招商中证1000指数增强型证券投资基金2018年度报告摘要

2018年12月31日

基金管理人：招商基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2019年3月28日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年3月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告财务资料已经审计，德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了2018年度无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自2018年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

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	47,512,405.09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	16,069,812.71份	31,442,592.38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	潘西里	王永民
	联系电话	0755－83196666	010-66594896
	电子邮箱	cmf@cmfchina.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-887-9555	95566
传真		0755－83196475	010－66594942

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.cmfchina.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

1、招商中证1000指数A

单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018年	2017年3月3日(基金合同生效日)-2017年12月31日
本期已实现收益	-7,157,025.40	-8,148,518.60
本期利润	-4,034,304.14	-11,889,528.37
加权平均基金份额本期利润	-0.0763	-0.0773
本期基金份额净值增长率	-29.25%	-7.96%
3.1.2 期末数据和指标	2018年末	2017年末
期末可供分配基金份额利润	-0.3515	-0.0796
期末基金资产净值	10,464,066.26	143,276,525.87
期末基金份额净值	0.6512	0.9204

2、招商中证1000指数C

单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018年	2017年3月3日(基金合同生效日)-2017年12月31日
本期已实现收益	-7,538,143.76	-192,705.51
本期利润	-6,634,660.33	-803,804.81
加权平均基金份额本期利润	-0.2859	-0.1904
本期基金份额净值增长率	-29.54%	-7.23%
3.1.2 期末数据和指标	2018年末	2017年末

期末可供分配基金份额利润	-0.3493	-0.0723
期末基金资产净值	20,554,294.51	11,424,627.57
期末基金份额净值	0.6537	0.9277

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

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

3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

招商中证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
过去三个月	-10.28%	1.75%	-10.59%	1.80%	0.31%	-0.05%
过去六个月	-18.41%	1.53%	-20.00%	1.54%	1.59%	-0.01%
过去一年	-29.25%	1.47%	-35.29%	1.48%	6.04%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-34.88%	1.26%	-45.86%	1.27%	10.98%	-0.01%

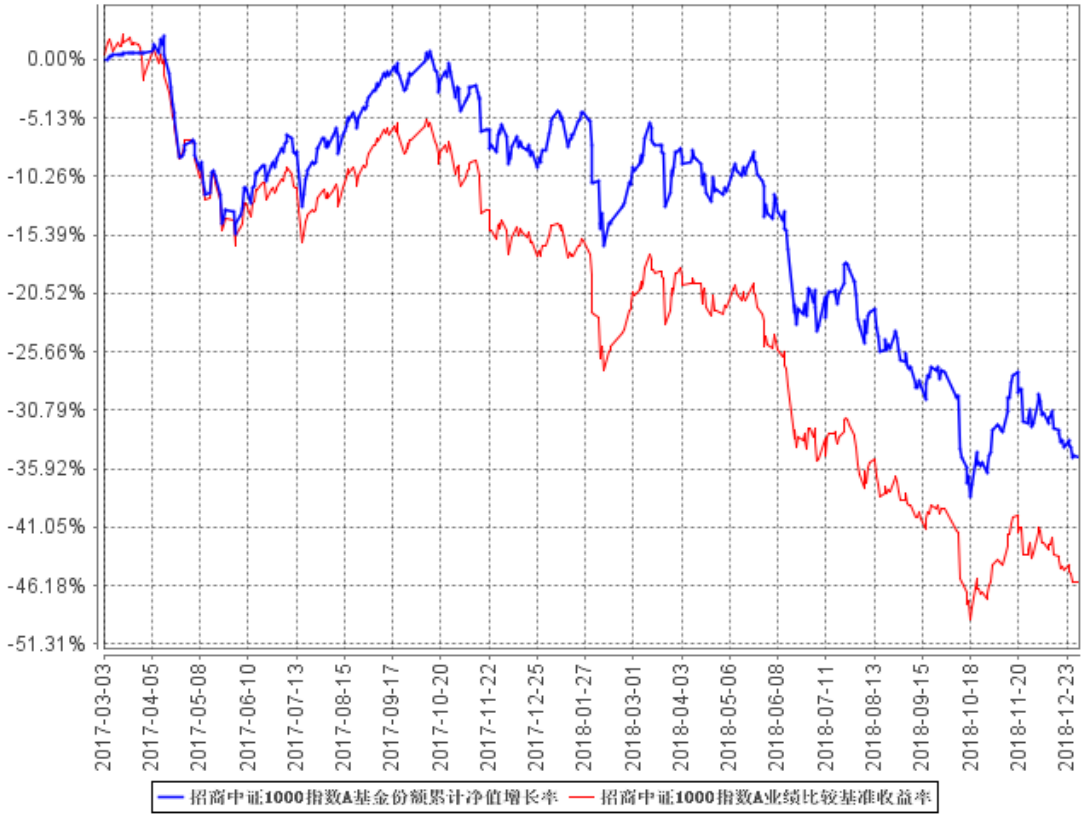
招商中证1000指数C

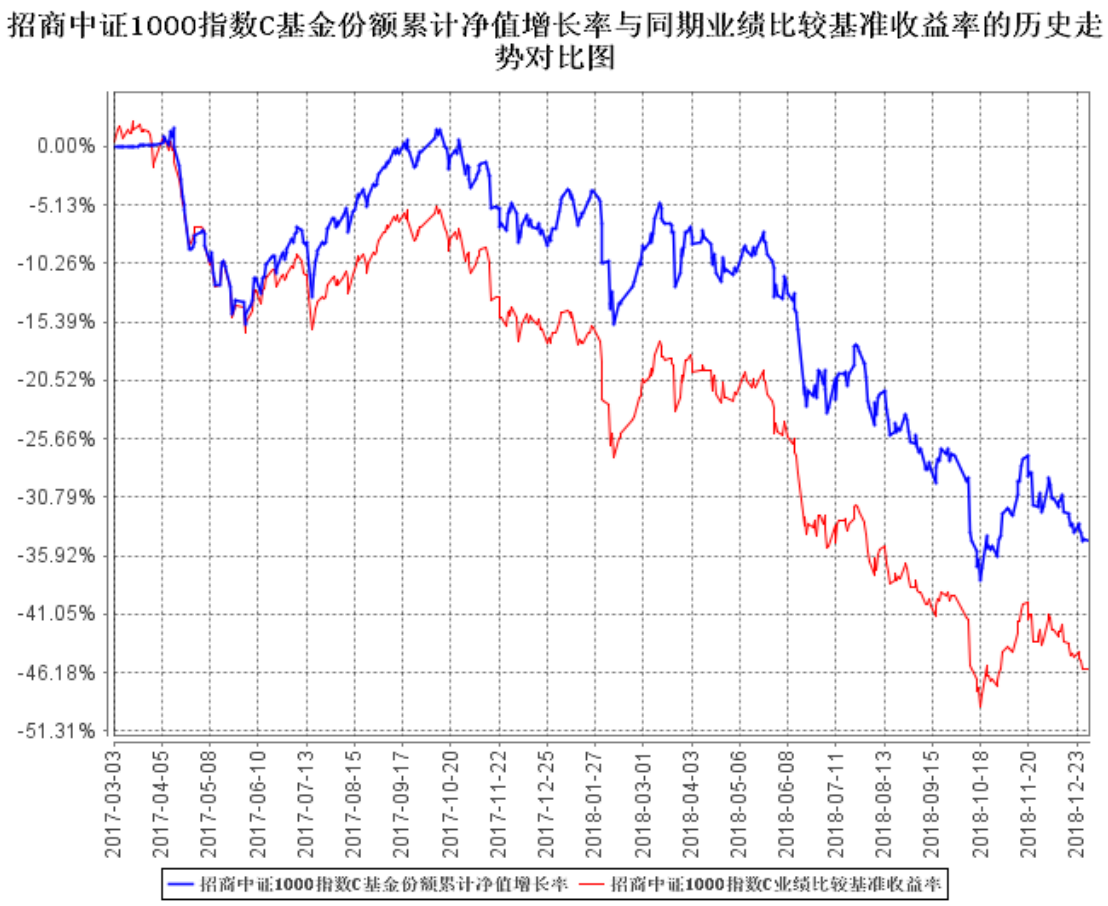
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-10.38%	1.75%	-10.59%	1.80%	0.21%	-0.05%
过去六个月	-18.57%	1.53%	-20.00%	1.54%	1.43%	-0.01%
过去一年	-29.54%	1.47%	-35.29%	1.48%	5.75%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-34.63%	1.26%	-45.86%	1.27%	11.23%	-0.01%

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

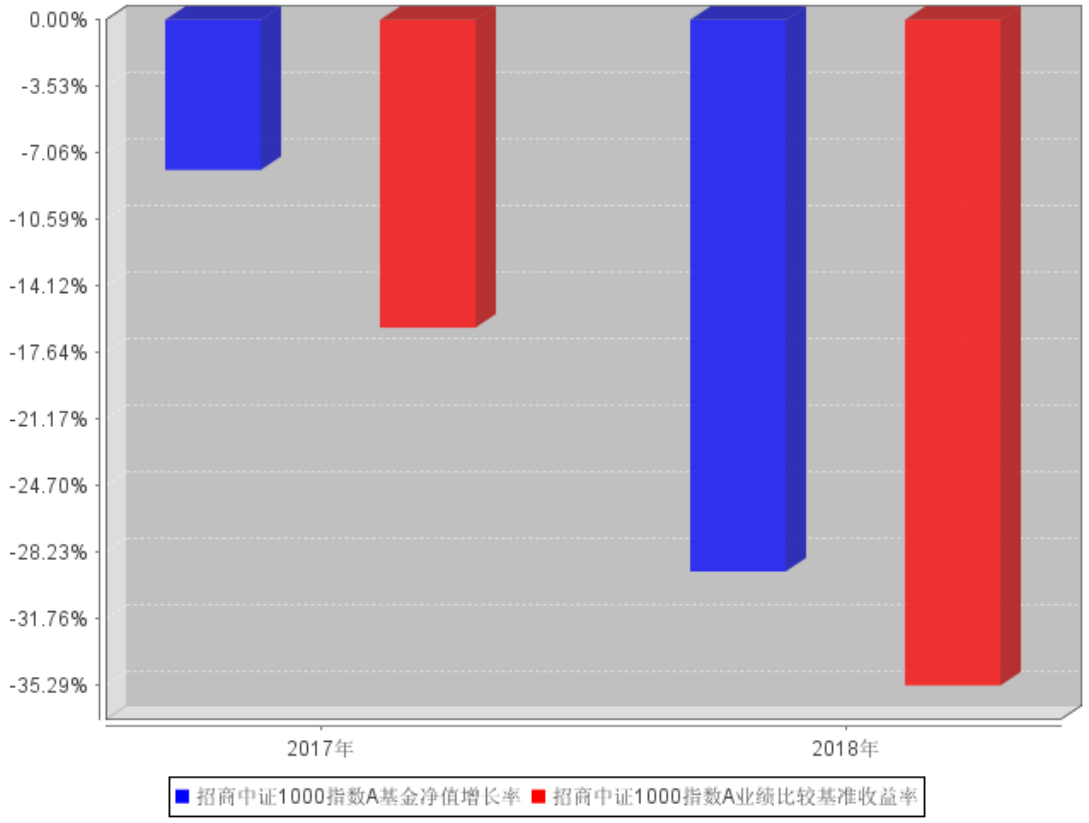
招商中证1000指数A基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



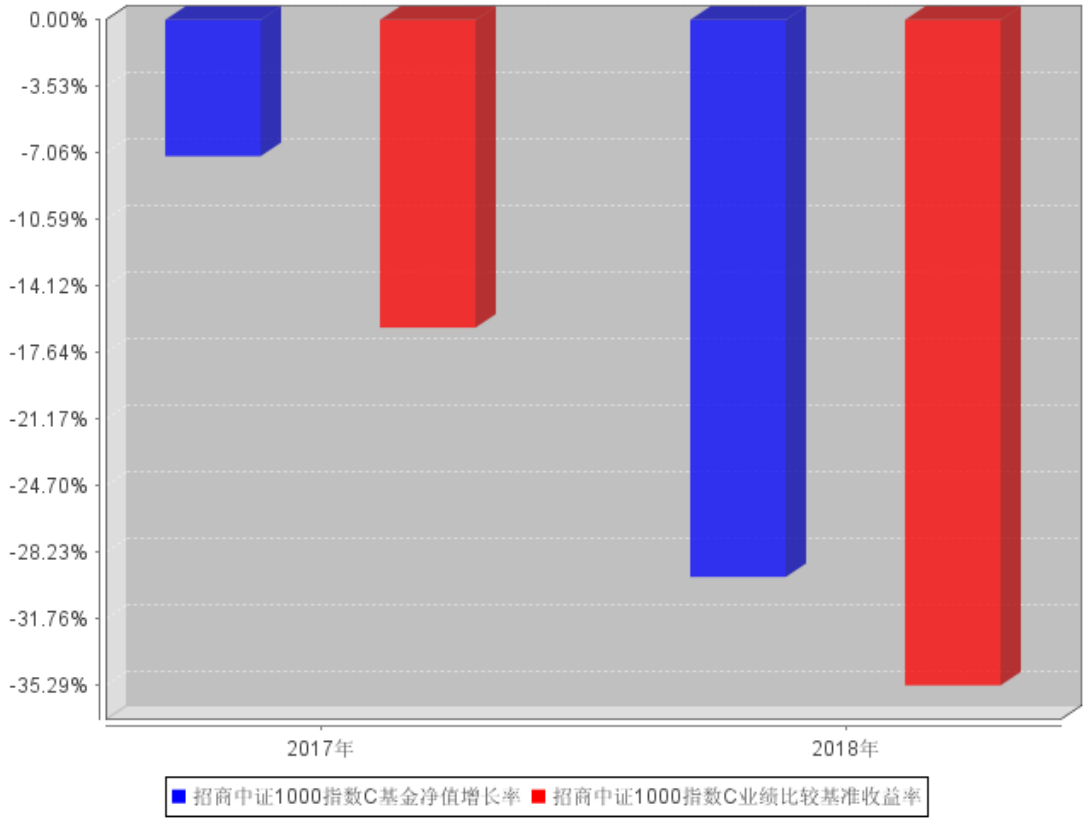


3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

招商中证1000指数A自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



招商中证1000指数C自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金于2017年3月3日成立，截至2017年12月31日基金成立未满1年，故成立当年净值增长率按当年实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金于2017年3月3日成立，自基金合同生效日以来未进行利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

招商基金管理有限公司于2002年12月27日经中国证监会【2002】100号文批准设立。目前，公司注册资本金为人民币13.1亿元，招商银行股份有限公司持有公司全部股权的55%，招商证券股份有限公司持有公司全部股权的45%。

招商基金管理有限公司首批获得企业年金基金投资管理人资格、基本养老保险基金投资管理资格；2004年获得全国社保基金投资管理人资格；同时拥有QDII(合格境内机构投资者)资格、专户理财（特定客户资产管理计划）资格。

2018年获奖情况如下：

债券投资能力五星基金公司·海通证券

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

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

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

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

明星基金奖·五年持续回报积极债券型明星基金（招商安瑞进取债券）《证券时报》

明星基金奖·五年持续回报普通债券型明星基金（招商产业债券）《证券时报》

明星基金奖·2017年度绝对收益明星基金（招商丰融混合）《证券时报》

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

金牛奖·五年期开放式债券型持续优胜金牛基金（招商产业债券）《中国证券报》

金基金奖·五年期债券基金奖（招商产业债券） 《上海证券报》

公募基金20周年·“金基金”债券投资回报基金管理公司奖《上海证券报》

公募基金20周年·“金基金”行业领军人物奖（金旭）《上海证券报》

致敬基金20年·基金行业领军人物奖（金旭）《新浪》

致敬基金20年·最受投资者欢迎基金公司奖《新浪》

致敬基金20年·区域影响力奖 《新浪》

金牛奖·三年期海外金牛私募投资经理（多策略）《中国证券报》

中国金融科技先锋榜·2018中国AI金融先锋榜《证券时报》

中国金融科技先锋榜·2018年中国智能投顾新锐榜《证券时报》

金帆奖·2018年度基金管理公司《21世纪经济报道》

2018年度教育扶贫先锋企业《国际金融报》

金鼎奖·最具潜力基金公司《每日经济新闻》

离岸中资基金大奖·最具创意产品·香港中资基金业协会、彭博

中国网金融扶贫先锋榜·中国网精准扶贫先锋机构《中国网》

金砖奖·最佳资产配置奖《南方都市报》

金禧奖·2018最佳基金投研团队《投资时报》

腾讯理财通金企鹅奖·最佳债券基金奖·腾讯、晨星

中国金融金领带奖·年度卓越海外投资基金《华尔街见闻》

公募基金20周年行业特别评选·卓越影响力基金公司《界面·财联社》

公募基金20周年行业特别评选·最佳互联网金融服务基金公司《界面·财联社》

金蝉奖·2018年度基金管理公司《华夏时报》

基情20年最受欢迎基金公司·东方财富、天天基金

天天基金6周年定投榜·东方财富、天天基金

2018年东方风云榜连续三年稳回报基金·东方财富、天天基金

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王平	本基金基金经理	2017年3月3日	-	12	男，管理学硕士，FRM。2006年加入招商基金管理有限公司，曾任投资风险管理部助理数量分析师、风险管理部数量分析师、高级风控经理，主要负责公司投资风险管理、金融工程研究等工作，曾任招商深证100指数证券投资基金、上证消费80交易型开放式指数证券投资基金、招商上证消费80交易型开放式指数证券投资基金联接基金、深证电子信息传媒产业(TMT)50交易型开放式指数证券投资基金、招商深证电子信息传媒产业(TMT)50交易型开放式指数证券投资基金联接基金、招商央视财经50指数证券投资基金、招商中证煤炭等权指数分级证券投资基金、

					招商中证银行指数分级证券投资基金、招商国证生物医药指数分级证券投资基金、招商中证白酒指数分级证券投资基金基金经理，现任量化投资部副总监兼招商量化精选股票型发起式证券投资基金、招商稳荣定期开放灵活配置混合型证券投资基金、招商财经大数据策略股票型证券投资基金、招商沪深300指数增强型证券投资基金、招商中证1000指数增强型证券投资基金、招商盛合灵活配置混合型证券投资基金、招商中证500指数增强型证券投资基金基金经理。

注：1、本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告（生效）日期；

2、证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

基金管理人声明：在本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关法律法规及其各项实施准则的规定以及本基金的基金合同等基金法律文件的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的前提下，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围以及投资运作符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

基金管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》（2011年修订）的规定，制定了《招商基金管理有限公司公平交易管理办法》，对投资决策的内部控制、交易执行的内部控制、公平交易实施情况的监控与检查稽核、异常交易的监控等进行了规定。为保证各投资组合在投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会，基金管理人合理设置了各类资产管理业务之间以及各类资产管理业务内部的组织结构，建立了科学的投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

基金管理人已建立较完善的研究方法和投资决策流程，确保各投资组合享有公平的投资决策机会。基金管理人建立了所有组合适用的投资对象备选库，制定明确的备选库建立、维护程序。基金管理人拥有健全的投资授权制度，明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限划分，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。基金管理人的相关研究成果向内部所有投资组合开放，在投资研究层面不存在各投资组合间不公平的问题。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，本基金各项交易均严格按照相关法律法规、基金合同的有关要求执行。报告期内，公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情形，在指数型投资组合与主动型投资组合之间发生过五次，原因是指数型投资组合为满足投资策略需要而发生反向交易。报告期内未发现有可能导致不公平交易和利益输送的重大异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

本基金为增强型指数产品，在标的成份股权重基础上根据量化增强模型对行业配置及个股权重等进行主动调整，力争在控制跟踪误差的基础上获取超越标的指数的投资收益。本基金所使用的模型为多因子量化增强模型，具体分析的因子包含价值指标、成长指标、盈利指标、运营指标、一致预期指标和市场行为指标。模型构建过程中本基金在以上因子的基础上进一步利用统计分析筛选出针对不同市场环境的有效因子。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。

关于本基金的运作，报告期内投资运作较为稳定，股票仓位稳定在93%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-29.25%，同期业绩基准增长率为-35.29%，C类份额净值增长率为-29.54%，同期业绩基准增长率为-35.29%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

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

3、报告期内受国内金融去杠杆的影响，资本市场的信用风险持续上升，高杠杆及融资依赖型公司股价显著回落，而另一方面在中美贸易摩擦影响下，电子行业受较大影响全年跌幅较大，有色金属板块则受到国内经济下行压力的影响，跌幅靠前。整体来看2018年A股普跌，并多次探底，当前A股整体估值水平处于底部区域，横向与国际比较亦有较大优势，长期来看具有较大配置价值。

4.6 管理人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

本基金存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，相关解决方案已经上报证监会。

§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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）审计了招商中证1000指数增强型证券投资基金的财务报表，包括2018年12月31日的资产负债表、2018年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注，并出具了无保留意见的审计报告。

投资者欲了解详细内容，可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 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：2018年12月31日

单位：人民币元

资产	本期末2018年12月31日	上年度末2017年12月31日
资产：		
银行存款	2,516,969.40	9,833,153.80
结算备付金	13,316.14	39,793.28
存出保证金	5,979.13	11,221.36
交易性金融资产	29,011,229.60	145,033,892.80
其中：股票投资	28,972,319.30	145,033,892.80
基金投资	-	-
债券投资	38,910.30	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	247,680.07

应收利息	505.75	5,966.50
应收股利	-	-
应收申购款	70,367.17	91,946.69
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	31,618,367.19	155,263,654.50
负债和所有者权益	本期末2018年12月31日	上年度末2017年12月31日
负债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	156,124.77	67,383.28
应付管理人报酬	31,851.52	156,885.18
应付托管费	3,981.42	19,610.63
应付销售服务费	7,013.57	3,615.93
应付交易费用	10,840.60	64,988.59
应交税费	0.35	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	390,194.19	250,017.45
负债合计	600,006.42	562,501.06
所有者权益：		
实收基金	47,512,405.09	167,979,226.37
未分配利润	-16,494,044.32	-13,278,072.93
所有者权益合计	31,018,360.77	154,701,153.44
负债和所有者权益总计	31,618,367.19	155,263,654.50

注：报告截止日2018年12月31日，招商中证1000指数A份额净值0.6512元，基金份额总额16,069,812.71份；招商中证1000指数C份额净值0.6537元，基金份额总额31,442,592.38份；总份额合计47,512,405.09份。

7.2 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：2018年1月1日至2018年12月31日

单位：人民币元

项目	本期2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间2017年3月3日（基金合同生效日）至2017年12月31日
一、收入	-8,693,554.27	-9,510,795.88
1.利息收入	44,510.63	550,207.94
其中：存款利息收入	44,473.04	99,848.49
债券利息收入	37.59	22.71
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）	-12,830,448.01	-6,515,590.05
其中：股票投资收益	-13,118,626.75	-7,485,076.48
基金投资收益	-	-
债券投资收益	15,122.69	5,590.15
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	273,056.05	963,896.28
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	4,026,204.69	-4,352,109.07
4.汇兑收益（损失以“－”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	66,178.42	806,695.30
减：二、费用	1,975,410.20	3,182,537.30

1.管理人报酬	792,859.52	1,487,586.56
2.托管费	99,107.46	185,948.35
3.销售服务费	73,053.92	13,214.32
4.交易费用	525,050.75	1,056,096.51
5.利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6.税金及附加	0.05	-
7.其他费用	485,338.50	439,691.56
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-10,668,964.47	-12,693,333.18
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-10,668,964.47	-12,693,333.18

7.3 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：2018年1月1日至2018年12月31日

单位：人民币元

项目	本期2018年1月1日至2018年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	167,979,226.37	-13,278,072.93	154,701,153.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-10,668,964.47	-10,668,964.47
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）	-120,466,821.28	7,452,993.08	-113,013,828.20
其中：1.基金申购款	56,759,444.47	-10,387,135.10	46,372,309.37
2.基金赎回款	-177,226,265.75	17,840,128.18	-159,386,137.57
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）	47,512,405.09	-16,494,044.32	31,018,360.77
项目	上年度可比期间2017年3月3日（基金合同生效日）至2017年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	200,984,030.89	-	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）	-	-12,693,333.18	-12,693,333.18
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）	-33,004,804.52	-584,739.75	-33,589,544.27
其中：1.基金申购款	33,108,532.22	-1,663,853.55	31,444,678.67
2.基金赎回款	-66,113,336.74	1,079,113.80	-65,034,222.94
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）	167,979,226.37	-13,278,072.93	154,701,153.44

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

金旭	欧志明	何剑萍
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

招商中证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》(以下简称“基金合同”)及其他有关法律法规的规定，经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]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。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(以下简称“中国银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及截至报告期末最新公告的《招商中证1000指数增强型证券投资基金更新的招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围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，其中，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为中证1000指数收益率×95%+同期银行活期存款利率(税后)×5%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金2018年12月31日的财务状况以及2018年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 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的说明

报告期所采用的会计政策、会计估计与2017年度报告相一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008年9月18日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]48号《关于实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

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

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

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
招商基金管理有限公司	基金管理人
中国银行股份有限公司	基金托管人
招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)	基金管理人的股东
招商证券股份有限公司(以下简称“招商证券”)	基金管理人的股东
招商财富资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司
招商资产管理（香港）有限公司	基金管理人的全资子公司

注：本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

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股票交易。

7.4.8.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券交易。

7.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期2018年1月1日至2018年12月31日		上年度可比期间2017年3月3日（基金合同生效日）至2017年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
招商证券	-	-	180,000,000.00	15.99%

7.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间2017年3月3日（基金合同生效日）至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	792,859.52	1,487,586.56
其中：支付销售机构的客户维护费	114,179.42	24,879.73

注：支付基金管理人招商基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值×1.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金管理人报酬＝前一日基金资产净值×1.20%÷当年天数

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间2017年3月3日（基金合同生效日）至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	99,107.46	185,948.35

注：支付基金托管人中国银行的基金托管费按前一日基金资产净值×0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金托管费＝前一日基金资产净值×0.15%÷当年天数

7.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期2018年1月1日至2018年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	招商中证1000指数A	招商中证1000指数C	合计
中国银行	-	429.92	429.92
招商基金管理有限公司	-	1,520.01	1,520.01
招商银行	-	6,055.14	6,055.14
合计	-	8,005.07	8,005.07
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间2017年3月3日(基金合同生效日)至2017年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	招商中证1000指数A	招商中证1000指数C	合计
招商基金管理有限公司	-	640.26	640.26
招商银行	-	1,002.10	1,002.10
中国银行	-	304.30	304.30
合计	-	1,946.66	1,946.66

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

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期2018年1月1日至2018年12月31日		上年度可比期间2017年3月3日（基金合同生效日）至2017年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	2,516,969.40	38,689.48	9,833,153.80	73,485.50

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.9 期末（2018年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 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。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
000540	中天金融	2017年8月21日	重大事项	3.80	2019年1月2日	4.38	900	4,352.00	3,420.00	-

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(b)以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

下表按公允价值三个层次列示了以公允价值计量的金融资产工具于12月31日的账面价值。

单位：人民币元

资产	本期末(2018年12月31日)			
	第一层次	第二层次	第三层次	合计
交易性金融资产				
股票投资	28,968,899.30	3,420.00	-	28,972,319.30
债券投资	38,910.30	-	-	38,910.30
合计	29,007,809.60	3,420.00	-	29,011,229.60
资产	上年度末(2017年12月31日)			
	第一层次	第二层次	第三层次	合计
交易性金融资产				
股票投资	140,468,128.54	4,565,764.26	-	145,033,892.80
债券投资	-	-	-	-
合计	140,468,128.54	4,565,764.26	-	145,033,892.80

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

对于本基金投资的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	28,972,319.30	91.63
	其中：股票	28,972,319.30	91.63
2	固定收益投资	38,910.30	0.12
	其中：债券	38,910.30	0.12
	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	2,530,285.54	8.00
7	其他资产	76,852.05	0.24
8	合计	31,618,367.19	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	365,072.00	1.18
B	采矿业	549,448.35	1.77
C	制造业	14,852,957.42	47.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	598,247.80	1.93
E	建筑业	374,312.00	1.21
F	批发和零售业	2,106,523.35	6.79
G	交通运输、仓储和邮政业	428,151.00	1.38
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,397,844.20	7.73
J	金融业	-	-
K	房地产业	1,160,366.70	3.74
L	租赁和商务服务业	46,154.00	0.15
M	科学研究和技术服务业	-	-

N	水利、环境和公共设施管理业	1,224,385.90	3.95
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	435,140.00	1.40
S	综合	-	-
	合计	24,538,602.72	79.11

8.2.2 期末积极投资按行业分类境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	104,535.00	0.34
C	制造业	3,040,654.00	9.80
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	288,175.00	0.93
E	建筑业	6,272.00	0.02
F	批发和零售业	46,324.00	0.15
G	交通运输、仓储和邮政业	150,065.00	0.48
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	146,124.00	0.47
J	金融业	174.00	0.00
K	房地产业	246,440.00	0.79
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	242,505.58	0.78
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	162,448.00	0.52
S	综合	-	-
	合计	4,433,716.58	14.29

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

8.3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例

					（%）
1	300232	洲明科技	33,800	322,452.00	1.04
2	300369	绿盟科技	35,400	306,564.00	0.99
3	603636	南威软件	31,827	305,539.20	0.99
4	002091	江苏国泰	54,177	303,391.20	0.98
5	002020	京新药业	35,200	302,720.00	0.98
6	600420	现代制药	33,060	302,168.40	0.97
7	002335	科华恒盛	19,900	299,893.00	0.97
8	600261	阳光照明	87,700	299,057.00	0.96
9	002449	国星光电	28,760	298,528.80	0.96
10	000791	甘肃电投	58,180	294,390.80	0.95

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读刊登于招商基金管理有限公司网站http://www.cmfchina.com上的年度报告正文。

8.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	002406	远东传动	46,100	243,869.00	0.79
2	601928	凤凰传媒	19,200	152,448.00	0.49
3	300403	汉宇集团	30,100	151,102.00	0.49
4	300656	民德电子	7,300	150,745.00	0.49
5	600660	福耀玻璃	6,600	150,348.00	0.48

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读刊登于招商基金管理有限公司网站http://www.cmfchina.com上的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000967	盈峰环境	1,761,350.00	1.14
2	600076	康欣新材	1,707,305.00	1.10
3	300323	华灿光电	1,672,155.00	1.08
4	300303	聚飞光电	1,654,189.20	1.07
5	603686	龙马环卫	1,590,145.00	1.03
6	600990	四创电子	1,568,422.00	1.01
7	600114	东睦股份	1,420,870.40	0.92
8	600035	楚天高速	1,401,223.16	0.91

9	002080	中材科技	1,266,094.20	0.82
10	600449	宁夏建材	1,235,192.00	0.80
11	603612	索通发展	1,219,649.96	0.79
12	000545	金浦钛业	1,198,229.00	0.77
13	002396	星网锐捷	1,181,073.00	0.76
14	300036	超图软件	1,162,342.00	0.75
15	601003	柳钢股份	1,148,066.00	0.74
16	000631	顺发恒业	1,137,808.00	0.74
17	600681	百川能源	1,105,650.00	0.71
18	601222	林洋能源	1,091,146.00	0.71
19	300237	美晨生态	1,086,341.00	0.70
20	000402	金融街	1,076,270.90	0.70

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票；

2、基金持有的股票分类为交易性金融资产的，本项的“累计买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300036	超图软件	2,459,858.00	1.59
2	002080	中材科技	2,399,420.26	1.55
3	600567	山鹰纸业	2,078,724.00	1.34
4	300323	华灿光电	2,023,302.00	1.31
5	600507	方大特钢	2,007,776.76	1.30
6	300226	上海钢联	1,969,597.00	1.27
7	000967	盈峰环境	1,911,763.00	1.24
8	002203	海亮股份	1,885,365.00	1.22
9	600210	紫江企业	1,842,540.48	1.19
10	002396	星网锐捷	1,829,642.00	1.18
11	000676	智度股份	1,715,770.20	1.11
12	600114	东睦股份	1,704,366.17	1.10
13	002712	思美传媒	1,673,025.20	1.08
14	600708	光明地产	1,664,432.10	1.08
15	603686	龙马环卫	1,602,615.92	1.04
16	300184	力源信息	1,598,422.42	1.03
17	000070	特发信息	1,596,167.00	1.03
18	000055	方大集团	1,565,312.50	1.01
19	300269	联建光电	1,559,571.00	1.01
20	600076	康欣新材	1,552,687.00	1.00

注：1、卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票；

2、基金持有的股票分类为交易性金融资产的，本项 “累计卖出金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	274,187,178.66
卖出股票收入（成交）总额	381,156,419.46

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票；

2、“买入股票成本（成交）总额”、“卖出股票收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	38,910.30	0.13
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	38,910.30	0.13

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	110047	山鹰转债	390	38,910.30	0.13

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，有选择地投资于流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金在进行股指期货投资时，首先将基于对证券市场总体行情的判断和组合风险收益的分析确定投资时机，并根据风险资产投资（或拟投资）的总体规模和风险系数决定股指期货的投资比例；其次，本基金将在综合考虑证券市场和期货市场运行趋势以及股指期货流动性、收益性、风险特征和估值水平的基础上进行投资品种选择，以对冲风险资产组合的系统性风险和流动性风险。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金参与国债期货投资是为了有效控制债券市场的系统性风险，本基金将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，适度运用国债期货提高投资组合运作效率。在国债期货投资过程中，基金管理人通过对宏观经济和利率市场走势的分析与判断，并充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置，谨慎进行投资，以调整债券组合的久期，降低投资组合的整体风险。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期未持有国债期货合约。

8.12 投资组合报告附注

报告期内基金投资的前十名证券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。

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库，本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

8.12.1 期末其他各项资产构成

金额单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	5,979.13
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	505.75
5	应收申购款	70,367.17
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	76,852.05

8.12.2 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.3 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.3.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

8.12.3.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
招商中证	1,769	9,084.12	-	-	16,069,812.71	100.00%

1000 指数 A						
招商中证 1000 指数 C	6,983	4,502.73	-	-	31,442,592.38	100.00%
合计	8,752	5,428.75	-	-	47,512,405.09	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）。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	招商中证 1000 指数 A	9,052.49	0.0563%
	招商中证 1000 指数 C	2,017.87	0.0064%
	合计	11,070.36	0.0233%

注：分级基金机构投资者/个人投资者持有份额占总份额比例计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	招商中证 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

§10 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 03 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	155,664,171.36	12,315,055.01
本报告期基金总申购份额	21,538,258.56	35,221,185.91
减：报告期基金总赎回份额	161,132,617.21	16,093,648.54

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	16,069,812.71	31,442,592.38

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

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

报告期内，2018年8月，刘连舸先生担任中国银行股份有限公司行长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的重大诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金的审计事务所无变化，目前德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）已为本基金提供审计服务2年，本报告期应支付给德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为人民币40,000.00元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金管理人没有受到监管部门的稽查或处罚，亦未收到关于基金管理人的高级管理人员、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员受到监管部门的稽查或处罚的书面通知或文件。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
第一创业证券	2	653,692,909.21	100.00%	85,835.46	100.00%	-
西藏东方财富	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
大通证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	3	-	-	-	-	-
方正证券	3	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	5	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	3	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	4	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	3	-	-	-	-	-
瑞信方正	2	-	-	-	-	-
申万宏源	4	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中投证券	3	-	-	-	-	-
中信建投	6	-	-	-	-	-

中信证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	3	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	4	-	-	-	-	-

注：基金交易佣金根据券商季度综合评分结果给与分配，券商综合评分根据研究报告质量、路演质量、联合调研质量以及销售服务质量打分，从多家服务券商中选取符合法律规范经营的综合能力靠前的券商给与佣金分配，季度评分和佣金分配分别由专人负责。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
第一创业证券	213,147.00	100.00%	-	-	-	-
西藏东方财富	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
瑞信方正	-	-	-	-	-	-

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

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
个人	1	20180101-20180416	48,002,400.00	-	48,002,400.00	-	-
个人	2	20180101-20180411	48,002,400.00	-	48,002,400.00	-	-
个人	3	20180101-20180416	54,002,200.00	-	54,002,200.00	-	-
产品特有风险							
本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况，可能会出现集中赎回甚至巨额赎回从而引发基金净值剧烈波动，甚至引发基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。							

注：报告期末持有份额占比按照四舍五入方法保留至小数点后第2位。

招商基金管理有限公司

2019年3月28日