

招商量化精选股票型发起式证券投资 基金 2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人：招商基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2023 年 3 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 2023 年 3 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。

本报告财务资料已经审计，毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了 2022 年度无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现	6
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
§4 管理人报告.....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
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.....	12
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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.9 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.....	14
§5 托管人报告.....	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	15
§6 审计报告	15
6.1 审计报告的基本内容.....	15
§7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表.....	17
7.2 利润表.....	19
7.3 净资产（基金净值）变动表	21
7.4 报表附注	22
§8 投资组合报告	55
8.1 期末基金资产组合情况	55
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	55
8.3 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.....	56
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	62
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	75
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	75

8.7	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.....	76
8.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	76
8.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	76
8.10	本基金投资股指期货的投资政策.....	76
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	76
8.12	投资组合报告附注.....	76
§9	基金份额持有人信息.....	77
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	77
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	77
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	78
9.4	发起式基金发起资金持有份额情况.....	78
§10	开放式基金份额变动	78
§11	重大事件揭示.....	79
11.1	基金份额持有人大会决议	79
11.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	79
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	79
11.4	基金投资策略的改变	79
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	79
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	79
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	80
11.8	其他重大事件.....	83
§12	影响投资者决策的其他重要信息.....	85
12.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	85
§13	备查文件目录.....	86
13.1	备查文件目录.....	86
13.2	存放地点.....	86
13.3	查阅方式.....	86

§ 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	566,051,145.37 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	招商量化精选股票 A	招商量化精选股票 C
下属分级基金的交易代码	001917	007950
报告期末下属分级基金的份 额总额	296,216,469.72 份	269,834,675.65 份

注：本基金从 2019 年 9 月 11 日起新增 C 类份额，C 类份额自 2019 年 9 月 18 日起存续。

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	资产配置策略：本基金投资组合中股票、存托凭证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。 股票投资策略：本基金主要采用量化模型用以评估资产定价、控制风险和优化交易。 债券投资策略：根据国内外宏观经济形势、财政、货币政策、市场资金与债券供求状况、央行公开市场操作等方面情况，采用定性与定量相结合的方式，在确保流动性充裕和业绩考核期内可实现绝对收益的约束下设定债券投资的组合久期，并根据通胀预期确定浮息债与固定收益债比例。 中小企业私募债券投资策略：中小企业私募债具有票面利率较高、信用风险较大、二级市场流动性较差等特点。 资产支持证券的投资策略：本基金将在宏观经济和基本面分析的基础上，对资产支持证券的质量和构成、利率风险、信用风险、流动性风险和提前偿付风险等进行定性和定量的全方面分析，评估其相对投资价值并作出相应的投资决策，力求在控制投资风险的前提下尽可能的提高本基金的收益。 权证投资策略：本基金对权证资产的投资主要是通过分析影响权证内在价值最重要的两种因素——标的资产价格以及市场隐含波动率的变化，灵活构建避险策略，波动率差策略以及套利策略。

	股指期货投资策略：本基金采取套期保值的方式参与股指期货的投资交易，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。 存托凭证投资策略：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。
业绩比较基准	中证 500 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，其预期风险收益水平高于债券型基金及货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	招商基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	潘西里
	联系电话	0755—83196666
	电子邮箱	cmf@cmfchina.com
客户服务电话	400-887-9555	95566
传真	0755—83196475	010—66594942
注册地址	深圳市福田区深南大道 7088 号	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址	深圳市福田区深南大道 7088 号	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	518040	100818
法定代表人	王小青	刘连舸

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.cmfchina.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	中国北京市东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 楼
注册登记机构	招商基金管理有限公司	深圳市福田区深南大道 7088 号

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

单位：人民币元

1、招商量化精选股票 A

3.1.1 期间数据和指标	2022 年	2021 年	2020 年
本期已实现收益	2,163,715.50	12,886,991.00	17,603,325.77
本期利润	-24,799,168.96	14,857,196.92	15,515,870.00
加权平均基金份额本期利润	-0.1611	0.3296	0.4397
本期加权平均净值利润率	-7.88%	17.90%	32.47%
本期基金份额净值增长率	-1.06%	28.50%	43.58%
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
期末可供分配利润	256,326,898.12	53,727,589.88	19,623,578.09
期末可供分配基金份额利润	0.8653	0.8724	0.5404
期末基金资产净值	590,266,491.47	124,034,554.27	56,917,468.27
期末基金份额净值	1.9927	2.014	1.5673
3.1.3 累计期末指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
基金份额累计净值增长率	112.10%	114.37%	66.82%

2、招商量化精选股票 C

3.1.1 期间数据和指标	2022 年	2021 年	2020 年
本期已实现收益	542,062.51	3,105,168.64	13,113,740.51
本期利润	-31,418,683.65	-1,025,877.96	11,266,433.53
加权平均基金份额本期利润	-0.3170	-0.0755	0.4595
本期加权平均净值利润率	-15.61%	-3.99%	30.61%
本期基金份额净值增长率	-1.65%	27.71%	42.74%
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
期末可供分配利润	229,699,575.29	20,422,076.15	9,083,133.08
期末可供分配基金份额利润	0.8513	0.8702	0.5520
期末基金资产净值	528,427,874.75	46,729,957.18	25,654,813.90
期末基金份额净值	1.9583	1.9912	1.5591
3.1.3 累计期末指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
基金份额累计净值增长率	99.66%	103.02%	58.96%

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；

4、本基金从 2019 年 9 月 11 日起新增 C 类份额，C 类份额自 2019 年 9 月 18 日起存续。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

招商量化精选股票 A

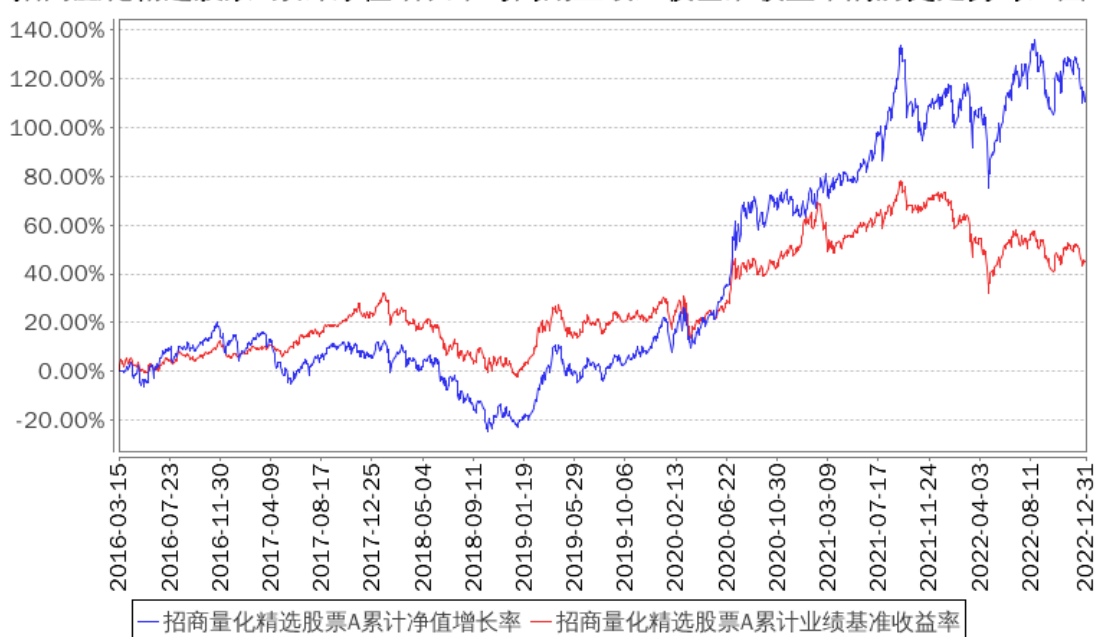
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	2.22%	1.11%	2.03%	0.82%	0.19%	0.29%
过去六个月	-3.57%	1.18%	-7.24%	0.88%	3.67%	0.30%
过去一年	-1.06%	1.43%	-16.21%	1.10%	15.15%	0.33%
过去三年	82.55%	1.39%	13.96%	1.05%	68.59%	0.34%
过去五年	98.28%	1.38%	17.63%	1.04%	80.65%	0.34%
自基金合同 生效起至今	112.10%	1.31%	45.18%	0.94%	66.92%	0.37%

招商量化精选股票 C

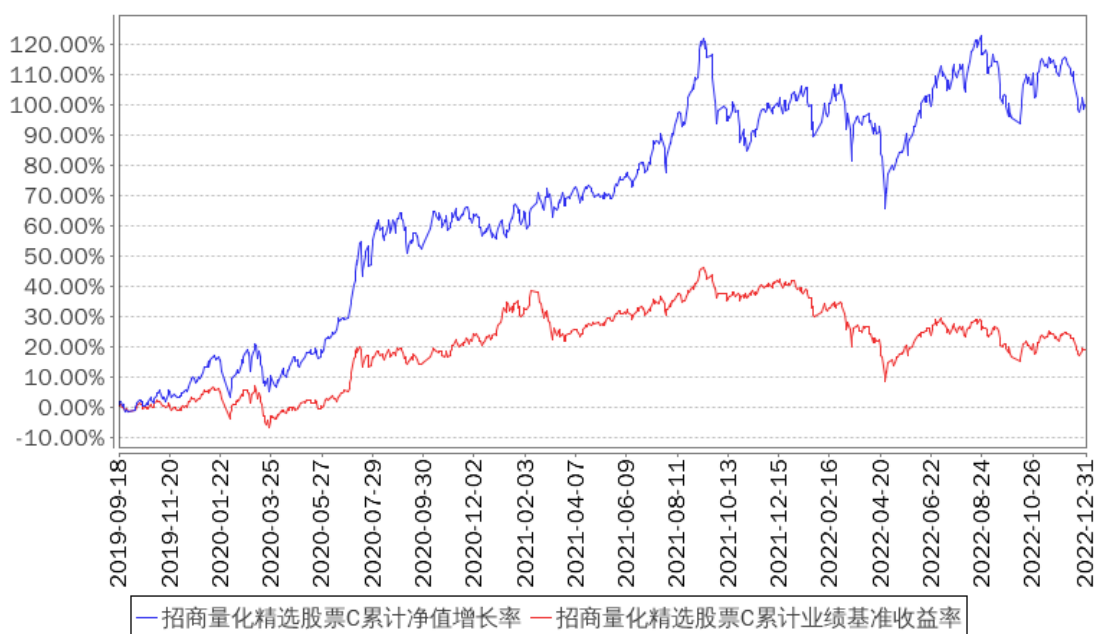
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	2.06%	1.11%	2.03%	0.82%	0.03%	0.29%
过去六个月	-3.86%	1.18%	-7.24%	0.88%	3.38%	0.30%
过去一年	-1.65%	1.42%	-16.21%	1.10%	14.56%	0.32%
过去三年	79.28%	1.38%	13.96%	1.05%	65.32%	0.33%
自基金合同 生效起至今	99.66%	1.35%	18.90%	1.01%	80.76%	0.34%

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

招商量化精选股票A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



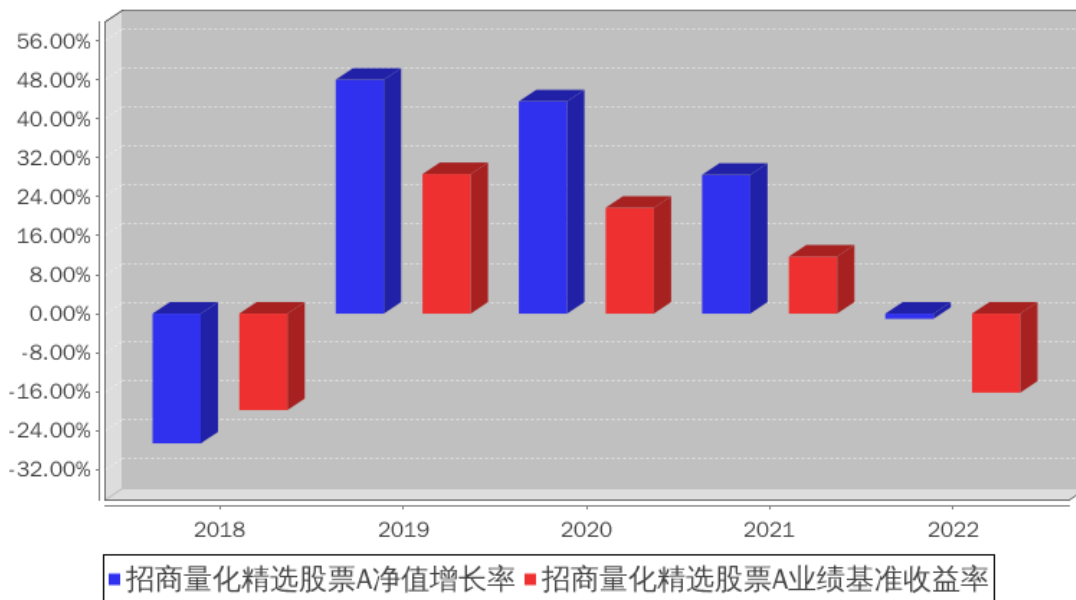
招商量化精选股票C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



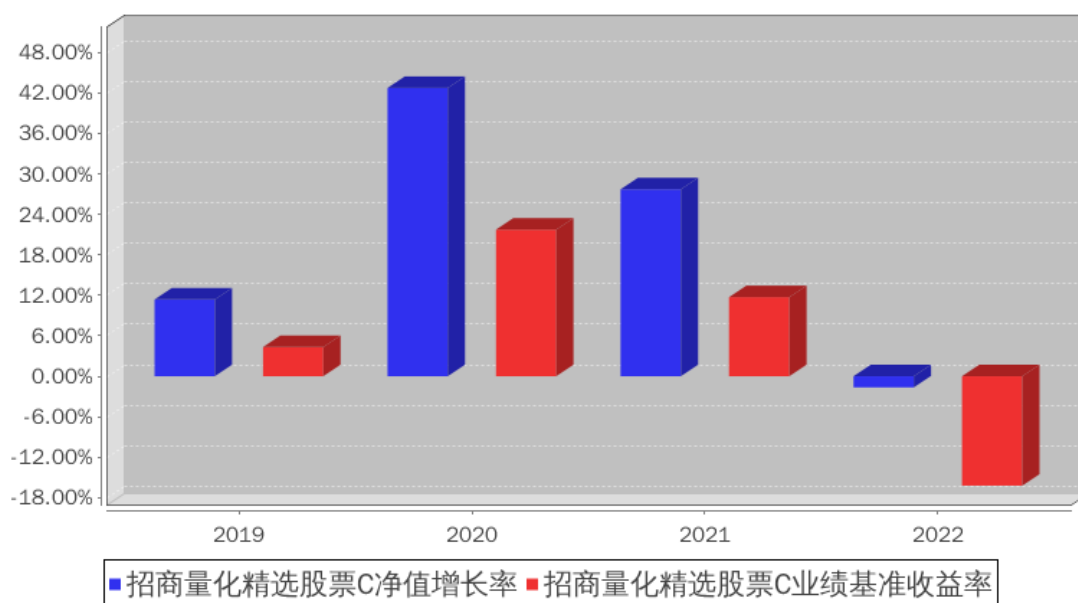
注：本基金从 2019 年 9 月 11 日起新增 C 类份额，C 类份额自 2019 年 9 月 18 日起存续。

3.2.3 过去五年以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

招商量化精选股票A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



招商量化精选股票C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金从 2019 年 9 月 11 日起新增 C 类份额，C 类份额自 2019 年 9 月 18 日起存续，故存续起始当年净值增长率按当年实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

招商基金管理有限公司首批获得企业年金基金投资管理人资格、基本养老保险基金投资管理人资格；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	说明
----	----	-----------------	------	----

		任职日期	离任日期	年限	
王平	本基金基金经理	2016 年 3 月 15 日	-	16	男，管理学硕士，FRM。2006 年加入招商基金管理有限公司，曾任投资风险管理部助理数量分析师、风险管理部数量分析师、高级风控经理，主要负责公司投资风险管理、金融工程研究等工作，曾任招商深证 100 指数证券投资基金、上证消费 80 交易型开放式指数证券投资基金、招商上证消费 80 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、深证电子信息传媒产业(TMT)50 交易型开放式指数证券投资基金、招商深证电子信息传媒产业(TMT)50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、招商中证大宗商品股票指数证券投资基金（LOF）、招商央视财经 50 指数证券投资基金、招商中证煤炭等权指数分级证券投资基金、招商中证银行指数分级证券投资基金、招商国证生物医药指数分级证券投资基金、招商中证白酒指数分级证券投资基金、招商稳荣定期开放灵活配置混合型证券投资基金、招商财经大数据策略股票型证券投资基金、招商盛合灵活配置混合型证券投资基金基金经理，现任量化投资部副总监兼招商量化精选股票型发起式证券投资基金、招商沪深 300 指数增强型证券投资基金、招商中证 1000 指数增强型证券投资基金、招商中证 500 指数增强型证券投资基金、招商中证红利交易型开放式指数证券投资基金、招商中证 500 等权重指数增强型证券投资基金、招商中证光伏产业指数型证券投资基金、招商沪深 300 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、招商中证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金、招商中证银行 AH 价格优选交易型开放式指数证券投资基金、招商中证 800 指数增强型证券投资基金、招商中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、招商中证银行 AH 价格优选交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理。

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《证券投资基金经营机构董事、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本基金的基金合同等基金法律文件的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的前提下，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围以及投资运作符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

基金管理人已建立较完善的研究方法和投资决策流程，确保各投资组合享有公平的投资决策机会。基金管理人建立了所有组合适用的投资对象备选库，制定明确的备选库建立、维护程序。基金管理人拥有健全的投资授权制度，明确投资决策委员会、投资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。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，本基金各项交易均严格按照相关法律法规、基金合同的有关要求执行，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% 的情形共发生过七次，原因是指数量化投资组合为满足投资策略需要而发生反向交易。报告期内未发现有可能导致不公平交易和利益输送的重大异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金的量化选股策略相对于基准指数获得了 18.01% 的超额收益，前 8 个月策略超额收益率稳步上行，后四个月出现了两波较大幅度的回撤，一波出现在 9 月，幅度 3.41%，一波出现在 11-12 月，幅度 4.18%，主要原因是地产政策及防疫政策的调整干扰了市场，短期吸引非常多的资金流向相关主题。由于回撤幅度依旧在合理范围之类，因此后续暂无调整策略的计划，预计在相关政策冲击过后，市场会恢复常态。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金 A 类份额净值增长率为-1.06%，同期业绩基准增长率为-16.21%，C 类份额净值增长率为-1.65%，同期业绩基准增长率为-16.21%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

回顾 2022 年，受俄乌冲突、美元加息、疫情冲击等因素影响，基准指数中证 500 指数震荡下行，全年下跌 20.31%，投资者预期及情绪的极不稳定造成了市场波动率加大。行业方面，电子、综合金融、计算机、国防军工等行业跌幅超过 24%，煤炭、消费者服务、交通运输获得了正收益。

展望 2023 年，影响过去一年的重大因素都有了边际上的改善，美元加息进入尾声、新型冠状病毒感染调整为乙类乙管，房地产政策积极调整，再叠加积极的财政政策和适度宽松的货币政策，实体经济会逐步步入复苏通道，企业盈利改善的确定性较高。投资者信心也将逐步恢复，预计 A 股市场也将震荡上行。行业方面，前期调整比较充分的生物医药、电子、汽车零配件等行业风险收益比更优。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人本着诚实信用、勤勉尽责、合法经营和保障基金持有人利益的原则，经营管理和业务运作稳健、合规，基金的投资、交易、后台等运作规范有序。基金管理人的风险管理及合规控制部门依据独立、客观、公正的原则，主要从以下几个方面进一步加强了公司内部控制和基金投资风险管理工作：

1、公司实施了员工全面培训和形式多样的专题培训，包括不定期推送监管动态和风险案例，持续整理风险点录入系统定期推送，定期或不定期组织法规考试，不定期开展各类合规主题培训等，丰富培训形式，不断提升员工合规与风控意识；

2、公司合规风控部门通过事中合规控制系统、事后投资风险管理系统、风险管理模型等对基金投资合规情况及风险情况进行严格的内部监控和管理；

3、定期稽核方面，除了每季度会对各业务领域进行一次全面的稽核，公司合规审计部门还根据监察稽核计划，对公司的关键业务部门及业务流程进行了专项稽核和检查；

4、根据法律法规的更新及业务的发展变化情况，公司各业务部门对相关内部控制制度提出修改意见和建议，并关注内部控制制度的健全性和有效性，进一步完善了公司内控制度体系，更好的防范法律风险和合规风险。

报告期内，本基金的投资运作符合国家相关法律法规、监管部门的有关规定以及公司相关制度的规定。本基金的投资目标、投资决策依据和投资管理程序均符合相关基金合同和招募说明书的约定，未发现重大异常交易、利益输送、内幕交易及其他有损基金投资者利益的情形。报告期内，本基金若曾因市场波动、申购赎回等原因出现了相关投资比例限制被动突破的情形，均在法规规定的时间内完成了调整，符合法律法规和基金合同的规定和要求。报告期内，本基金未出现因权证未行权、可转债未及时卖出或转股等有损基金份额持有人利益的投资失误行为。本基金管理人承诺将一如既往本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产，在规范经营、控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。

4.7 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。

4.8 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。

4.9 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

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（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 审计报告

6.1 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	招商量化精选股票型发起式证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了后附的招商量化精选股票型发起式证券投资基金(以下简称“该基金”)财务报表，包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表，2022 年度的利润表、净资产(基金净值)变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则（以下简称“企业会计准则”）、《资产管理产品相关会计处理规定》及财务报表附注[7.4.2]中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了该基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及，2022 年度的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则(以下简称“审计准则”)的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于该基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了

	基础。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	该基金管理人招商基金管理有限公司（以下简称“该基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括该基金 2022 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	该基金管理人管理层负责按照企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及财务报表附注[7.4.2]中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，该基金管理人管理层负责评估该基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非该基金预计在清算时资产无法按照公允价值处置。 该基金管理人治理层负责监督该基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我

	们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： (1)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 (2)了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 (3)评价该基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 (4)对该基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对该基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致该基金不能持续经营。 (5)评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与该基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	吴钟鸣，吴巧莉
会计师事务所的地址	中国北京市东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 楼
审计报告日期	2023 年 3 月 29 日

§ 7 年度财务报表

7.1 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：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	77,548,301.18	9,616,000.85
结算备付金		3,931,419.43	1,086,855.70
存出保证金		1,749,852.93	256,509.00
交易性金融资产	7.4.7.2	1,053,663,166.81	160,543,641.98
其中：股票投资		1,052,501,902.17	159,897,171.53
基金投资		-	-
债券投资		1,161,264.64	646,470.45
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
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		-	74,241.94
应收股利		-	-
应收申购款		3,123,332.98	196,588.94
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	1,543.76
资产总计		1,140,016,073.33	171,775,382.17
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		8,281,058.92	-
应付赎回款		8,669,471.99	276,280.29
应付管理人报酬		1,535,665.78	221,134.08
应付托管费		255,944.29	36,855.66
应付销售服务费		300,244.34	23,578.79

应付投资顾问费		-	-
应交税费		8.74	1.61
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	2,279,313.05	453,020.29
负债合计		21,321,707.11	1,010,870.72
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	566,051,145.37	85,053,358.27
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	552,643,220.85	85,711,153.18
净资产合计		1,118,694,366.22	170,764,511.45
负债和净资产总计		1,140,016,073.33	171,775,382.17

注：1、报告截止日 2022 年 12 月 31 日，招商量化精选股票 A 份额净值 1.9927 元，基金份额总额 296,216,469.72 份；招商量化精选股票 C 份额净值 1.9583 元，基金份额总额 269,834,675.65 份；总份额合计 566,051,145.37 份；

2、以下比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的资产负债表格式的要求进行列示：上年度资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目“本期末”余额合并列示在本期资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，上年度资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本期资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额中。

7.2 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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-46,061,652.56	17,366,731.55
1.利息收入		155,863.01	50,522.59
其中：存款利息收入	7.4.7.9	155,863.01	42,577.57
债券利息收入		-	7,945.02
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”		11,818,317.30	19,088,670.32

填列)			
其中：股票投资收益	7.4.7.10	6,169,760.24	17,524,969.10
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	573,544.93	67,795.03
资产支持证券投资 收益	7.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.13	-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-434,987.34	393,553.61
股利收益	7.4.7.15	5,509,999.47	1,102,352.58
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）	7.4.7.16	-58,923,630.62	-2,160,840.68
4.汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-” 号填列）	7.4.7.17	887,797.75	388,379.32
减：二、营业总支出		10,156,200.05	3,535,412.59
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	7,539,600.62	1,637,170.66
2.托管费	7.4.10.2.2	1,256,600.00	272,861.70
3.销售服务费	7.4.10.2.3	1,165,066.86	156,670.00
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	7.4.7.18	-	-
7.税金及附加		1,466.50	1,609.22
8.其他费用	7.4.7.19	193,466.07	1,467,101.01
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		-56,217,852.61	13,831,318.96
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		-56,217,852.61	13,831,318.96
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		-56,217,852.61	13,831,318.96

注：以下比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的利润表格式的要求进行列示：上年度可比期间利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本期利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

7.3 净资产（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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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）	85,053,358.27	-	85,711,153.18	170,764,511.45
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）	85,053,358.27	-	85,711,153.18	170,764,511.45
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	480,997,787.10	-	466,932,067.67	947,929,854.77
（一）、综合收益总额	-	-	-56,217,852.61	-56,217,852.61
（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）	480,997,787.10	-	523,149,920.28	1,004,147,707.38
其中：1.基金申购款	730,274,382.96	-	778,567,059.65	1,508,841,442.61
2.基金赎回款	-249,276,595.86	-	-255,417,139.37	-504,693,735.23
（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）	566,051,145.37	-	552,643,220.85	1,118,694,366.22
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 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）	52,770,232.72	-	29,802,049.45	82,572,282.17
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）	52,770,232.72	-	29,802,049.45	82,572,282.17
三、本期增减变动额	32,283,125.55	-	55,909,103.73	88,192,229.28

(减少以“-”号填列)				
(一)、综合收益总额	-	-	13,831,318.96	13,831,318.96
(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)	32,283,125.55	-	42,077,784.77	74,360,910.32
其中: 1.基金申购款	119,070,318.52	-	118,444,614.20	237,514,932.72
2.基金赎回款	-86,787,192.97	-	-76,366,829.43	-163,154,022.40
(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)	85,053,358.27	-	85,711,153.18	170,764,511.45

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

_____ 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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

招商量化精选股票型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人招商基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《招商量化精选股票型发起式证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规的规定,经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于准予招商量化精选股票型发起式证券投资基金注册的批复》(证监许可[2015]2210 号文)批准公开募集。本基金为契约型、开放式、发起式,存续期限为不定期,首次设立募集基金份额为 243,093,644.61 份,经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了编号为毕马威华振验字第 1600365 号验资报告。《招商量化精选股票型发起式证券投资基金基金合同》于 2016 年 3 月 15 日正式生效。本基金的基金管理人为招商基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”)。

本基金于 2016 年 2 月 18 日至 2016 年 3 月 11 日募集,募集期间净认购资金人民币 243,045,764.14 元,认购资金在募集期间产生的利息人民币 47,880.47 元,募集的有效认购份额及利息结转的基金份额合计 243,093,644.61 份。上述募集资金已由毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了毕马威华振验字第 1600365 号验资报告。

根据中国证监会 2017 年 8 月 31 日发布的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称“《流动性风险管理规定》”),对已经存续的开放式证券投资基金且基

金合同内容不符合《流动性风险管理规定》要求的，应当在《流动性风险管理规定》施行之日起 6 个月内予以调整。根据《流动性风险管理规定》等法律法规，经与基金托管人协商一致，招商基金管理有限公司对本基金合同相关条款进行修订，修订后的合同的全部条款已于 2018 年 3 月 31 日起正式实施。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《招商量化精选股票型发起式证券投资基金基金合同》和截至报告期末最新公告的《招商量化精选股票型发起式证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的 A 股股票和存托凭证(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和存托凭证)、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、存托凭证资产占基金资产的比例不低于 80%，权证投资占基金资产净值的 0%-3%；任何交易日日终在扣除需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%，其中，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金业绩比较基准为：中证 500 指数收益率×80%+中债综合指数收益率×20%。

为满足投资者需求，本基金于 2019 年 9 月 11 日起新增 C 类基金份额。原有的基金份额在增加 C 类基金份额后，全部自动转换为招商量化精选股票型发起式证券投资基金 A 类基金份额。

7.4.2 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，同时在实际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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(a) 金融资产的分类

本基金的金融工具包括股票投资和债券投资等。

本基金通常根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征，在初始确认时将金融资产分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以摊余成本计量的金融资产。

除非本基金改变管理金融资产的业务模式，在此情形下，所有受影响的相关金融资产在业务模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类，否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；
- 该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产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。本基金现无分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

管理金融资产的业务模式，是指本基金如何管理金融资产以产生现金流量。业务模式决定本基金所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本基金以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础，确定管理金融资产的业务模式。

本基金对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定时期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本基金对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

(b) 金融负债的分类

本基金将金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及以摊余成本计量的金融负债。

本基金现无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

(a) 金融工具的初始确认

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。

(b) 后续计量

-以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失(包括利息和股利收入)计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

-以摊余成本计量的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

-以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债以公允价值进行后续计量，除与套期会计有关外，产生的利得或损失(包括利息费用)计入当期损益。

-以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

(c) 金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；
- 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

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：

- 所转移金融资产在终止确认日的账面价值；
- 因转移金融资产而收到的对价。

金融负债（或其一部分）的现时义务已经解除的，本基金终止确认该金融负债（或该部分金融负债）。

(d) 金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

—以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

预期信用损失的计量

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

在计量预期信用损失时，本基金需考虑的最长期限为面临信用风险的最长合同期限（包括考虑续约选择权）。

整个存续期预期信用损失，是指因金融工具整个预计存续期内所有可能发生的违约事件而导致的预期信用损失。

未来 12 个月内预期信用损失，是指因资产负债表日后 12 个月内（若金融工具的预计存续期少于 12 个月，则为预计存续期）可能发生的金融工具违约事件而导致的预期信用损失，是整个存续期预期信用损失的一部分。

本基金对满足下列情形的金融工具按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备，对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备：

—该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险；或

—该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

预期信用损失准备的列报

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化，本基金在每个资产负债表日重新计量预期信用损失，由此形成的损失准备的增加或转回金额，应当作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产，损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

核销

如果本基金不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回，则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本基金确定债务人没有资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是，被减记的金融资产仍可能受到本基金催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

7.4.4.5 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。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据企业会计准则的规定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。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，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确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似金融工具的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时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时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。上述申购和赎回分别包括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。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平

准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配（未分配利润）。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产款在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

投资收益

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其初始计量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

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。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资，在其持有期间，按票面金额和票面利率计算的利息计入投资收益。

公允价值变动收益

公允价值变动收益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。

7.4.4.10 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。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产款在资金实际占用期间按实际利率法逐日确认为利息支出。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。基金可供分配利润为正的情况下，方可进行利益分配。本基金收益分配采用现金分红与红利再投资方式，基金份额持有人可选择现金分红或将现金红利按除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资，基金份额持有人事先未做出选择的，本基金默认的收益分配方式为现金分红。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。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，与所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策与计量基础一致。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

编制财务报表时，本基金需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入和支出的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本基金对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

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[2017]13号《中国证券监督管理委员会关于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。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

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、深圳证券交易所及银行间同业市场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。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

根据财政部发布的《企业会计准则第22号—金融工具确认计量》、《企业会计准则第23号—金融资产转移》、《企业会计准则第24号—套期会计》和《企业会计准则第37号—金融工具列报》（以下简称“新金融工具准则”）相关规定，以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于2020年12月30日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准

则的通知》，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。本基金在编制 2022 年度财务报表时已采用新金融工具准则，并采用准则允许的实务简便方法，调整期初基金净值，2021 年的比较数据将不作重述。

于首次执行日，本基金因执行新金融工具准则调减期初基金净值人民币 0.00 元，本基金执行新金融工具准则的影响如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融工具包括银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息和应付交易费用，金额分别为人民币 9,616,000.85 元、人民币 1,086,855.70 元、人民币 256,509.00 元、人民币 1,543.76 元和人民币 282,877.25 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融工具包括银行存款、结算备付金、存出保证金和其他负债-应付交易费用。本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在银行存款、结算备付金、存出保证金等项目中，不单独列示应收利息项目或应付利息项目。新金融工具准则下，银行存款、结算备付金、存出保证金和其他负债-应付交易费用的金额分别为人民币 9,616,998.78 元、人民币 1,087,324.64 元、人民币 256,532.30 元和人民币 282,877.25 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融工具为交易性金融资产，金额为人民币 160,543,641.98 元，归属于交易性金融资产的应收利息金额为人民币 53.59 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融工具为交易性金融资产，金额为人民币 160,543,695.57 元。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85 号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《财政部、国家税务总局、证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、《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》（财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号）、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《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通

知》、财税[2008]1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、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，本基金适用的主要税项列示如下：

(a) 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(b) 自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税(以下称营改增)试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人(以下称管理人)运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

2018 年 1 月 1 日(含)以后，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日以前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(c) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，

解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入个人所得税应纳税所得额。对基金从全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息、红利所得，由挂牌公司代扣代缴 20% 的个人所得税。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，其股息红利所得暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。

(e) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(f) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(g) 对基金在 2018 年 1 月 1 日（含）以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
活期存款	77,548,301.18	9,616,000.85
等于：本金	77,541,168.54	9,616,000.85
加：应计利息	7,132.64	-
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	77,548,301.18	9,616,000.85

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	1,112,555,471.58	-	1,052,501,902.17	-60,053,569.41

贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	1,160,989.82	274.82	1,161,264.64	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	1,160,989.82	274.82	1,161,264.64	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,113,716,461.40	274.82	1,053,663,166.81	-60,053,569.41
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票		161,533,185.10	-	159,897,171.53	-1,636,013.57
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	568,995.67	-	646,470.45	77,474.78
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	568,995.67	-	646,470.45	77,474.78
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		162,102,180.77	-	160,543,641.98	-1,558,538.79

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	9,204,120.00	-	-	-
其中：股指期货投资	9,204,120.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	9,204,120.00	-	-	-
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-

其中：国债期货投资	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
其中：远期外汇投资	-	-	-	-
权益衍生工具	1,461,160.00	-	-	-
其中：股指期货投资	1,461,160.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	1,461,160.00	-	-	-

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IM2301	IM2301	7.00	8,795,920.00	-408,200.00
合计				-408,200.00
减：可抵销期货暂收款				-408,200.00
净额				-

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末无各项买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应收利息	-	1,543.76
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	1,543.76

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	1,073.34	143.04
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	2,118,239.71	282,877.25
其中：交易所市场	2,118,239.71	282,877.25
银行间市场	-	-

应付利息	-	-
预提费用	160,000.00	170,000.00
合计	2,279,313.05	453,020.29

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

招商量化精选股票 A		
项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	61,584,909.65	61,584,909.65
本期申购	338,614,862.21	338,614,862.21
本期赎回（以“-”号填列）	-103,983,302.14	-103,983,302.14
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	296,216,469.72	296,216,469.72

招商量化精选股票 C		
项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	23,468,448.62	23,468,448.62
本期申购	391,659,520.75	391,659,520.75
本期赎回（以“-”号填列）	-145,293,293.72	-145,293,293.72
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	269,834,675.65	269,834,675.65

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。

7.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

招商量化精选股票 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	53,727,589.88	8,722,054.74	62,449,644.62
本期利润	2,163,715.50	-26,962,884.46	-24,799,168.96
本期基金份额交易产生的变动数	200,435,592.74	55,963,953.35	256,399,546.09
其中：基金申购款	289,006,256.33	76,710,415.25	365,716,671.58
基金赎回款	-88,570,663.59	-20,746,461.90	-109,317,125.49
本期已分配利润	-	-	-
本期末	256,326,898.12	37,723,123.63	294,050,021.75

招商量化精选股票 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	20,422,076.15	2,839,432.41	23,261,508.56
本期利润	542,062.51	-31,960,746.16	-31,418,683.65
本期基金份额交易产	208,735,436.63	58,014,937.56	266,750,374.19

生的变动数			
其中：基金申购款	332,709,761.19	80,140,626.88	412,850,388.07
基金赎回款	-123,974,324.56	-22,125,689.32	-146,100,013.88
本期已分配利润	-	-	-
本期末	229,699,575.29	28,893,623.81	258,593,199.10

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	113,960.02	29,681.56
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	39,772.91	12,425.52
其他	2,130.08	470.49
合计	155,863.01	42,577.57

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	6,169,760.24	17,524,969.10
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	6,169,760.24	17,524,969.10

7.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	2,002,744,996.04	404,601,605.56
减：卖出股票成本总额	1,989,896,963.29	387,076,636.46
减：交易费用	6,678,272.51	-
买卖股票差价收入	6,169,760.24	17,524,969.10

7.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无股票赎回差价收入。

7.4.7.10.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无股票申购差价收入。

7.4.7.10.5 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无证券出借差价收入。

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
债券投资收益——利息收入	589.10	-
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	572,955.83	67,795.03
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	573,544.93	67,795.03

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	2,513,613.16	2,058,600.58
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,940,185.66	1,959,618.56
减：应计利息总额	406.03	31,186.99
减：交易费用	65.64	-
买卖债券差价收入	572,955.83	67,795.03

7.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无债券赎回差价收入。

7.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无债券申购差价收入。

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

7.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无买卖资产支持证券差价收入。

7.4.7.12.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券赎回差价收入。

7.4.7.12.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券申购差价收入。

7.4.7.13 贵金属投资收益

7.4.7.13.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.13.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无买卖贵金属差价收入。

7.4.7.13.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属赎回差价收入。

7.4.7.13.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属申购差价收入。

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具买卖权证差价收入。

7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间收益金额 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
国债期货投资收益	-	-
股指期货投资收益	-434,987.34	393,553.61

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	5,509,999.47	1,102,352.58
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	5,509,999.47	1,102,352.58
----	--------------	--------------

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	-58,495,030.62	-2,181,240.68
——股票投资	-58,417,555.84	-2,257,629.43
——债券投资	-77,474.78	76,388.75
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-428,600.00	20,400.00
——权证投资	-	-
——期货投资	-428,600.00	20,400.00
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	-58,923,630.62	-2,160,840.68

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	887,797.75	388,379.32
其他	-	-
合计	887,797.75	388,379.32

7.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内及上年度可比期间无信用减值损失。

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
审计费用	40,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	15,466.07	6,453.40
交易费用	-	1,272,647.61
其他	18,000.00	18,000.00
合计	193,466.07	1,467,101.01

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

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

注：1、2022 年 12 月 30 日，招商资产管理(香港)有限公司的股权发生变更，基金管理人不再持有该公司的股权。同日，基金管理人新增持有博时基金(国际)有限公司 45% 的股权。

2、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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 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	148,953,774.99	3.03%	22,182,625.77	2.54%

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 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。

7.4.10.1.4 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。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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	138,722.08	3.28%	84,547.35	3.99%
关联方名称	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 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	20,658.77	2.64%	13,497.43	4.77%

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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	7,539,600.62	1,637,170.66
其中：支付销售机构的客户维护费	1,959,347.23	276,434.36
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：

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

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,256,600.00	272,861.70

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：

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

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	招商量化精选股票 A	招商量化精选股票 C	合计
招商基金管理有限公司	-	268,482.27	268,482.27
招商银行	-	67,617.58	67,617.58
招商证券	-	7.49	7.49
合计	-	336,107.34	336,107.34
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	招商量化精选股票 A	招商量化精选股票 C	合计
招商基金管理有限公司	-	79,632.11	79,632.11
招商银行	-	142.36	142.36
招商证券	-	-	-
合计	-	79,774.47	79,774.47

注：本基金的 C 类基金份额的年销售服务费率为 0.60%，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：

$$C \text{ 类份额日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金资产净值} \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

7.4.10.3 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。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 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	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
----	----------------------------------

	招商量化精选股票 A	招商量化精选股票 C
基金合同生效日（2016 年 3 月 15 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	10,000,450.02	-
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	5,000,000.00	-
报告期末持有的基金份额	5,000,450.02	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.69%	-

项目	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	招商量化精选股票 A	招商量化精选股票 C
基金合同生效日（2016 年 3 月 15 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	10,000,450.02	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,000,450.02	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	16.24%	-

7.4.10.5.2 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。

7.4.10.6 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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行-活期	77,548,301.18	113,960.02	9,616,000.85	29,681.56

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

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

单位：人民币元

本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
招商证券	688375	国博电子	网下申购	2,256	159,905.28

招商证券	001323	慕思股份	网下申购	573	22,306.89
招商证券	301123	奕东电子	网下申购	1,564	58,227.72

上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
招商证券	688206	概伦电子	网下申购	2,040	57,691.20
招商证券	301193	家联科技	网下申购	1,782	54,760.86
招商证券	001288	运机集团	网下申购	537	7,813.35
招商证券	688739	成大生物	网下申购	926	101,860.00
招商证券	301083	百胜智能	网下申购	4,160	37,772.80
招商证券	688772	珠海冠宇	网下申购	4,032	58,181.76
招商证券	605069	正和生态	网下申购	608	9,199.04
招商证券	001201	东瑞股份	网下申购	477	30,232.26
招商证券、中银国际证券	601728	中国电信	网上申购	7,000	31,710.00

注：本表已包含托管人的关联方承销期内承销的证券。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2022 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
301115	建科股份	2022 年 8 月 23 日	6 个月以上	新股流通受限	42.05	24.04	470	19,763.50	11,298.80	-
301132	满坤科技	2022 年 8 月 3 日	6 个月以上	新股流通受限	26.80	24.48	468	12,542.40	11,456.64	-
301152	天力锂能	2022 年 8 月 19 日	6 个月以上	新股流通受限	57.00	46.64	298	16,986.00	13,898.72	-
301161	唯万密封	2022 年 9 月 6 日	6 个月以上	新股流通受限	18.66	21.73	346	6,456.36	7,518.58	-
301165	锐捷网络	2022 年 11 月 14 日	6 个月以上	新股流通受限	32.38	31.61	1,077	34,873.26	34,043.97	-

		日								
301175	中科环保	2022 年 6 月 30 日	6 个月 以上	新股流通 受限	3.82	6.01	3,939	15,046.98	23,673.39	-
301176	逸豪新材	2022 年 9 月 21 日	6 个月 以上	新股流通 受限	23.88	16.89	544	12,990.72	9,188.16	-
301197	工大科雅	2022 年 7 月 29 日	6 个月 以上	新股流通 受限	25.50	20.08	380	9,690.00	7,630.40	-
301231	荣信文化	2022 年 8 月 31 日	6 个月 以上	新股流通 受限	25.49	20.38	275	7,009.75	5,604.50	-
301239	普瑞眼科	2022 年 6 月 22 日	6 个月 以上	新股流通 受限	33.65	69.68	369	12,416.85	25,711.92	-
301265	华新环保	2022 年 12 月 8 日	6 个月 以上	新股流通 受限	13.28	11.40	819	10,876.32	9,336.60	-
301267	华夏眼科	2022 年 10 月 26 日	6 个月 以上	新股流通 受限	50.88	66.20	569	28,950.72	37,667.80	-
301269	华大九天	2022 年 7 月 21 日	6 个月 以上	新股流通 受限	32.69	87.94	372	12,160.68	32,713.68	-
301270	汉仪股份	2022 年 8 月 19 日	6 个月 以上	新股流通 受限	25.68	28.37	210	5,392.80	5,957.70	-
301282	金禄电子	2022 年 8 月 18 日	6 个月 以上	新股流通 受限	30.38	25.25	404	12,273.52	10,201.00	-
301283	聚胶股份	2022 年 8 月 26 日	6 个月 以上	新股流通 受限	52.69	51.41	235	12,382.15	12,081.35	-
301285	鸿日达	2022 年 9 月 21 日	6 个月 以上	新股流通 受限	14.60	12.60	565	8,249.00	7,119.00	-
301296	新巨丰	2022 年 8 月 26 日	6 个月 以上	新股流通 受限	18.19	14.90	933	16,971.27	13,901.70	-
301297	富乐德	2022 年 12 月 23 日	6 个月 以上	新股流通 受限	8.48	12.99	1,015	8,607.20	13,184.85	-
301300	远翔新材	2022 年	6 个月	新股流通	36.15	29.37	211	7,627.65	6,197.07	-

		8月9日	以上	受限						
301301	川宁生物	2022年12月20日	6个月以上	新股流通受限	5.00	7.53	3,574	17,870.00	26,912.22	-
301306	西测测试	2022年7月19日	6个月以上	新股流通受限	43.23	42.29	255	11,023.65	10,783.95	-
301309	万得凯	2022年9月8日	6个月以上	新股流通受限	39.00	24.46	228	8,892.00	5,576.88	-
301311	昆船智能	2022年11月23日	6个月以上	新股流通受限	13.88	15.86	832	11,548.16	13,195.52	-
301313	凡拓数创	2022年9月22日	6个月以上	新股流通受限	25.25	29.14	247	6,236.75	7,197.58	-
301316	慧博云通	2022年9月29日	6个月以上	新股流通受限	7.60	14.32	359	2,728.40	5,140.88	-
301319	唯特偶	2022年9月22日	6个月以上	新股流通受限	47.75	53.27	115	5,491.25	6,126.05	-
301326	捷邦科技	2022年9月9日	6个月以上	新股流通受限	51.72	36.62	227	11,740.44	8,312.74	-
301327	华宝新能	2022年9月8日	6个月以上	新股流通受限	237.50	176.97	242	57,475.00	42,826.74	-
301328	维峰电子	2022年8月30日	6个月以上	新股流通受限	78.80	76.96	191	15,050.80	14,699.36	-
301338	凯格精机	2022年8月8日	6个月以上	新股流通受限	46.33	48.99	257	11,906.81	12,590.43	-
301339	通行宝	2022年9月2日	6个月以上	新股流通受限	18.78	15.59	913	17,146.14	14,233.67	-
301349	信德新材	2022年8月30日	6个月以上	新股流通受限	138.88	103.52	95	13,193.60	9,834.40	-
301359	东南电子	2022年11月2日	6个月以上	新股流通受限	20.84	19.90	328	6,835.52	6,527.20	-

301361	众智科技	2022 年 11 月 8 日	6 个月 以上	新股流通 受限	26.44	20.96	517	13,669.48	10,836.32	-
301367	怡和嘉业	2022 年 10 月 21 日	6 个月 以上	新股流通 受限	119.88	175.78	223	26,733.24	39,198.94	-
301368	丰立智能	2022 年 12 月 7 日	6 个月 以上	新股流通 受限	22.33	18.52	337	7,525.21	6,241.24	-
301377	鼎泰高科	2022 年 11 月 11 日	6 个月 以上	新股流通 受限	22.88	17.63	770	17,617.60	13,575.10	-
301388	欣灵电气	2022 年 10 月 26 日	6 个月 以上	新股流通 受限	25.88	21.60	292	7,556.96	6,307.20	-
301396	宏景科技	2022 年 11 月 4 日	6 个月 以上	新股流通 受限	40.13	31.90	396	15,891.48	12,632.40	-
301398	星源卓镁	2022 年 12 月 8 日	6 个月 以上	新股流通 受限	34.40	28.94	255	8,772.00	7,379.70	-
688053	思科瑞	2022 年 7 月 1 日	6 个月 以上	新股流通 受限	55.53	60.92	3,879	215,400.87	236,308.68	-
688252	天德钰	2022 年 9 月 20 日	6 个月 以上	新股流通 受限	21.68	15.78	5,201	112,757.68	82,071.78	-
688353	华盛锂电	2022 年 7 月 6 日	6 个月 以上	新股流通 受限	98.35	63.86	1,688	166,014.80	107,795.68	-
688372	伟测科技	2022 年 10 月 19 日	6 个月 以上	新股流通 受限	61.49	81.20	2,383	146,530.67	193,499.60	-
688416	恒烁股份	2022 年 8 月 22 日	6 个月 以上	新股流通 受限	65.11	37.01	1,982	129,048.02	73,353.82	-
688496	清越科技	2022 年 12 月 21 日	6 个月 以上	新股流通 受限	9.16	8.65	12,000	109,920.00	103,800.00	-
7.4.12.1.2 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
113664	大元转债	2022 年 12 月 5	1 个月 内（含）	新债未上 市	100.00	100.02	11,610	1,160,989.82	1,161,264.64	-

		日								
--	--	---	--	--	--	--	--	--	--	--

7.4.12.2 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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 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。

7.4.12.3.2 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。

7.4.12.4 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

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

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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，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 7.4.13.2.1 至 7.4.13.2.6 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。

7.4.13.2.1 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。

7.4.13.2.2 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。

7.4.13.2.3 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。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
AAA	-	53,999.76
AAA 以下	1,161,264.64	592,470.69
未评级	-	-
合计	1,161,264.64	646,470.45

注：上述评级均由经中国证监会核准从事证券市场资信评级业务的评级机构做出。

7.4.13.2.5 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。

7.4.13.2.6 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。

7.4.13.3 流动性风险

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金流动性风险来源于开放式基金每日兑付赎回资金的流动性风险，以及因部分投资品种交易不活跃而出现的变现风险以及因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理价格变现投资的风险。本基金所持有的交易性金融资产在证券交易所交易，除附注 7.4.12 所披露的流通受限不能自由转让的基金资产外，本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。除卖出回购金融资产款外，本基金所持有的全部金融负债无固定到期

日或合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值或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负债的账面价值，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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	77,548,301.18	-	-	-	77,548,301.18
结算备付金	3,931,419.43	-	-	-	3,931,419.43
存出保证金	430,464.93	-	-	1,319,388.00	1,749,852.93
交易性金融资产	-	-	1,161,264.64	1,052,501,902.17	1,053,663,166.81
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	-	-	-	3,123,332.98	3,123,332.98
应收清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	81,910,185.54	-	1,161,264.64	1,056,944,623.15	1,140,016,073.33
负债					

应付赎回款	-	-	-	8,669,471.99	8,669,471.99
应付管理人报酬	-	-	-	1,535,665.78	1,535,665.78
应付托管费	-	-	-	255,944.29	255,944.29
应付清算款	-	-	-	8,281,058.92	8,281,058.92
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	300,244.34	300,244.34
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	8.74	8.74
其他负债	-	-	-	2,279,313.05	2,279,313.05
负债总计	-	-	-	21,321,707.11	21,321,707.11
利率敏感度缺口	81,910,185.54	-	1,161,264.64	1,035,622,916.04	1,118,694,366.22
上年度末 2021 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	9,616,000.85	-	-	-	9,616,000.85
结算备付金	1,086,855.70	-	-	-	1,086,855.70
存出保证金	51,946.60	-	-	204,562.40	256,509.00
交易性金融资产	-	-	646,470.45	159,897,171.53	160,543,641.98
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	1,543.76	1,543.76
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	196,588.94	196,588.94
应收证券清算款	-	-	-	74,241.94	74,241.94
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	10,754,803.15	-	646,470.45	160,374,108.57	171,775,382.17
负债					
应付赎回款	-	-	-	276,280.29	276,280.29
应付管理人报酬	-	-	-	221,134.08	221,134.08
应付托管费	-	-	-	36,855.66	36,855.66
应付证券清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	23,578.79	23,578.79
应付交易费用	-	-	-	282,877.25	282,877.25
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	1.61	1.61
其他负债	-	-	-	170,143.04	170,143.04
负债总计	-	-	-	1,010,870.72	1,010,870.72

利率敏感度缺口	10,754,803.15	-	646,470.45	159,363,237.85	170,764,511.45
---------	---------------	---	------------	----------------	----------------

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

7.4.13.4.1.2 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（2022 年 12 月 31 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
	1. 市场利率平行上升 50 个基点	-32,160.00	-18,502.89
	2. 市场利率平行下降 50 个基点	33,248.23	19,149.57

7.4.13.4.2 其他价格风险

其他价格风险是指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。

7.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日		上年度末 2021 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	1,052,501,902.17	94.08	159,897,171.53	93.64
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	1,052,501,902.17	94.08	159,897,171.53	93.64

7.4.13.4.2.2 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（2022 年 12 月 31 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
	1. 权益性投资的市场价格上升 5%	52,625,095.11	7,994,858.58
	2. 权益性投资的市场价格下降 5%	-52,625,095.11	-7,994,858.58

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	1,051,126,558.26	159,379,535.70
第二层次	1,161,264.64	1,164,106.28
第三层次	1,375,343.91	-
合计	1,053,663,166.81	160,543,641.98

7.4.14.2.2 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。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	1,445,843.66	1,445,843.66

当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-70,499.75	-70,499.75
其中：计入损益的利得或损失	-	-70,499.75	-70,499.75
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,375,343.91	1,375,343.91
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-70,499.75	-70,499.75
项目	上年度可比同期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

金额单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股票投资	1,375,343.91	平均价格亚式期权模型	流通受限股票预期波动率	0.2127-2.4756	负相关
项目	上年度末公允	采用的估值技	不可观察输入值		

	价值	术	名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
-	-	-	-	-	-

7.4.14.3 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。

7.4.14.4 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。

7.4.15 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。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,052,501,902.17	92.32
	其中：股票	1,052,501,902.17	92.32
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,161,264.64	0.10
	其中：债券	1,161,264.64	0.10
	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	81,479,720.61	7.15
8	其他资产	4,873,185.91	0.43
9	合计	1,140,016,073.33	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	7,451,456.00	0.67
B	采矿业	13,244,836.00	1.18
C	制造业	884,859,205.29	79.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,566,850.00	0.32
E	建筑业	51,263,948.00	4.58
F	批发和零售业	34,538.69	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	56,994,459.09	5.09
J	金融业	5,072,457.21	0.45
K	房地产业	76,440.00	0.01
L	租赁和商务服务业	3,312,960.00	0.30
M	科学研究和技术服务业	15,721,039.28	1.41
N	水利、环境和公共设施管理业	23,673.39	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	63,379.72	0.01
R	文化、体育和娱乐业	5,604.50	0.00
S	综合	10,811,055.00	0.97
	合计	1,052,501,902.17	94.08

8.2.2 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。

8.3 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

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	600741	华域汽车	1,110,300	19,241,499.00	1.72
2	002048	宁波华翔	1,241,924	17,262,743.60	1.54
3	603600	永艺股份	1,689,981	16,477,314.75	1.47
4	600835	上海机电	1,448,420	16,251,272.40	1.45
5	600170	上海建工	6,211,130	16,148,938.00	1.44
6	603586	金麒麟	1,222,800	16,116,504.00	1.44
7	603890	春秋电子	1,759,000	16,077,260.00	1.44
8	601231	环旭电子	988,100	16,036,863.00	1.43
9	600742	一汽富维	1,854,600	15,504,456.00	1.39
10	002705	新宝股份	841,500	14,010,975.00	1.25
11	601717	郑煤机	1,225,796	13,679,883.36	1.22
12	603681	永冠新材	602,400	12,879,312.00	1.15
13	603355	莱克电气	451,100	12,648,844.00	1.13

14	002258	利尔化学	703,660	12,637,733.60	1.13
15	000030	富奥股份	2,728,400	12,004,960.00	1.07
16	000700	模塑科技	2,570,400	11,926,656.00	1.07
17	601038	一拖股份	1,053,173	11,900,854.90	1.06
18	603408	建霖家居	1,075,800	11,683,188.00	1.04
19	002662	京威股份	3,513,000	11,557,770.00	1.03
20	000726	鲁泰 A	1,535,800	11,334,204.00	1.01
21	605066	天正电气	1,513,640	11,291,754.40	1.01
22	300509	新美星	1,981,400	10,897,700.00	0.97
23	000551	创元科技	1,261,500	10,811,055.00	0.97
24	300407	凯发电气	1,497,400	10,751,332.00	0.96
25	601668	中国建筑	1,968,200	10,687,326.00	0.96
26	605088	冠盛股份	610,900	10,495,262.00	0.94
27	002085	万丰奥威	1,746,800	10,393,460.00	0.93
28	603228	景旺电子	503,617	10,193,208.08	0.91
29	605196	华通线缆	1,442,874	10,071,260.52	0.90
30	603013	亚普股份	683,600	9,795,988.00	0.88
31	603906	龙蟠科技	422,700	9,785,505.00	0.87
32	002957	科瑞技术	642,600	9,722,538.00	0.87
33	603298	杭叉集团	575,843	9,679,920.83	0.87
34	000921	海信家电	722,200	9,511,374.00	0.85
35	300115	长盈精密	894,900	9,244,317.00	0.83
36	605365	立达信	574,500	9,237,960.00	0.83
37	603083	剑桥科技	814,500	9,154,980.00	0.82
38	600582	天地科技	1,709,200	8,887,840.00	0.79
39	603161	科华控股	710,100	8,862,048.00	0.79
40	300694	蠡湖股份	903,900	8,550,894.00	0.76
41	002768	国恩股份	285,500	8,285,210.00	0.74
42	603421	鼎信通讯	973,800	8,150,706.00	0.73
43	002955	鸿合科技	341,400	8,039,970.00	0.72
44	600481	双良节能	621,258	8,039,078.52	0.72
45	000913	钱江摩托	433,900	8,018,472.00	0.72
46	603968	醋化股份	363,800	7,905,374.00	0.71
47	300377	赢时胜	959,500	7,877,495.00	0.70
48	002600	领益智造	1,707,000	7,749,780.00	0.69
49	603611	诺力股份	478,600	7,748,534.00	0.69
50	300100	双林股份	1,021,800	7,489,794.00	0.67
51	600731	湖南海利	1,001,338	7,469,981.48	0.67
52	000521	长虹美菱	1,713,200	7,212,572.00	0.64
53	603677	奇精机械	629,200	7,047,040.00	0.63
54	603089	正裕工业	848,600	7,009,436.00	0.63
55	300145	中金环境	2,797,120	6,797,001.60	0.61
56	600971	恒源煤电	944,200	6,760,472.00	0.60

57	002986	宇新股份	293,140	6,372,863.60	0.57
58	300639	凯普生物	378,200	6,372,670.00	0.57
59	002899	英派斯	481,800	6,032,136.00	0.54
60	603920	世运电路	419,400	6,030,972.00	0.54
61	603357	设计总院	593,100	5,385,348.00	0.48
62	000682	东方电子	649,600	5,222,784.00	0.47
63	002605	姚记科技	370,400	5,204,120.00	0.47
64	600210	紫江企业	1,019,800	5,099,000.00	0.46
65	600699	均胜电子	361,100	5,073,455.00	0.45
66	300684	中石科技	338,900	5,019,109.00	0.45
67	603855	华荣股份	216,300	4,996,530.00	0.45
68	600261	阳光照明	1,555,900	4,963,321.00	0.44
69	600629	华建集团	1,120,600	4,919,434.00	0.44
70	300118	东方日升	195,200	4,844,864.00	0.43
71	002829	星网宇达	140,800	4,842,112.00	0.43
72	002938	鹏鼎控股	176,200	4,834,928.00	0.43
73	600894	广日股份	743,190	4,793,575.50	0.43
74	600133	东湖高新	863,400	4,748,700.00	0.42
75	603515	欧普照明	306,452	4,743,876.96	0.42
76	603757	大元泵业	245,400	4,733,766.00	0.42
77	600820	隧道股份	894,100	4,711,907.00	0.42
78	603927	中科软	159,100	4,710,951.00	0.42
79	603339	四方科技	384,400	4,693,524.00	0.42
80	600761	安徽合力	351,200	4,618,280.00	0.41
81	002987	京北方	173,400	4,610,706.00	0.41
82	603086	先达股份	348,783	4,565,569.47	0.41
83	603018	华设集团	593,800	4,501,004.00	0.40
84	300445	康斯特	361,500	4,410,300.00	0.39
85	300570	太辰光	300,600	4,346,676.00	0.39
86	300807	天迈科技	211,600	4,325,104.00	0.39
87	603118	共进股份	543,700	4,322,415.00	0.39
88	600970	中材国际	501,600	4,273,632.00	0.38
89	000651	格力电器	131,100	4,237,152.00	0.38
90	300441	鲍斯股份	775,626	4,227,161.70	0.38
91	003011	海象新材	195,700	4,182,109.00	0.37
92	002929	润建股份	106,300	4,173,338.00	0.37
93	300403	汉宇集团	700,700	4,134,130.00	0.37
94	300698	万马科技	174,100	4,122,688.00	0.37
95	301004	嘉益股份	138,200	4,115,596.00	0.37
96	600285	羚锐制药	315,500	4,114,120.00	0.37
97	300644	南京聚隆	296,400	4,093,284.00	0.37
98	600129	太极集团	135,340	4,068,320.40	0.36
99	600967	内蒙一机	486,400	4,017,664.00	0.36

100	002360	同德化工	569,900	4,006,397.00	0.36
101	300504	天邑股份	248,600	3,990,030.00	0.36
102	002045	国光电器	321,100	3,978,429.00	0.36
103	300703	创源股份	399,500	3,951,055.00	0.35
104	603269	海鸥股份	319,700	3,948,295.00	0.35
105	300729	乐歌股份	237,600	3,841,992.00	0.34
106	603129	春风动力	34,100	3,836,932.00	0.34
107	002328	新朋股份	763,600	3,818,000.00	0.34
108	300970	华绿生物	213,400	3,798,520.00	0.34
109	600202	哈空调	752,400	3,784,572.00	0.34
110	603948	建业股份	171,800	3,740,086.00	0.33
111	603050	科林电气	237,700	3,739,021.00	0.33
112	300205	天喻信息	338,000	3,718,000.00	0.33
113	002478	常宝股份	660,300	3,717,489.00	0.33
114	003036	泰坦股份	313,900	3,707,159.00	0.33
115	603556	海兴电力	210,300	3,701,280.00	0.33
116	300130	新国都	306,000	3,693,420.00	0.33
117	000404	长虹华意	670,100	3,658,746.00	0.33
118	300972	万辰生物	303,400	3,652,936.00	0.33
119	601956	东贝集团	618,400	3,642,376.00	0.33
120	002567	唐人神	514,400	3,641,952.00	0.33
121	603661	恒林股份	127,660	3,634,480.20	0.32
122	002391	长青股份	516,200	3,628,886.00	0.32
123	300830	金现代	466,100	3,616,936.00	0.32
124	300514	友讯达	352,630	3,614,457.50	0.32
125	300385	雪浪环境	610,800	3,597,612.00	0.32
126	000600	建投能源	679,400	3,566,850.00	0.32
127	600469	风神股份	760,300	3,565,807.00	0.32
128	002615	哈尔斯	591,049	3,558,114.98	0.32
129	300907	康平科技	196,600	3,515,208.00	0.31
130	600985	淮北矿业	274,600	3,514,880.00	0.31
131	300349	金卡智能	374,700	3,510,939.00	0.31
132	000823	超声电子	376,300	3,495,827.00	0.31
133	300546	雄帝科技	162,300	3,466,728.00	0.31
134	002614	奥佳华	369,900	3,451,167.00	0.31
135	603767	中马传动	476,860	3,414,317.60	0.31
136	605218	伟时电子	244,000	3,367,200.00	0.30
137	603158	腾龙股份	472,600	3,350,734.00	0.30
138	600284	浦东建设	495,000	3,336,300.00	0.30
139	300269	联建光电	812,000	3,312,960.00	0.30
140	603037	凯众股份	205,500	3,304,440.00	0.30
141	002533	金杯电工	542,500	3,282,125.00	0.29
142	603266	天龙股份	262,900	3,259,960.00	0.29

143	600356	恒丰纸业	445,100	3,258,132.00	0.29
144	003002	壶化股份	176,100	3,240,240.00	0.29
145	603551	奥普家居	331,210	3,229,297.50	0.29
146	603059	倍加洁	169,100	3,224,737.00	0.29
147	002209	达意隆	398,200	3,189,582.00	0.29
148	002774	快意电梯	494,600	3,165,440.00	0.28
149	002510	天汽模	802,600	3,122,114.00	0.28
150	301067	显盈科技	86,100	3,112,515.00	0.28
151	600853	龙建股份	814,500	3,054,375.00	0.27
152	001696	宗申动力	506,000	3,005,640.00	0.27
153	000937	冀中能源	466,900	2,969,484.00	0.27
154	600039	四川路桥	264,100	2,936,792.00	0.26
155	300462	华铭智能	347,300	2,896,482.00	0.26
156	300532	今天国际	199,600	2,890,208.00	0.26
157	603657	春光科技	173,800	2,766,896.00	0.25
158	000541	佛山照明	534,500	2,629,740.00	0.24
159	002426	胜利精密	924,100	2,430,383.00	0.22
160	603861	白云电器	317,400	2,370,978.00	0.21
161	600587	新华医疗	110,000	2,356,200.00	0.21
162	603992	松霖科技	141,400	2,197,356.00	0.20
163	300231	银信科技	290,100	2,114,829.00	0.19
164	300541	先进数通	160,100	1,817,135.00	0.16
165	300690	双一科技	110,000	1,775,400.00	0.16
166	300851	交大思诺	75,200	1,635,600.00	0.15
167	603040	新坐标	95,430	1,629,944.40	0.15
168	300389	艾比森	183,600	1,602,828.00	0.14
169	000001	平安银行	86,000	1,131,760.00	0.10
170	002116	中国海诚	98,900	1,009,769.00	0.09
171	000333	美的集团	19,200	994,560.00	0.09
172	601166	兴业银行	52,615	925,497.85	0.08
173	603338	浙江鼎力	19,000	909,150.00	0.08
174	600219	南山铝业	270,000	882,900.00	0.08
175	601318	中国平安	16,800	789,600.00	0.07
176	601939	建设银行	127,500	717,825.00	0.06
177	600875	东方电气	32,600	685,252.00	0.06
178	688819	天能股份	18,316	672,929.84	0.06
179	600570	恒生电子	15,700	635,222.00	0.06
180	601869	长飞光纤	18,800	613,444.00	0.05
181	600609	金杯汽车	145,100	606,518.00	0.05
182	603639	海利尔	21,900	559,326.00	0.05
183	002937	兴瑞科技	24,300	550,395.00	0.05
184	600276	恒瑞医药	13,522	521,002.66	0.05
185	601398	工商银行	104,304	452,679.36	0.04

186	002142	宁波银行	13,300	431,585.00	0.04
187	603959	百利科技	33,700	356,209.00	0.03
188	300347	泰格医药	3,300	345,840.00	0.03
189	600519	贵州茅台	200	345,400.00	0.03
190	603444	吉比特	1,000	312,840.00	0.03
191	300059	东方财富	16,080	311,952.00	0.03
192	601009	南京银行	29,900	311,558.00	0.03
193	603259	药明康德	3,677	297,837.00	0.03
194	000895	双汇发展	9,900	256,707.00	0.02
195	688053	思科瑞	3,879	236,308.68	0.02
196	600406	国电南瑞	8,352	203,788.80	0.02
197	688372	伟测科技	2,383	193,499.60	0.02
198	002415	海康威视	5,200	180,336.00	0.02
199	600887	伊利股份	5,499	170,469.00	0.02
200	002304	洋河股份	1,000	160,500.00	0.01
201	600585	海螺水泥	5,300	145,114.00	0.01
202	688275	万润新能	813	142,396.95	0.01
203	688095	福昕软件	2,240	139,283.20	0.01
204	000960	锡业股份	9,100	128,310.00	0.01
205	600031	三一重工	8,100	127,980.00	0.01
206	301361	众智科技	5,169	115,134.16	0.01
207	688332	中科蓝讯	2,113	108,227.86	0.01
208	688353	华盛锂电	1,688	107,795.68	0.01
209	688496	清越科技	12,000	103,800.00	0.01
210	600352	浙江龙盛	9,400	93,060.00	0.01
211	688252	天德钰	5,201	82,071.78	0.01
212	000002	万科 A	4,200	76,440.00	0.01
213	300136	信维通信	4,600	75,946.00	0.01
214	688416	恒烁股份	1,982	73,353.82	0.01
215	600867	通化东宝	7,520	69,033.60	0.01
216	001301	尚太科技	1,164	68,722.56	0.01
217	301087	可孚医疗	1,440	52,531.20	0.00
218	600196	复星医药	1,300	45,812.00	0.00
219	301327	华宝新能	242	42,826.74	0.00
220	301367	怡和嘉业	223	39,198.94	0.00
221	301267	华夏眼科	569	37,667.80	0.00
222	301088	戎美股份	1,993	34,538.69	0.00
223	301165	锐捷网络	1,077	34,043.97	0.00
224	301269	华大九天	372	32,713.68	0.00
225	301301	川宁生物	3,574	26,912.22	0.00
226	301239	普瑞眼科	369	25,711.92	0.00
227	301175	中科环保	3,939	23,673.39	0.00
228	301328	维峰电子	191	14,699.36	0.00

229	301339	通行宝	913	14,233.67	0.00
230	301296	新巨丰	933	13,901.70	0.00
231	301152	天力锂能	298	13,898.72	0.00
232	301377	鼎泰高科	770	13,575.10	0.00
233	301311	昆船智能	832	13,195.52	0.00
234	301297	富乐德	1,015	13,184.85	0.00
235	301396	宏景科技	396	12,632.40	0.00
236	301338	凯格精机	257	12,590.43	0.00
237	301283	聚胶股份	235	12,081.35	0.00
238	301132	满坤科技	468	11,456.64	0.00
239	301115	建科股份	470	11,298.80	0.00
240	301306	西测测试	255	10,783.95	0.00
241	301282	金禄电子	404	10,201.00	0.00
242	301349	信德新材	95	9,834.40	0.00
243	301265	华新环保	819	9,336.60	0.00
244	301176	逸豪新材	544	9,188.16	0.00
245	301326	捷邦科技	227	8,312.74	0.00
246	301197	工大科雅	380	7,630.40	0.00
247	301161	唯万密封	346	7,518.58	0.00
248	301398	星源卓镁	255	7,379.70	0.00
249	301313	凡拓数创	247	7,197.58	0.00
250	301285	鸿日达	565	7,119.00	0.00
251	301359	东南电子	328	6,527.20	0.00
252	301388	欣灵电气	292	6,307.20	0.00
253	301368	丰立智能	337	6,241.24	0.00
254	301300	远翔新材	211	6,197.07	0.00
255	301319	唯特偶	115	6,126.05	0.00
256	301270	汉仪股份	210	5,957.70	0.00
257	301231	荣信文化	275	5,604.50	0.00
258	301309	万得凯	228	5,576.88	0.00
259	301316	慧博云通	359	5,140.88	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002258	利尔化学	22,402,841.28	13.12
2	601717	郑煤机	21,669,329.64	12.69
3	002705	新宝股份	20,729,249.00	12.14
4	600741	华域汽车	20,284,329.12	11.88
5	603586	金麒麟	19,998,038.00	11.71

6	002048	宁波华翔	19,878,628.83	11.64
7	603906	龙蟠科技	19,868,266.18	11.63
8	603890	春秋电子	19,608,616.00	11.48
9	603600	永艺股份	19,390,663.24	11.36
10	601231	环旭电子	19,380,193.22	11.35
11	603681	永冠新材	18,879,501.07	11.06
12	600731	湖南海利	18,309,730.50	10.72
13	603086	先达股份	18,282,567.63	10.71
14	600971	恒源煤电	18,156,697.00	10.63
15	603339	四方科技	18,064,590.25	10.58
16	002662	京威股份	17,761,537.33	10.40
17	605365	立达信	17,718,039.00	10.38
18	605088	冠盛股份	17,562,639.00	10.28
19	600835	上海机电	17,529,948.90	10.27
20	600170	上海建工	17,513,686.72	10.26
21	603408	建霖家居	17,099,604.42	10.01
22	600742	一汽富维	16,938,290.00	9.92
23	603355	莱克电气	16,877,100.05	9.88
24	002085	万丰奥威	16,816,418.00	9.85
25	601038	一拖股份	16,795,994.72	9.84
26	603089	正裕工业	16,600,081.98	9.72
27	300703	创源股份	16,321,337.00	9.56
28	300244	迪安诊断	15,517,669.00	9.09
29	603968	醋化股份	15,457,830.00	9.05
30	002768	国恩股份	15,253,048.00	8.93
31	000551	创元科技	14,820,951.00	8.68
32	603013	亚普股份	14,712,507.00	8.62
33	600470	六国化工	14,661,006.00	8.59
34	002955	鸿合科技	14,573,026.00	8.53
35	300440	运达科技	14,472,032.52	8.47
36	000521	长虹美菱	14,469,348.00	8.47
37	600582	天地科技	14,442,331.00	8.46
38	000700	模塑科技	14,245,227.00	8.34
39	000913	钱江摩托	13,866,107.00	8.12
40	603129	春风动力	13,857,225.00	8.11
41	002567	唐人神	13,777,976.71	8.07
42	002878	元隆雅图	13,283,495.64	7.78
43	300121	阳谷华泰	13,067,267.00	7.65
44	002615	哈尔斯	13,058,321.56	7.65
45	003036	泰坦股份	13,054,512.03	7.64
46	000030	富奥股份	12,956,492.00	7.59
47	300389	艾比森	12,894,475.00	7.55
48	603421	鼎信通讯	12,850,486.40	7.53

49	605066	天正电气	12,743,280.00	7.46
50	603920	世运电路	12,742,459.58	7.46
51	603228	景旺电子	12,693,866.72	7.43
52	000810	创维数字	12,647,007.00	7.41
53	600268	国电南自	12,646,069.28	7.41
54	300407	凯发电气	12,638,320.00	7.40
55	300509	新美星	12,259,713.78	7.18
56	000937	冀中能源	12,246,537.62	7.17
57	000726	鲁 泰 A	12,147,396.56	7.11
58	300118	东方日升	12,091,799.00	7.08
59	002066	瑞泰科技	12,066,349.00	7.07
60	600985	淮北矿业	11,984,522.45	7.02
61	605196	华通线缆	11,743,388.70	6.88
62	603787	新日股份	11,703,350.00	6.85
63	002004	华邦健康	11,424,925.00	6.69
64	002957	科瑞技术	11,314,046.00	6.63
65	300145	中金环境	11,291,132.00	6.61
66	603050	科林电气	11,281,648.00	6.61
67	603657	春光科技	10,994,049.32	6.44
68	603083	剑桥科技	10,887,230.00	6.38
69	300639	凯普生物	10,849,507.30	6.35
70	603298	杭叉集团	10,785,289.81	6.32
71	300115	长盈精密	10,755,320.00	6.30
72	002986	宇新股份	10,713,042.20	6.27
73	002932	明德生物	10,655,714.38	6.24
74	603161	科华控股	10,601,397.00	6.21
75	603585	苏利股份	10,425,411.52	6.11
76	300196	长海股份	10,365,809.00	6.07
77	603829	洛凯股份	10,352,353.00	6.06
78	300130	新国都	10,136,140.86	5.94
79	603992	松霖科技	10,129,138.00	5.93
80	600481	双良节能	10,081,508.38	5.90
81	002987	京北方	10,058,998.40	5.89
82	601668	中国建筑	10,045,141.00	5.88
83	603757	大元泵业	9,907,696.00	5.80
84	300694	蠡湖股份	9,812,381.00	5.75
85	002600	领益智造	9,661,706.00	5.66
86	603611	诺力股份	9,551,607.00	5.59
87	300866	安克创新	9,543,191.76	5.59
88	002588	史丹利	9,524,234.24	5.58
89	000921	海信家电	9,476,707.00	5.55
90	002225	濮耐股份	9,456,776.00	5.54
91	300801	泰和科技	9,346,995.00	5.47

92	603948	建业股份	9,285,551.00	5.44
93	000830	鲁西化工	9,239,113.28	5.41
94	002560	通达股份	8,945,576.00	5.24
95	600557	康缘药业	8,920,165.00	5.22
96	603661	恒林股份	8,733,726.80	5.11
97	300377	赢时胜	8,722,843.00	5.11
98	300100	双林股份	8,703,379.00	5.10
99	002478	常宝股份	8,684,173.00	5.09
100	002315	焦点科技	8,672,801.47	5.08
101	002396	星网锐捷	8,635,208.22	5.06
102	002643	万润股份	8,604,186.00	5.04
103	603766	隆鑫通用	8,483,961.64	4.97
104	603529	爱玛科技	8,404,064.00	4.92
105	600380	健康元	8,301,337.00	4.86
106	603385	惠达卫浴	8,254,962.60	4.83
107	600521	华海药业	8,226,178.00	4.82
108	600089	特变电工	8,200,403.76	4.80
109	603677	奇精机械	8,171,665.00	4.79
110	002035	华帝股份	8,169,054.00	4.78
111	300532	今天国际	8,085,295.00	4.73
112	600761	安徽合力	8,049,475.50	4.71
113	300445	康斯特	7,961,621.00	4.66
114	600549	厦门钨业	7,954,473.76	4.66
115	300080	易成新能	7,952,757.00	4.66
116	603269	海鸥股份	7,951,425.00	4.66
117	601666	平煤股份	7,941,096.00	4.65
118	600732	爱旭股份	7,870,883.00	4.61
119	600141	兴发集团	7,863,735.00	4.61
120	605218	伟时电子	7,861,212.00	4.60
121	600469	风神股份	7,758,400.16	4.54
122	601117	中国化学	7,733,945.00	4.53
123	600273	嘉化能源	7,716,897.00	4.52
124	002030	达安基因	7,673,895.50	4.49
125	601956	东贝集团	7,665,586.20	4.49
126	600987	航民股份	7,623,064.75	4.46
127	002014	永新股份	7,614,713.00	4.46
128	002392	北京利尔	7,426,149.00	4.35
129	002790	瑞尔特	7,373,008.00	4.32
130	600389	江山股份	7,342,198.00	4.30
131	603551	奥普家居	7,295,011.00	4.27
132	603556	海兴电力	7,237,216.60	4.24
133	002835	同为股份	7,201,815.00	4.22
134	603618	杭电股份	7,165,244.63	4.20

135	000404	长虹华意	7,119,544.50	4.17
136	000823	超声电子	7,117,974.58	4.17
137	002403	爱仕达	7,098,875.00	4.16
138	300514	友讯达	7,091,031.90	4.15
139	600596	新安股份	7,073,894.00	4.14
140	600710	苏美达	7,067,658.00	4.14
141	600500	中化国际	6,934,595.00	4.06
142	002938	鹏鼎控股	6,898,079.00	4.04
143	001696	宗申动力	6,845,893.00	4.01
144	002899	英派斯	6,685,188.00	3.91
145	601699	潞安环能	6,652,100.00	3.90
146	000682	东方电子	6,573,758.00	3.85
147	002209	达意隆	6,568,288.00	3.85
148	600699	均胜电子	6,448,544.80	3.78
149	600929	雪天盐业	6,367,316.00	3.73
150	300195	长荣股份	6,282,794.00	3.68
151	600525	长园集团	6,267,916.16	3.67
152	300570	太辰光	6,246,304.00	3.66
153	000153	丰原药业	6,226,123.90	3.65
154	600356	恒丰纸业	6,218,142.00	3.64
155	002426	胜利精密	6,199,377.00	3.63
156	002929	润建股份	6,081,478.00	3.56
157	300482	万孚生物	6,042,626.00	3.54
158	300739	明阳电路	6,038,211.10	3.54
159	600438	通威股份	5,992,554.00	3.51
160	603018	华设集团	5,942,640.00	3.48
161	603118	共进股份	5,916,967.00	3.46
162	002533	金杯电工	5,914,394.00	3.46
163	300684	中石科技	5,902,151.00	3.46
164	600667	太极实业	5,778,212.16	3.38
165	300557	理工光科	5,740,344.00	3.36
166	003017	大洋生物	5,731,402.00	3.36
167	603357	设计总院	5,697,543.00	3.34
168	002539	云图控股	5,644,834.00	3.31
169	600210	紫江企业	5,644,444.00	3.31
170	002193	如意集团	5,640,693.00	3.30
171	002605	姚记科技	5,636,944.00	3.30
172	002829	星网宇达	5,636,696.00	3.30
173	000422	湖北宜化	5,623,564.22	3.29
174	603515	欧普照明	5,562,502.88	3.26
175	002276	万马股份	5,547,617.00	3.25
176	000983	山西焦煤	5,522,446.00	3.23
177	603387	基蛋生物	5,517,306.00	3.23

178	300533	冰川网络	5,487,604.00	3.21
179	600970	中材国际	5,478,014.15	3.21
180	300504	天邑股份	5,467,741.00	3.20
181	002376	新北洋	5,443,250.00	3.19
182	002365	永安药业	5,440,713.00	3.19
183	600133	东湖高新	5,411,114.00	3.17
184	603855	华荣股份	5,390,116.00	3.16
185	600063	皖维高新	5,340,807.00	3.13
186	600261	阳光照明	5,318,052.00	3.11
187	002558	巨人网络	5,304,175.00	3.11
188	600629	华建集团	5,291,042.00	3.10
189	600392	盛和资源	5,194,247.41	3.04
190	600894	广日股份	5,186,011.80	3.04
191	002391	长青股份	5,169,005.50	3.03
192	600820	隧道股份	5,133,859.00	3.01
193	603599	广信股份	5,104,997.00	2.99
194	300856	科思股份	5,102,789.00	2.99
195	300807	天迈科技	5,100,783.00	2.99
196	000852	石化机械	5,066,427.94	2.97
197	300672	国科微	5,051,031.84	2.96
198	002614	奥佳华	5,024,581.00	2.94
199	603927	中科软	4,991,668.60	2.92
200	300761	立华股份	4,984,003.00	2.92
201	300327	中颖电子	4,983,331.00	2.92
202	300498	温氏股份	4,972,219.00	2.91
203	300349	金卡智能	4,916,530.98	2.88
204	601567	三星医疗	4,888,596.55	2.86
205	300205	天喻信息	4,884,262.00	2.86
206	300644	南京聚隆	4,872,502.00	2.85
207	300441	鲍斯股份	4,866,510.18	2.85
208	603928	兴业股份	4,861,994.00	2.85
209	000977	浪潮信息	4,794,405.33	2.81
210	002275	桂林三金	4,787,955.00	2.80
211	603012	创力集团	4,784,097.72	2.80
212	000948	南天信息	4,783,468.24	2.80
213	300363	博腾股份	4,766,141.73	2.79
214	601908	京运通	4,758,328.00	2.79
215	603115	海星股份	4,686,998.00	2.74
216	600285	羚锐制药	4,674,431.00	2.74
217	300403	汉宇集团	4,632,431.00	2.71
218	300771	智莱科技	4,626,462.00	2.71
219	300787	海能实业	4,625,429.00	2.71
220	002045	国光电器	4,612,084.00	2.70

221	001218	丽臣实业	4,605,732.95	2.70
222	002334	英威腾	4,588,831.00	2.69
223	301004	嘉益股份	4,578,151.00	2.68
224	600129	太极集团	4,574,819.00	2.68
225	003011	海象新材	4,556,867.00	2.67
226	002242	九阳股份	4,544,572.00	2.66
227	600967	内蒙一机	4,536,458.00	2.66
228	300970	华绿生物	4,519,938.00	2.65
229	603668	天马科技	4,502,390.00	2.64
230	603367	辰欣药业	4,481,388.00	2.62
231	300675	建科院	4,478,252.00	2.62
232	002360	同德化工	4,459,574.00	2.61
233	300698	万马科技	4,432,363.00	2.60
234	002394	联发股份	4,419,365.00	2.59
235	002773	康弘药业	4,418,322.00	2.59
236	603100	川仪股份	4,406,504.00	2.58
237	002440	闰土股份	4,398,823.00	2.58
238	000876	新 希 望	4,396,367.00	2.57
239	601177	杭齿前进	4,372,441.00	2.56
240	600433	冠豪高新	4,345,584.24	2.54
241	002328	新朋股份	4,312,127.00	2.53
242	002517	恺英网络	4,310,535.00	2.52
243	600853	龙建股份	4,296,360.00	2.52
244	300729	乐歌股份	4,271,775.00	2.50
245	000997	新 大 陆	4,249,636.00	2.49
246	600810	神马股份	4,224,033.00	2.47
247	300673	佩蒂股份	4,192,674.00	2.46
248	300972	万辰生物	4,156,387.00	2.43
249	002475	立讯精密	4,145,796.00	2.43
250	002166	莱茵生物	4,143,252.00	2.43
251	000651	格力电器	4,124,402.00	2.42
252	300907	康平科技	4,096,927.00	2.40
253	300002	神州泰岳	4,088,497.00	2.39
254	002562	兄弟科技	4,073,916.00	2.39
255	300830	金现代	4,030,425.00	2.36
256	603767	中马传动	4,006,809.20	2.35
257	300556	丝路视觉	3,995,138.00	2.34
258	600673	东阳光	3,992,174.00	2.34
259	603266	天龙股份	3,987,383.00	2.34
260	300546	雄帝科技	3,983,495.00	2.33
261	603303	得邦照明	3,979,078.00	2.33
262	600479	千金药业	3,965,264.00	2.32
263	603699	纽威股份	3,955,447.00	2.32

264	603283	赛腾股份	3,944,048.00	2.31
265	603790	雅运股份	3,937,083.50	2.31
266	603639	海利尔	3,926,621.00	2.30
267	002952	亚世光电	3,915,881.00	2.29
268	300385	雪浪环境	3,896,793.40	2.28
269	000600	建投能源	3,887,608.00	2.28
270	002100	天康生物	3,880,348.00	2.27
271	002881	美格智能	3,869,784.00	2.27
272	002124	天邦食品	3,846,422.00	2.25
273	300607	拓斯达	3,837,765.58	2.25
274	301067	显盈科技	3,837,649.00	2.25
275	600202	哈空调	3,834,730.00	2.25
276	002407	多氟多	3,828,632.00	2.24
277	300882	万胜智能	3,806,312.00	2.23
278	603337	杰克股份	3,805,611.68	2.23
279	300640	德艺文创	3,790,785.00	2.22
280	002510	天汽模	3,786,094.00	2.22
281	002714	牧原股份	3,730,012.00	2.18
282	605077	华康股份	3,719,693.00	2.18
283	600284	浦东建设	3,710,174.95	2.17
284	600833	第一医药	3,699,445.00	2.17
285	002624	完美世界	3,692,523.00	2.16
286	603158	腾龙股份	3,675,029.00	2.15
287	002422	科伦药业	3,673,928.00	2.15
288	603037	凯众股份	3,629,782.00	2.13
289	603351	威尔药业	3,616,930.00	2.12
290	600756	浪潮软件	3,585,700.90	2.10
291	603059	倍加洁	3,583,441.00	2.10
292	600039	四川路桥	3,576,240.00	2.09
293	600496	精工钢构	3,567,424.00	2.09
294	002182	云海金属	3,551,887.00	2.08
295	600177	雅戈尔	3,551,016.00	2.08
296	003002	壶化股份	3,532,055.00	2.07
297	002774	快意电梯	3,513,769.00	2.06
298	603970	中农立华	3,482,366.80	2.04
299	002084	海鸥住工	3,469,625.98	2.03
300	300596	利安隆	3,460,110.00	2.03
301	002855	捷荣技术	3,458,306.00	2.03
302	300206	理邦仪器	3,439,653.00	2.01

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

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

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	603086	先达股份	15,430,009.99	9.04
2	300440	运达科技	15,156,200.12	8.88
3	000810	创维数字	14,759,871.40	8.64
4	002066	瑞泰科技	14,524,069.00	8.51
5	300244	迪安诊断	14,061,942.00	8.23
6	300121	阳谷华泰	12,948,782.00	7.58
7	603787	新日股份	12,714,624.00	7.45
8	600470	六国化工	12,379,047.00	7.25
9	600971	恒源煤电	12,376,153.00	7.25
10	603339	四方科技	12,328,426.00	7.22
11	002932	明德生物	12,183,741.97	7.13
12	002878	元隆雅图	11,486,611.00	6.73
13	600268	国电南自	11,301,485.46	6.62
14	300703	创源股份	10,927,543.00	6.40
15	002396	星网锐捷	10,813,994.00	6.33
16	300389	艾比森	10,799,086.00	6.32
17	002768	国恩股份	10,744,397.00	6.29
18	002315	焦点科技	10,690,608.58	6.26
19	002004	华邦健康	10,655,336.73	6.24
20	300866	安克创新	10,478,523.36	6.14
21	603585	苏利股份	10,475,453.48	6.13
22	603829	洛凯股份	10,287,712.00	6.02
23	002615	哈尔斯	10,175,247.00	5.96
24	002567	唐人神	9,979,621.00	5.84
25	000937	冀中能源	9,969,581.60	5.84
26	000830	鲁西化工	9,813,252.00	5.75
27	601666	平煤股份	9,801,215.00	5.74
28	300196	长海股份	9,660,371.00	5.66
29	601699	潞安环能	9,653,326.00	5.65
30	300801	泰和科技	9,651,478.00	5.65
31	600273	嘉化能源	9,598,342.00	5.62
32	002258	利尔化学	9,576,084.80	5.61
33	600731	湖南海利	9,550,287.76	5.59
34	600732	爱旭股份	9,539,207.00	5.59
35	600985	淮北矿业	9,358,254.84	5.48

36	002560	通达股份	9,309,358.00	5.45
37	002588	史丹利	9,182,817.76	5.38
38	603766	隆鑫通用	9,139,554.72	5.35
39	600557	康缘药业	9,073,422.44	5.31
40	003036	泰坦股份	9,052,263.58	5.30
41	603657	春光科技	9,030,738.52	5.29
42	600380	健康元	8,913,713.72	5.22
43	600596	新安股份	8,877,160.80	5.20
44	603968	醋化股份	8,872,954.00	5.20
45	600089	特变电工	8,858,150.68	5.19
46	603089	正裕工业	8,835,901.00	5.17
47	002225	濮耐股份	8,768,157.00	5.13
48	600141	兴发集团	8,693,336.99	5.09
49	002035	华帝股份	8,629,904.00	5.05
50	300532	今天国际	8,460,896.00	4.95
51	002955	鸿合科技	8,452,572.70	4.95
52	603529	爱玛科技	8,228,407.00	4.82
53	600389	江山股份	8,167,154.20	4.78
54	603129	春风动力	8,145,104.30	4.77
55	002643	万润股份	8,140,500.66	4.77
56	300080	易成新能	8,066,028.00	4.72
57	600521	华海药业	8,033,311.00	4.70
58	600987	航民股份	7,995,260.85	4.68
59	002014	永新股份	7,992,454.60	4.68
60	000983	山西焦煤	7,972,109.99	4.67
61	603050	科林电气	7,944,032.45	4.65
62	603992	松霖科技	7,904,141.00	4.63
63	601117	中国化学	7,675,911.00	4.50
64	002030	达安基因	7,673,658.00	4.49
65	600063	皖维高新	7,562,976.00	4.43
66	603599	广信股份	7,509,000.92	4.40
67	600549	厦门钨业	7,414,643.74	4.34
68	002835	同为股份	7,408,251.00	4.34
69	605365	立达信	7,346,880.00	4.30
70	600500	中化国际	7,310,421.00	4.28
71	600710	苏美达	7,228,889.00	4.23
72	002790	瑞尔特	7,220,560.93	4.23
73	603385	惠达卫浴	7,157,942.00	4.19
74	002403	爱仕达	7,042,220.00	4.12
75	000521	长虹美菱	7,042,137.00	4.12
76	603906	龙蟠科技	6,930,764.00	4.06
77	002392	北京利尔	6,776,575.00	3.97
78	605088	冠盛股份	6,739,002.00	3.95

79	300739	明阳电路	6,705,661.39	3.93
80	002276	万马股份	6,691,225.00	3.92
81	600929	雪天盐业	6,615,604.12	3.87
82	603618	杭电股份	6,521,951.00	3.82
83	603920	世运电路	6,457,369.30	3.78
84	600582	天地科技	6,360,285.00	3.72
85	300118	东方日升	6,298,368.68	3.69
86	603115	海星股份	6,261,434.00	3.67
87	601717	郑煤机	6,174,089.00	3.62
88	600525	长园集团	6,148,815.04	3.60
89	603948	建业股份	6,104,976.00	3.58
90	300557	理工光科	6,103,299.00	3.57
91	603013	亚普股份	6,052,813.00	3.54
92	000153	丰原药业	6,024,411.66	3.53
93	000422	湖北宜化	5,967,538.00	3.49
94	002539	云图控股	5,942,074.00	3.48
95	300195	长荣股份	5,918,578.00	3.47
96	300533	冰川网络	5,905,100.50	3.46
97	300672	国科微	5,877,043.25	3.44
98	000948	南天信息	5,866,356.00	3.44
99	300130	新国都	5,852,063.00	3.43
100	002376	新北洋	5,702,451.00	3.34
101	002662	京威股份	5,694,520.00	3.33
102	600438	通威股份	5,649,226.00	3.31
103	603551	奥普家居	5,619,306.00	3.29
104	003017	大洋生物	5,567,395.00	3.26
105	600667	太极实业	5,566,728.00	3.26
106	002987	京北方	5,543,783.40	3.25
107	002061	浙江交科	5,500,211.00	3.22
108	002275	桂林三金	5,472,105.00	3.20
109	002517	恺英网络	5,423,562.00	3.18
110	002558	巨人网络	5,367,667.00	3.14
111	603100	川仪股份	5,366,024.00	3.14
112	000852	石化机械	5,354,615.76	3.14
113	603387	基蛋生物	5,347,825.40	3.13
114	603283	赛腾股份	5,337,307.06	3.13
115	300514	友讯达	5,283,332.00	3.09
116	603012	创力集团	5,229,475.56	3.06
117	002365	永安药业	5,209,378.00	3.05
118	603408	建霖家居	5,154,129.91	3.02
119	603367	辰欣药业	5,139,396.00	3.01
120	600833	第一医药	5,093,866.00	2.98
121	002193	如意集团	5,022,310.00	2.94

122	300327	中颖电子	5,013,756.00	2.94
123	601038	一拖股份	5,002,373.00	2.93
124	300498	温氏股份	4,983,746.00	2.92
125	603269	海鸥股份	4,967,281.00	2.91
126	603928	兴业股份	4,937,651.00	2.89
127	603661	恒林股份	4,845,173.00	2.84
128	603421	鼎信通讯	4,843,673.80	2.84
129	000404	长虹华意	4,838,142.00	2.83
130	603681	永冠新材	4,827,381.00	2.83
131	000977	浪潮信息	4,820,338.98	2.82
132	000997	新大陆	4,817,040.99	2.82
133	603303	得邦照明	4,799,364.00	2.81
134	300856	科思股份	4,794,923.00	2.81
135	002773	康弘药业	4,776,162.00	2.80
136	002085	万丰奥威	4,764,204.00	2.79
137	300482	万孚生物	4,749,682.00	2.78
138	300761	立华股份	4,745,668.80	2.78
139	300675	建科院	4,714,947.00	2.76
140	002705	新宝股份	4,708,154.00	2.76
141	605218	伟时电子	4,690,916.00	2.75
142	001218	丽臣实业	4,681,892.40	2.74
143	601908	京运通	4,641,462.00	2.72
144	002475	立讯精密	4,640,454.00	2.72
145	002242	九阳股份	4,612,313.00	2.70
146	002084	海鸥住工	4,578,434.75	2.68
147	601567	三星医疗	4,557,926.00	2.67
148	300596	利安隆	4,554,234.96	2.67
149	002478	常宝股份	4,551,135.00	2.67
150	002394	联发股份	4,529,520.40	2.65
151	300673	佩蒂股份	4,524,999.00	2.65
152	600469	风神股份	4,478,172.00	2.62
153	300787	海能实业	4,475,225.00	2.62
154	600756	浪潮软件	4,474,173.00	2.62
155	603556	海兴电力	4,463,441.00	2.61
156	002426	胜利精密	4,437,387.00	2.60
157	603889	新澳股份	4,382,627.81	2.57
158	300002	神州泰岳	4,380,700.86	2.57
159	603757	大元泵业	4,372,720.00	2.56
160	600392	盛和资源	4,355,292.00	2.55
161	000876	新希望	4,355,072.50	2.55
162	600433	冠豪高新	4,345,603.31	2.54
163	300145	中金环境	4,338,121.40	2.54
164	600761	安徽合力	4,323,895.00	2.53

165	603790	雅运股份	4,318,566.30	2.53
166	600479	千金药业	4,302,314.00	2.52
167	002166	莱茵生物	4,294,649.60	2.51
168	300206	理邦仪器	4,282,464.00	2.51
169	603699	纽威股份	4,180,853.00	2.45
170	603067	振华股份	4,115,609.00	2.41
171	002422	科伦药业	4,097,880.00	2.40
172	605077	华康股份	4,086,838.00	2.39
173	002881	美格智能	4,072,815.32	2.39
174	002440	闰土股份	4,038,276.00	2.36
175	002182	云海金属	4,025,144.00	2.36
176	002407	多氟多	4,021,335.00	2.35
177	601231	环旭电子	4,018,937.68	2.35
178	300607	拓斯达	4,016,915.00	2.35
179	300882	万胜智能	4,001,183.50	2.34
180	002334	英威腾	3,992,176.00	2.34
181	601177	杭齿前进	3,966,667.00	2.32
182	002020	京新药业	3,962,300.00	2.32
183	002100	天康生物	3,961,896.00	2.32
184	000551	创元科技	3,951,391.00	2.31
185	300771	智莱科技	3,948,597.80	2.31
186	600673	东阳光	3,928,596.00	2.30
187	603668	天马科技	3,922,355.00	2.30
188	002952	亚世光电	3,919,485.00	2.30
189	603995	甬金股份	3,888,065.00	2.28
190	002124	天邦食品	3,857,242.00	2.26
191	002597	金禾实业	3,774,118.00	2.21
192	002714	牧原股份	3,767,117.00	2.21
193	002855	捷荣技术	3,751,461.00	2.20
194	000913	钱江摩托	3,747,222.00	2.19
195	002986	宇新股份	3,704,873.20	2.17
196	603639	海利尔	3,685,233.78	2.16
197	603351	威尔药业	3,676,829.00	2.15
198	603337	杰克股份	3,629,571.00	2.13
199	300556	丝路视觉	3,604,014.00	2.11
200	300380	安硕信息	3,600,265.00	2.11
201	000823	超声电子	3,588,266.00	2.10
202	600248	陕西建工	3,587,660.60	2.10
203	300640	德艺文创	3,578,696.00	2.10
204	600810	神马股份	3,574,014.99	2.09
205	603095	越剑智能	3,561,068.00	2.09
206	300396	迪瑞医疗	3,539,203.00	2.07
207	002562	兄弟科技	3,528,642.00	2.07

208	001696	宗申动力	3,520,656.00	2.06
209	002497	雅化集团	3,500,836.00	2.05
210	300363	博腾股份	3,477,237.00	2.04
211	002543	万和电气	3,446,840.00	2.02
212	600177	雅戈尔	3,427,261.33	2.01

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

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,940,919,249.77
卖出股票收入（成交）总额	2,002,744,996.04

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

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	1,161,264.64	0.10
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,161,264.64	0.10

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	-------	---------	--------------

1	113664	大元转债	11,610	1,161,264.64	0.10
---	--------	------	--------	--------------	------

8.7 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。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

8.11.2 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。

8.12 投资组合报告附注

报告期基金投资的前十名证券除上海建工（证券代码 600170）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。

根据发布的相关公告，该证券发行人在报告期内因违规经营、未依法履行职责、涉嫌违反法律法规等原因，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。

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

8.12.1 期末其他各项资产构成

金额单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,749,852.93
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,123,332.98
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,873,185.91

8.12.2 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.3 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末投资前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
招商量化精选股票 A	22,302	13,282.06	138,592,648.94	46.79%	157,623,820.78	53.21%
招商量化精选股票 C	11,893	22,688.53	200,973,898.01	74.48%	68,860,777.64	25.52%
合计	34,195	16,553.62	339,566,546.95	59.99%	226,484,598.42	40.01%

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

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	招商量化精选股票 A	1,791,494.22	0.6048%
	招商量化精选股票 C	19,359.16	0.0072%

	合计	1,810,853.38	0.3199%
--	----	--------------	---------

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

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	招商量化精选股票 A	0
	招商量化精选股票 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	招商量化精选股票 A	>100
	招商量化精选股票 C	0
	合计	>100

9.4 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	5,000,450.02	0.88	10,000,450.02	1.77	3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	1,573,264.27	0.28	1,001,199.05	0.18	3 年
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	6,573,714.29	1.16	11,001,649.07	1.95	-

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	招商量化精选股票 A	招商量化精选股票 C
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	61,584,909.65	23,468,448.62
本报告期基金总申购份额	338,614,862.21	391,659,520.75
减：报告期基金总赎回份额	103,983,302.14	145,293,293.72

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	296,216,469.72	269,834,675.65

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

根据本基金管理人 2022 年 7 月 30 日的公告，经招商基金管理有限公司第六届董事会 2022 年第五次会议审议通过，同意聘任徐勇先生为公司总经理。

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的重大诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金的审计事务所无变化，目前毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）已为本基金提供审计服务 7 年，本报告期应支付给毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为人民币 40,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 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。

11.6.2 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，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安证券	3	381,836,951.09	7.76%	355,604.11	8.42%	-
长江证券	6	364,066,749.00	7.39%	333,346.62	7.89%	-
华安证券	5	361,006,566.90	7.33%	264,001.02	6.25%	-
东方证券	3	331,907,319.48	6.74%	309,104.77	7.32%	-
中信证券	6	278,171,989.83	5.65%	250,534.70	5.93%	-
中金公司	3	271,405,084.13	5.51%	252,762.04	5.99%	-
中信建投证券	5	255,021,758.34	5.18%	237,501.67	5.62%	-
东方财富	3	230,747,866.96	4.69%	168,750.03	4.00%	-
东海证券	2	188,394,120.41	3.83%	137,756.71	3.26%	-
民生证券	3	176,812,544.42	3.59%	129,308.98	3.06%	-
中泰证券	3	175,314,548.32	3.56%	128,208.06	3.04%	-
招商证券	5	148,953,774.99	3.03%	138,722.08	3.28%	-
万和证券	1	138,397,615.55	2.81%	101,211.88	2.40%	-
浙商证券	2	130,069,080.67	2.64%	95,119.35	2.25%	-
兴业证券	2	111,577,238.49	2.27%	103,912.43	2.46%	-
国金证券	1	111,208,139.75	2.26%	103,570.00	2.45%	-
西部证券	1	105,067,331.13	2.13%	97,849.63	2.32%	-
国信证券	3	102,692,027.10	2.09%	75,097.80	1.78%	-
华创证券	4	101,454,086.95	2.06%	94,486.49	2.24%	-
天风证券	5	97,166,816.55	1.97%	80,146.55	1.90%	-
东兴证券	3	95,061,269.15	1.93%	88,536.77	2.10%	-
长城证券	3	92,799,434.06	1.88%	86,425.14	2.05%	-
开源证券	2	91,561,096.86	1.86%	85,272.94	2.02%	-
华金证券	2	79,435,230.09	1.61%	58,091.78	1.38%	-
申万宏源	4	61,332,122.00	1.25%	57,117.04	1.35%	-
海通证券	4	61,253,869.83	1.24%	57,045.67	1.35%	-
第一创业	3	60,151,376.50	1.22%	56,017.10	1.33%	-
国盛证券	2	53,328,291.68	1.08%	49,662.66	1.18%	-
东吴证券	4	53,185,186.41	1.08%	38,895.97	0.92%	-
银河证券	1	52,544,415.20	1.07%	48,936.24	1.16%	-
中银国际证券	4	38,254,612.24	0.78%	35,626.03	0.84%	-
华泰证券	5	28,828,370.97	0.59%	21,083.57	0.50%	-

东北证券	3	17,573,795.00	0.36%	16,366.64	0.39%	-
方正证券	7	15,072,020.92	0.31%	14,036.46	0.33%	-
光大证券	3	14,607,571.96	0.30%	10,683.03	0.25%	-
安信证券	6	13,021,508.16	0.26%	12,127.11	0.29%	-
信达证券	5	11,685,943.00	0.24%	10,883.21	0.26%	-
平安证券	3	8,579,347.39	0.17%	7,990.59	0.19%	-
粤开证券	1	5,444,326.38	0.11%	5,070.40	0.12%	-
德邦证券	4	5,257,771.44	0.11%	3,845.21	0.09%	-
中金财富 证券	2	2,171,701.66	0.04%	1,588.23	0.04%	-
国联证券	4	557,200.00	0.01%	407.49	0.01%	-
山西证券	4	419,300.00	0.01%	306.53	0.01%	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
诚通证券	1	-	-	-	-	-
大通证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	3	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
宏信证券	2	-	-	-	-	-
华宝证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	3	-	-	-	-	-
华鑫证券	2	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
金元证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
瑞信方正	2	-	-	-	-	-
上海证券	2	-	-	-	-	-
申港证券	2	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
首创证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证 券	2	-	-	-	-	-
五矿证券	2	-	-	-	-	-
湘财证券	2	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	2	-	-	-	-	-

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。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易	债券回购交易	权证交易
------	------	--------	------

	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国泰君安证券	416,175.90	16.56%	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	192,418.54	7.66%	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	354,756.90	14.11%	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
万和证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	555,831.90	22.11%	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	871,896.82	34.69%	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	122,533.10	4.87%	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中银国际证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-

信达证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
中金财富 证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
诚通证券	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
瑞信方正	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证 券	-	-	-	-	-	-
五矿证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-

11.8 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公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	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	2022-01-01
2	招商基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	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	2022-01-15
3	招商基金管理有限公司旗下基金 2021 年第 4	中国证券报及基金管	2022-01-21

	季度报告提示性公告	理人网站	
4	招商量化精选股票型发起式证券投资基金 2021 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	2022-01-21
5	招商基金管理有限公司关于公司固有资金投资旗下公募基金的公告	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	2022-01-27
6	关于暂停招商量化精选股票型发起式证券投资基金大额申购（含定期定额投资）和转换转入业务的公告	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	2022-02-25
7	招商量化精选股票型发起式证券投资基金更新的招募说明书（二零二二年第一号）	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	2022-03-14
8	招商量化精选股票型发起式证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要更新	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	2022-03-14
9	招商量化精选股票型发起式证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要更新	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	2022-03-14
10	关于警惕冒用招商基金管理有限公司名义进行诈骗活动的特别提示公告	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	2022-03-22
11	招商量化精选股票型发起式证券投资基金 2021 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	2022-03-30
12	招商基金管理有限公司旗下基金 2021 年年度报告提示性公告	中国证券报及基金管理人网站	2022-03-30
13	招商量化精选股票型发起式证券投资基金 2022 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	2022-04-21
14	招商基金管理有限公司旗下基金 2022 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	2022-04-21
15	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	2022-05-13
16	招商基金管理有限公司关于养老金客户通过直销柜台申购旗下基金开展费率优惠活动的公告	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	2022-06-09
17	招商基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	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	2022-06-17
18	招商基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	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	2022-07-14

19	招商量化精选股票型发起式证券投资基金 2022 年第 2 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	2022-07-20
20	招商基金管理有限公司旗下基金 2022 年第 2 季度报告提示性公告	中国证券报及基金管理人网站	2022-07-20
21	招商基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	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	2022-07-30
22	关于调整招商量化精选股票型发起式证券投资基金大额申购（含定期定额投资）和转换转入业务的公告	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	2022-08-16
23	招商基金管理有限公司旗下基金 2022 年中期报告提示性公告	中国证券报及基金管理人网站	2022-08-30
24	招商量化精选股票型发起式证券投资基金 2022 年中期报告	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	2022-08-30
25	招商基金管理有限公司关于运用固有资金投资旗下公募基金的公告	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	2022-10-17
26	招商基金管理有限公司旗下基金 2022 年第 3 季度报告提示性公告	中国证券报及基金管理人网站	2022-10-25
27	招商量化精选股票型发起式证券投资基金 2022 年第 3 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	2022-10-25

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20220101-20220113	17,096,648.71	-	3,500,000.00	13,596,648.71	2.40%
产品特有风险							
本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况，可能会出现集中赎回甚至巨额赎回从而引发基金净值剧烈波动，甚至引发基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。							

注：报告期末持有份额占比按照四舍五入方法保留至小数点后第 2 位。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

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

13.2 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

13.3 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.cmfcchina.com>

招商基金管理有限公司

2023 年 3 月 30 日