

招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划

2024 年中期报告

2024 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:中国证券登记结算有限责任公司

送出日期:2024 年 08 月 21 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。

基金托管人中国证券登记结算有限责任公司根据本集合计划合同规定，于2024年08月20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集合计划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2022年4月25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2024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	7
§4 管理人报告	8
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.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	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.....	12
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 净资产变动表	17
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告.....	38
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 债券回购融资情况.....	39
7.3 基金投资组合平均剩余期限	39
7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	40
7.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细	41
7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离	41
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细.....	42
7.9 投资组合报告附注.....	42
§8 基金份额持有人信息.....	43
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	43
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况	43
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	44
8.4 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.....	44
§9 开放式基金份额变动.....	44

§10 重大事件揭示.....	44
10.1 基金份额持有人大会决议.....	44
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.....	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	45
10.4 基金投资策略的改变.....	45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	45
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.....	45
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	45
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	46
10.9 其他重大事件.....	47
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	56
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.....	56
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	56
§12 备查文件目录.....	56
12.1 备查文件目录.....	56
12.2 存放地点.....	56
12.3 查阅方式.....	56

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划
基金简称	招商资管智远天添利货币
基金主代码	880013
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022年04月25日
基金管理人	招商证券资产管理有限公司
基金托管人	中国证券登记结算有限责任公司
报告期末基金份额总额	38,536,638,668.01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。

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	本集合计划是在不影响委托人正常证券交易的前提下，委托人用资金账户中的资金申购本集合计划。本集合计划将主要投资于各类存款、债券回购等短期金融工具，并适当配置一定比例的固定收益类金融产品，从而力争为委托人取得超越活期存款利率的收益。
投资策略	本集合计划通过对货币政策、宏观经济运行状况、利率走势、资金供求变化情况进行深入研究，评估各类投资品种的流动性、收益性和风险特征，确定各类投资品种的配置比例及期限组合，并适时进行动态调整。由于本集合计划的目的是在不影响委托人的正常证券交易下，实现客户交易结算资金的增值，因此本集合计划的投资应坚持下列原则：（1）确保集合计划资产充分的流动性或者有相应的应急措施能保证委托人的正常交易；（2）确保集合计划资产充分的安全性。

	或者有相应的应急措施保证委托人的资产安全与避免负收益的出现；（3）在遵循上述两条原则的前提下，合理安排集合计划资产流动性，实现集合计划资产的增值。
业绩比较基准	中国人民银行公布的活期存款基准利率（税后）*100%
风险收益特征	本集合计划为货币市场型集合资产管理计划，预期风险和预期收益与货币市场基金相同，低于债券型基金、混合型基金和股票型基金。

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	中国证券登记结算有限责任公司
信息披露负责人	姓名	唐佳强	陈晨
	联系电话	0755-26951111	010-50938723
	电子邮箱	tangjq@cmschina.com.cn	zctg@chinaclear.com.cn
客户服务电话		95565	4008-058-058
传真		-	-
注册地址		深圳市前海深港合作区南山街道听海大道5059号前海鸿荣源中心A座2501	北京市西城区太平桥大街17号
办公地址		深圳市福田区福华一路111号招商证券大厦17、18楼	北京市西城区锦什坊街26号
邮政编码		518026	100033
法定代表人		易卫东	于文强

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	https://amc.cmschina.com/

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 (2024年01月01日-2024年06月30日)
本期已实现收益	223,766,682.73
本期利润	223,766,682.73
本期净值收益率	0.5699%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2024年06月30日)
期末基金资产净值	38,536,638,668.01
期末基金份额净值	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2024年06月30日)
累计净值收益率	2.5509%

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 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

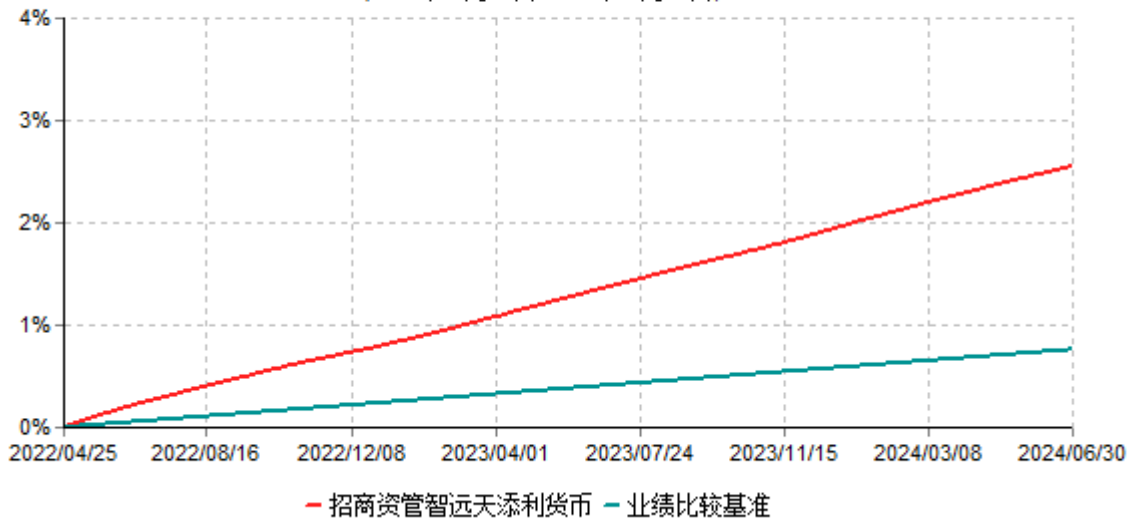
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.0840%	0.0001%	0.0284%	0.0000%	0.0556%	0.0001%
过去三个月	0.2710%	0.0003%	0.0862%	0.0000%	0.1848%	0.0003%
过去六个月	0.5699%	0.0003%	0.1726%	0.0000%	0.3973%	0.0003%
过去一年	1.1602%	0.0003%	0.3477%	0.0000%	0.8125%	0.0003%
自基金合同生效起至今	2.5509%	0.0004%	0.7602%	0.0000%	1.7907%	0.0004%

注：（1）本集合计划属于货币型集合资产管理计划，本集合计划业绩比较基准为“中国人民银行公布的活期存款基准利率（税后）”；

（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收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2022年04月25日-2024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，业务范围为公开募集证券投资基金管理业务、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		
陈功谋	本集合计划的基金经理	2022-04-25	-	13	武汉大学会计专业硕士，5年以上投资交易经历。2011年入职招商证券股份有限公司财务部，2016年-2017年历任财务部资金交易员、债券交易员，同时负责公司流动性管理工作，2018年-2020年任资金管理部司库投资经理，2020年9月入职招商证券资产管理有限公司。担任【招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划】基金经理（自2022年4月25日起任职）。
曾琦	本集合计划的基金经理	2022-04-25	-	19	CFA，南开大学金融学硕士，20年以上证券从业和投资经历，现任公募投资部基金经理。曾任招商证券股份有限公司资产管理部产品设计经理、理财投资部投资经理，招商证券资产管

					理有限公司固收投资部投资经理。担任【招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划】基金经理（自2022年4月25日起任职）。曾任【招商资管智远增利债券型集合资产管理计划】基金经理（自2021年11月18日至2023年12月4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合规守信情况的说明

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，未发现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

6月份，中国官方制造业PMI为49.5%，与前值持平，连续2个月处于收缩区间。制造业景气度整体稳定，从供需来看，生产仍偏强，需求仍偏弱，其中，新出口订单指数与上月持平，仍处于48.3%，显示外需仍对当前制造业订单形成拖累。5月CPI同比持平，PPI同比回升至-1.4%，PPI环比自去年11月以来首次转正，显示出物价延续温和回升态势。5月M2同比增长7%，M1同比下降4.2%，M1和M2的剪刀差扩大，显示出银行停止补息的背景下，企业经营活力偏弱，活期存款溢出至理财、非银等广义基金产品中去。

政策面上，央行多次对长端利率进行表态，提示长端利率快速下行的风险。其央行发布的《一季度货币政策执行报告》将长期国债内容列入专栏，并指出我国长期国债收益率在反映市场预期和宏观经济方面总体是有效的。1月份，央行下调了存款准备金率0.5%，2月份，5年期LPR下调25bp，5月中旬，央行宣布下调住房贷款最低首付比例，首套房最低首付降至15%，二套房最低首付降至25%，取消全国层面首套住房和二套住房商业性个人住房贷款利率政策下限，并下调公积金贷款利率0.25个百分点，各地新政执行细则逐步从二三线城市到一线城市展开落地。6月份，发改委表示，去年增发的1万亿国债项目加快建设，截至5月末项目开工率已超过80%，下一步将加快推动“两重”“双新”等各项政策落地见效。

上半年资金面整体充裕，资金加权利率波动较小，但一季度资金分层较为明显，二季度定价隔夜资金价格回落，央行日常的投放量维持地量，仅仅是月末或季末加大投放力度，平抑资金的波动，六月份受暂停存款账户贴息政策影响，非银产品成为市场流动性的重要供给方。受基本面影响，在机构与监管博弈下，上半年广谱利率仍呈现震荡下行的走势。半年来看，1年期国债收益率下行54bp至1.54%；10年期国债收益率下行35bp至2.21%；30年期国债收益率下行40bp至2.43%。

存单收益率随短端国债利率同步下行，组合的静态收益率有所下降，日常杠杆规模随资金利率而调整。产品跨季期间规模略有下降，仍在预期之内，时点平均剩余期限相对较高。安排好资金到期，保证流动性的同时，在资金紧张时期对优势品种进行投资有利于产品获取超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，基金份额净值收益率为0.5699%，同期业绩比较基准收益率为0.1726%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，央行表示将以某个短期操作利率为主要政策利率，后续来看公开市场7天期逆回购操作利率已基本承担了该功能，以此完善利率走廊调控模式，推动利率市场化。从曲线操作来看，中短端受央行直接影响，市场通过短期利率天平偏向决定各期限品种的波动方向和幅度，以此与央行表态保持向上倾斜的收益率曲线相呼应。后续来看，央行日常维护流动性合理充裕的目标仍没有改变，当前经济预期偏弱，扩张性财政政策实施仍有空间，已有建设项目配套资金亟需加强，对应债市当下的运行方向一致性较强。各类非银机构、理财资金面仍面临着较大的配置压力，保持合理杠杆，选择合适久期品种，是央行鼓励的方向，机构与监管或达到一定的平衡。此外，人民币汇率、国际市场降息幅度仍是影响下一阶段债券市场的重要外部变量。我们将密切关注二十届三中全会政策方向，以此判断对于债市市场和资本市场的长期影响。

目前主要工作是提前研判大类资产转换、月末季末节假日效应和汇率等因素对资金利率以及流动性的冲击，合理预计未来的规模变动趋势，保障组合流动性以满足客户赎回需求，并判断未来债券市场的走势，控制好投资品种的到期期限，积极调整产品的平均剩余期限，在满足流动性的前提下，逢资金相对紧张时期进行定期存款、存单和短债投资，以提高产品的收益。

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

根据本集合计划合同的约定，本集合计划根据每月基金收益情况，以每万份基金净收益为基准，为投资者每月计算当月收益并分配，且每月进行支付。每月支付方式只采用现金分红方式。本集合计划本报告期已实现收益分配金额为226,247,644.19元。

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

本报告期内，本托管人在对本集合计划的托管过程中，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，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，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有关规定，对本集合计划的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了监督和复核，未发现本集合计划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

本托管人复核了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、投资组合报告等内容，认为其内容真实、准确和完整。

§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：招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划

报告截止日：2024年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	18,755,077,142.17	17,788,865,818.08
结算备付金		-	5,002,475.00
存出保证金		24,362.16	-

交易性金融资产	6.4.7.2	15,584,705,614.30	14,183,230,924.26
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		15,584,705,614.30	14,183,230,924.26
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	4,244,162,095.70	2,234,894,315.91
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		38,583,969,214.33	34,211,993,533.25
负债和净资产	附注号	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
负 债：			
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		-	1,360,878,258.35
应付清算款		-	699,000,000.00
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		30,399,527.15	28,246,319.82
应付托管费		1,688,862.60	1,569,240.01
应付销售服务费		8,444,313.09	7,846,199.95
应付投资顾问费		-	-
应交税费		16,455.56	86,138.60
应付利润		6,493,670.83	8,974,632.29

递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	287,717.09	319,286.96
负债合计		47,330,546.32	2,106,920,075.98
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	38,536,638,668.01	32,105,073,457.27
未分配利润	6.4.7.8	-	-
净资产合计		38,536,638,668.01	32,105,073,457.27
负债和净资产总计		38,583,969,214.33	34,211,993,533.25

注：报告截止日2024年6月30日，招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划份额净值1.0000元，集合计划份额总额38,536,638,668.01份。

6.2 利润表

会计主体：招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年01月01日至 2024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日
一、营业总收入		484,319,635.42	520,977,640.12
1.利息收入		304,570,072.69	280,194,402.58
其中：存款利息收入	6.4.7.9	290,616,333.19	261,980,818.99
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		13,953,739.50	18,213,583.59
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		179,749,562.73	240,783,237.54
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-	-
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	179,749,562.73	240,783,237.54

资产支持证券投资 收益	6.4.7.13	-	-
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	-	-
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	-	-
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	-	-
减：二、营业总支出		260,552,952.69	277,246,537.74
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	176,621,100.40	189,780,916.82
2.托管费	6.4.10.2.2	9,812,283.38	10,543,384.27
3.销售服务费	6.4.10.2.3	49,061,416.74	52,716,921.40
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		24,876,455.15	23,997,785.10
其中：卖出回购金融资产 支出		24,876,455.15	23,997,785.10
6.信用减值损失	6.4.7.19	-	-
7.税金及附加		43,358.20	63,810.35
8.其他费用	6.4.7.20	138,338.82	143,719.80
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		223,766,682.73	243,731,102.38
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		223,766,682.73	243,731,102.38
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		223,766,682.73	243,731,102.38

6.3 净资产变动表

会计主体：招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	32,105,073,457.27	-	32,105,073,457.27
二、本期期初净资产	32,105,073,457.27	-	32,105,073,457.27
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	6,431,565,210.74	-	6,431,565,210.74
（一）、综合收益总额	-	223,766,682.73	223,766,682.73
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	6,431,565,210.74	-	6,431,565,210.74
其中：1.基金申购款	496,700,745,530.94	-	496,700,745,530.94
2.基金赎回款	-490,269,180,320.20	-	-490,269,180,320.20
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-223,766,682.73	-223,766,682.73
四、本期期末净资产	38,536,638,668.01	-	38,536,638,668.01
项目	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日		

	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	35,605,393,644.96	-	35,605,393,644.96
二、本期期初净资产	35,605,393,644.96	-	35,605,393,644.96
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	2,327,581,560.16	-	2,327,581,560.16
（一）、综合收益总额	-	243,731,102.38	243,731,102.38
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	2,327,581,560.16	-	2,327,581,560.16
其中：1.基金申购款	478,370,742,740.29	-	478,370,742,740.29
2.基金赎回款	-476,043,161,180.13	-	-476,043,161,180.13
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-243,731,102.38	-243,731,102.38
四、本期期末净资产	37,932,975,205.12	-	37,932,975,205.12

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：

易卫东

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

招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）原为招商证券智远天添利集合资产管理计划（以下简称“原集合计划”），原集合计划于2012年12月7日成立，并于2012年12月21日经中国证券业协会中证协函[2012]852号文备案。原集合计划在募集期间收到有效净参与资金为人民币3,628,244,813.63元，折合认购份额3,628,244,813.63份；以上实收资金共计人民币3,628,244,813.63元，折合3,628,244,813.63份集合计划份额。上述出资业经信永中和会计师事务所（特殊普通合伙）审验，并出具了XYZH/2012SZA1013-1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），托管人为中国证券登记结算有限责任公司。

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，招商证券智远天添利集合资产管理计划已完成产品的规范验收并向中国证监会申请合同变更。

2022年4月15日，招商证券资产管理有限公司发布公告《关于“招商证券智远天添利集合资产管理计划”变更为“招商资管智远天添利货币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2022年4月25日起，《招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划集合资产管理合同》（以下简称“集合计划合同”）生效，原《招商证券智远天添利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，原招商证券智远天添利集合资产管理计划份额变更为招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划的份额。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。

本集合计划投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括现金；期限在1年以内（含1年）的银行存款、中央银行票据、同业存单；期限在1个月以内的债券回购；剩余期限在397天以内（含397天）的国债、政策性金融债、企业债、公司债、短期融资券、中期票据、超短期融资券以及中国证监会认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。其中集合计划投资于企业债、公司债、短期融资券、中期票据的主体信用评级和债项信用评级均应当为最高级；超短期融资券的主体信用评级应当为最高级。发行人同时有两家以上境内评级机构评级的，按照孰低原则确定评级。如果法律法规或监管机构以后允许本集合计划投资其他品种，集合计划管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

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。

本财务报表以本集合计划持续经营为基础列报。

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资产管理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2024年6月30日的财务状况以及2024年1月1日至2024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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日
活期存款	4,486,032,668.30
等于：本金	4,482,586,112.29
加：应计利息	3,446,556.01
减：坏账准备	-
定期存款	14,269,044,473.87
等于：本金	14,160,000,000.00
加：应计利息	109,044,473.87
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	14,269,044,473.87
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	18,755,077,142.17

注：定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日

		按实际利率计算的账面价值	影子定价	偏离金额	偏离度(%)
债券	交易所市场	152,167,148.63	152,122,062.33	-45,086.30	-0.0001
	银行间市场	15,432,538,465.67	15,448,942,781.05	16,404,315.38	0.0426
	合计	15,584,705,614.30	15,601,064,843.38	16,359,229.08	0.0425
资产支持证券		-	-	-	-
合计		15,584,705,614.30	15,601,064,843.38	16,359,229.08	0.0425

注：1. 偏离金额=影子定价-摊余成本；2. 偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值×100%。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本集合计划本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

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

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	200,126,424.65	-
银行间市场	4,044,035,671.05	-
合计	4,244,162,095.70	-

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	
	2024年06月30日	
应付券商交易单元保证金		-
应付赎回费		-
应付证券出借违约金		-
应付交易费用		197,330.77
其中：交易所市场		-
银行间市场		197,330.77
应付利息		-
预提费用-审计费		21,713.98
预提费用-信息披露费		59,672.34
预提费用-账户维护费		9,000.00
合计		287,717.09

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	32,105,073,457.27	32,105,073,457.27
本期申购	496,700,745,530.94	496,700,745,530.94
本期赎回（以“-”号填列）	-490,269,180,320.20	-490,269,180,320.20
本期末	38,536,638,668.01	38,536,638,668.01

6.4.7.8 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
上年度末	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	223,766,682.73	-	223,766,682.73
本期基金份额交易产	-	-	-

生的变动数			
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-223,766,682.73	-	-223,766,682.73
本期末	-	-	-

根据本集合计划合同的约定，本集合计划根据每月基金收益情况，以每万份基金净收益为基准，为投资者每月计算当月收益并分配，且每月进行支付。每月支付方式只采用现金分红方式。

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
活期存款利息收入	91,640,061.78
定期存款利息收入	198,855,667.80
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	120,543.79
其他	59.82
合计	290,616,333.19

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

本集合计划本报告期无股票投资收益。

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

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
债券投资收益——利息收入	177,444,600.10
债券投资收益——买卖债券（债转股）	2,304,962.63

及债券到期兑付) 差价收入	
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	179,749,562.73

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	11,361,162,075.48
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	11,355,912,933.61
减：应计利息总额	2,944,179.24
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	2,304,962.63

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

本集合计划本报告期无股利收益。

6.4.7.17 公允价值变动收益

本集合计划本报告期无公允价值变动收益。

6.4.7.18 其他收入

本集合计划本报告期无其他收入。

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
	2024年01月01日至2024年06月30日
审计费用	6,713.98
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
汇划手续费	53,352.50
账户查询费	600.00
预提银行间账户维护费	9,000.00
预提上清所账户维护费	9,000.00
合计	138,338.82

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	基金管理人

中国证券登记结算有限责任公司	基金托管人、注册登记机构
招商证券股份有限公司	基金管理人的控股股东、销售机构

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

本集合计划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股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本集合计划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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日	
	成交金额	占当期 债券买 卖成交 总额的 比例	成交金额	占当期 债券买 卖成交 总额的 比例
招商证券股份有限公司	151,752,051.38	100.00%	-	-

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日	
	成交金额	占当期 债券回 购成交	成交金额	占当期 债券回 购成交

		总额的 比例		总额的 比例
招商证券 股份有限 公司	14,969,897,000.00	100.00%	34,187,669,000.00	100.00%

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本集合计划于本报告期及上年度可比期间无应付关联方的佣金。

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 2024年01月01日至20 24年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至20 23年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	176,621,100.40	189,780,916.82
其中：应支付销售机构的客户维护费	86,605,228.41	93,175,194.64
应支付基金管理人的净管理费	90,015,871.99	96,605,722.18

注：本集合计划的管理费按前一日集合计划资产净值的0.9%年费率计提。如以0.90%的管理费计算的7日年化暂估收益率小于或等于2倍活期存款利率，集合计划管理人将调整管理费为0.30%，以降低每万份集合计划暂估净收益为负并引发销售机构交收透支的风险，直至该类风险消除，集合计划管理人方可恢复计提0.90%的管理费。集合计划管理人应在费率调整后依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。本集合计划的管理费按前一日的集合计划资产净值对应的管理费年费率分别计提。

管理费的计算方法如下：

$$H = E \times I \div \text{当年天数}$$

H为各类份额每日应计提的集合计划管理费

E为该类份额前一日的集合计划资产净值

I为该类份额的管理费年费率

集合计划管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由集合计划管理人向集合计划托管人发送集合计划管理费划款指令，集合计划托管人复核后于次月前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。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年01月01日至2024年06月30日	2023年01月01日至2023年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	9,812,283.38	10,543,384.27

注：本集合计划托管费按前一日集合计划资产净值的0.05%年费率计提，计算方法如下：

$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$ ，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
	2024年01月01日至2024年06月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
招商证券股份有限公司	49,061,416.74
中国证券登记结算有限公司	0.00
合计	49,061,416.74
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间
	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
招商证券股份有限公司	52,716,921.40
中国证券登记结算有限公司	0.00
合计	52,716,921.40

注：本集合计划的销售服务费年费率为0.25%。

销售服务费计提的计算公式如下：

$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$

H 为C类份额每日应计提的销售服务费

E 为C类份额前一日的资产净值

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

份额单位：份

项目	本期 2024年01月01日至 2024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至 2023年06月30日
报告期初持有的基金份额	901,768,495.00	660,497,408.00
报告期间申购/买入总份额	65,470,905,630.00	65,883,136,767.00
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	65,761,318,710.00	65,834,660,002.00
报告期末持有的基金份额	611,355,415.00	708,974,173.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.59%	1.87%

注：期间申购/买入总份额交易方式为非交易过户，为管理人提供快取功能产生的份额。

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 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023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
中国证券登记结算有限责任公司	14,810,548.63	361,223.54	5,285,561.33	886,437.54

注：本集合计划的银行存款由集合计划托管人中国证券登记结算有限责任公司保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本集合计划本报告期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本集合计划本报告期及上年度可比期间无其他关联交易事项的说明。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金

单位：人民币元

已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润 分配合计	备注
-	-	223,766,682.73	223,766,682.73	-

根据本集合计划合同的约定，本集合计划根据每月集合计划收益情况，以每万份集合计划净收益为基准，为投资者每月计算当月收益并分配，且每月进行支付。每月支付方式只采用现金分红方式。

6.4.12 期末（2024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

本集合计划本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	223,260,059.98	-
A-1以下	-	-
未评级	452,987,266.04	-
合计	676,247,326.02	-

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级；2、以上未评级的债券为偿还期限在一年以内的企业债、政策性金融债、短期融资券；3、债券投资以全价列示。

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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	14,908,458,288.28	14,183,230,924.26
合计	14,908,458,288.28	14,183,230,924.26

注：1、同业存单评级取自第三方评级机构的同业存单债项评级；2、同业存单投资以全价列示。

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 2024年 06月30	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
-----------------------	-------	-------	--------	------	------	-----	----

日							
资产							
货币资金	6,319,539,890.6 3	4,698,087,277.9 6	7,737,449,973.5 8	-	-	-	18,755,077,142. 17
存出保证金	24,362.16	-	-	-	-	-	24,362.16
交易性金融资产	2,529,152,108.2 7	4,115,431,386.9 1	8,940,122,119.1 2	-	-	-	15,584,705,614. 30
买入返售金融资产	4,244,162,095.7 0	-	-	-	-	-	4,244,162,095.7 0
资产总计	13,092,878,456. 76	8,813,518,664.8 7	16,677,572,092. 70	-	-	-	38,583,969,214. 33
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	30,399,527.15	30,399,527.15
应付托管费	-	-	-	-	-	1,688,862.60	1,688,862.60
应付销售服务费	-	-	-	-	-	8,444,313.09	8,444,313.09
应交税费	-	-	-	-	-	16,455.56	16,455.56
应付利润	-	-	-	-	-	6,493,670.83	6,493,670.83
其他负债	-	-	-	-	-	287,717.09	287,717.09
负债总计	-	-	-	-	-	47,330,546.32	47,330,546.32
利率敏感度缺口	13,092,878,456. 76	8,813,518,664.8 7	16,677,572,092. 70	-	-	-47,330,546.32	38,536,638,668. 01
上年度末 2023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							
货币资金	5,816,774,317.8 3	7,572,106,668.6 7	4,399,984,831.5 8	-	-	-	17,788,865,818. 08

结算备付金	5,002,475.00	-	-	-	-	-	5,002,475.00
交易性金融资产	399,477,126.67	3,864,454,086.27	9,919,299,711.32	-	-	-	14,183,230,924.26
买入返售金融资产	2,234,894,315.91	-	-	-	-	-	2,234,894,315.91
资产总计	8,456,148,235.41	11,436,560,754.94	14,319,284,542.90	-	-	-	34,211,993,533.25
负债							
卖出回购金融资产款	1,360,878,258.35	-	-	-	-	-	1,360,878,258.35
应付清算款	-	-	-	-	-	699,000,000.00	699,000,000.00
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	28,246,319.82	28,246,319.82
应付托管费	-	-	-	-	-	1,569,240.01	1,569,240.01
应付销售服务费	-	-	-	-	-	7,846,199.95	7,846,199.95
应交税费	-	-	-	-	-	86,138.60	86,138.60
应付利润	-	-	-	-	-	8,974,632.29	8,974,632.29
其他负债	-	-	-	-	-	319,286.96	319,286.96
负债总计	1,360,878,258.35	-	-	-	-	746,041,817.63	2,106,920,075.98
利率敏感度缺口	7,095,269,977.06	11,436,560,754.94	14,319,284,542.90	-	-	-746,041,817.63	32,105,073,457.27

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

假设	1.若市场利率平行上升或下降25个基点；
假设	2.其他市场变量保持不变；

假设	3.仅存在公允价值变动对集合计划资产净值的影响(即平移收益率曲线)。		
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 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
	1.市场利率平行上升25个基点	-16,488,185.68	-14,826,008.42
	2.市场利率平行下降25个基点	16,539,314.29	14,866,139.66

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

本集合计划本报告期末及上年度末未持有交易性权益类投资，无其他价格风险敞口。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本集合计划主要投资于固定收益类金融工具，因此无重大其他价格风险。

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

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	-	-
第二层次	15,584,705,614.30	14,183,230,924.26
第三层次	-	-
合计	15,584,705,614.30	14,183,230,924.26

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及上年度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	固定收益投资	15,584,705,614.30	40.39

	其中：债券	15,584,705,614.30	40.39
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	4,244,162,095.70	11.00
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	18,755,077,142.17	48.61
4	其他各项资产	24,362.16	0.00
5	合计	38,583,969,214.33	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 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	5.77	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中：买断式回购融资	-	-

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本报告期债券正回购的资金余额未超过本集合计划资产净值的20%。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	115
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	117
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	88

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本集合计划本报告期不存在投资组合平均剩余存续期超过120天的情况。

7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	33.51	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	7.70	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	13.71	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	1.71	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天(含)	43.18	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	99.81	-

7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本集合计划本报告期投资组合平均剩余期限无超过240天的情况。

7.5 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	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	152,167,148.63	0.39
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-

5	企业短期融资券	524,080,177.39	1.36
6	中期票据	-	-
7	同业存单	14,908,458,288.28	38.69
8	其他	-	-
9	合计	15,584,705,614.30	40.44
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

7.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	112314120	23江苏银行CD120	7,000,000	699,601,977.85	1.82
2	112403132	24农业银行CD132	5,000,000	496,014,965.83	1.29
3	112490410	24北京农商银行CD008	3,000,000	299,798,032.72	0.78
4	112383185	23北京农商银行CD161	3,000,000	299,654,611.05	0.78
5	112304027	23中国银行CD027	3,000,000	299,499,855.76	0.78
6	112412060	24北京银行CD060	3,000,000	299,306,717.03	0.78
7	112480635	24宁波银行CD062	3,000,000	298,827,768.40	0.78
8	112413090	24浙商银行CD090	3,000,000	298,661,919.56	0.78
9	112387059	23北京农商银行CD185	3,000,000	298,391,776.90	0.77
10	112314157	23江苏银行CD157	3,000,000	298,263,778.91	0.77

7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0592%
报告期内偏离度的最低值	0.0017%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0323%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本集合计划本报告期不存在负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

本集合计划本报告期不存在正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本集合计划本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 基金计价方法说明

本集合计划估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内按照实际利率法每日计提收益。

7.9.2 本集合计划投资的前十名证券的发行主体中，中国银行股份有限公司曾受到中国人民银行、国家金融监督管理总局、国家外汇管理局及其派出机构的处罚，浙商银行股份有限公司曾受到国家金融监督管理总局、国家税务总局及其派出机构的处罚，中国农业银行股份有限公司、宁波银行股份有限公司曾受到国家金融监督管理总局、国家外汇管理局及其派出机构的处罚，北京银行股份有限公司、江苏银行股份有限公司、北京农村商业银行股份有限公司曾受到国家金融监督管理总局及其派出机构的处罚。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。

7.9.3 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	24,362.16
2	应收清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	24,362.16

7.9.4 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

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
989,269	38,954.66	2,360,060,123.92	6.12%	36,176,578,544.09	93.88%

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 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额(份)	占总份额比例
1	券商机构	611,355,415.00	1.59%
2	其他机构	369,704,139.91	0.96%
3	个人	101,520,848.92	0.26%

4	其他机构	100,513,831.11	0.26%
5	基金机构	95,821,370.84	0.25%
6	个人	94,950,212.74	0.25%
7	个人	82,667,883.77	0.21%
8	基金机构	72,643,245.51	0.19%
9	其他机构	68,393,843.04	0.18%
10	个人	60,221,843.89	0.16%

8.3 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	277,032.26	0.00%

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）。

8.4 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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2022年04月25日)基金份额总额	32,147,298,718.28
本报告期期初基金份额总额	32,105,073,457.27
本报告期基金总申购份额	496,700,745,530.94
减：本报告期基金总赎回份额	490,269,180,320.20
本报告期期末基金份额总额	38,536,638,668.01

§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

本报告期内，本集合计划管理人未发生重大人事变动。

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，由于业务开展需要，根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、集合计划合同及招募说明书等法律文件，经履行适当程序，集合计划管理人决定自2024年1月1日起，改聘德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）为本集合计划会计师事务所。具体可参见集合计划管理人于2024年1月2日发布的《招商证券资产管理有限公司关于旗下部分集合资产管理计划改聘会计师事务所的公告》。

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

本报告期内，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

本报告期内，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

10.7.1 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	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	佣金	占当期佣金总量的比	

	数量		的比例		例	
招商证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-

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。

10.7.2 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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
招商证券股份有限公司	151,752,051.38	100.00%	14,969,897,000.00	100.00%	-	-	-	-

10.8 偏离度绝对值超过0.5%的情况

本集合计划本报告期无偏离度绝对值超过0.5%的情况。

10.9 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	关于招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划“快速取款”服务额度调整的公告（2024年6月28日）	管理人网站	2024-06-28
2	关于招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划“快速取款”服务额度调整的公告（2024年6月27日）	管理人网站	2024-06-27
3	招商证券资产管理有限公司关于旗下部分集合资产管理计划更新招募说明书及产品资料概要的提示性公告	中国证监会规定报刊，管理人网站	2024-06-27
4	招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划收益支付公告（2024年第6号）	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	2024-06-26
5	关于招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划“快速取款”服务额度调整的公告（2024年6月24日）	管理人网站	2024-06-24
6	关于招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划“快速取款”服务额度调整的公告（2024年6月21日）	管理人网站	2024-06-21
7	关于招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划“快速取款”服务额度调整的公告（2024年6月14日）	管理人网站	2024-06-14
8	关于招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划“快速取款”服务额度调整的公告（2024年6月13日）	管理人网站	2024-06-13

9	关于招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划“快速取款”服务额度调整的公告	管理人网站	2024-06-11
10	关于招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划“快速取款”服务额度调整的公告（2024年6月7日）	管理人网站	2024-06-07
11	关于招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划“快速取款”服务额度调整的公告（2024年6月6日）	管理人网站	2024-06-06
12	关于招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划“快速取款”服务额度调整的公告（2024年6月5日）	管理人网站	2024-06-05
13	关于招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划“快速取款”服务额度调整的公告	管理人网站	2024-06-04
14	关于招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划“快速取款”服务额度调整的公告	管理人网站	2024-06-03
15	关于招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划“快速取款”服务额度调整的公告（2024年5月31日）	管理人网站	2024-05-31
16	关于招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划“快速取款”服务额度调整的公告（2024年5月30日）	管理人网站	2024-05-30
17	关于招商资管智远天添利货	管理人网站	2024-05-29

	币型集合资产管理计划“快速取款”服务额度调整的公告（2024年5月29日）		
18	关于招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划“快速取款”服务额度调整的公告（2024年5月24日）	管理人网站	2024-05-24
19	招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划收益支付公告（2024年第5号）	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	2024-05-24
20	关于招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划“快速取款”服务额度调整的公告（2024年5月17日）	管理人网站	2024-05-17
21	关于招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划“快速取款”服务额度调整的公告（2024年5月15日）	管理人网站	2024-05-15
22	关于招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划“快速取款”服务额度调整的公告（2024年5月10日）	管理人网站	2024-05-10
23	关于招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划“快速取款”服务额度调整的公告（2024年5月9日）	管理人网站	2024-05-09
24	关于招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划“快速取款”服务额度调整的公告（2024年5月8日）	管理人网站	2024-05-08
25	关于招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划“快速取款”服务额度调整的公告（2024年5月7日）	管理人网站	2024-05-07

26	关于招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划“快速取款”服务额度调整的公告（2024年5月6日）	管理人网站	2024-05-06
27	关于招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划“快速取款”服务额度调整的公告（2024年4月29日）	管理人网站	2024-04-29
28	招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划收益支付公告（2024年第4号）	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	2024-04-24
29	关于招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划“快速取款”服务额度调整的公告（2024年4月23日）	管理人网站	2024-04-23
30	关于招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划“快速取款”服务额度调整的公告（2024年4月22日）	管理人网站	2024-04-22
31	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2024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	2024-04-19
32	招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划2024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	2024-04-19
33	关于招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划“快速取款”服务额度调整的公告（2024年4月18日）	管理人网站	2024-04-18
34	招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划招募说明书（更新）及产品资料概要	中国证监会规定报刊，管理人网站	2024-04-18

	(更新) 提示性公告		
35	关于招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划“快速取款”服务额度调整的公告(2024年4月17日)	管理人网站	2024-04-17
36	关于招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划“快速取款”服务额度调整的公告(2024年4月12日)	管理人网站	2024-04-12
37	关于招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划“快速取款”服务额度调整的公告(2024年4月11日)	管理人网站	2024-04-11
38	关于招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划“快速取款”服务额度调整的公告(2024年4月9日)	管理人网站	2024-04-09
39	关于招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划“快速取款”服务额度调整的公告(2024年4月8日)	管理人网站	2024-04-08
40	关于招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划“快速取款”服务额度调整的公告(2024年4月2日)	管理人网站	2024-04-02
41	关于招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划“快速取款”服务额度调整的公告(2024年3月29日)	管理人网站	2024-03-29
42	关于招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划“快速取款”服务额度调整的公告(2024年3月26日)	管理人网站	2024-03-26

43	招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划收益支付公告（2024年第3号）	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	2024-03-26
44	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年年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊，管理人网站	2024-03-25
45	招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划2023年年度报告	中国证监会基金电子披露网站，管理人网站	2024-03-25
46	关于招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划“快速取款”服务额度调整的公告（2024年3月22日）	管理人网站	2024-03-22
47	关于招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划“快速取款”服务额度调整的公告（2024年3月21日）	管理人网站	2024-03-21
48	关于招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划“快速取款”服务额度调整的公告（2024年3月20日）	管理人网站	2024-03-20
49	关于招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划“快速取款”服务额度调整的公告（2024年3月19日）	管理人网站	2024-03-19
50	关于招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划“快速取款”服务额度调整的公告（2024年3月18日）	管理人网站	2024-03-18
51	关于招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划“快速取款”服务额度调整的公告	管理人网站	2024-03-12

	告（2024年3月12日）		
52	关于招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划“快速取款”服务额度调整的公告（2024年3月8日）	管理人网站	2024-03-08
53	关于招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划“快速取款”服务额度调整的公告（2024年2月28日）	管理人网站	2024-03-01
54	关于招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划“快速取款”服务额度调整的公告（2024年2月28日）	管理人网站	2024-02-28
55	关于招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划“快速取款”服务额度调整的公告（2024年2月27日）	管理人网站	2024-02-27
56	招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划收益支付公告（2024年第2号）	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	2024-02-24
57	关于招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划“快速取款”服务额度调整的公告（2024年2月22日）	管理人网站	2024-02-22
58	关于招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划“快速取款”服务额度调整的公告（2024年2月21日）	管理人网站	2024-02-21
59	关于招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划“快速取款”服务额度调整的公告（2024年2月20日）	管理人网站	2024-02-20
60	关于招商资管智远天添利货	管理人网站	2024-02-19

	币型集合资产管理计划“快速取款”服务额度调整的公告（2024年2月19日）		
61	关于招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划“快速取款”服务额度调整的公告（2024年2月8日）	管理人网站	2024-02-08
62	关于招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划“快速取款”服务额度调整的公告（2024年2月7日）	管理人网站	2024-02-07
63	关于招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划“快速取款”服务额度调整的公告（2024年2月5日）	管理人网站	2024-02-05
64	关于招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划“快速取款”服务额度调整的公告（2024年1月30日）	管理人网站	2024-01-30
65	关于招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划“快速取款”服务额度调整的公告（2024年1月26日）	管理人网站	2024-01-26
66	招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划收益支付公告（2024年第1号）	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	2024-01-23
67	关于招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划“快速取款”服务额度调整的公告（2024年1月22日）	管理人网站	2024-01-22
68	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4季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊，管理人网站	2024-01-19

69	关于招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划“快速取款”服务额度调整的公告（2024年1月19日）	管理人网站	2024-01-19
70	招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划2023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	2024-01-19
71	关于招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划“快速取款”服务额度调整的公告（2024年1月18日）	管理人网站	2024-01-18
72	关于招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划“快速取款”服务额度调整的公告（2024年1月11日）	管理人网站	2024-01-11
73	关于招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划“快速取款”服务额度调整的公告（2024年1月9日）	管理人网站	2024-01-09
74	关于招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划“快速取款”服务额度调整的公告（2024年1月8日）	管理人网站	2024-01-08
75	关于招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划“快速取款”服务额度调整的公告（2024年1月5日）	管理人网站	2024-01-05
76	关于招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划“快速取款”服务额度调整的公告（2024年1月4日）	管理人网站	2024-01-04
77	关于招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划“快	管理人网站	2024-01-03

	速取款”服务额度调整的公告（2024年1月3日）		
78	招商证券资产管理有限公司关于旗下部分集合资产管理计划改聘会计师事务所的公告	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	2024-01-02

§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天添利集合资产管理计划合同变更的回函；
2. 《招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划集合资产管理合同》；
3. 《招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划托管协议》；
4. 《招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划招募说明书》；
5. 《招商资管智远天添利货币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
二〇二四年八月二十一日