

招商量化精选股票型发起式证券投资基金 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 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§2 基金简介	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	6
§4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
4.8 报告期内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.....	11
§5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	11
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.....	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	15
§7 投资组合报告	32
7.1 期末基金资产组合情况.....	32
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	33
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.....	33
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	44
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	44
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.....	44
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.....	44
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.....	44
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	44
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	44
7.12 投资组合报告附注.....	45
§8 基金份额持有人信息	46

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	46
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	46
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	46
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	46
§9 开放式基金份额变动.....	47
§10 重大事件揭示.....	47
10.1 基金份额持有人大会决议.....	47
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.....	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	47
10.4 基金投资策略的改变.....	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	47
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.....	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	47
10.8 其他重大事件.....	50
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	51
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.....	51
§12 备查文件目录.....	51
12.1 备查文件目录.....	51
12.2 存放地点.....	52
12.3 查阅方式.....	52

§ 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	181,225,553.75 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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

业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×80%+中债综合指数收益率×20%
风险收益特征	本基金是股票型基金,属于证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的品种,其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		招商基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	潘西里	王永民
	联系电话	0755-83196666	010-66594896
	电子邮箱	cmf@cmfchina.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-887-9555	95566
传真		0755-83196475	010-66594942
注册地址		深圳市福田区深南大道 7088 号	北京西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		中国深圳深南大道 7088 号 招商银行大厦	北京西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		518040	100818
法定代表人		李浩	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、证券时报、上海证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.cmfchina.com
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1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	-26,252,332.68
本期利润	-25,163,175.65
加权平均基金份额本期利润	-0.1003
本期加权平均净值利润率	-9.92%
本期基金份额净值增长率	-8.97%
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	-6,479,693.52
期末可供分配基金份额利润	-0.0358
期末基金资产净值	174,745,860.23
期末基金份额净值	0.964
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	2.61%

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

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

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

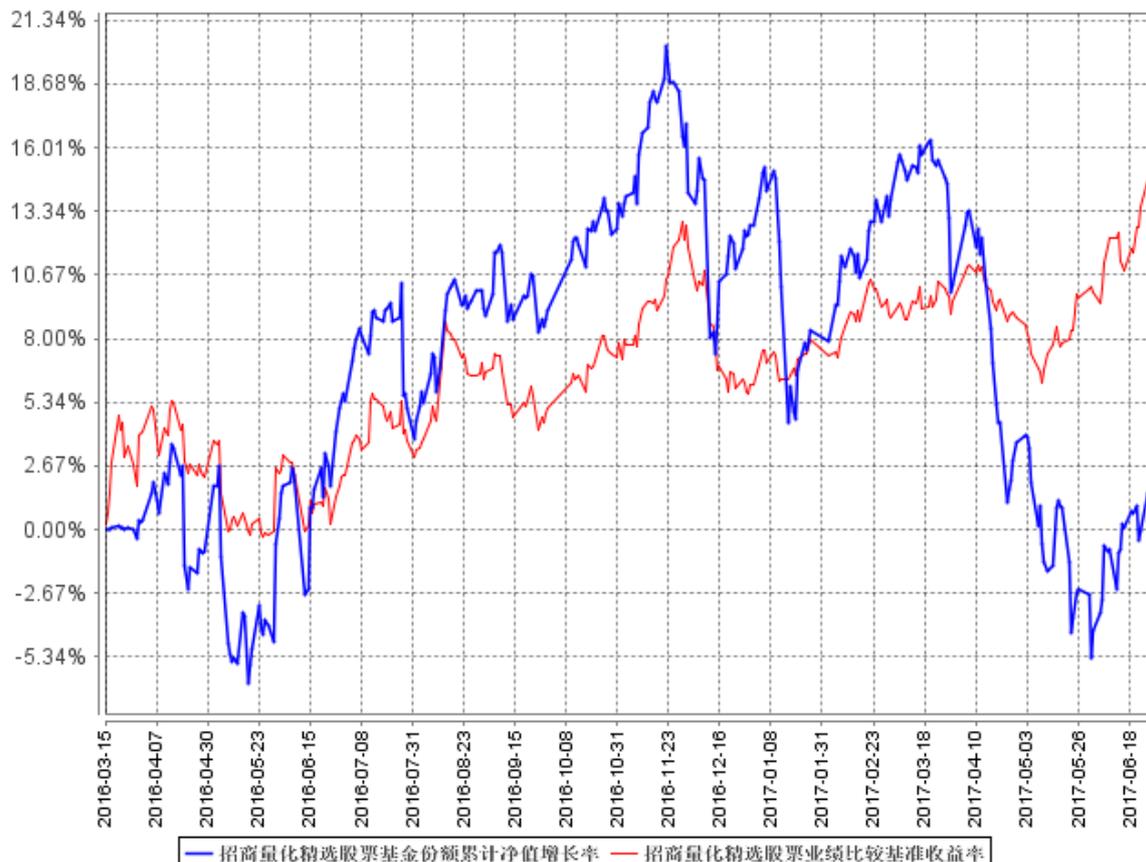
3.2 基金净值表现

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	5.47%	1.14%	4.16%	0.54%	1.31%	0.60%
过去三个月	-6.95%	1.24%	4.68%	0.50%	-11.63%	0.74%
过去六个月	-8.97%	1.16%	8.10%	0.46%	-17.07%	0.70%
过去一年	-2.93%	1.09%	12.10%	0.54%	-15.03%	0.55%
自基金合同生效起至今	2.61%	1.19%	14.66%	0.63%	-12.05%	0.56%

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

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



§ 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		
王平	本基金的 基金经理	2016 年 3 月 15 日	-	11	男，管理学硕士，FRM。2006 年加入招商基金管理有限公司，历任投资风险管理部助理数量分析师、风险管理部数量分析师、高级风控经理，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、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、招商中证银行指数分级证券投资基金、招商中证煤炭等权指数分级证券投资基金、招商中证白酒指数分级证券投资基金、招商国证生物医药指数分级证券投资基金、上证消费 80 交易型开放式指数证券投资基金及联接基金、深证电子信息传媒产业（TMT）50 交易型开放式指数证券投资基金及联接基金基金经理，现任量化投资部副总监兼招商量化精选股票型发起式证券投资基金、招商稳荣定期开放灵活配置混合型证券投资基金、招商财经大数据策略股票型证券投资基金、招商沪深 300 指数增强型证券投资基金、招商中证 1000 指数增强型证券投资基金、招商中证 500 指数增强型证券投资基金及招商盛合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合规守信情况的说明

基金管理人声明：在本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关法律法规及其各项实施准则的规定以及《招商量化精选股票型发起式证券投资基金基金合同》等基金法律文件的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的前提下，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围以及投资运作符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

基金管理人（以下简称“公司”）已建立较完善的研究方法和投资决策流程，确保各投资组合享有公平的投资决策机会。公司建立了所有组合适用的投资对象备选库，制定明确的备选库建立、维护程序。公司拥有健全的投资授权制度，明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限划分，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。公司的相关研究成果向内部所有投资组合开放，在投资研究层面不存在各投资组合间不公平的问题。

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会导致不公平交易和利益输送的重大异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，本基金股票投资策略主要使用量化模型评估资产定价、控制风险和优化交易，并

基于模型结果，结合市场环境和股票特性，精选个股构成投资组合，以追求超越业绩比较基准表现业绩水平。

本基金报告期内投资运作较为稳定，股票仓位总体维持在 92%左右的水平。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金份额净值增长率为-8.97%，同期业绩比较基准增长率为 8.10%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年欧洲经济复苏势头强劲，宽松的货币政策刺激消费增长，利于企业扩大投资规模，经济超预期增长，但欧洲银行业危机与债务危机的风险点并未消除，仍存隐患。美国经济数据喜忧参半，就业数据显示接近充分就业，房地产市场持续回暖，ISM 制造业 PMI 显著回升，但其通胀数据持续疲弱，政治风险增强，随着“通俄门”和医改遇挫的发生，美国特朗普新政存有较大不确定性。

2017 年上半年经济保持增长，GDP 实际同比增长 6.9%，与一季度持平，6 月 PMI 新出口订单指数对新订单指数的贡献较前期持续上升；受去年同期基数较小、上半年财政发力影响，三大类投资均有所反弹；消费名义增速亦好于市场预期，从数据观察来看，通讯器材、文化办公、建筑装潢、日用品等增速反弹明显，持续性仍需观望。展望下半年，在监管力度加大，地方债务持续收紧的大背景下，投资增速、制造业扩张及消费支出能否持续有待观察，下半年经济能否持续增长存隐忧。

报告期内大小盘分化明显，创业板连续四个季度业绩增速不达预期，下半年业绩下滑风险不减，再加上监管压力，及经济去杠杆、金融防风险的政策态势，创业板等小盘股行情仍不容乐观，市场仍将偏好业绩增长确定性高的大盘蓝筹股，预计下半年大盘蓝筹走势仍将好于中小创。

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

本报告期内本基金未进行利润分配。

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

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

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

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：招商量化精选股票型发起式证券投资基金

报告截止日：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	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	9,257,765.62	14,437,539.11
结算备付金		1,284,067.38	3,091,326.53
存出保证金		82,518.62	116,671.46
交易性金融资产	6.4.7.2	165,143,726.56	274,666,644.84
其中：股票投资		165,143,726.56	274,666,644.84
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		185,133.05	462,874.58
应收利息	6.4.7.5	2,044.79	4,892.48
应收股利		-	-
应收申购款		46,823.89	1,063,986.37
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		176,002,079.91	293,843,935.37
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		86.90	446,256.10
应付赎回款		148,115.20	32,847.72

应付管理人报酬		240,255.49	361,908.72
应付托管费		40,042.57	60,318.10
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	578,898.39	972,279.42
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	248,821.13	275,030.54
负债合计		1,256,219.68	2,148,640.60
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	181,225,553.75	275,513,763.74
未分配利润	6.4.7.10	-6,479,693.52	16,181,531.03
所有者权益合计		174,745,860.23	291,695,294.77
负债和所有者权益总计		176,002,079.91	293,843,935.37

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.964 元，基金份额总额 181,225,553.75 份。

6.2 利润表

会计主体：招商量化精选股票型发起式证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 3 月 15 日(基 金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		-20,301,471.40	10,773,534.11
1.利息收入		69,728.53	357,345.15
其中：存款利息收入	6.4.7.11	68,256.31	87,859.62
债券利息收入		-	37.01
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,472.22	269,448.52
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-21,708,545.90	-1,432,344.98
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-22,821,335.28	-2,198,506.02
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	79,317.79
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	112,800.00
股利收益	6.4.7.17	1,112,789.38	574,043.25
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	1,089,157.03	11,357,712.43

4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	248,188.94	490,821.51
减：二、费用		4,861,704.25	1,921,670.97
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,895,757.94	883,501.19
2. 托管费	6.4.10.2.2	315,959.69	147,250.23
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.20	2,462,732.69	783,496.10
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.21	187,253.93	107,423.45
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-25,163,175.65	8,851,863.14
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-25,163,175.65	8,851,863.14

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：招商量化精选股票型发起式证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 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）	275,513,763.74	16,181,531.03	291,695,294.77
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-25,163,175.65	-25,163,175.65
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）	-94,288,209.99	2,501,951.10	-91,786,258.89
其中：1. 基金申购款	42,037,798.00	1,780,762.78	43,818,560.78
2. 基金赎回款	-136,326,007.99	721,188.32	-135,604,819.67
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）	181,225,553.75	-6,479,693.52	174,745,860.23
项目	上年度可比期间 2016 年 3 月 15 日（基金合同生效日）至 2016 年 6 月 30 日		

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	243,093,644.61	-	243,093,644.61
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	8,851,863.14	8,851,863.14
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-45,314,660.28	2,459,479.94	-42,855,180.34
其中：1. 基金申购款	112,237,038.48	3,540,949.11	115,777,987.59
2. 基金赎回款	-157,551,698.76	-1,081,469.17	-158,633,167.93
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	197,778,984.33	11,311,343.08	209,090,327.41

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

_____	_____	_____
金旭	欧志明	何剑萍
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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

本基金于 2016 年 2 月 18 日至 2016 年 3 月 11 日募集，募集期间净认购资金人民币 243,045,764.14 元，认购资金在募集期间产生的利息人民币 47,880.47 元，募集的有效认购份额及利息结转的基金份额合计 243,093,644.61 份。上述募集资金已由毕马威华振会计师事务所

(特殊普通合伙) 验证, 并出具了毕马威华振验字第 1600365 号验资报告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《招商量化精选股票型发起式证券投资基金基金合同》和截至报告期末最新公告的《招商量化精选股票型发起式证券投资基金招募说明书》的有关规定, 本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具, 包括国内依法发行上市的 A 股股票 (包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票)、债券 (含中小企业私募债)、资产支持证券、货币市场工具、权证、股指期货, 以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具, 但须符合中国证监会的相关规定。本基金为股票型基金, 基金投资组合中股票资产占基金资产的比例不低于 80%, 权证投资占基金资产净值的 0%-3%; 任何交易日日终在扣除需缴纳的交易保证金后, 基金保留的现金或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种, 基金管理人在履行适当程序后, 可以将其纳入投资范围。本基金业绩比较基准为: 沪深 300 指数收益率 \times 80%+中债综合指数收益率 \times 20%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部 (以下简称“财政部”) 颁布的企业会计准则的要求, 同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求, 真实、完整地反映了本基金 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 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 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税字[1998]55 号文《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85 号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《财政部 国家税务总局 证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所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]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[2015] 125 号文《关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、《关于资管产品增值税有关问题的通知》（财税[2017] 56 号）及其他相关税务法规和实务操作，本基金及同类型基金适用的主要税项列示如下：

(a) 证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂免征收企业所得税，4 月 30 日（含）前免征营业税。

(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。

证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券收入免征增值税。

对香港市场投资者（包括单位和个人）通过基金互认买卖内地基金份额免征增值税。

2018 年 1 月 1 日（含）以后，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下称资管产品运营业务），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。管理人接受投资者委托以及管理人发生的除资管产品运营业务以外的其他增值税应税行为（以下称其他业务），按照现行规定缴纳增值税。管理人应分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额，未分别核算的，资管产品运营业务不得适用于简易计税方法。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日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。因此，截至 2017 年 6 月 30 日，本基金没有计提有关增值税费用。

(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) 对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入，由上市公司、发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，股权登记日为自 2013 年 1 月 1 日起至 2015 年 9 月 7 日期间的，暂减按 25% 计入应纳税所得额，股权登记日在 2015 年 9 月 8 日及以后的，暂免征收个人所得税。

(e) 关于香港市场投资者通过基金互认买卖内地基金份额的所得税问题：

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

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

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

(f) 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。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
活期存款	9,257,765.62
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-

其他存款	-
合计:	9,257,765.62

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	171,396,711.97	165,143,726.56	-6,252,985.41
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	171,396,711.97	165,143,726.56	-6,252,985.41

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融工具。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应收活期存款利息	1,619.57
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	391.83
应收债券利息	-

应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	33.39
合计	2,044.79

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	578,898.39
银行间市场应付交易费用	-
合计	578,898.39

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	260.23
预提费用	248,560.90
合计	248,821.13

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	275,513,763.74	275,513,763.74
本期申购	42,037,798.00	42,037,798.00
本期赎回(以“-”号填列)	-136,326,007.99	-136,326,007.99
本期末	181,225,553.75	181,225,553.75

注：本期申购含红利再投、转换入份(金)额，本期赎回含转换出份(金)额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	22,797,359.85	-6,615,828.82	16,181,531.03
本期利润	-26,252,332.68	1,089,157.03	-25,163,175.65
本期基金份额交易产生的变动数	-753,983.37	3,255,934.47	2,501,951.10
其中：基金申购款	2,445,492.26	-664,729.48	1,780,762.78
基金赎回款	-3,199,475.63	3,920,663.95	721,188.32
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-4,208,956.20	-2,270,737.32	-6,479,693.52

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
活期存款利息收入	51,843.74
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	15,586.44
其他	826.13
合计	68,256.31

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1月1日至2017年6月30日
卖出股票成交总额	844,321,673.07
减：卖出股票成本总额	867,143,008.35
买卖股票差价收入	-22,821,335.28

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1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,112,789.38
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,112,789.38

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1月1日至2017年6月30日
1. 交易性金融资产	1,089,157.03
——股票投资	1,089,157.03
——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	1,089,157.03

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
基金赎回费收入	226,606.22
转换转出收入	21,582.72
合计	248,188.94

注：1、本基金的赎回费率按基金持有人持有该部分基金份额的时间分段递减设定，于持有人赎回

基金份额时收取，赎回费总额按一定比例归入基金资产；

2、本基金的转换费由赎回费和申购费补差两部分组成，其中赎回费总额按一定比例归入转出基金的基金资产。

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
交易所市场交易费用	2,462,732.69
银行间市场交易费用	-
其他交易费用	-
合计	2,462,732.69

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	148,765.71
银行费用	4,693.03
其他费用	9,000.00
合计	187,253.93

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
-------	---------

招商基金管理有限公司	基金管理人
中国银行	基金托管人
招商证券股份有限公司(以下简称“招商证券”)	基金管理人的股东

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年3月15日(基金合同生效日)至 2016年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
招商证券	67,014,344.96	4.20%	54,076,698.28	9.51%

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年3月15日(基金合同生效日)至 2016年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例	成交金额	占当期债券 成交总额的比例
招商证券	-	-	347,354.80	100.00%

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年3月15日(基金合同生效日)至2016 年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券 回购成交总额的比例
招商证券	-	-	2,417,000,000.00	97.19%

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间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1月1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	62,413.84	4.23%	58,153.10	10.05%
关联方名称	上年度可比期间 2016年3月15日(基金合同生效日)至2016年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
招商证券	50,361.77	9.51%	38,413.29	8.41%

注：1、上述交易佣金比率均在合理商业条款范围内收取，并符合行业标准；

2、基金对该类交易佣金的计算方式是按合同约定的佣金率计算。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至 2017年6月30日	上年度可比期间 2016年3月15日(基金合同生效日) 至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,895,757.94	883,501.19
其中：支付销售机构的客户维护费	187,068.76	153,353.60

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

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	上年度可比期间 2016年3月15日(基金合同生效日) 至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	315,959.69	147,250.23

注：支付基金托管人中国银行的基金托管费按前一日基金资产净值×0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间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1月1日至2017年6 月30日	上年度可比期间 2016年3月15日(基金合同生效日) 至2016年6月30日
基金合同生效日（2016年3月15日）持有的基金份额	10,000,450.02	10,000,450.02
期初持有的基金份额	10,000,450.02	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	10,000,450.02	10,000,450.02
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	5.5182%	5.0564%

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方 名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年3月15日(基金合同生效日)至2016年 6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	9,257,765.62	51,843.74	54,891,021.40	58,603.87

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.11 利润分配情况

本报告期内本基金未进行利润分配。

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
002879	长缆科技	2017年6月5日	2017年7月7日	新股流通受限	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-
002882	金龙羽	2017年6月15日	2017年7月17日	新股流通受限	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-
300670	大烨智能	2017年6月26日	2017年7月3日	新股流通受限	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	-
300672	国科微	2017年6月30日	2017年7月12日	新股流通受限	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	-
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	-
300671	富满电子	2017年6月27日	2017年7月5日	新股流通受限	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-
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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

注：以上“可流通日”中，部分证券的日期是根据上市公司公告估算的流通日期。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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
300486	东杰智能	2017年1月25日	重大事项	22.63	2017年8月9日	20.38	126,900	3,609,663.00	2,871,747.00	-
300092	科新机电	2017年4月14日	重大事项	12.70	-	-	183,300	2,530,365.00	2,327,910.00	-
300022	吉峰农机	2017年5月23日	重大事项	6.72	-	-	198,700	1,809,673.27	1,335,264.00	-
300209	天泽信息	2017年2月10日	重大事项	27.72	-	-	44,901	998,114.22	1,244,655.72	-

603010	万盛股份	2016年12月26日	重大事项	40.36	2017年7月20日	36.32	26,295	710,693.11	1,061,266.20	-
300291	华录百纳	2017年4月19日	重大事项	20.02	-	-	45,182	899,966.82	904,543.64	-
002427	尤夫股份	2017年5月22日	重大事项	25.11	2017年7月21日	23.00	34,200	895,012.00	858,762.00	-
601088	中国神华	2017年6月5日	重大事项	22.29	-	-	32,300	640,815.55	719,967.00	-
002757	南兴装备	2017年6月19日	重大事项	37.49	-	-	16,900	637,385.66	633,581.00	-
002748	世龙实业	2017年6月29日	重大事项	19.45	2017年7月5日	20.00	30,900	622,738.96	601,005.00	-
300108	双龙股份	2017年5月12日	重大事项	7.75	2017年8月4日	8.35	55,500	469,721.00	430,125.00	-
300163	先锋新材	2017年4月26日	重大事项	7.60	-	-	54,700	463,481.00	415,720.00	-
000656	金科股份	2017年5月5日	重大事项	6.54	2017年7月5日	5.92	54,000	320,458.00	353,160.00	-
002567	唐人神	2017年6月5日	重大事项	9.70	2017年8月14日	9.54	30,000	280,735.00	291,000.00	-
000100	TCL集团	2017年4月21日	重大事项	3.43	2017年7月26日	3.72	78,400	278,649.00	268,912.00	-
601989	中国重工	2017年5月31日	重大事项	6.21	-	-	2,600	15,522.00	16,146.00	-

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

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

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人从事风险管理的目标是提升本基金风险调整后收益水平，保证本基金的基金资产安全，维护基金份额持有人利益。基于该风险管理目标，本基金的基金管理人风险管理

的基本策略是识别和分析本基金运作使本基金面临各种类型的风险，确定适当的风险容忍度，并及时可靠地对各种风险进行监督，将风险控制在限定的范围之内。本基金目前面临的主要风险包括：市场风险、信用风险和流动性风险。与本基金相关的市场风险主要包括市场价格风险和利率风险。

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.3 流动性风险

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

(所有者权益)无固定到期日且不计息。

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

6.4.13.4 市场风险

6.4.13.4.1 利率风险

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

下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	9,257,765.62	-	-	-	-	-	9,257,765.62
结算备付金	1,284,067.38	-	-	-	-	-	1,284,067.38
存出保证金	82,518.62	-	-	-	-	-	82,518.62
交易性金融资产	-	-	-	-	-	165,143,726.56	165,143,726.56
应收证券清算款	-	-	-	-	-	185,133.05	185,133.05
应收利息	-	-	-	-	-	2,044.79	2,044.79
应收申购款	-	-	-	-	-	46,823.89	46,823.89
资产总计	10,624,351.62	-	-	-	-	165,377,728.29	176,002,079.91
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	86.90	86.90
应付赎回款	-	-	-	-	-	148,115.20	148,115.20
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	240,255.49	240,255.49
应付托管费	-	-	-	-	-	40,042.57	40,042.57

应付交易费用	-	-	-	-	-	578,898.39	578,898.39
其他负债	-	-	-	-	-	248,821.13	248,821.13
负债总计	-	-	-	-	-	1,256,219.68	1,256,219.68
利率敏感度缺口	10,624,351.62	-	-	-	-	-164,121,508.61	174,745,860.23
上年度末 2016年12月31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	14,437,539.11	-	-	-	-	-	14,437,539.11
结算备付金	3,091,326.53	-	-	-	-	-	3,091,326.53
存出保证金	116,671.46	-	-	-	-	-	116,671.46
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-274,666,644.84	274,666,644.84
应收证券清算款	-	-	-	-	-	462,874.58	462,874.58
应收利息	-	-	-	-	-	4,892.48	4,892.48
应收申购款	-	-	-	-	-	1,063,986.37	1,063,986.37
资产总计	17,645,537.10	-	-	-	-	-276,198,398.27	293,843,935.37
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	446,256.10	446,256.10
应付赎回款	-	-	-	-	-	32,847.72	32,847.72
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	361,908.72	361,908.72
应付托管费	-	-	-	-	-	60,318.10	60,318.10
应付交易费用	-	-	-	-	-	972,279.42	972,279.42
其他负债	-	-	-	-	-	275,030.54	275,030.54
负债总计	-	-	-	-	-	2,148,640.60	2,148,640.60
利率敏感度缺口	17,645,537.10	-	-	-	-	-274,049,757.67	291,695,294.77

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 其他价格风险

市场价格风险是指以交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险，该风险可能与特定投资品种相关，也有可能与整体投资品种相关。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金在构建资产配置和基金资产投资组合的基础上，通过建立事前和事后跟踪误差的方式，对基金资产的市场价格风险进行管理。

6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 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	165,143,726.56	94.51	274,666,644.84	94.16
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	165,143,726.56	94.51	274,666,644.84	94.16

6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 若对市场价格敏感的权益性投资的市场价格上升或下降 5%		
	2. 其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2017 年 6 月 30 日）	上年度末（2016 年 12 月 31 日）
	1. 权益性投资的市场价格上升 5%	8,257,186.33	13,733,332.24
	2. 权益性投资的市场价格下降 5%	-8,257,186.33	-13,733,332.24

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	165,143,726.56	93.83
	其中：股票	165,143,726.56	93.83
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-

	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	10,541,833.00	5.99
7	其他各项资产	316,520.35	0.18
8	合计	176,002,079.91	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	2,592,692.00	1.48
B	采矿业	4,362,678.00	2.50
C	制造业	126,273,911.72	72.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,702,588.00	2.12
E	建筑业	2,575,175.00	1.47
F	批发和零售业	9,951,131.93	5.69
G	交通运输、仓储和邮政业	2,910,837.53	1.67
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,021,302.54	2.87
J	金融业	607,499.00	0.35
K	房地产业	2,858,091.20	1.64
L	租赁和商务服务业	541,552.00	0.31
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	3,746,267.64	2.14
S	综合	-	-
	合计	165,143,726.56	94.51

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	300486	东杰智能	126,900	2,871,747.00	1.64
2	300092	科新机电	183,300	2,327,910.00	1.33

3	000830	鲁西化工	213,600	1,473,840.00	0.84
4	002078	太阳纸业	186,000	1,367,100.00	0.78
5	300022	吉峰农机	198,700	1,335,264.00	0.76
6	300209	天泽信息	44,901	1,244,655.72	0.71
7	300387	富邦股份	60,674	1,201,345.20	0.69
8	603518	维格娜丝	48,100	1,176,526.00	0.67
9	300286	安科瑞	56,592	1,167,492.96	0.67
10	300067	安诺其	184,240	1,158,869.60	0.66
11	002496	辉丰股份	228,480	1,133,260.80	0.65
12	002083	孚日股份	146,700	1,120,788.00	0.64
13	002753	永东股份	59,500	1,104,915.00	0.63
14	300083	劲胜精密	119,200	1,101,408.00	0.63
15	300305	裕兴股份	122,709	1,099,472.64	0.63
16	600356	恒丰纸业	110,475	1,098,121.50	0.63
17	300452	山河药辅	38,700	1,064,250.00	0.61
18	002615	哈尔斯	94,100	1,063,330.00	0.61
19	603010	万盛股份	26,295	1,061,266.20	0.61
20	000985	大庆华科	44,700	1,059,390.00	0.61
21	000637	茂化实华	159,500	1,059,080.00	0.61
22	002042	华孚色纺	98,700	1,055,103.00	0.60
23	600513	联环药业	99,950	1,020,489.50	0.58
24	600309	万华化学	32,980	944,547.20	0.54
25	000822	山东海化	114,000	925,680.00	0.53
26	300291	华录百纳	45,182	904,543.64	0.52
27	002427	尤夫股份	34,200	858,762.00	0.49
28	000525	红太阳	44,300	824,423.00	0.47
29	300169	天晟新材	104,000	816,400.00	0.47
30	002014	永新股份	64,300	810,823.00	0.46
31	002144	宏达高科	47,516	807,772.00	0.46
32	002452	长高集团	115,100	790,737.00	0.45
33	600051	宁波联合	81,800	782,008.00	0.45
34	002019	亿帆医药	46,400	773,952.00	0.44
35	000528	柳工	88,300	762,912.00	0.44
36	300218	安利股份	66,123	761,736.96	0.44
37	300214	日科化学	111,356	747,198.76	0.43
38	600409	三友化工	74,200	747,194.00	0.43
39	000338	潍柴动力	56,200	741,840.00	0.42
40	002435	长江润发	43,100	738,734.00	0.42
41	000666	经纬纺机	32,200	732,228.00	0.42

42	002101	广东鸿图	30,600	731,034.00	0.42
43	300489	中飞股份	30,833	729,508.78	0.42
44	300132	青松股份	89,700	728,364.00	0.42
45	002636	金安国纪	42,000	725,340.00	0.42
46	300106	西部牧业	67,600	723,996.00	0.41
47	603002	宏昌电子	136,400	722,920.00	0.41
48	002174	游族网络	22,700	720,952.00	0.41
49	601088	中国神华	32,300	719,967.00	0.41
50	002195	二三四五	100,500	718,575.00	0.41
51	600742	一汽富维	37,095	708,885.45	0.41
52	600493	凤竹纺织	64,800	707,616.00	0.40
53	300208	恒顺众昇	44,300	707,471.00	0.40
54	000948	南天信息	58,000	705,280.00	0.40
55	600618	氯碱化工	65,900	703,812.00	0.40
56	300283	温州宏丰	96,488	696,643.36	0.40
57	600605	汇通能源	41,334	695,237.88	0.40
58	300239	东宝生物	104,700	691,020.00	0.40
59	300390	天华超净	75,300	690,501.00	0.40
60	600188	兖州煤业	56,400	690,336.00	0.40
61	600561	江西长运	73,948	686,237.44	0.39
62	002088	鲁阳节能	57,300	685,881.00	0.39
63	600980	北矿科技	39,500	684,535.00	0.39
64	600302	标准股份	82,400	683,920.00	0.39
65	300354	东华测试	44,083	683,727.33	0.39
66	000545	金浦钛业	116,700	682,695.00	0.39
67	600203	福日电子	80,976	679,388.64	0.39
68	600487	亨通光电	24,200	678,810.00	0.39
69	002562	兄弟科技	49,200	677,976.00	0.39
70	600235	民丰特纸	88,000	677,600.00	0.39
70	600982	宁波热电	140,000	677,600.00	0.39
71	600966	博汇纸业	130,500	677,295.00	0.39
72	002002	鸿达兴业	86,300	675,729.00	0.39
73	002502	骅威文化	71,400	670,446.00	0.38
74	300220	金运激光	35,996	669,885.56	0.38
75	000823	超声电子	46,300	667,646.00	0.38
76	002433	太安堂	72,166	667,535.50	0.38
77	300321	同大股份	29,517	665,903.52	0.38
78	300179	四方达	101,800	665,772.00	0.38
79	002402	和而泰	67,500	665,550.00	0.38

80	600213	亚星客车	61,435	664,112.35	0.38
81	002640	跨境通	31,100	660,875.00	0.38
82	600448	华纺股份	111,966	660,599.40	0.38
83	002380	科远股份	35,733	659,273.85	0.38
84	603789	星光农机	34,951	657,428.31	0.38
85	300254	仟源医药	46,200	656,502.00	0.38
86	300243	瑞丰高材	59,400	655,182.00	0.37
87	002589	瑞康医药	42,510	654,654.00	0.37
88	000669	金鸿能源	36,100	654,493.00	0.37
89	000036	华联控股	71,700	652,470.00	0.37
90	601677	明泰铝业	47,400	646,536.00	0.37
91	300126	锐奇股份	74,000	646,020.00	0.37
92	002597	金禾实业	29,400	642,684.00	0.37
93	002385	大北农	101,900	640,951.00	0.37
94	002222	福晶科技	44,800	639,296.00	0.37
95	600325	华发股份	76,500	638,775.00	0.37
96	002601	龙蟠佰利	38,900	637,182.00	0.36
97	002627	宜昌交运	34,631	636,864.09	0.36
98	002757	南兴装备	16,900	633,581.00	0.36
99	000636	风华高科	74,400	633,144.00	0.36
100	002425	凯撒文化	68,440	625,541.60	0.36
101	002532	新界泵业	76,600	624,290.00	0.36
102	002472	双环传动	56,800	623,096.00	0.36
103	002626	金达威	43,700	622,725.00	0.36
104	000756	新华制药	41,000	622,380.00	0.36
105	002773	康弘药业	11,900	622,370.00	0.36
106	002136	安纳达	35,500	621,960.00	0.36
107	002097	山河智能	69,800	620,522.00	0.36
108	000688	建新矿业	77,000	616,000.00	0.35
109	002166	莱茵生物	55,200	614,376.00	0.35
110	000903	云内动力	134,900	613,795.00	0.35
111	002734	利民股份	20,900	612,579.00	0.35
112	300094	国联水产	83,100	610,785.00	0.35
113	300365	恒华科技	17,100	610,470.00	0.35
114	300046	台基股份	32,500	607,750.00	0.35
115	002145	中核钛白	99,900	607,392.00	0.35
116	000713	丰乐种业	74,100	606,879.00	0.35
117	002171	楚江新材	40,900	606,547.00	0.35
118	002228	合兴包装	129,700	604,402.00	0.35

119	002748	世龙实业	30,900	601,005.00	0.34
120	002566	益盛药业	53,508	600,359.76	0.34
121	300146	汤臣倍健	43,600	599,064.00	0.34
122	000705	浙江震元	57,500	592,250.00	0.34
123	601015	陕西黑猫	77,800	591,280.00	0.34
124	300307	慈星股份	58,300	589,996.00	0.34
125	002370	亚太药业	20,100	589,332.00	0.34
126	002587	奥拓电子	78,000	588,120.00	0.34
127	002018	华信国际	85,800	587,730.00	0.34
128	300139	晓程科技	55,864	586,013.36	0.34
129	002436	兴森科技	92,800	584,640.00	0.33
130	300160	秀强股份	65,100	583,947.00	0.33
131	002705	新宝股份	38,840	583,765.20	0.33
132	002680	长生生物	38,100	582,549.00	0.33
133	002301	齐心集团	28,100	582,513.00	0.33
134	002416	爱施德	53,900	581,581.00	0.33
135	002132	恒星科技	125,000	581,250.00	0.33
136	300055	万邦达	31,400	577,760.00	0.33
137	000060	中金岭南	51,400	575,680.00	0.33
138	002233	塔牌集团	47,300	575,641.00	0.33
139	002084	海鸥卫浴	64,500	573,405.00	0.33
140	002768	国恩股份	27,300	571,935.00	0.33
141	002360	同德化工	69,300	570,339.00	0.33
142	002155	湖南黄金	59,200	566,544.00	0.32
143	002320	海峡股份	39,700	562,946.00	0.32
144	002091	江苏国泰	58,610	559,725.50	0.32
145	002221	东华能源	51,201	558,602.91	0.32
146	002434	万里扬	34,900	555,608.00	0.32
147	002759	天际股份	21,600	552,312.00	0.32
148	002449	国星光电	33,286	550,883.30	0.32
149	000821	京山轻机	41,300	548,051.00	0.31
150	300376	易事特	60,000	544,200.00	0.31
151	002290	中科新材	33,100	543,171.00	0.31
152	600415	小商品城	74,800	541,552.00	0.31
153	600589	广东榕泰	74,000	540,940.00	0.31
154	000550	江铃汽车	26,000	538,200.00	0.31
155	600507	方大特钢	62,600	533,978.00	0.31
156	002775	文科园林	26,100	528,786.00	0.30
157	300377	赢时胜	46,300	527,357.00	0.30

158	000404	华意压缩	66,275	521,584.25	0.30
159	000951	中国重汽	34,100	521,389.00	0.30
160	002648	卫星石化	31,500	519,750.00	0.30
161	600180	瑞茂通	37,000	519,480.00	0.30
162	002068	黑猫股份	61,700	518,897.00	0.30
163	002092	中泰化学	40,800	518,160.00	0.30
164	000933	神火股份	71,000	517,590.00	0.30
165	002226	江南化工	73,500	517,440.00	0.30
166	002182	云海金属	56,200	516,478.00	0.30
167	600889	南京化纤	54,214	514,490.86	0.29
168	002334	英威腾	70,300	509,675.00	0.29
169	000707	双环科技	67,800	507,822.00	0.29
170	600597	光明乳业	38,600	492,150.00	0.28
171	601801	皖新传媒	35,600	491,992.00	0.28
172	600475	华光股份	24,600	490,278.00	0.28
173	600741	华域汽车	20,200	489,648.00	0.28
174	002148	北纬通信	45,160	486,373.20	0.28
175	600729	重庆百货	17,800	477,752.00	0.27
176	601678	滨化股份	68,600	476,770.00	0.27
177	600197	伊力特	24,400	476,532.00	0.27
178	000030	富奥股份	53,100	474,714.00	0.27
179	002119	康强电子	27,600	474,168.00	0.27
180	600633	浙数文化	24,400	471,408.00	0.27
181	603369	今世缘	35,100	463,320.00	0.27
182	601636	旗滨集团	102,600	462,726.00	0.26
183	600758	红阳能源	51,700	462,198.00	0.26
184	600067	冠城大通	66,500	456,855.00	0.26
185	002236	大华股份	20,000	456,200.00	0.26
186	600073	上海梅林	47,600	454,580.00	0.26
187	600567	山鹰纸业	126,700	453,586.00	0.26
188	000759	中百集团	51,600	453,048.00	0.26
189	600668	尖峰集团	26,200	450,116.00	0.26
190	600499	科达洁能	56,600	449,404.00	0.26
191	002267	陕天然气	51,100	449,169.00	0.26
192	300121	阳谷华泰	32,300	445,740.00	0.26
193	000596	古井贡酒	8,700	443,265.00	0.25
194	600757	长江传媒	59,100	441,477.00	0.25
195	002534	杭锅股份	46,560	440,457.60	0.25
196	300362	天翔环境	25,500	434,775.00	0.25

197	000858	五 粮 液	7,800	434,148.00	0.25
198	600491	龙元建设	40,400	433,492.00	0.25
199	600183	生益科技	35,000	431,900.00	0.25
200	300108	双龙股份	55,500	430,125.00	0.25
201	000952	广济药业	28,500	428,355.00	0.25
202	300375	鹏翎股份	21,500	425,055.00	0.24
203	300443	金雷风电	19,800	424,116.00	0.24
204	600809	山西汾酒	12,200	423,218.00	0.24
205	002067	景兴纸业	71,700	420,879.00	0.24
206	600345	长江通信	20,200	416,322.00	0.24
207	300163	先锋新材	54,700	415,720.00	0.24
208	002150	通润装备	35,200	413,600.00	0.24
209	002172	澳洋科技	51,200	411,648.00	0.24
210	002737	葵花药业	13,300	409,640.00	0.23
211	300154	瑞凌股份	48,300	409,584.00	0.23
212	603599	广信股份	27,000	408,510.00	0.23
213	600644	乐山电力	53,700	407,583.00	0.23
214	600746	江苏索普	37,400	403,172.00	0.23
215	603223	恒通股份	16,400	400,980.00	0.23
216	603101	汇嘉时代	24,100	400,060.00	0.23
217	002100	天康生物	49,800	399,894.00	0.23
218	601579	会稽山	32,800	398,848.00	0.23
219	600163	中闽能源	83,600	397,100.00	0.23
220	300519	新光药业	6,200	392,150.00	0.22
221	600371	万向德农	32,600	390,548.00	0.22
222	300403	地尔汉宇	21,365	388,415.70	0.22
223	600229	城市传媒	41,300	386,981.00	0.22
224	300270	中威电子	32,800	384,088.00	0.22
225	600327	大东方	46,600	381,654.00	0.22
226	300394	天孚通信	14,900	381,291.00	0.22
227	002763	汇洁股份	13,200	379,500.00	0.22
228	601900	南方传媒	30,500	379,420.00	0.22
229	603520	司太立	12,000	376,680.00	0.22
230	000419	通程控股	52,800	373,824.00	0.21
231	002397	梦洁股份	55,400	370,072.00	0.21
232	300039	上海凯宝	50,700	368,589.00	0.21
233	000421	南京公用	49,800	363,540.00	0.21
234	002357	富临运业	34,000	356,320.00	0.20
235	300360	炬华科技	23,600	355,180.00	0.20

236	600081	东风科技	28,400	353,580.00	0.20
237	000656	金科股份	54,000	353,160.00	0.20
238	300484	蓝海华腾	11,600	352,176.00	0.20
239	603309	维力医疗	19,400	345,126.00	0.20
240	600098	广州发展	39,600	313,236.00	0.18
241	603519	立霸股份	14,400	311,904.00	0.18
242	002243	通产丽星	31,100	300,737.00	0.17
243	600216	浙江医药	29,800	295,318.00	0.17
244	002567	唐人神	30,000	291,000.00	0.17
245	600308	华泰股份	48,100	273,208.00	0.16
246	000100	TCL 集团	78,400	268,912.00	0.15
247	000488	晨鸣纸业	20,500	264,450.00	0.15
248	600295	鄂尔多斯	25,900	264,180.00	0.15
249	002620	瑞和股份	6,300	264,033.00	0.15
250	601155	新城控股	14,100	261,414.00	0.15
251	601908	京运通	54,300	260,640.00	0.15
252	002477	雏鹰农牧	58,800	260,484.00	0.15
253	600873	梅花生物	44,900	254,583.00	0.15
254	601225	陕西煤业	35,900	253,813.00	0.15
255	600282	南钢股份	68,200	253,022.00	0.14
256	600326	西藏天路	22,800	251,712.00	0.14
257	000725	京东方 A	59,200	246,272.00	0.14
258	600546	山煤国际	51,300	245,727.00	0.14
259	601233	桐昆股份	17,500	242,550.00	0.14
260	002109	兴化股份	30,000	242,400.00	0.14
261	300256	星星科技	22,700	236,080.00	0.14
262	600039	四川路桥	56,300	234,208.00	0.13
263	600808	马钢股份	65,800	232,932.00	0.13
264	600782	新钢股份	63,100	230,315.00	0.13
265	600168	武汉控股	24,700	222,547.00	0.13
266	601699	潞安环能	28,400	222,088.00	0.13
267	000898	鞍钢股份	38,600	218,476.00	0.13
268	000926	福星股份	17,700	215,940.00	0.12
269	600502	安徽水利	28,000	215,320.00	0.12
270	600166	福田汽车	74,400	211,296.00	0.12
271	601898	中煤能源	35,900	211,092.00	0.12
272	600348	阳泉煤业	31,100	210,858.00	0.12
273	600115	东方航空	30,700	208,760.00	0.12
274	600708	光明地产	31,330	208,031.20	0.12

275	600021	上海电力	17,200	207,948.00	0.12
276	601899	紫金矿业	60,300	206,829.00	0.12
277	600803	新奥股份	15,000	206,100.00	0.12
278	000789	万年青	28,400	201,356.00	0.12
279	000761	本钢板材	38,500	201,355.00	0.12
280	600720	祁连山	25,500	199,665.00	0.11
281	600801	华新水泥	20,500	195,365.00	0.11
282	600569	安阳钢铁	66,400	187,912.00	0.11
283	601666	平煤股份	34,600	182,342.00	0.10
284	601318	中国平安	2,400	119,064.00	0.07
285	601006	大秦铁路	7,000	58,730.00	0.03
286	601166	兴业银行	3,100	52,266.00	0.03
287	600016	民生银行	6,000	49,320.00	0.03
288	600519	贵州茅台	100	47,185.00	0.03
289	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.03
290	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.02
291	601328	交通银行	6,900	42,504.00	0.02
292	601668	中国建筑	3,900	37,752.00	0.02
293	600000	浦发银行	2,860	36,179.00	0.02
294	600030	中信证券	2,000	34,040.00	0.02
295	000042	中洲控股	2,000	33,260.00	0.02
296	601288	农业银行	9,300	32,736.00	0.02
297	600837	海通证券	2,100	31,185.00	0.02
298	600887	伊利股份	1,400	30,226.00	0.02
299	601169	北京银行	3,200	29,344.00	0.02
300	601398	工商银行	5,200	27,300.00	0.02
301	601601	中国太保	800	27,096.00	0.02
302	601766	中国中车	2,500	25,300.00	0.01
303	600104	上汽集团	800	24,840.00	0.01
304	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.01
305	002881	美格智能	989	22,608.54	0.01
306	601211	国泰君安	1,100	22,561.00	0.01
307	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.01
308	600048	保利地产	1,800	17,946.00	0.01
309	601390	中国中铁	1,900	16,473.00	0.01
310	601818	光大银行	4,000	16,200.00	0.01
311	601989	中国重工	2,600	16,146.00	0.01
312	601186	中国铁建	1,300	15,639.00	0.01
313	600518	康美药业	700	15,218.00	0.01

314	600028	中国石化	2,500	14,825.00	0.01
315	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.01
316	601688	华泰证券	800	14,320.00	0.01
317	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.01
318	601628	中国人寿	400	10,792.00	0.01
319	601881	中国银河	900	10,674.00	0.01
320	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.01
321	600919	江苏银行	1,100	10,219.00	0.01
322	601229	上海银行	400	10,216.00	0.01
323	600606	绿地控股	1,300	10,166.00	0.01
324	600340	华夏幸福	300	10,074.00	0.01
325	601901	方正证券	1,000	9,930.00	0.01
326	603331	百达精工	999	9,620.37	0.01
327	601985	中国核电	1,200	9,372.00	0.01
328	601377	兴业证券	1,200	8,916.00	0.01
329	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
330	601788	光大证券	500	7,465.00	0.00
331	600111	北方稀土	600	6,798.00	0.00
332	600547	山东黄金	200	5,786.00	0.00
333	601198	东兴证券	300	5,172.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300286	安科瑞	7,451,182.82	2.55
2	300154	瑞凌股份	7,347,560.88	2.52
3	300141	和顺电气	5,958,247.50	2.04
4	300452	山河药辅	5,920,945.18	2.03
5	600051	宁波联合	5,282,723.59	1.81
6	603701	德宏股份	5,251,580.99	1.80
7	002566	益盛药业	5,095,465.98	1.75
8	300354	东华测试	4,785,533.35	1.64
9	600213	亚星客车	4,744,658.20	1.63
10	300387	富邦股份	4,633,025.12	1.59
11	300139	晓程科技	4,450,897.77	1.53

12	002757	南兴装备	4,241,784.02	1.45
13	600302	标准股份	4,208,681.56	1.44
14	300240	飞力达	3,926,200.05	1.35
15	002452	长高集团	3,888,189.77	1.33
16	002136	安纳达	3,796,535.91	1.30
17	600444	国机通用	3,769,834.00	1.29
18	300254	仟源医药	3,680,404.54	1.26
19	300405	科隆股份	3,670,254.00	1.26
20	300442	普丽盛	3,647,538.68	1.25

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票；
2、基金持有的股票分类为交易性金融资产的，本项的“累计买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300452	山河药辅	7,882,793.37	2.70
2	600560	金白天正	7,195,849.96	2.47
3	300139	晓程科技	7,120,004.81	2.44
4	002457	青龙管业	6,863,852.82	2.35
5	000692	惠天热电	6,592,914.53	2.26
6	002057	中钢天源	6,548,485.44	2.24
7	300154	瑞凌股份	6,284,435.45	2.15
8	300330	华虹计通	5,935,009.91	2.03
9	600213	亚星客车	5,664,820.00	1.94
10	300141	和顺电气	5,653,304.94	1.94
11	603701	德宏股份	5,461,860.05	1.87
12	300286	安科瑞	5,451,787.76	1.87
13	300218	安利股份	5,287,298.27	1.81
14	600513	联环药业	5,248,438.18	1.80
15	300260	新莱应材	5,183,036.57	1.78
16	000713	丰乐种业	4,950,405.84	1.70
17	300239	东宝生物	4,890,727.83	1.68
18	300390	天华超净	4,631,164.04	1.59
19	002536	西泵股份	4,594,618.25	1.58
20	300240	飞力达	4,589,758.14	1.57

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	756,501,034.29
卖出股票收入（成交）总额	844,321,673.07

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

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

7.11.3 本期国债期货投资评价

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内基金投资的前十名证券除东杰智能（股票代码 300486）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。

该证券发行人于 2016 年 11 月 29 日发布公告称，因违规使用募集资金，未及时披露公司重大事件，被中国证监会山西监管局采取责令改正措施。

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

7.12.2 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	82,518.62
2	应收证券清算款	185,133.05
3	应收股利	-
4	应收利息	2,044.79
5	应收申购款	46,823.89
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	316,520.35

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	300486	东杰智能	2,871,747.00	1.64	重大事项
2	300092	科新机电	2,327,910.00	1.33	重大事项
3	300022	吉峰农机	1,335,264.00	0.76	重大事项
4	300209	天泽信息	1,244,655.72	0.71	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
3,167	57,223.10	113,529,407.47	62.65%	67,696,146.28	37.35%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	1,931,802.92	1.0660%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例（%）	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例（%）	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,450.02	5.52	10,000,450.02	5.52	3年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,450.02	5.52	10,000,450.02	5.52	3年

注：1、上述份额总数为扣除认购费用并包含利息结转份额后的总份额数；

2、本基金发起式资金提供方仅为基金管理人。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016年3月15日）基金份额总额	243,093,644.61
本报告期期初基金份额总额	275,513,763.74
本报告期基金总申购份额	42,037,798.00
减：本报告期基金总赎回份额	136,326,007.99
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	181,225,553.75

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期没有举行基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未作改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘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	

兴业证券	2	491,419,748.31	30.76%	457,660.75	30.99%	-
中信建投	6	229,110,788.84	14.34%	213,368.32	14.45%	-
中金公司	2	214,283,585.46	13.41%	199,559.42	13.51%	-
天风证券	2	174,104,951.97	10.90%	162,143.96	10.98%	-
海通证券	3	173,250,370.30	10.85%	161,348.66	10.93%	-
中信证券	2	75,297,007.00	4.71%	70,127.43	4.75%	-
招商证券	1	67,014,344.96	4.20%	62,413.84	4.23%	-
中泰证券	2	55,230,041.05	3.46%	40,376.79	2.73%	-
国信证券	2	44,785,663.04	2.80%	41,709.48	2.82%	-
安信证券	1	30,691,837.70	1.92%	28,587.14	1.94%	-
华创证券	2	26,388,762.88	1.65%	24,574.01	1.66%	-
东兴证券	3	15,854,729.08	0.99%	14,765.05	1.00%	-
国泰君安	3	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
西藏东方财富	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	3	-	-	-	-	-
第一创业证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	4	-	-	-	-	-
华泰证券	3	-	-	-	-	-
大通证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	3	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	3	-	-	-	-	-

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	20,000,000.00	100.00%	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
第一创业证券	-	-	-	-	-	-

国金证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	招商基金管理有限公司关于旗下部分产品参加恒丰银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2017年1月3日
2	招商基金管理有限公司关于公司董事、监事、高级管理人员以及其他从业人员在子公司兼职情况变更的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2017年1月7日
3	招商基金管理有限公司关于参加蛋卷基金基金申(认)购费率优惠的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2017年1月12日
4	招商量化精选股票型发起式证券投资基金2016年第4季度报告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2017年1月20日
5	招商基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参加交通银行股份有限公司手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2017年2月23日
6	招商基金旗下部分基金增加创金启富为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2017年3月17日
7	招商基金旗下部分基金增加联储证券为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2017年3月22日
8	招商量化精选股票型发起式证券投资基金2016年年度报告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2017年3月31日
9	招商量化精选股票型发起式证券投资基金2016年年度报告摘要	中国证券报、证券时报、上海证券报	2017年3月31日
10	招商基金关于招商量化精选股票型发起式证券投资基金增加兴业银行为代销机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2017年4月1日
11	招商量化精选股票型发起式证券投资基金2017年第1季度报告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2017年4月21日
12	招商基金管理有限公司关于旗下部分基金继续	中国证券报、证券	2017年4月22

	参加交通银行股份有限公司手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告	时报、上海证券报	日
13	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 2017 年第 1 号	中国证券报、证券时报、上海证券报	2017 年 4 月 27 日
14	招商量化精选股票型发起式证券投资基金更新的招募说明书摘要 2017 年第 1 号	中国证券报、证券时报、上海证券报	2017 年 4 月 27 日
15	招商基金旗下部分基金增加上海挖财为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2017 年 4 月 28 日
16	招商基金旗下部分基金增加华夏财富等机构为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2017 年 5 月 3 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	20170101-20170630	76,405,087.65	-	-	76,405,087.65	42.16%
机构	2	20170301-20170614	45,954,963.23	-	45,954,963.23	-	0.00%
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量化精选股票型发起式证券投资基金设立的文件；
- 3、《招商招商量化精选股票型发起式证券投资基金基金合同》；
- 4、《招商量化精选股票型发起式证券投资基金托管协议》；
- 5、《招商量化精选股票型发起式证券投资基金招募说明书》；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照。

12.2 存放地点

招商基金管理有限公司

地址：中国深圳深南大道 7088 号招商银行大厦

12.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人招商基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-887-9555

网址：<http://www.cmfcchina.com>

招商基金管理有限公司

2017 年 8 月 29 日