

招商中证 1000 指数增强型证券投资基金 2017 年半年度报告

2017 年 6 月 30 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：2017 年 8 月 29 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。本半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 2017 年 8 月 28 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 3 月 3 日（基金合同生效日）起至 6 月 30 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	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	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.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.8 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.....	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
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.....	14
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16

6.4 报表附注.....	17
§7 投资组合报告.....	38
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	38
7.3 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.....	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	57
7.6 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.....	57
7.7 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.....	57
7.8 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.....	57
7.9 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.....	57
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	57
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	58
7.12 投资组合报告附注.....	58
§8 基金份额持有人信息.....	59
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	59
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	59
8.3 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
§9 开放式基金份额变动.....	60
§10 重大事件揭示.....	60
10.1 基金份额持有人大会决议.....	60
10.2 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
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	61
10.4 基金投资策略的改变.....	61
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	61
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	61
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	61
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	65
11.1 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.....	65
§12 备查文件目录.....	65

12.1 备查文件目录.....	65
12.2 存放地点.....	65
12.3 查阅方式.....	65

§ 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	154,043,358.02 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	152,311,534.41 份	1,731,823.61 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	王永民
	联系电话	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	田国立

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
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.cmfchina.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
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 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	招商中证 1000 指数 A	招商中证 1000 指数 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2017 年 3 月 3 日 - 2017 年 6 月 30 日)	报告期(2017 年 3 月 3 日 - 2017 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-13,255,728.42	-101,205.44
本期利润	-13,022,953.93	-85,237.70
加权平均基金份额本期利润	-0.0850	-0.0726
本期加权平均净值利润率	-9.04%	-7.85%
本期基金份额净值增长率	-8.70%	-9.04%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	-13,459,559.22	-158,846.37
期末可供分配基金份额利润	-0.0884	-0.0917
期末基金资产净值	139,055,873.17	1,575,296.04
期末基金份额净值	0.9130	0.9096
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	-8.70%	-9.04%

注：1、基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

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

3、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，截至本报告期末成立未满半年。

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

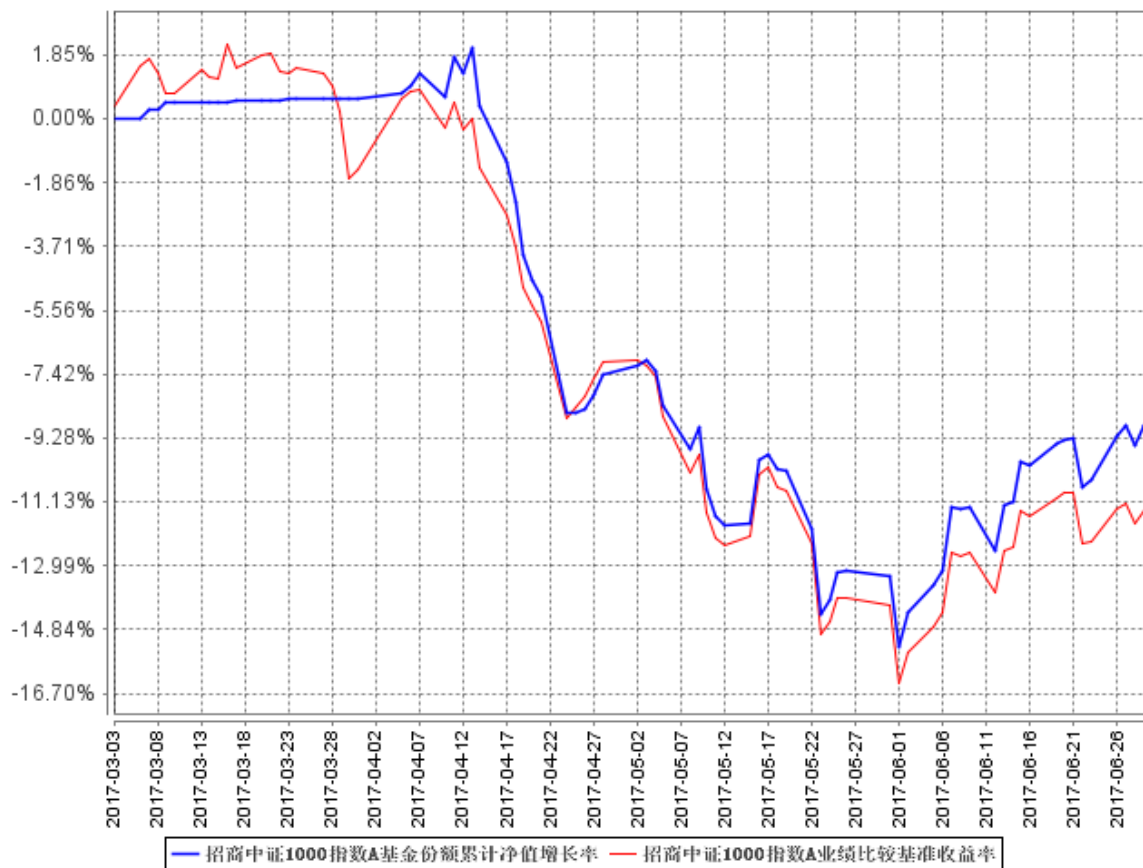
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	5.28%	1.05%	3.34%	1.03%	1.94%	0.02%
过去三个月	-9.24%	1.13%	-9.96%	1.10%	0.72%	0.03%
自基金合同生效起至今	-8.70%	0.97%	-11.29%	1.01%	2.59%	-0.04%

招商中证 1000 指数 C

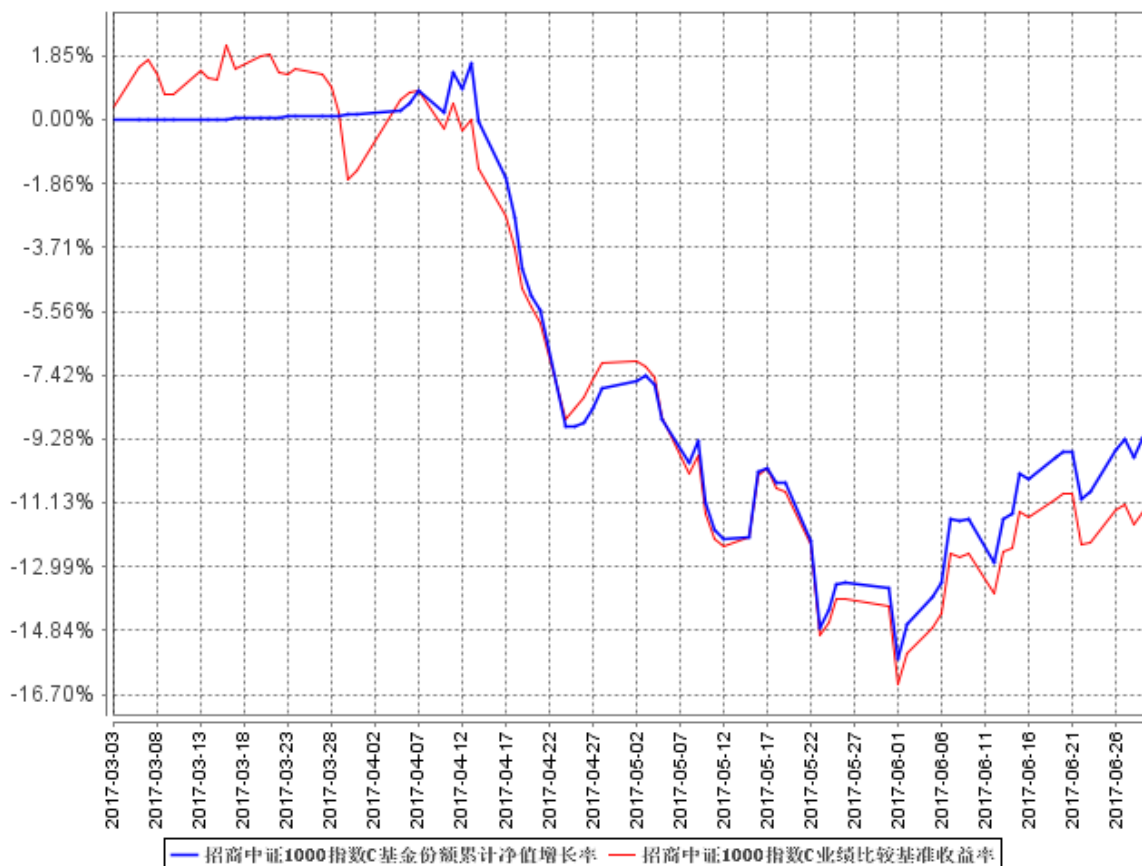
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	5.29%	1.05%	3.34%	1.03%	1.95%	0.02%
过去三个月	-9.18%	1.13%	-9.96%	1.10%	0.78%	0.03%
自基金合同生效起至今	-9.04%	0.97%	-11.29%	1.01%	2.25%	-0.04%

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半年；自基金成立日起 6 个月内为建仓期，截至报告期末基金尚未完成建仓。

§ 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，公司注册资本为人民币 2.1 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。

截至 2017 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 137 只基金，公募基金管理规模快速增长，公募基金管理规模为 3711 亿元，行业排名第 6。

2017 年上半年获奖情况如下：

债券投资能力五星基金公司（海通证券）

晨星 2017 年度基金奖提名（晨星）

招商产业债•三年期开放式债券型持续优胜金牛基金《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》

招商双债增强•2016 年度金基金•一年期债券基金奖《上海证券报》

招商产业债•2016 年度金基金•三年期债券基金奖《上海证券报》

招商安瑞进取•三年持续回报积极债券型明星基金奖《证券时报》

招商产业债基金•三年持续回报普通债券型明星基金奖《证券时报》

招商丰融基金•2016 年度绝对收益明星基金奖《证券时报》

招商制造业转型基金•2016 年度平衡混合型明星基金奖《证券时报》

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，历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、招商中证大宗商品股票指数证券投资基金（LOF）、招商央视财经 50 指数证券投资基金、招商中证银行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、招商中证白酒指数分级证券投资基金、招商国证生物医药指数分级证券投资基金、上证消费 80 交易型开放式指数证券投资基金及联接基金、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及联接基金基金经理，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、招商中证 500 指数增强型证券投资基金及招商盛合灵活配置混合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《招商中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》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 公平交易制度的执行情况

基金管理人（以下简称“公司”）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。公司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。公司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。公司的相关研究成果向内部所有投资组合开放，在投资研究层面不存在各投资组合间不公平的问题。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司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，公司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，本公司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。

本基金报告期内投资运作较为稳定，股票仓位维持在 94%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-8.70%，C 类份额净值增长率为-9.04%，同期业绩基准增长率为-11.29%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年欧洲经济复苏势头强劲，宽松的货币政策刺激消费增长，利于企业扩大投资规模，经济超预期增长，但欧洲银行业危机与债务危机的风险点并未消除，仍存隐患。美国经济数据喜忧参半，就业数据显示接近充分就业，房地产市场持续回暖，ISM 制造业 PMI 显著回升，但其通胀数据持续疲弱，政治风险增强，随着“通俄门”和医改遇挫的发生，美国特朗普新政存有较大不确定性。

2017 年上半年经济保持增长，GDP 实际同比增长 6.9%，与一季度持平，6 月 PMI 新出口订单指数对新订单指数的贡献较前期持续上升；受去年同期基数较小、上半年财政发力影响，三大类投资均有所反弹；消费名义增速亦好于市场预期，从数据观察来看，通讯器材、文化办公、建筑装饰、日用品等增速反弹明显，持续性仍需观望。展望下半年，在监管力度加大，地方债务持续收紧的大背景下，投资增速、制造业扩张及消费支出能否持续有待观察，下半年经济能否持续增长存隐忧。

报告期内大小盘分化明显，创业板连续四个季度业绩增速不达预期，下半年业绩下滑风险不减，再加上监管压力，及经济去杠杆、金融防风险的政策态势，创业板等小盘股行情仍不容乐观，市场仍将偏好业绩增长确定性高的大盘蓝筹股，预计下半年大盘蓝筹走势仍将好于中小创。

4.6 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，由其按约定提供在银行间同业市场和交易所市场交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

4.8 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合规守信、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 托管人对本半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 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 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日
资产：		
银行存款	6.4.7.1	7,778,036.68
结算备付金		1,072,833.92
存出保证金		100,532.38
交易性金融资产	6.4.7.2	131,923,473.91
其中：股票投资		131,923,473.91
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	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
应收证券清算款		165,030.23
应收利息	6.4.7.5	1,800.32
应收股利		-
应收申购款		30,065.84
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		141,071,773.28

负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日
负 债:		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		32,763.99
应付管理人报酬		134,101.76
应付托管费		16,762.71
应付销售服务费		441.66
应付交易费用	6.4.7.7	97,979.35
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	158,554.60
负债合计		440,604.07
所有者权益:		
实收基金	6.4.7.9	154,043,358.02
未分配利润	6.4.7.10	-13,412,188.81
所有者权益合计		140,631,169.21
负债和所有者权益总计		141,071,773.28

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，招商中证 1000 指数 A 基金份额净值 0.9130 元，基金份额总额 152,311,534.41 份；招商中证 1000 指数 C 基金份额净值 0.9096 元，基金份额总额 1,731,823.61 份；总份额合计 154,043,358.02 份。

6.2 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 6 月 30 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 6 月 30 日
一、收入		-11,841,939.11
1.利息收入		508,588.23
其中：存款利息收入	6.4.7.11	58,243.07
债券利息收入		8.42
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）		-13,355,843.96
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-14,101,654.60
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	5,751.88
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-
股利收益	6.4.7.17	740,058.76
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	248,742.23
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	756,574.39
减：二、费用		1,266,252.52
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	566,644.34
2. 托管费	6.4.10.2.2	70,830.56
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	1,414.83
4. 交易费用	6.4.7.20	464,746.32
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	6.4.7.21	162,616.47
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-13,108,191.63
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-13,108,191.63

6.3 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 6 月 30 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 6 月 30 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)	-	-13,108,191.63	-13,108,191.63
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)	-46,940,672.87	-303,997.18	-47,244,670.05
其中：1.基金申购款	4,280,078.91	-355,412.76	3,924,666.15
2.基金赎回款	-51,220,751.78	51,415.58	-51,169,336.20
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)	154,043,358.02	-13,412,188.81	140,631,169.21

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 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》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。《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”)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。

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 $95\% \times \text{中证 1000 指数收益率} + 5\% \times \text{同期银行活期存款利率(税后)}$ 。

6.4.2 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。

6.4.3 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 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 3 月 03 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本基金财务报告的编制期间自公历 2017 年 3 月 3 日(自基金合同生效日)起至 2017 年 6 月 30 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

6.4.4.3 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。

6.4.4.4 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。

6.4.4.5 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。

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。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 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。

6.4.4.8 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)。

6.4.4.9 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扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

- 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。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬和基金托管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。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

1) 基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式，基金份额持有人可自行选择收益分配方式；基金份额持有人事先未做出选择的，默认的分红方式为现金红利；

2) 每一基金份额享有同等分配权；

3) 基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值，基金收益分配基准日即期末可供分配利润计算截止日；

4) 在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年至多 12 次；每次基金收益分配比例不得低于期末可供分配利润的 10%。

5) 基金红利发放日距离收益分配基准日的时间不超过 15 个工作日；

6) 法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 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。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期内无其他重要的会计政策和会计估计。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 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》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1) 2016 年 4 月 30 日（含）前以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不缴纳营业税。

2) 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。

3) 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。

4) 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。

5) 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。

6) 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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
活期存款	7,778,036.68
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	7,778,036.68

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	131,674,731.68	131,923,473.91	248,742.23
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	131,674,731.68	131,923,473.91	248,742.23

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融工具。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 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。

6.4.7.4.2 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。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应收活期存款利息	1,324.85
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	434.79
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	40.68
合计	1,800.32

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
----	-------------------

交易所市场应付交易费用	97,979.35
银行间市场应付交易费用	-
合计	97,979.35

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2.60
预提费用	108,552.00
应付指数使用费	50,000.00
合计	158,554.60

6.4.7.9 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6月30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	2,537,504.93	2,537,504.93
本期赎回(以“-”号填列)	-50,424,677.51	-50,424,677.51
本期末	152,311,534.41	152,311,534.41

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6月30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	1,742,573.98	1,742,573.98
本期赎回(以“-”号填列)	-796,074.27	-796,074.27
本期末	1,731,823.61	1,731,823.61

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。

6.4.7.10 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	-13,255,728.42	232,774.49	-13,022,953.93
本期基金份额交易产生的变动数	-203,830.80	-28,876.51	-232,707.31
其中：基金申购款	-180,738.31	-34,920.44	-215,658.75
基金赎回款	-23,092.49	6,043.93	-17,048.56
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-13,459,559.22	203,897.98	-13,255,661.24

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	-101,205.44	15,967.74	-85,237.70
本期基金份额交易产生的变动数	-57,640.93	-13,648.94	-71,289.87
其中：基金申购款	-108,764.89	-30,989.12	-139,754.01
基金赎回款	51,123.96	17,340.18	68,464.14
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-158,846.37	2,318.80	-156,527.57

6.4.7.11 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 6 月 30 日
活期存款利息收入	42,196.45
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	11,793.11
其他	4,253.51
合计	58,243.07

6.4.7.12 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6月30日
卖出股票成交总额	300,572,761.99
减：卖出股票成本总额	314,674,416.59
买卖股票差价收入	-14,101,654.60

6.4.7.13 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6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	69,760.30
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	63,997.48
减：应收利息总额	10.94
买卖债券差价收入	5,751.88

6.4.7.14 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。

6.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具投资收益。

6.4.7.17 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6月30日
----	-------------------------------------

股票投资产生的股利收益	740,058.76
基金投资产生的股利收益	-
合计	740,058.76

6.4.7.18 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6月30日
1. 交易性金融资产	248,742.23
——股票投资	248,742.23
——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	248,742.23

6.4.7.19 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6 月30日
基金赎回费收入	756,571.04
转换转出收入	3.35
合计	756,574.39

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。

6.4.7.20 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6
----	---------------------------------

	月 30 日
交易所市场交易费用	464,746.32
银行间市场交易费用	-
合计	464,746.32

6.4.7.21 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 6 月 30 日
审计费用	19,736.40
信息披露费	88,815.60
指数使用费	51,967.22
银行费用	1,697.25
其他费用	400.00
合计	162,616.47

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 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。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

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。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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
招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）	基金管理人的股东

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 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。

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 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 6 月 30 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%

6.4.10.1.4 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。

6.4.10.1.5 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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 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 6 月 30 日	
	当期发生的基金应支付的管理费	566,644.34
其中：支付销售机构的客户维护费	3,032.40	

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

6.4.10.2.2 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 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	70,830.56

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

6.4.10.2.3 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 6 月 30 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	-	25.10	25.10
招商银行	-	43.09	43.09
中国银行	-	122.11	122.11
合计	-	190.30	190.30

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

6.4.10.3 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。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 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。

6.4.10.4.2 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

本报告期内除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

6.4.10.5 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 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行	7,778,036.68	42,196.45

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。

6.4.10.6 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。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 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
002879	长缆科技	2017 年 6 月 5 日	2017 年 7 月 7 日	新股流通受限	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-
002882	金龙羽	2017 年 6 月 15 日	2017 年 7 月 17 日	新股流通受限	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-
603933	睿能科技	2017 年 6 月 28 日	2017 年 7 月 6 日	新股流通受限	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-
603305	旭升股份	2017 年 6 月 30 日	2017 年 7 月 10 日	新股流通受限	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-
300670	大烨智能	2017 年 6 月 26 日	2017 年 7 月 3 日	新股流通受限	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	-
300672	国科微	2017 年 6 月 30 日	2017 年 7 月 12 日	新股流通受限	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	-
603331	百达精工	2017 年 6 月 27 日	2017 年 7 月 5 日	新股流通受限	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-
300671	富满电子	2017 年 6 月 27 日	2017 年 7 月 5 日	新股流通受限	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-

603617	君禾股份	2017年6月23日	2017年7月3日	新股流通受限	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-
6.4.12.1.2 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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
6.4.12.1.3 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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

6.4.12.2 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
300163	先锋新材	2017年4月26日	重大事项	7.60	-	-	126,400	1,034,391.00	960,640.00	-
600577	精达股份	2017年6月27日	重大事项	4.80	2017年7月10日	4.50	131,100	635,295.03	629,280.00	-
002625	光启技术	2017年4月13日	重大事项	36.36	-	-	16,700	576,119.00	607,212.00	-
002499	科林环保	2017年4月20日	重大事项	28.92	2017年7月10日	26.03	20,300	577,897.08	587,076.00	-
600602	云赛智联	2017年6月22日	重大事项	7.51	2017年7月4日	7.80	69,100	520,493.00	518,941.00	-
600289	亿阳信通	2017年5月10日	重大事项	10.94	2017年8月18日	12.03	37,000	412,236.40	404,780.00	-
603861	白云电器	2017年6月15日	重大事项	24.27	-	-	16,100	306,255.00	390,747.00	-
600057	象屿股份	2017年6月27日	重大事项	10.17	2017年7月4日	10.07	28,700	286,851.61	291,879.00	-
000038	深大通	2017年5月12日	重大事项	31.74	-	-	9,025	316,013.54	286,453.50	-
002348	高乐股份	2017年5月11日	重大事项	7.01	2017年7月27日	6.70	35,900	253,237.00	251,659.00	-
002567	唐人神	2017年6月5日	重大事项	9.70	2017年8月14日	9.54	23,550	232,473.00	228,435.00	-
300388	国祯环保	2017年6月26日	重大事项	21.15	2017年7月10日	21.06	8,900	171,737.81	188,235.00	-

002006	精工科技	2017 年 5 月 22 日	重大事项	7.91	-	-	22,300	176,880.00	176,393.00	-
300108	双龙股份	2017 年 5 月 12 日	重大事项	7.75	2017 年 8 月 4 日	8.35	22,600	186,495.97	175,150.00	-
002748	世龙实业	2017 年 6 月 29 日	重大事项	19.45	2017 年 7 月 5 日	20.00	9,000	174,637.00	175,050.00	-
600193	创兴资源	2017 年 6 月 1 日	重大事项	6.77	-	-	20,500	185,322.27	138,785.00	-
603598	引力传媒	2017 年 5 月 10 日	重大事项	16.21	-	-	7,700	125,804.00	124,817.00	-
601313	江南嘉捷	2017 年 6 月 13 日	重大事项	8.79	-	-	11,600	98,069.00	101,964.00	-
603299	井神股份	2017 年 6 月 1 日	重大事项	10.47	-	-	8,500	95,558.00	88,995.00	-
002781	奇信股份	2017 年 5 月 31 日	重大事项	29.44	-	-	2,700	74,322.00	79,488.00	-
600653	中华控股	2017 年 5 月 9 日	重大事项	3.26	-	-	20,300	71,600.31	66,178.00	-
600468	百利电气	2017 年 5 月 16 日	重大事项	6.50	-	-	3,450	22,793.00	22,425.00	-
002756	永兴特钢	2017 年 6 月 30 日	重大事项	28.20	-	-	71	2,053.55	2,002.20	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 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。

6.4.12.3.2 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金是股票型基金，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。

6.4.13.1 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。

6.4.13.2 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工商银行，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。

6.4.13.2.1 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。

6.4.13.2.2 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。

6.4.13.3 流动性风险

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同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。

6.4.13.4 市场风险

6.4.13.4.1 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。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。

下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017 年 6 月 30 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	7,778,036.68	-	-	-	-	-	7,778,036.68
结算备付金	1,072,833.92	-	-	-	-	-	1,072,833.92
存出保证金	100,532.38	-	-	-	-	-	100,532.38
交易性金融资产	-	-	-	-	-	131,923,473.91	131,923,473.91
应收证券清算款	-	-	-	-	-	165,030.23	165,030.23
应收利息	-	-	-	-	-	1,800.32	1,800.32
应收申购款	-	-	-	-	-	30,065.84	30,065.84
资产总计	8,951,402.98	-	-	-	-	132,120,370.30	141,071,773.28
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	32,763.99	32,763.99
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	134,101.76	134,101.76
应付托管费	-	-	-	-	-	16,762.71	16,762.71
应付销售服务费	-	-	-	-	-	441.66	441.66
应付交易费用	-	-	-	-	-	97,979.35	97,979.35
其他负债	-	-	-	-	-	158,554.60	158,554.60
负债总计	-	-	-	-	-	440,604.07	440,604.07
利率敏感度缺口	8,951,402.98	-	-	-	-	131,679,766.23	140,631,169.21

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。

6.4.13.4.1.2 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。

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30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	131,923,473.91	93.81
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	131,923,473.91	93.81

6.4.13.4.2.2 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6月30日)
	1. 权益性投资的市场价格上升 5%	6,596,173.70
	2. 权益性投资的市场价格下降 5%	-6,596,173.70

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金报告期内无需要说明有助于理解和分析财务报表的其他事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 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	131,923,473.91	93.52
	其中：股票	131,923,473.91	93.52
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	8,850,870.60	6.27
7	其他各项资产	297,428.77	0.21
8	合计	141,071,773.28	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	677,942.00	0.48
B	采矿业	2,096,737.20	1.49
C	制造业	68,683,524.55	48.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,497,710.72	3.20
E	建筑业	2,192,430.59	1.56
F	批发和零售业	5,651,965.75	4.02
G	交通运输、仓储和邮政业	2,421,955.90	1.72
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,305,986.52	3.77
J	金融业	-	-
K	房地产业	2,542,323.23	1.81
L	租赁和商务服务业	2,006,615.90	1.43
M	科学研究和技术服务业	557,626.50	0.40
N	水利、环境和公共设施管理业	546,037.00	0.39

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	298,571.00	0.21
R	文化、体育和娱乐业	2,352,350.00	1.67
S	综合	78,559.50	0.06
	合计	99,910,336.36	71.04

7.2.2 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（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	303,729.84	0.22
C	制造业	20,881,440.61	14.85
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	983,913.00	0.70
E	建筑业	688,368.46	0.49
F	批发和零售业	2,003,309.89	1.42
G	交通运输、仓储和邮政业	1,189,120.31	0.85
H	住宿和餐饮业	215,680.00	0.15
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,351,414.44	0.96
J	金融业	194,800.90	0.14
K	房地产业	2,136,460.98	1.52
L	租赁和商务服务业	151,570.00	0.11
M	科学研究和技术服务业	635,971.00	0.45
N	水利、环境和公共设施管理业	256,174.00	0.18
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	178,201.00	0.13
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	723,943.12	0.51
S	综合	119,040.00	0.08
	合计	32,013,137.55	22.76

7.2.3 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。

7.3 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

7.3.1 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	600713	南京医药	175,298	1,232,344.94	0.88
2	002496	辉丰股份	235,500	1,168,080.00	0.83
3	600229	城市传媒	121,700	1,140,329.00	0.81
4	600530	交大昂立	173,400	979,710.00	0.70
5	600210	紫江企业	155,200	952,928.00	0.68
6	002326	永太科技	66,300	918,918.00	0.65
7	600726	华电能源	191,200	856,576.00	0.61
8	601636	旗滨集团	185,100	834,801.00	0.59
9	600856	中天能源	73,800	830,988.00	0.59
10	603116	红蜻蜓	43,830	805,595.40	0.57
11	603686	龙马环卫	23,000	791,200.00	0.56
12	600105	永鼎股份	97,700	788,439.00	0.56
13	000666	经纬纺机	33,936	771,704.64	0.55
14	300208	恒顺众昇	47,200	753,784.00	0.54
15	603600	永艺股份	45,200	743,992.00	0.53
16	600261	阳光照明	113,100	743,067.00	0.53
17	601368	绿城水务	75,000	738,000.00	0.52
18	600668	尖峰集团	41,400	711,252.00	0.51
19	600218	全柴动力	77,400	695,826.00	0.49
20	600742	一汽富维	36,100	689,871.00	0.49
21	002067	景兴纸业	117,400	689,138.00	0.49
22	002171	楚江新材	43,900	651,037.00	0.46
23	000055	方大集团	88,950	647,556.00	0.46
24	600987	航民股份	49,286	638,746.56	0.45
25	600986	科达股份	46,500	630,540.00	0.45
26	600577	精达股份	131,100	629,280.00	0.45
27	600090	同济堂	66,200	620,294.00	0.44
28	600273	嘉化能源	65,500	614,390.00	0.44
29	002625	光启技术	16,700	607,212.00	0.43
30	603808	歌力思	20,300	599,256.00	0.43
31	002499	科林环保	20,300	587,076.00	0.42
32	601388	怡球资源	165,200	584,808.00	0.42
33	300363	博腾股份	38,400	582,144.00	0.41
34	300303	聚飞光电	131,080	567,576.40	0.40
35	002441	众业达	48,100	556,036.00	0.40
36	601015	陕西黑猫	73,100	555,560.00	0.40
37	000990	诚志股份	34,400	549,712.00	0.39

38	000683	远兴能源	203,400	549,180.00	0.39
39	600480	凌云股份	25,800	544,122.00	0.39
40	600711	盛屯矿业	81,600	541,824.00	0.39
41	002726	龙大肉食	29,900	541,489.00	0.39
42	300178	腾邦国际	42,283	541,222.40	0.38
43	600567	山鹰纸业	150,500	538,790.00	0.38
44	600020	中原高速	106,100	534,744.00	0.38
45	000733	振华科技	33,500	532,650.00	0.38
46	600035	楚天高速	94,200	519,042.00	0.37
47	600602	云赛智联	69,100	518,941.00	0.37
48	300317	珈伟股份	34,986	510,795.60	0.36
49	300204	舒泰神	32,400	505,116.00	0.36
50	002402	和而泰	51,200	504,832.00	0.36
51	002320	海峡股份	34,700	492,046.00	0.35
52	601700	风范股份	82,000	491,180.00	0.35
53	600782	新钢股份	133,900	488,735.00	0.35
54	603008	喜临门	27,300	486,213.00	0.35
55	002091	江苏国泰	50,897	486,066.35	0.35
56	300349	金卡智能	17,100	477,432.00	0.34
57	600363	联创光电	33,800	473,538.00	0.34
58	600684	珠江实业	53,600	471,680.00	0.34
59	002436	兴森科技	73,000	459,900.00	0.33
60	601789	宁波建工	94,400	459,728.00	0.33
61	600269	赣粤高速	88,100	459,001.00	0.33
62	600758	红阳能源	49,500	442,530.00	0.31
63	300083	劲胜智能	47,800	441,672.00	0.31
64	002185	华天科技	60,620	438,888.80	0.31
65	002108	沧州明珠	32,370	432,139.50	0.31
66	601199	江南水务	62,900	432,123.00	0.31
67	002550	千红制药	72,100	428,274.00	0.30
68	600745	闻泰科技	22,400	419,104.00	0.30
69	300219	鸿利智汇	31,200	413,712.00	0.29
70	300288	朗玛信息	14,800	412,180.00	0.29
71	600303	曙光股份	40,300	411,866.00	0.29
72	603818	曲美家居	25,800	410,994.00	0.29
73	600382	广东明珠	28,400	409,244.00	0.29
74	603338	浙江鼎力	6,200	408,766.00	0.29
75	000676	智度股份	27,114	405,896.58	0.29
76	002446	盛路通信	33,310	405,382.70	0.29

77	600123	兰花科创	52,600	400,812.00	0.29
78	300160	秀强股份	44,300	397,371.00	0.28
79	600641	万业企业	35,600	397,296.00	0.28
80	603861	白云电器	16,100	390,747.00	0.28
81	300232	洲明科技	24,200	387,200.00	0.28
82	600995	文山电力	39,600	385,308.00	0.27
83	000757	浩物股份	51,900	374,718.00	0.27
84	002502	骅威文化	39,900	374,661.00	0.27
85	300175	朗源股份	44,500	365,790.00	0.26
86	300307	慈星股份	36,100	365,332.00	0.26
87	300336	新文化	23,400	361,764.00	0.26
88	002324	普利特	13,300	357,504.00	0.25
89	002511	中顺洁柔	26,920	356,151.60	0.25
90	002274	华昌化工	45,000	355,950.00	0.25
91	002636	金安国纪	20,600	355,762.00	0.25
92	000531	穗恒运 A	37,121	353,391.92	0.25
93	601599	鹿港文化	56,200	351,812.00	0.25
94	603012	创力集团	42,500	351,050.00	0.25
95	300007	汉威科技	18,200	350,532.00	0.25
96	002626	金达威	24,500	349,125.00	0.25
97	002401	中远海科	26,500	348,475.00	0.25
98	002452	长高集团	50,688	348,226.56	0.25
99	000811	烟台冰轮	19,800	345,510.00	0.25
100	002716	金贵银业	18,000	345,420.00	0.25
101	002737	葵花药业	11,200	344,960.00	0.25
102	300497	富祥股份	6,504	343,346.16	0.24
103	600354	敦煌种业	45,600	341,544.00	0.24
104	600420	现代制药	21,758	341,383.02	0.24
105	300384	三联虹普	9,200	341,228.00	0.24
106	300231	银信科技	25,800	340,560.00	0.24
107	002145	中核钛白	56,000	340,480.00	0.24
108	600114	东睦股份	19,300	337,750.00	0.24
109	600824	益民集团	58,900	336,908.00	0.24
110	002518	科士达	22,850	334,067.00	0.24
111	000797	中国武夷	35,500	332,990.00	0.24
112	000404	华意压缩	42,275	332,704.25	0.24
113	600322	天房发展	65,800	332,290.00	0.24
114	300237	美晨科技	19,150	330,529.00	0.24
115	300432	富临精工	13,800	329,820.00	0.23

116	603118	共进股份	23,940	326,302.20	0.23
117	600336	澳柯玛	56,100	325,941.00	0.23
118	600550	保变电气	30,200	324,952.00	0.23
119	603618	杭电股份	31,100	322,507.00	0.23
120	600197	伊力特	16,400	320,292.00	0.23
121	300403	地尔汉宇	17,600	319,968.00	0.23
122	600287	江苏舜天	40,731	318,516.42	0.23
123	300439	美康生物	14,800	318,200.00	0.23
124	300484	蓝海华腾	10,400	315,744.00	0.22
125	300054	鼎龙股份	30,700	312,219.00	0.22
126	603508	思维列控	5,900	311,992.00	0.22
127	603566	普莱柯	12,800	310,528.00	0.22
128	300482	万孚生物	4,300	303,967.00	0.22
129	002079	苏州固锝	41,200	303,644.00	0.22
130	002172	澳洋科技	37,700	303,108.00	0.22
131	002649	博彦科技	27,100	298,913.00	0.21
132	600323	瀚蓝环境	20,600	298,906.00	0.21
133	600763	通策医疗	11,900	298,571.00	0.21
134	000419	通程控股	42,000	297,360.00	0.21
135	002148	北纬科技	27,600	297,252.00	0.21
136	600285	羚锐制药	26,300	295,349.00	0.21
137	300207	欣旺达	24,900	293,571.00	0.21
138	600843	上工申贝	22,400	292,320.00	0.21
139	002100	天康生物	36,400	292,292.00	0.21
140	600057	象屿股份	28,700	291,879.00	0.21
141	603609	禾丰牧业	30,300	289,668.00	0.21
142	600477	杭萧钢构	18,900	288,414.00	0.21
143	000038	深大通	9,025	286,453.50	0.20
144	000545	金浦钛业	48,900	286,065.00	0.20
145	300476	胜宏科技	12,100	285,923.00	0.20
146	600438	通威股份	51,000	284,580.00	0.20
147	300326	凯利泰	30,300	284,517.00	0.20
148	600101	明星电力	28,800	283,680.00	0.20
149	600093	易见股份	21,100	283,373.00	0.20
150	600133	东湖高新	29,400	281,946.00	0.20
151	002367	康力电梯	23,700	276,816.00	0.20
152	300342	天银机电	18,026	275,076.76	0.20
153	002247	帝龙文化	20,700	271,584.00	0.19
154	600508	上海能源	23,200	270,744.00	0.19

155	000782	美达股份	28,700	270,354.00	0.19
156	002448	中原内配	26,600	269,458.00	0.19
157	000952	广济药业	17,500	263,025.00	0.19
158	600185	格力地产	38,700	262,773.00	0.19
159	002801	微光股份	6,400	261,184.00	0.19
160	002790	瑞尔特	7,900	256,039.00	0.18
161	601011	宝泰隆	39,700	255,271.00	0.18
162	300102	乾照光电	29,700	253,638.00	0.18
163	002564	天沃科技	27,660	252,535.80	0.18
164	002348	高乐股份	35,900	251,659.00	0.18
165	002462	嘉事堂	6,400	251,456.00	0.18
166	600172	黄河旋风	30,460	250,685.80	0.18
167	000802	北京文化	17,200	250,432.00	0.18
168	601038	一拖股份	27,104	250,169.92	0.18
169	600396	金山股份	63,600	247,404.00	0.18
170	600331	宏达股份	45,300	247,338.00	0.18
171	000796	凯撒旅游	20,400	247,248.00	0.18
172	600096	云天化	33,100	244,940.00	0.17
173	002527	新时达	23,001	244,500.63	0.17
174	002474	榕基软件	22,500	244,125.00	0.17
175	603166	福达股份	22,600	244,080.00	0.17
176	300170	汉得信息	23,600	243,316.00	0.17
177	600063	皖维高新	58,900	243,257.00	0.17
178	600775	南京熊猫	23,700	242,214.00	0.17
179	002363	隆基机械	25,479	240,776.55	0.17
180	300351	永贵电器	13,200	240,636.00	0.17
181	603026	石大胜华	8,500	240,210.00	0.17
182	002182	云海金属	25,500	234,345.00	0.17
183	002612	朗姿股份	17,300	234,242.00	0.17
184	603456	九洲药业	14,200	233,874.00	0.17
185	000688	建新矿业	28,900	231,200.00	0.16
186	002567	唐人神	23,550	228,435.00	0.16
187	002157	正邦科技	50,200	228,410.00	0.16
188	600677	航天通信	16,508	226,654.84	0.16
189	002788	鹭燕医药	6,800	226,440.00	0.16
190	601900	南方传媒	18,100	225,164.00	0.16
191	300436	广生堂	5,900	221,899.00	0.16
192	600724	宁波富达	46,640	221,073.60	0.16
193	002270	华明装备	20,500	219,760.00	0.16

194	002376	新北洋	16,000	219,520.00	0.16
195	600756	浪潮软件	10,800	213,732.00	0.15
196	600206	有研新材	24,500	212,660.00	0.15
197	002554	惠博普	35,500	209,450.00	0.15
198	002097	山河智能	23,400	208,026.00	0.15
199	002080	中材科技	10,400	206,128.00	0.15
200	300377	赢时胜	18,000	205,020.00	0.15
201	000498	山东路桥	28,500	203,775.00	0.14
202	300353	东土科技	15,700	202,216.00	0.14
203	300009	安科生物	12,240	200,858.40	0.14
204	600459	贵研铂业	9,300	200,229.00	0.14
205	300018	中元股份	22,700	199,533.00	0.14
206	000570	苏常柴A	28,357	198,499.00	0.14
207	002378	章源钨业	21,900	198,195.00	0.14
208	002393	力生制药	5,500	197,285.00	0.14
209	002111	威海广泰	10,800	195,804.00	0.14
210	300074	华平股份	28,600	195,338.00	0.14
211	603308	应流股份	13,500	195,210.00	0.14
212	600523	贵航股份	10,500	194,355.00	0.14
213	300050	世纪鼎利	19,100	192,337.00	0.14
214	600526	菲达环保	18,500	190,735.00	0.14
215	002585	双星新材	24,570	189,926.10	0.14
216	300079	数码视讯	32,400	189,540.00	0.13
217	000921	海信科龙	11,000	189,310.00	0.13
218	000902	新洋丰	21,000	189,000.00	0.13
219	601058	赛轮金宇	55,200	188,784.00	0.13
220	300388	国祯环保	8,900	188,235.00	0.13
221	600491	龙元建设	17,500	187,775.00	0.13
222	300468	四方精创	4,200	187,278.00	0.13
223	300473	德尔股份	3,900	185,640.00	0.13
224	600589	广东榕泰	25,329	185,154.99	0.13
225	300457	赢合科技	2,700	184,680.00	0.13
226	002772	众兴菌业	13,700	184,265.00	0.13
227	002433	太安堂	19,800	183,150.00	0.13
228	300187	永清环保	16,000	183,040.00	0.13
229	000018	神州长城	24,100	182,437.00	0.13
230	300295	三六五网	9,700	181,487.00	0.13
231	600676	交运股份	24,303	181,057.35	0.13
232	002590	万安科技	12,800	179,328.00	0.13

233	603339	四方冷链	6,900	178,434.00	0.13
234	603936	博敏电子	6,700	176,545.00	0.13
235	603669	灵康药业	7,900	176,328.00	0.13
236	300242	明家联合	18,470	175,280.30	0.12
237	002033	丽江旅游	17,100	174,762.00	0.12
238	300221	银禧科技	12,532	174,194.80	0.12
239	002203	海亮股份	20,900	170,126.00	0.12
240	002712	思美传媒	7,800	168,324.00	0.12
241	002660	茂硕电源	17,201	164,097.54	0.12
242	002099	海翔药业	24,500	163,170.00	0.12
243	300451	创业软件	5,300	161,014.00	0.11
244	300008	天海防务	18,750	155,062.50	0.11
245	300512	中亚股份	7,600	154,128.00	0.11
246	300516	久之洋	2,400	152,376.00	0.11
247	603128	华贸物流	17,790	152,282.40	0.11
248	300519	新光药业	2,404	152,053.00	0.11
249	000059	华锦股份	15,100	151,151.00	0.11
250	000011	深物业 A	7,500	150,000.00	0.11
251	000701	厦门信达	12,000	150,000.00	0.11
252	002156	通富微电	14,600	148,628.00	0.11
253	002017	东信和平	13,300	148,029.00	0.11
254	300016	北陆药业	9,700	147,828.00	0.11
255	600386	北巴传媒	11,000	146,300.00	0.10
256	000920	南方汇通	11,700	145,548.00	0.10
257	000637	茂化实华	21,900	145,416.00	0.10
258	300185	通裕重工	54,800	143,028.00	0.10
259	002124	天邦股份	16,500	142,890.00	0.10
260	002769	普路通	9,200	139,840.00	0.10
261	002604	龙力生物	15,000	139,650.00	0.10
262	600193	创兴资源	20,500	138,785.00	0.10
263	002406	远东传动	16,800	135,912.00	0.10
264	600622	嘉宝集团	8,190	133,333.20	0.09
265	300114	中航电测	9,850	132,778.00	0.09
266	300373	扬杰科技	6,500	130,975.00	0.09
267	603989	艾华集团	3,300	129,492.00	0.09
268	000965	天保基建	14,900	129,034.00	0.09
269	300339	润和软件	10,102	127,285.20	0.09
270	002196	方正电机	10,760	122,986.80	0.09
271	002597	金禾实业	5,500	120,230.00	0.09

272	002222	福晶科技	8,300	118,441.00	0.08
273	000837	秦川机床	16,300	117,686.00	0.08
274	300447	全信股份	5,400	117,666.00	0.08
275	300494	盛天网络	5,000	115,950.00	0.08
276	300128	锦富技术	13,800	115,920.00	0.08
277	300292	吴通控股	17,000	115,090.00	0.08
278	000915	山大华特	3,120	115,034.40	0.08
279	603368	柳州医药	2,000	114,500.00	0.08
280	000639	西王食品	5,700	112,803.00	0.08
281	000070	特发信息	9,600	112,800.00	0.08
282	300456	耐威科技	3,000	111,840.00	0.08
283	300195	长荣股份	7,800	111,384.00	0.08
284	002042	华孚色纺	10,400	111,176.00	0.08
285	600965	福成股份	9,100	103,649.00	0.07
286	300406	九强生物	6,200	102,052.00	0.07
287	300206	理邦仪器	11,800	101,834.00	0.07
288	002301	齐心集团	4,700	97,431.00	0.07
289	002484	江海股份	9,600	95,232.00	0.07
290	300246	宝莱特	3,400	92,990.00	0.07
291	002516	旷达科技	16,900	92,781.00	0.07
292	603299	井神股份	8,500	88,995.00	0.06
293	600075	新疆天业	10,200	88,944.00	0.06
294	300193	佳士科技	10,700	88,917.00	0.06
295	600626	申达股份	9,300	87,699.00	0.06
296	600814	杭州解百	9,700	87,494.00	0.06
297	002103	广博股份	6,380	84,471.20	0.06
298	300348	长亮科技	3,900	82,680.00	0.06
299	002677	浙江美大	5,900	82,187.00	0.06
300	002245	澳洋顺昌	9,100	82,082.00	0.06
301	300441	鲍斯股份	3,800	81,434.00	0.06
302	002126	银轮股份	8,000	80,480.00	0.06
303	600246	万通地产	16,100	79,695.00	0.06
304	002781	奇信股份	2,700	79,488.00	0.06
305	002351	漫步者	7,100	78,597.00	0.06
306	600620	天宸股份	6,310	78,559.50	0.06
307	002771	真视通	2,800	77,140.00	0.05
308	300502	新易盛	3,000	71,940.00	0.05
309	000601	韶能股份	10,000	71,300.00	0.05
310	600531	豫光金铅	9,400	69,184.00	0.05

311	002110	三钢闽光	5,300	67,946.00	0.05
312	600789	鲁抗医药	8,500	67,235.00	0.05
313	300358	楚天科技	4,700	67,069.00	0.05
314	600653	申华控股	20,300	66,178.00	0.05
315	300066	三川智慧	11,800	65,372.00	0.05
316	300429	强力新材	2,600	64,766.00	0.05
317	600818	中路股份	3,000	63,240.00	0.04
318	002752	昇兴股份	5,180	63,196.00	0.04
319	603959	百利科技	3,400	61,336.00	0.04
320	601003	柳钢股份	13,300	59,584.00	0.04
321	002543	万和电气	2,400	58,968.00	0.04
322	300443	金雷风电	2,700	57,834.00	0.04
323	600135	乐凯胶片	3,600	56,124.00	0.04
324	603779	威龙股份	2,500	54,700.00	0.04
325	002224	三力士	4,900	54,390.00	0.04
326	300047	天源迪科	4,200	52,962.00	0.04
327	000525	红太阳	2,800	52,108.00	0.04
328	300450	先导智能	1,000	51,770.00	0.04
329	300014	亿纬锂能	2,799	50,801.85	0.04
330	600885	宏发股份	1,223	48,785.47	0.03
331	002791	坚朗五金	2,100	48,783.00	0.03
332	002528	英飞拓	8,200	48,626.00	0.03
333	300071	华谊嘉信	5,960	48,276.00	0.03
334	000735	罗牛山	7,600	47,500.00	0.03
335	002020	京新药业	3,900	46,215.00	0.03
336	000657	中钨高新	3,700	45,584.00	0.03
337	601566	九牧王	2,600	41,912.00	0.03
338	002521	齐峰新材	4,100	40,508.00	0.03
339	603919	金徽酒	2,000	38,160.00	0.03
340	300506	名家汇	1,300	36,699.00	0.03
341	002556	辉隆股份	5,027	36,646.83	0.03
342	600486	扬农化工	800	33,768.00	0.02
343	300165	天瑞仪器	4,000	32,800.00	0.02
344	000036	华联控股	3,300	30,030.00	0.02
345	002117	东港股份	1,100	28,468.00	0.02
346	600110	诺德股份	2,000	28,180.00	0.02
347	000739	普洛药业	3,500	25,690.00	0.02
348	603898	好莱客	600	20,970.00	0.01
349	300037	新宙邦	200	4,596.00	0.00

350	300294	博雅生物	50	2,062.00	0.00
351	002756	永兴特钢	71	2,002.20	0.00
352	300350	华鹏飞	165	1,701.15	0.00
353	300300	汉鼎宇佑	85	1,541.90	0.00
354	002322	理工环科	62	1,485.52	0.00
355	600278	东方创业	95	1,250.20	0.00
356	002434	万里扬	78	1,241.76	0.00
357	000819	岳阳兴长	71	1,202.74	0.00
358	300197	铁汉生态	90	1,195.20	0.00
359	300328	宜安科技	96	1,065.60	0.00
360	300262	巴安水务	68	1,032.92	0.00
361	600621	华鑫股份	83	1,006.79	0.00
362	300511	雪榕生物	50	984.00	0.00
363	002298	中电鑫龙	86	934.82	0.00
364	300310	宜通世纪	60	793.20	0.00
365	002515	金字火腿	80	758.40	0.00
366	002369	卓翼科技	79	682.56	0.00
367	002135	东南网架	79	626.47	0.00
368	300496	中科创达	22	622.60	0.00
369	000863	三湘印象	83	607.56	0.00
370	600876	洛阳玻璃	31	590.24	0.00
371	600128	弘业股份	53	577.17	0.00
372	002472	双环传动	52	570.44	0.00
373	601799	星宇股份	11	486.42	0.00
374	600730	中国高科	41	335.79	0.00
375	300352	北信源	50	288.50	0.00
376	603979	金诚信	10	177.20	0.00
377	600077	宋都股份	27	107.73	0.00
378	600533	栖霞建设	12	70.56	0.00
379	002239	奥特佳	11	47.63	0.00
380	000899	赣能股份	4	33.80	0.00
381	002540	亚太科技	1	7.06	0.00

7.3.2 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	002090	金智科技	45,871	1,089,436.25	0.77

2	300360	炬华科技	64,700	973,735.00	0.69
3	300163	先锋新材	126,400	960,640.00	0.68
4	600081	东风科技	58,600	729,570.00	0.52
5	603599	广信股份	44,500	673,285.00	0.48
6	002763	汇洁股份	15,618	449,017.50	0.32
7	600052	浙江广厦	84,000	424,200.00	0.30
8	002468	申通快递	16,374	416,063.34	0.30
9	002228	合兴包装	88,400	411,944.00	0.29
10	600850	华东电脑	19,000	406,030.00	0.29
11	600289	亿阳信通	37,000	404,780.00	0.29
12	000886	海南高速	80,500	399,280.00	0.28
13	002062	宏润建设	66,323	395,285.08	0.28
14	600243	青海华鼎	42,600	376,158.00	0.27
15	603168	莎普爱思	15,547	362,866.98	0.26
16	002454	松芝股份	26,375	332,325.00	0.24
17	601678	滨化股份	47,100	327,345.00	0.23
18	002601	龙鳞佰利	19,900	325,962.00	0.23
19	600368	五洲交通	56,200	325,398.00	0.23
20	600080	金花股份	30,600	308,448.00	0.22
21	601188	龙江交通	58,800	283,416.00	0.20
22	603309	维力医疗	15,900	282,861.00	0.20
23	000517	荣安地产	59,200	275,280.00	0.20
24	002357	富临运业	26,000	272,480.00	0.19
25	603158	腾龙股份	12,200	263,154.00	0.19
26	600383	金地集团	22,000	252,340.00	0.18
27	603100	川仪股份	21,708	252,029.88	0.18
28	300383	光环新网	18,400	249,504.00	0.18
29	600088	中视传媒	14,000	245,280.00	0.17
30	000564	供销大集	37,600	244,776.00	0.17
31	600794	保税科技	59,400	244,134.00	0.17
32	002147	新光圆成	15,700	243,978.00	0.17
33	600126	杭钢股份	35,500	243,530.00	0.17
34	603018	中设集团	7,500	242,925.00	0.17
35	300233	金城医药	11,554	242,518.46	0.17
36	600515	海航基础	23,600	242,372.00	0.17
37	601137	博威合金	21,300	241,968.00	0.17
38	000536	华映科技	41,620	241,812.20	0.17
39	600810	神马股份	30,100	238,693.00	0.17
40	600629	华建集团	11,100	238,650.00	0.17

41	603799	华友钴业	3,900	237,042.00	0.17
42	600665	天地源	47,100	235,029.00	0.17
43	002589	瑞康医药	14,900	229,460.00	0.16
44	600979	广安爱众	39,600	226,512.00	0.16
45	000717	韶钢松山	46,100	224,507.00	0.16
46	600308	华泰股份	39,200	222,656.00	0.16
47	603611	诺力股份	8,400	221,340.00	0.16
48	300376	易事特	24,400	221,308.00	0.16
49	000524	岭南控股	16,000	215,680.00	0.15
50	600167	联美控股	10,100	214,524.00	0.15
51	600581	八一钢铁	20,800	209,456.00	0.15
52	000987	越秀金控	17,800	207,014.00	0.15
53	601579	会稽山	17,001	206,732.16	0.15
54	002334	英威腾	28,300	205,175.00	0.15
55	002541	鸿路钢构	11,800	204,022.00	0.15
56	002065	东华软件	9,358	203,910.82	0.14
57	600633	浙数文化	10,500	202,860.00	0.14
58	300394	天孚通信	7,900	202,161.00	0.14
59	600647	同达创业	8,700	200,970.00	0.14
60	600439	瑞贝卡	33,300	196,137.00	0.14
61	600345	长江通信	9,500	195,795.00	0.14
62	600695	绿庭投资	29,605	194,800.90	0.14
63	601999	出版传媒	21,301	194,265.12	0.14
64	002107	沃华医药	15,100	188,750.00	0.13
65	603968	醋化股份	8,400	188,664.00	0.13
66	600223	鲁商置业	40,300	187,798.00	0.13
67	603188	亚邦股份	10,700	186,608.00	0.13
68	603198	迎驾贡酒	9,400	178,882.00	0.13
69	002084	海鸥卫浴	20,110	178,777.90	0.13
70	600661	新南洋	8,300	178,201.00	0.13
71	600163	中闽能源	37,500	178,125.00	0.13
72	002006	精功科技	22,300	176,393.00	0.13
73	300108	双龙股份	22,600	175,150.00	0.12
74	002748	世龙实业	9,000	175,050.00	0.12
75	000635	英力特	10,200	172,890.00	0.12
76	002534	杭锅股份	18,138	171,585.48	0.12
77	300270	中威电子	14,600	170,966.00	0.12
78	603568	伟明环保	7,700	166,474.00	0.12
79	600328	兰太实业	14,100	164,124.00	0.12

80	600785	新华百货	6,800	159,052.00	0.11
81	600714	金瑞矿业	13,100	157,200.00	0.11
82	600883	博闻科技	13,300	155,211.00	0.11
83	002479	富春环保	12,900	153,510.00	0.11
84	002536	西泵股份	12,300	152,274.00	0.11
85	600389	江山股份	9,100	150,878.00	0.11
86	002150	通润装备	12,600	148,050.00	0.11
87	300184	力源信息	11,900	148,036.00	0.11
88	300455	康拓红外	11,940	144,951.60	0.10
89	600487	亨通光电	4,900	137,445.00	0.10
90	600211	西藏药业	3,100	137,237.00	0.10
91	002048	宁波华翔	6,500	135,590.00	0.10
92	603899	晨光文具	7,700	133,980.00	0.10
93	300341	麦迪电气	15,300	132,345.00	0.09
94	600613	神奇制药	12,100	131,285.00	0.09
95	002092	中泰化学	10,300	130,810.00	0.09
96	600746	江苏索普	12,000	129,360.00	0.09
97	002776	柏堡龙	5,500	127,490.00	0.09
98	600230	沧州大化	4,200	124,824.00	0.09
99	603598	引力传媒	7,700	124,817.00	0.09
100	601515	东风股份	10,728	121,226.40	0.09
101	601231	环旭电子	7,700	120,967.00	0.09
102	600891	秋林集团	15,500	120,745.00	0.09
103	603518	维格娜丝	4,900	119,854.00	0.09
104	300119	瑞普生物	8,400	119,616.00	0.09
105	300116	坚瑞沃能	11,100	119,325.00	0.08
106	603806	福斯特	3,722	119,141.22	0.08
107	000609	绵石投资	8,000	119,040.00	0.08
108	603519	立霸股份	5,393	116,812.38	0.08
109	600180	瑞茂通	8,207	115,226.28	0.08
110	603306	华懋科技	3,600	113,904.00	0.08
111	002656	摩登大道	6,400	110,656.00	0.08
112	300255	常山药业	12,500	108,750.00	0.08
113	600681	百川能源	7,500	105,825.00	0.08
114	600168	武汉控股	11,700	105,417.00	0.07
115	603726	朗迪集团	2,900	104,951.00	0.07
116	600499	科达洁能	12,900	102,426.00	0.07
117	600183	生益科技	8,300	102,422.00	0.07
118	601313	江南嘉捷	11,600	101,964.00	0.07

119	600475	华光股份	4,900	97,657.00	0.07
120	600829	人民同泰	7,900	97,486.00	0.07
121	300230	永利股份	5,700	94,278.00	0.07
122	600182	S 佳通	4,100	94,259.00	0.07
123	600766	园城黄金	7,500	93,750.00	0.07
124	603020	爱普股份	6,176	89,922.56	0.06
125	603199	九华旅游	2,300	89,700.00	0.06
126	603828	柯利达	4,100	89,011.00	0.06
127	600628	新世界	7,600	87,780.00	0.06
128	300043	星辉娱乐	10,600	87,026.00	0.06
129	601677	明泰铝业	6,319	86,191.16	0.06
130	300132	青松股份	10,200	82,824.00	0.06
131	600857	宁波中百	6,800	82,756.00	0.06
132	600302	标准股份	9,941	82,510.30	0.06
133	002416	爱施德	7,600	82,004.00	0.06
134	601801	皖新传媒	5,900	81,538.00	0.06
135	002354	天神娱乐	3,700	79,550.00	0.06
136	600213	亚星客车	7,200	77,832.00	0.06
137	601208	东材科技	10,900	76,736.00	0.05
138	600522	中天科技	6,300	75,915.00	0.05
139	600319	亚星化学	7,100	75,615.00	0.05
140	603023	威帝股份	6,000	75,600.00	0.05
141	600769	祥龙电业	8,800	75,416.00	0.05
142	600689	上海三毛	5,100	70,635.00	0.05
143	300375	鹏翎股份	3,500	69,195.00	0.05
144	000906	浙商中拓	7,780	69,164.20	0.05
145	600558	大西洋	12,600	67,788.00	0.05
146	002789	建艺集团	1,300	66,690.00	0.05
147	300393	中来股份	1,200	66,012.00	0.05
148	600309	万华化学	2,300	65,872.00	0.05
149	300470	日机密封	1,900	64,961.00	0.05
150	603030	全筑股份	6,022	61,966.38	0.04
151	002136	安纳达	3,500	61,320.00	0.04
152	600067	冠城大通	8,700	59,769.00	0.04
153	603167	渤海轮渡	5,400	58,698.00	0.04
154	600606	绿地控股	7,500	58,650.00	0.04
155	600271	航天信息	2,800	57,792.00	0.04
156	002068	黑猫股份	6,800	57,188.00	0.04
157	300400	劲拓股份	3,700	55,204.00	0.04

158	300046	台基股份	2,900	54,230.00	0.04
159	002440	闰土股份	3,500	53,410.00	0.04
160	600251	冠农股份	6,700	53,399.00	0.04
161	600188	兖州煤业	4,300	52,632.00	0.04
162	002615	哈尔斯	4,450	50,285.00	0.04
163	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.03
164	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.03
165	600596	新安股份	5,400	45,630.00	0.03
166	300395	菲利华	3,100	45,415.00	0.03
167	002709	天赐材料	1,100	45,287.00	0.03
168	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.03
169	002489	浙江永强	6,600	42,108.00	0.03
170	002749	国光股份	600	40,404.00	0.03
171	002088	鲁阳节能	3,300	39,501.00	0.03
172	002397	梦洁股份	5,900	39,412.00	0.03
173	600306	商业城	2,700	37,125.00	0.03
174	300121	阳谷华泰	2,300	31,740.00	0.02
175	002382	蓝帆医疗	2,500	30,575.00	0.02
176	600231	凌钢股份	9,000	29,700.00	0.02
177	300127	银河磁体	1,800	29,394.00	0.02
178	000985	大庆华科	1,200	28,440.00	0.02
179	002582	好想你	2,300	27,646.00	0.02
180	002116	中国海诚	2,200	26,906.00	0.02
181	002183	怡亚通	3,100	26,753.00	0.02
182	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.02
183	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.02
184	002881	美格智能	989	22,608.54	0.02
185	600468	百利电气	3,450	22,425.00	0.02
186	603679	华体科技	809	21,438.50	0.02
187	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.01
188	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.01
189	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.01
190	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.01
191	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.01
192	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.01
193	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.01
194	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.01
195	603331	百达精工	999	9,620.37	0.01
196	300671	富满电子	942	7,639.62	0.01

197	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.01
198	603223	恒通股份	83	2,029.35	0.00
199	002627	宜昌交运	96	1,765.44	0.00
200	300013	新宁物流	72	1,199.52	0.00
201	300483	沃施股份	33	1,103.85	0.00
202	300274	阳光电源	81	898.29	0.00
203	000030	富奥股份	100	894.00	0.00
204	000023	深天地 A	32	865.92	0.00
205	300039	上海凯宝	90	654.30	0.00
206	300067	安诺其	34	213.86	0.00
207	300370	安控科技	34	165.24	0.00
208	601969	海南矿业	14	147.84	0.00
209	600683	京投发展	18	136.98	0.00
210	601010	文峰股份	21	88.41	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	600676	交运股份	2,693,708.00	1.92
2	600162	香江控股	2,409,953.50	1.71
3	000838	财信发展	2,094,311.00	1.49
4	601368	绿城水务	2,037,133.00	1.45
5	600824	益民集团	1,999,443.00	1.42
6	300388	国祯环保	1,803,202.00	1.28
7	002452	长高集团	1,802,415.62	1.28
8	603959	百利科技	1,784,348.00	1.27
9	600662	强生控股	1,778,678.00	1.26
10	000667	美好置业	1,751,763.00	1.25
11	600846	同济科技	1,746,559.76	1.24
12	300111	向日葵	1,742,983.00	1.24
13	603116	红蜻蜓	1,686,761.48	1.20
14	600595	中孚实业	1,657,368.00	1.18
15	601011	宝泰隆	1,646,500.00	1.17
16	600606	绿地控股	1,640,740.00	1.17

17	600269	赣粤高速	1,628,791.00	1.16
18	002540	亚太科技	1,608,082.19	1.14
19	600986	科达股份	1,600,245.15	1.14
20	300360	炬华科技	1,595,214.00	1.13

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。

7.4.2 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	2,555,723.00	1.82
2	600676	交运股份	2,353,797.95	1.67
3	000838	财信发展	1,910,360.00	1.36
4	000667	美好置业	1,736,339.00	1.23
5	600846	同济科技	1,672,161.98	1.19
6	600595	中孚实业	1,654,086.00	1.18
7	300111	向日葵	1,652,263.40	1.17
8	600662	强生控股	1,630,245.00	1.16
9	300388	国祯环保	1,627,289.00	1.16
10	300419	浩丰科技	1,538,379.00	1.09
11	603959	百利科技	1,530,390.00	1.09
12	600824	益民集团	1,500,797.00	1.07
13	600606	绿地控股	1,499,115.00	1.07
14	002540	亚太科技	1,485,608.74	1.06
15	600330	天通股份	1,394,355.00	0.99
16	600133	东湖高新	1,375,409.00	0.98
17	600503	华丽家族	1,372,812.00	0.98
18	000751	锌业股份	1,330,328.00	0.95
19	601222	林洋能源	1,314,693.00	0.93
20	600531	豫光金铅	1,300,321.78	0.92

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。

7.4.3 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	446,349,148.27
卖出股票收入（成交）总额	300,572,761.99

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。

7.5 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。

7.6 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。

7.7 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。

7.8 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投资。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.11.3 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

报告期内基金投资的前十名证券除交大昂立（证券代码 600530）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。

该证券发行人于 2017 年 1 月 24 日发布公告称，因未及时披露公司重大事件，被中国证监会地方监管机构采取监管警示。

该证券发行人于 2017 年 4 月 20 日发布公告称，因未及时披露公司重大事件，重大事项未履行审议程序，被中国证监会地方监管机构采取监管警示。

对上述证券的投资决策程序的说明：本基金投资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。

7.12.2

报告期内，本基金不存在投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情形。

7.12.3 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	100,532.38
2	应收证券清算款	165,030.23
3	应收股利	-
4	应收利息	1,800.32

5	应收申购款	30,065.84
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	297,428.77

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 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。

7.12.5.2 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	300163	先锋新材	960,640.00	0.68	重大事项

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 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	679	224,317.43	-	-	152,311,534.41	100.00%
招商中证 1000 指数 C	332	5,216.34	-	-	1,731,823.61	100.00%
合计	1,011	152,367.32	-	-	154,043,358.02	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）。

8.2 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	招商中证 1000 指数 A	6,374.18	0.0042%

业人员持有本基金	招商中证 1000 指数 C	718.42	0.0415%
	合计	7,092.60	0.0046%

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）。

8.3 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

§ 9 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）基金份额总额	200,198,706.99	785,323.90
本报告期期初基金份额总额	200,198,706.99	785,323.90
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	2,537,504.93	1,742,573.98
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	50,424,677.51	796,074.27
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）	-	-
本报告期期末基金份额总额	152,311,534.41	1,731,823.61

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期未举行基金份额持有人大会。

10.2 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

本基金本报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 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。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未作改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 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，基金管理人未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、托管人及其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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况**10.7.1 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	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	3	-	-	-	-	-
国泰君安	3	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	4	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
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	746,184,971.73	100.00%	97,979.35	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。

10.7.2 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	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
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	69,760.30	100.00%	945,900,000.00	84.01%	-

10.8 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
5	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
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	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
8	招商中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同生效公告	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	招商基金关于招商中证 1000 指数增强型基金以及沪深 300 指数增强型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

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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	20170303-20170630	64,002,200.00	-	10,000,000.00	54,002,200.00	35.06%
	2	20170303-20170630	68,002,400.00	-	20,000,000.00	48,002,400.00	31.16%
	3	20170303-20170630	68,002,400.00	-	20,000,000.00	48,002,400.00	31.16%
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。							

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会批准设立招商基金管理有限公司的文件；
- 2、中国证券监督管理委员会批准招商中证 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。

12.2 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

12.3 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.cmfcchina.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

2017 年 8 月 29 日