

# 招商量化精选股票型发起式证券投资基金 2016 年半年度报告

2016 年 6 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：2016 年 8 月 24 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。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 2016 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 2016 年 3 月 15 日（基金合同生效日）起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>1</b>
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>4</b>
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.....	6
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	13
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	14
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>14</b>
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>37</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	37
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.....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	46
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.....	46
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.....	46
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.....	46
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.....	46
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	46
7.12 投资组合报告附注.....	47

<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>47</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	47
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	48
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的情况.....	48
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	48
<b>§9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>48</b>
<b>§10 重大事件揭示</b> .....	<b>49</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	49
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.....	49
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.....	52
<b>§11 备查文件目录</b> .....	<b>54</b>
11.1 备查文件目录.....	54
11.2 存放地点.....	54
11.3 查阅方式.....	54

## § 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	197,778,984.33 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>1、资产配置策略</p> <p>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。一般情况下将保持各类资产配置的基本稳定。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>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。基于模型结果，基金管理人结合市场环境和股票特性，精选个股产出投资组合，以追求超越业绩比较基准表现的业绩水平。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>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；在满足组合久期设置的基础上，投资团队分析债券收益率曲线变动、各期限品种收益率及收益率基差波动等因素，预测收益率曲线的变动趋势，并结合流动性偏好、信用分析等多种市场因素进行分析，综合评判个券的投资价值。在个券选择的基础上，投资团队构建模拟组合，并比较不同模拟组合之间的收益和风险匹配情况，确定风险、收益最佳匹配的组合。</p> <p>4、中小企业私募债券投资策略</p> <p>主要采取买入持有到期策略；当预期发债企业的基本面情况出现恶化时，采取“尽早出售”策略，控制投</p>

	<p>资风险。</p> <p>5、资产支持证券的投资策略</p> <p>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>6、权证投资策略</p> <p>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>7、股指期货投资策略</p> <p>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	王永民
	联系电话	0755-83196666	010-66594896
	电子邮箱	cmf@cmfchina.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-887-9555	95566
传真		0755-83196475	010-66594942
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	田国立

### 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、证券时报、上海证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.cmfchina.com">http://www.cmfchina.com</a>
基金半年度报告备置地点	(1) 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 (2) 中国银行股份有限公司 地址:北京市复兴门内大街 1 号
--	----------------------------------------------------------------

## 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(2016 年 3 月 15 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-2,505,849.29
本期利润	8,851,863.14
加权平均基金份额本期利润	0.0437
本期加权平均净值利润率	4.38%
本期基金份额净值增长率	5.70%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-2,271,332.68
期末可供分配基金份额利润	-0.0115
期末基金资产净值	209,090,327.41
期末基金份额净值	1.057
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	5.70%

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

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

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

4、本基金合同于 2016 年 3 月 15 日生效, 截止本报告期末基金成立未满 1 年。

## 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

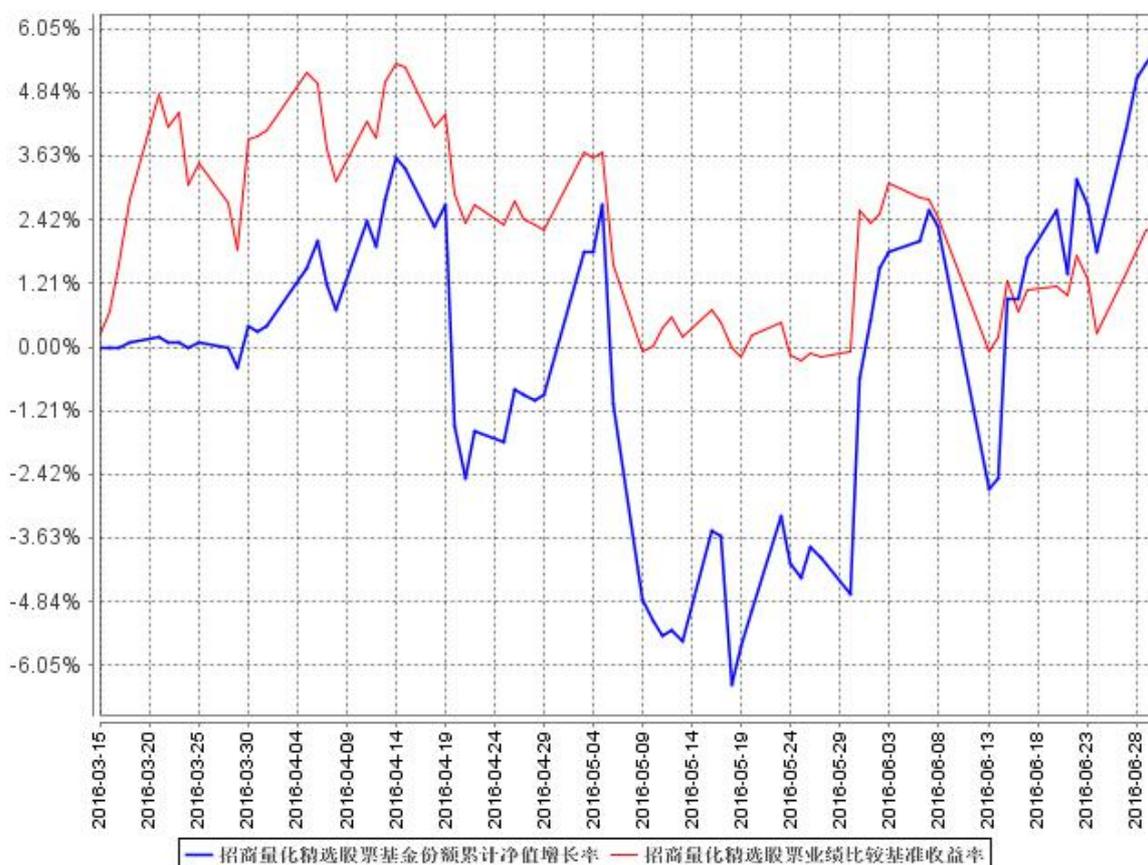
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	6.34%	1.62%	-0.31%	0.79%	6.65%	0.83%
过去三个月	5.38%	1.60%	-1.65%	0.81%	7.03%	0.79%
自基金合同生效起至今	5.70%	1.46%	2.29%	0.86%	3.41%	0.60%

注：1、业绩比较基准收益率=沪深 300 指数收益率×80%+中债综合指数收益率×20%，业绩比较基准在每个交易日实现再平衡；

2、本基金合同于 2016 年 3 月 15 日生效，截至本报告期末基金成立未满一年。

### 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

招商量化精选股票基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、根据基金合同的规定：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%。本基金于 2016 年 3 月 15 日成立，自基金成立日起 6 个月内为建仓期，截至报告期末建仓期未结束；

2、本基金合同于 2016 年 3 月 15 日生效，截至本报告期末基金成立未满一年。

## § 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 2.1 亿元人民币，其中，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%。

截至 2016 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 76 只共同基金，具体如下：

基金名称	基金类型	基金成立日
招商安泰偏股混合型证券投资基金	混合型基金	2003-04-28
招商安泰平衡型证券投资基金	混合型基金	2003-04-28
招商安泰债券投资基金	债券型基金	2003-04-28
招商现金增值开放式证券投资基金	货币市场型基金	2004-01-14
招商先锋证券投资基金	混合型基金	2004-06-01
招商优质成长混合型证券投资基金	混合型基金	2005-11-17
招商安本增利债券型证券投资基金	债券型基金	2006-07-11
招商核心价值混合型证券投资基金	混合型基金	2007-03-30
招商大盘蓝筹混合型证券投资基金	混合型基金	2008-06-19
招商安心收益债券型证券投资基金	债券型基金	2008-10-22
招商行业领先混合型证券投资基金	混合型基金	2009-06-19
招商中小盘精选混合型证券投资基金	混合型基金	2009-12-25
招商全球资源股票型证券投资基金	国际(QDII)基金	2010-03-25
招商深证 100 指数证券投资基金	股票型基金	2010-06-22
招商信用添利债券型证券投资基金(LOF)	债券型基金	2010-06-25
上证消费 80 交易型开放式指数证券投资基金	股票型基金	2010-12-08
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	股票型基金	2010-12-08
招商标普金砖四国指数证券投资基金(LOF)	国际(QDII)基金	2011-02-11
招商安瑞进取债券型证券投资基金	债券型基金	2011-03-17
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	股票型基金	2011-06-27
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	股票型基金	2011-06-27

招商安达保本混合型证券投资基金	混合型基金	2011-09-01
招商优势企业灵活配置混合型证券投资基金	混合型基金	2012-02-01
招商产业债券型证券投资基金	债券型基金	2012-03-21
招商中证大宗商品股票指数分级证券投资基金	股票型基金	2012-06-28
招商信用增强债券型证券投资基金	债券型基金	2012-07-20
招商安盈保本混合型证券投资基金	混合型基金	2012-08-20
招商理财 7 天债券型证券投资基金	货币市场型基金	2012-12-07
招商央视财经 50 指数证券投资基金	股票型基金	2013-02-05
招商双债增强债券型证券投资基金 (LOF)	债券型基金	2013-03-01
招商安润保本混合型证券投资基金	混合型基金	2013-04-19
招商保证金快线货币市场基金	货币市场型基金	2013-05-17
招商沪深 300 高贝塔指数分级证券投资基金	股票型基金	2013-08-01
招商瑞丰灵活配置混合型发起式证券投资基金	混合型基金	2013-11-06
招商标普高收益红利贵族指数增强型证券投资基金	国际 (QDII) 基金	2013-12-11
招商丰盛稳定增长灵活配置混合型证券投资基金	混合型基金	2014-03-20
招商招钱宝货币市场基金	货币市场型基金	2014-03-25
招商招金宝货币市场基金	货币市场型基金	2014-06-18
招商可转债分级债券型证券投资基金	债券型基金	2014-07-31
招商丰利灵活配置混合型证券投资基金	混合型基金	2014-08-12
招商行业精选股票型证券投资基金	股票型基金	2014-09-03
招商招利 1 个月理财债券型证券投资基金	货币市场型基金	2014-09-25
招商中证全指证券公司指数分级证券投资基金	股票型基金	2014-11-13
招商沪深 300 地产等权重指数分级证券投资基金	股票型基金	2014-11-27
招商医药健康产业股票型证券投资基金	股票型基金	2015-01-30
招商丰泰灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)	混合型基金	2015-04-17
招商中证煤炭等权指数分级证券投资基金	股票型基金	2015-05-20
招商中证银行指数分级证券投资基金	股票型基金	2015-05-20
招商国证生物医药指数分级证券投资基金	股票型基金	2015-05-27
招商中证白酒指数分级证券投资基金	股票型基金	2015-05-27
招商丰泽灵活配置混合型证券投资基金	混合型基金	2015-06-11
招商移动互联网产业股票型证券投资基金	股票型基金	2015-06-19
招商国企改革主题混合型证券投资基金	混合型基金	2015-06-29
招商安益保本混合型证券投资基金	混合型基金	2015-07-14
招商丰庆灵活配置混合型发起式证券投资基金	混合型基金	2015-07-31
招商体育文化休闲股票型证券投资基金	股票型基金	2015-08-18
招商丰融灵活配置混合型证券投资基金	混合型基金	2015-11-17
招商丰裕灵活配置混合型证券投资基金	混合型基金	2015-11-17
招商丰享灵活配置混合型证券投资基金	混合型基金	2015-11-17
招商制造业转型灵活配置混合型证券投资基金	混合型基金	2015-12-02
招商境远保本混合型证券投资基金	混合型基金	2015-12-15
招商招益一年定期开放债券型证券投资基金	债券型基金	2015-12-25
招商安弘保本混合型证券投资基金	混合型基金	2015-12-29

招商康泰养老灵活配置混合型证券投资基金	混合型基金	2016-02-04
招商安德保本混合型证券投资基金	混合型基金	2016-02-18
招商安元保本混合型证券投资基金	混合型基金	2016-03-01
招商招瑞纯债债券型发起式证券投资基金	债券型基金	2016-03-09
招商量化精选股票型发起式证券投资基金	股票型基金	2016-03-15
招商睿逸稳健配置混合型证券投资基金	混合型基金	2016-04-13
招商招兴纯债债券型证券投资基金	债券型基金	2016-05-18
招商安博保本混合型证券投资基金	混合型基金	2016-05-25
招商招盈 18 个月定期开放债券型证券投资基金	债券型基金	2016-06-01
招商增荣灵活配置混合型证券投资基金	混合型基金	2016-06-03
招商招恒纯债债券型证券投资基金	债券型基金	2016-06-08
招商安裕保本混合型证券投资基金	混合型基金	2016-06-20
招商财富宝交易型货币市场基金	货币型基金	2016-06-30

#### 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	本基金的基金经理	2016 年 3 月 15 日	-	10	男，管理学硕士，FRM。2006 年加入招商基金管理有限公司，历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、副总监，主要负责公司投资风险管理、金融工程研究等工作，现任全球量化投资部副总监、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及其联接基金、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及其联接基金、招商中证大宗商品股票指数分级证券投资基金、招商央视财经 50 指数证券投资基金、招商中证银行指数分级证券投资基金、招商中证煤炭等权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、招商国证生物医药指数分级证券投资基金及招商量化精选股票型发起式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合规守信情况的说明

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《招商量化精选股票型发起式证券投资基金基金合同》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（以下简称“公司”）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。公司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。公司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。公司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。公司交易部在报告期内，本着持有人利益最大化的原则执行了公平交易。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司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，公司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，在某指数型投资组合与某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指数复制比例要求的投资策略需要。报告期内未发现其他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，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 90%左右的水平，业绩表现大幅超越基准。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.057 元，本报告期份额净值增长率为 5.70%，同期业绩比较基准增长率为 2.29%，基金净值表现好于业绩比较基准，幅度为 3.41%。主要原因是使用量化模型所精选的个股组合业绩表现超越基准。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

美国 6 月份经济数据全面回暖：就业、通胀、PMI、零售销售以及工业产出数据在 6 月份呈现全面回暖，美国经济复苏的坚实程度较强；6 月欧元区宽松货币政策的刺激影响，经济继续以微弱动能回升，但受英国脱欧公投扰动，未来经济复苏或再受冲击。

国内 2016 年上半年在政策的支持下经济运行平稳。目前预计下半年经济增长不容乐观，主要原因来自于工业去产能带来负面影响，民间投资快速下滑，房地产销售与投资增速的回落，以及全球经济低迷及外围动荡造成的外需乏力，这些因素是维持下半年经济平稳增长的隐忧，预计下半年经济面临的下行压力较大，仍需政策给予积极刺激。

报告期内市场震荡下行，我们预计 2016 年下半年市场仍以震荡行情为主，需警惕两个风险点，一是债券市场的信用违约有可能带来整个金融市场的动荡，二是半年报披露业绩有可能不达预期。至于投资机会，随着国企改革近期有加速迹象，建议重点关注国企改革升温带来的主题投资机会。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金的估值业务严格按照相关的法律法规、基金合同以及《招商基金管理有限公司基金估值委员会管理制度》进行。基金核算部负责日常的基金资产的估值业务，执行基金估值政策。另外，公司设立由投资和研究部门、风险管理部、基金核算部、法律合规部负责人和基金经理代表组成的估值委员会。公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经验。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，由其按约定提供在银行间同业市场和交易所市场交易的债券品种的估值数据。

#### **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，本基金报告期无需进行利润分配。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 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

根据证监会《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条的相关要求，基金合同生效后，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情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露。

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**

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基金合同（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：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日
<b>资产：</b>		
银行存款	6.4.7.1	54,891,021.40
结算备付金		4,558,804.71
存出保证金		3,884,644.75
交易性金融资产	6.4.7.2	170,966,609.77
其中：股票投资		170,966,609.77
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
应收证券清算款		-
应收利息	6.4.7.5	14,509.71
应收股利		-
应收申购款		107,423.34
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		234,423,013.68

负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年6月30日
<b>负 债：</b>		
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		18,814,489.32
应付赎回款		5,708,425.24
应付管理人报酬		203,195.41
应付托管费		33,865.89
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	456,817.18
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	115,893.23
负债合计		25,332,686.27
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	6.4.7.9	197,778,984.33
未分配利润	6.4.7.10	11,311,343.08
所有者权益合计		209,090,327.41
负债和所有者权益总计		234,423,013.68

注：1、报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.057 元，基金份额总额 197,778,984.33 份；

2、本期财务报表的实际编制期间为 2016 年 3 月 15 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日，上年度无可比期间。

## 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：2016 年 3 月 15 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016年3月15日(基金合同生效日) 至2016年6月30日
<b>一、收入</b>		10,773,534.11
1.利息收入		357,345.15
其中：存款利息收入	6.4.7.11	87,859.62
债券利息收入		37.01
资产支持证券利息收入		-

买入返售金融资产收入		269,448.52
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-1,432,344.98
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-2,198,506.02
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	79,317.79
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-
衍生工具收益	6.4.7.16	112,800.00
股利收益	6.4.7.17	574,043.25
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	11,357,712.43
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	490,821.51
<b>减：二、费用</b>		1,921,670.97
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	883,501.19
2. 托管费	6.4.10.2.2	147,250.23
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.20	783,496.10
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	6.4.7.21	107,423.45
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		8,851,863.14
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		8,851,863.14

注：本期财务报表的实际编制期间为 2016 年 3 月 15 日（基金合同生效日）至 2016 年 6 月 30 日，上年度无可比期间。

### 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：2016 年 3 月 15 日（基金合同生效日）至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 3 月 15 日（基金合同生效日）至 2016 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）	243,093,644.61	-	243,093,644.61
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	8,851,863.14	8,851,863.14
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）	-45,314,660.28	2,459,479.94	-42,855,180.34
其中：1.基金申购款	112,237,038.48	3,540,949.11	115,777,987.59

2. 基金赎回款	-157,551,698.76	-1,081,469.17	-158,633,167.93
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）	197,778,984.33	11,311,343.08	209,090,327.41

注：本期财务报表的实际编制期间为 2016 年 3 月 15 日（基金合同生效日）至 2016 年 6 月 30 日，上年度无可比期间。

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：

<u>金旭</u>	<u>欧志明</u>	<u>何剑萍</u>
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”）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，由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》及其配套规则和《招商量化精选股票型发起式证券投资基金基金合同》发售，基金合同于 2016 年 3 月 15 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集规模为 243,093,644.61 份基金份额。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%。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。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×80%+中债综合指数收益率×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。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年 3 月 15 日（基金合同生效日）至 2016 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

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本基金财务报表的实际编制期间自公历 2016 年 3 月 15 日（基金合同生效日）起至 2016 年 6 月 30 日止。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的把金融资产和金融负债分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。

本基金目前持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

##### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入

当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

初始确认后，金融资产和金融负债的后续计量如下：

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值计量，公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益；

应收款项以实际利率法按摊余成本计量。

当收取某项金融资产的现金流量的合同权利终止或将所有权上几乎所有的风险和报酬转移时，本基金终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

一 所转移金融资产的账面价值

一 因转移而收到的对价

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金估计公允价值时，考虑市场参与者在计量日对相关资产或负债进行定价时考虑的特征（包括资产状况及所在位置、对资产出售或者使用的限制等），并采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且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，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括红利再投资和基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入“未分配利润”。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资收益 / (损失)、债券投资收益 / (损失) 和衍生工具收益 / (损失) 按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税(适用于企业债和可转债等)后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，逐日计提利息收入。

利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在回购期内按

实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益 /（损失）核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

本基金的交易费用用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在回购期内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每份基金份额享有同等分配权。基金可供分配利润为正的前提下，方可进行收益分配。本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 20%，若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配。基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

#### 6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38 号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字〔2007〕21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》（以下简称“《证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价的通知》”），若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易所交易天数占锁定期内总交易所交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

在银行间同业市场交易的债券品种，根据《证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》（以下简称“估值处理标准”），在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

#### **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**

本基金在本报告期内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**

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

#### **6.4.6 税项**

根据财税字〔1998〕55号文《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收问题的通知》、财税〔2002〕128号文《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

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[2015]125号文《关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》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) 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(b) 证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。

(c) 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。

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、债券收入免征增值税。

(d) 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。

(e) 对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入，由上市公司、发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。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，股权登记日为自 2013 年 1 月 1 日起至 2015 年 9 月 7 日期间的，暂减按 25% 计入应纳税所得额，股权登记日在 2015 年 9 月 8 日及以后的，暂免征收个人所得税。

(f) 关于香港市场投资者通过基金互认买卖内地基金份额的所得税问题：

对香港市场投资者（包括企业和个人）通过基金互认买卖内地基金份额取得的转让差价所得，暂免征收所得税。

对香港市场投资者（包括企业和个人）通过基金互认从内地基金分配取得的收益，由内地上市公司向该内地基金分配股息红利时，对香港市场投资者按照 10% 的税率代扣所得税；或发行债券的企业向该内地基金分配利息时，对香港市场投资者按照 7% 的税率代扣所得税，并由内地上市公司或发行债券的企业向其主管税务机关办理扣缴申报。内地基金向投资者分配收益时，不再扣缴所得税。

内地基金管理人应当向相关证券登记结算机构提供内地基金的香港市场投资者的相关信息。

(g) 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。

(h) 对投资者(包括个人和机构投资者)从基金分配中取得的收入, 暂不征收个人所得税和企业所得税。

## 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 2016年6月30日
活期存款	54,891,021.40
定期存款	-
其中: 存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计:	54,891,021.40

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位: 人民币元

项目	本期末 2016年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	160,592,257.34	170,966,609.77	10,374,352.43
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	160,592,257.34	170,966,609.77	10,374,352.43

### 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 2016年6月30日
应收活期存款利息	3,141.07
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	11,325.71
应收债券利息	-
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	42.93
合计	14,509.71

**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 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	456,817.18
银行间市场应付交易费用	-
合计	456,817.18

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	14,180.99
预提费用	101,712.24
合计	115,893.23

### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年3月15日(基金合同生效日)至2016年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	243,093,644.61	243,093,644.61
本期申购	112,237,038.48	112,237,038.48
本期赎回(以“-”号填列)	-157,551,698.76	-157,551,698.76
本期末	197,778,984.33	197,778,984.33

注：1、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。

2、本基金自2016年2月18日至2016年3月11日止期间公开发售，有效净认购金额人民币243,045,764.14元，折算为243,045,764.14份基金份额。根据《招商量化精选股票型发起式证券投资基金基金合同》的规定，经本基金注册登记人计算并确认，本基金认购资金在募集期内产生的利息人民币47,880.47元，折算为47,880.47份基金份额，划入基金持有人账户，两者合计243,093,644.61份基金份额。

### 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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-2,505,849.29	11,357,712.43	8,851,863.14
本期基金份额交易产生的变动数	234,516.61	2,224,963.33	2,459,479.94
其中：基金申购款	-1,775,738.18	5,316,687.29	3,540,949.11
基金赎回款	2,010,254.79	-3,091,723.96	-1,081,469.17
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,271,332.68	13,582,675.76	11,311,343.08

### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年3月15日(基金合同生效日)至2016年6月30日
	活期存款利息收入
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	28,958.57
其他	297.18
合计	87,859.62

**6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2016年3月15日(基金合同生效日)至2016 年6月30日
卖出股票成交总额	203,061,288.26
减：卖出股票成本总额	205,259,794.28
买卖股票差价收入	-2,198,506.02

**6.4.7.13 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2016年3月15日(基金合同生效日)至2016年 6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	347,354.80
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	267,989.43
减：应收利息总额	47.58
买卖债券差价收入	79,317.79

**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**

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

**6.4.7.16 衍生工具收益**

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2016年3月15日(基金合同生效日)至2016年 6月30日
权证投资收益	-
股指期货投资收益	112,800.00

**6.4.7.17 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2016年3月15日(基金合同生效日)至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	574,043.25
基金投资产生的股利收益	-
合计	574,043.25

**6.4.7.18 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年3月15日(基金合同生效日)至2016年6月30日
1. 交易性金融资产	10,374,352.43
——股票投资	10,374,352.43
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	983,360.00
合计	11,357,712.43

**6.4.7.19 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2016年3月15日(基金合同生效日)至2016年6月30日
基金赎回费收入	489,921.69
转换转出收入	899.82
合计	490,821.51

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 2016年3月15日(基金合同生效日)至2016 年6月30日
交易所市场交易费用	783,496.10
银行间市场交易费用	-
合计	783,496.10

**6.4.7.21 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2016年3月15日(基金合同生效日)至2016 年6月30日
审计费用	18,492.84
信息披露费	83,219.40
银行费用	5,311.21
其他费用	400.00
合计	107,423.45

**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**

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

**6.4.8.2 资产负债表日后事项**

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明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**

本报告期不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。

**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	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 2016年3月15日(基金合同生效日)至2016年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
招商证券	54,076,698.28	9.51%

**6.4.10.1.2 债券交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年3月15日(基金合同生效日)至2016年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例
招商证券	347,354.80	100.00%

**6.4.10.1.3 债券回购交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年3月15日(基金合同生效日)至2016年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例
招商证券	2,417,000,000.00	97.19%

**6.4.10.1.4 权证交易**

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行权证交易。

**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 2016年3月15日(基金合同生效日)至2016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	50,361.77	9.51%	38,413.29	8.41%

注：1、上述交易佣金比率均在合理商业条款范围内收取，并符合行业标准；

2、基金对该类交易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的证券投资研究成果和市场信息服务。

## 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
	2016年3月15日(基金合同生效日)至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	883,501.19
其中：支付销售机构的客户维护费	153,353.60

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：

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

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2016年3月15日(基金合同生效日)至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	147,250.23

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
	2016年3月15日(基金合同生效日)至2016年6月30日
基金合同生效日（2016年3月15日）持有的基金份额	10,000,450.02
期间申购/买入总份额	-
期间因拆分变动份额	-

减：期间赎回/卖出总份额	-
期末持有的基金份额	10,000,450.02
期末持有的基金份额占基金总份额比例	5.0564%

#### 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 2016年3月15日(基金合同生效日)至2016年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行	54,891,021.40	58,603.87

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内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

本报告期内本基金未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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
601966	玲珑轮胎	2016-6-24	2016-7-6	新股流通受限	12.98	12.98	1,336	17,341.28	17,341.28	-
603016	新宏泰	2016-6-23	2016-7-1	新股流通受限	8.49	8.49	1,314	11,155.86	11,155.86	-
300520	科大国创	2016-6-30	2016-7-8	新股流通受限	10.05	10.05	899	9,034.95	9,034.95	-
002805	丰元股份	2016-6-29	2016-7-7	新股流通受限	5.80	5.80	971	5,631.80	5,631.80	-
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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
6.4.12.1.3 受限证券类别：权证										
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：份)	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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值单 价	复牌日 期	复牌 开盘 单价	数量 (股)	期末 成本总额	期末估值 总额	备注
002591	恒大高新	2016-4-15	重大事项	17.78	-	-	54,836	808,228.44	974,984.08	-
002685	华东重机	2016-5-30	重大事项	9.03	-	-	105,100	810,952.00	949,053.00	-
300356	光一科技	2016-6-1	重大事项	48.44	2016-8-10	44.27	19,000	800,594.00	920,360.00	-
300166	东方国信	2016-6-8	重大事项	27.47	-	-	33,200	801,116.00	912,004.00	-
002101	广东鸿图	2016-4-29	重大事项	21.62	-	-	39,400	803,663.00	851,828.00	-
002319	乐通股份	2016-6-2	重大事项	17.28	-	-	48,900	806,440.00	844,992.00	-
002071	长城影视	2016-6-15	重大事项	13.64	-	-	57,800	800,035.00	788,392.00	-
002617	露笑科技	2016-5-9	重大事项	15.60	-	-	50,490	800,487.00	787,644.00	-
002631	德尔未来	2016-6-29	重大事项	26.60	-	-	27,500	550,398.37	731,500.00	-
300227	光韵达	2016-6-20	重大事项	23.79	-	-	30,700	662,326.43	730,353.00	-
002120	新海股份	2016-5-23	重大事项	20.48	2016-7-28	39.20	34,800	806,174.00	712,704.00	-
600634	中技控股	2016-6-22	重大事项	14.41	-	-	46,200	612,314.45	665,742.00	-
002713	东易日盛	2016-6-29	重大事项	29.03	2016-7-20	31.93	18,600	571,056.20	539,958.00	-
601611	中国核建	2016-6-30	重大事项	20.92	2016-7-1	23.01	4,790	16,621.30	100,206.80	-

#### 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市场价格风险和利率风险。

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

#### **6.4.13.2 信用风险**

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

本基金的银行存款存放于本基金的基金托管人中国银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在证券交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并采用券款对付交割方式，以控制相应的信用风险。

对于与债券投资等投资品种相关的信用风险，本基金的基金管理人通过对投资品种的信用等级评估来选择适当的投资对象，并限制单个投资品种的持有比例来管理信用风险。附注 6.4.13.2.1 及 6.4.13.2.2 列示了于本报告期末本基金所持有的债券投资的信用评级，该信用评级不包括本基金所持有的国债、央行票据、政策金融债。

##### **6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的债券投资。

##### **6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资**

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的债券投资。

#### **6.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指没有足够资金以满足到期债务支付的风险。本基金流动性风险来源于开放式基金每日兑付赎回资金的流动性风险，以及因部分投资品种交易不活跃而出现的变现风险以及因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理价格变现投资的风险。本基金所持有的交易性金融资产分别在证券交易所和银行间同业市场交易，除附注 6.4.12 所披露的流通受限不能自由转让的基金资产外，本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。除卖出回购金融资产款外，本基金所持有的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人在基金合同约定巨额赎回条款，设计

了非常情况下赎回资金的处理模式，控制因开放模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。日常流动性风险管理中，本基金的基金管理人每日监控和预测本基金的流动性指标，通过对投资品种的流动性指标来持续地评估、选择、跟踪和控制基金投资的流动性风险。同时，本基金通过预留一定的现金头寸，并且在需要时可通过卖出回购金融资产方式融入短期资金，以缓解流动性风险。

#### 6.4.13.4 市场风险

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的利率敏感性资产主要是银行存款、债券投资；持有的利率敏感性负债主要是卖出回购金融资产款。本基金的基金管理人日常通过对利率水平的预测、分析收益率曲线及优化利率重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 2016年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	54,891,021.40	-	-	-	-	-	54,891,021.40
结算备付金	4,558,804.71	-	-	-	-	-	4,558,804.71
存出保证金	3,884,644.75	-	-	-	-	-	3,884,644.75
交易性金融资产	-	-	-	-	-	170,966,609.77	170,966,609.77
应收利息	-	-	-	-	-	14,509.71	14,509.71
应收申购款	-	-	-	-	-	107,423.34	107,423.34
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	63,334,470.86	-	-	-	-	171,088,542.82	234,423,013.68
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	18,814,489.32	18,814,489.32
应付赎回款	-	-	-	-	-	5,708,425.24	5,708,425.24
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	203,195.41	203,195.41
应付托管费	-	-	-	-	-	33,865.89	33,865.89
应付交易费用	-	-	-	-	-	456,817.18	456,817.18
其他负债	-	-	-	-	-	115,893.23	115,893.23
负债总计	-	-	-	-	-	25,332,686.27	25,332,686.27
利率敏感度缺口	63,334,470.86	-	-	-	-	145,755,856.55	209,090,327.41

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末未持有债券投资及资产支持证券投资，因此市场利率变动而导致的利率敏感性资产的公允价值变动对基金资产净值的影响不重大。

#### 6.4.13.4.2 其他价格风险

市场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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，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 2016年6月30日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产-股票投资	170,966,609.77	81.77
衍生金融资产-权证投资	-	-
其他	-	-
合计	170,966,609.77	81.77

##### 6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	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 其他市场变量保持不变	
	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（2016年6月30日）
分析	1. 权益性投资的市场价格上升 5%	8,548,330.49
	2. 权益性投资的市场价格下降 5%	-8,548,330.49

#### 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	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	170,966,609.77	72.93
	其中：股票	170,966,609.77	72.93
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	59,449,826.11	25.36
7	其他各项资产	4,006,577.80	1.71
8	合计	234,423,013.68	100.00

### 7.2 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	5,356,962.56	2.56
B	采矿业	676,995.00	0.32
C	制造业	117,791,282.78	56.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,585,540.00	1.71
E	建筑业	2,860,643.37	1.37
F	批发和零售业	8,983,843.00	4.30
G	交通运输、仓储和邮政业	1,617,994.63	0.77
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,393,568.70	5.93
J	金融业	-	-
K	房地产业	7,357,106.67	3.52
L	租赁和商务服务业	4,519,018.00	2.16

M	科学研究和技术服务业	898,626.10	0.43
N	水利、环境和公共设施管理业	590,244.96	0.28
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	1,000,780.00	0.48
Q	卫生和社会工作	821,925.00	0.39
R	文化、体育和娱乐业	1,443,280.00	0.69
S	综合	1,068,799.00	0.51
	合计	170,966,609.77	81.77

### 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	占基金资产净值比例（%）
1	002157	正邦科技	80,552	1,889,749.92	0.90
2	002035	华帝股份	76,073	1,862,267.04	0.89
3	002726	龙大肉食	116,800	1,767,184.00	0.85
4	601012	隆基股份	127,100	1,658,655.00	0.79
5	002581	未名医药	59,414	1,619,031.50	0.77
6	002131	利欧股份	79,311	1,355,424.99	0.65
7	002108	沧州明珠	50,400	1,305,360.00	0.62
8	601258	庞大集团	474,100	1,303,775.00	0.62
9	002769	普路通	13,900	1,260,452.00	0.60
10	002787	华源包装	24,700	1,221,909.00	0.58
11	002722	金轮股份	31,900	1,210,924.00	0.58
12	002511	中顺洁柔	70,020	1,192,440.60	0.57
13	002079	苏州固锝	104,034	1,162,059.78	0.56
14	002645	华宏科技	43,896	1,158,854.40	0.55
15	300221	银禧科技	56,400	1,151,688.00	0.55
16	300444	双杰电气	38,600	1,133,682.00	0.54
17	002460	赣锋锂业	33,800	1,130,610.00	0.54
18	002182	云海金属	55,500	1,104,450.00	0.53
19	002402	和而泰	40,600	1,098,230.00	0.53
20	000536	华映科技	67,800	1,090,224.00	0.52
21	002734	利民股份	32,207	1,081,833.13	0.52
22	002600	江粉磁材	85,800	1,036,464.00	0.50
23	002418	康盛股份	97,700	1,031,712.00	0.49
24	300307	慈星股份	78,200	1,030,676.00	0.49

25	000066	长城电脑	80,600	1,027,650.00	0.49
26	300312	邦讯技术	51,900	1,027,620.00	0.49
27	002074	国轩高科	26,000	1,026,220.00	0.49
28	002411	必康股份	56,917	1,015,968.45	0.49
29	002403	爱仕达	62,550	1,010,182.50	0.48
30	002340	格林美	114,800	1,006,796.00	0.48
31	002603	以岭药业	63,200	1,005,512.00	0.48
32	300112	万讯自控	61,045	1,003,579.80	0.48
33	000973	佛塑科技	96,100	1,003,284.00	0.48
34	603377	东方时尚	22,000	1,000,780.00	0.48
35	002041	登海种业	63,900	993,006.00	0.47
36	300009	安科生物	32,995	985,890.60	0.47
37	002234	民和股份	33,500	985,235.00	0.47
38	601933	永辉超市	237,100	979,223.00	0.47
39	603766	隆鑫通用	48,390	978,445.80	0.47
40	002591	恒大高新	54,836	974,984.08	0.47
41	300387	富邦股份	34,600	974,336.00	0.47
42	002772	众兴菌业	38,922	974,217.66	0.47
43	600487	亨通光电	77,400	973,692.00	0.47
44	002765	蓝黛传动	36,900	972,315.00	0.47
45	603328	依顿电子	32,900	971,866.00	0.46
46	002318	久立特材	83,500	966,095.00	0.46
47	300131	英唐智控	81,600	963,696.00	0.46
48	300447	全信股份	21,500	960,405.00	0.46
49	600456	宝钛股份	47,700	959,724.00	0.46
50	300363	博腾股份	38,300	950,606.00	0.45
51	002685	华东重机	105,100	949,053.00	0.45
52	002748	世龙实业	57,000	949,050.00	0.45
53	002545	东方铁塔	106,150	946,858.00	0.45
54	002483	润邦股份	81,580	941,433.20	0.45
55	002366	台海核电	17,600	938,256.00	0.45
56	002174	游族网络	29,300	937,600.00	0.45
57	600075	新疆天业	81,000	932,310.00	0.45
58	002118	紫鑫药业	62,800	923,160.00	0.44
59	300356	光一科技	19,000	920,360.00	0.44
60	002317	众生药业	76,400	916,036.00	0.44
61	002472	双环传动	37,600	914,432.00	0.44
62	002138	顺络电子	50,400	913,752.00	0.44
63	300166	东方国信	33,200	912,004.00	0.44

64	300458	全志科技	8,500	909,330.00	0.43
65	002290	禾盛新材	32,469	903,612.27	0.43
66	002407	多氟多	21,200	902,908.00	0.43
67	002636	金安国纪	54,800	898,720.00	0.43
68	002309	中利科技	49,900	893,709.00	0.43
69	002477	雏鹰农牧	149,250	891,022.50	0.43
70	002042	华孚色纺	85,800	887,172.00	0.42
71	002702	海欣食品	43,700	886,673.00	0.42
72	300209	天泽信息	34,900	881,225.00	0.42
73	002296	辉煌科技	48,500	880,275.00	0.42
74	600645	中源协和	25,000	878,500.00	0.42
75	000868	安凯客车	115,000	875,150.00	0.42
76	002522	浙江众成	46,443	870,806.25	0.42
77	002001	新和成	41,200	870,556.00	0.42
78	600777	新潮实业	49,100	868,579.00	0.42
79	300439	美康生物	24,112	867,549.76	0.41
80	002166	莱茵生物	75,900	867,537.00	0.41
81	002562	兄弟科技	32,600	865,856.00	0.41
82	300469	信息发展	6,800	861,696.00	0.41
83	300222	科大智能	31,400	860,046.00	0.41
84	002640	跨境通	48,800	859,856.00	0.41
85	000701	厦门信达	48,400	853,292.00	0.41
86	600794	保税科技	158,800	852,756.00	0.41
87	002101	广东鸿图	39,400	851,828.00	0.41
88	600067	冠城大通	117,800	849,338.00	0.41
89	002223	鱼跃医疗	26,700	846,924.00	0.41
90	000599	青岛双星	123,000	846,240.00	0.40
91	002752	昇兴股份	50,200	845,368.00	0.40
92	002319	乐通股份	48,900	844,992.00	0.40
93	300253	卫宁健康	34,200	844,740.00	0.40
94	300257	开山股份	51,100	844,172.00	0.40
95	000705	浙江震元	59,900	843,991.00	0.40
96	002132	恒星科技	191,150	841,060.00	0.40
97	002493	荣盛石化	69,125	837,795.00	0.40
98	002639	雪人股份	71,800	835,752.00	0.40
99	000662	天夏智慧	38,644	830,846.00	0.40
100	002356	赫美集团	32,600	826,084.00	0.40
101	300015	爱尔眼科	22,500	821,925.00	0.39
102	603077	和邦生物	166,700	820,164.00	0.39

103	600037	歌华有线	53,800	818,298.00	0.39
104	300055	万邦达	44,767	815,207.07	0.39
105	600755	厦门国贸	102,200	812,490.00	0.39
106	600712	南宁百货	76,800	807,936.00	0.39
107	600323	瀚蓝环境	63,300	803,277.00	0.38
108	600684	珠江实业	106,800	802,068.00	0.38
109	600651	飞乐音响	63,100	798,846.00	0.38
110	000042	中洲控股	46,500	796,080.00	0.38
111	300022	吉峰农机	97,000	794,430.00	0.38
112	002203	海亮股份	102,200	794,094.00	0.38
113	002585	双星新材	74,400	790,128.00	0.38
114	300074	华平股份	65,800	789,600.00	0.38
115	002071	长城影视	57,800	788,392.00	0.38
116	002617	露笑科技	50,490	787,644.00	0.38
117	600978	宜华生活	70,500	785,370.00	0.38
118	002102	冠福股份	62,700	785,004.00	0.38
119	002536	西泵股份	51,900	783,171.00	0.37
120	300318	博晖创新	82,362	781,615.38	0.37
121	300178	腾邦国际	40,697	781,382.40	0.37
122	002217	合力泰	51,000	780,300.00	0.37
123	601233	桐昆股份	71,300	774,318.00	0.37
124	000010	美丽生态	98,500	771,255.00	0.37
125	000910	大亚科技	49,700	767,865.00	0.37
126	603066	音飞储存	16,000	764,320.00	0.37
127	002714	牧原股份	15,100	763,003.00	0.36
128	300011	鼎汉技术	32,300	758,081.00	0.36
129	300366	创意信息	20,000	757,200.00	0.36
130	600890	中房股份	67,000	756,430.00	0.36
131	601058	赛轮金宇	225,180	752,101.20	0.36
132	002707	众信旅游	37,000	751,100.00	0.36
133	300498	温氏股份	20,720	750,478.40	0.36
134	002113	天润控股	24,200	745,118.00	0.36
135	300096	易联众	40,558	743,833.72	0.36
136	000919	金陵药业	56,800	743,512.00	0.36
137	002528	英飞拓	83,450	741,036.00	0.35
138	002308	威创股份	45,100	740,993.00	0.35
139	002003	伟星股份	47,200	737,736.00	0.35
140	600482	中国动力	22,500	737,325.00	0.35
141	002583	海能达	61,200	736,848.00	0.35

142	000883	湖北能源	158,100	732,003.00	0.35
143	002631	德尔未来	27,500	731,500.00	0.35
144	002681	奋达科技	43,280	730,566.40	0.35
145	300227	光韵达	30,700	730,353.00	0.35
146	000671	阳光城	122,700	728,838.00	0.35
147	000703	恒逸石化	73,725	727,665.75	0.35
148	300121	阳谷华泰	52,897	724,159.93	0.35
149	002602	世纪华通	39,000	722,670.00	0.35
150	002715	登云股份	21,600	720,792.00	0.34
151	000816	智慧农业	121,900	720,429.00	0.34
152	002120	新海股份	34,800	712,704.00	0.34
153	600008	首创股份	183,200	712,648.00	0.34
154	300229	拓尔思	32,900	703,402.00	0.34
155	600982	宁波热电	132,700	698,002.00	0.33
156	600376	首开股份	62,700	697,224.00	0.33
157	002146	荣盛发展	103,600	696,192.00	0.33
158	300231	银信科技	37,610	693,528.40	0.33
159	002559	亚威股份	47,000	693,250.00	0.33
160	600388	龙净环保	55,100	692,056.00	0.33
161	300138	晨光生物	41,140	687,038.00	0.33
162	600803	新奥股份	58,386	681,948.48	0.33
163	000400	许继电气	44,082	680,626.08	0.33
164	600683	京投发展	73,600	680,064.00	0.33
165	002400	省广股份	48,120	679,935.60	0.33
166	600083	博信股份	33,949	678,301.02	0.32
167	600988	赤峰黄金	36,300	676,995.00	0.32
168	600568	中珠控股	38,600	671,640.00	0.32
169	600634	中技控股	46,200	665,742.00	0.32
170	002638	勤上光电	30,800	661,276.00	0.32
171	000752	西藏发展	41,710	659,852.20	0.32
172	000423	东阿阿胶	12,400	655,092.00	0.31
173	300364	中文在线	12,594	654,888.00	0.31
174	000595	宝塔实业	61,500	653,130.00	0.31
175	000951	中国重汽	68,100	651,036.00	0.31
176	002481	双塔食品	89,100	650,430.00	0.31
177	300273	和佳股份	33,700	645,355.00	0.31
178	000541	佛山照明	62,700	645,183.00	0.31
179	603688	石英股份	30,900	643,338.00	0.31
180	600057	象屿股份	62,300	640,444.00	0.31

181	000669	金鸿能源	38,300	639,610.00	0.31
182	300204	舒泰神	34,500	636,180.00	0.30
183	002456	欧菲光	21,500	634,250.00	0.30
184	300262	巴安水务	41,300	632,716.00	0.30
185	600422	昆药集团	46,300	631,532.00	0.30
186	300248	新开普	23,400	629,694.00	0.30
187	000790	华神集团	55,400	626,574.00	0.30
188	603998	方盛制药	41,700	612,156.00	0.29
189	000709	河钢股份	219,100	606,907.00	0.29
190	600048	保利地产	70,100	604,963.00	0.29
191	300070	碧水源	39,667	590,244.96	0.28
192	600153	建发股份	46,900	562,800.00	0.27
193	002713	东易日盛	18,600	539,958.00	0.26
194	300294	博雅生物	6,477	407,144.22	0.19
195	603729	龙韵股份	5,200	405,704.00	0.19
196	000836	鑫茂科技	65,300	403,554.00	0.19
197	000623	吉林敖东	16,100	401,695.00	0.19
198	600031	三一重工	79,200	397,584.00	0.19
199	600289	亿阳信通	28,200	394,518.00	0.19
200	002658	雪迪龙	16,200	281,718.00	0.13
201	002221	东华能源	16,600	202,354.00	0.10
202	600175	美都能源	42,600	200,220.00	0.10
203	300169	天晟新材	18,700	199,342.00	0.10
204	601611	中国核建	4,790	100,206.80	0.05
205	603131	上海沪工	1,263	76,664.10	0.04
206	300515	三德科技	1,355	63,508.85	0.03
207	601127	小康股份	2,440	58,242.80	0.03
208	300518	盛讯达	694	32,513.90	0.02
209	002802	洪汇新材	1,629	24,565.32	0.01
210	603909	合诚股份	1,095	20,126.10	0.01
211	603958	哈森股份	1,331	19,299.50	0.01
212	601966	玲珑轮胎	1,336	17,341.28	0.01
213	603016	新宏泰	1,314	11,155.86	0.01
214	300520	科大国创	899	9,034.95	0.00
215	002805	丰元股份	971	5,631.80	0.00
216	002781	奇信股份	30	1,300.50	0.00
217	300150	世纪瑞尔	98	1,061.34	0.00
218	000890	法尔胜	100	1,059.00	0.00
219	002320	海峡股份	59	918.63	0.00

220	000797	中国武夷	50	747.00	0.00
221	300378	鼎捷软件	20	574.40	0.00
222	002270	法因数控	30	487.20	0.00
223	002172	澳洋科技	45	482.85	0.00
224	002228	合兴包装	60	333.60	0.00
225	002218	拓日新能	28	285.60	0.00
226	000530	大冷股份	8	85.28	0.00
227	000534	万泽股份	3	44.67	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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	601012	隆基股份	2,660,740.54	1.27
2	000066	长城电脑	2,488,249.19	1.19
3	002131	利欧股份	2,389,038.36	1.14
4	002157	正邦科技	2,015,410.00	0.96
5	002035	华帝股份	1,998,845.81	0.96
6	002726	龙大肉食	1,988,142.00	0.95
7	002079	苏州固锔	1,894,429.28	0.91
8	002734	利民股份	1,879,577.52	0.90
9	002074	国轩高科	1,873,790.17	0.90
10	002581	未名医药	1,860,237.00	0.89
11	002411	必康股份	1,857,168.00	0.89
12	002407	多氟多	1,849,236.00	0.88
13	002483	润邦股份	1,842,380.00	0.88
14	002118	紫鑫药业	1,837,899.00	0.88
15	002317	众生药业	1,837,851.00	0.88
16	002166	莱茵生物	1,833,327.00	0.88
17	002223	鱼跃医疗	1,818,190.46	0.87
18	000703	恒逸石化	1,791,090.25	0.86
19	601933	永辉超市	1,781,833.00	0.85
20	300312	邦讯技术	1,781,260.00	0.85

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	002709	天赐材料	2,112,135.00	1.01
2	300497	富祥股份	1,848,615.00	0.88
3	600094	大名城	1,815,322.91	0.87
4	603158	腾龙股份	1,631,991.38	0.78
5	002728	台城制药	1,622,650.00	0.78
6	300016	北陆药业	1,620,864.00	0.78
7	000066	长城电脑	1,557,927.00	0.75
8	300148	天舟文化	1,444,841.64	0.69
9	300176	鸿特精密	1,316,085.00	0.63
10	002407	多氟多	1,122,054.00	0.54
11	300438	鹏辉能源	1,106,951.46	0.53
12	300201	海伦哲	1,092,444.00	0.52
13	002131	利欧股份	1,082,751.00	0.52
14	600260	凯乐科技	1,079,288.00	0.52
15	300429	强力新材	1,073,930.00	0.51
16	300121	阳谷华泰	996,371.48	0.48
17	002734	利民股份	984,630.00	0.47
18	300312	邦讯技术	971,935.00	0.46
19	300448	浩云科技	963,459.00	0.46
20	002411	必康股份	945,767.95	0.45

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

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	365,745,160.42
卖出股票收入（成交）总额	203,061,288.26

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

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

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量 (买/ 卖)	合约市值(元)	公允价值变 动(元)	风险说明
IC1607	中证500期货 IC1607 合约	3	3,626,040.00	257,080.00	-
IC1609	中证500期货 IC1609 合约	5	5,870,200.00	337,400.00	-
IC1612	中证500期货 IC1612 合约	8	9,049,920.00	388,880.00	-
公允价值变动总额合计(元)					983,360.00
股指期货投资本期收益(元)					112,800.00
股指期货投资本期公允价值变动(元)					983,360.00

### 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

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

## 7.12 投资组合报告附注

**7.12.1** 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	3,884,644.75
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	14,509.71
5	应收申购款	107,423.34
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,006,577.80

### 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
683	289,573.92	139,314,041.99	70.44%	58,464,942.34	29.56%

## 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	1,055,868.24	0.5339%

## 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的情况

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	5.06	10,000,450.02	5.06	3年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,450.02	5.06	10,000,450.02	5.06	3年

注：1、上述份额总数为扣除认购费用并包含利息结转份额后的总份额数；

2、本基金发起式资金提供方仅为基金管理人。

## § 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	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	112,237,038.48
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	157,551,698.76
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-
本报告期期末基金份额总额	197,778,984.33

注:总申购份额含红利再投、转换入份额,总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期没有举行基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金本报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未作改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘用毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)为其审计机构,本报告所涵盖的审计期间为基金成立日(2016年3月15日)起至2016年12月31日止,本报告期应支付毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)的报酬为人民币50,000.00元。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
招商证券	1	54,076,698.28	9.51%	50,361.77	9.51%	新增
天风证券	2	-	-	-	-	新增
申万宏源	1	57,177,675.02	10.06%	53,249.72	10.06%	新增
中银国际	3	223,336,817.68	39.29%	207,993.64	39.29%	新增
东兴证券	2	29,990,909.97	5.28%	27,930.69	5.28%	新增
华创证券	2	138,379,861.77	24.34%	128,873.68	24.34%	新增
中投证券	1	-	-	-	-	新增
民族证券	1	-	-	-	-	新增
方正证券	1	-	-	-	-	新增
大通证券	1	-	-	-	-	新增
华泰证券	3	-	-	-	-	新增
东海证券	1	-	-	-	-	新增
兴业证券	2	-	-	-	-	新增
太平洋证券	2	-	-	-	-	新增
信达证券	2	-	-	-	-	新增
国金证券	1	-	-	-	-	新增
第一创业证券	1	-	-	-	-	新增
海通证券	3	-	-	-	-	新增
国泰君安	3	-	-	-	-	新增
国盛证券	1	-	-	-	-	新增
银河证券	1	-	-	-	-	新增
长城证券	2	-	-	-	-	新增
中泰证券	2	-	-	-	-	新增
国信证券	2	-	-	-	-	新增
华安证券	1	-	-	-	-	新增
新时代证券	1	-	-	-	-	新增
安信证券	1	-	-	-	-	新增
光大证券	1	-	-	-	-	新增
中信建投	6	-	-	-	-	新增
广发证券	1	-	-	-	-	新增
国海证券	1	-	-	-	-	新增
中金公司	2	-	-	-	-	新增
红塔证券	1	-	-	-	-	新增
平安证券	1	-	-	-	-	新增

中信证券	2	-	-	-	-	新增
长江证券	2	65,497,325.64	11.52%	60,997.54	11.52%	新增

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
招商证券	347,354.80	100.00%	2,417,000,000.00	97.19%	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	70,000,000.00	2.81%	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
第一创业证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-

新时代证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-

## 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	招商量化精选股票型发起式证券投资基金基金合同	中国证券报、证券时报、上海证券报	2016年2月15日
2	招商量化精选股票型发起式证券投资基金基金合同内容摘要	中国证券报、证券时报、上海证券报	2016年2月15日
3	招商量化精选股票型发起式证券投资基金份额发售公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2016年2月15日
4	招商量化精选股票型发起式证券投资基金招募说明书	中国证券报、证券时报、上海证券报	2016年2月15日
5	招商量化精选股票型发起式证券投资基金托管协议	中国证券报、证券时报、上海证券报	2016年2月15日
6	招商基金管理有限公司关于养老金账户通过直销中心认购旗下招商量化精选股票型发起式证券投资基金费率优惠的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2016年2月15日
7	招商基金管理有限公司关于招商量化精选股票型发起式证券投资基金增加上海浦发银行为代销机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2016年2月18日
8	关于招商量化精选股票型发起式证券投资基金增加天天基金等公司为销售机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2016年2月22日
9	招商基金管理有限公司关于招商量化精选股票型发起式证券投资基金增加包商银行作为代销机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2016年2月22日
10	关于招商量化精选股票型发起式证券投资基金增加盈米财富为代销机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2016年2月23日
11	招商基金管理有限公司关于招商量化精选股票型发起式证券投资基金增加华安证券等机构为代销机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2016年2月26日

12	招商沪深 300 地产等权重指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2016 年 2 月 27 日
13	关于招商量化精选股票型发起式证券投资基金增加陆金所资管为代销机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2016 年 2 月 29 日
14	招商基金管理有限公司关于招商量化精选股票型发起式证券投资基金增加信达证券等机构为代销机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2016 年 3 月 2 日
15	招商基金管理有限公司关于招商量化精选股票型发起式证券投资基金增加东北证券股份有限公司为代销机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2016 年 3 月 8 日
16	招商基金旗下部分基金增加上海利得为代销机构并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2016 年 3 月 14 日
17	招商量化精选股票型发起式证券投资基金基金合同生效公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2016 年 3 月 16 日
18	招商基金管理有限公司关于参加深圳市新兰德证券投资咨询有限公司费率优惠的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2016 年 3 月 31 日
19	关于开放招商量化精选股票型发起式证券投资基金日常申购赎回及转换和定期定额投资业务的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2016 年 4 月 12 日
20	招商基金管理有限公司关于旗下招商量化精选股票型发起式证券投资基金参与银河证券等销售渠道基金定投申购优惠活动及网上交易系统申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2016 年 4 月 15 日
21	招商基金关于招商量化精选股票型发起式证券投资基金参加中国银行、交通银行、平安银行基金定投申购优惠活动、网上交易系统申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2016 年 4 月 15 日
22	招商基金管理有限公司关于旗下部分产品增加恒丰银行为代销机构并参加其基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2016 年 4 月 19 日
23	关于招商基金旗下部分基金增加钱景财富为代销机构并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2016 年 4 月 21 日
24	关于淘宝基金理财平台和支付宝基金支付业务下线的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2016 年 4 月 26 日
25	关于招商基金旗下部分基金增加新浪仓石为代销机构并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2016 年 4 月 27 日
26	关于招商基金旗下部分基金参加中国民生银行基金通申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2016 年 5 月 13 日
27	关于招商基金旗下部分基金增加苏宁为代销机构并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2016 年 5 月 13 日
28	招商基金管理有限公司关于旗下部分产品增加宁波银行为代销机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2016 年 5 月 16 日
29	招商基金旗下部分基金增加奕丰金融为代销机构并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2016 年 5 月 24 日

30	招商基金管理有限公司关于旗下部分产品增加大连银行为代销机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2016 年 5 月 31 日
31	招商基金管理有限公司关于旗下部分产品增加东莞农商银行为代销机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2016 年 6 月 17 日
32	招商基金旗下部分基金增加陆金所资管为代销机构及开通定投的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2016 年 6 月 28 日

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会批准设立招商基金管理有限公司的文件；
- 2、中国证券监督管理委员会批准招商量化精选股票型发起式证券投资基金设立的文件；
- 3、《招商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、《招商量化精选股票型发起式证券投资基金 2016 年第 2 季度报告》；
- 7、《招商量化精选股票型发起式证券投资基金 2016 年半年度报告》；
- 8、《招商量化精选股票型发起式证券投资基金 2016 年半年度报告摘要》。

### 11.2 存放地点

招商基金管理有限公司

地址：中国深圳深南大道 7088 号招商银行大厦

### 11.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人招商基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-887-9555

网址：<http://www.cmfchina.com>

招商基金管理有限公司  
2016 年 8 月 24 日