72
其中：存款利息收入	7.4.7.11	96,757.58	168,071.24
债券利息收入		53.09	23.64
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	75,282.84
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		17,737,873.06	16,561,413.63
其中：股票投资收益	7.4.7.12	15,742,008.23	12,494,193.91
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	26,104.72	26,341.96
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	568,237.29	415,860.00
股利收益	7.4.7.16	1,401,522.82	3,625,017.76
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-35,175,822.78	27,747,058.09

4.汇兑收益（损失以“－”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	94,150.26	38,154.32
减：二、费用		3,079,475.86	5,027,756.61
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	1,645,417.76	2,511,114.18
2.托管费	7.4.10.2.2	205,677.17	313,889.25
3.销售服务费	7.4.10.2.3	159,422.66	36,676.81
4.交易费用	7.4.7.19	548,266.01	1,706,912.81
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		2,141.14	-
7.其他费用	7.4.7.20	518,551.12	459,163.56
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-20,326,464.65	39,562,247.15
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-20,326,464.65	39,562,247.15

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：招商沪深 300 指数增强型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 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）	256,091,119.55	45,114,691.64	301,205,811.19
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-20,326,464.65	-20,326,464.65
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-134,049,525.63	-35,400,704.60	-169,450,230.23

（净值减少以“－”号填列）			
其中：1.基金申购款	111,789,894.41	5,094,971.25	116,884,865.66
2.基金赎回款	-245,839,420.04	-40,495,675.85	-286,335,095.89
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）	122,041,593.92	-10,612,477.61	111,429,116.31
项目	上年度可比期间 2017 年 2 月 10 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）	200,058,189.86	-	200,058,189.86
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	39,562,247.15	39,562,247.15
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）	56,032,929.69	5,552,444.49	61,585,374.18
其中：1.基金申购款	73,068,677.11	7,957,471.80	81,026,148.91
2.基金赎回款	-17,035,747.42	-2,405,027.31	-19,440,774.73
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）	256,091,119.55	45,114,691.64	301,205,811.19

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

招商沪深 300 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》、《招商沪深 300 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]3125 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。本基金根据是否收取销售服务费，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 200,058,189.86 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 00013 号验资报告。基金合同于 2017 年 2 月 10 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《招商沪深 300 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%，投资于沪深 300 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，其中现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数收益率×95%+同期银行活期存款利率(税后)×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 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度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。本基金上年度可比期间为自 2017 年 2 月 10 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情况下，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要说明的重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要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[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 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
活期存款	5,929,541.96	17,481,677.05
定期存款	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计	5,929,541.96	17,481,677.05

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2018 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		112,807,283.93	105,378,519.24	-7,428,764.69
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	17,999.92	17,999.92	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	17,999.92	17,999.92	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-

其他		-	-	-
合计		112,825,283.85	105,396,519.16	-7,428,764.69
项目		上年度末 2017 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		249,330,904.82	276,768,842.91	27,437,938.09
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		249,330,904.82	276,768,842.91	27,437,938.09

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-
项目	上年度末 2017 年 12 月 31 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	7,277,760.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	7,277,760.00	-	-	-

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

本基金本报告期末及上年度末无各项买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度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 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	1,777.53	3,300.00
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	171.29	6,688.95
应收债券利息	1.10	-
应收资产支持证券利息	-	-
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	13.10	15.40
合计	1,963.02	10,004.35

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	23,969.65	18,765.73
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	23,969.65	18,765.73

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	26.18	3.64
预提费用	377,500.00	210,000.00
应付指数使用费	50,000.00	50,000.00
合计	427,526.18	260,003.64

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

招商沪深 300 指数 A		
项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	226,911,150.85	226,911,150.85
本期申购	60,658,414.08	60,658,414.08

本期赎回（以“-”号填列）	-209,563,870.85	-209,563,870.85
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	78,005,694.08	78,005,694.08

金额单位：人民币元

招商沪深 300 指数 C		
项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	29,179,968.70	29,179,968.70
本期申购	51,131,480.33	51,131,480.33
本期赎回（以“-”号填列）	-36,275,549.19	-36,275,549.19
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	44,035,899.84	44,035,899.84

注：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。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

招商沪深 300 指数 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	11,392,393.47	28,612,346.66	40,004,740.13
本期利润	13,395,840.73	-23,205,877.77	-9,810,037.04
本期基金份额交易产生的变动数	-17,173,894.01	-19,679,099.22	-36,852,993.23
其中：基金申购款	7,126,264.25	-6,880,957.41	245,306.84
基金赎回款	-24,300,158.26	-12,798,141.81	-37,098,300.07
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,614,340.19	-14,272,630.33	-6,658,290.14

单位：人民币元

招商沪深 300 指数 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,431,425.21	3,678,526.30	5,109,951.51
本期利润	1,453,517.40	-11,969,945.01	-10,516,427.61
本期基金份额交易产生的变动数	1,184,539.68	267,748.95	1,452,288.63
其中：基金申购款	5,183,847.94	-334,183.53	4,849,664.41
基金赎回款	-3,999,308.26	601,932.48	-3,397,375.78
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,069,482.29	-8,023,669.76	-3,954,187.47

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 2 月 10 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日

活期存款利息收入	81,460.69	124,757.14
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	13,987.22	37,826.47
其他	1,309.67	5,487.63
合计	96,757.58	168,071.24

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 2 月 10 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	15,742,008.23	12,494,193.91
股票投资收益——赎回差价收入	-	-
股票投资收益——申购差价收入	-	-
合计	15,742,008.23	12,494,193.91

7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 2 月 10 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	403,486,740.52	751,928,338.58
减：卖出股票成本总额	387,744,732.29	739,434,144.67
买卖股票差价收入	15,742,008.23	12,494,193.91

7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无股票赎回差价收入。

7.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无股票申购差价收入。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 2 月 10 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差	26,104.72	26,341.96

价收入		
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	26,104.72	26,341.96

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 2 月 10 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	422,156.79	182,465.60
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	395,994.79	156,098.87
减：应收利息总额	57.28	24.77
买卖债券差价收入	26,104.72	26,341.96

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无债券赎回差价收入。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无债券申购差价收入。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无买卖贵金属差价收入。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属赎回差价收入。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属申购差价收入。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具买卖权证差价收入。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间收益金额 2017 年 2 月 10 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日
股指期货-投资收益	568,237.29	415,860.00

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 2 月 10 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	1,401,522.82	3,625,017.76
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	1,401,522.82	3,625,017.76

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 2 月 10 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	-34,866,702.78	27,437,938.09
——股票投资	-34,866,702.78	27,437,938.09
——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	-	-
——期货投资	-309,120.00	309,120.00
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-35,175,822.78	27,747,058.09

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 2 月 10 日（基金合同生效日）

		至 2017 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	64,836.38	28,325.35
转换费收入	29,313.88	9,828.97
合计	94,150.26	38,154.32

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。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 2 月 10 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	548,266.01	1,706,912.81
银行间市场交易费用	-	-
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	548,266.01	1,706,912.81

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 2 月 10 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日
审计费用	42,500.00	50,000.00
信息披露费	255,000.00	240,000.00
指数使用费	200,000.00	154,275.33
银行费用	3,051.12	3,988.23
其他	18,000.00	10,900.00
合计	518,551.12	459,163.56

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

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

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
中国银行股份有限公司	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

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2017 年 2 月 10 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
招商证券	-	-	497,511,569.04	28.66%

7.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券交易。

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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2017 年 2 月 10 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
招商证券	-	-	340,000,000.00	100.00%

7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例

招商证券	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2017 年 2 月 10 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
招商证券	463,331.73	57.91%	-	-

注：1、本基金与关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立；

2、基金对该类交易的佣金的计算方式是按合同约定的佣金率计算。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供研究成果和市场信息等证券综合服务，并不收取额外对价。

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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 2 月 10 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	1,645,417.76	2,511,114.18
其中：支付销售机构的客户维护费	370,802.37	70,574.41

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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 2 月 10 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	205,677.17	313,889.25

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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费

	招商沪深 300 指数 A	招商沪深 300 指数 C	合计
中国银行	-	1,763.10	1,763.10
招商基金管理有限公司	-	2,874.62	2,874.62
招商银行	-	143,344.81	143,344.81
合计	-	147,982.53	147,982.53
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017 年 2 月 10 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		
	招商沪深 300 指数 A	招商沪深 300 指数 C	合计
招商基金管理有限公司	-	540.62	540.62
招商银行	-	34,169.64	34,169.64
中国银行	-	197.30	197.30
合计	-	34,907.56	34,907.56

注：根据基金合同的规定，招商沪深 300 指数增强 A 不收取销售服务费,招商沪深 300 指数增强 C 的销售服务费按基金前一日的资产净值×0.40%的年费率来计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

招商沪深 300 指数增强 C 的日销售服务费＝前一日招商沪深 300 指数增强 C 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

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方进行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

本报告期内及上年度可比期间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

本报告期末及上年度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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2017 年 2 月 10 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	期末余额	当期利息收入
中国银行	5,929,541.96	81,460.69	17,481,677.05	124,757.14

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行股份有限公司保管，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

本基金本报告期内及上年度可比期间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（2018 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
601860	紫金银行	2018 年 12 月 20 日	2019 年 1 月 3 日	新股流通受限	3.14	3.14	15,970	50,145.80	50,145.80	-
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
110049	海尔转债	2018 年 12 月 20 日	2019 年 1 月 18 日	新债未上市	100.00	100.00	180	17,999.92	17,999.92	-

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
000540	中天金融	2017 年 8 月 21 日	重大事项	3.80	2019 年 1 月 2 日	4.38	204,486	903,635.52	777,046.80	-
600030	中信证券	2018 年 12 月 25 日	重大事项	16.01	2019 年 1 月 10 日	17.15	42,478	718,316.77	680,072.78	-

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；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，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 至 7.4.13.2.6 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

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
AAA	17,999.92	-
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	17,999.92	-

注：上述评级均由经中国证监会核准从事证券市场资信评级业务的评级机构做出。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

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。本基金流动性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，本基金通过预留一定的现金头寸，并且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，利率风险不重大。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 2018 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	5,929,541.96	-	-	-	-	-	5,929,541.96
结算备付金	765,265.47	-	-	-	-	-	765,265.47
存出保证金	29,105.77	-	-	-	-	-	29,105.77
交易性金融资产	-	-	-	-	17,999.92	105,378,519.24	105,396,519.16
应收证券清算款	-	-	-	-	-	40,161.00	40,161.00
应收利息	-	-	-	-	-	1,963.02	1,963.02
应收申购款	-	-	-	-	-	115,953.61	115,953.61
资产总计	6,723,913.20	-	-	-	17,999.92	105,536,596.87	112,278,509.99
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	253,209.00	253,209.00
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	116,197.31	116,197.31
应付托管费	-	-	-	-	-	14,524.67	14,524.67
应付销售	-	-	-	-	-	13,966.87	13,966.87

服务费							
应付交易费用	-	-	-	-	-	23,969.65	23,969.65
其他负债	-	-	-	-	-	427,526.18	427,526.18
负债总计	-	-	-	-	-	849,393.68	849,393.68
利率敏感度缺口	6,723,913.20	-	-	-	17,999.92	104,687,203.19	111,429,116.31
上年度末 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	17,481,677.05	-	-	-	-	-	17,481,677.05
结算备付金	6,030,238.57	-	-	-	-	-	6,030,238.57
存出保证金	34,352.01	-	-	-	-	1,091,664.00	1,126,016.01
交易性金融资产	-	-	-	-	-	276,768,842.91	276,768,842.91
应收证券清算款	-	-	-	-	-	256,220.75	256,220.75
应收利息	-	-	-	-	-	10,004.35	10,004.35
应收申购款	-	-	-	-	-	260,705.72	260,705.72
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	23,546,267.63	-	-	-	-	278,387,437.73	301,933,705.36
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	309,120.00	309,120.00
应付赎回款	-	-	-	-	-	93,021.50	93,021.50
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	305,884.69	305,884.69
应付托管费	-	-	-	-	-	38,235.58	38,235.58
应付销售服务费	-	-	-	-	-	11,983.03	11,983.03
应付交易费用	-	-	-	-	-	18,765.73	18,765.73
其他负债	-	-	-	-	-	-49,116.36	-49,116.36
负债总计	-	-	-	-	-	727,894.17	727,894.17
利率敏感度缺口	23,546,267.63	-	-	-	-	277,659,543.56	301,205,811.19

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

假设	1.若市场利率平行上升或下降 50 个基点		
	2.其他市场变量保持不变		
	3.仅存在公允价值变动对基金资产净值的影响		
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（ 2018 年 12 月 31 日 ）	上年度末（ 2017 年 12 月 31 日 ）
	1. 市场利率平行上升 50 个基点	-511.41	-
	2. 市场利率平行下降 50 个基点	529.13	-

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 2018 年 12 月 31 日		上年度末 2017 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产-股票投资	105,378,519.24	94.57	276,768,842.91	91.89
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	105,378,519.24	94.57	276,768,842.91	91.89

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（ 2018 年 12 月 31 日 ）	上年度末（ 2017 年 12 月 31 日 ）
	1. 权益性投资的市场价格上升 5%	5,268,925.96	13,838,442.15
	2. 权益性投资的市场价格下降 5%	-5,268,925.96	-13,838,442.15

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。

资产	本期末(2018 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	103,871,253.86	1,507,265.38	-	105,378,519.24
债券投资	-	-	17,999.92	17,999.92
合计	103,871,253.86	1,507,265.38	17,999.92	105,396,519.16

单位：人民币元

资产	上年度末(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	271,954,516.61	4,559,394.30	254,932.00	276,768,842.91
债券投资	-	-	-	-
合计	271,954,516.61	4,559,394.30	254,932.00	276,768,842.91

单位：人民币元

(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)、或属于非公开发行等情况，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（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	105,378,519.24	93.85
	其中：股票	105,378,519.24	93.85
2	固定收益投资	17,999.92	0.02
	其中：债券	17,999.92	0.02
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	6,694,807.43	5.96
7	其他资产	187,183.40	0.17
8	合计	112,278,509.99	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（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	2,337,847.44	2.10
C	制造业	32,212,514.04	28.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,288,537.64	2.95
E	建筑业	4,605,559.21	4.13

F	批发和零售业	2,482,902.70	2.23
G	交通运输、仓储和邮政业	2,560,188.70	2.30
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	934,208.06	0.84
J	金融业	33,684,162.67	30.23
K	房地产业	6,408,028.58	5.75
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	233,416.00	0.21
S	综合	-	-
	合计	88,747,365.04	79.64

8.2.2 期末积极投资按行业分类境内股票投资组合

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	755,087.52	0.68
B	采矿业	425,316.90	0.38
C	制造业	11,393,330.69	10.22
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	31,464.00	0.03
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	644,596.92	0.58
J	金融业	456,475.62	0.41
K	房地产业	2,277,805.77	2.04
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	647,076.78	0.58
S	综合	-	-
	合计	16,631,154.20	14.93

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 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所有股票投资明细

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	601318	中国平安	136,600	7,663,260.00	6.88
2	000651	格力电器	98,552	3,517,320.88	3.16
3	600016	民生银行	504,860	2,892,847.80	2.60
4	000333	美的集团	72,734	2,680,975.24	2.41
5	601288	农业银行	700,700	2,522,520.00	2.26
6	600000	浦发银行	242,050	2,372,090.00	2.13
7	601328	交通银行	407,400	2,358,846.00	2.12
8	601166	兴业银行	142,800	2,133,432.00	1.91
9	000002	万科 A	80,219	1,910,816.58	1.71
10	601601	中国太保	67,200	1,910,496.00	1.71
11	601668	中国建筑	332,880	1,897,416.00	1.70
12	000858	五粮液	35,848	1,823,946.24	1.64
13	600519	贵州茅台	2,800	1,652,028.00	1.48
14	601398	工商银行	256,700	1,357,943.00	1.22
15	601229	上海银行	116,600	1,304,754.00	1.17
16	601818	光大银行	332,200	1,229,140.00	1.10
17	600585	海螺水泥	41,500	1,215,120.00	1.09
18	600886	国投电力	148,600	1,196,230.00	1.07
19	000069	华侨城 A	181,700	1,153,795.00	1.04
20	600741	华域汽车	62,049	1,141,701.60	1.02
21	600276	恒瑞医药	21,064	1,111,126.00	1.00
22	600606	绿地控股	178,300	1,089,413.00	0.98
23	000568	泸州老窖	26,299	1,069,317.34	0.96
24	002304	洋河股份	11,281	1,068,536.32	0.96
25	601336	新华保险	25,023	1,056,971.52	0.95
26	600332	白云山	28,993	1,036,789.68	0.93
27	601169	北京银行	168,200	943,602.00	0.85
28	601006	大秦铁路	111,137	914,657.51	0.82
29	600352	浙江龙盛	94,288	909,879.20	0.82
30	600028	中国石化	174,051	878,957.55	0.79
31	600383	金地集团	90,553	871,119.86	0.78
32	000876	新希望	117,694	856,812.32	0.77
33	000895	双汇发展	36,271	855,632.89	0.77
34	601186	中国铁建	78,269	850,784.03	0.76

35	600809	山西汾酒	23,157	811,652.85	0.73
36	600104	上汽集团	29,880	796,899.60	0.72
37	000898	鞍钢股份	154,629	793,246.77	0.71
38	600887	伊利股份	33,200	759,616.00	0.68
39	600739	辽宁成大	72,300	756,258.00	0.68
40	601998	中信银行	136,500	743,925.00	0.67
41	601607	上海医药	41,300	702,100.00	0.63
42	601669	中国电建	141,200	686,232.00	0.62
43	600030	中信证券	42,478	680,072.78	0.61
44	600660	福耀玻璃	29,700	676,566.00	0.61
45	000338	潍柴动力	87,700	675,290.00	0.61
46	600362	江西铜业	50,300	661,948.00	0.59
47	000001	平安银行	70,467	660,980.46	0.59
48	601390	中国中铁	94,400	659,856.00	0.59
49	600048	保利地产	55,361	652,706.19	0.59
50	600346	恒力股份	48,600	643,950.00	0.58
51	002475	立讯精密	44,672	628,088.32	0.56
52	600704	物产中大	136,800	626,544.00	0.56
53	002456	欧菲科技	62,305	572,582.95	0.51
54	601211	国泰君安	36,100	553,052.00	0.50
55	600019	宝钢股份	79,099	514,143.50	0.46
56	600900	长江电力	31,872	506,127.36	0.45
57	002146	荣盛发展	62,001	492,907.95	0.44
58	000166	申万宏源	111,200	452,584.00	0.41
59	601898	中煤能源	97,300	452,445.00	0.41
60	600406	国电南瑞	24,402	452,169.06	0.41
61	600023	浙能电力	95,201	450,300.73	0.40
62	600027	华电国际	94,205	447,473.75	0.40
63	600795	国电电力	173,055	443,020.80	0.40
64	600522	中天科技	53,950	439,692.50	0.39
65	000709	河钢股份	144,918	411,567.12	0.37
66	601939	建设银行	64,574	411,336.38	0.37
67	600015	华夏银行	55,510	410,218.90	0.37
68	600690	青岛海尔	29,548	409,239.80	0.37
69	601857	中国石油	56,523	407,530.83	0.37
70	600919	江苏银行	67,479	402,849.63	0.36
71	600153	建发股份	56,454	398,000.70	0.36
72	601111	中国国航	51,792	395,690.88	0.36
73	603858	步长制药	15,604	394,469.12	0.35
74	600837	海通证券	44,654	392,955.20	0.35
75	600029	南方航空	59,179	392,948.56	0.35
76	600188	兖州煤业	44,082	387,039.96	0.35
77	600115	东方航空	80,593	382,816.75	0.34

78	600518	康美药业	39,840	366,926.40	0.33
79	000425	徐工机械	97,600	315,248.00	0.28
80	600031	三一重工	34,700	289,398.00	0.26
81	002252	上海莱士	35,705	285,997.05	0.26
82	600170	上海建工	89,806	272,112.18	0.24
83	603288	海天味业	3,600	247,680.00	0.22
84	601600	中国铝业	69,400	246,370.00	0.22
85	601901	方正证券	46,300	245,853.00	0.22
86	601991	大唐发电	77,900	245,385.00	0.22
87	600637	东方明珠	23,900	244,736.00	0.22
88	000776	广发证券	19,200	243,456.00	0.22
89	601877	正泰电器	9,900	239,976.00	0.22
90	601618	中国中冶	76,900	239,159.00	0.21
91	002352	顺丰控股	7,300	239,075.00	0.21
92	601727	上海电气	48,300	238,602.00	0.21
93	002736	国信证券	28,500	238,545.00	0.21
94	600050	中国联通	45,900	237,303.00	0.21
95	600177	雅戈尔	33,000	237,270.00	0.21
96	600688	上海石化	47,500	237,025.00	0.21
97	600926	杭州银行	32,000	236,800.00	0.21
98	601009	南京银行	36,600	236,436.00	0.21
99	600233	圆通速递	23,500	235,000.00	0.21
100	600977	中国电影	16,300	233,416.00	0.21
101	300122	智飞生物	6,000	232,560.00	0.21
102	000938	紫光股份	7,400	231,324.00	0.21
103	000661	长春高新	1,300	227,500.00	0.20
104	600760	中航沈飞	8,000	221,680.00	0.20
105	300433	蓝思科技	33,800	220,038.00	0.20
106	600157	永泰能源	158,115	211,874.10	0.19
107	002271	东方雨虹	14,193	183,799.35	0.16
108	000157	中联重科	41,500	147,740.00	0.13
109	002415	海康威视	4,800	123,648.00	0.11
110	002142	宁波银行	1,800	29,196.00	0.03
111	601766	中国中车	3,200	28,864.00	0.03

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000656	金科股份	145,831	902,693.89	0.81
2	300703	创源文化	58,390	855,997.40	0.77

3	300573	兴齐眼药	48,887	821,790.47	0.74
4	002150	通润装备	129,231	801,232.20	0.72
5	600801	华新水泥	47,725	797,962.00	0.72
6	000596	古井贡酒	14,616	788,679.36	0.71
7	000540	中天金融	204,486	777,046.80	0.70
8	300106	西部牧业	143,009	755,087.52	0.68
9	600808	马钢股份	210,900	729,714.00	0.65
10	600781	辅仁药业	53,039	670,943.35	0.60
11	002021	中捷资源	155,542	469,736.84	0.42
12	002563	森马服饰	48,389	431,629.88	0.39
13	600985	淮北矿业	45,733	425,316.90	0.38
14	603208	江山欧派	15,604	415,222.44	0.37
15	002938	鹏鼎控股	23,572	412,981.44	0.37
16	300640	德艺文创	43,326	412,896.78	0.37
17	601231	环旭电子	45,235	407,115.00	0.37
18	300120	经纬辉开	67,064	407,078.48	0.37
19	002939	长城证券	41,002	406,329.82	0.36
20	300552	万集科技	27,695	398,808.00	0.36
21	600623	华谊集团	49,302	398,360.16	0.36
22	600186	莲花健康	203,765	385,115.85	0.35
23	600469	风神股份	103,584	365,651.52	0.33
24	600466	蓝光发展	66,566	358,125.08	0.32
25	000880	潍柴重机	37,267	268,322.40	0.24
26	000702	正虹科技	45,900	255,204.00	0.23
27	600675	中华企业	43,000	239,940.00	0.22
28	600160	巨化股份	35,600	236,028.00	0.21
29	600373	中文传媒	18,000	234,180.00	0.21
30	300218	安利股份	38,100	232,029.00	0.21
31	002013	中航机电	35,600	231,756.00	0.21
32	002189	利达光电	18,300	227,835.00	0.20
33	300146	汤臣倍健	11,800	200,482.00	0.18
34	600875	东方电气	21,400	168,846.00	0.15
35	000948	南天信息	17,181	163,906.74	0.15
36	300558	贝达药业	4,700	150,259.00	0.13
37	002242	九阳股份	8,200	131,282.00	0.12
38	300608	思特奇	4,714	81,882.18	0.07
39	000021	深科技	13,500	77,625.00	0.07
40	603185	上机数控	1,109	54,451.90	0.05
41	601860	紫金银行	15,970	50,145.80	0.05
42	601866	中远海发	13,800	31,464.00	0.03

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初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	6,124,017.00	2.03
2	000333	美的集团	5,411,528.04	1.80
3	600000	浦发银行	3,837,795.00	1.27
4	000651	格力电器	3,655,266.08	1.21
5	000001	平安银行	3,289,239.00	1.09
6	601328	交通银行	3,279,656.00	1.09
7	601288	农业银行	3,000,590.00	1.00
8	601818	光大银行	2,828,382.00	0.94
9	600030	中信证券	2,760,658.00	0.92
10	600519	贵州茅台	2,757,388.00	0.92
11	600016	民生银行	2,642,081.20	0.88
12	000858	五粮液	2,637,312.00	0.88
13	601166	兴业银行	2,523,387.00	0.84
14	600623	华谊集团	2,418,353.00	0.80
15	000876	新希望	2,395,987.80	0.80
16	600048	保利地产	2,285,778.34	0.76
17	601991	大唐发电	2,256,972.00	0.75
18	600332	白云山	2,233,687.00	0.74
19	000895	双汇发展	2,167,500.44	0.72
20	000596	古井贡酒	2,107,866.00	0.70

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初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	13,557,161.17	4.50
2	000333	美的集团	11,399,922.50	3.78
3	600519	贵州茅台	9,414,071.32	3.13
4	000651	格力电器	9,216,718.70	3.06
5	000001	平安银行	6,091,358.23	2.02
6	000858	五粮液	5,669,248.00	1.88
7	000725	京东方 A	5,587,515.00	1.86
8	002415	海康威视	5,442,438.75	1.81

9	000002	万科 A	4,623,079.00	1.53
10	600030	中信证券	4,556,431.18	1.51
11	600000	浦发银行	4,188,487.00	1.39
12	601166	兴业银行	3,968,047.00	1.32
13	600016	民生银行	3,854,546.00	1.28
14	601288	农业银行	3,830,765.00	1.27
15	600048	保利地产	3,781,346.67	1.26
16	600887	伊利股份	3,718,228.00	1.23
17	601328	交通银行	3,692,726.00	1.23
18	000063	中兴通讯	3,462,226.65	1.15
19	600104	上汽集团	3,434,399.06	1.14
20	002236	大华股份	3,330,035.83	1.11

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

金额单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	251,221,111.40
卖出股票收入（成交）总额	403,486,740.52

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	17,999.92	0.02
8	同业存单	-	-

9	其他	-	-
10	合计	17,999.92	0.02

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	110049	海尔转债	180	17,999.92	0.02

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

金额单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计（元）					-
股指期货投资本期收益（元）					568,237.29
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-309,120.00

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

本基金本报告期末持有国债期货合约。

8.12 投资组合报告附注

报告期内基金投资的前十名证券除交通银行（证券代码 601328）、民生银行（证券代码 600016）、农业银行（证券代码 601288）、浦发银行（证券代码 600000）、兴业银行（证券代码 601166）、中国平安（证券代码 601318）外其他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。

1、交通银行（证券代码 601328）

根据 2018 年 8 月 1 日发布的相关公告，该证券发行人因违规经营被央行罚款。

根据 2018 年 12 月 7 日发布的相关公告，该证券发行人违规经营,信息披露虚假或严重误导性陈述被银保监会罚款。

2、民生银行（证券代码 600016）

根据 2018 年 12 月 7 日发布的相关公告，该证券发行人因违规经营,违规提供担保及财务资助被银保监会处以罚款。

3、农业银行（证券代码 601288）

根据 2018 年 5 月 15 日发布的相关公告，该证券发行人因未依法履行职责被相关机构处以罚款。

4、浦发银行（证券代码 600000）

根据 2018 年 1 月 19 日发布的相关公告，该证券发行人因违规经营被四川银监局采取行政处罚。

根据 2018 年 5 月 4 日发布的相关公告，该证券发行人因涉嫌违反法律法规被中国银监会处以罚款,并没收违法所得。

5、兴业银行（证券代码 601166）

根据 2018 年 3 月 26 日发布的相关公告，该证券发行人因违反国库管理规定，被中国人民银行福州中心支行采取行政处罚。

根据 2018 年 4 月 2 日发布的相关公告，该证券发行人因违规经营被央行福州中心支行处以罚款,警示。

根据 2018 年 5 月 4 日发布的相关公告，该证券发行人因涉嫌违反法律法规被银保监会处以罚款。

根据 2018 年 6 月 25 日发布的相关公告，该证券发行人因违反其他违法行为，被鼓东市场监督管理所采取行政处罚。

6、中国平安（证券代码 601318）

根据 2018 年 1 月 22 日发布的相关公告，该证券发行人因发布违法广告被地方市场监督管理局处以罚款。

对上述证券的投资决策程序的说明：本基金为指数型基金，因复制指数被动持有 ，上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

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。

8.12.1 期末其他各项资产构成

金额单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	29,105.77
2	应收证券清算款	40,161.00
3	应收股利	-
4	应收利息	1,963.02
5	应收申购款	115,953.61
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	187,183.40

8.12.2 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。

8.12.3 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.3.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况说明

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。

8.12.3.2 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。

§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
招商沪深 300 指数 A	1,733	45,011.94	19,183,165.87	24.59%	58,822,528.21	75.41%
招商沪深 300 指数 C	1,504	29,279.19	-	-	44,035,899.84	100.00%
合计	3,237	37,702.07	19,183,165.87	15.72%	102,858,428.05	84.28%

注：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	招商沪深 300 指数 A	41,263.01	0.0529%
	招商沪深 300 指数 C	3,374.95	0.0077%
	合计	44,637.96	0.0366%

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）。

9.3 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	招商沪深 300 指数 A	0~10
	招商沪深 300 指数 C	0~10
	合计	0~10

本基金基金经理持有本开放式基金	招商沪深 300 指数 A	0
	招商沪深 300 指数 C	0
	合计	0

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	招商沪深 300 指数 A	招商沪深 300 指数 C
基金合同生效日(2017 年 2 月 10 日)基金份额总额	200,048,770.92	9,418.94
本报告期期初基金份额总额	226,911,150.85	29,179,968.70
本报告期基金总申购份额	60,658,414.08	51,131,480.33
减：报告期基金总赎回份额	209,563,870.85	36,275,549.19
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	78,005,694.08	44,035,899.84

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期未召开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

招商基金第五届监事会监事周松先生因工作原因辞任公司监事会监事职务。2018 年 2 月 12 日，经招商基金管理有限公司股东会 2018 年第一次会议审议通过，选举彭家文先生担任公司第五届监事会监事。

2018 年 7 月 23 日，经招商基金管理有限公司第五届董事会 2018 年第五次会议审议通过，增选金旭女士为公司第五届董事会副董事长。

报告期内，2018 年 8 月，刘连舸先生担任中国银行股份有限公司行长职务。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、基金托管业务的重大诉讼事项。

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

本报告期本基金的审计事务所无变化，目前德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）已为本基金提供审计服务 2 年，本报告期应支付给德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为人民币 42,500.00 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	
第一创业证券	3	652,874,457.54	100.00%	85,722.11	100.00%	-
西藏东方财富	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
大通证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	3	-	-	-	-	-
方正证券	3	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	5	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	3	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	4	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-

平安证券	3	-	-	-	-	-
瑞信方正	2	-	-	-	-	-
申万宏源	4	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中投证券	3	-	-	-	-	-
中信建投	6	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	3	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	4	-	-	-	-	-

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
第一创业证券	422,156.79	100.00%	-	-	-	-
西藏东方财富	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-

光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
瑞信方正	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-

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	招商基金管理有限公司关于旗下产品缴纳增值税的提示性公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2018-01-02
2	招商基金管理有限公司旗下部分基金增加上宜信普泽投资顾问（北京）有限公司为代销机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2018-01-08

3	招商沪深 300 指数增强型证券投资基金 2017 年第 4 季度报告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2018-01-19
4	招商基金旗下部分基金增加万家财富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	2018-01-24
5	招商基金旗下基金参加上海长量定期定额投资手续费优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2018-03-08
6	关于招商沪深 300 指数增强型证券投资基金修订基金合同的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2018-03-22
7	招商沪深 300 指数增强型证券投资基金托管协议（2018 年 3 月 22 日修订）	中国证券报、证券时报、上海证券报	2018-03-22
8	招商沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同（2018 年 3 月 22 日修订）	中国证券报、证券时报、上海证券报	2018-03-22
9	招商沪深 300 指数增强型证券投资基金更新的招募说明书（二零一八年第一号）	中国证券报、证券时报、上海证券报	2018-03-23
10	招商沪深 300 指数增强型证券投资基金更新的招募说明书摘要（二零一八年第一号）	中国证券报、证券时报、上海证券报	2018-03-23
11	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	2018-03-29
12	招商沪深 300 指数增强型证券投资基金 2017 年度报告摘要	中国证券报、证券时报、上海证券报	2018-03-30
13	招商沪深 300 指数增强型证券投资基金 2017 年度报告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2018-03-30
14	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	2018-03-31
15	招商基金旗下部分基金增加蚂蚁基金为代销机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2018-04-11
16	招商基金旗下部分基金增加前海微众银行为代销机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2018-04-11
17	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	2018-04-19
18	招商沪深 300 指数增强型证券投资基金 2018 年第 1 季度报告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2018-04-23
19	招商基金管理有限公司关于降低旗下基金在招商银行定期定额投资最低限额的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2018-05-29
20	招商基金旗下部分基金增加腾安基金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	2018-05-30
21	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	2018-05-31
22	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	2018-06-09
23	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	2018-06-21

24	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	2018-06-30
25	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	2018-07-03
26	招商基金旗下部分基金增加恒天明泽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	2018-07-04
27	招商基金旗下部分基金增加济安财富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	2018-07-10
28	招商基金管理有限公司旗下部分基金增加泰诚财富为代销机构并参与泰诚财富费率优惠（含定投）活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2018-07-13
29	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	2018-07-18
30	招商沪深 300 指数增强型证券投资基金 2018 年第 2 季度报告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2018-07-19
31	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	2018-07-24
32	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	2018-07-26
33	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	2018-08-04
34	招商基金管理有限公司旗下基金增加海通证券为代销机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2018-08-13
35	招商基金旗下部分基金增加肯特瑞财富为代销机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2018-08-22
36	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	2018-08-25
37	招商沪深 300 指数增强型证券投资基金 2018 年半年度报告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2018-08-28
38	招商沪深 300 指数增强型证券投资基金 2018 年半年度报告摘要	中国证券报、证券时报、上海证券报	2018-08-28
39	关于招商基金旗下部分基金增加万得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	2018-09-18
40	招商沪深 300 指数增强型证券投资基金更新的招募说明书摘要（二零一八年第二号）	中国证券报、证券时报、上海证券报	2018-09-21
41	招商沪深 300 指数增强型证券投资基金更新的招募说明书（二零一八年第二号）	中国证券报、证券时报、上海证券报	2018-09-21
42	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	2018-09-22
43	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	中国证券报、证券时报、上海证券报	2018-09-29

	金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告		
44	招商基金管理有限公司旗下部分基金增加世纪证券有限责任公司为代销机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2018-10-17
45	招商沪深 300 指数增强型证券投资基金 2018 年第 3 季度报告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2018-10-24
46	关于招商基金旗下部分基金增加中民财富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	2018-11-27
47	招商基金旗下部分基金增加百度百盈为代销机构及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	2018-12-07
48	关于招商基金旗下部分基金增加大智慧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	2018-12-07
49	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	2018-12-28

§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
机构	1	20180322-20181029	19,183,165.87	-	-	19,183,165.87	15.72%
个人	1	20180101-20180321	99,999,000.00	-	99,999,000.00	-	-
个人	2	20180101-20180321	99,999,000.00	-	99,999,000.00	-	-
个人	3	20181030-20181231	-	32,105,094.17	-	32,105,094.17	26.31%
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。							

注：报告期末持有份额占比按照四舍五入方法保留至小数点后第 2 位。

§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批准招商沪深 300 指数增强型证券投资基金设立的文件；

3、《招商沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》；

4、《招商沪深 300 指数增强型证券投资基金托管协议》；

5、《招商沪深 300 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：中国深圳深南大道 7088 号招商银行大厦

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

2019 年 3 月 28 日