

# 招商量化精选股票型发起式证券投资 基金 2019 年半年度报告

2019 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：2019 年 8 月 26 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 2019 年 8 月 23 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 2019 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..... | 12 |
| 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.....                                 | 14 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....                      | 15 |
| 6.4 报表附注.....                                | 17 |
| §7 投资组合报告.....                               | 33 |
| 7.1 期末基金资产组合情况.....                          | 33 |
| 7.2 报告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.....       | 34 |
| 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.....                    | 42 |
| 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.....               | 43 |

|   |    |
|---|----|
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....          | 43 |
| 7.12 投资组合报告附注.....                      | 43 |
| §8 基金份额持有人信息.....                       | 44 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....              | 44 |
| 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 |
| 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....                | 45 |
| §9 开放式基金份额变动.....                       | 45 |
| §10 重大事件揭示.....                         | 45 |
| 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.....        | 46 |
| 10.4 基金投资策略的改变.....                     | 46 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....              | 46 |
| 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.....      | 46 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....             | 46 |
| 10.8 其他重大事件.....                        | 48 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息.....                 | 49 |
| 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况..... | 49 |
| §12 备查文件目录.....                         | 50 |
| 12.1 备查文件目录.....                        | 50 |
| 12.2 存放地点.....                          | 50 |
| 12.3 查阅方式.....                          | 50 |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                    |
|------------|--------------------|
| 基金名称       | 招商量化精选股票型发起式证券投资基金 |
| 基金简称       | 招商量化精选股票           |
| 基金主代码      | 001917             |
| 交易代码       | 001917             |
| 基金运作方式     | 契约型开放式             |
| 基金合同生效日    | 2016 年 3 月 15 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 | 44,955,547.64 份    |
| 基金合同存续期    | 不定期                |

### 2.2 基金产品说明

|        |  |
|--------|--|
| 投资目标   | 本基金通过量化模型精选股票，在有效控制风险的前提下，力争获取超越业绩比较基准的投资回报，谋求基金资产的长期增值。   |
| 投资策略   | <p>资产配置策略：本基金投资组合中股票资产占基金资产的比例不低于 80%，大类资产配置不作为本基金的核心策略。</p> <p>股票投资策略：本基金主要采用量化模型用以评估资产定价、控制风险和优化交易。</p> <p>债券投资策略：根据国内外宏观经济形势、财政、货币政策、市场资金与债券供求状况、央行公开市场操作等方面情况，采用定性与定量相结合的方式，在确保流动性充裕和业绩考核期内可实现绝对收益的约束下设定债券投资的组合久期，并根据通胀预期确定浮息债与固定收益债比例。</p> <p>中小企业私募债券投资策略：中小企业私募债具有票面利率较高、信用风险较大、二级市场流动性较差等特点。</p> <p>资产支持证券的投资策略：本基金将在宏观经济和基本面分析的基础上，对资产支持证券的质量和构成、利率风险、信用风险、流动性风险和提前偿付风险等进行定性和定量的全方面分析，评估其相对投资价值并作出相应的投资决策，力求在控制投资风险的前提下尽可能的提高本基金的收益。</p> <p>权证投资策略：本基金对权证资产的投资主要是通过分析影响权证内在价值最重要的两种因素——标的资产价格以及市场隐含波动率的变化，灵活构建避险策略，波动率差策略以及套利策略。</p> <p>股指期货投资策略：本基金采取套期保值的方式参与股指期货的投资交易，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。</p> |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×80%+中债综合指数收益率×20%   |
| 风险收益特征 | 本基金是股票型基金，属于证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的品种，其预期风险收益水平高于混合型基金、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              |
|         | 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                    | 刘连舸              |

## 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   |
| 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 | 招商基金管理有限公司 | 中国深圳深南大道 7088 号招商银行大厦 |

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

|               |                                       |
|---------------|---------------------------------------|
| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2019 年 1 月 1 日 - 2019 年 6 月 30 日) |
| 本期已实现收益       | 5,861,374.45                          |
| 本期利润          | 10,947,297.79                         |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.2258                                |
| 本期加权平均净值利润率   | 25.07%                                |
| 本期基金份额净值增长率   | 29.87%                                |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2019 年 6 月 30 日)                 |
| 期末可供分配利润      | -1,897,295.89                         |

|              |                       |
|--------------|-----------------------|
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.0422               |
| 期末基金资产净值     | 43,058,251.75         |
| 期末基金份额净值     | 0.9578                |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2019 年 6 月 30 日) |
| 基金份额累计净值增长率  | 1.95%                 |

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

| 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      | 2.61%    | 1.28%       | 4.37%      | 0.93%         | -1.76%  | 0.35% |
| 过去三个月      | -1.42%   | 1.60%       | -0.90%     | 1.22%         | -0.52%  | 0.38% |
| 过去六个月      | 29.87%   | 1.54%       | 21.47%     | 1.24%         | 8.40%   | 0.30% |
| 过去一年       | 4.91%    | 1.56%       | 8.21%      | 1.22%         | -3.30%  | 0.34% |
| 过去三年       | -3.55%   | 1.29%       | 17.58%     | 0.89%         | -21.13% | 0.40% |
| 自基金合同生效起至今 | 1.95%    | 1.30%       | 20.26%     | 0.88%         | -18.31% | 0.42% |

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

招商量化精选股票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。

2019 年上半年获奖情况如下：

Morningstar 晨星(中国)2019 年度普通债券型基金奖·招商产业债券·Morningstar 晨星

一级债五星基金公司·济安金信基金研究中心

五年持续回报普通债券型明星基金·招商安心收益债券·证券时报

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

三年持续回报普通债券型明星基金·招商双债增强债券(LOF)·证券时报

金牛奖·固定收益投资金牛基金公司·招商基金管理有限公司·中国证券报

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

金牛奖·年度开放式债券型金牛基金·招商安心收益债券·中国证券报



金牛奖·最受信赖金牛基金公司·招商基金管理有限公司·中国证券报

金基金·债券投资回报基金管理公司·招商基金管理有限公司·上海证券报

金基金·五年期债券基金·招商产业债券·上海证券报

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务      | 任本基金的基金经理（助理）期限 |      | 证券从业年限 | 说明   |
|----|---------|-----------------|------|--------|--|
|    |         | 任职日期            | 离任日期 |        |  |
| 王平 | 本基金基金经理 | 2016年3月15日      | -    | 13     | 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。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两次，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，从国内宏观经济数据来看，经济仍承受压力，货币政策保持中性偏松。报告期从行业来看，食品饮料、非银金融、农林牧渔、家用电器、计算机等行业板块涨幅较大，建筑装饰、钢铁、传媒、纺织服装、汽车等行业板块涨幅相对较小。因子表现方面上半年总体而言风格偏向成长，研发费用占比较高、分析师不断上调盈利预测以及季度业绩优异的公司股价表现较好，相反价值风格则相对弱一些，传统低估值、高股息率的企业整

体表现一般。沪深 300 指数上涨 27.07%，中证 500 上涨 18.77%，创业板指上涨 20.87%，中证 1000 上涨 20.12%。

本基金股票投资策略主要使用量化选股策略，使用量化模型评估资产定价、控制风险和优化交易，并基于模型结果，结合市场环境和股票特性，精选个股构成投资组合，以追求超越业绩比较基准表现的业绩水平。

关于本基金的运作，报告期内投资运作较为稳定，股票仓位总体维持在 94.5%左右的水平。

#### 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 29.87%，同期业绩基准增长率为 21.47%。

### 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、国内 2019 年二季度 GDP 同比增长 6.2%，相比一季度下降 0.2%，分产业来看，二季度第一产业与第三产业 GDP 相比一季度增速加快，而第二产业 GDP 同比增速与一季度持平；6 月工业增加值增速高于市场预期，分行业来看，中游行业的生产增速相对加快，如金属制品与运输设备制造业，但下游行业的生产增速放缓，如医药、汽车、计算机等相关行业，中美贸易摩擦的影响开始显现；6 月房地产开发投资同比增速上升，基建投资同比增速上升。从近期的经济数据来看，经济下行过程中，仍旧有一定的韧性。结合中央政治局会议，展望下半年，经济下行压力犹存，财政政策进一步落实过程中，改革与经济结构性转型仍是重要方向。

2、报告期内股市呈现先扬后抑局面，年初受到中美贸易摩擦缓和、流动性宽松以及资本市场战略地位抬升等多重利好的刺激股市出现大幅上涨，而 4 月下旬政治局会议后政策重心重新转向结构性去杠杆以及中美摩擦再度加剧后，股市出现明显调整。市场短期仍以区间震荡为主，但中期无需过度悲观。在全球转向宽松周期、国内利率趋向下行的背景下，同时考虑到当前时点的估值仍处于历史中枢以下，国内风险资产的下行风险尚相对可控。但另一方面，上市公司盈利仍有下修压力，而在长期结构性改革压力下，政策定力仍强，风险资产的上行空间也将受限，下半年区间震荡的概率更高。中长期看，随着科创板的加快落地，资本市场的改革开放仍有望得到进一步推进，而中长期资金的引入也将逐步抬升市场的底部区间，平抑市场的异常波动。

### 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

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”）在招商量化精选股票型发起式证券投资基金（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：招商量化精选股票型发起式证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产       | 附注号     | 本期末 2019 年 6 月 30 日 | 上年度末 2018 年 12 月 31 日 |
|----------|---------|---------------------|-----------------------|
| 资产：      |         |                     |                       |
| 银行存款     | 6.4.7.1 | 2,327,054.92        | 2,154,766.04          |
| 结算备付金    |         | 71,695.76           | 40,927.30             |
| 存出保证金    |         | 6,962.91            | 4,923.29              |
| 交易性金融资产  | 6.4.7.2 | 41,032,316.19       | 34,727,251.33         |
| 其中：股票投资  |         | 40,772,524.19       | 34,721,251.36         |
| 基金投资     |         | -                   | -                     |
| 债券投资     |         | 259,792.00          | 5,999.97              |
| 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    |          | 39,107.76           | 60,430.84             |
| 应收利息       | 6.4.7.5  | 3,149.74            | 452.52                |
| 应收股利       |          | -                   | -                     |
| 应收申购款      |          | 4,205.40            | 2,259.26              |
| 递延所得税资产    |          | -                   | -                     |
| 其他资产       | 6.4.7.6  | -                   | -                     |
| 资产总计       |          | 43,484,492.68       | 36,991,010.58         |
| 负债和所有者权益   | 附注号      | 本期末 2019 年 6 月 30 日 | 上年度末 2018 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    |          | -                   | 74,106.57             |
| 应付赎回款      |          | 101,663.39          | 4,009.97              |
| 应付管理人报酬    |          | 52,795.49           | 48,513.36             |
| 应付托管费      |          | 8,799.25            | 8,085.54              |
| 应付销售服务费    |          | -                   | -                     |
| 应付交易费用     | 6.4.7.7  | 70,391.63           | 31,414.49             |
| 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  | 192,591.17          | 230,000.48            |
| 负债合计       |          | 426,240.93          | 396,130.41            |
| 所有者权益：     |          |                     |                       |
| 实收基金       | 6.4.7.9  | 44,955,547.64       | 49,621,355.20         |
| 未分配利润      | 6.4.7.10 | -1,897,295.89       | -13,026,475.03        |
| 所有者权益合计    |          | 43,058,251.75       | 36,594,880.17         |
| 负债和所有者权益总计 |          | 43,484,492.68       | 36,991,010.58         |

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.9578 元，基金份额总额 44,955,547.64 份。

## 6.2 利润表

会计主体：招商量化精选股票型发起式证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                     | 附注号      | 本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 |
|------------------------|----------|------------------------------------|---|
| 一、收入                   |          | 11,561,468.99                      | -3,415,491.95                           |
| 1. 利息收入                |          | 10,440.30                          | 13,200.19                               |
| 其中：存款利息收入              | 6.4.7.11 | 9,591.83                           | 13,199.89                               |
| 债券利息收入                 |          | 848.47                             | 0.30                                    |
| 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）      |          | 6,447,729.64                       | -839,380.27                             |
| 其中：股票投资收益              | 6.4.7.12 | 5,874,685.16                       | -1,392,777.50                           |
| 基金投资收益                 |          | -                                  | -                                       |
| 债券投资收益                 | 6.4.7.13 | 4,468.74                           | 4.03                                    |
| 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 | 568,575.74                         | 553,393.20                              |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.18 | 5,085,923.34                       | -2,620,441.23                           |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）     |          | -                                  | -                                       |

|                     |                |                  |                  |
|---------------------|----------------|------------------|------------------|
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）  | 6. 4. 7. 19    | 17, 375. 71      | 31, 129. 36      |
| 减：二、费用              |                | 614, 171. 20     | 866, 759. 29     |
| 1. 管理人报酬            | 6. 4. 10. 2. 1 | 323, 380. 70     | 436, 542. 35     |
| 2. 托管费              | 6. 4. 10. 2. 2 | 53, 896. 79      | 72, 756. 99      |
| 3. 销售服务费            |                | -                | -                |
| 4. 交易费用             | 6. 4. 7. 20    | 163, 911. 17     | 173, 002. 90     |
| 5. 利息支出             |                | -                | -                |
| 其中：卖出回购金融资产支出       |                | -                | -                |
| 6. 税金及附加            |                | 0. 03            | -                |
| 7. 其他费用             | 6. 4. 7. 21    | 72, 982. 51      | 184, 457. 05     |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） |                | 10, 947, 297. 79 | -4, 282, 251. 24 |
| 减：所得税费用             |                | -                | -                |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）   |                | 10, 947, 297. 79 | -4, 282, 251. 24 |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：招商量化精选股票型发起式证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                | 本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 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, 621, 355. 20                   | -13, 026, 475. 03 | 36, 594, 880. 17 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）          | -                                  | 10, 947, 297. 79  | 10, 947, 297. 79 |
| 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, 665, 807. 56                   | 181, 881. 35      | -4, 483, 926. 21 |



|  |   |               |                |
|--|---|---------------|----------------|
| 其中：1. 基金申购款                            | 7,080,752.92                            | -339,342.68   | 6,741,410.24   |
| 2. 基金赎回款                               | -11,746,560.48                          | 521,224.03    | -11,225,336.45 |
| 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）                        | 44,955,547.64                           | -1,897,295.89 | 43,058,251.75  |
| 项目                                     | 上年度可比期间 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）                        | 75,660,612.89                           | 391,883.22    | 76,052,496.11  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                       | -4,282,251.24 | -4,282,251.24  |
| 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）      | -24,542,484.57                          | -571,179.02   | -25,113,663.59 |
| 其中：1. 基金申购款                            | 3,045,845.20                            | -69,709.47    | 2,976,135.73   |
| 2. 基金赎回款                               | -27,588,329.77                          | -501,469.55   | -28,089,799.32 |
| 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）                        | 51,118,128.32                           | -4,461,547.04 | 46,656,581.28  |

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

招商量化精选股票型发起式证券投资基金(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》、《招商量化精选股票型发起式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”)《关于准予招商量化精选股票型发起式证券投资基金注册的批复》(证监许可[2015]2210号文)批准公开募集。本基金为契约型、开放式、发起式,存续期限为不定期,首次设立募集基金份额为243,093,644.61份,经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了编号为毕马威华振验字第1600365号验资报告。《招商量化精选股票型发起式证券投资基金基金合同》于2016年3月15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”)。

本基金于2016年2月18日至2016年3月11日募集,募集期间净认购资金人民币243,045,764.14元,认购资金在募集期间产生的利息人民币47,880.47元,募集的有效认购份额及利息结转的基金份额合计243,093,644.61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1600365号验资报告。

根据中国证监会2017年8月31日发布的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称“《流动性风险管理规定》”),对已经存续的开放式证券投资基金且基金合同内容不符合《流动性风险管理规定》要求的,应当在《流动性风险管理规定》施行之日起6个月内予以调整。根据《流动性风险管理规定》等法律法规,经与基金托管人协商一致,招商基金管理有限公司对本基金合同相关条款进行修订。修订后的合同的全部条款已于2018年3月31日起正式实施。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《招商量化精选股票型发起式证券投资基金基金合同》和截至报告期末最新公告的《招商量化精选股票型发起式证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的A股股票(包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票)、债券(含中小企业私募债)、资产支持证券、货币市场工具、权证、股指期货,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的相关规定。本基金为股票型基金,基金投资组合中股票资产占基金资产的比例不低于80%,权证投资占基金资产净值的0%-3%;任何交易日日终在扣除需缴纳的交易保证金后,基金保留的现金或者投资于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%,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。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。本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率 $\times$ 80%+中债综合指数收益率 $\times$ 20%。

## 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2019年6月30日的财务状况以及自2019年1月1日至2019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[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、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) 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(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）运营资管产品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。对资管产品在 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、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(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) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入个人所得税应纳税所得额。

(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) 对投资者从证券投资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，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

## 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 2019 年 6 月 30 日 |
|----------------|---------------------|
| 活期存款           | 2,327,054.92        |
| 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             | 2,327,054.92        |

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末 2019 年 6 月 30 日 |               |             |
|---------------|---------------------|---------------|-------------|
|               | 成本                  | 公允价值          | 公允价值变动      |
| 股票            | 41,176,871.47       | 40,772,524.19 | -404,347.28 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                   | -             | -           |
| 债券            | 交易所市场               | 259,495.00    | 259,792.00  |
|               | 银行间市场               | -             | -           |
|               | 合计                  | 259,495.00    | 259,792.00  |
| 资产支持证券        | -                   | -             | -           |
| 基金            | -                   | -             | -           |
| 其他            | -                   | -             | -           |
| 合计            | 41,436,366.47       | 41,032,316.19 | -404,050.28 |

#### 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 2019 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------|
| 应收活期存款利息  | 403.11              |
| 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 | 28.80               |

|            |          |
|------------|----------|
| 应收债券利息     | 2,715.04 |
| 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         | 2.79     |
| 合计         | 3,149.74 |

#### 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 2019 年 6 月 30 日 |
|-------------|---------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 70,391.63           |
| 银行间市场应付交易费用 | -                   |
| 合计          | 70,391.63           |

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末 2019 年 6 月 30 日 |
|-------------|---------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                   |
| 应付赎回费       | 91.17               |
| 预提费用        | 192,500.00          |
| 合计          | 192,591.17          |

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 |                |
|---------------|------------------------------------|----------------|
|               | 基金份额（份）                            | 账面金额           |
| 上年度末          | 49,621,355.20                      | 49,621,355.20  |
| 本期申购          | 7,080,752.92                       | 7,080,752.92   |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -11,746,560.48                     | -11,746,560.48 |
| 基金份额折算变动份额    | -                                  | -              |
| 本期末           | 44,955,547.64                      | 44,955,547.64  |

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

| 项目        | 已实现部分         | 未实现部分         | 未分配利润合计        |
|-----------|---------------|---------------|----------------|
| 上年度末      | -7,666,711.94 | -5,359,763.09 | -13,026,475.03 |
| 本期利润      | 5,861,374.45  | 5,085,923.34  | 10,947,297.79  |
| 本期基金份额交易产 | 315,580.45    | -133,699.10   | 181,881.35     |

|          |               |             |               |
|----------|---------------|-------------|---------------|
| 生的变动数    |               |             |               |
| 其中：基金申购款 | -843,896.02   | 504,553.34  | -339,342.68   |
| 基金赎回款    | 1,159,476.47  | -638,252.44 | 521,224.03    |
| 本期已分配利润  | -             | -           | -             |
| 本期末      | -1,489,757.04 | -407,538.85 | -1,897,295.89 |

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 |
|-----------|------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 8,872.25                           |
| 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 | 681.76                             |
| 其他        | 37.82                              |
| 合计        | 9,591.83                           |

#### 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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 |
|------------------|------------------------------------|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | 5,874,685.16                       |
| 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               | 5,874,685.16                       |

##### 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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 |
|------------|------------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 55,985,203.24                      |
| 减：卖出股票成本总额 | 50,110,518.08                      |
| 买卖股票差价收入   | 5,874,685.16                       |

##### 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

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 |
|----|------------------------------------|
|----|------------------------------------|

|                               |          |
|-------------------------------|----------|
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入 | 4,468.74 |
| 债券投资收益——赎回差价收入                | -        |
| 债券投资收益——申购差价收入                | -        |
| 合计                            | 4,468.74 |

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                      | 本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 |
|-------------------------|------------------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额   | 62,381.18                          |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 57,899.52                          |
| 减：应收利息总额                | 12.92                              |
| 买卖债券差价收入                | 4,468.74                           |

#### 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其他投资收益。

**6.4.7.17 股利收益**

单位：人民币元

| 项目          | 本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 568,575.74                         |
| 基金投资产生的股利收益 | -                                  |
| 合计          | 568,575.74                         |

**6.4.7.18 公允价值变动收益**

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 |
|------------------------|------------------------------------|
| 1.交易性金融资产              | 5,085,923.34                       |
| ——股票投资                 | 5,085,626.34                       |
| ——债券投资                 | 297.00                             |
| ——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                     | 5,085,923.34                       |

**6.4.7.19 其他收入**

单位：人民币元

| 项目      | 本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 |
|---------|------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 17,375.71                          |
| 合计      | 17,375.71                          |

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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 |
|-----------|------------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 163,911.17                         |
| 银行间市场交易费用 | -                                  |

|    |            |
|----|------------|
| 合计 | 163,911.17 |
|----|------------|

#### 6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

| 项目    | 本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 |
|-------|------------------------------------|
| 审计费用  | 15,000.00                          |
| 信息披露费 | 47,500.00                          |
| 银行费用  | 1,482.51                           |
| 其他    | 9,000.00                           |
| 合计    | 72,982.51                          |

#### 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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 |              | 上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 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  | 9,573,098.01                       | 9.00%        | 14,013,583.56                           | 13.07%       |

##### 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 2019 年 1 月 1 日至 2019 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  | 8,915.18                                | 9.05%      | 6,163.58 | 8.76%        |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 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  | 13,051.48                               | 13.30%     | 6,806.87 | 15.33%       |

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 2019 年 1 月 1 日至<br>2019 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2018 年 1<br>月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 |
|-----------------|---------------------------------------|--|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 323,380.70                            | 436,542.35                                 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 94,050.70                             | 116,073.18                                 |

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×

1.50%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×1.50%÷当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期 2019 年 1 月 1 日至<br>2019 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2018 年 1<br>月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 |
|----------------|---------------------------------------|--|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 53,896.79                             | 72,756.99                                  |

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×0.25%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：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% \div \text{当年天数}。$$

#### 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

份额单位：份

| 项目                               | 本期 2019 年 1 月 1 日至<br>2019 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2018 年 1<br>月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 |
|----------------------------------|---------------------------------------|--|
| 基金合同生效日（2016 年 03 月 15 日）持有的基金份额 | -                                     | -  |
| 报告期初持有的基金份额                      | 10,000,450.02                         | 10,000,450.02                              |
| 报告期间申购/买入总份额                     | -                                     | -  |
| 报告期间因拆分变动份额                      | -                                     | -  |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额                   | -                                     | -  |
| 报告期末持有的基金份额                      | 10,000,450.02                         | 10,000,450.02                              |
| 报告期末持有的基金份额占<br>基金总份额比例          | 22.25%                                | 19.56%                                     |

##### 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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6<br>月 30 日 |          | 上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日<br>至 2018 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  | 2,327,054.92                          | 8,872.25 | 2,564,848.16                                | 12,353.06 |

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，按银行约定利率计息。

#### 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（2019 年 06 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 |
| 601236               | 红塔证券 | 2019 年 6 月 26 日 | 2019 年 7 月 5 日 | 新股流通受限 | 3.46 | 3.46   | 9,789    | 33,869.94 | 33,869.94 | -  |
| 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 |
| -                    | -    | -               | -              | -      | -    | -      | -        | -         | -         | -  |

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

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

### 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

本基金为股票型基金，本基金的运作涉及的金融工具主要包括股票投资、债券投资、银行存款等。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、股票投资、债券投资及其他金融资产。

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。附注 6.4.13.2.1 至 6.4.13.2.6 列示了于本报告期末及上年度末本基金所持有的债券投资及资产支持证券投资的信用评级，该信用评级不包括本基金所持有的国债、央行票据、政策性金融债。

##### 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

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2019 年 6 月 30 日 | 上年度末 2018 年 12 月 31 日 |
|--------|---------------------|-----------------------|
| AAA    | -                   | 5,999.97              |
| AAA 以下 | -                   | -                     |
| 未评级    | -                   | -                     |
| 合计     | -                   | 5,999.97              |

注：上述评级均由经中国证监会核准从事证券市场资信评级业务的评级机构做出。

#### 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。除卖出回购金融资产款外，本基金所持有的全部金融负债无固定到期日或合约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

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 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、股票投资、债券投资。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 2019 年 6 月 30 日   | 1 年以内        | 1-5 年 | 5 年以上    | 不计息           | 合计            |
|-----------------------|--------------|-------|----------|---------------|---------------|
| 资产                    |              |       |          |               |               |
| 银行存款                  | 2,327,054.92 | -     | -        | -             | 2,327,054.92  |
| 结算备付金                 | 71,695.76    | -     | -        | -             | 71,695.76     |
| 存出保证金                 | 6,962.91     | -     | -        | -             | 6,962.91      |
| 交易性金融资产               | 259,792.00   | -     | -        | 40,772,524.19 | 41,032,316.19 |
| 买入返售金融资产              | -            | -     | -        | -             | -             |
| 应收利息                  | -            | -     | -        | 3,149.74      | 3,149.74      |
| 应收股利                  | -            | -     | -        | -             | -             |
| 应收申购款                 | -            | -     | -        | 4,205.40      | 4,205.40      |
| 应收证券清算款               | -            | -     | -        | 39,107.76     | 39,107.76     |
| 其他资产                  | -            | -     | -        | -             | -             |
| 资产总计                  | 2,665,505.59 | -     | -        | 40,818,987.09 | 43,484,492.68 |
| 负债                    |              |       |          |               |               |
| 应付赎回款                 | -            | -     | -        | 101,663.39    | 101,663.39    |
| 应付管理人报酬               | -            | -     | -        | 52,795.49     | 52,795.49     |
| 应付托管费                 | -            | -     | -        | 8,799.25      | 8,799.25      |
| 应付证券清算款               | -            | -     | -        | -             | -             |
| 卖出回购金融资产款             | -            | -     | -        | -             | -             |
| 应付销售服务费               | -            | -     | -        | -             | -             |
| 应付交易费用                | -            | -     | -        | 70,391.63     | 70,391.63     |
| 应付利息                  | -            | -     | -        | -             | -             |
| 应付利润                  | -            | -     | -        | -             | -             |
| 应交税费                  | -            | -     | -        | -             | -             |
| 其他负债                  | -            | -     | -        | 192,591.17    | 192,591.17    |
| 负债总计                  | -            | -     | -        | 426,240.93    | 426,240.93    |
| 利率敏感度缺口               | 2,665,505.59 | -     | -        | 40,392,746.16 | 43,058,251.75 |
| 上年度末 2018 年 12 月 31 日 | 1 年以内        | 1-5 年 | 5 年以上    | 不计息           | 合计            |
| 资产                    |              |       |          |               |               |
| 银行存款                  | 2,154,766.04 | -     | -        | -             | 2,154,766.04  |
| 结算备付金                 | 40,927.30    | -     | -        | -             | 40,927.30     |
| 存出保证金                 | 4,923.29     | -     | -        | -             | 4,923.29      |
| 交易性金融资产               | -            | -     | 5,999.97 | 34,721,251.36 | 34,727,251.33 |
| 买入返售金融资产              | -            | -     | -        | -             | -             |
| 应收利息                  | -            | -     | -        | 452.52        | 452.52        |
| 应收股利                  | -            | -     | -        | -             | -             |
| 应收申购款                 | -            | -     | -        | 2,259.26      | 2,259.26      |



|           |              |   |          |               |               |
|-----------|--------------|---|----------|---------------|---------------|
| 应收证券清算款   | -            | - | -        | 60,430.84     | 60,430.84     |
| 其他资产      | -            | - | -        | -             | -             |
| 资产总计      | 2,200,616.63 | - | 5,999.97 | 34,784,393.98 | 36,991,010.58 |
| 负债        |              |   |          |               |               |
| 应付赎回款     | -            | - | -        | 4,009.97      | 4,009.97      |
| 应付管理人报酬   | -            | - | -        | 48,513.36     | 48,513.36     |
| 应付托管费     | -            | - | -        | 8,085.54      | 8,085.54      |
| 应付证券清算款   | -            | - | -        | 74,106.57     | 74,106.57     |
| 卖出回购金融资产款 | -            | - | -        | -             | -             |
| 应付销售服务费   | -            | - | -        | -             | -             |
| 应付交易费用    | -            | - | -        | 31,414.49     | 31,414.49     |
| 应付利息      | -            | - | -        | -             | -             |
| 应付利润      | -            | - | -        | -             | -             |
| 应交税费      | -            | - | -        | -             | -             |
| 其他负债      | -            | - | -        | 230,000.48    | 230,000.48    |
| 负债总计      | -            | - | -        | 396,130.41    | 396,130.41    |
| 利率敏感度缺口   | 2,200,616.63 | - | 5,999.97 | 34,388,263.57 | 36,594,880.17 |

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

|    |                       |                             |                   |
|----|-----------------------|-----------------------------|-------------------|
| 假设 | 1.若市场利率平行上升或下降 50 个基点 |                             |                   |
|    | 2.其他市场变量保持不变          |                             |                   |
|    | 3.仅存在公允价值变动对基金资产净值的影响 |                             |                   |
| 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（2019年6月30日）             | 上年度末（2018年12月31日） |
|    |                       | 1. 市场利率平行上升 50 个基点          | -703.68           |
|    | 2. 市场利率平行下降 50 个基点    | 709.05                      | 176.38            |

#### 6.4.13.4.2 其他价格风险

其他价格风险是指以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

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2019 年 6 月 30 日 | 上年度末 2018 年 12 月 31 日 |
|----|---------------------|-----------------------|
|----|---------------------|-----------------------|

|                   | 公允价值          | 占基金资产<br>净值比例<br>(%) | 公允价值          | 占基金资产<br>净值比例<br>(%) |
|-------------------|---------------|----------------------|---------------|----------------------|
| 交易性金融资产-<br>股票投资  | 40,772,524.19 | 94.69                | 34,721,251.36 | 94.88                |
| 交易性金融资产-<br>基金投资  | -             | -                    | -             | -                    |
| 交易性金融资产-<br>贵金属投资 | -             | -                    | -             | -                    |
| 衍生金融资产-权<br>证投资   | -             | -                    | -             | -                    |
| 其他                | -             | -                    | -             | -                    |
| 合计                | 40,772,524.19 | 94.69                | 34,721,251.36 | 94.88                |

#### 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（2019年6月30日）             | 上年度末（2018年12月31日） |
|    | 1. 权益性投资的市场价格上升 5%            | 2,038,626.21                | 1,736,062.57      |
|    | 2. 权益性投资的市场价格下降 5%            | -2,038,626.21               | -1,736,062.57     |

#### 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<br>(%) |
|----|--------|---------------|------------------|
| 1  | 权益投资   | 40,772,524.19 | 93.76            |
|    | 其中：股票  | 40,772,524.19 | 93.76            |
| 2  | 固定收益投资 | 259,792.00    | 0.60             |
|    | 其中：债券  | 259,792.00    | 0.60             |
|    | 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      | 2,398,750.68  | 5.52   |
| 7 | 其他资产              | 53,425.81     | 0.12   |
| 8 | 合计                | 43,484,492.68 | 100.00 |

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末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         | 604,118.95    | 1.40         |
| B  | 采矿业              | 506,886.09    | 1.18         |
| C  | 制造业              | 23,584,416.47 | 54.77        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 1,120,886.00  | 2.60         |
| E  | 建筑业              | 104,460.00    | 0.24         |
| F  | 批发和零售业           | 5,368,316.14  | 12.47        |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 501,351.00    | 1.16         |
| H  | 住宿和餐饮业           | 62,210.80     | 0.14         |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 1,065,946.52  | 2.48         |
| J  | 金融业              | 4,100,450.12  | 9.52         |
| K  | 房地产业             | 1,971,180.00  | 4.58         |
| L  | 租赁和商务服务业         | 332,426.00    | 0.77         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 133,977.00    | 0.31         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 368,333.00    | 0.86         |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -             | -            |
| P  | 教育               | -             | -            |
| Q  | 卫生和社会工作          | 334,430.10    | 0.78         |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | 613,136.00    | 1.42         |
| S  | 综合               | -             | -            |
|    | 合计               | 40,772,524.19 | 94.69        |

### 7.2.2 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

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  | 002615 | 哈尔斯  | 102,132 | 571,939.20 | 1.33 |
| 2  | 603609 | 禾丰牧业 | 46,100  | 545,824.00 | 1.27 |
| 3  | 600559 | 老白干酒 | 40,690  | 532,632.10 | 1.24 |
| 4  | 601166 | 兴业银行 | 29,115  | 532,513.35 | 1.24 |
| 5  | 000034 | 神州数码 | 41,200  | 531,480.00 | 1.23 |
| 6  | 603368 | 柳药股份 | 15,800  | 519,504.00 | 1.21 |
| 7  | 002688 | 金河生物 | 99,200  | 501,952.00 | 1.17 |
| 8  | 002441 | 众业达  | 62,200  | 493,868.00 | 1.15 |
| 9  | 601588 | 北辰实业 | 131,300 | 492,375.00 | 1.14 |
| 10 | 002788 | 鹭燕医药 | 61,370  | 488,505.20 | 1.13 |
| 11 | 603198 | 迎驾贡酒 | 27,200  | 487,152.00 | 1.13 |
| 12 | 002543 | 万和电气 | 36,200  | 485,804.00 | 1.13 |
| 13 | 000921 | 海信家电 | 38,700  | 482,976.00 | 1.12 |
| 14 | 002746 | 仙坛股份 | 28,085  | 434,474.95 | 1.01 |
| 15 | 000568 | 泸州老窖 | 5,200   | 420,316.00 | 0.98 |
| 16 | 002014 | 永新股份 | 51,422  | 419,089.30 | 0.97 |
| 17 | 603369 | 今世缘  | 14,900  | 415,561.00 | 0.97 |
| 18 | 000333 | 美的集团 | 8,000   | 414,880.00 | 0.96 |
| 19 | 002304 | 洋河股份 | 3,400   | 413,304.00 | 0.96 |
| 20 | 000411 | 英特集团 | 31,100  | 403,989.00 | 0.94 |
| 21 | 000936 | 华西股份 | 44,600  | 398,278.00 | 0.92 |
| 22 | 603919 | 金徽酒  | 25,200  | 387,828.00 | 0.90 |
| 23 | 600829 | 人民同泰 | 54,800  | 387,436.00 | 0.90 |
| 24 | 603589 | 口子窖  | 5,900   | 380,078.00 | 0.88 |
| 25 | 600475 | 华光股份 | 34,900  | 379,712.00 | 0.88 |
| 26 | 603777 | 来伊份  | 26,600  | 379,316.00 | 0.88 |
| 27 | 000860 | 顺鑫农业 | 8,060   | 375,999.00 | 0.87 |
| 28 | 600073 | 上海梅林 | 40,400  | 371,680.00 | 0.86 |
| 29 | 600056 | 中国医药 | 27,200  | 366,928.00 | 0.85 |
| 30 | 601169 | 北京银行 | 61,800  | 365,238.00 | 0.85 |
| 31 | 601717 | 郑煤机  | 63,400  | 362,014.00 | 0.84 |
| 32 | 600985 | 淮北矿业 | 31,700  | 359,478.00 | 0.83 |
| 33 | 002087 | 新野纺织 | 92,400  | 358,512.00 | 0.83 |
| 34 | 002462 | 嘉事堂  | 23,800  | 357,000.00 | 0.83 |
| 35 | 600757 | 长江传媒 | 52,200  | 355,482.00 | 0.83 |
| 36 | 601398 | 工商银行 | 58,804  | 346,355.56 | 0.80 |
| 37 | 601318 | 中国平安 | 3,900   | 345,579.00 | 0.80 |
| 38 | 600461 | 洪城水业 | 54,700  | 344,610.00 | 0.80 |
| 39 | 601009 | 南京银行 | 41,500  | 342,790.00 | 0.80 |
| 40 | 600694 | 大商股份 | 12,259  | 342,148.69 | 0.79 |
| 41 | 600810 | 神马股份 | 27,000  | 333,450.00 | 0.77 |
| 42 | 002712 | 思美传媒 | 47,900  | 332,426.00 | 0.77 |

|    |        |      |        |            |      |
|----|--------|------|--------|------------|------|
| 43 | 002489 | 浙江永强 | 97,700 | 326,318.00 | 0.76 |
| 44 | 002150 | 通润装备 | 54,310 | 300,877.40 | 0.70 |
| 45 | 002641 | 永高股份 | 69,400 | 281,764.00 | 0.65 |
| 46 | 601939 | 建设银行 | 36,800 | 273,792.00 | 0.64 |
| 47 | 000417 | 合肥百货 | 51,800 | 268,842.00 | 0.62 |
| 48 | 002605 | 姚记扑克 | 25,500 | 267,750.00 | 0.62 |
| 49 | 603313 | 梦百合  | 15,340 | 265,228.60 | 0.62 |
| 50 | 600858 | 银座股份 | 51,700 | 264,187.00 | 0.61 |
| 51 | 600809 | 山西汾酒 | 3,800  | 262,390.00 | 0.61 |
| 52 | 000031 | 大悦城  | 39,800 | 255,516.00 | 0.59 |
| 53 | 601288 | 农业银行 | 70,900 | 255,240.00 | 0.59 |
| 54 | 603600 | 永艺股份 | 25,900 | 254,856.00 | 0.59 |
| 55 | 600196 | 复星医药 | 10,000 | 253,000.00 | 0.59 |
| 56 | 600197 | 伊力特  | 12,900 | 248,970.00 | 0.58 |
| 57 | 002392 | 北京利尔 | 69,800 | 244,300.00 | 0.57 |
| 58 | 000529 | 广弘控股 | 40,900 | 242,537.00 | 0.56 |
| 59 | 002267 | 陕天然气 | 29,400 | 240,786.00 | 0.56 |
| 60 | 600873 | 梅花生物 | 49,600 | 237,584.00 | 0.55 |
| 61 | 300347 | 泰格医药 | 3,000  | 231,300.00 | 0.54 |
| 62 | 000756 | 新华制药 | 31,300 | 223,795.00 | 0.52 |
| 63 | 603299 | 苏盐井神 | 32,800 | 221,400.00 | 0.51 |
| 64 | 600690 | 海尔智家 | 12,800 | 221,312.00 | 0.51 |
| 65 | 002582 | 好想你  | 24,300 | 220,158.00 | 0.51 |
| 66 | 600702 | 舍得酒业 | 7,800  | 212,004.00 | 0.49 |
| 67 | 002099 | 海翔药业 | 29,600 | 210,160.00 | 0.49 |
| 68 | 000651 | 格力电器 | 3,800  | 209,000.00 | 0.49 |
| 69 | 000537 | 广宇发展 | 30,200 | 208,984.00 | 0.49 |
| 70 | 601328 | 交通银行 | 34,019 | 208,196.28 | 0.48 |
| 71 | 600000 | 浦发银行 | 17,461 | 203,944.48 | 0.47 |
| 72 | 600015 | 华夏银行 | 26,103 | 200,993.10 | 0.47 |
| 73 | 600519 | 贵州茅台 | 200    | 196,800.00 | 0.46 |
| 74 | 600781 | 辅仁药业 | 17,800 | 196,334.00 | 0.46 |
| 75 | 600030 | 中信证券 | 8,192  | 195,051.52 | 0.45 |
| 76 | 002637 | 赞宇科技 | 27,800 | 194,878.00 | 0.45 |
| 77 | 600062 | 华润双鹤 | 15,360 | 193,689.60 | 0.45 |
| 78 | 000789 | 万年青  | 19,240 | 192,784.80 | 0.45 |
| 79 | 601818 | 光大银行 | 49,169 | 187,333.89 | 0.44 |
| 80 | 600887 | 伊利股份 | 5,599  | 187,062.59 | 0.43 |
| 81 | 002626 | 金达威  | 15,800 | 185,176.00 | 0.43 |
| 82 | 600665 | 天地源  | 47,100 | 185,103.00 | 0.43 |
| 83 | 000089 | 深圳机场 | 20,800 | 184,912.00 | 0.43 |
| 84 | 600410 | 华胜天成 | 16,500 | 177,045.00 | 0.41 |
| 85 | 600706 | 曲江文旅 | 15,000 | 176,100.00 | 0.41 |

|     |        |      |        |            |      |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 86  | 002439 | 启明星辰 | 6,400  | 172,160.00 | 0.40 |
| 87  | 002299 | 圣农发展 | 6,700  | 169,644.00 | 0.39 |
| 88  | 600322 | 天房发展 | 46,100 | 167,343.00 | 0.39 |
| 89  | 600585 | 海螺水泥 | 4,000  | 166,000.00 | 0.39 |
| 90  | 300543 | 朗科智能 | 7,800  | 164,970.00 | 0.38 |
| 91  | 000966 | 长源电力 | 29,000 | 164,430.00 | 0.38 |
| 92  | 002728 | 特一药业 | 9,700  | 161,408.00 | 0.37 |
| 93  | 000666 | 经纬纺机 | 12,800 | 159,360.00 | 0.37 |
| 94  | 002241 | 歌尔股份 | 17,800 | 158,242.00 | 0.37 |
| 95  | 300513 | 恒实科技 | 5,900  | 158,179.00 | 0.37 |
| 96  | 603538 | 美诺华  | 7,300  | 156,439.00 | 0.36 |
| 97  | 000999 | 华润三九 | 5,300  | 155,502.00 | 0.36 |
| 98  | 000705 | 浙江震元 | 23,200 | 155,208.00 | 0.36 |
| 99  | 002533 | 金杯电工 | 29,800 | 152,874.00 | 0.36 |
| 100 | 300657 | 弘信电子 | 6,700  | 152,760.00 | 0.35 |
| 101 | 002008 | 大族激光 | 4,400  | 151,272.00 | 0.35 |
| 102 | 300196 | 长海股份 | 16,500 | 150,480.00 | 0.35 |
| 103 | 002425 | 凯撒文化 | 22,800 | 147,516.00 | 0.34 |
| 104 | 002726 | 龙大肉食 | 13,490 | 146,771.20 | 0.34 |
| 105 | 300683 | 海特生物 | 4,800  | 145,056.00 | 0.34 |
| 106 | 002882 | 金龙羽  | 12,000 | 144,840.00 | 0.34 |
| 107 | 601377 | 兴业证券 | 21,300 | 143,562.00 | 0.33 |
| 108 | 300399 | 京天利  | 9,800  | 142,590.00 | 0.33 |
| 109 | 600276 | 恒瑞医药 | 2,160  | 142,560.00 | 0.33 |
| 110 | 000719 | 中原传媒 | 20,000 | 142,000.00 | 0.33 |
| 111 | 300677 | 英科医疗 | 8,800  | 141,328.00 | 0.33 |
| 112 | 603689 | 皖天然气 | 12,800 | 140,928.00 | 0.33 |
| 113 | 002790 | 瑞尔特  | 20,480 | 138,444.80 | 0.32 |
| 114 | 600361 | 华联综超 | 33,400 | 137,608.00 | 0.32 |
| 115 | 000895 | 双汇发展 | 5,500  | 136,895.00 | 0.32 |
| 116 | 600260 | 凯乐科技 | 6,800  | 135,864.00 | 0.32 |
| 117 | 000863 | 三湘印象 | 25,800 | 135,708.00 | 0.32 |
| 118 | 603199 | 九华旅游 | 6,100  | 135,603.00 | 0.31 |
| 119 | 600867 | 通化东宝 | 8,800  | 135,520.00 | 0.31 |
| 120 | 603839 | 安正时尚 | 11,000 | 135,300.00 | 0.31 |
| 121 | 300214 | 日科化学 | 22,100 | 135,252.00 | 0.31 |
| 122 | 601002 | 晋亿实业 | 19,100 | 134,846.00 | 0.31 |
| 123 | 600201 | 生物股份 | 8,570  | 134,463.30 | 0.31 |
| 124 | 600739 | 辽宁成大 | 9,200  | 133,768.00 | 0.31 |
| 125 | 300003 | 乐普医疗 | 5,800  | 133,516.00 | 0.31 |
| 126 | 600704 | 物产中大 | 24,400 | 132,248.00 | 0.31 |
| 127 | 603661 | 恒林股份 | 4,000  | 131,480.00 | 0.31 |
| 128 | 600469 | 风神股份 | 26,800 | 131,320.00 | 0.30 |

|     |        |      |        |            |      |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 129 | 000601 | 韶能股份 | 27,200 | 130,288.00 | 0.30 |
| 130 | 002508 | 老板电器 | 4,800  | 130,272.00 | 0.30 |
| 131 | 603508 | 思维列控 | 2,000  | 130,160.00 | 0.30 |
| 132 | 000686 | 东北证券 | 14,700 | 129,507.00 | 0.30 |
| 133 | 600535 | 天士力  | 7,800  | 129,090.00 | 0.30 |
| 134 | 000002 | 万科A  | 4,600  | 127,926.00 | 0.30 |
| 135 | 002454 | 松芝股份 | 24,400 | 126,636.00 | 0.29 |
| 136 | 600741 | 华域汽车 | 5,800  | 125,280.00 | 0.29 |
| 137 | 600004 | 白云机场 | 6,800  | 123,760.00 | 0.29 |
| 138 | 603577 | 汇金通  | 10,000 | 121,300.00 | 0.28 |
| 139 | 300230 | 永利股份 | 27,500 | 121,275.00 | 0.28 |
| 140 | 603100 | 川仪股份 | 13,100 | 120,389.00 | 0.28 |
| 141 | 002195 | 二三四五 | 30,940 | 120,356.60 | 0.28 |
| 142 | 002415 | 海康威视 | 4,300  | 118,594.00 | 0.28 |
| 143 | 600064 | 南京高科 | 11,000 | 117,810.00 | 0.27 |
| 144 | 603233 | 大参林  | 2,600  | 117,000.00 | 0.27 |
| 145 | 600229 | 城市传媒 | 15,400 | 115,654.00 | 0.27 |
| 146 | 600563 | 法拉电子 | 2,800  | 115,276.00 | 0.27 |
| 147 | 002223 | 鱼跃医疗 | 4,500  | 110,790.00 | 0.26 |
| 148 | 000887 | 中鼎股份 | 10,800 | 103,572.00 | 0.24 |
| 149 | 000423 | 东阿阿胶 | 2,600  | 103,532.00 | 0.24 |
| 150 | 300015 | 爱尔眼科 | 3,330  | 103,130.10 | 0.24 |
| 151 | 603328 | 依顿电子 | 9,800  | 100,646.00 | 0.23 |
| 152 | 600176 | 中国巨石 | 10,120 | 96,443.60  | 0.22 |
| 153 | 002705 | 新宝股份 | 8,000  | 92,000.00  | 0.21 |
| 154 | 600897 | 厦门空港 | 3,800  | 91,618.00  | 0.21 |
| 155 | 603520 | 司太立  | 3,920  | 90,552.00  | 0.21 |
| 156 | 600383 | 金地集团 | 7,400  | 88,282.00  | 0.21 |
| 157 | 000963 | 华东医药 | 3,240  | 84,110.40  | 0.20 |
| 158 | 600837 | 海通证券 | 5,800  | 82,302.00  | 0.19 |
| 159 | 300253 | 卫宁健康 | 5,800  | 82,244.00  | 0.19 |
| 160 | 603259 | 药明康德 | 900    | 78,012.00  | 0.18 |
| 161 | 600742 | 一汽富维 | 7,100  | 75,757.00  | 0.18 |
| 162 | 000726 | 鲁泰A  | 7,700  | 73,612.00  | 0.17 |
| 163 | 600919 | 江苏银行 | 9,800  | 71,148.00  | 0.17 |
| 164 | 600028 | 中国石化 | 12,677 | 69,343.19  | 0.16 |
| 165 | 600271 | 航天信息 | 3,000  | 69,150.00  | 0.16 |
| 166 | 603587 | 地素时尚 | 3,000  | 68,220.00  | 0.16 |
| 167 | 002394 | 联发股份 | 7,000  | 68,110.00  | 0.16 |
| 168 | 002294 | 信立泰  | 2,800  | 62,664.00  | 0.15 |
| 169 | 600258 | 首旅酒店 | 3,460  | 62,210.80  | 0.14 |
| 170 | 601607 | 上海医药 | 3,399  | 61,691.85  | 0.14 |
| 171 | 300243 | 瑞丰高材 | 6,050  | 59,169.00  | 0.14 |

|     |        |       |        |           |      |
|-----|--------|-------|--------|-----------|------|
| 172 | 603903 | 中持股份  | 3,500  | 56,630.00 | 0.13 |
| 173 | 300712 | 永福股份  | 4,550  | 55,965.00 | 0.13 |
| 174 | 600016 | 民生银行  | 8,800  | 55,880.00 | 0.13 |
| 175 | 600243 | 青海华鼎  | 11,300 | 53,788.00 | 0.12 |
| 176 | 603955 | 大千生态  | 3,400  | 53,210.00 | 0.12 |
| 177 | 603331 | 百达精工  | 3,200  | 53,088.00 | 0.12 |
| 178 | 603286 | 日盈电子  | 3,400  | 53,074.00 | 0.12 |
| 179 | 603139 | 康惠制药  | 3,000  | 53,040.00 | 0.12 |
| 180 | 002896 | 中大力德  | 1,900  | 52,896.00 | 0.12 |
| 181 | 600137 | 浪莎股份  | 3,600  | 52,884.00 | 0.12 |
| 182 | 603578 | 三星新材  | 2,700  | 52,758.00 | 0.12 |
| 183 | 603041 | 美思德   | 3,200  | 52,672.00 | 0.12 |
| 184 | 002473 | 圣莱达   | 6,400  | 52,480.00 | 0.12 |
| 185 | 002144 | 宏达高科  | 4,900  | 52,283.00 | 0.12 |
| 186 | 603926 | 铁流股份  | 4,200  | 51,870.00 | 0.12 |
| 187 | 600561 | 江西长运  | 7,900  | 51,666.00 | 0.12 |
| 188 | 603767 | 中马传动  | 6,800  | 51,612.00 | 0.12 |
| 189 | 002066 | 瑞泰科技  | 6,000  | 51,600.00 | 0.12 |
| 190 | 002105 | 信隆健康  | 11,200 | 51,408.00 | 0.12 |
| 191 | 601211 | 国泰君安  | 2,800  | 51,380.00 | 0.12 |
| 192 | 603725 | 天安新材  | 6,700  | 51,255.00 | 0.12 |
| 193 | 002620 | 瑞和股份  | 8,200  | 51,250.00 | 0.12 |
| 194 | 603269 | 海鸥股份  | 3,400  | 51,170.00 | 0.12 |
| 195 | 601088 | 中国神华  | 2,500  | 50,950.00 | 0.12 |
| 196 | 600493 | 凤竹纺织  | 8,300  | 50,879.00 | 0.12 |
| 197 | 002487 | 大金重工  | 11,900 | 50,694.00 | 0.12 |
| 198 | 600159 | 大龙地产  | 17,900 | 50,657.00 | 0.12 |
| 199 | 300112 | 万讯自控  | 6,300  | 50,274.00 | 0.12 |
| 200 | 000573 | 粤宏远 A | 15,000 | 50,250.00 | 0.12 |
| 201 | 000692 | 惠天热电  | 16,300 | 50,204.00 | 0.12 |
| 202 | 603238 | 诺邦股份  | 2,900  | 50,170.00 | 0.12 |
| 203 | 603488 | 展鹏科技  | 6,000  | 50,160.00 | 0.12 |
| 204 | 603029 | 天鹅股份  | 3,400  | 50,150.00 | 0.12 |
| 205 | 300591 | 万里马   | 8,300  | 50,049.00 | 0.12 |
| 206 | 603076 | 乐惠国际  | 2,000  | 49,940.00 | 0.12 |
| 207 | 600982 | 宁波热电  | 14,600 | 49,640.00 | 0.12 |
| 208 | 600791 | 京能置业  | 11,700 | 49,608.00 | 0.12 |
| 209 | 300491 | 通合科技  | 3,500  | 49,595.00 | 0.12 |
| 210 | 000548 | 湖南投资  | 11,100 | 49,395.00 | 0.11 |
| 211 | 000619 | 海螺型材  | 8,900  | 48,861.00 | 0.11 |
| 212 | 300521 | 爱司凯   | 4,800  | 48,624.00 | 0.11 |
| 213 | 603161 | 科华控股  | 3,300  | 48,114.00 | 0.11 |
| 214 | 300619 | 金银河   | 2,100  | 47,985.00 | 0.11 |



|     |        |      |        |           |      |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 215 | 601998 | 中信银行 | 7,800  | 46,566.00 | 0.11 |
| 216 | 300150 | 世纪瑞尔 | 10,100 | 46,056.00 | 0.11 |
| 217 | 002826 | 易明医药 | 4,500  | 45,945.00 | 0.11 |
| 218 | 000782 | 美达股份 | 10,100 | 44,541.00 | 0.10 |
| 219 | 000153 | 丰原药业 | 6,900  | 43,125.00 | 0.10 |
| 220 | 600051 | 宁波联合 | 6,700  | 41,473.00 | 0.10 |
| 221 | 000679 | 大连友谊 | 10,100 | 39,693.00 | 0.09 |
| 222 | 600019 | 宝钢股份 | 6,000  | 39,000.00 | 0.09 |
| 223 | 600660 | 福耀玻璃 | 1,500  | 34,095.00 | 0.08 |
| 224 | 601236 | 红塔证券 | 9,789  | 33,869.94 | 0.08 |
| 225 | 300782 | 卓胜微  | 272    | 29,626.24 | 0.07 |
| 226 | 603883 | 老百姓  | 500    | 29,240.00 | 0.07 |
| 227 | 601601 | 中国太保 | 800    | 29,208.00 | 0.07 |
| 228 | 600968 | 海油发展 | 7,638  | 27,114.90 | 0.06 |
| 229 | 002583 | 海能达  | 3,000  | 25,170.00 | 0.06 |
| 230 | 600048 | 保利地产 | 1,800  | 22,968.00 | 0.05 |
| 231 | 603867 | 新化股份 | 836    | 21,577.16 | 0.05 |
| 232 | 601698 | 中国卫通 | 5,051  | 19,799.92 | 0.05 |
| 233 | 300594 | 朗进科技 | 378    | 16,673.58 | 0.04 |
| 234 | 600340 | 华夏幸福 | 300    | 9,771.00  | 0.02 |
| 235 | 600606 | 绿地控股 | 1,300  | 8,879.00  | 0.02 |

## 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  | 000034 | 神州数码 | 740,966.00 | 2.02            |
| 2  | 000402 | 金融街  | 647,854.00 | 1.77            |
| 3  | 603919 | 金徽酒  | 589,969.00 | 1.61            |
| 4  | 603368 | 柳药股份 | 586,137.00 | 1.60            |
| 5  | 600985 | 淮北矿业 | 540,857.00 | 1.48            |
| 6  | 000921 | 海信家电 | 531,901.00 | 1.45            |
| 7  | 002543 | 万和电气 | 522,532.00 | 1.43            |
| 8  | 601588 | 北辰实业 | 518,525.00 | 1.42            |
| 9  | 002441 | 众业达  | 499,100.00 | 1.36            |
| 10 | 603198 | 迎驾贡酒 | 482,797.30 | 1.32            |
| 11 | 002746 | 仙坛股份 | 476,071.00 | 1.30            |
| 12 | 600295 | 鄂尔多斯 | 474,388.00 | 1.30            |
| 13 | 000936 | 华西股份 | 445,824.00 | 1.22            |
| 14 | 000411 | 英特集团 | 445,775.00 | 1.22            |
| 15 | 603369 | 今世缘  | 440,784.00 | 1.20            |

|    |        |      |            |      |
|----|--------|------|------------|------|
| 16 | 600073 | 上海梅林 | 428,594.60 | 1.17 |
| 17 | 002615 | 哈尔斯  | 420,473.84 | 1.15 |
| 18 | 600195 | 中牧股份 | 415,132.40 | 1.13 |
| 19 | 603777 | 来伊份  | 406,062.00 | 1.11 |
| 20 | 600657 | 信达地产 | 405,142.00 | 1.11 |

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  | 600352 | 浙江龙盛 | 1,066,511.00 | 2.91           |
| 2  | 300573 | 兴齐眼药 | 914,559.00   | 2.50           |
| 3  | 002100 | 天康生物 | 852,189.00   | 2.33           |
| 4  | 603636 | 南威软件 | 692,646.60   | 1.89           |
| 5  | 600702 | 舍得酒业 | 675,633.72   | 1.85           |
| 6  | 600706 | 曲江文旅 | 658,879.00   | 1.80           |
| 7  | 603208 | 江山欧派 | 658,696.00   | 1.80           |
| 8  | 600195 | 中牧股份 | 605,005.80   | 1.65           |
| 9  | 000402 | 金融街  | 601,424.00   | 1.64           |
| 10 | 000713 | 丰乐种业 | 592,613.00   | 1.62           |
| 11 | 002022 | 科华生物 | 555,897.00   | 1.52           |
| 12 | 000921 | 海信家电 | 518,405.00   | 1.42           |
| 13 | 300232 | 洲明科技 | 507,486.00   | 1.39           |
| 14 | 002099 | 海翔药业 | 502,652.00   | 1.37           |
| 15 | 002705 | 新宝股份 | 493,005.00   | 1.35           |
| 16 | 601588 | 北辰实业 | 489,614.00   | 1.34           |
| 17 | 000823 | 超声电子 | 487,438.00   | 1.33           |
| 18 | 000401 | 冀东水泥 | 465,647.43   | 1.27           |
| 19 | 600295 | 鄂尔多斯 | 464,319.00   | 1.27           |
| 20 | 600756 | 浪潮软件 | 443,903.00   | 1.21           |

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 | 51,076,164.57 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 55,985,203.24 |

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

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      | 259,792.00 | 0.60         |
| 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） | -          | -            |
| 8  | 同业存单      | -          | -            |
| 9  | 其他        | -          | -            |
| 10 | 合计        | 259,792.00 | 0.60         |

## 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

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  | 019611 | 19 国债 01 | 2,600 | 259,792.00 | 0.60         |

## 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

本基金采取套期保值的方式参与股指期货的投资交易，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。

## 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除哈尔斯（证券代码 002615）、兴业银行（证券代码 601166）外其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

#### 1、哈尔斯（证券代码 002615）

根据 2018 年 9 月 21 日发布的相关公告，该证券发行人因重大事故，被安监局处以罚款。

#### 2、兴业银行（证券代码 601166）

根据发布的相关公告，该证券发行人在报告期内因违规经营、未依法履行职责多次受到监管机构的处罚。

对上述证券的投资决策程序的说明：本基金投资上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

### 7.12.2

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   | 6,962.91  |
| 2  | 应收证券清算款 | 39,107.76 |
| 3  | 应收股利    | -         |
| 4  | 应收利息    | 3,149.74  |
| 5  | 应收申购款   | 4,205.40  |
| 6  | 其他应收款   | -         |
| 7  | 待摊费用    | -         |
| 8  | 其他      | -         |
| 9  | 合计      | 53,425.81 |

### 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 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末投资前十名股票中不存在流通受限情况。

## § 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

| 持有人户数<br>(户) | 户均持有的基金<br>份额 | 持有人结构         |            |               |            |
|--------------|---------------|---------------|------------|---------------|------------|
|              |               | 机构投资者         |            | 个人投资者         |            |
|              |               | 持有份额          | 占总份<br>额比例 | 持有份额          | 占总份<br>额比例 |
| 1,462        | 30,749.35     | 10,000,450.02 | 22.25%     | 34,955,097.62 | 77.75%     |

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 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 | 1,181,000.02 | 2.6270%  |

### 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                             | 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 | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | >100              |

### 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目          | 持有份额总数        | 持有份额占基金总份额比例（%） | 发起份额总数        | 发起份额占基金总份额比例（%） | 发起份额承诺持有期限 |
|-------------|---------------|-----------------|---------------|-----------------|------------|
| 基金管理人固有资金   | 10,000,450.02 | 22.25           | 10,000,450.02 | 22.25           | 3 年        |
| 基金管理人高级管理人员 | 0.00          | 0.00            | 0.00          | 0.00            | -          |
| 基金经理等人员     | 1,131,743.71  | 2.52            | 1,001,199.05  | 2.23            | 3 年        |
| 基金管理人股东     | 0.00          | 0.00            | 0.00          | 0.00            | -          |
| 其他          | 0.00          | 0.00            | 0.00          | 0.00            | -          |
| 合计          | 11,132,193.73 | 24.76           | 11,001,649.07 | 24.47           | -          |

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                                |                |
|--------------------------------|----------------|
| 基金合同生效日(2016 年 3 月 15 日)基金份额总额 | 243,093,644.61 |
| 本报告期期初基金份额总额                   | 49,621,355.20  |
| 本报告期基金总申购份额                    | 7,080,752.92   |
| 减：报告期基金总赎回份额                   | 11,746,560.48  |
| 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                   | 44,955,547.64  |

## § 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未发生重大人事变动。

2019 年 5 月，陈四清先生因工作调动，辞去中国银行股份有限公司董事长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

## 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、基金托管业务的重大诉讼事项。

## 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 |    |
| 广发证券   | 1      | 21,074,420.97 | 19.82%       | 19,625.07 | 19.93%     | -  |
| 中信证券   | 2      | 16,883,976.83 | 15.88%       | 15,724.14 | 15.97%     | -  |
| 中信建投证券 | 6      | 16,057,482.34 | 15.10%       | 14,954.87 | 15.19%     | -  |
| 招商证券   | 1      | 9,573,098.01  | 9.00%        | 8,915.18  | 9.05%      | -  |
| 海通证券   | 3      | 6,364,788.66  | 5.99%        | 5,927.43  | 6.02%      | -  |
| 兴业证券   | 2      | 5,795,030.17  | 5.45%        | 5,397.21  | 5.48%      | -  |
| 方正证券   | 3      | 3,673,120.28  | 3.45%        | 3,420.83  | 3.47%      | -  |
| 国泰君安证券 | 5      | 3,375,648.43  | 3.17%        | 3,143.65  | 3.19%      | -  |

|            |   |              |       |          |       |   |
|------------|---|--------------|-------|----------|-------|---|
| 申万宏源       | 4 | 3,204,351.68 | 3.01% | 2,984.30 | 3.03% | - |
| 银河证券       | 1 | 3,176,401.00 | 2.99% | 2,958.16 | 3.00% | - |
| 中金公司       | 2 | 2,962,661.50 | 2.79% | 2,759.03 | 2.80% | - |
| 中泰证券       | 2 | 2,754,593.86 | 2.59% | 2,014.50 | 2.05% | - |
| 东方证券       | 1 | 2,642,140.71 | 2.48% | 2,460.60 | 2.50% | - |
| 国信证券       | 2 | 2,099,933.93 | 1.97% | 1,955.58 | 1.99% | - |
| 太平洋证<br>券  | 2 | 1,838,948.21 | 1.73% | 1,712.70 | 1.74% | - |
| 天风证券       | 2 | 1,794,548.00 | 1.69% | 1,671.21 | 1.70% | - |
| 东北证券       | 1 | 945,299.90   | 0.89% | 880.38   | 0.89% | - |
| 西部证券       | 1 | 892,757.21   | 0.84% | 831.35   | 0.84% | - |
| 华泰证券       | 4 | 809,716.00   | 0.76% | 754.02   | 0.77% | - |
| 光大证券       | 1 | 420,288.00   | 0.40% | 391.47   | 0.40% | - |
| 安信证券       | 2 | -            | -     | -        | -     | - |
| 长城证券       | 2 | -            | -     | -        | -     | - |
| 长江证券       | 2 | -            | -     | -        | -     | - |
| 大通证券       | 1 | -            | -     | -        | -     | - |
| 第一创业       | 3 | -            | -     | -        | -     | - |
| 东兴证券       | 3 | -            | -     | -        | -     | - |
| 国金证券       | 1 | -            | -     | -        | -     | - |
| 华安证券       | 1 | -            | -     | -        | -     | - |
| 华创证券       | 2 | -            | -     | -        | -     | - |
| 平安证券       | 3 | -            | -     | -        | -     | - |
| 瑞信方正       | 2 | -            | -     | -        | -     | - |
| 西藏东方<br>财富 | 1 | -            | -     | -        | -     | - |
| 新时代证<br>券  | 1 | -            | -     | -        | -     | - |
| 信达证券       | 2 | -            | -     | -        | -     | - |
| 中投证券       | 2 | -            | -     | -        | -     | - |
| 中银国际<br>证券 | 3 | -            | -     | -        | -     | - |

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

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 |              | 债券回购交易 |                | 权证交易 |              |
|------|------|--------------|--------|----------------|------|--------------|
|      | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额   | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
|      |      |              |        |                |      |              |



|            |            |        |   | 比例 |   |   |
|------------|------------|--------|---|----|---|---|
| 广发证券       | 5,321.00   | 1.65%  | - | -  | - | - |
| 中信证券       | 19,494.36  | 6.06%  | - | -  | - | - |
| 中信建投<br>证券 | 12,656.52  | 3.93%  | - | -  | - | - |
| 招商证券       | -          | -      | - | -  | - | - |
| 海通证券       | 8,422.50   | 2.62%  | - | -  | - | - |
| 兴业证券       | -          | -      | - | -  | - | - |
| 方正证券       | -          | -      | - | -  | - | - |
| 国泰君安<br>证券 | 6,720.00   | 2.09%  | - | -  | - | - |
| 申万宏源       | -          | -      | - | -  | - | - |
| 银河证券       | 9,766.80   | 3.03%  | - | -  | - | - |
| 中金公司       | 79,848.00  | 24.81% | - | -  | - | - |
| 中泰证券       | -          | -      | - | -  | - | - |
| 东方证券       | -          | -      | - | -  | - | - |
| 国信证券       | -          | -      | - | -  | - | - |
| 太平洋证<br>券  | 179,647.00 | 55.81% | - | -  | - | - |
| 天风证券       | -          | -      | - | -  | - | - |
| 东北证券       | -          | -      | - | -  | - | - |
| 西部证券       | -          | -      | - | -  | - | - |
| 华泰证券       | -          | -      | - | -  | - | - |
| 光大证券       | -          | -      | - | -  | - | - |
| 安信证券       | -          | -      | - | -  | - | - |
| 长城证券       | -          | -      | - | -  | - | - |
| 长江证券       | -          | -      | - | -  | - | - |
| 大通证券       | -          | -      | - | -  | - | - |
| 第一创业       | -          | -      | - | -  | - | - |
| 东兴证券       | -          | -      | - | -  | - | - |
| 国金证券       | -          | -      | - | -  | - | - |
| 华安证券       | -          | -      | - | -  | - | - |
| 华创证券       | -          | -      | - | -  | - | - |
| 平安证券       | -          | -      | - | -  | - | - |
| 瑞信方正       | -          | -      | - | -  | - | - |
| 西藏东方<br>财富 | -          | -      | - | -  | - | - |
| 新时代证<br>券  | -          | -      | - | -  | - | - |
| 信达证券       | -          | -      | - | -  | - | - |
| 中投证券       | -          | -      | - | -  | - | - |
| 中银国际<br>证券 | -          | -      | - | -  | - | - |

## 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基金估值变更的公告                                    | 中国证券报及基金管理人网站 | 2019-01-03 |
| 2  | 招商量化精选股票型发起式证券投资基金 2018 年第 4 季度报告                          | 中国证券报及基金管理人网站 | 2019-01-22 |
| 3  | 招商量化精选股票型发起式证券投资基金 2018 年度报告摘要                             | 中国证券报及基金管理人网站 | 2019-03-28 |
| 4  | 招商量化精选股票型发起式证券投资基金 2018 年度报告                               | 中国证券报及基金管理人网站 | 2019-03-28 |
| 5  | 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 | 中国证券报及基金管理人网站 | 2019-04-01 |
| 6  | 招商基金管理有限公司关于旗下基金估值变更的公告                                    | 中国证券报及基金管理人网站 | 2019-04-08 |
| 7  | 招商量化精选股票型发起式证券投资基金 2019 年第 1 季度报告                          | 中国证券报及基金管理人网站 | 2019-04-18 |
| 8  | 招商量化精选股票型发起式证券投资基金更新的招募说明书（二零一九年第一号）                       | 中国证券报及基金管理人网站 | 2019-04-26 |
| 9  | 招商量化精选股票型发起式证券投资基金更新的招募说明书摘要（二零一九年第一号）                     | 中国证券报及基金管理人网站 | 2019-04-26 |
| 10 | 招商基金旗下部分基金增加阳光人寿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               | 中国证券报及基金管理人网站 | 2019-05-20 |
| 11 | 招商基金旗下部分基金增加华瑞保险等机构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            | 中国证券报及基金管理人网站 | 2019-06-03 |
| 12 | 关于招商基金旗下部分基金增加汇林保大为代销机构并参与其费率优惠活动的公告                       | 中国证券报及基金管理人网站 | 2019-06-10 |
| 13 | 招商基金管理有限公司关于旗下基金参与科创板股票投资及相关风险揭示的公告                        | 中国证券报及基金管理人网站 | 2019-06-22 |
| 14 | 招商基金管理有限公司关于旗下部分基金增加广发银行为代销机构的公告                           | 中国证券报及基金管理人网站 | 2019-06-27 |

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

## 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 |                         |      |      | 报告期末持有基金情况 |      |
|-------|----------------|-------------------------|------|------|------------|------|
|       | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额       | 持有份额 |

|  |   |   |               |   |   |               |        |
|--|---|---|---------------|---|---|---------------|--------|
| 机构   | 1 | 20190101-20190312,20190326-20190328,20190402-20190630 | 10,000,450.02 | - | - | 10,000,450.02 | 22.25% |
| 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。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会批准设立招商基金管理有限公司的文件；
- 2、中国证券监督管理委员会批准招商量化精选股票型发起式证券投资基金设立的文件；
- 3、《招商量化精选股票型发起式证券投资基金基金合同》；
- 4、《招商量化精选股票型发起式证券投资基金托管协议》；
- 5、《招商量化精选股票型发起式证券投资基金招募说明书》；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照。

### 12.2 存放地点

招商基金管理有限公司

地址：中国深圳深南大道 7088 号招商银行大厦

### 12.3 查阅方式

上述文件可在招商基金管理有限公司互联网站上查阅，或者在营业时间内到招商基金管理有限公司查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人招商基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-887-9555

网址：<http://www.cmfchina.com>

招商基金管理有限公司

2019 年 8 月 26 日