招商月月盈沪深300指数增强发起式混合型证券投资基金2019年第2季度报告

2019-06-30

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

报告送出日期：2019-07-18

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。

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，但不保证投资一定盈利，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。

基金管理人保证基金托管人按照本报告所载内容和格式披露本基金的相关信息。

本报告财务指标金额以人民币披露。

本报告期自2019年04月01日起至2019年06月30日止。

基金基本情况

项目	内容
基金简称	招商月月盈沪深300指数增强发起式混合
场内简称	-
基金主代码	005410
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018-07-04
报告期末基金份额总额	21,701,486.98份
投资目标	本基金主要投资于中国大陆证券市场发行或交易的股票及证券监管机构允许投资的其它品种(包括但不限于：存托凭证)，在严格控制风险的前提下，力争超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	1、资产配置策略 本基金将根据宏观经济环境、证券市场估值水平、市场流动性、利率水平、汇率水平、市场情绪等因素的变化，对股票、债券、现金等资产的配置比例进行调整。 2、股票投资策略 (1)、指数成分股的选择 本基金将以沪深300指数成分股作为股票投资的主要对象，通过考察、分析上市公司的盈利能力、公司治理、成长性、估值水平、流动性、风险等因素，对指数成分股进行综合评估，选择具有较好投资价值的上市公司作为本基金的投资对象。通过对指数成分股的选择，本基金将力争获得与沪深300指数相近的风险收益特征。 (2)、指数成分股的权重调整 本基金将以沪深300指数成分股的权重为基准，根据对成分股的预期收益、风险、流动性、交易成本等因素的综合考虑，适当调整成分股的权重，以期在控制风险的前提下，获取超额收益。 (3)、股票投资组合的日常管理 本基金将根据基金合同的约定或基金管理人内部决策程序的规定，根据证券市场的变化情况，及时调整投资组合，以期在控制风险的前提下，获取超额收益。 (4)、股票投资组合的风险控制 本基金将采用多种手段进行风险控制，主要包括：分散投资、组合优化、止盈止损、设置投资比例限制、设置风险预警线、压力测试、设置止损线、设置投资比例限制、设置风险预警线、压力测试、设置止损线、设置止损线、设置止损线