

# 招商回报优选混合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：平安银行股份有限公司

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。

基金托管人平安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 3 月 19 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遵规守信情况的说明 .....	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.....	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.....	10
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.....	11
4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	11
§5 托管人报告.....	11
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 .....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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 .....	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 净资产变动表 .....	15
6.4 报表附注 .....	16
§7 投资组合报告 .....	40
7.1 期末基金资产组合情况 .....	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	40
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.....	41
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 .....	46
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	46
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	47
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.....	47
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.....	47
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	47

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	47
7.12 投资组合报告附注.....	47
§8 基金份额持有人信息.....	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	49
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	49
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.....	49
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	50
§9 开放式基金份额变动.....	50
§10 重大事件揭示.....	50
10.1 基金份额持有人大会决议.....	50
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.....	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	51
10.4 基金投资策略的改变.....	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	51
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.....	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	51
10.8 其他重大事件.....	52
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	53
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.....	53
§12 备查文件目录.....	53
12.1 备查文件目录.....	53
12.2 存放地点.....	54
12.3 查阅方式.....	54

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	招商回报优选混合型发起式证券投资基金	
基金简称	招商回报优选混合发起式	
基金主代码	018901	
交易代码	018901	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2024 年 3 月 19 日	
基金管理人	招商基金管理有限公司	
基金托管人	平安银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	25,240,960.97 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	招商回报优选混合发起式 A	招商回报优选混合发起式 C
下属分级基金的交易代码	018901	018902
报告期末下属分级基金的份额总额	17,093,881.68 份	8,147,079.29 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险、保证基金资产流动性的前提下，通过对中国优质企业的全面深入研究，基于行业景气度趋势，优选符合中国经济中长期发展趋势的上市公司，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金通过定性与定量相结合的方法分析宏观经济和证券市场发展趋势以及行业趋势变化，对证券市场当期的系统性风险以及可预见的未来时期内各大类资产的预期风险和预期收益率进行分析评估，在基金合同以及法律法规所允许的范围内，制定本基金在股票、存托凭证、债券、现金等资产之间的配置比例、调整原则和调整范围，在保持总体风险水平相对稳定的基础上，力争投资组合的稳定增值。此外，本基金将持续地进行定期与不定期的资产配置风险监控，适时地做出相应的调整。 本基金其他主要投资策略包括：股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、金融衍生品投资策略、参与融资业务的投资策略、存托凭证投资策略。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率 $\times$ 40% + 恒生综合指数收益率（经估值汇率调整后） $\times$ 40% + 中债综合（全价）指数收益率 $\times$ 20%
风险收益特征	本基金是混合型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金和债券型基金。 本基金资产投资于港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险（港股市场实行 T+0 回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股股价可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动）、汇率风险（汇率波动可能对基金的投资收益造成损失）、港股通机制下交易日不连

	贯穿可能带来的风险（在内地开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险）等。
--	--

## 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	平安银行股份有限公司
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	95511-3
传真	0755-83196475	0755-82080387
注册地址	深圳市福田区深南大道 7088 号	广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号
办公地址	深圳市福田区深南大道 7088 号	广东省深圳市福田区益田路 5023 号平安金融中心 B 座
邮政编码	518040	518001
法定代表人	王小青	谢永林

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.cmfchina.com">http://www.cmfchina.com</a>
基金中期报告备置地点	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、招商回报优选混合发起式 A

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024 年 3 月 19 日 - 2024 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-1,111,224.41
本期利润	-1,482,389.24
加权平均基金份额本期利润	-0.0857
本期加权平均净值利润率	-8.85%
本期基金份额净值增长率	-8.51%
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	-1,455,232.64
期末可供分配基金份额利润	-0.0851
期末基金资产净值	15,638,649.04
期末基金份额净值	0.9149
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	-8.51%

## 2、招商回报优选混合发起式 C

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024 年 3 月 19 日 - 2024 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-737,954.56
本期利润	-910,766.26
加权平均基金份额本期利润	-0.0857
本期加权平均净值利润率	-8.84%
本期基金份额净值增长率	-8.64%
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	-704,280.49
期末可供分配基金份额利润	-0.0864
期末基金资产净值	7,442,798.80
期末基金份额净值	0.9136
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	-8.64%

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、本基金合同于 2024 年 3 月 19 日生效，截至本报告期末成立未满半年。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

##### 招商回报优选混合发起式 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-4.00%	0.71%	-1.95%	0.49%	-2.05%	0.22%
过去三个月	-8.04%	0.85%	2.40%	0.70%	-10.44%	0.15%
自基金合同	-8.51%	0.79%	1.03%	0.69%	-9.54%	0.10%

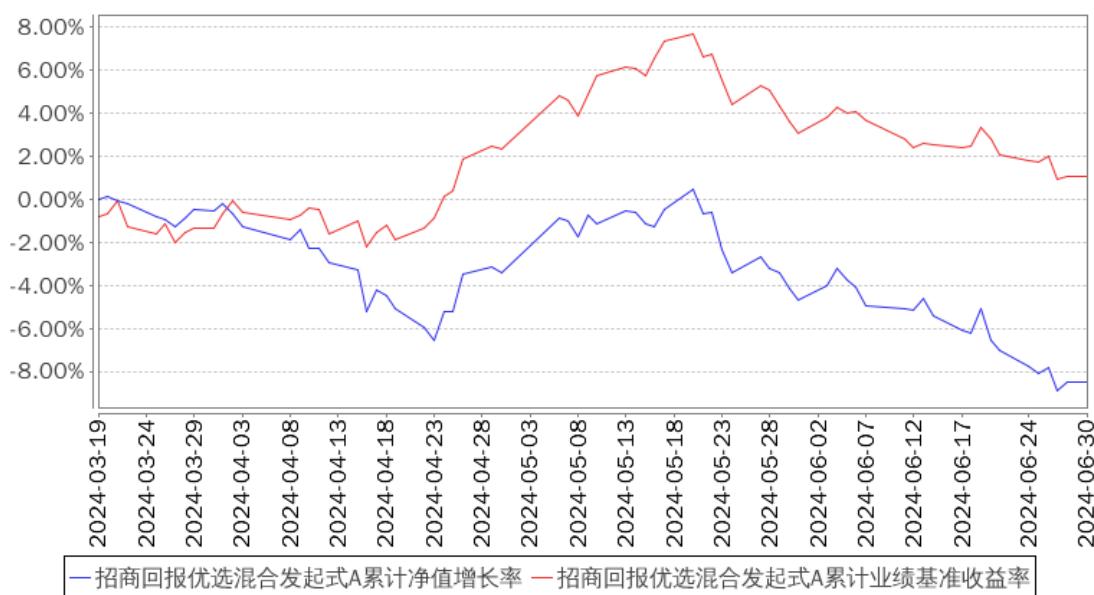
生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

招商回报优选混合发起式 C

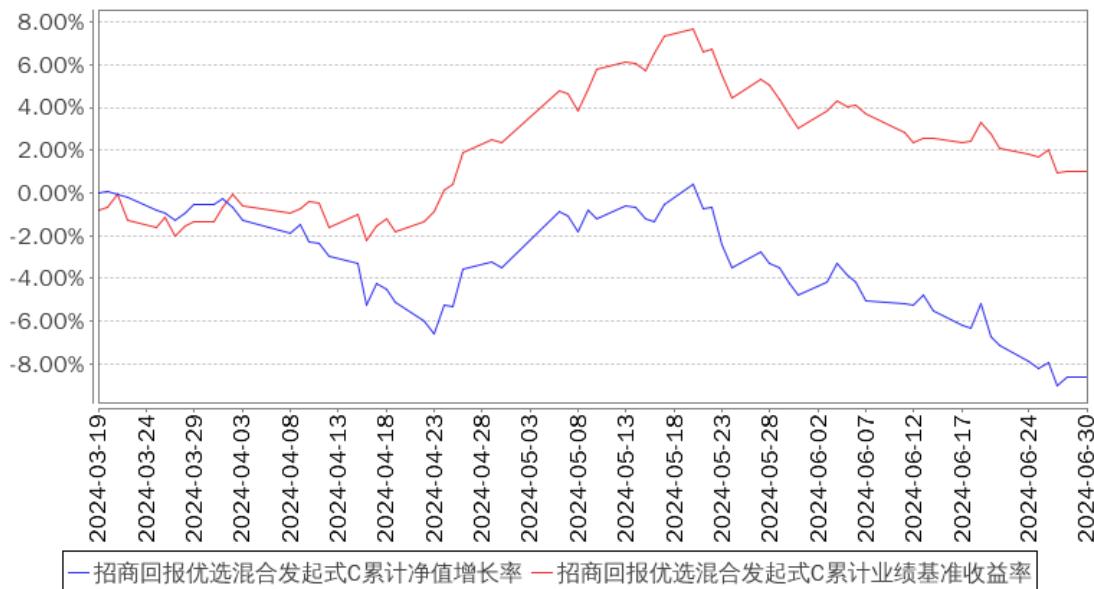
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-4.04%	0.72%	-1.95%	0.49%	-2.09%	0.23%
过去三个月	-8.15%	0.85%	2.40%	0.70%	-10.55%	0.15%
自基金合同生效起至今	-8.64%	0.80%	1.03%	0.69%	-9.67%	0.11%

### 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

招商回报优选混合发起式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



**招商回报优选混合发起式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：本基金合同于2024年3月19日生效，截至本报告期末基金成立未满一年；自基金成立日起6个月内为建仓期，截至报告期末基金建仓期尚未结束。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

招商基金管理有限公司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		
晏磊	本基金 基金经 理	2024年3 月19日	-	17	男，硕士。曾就职于国泰君安证券股份有限公司、上海英高咨询有限公司、上海亚鑫投资咨询有限公司、香港宝桥投

					资管理有限公司、中国人保资产管理有限公司。2021 年 3 月加入招商基金管理有限公司国际业务部，现任招商港股通核心精选股票型证券投资基金、招商沪港深科技创新主题精选灵活配置混合型证券投资基金、招商回报优选混合型发起式证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

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

2、证券从业年限计算标准遵从中国证监会《证券基金经营机构董事、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。

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

2024 年上半年，国内经济走势向上动能边际趋缓。地产行业虽有政策扶持，但仍低位徘徊；国内总需求仍处在收缩过程中，物价继续下行，消费动能不足；财政政策和货币政策虽有发力，但具体效果还有待观察。

在此背景下，整个权益市场表现一般：上半年沪深 300 指数上涨 0.9%，上证指数下跌 0.3%，偏成长风格的创业板指和科创 50 分别下跌 11.0%和 16.4%，偏小盘的中证 1000 和中证 2000 跌幅较大，分别下跌 16.8%和 23.3%。总体上来看，大盘和价值因子优于成长因子。

本基金遵从价值投资原则，通过对优质企业基本面全面深入研究，选择经营稳健业绩良好的蓝筹股票构建投资组合，目前计算机、公用事业、传媒、电子、电子设备是我们增配的主要方向。仓位上保持适度灵活。我们会根据市场的变化情况，不断反思组合管理操作上的得失，做好应对方案，去芜存菁，争取为投资者创造回报。

##### 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-8.51%，同期业绩基准增长率为 1.03%，C 类份额净值增长率为-8.64%，同期业绩基准增长率为 1.03%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2024 年下半年，国内经济有望逐渐修复、海外降息预期将会继续演绎。从过往的几轮周期来看，权益市场在类似的阶段表现较好的板块有互联网媒体、必选家居、医药等板块。特别是科技与医药板块经历了三年回调，估值基本回落至历史中枢以下，后续随着流动性预期好转，它们具备配置价值。同时，我们也应该看到，在资本市场风险偏好没有得到全面修复之前，A 股市场和港股市场中有高分红预期的大盘蓝筹股会持续受到青睐。结构性行情仍将继续演绎。

主要的风险点在于：1) 地缘政治走向的不确定性；2) 美联储降息时间的延后；3) 国内经济复苏不及预期。

#### 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专业胜任能力和相关工作经历。公司估值委员会主要负责制定、修订和完善基金估值政策和程序，定期评价现有估值政策和程序的适用性及对估值程序执行情况进行监督。

投资和研究部门以及基金核算部共同负责关注相关投资品种的动态，评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种；投资和研究部门定期审核公允价值的确认和计量；研究部提出合理的数量分析模型对需要进行估值测算或者调整的投资品种进行公允价值定价与计量并定期对估值政策和程序进行评价，以保证其持续适用；基金核算部定期审核估值政策和程序的一致性，并负责与托管行沟通估值调整事项；风险管理部负责估值委员会工作流程中的风险控制；法律合规部负责日常的基金估值调整结果的事后复核监督工作；法律合规部与基金核算部共同负责估值调整事项的信息披露工作。

基金经理代表向估值委员会提供估值参考信息，参与估值政策讨论；对需采用特别估值程序的证券，基金及时启动特别估值程序，由公司估值委员会集体讨论议定特别估值方案，咨询会计事务所的专业意见，并与托管行沟通后由基金核算部具体执行。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。截止报告期末本基金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

本基金为发起式基金，且截至本报告期末，本基金基金合同生效未满 3 年，不适用《公开募集证券投资基金运作管理办法》关于“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”的披露规定。

### § 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，平安银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

## 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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有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

本报告期，本托管人复核的财务指标、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真实、准确、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：招商回报优选混合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
资产：		
货币资金	6.4.7.1	3,822,314.19
结算备付金		401,416.99
存出保证金		-
交易性金融资产	6.4.7.2	16,314,833.74
其中：股票投资		16,314,833.74
基金投资		-
债券投资		-
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	600,000.00
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		2,226,654.93
应收股利		-
应收申购款		29.96
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.5	-
资产总计		23,365,249.81
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 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		-
应付赎回款		242,359.05
应付管理人报酬		23,618.32
应付托管费		3,936.40
应付销售服务费		3,880.87
应付投资顾问费		-
应交税费		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.6	10,007.33
负债合计		283,801.97
净资产：		
实收基金	6.4.7.7	25,240,960.97
其他综合收益		-
未分配利润	6.4.7.8	-2,159,513.13
净资产合计		23,081,447.84
负债和净资产总计		23,365,249.81

注：1. 报告截止日 2024 年 6 月 30 日，招商回报优选混合发起式 A 份额净值 0.9149 元，基

金份额总额 17,093,881.68 份；招商回报优选混合发起式 C 份额净值 0.9136 元，基金份额总额 8,147,079.29 份；总份额合计 25,240,960.97 份；

2. 本财务报表的实际编制期间为 2024 年 3 月 19 日(基金合同生效日)至 2024 年 6 月 30 日止期间。

## 6.2 利润表

会计主体：招商回报优选混合型发起式证券投资基金

本报告期：2024 年 3 月 19 日(基金合同生效日)至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 3 月 19 日(基金合同生效日)至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-2,258,824.39
1.利息收入		15,229.46
其中：存款利息收入	6.4.7.9	8,863.71
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		6,365.75
其他利息收入		-
2.投资收益(损失以“-”号填列)		-1,732,386.12
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-1,791,172.44
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	-
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	-
股利收益	6.4.7.15	58,786.32
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	-543,976.53
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	2,308.80
减：二、营业总支出		134,331.11
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	91,225.25
其中：暂估管理人报酬		-
2.托管费	6.4.10.2.2	15,204.22
3.销售服务费	6.4.10.2.3	17,344.83
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		-

8.其他费用	6.4.7.19	10,556.81
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-2,393,155.50
减: 所得税费用		-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-2,393,155.50
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-2,393,155.50

### 6.3 净资产变动表

会计主体: 招商回报优选混合型发起式证券投资基金

本报告期: 2024 年 3 月 19 日(基金合同生效日)至 2024 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2024 年 3 月 19 日(基金合同生效日)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	-	-	-	-
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	30,932,151.37	-	-	30,932,151.37
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-5,691,190.40	-	-2,159,513.13	-7,850,703.53
(一)、综合收益总额	-	-	-2,393,155.50	-2,393,155.50
(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)	-5,691,190.40	-	233,642.37	-5,457,548.03
其中: 1.基金申购款	352,229.54	-	-9,965.14	342,264.40
2.基金赎回款	-6,043,419.94	-	243,607.51	-5,799,812.43
(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	25,240,960.97	-	-2,159,513.13	23,081,447.84
-----------	---------------	---	---------------	---------------

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\_\_\_\_

基金管理人负责人

\_\_\_\_欧志明\_\_\_\_

主管会计工作负责人

\_\_\_\_何剑萍\_\_\_\_

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

招商回报优选混合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》、《招商回报优选混合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”)证监许可[2023]2900 号文准予公开募集注册。本基金为契约型开放式基金，存续期限为不定期。本基金根据是否收取认购费、申购费、销售服务费的不同，将基金份额分为 A 类基金份额和 C 类基金份额。本基金首次设立募集基金份额为 30,932,151.37 份，经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证，并出具了编号为德师报(验)字(24)第 00039 号验资报告。《招商回报优选混合型发起式证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)于 2024 年 3 月 19 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，基金托管人为平安银行股份有限公司(以下简称“平安银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及截至报告期末最新公告的招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股票和存托凭证(包括主板、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)、港股通标的股票、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券、可分离交易可转债、可交换债券及其他中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权，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。本基金可根据相关法律法规和基金合同的约定参与融资业务。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。本基金投资组合中股票、存托凭证投资比例为基金资产的 60%-95%，其中港股通标的股票投资比例不超过本基金股票资产的 50%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。股指期货、国债期货、股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规

或监管机构的规定执行。本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股通标的股票或选择不将基金资产投资于港股通标的股票，基金资产并非必然投资港股通标的股票。如果法律法规对基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，待履行相应程序后，以变更后的规定为准。

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率  $\times$  40%+恒生综合指数收益率(经估值汇率调整后)  $\times$  40%+中债综合(全价)指数收益率  $\times$  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 3 月 19 日(基金合同生效日)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

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为自 2024 年 3 月 19 日(基金合同生效日)至 2024 年 6 月 30 日止期间。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### 1) 金融资产的分类

根据本基金的金融资产业务模式和金融资产的合同现金流量特征，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产，暂无金融资产划分为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

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

则本基金将该金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产。此类金融资产主要包括货币资金、各类应收款项、买入返售金融资产等。

不符合分类为以摊余成本计量的金融资产以及公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产条件的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产计入“衍生金融资产”外，其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产计入“交易性金融资产”。

## 2) 金融负债的分类

本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。对于以常规方式购买或出售金融资产的，在交易日确认将收到的资产和为此将承担的负债，或者在交易日终止确认已出售的资产。金融资产和金融负债在初始确认时以公允价值计量。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券或资产支持证券已到付息期但尚未领取的利息，单独确认为应收项目。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，公允价值变动形成的利得或损失以及与该金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益。以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，发生减值或终止确认产生的利得或损失，计入当期损益。

本基金对分类为以摊余成本计量的金融资产以预期信用损失为基础确认损失准备。除购买或源生的已发生信用减值的金融资产外，本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后的变动情况。若该金融工具的信用风险自初始确认后已显著增加，本基金按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备；若该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加，本基金按照相当于该金融工具未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备。信用损失准备的增加或转回金额，作为减值损失或利得计入当期损益。

本基金在前一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形的，本基金在当期资产负债表日按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金

额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

本基金利用可获得的合理且有依据的前瞻性信息，通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止、该金融资产已转移且其所有权上几乎所有的风险和报酬已转移或虽然既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是未保留对该金融资产的控制，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。若本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有风险和报酬，且保留了对该金融资产控制的，则按照其继续涉入被转移金融资产的程度继续确认该被转移金融资产，并相应确认相关负债。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价(包括转出的非现金资产或承担的新金融负债)之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，将其公允价值划分为三个层次。第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值原则如下：

(1) 对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市价不能真实反映公允价值的，应对市价进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当投资品种不存在活跃市场，基金管理人估值委员会认为必要时，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、

参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

(3) 经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整，确定公允价值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

#### 6.4.4.9 收入/ (损失) 的确认和计量

##### 1) 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

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

转融通证券出借业务利息收入在转融通证券实际出借期间内，按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时计入转融通证券出借业务利息收入。

##### 2) 投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本与相关交易费用的差额确认。

债券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖债券价差收入。除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。买卖债券价差收入为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

资产支持证券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖资产支持证券价差收入。资产支持证券利息收入在持有期内，按资产支持证券的票面价值和预计收益率计算的利息逐日确认资产支持证券利息收入。在收到资产支持证券支付的款项时，其中属于证券投资收益的部分冲减应计利息(若有)后的差额，确认资产支持证券利息收入。买卖资产支持证券价差收入为卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本、相关交易费用与税费后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额确认，由上市公司代扣代缴的个人所得税于卖出交易日按实际代扣代缴金额确认。

出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益。

### 3) 公允价值变动收益

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

### 4) 信用减值损失

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认信用损失准备。本基金所计提的信用减值损失计入当期损益。

## 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬、基金托管费和销售服务费(如适用)按基金合同及相关公告约定的费率和计算方法逐日计提。

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

## 6.4.4.11 基金的收益分配政策

1) 在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配；

2) 本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资, 投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资; 若投资者不选择, 本基金默认的收益分配方式是现金分红;

3) 基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值; 即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值;

4) A 类基金份额和 C 类基金份额之间由于 A 类基金份额不收取而 C 类基金份额收取销售服务费将导致在可供分配利润上有所不同; 本基金同一类别的每份基金份额享有同等分配权;

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

6) 法律法规或监管机构另有规定的, 从其规定。

在不影响基金份额持有人利益的情况下, 基金管理人可在不违反法律法规的前提下酌情调整以上基金收益分配原则, 此项调整不需要召开基金份额持有人大会, 但应于变更实施日前在规定媒介公告。

#### 6.4.4.12 外币交易

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

#### 6.4.4.13 分部报告

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

#### 6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

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

1) 对于基金投资, 根据中基协发[2017]3 号《关于发布<基金中基金估值业务指引(试行)>的通知》之附件《基金中基金估值业务指引(试行)》的规定在估值日对非上市基金和上市基金进行估值。

2) 对于在发行时明确一定期限限售期的股票, 包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等, 不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票, 根据《关于发布<证券投资基金

投资流通受限股票估值指引(试行)》(中基协发[2017]6 号), 在估值日按照该通知规定的流通受限股票公允价值计算模型进行估值。

3)对于证券交易所上市的股票,若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况,根据《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》(中国证监会公告[2017]13 号)及《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》(中基协发[2013]13 号)相关规定,本基金根据情况决定使用指数收益法、可比公司法、市场价格模型法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

4)对于中国证券投资基金业协会《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》(中基协字[2022]566 号)所规定的固定收益品种,本基金按照相关规定,对以公允价值计量的固定收益品种选取第三方估值基准服务机构提供估值全价进行估值;对以摊余成本计量的固定收益品种用第三方估值基准服务机构提供的预期信用损失减值计量结果。

## 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

根据财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《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》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]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]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《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》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税；2018 年 1 月 1 日起，公开募集证券投资基金管理人运营公开募集证券投资基金过程中发生的资管产品运营业务，以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。

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

(3) 对基金取得的股票股息红利所得，由上市公司代扣代缴个人所得税；从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。对基金通过港股通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过港股通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

(4) 对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，受让方不再缴纳印花税；自 2023 年 8 月 28 日起，出让方减按 0.05%的税率缴纳证券(股票)交易印花税。对于基金通过港股通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 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	2,099,969.37
等于： 本金	2,099,807.43
加： 应计利息	161.94
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	1,722,344.82
等于：本金	1,722,135.21
加：应计利息	209.61
减：坏账准备	-
合计	3,822,314.19

#### 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	16,858,810.27	-	16,314,833.74	-543,976.53
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	16,858,810.27	-	16,314,833.74	-543,976.53

#### 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

本基金本报告期末无衍生金融工具。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	600,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	600,000.00	-

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 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	7.33
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	10,000.00
合计	10,007.33

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

招商回报优选混合发起式 A		
项目	本期 2024 年 3 月 19 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	17,589,107.53	17,589,107.53
本期申购	156,378.77	156,378.77
本期赎回（以“-”号填列）	-651,604.62	-651,604.62
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期末	17,093,881.68	17,093,881.68

招商回报优选混合发起式 C		
项目	本期 2024 年 3 月 19 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	13,343,043.84	13,343,043.84
本期申购	195,850.77	195,850.77
本期赎回（以“-”号填列）	-5,391,815.32	-5,391,815.32
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期末	8,147,079.29	8,147,079.29

注：1、本期申购含红利再投、转换入份（金）额，本期赎回含转换出份（金）额。

2、本基金自 2024 年 2 月 26 日至 2024 年 3 月 15 日止期间公开发售，有效净认购金额人民币 30,925,437.56 元，折算为 30,925,437.56 份基金份额。根据《招商回报优选混合型发起式证券投资基金基金合同》的规定，经本基金注册登记人计算并确认，本基金认购资金

在募集期内产生的利息人民币 6,713.81 元，折算为 6,713.81 份基金份额，划入基金持有人账户，两者合计 30,932,151.37 份基金份额。

#### 6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

招商回报优选混合发起式 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	-1,111,224.41	-371,164.83	-1,482,389.24
本期基金份额交易产生的变动数	23,293.92	3,862.68	27,156.60
其中：基金申购款	-2,730.48	-4,098.31	-6,828.79
基金赎回款	26,024.40	7,960.99	33,985.39
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,087,930.49	-367,302.15	-1,455,232.64

招商回报优选混合发起式 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	-737,954.56	-172,811.70	-910,766.26
本期基金份额交易产生的变动数	206,551.74	-65.97	206,485.77
其中：基金申购款	-5,294.53	2,158.18	-3,136.35
基金赎回款	211,846.27	-2,224.15	209,622.12
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-531,402.82	-172,877.67	-704,280.49

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 3 月 19 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	3,459.52
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	1,416.99

其他	3,987.20
合计	8,863.71

#### 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 3 月 19 日（基金合同生效日） 至 2024 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-1,791,172.44
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	-1,791,172.44

##### 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 3 月 19 日（基金合同生效日） 至 2024 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	68,942,590.58
减：卖出股票成本总额	70,539,782.17
减：交易费用	193,980.85
买卖股票差价收入	-1,791,172.44

##### 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

本基金本报告期内无债券投资收益。

##### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期内无买卖债券差价收入。

##### 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**

本基金本报告期内无衍生工具其他投资收益。

#### **6.4.7.15 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 3 月 19 日（基金合同生效日）
----	-----------------------------

	至 2024 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	58,786.32
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	58,786.32

#### 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 3 月 19 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-543,976.53
——股票投资	-543,976.53
——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	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-543,976.53

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 3 月 19 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	2,308.80
合计	2,308.80

#### 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 3 月 19 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	10,000.00
信息披露费	-
证券出借违约金	-
其他	556.81
合计	10,556.81

## 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
平安银行股份有限公司	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

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

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的股票交易。

#### 6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的债券交易。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内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

本基金本报告期内无应支付关联方的佣金。

### 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 3 月 19 日(基金合同生效日)至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	91,225.25
其中：应支付销售机构的客户维护费	15,946.71
应支付基金管理人的净管理费	75,278.54
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 3 月 19 日(基金合同生效日)至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	15,204.22

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 3 月 19 日(基金合同生效日)至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	招商回报优选混合发起式 A	招商回报优选混合发起式 C	合计
平安银行	-	1,626.99	1,626.99
招商基金管理有限公司	-	107.04	107.04
招商银行	-	849.52	849.52
合计	-	2,583.55	2,583.55

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：

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

#### 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

项目	本期 2024 年 3 月 19 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日		份额单位：份
	招商回报优选混合发起式 A	招商回报优选混合发起式 C	
基金合同生效日（2024 年 3 月 19 日）持有的基金份额	10,000,000.00	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-	-
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	-	-	-
报告期末持有的基金份额	10,000,000.00	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	58.50%	-	-

##### 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

关联方名称	本期 2024 年 3 月 19 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日		单位：人民币元
	期末余额	当期利息收入	
平安银行-活期	2,099,969.37	3,459.52	

注：本基金的银行存款由基金托管人平安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

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.11 利润分配情况

##### 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**

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### **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**

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

##### **6.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

本基金的基金管理人从事风险管理的目标是提升本基金风险调整后收益水平，保证本基金的基金资产安全，维护基金份额持有人利益。基于该风险管理目标，本基金的基金管理人风险管理的基本策略是识别和分析本基金运作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**

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的债券投资。

#### **6.4.13.2.5 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基金约定开放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。本基金所持有的金融资产主要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外，本基金所持有的金融负债的

合约约定到期日均为一年以内且不计息，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	3,822,314.19	-	-	-	3,822,314.19
结算备付金	401,416.99	-	-	-	401,416.99
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	16,314,833.74	16,314,833.74
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	600,000.00	-	-	-	600,000.00
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	29.96	29.96
应收清算款	-	-	-	2,226,654.93	2,226,654.93
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	4,823,731.18	-	-	18,541,518.63	23,365,249.81

负债					
应付赎回款	-	-	-	242,359.05	242,359.05
应付管理人报酬	-	-	-	23,618.32	23,618.32
应付托管费	-	-	-	3,936.40	3,936.40
应付清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	3,880.87	3,880.87
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	10,007.33	10,007.33
负债总计	-	-	-	283,801.97	283,801.97
利率敏感度缺口	4,823,731.18	-	-	18,257,716.66	23,081,447.84

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

本基金本报告期末及上年度末无利率风险的敏感性分析。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日					
	美元折合人民币	港币折合人民币	欧元折合人民币	日元折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产						
货币资金	-	-	-	-	-	-
结算备付金	-	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	3,961,213.74	-	-	-	3,961,213.74
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产合计	-	3,961,213.74	-	-	-	3,961,213.74
以外币计价						

的负债						
应付清算款	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-
应付管理人 报酬	-	-	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-	-	-
应付销售服 务费	-	-	-	-	-	-
应付投资顾 问费	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-	-	-
资产负债表 外汇风险敞 口净额	-	3,961,213.74	-	-	-	3,961,213.74

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的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 )
	1. 所有外币相对人民币升值 5%	198,060.69
	2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-198,060.69

#### 6.4.13.4.3 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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的债券和股票，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金在构建资产配置和基金资产投资组合的基础上，通过建立事前和事后跟踪误差的方式，对基金资产的市场价格风险进行管理。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位: 人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	16,314,833.74	70.68
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	16,314,833.74	70.68

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1.若对市场价格敏感的权益性投资的市场价格上升或下降 5%	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 )
	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 )
	1. 权益性投资的市场价格上升 5%	815,741.69
	2. 权益性投资的市场价格下降 5%	-815,741.69

#### 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	16,314,833.74	-
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	16,314,833.74	-

###### 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	16,314,833.74	69.83
	其中：股票	16,314,833.74	69.83
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	600,000.00	2.57
	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	4,223,731.18	18.08
8	其他各项资产	2,226,684.89	9.53
9	合计	23,365,249.81	100.00

注：上表权益投资中通过港股通交易机制投资的港股金额人民币 3,961,213.74 元，占基金净值比例 17.16%。

#### 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	1,272,500.00	5.51
C	制造业	3,830,420.00	16.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,804,400.00	12.15
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	563,300.00	2.44
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,613,400.00	6.99
J	金融业	757,000.00	3.28
K	房地产业	421,800.00	1.83
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	418,000.00	1.81
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	672,800.00	2.91
S	综合	-	-
	合计	12,353,620.00	53.52

## 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
通信服务	1,359,528.13	5.89
非日常生活消费品	-	-
日常消费品	-	-
能源	-	-
金融	685,057.61	2.97
医疗保健	376,480.50	1.63
工业	-	-
信息技术	1,540,147.50	6.67
原材料	-	-
房地产	-	-
公用事业	-	-
合计	3,961,213.74	17.16

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

## 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	00700	腾讯控股	4,000	1,359,528.13	5.89
2	600011	华能国际	120,000	1,154,400.00	5.00
3	600027	华电国际	150,000	1,041,000.00	4.51
4	688111	金山办公	4,000	910,000.00	3.94
5	600547	山东黄金	30,000	821,400.00	3.56
6	601128	常熟银行	100,000	757,000.00	3.28
7	000977	浪潮信息	20,000	727,400.00	3.15
8	00388	香港交易所	3,000	685,057.61	2.97
9	300251	光线传媒	80,000	672,800.00	2.91
10	01347	华虹半导体	30,000	603,737.82	2.62
11	601021	春秋航空	10,000	563,300.00	2.44
12	002273	水晶光电	30,000	509,400.00	2.21
13	00981	中芯国际	30,000	468,752.45	2.03
14	00268	金蝶国际	70,000	467,657.23	2.03
15	000552	甘肃能化	130,000	451,100.00	1.95
16	300910	瑞丰新材	10,000	437,200.00	1.89
17	002180	纳思达	16,000	422,720.00	1.83
18	000560	我爱我家	190,000	421,800.00	1.83
19	600323	瀚蓝环境	20,000	418,000.00	1.81
20	601179	中国西电	50,000	402,000.00	1.74
21	002475	立讯精密	10,000	393,100.00	1.70
22	00013	和黄医药	15,000	376,480.50	1.63
23	002380	科远智慧	20,000	366,000.00	1.59
24	600893	航发动力	10,000	365,500.00	1.58
25	600131	国网信通	20,000	337,400.00	1.46
26	002028	思源电气	5,000	334,500.00	1.45
27	601985	中国核电	30,000	319,800.00	1.39
28	600900	长江电力	10,000	289,200.00	1.25
29	000922	佳电股份	20,000	238,600.00	1.03

## 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	00700	腾讯控股	2,537,229.00	10.99
2	01024	快手-W	2,530,249.68	10.96
3	00960	龙湖集团	2,251,214.49	9.75

4	01810	小米集团-W	2,089,988.39	9.05
5	002475	立讯精密	1,950,078.00	8.45
6	00992	联想集团	1,802,559.14	7.81
7	00981	中芯国际	1,667,107.03	7.22
8	09626	哔哩哔哩-W	1,381,554.31	5.99
9	00268	金蝶国际	1,359,804.36	5.89
10	000977	浪潮信息	1,324,147.00	5.74
11	01818	招金矿业	1,206,830.39	5.23
12	600011	华能国际	1,103,652.00	4.78
13	688111	金山办公	1,088,461.56	4.72
14	03800	协鑫科技	1,086,410.50	4.71
15	000625	长安汽车	1,067,166.00	4.62
16	601128	常熟银行	1,025,706.00	4.44
17	00696	中国民航信息网络	996,524.30	4.32
18	600027	华电国际	992,500.00	4.30
19	688256	寒武纪	976,104.16	4.23
20	601801	皖新传媒	954,199.00	4.13
21	600426	华鲁恒升	886,100.00	3.84
22	600547	山东黄金	875,189.00	3.79
23	03690	美团-W	823,148.87	3.57
24	601857	中国石油	812,400.00	3.52
25	688009	中国通号	811,600.00	3.52
26	600131	国网信通	801,100.00	3.47
27	301029	怡合达	768,071.00	3.33
28	00388	香港交易所	764,766.90	3.31
29	688279	峰昭科技	757,000.00	3.28
30	600602	云赛智联	753,917.00	3.27
31	01766	中国中车	737,401.86	3.19
32	00836	华润电力	718,167.34	3.11
33	300251	光线传媒	717,600.00	3.11
34	688187	时代电气	711,512.23	3.08
35	01801	信达生物	695,820.24	3.01
36	002180	纳思达	695,373.00	3.01
37	000657	中钨高新	694,500.00	3.01
38	002028	思源电气	692,849.00	3.00
39	002938	鹏鼎控股	687,800.00	2.98
40	02015	理想汽车-W	670,186.62	2.90
41	02013	微盟集团	653,064.04	2.83
42	300347	泰格医药	652,800.00	2.83
43	000983	山西焦煤	643,200.00	2.79
44	01860	汇量科技	637,904.98	2.76
45	01347	华虹半导体	630,068.69	2.73

46	600346	恒力石化	613,850.00	2.66
47	000893	亚钾国际	586,634.00	2.54
48	300699	光威复材	585,800.00	2.54
49	601595	上海电影	584,922.00	2.53
50	601118	海南橡胶	577,589.00	2.50
51	601021	春秋航空	574,250.00	2.49
52	00168	青岛啤酒股份	571,519.50	2.48
53	603728	鸣志电器	571,250.00	2.47
54	605111	新洁能	559,266.00	2.42
55	603806	福斯特	559,070.00	2.42
56	01585	雅迪控股	548,729.85	2.38
57	003021	兆威机电	544,330.00	2.36
58	603920	世运电路	538,400.00	2.33
59	01896	猫眼娱乐	531,157.56	2.30
60	688027	国盾量子	530,424.43	2.30
61	300496	中科创达	529,087.00	2.29
62	00175	吉利汽车	522,698.10	2.26
63	02333	长城汽车	512,103.17	2.22
64	688197	首药控股	511,761.15	2.22
65	00694	北京首都机场股份	511,641.13	2.22
66	002245	蔚蓝锂芯	510,000.00	2.21
67	603393	新天然气	508,640.00	2.20
68	01357	美图公司	505,111.50	2.19
69	000100	TCL 科技	505,000.00	2.19
70	002273	水晶光电	499,200.00	2.16
71	688083	中望软件	488,971.16	2.12
72	688525	佰维存储	483,450.00	2.09
73	000560	我爱我家	478,800.00	2.07
74	01610	中粮家佳康	477,543.18	2.07
75	02669	中海物业	476,810.34	2.07
76	000552	甘肃能化	472,968.00	2.05
77	000768	中航西飞	470,773.00	2.04
78	300910	瑞丰新材	469,986.00	2.04
79	01109	华润置地	465,322.26	2.02

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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	01024	快手-W	2,412,371.89	10.45
2	01810	小米集团-W	2,184,089.66	9.46
3	00960	龙湖集团	2,169,165.10	9.40
4	00992	联想集团	1,779,782.60	7.71
5	002475	立讯精密	1,609,400.00	6.97
6	09626	哔哩哔哩-W	1,570,145.33	6.80
7	00700	腾讯控股	1,384,617.39	6.00
8	01818	招金矿业	1,263,733.46	5.48
9	00981	中芯国际	1,244,757.03	5.39
10	03800	协鑫科技	1,160,885.76	5.03
11	00268	金蝶国际	1,000,073.12	4.33
12	000625	长安汽车	968,100.00	4.19
13	00696	中国民航信息网络	925,647.44	4.01
14	601801	皖新传媒	867,118.00	3.76
15	03690	美团-W	859,566.81	3.72
16	688256	寒武纪	834,049.99	3.61
17	688009	中国通号	827,442.54	3.58
18	600426	华鲁恒升	824,438.00	3.57
19	002938	鹏鼎控股	811,758.00	3.52
20	601857	中国石油	786,400.00	3.41
21	01766	中国中车	762,778.80	3.30
22	688279	峰昭科技	751,460.00	3.26
23	000657	中钨高新	748,197.00	3.24
24	688187	时代电气	725,650.00	3.14
25	00836	华润电力	719,320.97	3.12
26	600602	云赛智联	679,800.00	2.95
27	000983	山西焦煤	673,200.00	2.92
28	301029	怡合达	667,503.00	2.89
29	600346	恒力石化	663,028.00	2.87
30	01801	信达生物	642,539.91	2.78
31	02015	理想汽车-W	620,504.68	2.69
32	300347	泰格医药	591,600.00	2.56
33	300496	中科创达	562,106.00	2.44
34	000893	亚钾国际	561,067.00	2.43
35	603920	世运电路	558,000.00	2.42
36	01610	中粮家佳康	557,130.00	2.41
37	601118	海南橡胶	549,072.00	2.38
38	00175	吉利汽车	540,084.83	2.34
39	00694	北京首都机场股份	536,701.92	2.33

40	02013	微盟集团	531,885.62	2.30
41	000977	浪潮信息	529,232.00	2.29
42	603393	新天然气	527,478.00	2.29
43	01860	汇量科技	522,648.08	2.26
44	300699	光威复材	520,000.00	2.25
45	605111	新洁能	511,548.00	2.22
46	01896	猫眼娱乐	510,688.31	2.21
47	002245	蔚蓝锂芯	504,000.00	2.18
48	688027	国盾量子	500,376.48	2.17
49	02343	太平洋航运	499,043.42	2.16
50	603728	鸣志电器	497,638.00	2.16
51	01357	美图公司	485,851.60	2.10
52	00168	青岛啤酒股份	482,152.75	2.09
53	000768	中航西飞	480,106.00	2.08
54	603806	福斯特	472,800.00	2.05
55	01585	雅迪控股	465,439.62	2.02
56	06088	FIT HON TENG	465,427.08	2.02
57	002810	山东赫达	463,541.00	2.01

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

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

#### 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	87,398,592.44
卖出股票收入（成交）总额	68,942,590.58

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 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。通过对股指期货的投资，实现管理市场风险和改善投资组合风险收益特性的目的。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金参与国债期货投资是为了有效控制债券市场的系统性风险，本基金将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，适度运用国债期货提高投资组合运作效率。在国债期货投资过程中，基金管理人通过对宏观经济和利率市场走势的分析与判断，并充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置，谨慎进行投资，以调整债券组合的久期，降低投资组合的整体风险。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

报告期内基金投资的前十名证券除常熟银行（证券代码 601128）、光线传媒（证券代码 300251）、山东黄金（证券代码 600547）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、常熟银行（证券代码 601128）

根据 2023 年 7 月 6 日发布的相关公告，该证券发行人因违规经营被苏州银保监分局处以罚款。

根据 2023 年 12 月 26 日发布的相关公告，该证券发行人因信息披露虚假或严重误导性陈述被国家金融监督管理总局扬州监管分局处以罚款。

根据 2024 年 6 月 13 日发布的相关公告，该证券发行人因违规经营被国家金融监督管理总局宿迁监管分局处以罚款。

#### 2、光线传媒（证券代码 300251）

根据 2024 年 6 月 21 日发布的相关公告，该证券发行人因未按期申报税款被国家税务总局北京市东城区税务局和平里税务所责令改正。

#### 3、山东黄金（证券代码 600547）

根据 2023 年 12 月 12 日发布的相关公告，该证券发行人因违反安全生产行为被烟台市应急局处以罚款。

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	-
2	应收清算款	2,226,654.93
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	29.96
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,226,684.89

### 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
招商回报优选混合发起式 A	241	70,928.97	10,000,000.00	58.50%	7,093,881.68	41.50%
招商回报优选混合发起式 C	142	57,373.80	1,000,225.00	12.28%	7,146,854.29	87.72%
合计	383	65,903.29	11,000,225.00	43.58%	14,240,735.97	56.42%

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	招商回报优选混合发起式 A	5,190,468.77	30.3645%
	招商回报优选混合发起式 C	500.40	0.0061%
	合计	5,190,969.17	20.5657%

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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	招商回报优选混合发起式 A	0~10
	招商回报优选混合发起式 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	招商回报优选混合发起式 A	>100
	招商回报优选混合发起式 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	10,000,000.00	39.62	10,000,000.00	39.62	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	10,000,000.00	39.62	10,000,000.00	39.62	-

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	招商回报优选混合发起式 A	招商回报优选混合发起式 C
基金合同生效日(2024 年 3 月 19 日)基金份额总额	17,589,107.53	13,343,043.84
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	156,378.77	195,850.77
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	651,604.62	5,391,815.32
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
本报告期期末基金份额总额	17,093,881.68	8,147,079.29

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末未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，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 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，本基金托管人及其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

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	
平安证券	3	156,341,183.02	100.00%	89,371.57	100.00%	-

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	成交金额	占当期债	成交金额	占当期权

		券成交总额的比例		券回购成交总额的比例		证成交总额的比例
平安证券	-	-	15,600,000.00	100.00%	-	-

## 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	招商回报优选混合型发起式证券投资基金基金份额发售公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-01-26
2	招商回报优选混合型发起式证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告	上海证券报及基金管理人网站	2024-01-26
3	招商回报优选混合型发起式证券投资基金（A类份额）基金产品资料概要	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-01-26
4	招商回报优选混合型发起式证券投资基金托管协议	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-01-26
5	招商回报优选混合型发起式证券投资基金基金合同	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-01-26
6	招商回报优选混合型发起式证券投资基金招募说明书	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-01-26
7	招商基金管理有限公司关于养老金客户通过直销柜台认购旗下招商回报优选混合型发起式证券投资基金 A 类基金份额费率优惠的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-01-26
8	招商回报优选混合型发起式证券投资基金（C类份额）基金产品资料概要	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-01-26
9	招商回报优选混合型发起式证券投资基金基金合同生效公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-03-20
10	关于开放招商回报优选混合型发起式证券投资基金日常申购赎回及转换和定期定额投资业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-04-18
11	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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-05-18
12	关于旗下部分基金 2024 年 7 月 1 日因港股通非交易日及境外主要投资市场节假日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-06-26

13	招商回报优选混合型发起式证券投资基金（A类份额）基金产品资料概要更新	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-06-28
14	招商回报优选混合型发起式证券投资基金（C类份额）基金产品资料概要更新	上海证券报、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 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	20240319-20240630	10,000,000.00	-	-	10,000,000.00	39.62%
产品特有风险							
本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况，可能会出现集中赎回甚至巨额赎回从而引发基金净值剧烈波动，甚至引发基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。							

注：1、报告期末持有份额占比按照四舍五入方法保留至小数点后第 2 位；

2、申购份额包含申购、定期定额投资、转换转入、红利再投资或者买入等业务增加的份额，赎回份额包含赎回、转换转出或者卖出等业务减少的份额。

## § 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回报优选混合型发起式证券投资基金设立的文件；
- 3、《招商回报优选混合型发起式证券投资基金基金合同》；
- 4、《招商回报优选混合型发起式证券投资基金托管协议》；
- 5、《招商回报优选混合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：深圳市福田区深南大道 7088 号

## 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.cmfchina.com>

招商基金管理有限公司

2024 年 8 月 30 日