

【招商资管智选科创1号集合资产管理计划】

2024年第2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：2024年04月01日至2024年06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 2024 年 04 月 01 日起至 2024 年 06 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	招商资管智选科创 1 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	880195
集合计划成立日期	2019 年 08 月 02 日
集合计划成立规模（份）	13,257,243.06
集合计划期末实收资本（份）	3,666,964.11
集合计划存续期	120 个月
类型	混合类

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南山街道听海大道 5059 号前海鸿荣源中心 A 座 2501	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	杨阳	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（2024 年 04 月 01 日 - 2024 年 06 月 30 日）
集合计划期末实收资本（份）	3,666,964.11
集合计划期末资产净值（元）	6,695,263.51
集合计划本期利润总额（元）	145,553.21
期末单位集合计划资产净值（元）	1.8258
期末单位集合计划累计资产净值（元）	1.8258
原始季度年化收益率（%）	—
集合计划本期净值增长率（%）	2.2227
集合计划累计净值增长率（%）	82.5800
期末运作杠杆=资产类合计/资产净值	1.0054
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

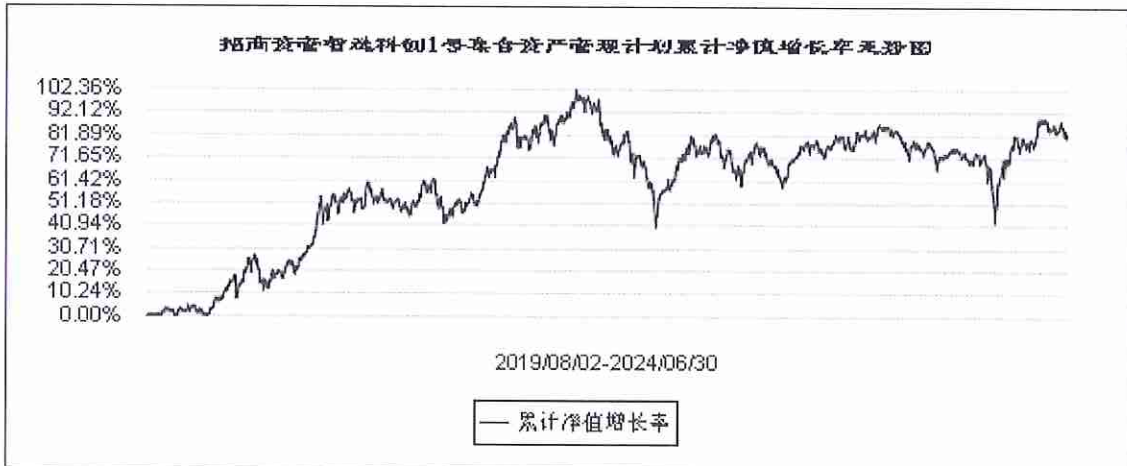
3、单位集合资产管理计划累计净值增长率=（第一年度单位集合计划资产净值增长率+1）×（第二年度单位集合计划资产净值增长率+1）×（第三年度单位集合计划资产净值增长率+1）×……×（上年度单位集合计划资产净值增长率+1）×（本期单位集合计划资产净值增长率+1）-1

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	2.2227	0.8979
本集合计划成立至今	82.5800	1.1913

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 2024 年 06 月 30 日，本集合计划单位净值 1.8258 元，累计单位净值

1.8258 元，本期净值增长率为 2.2227%。

3.2 投资经理简介

[周琦] 华中科技大学金融数学硕士，9 年以上投资研究经验，现任量化投资部投资经理，主要负责期权和套利策略投资。曾任职平安证券股份有限公司衍生品部、国信证券股份有限公司研究所，获新财富最佳分析师金融工程第一名(团队)。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

2024 年二季度产品净值增长 2.22%，同期中证 500 涨幅-6.50%，产品业绩优于中证 500 指数。回顾 2024 年上半年，受国内外经济形势、政策变化等多种因素影响，投资者情绪波动较大，市场走势较为震荡。市场板块轮动加剧，以国资央企、高股息为代表的稳健价值类资产和以 TMT 为代表的科技成长类资产出现快速轮动。从申万一级行业指数来看，涨幅居前的行业分别是银行、公用事业和电子，涨幅 5.81%、5.24%和 1.55%，涨幅居后的行业分别是综合、传媒和商贸零售，涨幅-25.66%、-20.15%和-19.26%；从市场核心指数和风格指数来看，涨幅居前的是大盘价值，涨幅 3.59%，涨幅居后的是中证 2000，涨幅-13.75%。

展望 2024 年下半年，从宏观背景角度，国内外经济形势的复杂多变，A 股市场在 2024 年下半年将继续面临多重因素的影响，包括全球经济复苏的不确定性、国内外政策环境的变化以及投资者情绪的波动等；从政策方面，预计国家将继续实施稳健的货币政策和积极的财政政策，以支持经济的稳定增长，在资本市场方面，国家也将继续深化金融改革，优化资本市场生态，提高金融服务实体经济的能力；在市场表现方面，A 股 2021 年 2 月份高位下跌以来，各大宽基指数跌幅超过-40%，调整时间接近 3 年，故我们不应该继续恐惧，应该保持信心，预计下半年将延续板块轮动和结构性行情，投资上需要重点关注政策导向和市场热点，在板块轮动和结构性行情的背景下，均衡配置将会有更多主动权。

3.4 集合计划运作合规性声明

本报告期内，本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》等法律法规及集合计划合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划资产，在规范集合计划运作和严格控制投资风险的前提下，为集合计划持有人谋求最大利益，未发现损害集合计划份额持有人利益的行为。

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、信用风险、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有效的风险管理制度，并建立了由风险管理委员会、投资决策委员会、估值委员会、风险管理部、法律合规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，管理人通过定性分析和定量分析的方法估测各种风险产生的可能损失，对各种风险进行监督、检查和评估，为投资决策提供风险分析支持。

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	5,159,890.70	76.6573
	其中：普通股	5,159,890.70	76.6573
	存托凭证	0.00	0.00
	其他	0.00	0.0000
2	基金投资	0.00	0.0000
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	0.00	0.0000
7	银行存款和结算备付金合计	1,511,958.31	22.4622
	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	59,264.29	0.8805
	合计	6,731,113.30	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

序号	股票代码	股票名称	数量(份)	公允价值(元)	占集合计划资产净值比例(%)
1	002053	云南能投	12,600.00	152,334.00	2.2753
2	000830	鲁西化工	11,600.00	134,444.00	2.0080
3	600125	铁龙物流	19,000.00	113,430.00	1.6942
4	002128	电投能源	4,800.00	101,280.00	1.5127
5	603693	江苏新能	8,000.00	92,960.00	1.3884
6	000415	渤海租赁	36,000.00	91,800.00	1.3711
7	600372	中航机载	7,600.00	90,972.00	1.3588
8	601628	中国人寿	2,900.00	90,045.00	1.3449
9	002948	青岛银行	26,500.00	89,305.00	1.3339

10	603337	杰克股份	3,100.00	81,592.00	1.2187
----	--------	------	----------	-----------	--------

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

本集合计划本报告期末未持有基金。

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

本集合计划本报告期末未持有理财产品。

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
----	------	---------	---------	------

周琦	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	2,341,501,983.79	20230801
	其他组合	0	0	
	合计	14	2,341,501,983.79	

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	3,666,964.11
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
减：报告期期间集合计划扣减份额计提业绩报酬	0.00
报告期期末集合计划份额总额	3,666,964.11

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/按季支付
托管费	0.05%	按日计提/按季支付
业绩报酬	“在两类情况下管理人将根据份额当期年化收益率对本集合计划提取业绩报酬，一类是投资者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。业绩报酬提取频率不得超过每6个月一次，因投资者退出集合计划，管理人按照合同约定提取业绩报酬的，不受前述提取频率的限制。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年化收益率超过0以上部分的20%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。管理人的业绩报酬由管理人依据《集合资产管理合同》计算并复核，托管人不承担复核义务。管理人业绩报酬由托管人根据管理人出具的业绩报酬划款指令从集合计划支付给管理人。

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）	1.7861	
期初集合计划累计净值（元）	1.7861	
期末集合计划单位净值（元）	1.8258	
期末集合计划累计净值（元）	1.8258	
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	880195
	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未发生变更。
- 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）。

产品	变更前的投资主办	变更后的投资主办	变更生效日期
招商资管智选科创1号集合资产管理计划	范万里	周琦	20240415

- 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、本报告期内关联方参与本集合计划情况（选填）。

计划名称	持有人户数 (户)	持有份额总 数(份)	占资管计划 总份额比例	持有人结构	
				机构投资者 持有份额	个人投资者 持有份额
招商资管智 选科创1号	1	969,907.41	26.45%	0.00	969,907.41

集合资产管理计划					
----------	--	--	--	--	--

7、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、《【招商资管智选科创1号集合资产管理计划】资产管理合同》
- 2、《【招商资管智选科创1号集合资产管理计划】说明书》
- 3、《【招商资管智选科创1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

2024年07月10日

