招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划

2024 年年度报告

2024 年 12 月 31 日

基金管理人:招商证券资产管理有限公司

基金托管人:中国证券登记结算有限责任公司

送出日期:2025 年 03 月 25 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。本年报已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国证券登记结算有限责任公司根据本集合计划合同规定，于2025年03月24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。

本报告中财务资料已经审计。德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）为本集合计划出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自2024年1月1日起至12月31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、基金净值表现及利润分配情况 7
3.1 主要会计数据和财务指标 7
3.2 基金净值表现 8
3.3 过去三年基金的利润分配情况 9
§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遵规守信情况的说明 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 12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 15
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 15
§5 托管人报告 15
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 15
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 15
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 16
§6 审计报告 16
6.1 审计报告基本信息 16
6.2 审计报告的基本内容 16
§7 年度财务报表 19
7.1 资产负债表 19
7.2 利润表 21
7.3 净资产变动表 22
7.4 报表附注 24
§8 投资组合报告 51
8.1 期末基金资产组合情况 51
8.2 债券回购融资情况 52
8.3 基金投资组合平均剩余期限 52
8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明 53
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 53
8.6 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 54
8.7 “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 54
8.8 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 55
8.9 投资组合报告附注 55
§9 基金份额持有人信息 55

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 55
9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况 56
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 56
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 56
§10 开放式基金份额变动 57
§11 重大事件揭示 57
11.1 基金份额持有人大会决议 57
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 57
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 57
11.4 基金投资策略的改变 57
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 58
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 58
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 58
11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况 59
11.9 其他重大事件 59
§12 影响投资者决策的其他重要信息 75
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 75
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 75
§13 备查文件目录 75
13.1 备查文件目录 75
13.2 存放地点 75
13.3 查阅方式 75

§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	58,772,543,048.87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	肖凌	陈晨
	联系电话	0755-26951111	010-50938723
	电子邮箱	xiaoling@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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	https://amc.cmschina.com/

基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）	中国上海市黄浦区延安东路222号外滩中心30楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区锦什坊街26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

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2024年	2023年	2022年04月25日（基金合同生效日）-2022年12月31日
本期已实现收益	442,243,189.65	481,427,954.03	305,070,424.80
本期利润	442,243,189.65	481,427,954.03	305,070,424.80
本期净值收益率	1.0090%	1.1639%	0.7966%
3.1.2 期末数据和指标	2024年末	2023年末	2022年末
期末基金资产净值	58,772,543,048.87	32,105,073,457.27	35,605,393,644.96
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	2024年末	2023年末	2022年末
累计净值收益率	2.9987%	1.9698%	0.7966%

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

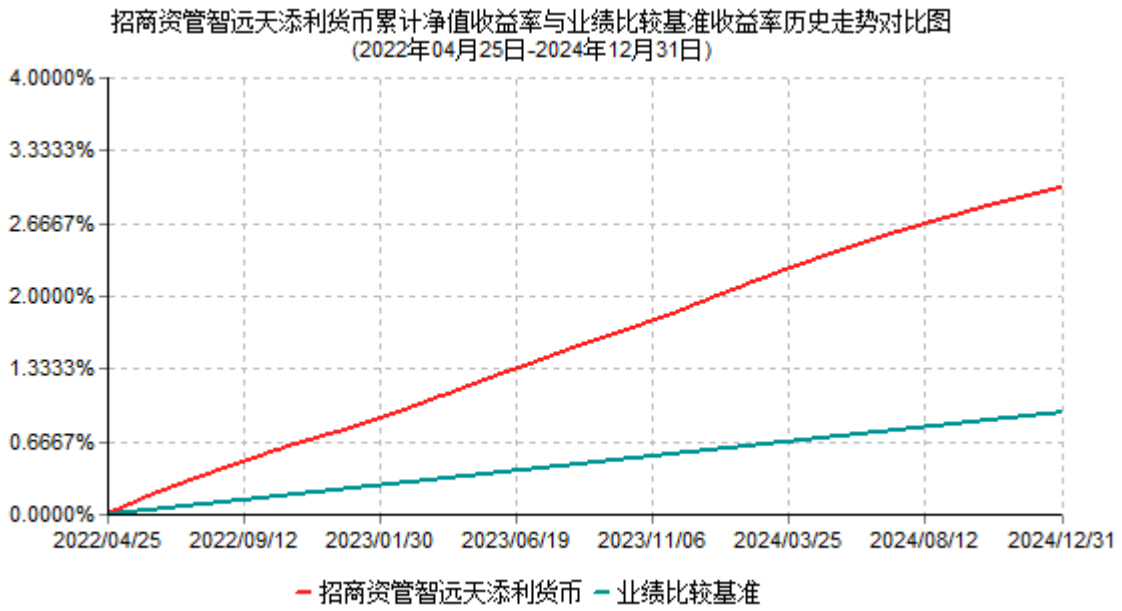
3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	0.2024%	0.0002%	0.0870%	0.0000%	0.1154%	0.0002%
过去六个月	0.4366%	0.0003%	0.1742%	0.0000%	0.2624%	0.0003%
过去一年	1.0090%	0.0005%	0.3470%	0.0000%	0.6620%	0.0005%
自基金合同生效起至今	2.9987%	0.0005%	0.9357%	0.0000%	2.0630%	0.0005%

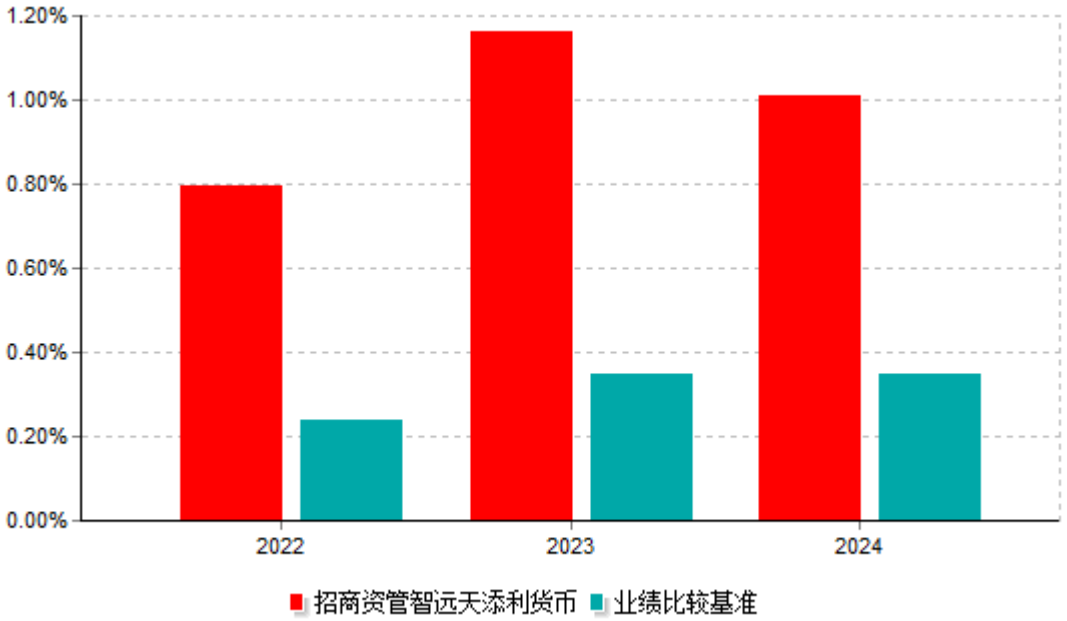
注：（1）本集合计划属于货币型集合资产管理计划，本集合计划业绩比较基准为“中国人民银行公布的活期存款基准利率（税后）”；

（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



3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本集合计划合同于 2022年4月25日生效，合同生效当年期间的相关数据和指标按实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	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	年度利润分配合计	备注
2024年	-	-	442,243,189.65	442,243,189.65	-
2023年	-	-	481,427,954.03	481,427,954.03	-
2022年	-	-	305,070,424.80	305,070,424.80	-
合计	-	-	1,228,741,568.48	1,228,741,568.48	-

§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。

4.1.4 基金经理薪酬机制

本报告期内，本集合计划基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况，亦不存在薪酬激励与私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩表现挂钩的情况。

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，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 公平交易制度和控制方法

公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《资产管理业务公平交易制度》，内容主要包括公平交易的适用范围、公平交易的原则和措施、公平交易执行、公平交易监测及报告等。

公平交易制度所规范的范围涵盖旗下各类资产组合，围绕境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，同时应包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。公平交易的原则包括：以资产委托人利益为重、公平的对待不同的资产委托人、严禁利益输送。

公平交易的实现措施和执行程序主要包括：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，集合计划管理人合理设置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，在保证投资管理各投资组合的投资决策相对独立性的同时，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；建立科学的投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制；通过对投资交易行为的监控、分析评估和披露来加强对公平交易过程和结果的监督；不断完善研究方法和投资决策流程，提高投资决策的科学性和客观性；健全投资授权制度，明确投资管理权限划分，合理确定各基金经理的投资权限；建立系统的交易方法。

集合计划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，相关基金经理需要提供决策依据，并留存记录备查。

4.3.2 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。

4.3.3 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

12月份，中国官方制造业PMI为50.1%，较上月下降0.2个百分点。综合PMI产出指数为52.2%，较上月回升1.4个百分点，扩展区间表明企业经营活动有所加快。12月份，规模以上工业增加值同比增长6.2%，高于前值0.8%，1至12月份固定资产投资增长为3.2%，较上月增速下降了0.1%，社会消费品零售总额累计同比增速为3.5%，增速与上月持平，内需偏弱的问题仍相对突出。12月份，美元计价的出口和进口增速分别为10.7%

和1.0%，“抢出口”现象增大了出口的韧性。四季度GDP同比增长5.4%，比上个季度加快了0.8个百分点，全年实现5%的经济增长目标，显示出一揽子政策在四季度激发了市场活力，经济整体基本面仍在底部震荡回升。

政策面上，2024年央行年内进行了两次降准，三次降息。三季度末以来，揽子金融货币政策超预期推出，中央政治局会议顶层部署经济工作，政策层面出台了诸多房地产配套支持政策。11月8日财政部表示2024年开始，将连续五年每年从新增地方政府专项债券中安排8000亿元，专门用于化债，再加上全国人大常委会批准的6万亿元债务限额，合计直接增加地方化债资源10万亿元，以消除地方政府的隐债。12月的政治局会议提出政策总基调是要实施更加积极的财政政策和适度宽松的货币政策。央行四季度货币政策委员会例会再度明确“择机降准降息”，新增“加大货币信贷投放力度”的表述，在稳汇率问题上表述较为明确和坚决。后续关注这一系列政策和信号对于宏观经济和金融市场的影响。

2024年资金面情况整体符合央行流动性合理充裕目标，资金加权利率有所波动，幅度有限，上半年的资金价格相对较优，下半年套息空间收窄不算宽裕。央行新增了购买国债和买断式逆回购两个新型货币政策工具操作，通过这些操作置换部分到期MLF，以维持保持资金面平稳。考虑到经济底部震荡温回升弱于预期，基本面支撑债市持续走强，全年广谱利率维持震荡下行的走势。全年来看，1年期国债收益率下行100bp至1.08%；10年期国债收益率下行88bp至1.68%；30年期国债收益率下行91bp至1.91%，国债收益率曲线大致陡峭化。

2024年，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，下半年增加了逆回购融出，自律机制实施前后，利率下行加速。全年来看，组合保持相对较高的平均剩余期限配置，年底期间规模略微缩减，谨慎增加了部分杠杆。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1.0090%，同期业绩比较基准收益率为0.3470%。

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，12月中央政治局会议和中央经济工作会议的精神是2025年经济活动的主线，货币政策适度宽松十来年再次提及，作为经济活动发动的重要引擎之一，未来继续降准降息可期，而买断式逆回购和购买国债等新货币政策工具的应用，提高了央行政策目标的可操作性。财政政策对于经济活动的持续复苏尤其关键，在外需可能受到国际政治环境影响而有一定不确定性的前提下，“促销费”和“扩投资”是重要的抓手，后续财政政策的发力值得关注。12月份美国降息后，美联储偏鹰的声明使得市场对于其降息

的幅度和必要性的预期进一步降低，关注国际汇率方面的影响。投资者的预期并未打破的前提下，债市的趋势性仍在，重视好预期管理是后续投资的关键。

我们的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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本集合计划管理人从维护集合计划份额持有人利益、保障集合计划合规运作角度出发，积极推动主动、全面的合规管理，持续完善内控机制，进一步加强内部风险的控制与防范的有效性。报告期内，主要从以下几个方面落实合规管理、强化监察稽核职能：

1、持续完善内部控制体系

公司根据法律法规和监管机构的各项要求，对公司制定的各项规章制度、操作流程和业务系统功能、各部门协作等方面进行持续修订和优化，不断夯实以资产管理业务为主线的内控及风险管理体系。

2、强化业务合规审查

加强公司和集合计划日常运作的合规审核。做好集合计划产品开发、新投资品种及其他创新业务中法律、合规及风险控制方面的支持，坚持对投资、研究、交易、销售等各项业务实施事前、事中、事后的合规性审核。

3、加强投资合规监控

公司严格遵照法律法规、集合计划合同和公司制度要求对日常投资运作进行管理和监控，对集合计划运作合规情况进行监控并跟踪分析异常指标，及时沟通及风险提示，全方位防范控制集合计划运作风险。

4、开展各项稽核审计工作

公司根据监管要求组织开展内部审计、专项稽核，排查业务风险隐患，主动发现自身管理中的不足，促进公司整体业务合规运作、稳健经营。此外，积极配合监管检查与年度外部中介机构的评估和审计工作，通过问题反馈、实施整改，进一步完善公司内部控制管理机制。

5、持续合规督导与培训

通过组织合规培训、推送资管业务动态、法律法规、监管政策跟踪研究等形式加强对员工的合规教育，提升员工合规遵从意识，推动公司合规文化建设。

本集合计划管理人承诺将坚持诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划资产，积极健全内部管理制度，不断提高监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种

风险，切实保障法律法规、监管要求和各项规章制度的落实，保证集合计划合同得到严格履行，保护集合计划份额持有人的合法权益。

4.7 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。

4.8 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441,556,922.59元。

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

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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	德师报(审)字(25)第P02110号

6.2 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	招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划全体持有人
审计意见	我们审计了招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划的财务报表，包括2024年12月31日的资产负债表，2024年度的利润表、净资产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企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于资产管理行业实务操作的有关规定编制，公允反映了招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划2024年12月31日的财务状况以及2024 年度的经营成果和净资产变动情况。
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，我们独立于招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划，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	招商证券资产管理有限公司(以下简称“资产管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划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。 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。 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。 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。
管理层和治理层对财务报表的责任	资产管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于资产管理行业实务操作的有关规定编制财务报表，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而导致的重大错报。 在编制财务报表时，资产管理人管理层负责评估招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非资产管理人管理层计划清算招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划、终止运营或别无其他现实的选择。 资产管理人治理层负责监督招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划的财务报告过程。

注册会计师对财务报表审计的责任	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。 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： (1)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，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。 (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。 (3)评价资产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。 (4)对资产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，就可能导致对招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划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招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划不能持续经营。

	(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。 我们与资产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。	
会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	洪锐明	周瀚林
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区延安东路222号外滩中心30楼	
审计报告日期	2025-03-24	

§7 年度财务报表

7.1 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12月31日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
资 产：			
货币资金	7.4.7.1	25,077,367,537.14	17,788,865,818.08
结算备付金		4,788,569.18	5,002,475.00
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	29,489,311,326.74	14,183,230,924.26
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		29,489,311,326.74	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	6,595,550,415.68	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	7.4.7.5	-	-
资产总计		61,167,017,848.74	34,211,993,533.25
负债和净资产	**附注号**	本期末 2024年12月31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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		2,320,291,040.71	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		48,083,957.34	28,246,319.82
应付托管费		2,671,331.00	1,569,240.01
应付销售服务费		13,356,654.82	7,846,199.95
应付投资顾问费		-	-
应交税费		72,702.08	86,138.60
应付利润		9,660,899.35	8,974,632.29
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	338,214.57	319,286.96
负债合计		2,394,474,799.87	2,106,920,075.98
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	58,772,543,048.87	32,105,073,457.27
未分配利润	7.4.7.8	-	-
净资产合计		58,772,543,048.87	32,105,073,457.27
负债和净资产总计		61,167,017,848.74	34,211,993,533.25

注：报告截止日2024年12月31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58,772,543,048.87份。

7.2 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12月31日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024年01月01日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年12月31日
一、营业总收入		1,013,599,983.13	1,036,276,545.01
1.利息收入		626,818,016.04	580,738,728.99
其中：存款利息收入	7.4.7.9	568,629,677.58	542,488,387.91
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		58,188,338.46	38,250,341.08
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		386,781,967.09	455,537,816.02
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-	-
基金投资收益	7.4.7.11	-	-
债券投资收益	7.4.7.12	386,781,967.09	455,537,816.02
资产支持证券投资收益	7.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-	-

4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-	-
减：二、营业总支出		571,356,793.48	554,848,590.98
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	407,221,847.80	374,126,081.93
2.托管费	7.4.10.2.2	22,623,436.09	20,784,782.32
3.销售服务费	7.4.10.2.3	113,117,179.91	103,923,911.66
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		28,022,066.77	55,596,545.21
其中：卖出回购金融资产支出		28,022,066.77	55,596,545.21
6.信用减值损失	7.4.7.19	-	-
7.税金及附加		88,678.42	139,110.23
8.其他费用	7.4.7.20	283,584.49	278,159.63
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		442,243,189.65	481,427,954.03
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		442,243,189.65	481,427,954.03
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		442,243,189.65	481,427,954.03

7.3 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12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2024年01月01日至2024年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资	32,105,073,457.27	-	32,105,073,457.27

产			
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）	26,667,469,591.60	-	26,667,469,591.60
（一）、综合收益总额	-	442,243,189.65	442,243,189.65
（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）	26,667,469,591.60	-	26,667,469,591.60
其中：1.基金申购款	1,254,243,792,510.59	-	1,254,243,792,510.59
2.基金赎回款	-1,227,576,322,918.99	-	-1,227,576,322,918.99
（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）	-	-442,243,189.65	-442,243,189.65
四、本期期末净资产	58,772,543,048.87	-	58,772,543,048.87
项 目	**上年度可比期间 2023年01月01日至2023年12月31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	-3,500,320,187.69	-	-3,500,320,187.69

填列）			
（一）、综合收益总额	-	481,427,954.03	481,427,954.03
（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）	-3,500,320,187.69	-	-3,500,320,187.69
其中：1.基金申购款	940,801,072,107.34	-	940,801,072,107.34
2.基金赎回款	-944,301,392,295.03	-	-944,301,392,295.03
（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）	-	-481,427,954.03	-481,427,954.03
四、本期期末净资产	32,105,073,457.27	-	32,105,073,457.27

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:

易卫东	肖凌	肖凌
————————	————————	————————
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。

7.4.2 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。

7.4.3 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12月31日的财务状况以及2024年度的经营成果和净资产变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本集合计划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

本集合计划记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

（1）金融资产的分类

根据本集合计划的业务特点和风险管理要求，本集合计划将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产，暂无金融资产划分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。

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，且本集合计划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，则本集合计划将该金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产。此类金融资产主要包括货币资金、各类应收款项、买入返售金融资产等。

不符合分类为以摊余成本计量的金融资产以及以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产条件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。除衍生工具所产生的金融资产计入“衍生金融资产”外，其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产计入“交易性金融资产”。

（2）金融负债的分类

本集合计划将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本集合计划暂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。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

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

本集合计划成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。对于以常规方式购买或出售金融资产的，在交易日确认将收到的资产和为此将承担的负债，或者在交易日终止确认已出售的资产。金融资产和金融负债在初始确认时以公允价值计量。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额；

支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券或资产支持证券已到付息期但尚未领取的利息，单独确认为应收项目。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，公允价值变动形成的利得或损失以及与该金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益。以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，发生减值或终止确认产生的利得或损失，计入当期损益。

本集合计划对分类为以摊余成本计量的金融资产以预期信用损失为基础确认损失准备。除购买或源生的已发生信用减值的金融资产外，本集合计划在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后的变动情况。若该金融工具的信用风险自初始确认后已显著增加，本集合计划按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备；若该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加，本集合计划按照相当于该金融工具未来12个月内预期信用损失的金额计量其损失准备。信用损失准备的增加或转回金额，作为减值损失或利得计入当期损益。

本集合计划在前一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形的，本集合计划在当期资产负债表日按照相当于未来12个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

本集合计划利用可获得的合理且有依据的前瞻性信息，通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止、该金融资产已转移且其所有权上几乎所有的风险和报酬已转移或虽然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，但是未保留对该金融资产的控制，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。若本集合计划既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有风险和报酬，且保留了对该金融资产控制的，则按照其继续涉入被转移金融资产的程度继续确认该被转移金融资产，并相应确认相关负债。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价(包括转出的非现金资产或承担的新金融负债)之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本集合计划持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

（1）对存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种，在估值日有报价的，除会计准则规定的例外情况外，应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，应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，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应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，集合计划管理人不应考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

（2）对不存在活跃市场的投资品种，应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，应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。

（3）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，使潜在估值调整对前一估值日的集合计划资产净值的影响在0.25%以上的，应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

当本集合计划具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本集合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的基金份额总额所对应的金额。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确认。

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集合计划净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于集合计划申购确认日或集合计划赎回确认日认列，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

（1）利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

（2）投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本与相关交易费用的差额确认。

债券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖债券价差收入。除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。买卖债券价差收入为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

资产支持证券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖资产支持证券价差收入。资产支持证券利息收入在持有期内，按资产支持证券的票面价值和预计收益率计算的利息逐日确认资产支持证券利息收入。在收到资产支持证券支付的款项时，其中属于证券投资收益的部分冲减应计利息(若有)后的差额，确认资产支持证券利息收入。买卖资产支持证券价差收入为卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本、相关交易费用与税费后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额确认，由上市公司代扣代缴的个人所得税于卖出交易日按实际代扣代缴金额确认。

（3）公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产卖出或到期时转出计入投资收益。

（4）信用减值损失

本集合计划对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认信用损失准备。本集合计划所计提的信用减值损失计入当期损益。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本集合计划的管理人报酬和托管费等在费用涵盖期间按集合计划合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的交易费用发生时按照确定的金额计入交易费用。

卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率逐日计提。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 本集合计划收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的集合计划份额进行再投资；若投资者不选择，本集合计划默认的收益分配方式是现金分红；

(2) 本集合计划收益分配后各类集合计划份额净值不能低于面值；即集合计划收益分配基准日的各类集合计划份额净值减去每单位该类集合计划份额收益分配金额后不能低于面值；

(3) 本集合计划同一类别的每一集合计划份额享有同等分配权；

(4) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 外币交易

本集合计划无外币交易。

7.4.4.13 分部报告

本集合计划无分部报告。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本集合计划确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

（1）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《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》(中基协发[2017]6号)，在估值日按照该通知规定的流通受限股票公允价值计算模型进行估值。

（2）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，根据《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》(中国证监会公告[2017]13号)及《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》(中基协发[2013]13 号)相关规定，本集合计划根据情况决定使用指数收益法、可比公司法、市场价格模型法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

（3）根据《关于发布<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>的通知》(中基协发[2014]24号)，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

本集合计划无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本集合计划无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本集合计划无差错更正。

7.4.6 税项

根据财税[2008]1号《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[2012]85号《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[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101号《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》、财税[2016]36号《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》、财政部、税务总局、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140号《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《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》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税；2018年1月1日起，公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务，以基金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。

(2)对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不计缴企业所得税。

(3)对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司代扣代缴个人所得税；从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4)对于基金从事A股买卖，出让方按1‰的税率缴纳证券(股票)交易印花税，对受让方不再缴纳印花税。

(5)本集合计划的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
活期存款	3,545,086,953.42	3,480,377,039.76
等于：本金	3,537,872,990.73	3,477,446,366.86
加：应计利息	7,213,962.69	2,930,672.90
减：坏账准备	-	-
定期存款	21,532,280,583.72	14,308,488,778.32
等于：本金	21,400,000,000.00	14,160,000,000.00
加：应计利息	132,280,583.72	148,488,778.32
减：坏账准备	-	-
其中：存款期限1个月以内	-	-
存款期限1-3个月	1,403,029,444.08	-
存款期限3个月以上	20,129,251,139.64	14,308,488,778.32
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计	25,077,367,537.14	17,788,865,818.08

注：定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2024年12月31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	-	-	-	-
	银行间市场	29,489,311,326.74	29,532,973,039.59	43,661,712.85	0.0743
	合计	29,489,311,326.74	29,532,973,039.59	43,661,712.85	0.0743
资产支持证券		-	-	-	-
合计		29,489,311,326.74	29,532,973,039.59	43,661,712.85	0.0743
项目		上年度末 2023年12月31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	-	-	-	-
	银行间市场	14,183,230,924.26	14,189,710,470.00	6,479,545.74	0.0202
	合计	14,183,230,924.26	14,189,710,470.00	6,479,545.74	0.0202
资产支持证券		-	-	-	-
合计		14,183,230,924.26	14,189,710,470.00	6,479,545.74	0.0202

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%。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本集合计划本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

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 2024年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	3,395,247,168.19	-
银行间市场	3,200,303,247.49	-
合计	6,595,550,415.68	-
项目	上年度末 2023年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	699,000,000.00	-
银行间市场	1,535,894,315.91	-
合计	2,234,894,315.91	-

7.4.7.4.2 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及上年度末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

本集合计划本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31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	315,714.57	175,286.96
其中：交易所市场	-	-
银行间市场	315,714.57	175,286.96
应付利息	-	-

预提费用-审计费	13,500.00	15,000.00
预提费用-账户维护费	9,000.00	9,000.00
预提费用-信息披露费	-	120,000.00
合计	338,214.57	319,286.96

7.4.7.7 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12月31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	1,254,243,792,510.59	1,254,243,792,510.59
本期赎回（以“-”号填列）	-1,227,576,322,918.99	-1,227,576,322,918.99
本期末	58,772,543,048.87	58,772,543,048.87

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
上年度末	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	442,243,189.65	-	442,243,189.65
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	-442,243,189.65	-	-442,243,189.65
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。

7.4.7.9 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12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年12月31日
活期存款利息收入	166,355,207.28	126,345,691.25
定期存款利息收入	401,983,010.99	415,535,725.70
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	291,263.82	606,970.96
其他	195.49	-
合计	568,629,677.58	542,488,387.91

7.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

本集合计划本报告期及上年度可比期间无股票投资收益。

7.4.7.11 基金投资收益

本集合计划本报告期及上年度可比期间无基金投资收益。

7.4.7.12 债券投资收益

7.4.7.12.1 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12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年12月31日
债券投资收益——利息收入	383,236,617.62	453,012,695.25
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	3,545,349.47	2,525,120.77
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	386,781,967.09	455,537,816.02

7.4.7.12.2 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12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	22,321,277,513.27	40,033,103,109.94
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	22,306,731,964.17	39,989,236,538.33
减：应计利息总额	11,000,199.63	41,340,655.84
减：交易费用	-	795.00
买卖债券差价收入	3,545,349.47	2,525,120.77

7.4.7.13 资产支持证券投资收益

本集合计划本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

本集合计划本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

本集合计划本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

本集合计划本报告期及上年度可比期间无股利收益。

7.4.7.17 公允价值变动收益

本集合计划本报告期及上年度可比期间无公允价值变动收益。

7.4.7.18 其他收入

本集合计划本报告期及上年度可比期间无其他收入。

7.4.7.19 信用减值损失

本集合计划本报告期及上年度可比期间无信用减值损失。

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年12月31日
审计费用	13,500.00	15,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
汇划手续费	112,884.49	105,959.63
账户查询费	1,200.00	1,200.00
预提银行间账户维护费	18,000.00	18,000.00
预提上清所账户维护费	18,000.00	18,000.00
合计	283,584.49	278,159.63

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，本集合计划无需要披露的或有事项。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

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
中国证券登记结算有限责任公司	集合计划托管人、注册登记机构
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。

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

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。

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 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12月31日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
招商证券股份有限公司	151,752,051.38	100.00%	-	-

7.4.10.1.4 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12月31日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023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
招商证券股份有限公司	44,138,731,000.00	100.00%	62,217,119,000.00	100.00%

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本集合计划本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

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 2024年01月01日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	407,221,847.80	374,126,081.93
其中：应支付销售机构的客户维护费	199,680,002.69	183,389,711.79
应支付基金管理人的净管理费	207,541,845.11	190,736,370.14

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×I÷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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	22,623,436.09	20,784,782.32

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×0.05%÷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。

7.4.10.2.3 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12月31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	113,117,179.91
中国证券登记结算有限公司	0.00
合计	113,117,179.91
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12月31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	103,923,911.66
中国证券登记结算有限公司	0.00
合计	103,923,911.66

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×0.25%÷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。

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。

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。

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。

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

份额单位：份

项目	本期 2024年01月01日至 2024年12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至 2023年12月31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	155,893,685,659.00	128,169,214,767.00
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	155,509,710,053.00	127,927,943,680.00
报告期末持有的基金份额	1,285,744,101.00	901,768,495.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.19%	2.81%

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，除集合计划管理人之外的其他关联方无投资本集合计划的情况。

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 2024年01月01日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023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
中国证券登记结算有限责任公司	32,993,082.72	1,195,974.63	711,469,216.38	1,630,209.84

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。

7.4.10.7 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。

7.4.10.8 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。

7.4.11 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
-	-	442,243,189.65	442,243,189.65	-

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。

7.4.12 期末（2024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。

7.4.12.2 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。

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

截至本报告期末2024年12月31日止，本集合计划从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额2,320,291,040.71元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
112402076	24工商银行CD076	2025-01-02	98.93	376,000	37,199,555.81
112402084	24工商银行CD084	2025-01-02	99.07	5,000,000	495,341,801.78
112404040	24中国银行CD040	2025-01-02	98.92	1,075,000	106,338,212.91
112404053	24中国银行CD053	2025-01-02	98.69	1,075,000	106,096,670.64
112404057	24中国银行CD057	2025-01-02	98.57	1,075,000	105,959,335.97
112404058	24中国银行CD058	2025-01-02	98.60	3,226,000	318,073,948.14
112405282	24建设银行CD282	2025-01-02	98.78	1,850,000	182,750,117.87
112405290	24建设银行CD290	2025-01-02	98.77	1,075,000	106,174,048.47
112406252	24交通银行CD252	2025-01-02	98.85	1,054,000	104,189,555.00
112409101	24浦发银行CD101	2025-01-02	99.60	870,000	86,651,671.06
112410278	24兴业银行CD278	2025-01-02	98.43	1,076,000	105,907,922.05
112410284	24兴业银行CD284	2025-01-02	99.79	2,381,000	237,597,619.97
112411085	24平安银行CD085	2025-01-02	98.57	1,613,000	158,997,625.51
112416229	24上海银行CD229	2025-01-02	98.38	1,290,000	126,913,578.37
112420186	24广发银行CD186	2025-01-02	99.92	2,128,000	212,633,024.36
合计				25,164,000	2,490,824,687.91

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本集合计划本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指集合计划在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者集合计划所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致集合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。

7.4.13.2.1 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12月31日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	1,192,956,109.59	-
合计	1,192,956,109.59	-

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。

7.4.13.2.2 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。

7.4.13.2.3 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12月31日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	28,296,355,217.15	14,183,230,924.26
合计	28,296,355,217.15	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。

7.4.13.2.4 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。

7.4.13.2.5 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。

7.4.13.2.6 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。

7.4.13.3 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，集合计划管理人可能无法迅速、低成本地调整集合计划投资组合，从而对集合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集合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

现金流风险是指集合计划因现金流不足导致无法应对正常集合计划支付义务的风险。本集合计划管理人对集合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。

7.4.13.3.1 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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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集合计划面临的利率风险敞口进行监控，以对该风险进行管理。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2024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	5,871,099,341.81	8,169,856,388.29	11,036,411,807.04	-	-	-	25,077,367,537.14
结算备	4,788,569.18	-	-	-	-	-	4,788,569.18

付金							
交易性金融资产	1,398,876,083.59	5,732,429,100.17	22,358,006,142.98	-	-	-	29,489,311,326.74
买入返售金融资产	6,595,550,415.68	-	-	-	-	-	6,595,550,415.68
资产总计	13,870,314,410.26	13,902,285,488.46	33,394,417,950.02	-	-	-	61,167,017,848.74
负债							
卖出回购金融资产款	2,320,291,040.71	-	-	-	-	-	2,320,291,040.71
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	48,083,957.34	48,083,957.34
应付托管费	-	-	-	-	-	2,671,331.00	2,671,331.00
应付销售服务费	-	-	-	-	-	13,356,654.82	13,356,654.82
应交税费	-	-	-	-	-	72,702.08	72,702.08
应付利润	-	-	-	-	-	9,660,899.35	9,660,899.35
其他负债	-	-	-	-	-	338,214.57	338,214.57
负债总计	2,320,291,040.71	-	-	-	-	74,183,759.16	2,394,474,799.87
利率敏感度缺口	11,550,023,369.55	13,902,285,488.46	33,394,417,950.02	-	-	-74,183,759.16	58,772,543,048.87
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	5,816,774,317.83	7,572,106,668.67	4,399,984,831.58	-	-	-	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。

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12月31日	上年度末 2023年12月31日
	1.市场利率平行上升25个基点	-33,852,067.30	-14,826,008.42
	2.市场利率平行下降25个基点	33,952,665.67	14,866,139.66

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 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。

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。

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 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	-	-
第二层次	29,489,311,326.74	14,183,230,924.26

第三层次	-	-
合计	29,489,311,326.74	14,183,230,924.26

7.4.14.2.2 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。

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

无。

7.4.14.3 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。

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。

7.4.15 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。

§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	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	29,489,311,326.74	48.21
	其中：债券	29,489,311,326.74	48.21
	资产支持证券	-	-

2	买入返售金融资产	6,595,550,415.68	10.78
	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	25,082,156,106.32	41.01
4	其他各项资产	-	-
5	合计	61,167,017,848.74	100.00

本集合计划本报告期末未持有港股通交易机制投资的港股。

8.2 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	3.28	
	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	2,320,291,040.71	3.95
	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%。

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 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	118
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	118
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	87

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。

8.3.2 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	各期限负债占基金资

		产净值的比例(%)	产净值的比例(%)
1	30天以内	23.54	3.95
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	11.56	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天（含）—90天	11.13	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	15.54	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天（含）	42.06	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		103.83	3.95

8.4 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。

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	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	1,192,956,109.59	2.03
6	中期票据	-	-

7	同业存单	28,296,355,217.15	48.15
8	其他	-	-
9	合计	29,489,311,326.74	50.18
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

8.6 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	112410284	24兴业银行CD284	8,000,000	798,312,036.86	1.36
2	112416125	24上海银行CD125	6,000,000	599,708,583.47	1.02
3	112413100	24浙商银行CD100	5,000,000	498,646,082.54	0.85
4	112402084	24工商银行CD084	5,000,000	495,341,801.78	0.84
5	112410318	24兴业银行CD318	5,000,000	492,050,921.24	0.84
6	112410294	24兴业银行CD294	5,000,000	491,844,051.70	0.84
7	112411069	24平安银行CD069	4,500,000	446,919,973.97	0.76
8	112413142	24浙商银行CD142	4,000,000	397,362,838.21	0.68
9	112402071	24工商银行CD071	4,000,000	395,865,031.25	0.67
10	112402081	24工商银行CD081	4,000,000	395,595,125.68	0.67

8.7 “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	0.0743%
报告期内偏离度的最低值	0.0014%
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。

8.8 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。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 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。

8.9.2 本集合计划投资的前十名证券的发行主体中，兴业银行股份有限公司、上海银行股份有限公司、浙商银行股份有限公司、平安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。

8.9.3 期末其他各项资产构成

无。

8.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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。

§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
1,087,100	54,063.60	2,926,566,409.73	4.98%	55,845,976,639.14	95.02%

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。

9.2 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	1,285,744,101.00	2.19%
2	其他机构	218,319,816.15	0.37%
3	个人	187,714,499.58	0.32%
4	个人	134,848,373.94	0.23%
5	信托机构	96,536,521.43	0.16%
6	个人	78,521,312.58	0.13%
7	基金机构	76,218,495.81	0.13%
8	个人	72,653,355.58	0.12%
9	个人	72,592,191.98	0.12%
10	个人	71,973,849.76	0.12%

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	546,338.18	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）。

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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§10 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	1,254,243,792,510.59
减：本报告期基金总赎回份额	1,227,576,322,918.99
本报告期期末基金份额总额	58,772,543,048.87

§11 重大事件揭示

11.1 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。

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

本集合计划管理人于2024年7月26日发布公告，自2024年7月24日起，杨阳先生离任公司总经理，易卫东先生新任公司总经理。

本集合计划管理人于2024年12月7日发布公告，自2024年12月6日起，熊志钢先生离任公司合规总监，任晓伟女士新任公司合规总监。

本集合计划管理人于2024年12月24日发布公告，自2024年12月23日起，熊志钢先生离任公司副董事长、董事，唐佳强先生离任公司财务负责人，徐勇先生新任公司财务负责人。

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。

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。

11.4 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。

11.5 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聘请的会计师事务所未发生变更。截至本报告期末，德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）已连续2年为本集合计划提供审计服务，本报告年度的审计费用为13,500.00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，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。

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，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。

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	
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。

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		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%	44,138,731,000.00	100.00%	-	-	-	-

11.8 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。

11.9 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12月31日）	管理人网站	2024-12-31
2	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12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	2024-12-25
3	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	2024-12-24
4	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	2024-12-10

	速取款”服务额度调整的公告（2024年12月10日）		
5	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	2024-12-07
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12月2日）	管理人网站	2024-12-02
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11月29日）	管理人网站	2024-11-29
8	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11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	2024-11-26
9	招商证券资产管理有限公司关于旗下部分公开募集证券投资基金可投资于北京证券交易所股票的公告	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	2024-11-12
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11月12日）	管理人网站	2024-11-12
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11月11日）	管理人网站	2024-11-11
12	关于警惕假冒招商证券资产管理有限公司名义进行非法证券活动的风险提示	管理人网站	2024-11-06
13	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	2024-11-06

	速取款”服务额度调整的公告（2024年11月6日）		
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（2024年11月1日）	管理人网站	2024-11-01
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10月28日）	管理人网站	2024-10-28
16	关于警惕假冒招商证券资产管理有限公司名义进行非法证券活动的风险提示	管理人网站	2024-10-25
17	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3季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊，管理人网站	2024-10-24
18	招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划2024年第3季度报告	中国证监会基金电子披露网站，管理人网站	2024-10-24
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10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	2024-10-24
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10月21日）	管理人网站	2024-10-21
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10月18日）	管理人网站	2024-10-18
22	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	2024-10-17

	速取款”服务额度调整的公告（2024年10月17日）		
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10月14日）	管理人网站	2024-10-14
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10月11日）	管理人网站	2024-10-11
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10月10日）	管理人网站	2024-10-10
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10月9日）	管理人网站	2024-10-09
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10月8日）	管理人网站	2024-10-08
28	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9月30日）	管理人网站	2024-09-30
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9月27日）	管理人网站	2024-09-27
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9月25日）	管理人网站	2024-09-25

31	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9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	2024-09-25
32	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9月24日）	管理人网站	2024-09-24
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9月13日）	管理人网站	2024-09-13
34	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9月4日）	管理人网站	2024-09-04
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9月2日）	管理人网站	2024-09-02
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8月30日）	管理人网站	2024-08-30
37	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8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	2024-08-24
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8月23日）	管理人网站	2024-08-23
39	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20	中国证监会规定报刊，管理人网站	2024-08-21

	24年中期报告提示性公告		
40	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	中国证监会基金电子披露网站，管理人网站	2024-08-21
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8月20日）	管理人网站	2024-08-20
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8月16日）	管理人网站	2024-08-16
43	招商证券资产管理有限公司法定代表人变更公告	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	2024-08-13
44	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8月13日）	管理人网站	2024-08-13
45	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8月9日）	管理人网站	2024-08-09
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8月1日）	管理人网站	2024-08-01
47	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	2024-07-26
48	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7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	2024-07-24

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7月19日）	管理人网站	2024-07-19
50	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2季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊，管理人网站	2024-07-18
51	招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划2024年第2季度报告	中国证监会基金电子披露网站，管理人网站	2024-07-18
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7月15日）	管理人网站	2024-07-15
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7月12日）	管理人网站	2024-07-12
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7月10日）	管理人网站	2024-07-10
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	管理人网站	2024-07-08
56	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7月3日）	管理人网站	2024-07-03
57	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	2024-06-28

	速取款”服务额度调整的公告（2024年6月28日）		
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6月27日）	管理人网站	2024-06-27
59	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
60	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
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6月24日）	管理人网站	2024-06-24
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6月21日）	管理人网站	2024-06-21
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6月14日）	管理人网站	2024-06-14
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6月13日）	管理人网站	2024-06-13
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	管理人网站	2024-06-11

66	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
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6月6日）	管理人网站	2024-06-06
68	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
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	管理人网站	2024-06-04
70	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
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5月31日）	管理人网站	2024-05-31
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5月30日）	管理人网站	2024-05-30
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5月29日）	管理人网站	2024-05-29
74	关于招商资管智远天添利货	管理人网站	2024-05-24

	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）		
75	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
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5月17日）	管理人网站	2024-05-17
77	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
78	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
79	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
80	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
81	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
82	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

83	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
84	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
85	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
86	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
87	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
88	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
89	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
90	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（更新）提示性公告	中国证监会规定报刊，管理人网站	2024-04-18
91	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	管理人网站	2024-04-17

	告（2024年4月17日）		
92	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
93	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
94	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
95	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
96	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
97	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
98	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
99	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
100	招商证券资产管理有限公司	中国证监会规定报刊，管理	2024-03-25

	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	人网站	
101	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
102	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
103	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
104	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
105	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
106	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
107	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12日）	管理人网站	2024-03-12
108	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

109	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
110	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
111	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
112	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
113	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
114	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
115	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
116	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19日）	管理人网站	2024-02-19
117	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	2024-02-08

	速取款”服务额度调整的公告（2024年2月8日）		
118	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
119	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
120	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
121	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
122	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
123	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
124	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
125	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

126	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
127	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
128	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
129	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
130	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
131	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
132	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
133	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3日）	管理人网站	2024-01-03
134	招商证券资产管理有限公司关于旗下部分集合资产管理	中国证监会基金电子披露网站，中国证监会规定报刊，	2024-01-02

	计划改聘会计师事务所的公告	管理人网站	

§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

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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

自2024年8月13日起，本管理人的法定代表人由杨阳变更为易卫东。

§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。

13.2 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/。

13.3 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

二〇二五年三月二十五日