

招商深证 100 指数证券投资基金 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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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.....	4
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	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.....	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.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
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.....	12
4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	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.....	13
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.....	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	13
6.1 资产负债表.....	13
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.....	18
§7 投资组合报告.....	35
7.1 期末基金资产组合情况.....	35
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	36
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.....	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	41
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.....	42
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.....	42
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.....	42
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.....	42

7.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	42
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	42
7.12	投资组合报告附注	42
§8	基金份额持有人信息	43
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	43
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	44
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情况	44
§9	开放式基金份额变动	44
§10	重大事件揭示	44
10.1	基金份额持有人大会决议	45
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	45
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	45
10.4	基金投资策略的改变	45
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	45
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	45
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	45
10.8	其他重大事件	46
§11	备查文件目录	48
11.1	备查文件目录	48
11.2	存放地点	48
11.3	查阅方式	49

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	招商深证 100 指数证券投资基金	
基金简称	招商深证 100 指数	
基金主代码	217016	
交易代码	217016	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2010 年 6 月 22 日	
基金管理人	招商基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	55,938,039.30 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	招商深证 100 指数 A	招商深证 100 指数 C
下属分级基金的交易代码	217016	004408
报告期末下属分级基金的份 额总额	55,864,746.53 份	73,292.77 份

注：本基金从 2017 年 3 月 1 日起新增 C 类份额，C 类份额自 2017 年 8 月 18 日起存续。

2.2 基金产品说明

投资目标	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。本基金的风险控制目标是追求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	本基金原则上采取完全复制法构建股票指数组合，即按照深证 100 指数成份股及权重构建指数投资组合，并根据指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。
业绩比较基准	深证 100 指数收益率×95%+商业银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金属于股票型指数基金，在证券投资基金中属于较高风险、较高收益的品种，本基金主要采用指数复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

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	中国工商银行股份有限公司
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	95588

传真	0755-83196475	010-66105798
注册地址	深圳市福田区深南大道 7088 号	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址	中国深圳深南大道 7088 号招商银行大厦	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	518040	100140
法定代表人	李浩	易会满

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	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	深证 100 指数 A: 招商基金管理有限公司 深证 100 指数 C: 中国证券登记结算有限责任公司	中国深圳深南大道 7088 号招商银行大厦 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

1、招商深证 100 指数 A

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	1,500,823.18
本期利润	-10,396,532.26
加权平均基金份额本期利润	-0.1855
本期加权平均净值利润率	-13.29%
本期基金份额净值增长率	-13.10%
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	13,771,321.53
期末可供分配基金份额利润	0.2465
期末基金资产净值	69,636,068.06
期末基金份额净值	1.2470

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	24.70%

2、招商深证 100 指数 C

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	1,942.22
本期利润	-28,052.44
加权平均基金份额本期利润	-0.3325
本期加权平均净值利润率	-23.82%
本期基金份额净值增长率	-13.32%
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	17,794.61
期末可供分配基金份额利润	0.2428
期末基金资产净值	91,087.38
期末基金份额净值	1.2430
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	-2.36%

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、本基金从 2017 年 3 月 1 日起新增 C 类份额，C 类份额自 2017 年 8 月 18 日起存续。

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

招商深证 100 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
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

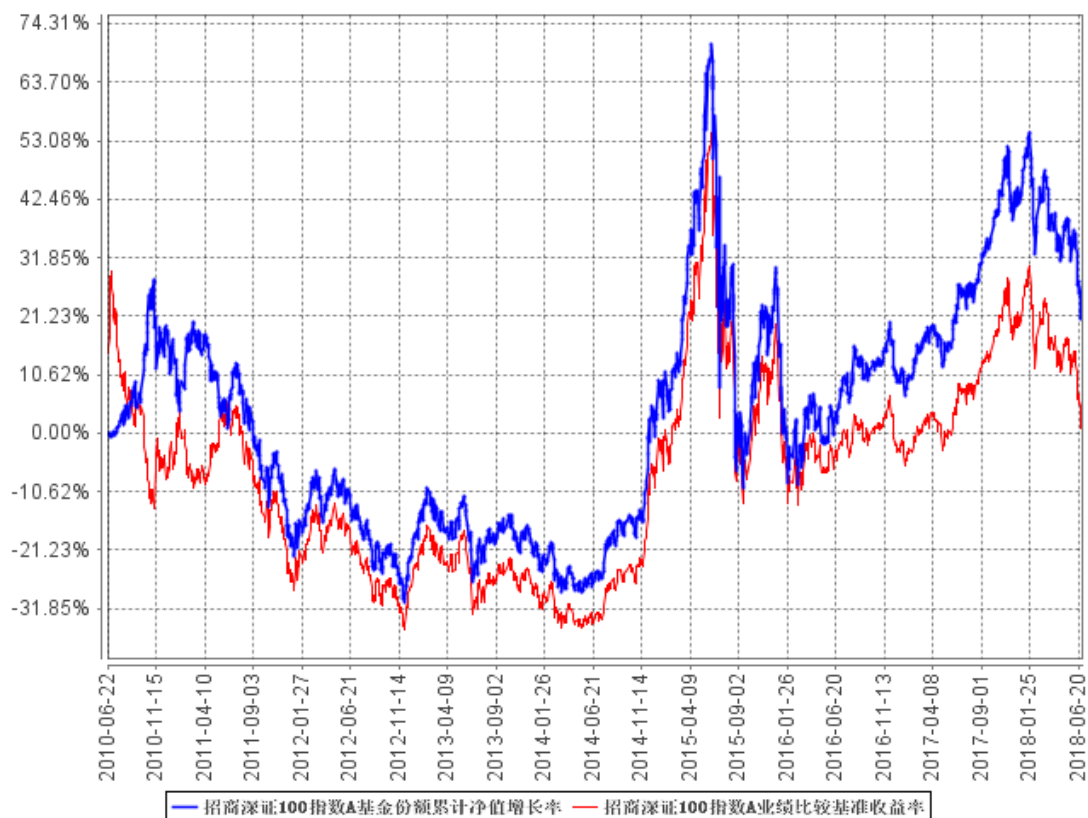
过去一个月	-7.36%	1.57%	-8.09%	1.57%	0.73%	0.00%
过去三个月	-10.67%	1.31%	-11.38%	1.31%	0.71%	0.00%
过去六个月	-13.10%	1.34%	-13.93%	1.34%	0.83%	0.00%
过去一年	-1.27%	1.15%	-4.08%	1.15%	2.81%	0.00%
过去三年	-12.61%	1.81%	-20.24%	1.63%	7.63%	0.18%
自基金合同 生效起至今	24.70%	1.57%	19.28%	1.52%	5.42%	0.05%

招商深证 100 指数 C

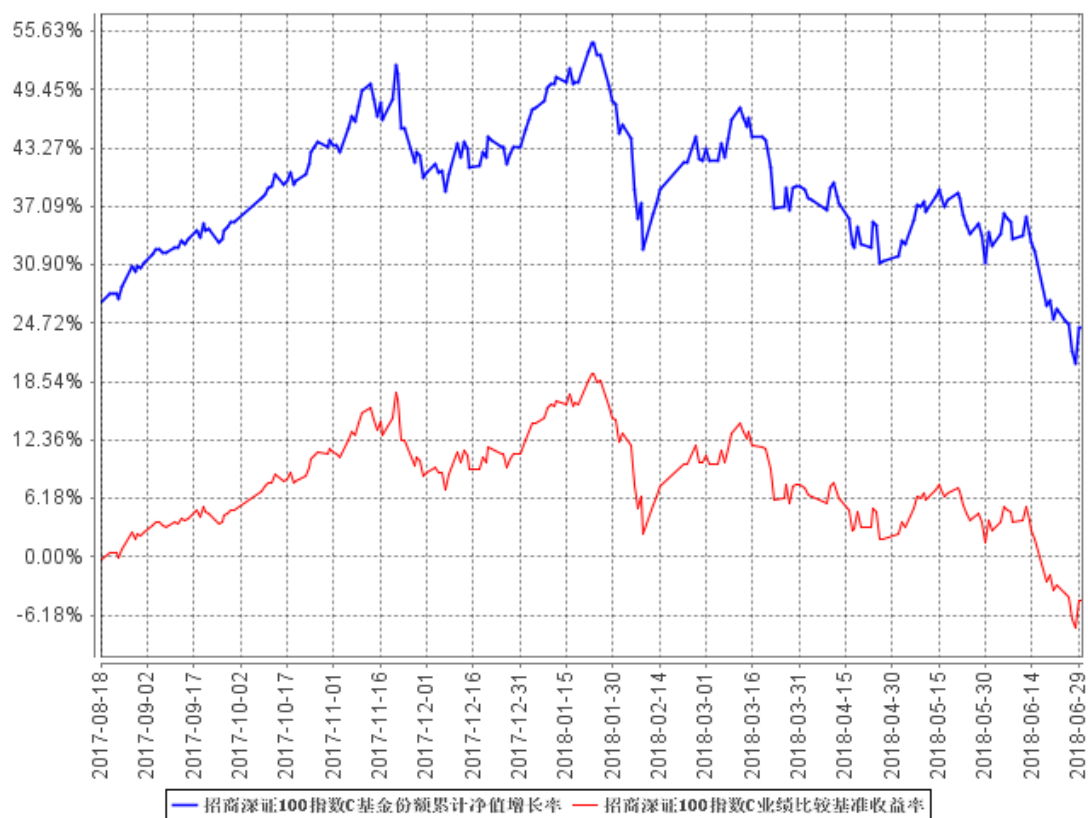
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	-7.45%	1.57%	-8.09%	1.57%	0.64%	0.00%
过去三个月	-10.77%	1.32%	-11.38%	1.31%	0.61%	0.01%
过去六个月	-13.32%	1.34%	-13.93%	1.34%	0.61%	0.00%
过去一年	-2.36%	1.19%	-4.59%	1.19%	2.23%	0.00%
自基金合同 生效起至今	-2.36%	1.19%	-4.59%	1.19%	2.23%	0.00%

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

招商深证100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



招商深证100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：1、本基金从 2017 年 3 月 1 日起新增 C 类份额，C 类份额自 2017 年 8 月 18 日起存续。

§ 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。本基金的基准指数深证 100 价格指数报告期内下跌 14.67%。

关于本基金的运作，股票仓位维持在 94% 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 A 类份额净值增长率为-13.10%，同期业绩基准增长率为-13.93%，C 类份额净值增长率为-13.32%，同期业绩基准增长率为-13.93%。

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究部门、风险管理部、基金核算部、法律合规部负责人和基金经理代表组成的估值委员会。公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历。公司估值委员会主要负责制定、修订和完善基金估值政策和程序，定期评价现有估值政策和程序的适用性及对估值程序执行情况进行监督。

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 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

2018 上半年，本基金托管人在对招商深证 100 指数证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

2018 上半年，招商深证 100 指数证券投资基金的管理人——招商基金管理有限公司在招商深证 100 指数证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，招商深证 100 指数证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对招商基金管理有限公司编制和披露的招商深证 100 指数证券投资基金 2018 年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、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：招商深证 100 指数证券投资基金

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	4,267,520.72	4,659,890.50
结算备付金		1,651.17	71,247.43
存出保证金		4,005.86	4,163.73
交易性金融资产	6.4.7.2	65,820,627.88	75,721,612.46
其中：股票投资		65,820,627.88	75,721,612.46
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		-	145,596.74
应收利息	6.4.7.5	782.76	979.29
应收股利		-	-
应收申购款		136,308.68	102,968.15
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		70,230,897.07	80,706,458.30
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		321,548.81	395,919.72
应付管理人报酬		42,107.79	47,942.23
应付托管费		9,023.08	10,273.32

应付销售服务费		31.51	20.71
应付交易费用	6.4.7.7	2,346.18	17,092.36
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	128,684.26	342,022.99
负债合计		503,741.63	813,271.33
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	55,938,039.30	55,656,124.50
未分配利润	6.4.7.10	13,789,116.14	24,237,062.47
所有者权益合计		69,727,155.44	79,893,186.97
负债和所有者权益总计		70,230,897.07	80,706,458.30

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，招商深证 100 指数 A 份额净值 1.2470 元，基金份额总额 55,864,746.53 份；招商深证 100 指数 C 份额净值 1.2430 元，基金份额总额 73,292.77 份；总份额合计 55,938,039.30 份。

6.2 利润表

会计主体：招商深证 100 指数证券投资基金

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		-9,914,843.92	9,227,578.54
1. 利息收入		16,933.20	16,094.11
其中：存款利息收入	6.4.7.11	16,933.20	16,094.11
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）		1,970,051.79	1,512,808.46
其中：股票投资收益	6.4.7.12	1,515,286.81	1,043,401.71
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
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	454,764.98	469,406.75
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-11,927,350.10	7,681,974.81
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	25,521.19	16,701.16
减：二、费用		509,740.78	405,726.71
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	271,671.33	209,110.99
2. 托管费	6.4.10.2.2	58,215.28	44,809.47
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	234.18	-
4. 交易费用	6.4.7.20	37,665.38	14,995.96
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	141,954.61	136,810.29
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-10,424,584.70	8,821,851.83
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-10,424,584.70	8,821,851.83

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：招商深证 100 指数证券投资基金

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)	55,656,124.50	24,237,062.47	79,893,186.97
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	-10,424,584.70	-10,424,584.70
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)	281,914.80	-23,361.63	258,553.17
其中：1. 基金申购款	17,545,749.54	7,194,315.98	24,740,065.52
2. 基金赎回款	-17,263,834.74	-7,217,677.61	-24,481,512.35
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)	55,938,039.30	13,789,116.14	69,727,155.44
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)	49,071,211.23	4,622,496.50	53,693,707.73
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	8,821,851.83	8,821,851.83
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)	4,556,393.40	680,143.23	5,236,536.63

—”号填列)			
其中：1. 基金申购款	19,825,258.20	3,293,782.47	23,119,040.67
2. 基金赎回款	-15,268,864.80	-2,613,639.24	-17,882,504.04
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）	53,627,604.63	14,124,491.56	67,752,096.19

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

招商深证 100 指数证券投资基金(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》、《招商深证 100 指数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[2010]513 号文批准公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限为不定期，首次设立募集基金份额为 661,815,306.06 份，经德勤华永会计师事务所有限公司验证，并出具了编号为德师报(验)字(10)第 0034 号验资报告。《招商深证 100 指数证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)于 2010 年 6 月 22 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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称“中国工商银行”)。

根据《关于招商深证 100 指数证券投资基金增加 C 类份额并修改基金合同和托管协议的公告》，本基金自 2017 年 3 月 1 日起增设 C 类基金份额，即不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 C 类基金份额。原有的基金份额在增加收取销售服务费的 C 类份额后，全部自动转换为招商深证 100 指数证券投资基金 A 类份额。本基金的基金合同和托管协议于公告当日作相应修改。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、最新适用的基金合同及《招商深证 100 指数证券投资基金更新的招募说明书》的有关规定，本基金投资于具有良好流动性的金融

工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的投资组合为：股票等权益类资产的投资比例为基金资产的 85%-95%，其中投资于标的指数成份股、备选成份股的资产占基金资产的比例不低于 80%；现金、债券等固定收益类资产的投资比例为基金资产的 5%-15%，其中现金及到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：深证 100 指数收益率×95%+商业银行活期存款利率(税后)×5%。

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 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

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]48 号《关于实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红

利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

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

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

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	4,267,520.72
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	4,267,520.72

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		61,998,988.40	65,820,627.88	3,821,639.48
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		61,998,988.40	65,820,627.88	3,821,639.48

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	780.51
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	0.63
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	1.62
合计	782.76

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	2,346.18
银行间市场应付交易费用	-
合计	2,346.18

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	955.26
预提费用	123,972.33
应付指数使用费	3,756.67
合计	128,684.26

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

招商深证 100 指数 A		
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	55,628,060.89	55,628,060.89
本期申购	17,318,775.76	17,318,775.76
本期赎回 (以“-”号填列)	-17,082,090.12	-17,082,090.12
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	55,864,746.53	55,864,746.53

金额单位：人民币元

招商深证 100 指数 C		
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	28,063.61	28,063.61
本期申购	226,973.78	226,973.78
本期赎回 (以“-”号填列)	-181,744.62	-181,744.62
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	73,292.77	73,292.77

注：本期申购含红利再投、转换入份（金）额，本期赎回含转换出份（金）额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

招商深证 100 指数 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	27,740,689.79	-3,515,812.27	24,224,877.52
本期利润	1,500,823.18	-11,897,355.44	-10,396,532.26
本期基金份额交易产生的变动数	113,420.71	-170,444.44	-57,023.73
其中：基金申购款	8,822,725.48	-1,733,883.29	7,088,842.19

基金赎回款	-8,709,304.77	1,563,438.85	-7,145,865.92
本期已分配利润	-	-	-
本期末	29,354,933.68	-15,583,612.15	13,771,321.53

单位：人民币元

招商深证 100 指数 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	8,873.77	3,311.18	12,184.95
本期利润	1,942.22	-29,994.66	-28,052.44
本期基金份额交易产生的变动数	14,105.42	19,556.68	33,662.10
其中：基金申购款	73,472.42	32,001.37	105,473.79
基金赎回款	-59,367.00	-12,444.69	-71,811.69
本期已分配利润	-	-	-
本期末	24,921.41	-7,126.80	17,794.61

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	16,645.05
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	173.21
其他	114.94
合计	16,933.20

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	1,515,286.81
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	1,515,286.81

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	12,421,791.91
减：卖出股票成本总额	10,906,505.10
买卖股票差价收入	1,515,286.81

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	454,764.98
基金投资产生的股利收益	-
合计	454,764.98

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	-11,927,350.10
——股票投资	-11,927,350.10
——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	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-11,927,350.10

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	22,082.62
转换转出收入	3,438.57
合计	25,521.19

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	37,665.38
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-

合计	37,665.38
----	-----------

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	24,795.19
信息披露费	99,177.14
银行费用	1,220.21
其他	16,762.07
合计	141,954.61

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
中国工商银行股份有限公司	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	14,235,804.35	57.54%	272,255.84	2.59%

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	13,258.63	57.55%	1,115.00	47.52%
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	253.56	2.59%	18.99	4.00%

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 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管理费	271,671.33	209,110.99
其中：支付销售机构的客户维护费	92,469.55	73,874.63

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×0.70%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×0.70%÷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	58,215.28	44,809.47

注：支付基金托管人中国工商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：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% \div \text{当年天数}。$$

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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	招商深证 100 指数 A	招商深证 100 指数 C	合计
招商基金管理有限公司	-	204.09	204.09
工商银行	-	-	-
合计	-	204.09	204.09

注：根据基金合同的规定，招商深证 100 指数 A 不收取销售服务费，招商深证 100 指数 C 的销售服务费按基金前一日的资产净值×0.40%的年费率来计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{招商深证 100 指数 C 的日销售服务费} = \text{前一日招商深证 100 指数 C 资产净值} \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

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

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

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
中国工商银行	4,267,520.72	16,645.05	6,315,515.04	15,781.91

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商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

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

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
002450	康得新	2018 年 6 月 4 日	重大事项	17.08	尚未复牌	-	45,480	551,593.70	776,798.40	-
002252	上海莱士	2018 年 2 月 23 日	重大事项	21.48	尚未复牌	-	29,081	605,017.12	624,659.88	-
002739	万达电影	2017 年 7 月 4 日	重大事项	52.04	尚未复牌	-	8,614	647,136.98	448,272.56	-
300072	三聚环保	2018 年 6 月 19 日	重大事项	23.28	2018 年 7 月 10 日	24.00	18,656	603,136.39	434,311.68	-
002310	东方园林	2018 年 5 月 25 日	重大事项	13.08	尚未复牌	-	29,597	478,117.22	387,128.76	-
000540	中天金融	2017 年 9 月 21 日	重大事项	4.18	尚未复牌	-	84,000	466,507.18	351,120.00	-
000415	渤海金控	2018 年 1 月 17 日	重大事项	5.84	2018 年 7 月 17 日	5.26	38,000	250,465.39	221,920.00	-

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；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。附注 6.4.13.2.1 及 6.4.13.2.2 列示了于本报告期末本基金所持有的债券投资的信用评级，该信用评级不包括本基金所持有的国债、央行票据、政策金融债。

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

流动性风险是指没有足够资金以满足到期债务支付的风险。本基金流动性风险来源于开放式基金每日兑付赎回资金的流动性风险，以及因部分投资品种交易不活跃而出现的变现风险以及因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理价格变现投资的风险。本基金所持有的交易性金融资产分别在证券交易所和银行间同业市场交易，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定价日组合等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018 年 6	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
-----------------	--------	--------	----------	----------	---------------	-----	----

月 30 日					上		
资产							
银行存款	4,267,520.72	-	-	-	-	-	4,267,520.72
结算备付金	1,651.17	-	-	-	-	-	1,651.17
存出保证金	4,005.86	-	-	-	-	-	4,005.86
交易性金融资产	-	-	-	-	-	65,820,627.88	65,820,627.88
应收利息	-	-	-	-	-	782.76	782.76
应收申购款	11,567.53	-	-	-	-	124,741.15	136,308.68
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	4,284,745.28	-	-	-	-	65,946,151.79	70,230,897.07
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	321,548.81	321,548.81
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	42,107.79	42,107.79
应付托管费	-	-	-	-	-	9,023.08	9,023.08
应付销售服务费	-	-	-	-	-	31.51	31.51
应付交易费用	-	-	-	-	-	2,346.18	2,346.18
其他负债	-	-	-	-	-	128,684.26	128,684.26
负债总计	-	-	-	-	-	503,741.63	503,741.63
利率敏感度缺口	4,284,745.28	-	-	-	-	65,442,410.16	69,727,155.44
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	4,659,890.50	-	-	-	-	-	4,659,890.50
结算备付金	71,247.43	-	-	-	-	-	71,247.43
存出保证金	4,163.73	-	-	-	-	-	4,163.73
交易性金融资产	-	-	-	-	-	75,721,612.46	75,721,612.46
应收证券清算款	-	-	-	-	-	145,596.74	145,596.74

应收利息	-	-	-	-	-	979.29	979.29
应收申购款	-	-	-	-	-	102,968.15	102,968.15
资产总计	4,735,301.66	-	-	-	-	75,971,156.64	80,706,458.30
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	395,919.72	395,919.72
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	47,942.23	47,942.23
应付托管费	-	-	-	-	-	10,273.32	10,273.32
应付销售服务费	-	-	-	-	-	20.71	20.71
应付交易费用	-	-	-	-	-	17,092.36	17,092.36
其他负债	-	-	-	-	-	342,022.99	342,022.99
负债总计	-	-	-	-	-	813,271.33	813,271.33
利率敏感度缺口	4,735,301.66	-	-	-	-	75,157,885.31	79,893,186.97

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。本基金所持有的金融资产以公允价值计量，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	65,820,627.88	94.40	75,721,612.46	94.78
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	65,820,627.88	94.40	75,721,612.46	94.78

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%	3,291,031.39	3,786,080.62
	2. 权益性投资的市场价格下降 5%	-3,291,031.39	-3,786,080.62

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	65,820,627.88	93.72
	其中:股票	65,820,627.88	93.72
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	4,269,171.89	6.08
7	其他资产	141,097.30	0.20

8	合计	70,230,897.07	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	1,729,362.72	2.48
B	采矿业	251,600.02	0.36
C	制造业	43,509,763.79	62.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	931,488.68	1.34
F	批发和零售业	1,707,382.53	2.45
G	交通运输、仓储和邮政业	171,000.00	0.25
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,245,743.01	6.09
J	金融业	6,274,591.33	9.00
K	房地产业	4,202,504.86	6.03
L	租赁和商务服务业	1,285,568.08	1.84
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	719,697.73	1.03
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	448,272.56	0.64
S	综合	199,131.10	0.29
	合计	65,676,106.41	94.19

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	83,549.82	0.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	339.00	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服	2,106.00	0.00

	务业		
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	58,526.65	0.08
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	144,521.47	0.20

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	000333	美的集团	95,510	4,987,532.20	7.15
2	000651	格力电器	100,838	4,754,511.70	6.82
3	000858	五粮液	38,826	2,950,776.00	4.23
4	000002	万科 A	106,443	2,618,497.80	3.76
5	002415	海康威视	69,900	2,595,387.00	3.72
6	000725	京东方 A	533,299	1,887,878.46	2.71
7	300498	温氏股份	78,536	1,729,362.72	2.48
8	000001	平安银行	177,490	1,613,384.10	2.31
9	002304	洋河股份	11,746	1,545,773.60	2.22
10	002027	分众传媒	111,144	1,063,648.08	1.53
11	002230	科大讯飞	32,464	1,041,120.48	1.49
12	002024	苏宁易购	72,941	1,027,009.28	1.47
13	000538	云南白药	9,394	1,004,782.24	1.44
14	002008	大族激光	18,709	995,131.71	1.43
15	300059	东方财富	75,303	992,493.54	1.42
16	000568	泸州老窖	15,204	925,315.44	1.33
17	000338	潍柴动力	100,752	881,580.00	1.26
18	002475	立讯精密	38,112	859,044.48	1.23
19	000776	广发证券	63,846	847,236.42	1.22

20	002594	比亚迪	17,759	846,749.12	1.21
21	002236	大华股份	34,554	779,192.70	1.12
22	002450	康得新	45,480	776,798.40	1.11
23	002142	宁波银行	47,580	775,078.20	1.11
24	002466	天齐锂业	15,430	765,173.70	1.10
25	300124	汇川技术	22,165	727,455.30	1.04
26	300003	乐普医疗	19,355	709,941.40	1.02
27	002456	欧菲科技	42,368	683,395.84	0.98
28	000963	华东医药	14,101	680,373.25	0.98
29	000063	中兴通讯	49,934	650,640.02	0.93
30	002252	上海莱士	29,081	624,659.88	0.90
31	002460	赣锋锂业	15,903	613,537.74	0.88
32	000166	申万宏源	139,940	611,537.80	0.88
33	000423	东阿阿胶	10,943	588,842.83	0.84
34	002202	金风科技	45,334	573,021.76	0.82
35	300408	三环集团	23,103	542,920.50	0.78
36	000895	双汇发展	20,542	542,514.22	0.78
37	000100	TCL 集团	186,869	541,920.10	0.78
38	000413	东旭光电	84,900	514,494.00	0.74
39	300136	信维通信	16,700	513,191.00	0.74
40	000069	华侨城 A	69,896	505,348.08	0.72
41	000503	国新健康	15,117	480,418.26	0.69
42	000783	长江证券	87,357	474,348.51	0.68
43	300024	机器人	26,301	457,637.40	0.66
44	300070	碧水源	32,293	449,841.49	0.65
45	002739	万达电影	8,614	448,272.56	0.64
46	000768	中航飞机	28,150	440,266.00	0.63
47	300072	三聚环保	18,656	434,311.68	0.62
48	002241	歌尔股份	40,697	414,702.43	0.59
49	000157	中联重科	99,339	408,283.29	0.59
50	000625	长安汽车	45,123	406,107.00	0.58
51	002572	索菲亚	12,500	402,250.00	0.58
52	000425	徐工机械	93,600	396,864.00	0.57
53	002310	东方园林	29,597	387,128.76	0.56
54	002340	格林美	61,150	369,957.50	0.53
55	002007	华兰生物	11,502	369,904.32	0.53
56	002405	四维图新	18,181	368,165.25	0.53
57	300017	网宿科技	33,253	356,139.63	0.51
58	000540	中天金融	84,000	351,120.00	0.50
59	002736	国信证券	38,500	350,350.00	0.50
60	000786	北新建材	18,200	337,246.00	0.48
61	000623	吉林敖东	18,505	332,719.90	0.48
62	002065	东华软件	37,902	325,957.20	0.47

63	002271	东方雨虹	19,140	325,571.40	0.47
64	002146	荣盛发展	36,903	322,163.19	0.46
65	000728	国元证券	43,003	318,222.20	0.46
66	000792	盐湖股份	29,300	317,026.00	0.45
67	002508	老板电器	10,000	306,200.00	0.44
68	002673	西部证券	40,535	306,039.25	0.44
69	002797	第一创业	44,702	302,632.54	0.43
70	000630	铜陵有色	134,865	298,051.65	0.43
71	002129	中环股份	38,000	297,540.00	0.43
72	002081	金螳螂	29,343	296,364.30	0.43
73	002092	中泰化学	30,501	294,029.64	0.42
74	000876	新希望	44,115	279,689.10	0.40
75	000709	河钢股份	93,660	276,297.00	0.40
76	000050	深天马 A	19,300	274,446.00	0.39
77	002465	海格通信	33,700	270,611.00	0.39
78	000826	启迪桑德	15,438	269,856.24	0.39
79	000839	中信国安	56,925	269,255.25	0.39
80	000983	西山煤电	33,502	251,600.02	0.36
81	000961	中南建设	39,302	247,995.62	0.36
82	000060	中金岭南	50,359	244,744.74	0.35
83	002500	山西证券	34,593	233,156.82	0.33
84	000415	渤海金控	38,000	221,920.00	0.32
85	300315	掌趣科技	52,530	219,575.40	0.31
86	300433	蓝思科技	10,200	213,996.00	0.31
87	000402	金融街	26,455	212,962.75	0.31
88	000750	国海证券	59,266	211,579.62	0.30
89	002074	国轩高科	14,600	205,276.00	0.29
90	000686	东北证券	31,307	200,677.87	0.29
91	000009	中国宝安	40,639	199,131.10	0.29
92	000778	新兴铸管	46,500	199,020.00	0.29
93	000938	紫光股份	3,100	194,060.00	0.28
94	000559	万向钱潮	28,523	193,956.40	0.28
95	002558	巨人网络	8,100	192,618.00	0.28
96	000046	泛海控股	33,816	192,413.04	0.28
97	002352	顺丰控股	3,800	171,000.00	0.25
98	002407	多氟多	11,900	166,838.00	0.24
99	000617	中油资本	2,700	30,348.00	0.04

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	977	78,511.72	0.11
2	002183	怡亚通	8,801	58,526.65	0.08
3	300504	天邑股份	86	3,390.98	0.00
4	002929	润建通信	52	2,106.00	0.00
5	002927	泰永长征	40	1,530.00	0.00
6	002928	华夏航空	12	339.00	0.00
7	300727	润禾材料	4	117.12	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	000002	万科 A	984,266.00	1.23
2	002074	国轩高科	692,076.00	0.87
3	002027	分众传媒	546,521.00	0.68
4	000333	美的集团	511,448.98	0.64
5	002508	老板电器	500,478.00	0.63
6	000651	格力电器	498,961.31	0.62
7	002572	索菲亚	491,007.00	0.61
8	002271	东方雨虹	484,549.00	0.61
9	300003	乐普医疗	473,741.70	0.59
10	000786	北新建材	469,505.00	0.59
11	002146	荣盛发展	407,873.00	0.51
12	000050	深天马 A	388,780.00	0.49
13	002594	比亚迪	358,502.00	0.45
14	300433	蓝思科技	318,020.00	0.40
15	000725	京东方 A	297,145.00	0.37
16	000778	新兴铸管	268,867.00	0.34
17	000413	东旭光电	258,394.00	0.32
18	002415	海康威视	244,894.00	0.31
19	002475	立讯精密	237,934.00	0.30
20	000858	五粮液	230,378.00	0.29

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	000651	格力电器	597,659.00	0.75
2	000333	美的集团	515,728.00	0.65
3	000793	华闻传媒	410,575.80	0.51
4	000725	京东方 A	387,979.00	0.49
5	000858	五粮液	385,896.22	0.48
6	000002	万科 A	375,611.00	0.47
7	300027	华谊兄弟	325,297.72	0.41
8	002074	国轩高科	317,371.00	0.40
9	002385	大北农	299,394.02	0.37
10	000001	平安银行	284,924.00	0.36
11	300498	温氏股份	263,562.00	0.33
12	002415	海康威视	238,874.00	0.30
13	000917	电广传媒	229,881.35	0.29
14	000063	中兴通讯	221,145.00	0.28
15	300168	万达信息	218,829.40	0.27
16	300104	乐视网	205,620.52	0.26
17	002709	天赐材料	183,617.00	0.23
18	002292	奥飞娱乐	182,320.60	0.23
19	002304	洋河股份	180,081.00	0.23
20	002183	怡亚通	167,352.00	0.21

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	12,932,870.62
卖出股票收入（成交）总额	12,421,791.91

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

根据本基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

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	4,005.86
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	782.76
5	应收申购款	136,308.68
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	141,097.30

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

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

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

§ 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
招商深证 100 指数 A	5,068	11,023.04	-	-	55,864,746.53	100.00%
招商深证 100 指数 C	30	2,443.09	-	-	73,292.77	100.00%

合计	5,098	10,972.55	-	-	55,938,039.30	100.00%
----	-------	-----------	---	---	---------------	---------

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	招商深证 100 指数 A	2,531.66	0.0045%
	招商深证 100 指数 C	3,842.83	5.2431%
	合计	6,374.49	0.0114%

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）。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	招商深证 100 指数 A	0~10
	招商深证 100 指数 C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	招商深证 100 指数 A	0
	招商深证 100 指数 C	0~10
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	招商深证 100 指数 A	招商深证 100 指数 C
基金合同生效日(2010 年 6 月 22 日)基金份额总额	661,815,306.06	-
本报告期期初基金份额总额	55,628,060.89	28,063.61
本报告期基金总申购份额	17,318,775.76	226,973.78
减：报告期基金总赎回份额	17,082,090.12	181,744.62
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	55,864,746.53	73,292.77

§ 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	2	14,235,804.35	57.54%	13,258.63	57.55%	-
中信建投	3	3,524,416.88	14.25%	3,282.20	14.25%	-
国海证券	1	3,405,172.37	13.76%	3,171.26	13.76%	-
东北证券	2	1,930,783.46	7.80%	1,798.21	7.80%	-
中泰证券	1	495,531.00	2.00%	461.54	2.00%	-
广发证券	3	461,724.09	1.87%	430.01	1.87%	-
光大证券	1	280,615.48	1.13%	261.31	1.13%	-
华泰证券	2	229,115.17	0.93%	213.38	0.93%	-

安信证券	2	175,629.10	0.71%	163.56	0.71%	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	2	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	2	-	-	-	-	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
九州证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	3	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
申万宏源	3	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
财富证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
中邮证券	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	证券时报、上海证券报	2018-01-02
2	招商基金管理有限公司旗下部分基金增加上宜信普泽投资顾问（北京）有限公司	证券时报、上海证券报	2018-01-08
3	招商深证 100 指数证券投资基金 2017 年第 4 季度报告	证券时报、上海证券报	2018-01-19
4	招商基金旗下部分基金增加万家财富为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告	证券时报、上海证券报	2018-01-24
5	关于招商基金旗下部分基金增加有鱼基金为代销机构并参与其费率优惠活动的公告	证券时报、上海证券报	2018-02-01
6	招商深证 100 指数证券投资基金更新的招募说明书（二零一八年第一号）	证券时报、上海证券报	2018-02-03
7	招商深证 100 指数证券投资基金更新的招募说明书摘要（二零一八年第一号）	证券时报、上海证券报	2018-02-03
8	招商基金旗下部分基金增加同花顺为代销机构及开通定投和转换业务的公告	证券时报、上海证券报	2018-02-12
9	招商基金旗下部分基金增加上海长量为代销机构及开通定投和转换业务的公告	证券时报、上海证券报	2018-02-12
10	招商基金旗下部分基金增加蛋卷基金为代销机构及开通定投和转换业务的公告	证券时报、上海证券报	2018-02-12
11	招商基金管理有限公司关于旗下部分产品增加南京银行为代销机构的公告	证券时报、上海证券报	2018-03-01
12	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	证券时报、上海证券报	2018-03-08
13	招商深证 100 指数证券投资基金托管协议（2018 年 3 月 22 日修订）	证券时报、上海证券报	2018-03-22
14	招商深证 100 指数证券投资基金基金合同（2018 年 3 月 22 日修订）	证券时报、上海证券报	2018-03-22
15	关于招商深证 100 指数证券投资基金修订基金合同的公告	证券时报、上海证券报	2018-03-22
16	关于招商基金旗下部分基金继续参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	证券时报、上海证券报	2018-03-28
17	招商基金管理有限公司关于旗下基金估值变更的公告	证券时报、上海证券报	2018-03-29
18	招商深证 100 指数证券投资基金 2017 年度报告摘要	证券时报、上海证券报	2018-03-30
19	招商深证 100 指数证券投资基金 2017 年度报告	证券时报、上海证券报	2018-03-30
20	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	证券时报、上海证券报	2018-03-31

	申购及定期定额投资手续费率优惠的公告		
21	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	证券时报、上海证券报	2018-04-02
22	招商基金旗下部分基金增加蚂蚁基金为代销机构的公告	证券时报、上海证券报	2018-04-11
23	招商基金旗下部分基金增加植信基金为代销机构及参与其费率优惠活动的公告	证券时报、上海证券报	2018-04-11
24	招商基金管理有限公司关于旗下基金估值变更的公告	证券时报、上海证券报	2018-04-19
25	招商深证 100 指数证券投资基金 2018 年第 1 季度报告	证券时报、上海证券报	2018-04-23
26	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	证券时报、上海证券报	2018-05-29
27	招商基金旗下部分基金增加腾安基金为代销机构并参与其费率优惠活动的公告	证券时报、上海证券报	2018-05-30
28	招商基金管理有限公司关于旗下基金估值变更的公告	证券时报、上海证券报	2018-05-31
29	招商基金管理有限公司关于旗下基金估值变更的公告	证券时报、上海证券报	2018-06-09
30	招商基金管理有限公司关于旗下基金估值变更的公告	证券时报、上海证券报	2018-06-21
31	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	证券时报、上海证券报	2018-06-29
32	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	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深证 100 指数证券投资基金设立的文件；
- 3、《招商深证 100 指数证券投资基金基金合同》；
- 4、《招商深证 100 指数证券投资基金托管协议》；
- 5、《招商深证 100 指数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