

【招商智远群英荟臻选 FOF7 号集合 资产管理计划】

2021 年第 3 季度资产管理报告

计划管理人：招商证券资产管理有限公司

计划托管人：中国民生银行股份有限公司

报告期间：2021 年 07 月 01 日至 2021 年 09 月 30 日



重要提示

本报告依据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》及其他有关规定制作。

本报告由管理人招商证券资产管理有限公司（以下简称“管理人”）编制，报告书中的内容由管理人招商证券资产管理有限公司负责解释。

管理人承诺以诚实守信、审慎尽责的原则管理和运用本集合计划资产，但不保证本集合计划一定盈利，也不保证最低收益。

集合资产管理计划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集合资产管理计划资产管理合同、说明书。

本报告书中的金额单位除特指外均为人民币元。

本报告期自 2021 年 07 月 01 日起至 2021 年 09 月 30 日止。

一、集合资产管理计划概况

1.1 基本资料

计划名称	招商智远群英荟臻选 FOF7 号集合资产管理计划
管理人	招商证券资产管理有限公司
托管人	中国民生银行股份有限公司
顾问（如有）	本集合计划不设投资顾问
产品代码	882607
集合计划成立日期	2018 年 06 月 28 日
集合计划成立规模（份）	36,318,584.79
集合计划期末实收资本（份）	3,650,054.06
集合计划存续期	无固定存续期限
类型	—

1.2 集合资产管理计划管理人和集合资产管理计划托管人

项目	管理人	托管人
名称	招商证券资产管理有限公司	中国民生银行股份有限公司

注册地址	深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室	北京市西城区复兴门内大街2号
办公地址	深圳市福田区福华一路111号招商证券大厦17、18楼	北京市西城区复兴门内大街2号
法定代表人	邓晓力	高迎欣
业务批准文号	证监机构字【2002】121号	中国证监会证监基金字【2004】101号

1.3 集合资产管理计划顾问（如有）

本集合计划不设投资顾问。

二、主要财务指标和集合资产管理计划净值表现

2.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期（2021年07月01日 - 2021年09月30日）
集合计划期末实收资本（份）	3,650,054.06
集合计划期末资产净值（元）	5,832,355.28
集合计划本期利润总额（元）	111,004.02
期末单位集合计划资产净值（元）	1.5979
期末单位集合计划累计资产净值（元）	1.5979
原始季度年化收益率（%）	—
集合计划本期净值增长率（%）	1.9394
集合计划累计净值增长率（%）	59.7900
期末运作杠杆=资产类合计/资产净值	1.0024
期末分级杠杆倍数=（优先级+中间级）份额/劣后级份额（选填）	—

注：财务指标计算公式：

- 1、单位集合资产管理计划资产净值= 集合计划资产净值 ÷ 集合计划份额
- 2、本期单位集合资产管理计划净值增长率=（本期第一次分红前单位集合计划资产净值 ÷ 期初单位集合计划资产净值）×（本期第二次分红前单位集合计划资产净值 ÷ 本期第一次分红后单位集合计划资产净值）×……×（期末单位集合计划资产净值 ÷ 本期最后一次分红后

单位集合计划资产净值) -1

3、单位集合资产管理计划累计净值增长率=(第一年度单位集合计划资产净值增长率+1) × (第二年度单位集合计划资产净值增长率+1) × (第三年度单位集合计划资产净值增长率+1) × …… × (上年度单位集合计划资产净值增长率+1) × (本期单位集合计划资产净值增长率+1) -1

2.2 集合计划净值表现

2.2.1 集合计划净值增长率情况

阶段	净值增长率(%) ^①	净值增长率标准差(%) ^②
本报告期	1.9394	0.7709
本集合计划成立至今	59.7900	0.9742

2.2.2 集合计划净值增长率历史走势图



三、集合资产管理计划管理人报告

3.1 业绩表现

截至 2021 年 09 月 30 日，本集合计划单位净值 1.5979 元，累计单位净值 1.5979 元，本期净值增长率为 1.9394%。

3.2 投资经理简介

[陈平] 陈平先生：招商证券资产管理有限公司组合投资部副总经理，澳大利亚新南威尔士大学金融学专业硕士，金融风险管理师 FRM，10 年以上证券从业经验。2006 年加入招商证券，历任招商证券资产管理总部产品设计经理、理财产品部投资经理、理财产品部总经理助理。该投资经理已取得基金从业资格，最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。

3.3 投资经理工作报告

2021 年三季度，新冠变种病毒蔓延、多个行业面临监管整顿、大型地产商陷债务困境，以及限电停产等不利因素，对中国经济复苏构成负面影响，三季度中国主要经济指标现疲弱迹象，经济增速略有放缓，这些也拖累 A 市场表现，上证综指和深圳成指分别下跌-0.6%和-5.6%。 预计政府将继续保持宽松的货币政策和扩张性的财政政策立场不变，以缓解经济下行风险，从而确保经济的可持续复苏。中国经济正从高速增长阶段转向高质量发展阶段，更多的资本市场结构性改革将落实，估值水平将回归合理，我们对 A 股市场的看法继续保持乐观。近期设立的北京证券交易所可以将更多家庭储蓄引入资本市场，为创新产业发展和经济复苏进一步奠定基础，同时减少企业发展对银行贷款的依赖程度。这是中国资本市场改革的重要一步，能够丰富多层次的资本市场体系。展望未来，受益于大规模的财政刺激措施和结构性改革方案的实施，中国经济已步入稳定复苏的轨道，增长动力不断增强。中国稳健的宏观经济环境为多个行业带来发展机会，包括非必需性消费品板块、可再生能源板块、周期性板块以及材料部门。我们认为，中国股市将在 2021 年四季度呈现震荡上行走势。 在整体仓位上，FOF 产品将保持较高权益仓位水平，同时配置少量相关性较低的 CTA 策略资产适度分散风险，提高整体组合风险收益比。在子基金组合构建上，本 FOF 组合采用“核心+卫星”的配置思路，核心策略方面：选择行业配置均衡、长期业绩稳定、选股有持续 Alpha 的基金进行配置。卫星策略方面：选择一定比例配置在相关的行业主题基金，关注景气度高、政策导向、竞争格局良好的行业，来获取行业 Alpha。

3.4 集合计划运作合规性声明

本报告期内，集合计划管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《证券公司监督管理条例》、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》及其他法律法规的规定，本着诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用本集合计划资产，在严格控制风险的基础上，为集合计划持有人谋求最大利益。本报告期内，本集合计划运作合法合规，未发现损害集合计划持有人利益的行为，本集合计划的投资管理、信息披露符合有关法规和计划合同的规定。

3.5 集合计划风险控制报告

本集合计划在运作过程中面临的风险主要包括：市场风险、管理风险、流动性风险等。针对集合计划管理的风险，管理人制定了一系列严密有效的风险控制制度，并建立了由风险控制委员会、证券投资决策委员会、风险管理部及各业务部门组成的风险管理体系，建立和完善对风险的事前防范、事中控制、事后稽查和监察的管理机制，各风险管理部门在各风险控制环节进行合理分工。

在本报告期内，投资权限管理、投资备选库等制度总体执行情况良好，同时通过风险指标监控和定期进行的风险状况分析，及时评估集合计划运作过程中面临的各种风险，并提醒投资主办人采取相应的风险规避措施，为投资决策提供风险分析支持，确保集合计划运作风险水平与其投资目标相一致。

四、集合资产管理计划投资组合报告

4.1 期末集合计划资产组合情况

金额单位：元

序号	项目	金额	占集合计划总资产的比例 (%)
1	权益投资	0.00	0.0000

	其中：普通股	0.00	0.0000
	存托凭证	0.00	0.00
	其他	0.00	0.00
2	基金投资	4,501,363.36	76.9939
3	固定收益投资	0.00	0.0000
	其中：债券	0.00	0.0000
	资产支持证券	0.00	0.0000
	其他	0.00	0.00
4	金融衍生品投资	0.00	0.0000
	其中：远期	0.00	0.00
	期权	0.00	0.0000
	权证	0.00	0.00
	转融通	0.00	0.00
	收益互换	0.00	0.0000
	利率互换	0.00	0.0000
	其他	0.00	0.00
5	买入返售金融资产	0.00	0.0000
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	0.00	0.0000
6	理财产品	1,265,273.31	21.6420
7	银行存款和结算备付金合计	77,159.62	1.3198
	其中：协议存款	0.00	0.0000
	定期存款	0.00	0.0000
8	其他各项资产	2,594.24	0.0444
	合计	5,846,390.53	100.0000

注：【基金投资】指公募证券投资基金；【银行理财】包括私募证券投资基金、信托计划、银行理财等；【其他各项资产】包括“存出保证金”、“应收股利”、“应收利息”、“其他应收款”、“应收申购款”、“应收证券清算款”、“待摊费用”等项目。

本期末如涉及港股，计入【权益投资-普通股】项目；

本期末如涉及优先股，计入【权益投资-其他】项目；

本期末如涉及融资融券持仓，计入“【权益投资-普通股】”、“【其他各项资产】”等项目下；

4.2 报告期末按公允价值占集合计划资产净值比例大小排序的前十名股票投资 明细

本集合计划本报告期末未持有股票。

4.3 报告期末按公允价值占集合计划资产净值比例大小排序的前十名基金投资 明细

序号	基金代码	基金名称	数量(份)	公允价值(元)	占集合计划资产净值比例 (%)
1	001856	易方达环保主题灵活配置混合	112,089.55	459,230.89	7.8738
2	001736	圆信永丰优加生活股票	109,541.38	365,758.67	6.2712
3	161903	万家优选	147,825.56	296,996.33	5.0922
4	001717	工银瑞信前沿医疗股票A	61,738.29	294,368.17	5.0472
5	519133	海富通改革驱动灵活配置混合	104,481.26	285,756.25	4.8995
6	007593	鹏扬中证500质量成长指数A	149,772.32	272,855.21	4.6783
7	001714	工银瑞信文体产业股票A	79,945.98	271,896.28	4.6619
8	000362	国泰聚信价值优势灵活配置混合A	94,275.59	271,230.87	4.6505
9	502000	500增强	140,474.85	257,181.36	4.4096
10	001410	信达澳银新能源产业股票	49,731.45	251,491.94	4.3120

4.4 报告期末按公允价值占集合计划资产净值比例大小排名的前五名债券投资 明细

本集合计划本报告期末未持有债券。

4.5 报告期末按公允价值占集合计划资产净值比例大小排名的前十名资产支持 证券投资明细

本集合计划本报告期末未持有资产支持证券。

4.6 报告期末按公允价值占集合计划资产净值比例大小排名的前五名权证投资

明细

本集合计划本报告期末未持有权证。

4.7 报告期末本集合计划投资的期货持仓和损益明细

本集合计划本报告期末未持有期货。

4.8 期末持仓管理人所设立的其他集合资产管理计划的情况

本集合计划本报告期末未持有集合资产管理计划。

4.9 报告期末按公允价值占集合计划资产净值比例大小排名的前十名理财产品投资明细

序号	代码	名称	数量(份)	公允价值(元)	占集合计划资产净值比例(%)
1	SGZ596	凡二经典 CTA-8号	803,858. 52	1,265,273.31	21.6940

4.10 报告期末本集合计划参与转融通证券出借业务的证券

本集合计划本报告期末未参与转融通证券出借业务。

4.11 投资经理期末兼任的产品情况

姓名	产品类型	产品数量(只)	资产净值(元)	任职时间
陈平	公募基金(含对标公募基金合同变更生效的集合资产管理计划)	0	0	
	私募资产管理计划	14	966392096.59	20180628
	其他组合	0	0	
	合计	0	0	

五、集合资产管理计划份额变动情况

报告期期初集合计划份额总额	3,650,054.06
报告期期间集合计划总申购份额	0.00
报告期期间集合计划红利再投资份额	0.00
减:报告期期间集合计划总赎回份额	0.00

报告期期末集合计划份额总额	3,650,054.06
---------------	--------------

六、集合资产管理计划的费用、业绩报酬

项目	费用标准	计提方式/支付方式
管理费	1.0%	按日计提/按月支付
托管费	0.04%	按日计提/按月支付
业绩报酬	“在两类情况下管理人将根据份额持有期间收益率对本集合计划提取业绩报酬，一类是委托人申请退出或本集合计划终止时提取业绩报酬，称为退出提取；另一类是分红时提取高水位业绩报酬，称为高水位提取。当集合计划份额退出、终止或分红时，管理人将根据份额持有期间收益率计提业绩报酬：当集合计划份额退出、终止或分红时，管理人将提取退出份额或分红份额当期收益率超过8%以上部分的10%作为业绩报酬。”	在集合计划业绩报酬计提后5个工作日内，托管人根据管理人的指令将业绩报酬划拨给管理人。

注：费用说明详见集合计划资产管理合同中的相关约定。

七、报告期内集合资产管理计划收益分配情况（选填）

期初集合计划单位净值（元）	1.5675	
期初集合计划累计净值（元）	1.5675	
期末集合计划单位净值（元）	1.5979	
期末集合计划累计净值（元）	1.5979	
本报告期内是否进行收益分配	否	
本报告期内收益分配事项说明 (第一次)	产品代码	882607
	权益登记日	
	分红总金额（元）	
	每份额分红金额（元）	
当期集合计划累计分红总金额（元）		

当期集合计划累计每份额分
红金额（元）

八、重要事项提示

- 1、本集合计划管理人在本报告期内没有发生与本集合计划相关的诉讼事项。
- 2、本集合计划管理人办公地址发生变更。

公司地址变更为：深圳市福田区福华一路 111 号招商证券大厦 17、18 楼。

- 3、本集合计划的管理人高级管理人员没有受到任何处罚。
- 4、本集合计划本报告期投资主办变更情况（选填）。

本集合计划在本报告期内未发生投资主办变更。

- 5、本集合计划本报告期重大关联交易公告（选填）。

本集合计划在本报告期内未发生重大关联交易。

- 6、份额登记、估值与核算服务机构：招商证券股份有限公司，服务业务登记编码为 A00001。

九、备查文件目录

（一）本集合计划备查文件目录

- 1、《【招商智远群英荟臻选 FOF7 号集合资产管理计划】资产管理合同》
- 2、《【招商智远群英荟臻选 FOF7 号集合资产管理计划】说明书》
- 3、《【招商智远群英荟臻选 FOF7 号集合资产管理计划】托管协议》
- 4、集合资产管理计划管理人业务资格批件、营业执照

（二）存放地点及查阅方式

查阅地址：深圳市福田区福华一路 111 号招商证券大厦 17、18 楼

管理人指定网址：<http://amc.cmschina.com/>

管理人指定客户服务热线：95565

投资者对本报告书如有任何疑问，可咨询管理人招商证券资产管理有限公司。

招商证券资产管理有限公司



2021年10月14日

