

# 招商安达灵活配置混合型证券投资基金 2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：招商基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2024 年 3 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 3 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告财务资料已经审计，德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了 2023 年度无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§2 基金简介.....	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	7
§4 管理人报告.....	7
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	11
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
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.....	13
§5 托管人报告.....	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	14
§6 审计报告.....	14
6.1 审计报告的基本内容.....	14
§7 年度财务报表.....	16
7.1 资产负债表.....	16
7.2 利润表.....	17
7.3 净资产变动表.....	19
7.4 报表附注.....	20
§8 投资组合报告.....	47
8.1 期末基金资产组合情况.....	47
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	48
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	49
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	51
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	55
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	55
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	55

8.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	56
8.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	56
8.10	本基金投资股指期货的投资政策.....	56
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	56
8.12	投资组合报告附注.....	56
§9	基金份额持有人信息.....	57
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	57
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	57
9.3	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.....	57
§10	开放式基金份额变动.....	58
§11	重大事件揭示.....	58
11.1	基金份额持有人大会决议.....	58
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.....	58
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	58
11.4	基金投资策略的改变.....	58
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.....	59
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	59
11.8	其他重大事件.....	60
§12	备查文件目录.....	62
12.1	备查文件目录.....	62
12.2	存放地点.....	62
12.3	查阅方式.....	62

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	招商安达灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	招商安达灵活配置混合
基金主代码	217020
交易代码	217020
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 10 月 10 日
基金管理人	招商基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	60,395,966.03 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过灵活动态的资产配置，在股市和债市之间选择投资机会，精选股票和债券品种，适当集中投资，致力于在多种市场环境下为投资者创造超额收益。
投资策略	<p>资产配置方法：在资产配置方法上，投资组合管理人在借鉴国际先进投资技术的基础上，结合国内实际情况和自身的投资管理经验，建立了自己的资产配置体系。招商基金的资产配置体系分为战略资产配置和战术资产配置。</p> <p>股票投资策略：本基金的股票投资采取自下而上的方法，以深入的基本面研究为基础，精选具有一定核心优势的且成长性良好、价值被低估的上市公司股票，构建投资组合，以寻求超越业绩基准的超额收益。</p> <p>货币市场工具投资策略：在本基金的货币市场工具投资过程中，将以严谨的市场价值分析为基础，采用稳健的投资组合策略，通过对短期金融工具的组合操作，在保持资产流动性的同时，追求稳定的投资收益。</p> <p>债券投资策略：根据国内外宏观经济形势、财政、货币政策、市场资金与债券供求状况、央行公开市场操作等方面情况，采用定性与定量相结合的方式，确定债券投资的组合久期，并根据通胀预期确定浮息债与固定收益债比例；在满足组合久期设置的基础上，投资团队分析债券收益率曲线变动、各期限品种收益率及收益率基差波动等因素，预测收益率曲线的变动趋势，并结合流动性偏好、信用分析等多种市场因素进行分析，综合评判个券的投资价值。在个券选择的基础上，投资团队构建模拟组合，并比较不同模拟组合之间的收益和风险匹配情况，确定风险、收益最佳匹配的组合。</p> <p>权证投资策略：本基金对权证资产的投资主要是通过分析影响权证内在价值最重要的两种因素——标的资产价格以及市场隐含波动率的变化，灵活构建避险策略，波动率差策略以及套利策略。</p> <p>存托凭证投资策略：在控制风险的前提下，本基金将根据本基金的投资</p>

	目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*55%+标普中国全债指数收益率*45%
风险收益特征	本基金是混合型基金，属于基金中的中高风险品种。

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	招商基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	潘西里
	联系电话	0755-83196666
	电子邮箱	cmf@cmfchina.com
客户服务电话	400-887-9555	95599
传真	0755-83196475	010-68121816
注册地址	深圳市福田区深南大道 7088 号	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址	深圳市福田区深南大道 7088 号	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	518040	100031
法定代表人	王小青	谷澍

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.cmfchina.com">http://www.cmfchina.com</a>
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）	中国上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼
注册登记机构	招商基金管理有限公司	深圳市福田区深南大道 7088 号

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2023 年	2022 年	2021 年
本期已实现收益	-51,002,066.74	-11,161,949.65	37,820,068.76
本期利润	-60,086,311.12	-46,476,576.54	15,129,262.64
加权平均基金份额本期利润	-0.9004	-0.6771	0.2297

本期加权平均净值利润率	-45.03%	-24.70%	7.91%
本期基金份额净值增长率	-35.44%	-20.89%	8.49%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
期末可供分配利润	49,626,314.28	118,188,905.60	136,185,613.88
期末可供分配基金份额利润	0.8217	1.6958	2.0363
期末基金资产净值	96,176,103.49	171,906,264.39	208,525,500.98
期末基金份额净值	1.5924	2.4665	3.1179
3.1.3 累计期末指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
基金份额累计净值增长率	30.31%	101.84%	155.15%

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

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

3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

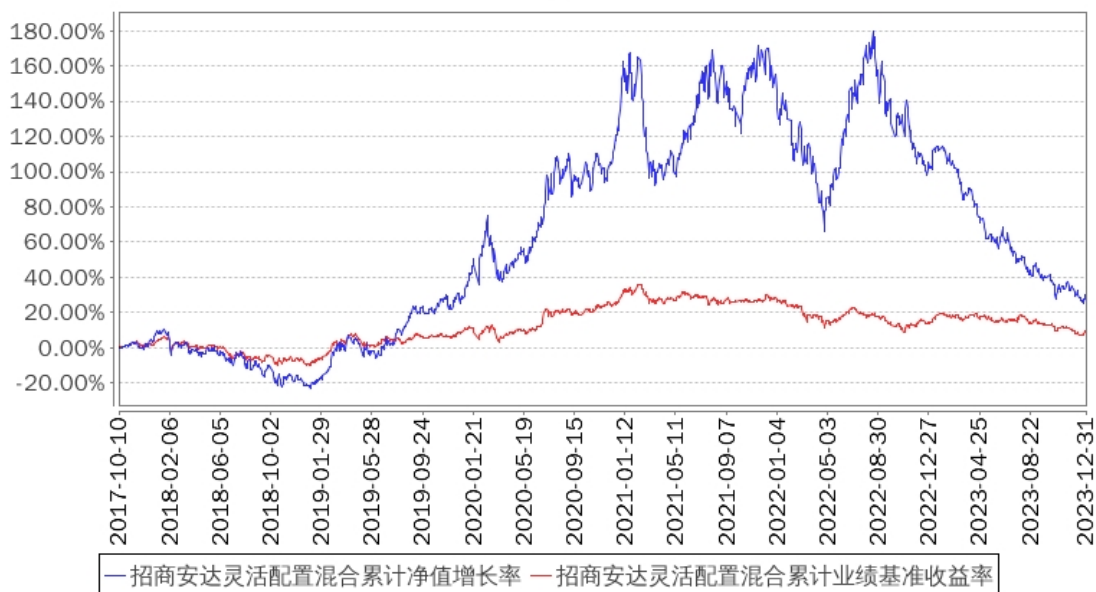
## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-7.00%	1.11%	-3.27%	0.44%	-3.73%	0.67%
过去六个月	-21.10%	1.16%	-5.10%	0.46%	-16.00%	0.70%
过去一年	-35.44%	1.11%	-4.27%	0.46%	-31.17%	0.65%
过去三年	-44.59%	1.87%	-14.67%	0.61%	-29.92%	1.26%
过去五年	64.90%	1.81%	20.64%	0.66%	44.26%	1.15%
自基金合同生效起至今	30.31%	1.73%	9.49%	0.67%	20.82%	1.06%

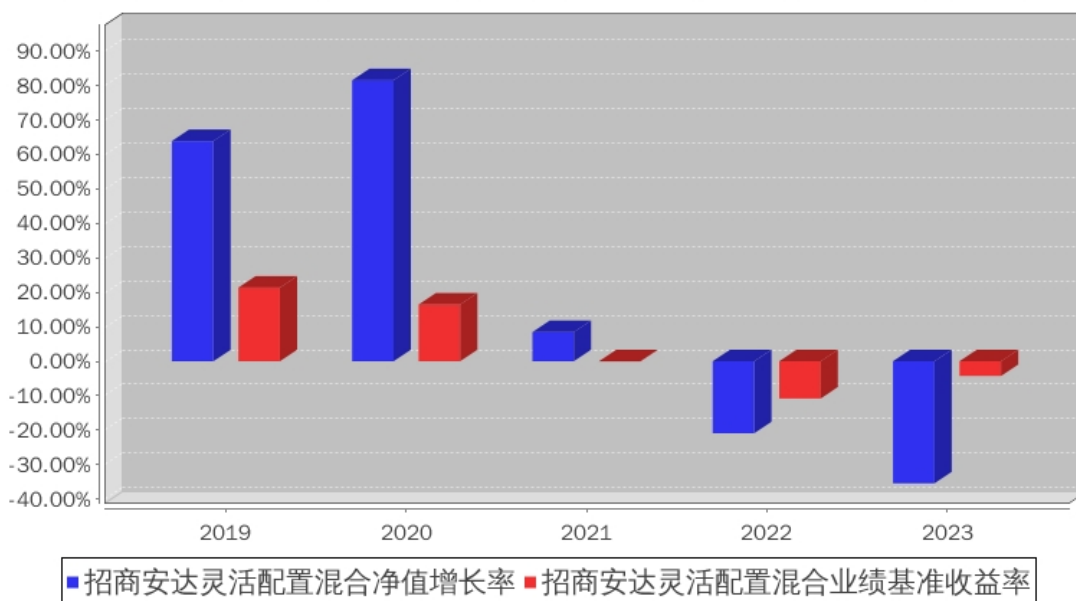
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

招商安达灵活配置混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



### 3.2.3 过去五年以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

招商安达灵活配置混合基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

## § 4 管理人报告



## 4.1 基金管理人及基金经理情况

### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

招商基金管理有限公司于 2002 年 12 月 27 日经中国证监会【2002】100 号文批准设立。目前，公司注册资本为人民币 13.1 亿元，招商银行股份有限公司持有公司全部股权的 55%，招商证券股份有限公司持有公司全部股权的 45%。

招商基金管理有限公司首批获得企业年金基金投资管理人资格、基本养老保险基金投资管理人资格；2004 年获得全国社保基金投资管理人资格；同时拥有合格境内机构投资者（QDII）业务资格、专户理财（特定客户资产管理业务）资格、公募基金投顾业务资格，在主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、海外投资、FOF 投资等领域全面布局。

### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王奇玮	本基金基金经理	2017 年 11 月 30 日	-	12	男，硕士。2011 年加入长江证券股份有限公司研究部，曾任分析师、高级分析师、资深分析师，食品饮料小组组长；2014 年 12 月加入招商基金管理有限公司，曾任研究部高级研究员、招商安泰偏股混合型证券投资基金基金经理，现任招商安达灵活配置混合型证券投资基金、招商丰盛稳定增长灵活配置混合型证券投资基金、招商商业模式优选混合型证券投资基金、招商兴和优选 1 年持有期混合型证券投资基金、招商企业优选混合型证券投资基金、招商远见成长混合型证券投资基金基金经理。

注：1、本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告（生效）日期；

2、证券从业年限计算标准遵从中国证监会《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

基金管理人声明：在本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关法律法规及其各项实施准则的规定以及本基金的基金合同等基金法律文件的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的前提下，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作

整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围以及投资运作符合有关法律、法规及基金合同的规定。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

基金管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》（2011 年修订）的规定，制定了《招商基金管理有限公司公平交易管理办法》，对投资决策的内部控制、交易执行的内部控制、公平交易实施情况的监控与检查稽核、异常交易的监控等进行了规定。为保证各投资组合在投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会，基金管理人合理设置了各类资产管理业务之间以及各类资产管理业务内部的组织结构，建立了科学的投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

基金管理人已建立较完善的研究方法和投资决策流程，确保各投资组合享有公平的投资决策机会。基金管理人建立了所有组合适用的投资对象备选库，制定明确的备选库建立、维护程序。基金管理人拥有健全的投资授权制度，明确投资决策委员会、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限划分，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。基金管理人的相关研究成果向内部所有投资组合开放，在投资研究层面不存在各投资组合间不公平的问题。

基金管理人按照法规要求，对连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合间的同向交易的交易价差进行分析，相关投资组合经理也对分析中发现的价格差异次数占比超过正常范围的情况进行了合理性解释。报告期内，公司旗下投资组合同向交易价差分析中未发现异常情形。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

基金管理人严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。确因投资组合的投资策略或流动性等需要而发生的同日反向交易，基金管理人要求相关投资组合经理提供决策依据，并留存记录备查，完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合等除外。

本报告期内，本基金各项交易均严格按照相关法律法规、基金合同的有关要求执行，公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 28 次，其中 21 次为旗下指数及量化组合因投资策略需要而发生

反向交易，7 次为不同基金经理管理的基金因投资策略不同而发生的反向交易。报告期内未发现有可能导致不公平交易和利益输送的重大异常交易行为。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年中国经济运行可谓一波三折，一季度开门红、二季度有下行压力、三季度逐步恢复，四季度略有回落，季调环比增速分别为 2.1%、0.6%、1.5%和 1.0%。一季度开门红来自于疫情防控平稳转段后前期积压需求的集中释放，居民服务消费热情高涨，房地产销售迎来“小阳春”；但需求短暂释放后出现空档，房地产市场和出口形势快速转弱，导致二季度经济增速放缓。三季度政策支持力度明显加大，专项债发行和使用进度加快、中央和地方政府密集出台稳地产政策、央行降息降准等，增强了经济恢复动能。然而，宏观上总需求不足、微观上信心不振的根本问题没有解决，企业家和地方政府的积极性仍有待进一步激发出来，而且一定程度上出现了“实体经济下行、金融市场低迷、信心预期不振”的负向循环，削弱了逆周期调控的政策效果，同时大宗商品价格下降导致企业补库存步伐放缓，四季度制造业 PMI 出现回落。分结构看，新旧经济动能转换和服务消费势能拉动是 2023 年两大亮点，第三产业和消费分别拉动 GDP 大约 3.07%和 4.30%，高质量发展的背景下以新能源和人工智能为代表的高端制造业增速较快，增长方式在波折中逐步完成换挡。基建维持较高增速支撑经济，全年增长 5.9%，出口则受外需疲软拖累。然而，房地产着陆和地方化债成为制约 2023 年经济修复的两大关键问题。房地产投资下行影响着居民和企业部门资产负债表修复，地方政府债务率上升则意味着募集资金将大量用于偿还债务。考虑到经济转型中面临一定减速压力，央行在全年维持了宽松的货币政策，资金利率在较低水平宽幅震荡。此外，通过下调 LPR 利率、降准，央行也得以引导实体融资成本下降来刺激需求。海外全年最重要的变化在于四季度美联储开始释放降息预期，虽然美国经济数据目前来看依然健康，且通胀回落的幅度还不足以支撑降息，但预防性降息的预期足以支撑市场利率下降，而这对全球资产价格的定价都会有极大影响。

市场回顾：

权益市场和经济一样走了个先上后下，年初各行业都出现反弹，市场全面上涨，但随着经济动能的减退市场也迎来了一波下跌。二季度开始，在经济不景气的情况下各种热点主题频发，从 AI 到中特估、机器人、自动驾驶都迎来了一波上涨。下半年，由于经济没有明显改善，基本面大部分都在走弱，因此市场下跌较多，只有量化风格主导的微盘股涨幅领先。截止年末，上证综指录得 3.7%的跌幅，创业板下跌 19.41%。

债券市场 2023 年走出了牛市，除了 1 月受经济复苏影响 10Y 国债收益率有所上行以及 8 月底绝对收益率水平过低叠加政策频出外，其余时间基本都是单边下行，收益率从 2.93%下

降到 2.5%。下行最快的阶段出现在 4 月份地产销售开始走弱叠加其他经济数据也开始走弱，年底 12 月受权益市场疲弱影响且债券收益率经历了 3 个月的调整后再次快速下行。

基金操作回顾：

本基金的主要配置资产为股票和债券。2023 年，我们严格遵照基金合同的相关约定，按照既定的投资流程进行了规范运作。权益部分我们在年初基于对经济修复的判断超配了消费和新能源，当强预期遭遇弱现实后我们积极调整组合配置的方向，逐步向代表高质量发展具备明确产业趋势的科技股和高端制造业切换仓位，参与了 AI 算力、机器人和 MR 等投资机会，并适度配置国企改革相关标的平衡组合风险敞口。债券部分我们持有少部分可转债。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金份额净值增长率为-35.44%，同期业绩基准增长率为-4.27%。

#### 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 2024 年，我国经济发展仍将处于战略机遇和风险挑战并存、不确定难预料因素增多的时期，但经济发展的底色和长期趋势没有改变。货币政策有望保持适度稳健宽松，财政政策更加积极有效，内需拉动作用将进一步增强，外需可能小幅改善，预计经济将进一步企稳回升。

美联储加息操作进入尾声，基准利率不具备大幅度上行的空间，人民币汇率压力逐渐缓和，为我国货币政策操作打开空间。同时，内部需求不足和房地产链条收缩等因素，对经济增长的扰动仍未完全出清，货币政策仍可能进一步发力护航宽信用和稳增长。财政政策预计将发力加码，发力的主要方向包括基建投资、城中村改造、地方化债、民生保障、产业升级等。另一方面，国资央企将继续加大对战略性新兴产业领域的投资，持续快速的高技术投入以及新发展格局所产生的新布局，特别是国产替代效应将产生系统性效果，有望持续、全面地为经济发展赋能。基于此，我们对 2024 年的权益市场并不悲观，高质量发展为代表的科技成长和具备全球供应链优势的高端制造业出海将成为贯穿全年的产业趋势主线，同时也建议密切关注潜在政策刺激下顺周期板块和核心资产的修复机会。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人本着诚实信用、勤勉尽责、合法经营和保障基金持有人利益的原则，经营管理和业务运作稳健、合规，基金的投资、交易、后台等运作规范有序。基金管理人的风险管理及合规控制部门依据独立、客观、公正的原则，主要从以下几个方面进一步加强了公司内部控制和基金投资风险管理工作：

1、公司实施了员工全面培训和形式多样的专题培训，包括不定期推送监管动态和风险案例，持续整理风险点录入系统定期推送，定期或不定期组织法规考试，不定期开展各类合规主题培训等，丰富培训形式，不断提升员工合规与风控意识；

2、公司合规风控部门通过事中合规控制系统、事后投资风险管理系统、风险管理模型等对基金投资合规情况及风险情况进行严格的内部监控和管理；

3、定期稽核方面，除了每季度会对各业务领域进行一次全面的稽核，公司合规审计部门还根据监察稽核计划，对公司的关键业务部门及业务流程进行了专项稽核和检查；

4、根据法律法规的更新及业务的发展变化情况，公司各业务部门对相关内部控制制度提出修改意见和建议，并关注内部控制制度的健全性和有效性，进一步完善了公司内控制度体系，更好的防范法律风险和合规风险。

报告期内，本基金的投资运作符合国家相关法律法规、监管部门的有关规定以及公司相关制度的规定。本基金的投资目标、投资决策依据和投资管理程序均符合相关基金合同和招募说明书的约定，未发现重大异常交易、利益输送、内幕交易及其他有损基金投资者利益的情形。报告期内，本基金若曾因市场波动、申购赎回等原因出现了相关投资比例限制被动突破的情形，均在法规规定的时间内完成了调整，符合法律法规和基金合同的规定和要求。报告期内，本基金未出现因权证未行权、可转债未及时卖出或转股等有损基金份额持有人利益的投资失误行为。本基金管理人承诺将一如既往本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产，在规范经营、控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金的估值业务严格按照相关的法律法规、基金合同以及《招商基金管理有限公司基金估值委员会管理制度》进行。基金核算部负责日常的基金资产的估值业务，执行基金估值政策。另外，公司设立由投资和研究部门、风险管理部、基金核算部、法律合规部负责人和基金经理代表组成的估值委员会。公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历。公司估值委员会主要负责制定、修订和完善基金估值政策和程序，定期评价现有估值政策和程序的适用性及对估值程序执行情况进行监督。

投资和研究部门以及基金核算部共同负责关注相关投资品种的动态，评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种；投资和研究部门定期审核公允价值的确认和计量；研究部提出合理的数量分析模型对需要进行估值测算或者调整的投资品种进行公允价值定价与计量并定期对估值政策和程序进行评价，以保证其持续适用；基金核算部定期审核估值政策和程序的一致性，并负责与托管行沟通估值调整事项；风险管理部负责估值委员会工作流程中的风险控制；法律合规部负责

日常的基金估值调整结果的事后复核监督工作; 法律合规部与基金核算部共同负责估值调整事项的信息披露工作。

基金经理代表向估值委员会提供估值参考信息, 参与估值政策讨论; 对需采用特别估值程序的证券, 基金及时启动特别估值程序, 由公司估值委员会集体讨论议定特别估值方案, 咨询会计事务所的专业意见, 并与托管行沟通后由基金核算部具体执行。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。截止报告期末本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司签署服务协议, 由其按约定提供相关债券品种、流通受限股票的估值参考数据。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规的规定和基金合同的约定, 以及本基金的实际运作情况, 本基金报告期末未进行利润分配。在符合分红条件的前提下, 本基金已实现尚未分配的可供分配收益部分, 将严格按照基金合同的约定适时向投资者予以分配。

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

报告期内, 本基金未发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中, 本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定, 对本基金基金管理人—招商基金管理有限公司 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日基金的投资运作, 进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督, 认真履行了托管人的义务, 没有从事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, 招商基金管理有限公司在本基金的投资运作、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

本托管人认为，招商基金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本基金年度报告中的财务指标、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 审计报告

### 6.1 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	招商安达灵活配置混合型证券投资基金全体持有人
审计意见	我们审计了招商安达灵活配置混合型证券投资基金的财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 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基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了招商安达灵活配置混合型证券投资基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 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，我们独立于招商安达灵活配置混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	招商基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括招商安达灵活配置混合型证券投资基金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	<p>基金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基金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导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估招商安达灵活配置混合型证券投资基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算招商安达灵活配置混合型证券投资基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督招商安达灵活配置混合型证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(1)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险,设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2)了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3)评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4)对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能对招商安达灵活配置混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致招商安达灵活配置混合型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5)评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容,并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p>



	我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
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	江丽雅	林婷婷
会计师事务所的地址	中国上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼	
审计报告日期	2024 年 3 月 28 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体:招商安达灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日:2023 年 12 月 31 日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产:			
货币资金	7.4.7.1	639,566.03	34,013.68
结算备付金		796,692.28	1,525,860.83
存出保证金		52,337.33	50,209.21
交易性金融资产	7.4.7.2	101,676,147.10	180,407,801.06
其中:股票投资		77,086,510.10	137,709,731.73
基金投资		-	-
债券投资		24,589,637.00	42,698,069.33
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	-	-
债权投资		-	-
其中:债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		671,915.92	954,812.77
应收股利		-	-
应收申购款		15,598.63	21,642.27
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		103,852,257.29	182,994,339.82

负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 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		5,939,308.36	9,338,523.78
应付清算款		1,077,793.44	873,328.27
应付赎回款		278,611.37	204,370.17
应付管理人报酬		98,036.34	223,347.53
应付托管费		16,339.40	37,224.57
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		7,013.54	7,105.81
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	259,051.35	404,175.30
负债合计		7,676,153.80	11,088,075.43
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	46,549,789.21	53,717,358.79
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	49,626,314.28	118,188,905.60
净资产合计		96,176,103.49	171,906,264.39
负债和净资产总计		103,852,257.29	182,994,339.82

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.5924 元，基金份额总额 60,395,966.03 份。

## 7.2 利润表

会计主体：招商安达灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-57,548,568.47	-42,790,513.79
1.利息收入		42,537.35	23,511.39
其中：存款利息收入	7.4.7.9	42,537.35	23,511.39
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			
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-48,553,789.53	-7,611,612.31
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-39,452,446.16	-1,848,488.97
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	-10,205,072.24	-6,302,823.59
资产支持证券投资 收益	7.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.13	-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	1,103,728.87	539,700.25
以摊余成本计量的 金融资产终止确认产生的 收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-9,084,244.38	-35,314,626.89
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	46,928.09	112,214.02
减：二、营业总支出		2,537,742.65	3,686,062.75
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	1,860,693.40	2,818,202.73
其中：暂估管理人报酬		-	-
2.托管费	7.4.10.2.2	310,115.52	469,700.43
3.销售服务费		-	-
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		182,316.48	194,087.12
其中：卖出回购金融资产 支出		182,316.48	194,087.12
6.信用减值损失	7.4.7.18	-	-
7.税金及附加		296.87	251.53
8.其他费用	7.4.7.19	184,320.38	203,820.94
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-60,086,311.12	-46,476,576.54
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-60,086,311.12	-46,476,576.54
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		-60,086,311.12	-46,476,576.54

注：根据最新《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》中的利润表格式的要求：上年度可比期间“证券出借利息收入”项目的“本期”金额列示于本期“其他利息收入”项目的“上年度可比期间”金额中。

### 7.3 净资产变动表

会计主体：招商安达灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	53,717,358.79	-	118,188,905.60	171,906,264.39
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	53,717,358.79	-	118,188,905.60	171,906,264.39
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-7,167,569.58	-	-68,562,591.32	-75,730,160.90
(一)、综合收益总额	-	-	-60,086,311.12	-60,086,311.12
(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)	-7,167,569.58	-	-8,476,280.20	-15,643,849.78
其中：1.基金申购款	7,008,091.46	-	12,573,325.86	19,581,417.32
2.基金赎回款	-14,175,661.04	-	-21,049,606.06	-35,225,267.10
(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)、其他综合收益 结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	46,549,789.21	-	49,626,314.28	96,176,103.49
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	51,547,026.86	-	156,978,474.12	208,525,500.98
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	51,547,026.86	-	156,978,474.12	208,525,500.98
三、本期增减变动额	2,170,331.93	-	-38,789,568.52	-36,619,236.59

(减少以“-”号填列)				
(一)、综合收益总额	-	-	-46,476,576.54	-46,476,576.54
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	2,170,331.93	-	7,687,008.02	9,857,339.95
其中: 1.基金申购款	15,813,082.00	-	44,847,300.27	60,660,382.27
2.基金赎回款	-13,642,750.07	-	-37,160,292.25	-50,803,042.32
(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)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	53,717,358.79	-	118,188,905.60	171,906,264.39

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

\_\_\_\_\_ 徐勇 \_\_\_\_\_ 欧志明 \_\_\_\_\_ 何剑萍 \_\_\_\_\_  
 基金管理人负责人      主管会计工作负责人      会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

招商安达灵活配置混合型证券投资基金(原名招商安达保本混合型证券投资基金,以下简称“本基金”)系由基金管理人招商基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《招商安达保本混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“原基金合同”)及其他有关法律法规的规定,经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2011]966号文批准公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限为不定期。本基金首次设立募集基金份额为1,032,286,589.43份,经德勤华永会计师事务所有限公司(现更名为“德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)”)验证,并出具了编号为德师报(验)字(11)第0066号验资报告。原基金合同于2011年9月1日正式生效。本基金的基金管理人为招商基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司(以下简称“中国农业银行”)。

依据招商安达保本混合型证券投资基金基金管理人于2017年9月20日发布的《招商安达保本混合型证券投资基金保本期到期安排及转型为招商安达灵活配置混合型证券投资基金的第一次提示性公告》,自2017年10月10日起,“招商安达保本混合型证券投资基金”将更名为“招商安达灵活配置混合型证券投资基金”,《招商安达灵活配置混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“新基金合同”)及托管协议亦于该日同时生效。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、新基金合同及截至报告期末最新公告的招募说明书的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票和存托凭证(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票和存托凭证)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但需符合中国证监会的相关规定。如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金投资于股票、存托凭证的比例为基金资产的 30%-80%;债券、货币市场工具等固定收益类资产占基金资产的 20%-70%,其中,基金保留不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率 $\times$ 55%+标普中国全债指数收益率 $\times$ 45%。

## 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)、中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

## 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日止期间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

本基金的会计年度为公历年度,即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

### 7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

#### 1) 金融资产的分类

根据本基金的金融资产业务模式和金融资产的合同现金流量特征,本基金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，且本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标，则本基金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变动计入当期损益的金融资产计入“交易性金融资产”。

#### 2) 金融负债的分类

本基金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。本基金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

本基金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和金融负债，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。

本基金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，本基金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，本基金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，本基金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。

本基金在上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，本基金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。

本基金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。若本基金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

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，将其公允价值划分为三个层次。第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值是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；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值原则如下：

(1) 对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市价不能真实反映公允价值的，应对市价进行调整，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，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当投资品种不存在活跃市场，基金管理人估值委员会认为必要时，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

(3) 经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整，确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

##### 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

本基金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。本基金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

本基金的基金管理人报酬、基金托管费和销售服务费(如适用)按基金合同及相关公告约定的费率和计算方法逐日计提。

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) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年最多分配 12 次，每次基金收益分配比例不低于该次可供分配利润的 10%；若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2) 本基金收益分配方式：基金收益分配方式分为两种，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基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；投资者在不同销售机构可以选择不同的收益分配方式，在同一

销售机构只能选择一种收益分配方式，基金注册登记机构将以投资者最后一次选择的收益分配方式为准；

3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4) 每一基金份额享有同等分配权；

5) 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

#### 7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，与所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 7.4.4.13 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策与计量基础一致。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金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，本基金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) 对于中国证券投资基金业协会《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》（中基协字[2022]566号）所规定的固定收益品种，本基金按照相关规定，对以公允价值计量的固定收益品种选取第三方估值基准服务机构提供估值全价进行估值；对以摊余成本计量的固定收益品种用第三方估值基准服务机构提供的预期信用损失减值计量结果。

## 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

本基金在本报告期间未发生重大会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期间未发生重大会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

## 7.4.6 税项

根据财税[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》、2008年9月18日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[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[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》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[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管理人运营公开募集证券投资基金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所得, 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 0.10%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；自 2023 年 8 月 28 日起，出让方减按 0.05%的税率缴纳证券(股票)交易印花税。

(5)本基金的城市维护建设税、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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	639,566.03	34,013.68
等于：本金	639,360.79	33,964.31
加：应计利息	205.24	49.37
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	639,566.03	34,013.68

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	74,037,599.44	-	77,086,510.10	3,048,910.66	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	24,206,105.95	137,870.27	24,589,637.00	245,660.78
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	24,206,105.95	137,870.27	24,589,637.00	245,660.78
资产支持证券	-	-	-	-	

基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	98,243,705.39	137,870.27	101,676,147.10	3,294,571.44	
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	124,269,547.13	-	137,709,731.73	13,440,184.60	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	43,532,854.14	226,583.97	42,698,069.33	-1,061,368.78
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	43,532,854.14	226,583.97	42,698,069.33	-1,061,368.78
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	167,802,401.27	226,583.97	180,407,801.06	12,378,815.82	

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融工具。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末无各项买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

#### 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	73.13	162.11
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	118,978.22	244,013.19
其中：交易所市场	118,978.22	244,013.19

银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	140,000.00	160,000.00
合计	259,051.35	404,175.30

#### 7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	69,695,691.30	53,717,358.79
本期申购	9,092,512.81	7,008,091.46
本期赎回（以“-”号填列）	-18,392,238.08	-14,175,661.04
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	60,395,966.03	46,549,789.21

注：本期申购含红利再投、转换入份（金）额，本期赎回含转换出份（金）额。

#### 7.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	130,730,422.68	-12,541,517.08	118,188,905.60
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	130,730,422.68	-12,541,517.08	118,188,905.60
本期利润	-51,002,066.74	-9,084,244.38	-60,086,311.12
本期基金份额交易产生的变动数	-11,418,875.38	2,942,595.18	-8,476,280.20
其中：基金申购款	15,361,990.87	-2,788,665.01	12,573,325.86
基金赎回款	-26,780,866.25	5,731,260.19	-21,049,606.06
本期已分配利润	-	-	-
本期末	68,309,480.56	-18,683,166.28	49,626,314.28

#### 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	19,453.38	5,378.12
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	21,684.70	17,422.60
其他	1,399.27	710.67

合计	42,537.35	23,511.39
----	-----------	-----------

### 7.4.7.10 股票投资收益

#### 7.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-39,452,446.16	-1,848,488.97
股票投资收益——赎回差价收入	-	-
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	-39,452,446.16	-1,848,488.97

#### 7.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	704,282,285.07	338,037,086.02
减：卖出股票成本总额	741,823,854.01	338,874,255.84
减：交易费用	1,910,877.22	1,011,319.15
买卖股票差价收入	-39,452,446.16	-1,848,488.97

#### 7.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无股票赎回差价收入。

#### 7.4.7.10.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无股票申购差价收入。

#### 7.4.7.10.5 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无证券出借差价收入。

### 7.4.7.11 债券投资收益

#### 7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
债券投资收益——利息收入	235,950.93	299,123.78
债券投资收益——买卖债券 (债转股及债券到期兑付) 差	-10,441,023.17	-6,601,947.37



价收入		
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	-10,205,072.24	-6,302,823.59

#### 7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	209,474,671.02	226,091,459.62
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	219,324,049.85	232,165,013.90
减：应计利息总额	576,081.78	516,799.46
减：交易费用	15,562.56	11,593.63
买卖债券差价收入	-10,441,023.17	-6,601,947.37

#### 7.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无债券赎回差价收入。

#### 7.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无债券申购差价收入。

#### 7.4.7.12 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

##### 7.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无买卖资产支持证券差价收入。

##### 7.4.7.12.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券赎回差价收入。

##### 7.4.7.12.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券申购差价收入。

#### 7.4.7.13 贵金属投资收益

##### 7.4.7.13.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.13.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无买卖贵金属差价收入。

#### 7.4.7.13.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属赎回差价收入。

#### 7.4.7.13.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属申购差价收入。

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

##### 7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具买卖权证差价收入。

##### 7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具其他投资收益。

#### 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	1,103,728.87	539,700.25
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	1,103,728.87	539,700.25

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	-9,084,244.38	-35,314,626.89
——股票投资	-10,391,273.94	-31,614,960.39
——债券投资	1,307,029.56	-3,699,666.50
——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	-9,084,244.38	-35,314,626.89

#### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	46,928.09	112,214.02
合计	46,928.09	112,214.02

#### 7.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内及上年度可比期间无信用减值损失。

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
审计费用	20,000.00	40,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	7,120.38	6,620.94
其他	37,200.00	37,200.00
合计	184,320.38	203,820.94

### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

#### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报告批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
招商基金管理有限公司	基金管理人
中国农业银行股份有限公司	基金托管人
招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)	基金管理人的股东
招商证券股份有限公司(以下简称“招商证券”)	基金管理人的股东
招商财富资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司
博时基金(国际)有限公司	基金管理人的参股经营机构

注：1、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。

2、基金的主要关联方包含基金管理人、基金管理人的股东及子公司、基金托管人等。

## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
招商证券	616,270,645.31	44.35%	56,562,684.81	8.42%

#### 7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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	174,784,034.73	43.71%	23,049,073.97	5.13%

#### 7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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	946,750,000.00	56.49%	102,536,000.00	5.46%

#### 7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
招商证券	452,728.17	39.37%	85,787.56	72.10%
关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
招商证券	41,363.69	6.80%	41,363.69	16.95%

注：1、本基金与关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立；

2、基金对该类交易的佣金的计算方式是按合同约定的佣金率计算。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供研究成果和市场信息等证券综合服务，并不收取额外对价。

## 7.4.10.2 关联方报酬

### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,860,693.40	2,818,202.73
其中：应支付销售机构的客户维护费	843,124.65	1,289,376.95
应支付基金管理人的净管理费	1,017,568.75	1,528,825.78
应支付投资顾问的投资顾问费	-	-

注 1、支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值×1.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日基金管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.20\% \div \text{当年天数}$$

2、根据《招商基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》，自 2023 年 7 月 10 日起本基金的管理费率由 1.50%调低至 1.20%。

### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	310,115.52	469,700.43

注 1、支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值×0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

2、根据《招商基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》，自 2023 年 7 月 10 日起本基金的托管费率由 0.25%调低至 0.20%。

## 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

##### 7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

本报告期内及上年度可比期间基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

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

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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
中国农业银行-活期	639,566.03	19,453.38	34,013.68	5,378.12

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行股份有限公司保管，按银行约定利率计息。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

单位：人民币元

本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单	总金额

				位：股/张)	
招商证券	688375	国博电子	网下申购	1,175	83,284.00
招商证券	001323	慕思股份	网下申购	573	22,306.89
招商证券	301123	奕东电子	网下申购	1,819	67,721.37

注：本表已包含托管人的关联方承销期内承销的证券。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2023 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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300904	威力传动	2023 年 8 月 2 日	6 个月	新股流通受限	35.41	61.53	147	5,205.27	9,044.91	-
301202	朗威股份	2023 年 6 月 28 日	6 个月	新股流通受限	25.82	31.80	128	3,304.96	4,070.40	-
301261	恒工精密	2023 年 6 月 29 日	6 个月	新股流通受限	36.90	50.85	96	3,542.40	4,881.60	-
301292	海科新源	2023 年 6 月 29 日	6 个月	新股流通受限	19.99	19.35	253	5,057.47	4,895.55	-
301348	蓝箭电子	2023 年 8 月 1 日	6 个月	新股流通受限	18.08	44.57	240	4,339.20	10,696.80	-
301370	国科恒泰	2023 年 7 月 3 日	6 个月	新股流通受限	13.39	16.01	459	6,146.01	7,348.59	-
301371	敷尔佳	2023 年 7 月 24 日	6 个月	新股流通受限	55.68	37.58	72	4,008.96	2,705.76	-
301372	科净源	2023 年 8 月 3 日	6 个月	新股流通受限	45.00	43.59	120	5,400.00	5,230.80	-
301381	赛维时代	2023 年 7 月	6 个月	新股流通受限	20.45	29.69	290	5,930.50	8,610.10	-

		5 日								
301393	昊帆生物	2023 年 7 月 5 日	6 个月	新股流通受限	67.68	59.37	67	4,534.56	3,977.79	-
301486	致尚科技	2023 年 6 月 30 日	6 个月	新股流通受限	57.66	47.25	106	6,111.96	5,008.50	-
301487	盟固利	2023 年 8 月 1 日	6 个月	新股流通受限	5.32	40.96	823	4,378.36	33,710.08	-
301488	豪恩汽电	2023 年 6 月 26 日	6 个月	新股流通受限	39.78	69.09	128	5,091.84	8,843.52	-
301498	乖宝宠物	2023 年 8 月 9 日	6 个月	新股流通受限	39.99	38.81	100	3,999.00	3,881.00	-
301505	苏州规划	2023 年 7 月 12 日	6 个月	新股流通受限	26.35	35.81	136	3,583.60	4,870.16	-
301509	金凯生科	2023 年 7 月 26 日	6 个月	新股流通受限	56.56	62.23	80	4,524.80	4,978.40	-
301511	德福科技	2023 年 8 月 8 日	6 个月	新股流通受限	28.00	22.67	187	5,236.00	4,239.29	-
301515	港通医疗	2023 年 7 月 13 日	6 个月	新股流通受限	31.16	28.27	108	3,365.28	3,053.16	-
301518	长华化学	2023 年 7 月 26 日	6 个月	新股流通受限	25.75	23.01	168	4,326.00	3,865.68	-
301519	舜禹股份	2023 年 7 月 19 日	6 个月	新股流通受限	20.93	20.21	189	3,955.77	3,819.69	-
301533	威马农机	2023 年 8 月 7 日	6 个月	新股流通受限	29.50	33.16	116	3,422.00	3,846.56	-

## 7.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-



#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 5,939,308.36 元，在 2024 年 1 月 2 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

本基金为混合型基金，本基金的运作涉及的金融工具主要包括股票投资、债券投资等。与这些金融工具有关的风险，以及本基金的基金管理人管理这些风险所采取的风险管理政策如下所述。

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人从事风险管理的目标是提升本基金风险调整后收益水平，保证本基金的基金资产安全，维护基金份额持有人利益。基于该风险管理目标，本基金的基金管理人风险管理的基本策略是识别和分析本基金运作时本基金面临各种类型的风险，确定适当的风险容忍度，并及时可靠地对各种风险进行监督，将风险控制在限定的范围之内。本基金目前面临的主要风险包括：市场风险、信用风险和流动性风险。

本基金的基金管理人建立了以全面、独立、互相制约以及定性和定量相结合为原则的，监事会、董事会及下设风险控制委员会、督察长、风险管理委员会、法律合规部和风险管理部等多层次的风险管理组织架构体系。

##### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指金融工具的一方到期无法履行约定义务致使本基金遭受损失的风险。本基金的信用风险主要存在于银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资及其他。

本基金的银行存款存放在本基金的基金托管人开立的托管账户中，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在证券交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成

证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并采用券款对付交割方式，以控制相应的信用风险。

对于与债券投资等投资品种相关的信用风险，本基金的基金管理人通过对投资品种的信用等级评估来选择适当的投资对象，并限制单个投资品种的持有比例来管理信用风险。本基金所持有的债券投资的信用评级情况参见附注 7.4.13.2.1 至 7.4.13.2.6，该信用评级不包括本基金所持有的国债、央行票据、政策性金融债。

#### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

#### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

#### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	-	5,123,319.67
AAA 以下	18,449,608.92	27,871,780.25
未评级	-	-
合计	18,449,608.92	32,995,099.92

注：上述评级均由经中国证监会核准从事证券市场资信评级业务的评级机构做出。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

### 7.4.13.3 流动性风险

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金流动性风险来源于基金约定开放日兑付赎回资金的流动性风险，以及因部分投资品种交易不活跃而出现的变现风险以及因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理价格变现投资的风险。本基金所持有的金融资产主要在证券交易所和银行间同业市场交易。除附注 7.4.12 所披露的流通受限不能自由转让的基金资产外，本基金未持有其他

有重大流动性风险的投资品种。除卖出回购金融资产外，本基金所持有的金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人在基金合同约定巨额赎回条款，设计了非常情况下赎回资金的处理模式，控制因开放模式带来的流动性风险，有效保障基金份额持有人利益。

日常流动性风险管理中，本基金的基金管理人每日监控和预测本基金的流动性指标，通过对投资品种的流动性指标来持续地评估、选择、跟踪和控制基金投资的流动性风险。同时，本基金通过预留一定的现金头寸，并且在需要时可通过卖出回购金融资产方式融入短期资金，以缓解流动性风险。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值或将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的基金管理人日常通过对利率水平的预测、分析收益率曲线及优化利率重新定价日组合等方法对上述利率风险进行管理。

下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	639,566.03	-	-	-	639,566.03
结算备付金	796,692.28	-	-	-	796,692.28
存出保证金	52,337.33	-	-	-	52,337.33
交易性金融资产	6,116,574.25	15,269,857.57	3,203,205.18	77,086,510.10	101,676,147.10
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	15,598.63	15,598.63
应收清算款	-	-	-	671,915.92	671,915.92
其他资产	-	-	-	-	-

资产总计	7,605,169.89	15,269,857.57	3,203,205.18	77,774,024.65	103,852,257.29
负债					
应付赎回款	-	-	-	278,611.37	278,611.37
应付管理人报酬	-	-	-	98,036.34	98,036.34
应付托管费	-	-	-	16,339.40	16,339.40
应付清算款	-	-	-	1,077,793.44	1,077,793.44
卖出回购金融资产款	5,939,308.36	-	-	-	5,939,308.36
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	7,013.54	7,013.54
其他负债	-	-	-	259,051.35	259,051.35
负债总计	5,939,308.36	-	-	1,736,845.44	7,676,153.80
利率敏感度缺口	1,665,861.53	15,269,857.57	3,203,205.18	76,037,179.21	96,176,103.49
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	34,013.68	-	-	-	34,013.68
结算备付金	1,525,860.83	-	-	-	1,525,860.83
存出保证金	50,209.21	-	-	-	50,209.21
交易性金融资产	9,679,585.98	26,385,280.00	6,633,203.35	137,709,731.73	180,407,801.06
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	21,642.27	21,642.27
应收清算款	-	-	-	954,812.77	954,812.77
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	11,289,669.70	26,385,280.00	6,633,203.35	138,686,186.77	182,994,339.82
负债					
应付赎回款	-	-	-	204,370.17	204,370.17
应付管理人报酬	-	-	-	223,347.53	223,347.53
应付托管费	-	-	-	37,224.57	37,224.57
应付清算款	-	-	-	873,328.27	873,328.27
卖出回购金融资产款	9,338,523.78	-	-	-	9,338,523.78
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	7,105.81	7,105.81
其他负债	-	-	-	404,175.30	404,175.30

负债总计	9,338,523.78	-	-	1,749,551.65	11,088,075.43
利率敏感度缺口	1,951,145.92	26,385,280.00	6,633,203.35	136,936,635.12	171,906,264.39

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1.若市场利率平行上升或下降 50 个基点		
	2.其他市场变量保持不变		
	3.仅存在公允价值变动对基金资产净值的影响		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023 年 12 月 31 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	1. 市场利率平行上升 50 个基点	-444,717.93	-769,850.22
2. 市场利率平行下降 50 个基点	458,366.65	792,874.55	

#### 7.4.13.4.2 其他价格风险

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险，该风险可能与特定投资品种相关，也有可能与整体投资品种相关。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的债券和股票，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金在构建资产配置和基金资产投资组合的基础上，通过建立事前和事后跟踪误差的方式，对基金资产的市场价格风险进行管理。

##### 7.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	77,086,510.10	80.15	137,709,731.73	80.11
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	77,086,510.10	80.15	137,709,731.73	80.11

##### 7.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1.若对市场价格敏感的权益性投资的市场价格上升或下降 5%		
	2.其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023 年 12 月 31 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	1. 权益性投资的市场价格上升 5%	3,854,325.51	6,885,486.59
	2. 权益性投资的市场价格下降 5%	-3,854,325.51	-6,885,486.59

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	95,394,540.68	170,082,275.99
第二层次	6,140,028.08	9,702,969.41
第三层次	141,578.34	622,555.66
合计	101,676,147.10	180,407,801.06

###### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

###### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

###### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	622,555.66	622,555.66
当期购买	-	3,741,126.97	3,741,126.97
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	4,635,323.62	4,635,323.62
当期利得或损失总额	-	413,219.33	413,219.33
其中：计入损益的利得或损失	-	413,219.33	413,219.33
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	141,578.34	141,578.34
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	46,114.40	46,114.40
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	1,918,800.58	1,918,800.58
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	639,692.86	639,692.86
当期利得或损失总额	-	-656,552.06	-656,552.06
其中：计入损益的利得或损失	-	-656,552.06	-656,552.06
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	622,555.66	622,555.66
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动	-	-27,645.19	-27,645.19

损益			
----	--	--	--

#### 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

金额单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股票投资	141,578.34	平均价格亚式期权模型	流通受限股票预期波动率	0.1969-0.5030	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股票投资	622,555.66	平均价格亚式期权模型	流通受限股票预期波动率	0.2127-2.4756	负相关

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括应收款项、卖出回购金融资产和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无需要说明有助于理解和分析会计报表的其他事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	77,086,510.10	74.23
	其中：股票	77,086,510.10	74.23
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	24,589,637.00	23.68
	其中：债券	24,589,637.00	23.68
	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	1,436,258.31	1.38
8	其他资产	739,851.88	0.71
9	合计	103,852,257.29	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	6,210,773.00	6.46
B	采矿业	-	-
C	制造业	67,749,987.93	70.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	5,124.12	0.01
F	批发和零售业	30,659.81	0.03
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	3,071,480.09	3.19
J	金融业	-	-
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	9,434.66	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	9,050.49	0.01
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	77,086,510.10	80.15

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

## 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002920	德赛西威	35,900	4,649,409.00	4.83

2	002475	立讯精密	124,000	4,271,800.00	4.44
3	300580	贝斯特	113,400	3,433,752.00	3.57
4	688072	拓荆科技	14,784	3,419,539.20	3.56
5	688012	中微公司	21,080	3,237,888.00	3.37
6	688188	柏楚电子	12,067	3,054,278.37	3.18
7	002465	海格通信	236,400	3,037,740.00	3.16
8	002472	双环传动	115,700	3,010,514.00	3.13
9	688150	莱特光电	135,141	2,917,694.19	3.03
10	688378	奥来德	61,289	2,901,421.26	3.02
11	688301	奕瑞科技	8,799	2,861,962.74	2.98
12	002832	比音勒芬	89,768	2,845,645.60	2.96
13	603667	五洲新春	120,300	2,815,020.00	2.93
14	600066	宇通客车	194,800	2,581,100.00	2.68
15	605296	神农集团	77,500	2,381,575.00	2.48
16	300545	联得装备	68,454	2,365,085.70	2.46
17	002241	歌尔股份	104,400	2,193,444.00	2.28
18	603477	巨星农牧	56,400	2,113,308.00	2.20
19	688333	铂力特	17,663	2,047,141.70	2.13
20	688383	新益昌	18,861	1,976,444.19	2.06
21	688433	华曙高科	63,026	1,969,562.50	2.05
22	002050	三花智控	65,700	1,931,580.00	2.01
23	002840	华统股份	92,200	1,916,838.00	1.99
24	300258	精锻科技	143,600	1,855,312.00	1.93
25	600975	新五丰	164,200	1,715,890.00	1.78
26	603327	福蓉科技	114,000	1,519,620.00	1.58
27	002983	芯瑞达	48,600	1,499,796.00	1.56
28	300809	华辰装备	50,100	1,465,425.00	1.52
29	301391	卡莱特	12,800	1,465,344.00	1.52
30	300351	永贵电器	66,000	1,367,520.00	1.42
31	301031	中熔电气	7,400	967,624.00	1.01
32	688352	颀中科技	31,924	491,948.84	0.51
33	002429	兆驰股份	85,400	476,532.00	0.50
34	301487	盟固利	823	33,710.08	0.04
35	688361	中科飞测	147	10,941.21	0.01
36	301348	蓝箭电子	240	10,696.80	0.01
37	688478	晶升股份	189	9,828.00	0.01
38	300904	威力传动	147	9,044.91	0.01
39	301488	豪恩汽电	128	8,843.52	0.01
40	301381	赛维时代	290	8,610.10	0.01
41	301320	豪江智能	445	8,219.15	0.01
42	688562	航天软件	328	7,872.00	0.01
43	301370	国科恒泰	459	7,348.59	0.01
44	301328	维峰电子	147	7,197.12	0.01

45	301326	捷邦科技	172	6,898.92	0.01
46	301315	威士顿	124	6,554.64	0.01
47	301176	逸豪新材	360	6,037.20	0.01
48	301408	华人健康	378	6,029.10	0.01
49	301300	远翔新材	190	6,009.70	0.01
50	301388	欣灵电气	244	5,951.16	0.01
51	301282	金禄电子	227	5,672.73	0.01
52	688146	中船特气	159	5,407.59	0.01
53	301372	科净源	120	5,230.80	0.01
54	301296	新巨丰	504	5,191.20	0.01
55	301319	唯特偶	87	5,081.67	0.01
56	301486	致尚科技	106	5,008.50	0.01
57	301509	金凯生科	80	4,978.40	0.01
58	688458	美芯晟	64	4,925.44	0.01
59	301292	海科新源	253	4,895.55	0.01
60	301261	恒工精密	96	4,881.60	0.01
61	301505	苏州规划	136	4,870.16	0.01
62	688581	安杰思	39	4,867.59	0.01
63	301295	美硕科技	146	4,845.74	0.01
64	301283	聚胶股份	147	4,833.36	0.01
65	301373	凌玮科技	163	4,832.95	0.01
66	301376	致欧科技	193	4,616.56	0.00
67	301115	建科股份	255	4,564.50	0.00
68	301265	华新环保	426	4,366.50	0.00
69	301511	德福科技	187	4,239.29	0.00
70	301202	朗威股份	128	4,070.40	0.00
71	601061	中信金属	526	4,055.46	0.00
72	301393	昊帆生物	67	3,977.79	0.00
73	300804	广康生化	128	3,950.08	0.00
74	301498	乖宝宠物	100	3,881.00	0.00
75	301518	长华化学	168	3,865.68	0.00
76	301533	威马农机	116	3,846.56	0.00
77	301519	舜禹股份	189	3,819.69	0.00
78	301355	南王科技	250	3,787.50	0.00
79	301170	锡南科技	119	3,621.17	0.00
80	301309	万得凯	129	3,605.55	0.00
81	301349	信德新材	74	3,483.92	0.00
82	301323	新莱福	94	3,477.06	0.00
83	301232	飞沃科技	66	3,200.34	0.00
84	301515	港通医疗	108	3,053.16	0.00
85	688479	友车科技	119	2,775.08	0.00
86	603137	恒尚节能	139	2,727.18	0.00
87	301371	敷尔佳	72	2,705.76	0.00

88	601133	柏诚股份	182	2,396.94	0.00
89	601065	江盐集团	203	2,322.32	0.00
90	600702	舍得酒业	21	2,030.70	0.00
91	603172	万丰股份	114	2,009.82	0.00
92	603125	常青科技	59	1,771.18	0.00
93	301266	宇邦新材	22	1,218.14	0.00

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601138	工业富联	17,835,973.00	10.38
2	300496	中科创达	17,363,791.92	10.10
3	002459	晶澳科技	16,574,538.51	9.64
4	300394	天孚通信	16,569,608.68	9.64
5	002555	三七互娱	16,157,453.00	9.40
6	002463	沪电股份	13,522,849.43	7.87
7	000977	浪潮信息	13,445,780.00	7.82
8	603688	石英股份	13,404,878.54	7.80
9	300750	宁德时代	12,877,066.20	7.49
10	688556	高测股份	12,566,940.48	7.31
11	000596	古井贡酒	11,769,017.00	6.85
12	600702	舍得酒业	11,732,394.26	6.82
13	300274	阳光电源	11,110,825.00	6.46
14	688981	中芯国际	10,949,346.51	6.37
15	002594	比亚迪	10,600,071.00	6.17
16	600329	达仁堂	9,269,139.00	5.39
17	603369	今世缘	9,123,485.02	5.31
18	688223	晶科能源	9,006,940.10	5.24
19	600557	康缘药业	8,669,742.00	5.04
20	000568	泸州老窖	8,604,835.00	5.01
21	600809	山西汾酒	8,488,606.84	4.94
22	000799	酒鬼酒	8,455,738.65	4.92
23	600559	老白干酒	8,325,736.00	4.84
24	600129	太极集团	8,092,935.00	4.71
25	600779	水井坊	7,675,982.26	4.47
26	002946	新乳业	7,389,794.00	4.30
27	002920	德赛西威	7,221,606.00	4.20
28	603019	中科曙光	7,046,373.00	4.10
29	688072	拓荆科技	6,949,804.62	4.04
30	002832	比音勒芬	6,738,186.92	3.92

31	002475	立讯精密	6,702,306.00	3.90
32	002304	洋河股份	6,516,303.00	3.79
33	002605	姚记科技	6,314,371.00	3.67
34	300973	立高食品	6,236,826.00	3.63
35	603338	浙江鼎力	6,219,472.52	3.62
36	300751	迈为股份	6,173,307.30	3.59
37	300253	卫宁健康	5,830,565.42	3.39
38	002410	广联达	5,827,180.00	3.39
39	000921	海信家电	5,821,422.00	3.39
40	600729	重庆百货	5,490,445.00	3.19
41	688516	奥特维	5,489,748.93	3.19
42	600612	老凤祥	5,412,750.00	3.15
43	600066	宇通客车	5,066,326.00	2.95
44	600584	长电科技	5,034,696.00	2.93
45	688036	传音控股	4,830,633.29	2.81
46	000661	长春高新	4,810,836.00	2.80
47	000651	格力电器	4,788,352.00	2.79
48	002517	恺英网络	4,784,752.00	2.78
49	000521	长虹美菱	4,617,133.00	2.69
50	002472	双环传动	4,615,649.00	2.68
51	603225	新凤鸣	4,473,297.40	2.60
52	688378	奥来德	4,439,138.23	2.58
53	601233	桐昆股份	4,307,983.60	2.51
54	300548	博创科技	4,288,964.11	2.49
55	000028	国药一致	4,271,841.50	2.48
56	000063	中兴通讯	4,151,801.62	2.42
57	601100	恒立液压	4,119,447.00	2.40
58	002371	北方华创	4,097,264.00	2.38
59	300258	精锻科技	4,063,438.00	2.36
60	600570	恒生电子	4,057,024.88	2.36
61	000729	燕京啤酒	4,012,594.00	2.33
62	300580	贝斯特	3,954,618.50	2.30
63	688700	东威科技	3,946,594.58	2.30
64	000404	长虹华意	3,921,650.00	2.28
65	000938	紫光股份	3,908,925.00	2.27
66	600276	恒瑞医药	3,621,008.00	2.11
67	001223	欧克科技	3,619,730.00	2.11
68	603027	千禾味业	3,522,590.60	2.05
69	600419	天润乳业	3,488,317.00	2.03

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票；

2、基金持有的股票分类为交易性金融资产的，本项的“累计买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300496	中科创达	20,539,363.00	11.95
2	603688	石英股份	17,919,331.69	10.42
3	300750	宁德时代	17,865,139.00	10.39
4	688556	高测股份	17,473,459.80	10.16
5	002594	比亚迪	16,936,725.00	9.85
6	601138	工业富联	16,642,639.01	9.68
7	002459	晶澳科技	15,291,361.00	8.90
8	002555	三七互娱	14,885,209.35	8.66
9	300394	天孚通信	14,727,388.00	8.57
10	688223	晶科能源	13,938,071.81	8.11
11	300751	迈为股份	12,515,091.20	7.28
12	000977	浪潮信息	12,238,586.00	7.12
13	002463	沪电股份	12,043,878.62	7.01
14	002920	德赛西威	12,014,437.00	6.99
15	688516	奥特维	11,643,484.41	6.77
16	000596	古井贡酒	11,571,310.72	6.73
17	002304	洋河股份	11,482,474.70	6.68
18	000858	五粮液	11,241,226.78	6.54
19	600702	舍得酒业	10,942,544.39	6.37
20	300274	阳光电源	10,421,507.00	6.06
21	601888	中国中免	9,898,384.29	5.76
22	688981	中芯国际	9,805,317.89	5.70
23	603369	今世缘	8,735,573.00	5.08
24	600329	达仁堂	8,477,733.05	4.93
25	600559	老白干酒	8,461,854.00	4.92
26	600809	山西汾酒	8,305,002.00	4.83
27	000568	泸州老窖	8,080,009.00	4.70
28	000799	酒鬼酒	7,482,853.65	4.35
29	600129	太极集团	7,449,092.00	4.33
30	600557	康缘药业	7,150,184.00	4.16
31	002946	新乳业	7,116,816.00	4.14
32	600779	水井坊	7,085,553.00	4.12
33	603816	顾家家居	6,947,782.00	4.04
34	600132	重庆啤酒	6,751,009.00	3.93
35	600519	贵州茅台	6,699,501.54	3.90

36	000921	海信家电	6,630,301.00	3.86
37	002352	顺丰控股	6,515,981.00	3.79
38	600600	青岛啤酒	6,496,258.40	3.78
39	603833	欧派家居	6,464,364.00	3.76
40	603019	中科曙光	6,234,383.00	3.63
41	600426	华鲁恒升	6,204,491.00	3.61
42	300973	立高食品	6,128,687.00	3.57
43	688295	中复神鹰	6,018,691.03	3.50
44	600729	重庆百货	5,583,006.00	3.25
45	002605	姚记科技	5,423,293.00	3.15
46	002410	广联达	5,357,436.00	3.12
47	600612	老凤祥	5,147,506.00	2.99
48	603338	浙江鼎力	5,122,531.00	2.98
49	002865	钧达股份	5,001,714.00	2.91
50	000661	长春高新	4,888,275.00	2.84
51	600584	长电科技	4,830,981.00	2.81
52	300253	卫宁健康	4,725,921.00	2.75
53	000521	长虹美菱	4,553,903.00	2.65
54	688036	传音控股	4,494,140.07	2.61
55	300548	博创科技	4,396,702.50	2.56
56	603225	新凤鸣	4,307,537.00	2.51
57	601233	桐昆股份	4,260,530.60	2.48
58	000651	格力电器	4,181,934.00	2.43
59	002517	恺英网络	4,161,957.00	2.42
60	002832	比音勒芬	4,152,492.00	2.42
61	000028	国药一致	3,998,192.80	2.33
62	600570	恒生电子	3,854,408.20	2.24
63	002371	北方华创	3,766,628.00	2.19
64	601100	恒立液压	3,685,075.44	2.14
65	688700	东威科技	3,626,249.46	2.11
66	001223	欧克科技	3,584,641.00	2.09
67	000729	燕京啤酒	3,580,644.00	2.08
68	000938	紫光股份	3,551,453.00	2.07
69	000404	长虹华意	3,503,775.00	2.04

注：1、卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票；

2、基金持有的股票分类为交易性金融资产的，本项“累计卖出金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	691,591,906.32
--------------	----------------

卖出股票收入（成交）总额	704,282,285.07
--------------	----------------

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票；

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

## 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	6,116,574.25	6.36
2	央行票据	-	-
3	金融债券	23,453.83	0.02
	其中：政策性金融债	23,453.83	0.02
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）	18,449,608.92	19.18
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	24,589,637.00	25.57

## 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	019694	23 国债 01	60,000	6,116,574.25	6.36
2	123223	九典转 02	18,231	3,203,205.18	3.33
3	113061	拓普转债	23,860	3,071,018.64	3.19
4	127058	科伦转债	14,830	2,685,762.98	2.79
5	111008	沿浦转债	15,430	2,125,774.19	2.21

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。



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

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

### 8.11.2 本期国债期货投资评价

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1

报告期基金投资的前十名证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 8.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库，本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

金额单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	52,337.33
2	应收清算款	671,915.92
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	15,598.63
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	739,851.88

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	113061	拓普转债	3,071,018.64	3.19
2	127058	科伦转债	2,685,762.98	2.79
3	111008	沿浦转债	2,125,774.19	2.21
4	127037	银轮转债	1,991,378.91	2.07
5	110090	爱迪转债	1,979,294.52	2.06
6	127065	瑞鹤转债	1,975,724.86	2.05
7	123150	九强转债	1,417,449.64	1.47

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末投资前十名股票中不存在流通受限情况。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
4,193	14,404.00	-	-	60,395,966.03	100.00%

### 9.2 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	96,026.64	0.1590%

### 9.3 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	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2017年10月10日)基金份额总额	602,042,667.94
本报告期期初基金份额总额	69,695,691.30
本报告期基金总申购份额	9,092,512.81
减：报告期基金总赎回份额	18,392,238.08
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	60,395,966.03

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

根据本基金管理人 2023 年 6 月 22 日的公告，经招商基金管理有限公司第六届董事会 2023 年第四次会议审议通过，同意钟文岳先生辞任公司常务副总经理、财务负责人职务。

根据本基金管理人 2023 年 8 月 30 日的公告，经招商基金管理有限公司第六届董事会 2023 年第五次会议审议通过，同意聘任孙明霞女士为公司副总经理。

根据本基金管理人 2023 年 9 月 28 日的公告，经招商基金管理有限公司第六届董事会 2023 年第七次会议审议通过，同意聘任董方先生为公司副总经理。

根据本基金管理人 2023 年 12 月 30 日的公告，经招商基金管理有限公司第七届董事会 2023 年第一次会议审议通过，同意聘任孙明霞女士为公司财务负责人。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的重大诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金的审计事务所无变化，目前德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）已为本基金提供审计服务 7 年，本报告期应支付给德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为人民币 20,000.00 元。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金管理人没有受到监管部门的稽查或处罚，亦未收到关于基金管理人的高级管理人员受到监管部门的稽查或处罚的书面通知或文件。

### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
招商证券	2	616,270,645.31	44.35%	452,728.17	39.37%	-
东方证券	1	221,276,220.59	15.92%	206,646.85	17.97%	-
华泰证券	2	161,812,119.65	11.64%	150,713.61	13.11%	-
东方财富	1	119,755,760.77	8.62%	87,576.75	7.62%	-
中信建投证券	1	118,144,287.22	8.50%	110,184.09	9.58%	-
西南证券	1	106,553,027.05	7.67%	99,233.53	8.63%	-
海通证券	1	34,745,068.87	2.50%	32,357.97	2.81%	-
天风证券	1	10,998,906.00	0.79%	10,404.06	0.90%	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-

注：基金交易佣金根据券商季度综合评分结果给与分配，券商综合评分根据研究报告质量、路演质量、联合调研质量等维度进行打分，从多家服务券商中选取符合法律规范经营的综合能力靠前的券商给与佣金分配，季度评分和佣金分配分别由专人负责。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易	债券回购交易	权证交易
------	------	--------	------

	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
招商证券	174,784,034.73	43.71%	946,750,000.00	56.49%	-	-
东方证券	44,323,189.00	11.08%	-	-	-	-
华泰证券	68,128,635.76	17.04%	54,759,000.00	3.27%	-	-
东方财富	25,608,723.80	6.40%	117,916,000.00	7.04%	-	-
中信建投证券	48,247,500.52	12.07%	261,096,000.00	15.58%	-	-
西南证券	27,215,974.27	6.81%	248,252,000.00	14.81%	-	-
海通证券	10,627,107.12	2.66%	47,196,000.00	2.82%	-	-
天风证券	930,034.86	0.23%	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

## 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	招商基金管理有限公司旗下基金 2022 年第 4 季度报告提示性公告	中国证券报及基金管理人网站	2023-01-18
2	招商安达灵活配置混合型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-01-18
3	招商基金管理有限公司旗下基金 2022 年年度报告提示性公告	中国证券报及基金管理人网站	2023-03-30
4	招商安达灵活配置混合型证券投资基金 2022 年年度报告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-03-30
5	招商安达灵活配置混合型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-04-21
6	招商基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 1 季度报告提示性公告	中国证券报及基金管理人网站	2023-04-21
7	招商基金管理有限公司关于提醒投资者持续完善身份信息资料的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-05-12
8	招商基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-06-22
9	招商基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会	2023-07-08

		会基金电子披露网站	
10	招商安达灵活配置混合型证券投资基金基金合同（2023 年 7 月 10 日修订）	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-07-10
11	招商安达灵活配置混合型证券投资基金托管协议（2023 年 7 月 10 日修订）	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-07-10
12	招商安达灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-07-13
13	招商安达灵活配置混合型证券投资基金更新的招募说明书（二零二三年第一号）	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-07-13
14	招商安达灵活配置混合型证券投资基金 2023 年第 2 季度报告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-07-20
15	招商基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 2 季度报告提示性公告	中国证券报及基金管理人网站	2023-07-20
16	招商基金管理有限公司关于运用自有资金投资旗下公募基金的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-08-21
17	招商安达灵活配置混合型证券投资基金 2023 年中期报告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-08-30
18	招商基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-08-30
19	招商基金管理有限公司旗下基金 2023 年中期报告提示性公告	中国证券报及基金管理人网站	2023-08-30
20	招商基金管理有限公司关于终止南京途牛基金销售有限公司办理旗下基金销售业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-09-05
21	招商基金管理有限公司关于终止凤凰金信（海口）基金销售有限公司办理旗下基金销售业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-09-07
22	招商基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-09-28
23	招商安达灵活配置混合型证券投资基金更新的招募说明书（二零二三年第二号）	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-10-09
24	招商安达灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-10-09

25	招商安达灵活配置混合型证券投资基金 2023 年第 3 季度报告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-10-24
26	招商基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 3 季度报告提示性公告	中国证券报及基金管理人网站	2023-10-24
27	招商基金管理有限公司关于运用自有资金投资旗下公募基金的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-10-30
28	招商基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-12-30

## § 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批准设立招商基金管理有限公司的文件；
- 2、中国证券监督管理委员会批准招商安达灵活配置混合型证券投资基金设立的文件；
- 3、《招商安达灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 4、《招商安达灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 5、《招商安达灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照。

### 12.2 存放地点

招商基金管理有限公司

地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

### 12.3 查阅方式

上述文件可在招商基金管理有限公司互联网站上查阅，或者在营业时间内到招商基金管理有限公司查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人招商基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-887-9555

网址：<http://www.cmfcchina.com>

招商基金管理有限公司

2024 年 3 月 29 日