

# 招商资管智远增利债券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:中信银行股份有限公司

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。

基金托管人中信银行股份有限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2021年11月18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 .....	8
§4 管理人报告 .....	10
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 .....	13
§5 托管人报告 .....	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	14
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 .....	14
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 .....	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计） .....	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表 .....	16
6.3 净资产变动表 .....	18
6.4 报表附注 .....	20
§7 投资组合报告.....	44
7.1 期末基金资产组合情况.....	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	44
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	50
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	50
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	50
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	51
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	51
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	51
7.12 投资组合报告附注 .....	51
§8 基金份额持有人信息.....	53
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	53
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	54

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	55
§9 开放式基金份额变动.....	55
§10 重大事件揭示.....	56
10.1 基金份额持有人大会决议.....	56
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.....	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	56
10.4 基金投资策略的改变.....	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	56
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.....	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	57
10.8 其他重大事件.....	58
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	59
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.....	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	60
§12 备查文件目录.....	60
12.1 备查文件目录.....	60
12.2 存放地点.....	60
12.3 查阅方式.....	60

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	招商资管智远增利债券型集合资产管理计划		
基金简称	招商资管智远增利债券		
基金主代码	880011		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2021年11月18日		
基金管理人	招商证券资产管理有限公司		
基金托管人	中信银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	48,681,105.36份		
基金合同存续期	本集合计划自本集合计划合同变更生效日起存续期不得超过3年。本集合计划自集合计划合同变更生效日起3年后，按照中国证监会有关规定执行。		
下属分级基金的基金简称	招商资管智远增利债券D	招商资管智远增利债券A	招商资管智远增利债券C
下属分级基金的交易代码	880011	881012	881013
报告期末下属分级基金的份额总额	2,409,492.80份	43,128,304.70份	3,143,307.86份

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

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本集合计划主要投资于具有良好流动性的债券类资产及现金管理类工具，同时适时适度地参与权益类资产投资，在控制投资风险前提下，努力为委托人谋求收益，实现集合计划资产的长期稳定增值。
投资策略	本集合计划通过对固定收益类资产和权益类资产的合理配置实现严控风险、稳健增值的目的。本集合计划主要投资于各种债券类品种以及现金管理类金融品种，投资于股票等资产的投资比例不超过集合计划

	资产的20%。同时，管理人会在分析宏观经济、政府经济政策变化及证券市场趋势的基础上，动态调整集合计划的资产配置。具体包括：（1）债券投资策略；（2）资产支持证券投资策略；（3）股票投资策略；（4）现金管理类投资策略；（5）国债期货投资策略。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*10% + 中债-综合财富（总值）指数收益率*90%
风险收益特征	本集合计划是债券型集合资产管理计划，预期风险和预期收益高于货币市场基金，低于股票型基金、混合型基金。

### 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	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	唐佳强	滕菲菲
	联系电话	0755-26951111	4006800000
	电子邮箱	tangjq@cmschina.com.cn	tengfeifei@citicbank.com
客户服务电话		95565	95558
传真		-	010-85230024
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	北京市朝阳区光华路10号院1号楼6-30层、32-42层
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	北京市朝阳区光华路10号院1号楼6-30层、32-42层
邮政编码		518026	100020
法定代表人		易卫东	方合英

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="https://amc.cmschina.com/">https://amc.cmschina.com/</a>

基金中期报告备置地点	深圳市福田区福华一路111号招商证券大厦17、18楼
------------	----------------------------

## 2.5 其他相关资料

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

## §3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2024年01月01日-2024年06月30日)		
	招商资管智远增利债券D	招商资管智远增利债券A	招商资管智远增利债券C
本期已实现收益	58,808.83	3,866.30	-1,037.29
本期利润	96,533.18	-133,325.60	-5,100.36
加权平均基金份额本期利润	0.0384	-0.0082	-0.0042
本期加权平均净值利润率	3.11%	-0.75%	-0.40%
本期基金份额净值增长率	3.17%	3.14%	2.97%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2024年06月30日)		
期末可供分配利润	396,365.31	3,170,307.04	59,996.96
期末可供分配基金份额利润	0.1645	0.0735	0.0191
期末基金资产净值	3,014,064.64	47,426,604.70	3,282,096.10
期末基金份额净值	1.2509	1.0997	1.0442
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2024年06月30日)		
基金份额累计净值增长率	5.82%	9.97%	4.42%

注：（1）所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

（2）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

（3）期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

##### 招商资管智远增利债券D

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.08%	0.14%	0.44%	0.05%	-0.52%	0.09%
过去三个月	0.64%	0.14%	1.36%	0.08%	-0.72%	0.06%
过去六个月	3.17%	0.21%	3.52%	0.09%	-0.35%	0.12%
过去一年	5.86%	0.18%	4.32%	0.09%	1.54%	0.09%
自基金合同生效起至今	5.82%	0.15%	8.50%	0.11%	-2.68%	0.04%

##### 招商资管智远增利债券A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.07%	0.14%	0.44%	0.05%	-0.51%	0.09%
过去三个月	0.64%	0.14%	1.36%	0.08%	-0.72%	0.06%
过去六个月	3.14%	0.21%	3.52%	0.09%	-0.38%	0.12%
过去一年	6.94%	0.21%	4.32%	0.09%	2.62%	0.12%
自基金合同生效起至今	9.97%	0.20%	8.50%	0.11%	1.47%	0.09%

##### 招商资管智远增利债券C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	-0.11%	0.14%	0.44%	0.05%	-0.55%	0.09%
过去三个月	0.55%	0.14%	1.36%	0.08%	-0.81%	0.06%
过去六个月	2.97%	0.21%	3.52%	0.09%	-0.55%	0.12%
过去一年	5.35%	0.18%	4.32%	0.09%	1.03%	0.09%
自基金合同 生效起至今	4.42%	0.15%	8.50%	0.11%	-4.08%	0.04%

注：（1）本集合计划属于债券型集合资产管理计划，本集合计划业绩比较基准为“中债综合财富（总值）指数收益率\*90%+沪深300指数收益率\*10%”；

（2）本集合计划对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

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

招商资管智远增利债券D累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2021年11月18日-2024年06月30日)



招商资管智远增利债券A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2021年11月18日-2024年06月30日)招商资管智远增利债券C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2021年11月18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		
姚彦如	本集合计划的基金经理	2023-12-04	-	4	历任长城基金固定收益研究员、固定收益部投资经理、建信理财多元资产投资部投资经理，现为招商证券资产管理有限公司基金经理。担任【招商资管智远增利债券型集合资产管理计划】基金经理（自2023年12月4日起任职）、【招商资管睿丰三个月持有期债券型集合资产管理计划】基金经理（自2024年3月18日起任职）。

注：（1）对集合计划的首任基金经理，其“任职日期”为集合计划合同生效日，“离任日期”为根据本管理人决定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据本管理人决定确定的聘任日期和解聘日期；

（2）证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期末，本集合计划不存在基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情形。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本集合计划管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规及集合计划合同、集合计划招募说明书等有关集合计划法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划资产，在规范集合计划运作和严格控制投资风险的前提下，为集合计划持有人谋求最大利益，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**

上半年国内宏观经济整体平稳维持弱复苏，增长主要贡献来自于海外补库带来的出口需求、国内服务业复苏、设备更新需求以及去年增发的国债项目落地。分季度来看，二季度环比一季度供需均有所回落。上半年通胀数据偏弱，产能利用率偏低，经济更为明显的改善迹象仍需观察。上半年政策方面，货币政策有一次降准并引导5年LPR大幅下调，除此之外也引导存款机构下调存款利率。虽然央行没有调降政策利率，但上半年债券收益率大幅下行，久期策略体现出明显优势。权益市场方面，主要受到风险偏好与流动性影响，权益类资产出现较大波动。风格上来看大盘、价值类股票具有明显的优势。可转债上半年表现一般，指数而言今年以来收益为负，主要也是受市场风格拖累。

##### **4.4.2 报告期内基金的业绩表现**

截至报告期末招商资管智远增利债券D基金份额净值为1.2509元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为3.17%，同期业绩比较基准收益率为3.52%；截至报告期末招商资管智远增利债券A基金份额净值为1.0997元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为3.14%，同期业绩比较基准收益率为3.52%；截至报告期末招商资管智远增利债券C基金份额净值为1.0442元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为2.97%，同期业绩比较基准收益率为3.52%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为经济主要的看点在于一线城市二手房价能否企稳，改善能否衍生至的地产拿地、开工以及销售数据；专项债与特别国债能多大程度形成实物工作量。海外方面大选可能会对贸易以及风险偏好形成影响，但如果联储降息能超预期前置，则对汇率以及国内资产价格都会形成支撑。从资产价格来看，债券资产目前受到央行指导，较难突破前低，依然会维持低位震荡；权益资产价格偏低，但需要等待更为明确的业绩改善以及风险偏好改善；可转债资产价格偏低，供需格局有利，依然是固收+策略较好的增强资产，但需要对信用问题做更细致的甄别。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本集合计划本报告期末未进行利润分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

2023年12月19日至2024年3月4日、2024年3月12日至2024年5月23日，本集合计划存在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

作为本集合计划的托管人，中信银行严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对招商资管智远增利债券型集合资产管理计划2024年上半年的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本托管人认为，招商证券资产管理有限公司在招商资管智远增利债券型集合资产管理计划的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 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

本托管人认为，招商证券资产管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的2024年上半年报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## §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：招商资管智远增利债券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	3,445,261.37	246,895.39

结算备付金		327,579.97	-
存出保证金		5,674.50	6,546.19
交易性金融资产	6.4.7.2	49,984,112.79	3,605,227.16
其中：股票投资		6,048,335.71	251,178.68
基金投资		-	-
债券投资		43,935,777.08	3,354,048.48
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	-	-
应收清算款		237,430.51	-
应收股利		-	-
应收申购款		1,213.91	15,645.97
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		54,001,273.05	3,874,314.71
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年06月30日</b>	<b>上年度末 2023年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		107,896.32	45,738.34
应付赎回款		93,129.51	39.90
应付管理人报酬		38,204.45	9,644.75
应付托管费		5,457.78	1,377.83
应付销售服务费		1,278.17	3.76
应付投资顾问费		-	-

应交税费		113.35	25.89
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	32,428.03	30,889.71
负债合计		278,507.61	87,720.18
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	48,681,105.36	3,196,417.68
未分配利润	6.4.7.8	5,041,660.08	590,176.85
净资产合计		53,722,765.44	3,786,594.53
负债和净资产总计		54,001,273.05	3,874,314.71

注：（1）报告截止日2024年6月30日，招商资管智远增利债券A份额净值1.0997元，集合计划份额总额43,128,304.70份；招商资管智远增利债券C份额净值1.0442元，集合计划份额总额3,143,307.86份；招商资管智远增利债券D份额净值1.2509元，集合计划份额总额2,409,492.80份；总份额合计48,681,105.36份。（2）截至报告期末，招商资管智远增利债券D份额未达到业绩报酬计提标准，无暂估业绩报酬金额。

## 6.2 利润表

会计主体：招商资管智远增利债券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202 3年06月30日
一、营业总收入		44,315.28	820,603.10
1.利息收入		28,701.29	16,423.16
其中：存款利息收入	6.4.7.9	28,566.44	13,822.89
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		134.85	2,600.27
其他利息收入		-	-

2.投资收益（损失以“-”填列）		-17,904.09	244,423.54
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-118,163.04	276,144.33
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	60,719.21	-34,720.79
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	39,539.74	3,000.00
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	-103,530.62	492,808.57
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	137,048.70	66,947.83
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>86,208.06</b>	<b>168,601.98</b>
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	74,243.38	68,226.54
2.托管费	6.4.10.2.2	10,606.20	9,746.70
3.销售服务费	6.4.10.2.3	2,436.10	25,895.53
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		986.16	82.19
其中：卖出回购金融资产 支出		986.16	82.19
6.信用减值损失	6.4.7.19	-	-
7.税金及附加		203.00	210.92
8.其他费用	6.4.7.20	-2,266.78	64,440.10
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-41,892.78</b>	<b>652,001.12</b>
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-41,892.78	652,001.12
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-41,892.78	652,001.12

### 6.3 净资产变动表

会计主体：招商资管智远增利债券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	3,196,417.68	590,176.85	3,786,594.53
二、本期期初净资产	3,196,417.68	590,176.85	3,786,594.53
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	45,484,687.68	4,451,483.23	49,936,170.91
（一）、综合收益总额	-	-41,892.78	-41,892.78
（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）	45,484,687.68	4,493,376.01	49,978,063.69
其中：1.基金申购款	135,218,443.53	12,407,915.00	147,626,358.53
2.基金赎回款	-89,733,755.85	-7,914,538.99	-97,648,294.84
（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）			
四、本期期末净资产	48,681,105.36	5,041,660.08	53,722,765.44
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	66,642,846.39	112,331.19	66,755,177.58
二、本期期初净资产	66,642,846.39	112,331.19	66,755,177.58
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-17,310,517.67	1,778,916.79	-15,531,600.88
（一）、综合收益总额	-	652,001.12	652,001.12
（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）	-17,310,517.67	1,126,915.67	-16,183,602.00
其中：1.基金申购款	90,172,621.62	2,216,236.83	92,388,858.45
2.基金赎回款	-107,483,139.29	-1,089,321.16	-108,572,460.45
（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）	-	-	-
四、本期期末净资产	49,332,328.72	1,891,247.98	51,223,576.70

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

招商资管智远增利债券型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）原为招商证券智远增利集合资产管理计划（以下简称“原集合计划”），原集合计划于2011年9月20日经中国证券监督管理委员会证监许可[2011]1520号文核准设立，于2012年3月14日正式成立。原集合计划在募集期间收到有效净参与资金为人民币718,864,792.82元，折合认购份额718,864,792.82份；参与金额在推广期内产生的利息为人民币159,674.37元，折合159,674.37份集合计划份额；以上实收资金共计人民币719,024,467.19元，折合719,024,467.19份集合计划份额。上述出资业经天职国际会计师事务所有限公司审验，并出具了天职深QJ[2012]294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），托管人为中信银行股份有限公司。

根据中国证监会于2018年11月28日发布的《证券公司大集合资产管理业务适用<关于规范金融机构资产管理业务的指导意见>操作指引》（证监会公告〔2018〕39号）的规定，招商证券智远增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。

2021年9月24日，招商证券资产管理有限公司发布公告《关于“招商证券智远增利集合资产管理计划”变更为“招商资管智远增利债券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2021年11月18日起，《招商资管智远增利债券型集合资产管理计划集合资产管理合同》生效，原《招商证券智远增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，原招商证券智远增利集合资产管理计划份额变更为招商资管智远增利债券型集合资产管理计划的D类份额。本集合计划自本集合计划合同变更生效日起存续期不得超过3年。

本集合计划的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括主板、中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、地方政府债券、政府支持机构债券、政府支持债券、可转换债券、可交换债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、国债期货以及法律法规或中国证监会允许本集合计划投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

## 6.4.2 会计报表的编制基础

本集合计划财务报表以持续经营假设为基础，按照财政部颁布的《企业会计准则》、应用指南、解释及其他相关规定并参照《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》应用指南等相关法规规定进行确认和计量，基于下述主要会计政策和会计估计进行财务报表编制。

本财务报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	3,445,261.37
等于：本金	3,443,024.76
加：应计利息	2,236.61
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	3,445,261.37

### 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				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	6,089,540.33	-	6,048,335.71	-41,204.62	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	43,857,014.05	134,325.65	43,935,777.08	-55,562.62
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	43,857,014.05	134,325.65	43,935,777.08	-55,562.62
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	49,946,554.38	134,325.65	49,984,112.79	-96,767.24	

#### 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

本集合计划本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本集合计划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	116.35

应付证券出借违约金	-
应付交易费用	14,180.78
其中：交易所市场	14,180.78
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用-审计费	13,630.90
预提费用-账户维护费	4,500.00
合计	32,428.03

### 6.4.7.7 实收基金

#### 6.4.7.7.1 招商资管智远增利债券D

金额单位：人民币元

项目 (招商资管智远增利债券D)	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	2,613,792.23	2,613,792.23
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-204,299.43	-204,299.43
本期末	2,409,492.80	2,409,492.80

#### 6.4.7.7.2 招商资管智远增利债券A

金额单位：人民币元

项目 (招商资管智远增利债券A)	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	511,119.15	511,119.15
本期申购	128,873,127.75	128,873,127.75
本期赎回（以“-”号填列）	-86,255,942.20	-86,255,942.20
本期末	43,128,304.70	43,128,304.70

#### 6.4.7.7.3 招商资管智远增利债券C

金额单位：人民币元

项目 (招商资管智远增利债券C)	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	71,506.30	71,506.30
本期申购	6,345,315.78	6,345,315.78
本期赎回（以“-”号填列）	-3,273,514.22	-3,273,514.22
本期末	3,143,307.86	3,143,307.86

#### 6.4.7.8 未分配利润

##### 6.4.7.8.1 招商资管智远增利债券D

单位：人民币元

项目 (招商资管智远增利债券D)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	368,980.14	186,369.36	555,349.50
本期期初	368,980.14	186,369.36	555,349.50
本期利润	58,808.83	37,724.35	96,533.18
本期基金份额交易产生的变动数	-31,423.66	-15,887.18	-47,310.84
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-31,423.66	-15,887.18	-47,310.84
本期已分配利润	-	-	-
本期末	396,365.31	208,206.53	604,571.84

##### 6.4.7.8.2 招商资管智远增利债券A

单位：人民币元

项目 (招商资管智远增利债券A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	27,241.25	6,578.11	33,819.36
本期期初	27,241.25	6,578.11	33,819.36
本期利润	3,866.30	-137,191.90	-133,325.60

本期基金份额交易产生的变动数	3,139,199.49	1,258,606.75	4,397,806.24
其中：基金申购款	8,889,119.48	3,229,389.32	12,118,508.80
基金赎回款	-5,749,919.99	-1,970,782.57	-7,720,702.56
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,170,307.04	1,127,992.96	4,298,300.00

#### 6.4.7.8.3 招商资管智远增利债券C

单位：人民币元

项目 (招商资管智远增利债券C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	118.31	889.68	1,007.99
本期期初	118.31	889.68	1,007.99
本期利润	-1,037.29	-4,063.07	-5,100.36
本期基金份额交易产生的变动数	60,915.94	81,964.67	142,880.61
其中：基金申购款	128,279.36	161,126.84	289,406.20
基金赎回款	-67,363.42	-79,162.17	-146,525.59
本期已分配利润	-	-	-
本期末	59,996.96	78,791.28	138,788.24

#### 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	28,179.86
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	369.57
其他	17.01
合计	28,566.44

**6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
卖出股票成交总额	7,796,462.83
减：卖出股票成本总额	7,893,285.52
减：交易费用	21,340.35
买卖股票差价收入	-118,163.04

**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	113,558.89
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-52,839.68
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	60,719.21

**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	30,199,821.26
减：卖出债券（债	30,128,496.74

转股及债券到期兑付) 成本总额	
减: 应计利息总额	123,278.52
减: 交易费用	885.68
买卖债券差价收入	-52,839.68

#### 6.4.7.13 资产支持证券投资收益

本集合计划本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

本集合计划本报告期无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

本集合计划本报告期无衍生工具收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位: 人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
股票投资产生的股利收益	39,539.74
其中: 证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	39,539.74

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位: 人民币元

项目名称	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
1.交易性金融资产	-103,530.62
——股票投资	-44,866.37
——债券投资	-58,664.25
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-

——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-103,530.62

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
基金赎回费收入	137,048.70
合计	137,048.70

#### 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	3,630.90
信息披露费	-
证券出借违约金	-
汇划手续费	350.00
账户维护费_上清所	9,000.00
账户维护费_中债登	-15,547.68
账户查询费	300.00
合计	-2,266.78

## 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
中信银行股份有限公司	基金托管人、销售机构
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

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	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
招商证券股份有限公司	21,532,436.30	100.00%	7,069,130.78	100.00%

注：股票交易金额已包含增值税。

#### 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	100,779,858.54	100.00%	191,330,611.68	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 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	11,830,000.00	100.00%	26,400,000.00	100.00%

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日

	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
招商证券股份有限公司	16,061.09	100.00%	14,180.78	100.00%
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			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
招商证券股份有限公司	5,169.68	100.00%	153.75	100.00%

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

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 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
当期发生的基金应支付的管理费	74,243.38	68,226.54
其中：应支付销售机构的客户维护费	35,230.32	23,287.47
应支付基金管理人的净管理费	39,013.06	44,939.07

注：本集合计划的A类、C类、D类份额管理费按前一日集合计划资产净值的0.7%年费率计提。本集合计划各类份额的管理费按该类份额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。

本集合计划A类份额、C类份额不提取业绩报酬。D类份额在D类份额持有人赎回D类份额时，管理人将根据D类份额持有人的持有期间年化收益率（R），对D类份额持有期间年化收益率超过6%以上部分按照20%的比例收取管理人业绩报酬。赎回的D类份额采取“先进先出”原则，集合计划管理人分别计算每一笔赎回的D类份额的业绩报酬；当本集合计划终止时，所有D类份额视同全部赎回，按规定计提业绩报酬。业绩报酬的计提，以集合计划份额持有人赎回时对应份额持有期间收益为基准，按比例提取，具体提取比例如下：

当集合计划份额持有人本次赎回对应份额持有期间的年化收益率低于6%（含），不提取业绩报酬；

当集合计划份额持有人本次赎回对应份额持有期间的年化收益率高于6%（不含），提取该对应份额年化收益率6%以上部分收益的20%作为业绩报酬。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024 年06月30日	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托管费	10,606.20	9,746.70

注：本集合计划托管费按前一日集合计划资产净值的0.1%年费率计提，计算方法如下：

$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$ ，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			
	招商资管智远增利 债券D	招商资管智远增利 债券A	招商资管智远增利 债券C	合计
招商证券股份有限公司	0.00	0.00	973.59	973.59
中信银行股份有限公司	0.00	0.00	0.00	0.00
合计	-	-	973.59	973.59
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			
	招商资管智远增利 债券D	招商资管智远增利 债券A	招商资管智远增利 债券C	合计
招商证券股份有限公司	0.00	0.00	25,894.68	25,894.68
中信银行股份有限公司	0.00	0.00	0.00	0.00
合计	-	-	25,894.68	25,894.68

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

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

H 为C类份额每日应计提的销售服务费

E 为C类份额前一日的资产净值

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

本报告期内，本集合计划管理人不存在运用固有资金（认）申购、赎回或买卖本集合计划的情况。

##### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末，没有除集合计划管理人之外的其他关联方投资本集合计划的情况。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信银行股份有限公司	3,445,261.37	28,179.86	8,918,323.07	13,186.60

公司				
----	--	--	--	--

注：本集合计划的银行存款由集合计划托管人中信银行股份有限公司保管，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

本集合计划于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之外的基金

本集合计划本报告期末未进行利润分配。

#### 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	-	-
A-1以下	-	-
未评级	28,696,371.42	2,512,974.69
合计	28,696,371.42	2,512,974.69

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、债券投资以净价列示。

##### 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

本集合计划本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

##### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	2,789,893.88	300,992.71
AAA以下	5,593,713.31	540,081.08
未评级	6,855,798.47	-
合计	15,239,405.66	841,073.79

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上的国债、中期票据；3、债券投资以净价列示。

#### 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 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	3,445,261.37	-	-	-	-	-	3,445,261.37
结算备付金	327,579.97	-	-	-	-	-	327,579.97
存出保证金	5,674.50	-	-	-	-	-	5,674.50
交易性金融资产	1,256,791.27	495,437.47	34,680,486.99	7,503,061.35	-	6,048,335.71	49,984,112.79
应收清算款	-	-	-	-	-	237,430.51	237,430.51
应收申购款	-	-	-	-	-	1,213.91	1,213.91
资产总计	5,035,307.11	495,437.47	34,680,486.99	7,503,061.35	-	6,286,980.13	54,001,273.05
负债							
应付清算款	-	-	-	-	-	107,896.32	107,896.32
应付赎回款	-	-	-	-	-	93,129.51	93,129.51

应付管理人报酬	-	-	-	-	-	38,204.45	38,204.45
应付托管费	-	-	-	-	-	5,457.78	5,457.78
应付销售服务费	-	-	-	-	-	1,278.17	1,278.17
应交税费	-	-	-	-	-	113.35	113.35
其他负债	-	-	-	-	-	32,428.03	32,428.03
负债总计	-	-	-	-	-	278,507.61	278,507.61
利率敏感度缺口	5,035,307.11	495,437.47	34,680,486.99	7,503,061.35	-	6,008,472.52	53,722,765.44
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	246,895.39	-	-	-	-	-	246,895.39
存出保证金	6,546.19	-	-	-	-	-	6,546.19
交易性金融资产	-	105,966.93	3,248,081.55	-	-	251,178.68	3,605,227.16
应收申购款	-	-	-	-	-	15,645.97	15,645.97
资产总计	253,441.58	105,966.93	3,248,081.55	-	-	266,824.65	3,874,314.71
负债							
应付清算款	-	-	-	-	-	45,738.34	45,738.34
应付赎回款	-	-	-	-	-	39.90	39.90
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	9,644.75	9,644.75

应付托管费	-	-	-	-	-	1,377.83	1,377.83
应付销售服务费	-	-	-	-	-	3.76	3.76
应交税费	-	-	-	-	-	25.89	25.89
其他负债	-	-	-	-	-	30,889.71	30,889.71
负债总计	-	-	-	-	-	87,720.18	87,720.18
利率敏感度缺口	253,441.58	105,966.93	3,248,081.55	-	-	179,104.47	3,786,594.53

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	-135,277.02	-3,662.93
	2.市场利率平行下降25个基点	135,950.39	3,669.94

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

## 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日		上年度末 2023年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	6,048,335.71	11.26	251,178.68	6.63
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	8,383,607.19	15.61	636,667.47	16.81
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	14,431,942.90	26.86	887,846.15	23.44

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

## 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1.权益性投资的市场价格上升或下降5%； 2.除沪深300指数以外的其他市场变量保持不变。		
	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.权益性投资的市场价	513,746.77	8,817.51

	格上升5%		
	2.权益性投资的市场价格下降5%	-513,746.77	-8,817.51

#### 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	14,431,942.90	887,846.15
第二层次	35,552,169.89	2,717,381.01
第三层次	-	-
合计	49,984,112.79	3,605,227.16

###### 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	权益投资	6,048,335.71	11.20
	其中：股票	6,048,335.71	11.20
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	43,935,777.08	81.36
	其中：债券	43,935,777.08	81.36
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	3,772,841.34	6.99
8	其他各项资产	244,318.92	0.45
9	合计	54,001,273.05	100.00

本集合计划本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

#### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

##### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-

B	采矿业	967,981.00	1.80
C	制造业	3,561,578.71	6.63
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	576,164.00	1.07
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	942,612.00	1.75
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	6,048,335.71	11.26

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本集合计划本报告期末未持有港股通投资股票投资组合。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600489	中金黄金	23,800	352,240.00	0.66
2	601088	中国神华	7,700	341,649.00	0.64
3	601658	邮储银行	64,800	328,536.00	0.61
4	601318	中国平安	7,700	318,472.00	0.59

5	600011	华能国际	31,400	302,068.00	0.56
6	002142	宁波银行	13,400	295,604.00	0.55
7	600150	中国船舶	7,100	289,041.00	0.54
8	002475	立讯精密	7,200	283,032.00	0.53
9	600309	万华化学	3,500	283,010.00	0.53
10	003816	中国广核	59,200	274,096.00	0.51
11	601899	紫金矿业	15,600	274,092.00	0.51
12	600600	青岛啤酒	3,700	269,249.00	0.50
13	300750	宁德时代	1,400	252,042.00	0.47
14	688012	中微公司	1,636	231,101.36	0.43
15	600089	特变电工	16,000	221,920.00	0.41
16	000513	丽珠集团	5,600	208,376.00	0.39
17	601799	星宇股份	1,700	190,468.00	0.35
18	300394	天孚通信	2,100	185,682.00	0.35
19	603986	兆易创新	1,900	181,678.00	0.34
20	300308	中际旭创	1,300	179,244.00	0.33
21	300274	阳光电源	2,720	168,721.60	0.31
22	601138	工业富联	5,900	161,660.00	0.30
23	688525	佰维存储	2,265	145,299.75	0.27
24	002384	东山精密	6,500	134,550.00	0.25
25	002409	雅克科技	1,600	100,656.00	0.19
26	300014	亿纬锂能	1,900	75,848.00	0.14

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601658	邮储银行	542,838.00	14.34
2	002384	东山精密	501,261.00	13.24

3	002142	宁波银行	435,587.00	11.50
4	300308	中际旭创	434,742.00	11.48
5	601318	中国平安	418,781.00	11.06
6	600941	中国移动	418,469.00	11.05
7	601899	紫金矿业	405,384.00	10.71
8	600309	万华化学	391,355.00	10.34
9	600547	山东黄金	377,789.00	9.98
10	688192	迪哲医药	371,491.35	9.81
11	300750	宁德时代	363,059.00	9.59
12	600600	青岛啤酒	359,128.00	9.48
13	600011	华能国际	352,071.00	9.30
14	600489	中金黄金	340,719.00	9.00
15	300274	阳光电源	326,847.00	8.63
16	601088	中国神华	322,070.00	8.51
17	601857	中国石油	320,609.00	8.47
18	002475	立讯精密	312,320.00	8.25
19	000858	五粮液	300,887.00	7.95
20	600188	兖矿能源	295,562.00	7.81
21	300394	天孚通信	279,249.00	7.37
22	600048	保利发展	279,010.00	7.37
23	300442	润泽科技	277,842.00	7.34
24	601799	星宇股份	270,925.00	7.15
25	600129	太极集团	263,077.00	6.95
26	600150	中国船舶	262,191.00	6.92
27	000513	丽珠集团	257,462.00	6.80
28	600760	中航沈飞	251,923.00	6.65
29	003816	中国广核	251,196.00	6.63
30	601985	中国核电	250,540.00	6.62
31	601100	恒立液压	237,295.00	6.27
32	688012	中微公司	236,057.32	6.23
33	600089	特变电工	230,545.00	6.09

34	300502	新易盛	222,276.00	5.87
35	688256	寒武纪	218,225.20	5.76
36	002371	北方华创	207,860.00	5.49
37	600872	中炬高新	180,311.00	4.76
38	603986	兆易创新	179,347.00	4.74
39	601138	工业富联	142,021.00	3.75
40	600028	中国石化	136,375.00	3.60
41	688525	佰维存储	131,813.82	3.48
42	601728	中国电信	101,142.00	2.67
43	002409	雅克科技	99,975.00	2.64
44	301091	深城交	96,483.00	2.55
45	601865	福莱特	83,476.00	2.20
46	000333	美的集团	82,443.00	2.18
47	603228	景旺电子	79,092.00	2.09
48	300014	亿纬锂能	78,333.00	2.07

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

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600941	中国移动	418,134.00	11.04
2	002384	东山精密	378,839.00	10.00
3	600547	XD山东黄	358,280.00	9.46
4	688192	迪哲医药	345,148.86	9.12
5	601857	中国石油	312,664.00	8.26
6	600048	保利发展	277,282.00	7.32
7	600188	兖矿能源	277,193.00	7.32
8	300502	新易盛	276,546.00	7.30

9	300442	润泽科技	272,711.00	7.20
10	000858	五粮液	268,572.00	7.09
11	601985	中国核电	260,140.00	6.87
12	300308	中际旭创	248,212.00	6.56
13	600760	中航沈飞	247,407.00	6.53
14	688256	寒武纪	239,868.00	6.33
15	601100	恒立液压	238,252.00	6.29
16	002371	北方华创	227,866.00	6.02
17	600129	太极集团	216,160.00	5.71
18	601658	邮储银行	214,668.00	5.67
19	600872	中炬高新	168,905.00	4.46
20	688100	威胜信息	140,773.10	3.72
21	600028	中国石化	134,810.00	3.56
22	601899	紫金矿业	128,188.00	3.39
23	300274	阳光电源	119,101.00	3.15
24	600150	中国船舶	111,431.00	2.94
25	601728	中国电信	102,329.00	2.70
26	002142	宁波银行	100,920.00	2.67
27	301091	深城交	94,896.00	2.51
28	002475	立讯精密	85,610.00	2.26
29	600309	万华化学	84,908.00	2.24
30	300394	天孚通信	83,460.00	2.20
31	603228	景旺电子	82,526.00	2.18
32	601318	中国平安	79,179.00	2.09
33	000333	美的集团	78,648.00	2.08
34	000589	贵州轮胎	77,764.00	2.05

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

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	13,735,308.92
卖出股票收入（成交）总额	7,796,462.83

注：本项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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	35,552,169.89	66.18
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	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	8,383,607.19	15.61
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	43,935,777.08	81.78

### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	019740	24国债09	286,000	28,696,371.42	53.42
2	019739	24国债08	68,000	6,855,798.47	12.76
3	113052	兴业转债	6,940	751,009.82	1.40
4	132026	G三峡EB2	5,000	647,262.88	1.20
5	113056	重银转债	3,060	331,894.26	0.62

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本集合计划本报告期末未持有资产支持证券。

**7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**

本集合计划本报告期末未持有贵金属。

**7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

本集合计划本报告期末未持有权证。

**7.10 本基金投资股指期货的投资政策**

本集合计划本报告期内未参与股指期货投资。

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

本集合计划本报告期末未参与国债期货交易。

**7.11.2 本期国债期货投资评价**

本集合计划本报告期末未参与国债期货投资。

**7.12 投资组合报告附注**

**7.12.1** 本集合计划投资的前十名证券的发行主体中，中国邮政储蓄银行股份有限公司曾受到中国人民银行及其派出机构的处罚和公开批评，重庆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。

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

**7.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	5,674.50
2	应收清算款	237,430.51
3	应收股利	-

4	应收利息	-
5	应收申购款	1,213.91
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	244,318.92

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113052	兴业转债	751,009.82	1.40
2	132026	G三峡EB2	647,262.88	1.20
3	113056	重银转债	331,894.26	0.62
4	127056	中特转债	328,015.64	0.61
5	113616	韦尔转债	321,081.39	0.60
6	113045	环旭转债	301,731.85	0.56
7	127050	麒麟转债	279,380.39	0.52
8	113067	燃23转债	263,226.68	0.49
9	127020	中金转债	256,544.35	0.48
10	113623	风21转债	256,367.77	0.48
11	127049	希望转2	255,653.83	0.48
12	118024	冠宇转债	242,330.86	0.45
13	127086	恒邦转债	240,912.42	0.45
14	113069	博23转债	239,644.32	0.45
15	118013	道通转债	230,688.70	0.43
16	127045	牧原转债	229,605.48	0.43
17	113061	拓普转债	226,708.60	0.42
18	127095	广泰转债	221,874.58	0.41
19	110068	龙净转债	217,228.35	0.40
20	127039	北港转债	212,830.77	0.40

21	123188	水羊转债	206,884.36	0.39
22	111002	特纸转债	200,654.23	0.37
23	127031	洋丰转债	197,995.06	0.37
24	113641	华友转债	175,539.66	0.33
25	123192	科思转债	170,011.41	0.32
26	113669	景23转债	161,434.59	0.30
27	118036	力合转债	160,895.43	0.30
28	127066	科利转债	147,280.04	0.27
29	113655	欧22转债	142,575.37	0.27
30	123225	翔丰转债	135,583.88	0.25
31	113619	世运转债	135,069.59	0.25
32	113652	伟22转债	132,342.90	0.25
33	128128	齐翔转2	123,256.62	0.23
34	123235	亿田转债	109,284.27	0.20
35	123025	精测转债	77,695.60	0.14
36	123133	佩蒂转债	53,111.24	0.10

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本集合计划本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持 有 人 户 数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总 份额 比例	持有份额	占总份 额比例

招商资管智远增利债券D	128	18,824.16	0.32	0.00%	2,409,492.48	100.00%
招商资管智远增利债券A	617	69,900.01	906,757.45	2.10%	42,221,547.25	97.90%
招商资管智远增利债券C	192	16,371.40	286,998.95	9.13%	2,856,308.91	90.87%
合计	937	51,954.22	1,193,756.72	2.45%	47,487,348.64	97.55%

注：（1）分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）；（2）户均持有的基金份额合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	招商资管智远增利债券D	7,207.59	0.30%
	招商资管智远增利债券A	2,649,252.89	6.14%
	招商资管智远增利债券C	389,804.79	12.40%
	合计	3,046,265.27	6.26%

注：对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	招商资管智远增利债券D	0~10
	招商资管智远增利债券A	10~50
	招商资管智远增利债券C	10~50
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	招商资管智远增利债券D	0
	招商资管智远增利债券A	10~50
	招商资管智远增利债券C	0
	合计	10~50

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

	招商资管智远增利债券D	招商资管智远增利债券A	招商资管智远增利债券C
基金合同生效日(2021年11月18日)基金份额总额	5,717,469.29	-	-
本报告期期初基金份额总额	2,613,792.23	511,119.15	71,506.30
本报告期基金总申购份额	-	128,873,127.75	6,345,315.78
减：本报告期基金	204,299.43	86,255,942.20	3,273,514.22

总赎回份额			
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	2,409,492.80	43,128,304.70	3,143,307.86

## §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	21,532,436.30	100.00%	16,061.09	100.00%	-

注：（1）本报告期本集合计划交易单元未发生变更。

（2）交易单元的选择标准：

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

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

### 10.7.2 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	成交金额	占当期债券回	成交金额	占当期权证成	成交金额	占当期基金成

		交总额的 比例		购成交总额的 比例		交总额的 比例		交总额的 比例
招商证券股份 有限公司	100,779,8 58.54	100.0 0%	11,830,0 00.00	100.0 0%	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	招商证券资产管理有限公司关于旗下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
2	招商证券资产管理有限公司关于旗下部分参照公募基金管理运作集合资产管理计划增加上海利得基金销售有限公司为销售机构及参加其费率优惠活动的公告	中国证监会基金电子披露网站，中国证监会规定报刊，管理人网站	2024-06-07
3	招商证券资产管理有限公司关于旗下参照公募基金管理运作的集合资产管理计划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
4	招商资管智远增利债券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
5	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
6	招商资管智远增利债券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

7	关于招商资管智远增利债券型集合资产管理计划暂停大额申购的公告	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	2024-03-25
8	招商证券资产管理有限公司关于旗下部分参照公募基金管理运作集合资产管理计划参加招商证券股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会基金电子披露网站，中国证监会规定报刊，管理人网站	2024-03-25
9	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
10	招商资管智远增利债券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
11	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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2024年03月12日-2024年03月12日	0.00	9,268,631.81	9,268,631.81	0.00	0.00%

个人	1	2024年05月15日-2024年05月23日	0.00	16,417,488.82	16,417,488.82	0.00	0.00%
产品特有风险							
报告期内，本集合计划存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况。 报告期内，未发现本集合计划实质上存在特有风险。							

## 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增利集合资产管理计划合同变更的回函；

2. 《招商资管智远增利债券型集合资产管理计划集合资产管理合同》；

3. 《招商资管智远增利债券型集合资产管理计划托管协议》；

4. 《招商资管智远增利债券型集合资产管理计划招募说明书》；

5. 《招商资管智远增利债券型集合资产管理计划产品资料概要》；

6. 集合计划管理人业务资格批件、营业执照；

7. 中国证券监督管理委员会要求的其他文件。

### 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