

# 招商丰泰灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 2022 年年度报告

2022 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：中国银行股份有限公司

送出日期：2023 年 3 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年3月29日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告财务资料已经审计，毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了2022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2022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.....	5
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§3 主要财务指标、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.....	7
§4 管理人报告.....	7
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	8
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.....	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	10
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
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.....	12
§5 托管人报告.....	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	13
§6 审计报告.....	13
6.1 审计报告的基本内容.....	13
§7 年度财务报表.....	15
7.1 资产负债表.....	15
7.2 利润表.....	17
7.3 净资产（基金净值）变动表.....	18
7.4 报表附注.....	20
§8 投资组合报告.....	47
8.1 期末基金资产组合情况.....	47
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	47
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.....	48
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	49
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	51
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.....	51

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.....	52
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.....	52
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.....	52
8.10	本基金投资股指期货的投资政策.....	52
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	52
8.12	投资组合报告附注.....	52
§9	基金份额持有人信息.....	54
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	54
9.2	期末上市基金前十名持有人.....	54
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	55
9.4	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.....	55
§10	开放式基金份额变动.....	55
§11	重大事件揭示.....	55
11.1	基金份额持有人大会决议.....	55
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.....	56
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	56
11.4	基金投资策略的改变.....	56
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	56
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.....	56
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	56
11.8	其他重大事件.....	60
§12	影响投资者决策的其他重要信息.....	62
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.....	62
§13	备查文件目录.....	63
13.1	备查文件目录.....	63
13.2	存放地点.....	63
13.3	查阅方式.....	63

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	招商丰泰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)
基金简称	招商丰泰灵活配置混合 (LOF)
场内简称	招商丰泰 LOF
基金主代码	161722
交易代码	161722
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 4 月 17 日
基金管理人	招商基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	76,706,718.27 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2015 年 7 月 22 日

### 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	<p>资产配置策略：本基金的大类资产配置主要通过对宏观经济运行状况、国家财政和货币政策、国家产业政策以及资本市场资金环境、证券市场走势的分析，预测宏观经济的发展趋势，并据此评价未来一段时间股票、债券市场相对收益率，主动调整股票、债券类资产在给定区间内的动态配置，以使基金在保持总体风险水平相对稳定的基础上，优化投资组合。</p> <p>股票投资策略：本基金通过定量和定性相结合的方法进行个股自下而上的选择。</p> <p>债券投资策略：本基金采用的固定收益品种主要投资策略包括：久期策略、期限结构策略和个券选择策略等。</p> <p>权证投资策略：本基金对权证资产的投资主要是通过分析影响权证内在价值最重要的两种因素——标的资产价格以及市场隐含波动率的变化，灵活构建避险策略，波动率差策略以及套利策略。</p> <p>股指期货投资策略：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。</p> <p>中小企业私募债券投资策略：中小企业私募债具有票面利率较高、信用风险较大、二级市场流动性较差等特点。因此本基金审慎投资中小企业私募债券。</p> <p>存托凭证投资策略：在控制风险的前提下，本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。</p>
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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	潘西里
	联系电话	0755—83196666
	电子邮箱	cmf@cmfchina.com
客户服务电话	400-887-9555	95566
传真	0755—83196475	010—66594942
注册地址	深圳市福田区深南大道7088号	北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址	深圳市福田区深南大道7088号	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码	518040	100818
法定代表人	王小青	刘连舸

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.cmfchina.com">http://www.cmfchina.com</a>
基金年度报告备置地点	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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17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

3.1.1 期间数据和指标	2022 年	2021 年	2020 年
本期已实现收益	-15,461,982.49	49,306,855.01	76,626,844.66
本期利润	-28,092,693.64	39,488,581.34	91,984,004.16
加权平均基金份额本期利润	-0.1741	0.0914	0.2385

本期加权平均净值利润率	-12.51%	6.60%	19.52%
本期基金份额净值增长率	-4.94%	7.80%	21.62%
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
期末可供分配利润	28,071,744.49	193,412,722.97	211,199,013.28
期末可供分配基金份额利润	0.3660	0.4371	0.3331
期末基金资产净值	104,778,462.76	635,899,198.69	845,175,265.83
期末基金份额净值	1.366	1.437	1.333
3.1.3 累计期末指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
基金份额累计净值增长率	36.60%	43.70%	33.30%

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。

## 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

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	-1.37%	0.26%	1.13%	0.02%	-2.50%	0.24%
过去六个月	-2.50%	0.25%	2.27%	0.01%	-4.77%	0.24%
过去一年	-4.94%	0.31%	4.50%	0.01%	-9.44%	0.30%
过去三年	24.64%	0.41%	13.50%	0.01%	11.14%	0.40%
过去五年	16.16%	0.71%	22.50%	0.01%	-6.34%	0.70%
自基金合同生效起至今	36.60%	0.59%	34.98%	0.01%	1.62%	0.58%

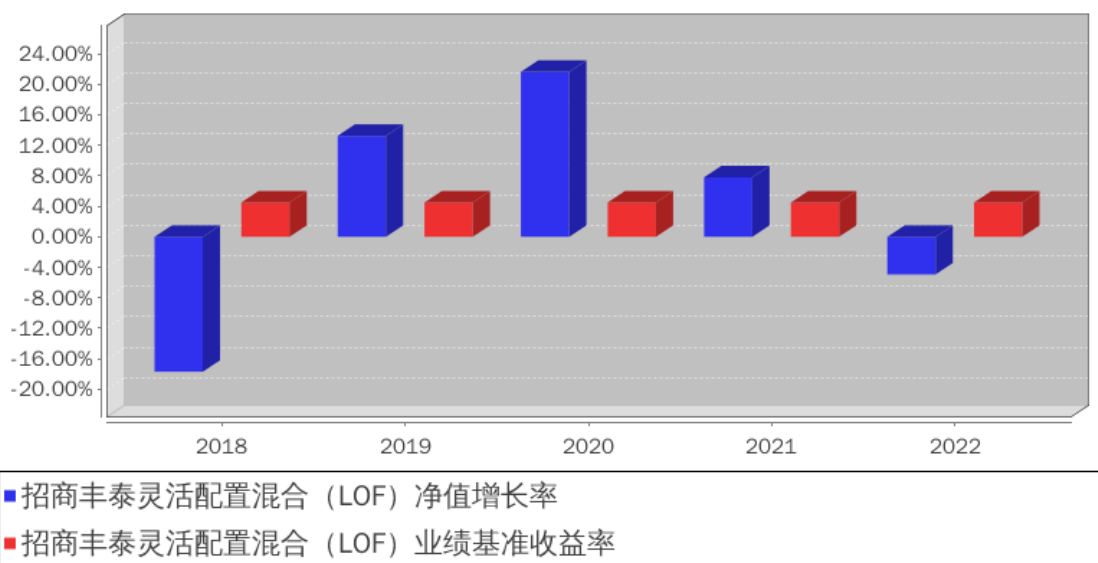
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

### 招商丰泰灵活配置混合（LOF）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



### 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

#### 招商丰泰灵活配置混合（LOF）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



### 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		
张潇潇	本基金基金经理	2021 年 11 月 13 日	-	12	女，硕士。曾任普华永道中天会计师事务所有限公司审计员、上海申银万国证券研究所有限公司研究员，2016 年 1 月加入招商基金管理有限公司，曾任研究员，现任招商丰泰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)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合规守信情况的说明

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% 的情形共发生过七次，原因是指数量化投资组合为满足投资策略需要而发生反向交易。报告期内未发现有可能导致不公平交易和利益输送的重大异常交易行为。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2022 年宏观环境波动加剧，海外地缘冲突爆发，美联储应对通胀开启加息周期，国内疫情反复，风险偏好大幅下降，股票市场整体下跌，上证指数下跌 15.13%，沪深 300 下跌 21.63%，创业板指下跌 29.37%，红利指数下跌 2.42%，全年价值占优。全年大幅波动的行情中，极端宏观风险认识不足，仓位控制上有所欠佳，年初低估值板块上配置较低导致回撤较大，后续市场反弹中，业绩有所回升，但是年底对于疫情优化政策的变化，经济复苏预期反应较慢，行业配置还是相对均衡，业绩回升相对较慢，后续更多关注行业中长期基本面变化，自下而上精选优质个股。

2022 年可转债市场全年下跌，中证转债指数下跌 10.02%，组合转债仓位全年维持在低位，主要是由于前期转债估值较高导致转债的配置价值下降。

2022 年债券市场先涨后跌，2022 年四季度理财的大幅度赎回给债券市场造成了较大冲击。银行理财重仓的银行永续债和二级资本债利率大幅度上行，银行表内资金偏好的利率债波动相对较小。组合在四季度加仓银行永续债和二级资本债，提高组合的静态收益率。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金份额净值增长率为-4.94%，同期业绩基准增长率为 4.50%。

### 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 2023 年，2022 年底政策出台的力道超预期，可以支撑 2023 年经济缓慢复苏。国内的货币政策仍然维持宽松，货币政策仍可期待。国外方面，美国衰退预期持续，美联储年内是否降息仍需观察。地缘形势仍然复杂，谨防黑天鹅事件发生。

股票市场方面：22 年四季度以来对于疫情防控政策优化，经济修复的预期带动市场上行。经济复苏的方向是确定，但是预期也已经先行，并且复苏的路径可能一波三折，后续更多需要跟踪分化超预期的东西。2023 年整体宏观环境要优于去年，没有极端因素发生的情况下，在仓位上不做太大调整，更多关注结构性机会，精选优质细分行业和个股。

可转债方面：转债的性价比有所提升，但是估值水平仍然较高。由于板块间的分化加大，要注重个券挖掘。

债券市场方面：由于 2023 年经济弱复苏的进程会持续全年，长端利率债难有趋势性机会，有利率过调后的交易性机会。与此同时，由于部分信用债有很高的性价比，所以高票息加杠杆仍然是较优的策略。

### 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动突破的情形，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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在招商丰泰灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基

金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## § 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	招商丰泰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了后附的招商丰泰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)(以下简称“该基金”)财务报表,包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表,2022 年度的利润表、净资产(基金净值)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(以下简称“企业会计准则”)、《资产管理产品相关会计处理规定》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 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及,2022 年度的经营成果和基金净值变动情况。
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 2022 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、《资产管理产品相关会计处理规定》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>
注册会计师对财务报表审计的责任	<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</p>

	<p>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)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>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。</p>
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	2023年3月29日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：招商丰泰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)

报告截止日：2022年12月31日



单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	1,229,899.63	3,582,105.81
结算备付金		4,436,629.88	5,414,493.32
存出保证金		16,611.71	81,358.71
交易性金融资产	7.4.7.2	89,405,087.61	689,322,723.27
其中：股票投资		22,511,529.57	153,323,540.77
基金投资		-	-
债券投资		66,893,558.04	535,999,182.50
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	10,008,280.60	-
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		-	1,060,782.45
应收股利		-	-
应收申购款		5,779.04	32,786.09
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	6,986,403.76
资产总计		105,102,288.47	706,480,653.41
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 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		-	69,500,000.00
应付清算款		-	-
应付赎回款		49,421.49	1,041.40
应付管理人报酬		53,748.63	326,063.99
应付托管费		13,437.16	81,515.98
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		2,261.00	46,798.65
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	204,957.43	626,034.70
负债合计		323,825.71	70,581,454.72
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	76,706,718.27	442,486,475.72
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	28,071,744.49	193,412,722.97
净资产合计		104,778,462.76	635,899,198.69
负债和净资产总计		105,102,288.47	706,480,653.41

注：1、报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.366 元，基金份额总额 76,706,718.27 份；

2、以下比较数据已根据本年《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>》中的资产负债表格式的要求进行列示：上年度资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目“本期末”余额合并列示在本期资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，上年度资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本期资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额中。

## 7.2 利润表

会计主体：招商丰泰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-25,691,989.69	48,789,804.44
1.利息收入		267,172.07	17,037,917.85
其中：存款利息收入	7.4.7.9	114,536.93	190,399.11
债券利息收入		-	16,397,076.06
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		152,635.14	450,442.68
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-13,801,629.86	40,646,182.21
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-26,070,043.96	38,557,580.16
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	11,919,385.46	1,056,562.75
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	349,028.64	1,032,039.30
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	-12,630,711.15	-9,818,273.67
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	473,179.25	923,978.05
减：二、营业总支出		2,400,703.95	9,301,223.10
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	1,380,258.25	3,631,270.47
2.托管费	7.4.10.2.2	345,064.60	907,817.68
3.销售服务费		-	-
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		500,916.25	949,724.29
其中：卖出回购金融资产支出		500,916.25	949,724.29
6.信用减值损失	7.4.7.18	-	-
7.税金及附加		12,835.19	44,731.97
8.其他费用	7.4.7.19	161,629.66	3,767,678.69
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-28,092,693.64	39,488,581.34
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-28,092,693.64	39,488,581.34
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-28,092,693.64	39,488,581.34

注：以下比较数据已根据本年《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进行列示：上年度可比期间利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本期利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

### 7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：招商丰泰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 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(基金净值)	442,486,475.72	-	193,412,722.97	635,899,198.69
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	442,486,475.72	-	193,412,722.97	635,899,198.69
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-365,779,757.45	-	-165,340,978.48	-531,120,735.93
(一)、综合收益总额	-	-	-28,092,693.64	-28,092,693.64
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-365,779,757.45	-	-137,248,284.84	-503,028,042.29
其中：1.基金申购款	14,629,436.14	-	5,611,241.73	20,240,677.87
2.基金赎回款	-380,409,193.59	-	-142,859,526.57	-523,268,720.16
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	76,706,718.27	-	28,071,744.49	104,778,462.76
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 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(基金净值)	633,976,252.55	-	211,199,013.28	845,175,265.83
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-

正				
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	633,976,252.55	-	211,199,013.28	845,175,265.83
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-191,489,776.83	-	-17,786,290.31	-209,276,067.14
(一)、综合收益总额	-	-	39,488,581.34	39,488,581.34
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-191,489,776.83	-	-57,274,871.65	-248,764,648.48
其中：1.基金申购款	342,123,668.21	-	134,088,719.65	476,212,387.86
2.基金赎回款	-533,613,445.04	-	-191,363,591.30	-724,977,036.34
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	442,486,475.72	-	193,412,722.97	635,899,198.69

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

招商丰泰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)(以下简称“本基金”)系由基金管理人招商基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《招商丰泰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金合同》及其他有关法律法规的规定，经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]436 号文批准公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限为不定期，首次设立募集基金份额为 7,094,136,239.15 份，经毕马威华振会

计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了编号为毕马威华振验字第 1500162 号验资报告。

《招商丰泰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金合同》于 2015 年 4 月 17 日正式生效。本基金的基金管理人为招商基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”)。

根据中国证监会 2017 年 8 月 31 日发布的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称“《流动性风险管理规定》”),对已经存续的开放式证券投资基金且基金合同内容不符合《流动性风险管理规定》要求的,应当在《流动性风险管理规定》施行之日起 6 个月内予以调整。根据《流动性风险管理规定》等法律法规,经与基金托管人协商一致,招商基金管理有限公司对本基金合同相关条款进行修订,修订后的合同的全部条款已于 2018 年 3 月 31 日起正式实施。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及最新公告的《招商丰泰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)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,但须符合中国证监会的相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金投资于股票、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,现金类资产不包括结算备付金、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。本基金业绩比较基准为: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)。

本基金于 2015 年 7 月 22 日开始在深圳证券交易所上市交易。

#### 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”)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 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

## 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，债券投资和买入返售金融资产等。

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

本基金的管理人报酬、托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产款在资金实际占用期间按实际利率法逐日确认为利息支出。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金每一基金份额享有同等分配权。基金可供分配利润为正的前提下，方可进行收益分配。本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。登记在注册登记系统基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额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。登记在证券登记结算系统基金份额持有人深圳证券账户下的基金份额，只能选择现金分红的方式。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 20%，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估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》(以下简称“估值处理标准”)，在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)，采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

### 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

根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》（以下简称“新金融工具准则”）相关规定，以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。本基金在编制 2022 年度财务报表时已采用新金融工具准则，并采用准则允许的实务简便方法，调整期初基金净值，2021 年的比较数据将不作重述。

于首次执行日，本基金因执行新金融工具准则调减期初基金净值人民币 0.00 元，本基金执行新金融工具准则的影响如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融工具包括银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息、卖出回购金融资产款、应付利息和应付交易费用，金额分别为人民币 3,582,105.81 元、人民币 5,414,493.32 元、人民币 81,358.71 元、人民币 6,986,403.76 元、人民币 69,500,000.00 元、人民币 15,845.47 元和人民币 310,189.18 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融工具包括银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产—应收利息、卖出回购金融资产款和其他负债—应付利息。本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在银行存款、结算备付金、存出保证金、卖出回购金融资产款等项目中，不单独列示应收利息项目或应付利息项目。新金融工具准则下，银行存款、结算备付金、存出保证金、卖出回购金融资产款和其他负债—应付交易费用的金额分别为人民币 3,582,567.57 元、人民币 5,416,814.96 元、人民币 81,395.31 元、人民币 69,515,845.47 元和人民币 310,189.18 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融工具为交易性金融资产，金额为人民币 689,322,723.27 元，归属于交易性金融资产的应收利息金额为人民币 6,983,583.76 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融工具为交易性金融资产，金额为人民币 696,306,307.03 元。

#### 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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
活期存款	1,229,899.63	3,582,105.81
等于：本金	1,229,442.14	3,582,105.81
加：应计利息	457.49	-
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	1,229,899.63	3,582,105.81

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2022 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		22,506,114.69	-	22,511,529.57	5,414.88
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	10,806,448.85	153,811.58	10,898,821.88	-61,438.55
	银行间市场	55,993,370.32	805,236.16	55,994,736.16	-803,870.32
	合计	66,799,819.17	959,047.74	66,893,558.04	-865,308.87
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		89,305,933.86	959,047.74	89,405,087.61	-859,893.99
项目		上年度末 2021 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		146,677,294.75	-	153,323,540.77	6,646,246.02
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	206,047,788.79	-	207,232,182.50	1,184,393.71
	银行间市场	324,826,822.57	-	328,767,000.00	3,940,177.43
	合计	530,874,611.36	-	535,999,182.50	5,124,571.14
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		677,551,906.11	-	689,322,723.27	11,770,817.16

#### 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 2022 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	10,008,280.60	-
合计	10,008,280.60	-
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-

#### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应收利息	-	6,986,403.76
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	6,986,403.76

#### 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	62.07	0.05
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	94,895.36	310,189.18
其中：交易所市场	93,745.36	306,522.68
银行间市场	1,150.00	3,666.50
应付利息	-	15,845.47
预提费用	110,000.00	300,000.00
合计	204,957.43	626,034.70

#### 7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	442,486,475.72	442,486,475.72
本期申购	14,629,436.14	14,629,436.14
本期赎回（以“-”号填列）	-380,409,193.59	-380,409,193.59
基金份额折算变动份额	-	-

本期末	76,706,718.27	76,706,718.27
-----	---------------	---------------

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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	196,559,270.71	-3,146,547.74	193,412,722.97
本期利润	-15,461,982.49	-12,630,711.15	-28,092,693.64
本期基金份额交易产生的变动数	-147,568,562.76	10,320,277.92	-137,248,284.84
其中：基金申购款	6,211,530.47	-600,288.74	5,611,241.73
基金赎回款	-153,780,093.23	10,920,566.66	-142,859,526.57
本期已分配利润	-	-	-
本期末	33,528,725.46	-5,456,980.97	28,071,744.49

#### 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	29,569.28	78,686.03
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	83,764.23	103,521.17
其他	1,203.42	8,191.91
合计	114,536.93	190,399.11

#### 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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-26,070,043.96	38,557,580.16
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	-26,070,043.96	38,557,580.16

##### 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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
----	-------------------------------------	--

卖出股票成交总额	442,414,013.80	1,193,503,789.11
减：卖出股票成本总额	467,288,287.36	1,154,946,208.95
减：交易费用	1,195,770.40	-
买卖股票差价收入	-26,070,043.96	38,557,580.16

#### 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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
债券投资收益——利息收入	6,643,137.37	-
债券投资收益——买卖债券（债 转股及债券到期兑付）差价收入	5,276,248.09	1,056,562.75
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	11,919,385.46	1,056,562.75

#### 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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
卖出债券（债转股及债券到 期兑付）成交总额	623,159,012.22	633,597,501.70
减：卖出债券（债转股及债 券到期兑付）成本总额	608,662,631.09	621,816,719.73
减：应计利息总额	9,211,545.02	10,724,219.22
减：交易费用	8,588.02	-
买卖债券差价收入	5,276,248.09	1,056,562.75

#### 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 2022 年 1 月 1 日至	上年度可比期间 2021 年 1 月
----	--------------------	--------------------

	2022 年 12 月 31 日	1 日至 2021 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	349,028.64	1,032,039.30
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	349,028.64	1,032,039.30

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	-12,630,711.15	-9,818,273.67
——股票投资	-6,640,831.14	-18,168,844.13
——债券投资	-5,989,880.01	8,350,570.46
——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	-12,630,711.15	-9,818,273.67

#### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	473,179.25	923,978.05
其他	-	-
合计	473,179.25	923,978.05

#### 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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
审计费用	30,000.00	60,000.00
信息披露费	80,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	14,279.66	21,582.10
交易费用	-	3,468,896.59

上市费	-	60,000.00
其他	37,350.00	37,200.00
合计	161,629.66	3,767,678.69

#### 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
招商资产管理(香港)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、2022 年 12 月 30 日，招商资产管理(香港)有限公司的股权发生变更，基金管理人不再持有该公司的股权。同日，基金管理人新增持有博时基金(国际)有限公司 45% 的股权。

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 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	35,172,310.59	4.51%	22,114,406.35	0.97%

###### 7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券成交	成交金额	占当期债券成交

		总额的比例		总额的比例
招商证券	-	-	279,200.00	0.12%

### 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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 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	142,500,000.00	6.26%	30,000,000.00	0.59%

### 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 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	32,756.92	4.85%	292.69	0.31%
关联方名称	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 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	20,595.15	1.03%	20,595.15	6.72%

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,380,258.25	3,631,270.47
其中：支付销售机构的客户维护费	162,726.03	193,020.72
支付投资顾问的投资顾问费	-	-

注：支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值×0.60%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：

日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×0.60%÷当年天数

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	345,064.60	907,817.68

注：支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值×0.15%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：

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.15%÷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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 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



中国银行-活期	1,229,899.63	29,569.28	3,582,105.81	78,686.03
---------	--------------	-----------	--------------	-----------

注：本基金的银行存款由基金托管人中国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 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	301123	奕东电子	网下申购	5,968	222,188.64
招商证券	600030	中信证券	配股	15,000	216,450.00
中银国际证券	600938	中国海油	网下申购	120,005	1,296,054.00

上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 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	688206	概伦电子	网下申购	6,000	169,680.00
招商证券	301193	家联科技	网下申购	2,970	91,268.10
招商证券	001288	运机集团	网下申购	537	7,813.35
招商证券	688739	成大生物	网下申购	3,705	407,550.00
招商证券	301083	百胜智能	网下申购	4,160	37,772.80
招商证券	688772	珠海冠宇	网下申购	12,960	187,012.80
招商证券	688103	国力股份	网下申购	1,595	19,203.80
招商证券	605069	正和生态	网下申购	608	9,199.04
招商证券	688517	金冠电气	网下申购	2,892	22,297.32
招商证券	001201	东瑞股份	网下申购	477	30,232.26
招商证券	300960	通业科技	网下申购	2,332	28,170.56
招商证券、中银国际证券	601728	中国电信	网下申购	216,490	980,699.70
中银国际证券	688509	正元地信	网下申购	15,433	30,403.01

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（2022 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

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

#### 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

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
AAA	50,805,108.49	460,277,086.20
AAA 以下	370,772.75	2,623,991.90
未评级	-	-
合计	51,175,881.24	462,901,078.10

注：上述评级均由经中国证监会核准从事证券市场资信评级业务的评级机构做出。

#### 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同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 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,229,899.63	-	-	-	1,229,899.63
结算备付金	4,436,629.88	-	-	-	4,436,629.88
存出保证金	16,611.71	-	-	-	16,611.71
交易性金融资产	5,365,791.87	46,075,162.12	15,452,604.05	22,511,529.57	89,405,087.61
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	10,008,280.60	-	-	-	10,008,280.60
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	5,779.04	5,779.04
应收清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	21,057,213.69	46,075,162.12	15,452,604.05	22,517,308.61	105,102,288.47
负债					
应付赎回款	-	-	-	49,421.49	49,421.49
应付管理人报酬	-	-	-	53,748.63	53,748.63
应付托管费	-	-	-	13,437.16	13,437.16

应付清算款	-	-	-	-	-
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	-	-	-	2,261.00	2,261.00
其他负债	-	-	-	204,957.43	204,957.43
负债总计	-	-	-	323,825.71	323,825.71
利率敏感度缺口	21,057,213.69	46,075,162.12	15,452,604.05	22,193,482.90	104,778,462.76
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,582,105.81	-	-	-	3,582,105.81
结算备付金	5,414,493.32	-	-	-	5,414,493.32
存出保证金	81,358.71	-	-	-	81,358.71
交易性金融资产	132,888,104.40	371,521,551.10	31,589,527.00	153,323,540.77	689,322,723.27
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	6,986,403.76	6,986,403.76
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	32,786.09	32,786.09
应收证券清算款	-	-	-	1,060,782.45	1,060,782.45
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	141,966,062.24	371,521,551.10	31,589,527.00	161,403,513.07	706,480,653.41
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,041.40	1,041.40
应付管理人报酬	-	-	-	326,063.99	326,063.99
应付托管费	-	-	-	81,515.98	81,515.98
应付证券清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	69,500,000.00	-	-	-	69,500,000.00
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	310,189.18	310,189.18
应付利息	-	-	-	15,845.47	15,845.47
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	46,798.65	46,798.65
其他负债	-	-	-	300,000.05	300,000.05
负债总计	69,500,000.00	-	-	1,081,454.72	70,581,454.72
利率敏感度缺口	72,466,062.24	371,521,551.10	31,589,527.00	160,322,058.35	635,899,198.69

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

假设	1.若市场利率平行上升或下降 50 个基点		
	2.其他市场变量保持不变		
	3.仅存在公允价值变动对基金资产净值的影响		
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（2022 年 12 月 31 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
	1. 市场利率平行上升 50 个基点	-1,222,460.13	-6,634,304.83
	2. 市场利率平行下降 50 个基点	1,258,765.63	6,852,052.37

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

## 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 2022 年 12 月 31 日		上年度末 2021 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	22,511,529.57	21.48	153,323,540.77	24.11
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	22,511,529.57	21.48	153,323,540.77	24.11

## 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（2022 年 12 月 31 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
	1. 权益性投资的市场价格上升 5%	1,125,576.48	7,666,177.04
	2. 权益性投资的市场价格下降 5%	-1,125,576.48	-7,666,177.04

#### 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 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	22,966,539.03	151,836,014.90
第二层次	66,438,548.58	537,486,708.37
第三层次	-	-
合计	89,405,087.61	689,322,723.27

###### 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

报告期间，本基金无第三层次公允价值余额及变动情况。

###### 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	22,511,529.57	21.42
	其中：股票	22,511,529.57	21.42
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	66,893,558.04	63.65
	其中：债券	66,893,558.04	63.65
	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	10,008,280.60	9.52
	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	5,666,529.51	5.39
8	其他资产	22,390.75	0.02
9	合计	105,102,288.47	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	17,247,549.89	16.46
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	1,311,410.00	1.25



G	交通运输、仓储和邮政业	674,943.00	0.64
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,477,614.68	1.41
J	金融业	-	-
K	房地产业	778,074.00	0.74
L	租赁和商务服务业	449,764.00	0.43
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	226,944.00	0.22
R	文化、体育和娱乐业	345,230.00	0.33
S	综合	-	-
	合计	22,511,529.57	21.48

### 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	000733	振华科技	8,000	913,840.00	0.87
2	600079	人福医药	33,500	800,315.00	0.76
3	688558	国盛智科	21,901	768,068.07	0.73
4	688232	新点软件	11,478	654,934.68	0.63
5	002572	索菲亚	35,800	650,128.00	0.62
6	300911	亿田智能	14,000	645,960.00	0.62
7	600426	华鲁恒升	19,300	639,795.00	0.61
8	000858	五粮液	3,500	632,415.00	0.60
9	000651	格力电器	18,900	610,848.00	0.58
10	603517	绝味食品	9,700	592,573.00	0.57
11	000963	华东医药	12,500	585,000.00	0.56
12	603816	顾家家居	13,100	559,501.00	0.53
13	600859	王府井	19,100	537,474.00	0.51
14	300451	创业慧康	66,900	529,179.00	0.51
15	688059	华锐精密	3,162	509,082.00	0.49
16	603822	嘉澳环保	14,500	496,190.00	0.47
17	002906	华阳集团	14,700	488,334.00	0.47
18	002426	胜利精密	176,400	463,932.00	0.44
19	002920	德赛西威	4,400	463,496.00	0.44
20	000625	长安汽车	37,600	462,856.00	0.44

21	603338	浙江鼎力	9,300	445,005.00	0.42
22	603197	保隆科技	9,100	430,430.00	0.41
23	600872	中炬高新	11,000	405,570.00	0.39
24	300132	青松股份	54,100	377,077.00	0.36
25	603069	海汽集团	13,800	363,768.00	0.35
26	300699	光威复材	4,800	346,800.00	0.33
27	300413	芒果超媒	11,500	345,230.00	0.33
28	601636	旗滨集团	30,000	341,700.00	0.33
29	300595	欧普康视	9,300	332,010.00	0.32
30	600132	重庆啤酒	2,500	318,450.00	0.30
31	603877	太平鸟	17,000	312,630.00	0.30
32	002928	华夏航空	22,500	311,175.00	0.30
33	002859	洁美科技	10,800	304,884.00	0.29
34	603363	傲农生物	23,600	304,204.00	0.29
35	000799	酒鬼酒	2,200	303,468.00	0.29
36	688793	倍轻松	6,142	301,142.26	0.29
37	600515	海南机场	59,800	300,196.00	0.29
38	600199	金种子酒	11,200	299,264.00	0.29
39	300782	卓胜微	2,600	297,180.00	0.28
40	600138	中青旅	19,400	294,686.00	0.28
41	002990	盛视科技	10,700	293,501.00	0.28
42	600882	妙可蓝多	9,000	286,560.00	0.27
43	601155	新城控股	13,700	280,850.00	0.27
44	300553	集智股份	4,500	280,350.00	0.27
45	605268	王力安防	31,700	278,960.00	0.27
46	002371	北方华创	1,200	270,360.00	0.26
47	000519	中兵红箭	12,800	251,392.00	0.24
48	600779	水井坊	2,700	227,934.00	0.22
49	301103	何氏眼科	7,200	226,944.00	0.22
50	300957	贝泰妮	1,400	208,936.00	0.20
51	603866	桃李面包	12,800	197,120.00	0.19
52	001979	招商蛇口	15,600	197,028.00	0.19
53	300979	华利集团	3,400	194,174.00	0.19
54	300783	三只松鼠	8,800	188,936.00	0.18
55	600438	通威股份	4,300	165,894.00	0.16
56	300795	米奥会展	3,800	155,078.00	0.15
57	001301	尚太科技	1,164	68,722.56	0.07

## 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	000672	上峰水泥	8,149,972.18	1.28
2	301071	力量钻石	7,804,378.00	1.23
3	000333	美的集团	7,632,898.09	1.20
4	601628	中国人寿	7,589,346.99	1.19
5	301058	中粮科工	7,104,397.90	1.12
6	000002	万科 A	6,381,198.00	1.00
7	002100	天康生物	6,036,037.00	0.95
8	300911	亿田智能	5,905,067.52	0.93
9	002714	牧原股份	5,763,428.00	0.91
10	002594	比亚迪	5,599,150.00	0.88
11	002508	老板电器	5,395,057.98	0.85
12	600985	淮北矿业	5,277,782.00	0.83
13	603589	口子窖	5,104,620.00	0.80
14	000498	山东路桥	4,913,765.00	0.77
15	600188	兖矿能源	4,859,900.00	0.76
16	300122	智飞生物	4,677,328.00	0.74
17	688599	天合光能	4,459,351.88	0.70
18	603363	傲农生物	4,276,817.00	0.67
19	600153	建发股份	4,220,852.00	0.66
20	600383	金地集团	4,134,803.00	0.65

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	600519	贵州茅台	11,418,672.00	1.80
2	301071	力量钻石	11,205,663.00	1.76
3	000672	上峰水泥	10,528,137.00	1.66
4	002594	比亚迪	10,035,527.00	1.58
5	000333	美的集团	8,786,182.00	1.38
6	300750	宁德时代	8,102,358.00	1.27
7	003038	鑫铂股份	8,063,114.00	1.27
8	300911	亿田智能	7,210,195.00	1.13
9	688599	天合光能	7,091,392.29	1.12
10	601628	中国人寿	7,086,006.91	1.11
11	600801	华新水泥	6,879,958.88	1.08
12	600585	海螺水泥	6,735,059.00	1.06

13	601058	赛轮轮胎	6,381,472.00	1.00
14	300274	阳光电源	6,312,708.64	0.99
15	002100	天康生物	6,039,614.05	0.95
16	600809	山西汾酒	5,966,332.60	0.94
17	002714	牧原股份	5,664,034.00	0.89
18	600188	兖矿能源	5,661,770.00	0.89
19	301058	中粮科工	5,573,451.62	0.88
20	600153	建发股份	5,274,326.00	0.83

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	343,117,107.30
卖出股票收入（成交）总额	442,414,013.80

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

金额单位：人民币元

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	5,365,791.87	5.12
2	央行票据	-	-
3	金融债券	51,001,057.80	48.68
	其中：政策性金融债	10,351,884.93	9.88
4	企业债券	5,078,020.55	4.85
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	455,009.46	0.43
8	同业存单	-	-
9	其他	4,993,678.36	4.77
10	合计	66,893,558.04	63.84

#### 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

金额单位：人民币元

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	220310	22 进出 10	100,000	10,351,884.93	9.88
2	2128017	21 中信银行永续债	50,000	5,181,568.49	4.95
3	2028040	20 交通银行永续债	50,000	5,172,795.34	4.94
4	2128021	21 工商银行永续债 01	50,000	5,139,647.12	4.91
5	1928031	19 广发银行永续债	50,000	5,139,342.47	4.90

### 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

报告期基金投资的前十名证券除 19 广发银行永续债（证券代码 1928031）、20 交通银行永续债（证券代码 2028040）、21 北京银行永续债 01（证券代码 2120089）、21 工商银行永续债 01（证券代码 2128021）、21 农业银行永续债 01（证券代码 2128038）、21 兴业

银行二级 02（证券代码 2128042）、21 中信银行永续债（证券代码 2128017）、22 进出 10（证券代码 220310）、22 邮储银行永续债 01（证券代码 2228001）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、19 广发银行永续债（证券代码 1928031）

根据发布的相关公告，该证券发行人在报告期内因违规经营、未依法履行职责、违反反洗钱法、违规提供担保及财务资助、涉嫌违反法律法规，多次受到监管机构的处罚。

2、20 交通银行永续债（证券代码 2028040）

根据发布的相关公告，该证券发行人在报告期内因违规经营、违反反洗钱法、信息披露虚假或严重误导性陈述等原因，多次受到监管机构的处罚。

3、21 北京银行永续债 01（证券代码 2120089）

根据发布的相关公告，该证券发行人在报告期内因违规经营、违反反洗钱法、未依法履行职责等原因，多次受到监管机构的处罚。

4、21 工商银行永续债 01（证券代码 2128021）

根据发布的相关公告，该证券发行人在报告期内因违规经营、内部制度不完善、违反反洗钱法、未依法履行职责等原因，多次受到监管机构的处罚。

5、21 农业银行永续债 01（证券代码 2128038）

根据发布的相关公告，该证券发行人在报告期内因违规经营、内部制度不完善、违反反洗钱法、未依法履行职责等原因，多次受到监管机构的处罚。

6、21 兴业银行二级 02（证券代码 2128042）

根据发布的相关公告，该证券发行人在报告期内因违规经营、未依法履行职责、涉嫌违反法律法规等原因，多次受到监管机构的处罚。

7、21 中信银行永续债（证券代码 2128017）

根据发布的相关公告，该证券发行人在报告期内因违规经营、未依法履行职责、违反反洗钱法等原因，多次受到监管机构的处罚。

8、22 进出 10（证券代码 220310）

根据发布的相关公告，该证券发行人在报告期内因违规经营、未依法履行职责、违反反洗钱法等原因，多次受到监管机构的处罚。

9、22 邮储银行永续债 01（证券代码 2228001）

根据发布的相关公告，该证券发行人在报告期内因违规经营、违反反洗钱法、未依法履行职责等原因，多次受到监管机构的处罚。

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	16,611.71
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	5,779.04
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	22,390.75

### 8.12.4 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	127031	洋丰转债	123,968.90	0.12
2	110076	华海转债	90,635.84	0.09
3	110081	闻泰转债	88,329.43	0.08
4	127056	中特转债	84,236.71	0.08
5	113633	科沃转债	45,034.53	0.04

### 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

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
650	118,010.34	64,235,965.17	83.74%	12,470,753.10	16.26%

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	高德荣	104,100.00	25.32%
2	杜志	46,500.00	11.31%

3	郑龙根	34,400.00	8.37%
4	刘景贺	23,800.00	5.79%
5	杨自由	19,545.00	4.75%
6	马建英	16,700.00	4.06%
7	何海敏	15,700.00	3.82%
8	陈启玉	14,700.00	3.57%
9	宋洁	14,320.00	3.48%
10	杨婕	13,060.00	3.18%

注：以上数据由中国证券登记结算公司提供，持有人为场内持有人。

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	35,561.88	0.0464%

### 9.4 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	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2015年4月17日)基金份额总额	7,094,136,239.15
本报告期期初基金份额总额	442,486,475.72
本报告期基金总申购份额	14,629,436.14
减：报告期基金总赎回份额	380,409,193.59
本报告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	76,706,718.27

## § 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 2022 年 7 月 30 日的公告，经招商基金管理有限公司第六届董事会 2022 年第五次会议审议通过，同意聘任徐勇先生为公司总经理。

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

## 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 8 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 30,000.00 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	
中泰证券	3	127,804,744.01	16.40%	93,464.28	13.83%	-
长江证券	6	68,879,534.70	8.84%	64,015.31	9.47%	-
中金公司	3	65,709,758.33	8.43%	61,195.70	9.06%	-

东方证券	3	63,834,362.31	8.19%	59,031.70	8.74%	-
天风证券	5	45,175,501.51	5.80%	41,126.24	6.09%	-
申万宏源	4	44,786,119.76	5.75%	41,709.11	6.17%	-
中信建投 证券	6	38,657,210.25	4.96%	36,003.15	5.33%	-
招商证券	5	35,172,310.59	4.51%	32,756.92	4.85%	-
光大证券	3	30,010,713.85	3.85%	22,308.63	3.30%	-
东兴证券	3	29,595,489.97	3.80%	27,562.12	4.08%	-
国泰君安 证券	3	26,642,468.64	3.42%	24,811.28	3.67%	-
国信证券	3	24,617,994.27	3.16%	22,477.17	3.33%	-
中银国际 证券	4	16,086,221.10	2.06%	14,980.43	2.22%	-
华泰证券	5	15,822,621.41	2.03%	13,274.39	1.96%	-
中金财富 证券	2	12,325,912.58	1.58%	9,014.08	1.33%	-
德邦证券	4	12,192,623.94	1.57%	8,916.69	1.32%	-
银河证券	1	11,315,662.79	1.45%	10,538.52	1.56%	-
华西证券	3	9,265,160.75	1.19%	8,628.68	1.28%	-
浙商证券	2	9,027,841.42	1.16%	6,601.80	0.98%	-
开源证券	2	8,752,367.65	1.12%	8,150.97	1.21%	-
海通证券	4	8,336,702.16	1.07%	6,323.01	0.94%	-
华安证券	5	7,968,693.00	1.02%	5,827.33	0.86%	-
平安证券	3	7,798,049.91	1.00%	7,262.58	1.07%	-
西部证券	1	7,665,145.60	0.98%	7,138.77	1.06%	-
长城证券	3	7,464,769.54	0.96%	6,951.96	1.03%	-
国联证券	4	7,311,267.04	0.94%	5,346.75	0.79%	-
信达证券	5	5,619,287.50	0.72%	5,233.26	0.77%	-
民生证券	3	5,028,894.50	0.65%	3,677.56	0.54%	-
东海证券	2	4,583,861.21	0.59%	3,352.31	0.50%	-
东吴证券	4	4,093,382.67	0.53%	2,993.45	0.44%	-
方正证券	7	3,701,668.46	0.48%	3,447.36	0.51%	-
安信证券	6	3,067,075.06	0.39%	2,856.33	0.42%	-
东方财富	3	3,027,558.10	0.39%	2,214.04	0.33%	-
山西证券	4	2,865,648.00	0.37%	2,095.61	0.31%	-
国盛证券	2	2,823,080.55	0.36%	2,629.32	0.39%	-
中信证券	6	849,912.00	0.11%	621.55	0.09%	-
兴业证券	2	719,246.00	0.09%	669.81	0.10%	-
东北证券	3	431,236.58	0.06%	401.61	0.06%	-
华创证券	4	31,056.25	0.00%	28.92	0.00%	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
诚通证券	1	-	-	-	-	-
大通证券	1	-	-	-	-	-

第一创业	3	-	-	-	-	-
广发证券	3	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
宏信证券	2	-	-	-	-	-
华宝证券	2	-	-	-	-	-
华金证券	2	-	-	-	-	-
华鑫证券	2	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
金元证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
瑞信方正	2	-	-	-	-	-
上海证券	2	-	-	-	-	-
申港证券	2	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
首创证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
万和证券	1	-	-	-	-	-
五矿证券	2	-	-	-	-	-
湘财证券	2	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
粤开证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	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
中泰证券	22,355,799.90	11.48%	394,400,000.00	17.34%	-	-
长江证券	-	-	69,500,000.00	3.06%	-	-
中金公司	61,353,704.19	31.50%	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	213,200,000.00	9.37%	-	-
申万宏源	67,483,286.60	34.64%	227,000,000.00	9.98%	-	-
中信建投	1,513,940.07	0.78%	307,400,000.00	13.51%	-	-

证券						
招商证券	-	-	142,500,000.00	6.26%	-	-
光大证券	-	-	115,000,000.00	5.06%	-	-
东兴证券	30,193,900.00	15.50%	109,000,000.00	4.79%	-	-
国泰君安 证券	-	-	59,871,000.00	2.63%	-	-
国信证券	-	-	25,000,000.00	1.10%	-	-
中银国际 证券	92,876.79	0.05%	57,400,000.00	2.52%	-	-
华泰证券	-	-	188,600,000.00	8.29%	-	-
中金财富 证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	5,097,870.00	2.62%	-	-	-	-
银河证券	-	-	11,200,000.00	0.49%	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	61,700,000.00	2.71%	-	-
开源证券	-	-	135,000,000.00	5.93%	-	-
海通证券	135,849.55	0.07%	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	24,860,000.00	1.09%	-	-
西部证券	427,173.00	0.22%	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	2,000,000.00	0.09%	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	602,634.00	0.31%	63,150,000.00	2.78%	-	-
东吴证券	133,858.44	0.07%	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	5,131,620.00	2.63%	32,000,000.00	1.41%	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
山西证券	265,558.15	0.14%	-	-	-	-
国盛证券	-	-	5,700,000.00	0.25%	-	-
中信证券	-	-	28,290,000.00	1.24%	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	1,871,000.00	0.08%	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
诚通证券	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-

宏信证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
瑞信方正	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证 券	-	-	-	-	-	-
万和证券	-	-	-	-	-	-
五矿证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-

### 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关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-01-01
2	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	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-01-15
3	招商基金管理有限公司旗下基金 2021 年第 4 季度报告提示性公告	证券日报及基金管理人网站	2022-01-21
4	招商丰泰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)2021 年第 4 季度报告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-01-21
5	招商基金管理有限公司关于公司自有资金投资旗下公募基金的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-01-27
6	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	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-01-28
7	关于警惕冒用招商基金管理有限公司名义进行	证券日报、基金管理	2022-03-22

	诈骗活动的特别提示公告	人网站及中国证监会 基金电子披露网站	
8	招商丰泰灵活配置混合型证券投资基金(LOF) 溢价风险提示公告	证券日报、基金管理 人网站及中国证监会 基金电子披露网站	2022-03-23
9	招商丰泰灵活配置混合型证券投资基金(LOF) 溢价风险提示及停复牌公告	证券日报、基金管理 人网站及中国证监会 基金电子披露网站	2022-03-24
10	招商丰泰灵活配置混合型证券投资基金(LOF) 溢价风险提示公告	证券日报、基金管理 人网站及中国证监会 基金电子披露网站	2022-03-25
11	招商丰泰灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)2021 年年度报告	证券日报、基金管理 人网站及中国证监会 基金电子披露网站	2022-03-30
12	招商基金管理有限公司旗下基金 2021 年年度 报告提示性公告	证券日报及基金管理 人网站	2022-03-30
13	招商丰泰灵活配置混合型证券投资基金(LOF) 更新的招募说明书(二零二二年第一号)	证券日报、基金管理 人网站及中国证监会 基金电子披露网站	2022-04-15
14	招商丰泰灵活配置混合型证券投资基金(LOF) 基金产品资料概要更新	证券日报、基金管理 人网站及中国证监会 基金电子披露网站	2022-04-15
15	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	证券日报、基金管理 人网站及中国证监会 基金电子披露网站	2022-04-15
16	招商基金管理有限公司关于旗下基金估值变更 的公告	证券日报、基金管理 人网站及中国证监会 基金电子披露网站	2022-04-20
17	招商丰泰灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)2022 年第 1 季度报告	证券日报、基金管理 人网站及中国证监会 基金电子披露网站	2022-04-21
18	招商基金管理有限公司旗下基金 2022 年第 1 季度报告提示性公告	证券日报及基金管理 人网站	2022-04-21
19	招商丰泰灵活配置混合型证券投资基金(LOF) 溢价风险提示公告	证券日报、基金管理 人网站及中国证监会 基金电子披露网站	2022-04-27
20	关于恢复招商丰泰灵活配置混合型证券投资基 金(LOF)大额申购(含定期定额投资)和转换 转入业务的公告	证券日报、基金管理 人网站及中国证监会 基金电子披露网站	2022-04-28
21	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	证券日报、基金管理 人网站及中国证监会 基金电子披露网站	2022-05-13
22	招商基金管理有限公司关于养老金客户通过直 销柜台申购旗下基金开展费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理 人网站及中国证监会	2022-06-09

		基金电子披露网站	
23	招商丰泰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)2022 年第 2 季度报告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-07-20
24	招商基金管理有限公司旗下基金 2022 年第 2 季度报告提示性公告	证券日报及基金管理人网站	2022-07-20
25	招商基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-07-30
26	招商基金管理有限公司旗下基金 2022 年中期报告提示性公告	证券日报及基金管理人网站	2022-08-30
27	招商丰泰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)2022 年中期报告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-08-30
28	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	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-10-17
29	招商基金管理有限公司旗下基金 2022 年第 3 季度报告提示性公告	证券日报及基金管理人网站	2022-10-25
30	招商丰泰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)2022 年第 3 季度报告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-10-25
31	招商基金管理有限公司关于调整旗下部分开放式基金业务最低申购金额及最小追加申购金额的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-11-08
32	招商基金管理有限公司关于旗下基金估值变更的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-12-10

## § 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	20220101-20220308,20220401-20221231	89,674,175.85	-	36,260,000.00	53,414,175.85	69.63%
机构	2	20220425-20220726	21,306,107.95	-	21,306,107.95	-	-
机构	3	20220101-20220331	105,388,897.06	-	105,388,897.06	-	-
机构	4	20220309-20220331	84,227,229.15	-	84,227,229.15	-	-
产品特有风险							

本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况,可能会出现集中赎回甚至巨额赎回从而引发基金净值剧烈波动,甚至引发基金的流动性风险,基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请,基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。

注: 1、报告期末持有份额占比按照四舍五入方法保留至小数点后第 2 位;

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

## § 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丰泰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)设立的文件;
- 3、《招商丰泰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金合同》;
- 4、《招商丰泰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)托管协议》;
- 5、《招商丰泰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)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

2023 年 3 月 30 日