

招商沪港深科技创新主题精选混合型证券  
投资基金  
2017 年半年度报告

2017 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：2017 年 8 月 29 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 2017 年 8 月 28 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 2017 年 4 月 26 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>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
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>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
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.....	10
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.....	13
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.....	13
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>13</b>
6.1 资产负债表.....	13
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.....	16
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>35</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	35
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	36
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.....	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	37
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	39
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.....	39
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.....	39
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.....	39
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.....	39
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	39
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	39
7.12 投资组合报告附注.....	40
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>40</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	40
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	41
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>41</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>41</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	41
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.....	41
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	42
10.4 基金投资策略的改变.....	42
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	42
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.....	42
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	42
10.8 其他重大事件.....	44
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>45</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况.....	45
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>46</b>

12.1 备查文件目录.....	46
12.2 存放地点.....	46
12.3 查阅方式.....	46

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	招商沪港深科技创新主题精选混合型证券投资基金
基金简称	招商沪港深科技创新混合
基金主代码	004266
交易代码	004266
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 4 月 26 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	200,090,030.36 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过对优质企业基本面全面深入的研究、把握沪港深股票市场的投资机会，在严格控制投资组合风险的前提下，谋求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>资产配置策略:本基金将结合对包括宏观经济形势、政策走势、证券市场环境等在内的因素的分析，主动判断市场时机，进行积极的资产配置策略，合理确定基金在股票、债券等各类资产上的投资比例，最大限度地降低投资组合的风险，提高收益。</p> <p>股票投资策略:本基金将运用“价值为本、成长为重”的投资策略来确定具体选股标准。</p> <p>债券投资策略:本基金采用的固定收益品种主要投资策略包括：久期策略、期限结构策略和个券选择策略等。</p> <p>权证投资策略:本基金在进行权证投资时，将通过对权证标的证券基本面的研究，并结合权证定价模型寻求其合理估值水平，主要考虑运用的策略包括：价值挖掘策略、杠杆策略、获利保护策略、价差策略、双向权证策略、买入保护性的认沽权证策略、卖空保护性的认购权证策略等。</p> <p>期货投资策略:为更好地实现投资目标，本基金在注重风险管理的前提下，以套期保值为目的，适度运用股指期货、国债期货等金融衍生品。</p> <p>中小企业私募债券投资策略:中小企业私募债具有票面利率较高、信用风险较大、二级市场流动性较差等特点。因此本基金审慎投资中小企业私募债券。</p> <p>资产支持证券的投资策略:本基金将在利率基本面分析、市场流动性分析和信用评级支持的基础上，辅之以与国债、企业债等债券品种的相对价值比较，审慎投</p>

	资资产支持证券类资产。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×40%+中债综合指数收益率×40%+恒生综合指数收益率×20%
风险收益特征	本基金是混合型基金，在证券投资基金中属于预期风险收益水平中等的投资品种，预期收益和预期风险高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。本基金除了投资于 A 股市场优质企业外，还可在法律法规规定的范围内投资香港联合交易所上市的股票。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

### 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	证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.cmfchina.com">http://www.cmfchina.com</a>
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

### 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(2017 年 4 月 26 日 - 2017 年 6 月 30 日 )
本期已实现收益	2,819,169.22
本期利润	8,017,237.23
加权平均基金份额本期利润	0.0401
本期加权平均净值利润率	3.93%
本期基金份额净值增长率	4.01%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末( 2017 年 6 月 30 日 )
期末可供分配利润	2,819,169.22
期末可供分配基金份额利润	0.0141
期末基金资产净值	208,107,267.59
期末基金份额净值	1.0401
3.1.3 累计期末指标	报告期末( 2017 年 6 月 30 日 )
基金份额累计净值增长率	4.01%

注：1、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、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 2017 年 4 月 26 日生效，截至本报告期末成立未满半年。

#### 3.2 基金净值表现

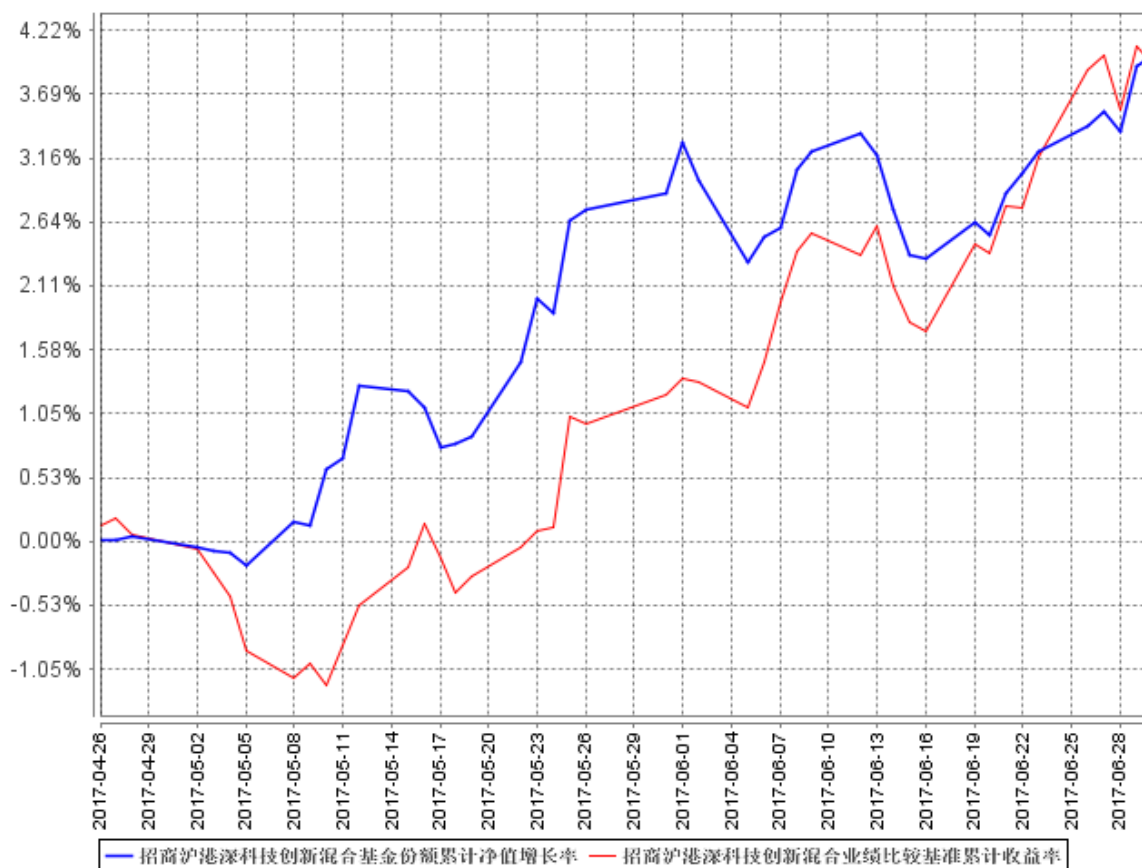
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	1.10%	0.30%	2.69%	0.34%	-1.59%	-0.04%
自基金合同生效起至今	4.01%	0.29%	3.93%	0.32%	0.08%	-0.03%



### 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

招商沪港深科技创新混合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：本基金合同于 2017 年 4 月 26 日生效，截至本报告期末基金成立未满一年；自基金成立日起 6 个月内为建仓期，截至报告期末基金尚未完成建仓。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

招商基金管理有限公司于 2002 年 12 月 27 日经中国证监会（2002）100 号文批准设立。目前，公司注册资本为人民币 2.1 亿元，招商银行股份有限公司持有公司全部股权的 55%，招商证券股份有限公司持有公司全部股权的 45%。

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

截至 2017 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 137 只基金，公募基金管理规模快速增长，公募基金管理规模为 3711 亿元，行业排名第 6。

2017 年上半年获奖情况如下：

债券投资能力五星基金公司（海通证券）

晨星 2017 年度基金奖提名（晨星）

招商产业债•三年期开放式债券型持续优胜金牛基金《中国证券报》

金基金•股票投资回报基金管理公司奖《上海证券报》

招商双债增强•2016 年度金基金•一年期债券基金奖《上海证券报》

招商产业债•2016 年度金基金•三年期债券基金奖《上海证券报》

招商安瑞进取•三年持续回报积极债券型明星基金奖《证券时报》

招商产业债基金•三年持续回报普通债券型明星基金奖《证券时报》

招商丰融基金•2016 年度绝对收益明星基金奖《证券时报》

招商制造业转型基金•2016 年度平衡混合型明星基金奖《证券时报》

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
向霏	本基金基金经理	2017 年 4 月 26 日	-	11	女，工商管理硕士。2006 年加入招商基金管理有限公司，先后曾任职于市场部、股票投资部、交易部，2011 年起任固定收益投资部研究员，曾任招商现金增值开放式证券投资基金、招商理财 7 天债券型证券投资基金、招商招金宝货币市场基金及招商保证金快线货币市场基金基金经理，现任招商招钱宝货币市场基金、招商信用添利债券型证券投资基金（LOF）、招商招利 1 个月期理财债券型证券投资基金、招商招盈 18 个月定开债券型证券投资基金、招商财富宝交易型货币市场基金、招商中国信用机会定期开放债券型证券投资

					基金 (QDII)、招商招轩债券型证券投资基金及招商招泰 6 个月定期开放债券型证券投资基金、招商招财通理财债券型证券投资基金、招商招福宝货币市场基金及招商沪港深科技创新主题精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
白海峰	本基金基金经理	2017 年 5 月 13 日	-	7	男，硕士。曾任职于新东方教育科技集团；2010 年 6 月加入国泰基金管理有限公司，历任管理培训生、宏观经济研究高级经理、首席经济学家助理、国际业务部负责人；2015 年加入招商基金管理有限公司，现任国际业务部总监兼招商资产管理（香港）有限公司执行董事兼总经理、招商标普金砖四国指数证券投资基金 (LOF)、招商全球资源股票型证券投资基金 (QDII)、招商中国信用机会定期开放债券型证券投资基金 (QDII) 及招商沪港深科技创新主题精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

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

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

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

基金管理人声明：在本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关法律法规及其各项实施准则的规定以及《招商沪港深科技创新主题精选灵活配置混合型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。

#### 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，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易不存在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。报告期内未发现有可能导致不公平交易和利益输送的重大异常交易行为。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，在出口复苏、消费升级及财政加速发力的支撑下，中国经济数据继续保持平稳，一、二季度实际 GDP 同比增长均为 6.9%，略超市场预期，显示中国经济韧性仍然较强，但在金融去杠杆的压力下，市场流动性趋紧，价值投资理念复兴，A 股市场股票价格由流动性驱动转向业绩驱动，小股票不断创新低，但上证 50 却大幅上涨。报告期内，中小板综指和创业板综指分别下跌 2.44% 和 10.12%，但同期上证 50 指数上涨 11.50%。

自沪、深两市港股通开通以来，香港市场凭借其低估值和高股息的优势受到内地资金的青睐，南下资金规模不断增加，叠加欧洲大选及特朗普政治举措的不确定性，大量资金从发达市场涌向新兴市场，部分海外资金挤入港股，两方面因素为港股市场的估值修复提供了催化剂，上半年，港股恒生指数上涨 17.15%，跑赢 A 股市场。

报告期内，我们看好白马蓝筹股的配置价值，并认为利率上行利好银行、保险等板块，股票仓位主要配置银行、保险、有色、能源等板块的行业龙头股。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金份额净值增长率为 4.01%，同期业绩比较基准增长率为 3.93%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年，预计欧美等主要经济体仍将保持复苏态势，外部需求的持续改善有望支撑出口的整体抬升；同时，三四线地产数据较强，且棚户区改造货币化安置比重的提升对房地产库存的消化形成一定支撑，预计下半年房地产投资增速仍然不低；另外，下半年财政预算及赤字空间仍然较大，财政支出放缓可能性较小。基于以上几方面因素，预计下半年国内经济仍将保持相对平稳的增长态势。

我们预计 2017 年下半年金融去杠杆压力仍存，市场流动性仍将维持紧平衡状态，且企业整体盈利状况并无明显改善，市场分化状态仍将持续，大盘蓝筹股大概率仍将是市场关注的重点。港股市场方面，在估值差异仍存的状况下，南下资金规模将继续增长，有望继续推动港股估值的进一步修复。

#### 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

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 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

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”）在招商沪港深科技创新主题精选灵活配置混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

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

### 5.3 托管人对本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：招商沪港深科技创新主题精选混合型证券投资基金

报告截止日：2017年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017年6月30日
<b>资产:</b>		
银行存款	6.4.7.1	52,603,217.70
结算备付金		695,383.05
存出保证金		129,213.50
交易性金融资产	6.4.7.2	64,651,303.81
其中: 股票投资		64,651,303.81
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	90,000,455.00
应收证券清算款		-
应收利息	6.4.7.5	475,552.85
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		208,555,125.91
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017年6月30日</b>
<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		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		254,000.80
应付托管费		42,333.45
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	121,164.07
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	30,360.00
负债合计		447,858.32
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	6.4.7.9	200,090,030.36
未分配利润	6.4.7.10	8,017,237.23

所有者权益合计		208,107,267.59
负债和所有者权益总计		208,555,125.91

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0401 元，基金份额总额 200,090,030.36 份。

## 6.2 利润表

会计主体：招商沪港深科技创新主题精选混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 4 月 26 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2017 年 4 月 26 日(基金合同 生效日)至 2017 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		8,853,455.07
1.利息收入		1,014,007.08
其中：存款利息收入	6.4.7.11	484,352.38
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		529,654.70
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,641,379.98
其中：股票投资收益	6.4.7.12	2,320,670.62
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-
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	-
股利收益	6.4.7.17	320,709.36
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	5,198,068.01
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	-
<b>减：二、费用</b>		836,217.84
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	544,517.80
2. 托管费	6.4.10.2.2	90,752.96
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.20	168,154.34
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	32,792.74
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		8,017,237.23
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		8,017,237.23



### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：招商沪港深科技创新主题精选混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 4 月 26 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 4 月 26 日(基金合同生效日)至 2017 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)	200,090,030.36	-	200,090,030.36
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	8,017,237.23	8,017,237.23
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)	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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)	200,090,030.36	8,017,237.23	208,107,267.59

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

\_\_\_\_\_金旭\_\_\_\_\_

基金管理人负责人

\_\_\_\_\_欧志明\_\_\_\_\_

主管会计工作负责人

\_\_\_\_\_何剑萍\_\_\_\_\_

会计机构负责人

### 6.4 报表附注

#### 6.4.1 基金基本情况

招商沪港深科技创新主题精选灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人招商基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《招商沪港深科技创新主题精选灵活配置混合型投资基金基金合同》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”)证监许可[2016]1666 号文准予公开募集注册。本基金为契约型开

开放式基金，存续期限为不定期。本基金首次设立募集基金份额为 200,090,030.36 份，经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证，并出具了编号为德师报(验)字(17)第 00117 号验资报告。《招商沪港深科技创新主题精选灵活配置混合型投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)于 2017 年 4 月 26 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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及截至报告期末最新公告的《招商沪港深科技创新主题精选灵活配置混合型投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票等)、沪港股票市场交易互联互通机制下允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票(以下简称“港股通标的股票”)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、企业债、公司债、次级债、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券(含超短期融资券)、可交换债券、中小企业私募债券、证券公司发行的短期公司债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、权证、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。本基金的投资组合为：投资于股票的比例为基金资产的 0%-95%(其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的 0-95%，投资于港股通标的股票的比例占基金资产的 0-95%)，其中投资于本基金定义的“科技创新主题”相关上市公司证券不低于非现金基金资产的 80%；权证投资占基金资产净值的比例为 0%-3%；每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金和到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金投资于其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为  $40\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 40\% \times \text{中债综合指数收益率} + 20\% \times \text{恒生综合指数收益率}$ 。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

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

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2017 年 4 月 26 日(基金合同生效日)至 2017 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

本基金的会计年度为公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为自 2017 年 4 月 26 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日止期间。

### 6.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

#### 1) 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和贷款及应收款项，暂无金融资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的各类应收款项、买入返售金融资产等在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产分类为贷款及应收款项。

#### 2) 金融负债的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂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。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

### 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

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。贷款及应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，贷款及应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报

酬已转移时，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。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价（包括转出的非现金资产或承担的新金融负债）之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层次的输入值确定公允价值计量层次。第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值是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；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

1) 对于银行间市场交易的固定收益品种，以及交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、资产支持证券和私募债券除外），按照第三方估值机构提供的估值确定公允价值。

2) 对存在活跃市场的其他投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且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，采用最近交易市价确定公允价值。

3) 对存在活跃市场的其他投资品种，如估值日无市价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或基金管理人估值委员会认为必要时，应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，确定公允价值。

4) 当投资品种不再存在活跃市场，基金管理人估值委员会认为必要时，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，确定投资品种的公允价值。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

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。

#### 6.4.4.7 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。

#### 6.4.4.8 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)。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

##### - 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

##### - 投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认。

债券投资收益为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

##### - 公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产卖出或到期时转出计入投资收益。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬和基金托管费按基金合同及相关公告约定的费率和计算方法逐日计提。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的交易费用发生时按照确定的金额计入交易费用。

卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率逐日计提。

#### **6.4.4.11 基金的收益分配政策**

1) 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；

2) 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；

3) 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；

4) 本基金每份基金份额享有同等分配权；

5) 投资者的现金红利和红利再投资形成的基金份额均保留到小数点后第 2 位，小数点后第 3 位开始舍去，舍去部分归基金资产；

6) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### **6.4.4.12 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。

#### **6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计**

本基金本报告期内无其他重要的会计政策和会计估计。

### **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**

本基金本报告期无会计政策变更。

#### **6.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期无会计估计变更。

#### **6.4.5.3 差错更正的说明**

本基金本报告期内无需说明的重大会计差错更正。

### **6.4.6 税项**

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]48 号《关于实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1) 2016 年 4 月 30 日（含）前以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不缴纳营业税。

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

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

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

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

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

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末
	2017 年 6 月 30 日
活期存款	12,603,217.70
定期存款	40,000,000.00
其中：存款期限 1-3 个月	40,000,000.00
其他存款	-
合计：	52,603,217.70

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2017 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	59,453,235.80	64,651,303.81	5,198,068.01
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	59,453,235.80	64,651,303.81	5,198,068.01

#### 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

单位：人民币元

项目	本期末	
	2017 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间	90,000,455.00	-
合计	90,000,455.00	-



**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 2017年6月30日
应收活期存款利息	2,666.93
应收定期存款利息	300,000.00
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	281.65
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	172,551.98
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	52.29
合计	475,552.85

**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 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	120,484.07
银行间市场应付交易费用	680.00
合计	121,164.07

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	30,360.00
合计	30,360.00

**6.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年4月26日(基金合同生效日)至2017年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	200,090,030.36	200,090,030.36
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	200,090,030.36	200,090,030.36

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2017年1月20日至2017年4月19日止期间公开发售，有效净认购金额人民币200,085,444.62元，折算为200,085,444.62份基金份额。根据《招商沪港深科技创新混合型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4,585.74元，折算为4,585.74份基金份额，划入基金持有人账户，两者合计200,090,030.36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	2,819,169.22	5,198,068.01	8,017,237.23
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,819,169.22	5,198,068.01	8,017,237.23

**6.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2017年4月26日(基金合同生效日)至2017年6月30日
	活期存款利息收入
定期存款利息收入	421,333.33
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	2,226.31
其他	236.77

合计	484,352.38
----	------------

#### 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 2017年4月26日(基金合同生效日)至2017 年6月30日
卖出股票成交总额	36,194,055.69
减：卖出股票成本总额	33,873,385.07
买卖股票差价收入	2,320,670.62

#### 6.4.7.13 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益。

#### 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

本基金本报告期内无衍生工具投资收益。

#### 6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年4月26日(基金合同生效日)至2017年6 月30日
股票投资产生的股利收益	320,709.36
基金投资产生的股利收益	-
合计	320,709.36

#### 6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年4月26日(基金合同生效日)至2017
------	--------------------------------

	年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	5,198,068.01
——股票投资	5,198,068.01
——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	-
合计	5,198,068.01

#### 6.4.7.19 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

#### 6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 4 月 26 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	168,154.34
银行间市场交易费用	-
合计	168,154.34

#### 6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 4 月 26 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日
审计费用	13,200.00
信息披露费	17,160.00
银行费用	2,032.74
其他费用	400.00
合计	32,792.74

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
招商基金管理有限公司	基金管理人
中国银行	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 2017年4月26日(基金合同生效日)至2017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	129,372,664.51	100.00%

#### 6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 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 2017年4月26日(基金合同生效日)至2017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	195,000,000.00	100.00%

#### 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 2017年4月26日(基金合同生效日)至2017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	120,484.07	100.00%	120,484.07	100.00%

#### 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 2017年4月26日(基金合同生效日)至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	544,517.80
其中：支付销售机构的客户维护费	-

注：支付基金管理人招商基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值×1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×1.50%÷当年天数

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年4月26日(基金合同生效日)至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	90,752.96

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：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷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的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
	2017 年 4 月 26 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2017 年 4 月 26 日）持有的基金份额	99,999,000.00
期初持有的基金份额	99,999,000.00
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	99,999,000.00
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	49.9770%

注：招商基金管理有限公司于该基金产品募集期间认购 99,999,000.00 份，基金合同生效日起至报告期期末无交易。

**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	
	2017 年 4 月 26 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行	12,603,217.70	60,555.97

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**

本基金本报告期内未进行利润分配。

**6.4.12 期末（2017 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
603933	睿能科技	2017年6月28日	2017年7月6日	新股流通受限	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-
603305	旭升股份	2017年6月30日	2017年7月10日	新股流通受限	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-
603331	百达精工	2017年6月27日	2017年7月5日	新股流通受限	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-
603617	君禾股份	2017年6月23日	2017年7月3日	新股流通受限	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-
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
601088	中国神华	2017年6月5日	重大事项	22.29	-	-	191,900	3,798,495.00	4,277,451.00	-

#### 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

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

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

#### 6.4.13.2 信用风险

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

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

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的利率敏感性资产主要是银行存款、债券投资。本基金的基金管理人日常通过对利率水平的预测、分析收益率曲线及优化利率重新定价日组合等方法对上述利率风险进行管理。

下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合同约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 2017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	12,603,217.70	40,000,000.00	-	-	-	-	52,603,217.70

结算备付金	695,383.05	-	-	-	-	695,383.05
存出保证金	129,213.50	-	-	-	-	129,213.50
交易性金融资产	-	-	-	-	64,651,303.81	64,651,303.81
买入返售金融资产	90,000,455.00	-	-	-	-	90,000,455.00
应收利息	-	-	-	-	475,552.85	475,552.85
资产总计	103,428,269.25	40,000,000.00	-	-	65,126,856.66	208,555,125.91
负债						
应付管理人报酬	-	-	-	-	254,000.80	254,000.80
应付托管费	-	-	-	-	42,333.45	42,333.45
应付交易费用	-	-	-	-	121,164.07	121,164.07
其他负债	-	-	-	-	30,360.00	30,360.00
负债总计	-	-	-	-	447,858.32	447,858.32
利率敏感度缺口	103,428,269.25	40,000,000.00	-	-	64,678,998.34	208,107,267.59

注：上表按金融资产或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 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有港股通标的的股票，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指以交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险，该风险可能与特定投资品种相关，也有可能与整体投资品种相关。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的债券和股票，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。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017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	64,651,303.81	31.07
衍生金融资产-权证投资	-	-
其他	-	-
合计	64,651,303.81	31.07

#### 6.4.13.4.3.2 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（2017年6月30日）
	1. 权益性投资的市场价格上升 5%	3,232,565.19
	2. 权益性投资的市场价格下降 5%	-3,232,565.19

#### 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	64,651,303.81	31.00
	其中：股票	64,651,303.81	31.00
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	90,000,455.00	43.15
	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	53,298,600.75	25.56
7	其他各项资产	604,766.35	0.29
8	合计	208,555,125.91	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	-	-
B	采矿业	12,571,354.00	6.04
C	制造业	19,387,991.59	9.32
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	4,842,708.00	2.33
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	27,849,250.22	13.38
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	64,651,303.81	31.07

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600585	海螺水泥	240,000	5,455,200.00	2.62
2	601288	农业银行	1,509,600	5,313,792.00	2.55
3	600887	伊利股份	245,000	5,289,550.00	2.54
4	600019	宝钢股份	780,000	5,233,800.00	2.51
5	601318	中国平安	105,200	5,218,972.00	2.51

6	601601	中国太保	150,000	5,080,500.00	2.44
7	601398	工商银行	958,200	5,030,550.00	2.42
8	600028	中国石化	832,200	4,934,946.00	2.37
9	601006	大秦铁路	577,200	4,842,708.00	2.33
10	601088	中国神华	191,900	4,277,451.00	2.06
11	601166	兴业银行	250,000	4,215,000.00	2.03
12	601225	陕西煤业	475,100	3,358,957.00	1.61
13	601600	中国铝业	700,000	3,164,000.00	1.52
14	601628	中国人寿	110,839	2,990,436.22	1.44
15	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.02
16	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.02
17	603380	易德龙	1,298	35,370.50	0.02
18	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.01
19	603679	华体科技	809	21,438.50	0.01
20	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.01
21	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.01
22	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.01
23	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
24	603617	君禾股份	832	7,429.76	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	601288	农业银行	15,138,564.00	7.27
2	601398	工商银行	9,994,533.00	4.80
3	601628	中国人寿	7,893,980.68	3.79
4	601318	中国平安	7,797,600.00	3.75
5	600028	中国石化	5,799,906.00	2.79
6	600585	海螺水泥	5,038,892.00	2.42
7	600019	宝钢股份	4,987,800.00	2.40
8	601601	中国太保	4,820,046.14	2.32
9	601336	新华保险	4,795,920.00	2.30
10	600887	伊利股份	4,733,112.00	2.27
11	601006	大秦铁路	4,632,898.00	2.23
12	601166	兴业银行	3,965,000.00	1.91

13	601985	中国核电	3,799,666.00	1.83
14	601088	中国神华	3,798,495.00	1.83
15	601600	中国铝业	3,182,480.00	1.53
16	601225	陕西煤业	2,799,716.00	1.35
17	603801	志邦股份	32,998.82	0.02
18	603043	广州酒家	23,855.80	0.01
19	603933	睿能科技	17,311.40	0.01
20	603305	旭升股份	15,212.26	0.01

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。

#### 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	601288	农业银行	10,416,000.00	5.01
2	601398	工商银行	5,621,000.00	2.70
3	601336	新华保险	5,292,882.00	2.54
4	601628	中国人寿	5,223,535.30	2.51
5	601318	中国平安	4,695,291.00	2.26
6	601985	中国核电	3,876,147.39	1.86
7	600028	中国石化	1,069,200.00	0.51

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	93,326,620.87
卖出股票收入（成交）总额	36,194,055.69

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投资。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

为更好地实现投资目标，本基金在注重风险管理的前提下，以套期保值为目的，适度运用股指期货、国债期货等金融衍生品。本基金利用金融衍生品合约流动性好、交易成本低和杠杆操作等特点，提高投资组合运作效率。本基金采取套期保值的方式参与股指期货的投资交易，以管理市场风险和调节股票仓位为主要目的。

## 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

为更好地实现投资目标，本基金在注重风险管理的前提下，以套期保值为目的，适度运用股指期货、国债期货等金融衍生品。本基金利用金融衍生品合约流动性好、交易成本低和杠杆操作等特点，提高投资组合运作效率。

### 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

本基金本报告期末未持有国债期货合约。



## 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

报告期内，本基金不存在投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情形。

### 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	129,213.50
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	475,552.85
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	604,766.35

### 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	601088	中国神华	4,277,451.00	2.06	重大事项

## § 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

237	844,261.73	199,996,500.00	99.95%	93,530.36	0.05%
-----	------------	----------------	--------	-----------	-------

## 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	17,690.98	0.0088%

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、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2017年4月26日）基金份额总额	200,090,030.36
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	-
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-
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）	-
本报告期末基金份额总额	200,090,030.36

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

本基金基金份额持有人大会以通讯方式召开，大会投票表决时间自2017年6月23日起至2017年7月24日17:00止，因参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额低于权益登记日基金总份额的50%，未达到法定的会议召开条件，故本次基金份额持有人大会召开失败，具体参见招商基金官网《关于招商沪港深科技创新主题精选灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会会议情况的公告》。

### 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

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金管理人没有受到监管部门的稽查或处罚，亦未收到关于基金管理人的高级管理人员、托管人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	129,372,664.51	100.00%	120,484.07	100.00%	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	3	-	-	-	-	-
方正证券	3	-	-	-	-	-
大通证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	3	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
第一创业证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	3	-	-	-	-	-

国泰君安	3	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	3	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	6	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
西藏东方财富	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	3	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	4	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-

注：基金交易佣金根据券商季度综合评分结果给与分配，券商综合评分根据研究报告质量、路演质量、联合调研质量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	-	-	195,000,000.00	100.00%	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-

中银国际	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-

## 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	招商沪港深科技创新主题精选灵活配置混合型证券投资基金基金份额发售公告	证券时报	2017 年 1 月 17 日
2	招商沪港深科技创新主题精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同	证券时报	2017 年 1 月 17 日
3	招商沪港深科技创新主题精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同摘要	证券时报	2017 年 1 月 17 日
4	招商沪港深科技创新主题精选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书	证券时报	2017 年 1 月 17 日
5	招商沪港深科技创新主题精选灵活配置混合型证券投资基金托管协议	证券时报	2017 年 1 月 17 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沪港深科技创新主题精选灵活配置混合型证券投资基金基金份额费率优惠的公告	证券时报	2017 年 1 月 17 日
7	招商基金旗下部分基金增加同花顺为代销机构的公告	证券时报	2017 年 4 月 21 日
8	招商沪港深科技创新主题精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同生效公告	证券时报	2017 年 4 月 27 日
9	关于招商沪港深科技创新主题精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更的公告	证券时报	2017 年 5 月 13 日
10	招商基金管理有限公司关于以通讯方式召开招商沪港深科技创新主题精选灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告	证券时报	2017 年 6 月 20 日
11	招商基金管理有限公司关于以通讯方式召开招商沪港深科技创新主题精选灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会第一次提示性公告	证券时报	2017 年 6 月 21 日
12	招商基金管理有限公司关于以通讯方式召开招商沪港深科技创新主题精选灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会第二次提示性公告	证券时报	2017 年 6 月 22 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20170426-20170630	99,999,000.00	-	-	99,999,000.00	49.98%

### 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。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会批准设立招商基金管理有限公司的文件；
- 2、中国证券监督管理委员会批准招商沪港深科技创新主题精选灵活配置混合型证券投资基金设立的文件；
- 3、《招商沪港深科技创新主题精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 4、《招商沪港深科技创新主题精选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 5、《招商沪港深科技创新主题精选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照。

### 12.2 存放地点

招商基金管理有限公司

地址：中国深圳深南大道 7088 号招商银行大厦

### 12.3 查阅方式

上述文件可在招商基金管理有限公司互联网站 <http://www.cmfchina.com> 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

2017 年 8 月 29 日