

# 招商康泰灵活配置混合型证券投资基金 2024 年中期报告

2024 年 06 月 30 日

基金管理人：招商基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 30 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。本中期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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 29 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.....                              | 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.....                         | 4  |
| 2.4 信息披露方式.....                              | 5  |
| 2.5 其他相关资料.....                              | 5  |
| §3 主要财务指标和基金净值表现.....                        | 5  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标.....                         | 5  |
| 3.2 基金净值表现.....                              | 6  |
| §4 管理人报告.....                                | 6  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况.....                        | 6  |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....              | 7  |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....                 | 7  |
| 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.....             | 8  |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....             | 9  |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....                | 9  |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....                 | 10 |
| 4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....               | 10 |
| §5 托管人报告.....                                | 10 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....                  | 10 |
| 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..... | 10 |
| 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.....      | 10 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计）.....                      | 10 |
| 6.1 资产负债表.....                               | 10 |
| 6.2 利润表.....                                 | 12 |
| 6.3 净资产变动表.....                              | 13 |
| 6.4 报表附注.....                                | 15 |
| §7 投资组合报告.....                               | 33 |
| 7.1 期末基金资产组合情况.....                          | 33 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....                    | 34 |
| 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.....       | 34 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                     | 35 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                    | 37 |
| 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.....      | 37 |
| 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.....   | 38 |
| 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.....   | 38 |
| 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.....      | 38 |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....                     | 38 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....               | 38 |

|                                       |    |
|---------------------------------------|----|
| 7.12 投资组合报告附注.....                    | 38 |
| §8 基金份额持有人信息.....                     | 40 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....            | 40 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....         | 40 |
| 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..... | 40 |
| §9 开放式基金份额变动.....                     | 40 |
| §10 重大事件揭示.....                       | 40 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议.....                 | 41 |
| 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..... | 41 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....      | 41 |
| 10.4 基金投资策略的改变.....                   | 41 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....            | 41 |
| 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.....    | 41 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....           | 41 |
| 10.8 其他重大事件.....                      | 42 |
| §11 备查文件目录.....                       | 43 |
| 11.1 备查文件目录.....                      | 43 |
| 11.2 存放地点.....                        | 43 |
| 11.3 查阅方式.....                        | 43 |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                   |
|------------|-------------------|
| 基金名称       | 招商康泰灵活配置混合型证券投资基金 |
| 基金简称       | 招商康泰混合            |
| 基金主代码      | 002103            |
| 交易代码       | 002103            |
| 基金运作方式     | 契约型开放式            |
| 基金合同生效日    | 2016 年 2 月 4 日    |
| 基金管理人      | 招商基金管理有限公司        |
| 基金托管人      | 中国建设银行股份有限公司      |
| 报告期末基金份额总额 | 128,367,998.57 份  |
| 基金合同存续期    | 不定期               |

注：2018 年 4 月 21 日本基金名称变更为“招商康泰灵活配置混合型证券投资基金”。

### 2.2 基金产品说明

|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 在有效控制投资风险的前提下，通过积极主动的投资管理，力争获取超越业绩比较基准的投资收益，追求基金资产的长期稳定增值。  |
| 投资策略   | 在投资策略上，本基金从两个层次进行，首先是进行大类资产配置，采取宏观市场分析研判和与投资收益挂钩相结合的资产配置策略，从而有效控制基金净值的下行风险；其次是从定量和定性两个方面，通过深入的基本面研究分析，精选在业绩考核周期内具有获取绝对收益潜力的个股和个券，构建股票组合和债券组合。<br>具体包括：（一）资产配置策略；（二）股票投资策略；（三）债券投资策略；（四）权证投资策略；（五）股指期货投资策略；（六）资产支持证券的投资策略；（七）存托凭证投资策略。 |
| 业绩比较基准 | 中债综合指数收益率*70%+沪深 300 指数收益率*30%  |
| 风险收益特征 | 本基金是混合型基金，属于证券投资基金中预期风险、收益水平中等的投资品种，其预期风险收益水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金。  |

### 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      | 招商基金管理有限公司    | 中国建设银行股份有限公司     |
| 信息披露负责人 | 姓名            | 王小飞              |
|         | 联系电话          | 0755-83196666    |
|         | 电子邮箱          | cmf@cmfchina.com |
| 客户服务电话  | 400-887-9555  | 021-60637228     |
| 传真      | 0755-83196475 | 021-60635778     |

|       |                   |                       |
|-------|-------------------|-----------------------|
| 注册地址  | 深圳市福田区深南大道 7088 号 | 北京市西城区金融大街 25 号       |
| 办公地址  | 深圳市福田区深南大道 7088 号 | 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼 |
| 邮政编码  | 518040            | 100033                |
| 法定代表人 | 王小青               | 张金良                   |

## 2.4 信息披露方式

|                     |   |
|---------------------|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 证券时报  |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | <a href="http://www.cmfchina.com">http://www.cmfchina.com</a> |
| 基金中期报告备置地点          | 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              |
|--------|------------|-------------------|
| 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 1 月 1 日 - 2024 年 6 月 30 日) |
| 本期已实现收益       | -2,837,469.66                         |
| 本期利润          | -3,494,606.84                         |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.0261                               |
| 本期加权平均净值利润率   | -3.44%                                |
| 本期基金份额净值增长率   | -3.34%                                |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2024 年 6 月 30 日)                 |
| 期末可供分配利润      | -31,785,309.45                        |
| 期末可供分配基金份额利润  | -0.2476                               |
| 期末基金资产净值      | 96,582,689.12                         |
| 期末基金份额净值      | 0.752                                 |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2024 年 6 月 30 日)                 |
| 基金份额累计净值增长率   | -4.64%                                |

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。

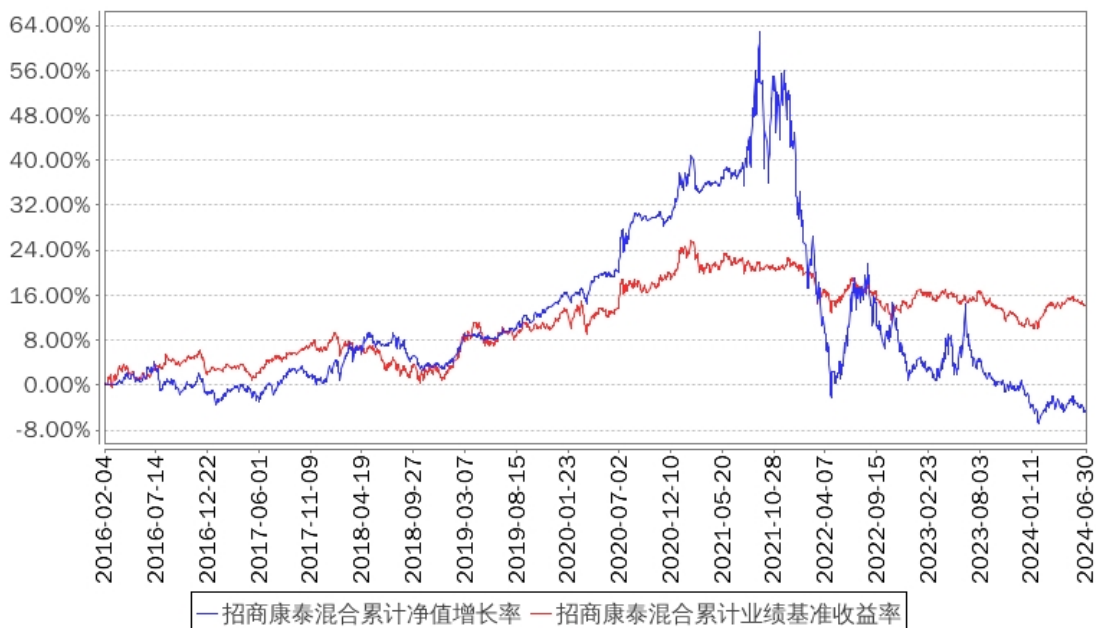
### 3.2 基金净值表现

#### 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   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去一个月      | -1.31%   | 0.27%       | -0.55%     | 0.14%         | -0.76%  | 0.13% |
| 过去三个月      | -1.44%   | 0.38%       | 0.12%      | 0.21%         | -1.56%  | 0.17% |
| 过去六个月      | -3.34%   | 0.45%       | 2.07%      | 0.26%         | -5.41%  | 0.19% |
| 过去一年       | -11.74%  | 0.44%       | -0.67%     | 0.26%         | -11.07% | 0.18% |
| 过去三年       | -30.82%  | 1.16%       | -6.79%     | 0.31%         | -24.03% | 0.85% |
| 自基金合同生效起至今 | -4.64%   | 0.75%       | 14.20%     | 0.34%         | -18.84% | 0.41% |

#### 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

招商康泰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



## § 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拥有公开募集证券投资基金管理、基金销售、全国社会保障基金境内委托管理、企业年金和职业年金基金投资管理、合格境内机构投资者、特定客户资产管理、保险资金投资管理、基本养老保险基金投资管理、公募基金投资顾问业务试点资格。

#### 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 |        |   |
| 李华建 | 本基金基金经理 | 2020 年 11 月 3 日 | -    | 20     | 男，硕士。2003 年 7 月加入中国人寿资产管理有限公司，曾任投资分析部研究员、基金投资部高级投资经理、股票投资部总经理助理及信用管理部副总经理等职务，从事证券研究分析、证券投资以及管理等工作。2020 年 9 月加入招商基金管理有限公司投资管理一部，曾任招商盛洋 3 个月定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理，现任招商康泰灵活配置混合型证券投资基金、招商中国机遇股票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》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遵规守信情况的说明

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。

#### 4.3.2 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 6 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。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

2024 年上半年,A 股市场整体处于震荡行情,沪深 300 指数上涨 0.89%,表现较好的行业有公用事业、煤炭、石油石化、通信、银行、家电等,表现较差的行业有房地产、医药、计算机、社服、食品饮料等。

上半年组合净值下跌 3.34%。上半年组合采取灵活配置型股票基金投资策略,根据对股票和债券市场走势的判断,采取了比较均衡的大类资产配置,股票平均配置比例 32%左右,可转债平均配置比例 19%左右,债券、同业存单等固息类资产配置占比 37%左右。

组合在可转债投资上,以债性品种为主;在固息类资产方面,采取比较均衡灵活的久期策略,二季度适当拉长了组合久期。

股票投资方面,上半年组合主要配置的方向有电子、医药、油运、农业、教育、煤炭等,在教育、煤炭、有色等行业的投资上取得较好效果,但在医药、油运、化工、食品饮料等行业的投资产生了负收益。上半年组合减少了对医药、机械、传媒等行业的配置。

#### 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-3.34%，同期业绩基准增长率为 2.07%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前市场处于底部地区，经济稳步复苏，看好的方向有：一是，具备较高 ROE、现金流较好、具备持续分红能力的高股息类公司，是重要的配置型资产；二是，看好符合新质生产力发展方向的电子、通信、创新药和创新医疗器械等；三是，看好与全球宏观经济周期相关的有色、油运；消费类的家电、教育等方向。

#### 4.6 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办法》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。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

#### 4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期,本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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

本托管人复核审查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。

## § 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：招商康泰灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产  | 附注号 | 本期末 2024 年 6 月 30 日 | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 |
|-----|-----|---------------------|-----------------------|
| 资产： |     |                     |                       |

|           |         |                     |                       |
|-----------|---------|---------------------|-----------------------|
| 货币资金      | 6.4.7.1 | 580,734.82          | 26,399,606.72         |
| 结算备付金     |         | 239,343.27          | 133,132.10            |
| 存出保证金     |         | 32,107.34           | 55,667.24             |
| 交易性金融资产   | 6.4.7.2 | 90,871,078.53       | 93,737,575.86         |
| 其中：股票投资   |         | 30,788,508.66       | 33,800,574.24         |
| 基金投资      |         | -                   | -                     |
| 债券投资      |         | 60,082,569.87       | 59,937,001.62         |
| 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 | 5,583,263.21        | -                     |
| 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     |         | 815,794.23          | -                     |
| 应收股利      |         | -                   | -                     |
| 应收申购款     |         | 2,245.29            | 1,793.88              |
| 递延所得税资产   |         | -                   | -                     |
| 其他资产      | 6.4.7.5 | -                   | -                     |
| 资产总计      |         | 98,124,566.69       | 120,327,775.80        |
| 负债和净资产    | 附注号     | 本期末 2024 年 6 月 30 日 | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 |
| 负债：       |         |                     |                       |
| 短期借款      |         | -                   | -                     |
| 交易性金融负债   |         | -                   | -                     |
| 衍生金融负债    | 6.4.7.3 | -                   | -                     |
| 卖出回购金融资产款 |         | -                   | -                     |
| 应付清算款     |         | 855,933.12          | 12,481,666.29         |
| 应付赎回款     |         | 343,184.49          | 23,372.49             |
| 应付管理人报酬   |         | 97,583.08           | 110,601.31            |
| 应付托管费     |         | 16,263.84           | 18,433.56             |
| 应付销售服务费   |         | -                   | -                     |
| 应付投资顾问费   |         | -                   | -                     |
| 应交税费      |         | 232.76              | -                     |
| 应付利润      |         | -                   | -                     |
| 递延所得税负债   |         | -                   | -                     |
| 其他负债      | 6.4.7.6 | 228,680.28          | 306,632.81            |
| 负债合计      |         | 1,541,877.57        | 12,940,706.46         |
| 净资产：      |         |                     |                       |

|          |         |                |                |
|----------|---------|----------------|----------------|
| 实收基金     | 6.4.7.7 | 128,367,998.57 | 138,056,106.63 |
| 其他综合收益   |         | -              | -              |
| 未分配利润    | 6.4.7.8 | -31,785,309.45 | -30,669,037.29 |
| 净资产合计    |         | 96,582,689.12  | 107,387,069.34 |
| 负债和净资产总计 |         | 98,124,566.69  | 120,327,775.80 |

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.752 元，基金份额总额 128,367,998.57 份。

## 6.2 利润表

会计主体：招商康泰灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                            | 附注号      | 本期 2024 年 1 月 1 日至<br>2024 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2023<br>年 1 月 1 日至 2023 年 6<br>月 30 日 |
|-------------------------------|----------|---------------------------------------|---|
| 一、营业总收入                       |          | -2,697,282.39                         | 8,154,239.45                                  |
| 1.利息收入                        |          | 60,449.45                             | 69,534.93                                     |
| 其中：存款利息收入                     | 6.4.7.9  | 18,812.45                             | 30,466.49                                     |
| 债券利息收入                        |          | -                                     | -   |
| 资产支持证券利息<br>收入                |          | -                                     | -   |
| 买入返售金融资产<br>收入                |          | 41,637.00                             | 39,068.44                                     |
| 其他利息收入                        |          | -                                     | -   |
| 2.投资收益（损失以“-”<br>填列）          |          | -2,102,234.51                         | 3,841,133.79                                  |
| 其中：股票投资收益                     | 6.4.7.10 | -4,228,938.35                         | 3,574,798.18                                  |
| 基金投资收益                        |          | -                                     | -   |
| 债券投资收益                        | 6.4.7.11 | 1,830,272.68                          | -25,694.01                                    |
| 资产支持证券投资<br>收益                | 6.4.7.12 | -                                     | -   |
| 贵金属投资收益                       | 6.4.7.13 | -                                     | -   |
| 衍生工具收益                        | 6.4.7.14 | -                                     | -   |
| 股利收益                          | 6.4.7.15 | 296,431.16                            | 292,029.62                                    |
| 以摊余成本计量的<br>金融资产终止确认产生的<br>收益 |          | -                                     | -   |
| 其他投资收益                        |          | -                                     | -   |
| 3.公允价值变动收益（损<br>失以“-”号填列）     | 6.4.7.16 | -657,137.18                           | 4,225,251.59                                  |
| 4.汇兑收益（损失以“-”                 |          | -                                     | -   |

|                     |            |               |              |
|---------------------|------------|---------------|--------------|
| 号填列)                |            |               |              |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列)   | 6.4.7.17   | 1,639.85      | 18,319.14    |
| 减：二、营业总支出           |            | 797,324.45    | 1,245,072.31 |
| 1.管理人报酬             | 6.4.10.2.1 | 605,731.38    | 987,585.50   |
| 其中：暂估管理人报酬          |            | -             | -            |
| 2.托管费               | 6.4.10.2.2 | 100,955.20    | 164,597.61   |
| 3.销售服务费             |            | -             | -            |
| 4.投资顾问费             |            | -             | -            |
| 5.利息支出              |            | 389.62        | 2,373.29     |
| 其中：卖出回购金融资产支出       |            | 389.62        | 2,373.29     |
| 6.信用减值损失            | 6.4.7.18   | -             | -            |
| 7.税金及附加             |            | 595.43        | 25.47        |
| 8.其他费用              | 6.4.7.19   | 89,652.82     | 90,490.44    |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列) |            | -3,494,606.84 | 6,909,167.14 |
| 减：所得税费用             |            | -             | -            |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列)   |            | -3,494,606.84 | 6,909,167.14 |
| 五、其他综合收益的税后净额       |            | -             | -            |
| 六、综合收益总额            |            | -3,494,606.84 | 6,909,167.14 |

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。

### 6.3 净资产变动表

会计主体：招商康泰灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目        | 本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |        |                |                |
|-----------|------------------------------------|--------|----------------|----------------|
|           | 实收基金                               | 其他综合收益 | 未分配利润          | 净资产合计          |
| 一、上期期末净资产 | 138,056,106.63                     | -      | -30,669,037.29 | 107,387,069.34 |
| 加：会计政策变更  | -                                  | -      | -              | -              |
| 前期差错更正    | -                                  | -      | -              | -              |
| 其他        | -                                  | -      | -              | -              |
| 二、本期期初净资产 | 138,056,106.63                     | -      | -30,669,037.29 | 107,387,069.34 |

|  |   |        |                |                |
|--|---|--------|----------------|----------------|
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | -9,688,108.06                           | -      | -1,116,272.16  | -10,804,380.22 |
| （一）、综合收益总额                               | -                                       | -      | -3,494,606.84  | -3,494,606.84  |
| （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）      | -9,688,108.06                           | -      | 2,378,334.68   | -7,309,773.38  |
| 其中：1.基金申购款                               | 946,522.04                              | -      | -230,042.95    | 716,479.09     |
| 2.基金赎回款                                  | -10,634,630.10                          | -      | 2,608,377.63   | -8,026,252.47  |
| （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                                | 128,367,998.57                          | -      | -31,785,309.45 | 96,582,689.12  |
| 项目                                       | 上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |        |                |                |
|  | 实收基金                                    | 其他综合收益 | 未分配利润          | 净资产合计          |
| 一、上期期末净资产                                | 178,093,518.62                          | -      | -34,760,995.59 | 143,332,523.03 |
| 加：会计政策变更                                 | -                                       | -      | -              | -              |
| 前期差错更正                                   | -                                       | -      | -              | -              |
| 其他                                       | -                                       | -      | -              | -              |
| 二、本期期初净资产                                | 178,093,518.62                          | -      | -34,760,995.59 | 143,332,523.03 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | -33,424,582.13                          | -      | 13,302,593.81  | -20,121,988.32 |
| （一）、综合收益总额                               | -                                       | -      | 6,909,167.14   | 6,909,167.14   |
| （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）      | -33,424,582.13                          | -      | 6,393,426.67   | -27,031,155.46 |
| 其中：1.基金申购款                               | 3,214,270.80                            | -      | -559,893.80    | 2,654,377.00   |
| 2.基金赎回款                                  | -36,638,852.93                          | -      | 6,953,320.47   | -29,685,532.46 |
| （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                       | 144,668,936.49 | - | -21,458,401.78 | 123,210,534.71 |

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：

\_\_\_\_\_ 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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

招商康泰灵活配置混合型证券投资基金(原名招商康泰养老灵活配置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》、《招商康泰灵活配置混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“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[2015]2563号文准予公开募集注册。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231,740,450.36份,经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(16)第0074号验资报告。基金合同于2016年2月4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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称“中国建设银行”)。本基金于2018年4月21日起更名为招商康泰灵活配置混合型证券投资基金。

根据本基金管理人于2018年4月21日发布的《招商基金管理有限公司关于变更招商康泰养老灵活配置混合型证券投资基金基金名称的公告》,根据中国证监会发布的《养老目标证券投资基金指引(试行)》第十二条的规定:“本指引实施后,基金名称中已经包含“养老”字样的公募基金,不符合本指引要求的,基金管理人应当在3个月内履行程序修改基金名称,“养老”产业投资主题基金除外”,招商基金管理有限公司现经与基金托管人协商一致,并报中国证监会备案,决定自2018年4月21日起将招商康泰养老灵活配置混合型证券投资基金的基金名称变更为招商康泰灵活配置混合型证券投资基金,基金代码保持不变。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、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,本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票和存托凭证(包括主板、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(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、



政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、中小企业私募债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、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)、货币市场工具、权证、股指期货以及经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。本基金股票和存托凭证资产占基金资产的比例为 0%-95%,权证投资比例不超过基金资产净值的 3%,每个交易日日终在扣除需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人履行适当程序后,可以将其纳入投资范围,并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。

本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率×30%+中债综合指数收益率×70%。

#### 6.4.2 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。

#### 6.4.3 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 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

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。

#### 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

本基金在本报告期间未发生重大会计政策变更。

##### 6.4.5.2 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。

##### 6.4.5.3 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。

## 6.4.6 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。

## 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 6 月 30 日 |
|----|---------------------|
|----|---------------------|

|                |            |
|----------------|------------|
| 活期存款           | 580,734.82 |
| 等于：本金          | 580,648.31 |
| 加：应计利息         | 86.51      |
| 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             | 580,734.82 |

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末 2024 年 6 月 30 日 |               |               |               |            |
|---------------|---------------------|---------------|---------------|---------------|------------|
|               | 成本                  | 应计利息          | 公允价值          | 公允价值变动        |            |
| 股票            | 30,506,351.53       | -             | 30,788,508.66 | 282,157.13    |            |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                   | -             | -             | -             |            |
| 债券            | 交易所市场               | 17,207,309.63 | 180,050.28    | 17,519,238.78 | 131,878.87 |
|               | 银行间市场               | 41,649,557.00 | 480,731.09    | 42,563,331.09 | 433,043.00 |
|               | 合计                  | 58,856,866.63 | 660,781.37    | 60,082,569.87 | 564,921.87 |
| 资产支持证券        | -                   | -             | -             | -             |            |
| 基金            | -                   | -             | -             | -             |            |
| 其他            | -                   | -             | -             | -             |            |
| 合计            | 89,363,218.16       | 660,781.37    | 90,871,078.53 | 847,079.00    |            |

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末无衍生金融工具。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2024 年 6 月 30 日 |
|----|---------------------|
|----|---------------------|

|       | 账面余额         | 其中：买断式逆回购 |
|-------|--------------|-----------|
| 交易所市场 | 5,583,263.21 | -         |
| 银行间市场 | -            | -         |
| 合计    | 5,583,263.21 | -         |

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 其他资产

本基金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 6 月 30 日 |
|-------------|---------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                   |
| 应付赎回费       | 112.85              |
| 应付证券出借违约金   | -                   |
| 应付交易费用      | 158,895.09          |
| 其中：交易所市场    | 158,445.09          |
| 银行间市场       | 450.00              |
| 应付利息        | -                   |
| 预提费用        | 69,672.34           |
| 合计          | 228,680.28          |

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |                |
|---------------|------------------------------------|----------------|
|               | 基金份额（份）                            | 账面金额           |
| 上年度末          | 138,056,106.63                     | 138,056,106.63 |
| 本期申购          | 946,522.04                         | 946,522.04     |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -10,634,630.10                     | -10,634,630.10 |
| 基金拆分/份额折算调整   | -                                  | -              |
| 本期末           | 128,367,998.57                     | 128,367,998.57 |

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。

#### 6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

| 项目       | 已实现部分          | 未实现部分         | 未分配利润合计        |
|----------|----------------|---------------|----------------|
| 上年度末     | -26,890,850.42 | -3,778,186.87 | -30,669,037.29 |
| 加：会计政策变更 | -              | -             | -              |
| 前期差错更正   | -              | -             | -              |
| 其他       | -              | -             | -              |

|                |                |               |                |
|----------------|----------------|---------------|----------------|
| 本期期初           | -26,890,850.42 | -3,778,186.87 | -30,669,037.29 |
| 本期利润           | -2,837,469.66  | -657,137.18   | -3,494,606.84  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 2,061,448.00   | 316,886.68    | 2,378,334.68   |
| 其中：基金申购款       | -202,300.61    | -27,742.34    | -230,042.95    |
| 基金赎回款          | 2,263,748.61   | 344,629.02    | 2,608,377.63   |
| 本期已分配利润        | -              | -             | -              |
| 本期末            | -27,666,872.08 | -4,118,437.37 | -31,785,309.45 |

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
|-----------|------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 14,506.28                          |
| 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 | 3,998.30                           |
| 其他        | 307.87                             |
| 合计        | 18,812.45                          |

#### 6.4.7.10 股票投资收益

##### 6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目               | 本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
|------------------|------------------------------------|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | -4,228,938.35                      |
| 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               | -4,228,938.35                      |

##### 6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目         | 本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
|------------|------------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 157,811,002.32                     |
| 减：卖出股票成本总额 | 161,678,562.81                     |
| 减：交易费用     | 361,377.86                         |
| 买卖股票差价收入   | -4,228,938.35                      |

##### 6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无股票赎回差价收入。

##### 6.4.7.10.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无股票申购差价收入。

**6.4.7.10.5 股票投资收益——证券出借差价收入**

本基金本报告期内无证券出借差价收入。

**6.4.7.11 债券投资收益****6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

| 项目                           | 本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
|------------------------------|------------------------------------|
| 债券投资收益——利息收入                 | 829,370.69                         |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 1,000,901.99                       |
| 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                           | 1,830,272.68                       |

**6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

| 项目                     | 本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
|------------------------|------------------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 69,455,200.16                      |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 67,842,540.09                      |
| 减：应计利息总额               | 607,858.01                         |
| 减：交易费用                 | 3,900.07                           |
| 买卖债券差价收入               | 1,000,901.99                       |

**6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入**

本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

**6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期内无债券申购差价收入。

**6.4.7.12 资产支持证券投资收益****6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成**

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

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

本基金本报告期内无买卖资产支持证券差价收入。

**6.4.7.12.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入**

本基金本报告期内无资产支持证券赎回差价收入。

**6.4.7.12.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期内无资产支持证券申购差价收入。

**6.4.7.13 贵金属投资收益****6.4.7.13.1 贵金属投资收益项目构成**

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

**6.4.7.13.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

本基金本报告期内无买卖贵金属差价收入。

**6.4.7.13.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

本基金本报告期内无贵金属赎回差价收入。

**6.4.7.13.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期内无贵金属申购差价收入。

**6.4.7.14 衍生工具收益****6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期内无衍生工具买卖权证差价收入。

**6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益**

本基金本报告期内无衍生工具其他投资收益。

**6.4.7.15 股利收益**

单位：人民币元

| 项目            | 本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
|---------------|------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 296,431.16                         |
| 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            | 296,431.16                         |

**6.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
|------------|------------------------------------|
| 1.交易性金融资产  | -657,137.18                        |
| ——股票投资     | -750,333.65                        |
| ——债券投资     | 93,196.47                          |
| ——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                     | -657,137.18 |

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
|---------|------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 1,639.85                           |
| 合计      | 1,639.85                           |

#### 6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
|---------|------------------------------------|
| 审计费用    | 10,000.00                          |
| 信息披露费   | 59,672.34                          |
| 证券出借违约金 | -                                  |
| 其他      | 19,980.48                          |
| 合计      | 89,652.82                          |

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

#### 6.4.8.2 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。

### 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  |
|------------------------|----------|
| 招商基金管理有限公司             | 基金管理人    |
| 中国建设银行股份有限公司           | 基金托管人    |
| 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 |



注：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。

## 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 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |              | 上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 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  | 116,053,524.76                     | 36.58%       | 87,467,869.65                           | 13.89%       |

#### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |              | 上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 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  | 15,031,901.23                      | 21.10%       | 6,223,956.63                            | 24.98%       |

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |                | 上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 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  | 17,570,000.00                      | 6.32%          | -                                       | -              |

#### 6.4.10.1.4 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。

#### 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 1 月 1 日至 2024 年 6 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  | 86,565.03                               | 33.02%     | 58,900.93 | 37.17%       |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 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 | 63,965.64 | 11.51% | 59,154.77 | 13.99% |
|------|-----------|--------|-----------|--------|

注：1、本报告期内，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、本报告期内，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。

## 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 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|------------------|------------------------------------|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 605,731.38                         | 987,585.50                              |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 274,552.26                         | 421,289.15                              |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 331,179.12                         | 566,296.35                              |
| 应支付投资顾问的投资顾问费    | -                                  | -                                       |

注：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：

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

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------------------|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 100,955.20                         | 164,597.61                              |

注：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：

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

## 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。

## 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。

#### 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。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

| 项目                               | 本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|----------------------------------|------------------------------------|---|
| 基金合同生效日（2016 年 02 月 04 日）持有的基金份额 | -                                  | -                                       |
| 报告期初持有的基金份额                      | 1,114,557.99                       | 1,114,557.99                            |
| 报告期间申购/买入总份额                     | -                                  | -                                       |
| 报告期间因拆分变动份额                      | -                                  | -                                       |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额                   | -                                  | -                                       |
| 报告期末持有的基金份额                      | 1,114,557.99                       | 1,114,557.99                            |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例              | 0.87%                              | 0.77%                                   |

##### 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。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称   | 本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |           | 上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |           |
|---------|------------------------------------|-----------|---|-----------|
|         | 期末余额                               | 当期利息收入    | 期末余额                                    | 当期利息收入    |
| 建设银行-活期 | 580,734.82                         | 14,506.28 | 6,030,390.25                            | 26,482.17 |

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

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内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。

#### 6.4.11 利润分配情况

##### 6.4.11.1 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

## 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

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

### 6.4.12.2 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。

### 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

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。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

### 6.4.12.4 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。

## 6.4.13 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。

### 6.4.13.1 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。

### 6.4.13.2 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、资产支持证券投资及其他。

本基金的银行存款存放于本基金的基金托管人，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、资产支持证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。附注 6.4.13.2.1 至 6.4.13.2.6 列示了本基金所持有的债券投资及资产支持证券投资的信用评级，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。

#### 6.4.13.2.1 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。

#### 6.4.13.2.2 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。

#### 6.4.13.2.3 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。

#### 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 6 月 30 日 | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 |
|--------|---------------------|-----------------------|
| AAA    | 8,614,994.12        | 43,766,801.34         |
| AAA 以下 | 3,000,027.95        | -                     |
| 未评级    | -                   | -                     |
| 合计     | 11,615,022.07       | 43,766,801.34         |

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。

#### 6.4.13.2.5 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。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2024 年 6 月 30 日 | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 |
|--------|---------------------|-----------------------|
| AAA    | 19,860,731.09       | -                     |
| AAA 以下 | -                   | -                     |
| 未评级    | -                   | -                     |
| 合计     | 19,860,731.09       | -                     |

注：同业存单投资评级以其主体评级进行列示。

#### 6.4.13.3 流动性风险

### 6.4.13.3.1 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 6.4.12 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(所有者权益)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。

### 6.4.13.4 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。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2024 年 6 月 30 日 | 1 年以内         | 1-5 年         | 5 年以上         | 不计息           | 合计            |
|---------------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|
| 资产                  |               |               |               |               |               |
| 货币资金                | 580,734.82    | -             | -             | -             | 580,734.82    |
| 结算备付金               | 239,343.27    | -             | -             | -             | 239,343.27    |
| 存出保证金               | 32,107.34     | -             | -             | -             | 32,107.34     |
| 交易性金融资产             | 25,764,947.80 | 21,921,595.84 | 12,396,026.23 | 30,788,508.66 | 90,871,078.53 |

|                       |               |               |               |               |                |
|-----------------------|---------------|---------------|---------------|---------------|----------------|
| 衍生金融资产                | -             | -             | -             | -             | -              |
| 买入返售金融资产              | 5,583,263.21  | -             | -             | -             | 5,583,263.21   |
| 债权投资                  | -             | -             | -             | -             | -              |
| 应收股利                  | -             | -             | -             | -             | -              |
| 应收申购款                 | -             | -             | -             | 2,245.29      | 2,245.29       |
| 应收清算款                 | -             | -             | -             | 815,794.23    | 815,794.23     |
| 其他资产                  | -             | -             | -             | -             | -              |
| 资产总计                  | 32,200,396.44 | 21,921,595.84 | 12,396,026.23 | 31,606,548.18 | 98,124,566.69  |
| 负债                    |               |               |               |               |                |
| 应付赎回款                 | -             | -             | -             | 343,184.49    | 343,184.49     |
| 应付管理人报酬               | -             | -             | -             | 97,583.08     | 97,583.08      |
| 应付托管费                 | -             | -             | -             | 16,263.84     | 16,263.84      |
| 应付清算款                 | -             | -             | -             | 855,933.12    | 855,933.12     |
| 卖出回购金融资产款             | -             | -             | -             | -             | -              |
| 应付销售服务费               | -             | -             | -             | -             | -              |
| 应付投资顾问费               | -             | -             | -             | -             | -              |
| 应付利润                  | -             | -             | -             | -             | -              |
| 应交税费                  | -             | -             | -             | 232.76        | 232.76         |
| 其他负债                  | -             | -             | -             | 228,680.28    | 228,680.28     |
| 负债总计                  | -             | -             | -             | 1,541,877.57  | 1,541,877.57   |
| 利率敏感度缺口               | 32,200,396.44 | 21,921,595.84 | 12,396,026.23 | 30,064,670.61 | 96,582,689.12  |
| 上年度末 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                  | 26,399,606.72 | -             | -             | -             | 26,399,606.72  |
| 结算备付金                 | 133,132.10    | -             | -             | -             | 133,132.10     |
| 存出保证金                 | 55,667.24     | -             | -             | -             | 55,667.24      |
| 交易性金融资产               | 5,836,986.58  | 43,736,129.79 | 10,363,885.25 | 33,800,574.24 | 93,737,575.86  |
| 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                 | -             | -             | -             | 1,793.88      | 1,793.88       |
| 应收清算款                 | -             | -             | -             | -             | -              |
| 其他资产                  | -             | -             | -             | -             | -              |
| 资产总计                  | 32,425,392.64 | 43,736,129.79 | 10,363,885.25 | 33,802,368.12 | 120,327,775.80 |
| 负债                    |               |               |               |               |                |
| 应付赎回款                 | -             | -             | -             | 23,372.49     | 23,372.49      |
| 应付管理人报酬               | -             | -             | -             | 110,601.31    | 110,601.31     |
| 应付托管费                 | -             | -             | -             | 18,433.56     | 18,433.56      |

|           |               |               |               |               |                |
|-----------|---------------|---------------|---------------|---------------|----------------|
| 应付清算款     | -             | -             | -             | 12,481,666.29 | 12,481,666.29  |
| 卖出回购金融资产款 | -             | -             | -             | -             | -              |
| 应付销售服务费   | -             | -             | -             | -             | -              |
| 应付投资顾问费   | -             | -             | -             | -             | -              |
| 应付利润      | -             | -             | -             | -             | -              |
| 应交税费      | -             | -             | -             | -             | -              |
| 其他负债      | -             | -             | -             | 306,632.81    | 306,632.81     |
| 负债总计      | -             | -             | -             | 12,940,706.46 | 12,940,706.46  |
| 利率敏感度缺口   | 32,425,392.64 | 43,736,129.79 | 10,363,885.25 | 20,861,661.66 | 107,387,069.34 |

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。

#### 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 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（2024 年 6 月 30 日）        | 上年度末（2023 年 12 月 31 日） |
|    |                       | 1. 市场利率平行上升 50 个基点          | -1,478,219.27          |
|    | 2. 市场利率平行下降 50 个基点    | 1,641,516.07                | 703,599.66             |

#### 6.4.13.4.2 其他价格风险

其他价格风险是指以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，也有可能与其他投资品种相关。本基金所持有的金融资产以公允价值计量，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。

##### 6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期末 2024 年 6 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  | 30,788,508.66       | 31.88        | 33,800,574.24         | 31.48        |
| 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  | 30,788,508.66 | 31.88 | 33,800,574.24 | 31.48 |

#### 6.4.13.4.2.2 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（2024 年 6 月 30 日）        | 上年度末（2023 年 12 月 31 日） |
|    | 1. 权益性投资的市场价格上升 5%            | 1,539,425.43                | 1,690,028.71           |
|    | 2. 权益性投资的市场价格下降 5%            | -1,539,425.43               | -1,690,028.71          |

#### 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 6 月 30 日 | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 |
|---------------|---------------------|-----------------------|
| 第一层次          | 42,403,530.73       | 46,254,959.43         |
| 第二层次          | 48,467,547.80       | 47,482,616.43         |
| 第三层次          | -                   | -                     |
| 合计            | 90,871,078.53       | 93,737,575.86         |

###### 6.4.14.2.2 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。

###### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 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。

#### 6.4.15 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。

## § 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              | 30,788,508.66 | 31.38         |
|    | 其中：股票             | 30,788,508.66 | 31.38         |
| 2  | 基金投资              | -             | -             |
| 3  | 固定收益投资            | 60,082,569.87 | 61.23         |
|    | 其中：债券             | 60,082,569.87 | 61.23         |
|    | 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          | 5,583,263.21  | 5.69          |
|    | 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      | 820,078.09    | 0.84          |
| 8  | 其他各项资产            | 850,146.86    | 0.87          |
| 9  | 合计                | 98,124,566.69 | 100.00        |

### 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

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         | -             | -             |
| B  | 采矿业              | 4,853,119.00  | 5.02          |
| C  | 制造业              | 11,633,353.40 | 12.04         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 1,179,942.00  | 1.22          |
| E  | 建筑业              | -             | -             |

|   |                 |               |       |
|---|-----------------|---------------|-------|
| F | 批发和零售业          | 496,250.00    | 0.51  |
| G | 交通运输、仓储和邮政业     | 2,922,310.00  | 3.03  |
| H | 住宿和餐饮业          | -             | -     |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 1,827,324.26  | 1.89  |
| J | 金融业             | 2,857,357.00  | 2.96  |
| K | 房地产业            | 282,948.00    | 0.29  |
| 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   | 503,690.00    | 0.52  |
| O | 居民服务、修理和其他服务业   | -             | -     |
| P | 教育              | 4,232,215.00  | 4.38  |
| Q | 卫生和社会工作         | -             | -     |
| R | 文化、体育和娱乐业       | -             | -     |
| S | 综合              | -             | -     |
|   | 合计              | 30,788,508.66 | 31.88 |

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

### 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  | 000526 | 学大教育 | 53,300  | 3,283,280.00 | 3.40         |
| 2  | 002475 | 立讯精密 | 62,500  | 2,456,875.00 | 2.54         |
| 3  | 601225 | 陕西煤业 | 75,100  | 1,935,327.00 | 2.00         |
| 4  | 600026 | 中远海能 | 120,600 | 1,882,566.00 | 1.95         |
| 5  | 600941 | 中国移动 | 13,500  | 1,451,250.00 | 1.50         |
| 6  | 600690 | 海尔智家 | 44,900  | 1,274,262.00 | 1.32         |
| 7  | 300308 | 中际旭创 | 8,800   | 1,213,344.00 | 1.26         |
| 8  | 600938 | 中国海油 | 33,700  | 1,112,100.00 | 1.15         |
| 9  | 603986 | 兆易创新 | 11,500  | 1,099,630.00 | 1.14         |
| 10 | 000333 | 美的集团 | 16,600  | 1,070,700.00 | 1.11         |
| 11 | 000975 | 山金国际 | 63,600  | 1,036,044.00 | 1.07         |
| 12 | 600163 | 中闽能源 | 205,100 | 988,582.00   | 1.02         |
| 13 | 600926 | 杭州银行 | 73,400  | 957,870.00   | 0.99         |
| 14 | 600661 | 昂立教育 | 84,500  | 948,935.00   | 0.98         |
| 15 | 601838 | 成都银行 | 62,300  | 946,337.00   | 0.98         |
| 16 | 300750 | 宁德时代 | 5,100   | 918,153.00   | 0.95         |
| 17 | 688266 | 泽璟制药 | 14,320  | 776,430.40   | 0.80         |
| 18 | 002371 | 北方华创 | 2,000   | 639,780.00   | 0.66         |

|    |        |        |         |            |      |
|----|--------|--------|---------|------------|------|
| 19 | 002668 | TCL 智家 | 68,300  | 618,798.00 | 0.64 |
| 20 | 601288 | 农业银行   | 133,300 | 581,188.00 | 0.60 |
| 21 | 601298 | 青岛港    | 59,400  | 567,864.00 | 0.59 |
| 22 | 600323 | 瀚蓝环境   | 24,100  | 503,690.00 | 0.52 |
| 23 | 601028 | 玉龙股份   | 39,700  | 496,250.00 | 0.51 |
| 24 | 600547 | 山东黄金   | 17,400  | 476,412.00 | 0.49 |
| 25 | 603507 | 振江股份   | 14,500  | 475,890.00 | 0.49 |
| 26 | 601000 | 唐山港    | 100,400 | 471,880.00 | 0.49 |
| 27 | 601009 | 南京银行   | 35,800  | 371,962.00 | 0.39 |
| 28 | 688279 | 峰昭科技   | 3,190   | 353,771.00 | 0.37 |
| 29 | 688617 | 惠泰医疗   | 640     | 291,904.00 | 0.30 |
| 30 | 002138 | 顺络电子   | 10,500  | 288,330.00 | 0.30 |
| 31 | 000552 | 甘肃能化   | 82,700  | 286,969.00 | 0.30 |
| 32 | 600048 | 保利发展   | 32,300  | 282,948.00 | 0.29 |
| 33 | 002648 | 卫星化学   | 10,900  | 195,982.00 | 0.20 |
| 34 | 600803 | 新奥股份   | 9,200   | 191,360.00 | 0.20 |
| 35 | 300705 | 九典制药   | 5,500   | 147,070.00 | 0.15 |
| 36 | 002179 | 中航光电   | 2,600   | 98,930.00  | 0.10 |
| 37 | 600761 | 安徽合力   | 2,100   | 45,444.00  | 0.05 |
| 38 | 688052 | 纳芯微    | 217     | 22,303.26  | 0.02 |
| 39 | 600600 | 青岛啤酒   | 300     | 21,831.00  | 0.02 |
| 40 | 601899 | 紫金矿业   | 300     | 5,271.00   | 0.01 |
| 41 | 600348 | 华阳股份   | 100     | 996.00     | 0.00 |

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称  | 本期累计买入金额     | 占期初基金资产净值比例（%） |
|----|--------|-------|--------------|----------------|
| 1  | 000526 | 学大教育  | 6,073,911.66 | 5.66           |
| 2  | 600026 | 中远海能  | 4,736,894.00 | 4.41           |
| 3  | 600938 | 中国海油  | 4,138,724.00 | 3.85           |
| 4  | 601666 | 平煤股份  | 3,985,745.00 | 3.71           |
| 5  | 600941 | 中国移动  | 3,038,343.00 | 2.83           |
| 6  | 000429 | 粤高速 A | 2,959,829.86 | 2.76           |
| 7  | 002714 | 牧原股份  | 2,848,819.00 | 2.65           |
| 8  | 600690 | 海尔智家  | 2,585,389.00 | 2.41           |
| 9  | 000858 | 五粮液   | 2,504,065.00 | 2.33           |
| 10 | 000792 | 盐湖股份  | 2,391,614.78 | 2.23           |
| 11 | 688256 | 寒武纪   | 2,353,302.83 | 2.19           |
| 12 | 300308 | 中际旭创  | 2,322,527.00 | 2.16           |
| 13 | 600519 | 贵州茅台  | 2,264,026.00 | 2.11           |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 14 | 601699 | 潞安环能 | 2,171,124.00 | 2.02 |
| 15 | 002475 | 立讯精密 | 2,088,993.00 | 1.95 |
| 16 | 002311 | 海大集团 | 2,068,228.00 | 1.93 |
| 17 | 601225 | 陕西煤业 | 2,047,305.00 | 1.91 |
| 18 | 300820 | 英杰电气 | 2,030,529.00 | 1.89 |
| 19 | 600661 | 昂立教育 | 2,010,867.00 | 1.87 |
| 20 | 600795 | 国电电力 | 2,003,794.00 | 1.87 |

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。

#### 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  | 688256 | 寒武纪   | 4,432,250.19 | 4.13           |
| 2  | 601666 | 平煤股份  | 3,697,601.00 | 3.44           |
| 3  | 002714 | 牧原股份  | 3,646,969.00 | 3.40           |
| 4  | 300705 | 九典制药  | 3,512,614.60 | 3.27           |
| 5  | 600938 | 中国海油  | 3,057,674.00 | 2.85           |
| 6  | 000526 | 学大教育  | 3,031,119.00 | 2.82           |
| 7  | 688220 | 翱捷科技  | 2,981,229.35 | 2.78           |
| 8  | 000429 | 粤高速 A | 2,948,491.00 | 2.75           |
| 9  | 300418 | 昆仑万维  | 2,805,959.00 | 2.61           |
| 10 | 000858 | 五粮液   | 2,721,688.00 | 2.53           |
| 11 | 600026 | 中远海能  | 2,709,795.00 | 2.52           |
| 12 | 605016 | 百龙创园  | 2,624,541.00 | 2.44           |
| 13 | 688012 | 中微公司  | 2,423,355.40 | 2.26           |
| 14 | 000792 | 盐湖股份  | 2,353,648.00 | 2.19           |
| 15 | 300757 | 罗博特科  | 2,276,054.20 | 2.12           |
| 16 | 600519 | 贵州茅台  | 2,222,996.00 | 2.07           |
| 17 | 603108 | 润达医疗  | 2,147,042.00 | 2.00           |
| 18 | 002311 | 海大集团  | 2,134,725.00 | 1.99           |
| 19 | 688687 | 凯因科技  | 2,125,816.12 | 1.98           |
| 20 | 603516 | 淳中科技  | 2,093,920.00 | 1.95           |

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。

### 7.4.3 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 | 159,416,830.88 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 157,811,002.32 |

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。

### 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（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|---------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 18,300,242.94 | 18.95        |
| 2  | 央行票据      | -             | -            |
| 3  | 金融债券      | 10,306,573.77 | 10.67        |
|    | 其中：政策性金融债 | 10,306,573.77 | 10.67        |
| 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） | 11,615,022.07 | 12.03        |
| 8  | 同业存单      | 19,860,731.09 | 20.56        |
| 9  | 其他        | -             | -            |
| 10 | 合计        | 60,082,569.87 | 62.21        |

### 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（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|---------------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 112318273 | 23 华夏银行 CD273 | 200,000 | 19,860,731.09 | 20.56        |
| 2  | 230023    | 23 付息国债 23    | 110,000 | 12,396,026.23 | 12.83        |
| 3  | 220402    | 22 农发 02      | 100,000 | 10,306,573.77 | 10.67        |
| 4  | 019727    | 23 国债 24      | 53,000  | 5,396,409.18  | 5.59         |
| 5  | 113052    | 兴业转债          | 33,430  | 3,617,716.75  | 3.75         |

### 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

本基金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

本基金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

本基金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

本基金采取套期保值的方式参与股指期货的投资交易，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。

## 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

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

### 7.11.2 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。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

报告期内基金投资的前十名证券除 22 农发 02（证券代码 220402）、23 华夏银行 CD273（证券代码 112318273）、浦发转债（证券代码 110059）、兴业转债（证券代码 113052）外其他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。

#### 1、22 农发 02（证券代码 220402）

根据发布的相关公告，该证券发行人在报告期内因未依法履行职责、未按期申报税款、违反税收管理规定等原因，多次受到监管机构的处罚。

#### 2、23 华夏银行 CD273（证券代码 112318273）

根据发布的相关公告，该证券发行人在报告期内因违规经营、内部制度不完善、违反反洗钱法等原因，多次受到监管机构的处罚。

#### 3、浦发转债（证券代码 110059）

根据发布的相关公告，该证券发行人在报告期内因违规经营、未依法履行职责、违反反洗钱法等原因，多次受到监管机构的处罚。

#### 4、兴业转债（证券代码 113052）

根据发布的相关公告，该证券发行人在报告期内因违规经营、未依法履行职责、涉嫌违反法律法规等原因，多次受到监管机构的处罚。

对上述证券的投资决策程序的说明：本基金投资上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

### 7.12.2

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。

### 7.12.3 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 | 32,107.34  |
| 2  | 应收清算款 | 815,794.23 |
| 3  | 应收股利  | -          |
| 4  | 应收利息  | -          |
| 5  | 应收申购款 | 2,245.29   |
| 6  | 其他应收款 | -          |
| 7  | 待摊费用  | -          |
| 8  | 其他    | -          |
| 9  | 合计    | 850,146.86 |

### 7.12.4 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  | 113052 | 兴业转债 | 3,617,716.75 | 3.75         |
| 2  | 110059 | 浦发转债 | 2,971,921.22 | 3.08         |
| 3  | 127022 | 恒逸转债 | 1,508,598.57 | 1.56         |
| 4  | 113056 | 重银转债 | 1,037,954.33 | 1.07         |
| 5  | 113055 | 成银转债 | 987,401.82   | 1.02         |
| 6  | 110064 | 建工转债 | 842,456.51   | 0.87         |
| 7  | 128134 | 鸿路转债 | 648,972.87   | 0.67         |

### 7.12.5 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。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数(户) | 户均持有的基 | 持有人结构 |
|----------|--------|-------|
|----------|--------|-------|



|       | 金份额       | 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 |
| 2,492 | 51,512.04 | 23,361,460.64 | 18.20% | 105,006,537.93 | 81.80% |

## 8.2 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 | 85,102.79 | 0.0663%  |

## 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                             | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研发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                 |

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                            |                |
|----------------------------|----------------|
| 基金合同生效日(2016年2月4日)基金份额总额   | 231,740,450.36 |
| 本报告期期初基金份额总额               | 138,056,106.63 |
| 本报告期基金总申购份额                | 946,522.04     |
| 减：本报告期基金总赎回份额              | 10,634,630.10  |
| 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               | 128,367,998.57 |

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末召开基金份额持有人大会。

### 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，本基金管理人未发生重大人事变动。

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。

### 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。

## 10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

## 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，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。

### 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，本基金托管人及其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   | 3      | 116,053,524.76 | 36.58%       | 86,565.03 | 33.02%     | -  |
| 广发证券   | 2      | 70,010,943.30  | 22.07%       | 66,223.83 | 25.26%     | -  |
| 长江证券   | 2      | 68,022,724.26  | 21.44%       | 50,737.57 | 19.36%     | -  |
| 西部证券   | 1      | 33,186,420.02  | 10.46%       | 31,391.05 | 11.98%     | -  |
| 中泰证券   | 2      | 24,376,137.09  | 7.68%        | 23,056.52 | 8.80%      | -  |
| 江海证券   | 2      | 5,578,083.77   | 1.76%        | 4,160.70  | 1.59%      | -  |
| 财通证券   | 2      | -              | -            | -         | -          | -  |
| 平安证券   | 2      | -              | -            | -         | -          | -  |
| 英大证券   | 1      | -              | -            | -         | -          | -  |
| 中信证券   | 1      | -              | -            | -         | -          | -  |
| 中银国际证券 | 2      | -              | -            | -         | -          | -  |

注：本报告期内，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。

### 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 |              |
|--------|---------------|--------------|----------------|----------------|------|--------------|
|        | 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   | 15,031,901.23 | 21.10%       | 17,570,000.00  | 6.32%          | -    | -            |
| 广发证券   | 22,131,995.73 | 31.06%       | 39,300,000.00  | 14.13%         | -    | -            |
| 长江证券   | 14,801,025.24 | 20.77%       | 213,291,000.00 | 76.71%         | -    | -            |
| 西部证券   | 16,622,659.41 | 23.33%       | 7,880,000.00   | 2.83%          | -    | -            |
| 中泰证券   | 2,661,815.70  | 3.74%        | -              | -              | -    | -            |
| 江海证券   | -             | -            | -              | -              | -    | -            |
| 财通证券   | -             | -            | -              | -              | -    | -            |
| 平安证券   | -             | -            | -              | -              | -    | -            |
| 英大证券   | -             | -            | -              | -              | -    | -            |
| 中信证券   | -             | -            | -              | -              | -    | -            |
| 中银国际证券 | -             | -            | -              | -              | -    | -            |

## 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  | 招商基金管理有限公司关于终止北京中期时代基金销售有限公司办理旗下基金销售业务的公告 | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2024-01-18 |
| 2  | 招商基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 4 季度报告提示性公告        | 证券时报及基金管理人网站               | 2024-01-19 |
| 3  | 招商康泰灵活配置混合型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告          | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2024-01-19 |
| 4  | 招商康泰灵活配置混合型证券投资基金更新的招募说明书（二零二四年第一号）       | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2024-02-02 |
| 5  | 招商康泰灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新               | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2024-02-02 |
| 6  | 招商基金管理有限公司旗下基金 2023 年年度报告提示性公告            | 证券时报及基金管理人网站               | 2024-03-29 |
| 7  | 招商康泰灵活配置混合型证券投资基金 2023 年年度报告              | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2024-03-29 |
| 8  | 招商康泰灵活配置混合型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告          | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会         | 2024-04-19 |

|    |                                    |                            |            |
|----|------------------------------------|----------------------------|------------|
|    |                                    | 基金电子披露网站                   |            |
| 9  | 招商基金管理有限公司旗下基金 2024 年第 1 季度报告提示性公告 | 证券时报及基金管理人网站               | 2024-04-19 |
| 10 | 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     | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2024-05-18 |
| 11 | 招商康泰灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新        | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2024-06-28 |

## § 11 备查文件目录

### 11.1 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康泰灵活配置混合型证券投资基金设立的文件；
- 3、《招商康泰灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 4、《招商康泰灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 5、《招商康泰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。

### 11.2 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

### 11.3 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.cmfchina.com>

招商基金管理有限公司

2024 年 8 月 30 日