

# 招商国证生物医药指数分级证券投资 基金 2018 年半年度报告

2018 年 06 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：2018 年 8 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2018年8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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 1 月 1 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.....	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.....	5
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
§4 管理人报告.....	7
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
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.....	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	11
§5 托管人报告.....	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
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.....	11
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.....	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告.....	33
7.1 期末基金资产组合情况.....	33
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	34
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.....	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	38
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.....	38
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.....	38
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.....	38
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.....	39

7.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	39
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	39
7.12	投资组合报告附注.....	39
§8	基金份额持有人信息.....	40
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	40
8.2	期末上市基金前十名持有人.....	41
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	42
8.4	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.....	42
§9	开放式基金份额变动.....	43
§10	重大事件揭示.....	43
10.1	基金份额持有人大会决议.....	43
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.....	43
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	43
10.4	基金投资策略的改变.....	44
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	44
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.....	44
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	44
10.8	其他重大事件.....	45
§11	备查文件目录.....	46
11.1	备查文件目录.....	46
11.2	存放地点.....	47
11.3	查阅方式.....	47

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	招商国证生物医药指数分级证券投资基金		
基金简称	招商国证生物医药指数分级		
场内简称	生物医药		
基金主代码	161726		
交易代码	161726		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2015 年 5 月 27 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	380,374,985.30 份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2015 年 6 月 5 日		
下属分级基金的基金简称	招商国证生物医药 A	招商国证生物医药 B	招商国证生物医药指数分级
下属分级基金的场内简称	生物药 A	生物药 B	生物医药
下属分级基金的交易代码	150271	150272	161726
报告期末下属分级基金的份额总额	8,962,131.00 份	8,962,131.00 份	362,450,723.30 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段，实现对标的指数的有效跟踪，获得与标的指数收益相似的回报。本基金的投资目标是保持基金净值收益率与业绩基准日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。
投资策略	本基金以国证生物医药指数为标的指数，采用完全复制法，按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，进行被动式指数化投资。股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合复制标的指数，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，以复制和跟踪标的指数。基金管理人将对成份股的流动性进行分析，如发现流动性欠佳的个股将可能采用基本面替代策略、相关性检验策略构造替代股组合。本基金管理人每日跟踪基金组合与标的指数表现的偏离度，每月末、季度末定期分析基

	金的实际组合与标的指数表现的累计偏离度、跟踪误差变化情况及其原因，并优化跟踪偏离度管理方案。可运用股指期货，以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。		
业绩比较基准	国证生物医药指数收益率×95%+金融机构人民币活期存款基准利率（税后）×5%		
风险收益特征	本基金为股票型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征。		
下属分级基金的风险收益特征	招商国证生物医药 A 份额具有低风险、收益相对稳定的特征。	招商国证生物医药 B 份额具有高风险、高预期收益的特征。	本基金为股票型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征。

## 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
	联系电话	0755-83196666
	电子邮箱	cmf@cmfchina.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
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.cmfchina.com">http://www.cmfchina.com</a>
基金半年度报告备置地点	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
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 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

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018 年 1 月 1 日) - (2018 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-13,058,634.27
本期利润	21,187,307.47
加权平均基金份额本期利润	0.0580
本期加权平均净值利润率	5.26%
本期基金份额净值增长率	6.22%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-230,722,295.42
期末可供分配基金份额利润	-0.6066
期末基金资产净值	428,516,175.48
期末基金份额净值	1.1270
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-24.53%

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。

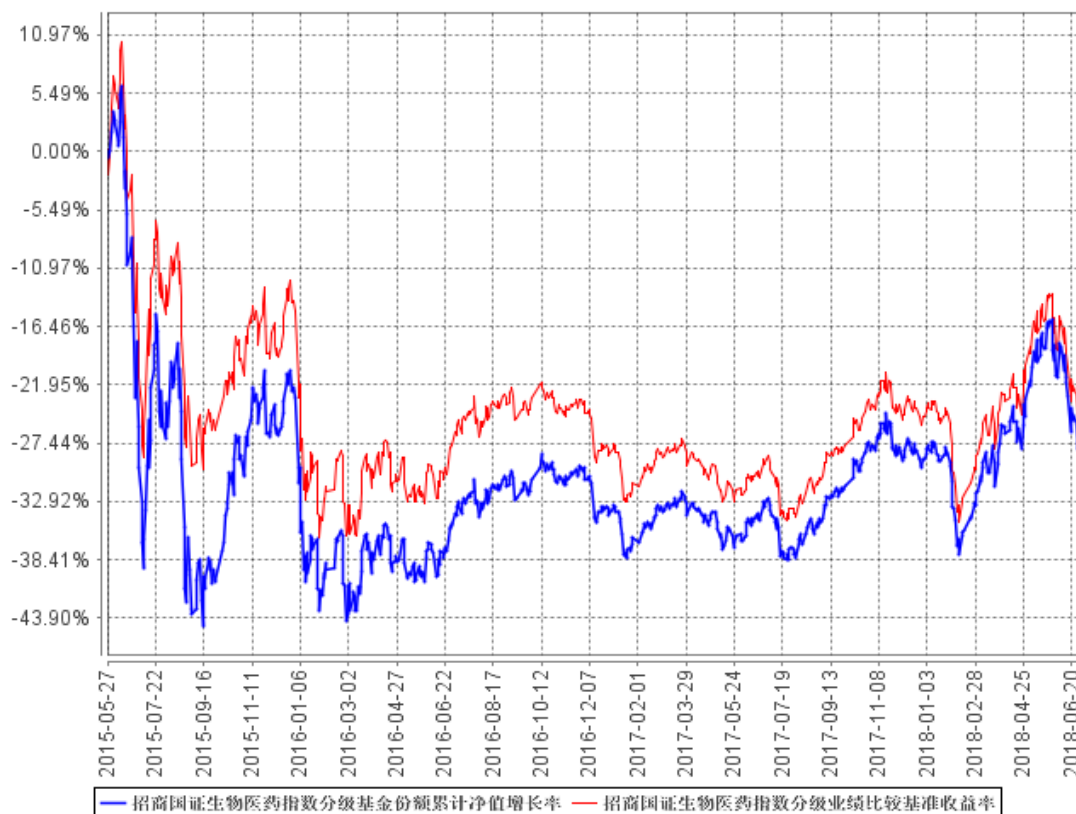
## 3.2 基金净值表现

### 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

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	-7.77%	2.26%	-7.41%	2.10%	-0.36%	0.16%
过去三个月	1.62%	1.86%	1.02%	1.73%	0.60%	0.13%
过去六个月	6.22%	1.64%	4.08%	1.56%	2.14%	0.08%
过去一年	12.37%	1.33%	9.85%	1.27%	2.52%	0.06%
过去三年	-8.18%	1.94%	-12.77%	1.66%	4.59%	0.28%
自基金合同生效起至今	-24.53%	2.01%	-21.92%	1.72%	-2.61%	0.29%

### 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

招商国证生物医药指数分级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



## § 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》

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》

#### 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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
侯昊	本基金基金经理	2017 年 9 月 5 日	-	8	男，硕士。2009 年 7 月加入招商基金管理有限公司，曾任风险管理部风控经理，量化投资部助理投资经理、投资经理，现任量化投资部副总监兼招商中证白酒指数分级证券投资基金、招商中证煤炭等权指数分级证券投资基金、招商深证 100 指数证券投资基金、招商国证生物医药指数分级证券投资基金、招商中证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。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

基金管理人严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。确因投资组合的投资策略或流动性等需要而发生的同日反向交易，基金管理人要求相关投资组合经理提供决策依据，并留存记录备查，完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合等除外。

本报告期内，本基金各项交易均严格按照相关法律法规、基金合同的有关要求执行，本基金管理人所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易不存在成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形。报告期内未发现有可能导致不公平交易和利益输送的重大异常交易行为。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，国内经济继续下滑，货币政策中性偏松，受中美贸易战的影响，及国内金融严监管效应持续的持续，报告期内 A 股普跌，仅休闲服务、医药生物、食品饮料两个行业获得了正收益，综合、通信、电气设备、机械设备、有色金属跌幅居前。本基金的基准指数国证生物医药指数报告期内上涨 4.21%。

关于本基金的运作，股票仓位维持在 94.5% 左右的水平，基本完成了对基准的跟踪。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金份额净值增长率为 6.22%，同期业绩基准增长率为 4.08%。

#### 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、回顾 2018 年上半年，几个主要发达经济体（美、欧、日）经济景气度边际走弱，且年初大幅低于预期（花旗经济意外指数明显下降）；并且从结构上而言，也与最初市场预期的“欧强美弱”方向相左。而这背后原因则在于，美国经济得益于房地产加速补库存以及税改措施刺激经济，而欧元区经济增长动能的衰减则源于 2017 年汇率升值过快带来对经济的滞后下拉作用（2017 年欧央行削减 QE 导致欧元兑美元全年大幅升值 14%、实际有效汇率升幅也接近 5%）。

2、国内从今年上半年情况来看，实体经济整体韧性仍然较强。截至 2018 年一季度，我国的实际 GDP 增速仍有 6.8%水平；截至 5 月，克强指数仍维持在 10%以上的高位；截至 6 月，我国制造业 PMI 数据已经连续 23 个月在荣枯线上方、连续 4 个月在 51 以上。与此同时，扩张的 PPI 同比增速也进一步有利支撑了工业企业利润名义值增长。但往前看，我们看到今年以来社会融资规模存量同比增速急剧收窄，“去杠杆”带来的信用紧缩环境或将对后续的经济增长造成一定负面影响；此外，在上半年对企业利润起到重要支撑作用的 PPI 同比在下半年也将面临基数抬高的问题；而中美贸易摩擦的加剧也再给经济增长前景增添了一丝不确定性。

3、2018 年上半年，我国的股票市场出现了较大幅度调整（万得全 A、沪深 300、上证 50、中证 500 等指数分别下跌 14.6%、12.9%、13.3%、16.5%），主要源于“金融去杠杆”进程对微观流动性、标的基本面以及市场情绪均造成了一定程度的负面影响，而中美贸易摩擦则加剧了股市下行幅度。展望下半年，金融去杠杆与中美贸易摩擦仍旧持续存在，当前市场估值已经处于历史底部，中期等待释放更多经济改革新信号带来的结构性机会。

#### 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发部门、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。

投资和研发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；投资和研发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。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《基金合同》的约定，在存续期内，本基金不进行收益分配。

#### 4.8 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”）在招商国证生物医药指数分级证券投资基金（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：招商国证生物医药指数分级证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	23,638,734.83	26,870,373.88
结算备付金		483,548.86	120,191.29
存出保证金		45,320.70	18,015.65
交易性金融资产	6.4.7.2	406,895,344.23	384,367,737.69
其中：股票投资		406,895,344.23	384,367,737.69
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		-	22,148,630.82
应收利息	6.4.7.5	4,711.24	4,637.35
应收股利		-	-
应收申购款		792,511.22	567,219.53
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		431,860,171.08	434,096,806.21

负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 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	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		2,546,993.97	810,809.22
应付管理人报酬		365,194.88	370,257.09
应付托管费		80,342.90	81,456.53
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	84,999.86	105,389.54
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	266,463.99	212,172.00
负债合计		3,343,995.60	1,580,084.38
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	567,949,888.31	608,812,549.67
未分配利润	6.4.7.10	-139,433,712.83	-176,295,827.84
所有者权益合计		428,516,175.48	432,516,721.83
负债和所有者权益总计		431,860,171.08	434,096,806.21

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，招商生物医药份额净值 1.127 元，招商生物医药 A 份额参考净值 1.024 元，招商生物医药 B 份额参考净值 1.230 元；基金份额总额 380,374,985.30 份，其中招商生物医药份额 362,450,723.30 份，招商生物医药 A 份额 8,962,131.00 份，招商生物医药 B 份额 8,962,131.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：招商国证生物医药指数分级证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		24,199,176.58	9,122,191.60
1. 利息收入		86,143.77	91,515.93
其中：存款利息收入	6.4.7.11	86,143.77	91,515.93
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-10,516,922.39	-6,087,305.11
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-12,499,120.89	-8,225,450.54
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.14	-	-
收益			
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	1,982,198.50	2,138,145.43
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	34,245,941.74	15,005,025.24
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	384,013.46	112,955.54
减：二、费用		3,011,869.11	3,067,858.14
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,985,673.22	2,145,059.61
2. 托管费	6.4.10.2.2	436,848.12	471,913.10
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.20	268,430.87	130,317.94

5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6. 4. 7. 21	320, 916. 90	320, 567. 49
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		21, 187, 307. 47	6, 054, 333. 46
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		21, 187, 307. 47	6, 054, 333. 46

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：招商国证生物医药指数分级证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 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）	608, 812, 549. 67	-176, 295, 827. 84	432, 516, 721. 83
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	21, 187, 307. 47	21, 187, 307. 47
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）	-40, 862, 661. 36	15, 674, 807. 54	-25, 187, 853. 82
其中：1. 基金申购款	319, 492, 832. 30	-71, 182, 786. 36	248, 310, 045. 94
2. 基金赎回款	-360, 355, 493. 66	86, 857, 593. 90	-273, 497, 899. 76
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)	567,949,888.31	-139,433,712.83	428,516,175.48
项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 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)	687,745,623.81	-233,168,474.13	454,577,149.68
二、本期经营活动产生 的基金净值变动数 (本期利润)	-	6,054,333.46	6,054,333.46
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)	-69,016,024.82	24,010,212.98	-45,005,811.84
其中: 1. 基金申购款	105,209,482.75	-35,485,658.10	69,723,824.65
2. 基金赎回款	-174,225,507.57	59,495,871.08	-114,729,636.49
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)	618,729,598.99	-203,103,927.69	415,625,671.30

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:

\_\_\_\_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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

招商国证生物医药指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于准予招商国证生物医药指数分级证券投资基金注册的批复》(证监许可[2015]668号文)批准,由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》及其配套规则和《招商国证生物医药指数分级证券投资基金基金合同》发售,基金合同于2015年5月27日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定,

首次设立募集规模为 1,130,152,987.25 份基金份额。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”）。

本基金于 2015 年 5 月 19 日至 2015 年 5 月 29 日募集，并提前于 2015 年 5 月 22 日募集完毕。募集期间净认购资金人民币 1,130,003,547.81 元，认购资金在募集期间产生的利息人民币 149,439.44 元，募集的有效认购份额及利息结转的基金份额合计 1,130,152,987.25 份。上述募集资金已由毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）验证，并出具了毕马威华振验字第 1500166 号验资报告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《招商国证生物医药指数分级证券投资基金基金合同》和截至报告期末最新公告的《招商国证生物医药指数分级证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国证生物医药指数的成份股、备选成份股、股指期货、固定收益投资品种（如债券、资产支持证券、货币市场工具等）以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金投资于股票的资产不低于基金资产的 85%，投资于国证生物医药指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%，且不低于非现金资产的 80%；本基金每个交易日日终在扣除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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为：国证生物医药指数收益率×95%+金融机构人民币活期存款基准利率（税后）×5%。

招商国证生物医药 A 份额、招商国证生物医药 B 份额于 2015 年 6 月 5 日开始上市交易。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

#### 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 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2018 年 1 月 1 日至 2018 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

本报告期所采用的会计政策，会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 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

本基金在本报告期间未发生重大会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内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

根据财税 [2004] 78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2012] 85 号文《财政部、国家税务总局、证监会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 [2015] 101 号《财政部、国家税务总局、证监会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 [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》、上证交字 [2008] 16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《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 [2008] 1 号文《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》、财税 [2016] 36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税 [2016] 140 号文《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] 2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、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，本基金适用的主要税项列示如下：

(a) 证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。

(b) 自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

2018 年 1 月 1 日（含）以后，资管产品管理人（以下称管理人）运营基金过程中发生的增值税应税行为，以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。对基金在 2018 年 1 月 1 日以前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入免征增值税。

(c) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d)对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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，股权登记日为自 2013 年 1 月 1 日起至 2015 年 9 月 7 日期间的，暂减按 25%计入应纳税所得额，股权登记日在 2015 年 9 月 8 日及以后的，暂免征收个人所得税。

(e)基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(f)对投资者（包括个人和机构投资者）从基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(g)对基金在 2018 年 1 月 1 日（含）以后运营过程中缴纳的增值税，按照证券投资基金管理人所在地适用的城市维护建设税税率，计算缴纳城市维护建设税。

(h)对基金在 2018 年 1 月 1 日（含）以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的费率计算缴纳教育费附加、地方教育费附加。

## 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 2018 年 6 月 30 日
活期存款	23,638,734.83
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	23,638,734.83

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	466,611,470.13	406,895,344.23	-59,716,125.90
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	466,611,470.13	406,895,344.23	-59,716,125.90

#### 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各项买入返售金融资产。

##### 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 2018 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	4,497.04
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	195.84
应收债券利息	-
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	18.36
合计	4,711.24

#### 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 2018 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	84,999.86
银行间市场应付交易费用	-
合计	84,999.86

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
----	---------------------

应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	8,192.72
预提费用	208,271.27
应付指数使用费	50,000.00
合计	266,463.99

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	407,724,036.78	608,812,549.67
本期申购	213,988,768.77	319,492,832.30
本期赎回（以“-”号填列）	-241,337,820.25	-360,355,493.66
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	380,374,985.30	567,949,888.31

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、根据《基金合同》规定，投资者可申购、赎回招商国证生物医药份额，招商国证生物医药 A 份额和招商国证生物医药 B 份额只可在深圳证券交易所上市交易，因此上表不再单独披露招商国证生物医药 A 份额和招商国证生物医药 B 份额的情况。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-232,761,015.41	56,465,187.57	-176,295,827.84
本期利润	-13,058,634.27	34,245,941.74	21,187,307.47
本期基金份额交易产生的变动数	15,097,354.26	577,453.28	15,674,807.54
其中：基金申购款	-130,503,659.99	59,320,873.63	-71,182,786.36
基金赎回款	145,601,014.25	-58,743,420.35	86,857,593.90
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-230,722,295.42	91,288,582.59	-139,433,712.83

#### 6.4.7.11 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 6 月 30 日
活期存款利息收入	84,592.74
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	1,228.81
其他	322.22
合计	86,143.77

#### 6.4.7.12 股票投资收益

**6.4.7.12.1 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 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-12,499,120.89
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	-12,499,120.89

**6.4.7.12.2 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 6 月 30 日
卖出股票成交总额	91,787,058.38
减：卖出股票成本总额	104,286,179.27
买卖股票差价收入	-12,499,120.89

**6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入**

本基金本报告期内无股票赎回差价收入。

**6.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期内无股票申购差价收入。

**6.4.7.13 债券投资收益****6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

本基金本报告期内无债券投资收益。

**6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

本基金本报告期内无买卖债券差价收入。

**6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入**

本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

**6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期内无债券申购差价收入。

**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****6.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成**

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

**6.4.7.15.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

本基金本报告期内无买卖贵金属差价收入。

**6.4.7.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

本基金本报告期内无贵金属赎回差价收入。

**6.4.7.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期内无贵金属申购差价收入。

**6.4.7.16 衍生工具收益****6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期内无衍生工具买卖权证差价收入。

**6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益**

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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,982,198.50
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,982,198.50

**6.4.7.18 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	34,245,941.74
——股票投资	34,245,941.74
——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	34,245,941.74

**6.4.7.19 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	267,984.59



转换转出收入	116,028.87
合计	384,013.46

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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	268,430.87
银行间市场交易费用	-
合计	268,430.87

#### 6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	148,765.71
上市费	29,752.78
指数使用费	100,000.00
银行费用	3,645.63
其他费用	9,000.00
合计	320,916.90

### 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，本基金无需要说明的重大或有事项。

#### 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
中国银行股份有限公司	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
------------------------	----------

## 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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 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	28,915,145.50	15.89%	668,698.71	0.96%

#### 6.4.10.1.2 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。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

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回购交易。

#### 6.4.10.1.4 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。

#### 6.4.10.1.5 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 6 月 30 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	26,931.12	16.78%	15,965.40	18.78%
关联方名称	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 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	622.77	0.96%	622.77	2.68%

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。

### 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 2018 年 1 月 1 日至 2018	上年度可比期间 2017 年 1 月
----	-------------------------	--------------------

	年 6 月 30 日	1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,985,673.22	2,145,059.61
其中：支付销售机构的客户维护费	1,040,818.46	907,726.97

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×1.00%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：

$$\text{日基金管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.00\% \div \text{当年天数}$$

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	436,848.12	471,913.10

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×0.22%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：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.22\% \div \text{当年天数}$$

#### 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。

#### 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。

##### 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
招商证券股份有限公司	1.00	0.0000%	1.00	0.0000%

#### 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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 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	23,638,734.83	84,592.74	22,295,787.60	91,152.09
------	---------------	-----------	---------------	-----------

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。

#### 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。

#### 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（2018 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
603693	江苏新能	2018 年 6 月 25 日	2018 年 7 月 3 日	新股流通受限	9.00	9.00	5,384	48,456.00	48,456.00	-
603706	东方环宇	2018 年 6 月 29 日	2018 年 7 月 9 日	新股流通受限	13.09	13.09	1,765	23,103.85	23,103.85	-
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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

注：以上“可流通日”中，部分证券的日期是根据上市公司公告估算的流通日期。

##### 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
002252	上海莱士	2018 年 2 月 23 日	重大事项	21.48	尚未复牌	-	1,799,164	34,819,340.26	38,646,042.72	-

300238	冠昊生物	2018 年 2 月 2 日	重大事项	18.87	2018 年 7 月 18 日	16.98	282,590	11,682,051.39	5,332,473.30	-
--------	------	----------------	------	-------	-----------------	-------	---------	---------------	--------------	---

### 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（主要是指成份股、备选成份股）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使本基金面临各种类型的风险，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、存出保证金及其他。

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

对于与债券投资等投资品种相关的信用风险，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

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

#### 6.4.13.2.2 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。

#### 6.4.13.2.3 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。

#### 6.4.13.2.4 按长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长期信用评级列示的债券投资。

#### 6.4.13.2.5 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。

#### 6.4.13.2.6 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。

### 6.4.13.3 流动性风险

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。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。本基金所持有的交易性金融资产在证券交易所交易，除附注 6.4.12 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。本基金所持有的全部金融负债无固定到期日或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，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

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，通过投资品种的流动性指标来持续地评估、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。

### 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 2018 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	23,638,734.83	-	-	-	-	-	23,638,734.83
结算备付金	483,548.86	-	-	-	-	-	483,548.86
存出保证金	45,320.70	-	-	-	-	-	45,320.70
交易性金融资产	-	-	-	-	-	406,895,344.23	406,895,344.23
应收利息	-	-	-	-	-	4,711.24	4,711.24
应收申购款	-	-	-	-	-	792,511.22	792,511.22
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	24,167,604.39	-	-	-	-	407,692,566.69	431,860,171.08
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,546,993.97	2,546,993.97
应付	-	-	-	-	-	365,194.88	365,194.88

管理人报酬								
应付托管费	-	-	-	-	-	80,342.90	80,342.90	
应付交易费用	-	-	-	-	-	84,999.86	84,999.86	
其他负债	-	-	-	-	-	266,463.99	266,463.99	
负债总计	-	-	-	-	-	3,343,995.60	3,343,995.60	
利率敏感度缺口	24,167,604.39	-	-	-	-	404,348,571.09	428,516,175.48	
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	26,870,373.88	-	-	-	-	-	26,870,373.88	
结算备付金	120,191.29	-	-	-	-	-	120,191.29	
存出保证金	18,015.65	-	-	-	-	-	18,015.65	
交易性金融资产	-	-	-	-	-	384,367,737.69	384,367,737.69	
应收证券清算款	-	-	-	-	-	22,148,630.82	22,148,630.82	
应收利息	-	-	-	-	-	4,637.35	4,637.35	
应收申购	-	-	-	-	-	567,219.53	567,219.53	



款							
资产总计	27,008,580.82	-	-	-	-	407,088,225.39	434,096,806.21
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	810,809.22	810,809.22
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	370,257.09	370,257.09
应付托管费	-	-	-	-	-	81,456.53	81,456.53
应付交易费用	-	-	-	-	-	105,389.54	105,389.54
其他负债	-	-	-	-	-	212,172.00	212,172.00
负债总计	-	-	-	-	-	1,580,084.38	1,580,084.38
利率敏感度缺口	27,008,580.82	-	-	-	-	405,508,141.01	432,516,721.83

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交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 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	406,895,344.23	94.95	384,367,737.69	88.87
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	406,895,344.23	94.95	384,367,737.69	88.87

#### 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(2018年6 月30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%	20,344,767.21	19,218,386.88
	2. 权益性投资的市 场价格下降 5%	-20,344,767.21	-19,218,386.88

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无需要说明有助于理解和分析会计报表的其他事项。

## § 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(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	406,895,344.23	94.22
	其中:股票	406,895,344.23	94.22
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	24,122,283.69	5.59
7	其他资产	842,543.16	0.20
8	合计	431,860,171.08	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	386,885,672.71	90.28
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	3,895,662.54	0.91
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	15,744,069.08	3.67
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	406,525,404.33	94.87

### 7.2.2 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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	179,926.82	0.04

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	71,559.85	0.02
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	339.00	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	35,094.00	0.01
J	金融业	1,794.09	0.00
K	房地产业	-	-
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	81,226.14	0.02
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	369,939.90	0.09

### 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 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

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	000661	长春高新	216,929	49,394,733.30	11.53
2	002252	上海莱士	1,799,164	38,646,042.72	9.02
3	300142	沃森生物	1,813,782	36,239,364.36	8.46
4	300122	智飞生物	714,037	32,660,052.38	7.62
5	600201	生物股份	1,677,051	28,660,801.59	6.69
6	002007	华兰生物	841,031	27,047,556.96	6.31
7	002038	双鹭药业	647,804	24,610,073.96	5.74
8	300009	安科生物	941,881	17,368,285.64	4.05
9	002030	达安基因	864,593	13,332,024.06	3.11
10	600161	天坛生物	669,319	12,951,322.65	3.02
11	300463	迈克生物	399,280	9,954,050.40	2.32
12	600645	中源协和	476,230	9,172,189.80	2.14
13	603658	安图生物	109,398	9,020,959.08	2.11
14	002680	长生生物	379,686	8,463,200.94	1.98

15	300294	博雅生物	267,860	8,300,981.40	1.94
16	300529	健帆生物	178,696	7,664,271.44	1.79
17	002022	科华生物	642,366	7,612,037.10	1.78
18	603718	海利生物	515,280	7,399,420.80	1.73
19	300482	万孚生物	103,833	7,268,310.00	1.70
20	600195	中牧股份	363,778	7,075,482.10	1.65
21	000710	贝瑞基因	130,498	6,571,879.28	1.53
22	300298	三诺生物	294,099	6,081,967.32	1.42
23	300238	冠昊生物	282,590	5,332,473.30	1.24
24	600530	交大昂立	816,723	4,516,478.19	1.05
25	300406	九强生物	311,267	4,482,244.80	1.05
26	300439	美康生物	186,570	4,029,912.00	0.94
27	603108	润达医疗	347,207	3,895,662.54	0.91
28	002166	莱茵生物	503,473	3,685,422.36	0.86
29	300204	舒泰神	263,537	2,851,470.34	0.67
30	300318	博晖创新	469,902	2,236,733.52	0.52

### 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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300747	锐科激光	1,543	123,995.48	0.03
2	601330	绿色动力	4,971	81,226.14	0.02
3	603650	彤程新材	2,376	50,988.96	0.01
4	603693	江苏新能	5,384	48,456.00	0.01
5	300454	深信服	300	32,988.00	0.01
6	603706	东方环宇	1,765	23,103.85	0.01
7	300504	天邑股份	62	2,444.66	0.00
8	002929	润建通信	52	2,106.00	0.00
9	600901	江苏租赁	237	1,794.09	0.00
10	002927	泰永长征	40	1,530.00	0.00
11	603356	华菱精工	39	818.22	0.00
12	002928	华夏航空	12	339.00	0.00
13	300727	润禾材料	4	117.12	0.00
14	603013	亚普股份	1	32.38	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	300142	沃森生物	11,739,747.82	2.71
2	000661	长春高新	9,640,820.40	2.23
3	000710	贝瑞基因	8,330,194.37	1.93
4	600201	生物股份	6,040,085.30	1.40
5	300122	智飞生物	5,706,845.10	1.32
6	002038	双鹭药业	5,268,902.92	1.22
7	002007	华兰生物	5,049,449.00	1.17
8	300529	健帆生物	4,596,734.50	1.06
9	300009	安科生物	3,849,359.80	0.89
10	603658	安图生物	3,081,007.93	0.71
11	002252	上海莱士	2,725,480.52	0.63
12	600161	天坛生物	2,624,038.60	0.61
13	002030	达安基因	2,486,222.22	0.57
14	002680	长生生物	1,856,202.00	0.43
15	300463	迈克生物	1,856,200.00	0.43
16	600645	中源协和	1,776,304.00	0.41
17	300294	博雅生物	1,653,542.50	0.38
18	002022	科华生物	1,617,076.00	0.37
19	600195	中牧股份	1,494,710.96	0.35
20	300298	三诺生物	1,332,330.46	0.31

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	000661	长春高新	12,458,442.22	2.88
2	300142	沃森生物	5,996,477.17	1.39
3	300122	智飞生物	5,949,544.48	1.38
4	002007	华兰生物	5,801,841.11	1.34
5	600201	生物股份	5,502,310.72	1.27
6	002038	双鹭药业	5,449,761.98	1.26
7	300009	安科生物	4,287,587.62	0.99
8	600161	天坛生物	3,360,204.00	0.78
9	002030	达安基因	3,281,147.40	0.76
10	300119	瑞普生物	3,230,751.78	0.75
11	600645	中源协和	3,115,731.00	0.72
12	002252	上海莱士	2,313,180.00	0.53

13	300463	迈克生物	2,064,904.97	0.48
14	002022	科华生物	2,005,053.22	0.46
15	300294	博雅生物	1,973,581.00	0.46
16	300482	万孚生物	1,594,352.00	0.37
17	002166	莱茵生物	1,510,680.35	0.35
18	300298	三诺生物	1,495,675.17	0.35
19	600195	中牧股份	1,384,071.00	0.32
20	002680	长生生物	1,377,260.78	0.32

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

金额单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	92,567,844.07
卖出股票收入（成交）总额	91,787,058.38

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。

## 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

本基金管理人可运用股指期货，以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，参与股指期货的投资，以改善组合的风险收益特性。本基金主要通过对现货和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货定价模型寻求其合理估值水平，采用流动性好、交易活跃的期货合约，达到有效跟踪标的指数的目的。此外，本基金还将运用股指期货来对冲特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理，如预期大额申购赎回、大量分红等，以及对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险。

## 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

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

## 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。

### 7.12.2

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。

### 7.12.3 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	45,320.70
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,711.24
5	应收申购款	792,511.22
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	842,543.16

#### 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（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	002252	上海莱士	38,646,042.72	9.02	重大事项

##### 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（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	603693	江苏新能	48,456.00	0.01	新股流通受限

## § 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
招商国证生物医药 A	188	47,670.91	7,534,897.00	84.07%	1,427,234.00	15.93%
招商国	1,081	8,290.59	395,973.00	4.42%	8,566,158.00	95.58%

证生物 医药 B						
招商国 证生物 医药	31,267	11,592.12	338,970.99	0.09%	362,111,752.31	99.91%
合计	32,536	11,690.90	8,269,840.99	2.17%	372,105,144.31	97.83%

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）。

## 8.2 期末上市基金前十名持有人

### 招商国证生物医药 A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中国太平洋财产保险-传统-普通保险产品-013C-CT001 深	3,090,547.00	34.48%
2	中国太平洋人寿保险股份有限公司-分红-个人分红	2,295,084.00	25.61%
3	中国太平洋人寿保险股份有限公司-传统-普通保险产品	962,958.00	10.74%
4	太平洋资管-建设银行-太平洋第三极稳定增值混合型产品	776,500.00	8.66%
5	太平洋资管-建设银行-太平洋卓越第三极稳定增值二号产品	273,851.00	3.06%
6	梁荣光	131,933.00	1.47%
7	谭梅	96,196.00	1.07%
8	华夏未来资本管理有限公司-华夏未来泽时进取 1 号基金	85,957.00	0.96%
9	陈超英	79,391.00	0.89%
10	深圳市紫金投资有限公司	50,000.00	0.56%

### 招商国证生物医药 B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	卢国仨	1,244,097.00	13.88%
2	洪强	538,173.00	6.00%
3	湖北开放职业学院	395,773.00	4.42%

4	谭强辉	238,564.00	2.66%
5	邢宝华	192,352.00	2.15%
6	刘孝群	164,770.00	1.84%
7	杜效军	145,000.00	1.62%
8	袁璟	137,900.00	1.54%
9	梁荣光	131,933.00	1.47%
10	牟莹	102,426.00	1.14%

## 招商国证生物医药

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	王圣能	468,778.00	7.65%
2	梁荣光	405,862.00	6.62%
3	赖国芬	195,374.00	3.19%
4	李康	121,758.00	1.99%
5	任映红	121,758.00	1.99%
6	林景雪	103,495.00	1.69%
7	李莉	101,384.00	1.65%
8	刘桂珍	81,172.00	1.32%
9	李秀英	81,172.00	1.32%
10	郎文昆	81,171.00	1.32%

注：以上数据由中国证券登记结算公司提供，持有人为场内持有人。

## 8.3 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	招商国证生物医药 A	-	-
	招商国证生物医药 B	-	-
	招商国证生物医药	116,502.76	0.0321%
	合计	116,502.76	0.0321%

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）。

## 8.4 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	招商国证生物医药 A	0
	招商国证生物医药 B	0
	招商国证生物医药	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	招商国证生物医药 A	0
	招商国证生物医药 B	0
	招商国证生物医药	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	招商国证生物医药 A	招商国证生物医药 B	招商国证生物医药
基金合同生效日 (2015 年 5 月 27 日) 基金份额总额	90,994,352.00	90,994,352.00	948,164,283.25
本报告期期初基金份额总额	10,863,311.00	10,863,311.00	385,997,414.78
本报告期基金总申购份额	-	-	213,988,768.77
减：报告期基金总赎回份额	-	-	241,337,820.25
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-1,901,180.00	-1,901,180.00	3,802,360.00
本报告期期末基金份额总额	8,962,131.00	8,962,131.00	362,450,723.30

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末未召开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无改变。

## 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。

## 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	
西藏东方财富	1	43,768,202.72	24.06%	32,008.05	19.94%	-
招商证券	1	28,915,145.50	15.89%	26,931.12	16.78%	-
华泰证券	3	27,072,696.64	14.88%	25,212.93	15.71%	-
长城证券	2	18,765,095.95	10.31%	17,475.93	10.89%	-
中信建投	6	15,570,049.30	8.56%	14,500.37	9.04%	-
兴业证券	2	12,521,730.33	6.88%	11,661.82	7.27%	-
海通证券	3	10,215,877.06	5.61%	9,514.21	5.93%	-
申万宏源	4	9,188,625.02	5.05%	8,557.22	5.33%	-
中信证券	2	7,453,776.52	4.10%	6,941.95	4.33%	-
国泰君安	3	4,597,413.43	2.53%	4,282.10	2.67%	-
长江证券	2	1,928,791.21	1.06%	1,751.11	1.12%	-
中泰证券	2	1,027,606.28	0.56%	751.52	0.47%	-
华创证券	2	500,890.45	0.28%	466.50	0.29%	-
中金公司	2	417,169.37	0.23%	388.45	0.24%	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-

光大证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	3	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	3	-	-	-	-	-
东兴证券	3	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
大通证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	3	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
第一创业证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-

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法规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

本基金本报告期无租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况。

### 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	招商国证生物医药指数分级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	2018-01-09
3	招商国证生物医药指数分级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	2018-01-09
4	招商国证生物医药指数分级证券投资基金 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
5	关于招商基金旗下部分基金增加基煜为代销机	中国证券报、证券时	2018-02-12

	构并参与其费率优惠活动的公告	报、上海证券报	
6	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
7	招商基金旗下部分基金增加上海挖财为代销机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2018-03-08
8	关于招商国证生物医药指数分级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
9	招商国证生物医药指数分级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
10	招商国证生物医药指数分级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
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	招商国证生物医药指数分级证券投资基金 2017 年度报告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2018-03-30
13	招商国证生物医药指数分级证券投资基金 2017 年度报告摘要	中国证券报、证券时报、上海证券报	2018-03-30
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	招商基金管理有限公司关于旗下部分基金参与东海证券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	2018-04-02
16	招商国证生物医药指数分级证券投资基金 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
17	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
18	招商基金管理有限公司关于旗下部分证券投资基金变更基金份额净值小数点后保留位数及修改基金合同、托管协议的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2018-06-29
19	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

## § 11 备查文件目录

### 11.1 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国证生物医药指数分级证券投资基金设立的文件；
- 3、《招商国证生物医药指数分级证券投资基金基金合同》；
- 4、《招商国证生物医药指数分级证券投资基金托管协议》；

- 5、《招商国证生物医药指数分级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。

## 11.2 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

## 11.3 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.cmfcchina.com>

招商基金管理有限公司

2018 年 8 月 28 日