

招商安益灵活配置混合型证券投资基金 2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：招商基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2024 年 3 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 3 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告财务资料已经审计，毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了 2023 年度无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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.....	4
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、基金净值表现及利润分配情况.....	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	8
§4 管理人报告.....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	14
§5 托管人报告.....	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	14
§6 审计报告.....	14
6.1 审计报告的基本内容.....	14
§7 年度财务报表.....	17
7.1 资产负债表.....	17
7.2 利润表.....	18
7.3 净资产变动表.....	20
7.4 报表附注.....	21
§8 投资组合报告.....	53
8.1 期末基金资产组合情况.....	53
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	53
8.3 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.....	54
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	62
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	70
8.6 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.....	70
8.7 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.....	70

8.8	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	70
8.9	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	70
8.10	本基金投资股指期货的投资政策	70
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	70
8.12	投资组合报告附注	70
§9	基金份额持有人信息	71
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	71
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	72
9.3	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	72
§10	开放式基金份额变动	72
§11	重大事件揭示	73
11.1	基金份额持有人大会决议	73
11.2	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	73
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	73
11.4	基金投资策略的改变	73
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	73
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	74
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	74
11.8	其他重大事件	75
§12	影响投资者决策的其他重要信息	77
12.1	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	78
§13	备查文件目录	78
13.1	备查文件目录	78
13.2	存放地点	78
13.3	查阅方式	78

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	招商安益灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	招商安益灵活配置混合	
基金主代码	001531	
交易代码	001531	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 7 月 17 日	
基金管理人	招商基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	487,348,607.34 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	招商安益灵活配置混合 A	招商安益灵活配置混合 C
下属分级基金的交易代码	001531	018946
报告期末下属分级基金的份 额总额	232,711,306.44 份	254,637,300.90 份

注：本基金从 2023 年 7 月 20 日起新增 C 类份额，C 类份额自 2023 年 7 月 21 日起存续。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过将基金资产在不同投资资产类别之间灵活配置，在控制下行风险的前提下为投资人获取稳健回报。
投资策略	本基金在大类资产配置过程中，注重平衡投资的收益和风险水平，以实现基金份额净值的稳定增长。具体包括：1、资产配置策略；2、个股投资策略；3、债券（不含可转换公司债）投资策略；4、可转换公司债投资策略；5、中小企业私募债的投资策略；6、资产证券化产品投资策略；7、权证投资策略；8、股指期货投资策略；9、存托凭证投资策略。
业绩比较基准	中国人民银行公布金融机构人民币一年期存款基准利率+3%（单利年化）
风险收益特征	本基金是混合型基金，在证券投资基金中属于预期风险收益水平中等的投资品种，预期收益和预期风险高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

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	中国建设银行股份有限公司
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
		王小飞
		021-60637103
		wangxiaofei.zh@ccb.com

客户服务电话	400-887-9555	021-60637228
传真	0755—83196475	021-60635778
注册地址	深圳市福田区深南大道 7088 号	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	深圳市福田区深南大道 7088 号	北京市西城区闹市口大街 1 号 院 1 号楼
邮政编码	518040	100033
法定代表人	王小青	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.cmfchina.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特 殊普通合伙）	中国北京市东长安街 1 号东方广场毕马 威大楼 8 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

单位：人民币元

1、招商安益灵活配置混合 A

3.1.1 期间数据和指标	2023 年	2022 年	2021 年
本期已实现收益	5,661,731.34	-9,358,381.02	3,627,599.59
本期利润	-6,588,177.85	-6,777,857.90	-938,532.71
加权平均基金份额本期利润	-0.0612	-0.1867	-0.0332
本期加权平均净值利润率	-4.30%	-12.96%	-1.95%
本期基金份额净值增长率	-0.77%	-15.59%	-2.44%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
期末可供分配利润	91,714,257.02	15,671,256.25	17,578,391.58
期末可供分配基金份额利润	0.3941	0.3994	0.6643
期末基金资产净值	324,425,563.46	55,115,943.16	44,038,474.39
期末基金份额净值	1.3941	1.4049	1.6643
3.1.3 累计期末指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
基金份额累计净值增长率	24.03%	24.99%	48.07%

2、招商安益灵活配置混合 C

3.1.1 期间数据和指标	2023 年 7 月 21 日-2023 年 12 月 31 日
本期已实现收益	345,864.65
本期利润	-11,741,246.83
加权平均基金份额本期利润	-0.0780
本期加权平均净值利润率	-5.47%
本期基金份额净值增长率	-2.80%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末
期末可供分配利润	104,404,897.10
期末可供分配基金份额利润	0.4100
期末基金资产净值	359,042,198.00
期末基金份额净值	1.4100
3.1.3 累计期末指标	2023 年末
基金份额累计净值增长率	-2.80%

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 2023 年 7 月 20 日起新增 C 类份额，C 类份额自 2023 年 7 月 21 日起存续，该类份额本报告期的相关数据和指标按实际存续期计算。

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

招商安益灵活配置混合 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
过去三个月	-2.50%	0.63%	1.13%	0.02%	-3.63%	0.61%
过去六个月	-3.99%	0.70%	2.27%	0.01%	-6.26%	0.69%
过去一年	-0.77%	0.74%	4.50%	0.01%	-5.27%	0.73%
过去三年	-18.28%	1.06%	13.50%	0.01%	-31.78%	1.05%
过去五年	39.96%	1.20%	22.50%	0.01%	17.46%	1.19%
自基金合同生效起至今	24.03%	1.16%	24.57%	0.01%	-0.54%	1.15%

招商安益灵活配置混合 C

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

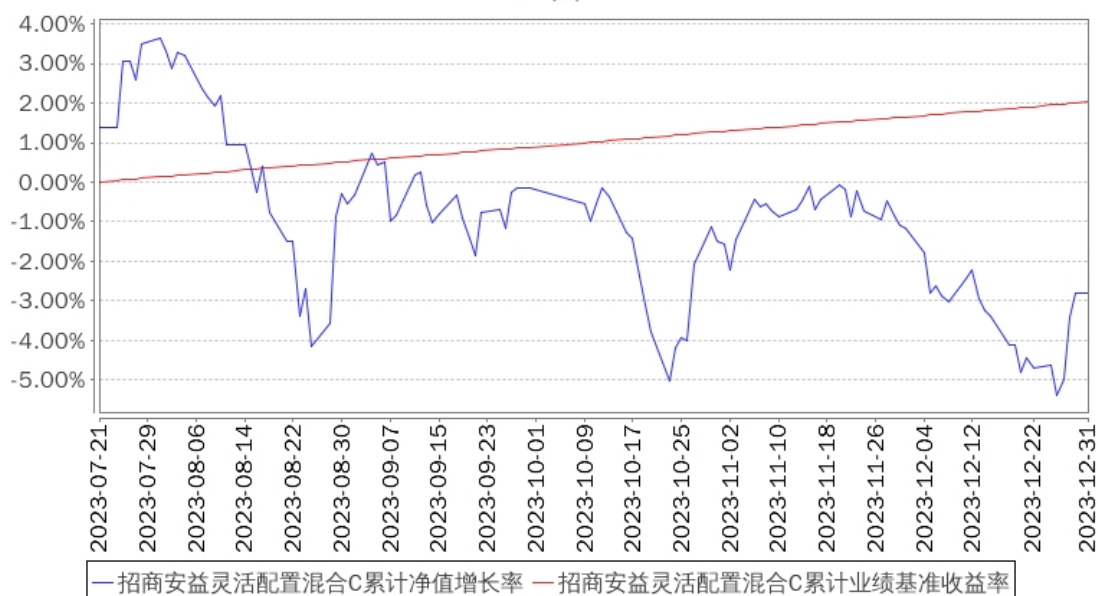
	增长率①	增长率标准差②	基准收益率③	基准收益率标准差④		
过去三个月	-2.64%	0.63%	1.13%	0.02%	-3.77%	0.61%
自基金合同生效起至今	-2.80%	0.73%	2.02%	0.01%	-4.82%	0.72%

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

招商安益灵活配置混合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



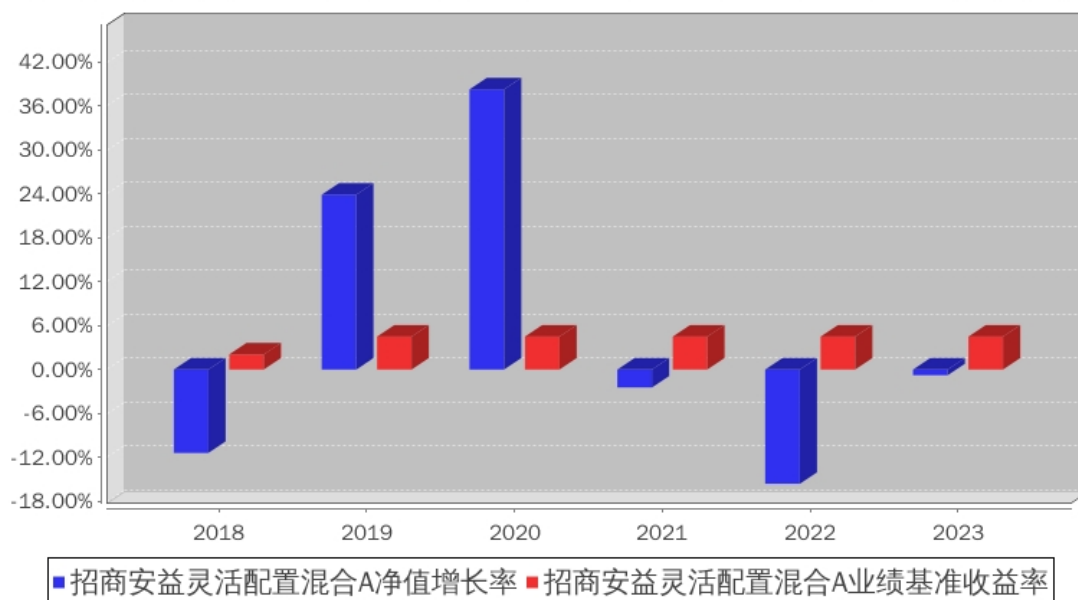
招商安益灵活配置混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



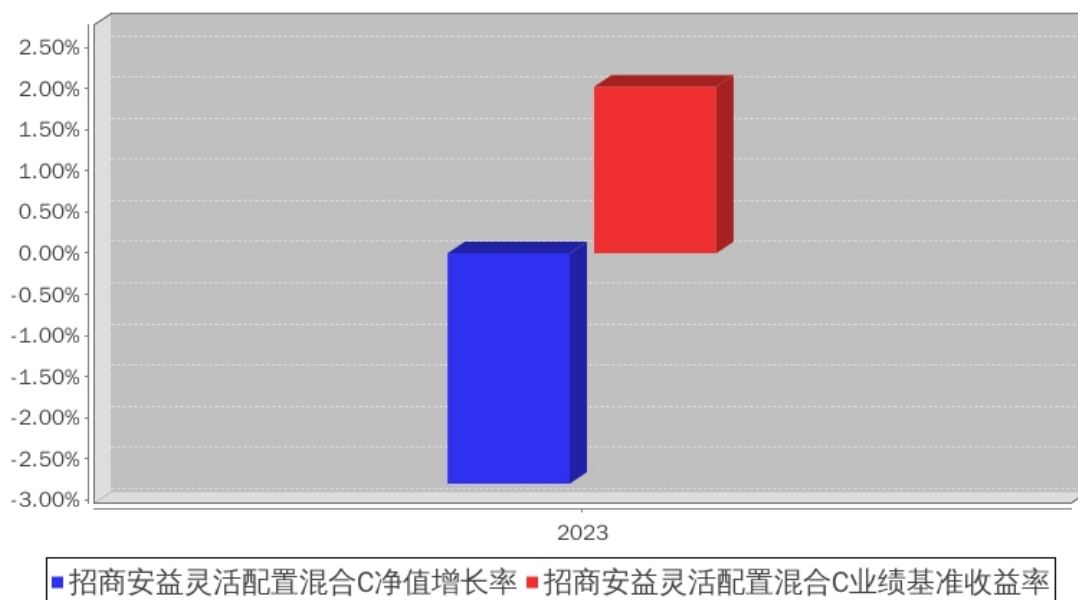
注：本基金从 2023 年 7 月 20 日起新增 C 类份额，C 类份额自 2023 年 7 月 21 日起存续，该类份额本报告期的相关数据和指标按实际存续期计算。

3.2.3 过去五年以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

招商安益灵活配置混合A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



招商安益灵活配置混合C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金从 2023 年 7 月 20 日起新增 C 类份额，C 类份额自 2023 年 7 月 21 日起存续，截至本报告期末 C 类份额存续未满 1 年，故本报告期净值增长率按当年实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

§ 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首批获得企业年金基金投资管理人资格、基本养老保险基金投资管理人资格；2004 年获得全国社保基金投资管理人资格；同时拥有合格境内机构投资者（QDII）业务资格、专户理财（特定客户资产管理业务）资格、公募基金投顾业务资格，在主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、海外投资、FOF 投资等领域全面布局。

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		
蔡宇滨	本基金基金经理	2023 年 9 月 12 日	-	14	男，硕士。2008 年 9 月至 2009 年 10 月在 IMI 工业集团工作；2009 年 11 月至 2013 年 12 月在招商证券股份有限公司工作，任研发中心研究员；2014 年 3 月至 2023 年 2 月在诺安基金管理有限公司工作，历任研究员、基金经理。2023 年 3 月加入招商基金管理有限公司，现任招商安益灵活配置混合型证券投资基金、招商品质生活混合型证券投资基金基金经理。
韩冰	本基金基金经理（已离任）	2022 年 1 月 14 日	2023 年 9 月 12 日	12	男，管理学硕士。2006 年 7 月加入上海文广新闻传媒集团任工程师，从事媒体资产管理的工作；2011 年 4 月加入平安大华基金管理有限公司，任研究员，从事 TMT 行业研究的工作；2013 年 6 月加入招商基金管理有限公司，曾任研究员、助理基金经理，招商移动互联网产业股票型证券投资基金、招商安益灵活配置混合型证券投资基金基金经理，现任招商中小盘精选混合型证券投资基金、招商专精特新股票型证券投资基金、招商北证 50 成份指数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 公平交易制度和控制方法

基金管理人根据《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》和《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》（2011年修订）的规定，制定了《招商基金管理有限公司公平交易管理办法》，对投资决策的内部控制、交易执行的内部控制、公平交易实施情况的监控与检查稽核、异常交易的监控等进行了规定。为保证各投资组合在投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会，基金管理人合理设置了各类资产管理业务之间以及各类资产管理业务内部的组织结构，建立了科学的投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 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。

4.3.3 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 28 次，其中 21 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，7 次为不同基金经理管理的基金因投资策略不同而发生的反向交易。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

回顾 2023 年，A 股市场走了一个倒“V”形，年初在 AI 技术和“中特估”主题推动下，TMT 和央国企板块都有明显的上涨。下半年由于经济复苏低于预期，上市公司业绩出现恶化，市场明显回调，而防御性较强的高分红板块则逆势走强有较好的相对收益。2023 年上证下跌 3.7%，沪深 300 下跌 11.4%，中证 500 下跌 7.4%，中证 1000 下跌 6.3%，全年受益 AI 技术的 TMT 板块和高分红的煤炭家电石油石化板块涨幅领先，而消费者服务、房地产和电力设备新能源调整幅度较大。虽然 A 股市场超过一半的股票 2023 年是上涨的，但其中一大半为市值较小的小微盘股，而投资者持有较多的蓝筹调整明显，因此 2023 年投资者整体收益仍较不如意，持仓收益进一步降低。

本基金上半年持有较多 TMT 和医药行业，下半年逐步分散至消费和周期板块，至 2023 年底，基本上 TMT、制造业、消费和周期板块基本均衡，偏向中盘价值和成长风格。最终 2023 年收益-0.77%，略微跑赢主要股票指数，但没有获得正收益。

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-0.77%，同期业绩基准增长率为 4.50%，C 类份额净值增长率为-2.80%，同期业绩基准增长率为 2.02%。

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，一方面 A 股经过了 2 年的调整和估值消化处于相对低点，另一方面 A 股市场 23 年表现弱于债券和外围股票市场，性价比相对提升，预期 2024 年表现很差的概率并不高。因此本基金保留了成长股的仓位，保持一定弹性。但市场的尾部下跌风险超出预期，市场表现偏离前期判断，实际上 24 年 1 月市场出现了大幅下行，风险偏好大幅下降，成长股估值持续下挫，导致了基金净值在年初出现了较大调整。

调整过后我们迅速复盘总结，积极寻找判断与市场表现不一致的原因。第一是对政策转向过于乐观，虽然经济增长压力增大，但政策对于刺激经济仍保持定力，短期增长目标和长期结构调整仍需权衡，实际利率维持高位，市场投资吸引力不足；第二是对风险的应对不及时，即使看到了小盘股的流动性风险，受到了雪球产品和融资盘双重冲击，但是没有及时大幅降低对中小盘股票的敞口，导致部分持仓短期下跌幅度较大。

目前 A 股市场处于风险偏好较低的位置，市场对于上市公司的未来增长给了非常低的预期和估值，而股债性价比处于较高的位置。在此情况下，我们对于股票资产未来表现会有更强的信心，同时在面对市场大幅波动，尤其是在情绪极端悲观的时候，我们也要保持理性和定力，相信公司价值的回归。没有一个冬天不会过去，没有一个春天不会到来，在越艰难的时期我们需要更多的耐心和信心。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人本着诚实信用、勤勉尽责、合法经营和保障基金持有人利益的原则，经营管理和业务运作稳健、合规，基金的投资、交易、后台等运作规范有序。基金管理人的风险管理及合规控制部门依据独立、客观、公正的原则，主要从以下几个方面进一步加强了公司内部控制和基金投资风险管理工作：

1、公司实施了员工全面培训和形式多样的专题培训，包括不定期推送监管动态和风险案例，持续整理风险点录入系统定期推送，定期或不定期组织法规考试，不定期开展各类合规主题培训等，丰富培训形式，不断提升员工合规与风控意识；

2、公司合规风控部门通过事中合规控制系统、事后投资风险管理系统、风险管理模型等对基金投资合规情况及风险情况进行严格的内部监控和管理；

3、定期稽核方面，除了每季度会对各业务领域进行一次全面的稽核，公司合规审计部门还根据监察稽核计划，对公司的关键业务部门及业务流程进行了专项稽核和检查；

4、根据法律法规的更新及业务的发展变化情况，公司各业务部门对相关内部控制制度提出修改意见和建议，并关注内部控制制度的健全性和有效性，进一步完善了公司内控制度体系，更好的防范法律风险和合规风险。

报告期内，本基金的投资运作符合国家相关法律法规、监管部门的有关规定以及公司相关制度的规定。本基金的投资目标、投资决策依据和投资管理程序均符合相关基金合同和招募说明书的约定，未发现重大异常交易、利益输送、内幕交易及其他有损基金投资者利益的

情形。报告期内，本基金若曾因市场波动、申购赎回等原因出现了相关投资比例限制被突破的情形，均在法规规定的时间内完成了调整，符合法律法规和基金合同的规定和要求。报告期内，本基金未出现因权证未行权、可转债未及时卖出或转股等有损基金份额持有人利益的投资失误行为。本基金管理人承诺将一如既往本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产，在规范经营、控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金的估值业务严格按照相关的法律法规、基金合同以及《招商基金管理有限公司基金估值委员会管理制度》进行。基金核算部负责日常的基金资产的估值业务，执行基金估值政策。另外，公司设立由投资和研究部门、风险管理部、基金核算部、法律合规部负责人和基金经理代表组成的估值委员会。公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历。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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规的规定和基金合同的约定，以及本基金的实际运作情况，本基金报告期末未进行利润分配。在符合分红条件的前提下，本基金已实现尚未分配的可供分配收益部分，将严格按照基金合同的约定适时向投资者予以分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期,中国建设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,本基金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关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	招商安益灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了后附的招商安益灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“该基金”)财务报表,包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表,2023 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为,后附的财务报表在所有重大方面

	按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称“企业会计准则”)及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制,公允反映了该基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则(以下简称“审计准则”)的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于该基金,并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	<p>该基金管理人招商基金管理有限公司(以下简称“该基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括该基金 2023 年年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作,如果我们确定其他信息存在重大错报,我们应当报告该事实。在这方面,我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>该基金管理人管理层负责按照企业会计准则及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,该基金管理人管理层负</p>

	<p>责评估该基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非该基金预计在清算时资产无法按照公允价值处置。</p> <p>该基金管理人治理层负责监督该基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2)了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3)评价该基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4)对该基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对该基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致该基金不能持续经营。</p> <p>(5)评价财务报表的总体列报(包括披露)、结</p>

	构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与该基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	吴钟鸣，刘西茜
会计师事务所的地址	中国北京市东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 楼
审计报告日期	2024 年 3 月 28 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：招商安益灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	41,658,371.96	8,353,362.51
结算备付金		9,478,298.85	635,570.26
存出保证金		79,886.40	9,810.80
交易性金融资产	7.4.7.2	461,535,029.41	46,204,594.10
其中：股票投资		461,535,029.41	46,204,594.10
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	165,065,839.66	4,963,000.00
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		-	369,217.33

应收股利		-	-
应收申购款		10,834,736.96	309.55
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		688,652,163.24	60,535,864.55
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		1,948,766.60	4,753,368.18
应付赎回款		1,785,512.48	433,912.76
应付管理人报酬		675,181.70	70,301.75
应付托管费		112,530.29	11,716.93
应付销售服务费		183,552.12	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		42.17	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	478,816.42	150,621.77
负债合计		5,184,401.78	5,419,921.39
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	487,348,607.34	39,232,480.74
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	196,119,154.12	15,883,462.42
净资产合计		683,467,761.46	55,115,943.16
负债和净资产总计		688,652,163.24	60,535,864.55

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，招商安益灵活配置混合 A 份额净值 1.3941 元，基金份额总额 232,711,306.44 份；招商安益灵活配置混合 C 份额净值 1.4100 元，基金份额总额 254,637,300.90 份；总份额合计 487,348,607.34 份。

7.2 利润表

会计主体：招商安益灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-14,022,646.14	-5,747,193.08

1.利息收入		1,201,359.57	184,842.19
其中：存款利息收入	7.4.7.9	345,691.61	49,626.88
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		855,667.96	135,215.31
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		8,955,285.84	-8,513,613.06
其中：股票投资收益	7.4.7.10	7,648,190.42	-8,906,545.96
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	110,054.87	33,057.01
资产支持证券投资	7.4.7.12	-	-
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.13	-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	1,197,040.55	359,875.89
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）	7.4.7.16	-24,337,020.67	2,580,523.12
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	157,729.12	1,054.67
减：二、营业总支出		4,306,778.54	1,030,664.82
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	3,075,762.55	780,535.57
其中：暂估管理人报酬		-	-
2.托管费	7.4.10.2.2	512,627.22	130,089.25
3.销售服务费	7.4.10.2.3	574,289.81	-
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	7.4.7.18	-	-
7.税金及附加		7.41	-
8.其他费用	7.4.7.19	144,091.55	120,040.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-18,329,424.68	-6,777,857.90
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-18,329,424.68	-6,777,857.90
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-18,329,424.68	-6,777,857.90

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。

7.3 净资产变动表

会计主体：招商安益灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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	39,232,480.74	-	15,883,462.42	55,115,943.16
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	39,232,480.74	-	15,883,462.42	55,115,943.16
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	448,116,126.60	-	180,235,691.70	628,351,818.30
（一）、综合收益总额	-	-	-18,329,424.68	-18,329,424.68
（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）	448,116,126.60	-	198,565,116.38	646,681,242.98
其中：1.基金申购款	552,799,448.26	-	241,535,436.89	794,334,885.15
2.基金赎回款	-104,683,321.66	-	-42,970,320.51	-147,653,642.17
（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	487,348,607.34	-	196,119,154.12	683,467,761.46
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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	26,460,082.81	-	17,578,391.58	44,038,474.39

加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	26,460,082.81	-	17,578,391.58	44,038,474.39
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	12,772,397.93	-	-1,694,929.16	11,077,468.77
(一)、综合收益总额	-	-	-6,777,857.90	-6,777,857.90
(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)	12,772,397.93	-	5,082,928.74	17,855,326.67
其中：1.基金申购款	16,130,704.80	-	6,593,682.75	22,724,387.55
2.基金赎回款	-3,358,306.87	-	-1,510,754.01	-4,869,060.88
(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	39,232,480.74	-	15,883,462.42	55,115,943.16

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

招商安益灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)系由招商安益保本混合型证券投资基金转型而来。根据原《招商安益保本混合型证券投资基金基金合同》的约定,2018年7月16日,本基金的第一个保本周期到期后,未能符合保本基金存续条件,自2018年7月17日起本基金转型为招商安益灵活配置混合型证券投资基金,同时,基金的投资目标、投资范围、投资策略以及基金费率等相关内容根据《招商安益保本混合型证券投资基金基金合同》的相关约定作相应修改。自2018年7月17日起,原基金合同失效,《招商安益灵活配置混合型证券投资基金合同》于同一日生效。本基金为契约型开放式基金,存续期不定。本基金的基金管理人为招商基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称“中国建设银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《招商安益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和截至报告期末最新公告的《招商安益灵活配置混合型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、地方政府债券等）、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。本基金投资于股票、存托凭证的比例为基金资产的 0%-95%，投资于权证的比例为基金资产净值的 0%-3%，本基金每个交易日日终在扣除股指期货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。股指期货的投资比例遵循国家相关法律法规。如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的业绩比较基准为：中国人民银行公布金融机构人民币一年期存款基准利率+3%（单利年化）。

7.4.2 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。

7.4.3 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 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 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。

7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(a) 金融资产的分类

本基金的金融工具包括股票投资和债券投资等。

本基金通常根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征，在初始确认时将金融资产分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以摊余成本计量的金融资产。

除非本基金改变管理金融资产的业务模式，在此情形下，所有受影响的相关金融资产在业务模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类，否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 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；

- 该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。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有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。本基金现无分类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。

管理金融资产的业务模式，是指本基金如何管理金融资产以产生现金流量。业务模式决定本基金所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本基金以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础，确定管理金融资产的业务模式。

本基金对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定时期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本基金对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

(b) 金融负债的分类

本基金将金融负债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及以摊余成本计量的金融负债。

本基金现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。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

(a) 金融工具的初始确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

(b) 后续计量

-以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失（包括利息和股利收入）计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

-以摊余成本计量的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

-以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债以公允价值进行后续计量，除与套期会计有关外，产生的利得或损失（包括利息费用）计入当期损益。

-以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

(c) 金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

-收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

-该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；

-该金融资产已转移，虽然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的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

-所转移金融资产在终止确认日的账面价值；

-因转移金融资产而收到的对价。

金融负债（或其一部分）的现时义务已经解除的，本基金终止确认该金融负债（或该部分金融负债）。

(d) 金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

-以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

预期信用损失的计量

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

在计量预期信用损失时，本基金需考虑的最长期限为面临信用风险的最长合同期限(包括考虑续约选择权)。

整个存续期预期信用损失，是指因金融工具整个预计存续期内所有可能发生的违约事件而导致的预期信用损失。

未来 12 个月内预期信用损失，是指因资产负债表日后 12 个月内(若金融工具的预计存续期少于 12 个月，则为预计存续期)可能发生的金融工具违约事件而导致的预期信用损失，是整个存续期预期信用损失的一部分。

本基金对满足下列情形的金融工具按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备，对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备：

- 该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险；或
- 该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

预期信用损失准备的列报

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化，本基金在每个资产负债表日重新计量预期信用损失，由此形成的损失准备的增加或转回金额，应当作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产，损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

核销

如果本基金不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回，则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本基金确定债务人没有资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是，被减记的金融资产仍可能受到本基金催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

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。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据企业会计准则的规定采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报

价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的,采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的,对报价进行调整,确定公允价值。与上述金融工具相同,但具有不同特征的,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,本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具,采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时,优先使用可观察输入值,只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下,才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件,参考类似金融工具的现行市价及重大变化等因素,对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 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。

7.4.4.7 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。

7.4.4.8 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)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产款在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

投资收益

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其初始计量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资，在其持有期间，按票面金额和票面利率计算的利息计入投资收益。

公允价值变动收益

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

7.4.4.10 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。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若基金份额持有人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为12次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的10%。若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配。基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

7.4.4.12 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。

7.4.4.13 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。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

编制财务报表时，本基金需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入和支出的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本基金对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

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，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《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》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

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，根据中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据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，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机构提供的预期信用损失减值计量结果。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	41,658,371.96	8,353,362.51
等于：本金	41,653,874.73	8,352,791.09
加：应计利息	4,497.23	571.42
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	41,658,371.96	8,353,362.51

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日
----	----------------------

	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	484,048,068.61	-	461,535,029.41	-22,513,039.20
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	484,048,068.61	-	461,535,029.41	-22,513,039.20
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	44,380,612.63	-	46,204,594.10	1,823,981.47
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	44,380,612.63	-	46,204,594.10	1,823,981.47

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融工具。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 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 2023 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	165,065,839.66	-
银行间市场	-	-
合计	165,065,839.66	-
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购

交易所市场	4,963,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	4,963,000.00	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	428.76	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	336,387.66	50,621.77
其中：交易所市场	336,387.66	50,621.77
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	142,000.00	100,000.00
合计	478,816.42	150,621.77

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

招商安益灵活配置混合 A		
项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	39,232,480.74	39,232,480.74
本期申购	229,666,666.63	229,666,666.63
本期赎回（以“-”号填列）	-36,187,840.93	-36,187,840.93
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	232,711,306.44	232,711,306.44

招商安益灵活配置混合 C		
项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	323,132,781.63	323,132,781.63
本期赎回（以“-”号填列）	-68,495,480.73	-68,495,480.73
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	254,637,300.90	254,637,300.90

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。

7.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

招商安益灵活配置混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	15,671,256.25	212,206.17	15,883,462.42
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	15,671,256.25	212,206.17	15,883,462.42
本期利润	5,661,731.34	-12,249,909.19	-6,588,177.85
本期基金份额交易产生的变动数	93,884,460.83	-11,465,488.38	82,418,972.45
其中：基金申购款	111,466,612.76	-13,901,962.14	97,564,650.62
基金赎回款	-17,582,151.93	2,436,473.76	-15,145,678.17
本期已分配利润	-	-	-
本期末	115,217,448.42	-23,503,191.40	91,714,257.02

招商安益灵活配置混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	345,864.65	-12,087,111.48	-11,741,246.83
本期基金份额交易产生的变动数	130,145,248.88	-13,999,104.95	116,146,143.93
其中：基金申购款	165,146,856.99	-21,176,070.72	143,970,786.27
基金赎回款	-35,001,608.11	7,176,965.77	-27,824,642.34
本期已分配利润	-	-	-
本期末	130,491,113.53	-26,086,216.43	104,404,897.10

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	110,173.49	40,809.46
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	234,896.15	8,411.73
其他	621.97	405.69
合计	345,691.61	49,626.88

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	7,648,190.42	-8,906,545.96
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	7,648,190.42	-8,906,545.96

7.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	306,404,950.22	103,265,350.76
减：卖出股票成本总额	297,608,056.21	111,869,896.50
减：交易费用	1,148,703.59	302,000.22
买卖股票差价收入	7,648,190.42	-8,906,545.96

7.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无股票赎回差价收入。

7.4.7.10.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无股票申购差价收入。

7.4.7.10.5 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无证券出借差价收入。

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
----	--	--

债券投资收益——利息收入	183,060.27	14,160.57
债券投资收益——买卖债券 (债转股及债券到期兑付) 差价收入	-73,005.40	18,896.44
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	110,054.87	33,057.01

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	34,831,876.79	1,732,557.77
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	34,670,095.99	1,670,955.02
减：应计利息总额	234,395.96	42,702.21
减：交易费用	390.24	4.10
买卖债券差价收入	-73,005.40	18,896.44

7.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无债券赎回差价收入。

7.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无债券申购差价收入。

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

7.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无买卖资产支持证券差价收入。

7.4.7.12.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券赎回差价收入。

7.4.7.12.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券申购差价收入。

7.4.7.13 贵金属投资收益

7.4.7.13.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.13.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无买卖贵金属差价收入。

7.4.7.13.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属赎回差价收入。

7.4.7.13.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属申购差价收入。

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具买卖权证差价收入。

7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具其他投资收益。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	1,197,040.55	359,875.89
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	1,197,040.55	359,875.89

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	-24,337,020.67	2,580,523.12
——股票投资	-24,337,020.67	2,611,097.75
——债券投资	-	-30,574.63
——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	-24,337,020.67	2,580,523.12

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	157,729.12	1,054.67
合计	157,729.12	1,054.67

7.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内及上年度可比期间无信用减值损失。

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
审计费用	22,000.00	20,000.00
信息披露费	120,000.00	80,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	1,731.55	1,080.00
其他	360.00	18,960.00
合计	144,091.55	120,040.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

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
中国建设银行股份有限公司	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

招商财富资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司
博时基金（国际）有限公司	基金管理人的参股经营机构

注：1、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。

2、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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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	551,078,730.99	52.97%	50,374,663.71	23.07%

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
招商证券	33,221,478.45	48.00%	-	-

7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
招商证券	2,676,437,000.00	53.79%	211,339,000.00	19.74%

7.4.10.1.4 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。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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	407,556.05	48.43%	195,126.91	58.01%
关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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	36,840.09	20.38%	8,900.24	17.58%

注：1、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、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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,075,762.55	780,535.57
其中：应支付销售机构的客户维护费	589,331.28	265,985.03
应支付基金管理人的净管理费	2,486,431.27	514,550.54
应支付投资顾问的投资顾问费	-	-

注：1、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：

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

2、根据《招商基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》，自 2023 年 7 月 10 日起本基金的管理费年费率由 1.50%调低至 1.20%。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	512,627.22	130,089.25

注：1、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：

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

2、根据《招商基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》，自 2023 年 7 月 10 日起本基金的托管费年费率由 0.25% 调低至 0.20%。

7.4.10.2.3 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	招商安益灵活配置混合 A	招商安益灵活配置混合 C	合计
招商基金管理有限公司	-	336,022.00	336,022.00
招商银行	-	359.81	359.81
招商证券	-	0.52	0.52
合计	-	336,382.33	336,382.33
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	招商安益灵活配置混合 A	招商安益灵活配置混合 C	合计
招商基金管理有限公司	-	-	-
招商银行	-	-	-
招商证券	-	-	-
合计	-	-	-

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：

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

7.4.10.3 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。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

7.4.10.5.2 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。

7.4.10.6 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
建设银行-活期	41,658,371.96	110,173.49	8,353,362.51	40,809.46

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行股份有限公司保管，按银行约定利率计息。

7.4.10.7 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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	001378	德冠新材	网下申购	2,044	64,753.92
招商证券	688653	康希通信	网下申购	6,478	68,019.00

上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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	001323	慕思股份	网下申购	573	22,306.89

注：本表已包含托管人的关联方承销期内承销的证券。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2023 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
001239	永达股份	2023年12月4日	6个月	新股流通受限	12.05	19.92	189	2,277.45	3,764.88	-
001306	夏厦精密	2023年11月9日	6个月	新股流通受限	53.63	75.36	64	3,432.32	4,823.04	-
001326	联域股份	2023年11月1日	6个月	新股流通受限	41.18	48.64	99	4,076.82	4,815.36	-
001358	兴欣新材	2023年12月14日	6个月	新股流通受限	41.00	44.16	87	3,567.00	3,841.92	-
001378	德冠新材	2023年10月23日	6个月	新股流通受限	31.68	31.27	205	6,494.40	6,410.35	-
301251	威尔高	2023年8月30日	6个月	新股流通受限	28.88	34.59	215	6,209.20	7,436.85	-
301413	安培龙	2023年12月11日	6个月	新股流通受限	33.25	58.19	164	5,453.00	9,543.16	-
301459	丰茂股份	2023年12月6日	6个月	新股流通受限	31.90	39.84	208	6,635.20	8,286.72	-
301489	思泉新材	2023年10月16日	6个月	新股流通受限	41.66	64.11	128	5,332.48	8,206.08	-
301500	飞南资源	2023年9月13日	6个月	新股流通受限	23.97	20.89	261	6,256.17	5,452.29	-
301507	民生健康	2023年8月24日	6个月	新股流通受限	10.00	15.85	531	5,310.00	8,416.35	-
301508	中机认检	2023年11月23日	6个月	新股流通受限	16.82	26.68	419	7,047.58	11,178.92	-

		日								
301516	中远通	2023年12月1日	6个月	新股流通受限	6.87	15.51	604	4,149.48	9,368.04	-
301517	陕西华达	2023年10月9日	6个月	新股流通受限	26.87	43.69	185	4,970.95	8,082.65	-
301520	万邦医药	2023年9月18日	6个月	新股流通受限	67.88	52.74	125	8,485.00	6,592.50	-
301525	儒竞科技	2023年8月23日	6个月	新股流通受限	99.57	81.46	69	6,870.33	5,620.74	-
301526	国际复材	2023年12月19日	6个月	新股流通受限	2.66	4.45	9,723	25,863.18	43,267.35	-
301529	福赛科技	2023年8月31日	6个月	新股流通受限	36.60	37.88	140	5,124.00	5,303.20	-
301548	崇德科技	2023年9月11日	6个月	新股流通受限	66.80	58.99	75	5,010.00	4,424.25	-
301550	斯菱股份	2023年9月6日	6个月	新股流通受限	37.56	43.57	148	5,558.88	6,448.36	-
301555	惠柏新材	2023年10月24日	6个月	新股流通受限	22.88	32.44	224	5,125.12	7,266.56	-
301558	三态股份	2023年9月21日	6个月	新股流通受限	7.33	13.40	1,196	8,766.68	16,026.40	-
301559	中集环科	2023年9月26日	6个月	新股流通受限	24.22	18.24	387	9,373.14	7,058.88	-
301566	达利凯普	2023年12月22日	6个月	新股流通受限	8.90	22.14	576	5,126.40	12,752.64	-
301568	思泰克	2023年11月21日	6个月	新股流通受限	23.23	35.58	246	5,714.58	8,752.68	-

301578	辰奕智能	2023年12月21日	6个月	新股流通受限	48.94	68.32	118	5,774.92	8,061.76	-
601083	锦江航运	2023年11月28日	6个月	新股流通受限	11.25	11.07	859	9,663.75	9,509.13	-
601096	宏盛华源	2023年12月15日	6个月	新股流通受限	1.70	4.06	3,918	6,660.60	15,907.08	-
603004	鼎龙科技	2023年12月20日	6个月	新股流通受限	16.80	31.19	195	3,276.00	6,082.05	-
603075	热威股份	2023年9月1日	6个月	新股流通受限	23.10	23.31	97	2,240.70	2,261.07	-
603107	上海汽配	2023年10月25日	6个月	新股流通受限	14.23	18.19	292	4,155.16	5,311.48	-
603119	浙江荣泰	2023年7月21日	6个月	新股流通受限	15.32	23.87	80	1,225.60	1,909.60	-
603193	润本股份	2023年10月9日	6个月	新股流通受限	17.38	16.66	220	3,823.60	3,665.20	-
603231	索宝蛋白	2023年12月6日	6个月	新股流通受限	21.29	21.53	161	3,427.69	3,466.33	-
603270	金帝股份	2023年8月25日	6个月	新股流通受限	21.77	29.58	129	2,808.33	3,815.82	-
603273	天元智能	2023年10月16日	6个月	新股流通受限	9.50	18.97	178	1,691.00	3,376.66	-
603276	恒兴新材	2023年9月18日	6个月	新股流通受限	25.73	24.88	134	3,447.82	3,333.92	-
603373	安邦护卫	2023年12	6个月	新股流通受限	19.10	34.75	88	1,680.80	3,058.00	-

		月 13 日								
688549	中巨芯	2023 年 8 月 30 日	6 个月	新股流通受限	5.18	8.09	1,366	7,075.88	11,050.94	-
688573	信宇人	2023 年 8 月 9 日	6 个月	新股流通受限	23.68	28.80	228	5,399.04	6,566.40	-
688591	泰凌微	2023 年 8 月 18 日	6 个月	新股流通受限	24.98	28.02	326	8,143.48	9,134.52	-
688646	逸飞激光	2023 年 7 月 21 日	6 个月	新股流通受限	46.80	36.07	91	4,258.80	3,282.37	-
688648	中邮科技	2023 年 11 月 6 日	6 个月	新股流通受限	15.18	21.43	303	4,599.54	6,493.29	-
688652	京仪装备	2023 年 11 月 22 日	6 个月	新股流通受限	31.95	52.25	416	13,291.20	21,736.00	-
688653	康希通信	2023 年 11 月 10 日	6 个月	新股流通受限	10.50	15.99	648	6,804.00	10,361.52	-
688657	浩辰软件	2023 年 9 月 25 日	6 个月	新股流通受限	103.40	78.23	80	8,272.00	6,258.40	-
688671	碧兴物联	2023 年 8 月 2 日	6 个月	新股流通受限	36.12	34.30	152	5,490.24	5,213.60	-
688693	锆威特	2023 年 8 月 10 日	6 个月	新股流通受限	40.83	43.41	89	3,633.87	3,863.49	-
688702	盛科通信	2023 年 9 月 6 日	6 个月	新股流通受限	42.66	48.18	158	6,740.28	7,612.44	-
688716	中研股份	2023 年 9 月 13 日	6 个月	新股流通受限	29.66	36.39	233	6,910.78	8,478.87	-
688719	爱科赛博	2023 年 9 月 20 日	6 个月	新股流通受限	69.98	60.10	136	9,517.28	8,173.60	-
688720	艾森股份	2023	6 个月	新股流通	28.03	49.84	165	4,624.95	8,223.60	-

		年 11 月 29 日		受限						
7.4.12.1.2 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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

7.4.12.2 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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 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。

7.4.12.3.2 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。

7.4.12.4 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。

7.4.13 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。

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 信用风险

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

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

对于与债券投资等投资品种相关的信用风险，本基金的基金管理人通过对投资品种的信用等级评估来选择适当的投资对象，并限制单个投资品种的持有比例来管理信用风险。附注 7.4.13.2.1 至 7.4.13.2.6 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。

7.4.13.2.1 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。

7.4.13.2.2 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。

7.4.13.2.3 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。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的债券投资。

7.4.13.2.5 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。

7.4.13.2.6 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。

7.4.13.3 流动性风险

7.4.13.3.1 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交易，除附注 7.4.12 所披露的流通受限不能自由转让的基金资产外，本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。除卖出回购金融资产款外，本基金所持有的全部金融负债无固定到期日或合

约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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值或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负债的账面价值，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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	41,658,371.96	-	-	-	41,658,371.96
结算备付金	9,478,298.85	-	-	-	9,478,298.85
存出保证金	79,886.40	-	-	-	79,886.40
交易性金融资产	-	-	-	461,535,029.41	461,535,029.41
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	165,065,839.66	-	-	-	165,065,839.66
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	10,834,736.96	10,834,736.96
应收清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	216,282,396.87	-	-	472,369,766.37	688,652,163.24
负债					

应付赎回款	-	-	-	1,785,512.48	1,785,512.48
应付管理人报酬	-	-	-	675,181.70	675,181.70
应付托管费	-	-	-	112,530.29	112,530.29
应付清算款	-	-	-	1,948,766.60	1,948,766.60
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	183,552.12	183,552.12
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	42.17	42.17
其他负债	-	-	-	478,816.42	478,816.42
负债总计	-	-	-	5,184,401.78	5,184,401.78
利率敏感度缺口	216,282,396.87	-	-	467,185,364.59	683,467,761.46
上年度末 2022 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	8,353,362.51	-	-	-	8,353,362.51
结算备付金	635,570.26	-	-	-	635,570.26
存出保证金	9,810.80	-	-	-	9,810.80
交易性金融资产	-	-	-	46,204,594.10	46,204,594.10
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	4,963,000.00	-	-	-	4,963,000.00
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	309.55	309.55
应收清算款	-	-	-	369,217.33	369,217.33
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	13,961,743.57	-	-	46,574,120.98	60,535,864.55
负债					
应付赎回款	-	-	-	433,912.76	433,912.76
应付管理人报酬	-	-	-	70,301.75	70,301.75
应付托管费	-	-	-	11,716.93	11,716.93
应付清算款	-	-	-	4,753,368.18	4,753,368.18
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	150,621.77	150,621.77
负债总计	-	-	-	5,419,921.39	5,419,921.39
利率敏感度缺口	13,961,743.57	-	-	41,154,199.59	55,115,943.16

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。

7.4.13.4.1.2 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。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日		上年度末 2022 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	461,535,029.41	67.53	46,204,594.10	83.83
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	461,535,029.41	67.53	46,204,594.10	83.83

7.4.13.4.2.2 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（2023 年 12 月 31 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	1. 权益性投资的市场价格上升 5%	23,076,751.47	2,310,229.71
	2. 权益性投资的市场价格下降 5%	-23,076,751.47	-2,310,229.71

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	461,125,682.10	46,204,594.10
第二层次	-	-
第三层次	409,347.31	-
合计	461,535,029.41	46,204,594.10

7.4.14.2.2 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。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位:人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	306,866.67	306,866.67
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	102,480.64	102,480.64
其中:计入损益的利得或损失	-	102,480.64	102,480.64

计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	409,347.31	409,347.31
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	102,480.64	102,480.64
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

金额单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股票投资	409,347.31	平均价格亚式期权模型	流通受限股票预期波动率	0.1962-2.1988	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系

					关系
-	-	-	-	-	-

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.4 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。

7.4.15 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。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	461,535,029.41	67.02
	其中：股票	461,535,029.41	67.02
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	165,065,839.66	23.97
	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	51,136,670.81	7.43
8	其他资产	10,914,623.36	1.58
9	合计	688,652,163.24	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	98,700.00	0.01

B	采矿业	3,460,477.00	0.51
C	制造业	356,797,480.27	52.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,395,746.00	0.20
E	建筑业	13,179,654.00	1.93
F	批发和零售业	1,545,680.40	0.23
G	交通运输、仓储和邮政业	11,049,046.33	1.62
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	21,935,145.99	3.21
J	金融业	15,232,570.00	2.23
K	房地产业	13,160,366.00	1.93
L	租赁和商务服务业	1,552,384.00	0.23
M	科学研究和技术服务业	8,011,164.42	1.17
N	水利、环境和公共设施管理业	6,650,305.00	0.97
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	7,466,310.00	1.09
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	461,535,029.41	67.53

8.2.2 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。

8.3 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

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	002402	和而泰	1,578,900	22,562,481.00	3.30
2	002706	良信股份	1,660,400	14,661,332.00	2.15
3	002311	海大集团	291,600	13,095,756.00	1.92
4	603345	安井食品	116,600	12,197,526.00	1.78
5	603517	绝味食品	349,300	9,382,198.00	1.37
6	002415	海康威视	253,200	8,791,104.00	1.29
7	603170	宝立食品	512,500	8,666,375.00	1.27
8	603308	应流股份	581,600	8,334,328.00	1.22
9	603707	健友股份	520,100	7,801,500.00	1.14
10	002185	华天科技	898,800	7,657,776.00	1.12
11	600183	生益科技	384,200	7,034,702.00	1.03
12	002064	华峰化学	950,600	6,378,526.00	0.93
13	600176	中国巨石	643,300	6,323,639.00	0.93
14	002271	东方雨虹	317,300	6,092,160.00	0.89
15	002541	鸿路钢构	273,700	5,947,501.00	0.87

16	603588	高能环境	864,500	5,653,830.00	0.83
17	601668	中国建筑	1,160,400	5,581,524.00	0.82
18	600048	保利发展	504,900	4,998,510.00	0.73
19	000002	万科 A	467,800	4,893,188.00	0.72
20	600315	上海家化	225,500	4,776,090.00	0.70
21	002352	顺丰控股	108,800	4,395,520.00	0.64
22	688093	世华科技	239,086	4,353,756.06	0.64
23	002410	广联达	242,920	4,163,648.80	0.61
24	301498	乖宝宠物	100,500	4,000,905.00	0.59
25	603181	皇马科技	361,200	3,947,916.00	0.58
26	300012	华测检测	273,000	3,876,600.00	0.57
27	600817	宇通重工	393,700	3,779,520.00	0.55
28	301195	北路智控	92,750	3,763,795.00	0.55
29	601916	浙商银行	1,456,500	3,670,380.00	0.54
30	688357	建龙微纳	68,074	3,518,745.06	0.51
31	603187	海容冷链	223,680	3,390,988.80	0.50
32	603613	国联股份	153,400	3,376,334.00	0.49
33	300015	爱尔眼科	209,700	3,317,454.00	0.49
34	001914	招商积余	273,300	3,268,668.00	0.48
35	601233	桐昆股份	208,600	3,156,118.00	0.46
36	603989	艾华集团	145,400	3,129,008.00	0.46
37	603062	麦加芯彩	48,800	3,047,072.00	0.45
38	300454	深信服	41,200	2,978,348.00	0.44
39	002966	苏州银行	460,000	2,971,600.00	0.43
40	601166	兴业银行	183,300	2,971,293.00	0.43
41	300017	网宿科技	373,800	2,934,330.00	0.43
42	002092	中泰化学	478,700	2,920,070.00	0.43
43	688112	鼎阳科技	72,914	2,919,476.56	0.43
44	603456	九洲药业	119,100	2,883,411.00	0.42
45	601089	福元医药	159,500	2,749,780.00	0.40
46	300452	山河药辅	189,300	2,695,632.00	0.39
47	000739	普洛药业	170,900	2,630,151.00	0.38
48	002044	美年健康	432,100	2,596,921.00	0.38
49	601117	中国化学	404,400	2,571,984.00	0.38
50	002601	龙佰集团	148,700	2,547,231.00	0.37
51	000768	中航西飞	113,600	2,541,232.00	0.37
52	603993	洛阳钼业	488,600	2,540,720.00	0.37
53	300957	贝泰妮	36,900	2,515,473.00	0.37
54	603987	康德莱	259,300	2,473,722.00	0.36
55	300138	晨光生物	178,600	2,398,598.00	0.35
56	600059	古越龙山	250,100	2,325,930.00	0.34
57	301319	唯特偶	39,200	2,289,672.00	0.34
58	601678	滨化股份	538,300	2,266,243.00	0.33

59	002008	大族激光	107,900	2,235,688.00	0.33
60	300373	扬杰科技	57,600	2,113,920.00	0.31
61	603899	晨光股份	56,000	2,102,800.00	0.31
62	601975	招商南油	746,100	2,089,080.00	0.31
63	300347	泰格医药	37,900	2,083,363.00	0.30
64	603520	司太立	145,900	2,054,272.00	0.30
65	002938	鹏鼎控股	91,400	2,040,048.00	0.30
66	301080	百普赛斯	34,500	2,033,430.00	0.30
67	603113	金能科技	247,200	1,994,904.00	0.29
68	603125	常青科技	66,245	1,988,674.90	0.29
69	300408	三环集团	67,000	1,973,150.00	0.29
70	601138	工业富联	129,400	1,956,528.00	0.29
71	603811	诚意药业	187,360	1,942,923.20	0.28
72	605589	圣泉集团	85,200	1,906,776.00	0.28
73	603583	捷昌驱动	93,500	1,872,805.00	0.27
74	300986	志特新材	143,452	1,826,143.96	0.27
75	002810	山东赫达	85,887	1,819,945.53	0.27
76	300196	长海股份	166,200	1,808,256.00	0.26
77	605080	浙江自然	84,920	1,797,756.40	0.26
78	300837	浙矿股份	60,000	1,792,200.00	0.26
79	600267	海正药业	187,700	1,756,872.00	0.26
80	688190	云路股份	24,169	1,731,225.47	0.25
81	600426	华鲁恒升	61,700	1,702,303.00	0.25
82	603738	泰晶科技	102,200	1,670,970.00	0.24
83	603309	维力医疗	117,400	1,670,602.00	0.24
84	600248	陕建股份	407,700	1,638,954.00	0.24
85	000922	佳电股份	157,700	1,619,579.00	0.24
86	601702	华峰铝业	89,400	1,604,730.00	0.23
87	300482	万孚生物	52,800	1,592,976.00	0.23
88	601058	赛轮轮胎	133,100	1,563,925.00	0.23
89	300638	广和通	81,680	1,554,370.40	0.23
90	600763	通策医疗	20,300	1,551,935.00	0.23
91	601390	中国中铁	272,500	1,547,800.00	0.23
92	002643	万润股份	92,000	1,526,280.00	0.22
93	002120	韵达股份	203,100	1,515,126.00	0.22
94	002705	新宝股份	103,980	1,514,988.60	0.22
95	605166	聚合顺	151,500	1,502,880.00	0.22
96	603337	杰克股份	68,400	1,477,440.00	0.22
97	301296	新巨丰	140,600	1,448,180.00	0.21
98	002001	新和成	84,800	1,438,208.00	0.21
99	002020	京新药业	112,200	1,427,184.00	0.21
100	600309	万华化学	18,500	1,421,170.00	0.21
101	688531	日联科技	13,905	1,405,517.40	0.21

102	600837	海通证券	147,700	1,383,949.00	0.20
103	301328	维峰电子	27,900	1,365,984.00	0.20
104	002372	伟星新材	94,400	1,365,968.00	0.20
105	603877	太平鸟	79,300	1,354,444.00	0.20
106	600409	三友化工	240,700	1,321,443.00	0.19
107	603297	永新光学	13,300	1,321,355.00	0.19
108	002649	博彦科技	106,900	1,311,663.00	0.19
109	301220	亚香股份	39,600	1,308,780.00	0.19
110	001228	永泰运	40,800	1,298,256.00	0.19
111	688625	呈和科技	32,999	1,294,220.78	0.19
112	605305	中际联合	39,300	1,269,783.00	0.19
113	002959	小熊电器	24,100	1,251,513.00	0.18
114	688220	翱捷科技	17,455	1,229,530.20	0.18
115	000063	中兴通讯	46,100	1,220,728.00	0.18
116	002773	康弘药业	66,000	1,217,040.00	0.18
117	603966	法兰泰克	146,700	1,200,006.00	0.18
118	300596	利安隆	39,800	1,176,488.00	0.17
119	601601	中国太保	49,200	1,169,976.00	0.17
120	603986	兆易创新	12,300	1,136,397.00	0.17
121	601208	东材科技	90,300	1,117,914.00	0.16
122	688513	苑东生物	17,526	1,117,808.28	0.16
123	688768	容知日新	29,625	1,090,496.25	0.16
124	600079	人福医药	43,500	1,081,410.00	0.16
125	601100	恒立液压	19,400	1,060,792.00	0.16
126	002507	涪陵榨菜	73,600	1,051,744.00	0.15
127	300677	英科医疗	44,900	1,048,864.00	0.15
128	300699	光威复材	39,200	1,045,464.00	0.15
129	603209	兴通股份	63,980	1,042,234.20	0.15
130	301029	怡合达	40,100	1,033,778.00	0.15
131	002096	易普力	97,000	1,004,920.00	0.15
132	600323	瀚蓝环境	57,500	996,475.00	0.15
133	600993	马应龙	40,600	981,708.00	0.14
134	600585	海螺水泥	43,400	979,104.00	0.14
135	000683	远兴能源	166,100	975,007.00	0.14
136	000950	重药控股	196,000	974,120.00	0.14
137	605088	冠盛股份	42,200	970,600.00	0.14
138	600298	安琪酵母	27,300	960,414.00	0.14
139	001308	康冠科技	32,900	920,542.00	0.13
140	688789	宏华数科	9,035	902,686.85	0.13
141	600499	科达制造	85,100	897,805.00	0.13
142	603338	浙江鼎力	17,400	890,358.00	0.13
143	688018	乐鑫科技	8,275	851,911.25	0.12
144	603727	博迈科	67,900	850,787.00	0.12

145	688233	神工股份	23,905	843,607.45	0.12
146	603301	振德医疗	34,300	840,350.00	0.12
147	000776	广发证券	57,500	821,675.00	0.12
148	002353	杰瑞股份	28,800	809,568.00	0.12
149	601339	百隆东方	160,400	781,148.00	0.11
150	603217	元利科技	42,700	778,848.00	0.11
151	002475	立讯精密	22,600	778,570.00	0.11
152	600894	广日股份	105,300	773,955.00	0.11
153	002895	川恒股份	40,700	773,300.00	0.11
154	300327	中颖电子	33,600	766,080.00	0.11
155	002998	优彩资源	94,200	748,890.00	0.11
156	301391	卡莱特	6,400	732,672.00	0.11
157	603885	吉祥航空	58,500	702,000.00	0.10
158	600887	伊利股份	26,200	700,850.00	0.10
159	601717	郑煤机	55,300	699,545.00	0.10
160	301122	采纳股份	20,600	697,516.00	0.10
161	301373	凌玮科技	22,000	652,300.00	0.10
162	600483	福能股份	72,400	598,748.00	0.09
163	601669	中国电建	114,400	559,416.00	0.08
164	688107	安路科技	15,178	558,246.84	0.08
165	600926	杭州银行	51,800	518,518.00	0.08
166	601107	四川成渝	117,400	515,386.00	0.08
167	600566	济川药业	16,390	515,137.70	0.08
168	301269	华大九天	4,800	508,080.00	0.07
169	301367	怡和嘉业	4,100	499,175.00	0.07
170	000895	双汇发展	18,500	494,135.00	0.07
171	600461	洪城环境	53,600	489,904.00	0.07
172	688200	华峰测控	3,966	487,024.80	0.07
173	301227	森鹰窗业	17,900	484,553.00	0.07
174	300653	正海生物	16,500	478,830.00	0.07
175	000090	天健集团	103,900	477,940.00	0.07
176	600380	健康元	37,800	469,854.00	0.07
177	688085	三友医疗	23,678	461,721.00	0.07
178	002675	东诚药业	25,100	460,083.00	0.07
179	300525	博思软件	30,100	449,092.00	0.07
180	600351	亚宝药业	64,400	444,360.00	0.07
181	002375	亚厦股份	97,400	441,222.00	0.06
182	002422	科伦药业	15,000	435,750.00	0.06
183	603128	华贸物流	58,800	434,532.00	0.06
184	002073	软控股份	65,100	427,707.00	0.06
185	002463	沪电股份	19,200	424,704.00	0.06
186	601108	财通证券	53,900	418,264.00	0.06
187	688087	英科再生	17,365	418,149.20	0.06

188	603589	口子窖	9,200	416,760.00	0.06
189	300158	振东制药	60,400	407,700.00	0.06
190	688033	天宜上佳	24,118	407,594.20	0.06
191	000708	中信特钢	28,500	400,140.00	0.06
192	688550	瑞联新材	10,060	399,180.80	0.06
193	002153	石基信息	40,420	393,690.80	0.06
194	000893	亚钾国际	15,000	393,600.00	0.06
195	605337	李子园	27,200	383,248.00	0.06
196	000858	五粮液	2,700	378,837.00	0.06
197	688658	悦康药业	18,086	377,273.96	0.06
198	688777	中控技术	8,271	375,089.85	0.05
199	301272	英华特	6,900	374,808.00	0.05
200	600872	中炬高新	13,100	368,110.00	0.05
201	688401	路维光电	11,959	367,380.48	0.05
202	002156	通富微电	15,700	362,984.00	0.05
203	601318	中国平安	8,600	346,580.00	0.05
204	002409	雅克科技	6,200	345,526.00	0.05
205	688283	坤恒顺维	4,980	341,777.40	0.05
206	600584	长电科技	11,100	331,446.00	0.05
207	300036	超图软件	15,500	323,950.00	0.05
208	603713	密尔克卫	5,900	313,939.00	0.05
209	688503	聚和材料	5,758	308,628.80	0.05
210	601179	中国西电	62,400	307,632.00	0.05
211	600886	国投电力	23,300	307,094.00	0.04
212	688114	华大智造	3,525	303,220.50	0.04
213	002167	东方锆业	45,600	293,208.00	0.04
214	300037	新宙邦	6,100	288,530.00	0.04
215	603208	江山欧派	9,700	287,993.00	0.04
216	600710	苏美达	40,600	287,854.00	0.04
217	002241	歌尔股份	13,700	287,837.00	0.04
218	603806	福斯特	11,600	281,532.00	0.04
219	300863	卡倍亿	5,600	280,224.00	0.04
220	603218	日月股份	22,500	278,325.00	0.04
221	002142	宁波银行	13,800	277,518.00	0.04
222	002049	紫光国微	4,100	276,545.00	0.04
223	603816	顾家家居	7,900	276,500.00	0.04
224	301051	信濠光电	4,300	273,781.00	0.04
225	688059	华锐精密	3,403	267,850.13	0.04
226	601607	上海医药	16,000	267,680.00	0.04
227	000726	鲁泰 A	40,600	263,088.00	0.04
228	603057	紫燕食品	11,900	256,802.00	0.04
229	300121	阳谷华泰	28,700	254,856.00	0.04
230	601888	中国中免	3,000	251,070.00	0.04

231	688696	极米科技	2,214	250,137.72	0.04
232	688019	安集科技	1,515	242,036.40	0.04
233	688472	阿特斯	18,941	239,224.83	0.04
234	002129	TCL 中环	14,800	231,472.00	0.03
235	601868	中国能建	107,700	226,170.00	0.03
236	688049	炬芯科技	5,894	224,384.58	0.03
237	688581	安杰思	1,756	219,166.36	0.03
238	688139	海尔生物	5,260	213,135.20	0.03
239	688249	晶合集成	12,345	212,951.25	0.03
240	600958	东方证券	24,300	211,410.00	0.03
241	301061	匠心家居	4,200	208,950.00	0.03
242	688035	德邦科技	3,838	204,795.68	0.03
243	301087	可孚医疗	5,400	204,660.00	0.03
244	688356	键凯科技	1,869	198,861.60	0.03
245	603112	华翔股份	16,100	195,615.00	0.03
246	002384	东山精密	10,600	192,708.00	0.03
247	603855	华荣股份	9,500	189,620.00	0.03
248	600201	生物股份	17,500	188,475.00	0.03
249	605377	华旺科技	9,600	183,264.00	0.03
250	301362	民爆光电	4,600	181,056.00	0.03
251	688317	之江生物	8,483	177,973.34	0.03
252	601231	环旭电子	11,600	175,276.00	0.03
253	002939	长城证券	21,900	175,200.00	0.03
254	688668	鼎通科技	3,113	172,211.16	0.03
255	600141	兴发集团	9,100	166,075.00	0.02
256	600741	华域汽车	9,900	161,172.00	0.02
257	300496	中科创达	2,000	160,120.00	0.02
258	688103	国力股份	3,219	158,954.22	0.02
259	002517	恺英网络	14,200	158,614.00	0.02
260	600276	恒瑞医药	3,500	158,305.00	0.02
261	688702	盛科通信	3,009	152,870.89	0.02
262	688798	艾为电子	2,140	147,724.20	0.02
263	600745	闻泰科技	3,400	143,854.00	0.02
264	603296	华勤技术	1,800	143,802.00	0.02
265	688253	英诺特	5,579	139,530.79	0.02
266	688125	安达智能	3,495	137,877.75	0.02
267	688516	奥特维	1,510	136,655.00	0.02
268	300982	苏文电能	4,100	134,644.00	0.02
269	002841	视源股份	2,900	132,704.00	0.02
270	603916	苏博特	12,700	129,413.00	0.02
271	688399	硕世生物	2,313	126,197.28	0.02
272	688377	迪威尔	4,613	123,720.66	0.02
273	002993	奥海科技	3,200	121,920.00	0.02

274	688302	海创药业	2,314	120,489.98	0.02
275	600919	江苏银行	18,000	120,420.00	0.02
276	300910	瑞丰新材	2,600	119,444.00	0.02
277	300054	鼎龙股份	4,800	116,160.00	0.02
278	601377	兴业证券	19,300	113,291.00	0.02
279	002648	卫星化学	7,300	107,675.00	0.02
280	000998	隆平高科	7,000	98,700.00	0.01
281	300705	九典制药	2,900	96,367.00	0.01
282	300529	健帆生物	4,000	88,920.00	0.01
283	002138	顺络电子	3,000	81,030.00	0.01
284	603737	三棵树	1,500	71,415.00	0.01
285	002508	老板电器	3,200	69,696.00	0.01
286	002270	华明装备	4,900	69,188.00	0.01
287	601088	中国神华	2,200	68,970.00	0.01
288	688308	欧科亿	2,337	65,202.30	0.01
289	300997	欢乐家	4,500	62,865.00	0.01
290	601211	国泰君安	4,200	62,496.00	0.01
291	688269	凯立新材	1,589	58,808.89	0.01
292	002236	大华股份	2,900	53,505.00	0.01
293	300866	安克创新	600	53,160.00	0.01
294	300470	中密控股	1,400	52,920.00	0.01
295	000403	派林生物	1,900	51,756.00	0.01
296	600801	华新水泥	3,800	47,234.00	0.01
297	603699	纽威股份	3,400	47,124.00	0.01
298	600966	博汇纸业	7,000	43,470.00	0.01
299	301526	国际复材	9,723	43,267.35	0.01
300	688628	优利德	834	32,859.60	0.00
301	603871	嘉友国际	2,000	31,720.00	0.00
302	688507	索辰科技	200	27,350.00	0.00
303	688652	京仪装备	416	21,736.00	0.00
304	603486	科沃斯	500	20,720.00	0.00
305	301558	三态股份	1,196	16,026.40	0.00
306	601096	宏盛华源	3,918	15,907.08	0.00
307	301566	达利凯普	576	12,752.64	0.00
308	301508	中机认检	419	11,178.92	0.00
309	688549	中巨芯	1,366	11,050.94	0.00
310	688653	康希通信	648	10,361.52	0.00
311	301413	安培龙	164	9,543.16	0.00
312	601083	锦江航运	859	9,509.13	0.00
313	301516	中远通	604	9,368.04	0.00
314	688591	泰凌微	326	9,134.52	0.00
315	301568	思泰克	246	8,752.68	0.00
316	688716	中研股份	233	8,478.87	0.00

317	301507	民生健康	531	8,416.35	0.00
318	301459	丰茂股份	208	8,286.72	0.00
319	688720	艾森股份	165	8,223.60	0.00
320	301489	思泉新材	128	8,206.08	0.00
321	688719	爱科赛博	136	8,173.60	0.00
322	301517	陕西华达	185	8,082.65	0.00
323	301578	辰奕智能	118	8,061.76	0.00
324	301251	威尔高	215	7,436.85	0.00
325	301555	惠柏新材	224	7,266.56	0.00
326	301559	中集环科	387	7,058.88	0.00
327	301520	万邦医药	125	6,592.50	0.00
328	688573	信宇人	228	6,566.40	0.00
329	688648	中邮科技	303	6,493.29	0.00
330	301550	斯菱股份	148	6,448.36	0.00
331	001378	德冠新材	205	6,410.35	0.00
332	688657	浩辰软件	80	6,258.40	0.00
333	603004	鼎龙科技	195	6,082.05	0.00
334	301525	儒竞科技	69	5,620.74	0.00
335	301500	飞南资源	261	5,452.29	0.00
336	603107	上海汽配	292	5,311.48	0.00
337	301529	福赛科技	140	5,303.20	0.00
338	688671	碧兴物联	152	5,213.60	0.00
339	001306	夏厦精密	64	4,823.04	0.00
340	001326	联域股份	99	4,815.36	0.00
341	301548	崇德科技	75	4,424.25	0.00
342	688693	锆威特	89	3,863.49	0.00
343	001358	兴欣新材	87	3,841.92	0.00
344	603270	金帝股份	129	3,815.82	0.00
345	001239	永达股份	189	3,764.88	0.00
346	603193	润本股份	220	3,665.20	0.00
347	603231	索宝蛋白	161	3,466.33	0.00
348	603273	天元智能	178	3,376.66	0.00
349	603276	恒兴新材	134	3,333.92	0.00
350	688646	逸飞激光	91	3,282.37	0.00
351	603373	安邦护卫	88	3,058.00	0.00
352	603075	热威股份	97	2,261.07	0.00
353	603119	浙江荣泰	80	1,909.60	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	002402	和而泰	22,630,713.00	41.06
2	002706	良信股份	16,805,410.00	30.49
3	603345	安井食品	13,374,152.00	24.27
4	002311	海大集团	13,127,881.00	23.82
5	603517	绝味食品	11,963,533.00	21.71
6	603707	健友股份	10,823,642.20	19.64
7	603170	宝立食品	9,276,432.00	16.83
8	603308	应流股份	8,597,364.00	15.60
9	002415	海康威视	8,509,595.00	15.44
10	600183	生益科技	7,853,378.00	14.25
11	002185	华天科技	7,635,015.00	13.85
12	603588	高能环境	7,361,793.28	13.36
13	002271	东方雨虹	7,326,261.00	13.29
14	002064	华峰化学	6,830,084.00	12.39
15	603613	国联股份	6,692,370.95	12.14
16	600176	中国巨石	6,679,802.85	12.12
17	002541	鸿路钢构	6,399,231.00	11.61
18	002352	顺丰控股	6,276,102.00	11.39
19	002410	广联达	6,137,851.00	11.14
20	600315	上海家化	6,115,181.00	11.10
21	601668	中国建筑	5,973,789.00	10.84
22	000002	万科 A	5,901,278.00	10.71
23	600048	保利发展	5,029,363.00	9.13
24	605589	圣泉集团	4,842,643.00	8.79
25	603062	麦加芯彩	4,688,752.98	8.51
26	301498	乖宝宠物	4,430,609.00	8.04
27	688093	世华科技	4,365,321.73	7.92
28	600703	三安光电	4,241,937.00	7.70
29	603181	皇马科技	4,233,395.06	7.68
30	688356	键凯科技	4,221,002.37	7.66
31	300012	华测检测	4,073,165.00	7.39
32	603456	九洲药业	4,036,190.00	7.32
33	301195	北路智控	3,916,786.00	7.11
34	603187	海容冷链	3,866,631.00	7.02
35	300957	贝泰妮	3,845,578.00	6.98
36	603125	常青科技	3,790,950.00	6.88
37	688472	阿特斯	3,780,448.99	6.86
38	001914	招商积余	3,773,070.00	6.85
39	600817	宇通重工	3,770,189.66	6.84
40	601916	浙商银行	3,734,276.00	6.78
41	605080	浙江自然	3,544,888.20	6.43
42	688357	建龙微纳	3,471,097.73	6.30

43	300015	爱尔眼科	3,398,266.00	6.17
44	301080	百普赛斯	3,390,780.00	6.15
45	601138	工业富联	3,389,849.00	6.15
46	300454	深信服	3,367,245.00	6.11
47	600763	通策医疗	3,355,070.00	6.09
48	000768	中航西飞	3,307,410.00	6.00
49	600063	皖维高新	3,302,888.00	5.99
50	688112	鼎阳科技	3,242,603.97	5.88
51	300138	晨光生物	3,240,617.00	5.88
52	603989	艾华集团	3,151,693.40	5.72
53	002092	中泰化学	3,111,529.00	5.65
54	601089	福元医药	2,996,593.63	5.44
55	601166	兴业银行	2,913,705.00	5.29
56	603987	康德莱	2,888,990.00	5.24
57	601117	中国化学	2,886,864.00	5.24
58	002966	苏州银行	2,853,841.00	5.18
59	000739	普洛药业	2,846,986.00	5.17
60	688588	凌志软件	2,843,009.68	5.16
61	601233	桐昆股份	2,835,528.08	5.14
62	300986	志特新材	2,833,176.12	5.14
63	300017	网宿科技	2,798,533.00	5.08
64	688658	悦康药业	2,779,743.18	5.04
65	002129	TCL 中环	2,745,785.68	4.98
66	600426	华鲁恒升	2,703,151.00	4.90
67	300452	山河药辅	2,687,146.00	4.88
68	601702	华峰铝业	2,657,455.00	4.82
69	300196	长海股份	2,604,408.00	4.73
70	002044	美年健康	2,555,368.00	4.64
71	002601	龙佰集团	2,554,983.00	4.64
72	600059	古越龙山	2,491,369.00	4.52
73	002649	博彦科技	2,487,236.00	4.51
74	002008	大族激光	2,479,846.00	4.50
75	002275	桂林三金	2,455,534.02	4.46
76	002020	京新药业	2,384,756.00	4.33
77	603993	洛阳钼业	2,376,822.00	4.31
78	601678	滨化股份	2,358,758.00	4.28
79	603520	司太立	2,356,992.00	4.28
80	688503	聚和材料	2,333,809.11	4.23
81	688114	华大智造	2,316,826.93	4.20
82	300373	扬杰科技	2,296,822.00	4.17
83	601058	赛轮轮胎	2,295,597.00	4.17
84	002810	山东赫达	2,293,957.00	4.16
85	002938	鹏鼎控股	2,260,247.00	4.10

86	603877	太平鸟	2,211,903.00	4.01
87	300347	泰格医药	2,176,954.00	3.95
88	603811	诚意药业	2,171,869.00	3.94
89	601975	招商南油	2,170,053.00	3.94
90	301319	唯特偶	2,152,909.00	3.91
91	688233	神工股份	2,122,992.25	3.85
92	603738	泰晶科技	2,114,651.40	3.84
93	603899	晨光股份	2,104,728.00	3.82
94	300837	浙矿股份	2,102,810.00	3.82
95	688059	华锐精密	2,098,854.11	3.81
96	301296	新巨丰	2,084,341.76	3.78
97	603113	金能科技	2,078,806.05	3.77
98	002073	软控股份	2,061,606.00	3.74
99	002675	东诚药业	2,044,933.00	3.71
100	601177	杭齿前进	1,995,552.00	3.62
101	600566	济川药业	1,977,418.10	3.59
102	300638	广和通	1,968,493.00	3.57
103	002922	伊戈尔	1,940,417.13	3.52
104	002120	韵达股份	1,920,540.00	3.48
105	300408	三环集团	1,912,315.00	3.47
106	600266	城建发展	1,907,592.63	3.46
107	688212	澳华内镜	1,906,766.36	3.46
108	600351	亚宝药业	1,887,985.00	3.43
109	002507	涪陵榨菜	1,880,860.40	3.41
110	301328	维峰电子	1,879,492.00	3.41
111	002353	杰瑞股份	1,873,702.00	3.40
112	603337	杰克股份	1,866,947.00	3.39
113	300525	博思软件	1,856,676.50	3.37
114	002049	紫光国微	1,850,167.00	3.36
115	603565	中谷物流	1,843,947.52	3.35
116	000858	五粮液	1,837,928.86	3.33
117	688531	日联科技	1,834,967.85	3.33
118	002928	华夏航空	1,834,446.00	3.33
119	600267	海正药业	1,822,702.00	3.31
120	605305	中际联合	1,819,211.00	3.30
121	688581	安杰思	1,816,664.54	3.30
122	002439	启明星辰	1,812,139.00	3.29
123	300653	正海生物	1,803,588.00	3.27
124	002705	新宝股份	1,786,274.80	3.24
125	688513	苑东生物	1,785,919.10	3.24
126	603338	浙江鼎力	1,776,768.00	3.22
127	688107	安路科技	1,769,534.66	3.21
128	603583	捷昌驱动	1,767,660.00	3.21

129	603297	永新光学	1,759,692.00	3.19
130	688125	安达智能	1,740,818.93	3.16
131	688190	云路股份	1,719,540.85	3.12
132	000063	中兴通讯	1,718,733.00	3.12
133	000651	格力电器	1,714,421.00	3.11
134	002643	万润股份	1,714,393.00	3.11
135	600248	陕建股份	1,702,913.00	3.09
136	688236	春立医疗	1,698,874.87	3.08
137	603727	博迈科	1,697,172.00	3.08
138	002773	康弘药业	1,685,689.00	3.06
139	000683	远兴能源	1,664,216.00	3.02
140	000922	佳电股份	1,645,848.00	2.99
141	301061	匠心家居	1,640,650.00	2.98
142	600993	马应龙	1,630,610.00	2.96
143	601339	百隆东方	1,617,850.00	2.94
144	600872	中炬高新	1,611,508.25	2.92
145	300482	万孚生物	1,605,030.00	2.91
146	603309	维力医疗	1,586,395.00	2.88
147	002372	伟星新材	1,564,374.00	2.84
148	300009	安科生物	1,539,227.00	2.79
149	300699	光威复材	1,535,074.60	2.79
150	601390	中国中铁	1,533,031.00	2.78
151	600603	广汇物流	1,528,037.00	2.77
152	603209	兴通股份	1,519,060.00	2.76
153	688680	海优新材	1,513,212.72	2.75
154	301383	天键股份	1,486,208.00	2.70
155	001228	永泰运	1,484,797.00	2.69
156	002959	小熊电器	1,483,653.00	2.69
157	600309	万华化学	1,479,946.00	2.69
158	688018	乐鑫科技	1,463,576.18	2.66
159	600837	海通证券	1,459,075.00	2.65
160	600298	安琪酵母	1,445,133.00	2.62
161	002096	易普力	1,444,869.00	2.62
162	603966	法兰泰克	1,413,419.48	2.56
163	002255	海陆重工	1,405,387.00	2.55
164	605166	聚合顺	1,404,315.00	2.55
165	688516	奥特维	1,402,715.49	2.55
166	603681	永冠新材	1,400,610.00	2.54
167	688220	翱捷科技	1,390,640.20	2.52
168	600409	三友化工	1,374,703.00	2.49
169	002375	亚厦股份	1,370,631.00	2.49
170	301220	亚香股份	1,361,021.00	2.47
171	603369	今世缘	1,351,364.00	2.45

172	002001	新和成	1,346,166.00	2.44
173	688035	德邦科技	1,317,480.58	2.39
174	688029	南微医学	1,310,772.86	2.38
175	688768	容知日新	1,291,525.94	2.34
176	603217	元利科技	1,290,026.00	2.34
177	601601	中国太保	1,288,917.00	2.34
178	300101	振芯科技	1,284,737.00	2.33
179	600079	人福医药	1,280,596.00	2.32
180	688123	聚辰股份	1,256,117.15	2.28
181	601208	东材科技	1,238,100.00	2.25
182	001301	尚太科技	1,237,670.00	2.25
183	300596	利安隆	1,227,136.00	2.23
184	002179	中航光电	1,218,948.00	2.21
185	603057	紫燕食品	1,218,473.00	2.21
186	688625	呈和科技	1,211,755.73	2.20
187	301029	怡合达	1,211,007.00	2.20
188	300677	英科医疗	1,208,295.00	2.19
189	688033	天宜上佳	1,196,688.04	2.17
190	002929	润建股份	1,179,993.00	2.14
191	688085	三友医疗	1,177,085.26	2.14
192	603885	吉祥航空	1,159,026.00	2.10
193	603612	索通发展	1,153,734.00	2.09
194	603380	易德龙	1,151,958.00	2.09
195	000950	重药控股	1,149,033.00	2.08
196	603986	兆易创新	1,148,549.69	2.08
197	600050	中国联通	1,143,975.00	2.08
198	300791	仙乐健康	1,124,413.00	2.04
199	688005	容百科技	1,103,984.69	2.00

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。

8.4.2 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	603707	健友股份	4,963,878.00	9.01
2	688356	键凯科技	4,559,841.10	8.27
3	600132	重庆啤酒	4,096,357.00	7.43
4	600809	山西汾酒	4,093,018.00	7.43
5	002179	中航光电	3,872,257.16	7.03

6	600703	三安光电	3,850,554.00	6.99
7	605589	圣泉集团	3,748,045.00	6.80
8	688472	阿特斯	3,368,438.64	6.11
9	601888	中国中免	2,930,066.00	5.32
10	600063	皖维高新	2,847,557.00	5.17
11	688658	悦康药业	2,803,357.69	5.09
12	688777	中控技术	2,795,986.48	5.07
13	300347	泰格医药	2,783,257.00	5.05
14	000568	泸州老窖	2,645,863.00	4.80
15	688588	凌志软件	2,570,623.54	4.66
16	688114	华大智造	2,436,207.80	4.42
17	600378	昊华科技	2,356,616.00	4.28
18	002275	桂林三金	2,334,535.94	4.24
19	688677	海泰新光	2,326,157.63	4.22
20	688244	永信至诚	2,305,878.34	4.18
21	600872	中炬高新	2,268,155.00	4.12
22	600183	生益科技	2,195,376.00	3.98
23	002049	紫光国微	2,184,139.40	3.96
24	603125	常青科技	2,151,866.00	3.90
25	002922	伊戈尔	2,136,039.00	3.88
26	688212	澳华内镜	2,001,904.20	3.63
27	002675	东诚药业	1,986,791.00	3.60
28	603062	麦加芯彩	1,966,014.74	3.57
29	600426	华鲁恒升	1,954,335.00	3.55
30	300101	振芯科技	1,954,091.00	3.55
31	002371	北方华创	1,898,253.00	3.44
32	000576	甘化科工	1,894,681.00	3.44
33	600566	济川药业	1,861,164.00	3.38
34	601138	工业富联	1,848,192.38	3.35
35	601702	华峰铝业	1,842,187.00	3.34
36	601177	杭齿前进	1,836,156.00	3.33
37	688503	聚和材料	1,825,363.60	3.31
38	002439	启明星辰	1,792,952.39	3.25
39	301061	匠心家居	1,788,074.00	3.24
40	601988	中国银行	1,783,630.00	3.24
41	688236	春立医疗	1,772,477.62	3.22
42	688581	安杰思	1,748,510.44	3.17
43	002352	顺丰控股	1,745,419.00	3.17
44	688059	华锐精密	1,738,345.88	3.15
45	002073	软控股份	1,693,132.00	3.07
46	002928	华夏航空	1,673,703.00	3.04
47	603565	中谷物流	1,646,322.00	2.99
48	600266	城建发展	1,638,280.22	2.97

49	301383	天键股份	1,622,797.00	2.94
50	600351	亚宝药业	1,590,843.00	2.89
51	603613	国联股份	1,564,625.00	2.84
52	002129	TCL 中环	1,564,548.00	2.84
53	688107	安路科技	1,558,387.39	2.83
54	301080	百普赛斯	1,519,691.00	2.76
55	000651	格力电器	1,515,075.00	2.75
56	600050	中国联通	1,491,732.00	2.71
57	600763	通策医疗	1,485,754.00	2.70
58	300791	仙乐健康	1,481,612.00	2.69
59	300009	安科生物	1,481,066.53	2.69
60	002517	恺英网络	1,475,805.00	2.68
61	603681	永冠新材	1,430,963.00	2.60
62	600603	广汇物流	1,419,384.00	2.58
63	688175	高凌信息	1,412,454.01	2.56
64	688680	海优新材	1,376,406.74	2.50
65	300253	卫宁健康	1,343,555.00	2.44
66	688125	安达智能	1,316,394.98	2.39
67	603369	今世缘	1,297,454.00	2.35
68	002929	润建股份	1,292,414.00	2.34
69	000858	五粮液	1,288,513.00	2.34
70	002255	海陆重工	1,280,785.00	2.32
71	688029	南微医学	1,268,638.79	2.30
72	688516	奥特维	1,261,881.60	2.29
73	688123	聚辰股份	1,244,858.91	2.26
74	000799	酒鬼酒	1,241,754.00	2.25
75	603380	易德龙	1,231,373.00	2.23
76	001301	尚太科技	1,207,720.42	2.19
77	688005	容百科技	1,180,619.30	2.14
78	300653	正海生物	1,171,483.00	2.13
79	300525	博思软件	1,157,172.00	2.10
80	002353	杰瑞股份	1,150,159.00	2.09
81	688311	盟升电子	1,149,211.34	2.09
82	603612	索通发展	1,144,092.00	2.08
83	300672	国科微	1,141,945.00	2.07
84	002020	京新药业	1,139,235.00	2.07
85	301117	佳缘科技	1,124,892.70	2.04
86	600197	伊力特	1,106,959.00	2.01
87	300180	华峰超纤	1,106,539.00	2.01
88	605080	浙江自然	1,104,402.00	2.00

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。

8.4.3 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	737,275,512.19
卖出股票收入（成交）总额	306,404,950.22

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。

8.5 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。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 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，以管理市场风险和调节股票仓位为主要目的。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

报告期内基金投资的前十名证券除和而泰（证券代码 002402）、绝味食品（证券代码 603517）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、和而泰（证券代码 002402）

根据 2023 年 1 月 31 日发布的相关公告，该证券发行人因欠税被国家税务总局佛山市顺德区税务局大良税务分局责令改正。

2、绝味食品（证券代码 603517）

根据 2023 年 4 月 28 日发布的相关公告，该证券发行人因未及时披露公司重大事件，资金占用被湖南证监局给予警示。

根据 2023 年 8 月 18 日发布的相关公告，该证券发行人因关联交易、内部制度不完善、未及时披露公司重大事件被上海证券交易所上市公司管理一部给予警示。

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。

8.12.2

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。

8.12.3 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	79,886.40
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	10,834,736.96
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	10,914,623.36

8.12.4 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。

8.12.5 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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
招商安益灵活配置混合 A	2,991	77,803.85	190,210,095.18	81.74%	42,501,211.26	18.26%
招商安益灵活配置混合 C	38,997	6,529.66	229,160,522.11	89.99%	25,476,778.79	10.01%
合计	41,988	11,606.85	419,370,617.29	86.05%	67,977,990.05	13.95%

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）。

9.2 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	招商安益灵活配置混合 A	2,631,669.18	1.1309%
	招商安益灵活配置混合 C	292.46	0.0001%
	合计	2,631,961.64	0.5401%

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）。

9.3 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	招商安益灵活配置混合 A	0~10
	招商安益灵活配置混合 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	招商安益灵活配置混合 A	>100
	招商安益灵活配置混合 C	0
	合计	>100

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	招商安益灵活配置混合 A	招商安益灵活配置混合 C
基金合同生效日(2018年7月17日)基金份额总额	699,324,273.74	-
本报告期期初基金份额总额	39,232,480.74	-
本报告期基金总申购份额	229,666,666.63	323,132,781.63
减：报告期基金总赎回份额	36,187,840.93	68,495,480.73
本报告期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	232,711,306.44	254,637,300.90

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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

根据本基金管理人 2023 年 6 月 22 日的公告，经招商基金管理有限公司第六届董事会 2023 年第四次会议审议通过，同意钟文岳先生辞任公司常务副总经理、财务负责人职务。

根据本基金管理人 2023 年 8 月 30 日的公告，经招商基金管理有限公司第六届董事会 2023 年第五次会议审议通过，同意聘任孙明霞女士为公司副总经理。

根据本基金管理人 2023 年 9 月 28 日的公告，经招商基金管理有限公司第六届董事会 2023 年第七次会议审议通过，同意聘任董方先生为公司副总经理。

根据本基金管理人 2023 年 12 月 30 日的公告，经招商基金管理有限公司第七届董事会 2023 年第一次会议审议通过，同意聘任孙明霞女士为公司财务负责人。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门根据工作需要，任命牛环起、施伟为资产托管业务部副总经理。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金的审计事务所无变化，目前毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）已为本基金提供审计服务 6 年，本报告期应支付给毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为人民币 22,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 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。

11.6.2 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
招商证券	3	551,078,730.99	52.97%	407,556.05	48.43%	-
西部证券	1	145,020,330.12	13.94%	136,167.26	16.18%	-
广发证券	2	126,196,769.95	12.13%	118,255.46	14.05%	-
中泰证券	2	95,937,779.71	9.22%	89,347.05	10.62%	-
长江证券	2	88,576,040.49	8.51%	65,594.06	7.79%	-
江海证券	2	33,533,924.15	3.22%	24,664.07	2.93%	-

财通证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
中银国际 证券	2	-	-	-	-	-

注：基金交易佣金根据券商季度综合评分结果给与分配，券商综合评分根据研究报告质量、路演质量、联合调研质量等维度进行打分，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。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
招商证券	33,221,478.45	48.00%	2,676,437,000.00	53.79%	-	-
西部证券	-	-	1,676,889,000.00	33.70%	-	-
广发证券	14,785,200.00	21.36%	424,659,000.00	8.53%	-	-
中泰证券	19,858,311.00	28.69%	10,954,000.00	0.22%	-	-
长江证券	1,344,415.25	1.94%	55,015,000.00	1.11%	-	-
江海证券	-	-	131,723,000.00	2.65%	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际 证券	-	-	-	-	-	-

11.8 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旗下基金 2022 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	2023-01-18
2	招商安益灵活配置混合型证券投资基金 2022 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	2023-01-18
3	招商基金管理有限公司旗下基金 2022 年年度报告提示性公告	中国证券报及基金管理人网站	2023-03-30
4	招商安益灵活配置混合型证券投资基金 2022 年年度报告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会	2023-03-30

		会基金电子披露网站	
5	招商基金管理有限公司旗下基金 2023 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	2023-04-21
6	招商安益灵活配置混合型证券投资基金 2023 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	2023-04-21
7	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	2023-05-12
8	招商基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	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	2023-06-22
9	招商基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告	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	2023-07-08
10	招商安益灵活配置混合型证券投资基金托管协议（2023 年 7 月 10 日修订）	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	2023-07-10
11	招商安益灵活配置混合型证券投资基金基金合同（2023 年 7 月 10 日修订）	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	2023-07-10
12	招商安益灵活配置混合型证券投资基金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	2023-07-13
13	招商安益灵活配置混合型证券投资基金更新的招募说明书（二零二三年第一号）	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	2023-07-13
14	招商安益灵活配置混合型证券投资基金基金合同（2023 年 7 月 20 日修订）	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	2023-07-20
15	招商基金管理有限公司关于招商安益灵活配置混合型证券投资基金增加基金份额类别并修改基金合同和托管协议的公告	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	2023-07-20
16	招商安益灵活配置混合型证券投资基金更新的招募说明书（二零二三年第二号）	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	2023-07-20
17	招商基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 2 季度报告提示性公告	中国证券报及基金管理人网站	2023-07-20
18	招商安益灵活配置混合型证券投资基金托管协议（2023 年 7 月 20 日修订）	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	2023-07-20
19	招商安益灵活配置混合型证券投资基金 2023 年第 2 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	2023-07-20

20	招商安益灵活配置混合型证券投资基金（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	2023-07-20
21	招商安益灵活配置混合型证券投资基金（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	2023-07-20
22	招商基金管理有限公司关于运用自有资金投资旗下公募基金的公告	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	2023-08-21
23	招商基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	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	2023-08-30
24	招商安益灵活配置混合型证券投资基金 2023 年中期报告	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	2023-08-30
25	招商基金管理有限公司旗下基金 2023 年中期报告提示性公告	中国证券报及基金管理人网站	2023-08-30
26	招商基金管理有限公司关于终止南京途牛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	2023-09-05
27	招商基金管理有限公司关于终止凤凰金信（海口）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	2023-09-07
28	关于招商安益灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更的公告	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	2023-09-12
29	招商安益灵活配置混合型证券投资基金更新的招募说明书（二零二三年第三号）	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	2023-09-15
30	招商安益灵活配置混合型证券投资基金（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	2023-09-15
31	招商安益灵活配置混合型证券投资基金（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	2023-09-15
32	招商基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	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	2023-09-28
33	招商基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 3 季度报告提示性公告	中国证券报及基金管理人网站	2023-10-24
34	招商安益灵活配置混合型证券投资基金 2023 年第 3 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	2023-10-24
35	招商基金管理有限公司关于旗下基金投资关联	中国证券报、基金管	2023-10-24

	方承销证券的公告	理人网站及中国证监会基金电子披露网站	
36	招商基金管理有限公司关于运用自有资金投资旗下公募基金的公告	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	2023-10-30
37	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	2023-11-11
38	招商基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	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	2023-12-30

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	20230629-20230723	-	41,026,300.26	-	41,026,300.26	8.42%

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：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。

§ 13 备查文件目录

13.1 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安益灵活配置混合型证券投资基金设立的文件；
- 3、《招商安益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 4、《招商安益灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 5、《招商安益灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照。

13.2 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

13.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人招商基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-887-9555

网址：<http://www.cmfcchina.com>

招商基金管理有限公司

2024 年 3 月 29 日