

# 招商优质成长混合型证券投资基金 (LOF) 2023 年中期报告

2023 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：中信银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 30 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。本中期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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 29 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 2023 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.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
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.....	8
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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告.....	39
7.1 期末基金资产组合情况.....	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	39
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.....	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	44
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.....	45
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.....	45
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.....	45
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.....	45
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	45

7.12 投资组合报告附注.....	46
§8 基金份额持有人信息.....	47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	47
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	47
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	48
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	48
§9 开放式基金份额变动.....	48
§10 重大事件揭示.....	48
10.1 基金份额持有人大会决议.....	48
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.....	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	49
10.4 基金投资策略的改变.....	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	49
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.....	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	49
10.8 其他重大事件.....	50
§11 备查文件目录.....	51
11.1 存放地点.....	51
11.2 查阅方式.....	52

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	招商优质成长混合型证券投资基金(LOF)
基金简称	招商优质成长混合（LOF）
场内简称	招商成长 LOF
基金主代码	161706
交易代码	161706
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）
基金合同生效日	2005 年 11 月 17 日
基金管理人	招商基金管理有限公司
基金托管人	中信银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	597,656,327.16 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2005 年 12 月 9 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	精选受益于中国经济成长的优秀企业，进行积极主动的投资管理，在控制风险的前提下为基金份额持有人谋求长期、稳定的资本增值。
投资策略	<p>本基金将应用招商基金从 ING 引进的投资技术和投资模型，其中包括严谨的投资管理流程、市场量表的资产配置技术、股票筛选模型、SRS 股票分析系统、PFG 组合配置模型、EMA 风险管理模型等。</p> <p>本基金股票、存托凭证投资比例为 75%-95%，债券及现金投资比例为 5%-25%（其中，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于 5%）。本基金为混合型基金，在一般情况下，本基金不太进行大类资产配置，股票投资保持相对较高的比例。在有必要进行资产配置时，本基金管理人将借鉴 ING 的成熟技术，采取市场量表的资产配置工具。市场量表是 ING 在资产配置过程中普遍采用的方法。它通过对影响股票市场和债券市场的基本因素和市场因素的分析，对股票市场和债券市场趋势作出更全面的评估。本基金拟采用的市场量表中，基本分析包括一系列反映宏观经济的定量指标和反映市场投资价值的定量指标，其目的在于判断股票市场和债券市场的投资价值；市场分析通过对股票市场和债券市场驱动因素的分析，以及分析股票市场与债券市场的相对投资价值分析，对股票市场和债券市场的趋势作出评估。市场量表的结论是采用定性的评分方法，资产配置比例将根据评分结果得出。</p> <p>本基金的股票资产将投资于招商基金认为具有优质成长性并且较高相对投资价值的股票。本基金对优质成长股票的筛选主要关注的因素包括：公司是否具备良好的治理结构及长期的核心竞争力，公司是否有持续的经济利润的增长，公司股票的估值是否合理等等。</p> <p>在本基金认为股票市场投资风险非常大时，将会有一定的债券投资比例。</p>

	<p>本基金的债券投资采用主动的投资管理，获得与风险相匹配的收益率，同时保证组合的流动性满足正常的现金流的需要。与股票组合构建类似，本基金债券组合构建也采取团队投资的决策方式，并在借鉴 ING 海外债券投资管理的先进经验与方法的基础上，结合我国债券市场的具体特点，形成稳健安全、积极主动的债券投资流程。本基金将采用自下而上的方法，利用收益率曲线的形状变动、单个债券的收益率和基准收益率曲线的偏离选择投资券种；同时本基金还将通过发现市场的不均衡进行无风险套利，增加组合收益。</p> <p>在控制风险的前提下，本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数*95%+同业存款利率*5%
风险收益特征	本基金属于主动管理的混合型基金，精选价值被低估的具有优质成长性的个股进行积极投资，属于预期风险和预期收益相对较高的证券投资基金品种，本基金力争在严格控制风险的前提下谋求实现基金资产长期稳定增值。

### 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	中信银行股份有限公司
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	95558
传真	0755-83196475	010-85230024
注册地址	深圳市福田区深南大道 7088 号	北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层
办公地址	深圳市福田区深南大道 7088 号	北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层
邮政编码	518040	100020
法定代表人	王小青	朱鹤新

### 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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.cmfchina.com">http://www.cmfchina.com</a>
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023年1月1日 - 2023年6月30日)
本期已实现收益	109,214,013.46
本期利润	-47,645,431.34
加权平均基金份额本期利润	-0.0790
本期加权平均净值利润率	-2.88%
本期基金份额净值增长率	-3.07%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年6月30日)
期末可供分配利润	1,302,704,166.62
期末可供分配基金份额利润	2.1797
期末基金资产净值	1,561,394,541.75
期末基金份额净值	2.6125
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)
基金份额累计净值增长率	878.95%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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。

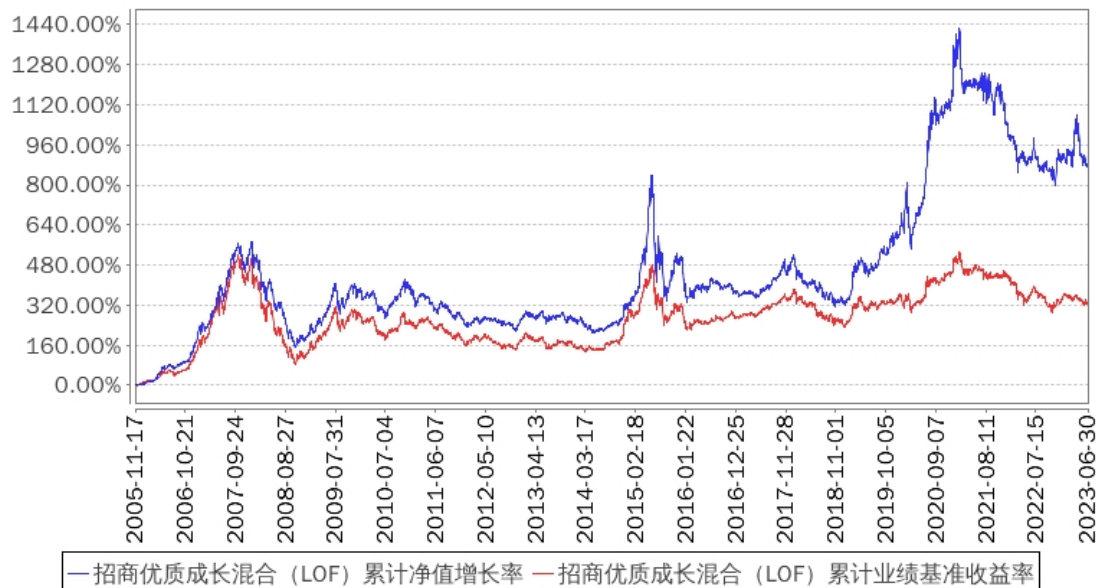
#### 3.2 基金净值表现

##### 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	-2.43%	0.81%	1.10%	0.83%	-3.53%	-0.02%
过去三个月	-7.55%	1.68%	-4.88%	0.79%	-2.67%	0.89%
过去六个月	-3.07%	1.47%	-0.69%	0.80%	-2.38%	0.67%
过去一年	-10.12%	1.31%	-13.60%	0.94%	3.48%	0.37%
过去三年	5.88%	1.43%	-7.07%	1.14%	12.95%	0.29%
自基金合同生效起至今	878.95%	1.64%	327.57%	1.57%	551.38%	0.07%

### 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

招商优质成长混合（LOF）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人资格；2004 年获得全国社保基金投资管理人资格；同时拥有合格境内机构投资者（QDII）业务资格、专户理财（特定客户资产管理业务）资格、公募基金投顾业务资格，在主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、海外投资、FOF 投资等领域全面布局。

#### 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		
贾成东	本基金基金经理	2017 年 6 月 29 日	-	15	男，理学硕士。2008 年加入国泰基金管理有限公司，先后任宏观策略研究员、基金经理；2015 年加入招商基金管理有限公司，曾任招商安达灵活配置混合型



					证券投资基金、招商安盈保本混合型证券投资基金、招商研究优选股票型证券投资基金、招商财经大数据策略股票型证券投资基金基金经理，现任投资管理四部专业总监兼招商行业精选股票型证券投资基金、招商优质成长混合型证券投资基金(LOF)、招商科技动力 3 个月滚动持有股票型证券投资基金、招商产业精选股票型证券投资基金、招商景气精选股票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中国证监会《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》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。

基金管理人按照法规要求，对连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合间的同向交易的交易价差进行分析，相关投资组合经理也对分析中发现的价格差异次数占比超过正常范围的情况进行了合理性解释。报告期内，公司旗下投资组合同向交易价差分析中未发现异常情形。

### 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,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%的交易共有 18 次,其中 14 次为旗下指数及量化组合因投资策略需要而发生反向交易,4 次为不同基金经理管理的基金因投资策略不同而发生的反向交易。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

2023 年上半年中国平稳度过疫情政策优化期,宏观经济实现了恢复式增长。其中一季度经济发展呈现回升向好态势,主要受四方面因素推动:一是疫情政策平稳优化,促消费政策持续发力,市场销售明显回升,尤其服务性消费改善明显,消费对经济增长拉动作用显著增强。二是居民积压购房需求集中释放,推动市场交易量和房地产开发投资增速降幅收窄。三是地方政府按照“起步即冲刺、开局即决战”原则加快项目落地,专项债发行前置,金融支持力度加强,基建投资增速保持在较高水平,继续发挥托底作用。四是出口产能加速恢复,市场多元化初见成效,特别是新能源汽车增速显著,使出口表现出较强韧性。但进入二季度之后,经济恢复速度放缓,各项指标大都见顶回落,复苏“强预期”让位于“弱现实”。原因包括以下几个方面:一是政策进入观望时段。今年 4 月 28 日中共中央政治局会议将工作重点放在“加快建设以实体经济为支撑的现代产业体系”,货币政策转向“总量适度、节奏平稳”。二是受就业压力加大、收入增速放缓等影响,居民消费能力受损,耐用品消费增速明显走低。三是中小企业对未来预期不稳,扩产意愿不足。四是房地产积压需求释放殆尽,受市场预期扭转、加杠杆意愿薄弱、低线城市透支等因素抑制,新增购房需求下降,市场转向降温。五是出口受外需放缓和地缘政治等因素影响转向低迷。海外经济比去年末市场预期的要强,我们看到美国的零售数据、就业、薪资等数据都表明美国经济依然健康,一季度美国小银行对经济的影响微乎其微,欧洲的数据开始走弱,但也还没到衰退阶段。困扰海外各央行最大的通胀问题在高基数的影响下回落,但显然回落的幅度还远远不够,因此央行们还是在加息通道中。

市场回顾:

债券市场在上半年走了个牛市,除了 1 月受经济复苏影响 10Y 国债收益率有所上行外,其余时间基本都是单边下行,收益率从 2.93%下降到 2.6%。下行最快的阶段出现在 4 月份地产销售开始走弱叠加其他经济数据也开始走弱,6 月政策预期的变化对市场有所扰动。股票

市场和经济一样走了个先上后下，年初各行业都出现反弹，市场全面上涨，但随着经济动能的减退市场也迎来了一波下跌。二季度开始，在经济不景气的情况下各种热点主题频发，从 AI 到中特估、机器人、自动驾驶都迎来了一波上涨。上半年，通信、传媒、计算机受益于 ChatGPT 在海外的爆发表现较好，此外家电由于销售持续超预期表现也不错，其余板块总的来说偏弱。截止半年末，上证综指录得 3.65% 的涨幅，创业板下跌 5.61%。

基金操作回顾：

本基金的主要配置资产为股票和债券。2023 年上半年，我们严格遵照基金合同的相关约定，按照既定的投资流程进行了规范运作。权益部分我们在 3 月积极参与了 AI，并在 4 月下旬逐步兑现，继而基于防御性超配银行和出行产业链。债券部分我们主要持有部分国债。

#### 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-3.07%，同期业绩基准增长率为-0.69%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2023 年下半年我们认为市场的走势重新回归至基本面，当前主要矛盾始终围绕经济复苏的方向与结构，在修复式增长的背景下，下半年需要关注相关扩内需政策出台以提振市场信心。

政策重心依然聚焦产业结构升级和扩大内需。7 月是增量政策出台的窗口期，一方面稳定居民消费预期、在提升居民消费意愿等方面可发挥积极作用；另一方面帮助扶持地方支柱产业，有利于扩大企业营收。另外，除了加快地方政府专项债券发行等常规操作外，政策性开发性金融工具、特别国债、长期建设国债也是潜在的增量政策选项。

在此背景下，我们看好顺周期方向，特别是高分红标的，一是估值便宜，二是盈利底部改善，包括银行保险、地产链、消费等。此外，下半年专项债发行节奏加快、基建也会成为经济的推手，一些基建相关的方向也会有机会。海外方面，我们认为最重要的还是跟踪美国的数据，预判衰退的拐点很难，只能仔细跟踪，美国经济的拐点对全球资产定价都会有很大影响。短期我们认为衰退的风险不大，因此在中国复苏叠加美国经济不错的状态下，原油的表现会不错。长期来看，黄金依然是买点，当软着陆叙事结束，通胀预期重来后，黄金价格会继续上涨。对于债券市场，我们认为风险在加大，目前性价比较低。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金的估值业务严格按照相关的法律法规、基金合同以及《招商基金管理有限公司基金估值委员会管理制度》进行。基金核算部负责日常的基金资产的估值业务，执行基金估值政策。另外，公司设立由投资和研究部门、风险管理部、基金核算部、法律合规部负责人和基金经理代表组成的估值委员会。公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业

胜任能力和相关工作经历。公司估值委员会主要负责制定、修订和完善基金估值政策和程序，定期评价现有估值政策和程序的适用性及对估值程序执行情况进行监督。

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

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

#### 4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金未发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对招商优质成长混合型证券投资基金(LOF)2023

年上半年的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

## 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

本托管人认为，招商基金管理有限公司在招商优质成长混合型证券投资基金（LOF）的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

## 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，招商基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的 2023 年中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

# § 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：招商优质成长混合型证券投资基金(LOF)

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	158,165,993.29	44,007,756.98
结算备付金		8,613,533.19	6,020,063.29
存出保证金		1,119,260.44	977,845.38
交易性金融资产	6.4.7.2	1,398,871,725.46	1,590,147,181.12
其中：股票投资		1,307,862,314.50	1,520,160,394.82
基金投资		-	-
债券投资		91,009,410.96	69,986,786.30
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-

买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	1,552,517.82
应收股利		-	-
应收申购款		213,633.13	1,371,658.86
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		1,566,984,145.51	1,644,077,023.45
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 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		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		458,217.28	1,127,544.13
应付管理人报酬		1,951,521.28	2,084,300.63
应付托管费		325,253.54	347,383.44
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	2,854,611.66	1,862,636.95
负债合计		5,589,603.76	5,421,865.15
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	258,690,375.13	263,155,916.35
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	1,302,704,166.62	1,375,499,241.95
净资产合计		1,561,394,541.75	1,638,655,158.30
负债和净资产总计		1,566,984,145.51	1,644,077,023.45

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.6125 元，基金份额总额 597,656,327.16 份。

## 6.2 利润表

会计主体：招商优质成长混合型证券投资基金(LOF)

本报告期：2023年1月1日至2023年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2023年1月1日至 2023年6月30日	上年度可比期间2022 年1月1日至2022年6 月30日
一、营业总收入		-33,131,404.60	-91,985,625.32
1.利息收入		502,837.29	1,011,169.59
其中：存款利息收入	6.4.7.9	502,837.29	981,196.16
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息 收入		-	-
买入返售金融资产 收入		-	29,973.43
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-” 填列）		123,170,008.37	-98,083,914.77
其中：股票投资收益	6.4.7.10	117,164,029.03	-100,272,585.60
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	674,213.70	706,704.46
资产支持证券投资 收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	5,331,765.64	1,481,966.37
以摊余成本计量的 金融资产终止确认产生的 收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.16	-156,859,444.80	5,009,758.24
4.汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.17	55,194.54	77,361.62
减：二、营业总支出		14,514,026.74	14,929,809.47
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	12,336,463.64	12,698,527.05
2.托管费	6.4.10.2.2	2,056,077.27	2,116,421.20
3.销售服务费		-	-
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-

6.信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7.税金及附加		-	0.16
8.其他费用	6.4.7.19	121,485.83	114,861.06
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-47,645,431.34	-106,915,434.79
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-47,645,431.34	-106,915,434.79
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-47,645,431.34	-106,915,434.79

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：招商优质成长混合型证券投资基金(LOF)

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	263,155,916.35	-	1,375,499,241.95	1,638,655,158.30
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	263,155,916.35	-	1,375,499,241.95	1,638,655,158.30
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-4,465,541.22	-	-72,795,075.33	-77,260,616.55
（一）、综合收益总额	-	-	-47,645,431.34	-47,645,431.34
（二）、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）	-4,465,541.22	-	-25,149,643.99	-29,615,185.21
其中：1.基金申购款	9,913,778.04	-	53,667,205.22	63,580,983.26
2.基金赎回款	-14,379,319.26	-	-78,816,849.21	-93,196,168.47
（三）、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）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	258,690,375.13	-	1,302,704,166.62	1,561,394,541.75



项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	268,217,111.09	-	1,638,732,105.37	1,906,949,216.46
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	268,217,111.09	-	1,638,732,105.37	1,906,949,216.46
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-2,270,714.69	-	-118,866,518.22	-121,137,232.91
（一）、综合收益总额	-	-	-106,915,434.79	-106,915,434.79
（二）、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）	-2,270,714.69	-	-11,951,083.43	-14,221,798.12
其中：1.基金申购款	14,483,934.58	-	78,469,288.62	92,953,223.20
2.基金赎回款	-16,754,649.27	-	-90,420,372.05	-107,175,021.32
（三）、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）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	265,946,396.40	-	1,519,865,587.15	1,785,811,983.55

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：

\_\_\_\_\_ 徐勇 \_\_\_\_\_ 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

招商优质成长混合型证券投资基金(LOF) (原名招商优质成长股票型证券投资基金(LOF)，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》、《招商优质成长股票型证券投资基金(LOF)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”)证监基金字[2005]137号文批准公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限为不定期，首次设立募集基金份额为653,405,124.62份，经德勤华永会计师事务所有限公司验证，并出具了编号为德师报(验)字(05)第0044号验资报告。基金合同于2005年11月17日正式生效。本基金因自2007年

7月1日起执行财政部于2006年2月15日颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”),于2007年9月28日公告了修改后的基金合同(以下简称“基金合同”)。本基金的基金管理人为招商基金管理有限公司,基金托管人为中信银行股份有限公司(以下简称“中信银行”)。本基金于2015年7月27日起更名为招商优质成长混合型证券投资基金(LOF)。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上字[2005]第100号文审核同意,本基金67,790,448份基金份额于2005年12月9日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外,基金份额持有人可通过将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《招商基金管理有限公司关于招商优质成长股票型证券投资基金(LOF)基金份额拆分比例的公告》,本基金管理人于2007年3月22日对本基金进行基金份额拆分。根据拆分前基金份额净值和公告的基金份额拆分比例计算公式,基金份额拆分比例为1:2.310328237(保留到小数点后9位),拆分后的基金份额净值为1.0000元。本基金注册登记机构于2007年3月23日对各基金份额持有人经重新计算的基金份额进行了变更登记。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、截至报告期末最新公告的基金合同及《招商优质成长混合型证券投资基金(LOF)更新的招募说明书》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,包括国内依法公开发行上市的股票、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中,股票的主要投资对象是本基金的基金管理人认为具有良好盈利成长性,同时价值被市场低估的具有较高相对投资价值的股票。债券的主要投资对象是本基金的基金管理人认为具有相对投资价值的固定收益品种,包括国债、金融债、企业(公司)债与可转换债等。基金的投资组合为:股票投资占基金资产的比例为75%-95%,债券及现金投资比例为5%-25%(其中,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于5%,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)。本基金至少有80%以上的非现金基金资产将投资于本基金名称所显示的投资方向。本基金的业绩比较基准为沪深300指数 $\times$ 95%+同业存款利率 $\times$ 5%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 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 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2023 年 1 月 1 日至 2023 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

本基金本报告期间未发生重大会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继续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的公告》、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资管产品运营业务，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)对于基金从事A股买卖，出让方按0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，对受让方不再缴纳印花税。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	158,165,993.29
等于：本金	158,138,374.97
加：应计利息	27,618.32
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	158,165,993.29

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	1,364,095,594.83	-	1,307,862,314.50	-56,233,280.33	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	-	
	银行间市场	89,734,620.00	981,410.96	91,009,410.96	293,380.00
	合计	89,734,620.00	981,410.96	91,009,410.96	293,380.00

资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,453,830,214.83	981,410.96	1,398,871,725.46	-55,939,900.33

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

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 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,934.22
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	2,752,048.55
其中：交易所市场	2,751,848.55
银行间市场	200.00
应付利息	-
预提费用	100,628.89
合计	2,854,611.66

### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	607,973,059.00	263,155,916.35
本期申购	22,903,935.78	9,913,778.04
本期赎回（以“-”号填列）	-33,220,667.62	-14,379,319.26
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	597,656,327.16	258,690,375.13

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。

#### 6.4.7.8 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	1,392,624,726.40	-17,125,484.45	1,375,499,241.95
本期利润	109,214,013.46	-156,859,444.80	-47,645,431.34
本期基金份额交易产生的变动数	-24,318,093.32	-831,550.67	-25,149,643.99
其中：基金申购款	54,466,566.09	-799,360.87	53,667,205.22
基金赎回款	-78,784,659.41	-32,189.80	-78,816,849.21
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,477,520,646.54	-174,816,479.92	1,302,704,166.62

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	468,373.14
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	27,546.07
其他	6,918.08
合计	502,837.29

#### 6.4.7.10 股票投资收益

##### 6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	117,164,029.03
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	117,164,029.03

##### 6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	2,731,591,308.90
减：卖出股票成本总额	2,606,372,127.81
减：交易费用	8,055,152.06
买卖股票差价收入	117,164,029.03

##### 6.4.7.10.3 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。

#### 6.4.7.10.4 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。

#### 6.4.7.10.5 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内无证券出借差价收入。

### 6.4.7.11 债券投资收益

#### 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	674,413.70
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-200.00
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	674,213.70

#### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	-
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	-
减：应计利息总额	-
减：交易费用	200.00
买卖债券差价收入	-200.00

#### 6.4.7.11.3 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。

#### 6.4.7.11.4 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。

### 6.4.7.12 资产支持证券投资收益

#### 6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内无买卖资产支持证券差价收入。

#### 6.4.7.12.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券赎回差价收入。

#### 6.4.7.12.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券申购差价收入。

### 6.4.7.13 贵金属投资收益

#### 6.4.7.13.1 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。

#### 6.4.7.13.2 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。

#### 6.4.7.13.3 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。

#### 6.4.7.13.4 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。

### 6.4.7.14 衍生工具收益

#### 6.4.7.14.1 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。

#### 6.4.7.14.2 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。

### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	5,331,765.64
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	5,331,765.64

### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-156,859,444.80



——股票投资	-157,147,084.80
——债券投资	287,640.00
——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	-156,859,444.80

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	55,194.54
合计	55,194.54

#### 6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	41,121.52
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	2,256.94
其他	18,600.00
合计	121,485.83

#### 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

截至财务报告批准报出日，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
中信银行股份有限公司	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

注：基金的主要关联方包含基金管理人、基金管理人的股东及子公司、基金托管人等。

#### 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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	2,355,307,779.54	44.71%	1,351,703,737.62	26.78%

##### 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	2,193,516.94	44.71%	1,836,695.91	66.74%
关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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	1,258,821.68	26.78%	528,312.08	20.12%

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	12,336,463.64	12,698,527.05
其中：支付销售机构的客户维护费	4,610,416.61	4,621,111.15
支付投资顾问的投资顾问费	-	-

注：支付基金管理人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：

$$\text{日基金管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,056,077.27	2,116,421.20

注：支付基金托管人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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

#### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

#### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.10.5.1 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2005 年 11 月 17 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	4,818,116.08	7,227,174.17
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	4,818,116.08	7,227,174.17
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.81%	1.18%

#### 6.4.10.5.2 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。

### 6.4.10.6 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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
中信银行-活期	158,165,993.29	468,373.14	187,201,172.14	941,358.95

注：本基金的银行存款由基金托管人中信银行股份有限公司保管，按银行约定利率计息。

### 6.4.10.7 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

#### 6.4.11.1 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

### 6.4.12 期末（2023 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	受限期	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

001282	三联锻造	2023年5月15日	6个月	新股流通受限	27.93	33.03	105	2,932.65	3,468.15	-
001286	陕西能源	2023年3月31日	6个月	新股流通受限	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
001287	中电港	2023年3月30日	6个月	新股流通受限	11.88	21.02	1,386	16,465.68	29,133.72	-
001324	长青科技	2023年5月12日	6个月	新股流通受限	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-
001328	登康口腔	2023年3月29日	6个月	新股流通受限	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	-
001360	南矿集团	2023年3月31日	6个月	新股流通受限	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	-
001367	海森药业	2023年3月30日	6个月	新股流通受限	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-
001380	华纬科技	2023年5月9日	6个月	新股流通受限	28.84	30.78	170	4,902.80	5,232.60	-
301073	君亭酒店	2023年1月3日	6个月	自愿锁定	58.59	35.88	39,747	1,552,517.82	1,426,122.36	-
301141	中科磁业	2023年3月27日	6个月	新股流通受限	41.20	42.69	262	10,794.40	11,184.78	-
301157	华塑科技	2023年3月1日	6个月	新股流通受限	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-
301203	国泰环保	2023年3月28日	6个月	新股流通受限	46.13	34.40	225	10,379.25	7,740.00	-
301232	飞沃科技	2023年6月8日	6个月	新股流通受限	72.50	58.42	165	11,962.50	9,639.30	-
301246	宏源药业	2023年3月10日	6个月	新股流通受限	50.00	30.71	931	46,550.00	28,591.01	-
301293	三博脑科	2023年4月	6个月	新股流通受限	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-

		25 日								
301315	威士顿	2023 年 6 月 13 日	6 个月	新股流通受限	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	-
301320	豪江智能	2023 年 6 月 1 日	6 个月	新股流通受限	13.06	20.62	642	8,384.52	13,238.04	-
301322	绿通科技	2023 年 2 月 27 日	6 个月	新股流通受限	131.11	53.24	392	34,219.71	20,870.08	-
301323	新莱福	2023 年 5 月 29 日	6 个月	新股流通受限	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08	-
301325	曼恩斯特	2023 年 5 月 4 日	6 个月	新股流通受限	76.80	107.95	364	27,955.20	39,293.80	-
301332	德尔玛	2023 年 5 月 9 日	6 个月	新股流通受限	14.81	13.73	1,122	16,616.82	15,405.06	-
301337	亚华电子	2023 年 5 月 16 日	6 个月	新股流通受限	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-
301345	涛涛车业	2023 年 3 月 10 日	6 个月	新股流通受限	73.45	46.64	266	19,537.70	12,406.24	-
301355	南王科技	2023 年 6 月 2 日	6 个月	新股流通受限	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25	-
301357	北方长龙	2023 年 4 月 11 日	6 个月	新股流通受限	50.00	48.39	190	9,500.00	9,194.10	-
301358	湖南裕能	2023 年 2 月 1 日	6 个月	新股流通受限	23.77	42.89	2,023	48,086.71	86,766.47	-
301360	荣旗科技	2023 年 4 月 17 日	6 个月	新股流通受限	71.88	92.60	134	9,631.92	12,408.40	-
301373	凌玮科技	2023 年 1 月 20 日	6 个月	新股流通受限	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45	-
301376	致欧科技	2023 年 6 月 14 日	6 个月	新股流通受限	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20	-
301386	未来电器	2023	6 个月	新股流通	29.99	23.79	378	11,336.22	8,992.62	-

		年 3 月 21 日		受限							
301408	华人健康	2023 年 2 月 22 日	6 个月	新股流通受限	16.24	16.95	879	14,274.96	14,899.05	-	
301419	阿莱德	2023 年 2 月 2 日	6 个月	新股流通受限	24.80	43.85	330	8,184.00	14,470.50	-	
301439	泓淋电力	2023 年 3 月 10 日	6 个月	新股流通受限	19.99	16.90	949	18,970.51	16,038.10	-	
601061	中信金属	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股流通受限	6.58	7.58	4,016	26,425.28	30,441.28	-	
601065	江盐集团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	10.36	11.84	875	9,065.00	10,360.00	-	
601133	柏诚股份	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	11.66	12.26	664	7,742.24	8,140.64	-	
603125	常青科技	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股流通受限	25.98	24.53	160	4,156.80	3,924.80	-	
603137	恒尚节能	2023 年 4 月 10 日	6 个月	新股流通受限	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51	-	
603172	万丰股份	2023 年 4 月 28 日	6 个月	新股流通受限	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-	
688146	中船特气	2023 年 4 月 13 日	6 个月	新股流通受限	36.15	38.13	1,011	36,547.65	38,549.43	-	
688249	晶合集成	2023 年 4 月 24 日	6 个月	新股流通受限	19.86	18.06	7,405	147,063.30	133,734.30	-	
688334	西高院	2023 年 6 月 9 日	6 个月	新股流通受限	14.16	16.21	888	12,574.08	14,394.48	-	
688352	颀中科技	2023 年 4 月 11 日	6 个月	新股流通受限	12.10	12.07	2,361	28,568.10	28,497.27	-	
688361	中科飞测	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股流通受限	23.60	64.67	831	19,611.60	53,740.77	-	

688429	时创能源	2023年6月20日	6个月	新股流通受限	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	-
688433	华曙高科	2023年4月7日	6个月	新股流通受限	26.66	31.50	418	11,143.88	13,167.00	-
688435	英方软件	2023年1月12日	6个月	新股流通受限	38.66	73.03	2,728	105,464.48	199,225.84	-
688458	美芯晟	2023年5月15日	6个月	新股流通受限	75.00	90.76	221	16,575.00	20,057.96	-
688469	中芯集成	2023年4月28日	6个月	新股流通受限	5.69	5.41	13,800	78,522.00	74,658.00	-
688472	阿特斯	2023年6月2日	6个月	新股流通受限	11.10	17.04	6,261	69,497.10	106,687.44	-
688478	晶升股份	2023年4月13日	6个月	新股流通受限	32.52	42.37	402	13,073.04	17,032.74	-
688479	友车科技	2023年5月4日	6个月	新股流通受限	33.99	29.49	332	11,284.68	9,790.68	-
688507	索辰科技	2023年4月10日	6个月	新股流通受限	245.56	122.11	222	36,834.00	27,108.42	-
688512	慧智微	2023年5月8日	6个月	新股流通受限	20.92	19.16	721	15,083.32	13,814.36	-
688523	航天环宇	2023年5月26日	6个月	新股流通受限	21.86	23.85	472	10,317.92	11,257.20	-
688531	日联科技	2023年3月24日	6个月	新股流通受限	152.38	135.97	346	52,723.48	47,045.62	-
688535	华海诚科	2023年3月28日	6个月	新股流通受限	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	-
688543	国科军工	2023年6月14日	6个月	新股流通受限	43.67	53.05	410	17,904.70	21,750.50	-
688562	航天软件	2023年5月	6个月	新股流通受限	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06	-



		15日								
688570	天玛智控	2023年5月29日	6个月	新股流通受限	30.26	25.33	884	26,749.84	22,391.72	-
688581	安杰思	2023年5月12日	6个月	新股流通受限	125.80	118.03	163	20,505.40	19,238.89	-
688582	芯动联科	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	26.74	40.68	648	17,327.52	26,360.64	-
688593	新相微	2023年5月25日	6个月	新股流通受限	11.18	14.59	959	10,721.62	13,991.81	-
688603	天承科技	2023年6月30日	6个月	新股流通受限	55.00	55.00	140	7,700.00	7,700.00	-
688603	天承科技	2023年6月30日	1个月内(含)	新股流通受限	55.00	55.00	1,251	68,805.00	68,805.00	-
688620	安凯微	2023年6月15日	6个月	新股流通受限	10.68	12.34	1,016	10,850.88	12,537.44	-
688623	二元科技	2023年5月31日	6个月	新股流通受限	125.88	86.79	178	22,406.64	15,448.62	-
688629	华丰科技	2023年6月16日	6个月	新股流通受限	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72	-
688631	莱斯信息	2023年6月19日	6个月	新股流通受限	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	-

## 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	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

## 6.4.12.2 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。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

本基金为混合型基金，本基金的运作涉及的金融工具主要包括股票投资、债券投资等。与这些金融工具有关的风险，以及本基金的基金管理人管理这些风险所采取的风险管理政策如下所述。

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人从事风险管理的目标是提升本基金风险调整后收益水平，保证本基金的基金资产安全，维护基金份额持有人利益。基于该风险管理目标，本基金的基金管理人风险管理的基本策略是识别和分析本基金运作时本基金面临各种类型的风险，确定适当的风险容忍度，并及时可靠地对各种风险进行监督，将风险控制在限定的范围之内。本基金目前面临的主要风险包括：市场风险、信用风险和流动性风险。

本基金的基金管理人建立了以全面、独立、互相制约以及定性和定量相结合为原则的，监事会、董事会及下设风险控制委员会、督察长、风险管理委员会、法律合规部和风险管理部等多层次的风险管理组织架构体系。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指金融工具的一方到期无法履行约定义务致使本基金遭受损失的风险。本基金的信用风险主要存在于银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资、资产支持证券投资及其他。

本基金的银行存款存放于本基金的基金托管人，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、资产支持证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

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的债券投资。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

### 6.4.13.3 流动性风险

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金流动性风险来源于基金约定开放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。本基金所持有的金融资产主要在证券交易所和银行间同业市场交易。除附注 6.4.12 所披露的流通受限不能自由转让的基金资产外,本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。除卖出回购金融资产外,本基金所持有的金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息,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 2023 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	158,165,993.29	-	-	-	158,165,993.29
结算备付金	8,613,533.19	-	-	-	8,613,533.19
存出保证金	1,119,260.44	-	-	-	1,119,260.44
交易性金融资产	91,009,410.96	-	-	1,307,862,314.50	1,398,871,725.46
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	213,633.13	213,633.13
应收清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	258,908,197.88	-	-	1,308,075,947.63	1,566,984,145.51
负债					
应付赎回款	-	-	-	458,217.28	458,217.28
应付管理人报酬	-	-	-	1,951,521.28	1,951,521.28
应付托管费	-	-	-	325,253.54	325,253.54
应付清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	2,854,611.66	2,854,611.66
负债总计	-	-	-	5,589,603.76	5,589,603.76
利率敏感度缺口	258,908,197.88	-	-	1,302,486,343.87	1,561,394,541.75
上年度末 2022 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	44,007,756.98	-	-	-	44,007,756.98
结算备付金	6,020,063.29	-	-	-	6,020,063.29
存出保证金	977,845.38	-	-	-	977,845.38
交易性金融资产	69,986,786.30	-	-	1,520,160,394.82	1,590,147,181.12
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	1,371,658.86	1,371,658.86
应收清算款	-	-	-	1,552,517.82	1,552,517.82
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	120,992,451.95	-	-	1,523,084,571.50	1,644,077,023.45
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,127,544.13	1,127,544.13
应付管理人报酬	-	-	-	2,084,300.63	2,084,300.63
应付托管费	-	-	-	347,383.44	347,383.44
应付清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,862,636.95	1,862,636.95
负债总计	-	-	-	5,421,865.15	5,421,865.15
利率敏感度缺口	120,992,451.95	-	-	1,517,662,706.35	1,638,655,158.30

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（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
		1. 市场利率平行上升 50 个基点	-167,141.50
	2. 市场利率平行下降 50 个基点	167,796.30	283,007.05

#### 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 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产-股票投资	1,307,862,314.50	83.76	1,520,160,394.82	92.77
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,307,862,314.50	83.76	1,520,160,394.82	92.77

#### 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（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	1. 权益性投资的市场价格上升 5%	65,393,115.73	76,008,019.74
	2. 权益性投资的市场价格下降 5%	-65,393,115.73	-76,008,019.74

### 6.4.14 公允价值

#### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

#### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

#### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日
第一层次	1,304,813,363.78
第二层次	91,085,915.96
第三层次	2,972,445.72
合计	1,398,871,725.46

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，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，本基金不会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将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并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，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括应收款项、卖出回购金融资产和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无需要说明有助于理解和分析会计报表的其他事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,307,862,314.50	83.46
	其中：股票	1,307,862,314.50	83.46
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	91,009,410.96	5.81
	其中：债券	91,009,410.96	5.81
	资产支持证券	-	-

4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中: 买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	166,779,526.48	10.64
8	其他资产	1,332,893.57	0.09
9	合计	1,566,984,145.51	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	-	-
B	采矿业	63,714,861.60	4.08
C	制造业	3,190,844.94	0.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	346,327,232.02	22.18
E	建筑业	10,516.15	0.00
F	批发和零售业	193,573.45	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	178,324,926.50	11.42
H	住宿和餐饮业	2,504,437.48	0.16
I	信息传输、软件和信息技术服务业	148,708,530.24	9.52
J	金融业	564,841,474.78	36.18
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	14,394.48	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	7,740.00	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	23,782.86	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,307,862,314.50	83.76

### 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	601288	农业银行	36,216,400	127,843,892.00	8.19
2	600900	长江电力	5,726,250	126,321,075.00	8.09
3	601398	工商银行	25,961,229	125,133,123.78	8.01
4	601939	建设银行	19,294,500	120,783,570.00	7.74
5	601988	中国银行	29,117,900	113,850,989.00	7.29
6	601328	交通银行	13,315,500	77,229,900.00	4.95
7	600021	上海电力	7,051,177	75,941,176.29	4.86
8	600941	中国移动	801,800	74,807,940.00	4.79
9	601728	中国电信	13,058,840	73,521,269.20	4.71
10	600028	中国石化	10,018,060	63,714,861.60	4.08
11	601006	大秦铁路	6,437,900	47,833,597.00	3.06
12	601816	京沪高铁	8,824,100	46,414,766.00	2.97
13	600011	华能国际	4,967,900	46,002,754.00	2.95
14	603885	吉祥航空	2,973,400	45,879,562.00	2.94
15	601991	大唐发电	11,083,446	36,686,206.26	2.35
16	601021	春秋航空	607,650	34,921,645.50	2.24
17	000539	粤电力 A	4,232,600	30,897,980.00	1.98
18	600027	华电国际	3,830,900	25,628,721.00	1.64
19	600483	福能股份	404,500	4,671,975.00	0.30
20	600115	中国东航	688,100	3,275,356.00	0.21
21	002595	豪迈科技	44,500	1,563,285.00	0.10
22	301073	君亭酒店	39,747	1,426,122.36	0.09
23	600754	锦江酒店	25,468	1,078,315.12	0.07
24	688582	芯动联科	6,476	299,402.44	0.02
25	688435	英方软件	2,728	199,225.84	0.01
26	600642	申能股份	20,300	141,897.00	0.01
27	688249	晶合集成	7,405	133,734.30	0.01
28	603108	润达医疗	5,900	109,622.00	0.01
29	688631	莱斯信息	3,357	108,400.08	0.01
30	688472	阿特斯	6,261	106,687.44	0.01
31	688429	时创能源	3,452	98,752.08	0.01
32	300476	胜宏科技	4,087	98,537.57	0.01
33	301358	湖南裕能	2,023	86,766.47	0.01
34	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.00
35	688469	中芯集成	13,800	74,658.00	0.00
36	688361	中科飞测	831	53,740.77	0.00
37	688531	日联科技	346	47,045.62	0.00
38	301325	曼恩斯特	364	39,293.80	0.00
39	688146	中船特气	1,011	38,549.43	0.00
40	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00
41	601061	中信金属	4,016	30,441.28	0.00

42	001287	中电港	1,386	29,133.72	0.00
43	301246	宏源药业	931	28,591.01	0.00
44	688352	颀中科技	2,361	28,497.27	0.00
45	688507	索辰科技	222	27,108.42	0.00
46	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
47	688570	天玛智控	884	22,391.72	0.00
48	688543	国科军工	410	21,750.50	0.00
49	301322	绿通科技	392	20,870.08	0.00
50	688458	美芯晟	221	20,057.96	0.00
51	688581	安杰思	163	19,238.89	0.00
52	688478	晶升股份	402	17,032.74	0.00
53	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
54	301439	泓淋电力	949	16,038.10	0.00
55	688623	双元科技	178	15,448.62	0.00
56	301332	德尔玛	1,122	15,405.06	0.00
57	301408	华人健康	879	14,899.05	0.00
58	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00
59	688334	西高院	888	14,394.48	0.00
60	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
61	688512	慧智微	721	13,814.36	0.00
62	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00
63	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
64	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
65	688620	安凯微	1,016	12,537.44	0.00
66	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
67	301345	涛涛车业	266	12,406.24	0.00
68	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
69	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
70	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
71	601065	江盐集团	875	10,360.00	0.00
72	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
73	301232	飞沃科技	165	9,639.30	0.00
74	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
75	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
76	301357	北方长龙	190	9,194.10	0.00
77	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
78	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
79	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
80	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
81	601133	柏诚股份	664	8,140.64	0.00
82	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
83	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
84	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00

85	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
86	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
87	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
88	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
89	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
90	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
91	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
92	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
93	603172	万丰股份	122	1,967.86	0.00
94	600861	北京人力	1	23.20	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601398	工商银行	130,378,780.27	7.96
2	601288	农业银行	129,828,851.00	7.92
3	601939	建设银行	128,075,669.30	7.82
4	600900	长江电力	127,433,497.31	7.78
5	300896	爱美客	124,676,700.46	7.61
6	601988	中国银行	120,440,455.35	7.35
7	601138	工业富联	88,115,044.20	5.38
8	601728	中国电信	86,198,461.40	5.26
9	000977	浪潮信息	81,744,320.08	4.99
10	601328	交通银行	81,139,301.88	4.95
11	600941	中国移动	80,758,516.57	4.93
12	002230	科大讯飞	79,064,423.24	4.82
13	600021	上海电力	78,236,314.62	4.77
14	000963	华东医药	77,749,264.22	4.74
15	300308	中际旭创	76,217,545.89	4.65
16	002916	深南电路	73,257,201.91	4.47
17	300476	胜宏科技	70,043,781.92	4.27
18	000063	中兴通讯	69,658,611.27	4.25
19	002463	沪电股份	68,384,760.44	4.17
20	600028	中国石化	67,807,626.20	4.14
21	600763	通策医疗	63,354,348.46	3.87
22	300394	天孚通信	61,167,719.10	3.73
23	002415	海康威视	57,690,635.68	3.52
24	688256	寒武纪	57,533,820.88	3.51
25	601006	大秦铁路	50,603,769.36	3.09
26	601816	京沪高铁	50,465,198.00	3.08

27	600011	华能国际	48,059,412.00	2.93
28	300502	新易盛	42,190,507.10	2.57
29	601991	大唐发电	37,809,624.90	2.31

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

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

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300308	中际旭创	159,659,091.64	9.74
2	603288	海天味业	140,090,852.85	8.55
3	600809	山西汾酒	137,659,600.22	8.40
4	300896	爱美客	112,414,935.67	6.86
5	600754	锦江酒店	108,414,814.13	6.62
6	600004	白云机场	94,207,749.68	5.75
7	000977	浪潮信息	92,976,219.50	5.67
8	300144	宋城演艺	87,251,375.36	5.32
9	002230	科大讯飞	84,835,819.08	5.18
10	603899	晨光股份	79,929,347.94	4.88
11	002463	沪电股份	79,498,183.10	4.85
12	600600	青岛啤酒	79,335,720.00	4.84
13	688256	寒武纪	78,774,860.21	4.81
14	601111	中国国航	78,343,232.03	4.78
15	600009	上海机场	77,343,020.78	4.72
16	300502	新易盛	76,306,577.55	4.66
17	000963	华东医药	75,732,505.40	4.62
18	601138	工业富联	75,371,029.00	4.60
19	603517	绝味食品	73,566,542.16	4.49
20	300394	天孚通信	72,071,331.46	4.40
21	600029	南方航空	71,067,884.72	4.34
22	600258	首旅酒店	70,935,368.94	4.33
23	600115	中国东航	69,787,579.00	4.26
24	000063	中兴通讯	65,676,907.27	4.01
25	002916	深南电路	61,023,616.58	3.72
26	300476	胜宏科技	59,875,756.92	3.65
27	002415	海康威视	49,730,577.04	3.03
28	000951	中国重汽	49,454,410.75	3.02
29	600763	通策医疗	43,066,443.88	2.63
30	601021	春秋航空	37,163,487.00	2.27

31	002236	大华股份	36,438,422.00	2.22
----	--------	------	---------------	------

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	2,551,221,132.29
卖出股票收入（成交）总额	2,731,591,308.90

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	91,009,410.96	5.83
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	91,009,410.96	5.83

#### 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	220023	22 付息国债 23	700,000	70,797,482.19	4.53
2	230001	23 付息国债 01	200,000	20,211,928.77	1.29

## 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 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

### 7.11.2 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工商银行（证券代码 601398）、建设银行（证券代码 601939）、交通银行（证券代码 601328）、农业银行（证券代码 601288）、中国电信（证券代码 601728）、中国银行（证券代码 601988）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、工商银行（证券代码 601398）

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、内部制度不完善、违反反洗钱法、未依法履行职责等原因，多次受到监管机构的处罚。

#### 2、建设银行（证券代码 601939）

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、内部制度不完善、违反反洗钱法、未依法履行职责等原因，多次受到监管机构的处罚。

#### 3、交通银行（证券代码 601328）

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、违反反洗钱法、信息披露虚假或严重误导性陈述多次受到监管机构的处罚。

#### 4、农业银行（证券代码 601288）

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、内部制度不完善、违反反洗钱法、未依法履行职责等原因，多次受到监管机构的处罚。

#### 5、中国电信（证券代码 601728）

根据发布的相关公告，该证券发行人在报告期内未依法履行职责、违反税收管理规定，多次受到监管机构的处罚。

#### 6、中国银行（证券代码 601988）

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、涉嫌违反法律法规、违反税收管理规定、未依法履行职责等原因，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	1,119,260.44
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	213,633.13
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,332,893.57

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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(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
57,163	10,455.30	5,684,897.87	0.95%	591,971,429.29	99.05%

## 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	姚乐音	2,130,052.00	11.37%
2	肖鹰	413,730.00	2.21%
3	郭爱琴	196,935.00	1.05%
4	刘秀芳	173,749.00	0.93%
5	侯举超	158,992.00	0.85%
6	张保华	158,613.00	0.85%
7	曾金华	157,300.00	0.84%
8	林楚	149,051.00	0.80%
9	毕远峰	146,189.00	0.78%
10	张大伟	141,700.00	0.76%

注：以上数据由中国证券登记结算公司提供，持有人为场内持有人。

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	3,932.41	0.0007%

## 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	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	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2005年11月17日)基金份额总额	653,405,124.62
本报告期期初基金份额总额	607,973,059.00
本报告期基金总申购份额	22,903,935.78



减：报告期基金总赎回份额	33,220,667.62
本报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-
本报告期期末基金份额总额	597,656,327.16

## § 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

根据本基金管理人 2023 年 6 月 22 日的公告，经招商基金管理有限公司第六届董事会 2023 年第四次会议审议通过，钟文岳先生离任公司常务副总经理、财务负责人职务。

本报告期内，基金托管人中信银行股份有限公司董事会于 2023 年 4 月 17 日收到董事长、非执行董事朱鹤新先生的辞呈。董事会选举本行党委书记、副董事长、董事方合英先生为本行董事长，将自中国银行业监管机构核准其董事长任职资格之日起正式就任。

本报告期内，基金托管人中信银行股份有限公司董事会于 2023 年 4 月 17 日收到本行行长方合英先生的辞呈。董事会聘任本行党委副书记、董事、常务副行长刘成先生为本行行长，将自中国银行业监管机构核准其行长任职资格之日起正式就任。

### 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

#### 10.6.1 管理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受到监管部门的稽查或处罚的书面通知或文件。

### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，托管人及其高级管理人员未受到稽查或处罚等情况。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
招商证券	1	2,355,307,779.54	44.71%	2,193,516.94	44.71%	-
海通证券	2	1,203,335,588.38	22.84%	1,120,670.23	22.84%	-
中金公司	1	605,709,125.12	11.50%	564,096.95	11.50%	-
国泰君安	1	419,952,042.64	7.97%	391,102.77	7.97%	-
中信建投证券	1	225,282,644.86	4.28%	209,809.22	4.28%	-
光大证券	1	187,994,887.33	3.57%	175,083.50	3.57%	-
华泰证券	1	163,143,247.35	3.10%	151,924.33	3.10%	-
恒泰证券	1	107,399,212.38	2.04%	100,020.94	2.04%	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华龙证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
联储证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-

注：基金交易佣金根据券商季度综合评分结果给与分配，券商综合评分根据研究报告质量、路演质量、联合调研质量等维度进行打分，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
招商证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-

中金公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中信建投 证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华龙证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
联储证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-

## 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投资君亭酒店（301073）非公开发行的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-01-05
2	招商基金管理有限公司旗下基金2022年第4季度报告提示性公告	中国证券报及基金管理人网站	2023-01-18
3	招商优质成长混合型证券投资基金(LOF)2022年第4季度报告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-01-18
4	招商优质成长混合型证券投资基金(LOF)2022年年度报告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-03-30
5	招商基金管理有限公司旗下基金2022年年度报告提示性公告	中国证券报及基金管理人网站	2023-03-30
6	招商优质成长混合型证券投资基金(LOF)2023年第1季度报告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-04-21
7	招商基金管理有限公司旗下基金2023年第1季度报告提示性公告	中国证券报及基金管理人网站	2023-04-21
8	招商基金管理有限公司关于提醒投资者持续完善身份信息资料的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-05-12
9	招商基金管理有限公司关于高级管理人员变更	中国证券报、基金管	2023-06-22

的公告	理人网站及中国证监会基金电子披露网站
-----	--------------------

## § 11 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优质成长混合型证券投资基金(LOF)设立的文件；
- 3、《招商优质成长混合型证券投资基金(LOF)基金合同》；
- 4、《招商优质成长混合型证券投资基金(LOF)托管协议》；
- 5、《招商优质成长混合型证券投资基金(LOF)招募说明书》；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照。

### 11.1 存放地点

招商基金管理有限公司

地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

### 11.2 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

2023 年 8 月 30 日