

招商量化精选股票型发起式证券投资 基金 2024 年中期报告

2024 年 06 月 30 日

基金管理人：招商基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 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.....	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
§4 管理人报告.....	8
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.....	10
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.....	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.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	12
§5 托管人报告.....	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 净资产变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
§7 投资组合报告.....	41
7.1 期末基金资产组合情况.....	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	41
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.....	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	50
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.....	50
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.....	50
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.....	50
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.....	51
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	51

7.12 投资组合报告附注.....	51
§8 基金份额持有人信息.....	52
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	52
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	53
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情况.....	53
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	53
§9 开放式基金份额变动.....	54
§10 重大事件揭示.....	54
10.1 基金份额持有人大会决议.....	54
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.....	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	54
10.4 基金投资策略的改变.....	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	54
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.....	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	55
10.8 其他重大事件.....	59
§11 备查文件目录.....	60
11.1 备查文件目录.....	60
11.2 存放地点.....	60
11.3 查阅方式.....	61

§ 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	招商量化精选股票发起式	
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	1,527,414,516.48 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	招商量化精选股票发起式 A	招商量化精选股票发起式 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	856,130,917.93 份	671,283,598.55 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	<p>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。</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定量的全方面分析，评估其相对投资价值并作出相应的投资决策，力求在控制投资风险的前提下尽可能的提高本基金的收益。</p> <p>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> <p>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。</p>
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	葛海蛟

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	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

1、招商量化精选股票发起式 A

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024 年 1 月 1 日 - 2024 年 6 月 30 日)
---------------	---------------------------------------

本期已实现收益	1,218,775.70
本期利润	-83,898,180.36
加权平均基金份额本期利润	-0.0961
本期加权平均净值利润率	-4.40%
本期基金份额净值增长率	-2.96%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	821,610,331.54
期末可供分配基金份额利润	0.9597
期末基金资产净值	1,817,600,589.50
期末基金份额净值	2.1230
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	125.97%

2、招商量化精选股票发起式 C

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024 年 1 月 1 日 - 2024 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	5,488,030.73
本期利润	-86,085,629.19
加权平均基金份额本期利润	-0.1192
本期加权平均净值利润率	-5.58%
本期基金份额净值增长率	-3.24%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	620,655,951.95
期末可供分配基金份额利润	0.9246
期末基金资产净值	1,388,117,014.96
期末基金份额净值	2.0679
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	110.84%

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

招商量化精选股票发起式 A

阶段	份额净值	份额净值	业绩比较	业绩比较	①-③	②-④
----	------	------	------	------	-----	-----

	增长率①	增长率标准差②	基准收益率③	基准收益率标准差④		
过去一个月	-7.04%	1.43%	-5.41%	0.77%	-1.63%	0.66%
过去三个月	-5.95%	1.51%	-4.97%	0.91%	-0.98%	0.60%
过去六个月	-2.96%	1.85%	-6.56%	1.28%	3.60%	0.57%
过去一年	-8.95%	1.43%	-13.52%	1.02%	4.57%	0.41%
过去三年	18.59%	1.32%	-20.94%	0.96%	39.53%	0.36%
自基金合同生效起至今	125.97%	1.31%	28.24%	0.94%	97.73%	0.37%

招商量化精选股票发起式 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
过去一个月	-7.09%	1.43%	-5.41%	0.77%	-1.68%	0.66%
过去三个月	-6.09%	1.51%	-4.97%	0.91%	-1.12%	0.60%
过去六个月	-3.24%	1.85%	-6.56%	1.28%	3.32%	0.57%
过去一年	-9.49%	1.43%	-13.52%	1.02%	4.03%	0.41%
过去三年	16.49%	1.32%	-20.94%	0.96%	37.43%	0.36%
自基金合同生效起至今	110.84%	1.32%	5.02%	0.98%	105.82%	0.34%

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。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

招商基金管理有限公司拥有公开募集证券投资基金管理、基金销售、全国社会保障基金境内委托管理、企业年金和职业年金基金投资管理、合格境内机构投资者、特定客户资产管理、保险资金投资管理、基本养老保险基金投资管理、公募基金投资顾问业务试点资格。

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	本基金基金经理	2016 年 3 月 15 日	-	18	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、

				<p>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、招商中证 500 指数增强型证券投资基金、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，现任量化投资部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 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 2000 指数增强型证券投资基金、招商成长量化选股股票型证券投资基金基金经理。</p>
--	--	--	--	--

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遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内, 本基金各项交易均严格按照相关法律法规、基金合同的有关要求执行, 公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 6 次, 为旗下指数及量化组合因投资策略需要而发生反向交易。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, A 股市场震荡下行, 代表大盘的沪深 300 指数微涨 0.89%, 中证 500 指数下跌 8.96%, 中证 1000 指数下跌 16.84%, 代表小盘的中证 2000 指数下跌 23.28%, 创业板指

数下跌 10.99%。从行业来看，银行指数上涨 19.2%，煤炭、石油石化、家电三个行业涨幅超过 10%，综合、消费者服务、计算机、商贸零售、传媒、医药跌幅超过 20%。从因子角度来看，大盘因子、高股息因子、估值类因子表现较好。策略方面，上半年取得的超额收益率为 6%，整体偏低，其中一季度为 4.6%，二季度为 1.4%，从季度数据来看今年二季度表现较差，而且在 2 月份的中小市值公司流动性危机中我们的策略录得了 15.11% 的相对回撤，这个回撤的幅度也创了 2018 年以来的新高，预示着市场的运行状态有着本质的变化。2 月以来我们高度关注组合的收益和回撤的情况，随时准备对策略进行微调，主要考虑调整的方向还是在市值暴露上，希望组合的平均市值能够稍微大一些，以抵抗经济增速下行过程中的相关风险，另外退市制度的优化对于中短期中小市值公司的估值也会造成一定的冲击和影响。

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-2.96%，同期业绩基准增长率为-6.56%，C 类份额净值增长率为-3.24%，同期业绩基准增长率为-6.56%。

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 2024 年上半年，国内经济整体延续回升态势，货币环境适度宽松，财政支出节奏偏慢，出口、制造业和基建投资是拉动经济的主要动力，消费表现相对平淡，地产依旧是拖累。

展望下半年，在稳增长政策加码的预期下，国内经济增长动能有望温和改善，然而美国政治经济环境与全球贸易格局等外部局势仍是不确定性因素。指数震荡格局延续，建议关注相对基准的超额收益。

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办法》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，咨询会计师事务所的专业意见，并与托管行沟通后由基金核算部具体执行。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本托管人在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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、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 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：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	90,347,606.74	61,496,769.25
结算备付金		8,119,178.09	6,492,559.16
存出保证金		1,318,714.52	1,570,829.69
交易性金融资产	6.4.7.2	3,119,205,938.10	3,354,819,570.46
其中：股票投资		3,033,883,933.39	3,224,007,009.43
基金投资		-	-
债券投资		85,322,004.71	130,812,561.03
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		9,038,298.18	1,847,476.75
应收股利		-	-
应收申购款		5,933,650.23	13,747,846.40
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		3,233,963,385.86	3,439,975,051.71
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负债：			

短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	5,324,284.30
应付赎回款		17,198,218.94	13,955,593.10
应付管理人报酬		3,346,475.45	3,459,091.45
应付托管费		557,745.92	576,515.21
应付销售服务费		747,557.74	727,814.68
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	8.27
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	6,395,783.35	4,433,103.33
负债合计		28,245,781.40	28,476,410.34
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	1,527,414,516.48	1,574,901,680.70
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	1,678,303,087.98	1,836,596,960.67
净资产合计		3,205,717,604.46	3,411,498,641.37
负债和净资产总计		3,233,963,385.86	3,439,975,051.71

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，招商量化精选股票发起式 A 份额净值 2.1230 元，基金份额总额 856,130,917.93 份；招商量化精选股票发起式 C 份额净值 2.0679 元，基金份额总额 671,283,598.55 份；总份额合计 1,527,414,516.48 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-141,436,242.64	289,512,925.86
1.利息收入		245,351.58	333,688.32
其中：存款利息收入	6.4.7.9	245,351.58	333,688.32
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		-	-
其他利息收入		-	-

2.投资收益（损失以“-”填列）		32,399,122.27	204,026,936.60
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-21,346,367.40	149,977,859.88
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	1,554,805.20	2,883,948.57
资产支持证券投资 收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-1,598,538.95	49,762.33
股利收益	6.4.7.15	53,789,223.42	51,115,365.82
以摊余成本计量的 金融资产终止确认产生的 收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.16	-176,690,615.98	83,365,155.89
4.汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.17	2,609,899.49	1,787,145.05
减：二、营业总支出		28,547,566.91	26,777,950.76
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	20,443,380.54	19,445,637.90
其中：暂估管理人报酬		-	-
2.托管费	6.4.10.2.2	3,407,230.15	3,240,939.72
3.销售服务费	6.4.10.2.3	4,561,097.92	3,955,342.86
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6.信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7.税金及附加		1.77	957.93
8.其他费用	6.4.7.19	135,856.53	135,072.35
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		-169,983,809.55	262,734,975.10
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以 “-”号填列）		-169,983,809.55	262,734,975.10
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		-169,983,809.55	262,734,975.10

注：根据最新《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：上年度可比期间“证券出借利息收入”项目的“本期”金额列示于本期“其他利息收入”项目的“上年度可比期间”金额中。

6.3 净资产变动表

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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1,574,901,680.70	-	1,836,596,960.67	3,411,498,641.37
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,574,901,680.70	-	1,836,596,960.67	3,411,498,641.37
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-47,487,164.22	-	-158,293,872.69	-205,781,036.91
（一）、综合收益总额	-	-	-169,983,809.55	-169,983,809.55
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-47,487,164.22	-	11,689,936.86	-35,797,227.36
其中：1.基金申购款	977,654,498.45	-	1,115,925,716.62	2,093,580,215.07
2.基金赎回款	-1,025,141,662.67	-	-1,104,235,779.76	-2,129,377,442.43
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	1,527,414,516.48	-	1,678,303,087.98	3,205,717,604.46
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	566,051,145.37	-	552,643,220.85	1,118,694,366.22
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	566,051,145.37	-	552,643,220.85	1,118,694,366.22
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	912,516,365.24	-	1,382,944,635.72	2,295,461,000.96
（一）、综合收益总额	-	-	262,734,975.10	262,734,975.10
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	912,516,365.24	-	1,120,209,660.62	2,032,726,025.86
其中：1.基金申购款	1,405,592,291.78	-	1,724,218,137.04	3,129,810,428.82
2.基金赎回款	-493,075,926.54	-	-604,008,476.42	-1,097,084,402.96
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	1,478,567,510.61	-	1,935,587,856.57	3,414,155,367.18

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

招商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%。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策，会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期间未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位:人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	90,347,606.74
等于: 本金	90,339,209.95
加: 应计利息	8,396.79
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	90,347,606.74

6.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	3,307,953,414.23	-	3,033,883,933.39	-274,069,480.84	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	4,009,080.00	33,722.74	4,042,922.74	120.00
	银行间市场	79,819,280.00	1,231,081.97	81,279,081.97	228,720.00
	合计	83,828,360.00	1,264,804.71	85,322,004.71	228,840.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	3,391,781,774.23	1,264,804.71	3,119,205,938.10	-273,840,640.84	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 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	7,170,280.00	-	-	-
其中：股指期货 投资	7,170,280.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	7,170,280.00	-	-	-

6.4.7.3.2 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
IM2407	IM2407	7.00	6,801,200.00	-369,080.00
合计				-369,080.00
减：可抵销期货暂收款				-369,080.00
净额				-

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无各项买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	23,946.09
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	6,262,164.92
其中：交易所市场	6,262,164.92
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	109,672.34

合计	6,395,783.35
----	--------------

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

招商量化精选股票发起式 A		
项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	903,455,139.52	903,455,139.52
本期申购	329,527,682.39	329,527,682.39
本期赎回（以“-”号填列）	-376,851,903.98	-376,851,903.98
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期末	856,130,917.93	856,130,917.93

招商量化精选股票发起式 C		
项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	671,446,541.18	671,446,541.18
本期申购	648,126,816.06	648,126,816.06
本期赎回（以“-”号填列）	-648,289,758.69	-648,289,758.69
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期末	671,283,598.55	671,283,598.55

注：本期申购含红利再投、转换入份（金）额，本期赎回含转换出份（金）额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

招商量化精选股票发起式 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	864,810,608.40	208,234,090.81	1,073,044,699.21
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	864,810,608.40	208,234,090.81	1,073,044,699.21
本期利润	1,218,775.70	-85,116,956.06	-83,898,180.36
本期基金份额交易产生的变动数	-44,419,052.56	16,742,205.28	-27,676,847.28
其中：基金申购款	307,715,477.21	82,745,827.02	390,461,304.23
基金赎回款	-352,134,529.77	-66,003,621.74	-418,138,151.51
本期已分配利润	-	-	-
本期末	821,610,331.54	139,859,340.03	961,469,671.57

招商量化精选股票发起式 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	623,475,603.52	140,076,657.94	763,552,261.46

加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	623,475,603.52	140,076,657.94	763,552,261.46
本期利润	5,488,030.73	-91,573,659.92	-86,085,629.19
本期基金份额交易产生的变动数	-8,307,682.30	47,674,466.44	39,366,784.14
其中：基金申购款	578,934,605.56	146,529,806.83	725,464,412.39
基金赎回款	-587,242,287.86	-98,855,340.39	-686,097,628.25
本期已分配利润	-	-	-
本期末	620,655,951.95	96,177,464.46	716,833,416.41

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	176,860.56
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	64,811.99
其他	3,679.03
合计	245,351.58

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-21,346,367.40
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	-21,346,367.40

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	5,367,873,487.14
减：卖出股票成本总额	5,376,502,329.13
减：交易费用	12,717,525.41
买卖股票差价收入	-21,346,367.40

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无股票赎回差价收入。

6.4.7.10.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无股票申购差价收入。

6.4.7.10.5 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内无证券出借差价收入。

6.4.7.11 债券投资收益**6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	892,953.57
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	661,851.63
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	1,554,805.20

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	51,322,881.60
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	50,217,091.81
减：应计利息总额	443,490.92
减：交易费用	447.24
买卖债券差价收入	661,851.63

6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券申购差价收入。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益**6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成**

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内无买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.12.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券赎回差价收入。

6.4.7.12.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券申购差价收入。

6.4.7.13 贵金属投资收益**6.4.7.13.1 贵金属投资收益项目构成**

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.13.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无买卖贵金属差价收入。

6.4.7.13.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无贵金属赎回差价收入。

6.4.7.13.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无贵金属申购差价收入。

6.4.7.14 衍生工具收益**6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期内无衍生工具买卖权证差价收入。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	-1,598,538.95

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	53,789,223.42
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	53,789,223.42

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-176,575,455.98

——股票投资	-176,815,295.98
——债券投资	239,840.00
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-115,160.00
——权证投资	-
——期货投资	-115,160.00
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	-176,690,615.98

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	2,609,899.49
合计	2,609,899.49

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	50,000.00
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
其他	26,184.19
合计	135,856.53

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报告批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
招商基金管理有限公司	基金管理人
中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

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

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	630,369,276.20	5.88%	-	-

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	596,263.97	6.38%	596,263.97	9.52%
关联方名称	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
招商证券	-	-	-	-

注：1、本报告期内，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、本报告期内，基金对该类交易的佣金的计算方式是按合同约定的佣金率计算。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供研究成果和市场信息等证券综合服务，并不收取额外对价。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	20,443,380.54	19,445,637.90
其中：应支付销售机构的客户维护费	7,138,325.96	6,520,607.27
应支付基金管理人的净管理费	13,305,054.58	12,925,030.63
应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×1.20%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：

$$\text{日基金管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.20\% \div \text{当年天数}$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	3,407,230.15	3,240,939.72

注：支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值×0.20%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：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

6.4.10.2.3 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	招商量化精选股票发起式 A	招商量化精选股票发起式 C	合计
招商基金管理有限公司	-	805,169.47	805,169.47
招商银行	-	623,184.34	623,184.34

招商证券	-	23,251.44	23,251.44
合计	-	1,451,605.25	1,451,605.25
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	招商量化精选股票发起式 A	招商量化精选股票发起式 C	合计
招商基金管理有限公司	-	1,052,351.04	1,052,351.04
招商银行	-	356,843.01	356,843.01
招商证券	-	20,377.42	20,377.42
合计	-	1,429,571.47	1,429,571.47

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：

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	招商量化精选股票发起式 A	招商量化精选股票发起式 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	4,500,450.02	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-

减：报告期内赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	4,500,450.02	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.53%	-

项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	招商量化精选股票发起式 A	招商量化精选股票发起式 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	5,000,450.02	-
报告期内申购/买入总份额	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	500,000.00	-
报告期末持有的基金份额	4,500,450.02	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.59%	-

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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-活期	90,347,606.74	176,860.56	179,079,496.07	249,785.39

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。

6.4.10.7 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 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	688692	达梦数据	新股获配	1,745	151,745.20

上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 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	301305	朗坤环境	新股获配	7,523	189,955.75

招商证券	301428	世纪恒通	新股获配	2,289	60,315.15
------	--------	------	------	-------	-----------

注：本表已包含托管人的关联方承销期内承销的证券。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2024 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001359	平安电工	2024年3月19日	6个月	新股流通受限	17.39	20.60	184	3,199.76	3,790.40	-
001379	腾达科技	2024年1月11日	6个月	新股流通受限	16.98	13.48	213	3,616.74	2,871.24	-
001387	雪祺电气	2024年1月4日	6个月	新股流通受限	15.38	15.25	173	2,045.54	2,638.25	-
001389	广合科技	2024年3月26日	6个月	新股流通受限	17.43	34.56	222	3,869.46	7,672.32	-
301392	汇成真空	2024年5月28日	6个月	新股流通受限	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-
301502	华阳智能	2024年1月26日	6个月	新股流通受限	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-
301536	星辰科技	2024年3月20日	6个月	新股流通受限	16.16	32.27	481	7,772.96	15,521.87	-
301538	骏鼎达	2024年3月13日	6个月	新股流通受限	55.82	91.24	150	5,972.74	13,686.00	-
301539	宏鑫科技	2024年4月3日	6个月	新股流通受限	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	-
301565	中仑新材	2024年6月	6个月	新股流通受限	11.88	18.98	711	8,446.68	13,494.78	-

		13 日								
301566	达利凯普	2023 年 12 月 22 日	6 个月	新股流通受限	8.90	16.97	576	5,126.40	9,774.72	-
301580	爱迪特	2024 年 6 月 19 日	6 个月	新股流通受限	44.95	65.93	202	9,079.90	13,317.86	-
301587	中瑞股份	2024 年 3 月 27 日	6 个月	新股流通受限	21.73	25.26	306	6,649.38	7,729.56	-
301588	美新科技	2024 年 3 月 6 日	6 个月	新股流通受限	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-
301589	诺瓦星云	2024 年 2 月 1 日	6 个月	新股流通受限	126.89	188.01	1,244	87,680.99	233,884.44	-
301591	肯特股份	2024 年 2 月 20 日	6 个月	新股流通受限	19.43	36.98	219	4,255.17	8,098.62	-
603082	北自科技	2024 年 1 月 23 日	6 个月	新股流通受限	21.28	29.49	107	2,276.96	3,155.43	-
603285	键邦股份	2024 年 6 月 28 日	1 个月内(含)	新股流通受限	18.65	18.65	1,158	21,596.70	21,596.70	-
603285	键邦股份	2024 年 6 月 28 日	6 个月	新股流通受限	18.65	18.65	129	2,405.85	2,405.85	-
603312	西典新能	2024 年 1 月 4 日	6 个月	新股流通受限	29.02	25.36	130	3,772.60	3,296.80	-
603325	博隆技术	2024 年 1 月 3 日	6 个月	新股流通受限	72.46	68.06	66	4,782.36	4,491.96	-
603341	龙旗科技	2024 年 2 月 23 日	6 个月	新股流通受限	26.00	37.49	298	7,748.00	11,172.02	-
603344	星德胜	2024 年 3 月 13 日	6 个月	新股流通受限	19.18	22.66	182	3,490.76	4,124.12	-
603350	安乃达	2024 年 6 月 26 日	1 个月内(含)	新股流通受限	20.56	20.56	945	19,429.20	19,429.20	-
603350	安乃达	2024	6 个月	新股流通	20.56	20.56	106	2,179.36	2,179.36	-

		年 6 月 26 日		受限						
603375	盛景微	2024 年 1 月 17 日	6 个月	新股流通受限	38.18	38.90	72	2,748.96	2,800.80	-
603381	永臻股份	2024 年 6 月 19 日	6 个月	新股流通受限	23.35	25.13	178	4,156.30	4,473.14	-
688530	欧莱新材	2024 年 4 月 29 日	6 个月	新股流通受限	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-
688584	上海合晶	2024 年 2 月 1 日	6 个月	新股流通受限	22.66	15.89	866	19,623.56	13,760.74	-
688691	灿芯股份	2024 年 4 月 2 日	6 个月	新股流通受限	19.86	42.51	247	4,905.42	10,499.97	-
688692	达梦数据	2024 年 6 月 4 日	6 个月	新股流通受限	86.96	174.93	175	15,218.00	30,612.75	-
688695	中创股份	2024 年 3 月 6 日	6 个月	新股流通受限	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-
688709	成都华微	2024 年 1 月 31 日	6 个月	新股流通受限	15.69	18.79	1,045	16,396.05	19,635.55	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

注：对于在流通受限期内发生送股的股票，上表列示的数量为原受限股票数量与送股数量的加总。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金为股票型基金，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。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

对于与债券投资、资产支持证券投资等投资品种相关的信用风险，本基金的基金管理人通过对投资品种的信用等级评估来选择适当的投资对象，并限制单个投资品种的持有比例来管理信用风险。附注 6.4.13.2.1 至 6.4.13.2.6 列示了本基金所持有的债券投资及资产支持证券投资的信用评级，该信用评级不包括本基金所持有的国债、央行票据、政策性金融债。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	4,287,253.69
未评级	-	-
合计	-	4,287,253.69

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。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金流动性风险来源于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。本基金所持有的全部金融负债无固定到期日或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，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	90,347,606.74	-	-	-	90,347,606.74
结算备付金	8,119,178.09	-	-	-	8,119,178.09
存出保证金	502,570.52	-	-	816,144.00	1,318,714.52
交易性金融资产	85,322,004.71	-	-	3,033,883,933.39	3,119,205,938.10
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	-	-	-	5,933,650.23	5,933,650.23
应收清算款	-	-	-	9,038,298.18	9,038,298.18
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	184,291,360.06	-	-	3,049,672,025.80	3,233,963,385.86
负债					
应付赎回款	-	-	-	17,198,218.94	17,198,218.94
应付管理人报酬	-	-	-	3,346,475.45	3,346,475.45
应付托管费	-	-	-	557,745.92	557,745.92
应付清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	747,557.74	747,557.74
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	6,395,783.35	6,395,783.35
负债总计	-	-	-	28,245,781.40	28,245,781.40

利率敏感度缺口	184,291,360.06	-	-	3,021,426,244.40	3,205,717,604.46
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	61,496,769.25	-	-	-	61,496,769.25
结算备付金	6,492,559.16	-	-	-	6,492,559.16
存出保证金	309,850.49	-	-	1,260,979.20	1,570,829.69
交易性金融资产	126,525,307.34	4,287,253.69	-	3,224,007,009.43	3,354,819,570.46
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	13,747,846.40	13,747,846.40
应收清算款	-	-	-	1,847,476.75	1,847,476.75
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	194,824,486.24	4,287,253.69	-	3,240,863,311.78	3,439,975,051.71
负债					
应付赎回款	-	-	-	13,955,593.10	13,955,593.10
应付管理人报酬	-	-	-	3,459,091.45	3,459,091.45
应付托管费	-	-	-	576,515.21	576,515.21
应付清算款	-	-	-	5,324,284.30	5,324,284.30
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	727,814.68	727,814.68
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	8.27	8.27
其他负债	-	-	-	4,433,103.33	4,433,103.33
负债总计	-	-	-	28,476,410.34	28,476,410.34
利率敏感度缺口	194,824,486.24	4,287,253.69	-	3,212,386,901.44	3,411,498,641.37

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1.若市场利率平行上升或下降 50 个基点		
	2.其他市场变量保持不变		
	3.仅存在公允价值变动对基金资产净值的影响		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
		1. 市场利率平行上升 50 个基点	-92,442.31
	2. 市场利率平行下降 50 个基点	92,648.58	533,601.71

6.4.13.4.2 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。

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 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 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	3,033,883,933.39	94.64	3,224,007,009.43	94.50
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	3,033,883,933.39	94.64	3,224,007,009.43	94.50

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(2024年6月30日)			上年度末(2023年12月31日)
1. 权益性投资的市场价格上升 5%		151,694,196.67	161,200,350.47
2. 权益性投资的市场价格下降 5%	-151,694,196.67	-161,200,350.47	

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	3,033,359,451.89	3,222,823,184.95
第二层次	85,367,615.82	130,812,561.03
第三层次	478,870.39	1,183,824.48
合计	3,119,205,938.10	3,354,819,570.46

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无需要说明有助于理解和分析会计报表的其他事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	3,033,883,933.39	93.81
	其中：股票	3,033,883,933.39	93.81
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	85,322,004.71	2.64

	其中：债券	85,322,004.71	2.64
	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	98,466,784.83	3.04
8	其他各项资产	16,290,662.93	0.50
9	合计	3,233,963,385.86	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	13,676,838.00	0.43
C	制造业	2,734,642,120.80	85.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	41,729,140.00	1.30
E	建筑业	101,468,477.00	3.17
F	批发和零售业	40,809,217.00	1.27
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	52,036,014.86	1.62
J	金融业	13,279,331.86	0.41
K	房地产业	29,106.00	0.00
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	7,291,060.19	0.23
N	水利、环境和公共设施管理业	22,014,371.68	0.69
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	6,908,256.00	0.22
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,033,883,933.39	94.64

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

7.3.1 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产 净值比例 （%）
1	002139	拓邦股份	5,834,000	61,957,080.00	1.93
2	601886	江河集团	11,298,800	55,138,144.00	1.72
3	300428	立中集团	2,931,560	54,497,700.40	1.70
4	002533	金杯电工	5,276,000	52,496,200.00	1.64
5	603995	甬金股份	2,767,576	48,487,931.52	1.51
6	601717	郑煤机	3,270,796	48,407,780.80	1.51
7	000830	鲁西化工	4,076,100	47,241,999.00	1.47
8	000551	创元科技	5,318,663	46,431,927.99	1.45
9	000550	江铃汽车	2,058,300	44,685,693.00	1.39
10	300441	鲍斯股份	7,261,100	43,058,323.00	1.34
11	000887	中鼎股份	3,419,810	41,858,474.40	1.31
12	300207	欣旺达	2,712,500	41,148,625.00	1.28
13	002106	莱宝高科	3,765,800	41,047,220.00	1.28
14	002705	新宝股份	2,821,800	39,702,726.00	1.24
15	002845	同兴达	2,804,400	37,074,168.00	1.16
16	300218	安利股份	2,415,334	36,423,236.72	1.14
17	300100	双林股份	3,316,900	35,723,013.00	1.11
18	000030	富奥股份	7,238,500	35,541,035.00	1.11
19	002768	国恩股份	1,900,315	35,535,890.50	1.11
20	002020	京新药业	3,342,100	34,991,787.00	1.09
21	603408	建霖家居	2,621,900	34,582,861.00	1.08
22	002026	山东威达	4,111,900	34,128,770.00	1.06
23	002035	华帝股份	5,445,800	33,927,334.00	1.06
24	603337	杰克股份	1,266,276	33,328,384.32	1.04
25	002615	哈尔斯	5,177,265	32,099,043.00	1.00
26	002835	同为股份	1,812,900	30,619,881.00	0.96
27	601126	四方股份	1,578,300	30,334,926.00	0.95
28	000600	建投能源	4,810,000	30,303,000.00	0.95
29	600480	凌云股份	3,049,700	29,978,551.00	0.94
30	603897	长城科技	1,700,300	29,840,265.00	0.93
31	300145	中金环境	11,388,500	28,471,250.00	0.89
32	002662	京威股份	9,023,900	27,432,656.00	0.86
33	002066	瑞泰科技	3,448,100	27,412,395.00	0.86
34	603681	永冠新材	2,062,300	26,294,325.00	0.82
35	600420	国药现代	2,394,100	25,568,988.00	0.80
36	600380	健康元	2,259,800	25,241,966.00	0.79
37	600704	物产中大	5,779,300	25,082,162.00	0.78

38	605166	聚合顺	2,358,885	24,744,703.65	0.77
39	600966	博汇纸业	5,176,287	24,742,651.86	0.77
40	002870	香山股份	825,300	24,618,699.00	0.77
41	000821	京山轻机	2,157,800	24,447,874.00	0.76
42	605488	福莱新材	1,836,200	23,870,600.00	0.74
43	600261	阳光照明	8,748,600	23,621,220.00	0.74
44	000528	柳工	2,104,900	23,553,831.00	0.73
45	600623	华谊集团	3,929,800	22,714,244.00	0.71
46	002558	巨人网络	2,387,400	22,537,056.00	0.70
47	300703	创源股份	2,749,938	22,219,499.04	0.69
48	300422	博世科	4,624,868	22,014,371.68	0.69
49	002394	联发股份	3,573,199	22,010,905.84	0.69
50	002228	合兴包装	9,371,800	21,930,012.00	0.68
51	601636	旗滨集团	3,348,800	21,599,760.00	0.67
52	000708	中信特钢	1,529,000	20,748,530.00	0.65
53	002209	达意隆	2,569,900	19,608,337.00	0.61
54	603150	万朗磁塑	776,661	19,447,591.44	0.61
55	601311	骆驼股份	2,407,900	19,311,358.00	0.60
56	300841	康华生物	357,400	18,098,736.00	0.56
57	002774	快意电梯	2,822,500	17,922,875.00	0.56
58	603611	诺力股份	1,022,900	17,430,216.00	0.54
59	600987	航民股份	2,457,900	17,352,774.00	0.54
60	002215	诺普信	2,312,400	17,227,380.00	0.54
61	603558	健盛集团	1,689,300	16,808,535.00	0.52
62	300439	美康生物	1,830,300	16,765,548.00	0.52
63	300566	激智科技	1,193,600	16,698,464.00	0.52
64	002543	万和电气	1,671,234	16,645,490.64	0.52
65	000700	模塑科技	3,050,000	16,012,500.00	0.50
66	002296	辉煌科技	1,545,500	15,934,105.00	0.50
67	600066	宇通客车	615,100	15,869,580.00	0.50
68	002078	太阳纸业	1,130,600	15,771,870.00	0.49
69	600710	苏美达	1,929,700	15,727,055.00	0.49
70	300724	捷佳伟创	289,240	15,621,852.40	0.49
71	688159	有方科技	411,423	15,576,474.78	0.49
72	300638	广和通	910,500	15,569,550.00	0.49
73	603228	景旺电子	488,800	15,543,840.00	0.48
74	600409	三友化工	3,063,903	15,380,793.06	0.48
75	601609	金田股份	2,711,700	15,348,222.00	0.48
76	002552	宝鼎科技	1,177,300	15,328,446.00	0.48
77	002140	东华科技	1,971,400	15,278,350.00	0.48
78	600479	千金药业	1,494,360	15,197,641.20	0.47
79	603355	莱克电气	703,323	15,191,776.80	0.47
80	300396	迪瑞医疗	745,100	15,132,981.00	0.47

81	600210	紫江企业	2,818,900	14,996,548.00	0.47
82	603112	华翔股份	1,407,600	14,793,876.00	0.46
83	300115	长盈精密	1,221,960	14,651,300.40	0.46
84	603173	福斯达	660,000	14,328,600.00	0.45
85	603726	朗迪集团	1,063,600	14,252,240.00	0.44
86	601038	一拖股份	884,027	13,976,466.87	0.44
87	002065	东华软件	3,052,700	13,798,204.00	0.43
88	600741	华域汽车	828,500	13,570,830.00	0.42
89	300450	先导智能	810,940	13,485,932.20	0.42
90	603677	奇精机械	1,151,300	13,412,645.00	0.42
91	600308	华泰股份	4,264,700	13,391,158.00	0.42
92	002849	威星智能	1,188,600	13,264,776.00	0.41
93	600618	氯碱化工	1,510,700	13,263,946.00	0.41
94	603236	移远通信	282,559	13,203,982.07	0.41
95	600284	浦东建设	2,380,300	12,710,802.00	0.40
96	002073	软控股份	1,712,500	12,655,375.00	0.39
97	600513	联环药业	1,553,800	12,601,318.00	0.39
98	603579	荣泰健康	802,350	12,404,331.00	0.39
99	603803	瑞斯康达	1,703,500	12,094,850.00	0.38
100	002469	三维化学	2,116,500	12,064,050.00	0.38
101	001218	丽臣实业	791,500	11,848,755.00	0.37
102	002062	宏润建设	3,374,100	11,741,868.00	0.37
103	002763	汇洁股份	1,738,500	11,526,255.00	0.36
104	601139	深圳燃气	1,710,500	11,426,140.00	0.36
105	300482	万孚生物	467,000	11,394,800.00	0.36
106	000521	长虹美菱	1,494,900	11,331,342.00	0.35
107	001207	联科科技	776,900	11,280,588.00	0.35
108	002988	豪美新材	734,000	11,266,900.00	0.35
109	300463	迈克生物	974,700	11,092,086.00	0.35
110	600699	均胜电子	744,100	11,027,562.00	0.34
111	603610	麒盛科技	1,084,600	10,715,848.00	0.33
112	002054	德美化工	2,137,200	10,493,652.00	0.33
113	003023	彩虹集团	656,400	10,469,580.00	0.33
114	301032	新柴股份	1,535,140	10,300,789.40	0.32
115	002242	九阳股份	973,727	10,204,658.96	0.32
116	603380	易德龙	501,200	10,064,096.00	0.31
117	605189	富春染织	942,660	10,048,755.60	0.31
118	603192	汇得科技	744,710	10,001,455.30	0.31
119	002165	红宝丽	2,967,200	9,791,760.00	0.31
120	600469	风神股份	1,596,779	9,325,189.36	0.29
121	002498	汉缆股份	2,807,000	9,235,030.00	0.29
122	603158	腾龙股份	1,291,000	9,088,640.00	0.28
123	002536	飞龙股份	931,000	8,863,120.00	0.28

124	002204	大连重工	2,037,400	8,699,698.00	0.27
125	000727	冠捷科技	4,179,500	8,609,770.00	0.27
126	605066	天正电气	1,542,550	8,592,003.50	0.27
127	300562	乐心医疗	955,100	8,509,941.00	0.27
128	002454	松芝股份	1,511,300	8,448,167.00	0.26
129	688208	道通科技	344,993	8,328,131.02	0.26
130	603160	汇顶科技	120,000	8,250,000.00	0.26
131	002787	华源控股	1,210,000	8,179,600.00	0.26
132	603338	浙江鼎力	130,600	7,890,852.00	0.25
133	603385	惠达卫浴	1,432,890	7,866,566.10	0.25
134	300457	赢合科技	441,000	7,863,030.00	0.25
135	600262	北方股份	473,800	7,784,534.00	0.24
136	002420	毅昌科技	1,688,800	7,700,928.00	0.24
137	300535	达威股份	649,900	7,668,820.00	0.24
138	600626	申达股份	3,162,500	7,653,250.00	0.24
139	600235	民丰特纸	1,661,500	7,642,900.00	0.24
140	601956	东贝集团	1,639,000	7,506,620.00	0.23
141	300925	法本信息	732,000	7,385,880.00	0.23
142	002084	海鸥住工	2,901,100	7,107,695.00	0.22
143	600985	淮北矿业	422,100	7,065,954.00	0.22
144	603909	建发合诚	839,733	6,986,578.56	0.22
145	002607	中公教育	4,515,200	6,908,256.00	0.22
146	603089	正裕工业	820,823	6,862,080.28	0.21
147	002392	北京利尔	2,153,568	6,783,739.20	0.21
148	600282	南钢股份	1,360,200	6,773,796.00	0.21
149	603238	诺邦股份	673,868	6,711,725.28	0.21
150	000001	平安银行	657,000	6,668,550.00	0.21
151	600512	腾达建设	3,491,700	6,599,313.00	0.21
152	688767	博拓生物	251,928	6,315,834.96	0.20
153	002403	爱仕达	951,800	6,300,916.00	0.20
154	603111	康尼机电	1,049,000	6,105,180.00	0.19
155	002598	山东章鼓	762,400	5,657,008.00	0.18
156	600166	福田汽车	2,419,700	5,444,325.00	0.17
157	688132	邦彦技术	287,548	4,988,957.80	0.16
158	300194	福安药业	1,313,100	4,910,994.00	0.15
159	003003	天元股份	608,400	4,848,948.00	0.15
160	000589	贵州轮胎	929,900	4,714,593.00	0.15
161	603727	博迈科	342,300	4,504,668.00	0.14
162	000570	苏常柴 A	999,500	4,467,765.00	0.14
163	002555	三七互娱	329,800	4,303,890.00	0.13
164	603956	威派格	771,400	4,096,134.00	0.13
165	601166	兴业银行	202,615	3,570,076.30	0.11
166	000333	美的集团	49,200	3,173,400.00	0.10

167	605365	立达信	147,900	2,347,173.00	0.07
168	603203	快克股份	90,200	2,126,916.00	0.07
169	600971	恒源煤电	176,400	2,106,216.00	0.07
170	300679	电连技术	50,000	2,011,500.00	0.06
171	002001	新 和 成	102,900	1,975,680.00	0.06
172	002942	新农股份	167,100	1,970,109.00	0.06
173	603992	松霖科技	106,200	1,953,018.00	0.06
174	300881	盛德鑫泰	70,700	1,816,283.00	0.06
175	600563	法拉电子	23,200	1,767,376.00	0.06
176	002916	深南电路	16,700	1,766,359.00	0.06
177	603055	台华新材	174,000	1,762,620.00	0.05
178	301028	东亚机械	199,300	1,747,861.00	0.05
179	603322	超讯通信	60,700	1,609,157.00	0.05
180	300515	三德科技	150,000	1,480,500.00	0.05
181	605007	五洲特纸	115,000	1,452,450.00	0.05
182	002315	焦点科技	53,400	1,439,664.00	0.04
183	001211	双枪科技	78,700	1,199,388.00	0.04
184	002687	乔治白	251,601	1,056,724.20	0.03
185	600219	南山铝业	270,000	1,028,700.00	0.03
186	601939	建设银行	127,500	943,500.00	0.03
187	688051	佳华科技	55,198	915,182.84	0.03
188	000639	西王食品	372,100	885,598.00	0.03
189	002158	汉钟精机	50,000	836,000.00	0.03
190	605333	沪光股份	26,600	740,810.00	0.02
191	000599	青岛双星	200,000	706,000.00	0.02
192	601318	中国平安	16,800	694,848.00	0.02
193	601398	工商银行	104,304	594,532.80	0.02
194	600276	恒瑞医药	13,522	520,056.12	0.02
195	601009	南京银行	29,900	310,661.00	0.01
196	600519	贵州茅台	200	293,478.00	0.01
197	002142	宁波银行	13,300	293,398.00	0.01
198	000895	双汇发展	9,900	235,323.00	0.01
199	301589	诺瓦星云	1,244	233,884.44	0.01
200	300059	东方财富	19,296	203,765.76	0.01
201	002415	海康威视	5,200	160,732.00	0.01
202	300347	泰格医药	3,300	160,380.00	0.01
203	603259	药明康德	3,677	144,101.63	0.00
204	600887	伊利股份	5,499	142,094.16	0.00
205	000960	锡业股份	9,100	140,959.00	0.00
206	600031	三一重工	8,100	133,650.00	0.00
207	600585	海螺水泥	5,300	125,027.00	0.00
208	300136	信维通信	4,600	90,068.00	0.00
209	600352	浙江龙盛	9,400	80,746.00	0.00

210	002304	洋河股份	1,000	80,740.00	0.00
211	600867	通化东宝	7,520	62,942.40	0.00
212	688692	达梦数据	175	30,612.75	0.00
213	000002	万科 A	4,200	29,106.00	0.00
214	600196	复星医药	1,300	28,782.00	0.00
215	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.00
216	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.00
217	688709	成都华微	1,045	19,635.55	0.00
218	301536	星宸科技	481	15,521.87	0.00
219	688584	上海合晶	866	13,760.74	0.00
220	301538	骏鼎达	150	13,686.00	0.00
221	301565	中仑新材	711	13,494.78	0.00
222	301580	爱迪特	202	13,317.86	0.00
223	603341	龙旗科技	298	11,172.02	0.00
224	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
225	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
226	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
227	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
228	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
229	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
230	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
231	301578	辰奕智能	154	6,093.78	0.00
232	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
233	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
234	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
235	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
236	603325	博隆技术	66	4,491.96	0.00
237	603381	永臻股份	178	4,473.14	0.00
238	603344	星德胜	182	4,124.12	0.00
239	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00
240	603312	西典新能	130	3,296.80	0.00
241	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
242	001379	腾达科技	213	2,871.24	0.00
243	603375	盛景微	72	2,800.80	0.00
244	001387	雪祺电气	173	2,638.25	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	601886	江河集团	68,094,057.00	2.00

2	002139	拓邦股份	65,564,332.00	1.92
3	603518	锦泓集团	58,212,026.00	1.71
4	000550	江铃汽车	57,662,426.00	1.69
5	300682	朗新集团	52,741,392.60	1.55
6	000830	鲁西化工	50,709,489.00	1.49
7	300428	立中集团	50,568,029.00	1.48
8	002705	新宝股份	47,616,397.00	1.40
9	000951	中国重汽	47,461,882.40	1.39
10	300100	双林股份	45,348,585.00	1.33
11	002106	莱宝高科	44,882,855.00	1.32
12	600222	太龙药业	43,769,498.68	1.28
13	000551	创元科技	42,874,102.11	1.26
14	002768	国恩股份	42,692,572.50	1.25
15	300441	鲍斯股份	42,095,496.00	1.23
16	300228	富瑞特装	42,022,694.00	1.23
17	000030	富奥股份	41,927,235.00	1.23
18	300207	欣旺达	41,226,425.00	1.21
19	300145	中金环境	40,540,630.00	1.19
20	300674	宇信科技	40,442,651.40	1.19

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	002641	公元股份	70,939,776.93	2.08
2	603518	锦泓集团	66,569,065.30	1.95
3	605158	华达新材	63,661,369.90	1.87
4	000682	东方电子	63,222,958.76	1.85
5	002171	楚江新材	62,955,053.00	1.85
6	000680	山推股份	61,476,844.09	1.80
7	000404	长虹华意	58,191,507.00	1.71
8	002498	汉缆股份	55,151,814.20	1.62
9	601126	四方股份	54,460,910.20	1.60
10	000921	海信家电	52,862,604.70	1.55
11	002588	史丹利	51,418,516.00	1.51
12	600582	天地科技	50,455,861.00	1.48
13	600531	豫光金铅	50,172,262.00	1.47
14	002870	香山股份	49,178,081.00	1.44

15	601137	博威合金	48,789,913.90	1.43
16	600502	安徽建工	48,115,405.05	1.41
17	000951	中国重汽	47,445,279.20	1.39
18	000997	新大陆	47,440,399.41	1.39
19	002130	沃尔核材	45,899,275.00	1.35
20	600222	太龙药业	44,692,841.28	1.31

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

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	5,363,194,549.07
卖出股票收入（成交）总额	5,367,873,487.14

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

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	4,042,922.74	0.13
2	央行票据	-	-
3	金融债券	81,279,081.97	2.54
	其中：政策性金融债	81,279,081.97	2.54
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	85,322,004.71	2.66

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资
----	------	------	-------	---------	------

					产净值比例 (%)
1	230211	23 国开 11	800,000	81,279,081.97	2.54
2	019733	24 国债 02	40,000	4,042,922.74	0.13

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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 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 23 国开 11（证券代码 230211）、江河集团（证券代码 601886）、江铃汽车（证券代码 000550）、鲁西化工（证券代码 000830）外其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

1、23 国开 11（证券代码 230211）

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，多次受到监管机构的处罚。

2、江河集团（证券代码 601886）

根据发布的相关公告，该证券发行人在报告期内因未按期申报税款，多次受到监管机构的处罚。

3、江铃汽车（证券代码 000550）

根据 2023 年 9 月 9 日发布的相关公告，该证券发行人因环境污染被南昌县生态环境局责令改正。

4、鲁西化工（证券代码 000830）

根据 2023 年 8 月 25 日发布的相关公告，该证券发行人因未依法履行职责被聊城高新技术产业开发区管理委员会处以罚款。

根据 2024 年 4 月 22 日发布的相关公告，该证券发行人因重大事故被山东省人民政府处以罚款。

根据 2024 年 6 月 5 日发布的相关公告，该证券发行人因违规经营被聊城高新技术产业开发区管理委员会处以行政处罚。

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

7.12.2

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

金额单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,318,714.52
2	应收清算款	9,038,298.18
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	5,933,650.23
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,290,662.93

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 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。

§ 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

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
招商量化精选股票发起式 A	204,792	4,180.49	84,346,572.33	9.85%	771,784,345.60	90.15%
招商量化精选股票发起式 C	133,176	5,040.57	271,690,120.18	40.47%	399,593,478.37	59.53%
合计	337,968	4,519.41	356,036,692.51	23.31%	1,171,377,823.97	76.69%

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）。

8.2 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	招商量化精选股票发起式 A	4,803,326.53	0.5611%
	招商量化精选股票发起式 C	131,132.77	0.0195%
	合计	4,934,459.30	0.3231%

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）。

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、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	招商量化精选股票发起式 A	0~10
	招商量化精选股票发起式 C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	招商量化精选股票发起式 A	>100
	招商量化精选股票发起式 C	0

	合计	>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	4,500,450.02	0.29	10,000,450.02	0.65	3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	2,991,302.13	0.20	1,001,199.05	0.07	3 年
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	7,491,752.15	0.49	11,001,649.07	0.72	-

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	招商量化精选股票发起式 A	招商量化精选股票发起式 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	903,455,139.52	671,446,541.18
本报告期基金总申购份额	329,527,682.39	648,126,816.06
减：本报告期基金总赎回份额	376,851,903.98	648,289,758.69
本报告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	856,130,917.93	671,283,598.55

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，经中国银行股份有限公司研究决定，郭德秋先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的重大诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，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。

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	
中信证券	11	1,218,060,956.64	11.35%	1,020,246.11	10.92%	-
国投证券	6	1,166,531,000.33	10.87%	1,103,427.94	11.81%	-
德邦证券	4	809,465,568.89	7.54%	603,813.35	6.46%	-
兴业证券	2	665,704,176.27	6.20%	629,687.04	6.74%	-
长江证券	4	642,147,628.83	5.99%	555,844.07	5.95%	-
方正证券	7	630,767,426.83	5.88%	596,639.50	6.38%	-
招商证券	6	630,369,276.20	5.88%	596,263.97	6.38%	-
光大证券	3	546,863,658.92	5.10%	407,925.12	4.36%	-

海通证券	4	526,055,148.14	4.90%	497,597.49	5.32%	-
东北证券	3	456,436,489.67	4.25%	431,747.19	4.62%	-
中信建投 证券	5	436,188,177.23	4.07%	412,589.58	4.41%	-
华创证券	4	422,322,825.30	3.94%	399,474.98	4.27%	-
浙商证券	2	361,211,526.04	3.37%	269,424.43	2.88%	-
民生证券	5	357,996,598.18	3.34%	267,019.86	2.86%	-
银河证券	1	337,813,502.75	3.15%	319,546.36	3.42%	-
国联证券	4	319,939,980.77	2.98%	238,642.44	2.55%	-
国新证券	2	258,086,878.98	2.41%	192,497.95	2.06%	-
广发证券	7	228,929,578.66	2.13%	170,762.76	1.83%	-
开源证券	2	215,194,396.78	2.01%	203,554.98	2.18%	-
申万宏源	2	175,522,077.15	1.64%	166,033.51	1.78%	-
华泰证券	4	168,808,988.18	1.57%	128,986.51	1.38%	-
天风证券	5	51,872,577.81	0.48%	49,063.26	0.52%	-
国盛证券	2	36,813,631.68	0.34%	34,823.78	0.37%	-
华金证券	4	35,976,479.08	0.34%	26,834.51	0.29%	-
国信证券	3	27,172,743.21	0.25%	20,272.21	0.22%	-
中金公司	5	2,982,200.00	0.03%	2,820.85	0.03%	-
财通证券	3	-	-	-	-	-
长城证券	3	-	-	-	-	-
诚通证券	1	-	-	-	-	-
大通证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	3	-	-	-	-	-
东方财富	3	-	-	-	-	-
东方证券	3	-	-	-	-	-
东海证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	6	-	-	-	-	-
东兴证券	3	-	-	-	-	-
国海证券	3	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	3	-	-	-	-	-
国元证券	2	-	-	-	-	-
宏信证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	5	-	-	-	-	-
华宝证券	2	-	-	-	-	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	3	-	-	-	-	-
华源证券	2	-	-	-	-	-
华鑫证券	2	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
金元证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-

平安证券	3	-	-	-	-	-
瑞信方正	2	-	-	-	-	-
山西证券	6	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
万和证券	1	-	-	-	-	-
五矿证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	3	-	-	-	-	-
信达证券	7	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
粤开证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	2	-	-	-	-	-
中金财富证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	3	-	-	-	-	-
中银国际证券	4	-	-	-	-	-
中邮证券	2	-	-	-	-	-
甬兴证券	2	-	-	-	-	-

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

光大证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
中信建投 证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	4,009,080.00	44.86%	-	-	-	-
民生证券	4,928,059.96	55.14%	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国新证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
诚通证券	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
华源证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-

南京证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
瑞信方正	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证 券	-	-	-	-	-	-
万和证券	-	-	-	-	-	-
五矿证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
中金财富 证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中银国际 证券	-	-	-	-	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-
甬兴证券	-	-	-	-	-	-

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	招商基金管理有限公司关于终止北京中期时代基金销售有限公司办理旗下基金销售业务的公告	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	2024-01-18
2	招商基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 4 季度报告提示性公告	中国证券报及基金管理人网站	2024-01-19
3	招商量化精选股票型发起式证券投资基金 2023 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	2024-01-19
4	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	2024-01-23
5	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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监	2024-02-01

	业务的公告	会基金电子披露网站	
6	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	2024-02-06
7	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	2024-02-22
8	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（二零二四年第一号）	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	2024-03-14
9	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	2024-03-14
10	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	2024-03-14
11	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	2024-03-22
12	招商基金管理有限公司旗下基金 2023 年年度报告提示性公告	中国证券报及基金管理人网站	2024-03-29
13	招商量化精选股票型发起式证券投资基金 2023 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	2024-03-29
14	招商基金管理有限公司旗下基金 2024 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	2024-04-19
15	招商量化精选股票型发起式证券投资基金 2024 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	2024-04-19
16	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	2024-05-18
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	2024-06-05
18	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	2024-06-28
19	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	2024-06-28

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会批准设立招商基金管理有限公司的文件；
- 2、中国证券监督管理委员会批准招商量化精选股票型发起式证券投资基金设立的文件；
- 3、《招商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。

11.2 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

11.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人招商基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-887-9555

网址：<http://www.cmfchina.com>

招商基金管理有限公司

2024 年 8 月 30 日