
招商资管智远增利债券型集合资产管理计划

2022年第4季度报告

2022年12月31日

基金管理人:招商证券资产管理有限公司

基金托管人:中信银行股份有限公司

报告送出日期:2023年01月20日

§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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本集合计划合同规定，于2023年1月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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集合计划的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2022年10月1日起至2022年12月31日止。

§2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 招商资管智远增利债券 |
| 基金主代码 | 880011 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2021年11月18日 |
| 报告期末基金份额总额 | 66,642,846.39份 |
| 投资目标 | 本集合计划主要投资于具有良好流动性的债券类资产及现金管理类工具，同时适时适度地参与权益类资产投资，在控制投资风险前提下，努力为委托人谋求收益，实现集合计划资产的长期稳定增值。 |
| 投资策略 | 本集合计划通过对固定收益类资产和权益类资产的合理配置实现严控风险、稳健增值的目的。本集合计划主要投资于各种债券类品种以及现金管理类金融品种，投资于股票等资产的投资比例不超过集合计划资产的20%。同 |

| | | | |
|-----------------|--|-------------|----------------|
| | 时，管理人会在分析宏观经济、政府经济政策变化及证券市场趋势的基础上，动态调整集合计划的资产配置。 具体包括：（1）债券投资策略；（2）资产支持证券投资策略；（3）股票投资策略；（4）现金管理类投资策略；（5）国债期货投资策略。 | | |
| 业绩比较基准 | 10%沪深300指数收益率+90%中债综合财富（总值）指数收益率 | | |
| 风险收益特征 | 本集合计划是债券型集合资产管理计划，预期风险和预期收益高于货币市场基金，低于股票型基金、混合型基金。 | | |
| 基金管理人 | 招商证券资产管理有限公司 | | |
| 基金托管人 | 中信银行股份有限公司 | | |
| 下属分级基金的基金简称 | 招商资管智远增利债券D | 招商资管智远增利债券A | 招商资管智远增利债券C |
| 下属分级基金的交易代码 | 880011 | 881012 | 881013 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 3,348,548.19份 | 875,712.31份 | 62,418,585.89份 |

注：本报告所述的“基金”也包括按照《证券公司大集合资产管理业务适用<关于规范金融机构资产管理业务的指导意见>操作指引》的要求进行变更后的证券公司大集合资产管理产品。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期(2022年10月01日 - 2022年12月31日) | | |
|-----------|--------------------------------|-------------|-------------|
| | 招商资管智远增利债券D | 招商资管智远增利债券A | 招商资管智远增利债券C |
| 1.本期已实现收益 | -23,200.13 | -33,688.98 | -423,959.27 |

| | | | |
|----------------|--------------|------------|---------------|
| 2.本期利润 | -29,343.33 | 981.42 | -534,768.19 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0084 | 0.0002 | -0.0086 |
| 4.期末基金资产净值 | 3,941,402.28 | 899,051.28 | 61,914,724.02 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.1770 | 1.0267 | 0.9919 |

注：（1）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；

（2）所述基金业绩指标不包括持有人认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。

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

招商资管智远增利债券D净值表现

| 阶段 | 净值增长率① | 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 | -0.76% | 0.18% | 0.19% | 0.13% | -0.95% | 0.05% |
| 过去六个月 | -1.18% | 0.15% | -0.11% | 0.11% | -1.07% | 0.04% |
| 过去一年 | -0.76% | 0.12% | 0.66% | 0.13% | -1.42% | -0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | -0.43% | 0.11% | 1.63% | 0.13% | -2.06% | -0.02% |

招商资管智远增利债券A净值表现

| 阶段 | 净值增长率① | 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 | 2.26% | 0.43% | 0.19% | 0.13% | 2.07% | 0.30% |

| | | | | | | |
|----------------|-------|-------|--------|-------|-------|-------|
| 过去六个月 | 1.83% | 0.31% | -0.11% | 0.11% | 1.94% | 0.20% |
| 过去一年 | 2.26% | 0.23% | 0.66% | 0.13% | 1.60% | 0.10% |
| 自基金合同 生效起至今 | 2.67% | 0.22% | 1.63% | 0.13% | 1.04% | 0.09% |

招商资管智远增利债券C净值表现

| 阶段 | 净值增长率① | 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 | -0.86% | 0.18% | 0.19% | 0.13% | -1.05% | 0.05% |
| 过去六个月 | -1.37% | 0.15% | -0.11% | 0.11% | -1.26% | 0.04% |
| 过去一年 | -1.17% | 0.12% | 0.66% | 0.13% | -1.83% | -0.01% |
| 自基金合同 生效起至今 | -0.81% | 0.11% | 1.63% | 0.13% | -2.44% | -0.02% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



注：按集合计划合同和招募说明书的约定，本集合计划建仓期为合同生效后6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同有关规定。



注：按集合计划合同和招募说明书的约定，本集合计划建仓期为合同生效后6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同有关规定。



注：按集合计划合同和招募说明书的约定，本集合计划建仓期为合同生效后6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同有关规定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|----|------------|-------------|------|--------|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 曾琦 | 本集合计划的基金经理 | 2021-11-18 | - | 18 | CFA，南开大学金融学硕士，18年证券从业和投资经历，现任固定收益投资部基金经理。曾任招商证券股份有限公司资产管理部产品设计经理、理财投资部投资经理。担任【招商资管智远增利债券型集合资产管理计划】基金经理（自2021年11月18日起任职）、【招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划】基 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|----------------------|
| | | | | | 金经理（自2022年4月25日起任职）。 |
|--|--|--|--|--|----------------------|

注：（1）对集合计划的首任基金经理，其“任职日期”为集合计划合同生效日，“离任日期”为根据本管理人决定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据本管理人决定确定的聘任日期和解聘日期；（2）证券从业的含义遵从《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》的相关规定。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期末，本集合计划不存在基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情形。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规及集合计划合同、集合计划招募说明书等有关集合计划法律文件的规定，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，无损害集合计划份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本集合计划管理人通过合理设立组织架构，建立科学的投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，对投资交易行为的监控、分析评估，公平对待不同投资组合。

本集合计划管理人不断完善研究方法和投资决策流程，建立投资备选库和投资授权制度，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序，不同投资组合经理之间的持仓和交易重大非公开投资信息相互隔离，实行集中交易制度，遵循公平交易的原则。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好，在研究分析、投资决策、交易执行等各个环节，公平对待旗下所有投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未发生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。

本报告期内，未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

1、投资回顾

中国12月制造业PMI为47.0，低于前值的48.0；非制造业商务活动指数为41.6，环比下降5.1个百分点；综合PMI产出指数为42.6，环比下降4.5个百分点。制造业PMI连续3个月下跌，为2022年以来的最低点。12月财新中国制造业PMI为49.0，低于11月份0.4个百分点，降至三个月来的最低。PMI均低于临界点，表明我国企业生产经营活动总体大幅放缓。新冠病毒感染疫情对于经济活动短期内的影响显著增大，市场需求继续收缩，生产活动放缓，市场价格有所回升，经济处于探底运行阶段。

政策面上，首先是疫情防控政策的转变，在二十条措施出台后，我国的疫情防控政策再次做出了新的调整，12月7日，国务院应对新型冠状病毒肺炎疫情联防联控机制综合组发布《关于进一步优化落实新冠肺炎疫情防控措施的通知》，对核酸检测、阳性感染者等防控工作进行了进一步优化，实行科学精准的十条优化措施。其次，地产政策进一步推进，人民银行、银保监会11月23日发布《关于做好当前金融支持房地产市场平稳健康发展工作的通知》，从保持房地产融资平稳有序、积极做好“保交楼”金融服务等六个方面提出16项具体措施。最后，中央经济工作会议12月15日至16日在北京举行。会议要求，2023年要坚持稳字当头、稳中求进，继续实施积极的财政政策和稳健的货币政策，加大宏观政策调控力度，加强各类政策协调配合，形成共促高质量发展合力。

四季度，资金面一度仍维持偏宽松的水平，进入11月份，资金面较前期有所收敛，月中MLF减量续做，虽然后续央行实施了全面降准，但债券市场关注的重点转到疫情防控政策放松和房地产新政带来的宽信用预期上来，加上广义理财基金赎回后被动卖出，债券市场大幅调整。随着年底央行逐步加大逆回购投放，跨年资金面逐渐宽松，债券市场也逐步企稳。整个季度来看，1年期国债收益率上行23bp至2.10%；10年期国债收益率上行8bp至2.84%；1年期国开债收益率上行34bp至2.23%；10年期国开债收益率上行6bp至2.99%。四季度，我们的债券持仓仍然以短期利率债为主。转债市场指数有所调整，转债整体估值继续缓解，我们适当增加了可转债的仓位，并对一些品种进行了波段操作。

权益市场方面，此前压制市场的部分宏观因素逐步走出不确定性，走向明朗：公共卫生防控措施逐步改善、优化直至完全放开，美联储加息最快的阶段也即将过去，A股整体震荡上行，尤其是11月后，在上述因素逐步明朗之后市场整体表现较好，但是期间行业、风格博弈剧烈。整体来看，四季度上证指数最终上涨2.14%，创业板指收涨2.53%。行业结构上，受益放开的消费、社会服务以及有政策支持的地产产业链表现较好。

2、投资展望

展望未来，随着年底央行对资金面进行呵护，债市明显企稳，市场的配置需求也逐步恢复。跨年后市场的关注点也将重回经济增长内因，政策落地和执行将成为投资中重要的考量。央行虽然表示，2023年的货币政策总量要够、结构要准，维持宽松的货币政策是手段，实现经济增长是目标，需注意央行对于这个手段拿捏的幅度。可以预计的是2023年宏观经济的主基调是疫情对经济活动的扰动将趋向结束，经济社会生活有望逐步恢复常态，各项政策效果将持续显现，宏观经济将有望总体回升。另一方面，经济的弱现实和强预期这一天平存在着左右摆动的可能，债券市场波动仍将继续。

转债市场调整后，风险大幅度释放，我们仍然倾向于持有双低转债，继续挖掘受益于经济复苏的转债，尽可能做好个券的波段操作，获取稳健收益。

权益市场来看，大势研判方面，市场已经见到中长期的底部，边际上看，此前负向扰动市场的几大宏观不确定因素2023年转向明朗甚至乐观：海外流动性（美国通胀的回落驱动美联储在2Q2023给出更为明确的流动性转向信号）、地缘冲突（俄乌战争本身进入稳态均衡后对资产价格影响逐步钝化）、疫情防控政策（已经几乎完全放开，对经济活动拖累将逐步走弱）、地产及地产政策（在中长期的规划和中短期政策支持下，地产对宏观经济的负向拖累在2023年得到有效改善）。结构上，我们仍然看好以泛新能源为代表的高景气、有产业趋势的成长行业，其中尤其看好具有绝对增速比较优势、2023年中美欧需求共振的储能行业。其次，半导体行业有望在2023年2-3季度迎来周期向上的拐点，考虑到股票市场的博弈性，我们亦逐步开始关注行业左侧布局机会。此外，我们看好安全主题下的信创、高端制造等方向。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末招商资管智远增利债券D基金份额净值为1.1770元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-0.76%，同期业绩比较基准收益率为0.19%；截至报告期末招商资管智远增利债券A基金份额净值为1.0267元，本报告期内，该类基金份额净值增长

率为2.26%，同期业绩比较基准收益率为0.19%；截至报告期末招商资管智远增利债券C基金份额净值为0.9919元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-0.86%，同期业绩比较基准收益率为0.19%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本集合计划未出现连续二十个工作日集合计划份额持有人数量不满二百人或者集合计划资产净值低于五千万元的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|---------------|---------------|
| 1 | 权益投资 | 5,968,306.05 | 8.92 |
| | 其中：股票 | 5,968,306.05 | 8.92 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 60,018,183.72 | 89.66 |
| | 其中：债券 | 60,018,183.72 | 89.66 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 941,227.22 | 1.41 |
| 8 | 其他资产 | 8,528.78 | 0.01 |
| 9 | 合计 | 66,936,245.77 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|--------------|---------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 5,217,190.00 | 7.82 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | - | - |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 751,116.05 | 1.13 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 5,968,306.05 | 8.94 |

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本集合计划本报告期末未持有港股通投资股票投资组合。

5.3 报告期末按公允价值占基金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(股) | 公允价值(元) | 占基金资产净值 |
|----|------|------|-------|---------|---------|
|----|------|------|-------|---------|---------|

| | | | | | 比例 (%) |
|----|--------|------|--------|------------|--------|
| 1 | 688156 | 路德环境 | 25,079 | 751,116.05 | 1.13 |
| 2 | 688348 | 昱能科技 | 1,000 | 568,500.00 | 0.85 |
| 3 | 300014 | 亿纬锂能 | 5,900 | 518,610.00 | 0.78 |
| 4 | 002738 | 中矿资源 | 7,500 | 499,950.00 | 0.75 |
| 5 | 301029 | 怡合达 | 7,300 | 479,902.00 | 0.72 |
| 6 | 688301 | 奕瑞科技 | 1,000 | 457,880.00 | 0.69 |
| 7 | 688598 | 金博股份 | 1,700 | 373,116.00 | 0.56 |
| 8 | 300586 | 美联新材 | 18,700 | 327,250.00 | 0.49 |
| 9 | 002709 | 天赐材料 | 7,300 | 320,178.00 | 0.48 |
| 10 | 603628 | 清源股份 | 19,900 | 305,266.00 | 0.46 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|-----------|---------------|---------------|
| 1 | 国家债券 | 24,104,445.36 | 36.11 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 12,077,745.19 | 18.09 |
| | 其中：政策性金融债 | 12,077,745.19 | 18.09 |
| 4 | 企业债券 | 3,945,552.12 | 5.91 |
| 5 | 企业短期融资券 | 10,025,829.25 | 15.02 |
| 6 | 中期票据 | 5,114,741.99 | 7.66 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 4,749,869.81 | 7.12 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 60,018,183.72 | 89.91 |

5.5 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债券投资明细

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

| | | | | | 值比例 (%) |
|---|-----------|--------------|---------|---------------|---------|
| 1 | 019674 | 22国债09 | 238,000 | 24,104,445.36 | 36.11 |
| 2 | 018008 | 国开1802 | 117,670 | 12,077,745.19 | 18.09 |
| 3 | 101661025 | 16皖交控MTN002B | 50,000 | 5,114,741.99 | 7.66 |
| 4 | 012282904 | 22乌城投SCP003 | 50,000 | 5,014,699.04 | 7.51 |
| 5 | 072210142 | 22东兴证券CP003 | 50,000 | 5,011,130.21 | 7.51 |

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

5.7 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

本集合计划本报告期末未持有贵金属。

5.8 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权证投资明细

本集合计划本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本集合计划本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本集合计划本报告期末未参与股指期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本集合计划本报告期末未参与国债期货交易。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本集合计划本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本集合计划本报告期末未参与国债期货投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本集合计划投资的前十名证券的发行主体中，在报告编制日前一年内，国家开发银行曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚，杭州银行股份有限公司曾受到中国人民银行及其派出机构的处罚，处罚力度和性质对该公司长期经营业绩未产生重大负面影响，不影响相关证券标的长期投资价值。本集合计划对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规的要求。

除上述主体外，未发现期末投资的其他前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 本集合计划投资的前十名股票，均为集合计划合同规定备选股票库之内的股票。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|----------|
| 1 | 存出保证金 | 8,498.85 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 29.93 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 8,528.78 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|--------------|--------------|
| 1 | 110079 | 杭银转债 | 1,045,842.53 | 1.57 |
| 2 | 128048 | 张行转债 | 789,085.80 | 1.18 |
| 3 | 110057 | 现代转债 | 675,036.66 | 1.01 |
| 4 | 110053 | 苏银转债 | 618,600.21 | 0.93 |

| | | | | |
|---|--------|------|------------|------|
| 5 | 128037 | 岩土转债 | 525,172.50 | 0.79 |
| 6 | 113024 | 核建转债 | 520,528.93 | 0.78 |
| 7 | 110080 | 东湖转债 | 334,401.95 | 0.50 |
| 8 | 127028 | 英特转债 | 241,201.23 | 0.36 |

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本集合计划本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

| | 招商资管智远 增利债券D | 招商资管智远 增利债券A | 招商资管智远 增利债券C |
|-------------------------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 3,922,386.56 | 10,787,652.64 | 62,418,820.68 |
| 报告期期间基金总申购份额 | - | 904,091.49 | 221.90 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 573,838.37 | 10,816,031.82 | 456.69 |
| 报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列) | - | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 3,348,548.19 | 875,712.31 | 62,418,585.89 |

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

| | 招商资管智远 增利债券D | 招商资管智远 增利债券A | 招商资管智远 增利债券C |
|----------------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 报告期期初管理人持有的本基 金份额 | - | 10,777,440.61 | - |

| | | | |
|--------------------------|---|---------------|---|
| 报告期期间买入/申购总份额 | - | - | - |
| 报告期期间卖出/赎回总份额 | - | 10,777,440.61 | - |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | - | - | - |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | - | - | - |

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

| 序号 | 交易方式 | 交易日期 | 交易份额（份） | 交易金额（元） | 适用费率 |
|----|------|------------|----------------|----------------|-------|
| 1 | 申赎 | 2022-10-26 | -3,000,000.00 | -3,014,682.30 | 0.10% |
| 2 | 申赎 | 2022-12-05 | -7,777,440.61 | -7,802,295.75 | 0.10% |
| 合计 | | | -10,777,440.61 | -10,816,978.05 | |

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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 | 2022年10月01日-2022年12月31日 | 54,817,884.49 | 0.00 | 0.00 | 54,817,884.49 | 82.26% |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| <p>报告期内，本集合计划存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况。</p> <p>报告期内，未发现本集合计划实质上存在特有风险。</p> | | | | | | | |

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1. 中国证券监督管理委员会关于准予招商证券智远增利集合资产管理计划合同变更的回函；
2. 《招商资管智远增利债券型集合资产管理计划集合资产管理合同》；
3. 《招商资管智远增利债券型集合资产管理计划托管协议》；
4. 《招商资管智远增利债券型集合资产管理计划招募说明书》；
5. 《招商资管智远增利债券型集合资产管理计划产品资料概要》；
6. 集合计划管理人业务资格批件、营业执照；
7. 中国证券监督管理委员会要求的其他文件。

9.2 存放地点

备查文件存放于集合计划管理人和集合计划托管人的办公场所，并登载于集合计划管理人互联网站<https://amc.cmschina.com/>。

9.3 查阅方式

投资者可登录集合计划管理人互联网站查阅，或在营业时间内至集合计划管理人或集合计划托管人的办公场所免费查阅。

投资者对本报告如有疑问，敬请致电或登录管理人网站了解相关情况，咨询电话：95565，公司网站：<https://amc.cmschina.com/>。

招商证券资产管理有限公司

2023年01月20日