

# 招商资管智远成长灵活配置混合型集合资产管理计划

## 2023 年中期报告

2023 年 06 月 30 日

基金管理人:招商证券资产管理有限公司

基金托管人:招商银行股份有限公司

送出日期:2023 年 08 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、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的法律责任。本中期报告已经三分之二以上董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年8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。

根据《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》，本集合计划于2020年10月13日合同变更生效。本集合计划按照相关规定，参照公募基金管理运作。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2023年1月1日起至6月30日止。

## 1.2 目录

§ 1	重要提示及目录	2
1.1	重要提示	2
1.2	目录	3
§ 2	基金简介	5
2.1	基金基本情况	5
2.2	基金产品说明	5
2.3	基金管理人和基金托管人	6
2.4	信息披露方式	6
2.5	其他相关资料	7
§ 3	主要财务指标和基金净值表现	7
3.1	主要会计数据和财务指标	7
3.2	基金净值表现	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	11
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8	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	13
§ 5	托管人报告	13
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
5.3	托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	13
§ 6	半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1	资产负债表	13
6.2	利润表	15
6.3	净资产（基金净值）变动表	17
6.4	报表附注	20
§ 7	投资组合报告	42
7.1	期末基金资产组合情况	42
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	43
7.3	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	43
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	48
7.6	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	48
7.7	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	49
7.8	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	

.....	49
7.9 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	49
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	49
7.12 投资组合报告附注	49
§ 8 基金份额持有人信息	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	51
8.3 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	51
§ 9 开放式基金份额变动	51
§ 10 重大事件揭示	52
10.1 基金份额持有人大会决议	52
10.2 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	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	52
10.4 基金投资策略的改变	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	52
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	52
10.8 其他重大事件	53
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	54
11.1 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	54
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	54
§ 12 备查文件目录	55
12.1 备查文件目录	55
12.2 存放地点	55
12.3 查阅方式	55

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	招商资管智远成长灵活配置混合型集合资产管理计划	
基金简称	招商资管智远成长灵活配置混合	
基金主代码	880007	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020年10月13日	
基金管理人	招商证券资产管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	340,971,341.70份	
基金合同存续期	本集合计划自本集合计划合同变更生效日起存续期不得超过3年。本集合计划自集合计划合同变更生效日起3年后，按照中国证监会有关规定执行。	
下属分级基金的基金简称	招商资管智远成长灵活配置混合A	招商资管智远成长灵活配置混合C
下属分级基金的交易代码	880007	881007
报告期末下属分级基金的份额总额	240,657,046.22份	100,314,295.48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。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本集合计划在严格控制投资风险的前提下，通过大类资产配置，以及精选受益于中国经济高速增长而出现持续竞争优势和良好成长性的上市公司股票，力争获得超越业绩比较基准的稳健回报。
投资策略	根据本集合计划所奉行的“自上而下为主、自下而上为辅”的投资策略，在投资决策中，管理人在相关法律法规和本集合计划合同规定的投资范围和比例限制内，根据各项经济领先指标和行业领先指标的相对变化，确定资产在股票、债券及现金等类别资产间的分配比例以及股票资产在细分行业内的配置比例。具体包括：（1）

	资产和行业配置策略；（2）股票投资策略；（3）债券投资策略；（4）现金类管理工具投资策略；（5）新股/新债投资策略；（6）股指期货投资策略；（7）国债期货投资策略；（8）资产支持证券投资策略。
业绩比较基准	税后活期存款利率*10% + 上证国债指数收益率*30% + 沪深300指数收益率*60%
风险收益特征	本集合计划是混合型集合资产管理计划，预期风险和预期收益与混合型基金相同，高于债券型基金和货币市场基金，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		招商证券资产管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	唐佳强	张燕
	联系电话	0755-26951111	0755-83199084
	电子邮箱	tangjq@cmschina.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		95565	95555
传真		-	0755-83195201
注册地址		深圳市前海深港合作区南山街道兴海大道3040号前海世茂金融中心二期2902(前海世茂大厦29层02-08号)	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
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	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码		518026	518040
法定代表人		杨阳	缪建民

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="https://amc.cmschina.com/">https://amc.cmschina.com/</a>
基金中期报告备置地点	深圳市福田区福华一路111号招商证券大厦17、18楼

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区锦什坊街26号

## §3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2023年01月01日-2023年06月30日)	
	招商资管智远成长 灵活配置混合A	招商资管智远成长 灵活配置混合C
本期已实现收益	-22,178,511.16	-8,906,103.00
本期利润	-12,796,612.23	-5,063,989.36
加权平均基金份额本期利润	-0.0490	-0.0485
本期加权平均净值利润率	-9.23%	-9.19%
本期基金份额净值增长率	-8.90%	-9.07%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2023年06月30日)	
期末可供分配利润	-53,771,487.44	-50,632,125.30
期末可供分配基金份额利润	-0.2234	-0.5047
期末基金资产净值	119,933,580.02	49,682,170.18
期末基金份额净值	0.4984	0.4953
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2023年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	-50.16%	-50.47%

注：（1）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；

（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）期末可供分配利润为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

##### 招商资管智远成长灵活配置混合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
过去一个月	1.03%	0.99%	0.84%	0.52%	0.19%	0.47%
过去三个月	-2.18%	1.17%	-2.65%	0.50%	0.47%	0.67%
过去六个月	-8.90%	1.25%	0.30%	0.51%	-9.20%	0.74%
过去一年	-34.92%	1.46%	-7.56%	0.59%	-27.36%	0.87%
自基金合同生效起至今	-50.16%	1.25%	-9.02%	0.69%	-41.14%	0.56%

##### 招商资管智远成长灵活配置混合C

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
过去一个月	1.00%	0.99%	0.84%	0.52%	0.16%	0.47%
过去三个月	-2.29%	1.17%	-2.65%	0.50%	0.36%	0.67%
过去六个月	-9.07%	1.25%	0.30%	0.51%	-9.37%	0.74%
过去一年	-35.17%	1.46%	-7.56%	0.59%	-27.61%	0.87%
自基金合同生效起至今	-50.47%	1.25%	-9.02%	0.69%	-41.45%	0.56%

注：（1）本集合计划属于混合型集合资产管理计划，本集合计划业绩比较基准为“沪深300指数收益率×60%+上证国债指数收益率×30%+税后活期存款利率×10%”；

（2）本集合计划对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

#### 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

招商资管智远成长灵活配置混合A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2020年10月13日-2023年06月30日)



招商资管智远成长灵活配置混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2020年10月13日-2023年06月30日)



## §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

招商证券资产管理有限公司（以下简称“招商资管”）经中国证券监督管理委员会批准（《关于核准招商证券股份有限公司设立资产管理子公司的批复》（证监许可〔2015〕

123号) )，于2015年4月成立，是招商证券股份有限公司全资子公司。注册资本10亿元，业务范围为证券资产管理业务。

招商资管作为招商证券股份有限公司100%控股的资管子公司，前身是招商证券资产管理总部，国内最早获得受托资产管理、创新试点、QDII资格的券商资产管理之一，业务实力长期居于行业第一梯队。

招商资管现有投资、策略、研究、交易专业人员数十位，多数拥有名校或海外教育背景，部分拥有在全球著名资产管理机构的专业工作经验。主要投资管理人员均具有多年研究及投资经历，在市场起伏中积累了丰富理论和实战经验，形成了较为成熟的投资理念和稳健的投资风格。

#### 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		
何怀志	本集合计划的基金经理	2023-01-11	-	7	硕士研究生，现任权益投资部基金经理。曾任招商证券资产管理有限公司权益投资部研究员。担任【招商资管智远成长灵活配置混合型集合资产管理计划】基金经理（自2023年1月11日起任职）。
赵波	本集合计划的基金经理	2021-10-15	2023-01-11	13	中国社会科学院研究生院国民经济专业博士，13年证券从业年限。曾任长城基金管理有限公司基金经理、基金经理助理、研究员，中银国际证券有限责任公司北京投行部高级分析员。曾任【招商资管智远成长灵活配置混合型集合资产管理计划】基金经理（自2021年10月15日至2023年1月11日）。

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。

#### 4.1.3 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 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 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

2023年上半年，一季度和二季度市场风格和结构有着明显的差异：一季度在市场对于宏观经济复苏的乐观预期下，市场呈现出了明显的板块轮动上涨，不管是大盘蓝筹股还是各类型主题交易，都有着较好的表现。但是二季度以来，随着宏观经济复苏程度、

一季度企业盈利低于此前乐观预期，叠加宽裕的流动性，市场逐步转向各类型主题交易，而以茅指数和宁组合为代表的大盘价值和大盘成长类行业和个股表现相对较差。整体而言，2023年上半年上证指数上涨3.65%，沪深300指数下跌0.75%，创业板指数下跌5.61%。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末招商资管智远成长灵活配置混合A基金份额净值为0.4984元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-8.90%，同期业绩比较基准收益率为0.30%；截至报告期末招商资管智远成长灵活配置混合C基金份额净值为0.4953元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-9.07%，同期业绩比较基准收益率为0.30%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

大势研判方面，考虑到宏观经济整体现实层面的边际好转、预期层面的边际乐观，考虑到去年的基数效应，二季度开始A股企业盈利将迎来拐点，伴随着相对宽松的流动性环境以及美联储加息周期的尾声，市场会开始逐步开启一轮震荡向上的反弹。就结构而言，A股企业盈利的在中报业绩期将出现拐点，此前已经大幅上涨的纯主题交易可能告一段落，未来市场将逐步回归基本面和景气定价，我们看好具备景气优势和业绩比较优势的大盘成长、大盘价值为代表的泛新能源、高端消费品等。此外，对于人工智能为代表的TMT行业，我们需要加强研究去伪存真，挖掘真正具备产业趋势的标的，同时，考虑到整体半导体的周期，我们认为三季度以半导体为代表的电子在TMT内部具备一定的比较优势。我们将在此类高景气行业中，结合产业趋势和产业链上下游优劣势比较，自下而上精选个股投资机会。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本集合计划管理人严格遵守企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和集合计划合同约定，制定了资产管理业务的估值管理办法，建立了估值委员会。估值委员会负责估值方法决策，并审议估值方法年度评估报告、金融工具估值方法确认和调整的临时议案，以及特殊情况下个别金融工具估值结果调整的临时议案等。估值委员会成员具有丰富的从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规或产品估值运作等方面的专业胜任能力。集合计划基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与自身担任基金经理的产品估值事项表决投票。

本集合计划托管人根据法律法规要求，审阅本集合计划管理人采用的估值原则及技术，履行估值及净值计算的复核责任。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。相关定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本集合计划本报告期未进行利润分配。

#### 4.8 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

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 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

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

#### 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

#### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

### §6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：招商资管智远成长灵活配置混合型集合资产管理计划

报告截止日：2023年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	27,011,056.87	12,994,359.74

结算备付金		343,390.71	1,281,642.78
存出保证金		80,748.32	93,223.95
交易性金融资产	6.4.7.2	143,916,421.17	189,668,131.76
其中：股票投资		143,916,421.17	189,668,131.76
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-1,497.66
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		10,074.28	5,002,995.34
应收股利		-	-
应收申购款		4,528.99	182,179.56
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		171,366,220.34	209,221,035.47
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年06月30日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-

应付清算款		-	-
应付赎回款		1,184,720.77	27,329.58
应付管理人报酬		210,950.67	260,694.76
应付托管费		28,126.76	34,759.29
应付销售服务费		16,274.86	33,830.41
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	90.06
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	310,397.08	280,731.02
负债合计		1,750,470.14	637,435.12
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	274,019,362.94	305,803,052.60
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-104,403,612.74	-97,219,452.25
净资产合计		169,615,750.20	208,583,600.35
负债和净资产总计		171,366,220.34	209,221,035.47

注：于报告截止日2023年6月30日，A类份额净值人民币0.4984元，份额总额240,657,046.22份；C类份额净值人民币0.4953元，份额总额100,314,295.48份；集合计划份额总额340,971,341.70份。

## 6.2 利润表

会计主体：招商资管智远成长灵活配置混合型集合资产管理计划

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年01月01日至 2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至202 2年06月30日
一、营业总收入		-16,047,692.31	-44,582,294.71
1.利息收入		120,949.07	139,252.88
其中：存款利息收入	6.4.7.9	119,495.03	139,252.88
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		1,454.04	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-29,394,908.84	-54,815,604.55
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-30,543,128.35	-56,874,922.65
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.13	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	1,148,219.51	2,059,318.10
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）	6.4.7.17	13,224,012.57	10,048,214.02
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	2,254.89	45,842.94
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>1,812,909.28</b>	<b>2,605,096.73</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,443,489.21	2,131,678.34
2. 托管费	6.4.10.2.2	192,465.18	284,223.72
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	109,503.19	121,723.20
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	6.4.7.19	-	-
7. 税金及附加		5.23	-
8. 其他费用	6.4.7.20	67,446.47	67,471.47
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-17,860,601.59	-47,187,391.44
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-17,860,601.59	-47,187,391.44
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-17,860,601.59	-47,187,391.44

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：招商资管智远成长灵活配置混合型集合资产管理计划

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30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）	305,803,052.60	-	-97,219,452.25	208,583,600.35
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）	305,803,052.60	-	-97,219,452.25	208,583,600.35

三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-31,783,689.66	-	-7,184,160.49	-38,967,850.15
（一）、综合收益总额	-	-	-17,860,601.59	-17,860,601.59
（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）	-31,783,689.66	-	10,676,441.10	-21,107,248.56
其中：1.基金申购款	3,688,029.82	-	-1,332,908.42	2,355,121.40
2.基金赎回款	-35,471,719.48	-	12,009,349.52	-23,462,369.96
（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）	274,019,362.94	-	-104,403,612.74	169,615,750.20
项目	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30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）	311,408,157.95	-	40,472,812.97	351,880,970.92

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）	311,408,157.95	-	40,472,812.97	351,880,970.92
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-20,177,603.66	-	-46,354,282.58	-66,531,886.24
（一）、综合收益总额	-	-	-47,187,391.44	-47,187,391.44
（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）	-20,177,603.66	-	833,108.86	-19,344,494.80
其中：1.基金申购款	2,806,087.10	-	12,251.44	2,818,338.54
2.基金赎回款	-22,983,690.76	-	820,857.42	-22,162,833.34
（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	291,230,554.29	-	-5,881,469.61	285,349,084.68

资产（基金净值）				
----------	--	--	--	--

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

杨阳

唐佳强

唐佳强

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

招商资管智远成长灵活配置混合型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）原为招商证券智远成长集合资产管理计划（以下简称“原集合计划”），原集合计划于2010年2月8日经中国证券监督管理委员会证监许可[2010]177号文核准，于2010年4月30日正式成立。原集合计划在募集期间收到有效净参与资金为人民币534,554,787.23元，折合认购份额534,554,787.23份；参与金额在推广期内产生的利息为人民币153,892.33元，折合153,892.33份集合计划份额；以上实收资金共计人民币534,708,679.56元，折合534,708,679.56份集合计划份额。上述出资业经天职国际会计师事务所有限公司审验，并出具了天职深核字[2010]399号验资报告。原集合计划成立时集合计划管理人为招商证券股份有限公司（2015年变更为招商证券资产管理有限公司），托管人为招商银行股份有限公司。

根据中国证监会于2018年11月28日发布的《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》（证监会公告〔2018〕39号）的规定，本集合计划已完成产品的规范验收、向中国证监会申请并获批了合同变更。

2020年8月19日，招商证券资产管理有限公司发布公告《关于“招商证券智远成长集合资产管理计划”变更为“招商资管智远成长灵活配置混合型集合资产管理计划”及其法律文件变更的公告》。

经中国证监会批准，自2020年10月13日起，《招商资管智远成长灵活配置混合型集合资产管理计划集合资产管理合同》生效，原《招商证券智远成长集合资产管理计划集合资产管理合同》自同日起失效。自合同变更生效日起，原招商证券智远成长集合资产管理计划份额变更为招商资管智远成长灵活配置混合型集合资产管理计划的A类份额。本集合计划自本集合计划合同变更生效日起存续期不得超过3年。

本集合计划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股票（包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会允许投资的股票）、债券（国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券（含分离交易可转债的纯债部分）、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券）、

资产支持证券、货币市场工具、债券回购、银行存款、同业存单、现金、股指期货、国债期货，以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本集合计划财务报表以持续经营假设为基础，按照财政部颁布的《企业会计准则》、应用指南、解释及其他相关规定并参照《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会颁布的《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>》应用指南等相关法规规定进行确认和计量，基于下述主要会计政策和会计估计进行财务报表编制。

本财务报告以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本集合计划财务报表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、完整地反映了本集合计划2023年6月30日的财务状况以及2023年1月1日至2023年6月30日的经营成果和净资产（基金净值）变动情况。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本集合计划报告期采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本集合计划无会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本集合计划无会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本集合计划无差错更正。

#### 6.4.6 税项

本集合计划目前比照证券投资基金的相关税务法规及其他相关国内税务法规计提和缴纳税款主要税项列示如下：

##### （1）增值税

根据财政部和国家税务总局2017年6月30日发布的《关于资管产品增值税有关问题的通知》，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，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税，通知自2018年1月1日起施行。对资管产品在2018

年1月1日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，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

本集合计划分别按实际缴纳的增值税额的7%、3%和2%缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

(2) 印花税

证券（股票）交易印花税税率为1%，由出让方缴纳。

(3) 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日
活期存款	27,011,056.87
等于：本金	27,002,030.03
加：应计利息	9,026.84
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	27,011,056.87

**6.4.7.2 交易性金融资产**

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	141,341,967.11	-	143,916,421.17	2,574,454.06
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	141,341,967.11	-	143,916,421.17	2,574,454.06

**6.4.7.3 衍生金融资产/负债**

本集合计划于本报告期末未持有衍生金融工具。

**6.4.7.4 买入返售金融资产****6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

本集合计划于本报告期末未持有买入返售金融资产。

**6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

本集合计划于本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

**6.4.7.5 其他资产**

本集合计划本报告期末无其他资产。

**6.4.7.6 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日

应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	115.03
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	228,335.58
其中：交易所市场	228,335.58
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用-审计费	22,439.10
预提费用-信息披露费	59,507.37
合计	310,397.08

#### 6.4.7.7 实收基金

##### 6.4.7.7.1 招商资管智远成长灵活配置混合A

金额单位：人民币元

项目 (招商资管智远成长灵活配置 混合A)	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	272,958,323.81	197,020,039.11
本期申购	2,536,334.58	1,830,701.94
本期赎回（以“-”号填列）	-34,837,612.17	-25,145,673.59
本期末	240,657,046.22	173,705,067.46

##### 6.4.7.7.2 招商资管智远成长灵活配置混合C

金额单位：人民币元

项目 (招商资管智远成长灵活配置 混合C)	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	108,783,013.49	108,783,013.49
本期申购	1,857,327.88	1,857,327.88
本期赎回（以“-”号填列）	-10,326,045.89	-10,326,045.89
本期末	100,314,295.48	100,314,295.48

**6.4.7.8 未分配利润****6.4.7.8.1 招商资管智远成长灵活配置混合A**

单位：人民币元

项目 (招商资管智远成长灵活配置混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	72,177,575.64	-119,872,978.50	-47,695,402.86
本期利润	-22,178,511.16	9,381,898.93	-12,796,612.23
本期基金份额交易产生的变动数	-6,806,095.86	13,526,623.51	6,720,527.65
其中：基金申购款	576,248.87	-1,051,566.68	-475,317.81
基金赎回款	-7,382,344.73	14,578,190.19	7,195,845.46
本期已分配利润	-	-	-
本期末	43,192,968.62	-96,964,456.06	-53,771,487.44

**6.4.7.8.2 招商资管智远成长灵活配置混合C**

单位：人民币元

项目 (招商资管智远成长灵活配置混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-38,780,273.39	-10,743,776.00	-49,524,049.39
本期利润	-8,906,103.00	3,842,113.64	-5,063,989.36
本期基金份额交易产生的变动数	3,343,272.67	612,640.78	3,955,913.45
其中：基金申购款	-722,388.36	-135,202.25	-857,590.61
基金赎回款	4,065,661.03	747,843.03	4,813,504.06
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-44,343,103.72	-6,289,021.58	-50,632,125.30

**6.4.7.9 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2023年01月01日至2023年06月30日
活期存款利息收入	113,648.48
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	5,155.55
其他	691.00
合计	119,495.03

#### 6.4.7.10 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01月01日至2023年06月30日
卖出股票成交总额	370,245,237.73
减：卖出股票成本总额	399,843,083.42
减：交易费用	945,282.66
买卖股票差价收入	-30,543,128.35

#### 6.4.7.11 基金投资收益

本集合计划本报告期无基金投资收益。

#### 6.4.7.12 债券投资收益

本集合计划本报告期无债券投资收益。

#### 6.4.7.13 资产支持证券投资收益

本集合计划本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

本集合计划本报告期无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

本集合计划本报告期无衍生工具收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
股票投资产生的股利收益	1,148,219.51
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	1,148,219.51

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
1.交易性金融资产	13,224,012.57
——股票投资	13,224,012.57
——债券投资	-
——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	13,224,012.57

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
基金赎回费收入	2,254.89
合计	2,254.89

**6.4.7.19 信用减值损失**

本集合计划本报告期无信用减值损失。

**6.4.7.20 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
审计费用	7,439.10
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	500.00
合计	67,446.47

**6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明****6.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本集合计划无需要披露的或有事项。

**6.4.8.2 资产负债表日后事项**

截至本财务报表批准报出日，本集合计划无需要披露的资产负债表日后事项。

**6.4.9 关联方关系****6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况**

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。

**6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方**

关联方名称	与本基金的关系
招商证券资产管理有限公司	集合计划管理人
招商银行股份有限公司	集合计划托管人
招商证券股份有限公司	集合计划管理人的控股股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

**6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易****6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.10.1.1 股票交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30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
招商证券股份有限公司	709,191,489.13	100.00%	1,081,712,601.54	100.00%

**6.4.10.1.2 权证交易**

本集合计划于本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

**6.4.10.1.3 债券交易**

本集合计划于本报告期以及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

**6.4.10.1.4 债券回购交易**

本集合计划于本报告期以及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

**6.4.10.1.5 基金交易**

本集合计划于本报告期以及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的基金交易。

**6.4.10.1.6 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01月01日至2023年06月30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
招商证券股份有限公司	518,624.49	100.00%	228,335.58	100.00%
关联方名称	上年度可比期间			

	2022年01月01日至2022年06月30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
招商证券股份有限公司	782,610.08	100.00%	236,074.88	100.00%

注：上述佣金按市场佣金率计算，并已扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取，并由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,443,489.21	2,131,678.34
其中：支付销售机构的客户维护费	690,602.58	1,057,708.15

注：本集合计划管理费按前一日集合计划资产净值的1.5%年费率计提，计算方法如下：

$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$ ，其中：

H为每日应计提的集合计划管理费

E为前一日集合计划资产净值

集合计划管理费每日计提，逐日累计，按月支付。由管理人向托管人发送集合计划管理费划付指令，托管人复核后于次月的首日起5个工作日内从集合计划资产中一次性支付给管理人。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	192,465.18	284,223.72

注：本集合计划托管费按前一日集合计划资产净值的0.2%年费率计提，计算方法如下：

$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$ ，其中：

H为每日应计提的集合计划托管费

E为前一日集合计划资产净值

集合计划托管费每日计提，逐日累计，按月支付。由管理人向托管人发送集合计划托管费划付指令，托管人复核后于次月的首日起5个工作日内从集合计划资产中一次性支付给托管人。

#### 6.4.10.2.3 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01月01日至2023年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	招商资管智远成长灵活配置混合A	招商资管智远成长灵活配置混合C	合计
招商证券股份有限公司	0.00	71,090.67	71,090.67
招商银行股份有限公司	0.00	38,049.52	38,049.52
合计	0.00	109,140.19	109,140.19
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	招商资管智远成长灵活配置混合A	招商资管智远成长灵活配置混合C	合计
招商证券股份有限公司	0.00	59,514.94	59,514.94
招商银行股份有限公司	0.00	62,208.26	62,208.26
合计	0.00	121,723.20	121,723.20

注：本集合计划A类份额不收取销售服务费，C类份额的销售服务费年费率为0.4%。本销售服务费将专门用于本集合计划C类份额的销售与C类集合计划份额持有人服务，管理人将在集合计划年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。销售服务费计提的计算公式如下：

$$H = E \times 0.4\% \div \text{当年天数}$$

H为C类份额每日应计提的销售服务费

E为C类份额前一日资产净值

销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经管理人与托管人双方核对无误后，托管人按照与管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从集合计划财产中一次性支付给集合计划管理人，由集合计划管理人按规定支付给各销售机构。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本集合计划于本报告期及上年度可比期间未发生与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 6.4.10.4 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

##### 6.4.10.4.1 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

本集合计划本报告期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。

##### 6.4.10.4.2 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

本集合计划本报告期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。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

招商资管智远成长灵活配置混合A

份额单位：份

项目	本期 2023年01月01日至 2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至 2022年06月30日
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

招商资管智远成长灵活配置混合C

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2023年01月01日至 2023年06月30日	2022年01月01日至 2022年06月30日
报告期初持有的基金份额	36,792,113.96	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	36,792,113.96	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	36.68%	-

注：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）。

#### 6.4.10.5.2 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，没有除集合计划管理人之外的其他关联方投资本集合计划的情况。

#### 6.4.10.6 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		上年度可比期间	
	2023年01月01日至2023年06月30日		2022年01月01日至2022年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司	27,011,056.87	113,648.48	26,015,493.37	131,243.49

注：本基金的上述银行存款由基金托管人保管，按银行同业利率或约定利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本集合计划于本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本集合计划于本报告期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本集合计划本报告期末未发生利润分配。

## 6.4.12 期末（2023年06月30日）本基金持有的流通受限证券

## 6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 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
688343	云天励飞	2023-03-28	6个月	科创板打新限售	43.92	57.36	2,828	124,205.76	162,214.08	-
001286	陕西能源	2023-03-31	6个月	新股锁定	9.60	9.93	2,137	20,515.20	21,220.41	-
301358	湖南裕能	2023-02-01	6个月	创业板打新限售	23.77	42.86	264	6,275.28	11,315.04	-
301325	曼恩斯特	2023-05-04	6个月	创业板打新限售	76.80	109.44	92	7,065.60	10,068.48	-
688469	中芯集成	2023-04-28	6个月	科创板打新限售	5.69	5.45	1,713	9,746.97	9,335.85	-
301293	三博脑科	2023-04-25	6个月	创业板打新限售	29.60	76.13	110	3,256.00	8,374.30	-
688562	航天软件	2023-05-15	6个月	科创板打新限售	12.68	25.35	322	4,082.96	8,162.70	-
688249	晶合集成	2023-04-24	6个月	科创板打新限售	19.86	18.07	423	8,400.78	7,643.61	-
688531	日联科技	2023-03-24	6个月	科创板打新限售	152.38	139.16	52	7,923.76	7,236.32	-
688478	晶升股份	2023-04-13	6个月	科创板打新限售	32.52	43.22	166	5,398.32	7,174.52	-
688146	中船特气	2023-04-13	6个月	科创板打新限售	36.15	39.34	173	6,253.95	6,805.82	-
688484	南芯科技	2023-03-28	6个月	科创板打新限售	39.99	38.64	176	7,038.24	6,800.64	-
301382	蜂助手	2023-05-09	6个月	创业板打新限售	23.80	35.90	159	3,784.20	5,708.10	-
688458	美芯晟	2023-05-15	6个月	科创板打新限售	75.00	90.95	61	4,575.00	5,547.95	-
301322	绿通科技	2023-02-27	6个月	创业板打新限售	131.11	53.20	101	8,784.37	5,373.20	-

688552	航天南湖	2023-05-08	6个月	科创板打新限售	21.17	24.18	221	4,678.57	5,343.78	-
301439	泓淋电力	2023-03-10	6个月	创业板打新限售	19.99	16.91	307	6,136.93	5,191.37	-
688581	安杰思	2023-05-12	6个月	科创板打新限售	125.80	118.08	43	5,409.40	5,077.44	-
301332	德尔玛	2023-05-09	6个月	创业板打新限售	14.81	13.74	365	5,405.65	5,015.10	-
688535	华海诚科	2023-03-28	6个月	科创板打新限售	35.00	54.75	83	2,905.00	4,544.25	-
301373	凌玮科技	2023-01-20	6个月	创业板打新限售	33.73	31.84	142	4,789.66	4,521.28	-
688512	慧智微	2023-05-08	6个月	科创板打新限售	20.92	19.23	223	4,665.16	4,288.29	-
603135	中重科技	2023-03-29	6个月	新股锁定	17.80	19.09	183	3,257.40	3,493.47	-
301386	未来电器	2023-03-21	6个月	创业板打新限售	29.99	23.78	144	4,318.56	3,424.32	-
301281	科源制药	2023-03-28	6个月	创业板打新限售	44.18	25.36	116	3,666.94	2,941.76	-
301337	亚华电子	2023-05-16	6个月	创业板打新限售	32.60	32.24	87	2,836.20	2,804.88	-
601133	柏诚股份	2023-03-31	6个月	新股锁定	11.66	13.72	192	2,238.72	2,634.24	-
601065	江盐集团	2023-03-31	6个月	新股锁定	10.36	12.59	207	2,144.52	2,606.13	-
001328	登康口腔	2023-03-29	6个月	新股锁定	20.68	29.79	71	1,468.28	2,115.09	-
001380	华纬科技	2023-05-09	6个月	新股锁定	28.84	30.85	48	1,384.32	1,480.80	-
001360	南矿集团	2023-03-31	6个月	新股锁定	15.38	16.45	84	1,291.92	1,381.80	-
001282	三联锻造	2023-05-15	6个月	新股锁定	27.93	33.12	38	1,061.34	1,258.56	-
001324	长青科技	2023-05-12	6个月	新股锁定	18.88	20.03	58	1,095.04	1,161.74	-

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本集合计划本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.12.4 期末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持有因参与转融通证券出借业务而出借的证券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本集合计划在日常经营活动中涉及的风险主要包括市场风险、流动性风险及信用风险。本集合计划管理人制定了相应的政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本集合计划管理人建立了由风险管理部、法律合规部组成的风险控制职能部门，独立开展对业务和相关操作的风险评价。风险管理部、法律合规部等互相配合，建立信息沟通机制，从事前、事中、事后全面进行业务风险监控。此外，业务部门也建立了自身的内部控制机制，主要由授权体系和业务后台部门信息监控机制组成。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指计划在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者计划所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致计划资产损失和收益变化的风险。本集合计划均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本集合计划在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，在银行间同业市场交易前对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本集合计划本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的债券投资。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本集合计划本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### **6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

本集合计划本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

#### **6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

本集合计划本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的债券投资。

#### **6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

本集合计划本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### **6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

本集合计划本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

### **6.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是在市场或持有资产流动性不足的情况下，计划管理人可能无法迅速、低成本地调整计划投资组合，从而对计划收益造成不利影响。流动性风险一般存在两种形式：资产变现风险和现金流风险。

#### **(1) 资产变现风险**

资产变现风险是指由于计划持有的某个券种的头寸相对于市场正常的交易量过大，或由于停牌造成交易无法在当前的市场价格下成交。本集合计划管理人应用定量方法对各持仓品种的变现能力进行测算和分析，以对资产变现风险进行管理。

#### **(2) 现金流风险**

现金流风险是指计划因现金流不足导致无法应对正常计划支付义务的风险。本集合计划管理人对计划每日和每周净退出比例进行测算和分析，以对该风险进行跟踪和管理。此外，本集合计划管理人建立了现金头寸控制机制，以确保退出款项的及时支付。

#### **6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析**

本集合计划的管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本集合计划组合资产的流动性风险进行管理。

本报告期内，本集合计划未发生重大流动性风险事件。

### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指集合计划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。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指集合计划的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本集合计划持有的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金等，其余金融资产及金融负债不计息。本集合计划的管理人定期对本计划面临的利率风险敞口进行监控，以对该风险进行管理。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 06 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	27,011,056.87	-	-	-	-	-	27,011,056.87
结算备付金	343,390.71	-	-	-	-	-	343,390.71
存出保证金	80,748.32	-	-	-	-	-	80,748.32
交易性金融资产	-	-	-	-	-	143,916,421.17	143,916,421.17
应收清算款	-	-	-	-	-	10,074.28	10,074.28
应收申购款	-	-	-	-	-	4,528.99	4,528.99
资产总计	27,435,195.90	-	-	-	-	143,931,024.44	171,366,220.34
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,184,720.77	1,184,720.77
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	210,950.67	210,950.67
应付托管费	-	-	-	-	-	28,126.76	28,126.76
应付销售服务费	-	-	-	-	-	16,274.86	16,274.86
其他负债	-	-	-	-	-	310,397.08	310,397.08
负债总计	-	-	-	-	-	1,750,470.14	1,750,470.14

## 招商资管智远成长灵活配置混合型集合资产管理计划 2023 年中期报告

计							
利率敏感度缺口	27,435,195.90	-	-	-	-	142,180,554.30	169,615,750.20
上年度末 2022年 12月31 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	12,994,359.74	-	-	-	-	-	12,994,359.74
结算备付金	1,281,642.78	-	-	-	-	-	1,281,642.78
存出保证金	93,223.95	-	-	-	-	-	93,223.95
交易性金融资产	-	-	-	-	-	189,668,131.76	189,668,131.76
应收清算款	-	-	-	-	-	5,002,995.34	5,002,995.34
应收申购款	-	-	-	-	-	182,179.56	182,179.56
买入返售金融资产	-1,497.66	-	-	-	-	-	-1,497.66
资产总计	14,367,728.81	-	-	-	-	194,853,306.66	209,221,035.47
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	27,329.58	27,329.58
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	260,694.76	260,694.76
应付托管费	-	-	-	-	-	34,759.29	34,759.29
应付销售服务费	-	-	-	-	-	33,830.41	33,830.41
应交税费	-	-	-	-	-	90.06	90.06
其他负债	-	-	-	-	-	280,731.02	280,731.02
负债总计	-	-	-	-	-	637,435.12	637,435.12
利率敏感度缺口	14,367,728.81	-	-	-	-	194,215,871.54	208,583,600.35

注：上表统计了本集合计划交易的利率风险敞口。表中所示为本集合计划资产及交易形成负债的公允价值，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。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本集合计划本报告期末及上年度末未持有债券资产（不含转债），因此市场利率的变动对于本集合计划资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本集合计划的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率以外的市场因素发生变动时产生的价格波动风险。本集合计划的其他价格风险主要为市场价格变化或波动所引起的投资资产损失的可能性。本集合计划通过投资组合的分散化降低市场价格风险。此外，本集合计划管理人通过建立多层次的风险指标体系，对其他价格风险进行持续的度量和分析，以对该风险进行管理。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30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	143,916,421.17	84.85	189,668,131.76	90.93
交易性金融资产 — 基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产 — 债券投资	-	-	-	-
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	143,916,421.17	84.85	189,668,131.76	90.93

注：本表中交易性金融资产-债券投资科目仅包含可转换公司债券和可交换公司债券等。

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的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06月30日	上年度末 2022年12月31日
	上涨5%	12,822,890.61	14,555,801.58
	下降5%	-12,822,890.61	-14,555,801.58

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 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公开报价。

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。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	143,574,155.85	189,440,941.67
第二层次	-	227,190.09
第三层次	342,265.32	-
合计	143,916,421.17	189,668,131.76

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本集合计划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，本集合计划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；本集

合计划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。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本集合计划本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

#### 6.4.14.4 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资产和负债主要包括银行存款、结算备付金和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本集合计划无需要说明的其他重要事项。

## §7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	143,916,421.17	83.98
	其中：股票	143,916,421.17	83.98
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	-	-
	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	27,354,447.58	15.96
8	其他各项资产	95,351.59	0.06
9	合计	171,366,220.34	100.00

本集合计划本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 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	99,827,129.03	58.85
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	21,220.41	0.01
E	建筑业	6,862,184.09	4.05
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	16,977,435.14	10.01
J	金融业	6,861,549.00	4.05
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	2,533,195.92	1.49
N	水利、环境和公共设施管理业	10,825,333.28	6.38
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	8,374.30	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	143,916,421.17	84.85

### 7.2.2 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。

## 7.3 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

金额单位：人民币元

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	377,584	10,825,333.28	6.38
2	688036	传音控股	66,122	9,719,934.00	5.73
3	002555	三七互娱	267,000	9,312,960.00	5.49
4	688556	高测股份	174,355	9,265,224.70	5.46
5	002965	祥鑫科技	162,200	9,031,296.00	5.32
6	605117	德业股份	54,280	8,117,574.00	4.79
7	601186	中国铁建	696,401	6,859,549.85	4.04
8	300693	盛弘股份	177,918	6,568,732.56	3.87
9	000589	贵州轮胎	893,820	5,005,392.00	2.95
10	603305	旭升集团	176,820	4,927,973.40	2.91
11	688517	金冠电气	217,619	4,778,913.24	2.82
12	601318	中国平安	99,600	4,621,440.00	2.72
13	688111	金山办公	8,627	4,073,841.94	2.40
14	002409	雅克科技	55,700	4,059,416.00	2.39
15	000938	紫光股份	114,500	3,646,825.00	2.15
16	600690	海尔智家	147,200	3,456,256.00	2.04
17	688031	星环科技	25,606	3,411,743.44	2.01
18	600085	同仁堂	59,000	3,396,040.00	2.00
19	000568	泸州老窖	15,600	3,269,292.00	1.93
20	688012	中微公司	20,882	3,266,988.90	1.93
21	600150	中国船舶	96,200	3,165,942.00	1.87
22	002371	北方华创	8,600	2,731,790.00	1.61
23	000425	徐工机械	393,000	2,660,610.00	1.57
24	600600	青岛啤酒	24,900	2,580,387.00	1.52
25	688073	毕得医药	35,699	2,526,775.22	1.49
26	600887	伊利股份	85,600	2,424,192.00	1.43
27	002271	东方雨虹	86,200	2,349,812.00	1.39

28	688981	中芯国际	45,074	2,277,138.48	1.34
29	601658	邮储银行	458,100	2,240,109.00	1.32
30	000977	浪潮信息	44,400	2,153,400.00	1.27
31	300502	新易盛	12,100	822,437.00	0.48
32	688343	云天励飞	2,828	162,214.08	0.10
33	001286	陕西能源	2,137	21,220.41	0.01
34	301358	湖南裕能	264	11,315.04	0.01
35	301325	曼恩斯特	92	10,068.48	0.01
36	688469	中芯集成	1,713	9,335.85	0.01
37	301293	三博脑科	110	8,374.30	0.00
38	688562	航天软件	322	8,162.70	0.00
39	688249	晶合集成	423	7,643.61	0.00
40	688531	日联科技	52	7,236.32	0.00
41	688478	晶升股份	166	7,174.52	0.00
42	688146	中船特气	173	6,805.82	0.00
43	688484	南芯科技	176	6,800.64	0.00
44	301230	泓博医药	143	6,420.70	0.00
45	301382	蜂助手	159	5,708.10	0.00
46	688458	美芯晟	61	5,547.95	0.00
47	301322	绿通科技	101	5,373.20	0.00
48	688552	航天南湖	221	5,343.78	0.00
49	301361	众智科技	186	5,243.34	0.00
50	301439	泓淋电力	307	5,191.37	0.00
51	688581	安杰思	43	5,077.44	0.00
52	301332	德尔玛	365	5,015.10	0.00
53	301277	新天地	245	4,779.95	0.00
54	688535	华海诚科	83	4,544.25	0.00
55	301373	凌玮科技	142	4,521.28	0.00
56	688512	慧智微	223	4,288.29	0.00
57	301388	欣灵电气	133	3,571.05	0.00
58	603135	中重科技	183	3,493.47	0.00

59	301335	天元宠物	144	3,432.96	0.00
60	301386	未来电器	144	3,424.32	0.00
61	301359	东南电子	133	3,388.84	0.00
62	301281	科源制药	116	2,941.76	0.00
63	301337	亚华电子	87	2,804.88	0.00
64	601133	柏诚股份	192	2,634.24	0.00
65	601065	江盐集团	207	2,606.13	0.00
66	001328	登康口腔	71	2,115.09	0.00
67	001380	华纬科技	48	1,480.80	0.00
68	001360	南矿集团	84	1,381.80	0.00
69	001282	三联锻造	38	1,258.56	0.00
70	001324	长青科技	58	1,161.74	0.00

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 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	002555	三七互娱	9,087,745.00	4.36
2	601186	中国铁建	8,932,941.90	4.28
3	301260	格力博	8,412,318.85	4.03
4	688556	高测股份	8,395,835.01	4.03
5	688036	传音控股	8,077,180.69	3.87
6	688022	瀚川智能	6,080,379.58	2.92
7	300364	中文在线	5,788,010.00	2.77
8	001269	欧晶科技	5,778,549.00	2.77
9	002965	祥鑫科技	5,568,450.00	2.67
10	688409	富创精密	5,410,225.86	2.59
11	000568	泸州老窖	5,406,325.00	2.59
12	300217	东方电热	5,287,657.23	2.54
13	688012	中微公司	5,197,132.68	2.49

14	601318	中国平安	5,123,576.98	2.46
15	002409	雅克科技	5,050,922.00	2.42
16	000589	贵州轮胎	4,990,665.00	2.39
17	688498	源杰科技	4,833,880.44	2.32
18	688596	正帆科技	4,779,491.16	2.29
19	688365	光云科技	4,755,520.72	2.28
20	000063	中兴通讯	4,720,787.00	2.26
21	300059	东方财富	4,690,106.00	2.25
22	603305	旭升集团	4,689,668.00	2.25
23	300383	光环新网	4,299,445.00	2.06
24	601668	中国建筑	4,201,713.80	2.01

注：本项的“买入金额”均按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 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	002738	中矿资源	12,844,122.80	6.16
2	603876	鼎胜新材	8,804,513.32	4.22
3	600745	闻泰科技	8,524,323.00	4.09
4	300438	鹏辉能源	7,998,142.00	3.83
5	688301	奕瑞科技	6,927,037.07	3.32
6	688063	派能科技	6,699,147.69	3.21
7	002812	恩捷股份	6,418,086.00	3.08
8	300594	朗进科技	6,281,080.00	3.01
9	605128	上海沿浦	6,268,196.00	3.01
10	002475	立讯精密	6,218,308.00	2.98
11	301260	格力博	5,873,089.81	2.82
12	688663	新风光	5,805,792.80	2.78
13	688020	方邦股份	5,792,519.03	2.78

14	688365	光云科技	5,746,687.45	2.76
15	301046	能辉科技	5,719,011.00	2.74
16	688248	南网科技	5,577,452.78	2.67
17	300364	中文在线	5,440,447.00	2.61
18	688503	聚和材料	5,431,464.11	2.60
19	688409	富创精密	5,283,267.08	2.53
20	002865	钧达股份	5,172,579.00	2.48
21	688676	金盘科技	5,125,667.85	2.46
22	300418	昆仑万维	5,096,344.08	2.44
23	688596	正帆科技	5,071,545.60	2.43
24	300059	东方财富	5,003,114.80	2.40
25	000625	长安汽车	4,872,608.00	2.34
26	688498	源杰科技	4,819,518.85	2.31
27	688022	瀚川智能	4,583,974.00	2.20
28	000063	中兴通讯	4,537,554.00	2.18
29	300217	东方电热	4,357,479.00	2.09
30	001269	欧晶科技	4,351,363.00	2.09

注：本项的“卖出金额”均按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	340,867,360.26
卖出股票收入（成交）总额	370,245,237.73

注：本项“买入股票成本”、“卖出股票收入”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。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本集合计划本报告期末未持有债券。

#### 7.6 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

本集合计划本报告期末未持有债券。

**7.7 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**

本集合计划本报告期末未持有资产支持证券。

**7.8 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**

本集合计划本报告期末未持有贵金属。

**7.9 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**

本集合计划本报告期末未持有权证。

**7.10 本基金投资股指期货的投资政策**

本集合计划本报告期内未参与股指期货投资。

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****7.11.1 本期国债期货投资政策**

本集合计划本报告期内未参与国债期货投资。

**7.11.2 本期国债期货投资评价**

本集合计划本报告期内未参与国债期货投资。

**7.12 投资组合报告附注**

**7.12.1** 本集合计划投资的前十名证券的发行主体中，三七互娱网络科技集团股份有限公司在本期内被中国证券监督管理委员会立案调查。其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。

**7.12.2** 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。

**7.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	80,748.32
2	应收清算款	10,074.28
3	应收股利	-

4	应收利息	-
5	应收申购款	4,528.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	95,351.59

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本集合计划本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 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。

#### 7.12.6 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。

### §8 基金份额持有人信息

#### 8.1 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
招商资管智远成长灵活配置混合A	4,645	51,809.91	2,854,948.59	1.19%	237,802,097.63	98.81%
招商资管智远成长灵活配置混合C	1,031	97,298.06	36,792,113.96	36.68%	63,522,181.52	63.32%
合计	5,676	60,072.47	39,647,062.55	11.63%	301,324,279.15	88.37%

注：（1）分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，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）；（2）户均持有的基金份额合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

### 8.2 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	招商资管智远成长灵活配置混合A	1,412,400.40	0.59%
	招商资管智远成长灵活配置混合C	272,515.93	0.27%
	合计	1,684,916.33	0.49%

注：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）。

### 8.3 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	招商资管智远成长灵活配置混合A	>100
	招商资管智远成长灵活配置混合C	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	招商资管智远成长灵活配置混合A	0
	招商资管智远成长灵活配置混合C	0
	合计	0

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

	招商资管智远成长灵活配置混合A	招商资管智远成长灵活配置混合C
基金合同生效日(2020年10月13日)基金份额总额	16,838,429.88	-
本报告期期初基金份额总额	272,958,323.81	108,783,013.49
本报告期基金总申购份额	2,536,334.58	1,857,327.88

减：本报告期基金总赎回份额	34,837,612.17	10,326,045.89
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	240,657,046.22	100,314,295.48

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本集合计划本报告期未召开份额持有人大会。

### 10.2 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

本集合计划管理人于2023年1月11日发布公告，自2023年1月10日起，范文孟先生离任公司副总经理。

本报告期内，本集合计划托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生涉及本集合计划管理人、本集合计划财产或本集合计划托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本集合计划的投资策略未发生重大变化。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本集合计划未改聘会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，本集合计划管理人及相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，本集合计划托管人的托管业务部门及相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易	股票交易	应支付该券商的佣金	备
------	----	------	-----------	---

	单元数量					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	
招商证券股份有限公司	2	709,191,489.13	100.00%	518,624.49	100.00%	-

注：（1）本报告期本集合计划交易单元未发生变更。

（2）交易单元的选择标准：

- 1) 公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好；
- 2) 公司具有较强的研究能力,能及时、全面地为集合计划提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告；
- 3) 公司内部管理规范，能满足集合计划操作的保密要求；
- 4) 建立了广泛的信息网络,能及时提供准确的信息资讯服务。

（3）交易单元的选择程序：本集合计划管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构，集合计划管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

## 10.8 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	招商证券资产管理有限公司关于旗下参照公募基金管理运作的集合资产管理计划2023年1季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊、管理人网站	2023-04-21
2	招商资管智远成长灵活配置混合型集合资产管理计划2023年第1季度报告	中国证监会基金电子披露网站、管理人网站	2023-04-21
3	招商证券资产管理有限公司关于旗下参照公募基金管理运作的集合资产管理计划2022年年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊、管理人网站	2023-03-24
4	招商资管智远成长灵活配置混合型集合资产管理计划2022年年度报告	中国证监会基金电子披露网站、管理人网站	2023-03-24
5	招商证券资产管理有限公司住所	中国证监会基金电子	2023-03-07

	变更公告	披露网站、中国证监会规定报刊、管理人网站	
6	招商证券资产管理有限公司关于旗下参照公募基金管理运作的集合资产管理计划2022年4季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊、管理人网站	2023-01-20
7	招商资管智远成长灵活配置混合型集合资产管理计划2022年第4季度报告	中国证监会基金电子披露网站、管理人网站	2023-01-20
8	招商资管智远成长灵活配置混合型集合资产管理计划招募说明书（更新）及产品资料概要（更新）提示性公告	中国证监会规定报刊、管理人网站	2023-01-13
9	招商证券资产管理有限公司关于旗下部分参照公募基金管理运作集合资产管理计划参加上海天天基金销售有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会基金电子披露网站、中国证监会规定报刊、管理人网站	2023-01-11
10	招商资管智远成长灵活配置混合型集合资产管理计划基金经理变更公告	中国证监会基金电子披露网站、中国证监会规定报刊、管理人网站	2023-01-11
11	招商证券资产管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会基金电子披露网站、中国证监会规定报刊、管理人网站	2023-01-11

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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

本集合计划本报告期未出现单一投资者持有集合计划份额比例达到或超过20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §12 备查文件目录

### 12.1 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成长集合资产管理计划合同变更的回函；
2. 《招商资管智远成长灵活配置混合型集合资产管理计划集合资产管理合同》；
3. 《招商资管智远成长灵活配置混合型集合资产管理计划托管协议》；
4. 《招商资管智远成长灵活配置混合型集合资产管理计划招募说明书》；
5. 《招商资管智远成长灵活配置混合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。

### 12.2 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/>。

### 12.3 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  
二〇二三年八月二十九日