

# 招商安益灵活配置混合型证券投资基金 2023 年中期报告

2023 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：2023 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 2023 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 2023 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.....	5
§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.....	11
6.2 利润表.....	12
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	13
6.4 报表附注.....	15
§7 投资组合报告.....	31
7.1 期末基金资产组合情况.....	31
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	31
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.....	32
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	37
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	39
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.....	39
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.....	39
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.....	39
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.....	40
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	40
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	40

7.12 投资组合报告附注.....	40
§8 基金份额持有人信息.....	41
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	41
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	41
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.....	41
§9 开放式基金份额变动.....	42
§10 重大事件揭示.....	42
10.1 基金份额持有人大会决议.....	42
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.....	42
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	42
10.4 基金投资策略的改变.....	42
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	42
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.....	43
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	43
10.8 其他重大事件.....	44
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	44
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	44
§12 备查文件目录.....	45
12.1 存放地点.....	45
12.2 查阅方式.....	45

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	招商安益灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	招商安益灵活配置混合
基金主代码	001531
交易代码	001531
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 7 月 17 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	101,812,301.56 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过将基金资产在不同投资资产类别之间灵活配置，在控制下行风险的前提下为投资人获取稳健回报。
投资策略	本基金在大类资产配置过程中，注重平衡投资的收益和风险水平，以实现基金份额净值的稳定增长。具体包括：1、资产配置策略；2、个股投资策略；3、债券（不含可转换公司债）投资策略；4、可转换公司债投资策略；5、中小企业私募债的投资策略；6、资产证券化产品投资策略；7、权证投资策略；8、股指期货投资策略；9、存托凭证投资策略。
业绩比较基准	中国人民银行公布金融机构人民币一年期存款基准利率+3%（单利年化）
风险收益特征	本基金是混合型基金，在证券投资基金中属于预期风险收益水平中等的投资品种，预期收益和预期风险高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	招商基金管理有限公司	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	021-60637103
	电子邮箱	wangxiaofei.zh@ccb.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	田国立
-------	-----	-----

## 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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.cmfcchina.com">http://www.cmfcchina.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(2023 年 1 月 1 日 - 2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	3,939,946.63
本期利润	2,999,530.73
加权平均基金份额本期利润	0.0606
本期加权平均净值利润率	4.20%
本期基金份额净值增长率	3.36%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	46,031,115.49
期末可供分配基金份额利润	0.4521
期末基金资产净值	147,843,417.05
期末基金份额净值	1.4521
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	29.19%

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

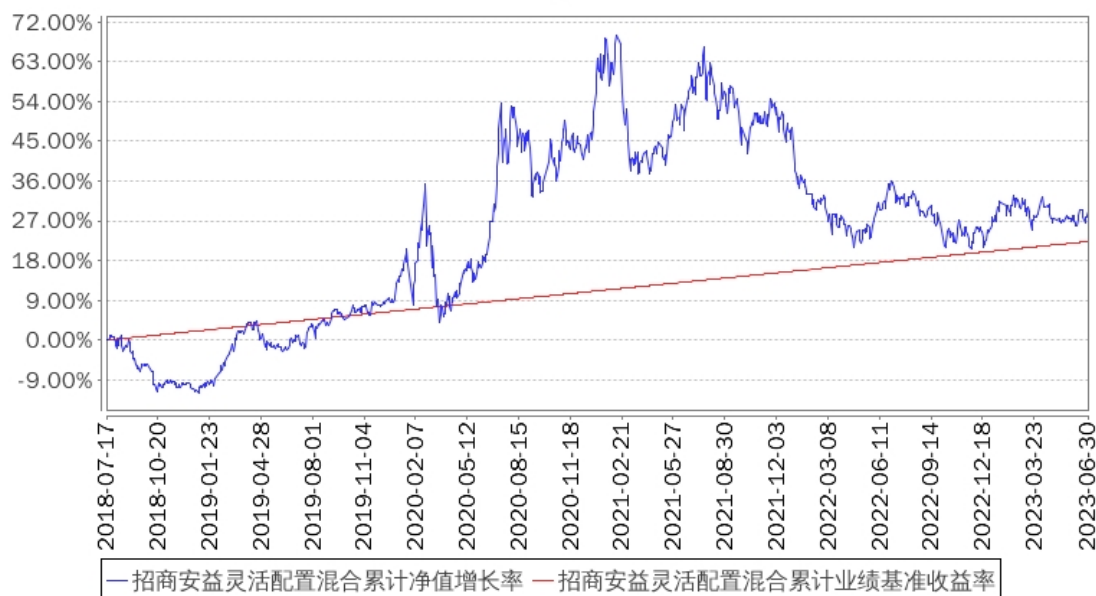
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

招商安益灵活配置混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.78%	0.70%	0.37%	0.01%	1.41%	0.69%
过去三个月	0.19%	0.59%	1.12%	0.01%	-0.93%	0.58%
过去六个月	3.36%	0.78%	2.23%	0.02%	1.13%	0.76%
过去一年	-4.49%	0.83%	4.50%	0.01%	-8.99%	0.82%
过去三年	-1.12%	1.23%	13.49%	0.01%	-14.61%	1.22%
自基金合同生效起至今	29.19%	1.20%	22.30%	0.01%	6.89%	1.19%

### 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

招商安益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



## § 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		
韩冰	本基金基金经理	2022 年 1 月 14 日	-	12	男，管理学硕士。2006 年 7 月加入上海文广新闻传媒集团任工程师，从事媒体资产管理的工作；2011 年 4 月加入平安大华基金管理有限公司，任研究员，从事 TMT 行业研究的工作；2013 年 6 月加入招商基金管理有限公司，曾任研究员、助理基金经理、招商移动互联网产业股票型证券投资基金基金经理，现任招商中小盘精选混合型证券投资基金、招商专精特新股票型证券投资基金、招商安益灵活配置混合型证券投资基金、招商北证 50 成份指数型发起式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 18 次,其中 14 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,4 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

报告期内,受经济复苏不达预期,人民币汇率走弱影响,A股和港股市场在本季度均出现了调整,沪深 300 下跌 0.75%,恒生指数下跌 4.37%。二季度继续降息 10BP,十年期国债利率走低至 2.6%,CPI,PPI 仍在探底,PMI 低位徘徊,经济复苏或需要更有力的刺激政策。

上半年 AIGC 主题的通信、传媒和计算机行业仍然涨幅居前,而受益于成本下降需求恢复的家电行业、机械行业也表现较佳。而消费者服务行业在管控放开利好兑现后,出现较大幅度调整。房地产行业由于销售数据屡低于预期表现也较为落后。

报告期内本基金录得 3.36%的涨幅,主要得益于对 TMT 行业的配置和对消费行业的减仓,并在市场炒作 AI 情绪较为狂热的时候逢高了结,适当减仓;而医药持仓出现了一定调整,部分拖累了业绩表现。

#### 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 3.36%，同期业绩基准增长率为 2.23%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，本人认为沪深 300 本轮调整基本结束，但往后是震荡还是反弹仍存在不确定性。因为本轮调整以来，外资持续流出但内资仓位维持高位，而目前无论是货币政策还是财政政策，难以启动一轮新周期，所以市场或会继续较为逼仄的空间中腾挪，以时间换取空间。此外，TMT 行业在 4 月和 6 月两次出现了当日交易占比超过 45% 的情形，且部分公司已积累巨大涨幅，应该注意该类行业交易拥挤和估值过高的风险。

政治局会议中明确确定目前的困难是“需求不足”，提振国内需求或将会成为下一阶段政策的主要侧重方向。下半年对内需驱动的行业应提高重视，包括房地产产业链，可选和必选消费品等。

#### 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。

#### 4.7 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。

#### 4.8 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：招商安益灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	13,462,858.73	8,353,362.51
结算备付金		1,880,875.40	635,570.26
存出保证金		24,551.36	9,810.80
交易性金融资产	6.4.7.2	109,145,979.26	46,204,594.10
其中：股票投资		99,223,621.53	46,204,594.10
基金投资		-	-
债券投资		9,922,357.73	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产	6.4.7.3	-7,145.87	4,963,000.00
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		23,765,148.14	369,217.33
应收股利		-	-
应收申购款		13,334.52	309.55
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		148,285,601.54	60,535,864.55
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 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		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	4,753,368.18
应付赎回款		10,998.39	433,912.76
应付管理人报酬		152,800.30	70,301.75
应付托管费		25,466.72	11,716.93
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.4	252,919.08	150,621.77
负债合计		442,184.49	5,419,921.39
净资产：			
实收基金	6.4.7.5	101,812,301.56	39,232,480.74
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.6	46,031,115.49	15,883,462.42
净资产合计		147,843,417.05	55,115,943.16
负债和净资产总计		148,285,601.54	60,535,864.55

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.4521 元，基金份额总额 101,812,301.56 份。

## 6.2 利润表

会计主体：招商安益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 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		3,685,953.09	-1,600,506.49
1.利息收入		102,253.72	107,562.63
其中：存款利息收入	6.4.7.7	30,607.74	26,131.33
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		71,645.98	81,431.30
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-” 填列）		4,515,082.69	-6,884,593.91
其中：股票投资收益	6.4.7.8	3,995,175.35	-7,238,953.99
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.9	1,182.58	31,586.23
资产支持证券投资 收益	6.4.7.10	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益	6.4.7.11	518,724.76	322,773.85
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）	6.4.7.12	-940,415.90	5,175,796.62
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.13	9,032.58	728.17
减：二、营业总支出		686,422.36	491,104.63
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	528,251.82	345,013.11
2.托管费	6.4.10.2.2	88,042.01	57,502.16
3.销售服务费		-	-
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.信用减值损失	6.4.7.14	-	-
7.税金及附加		-	-
8.其他费用	6.4.7.15	70,128.53	88,589.36
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,999,530.73	-2,091,611.12
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,999,530.73	-2,091,611.12
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		2,999,530.73	-2,091,611.12

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：招商安益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 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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（基金净值）	39,232,480.74	-	15,883,462.42	55,115,943.16
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	39,232,480.74	-	15,883,462.42	55,115,943.16

三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	62,579,820.82	-	30,147,653.07	92,727,473.89
（一）、综合收益总额	-	-	2,999,530.73	2,999,530.73
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	62,579,820.82	-	27,148,122.34	89,727,943.16
其中：1.基金申购款	71,579,186.40	-	31,251,592.70	102,830,779.10
2.基金赎回款	-8,999,365.58	-	-4,103,470.36	-13,102,835.94
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	101,812,301.56	-	46,031,115.49	147,843,417.05
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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（基金净值）	26,460,082.81	-	17,578,391.58	44,038,474.39
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	26,460,082.81	-	17,578,391.58	44,038,474.39
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	14,609,105.00	-	3,791,126.57	18,400,231.57
（一）、综合收益总额	-	-	-2,091,611.12	-2,091,611.12
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	14,609,105.00	-	5,882,737.69	20,491,842.69
其中：1.基金申购款	15,960,905.32	-	6,516,148.41	22,477,053.73
2.基金赎回款	-1,351,800.32	-	-633,410.72	-1,985,211.04
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	41,069,187.81	-	21,369,518.15	62,438,705.96

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

招商安益灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)系由招商安益保本混合型证券投资基金转型而来。根据原《招商安益保本混合型证券投资基金基金合同》的约定,2018年7月16日,本基金的第一个保本周期到期后,未能符合保本基金存续条件,自2018年7月17日起本基金转型为招商安益灵活配置混合型证券投资基金,同时,基金的投资目标、投资范围、投资策略以及基金费率等相关内容根据《招商安益保本混合型证券投资基金基金合同》的相关约定作相应修改。自2018年7月17日起,原基金合同失效,《招商安益灵活配置混合型证券投资基金合同》于同一日生效。本基金为契约型开放式基金,存续期不定。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”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《招商安益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和截至报告期末最新公告的《招商安益灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》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A股股票和存托凭证(包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票和存托凭证)、债券(含中小企业私募债、地方政府债券等)、资产支持证券、货币市场工具、权证、股指期货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。本基金投资于股票、存托凭证的比例为基金资产的0%-95%,投资于权证的比例为基金资产净值的0%-3%,本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或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。股指期货的投资比例遵循国家相关法律法规。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。本基金的业绩比较基准为:中国人民银行公布金融机构人民币一年期存款基准利率+3%(单利年化)。

### 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”)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 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

### 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

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85 号文《财政部、国家税务总局、证监会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《财政部、国家税务总局、证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《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[2008]1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号文《财政部、国家税务总局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]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号文《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 号文《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》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a) 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(b) 自 2016 年 5 月 1 日起,在全国范围内全面推开营业税改征增值税(以下称营改增)试点,建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人,纳入试点范围,由缴纳营业税改为缴纳增值税。

2018 年 1 月 1 日(含)以后,资管产品管理人(以下称管理人)运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,以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。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日以前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税;对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税;同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(c) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价,暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得,由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起,对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额: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,暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入个人所得税应纳税所得额。

(e) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

(f) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入,暂不征收企业所得税,对基金在 2018 年 1 月 1 日(含)以后运营过程中缴纳的增值税,分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率,计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	13,462,858.73
等于: 本金	13,459,037.92
加: 应计利息	3,820.81
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	13,462,858.73

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	98,341,243.96	-	99,223,621.53	882,377.57	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	9,917,622.00	3,547.73	9,922,357.73	1,188.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	9,917,622.00	3,547.73	9,922,357.73	1,188.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	108,258,865.96	3,547.73	109,145,979.26	883,565.57	

#### 6.4.7.3 买入返售金融资产

##### 6.4.7.3.1 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 2023 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-7,145.87	-
银行间市场	-	-
合计	-7,145.87	-

#### 6.4.7.4 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1.66
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	183,410.05

其中：交易所市场	183,410.05
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	69,507.37
合计	252,919.08

#### 6.4.7.5 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 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	39,232,480.74	39,232,480.74
本期申购	71,579,186.40	71,579,186.40
本期赎回（以“-”号填列）	-8,999,365.58	-8,999,365.58
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	101,812,301.56	101,812,301.56

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。

#### 6.4.7.6 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	15,671,256.25	212,206.17	15,883,462.42
本期利润	3,939,946.63	-940,415.90	2,999,530.73
本期基金份额交易产生的变动数	29,601,315.36	-2,453,193.02	27,148,122.34
其中：基金申购款	33,793,331.91	-2,541,739.21	31,251,592.70
基金赎回款	-4,192,016.55	88,546.19	-4,103,470.36
本期已分配利润	-	-	-
本期末	49,212,518.24	-3,181,402.75	46,031,115.49

#### 6.4.7.7 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 6 月 30 日
活期存款利息收入	26,368.40
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	4,120.48
其他	118.86
合计	30,607.74

#### 6.4.7.8 股票投资收益

##### 6.4.7.8.1 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 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	3,995,175.35
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	3,995,175.35

#### 6.4.7.8.2 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 6 月 30 日
卖出股票成交总额	115,791,618.06
减：卖出股票成本总额	111,421,180.17
减：交易费用	375,262.54
买卖股票差价收入	3,995,175.35

#### 6.4.7.9 债券投资收益

##### 6.4.7.9.1 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 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	1,182.58
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	1,182.58

##### 6.4.7.10 资产支持证券投资收益

###### 6.4.7.10.1 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。

###### 6.4.7.10.2 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。

###### 6.4.7.10.3 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。

###### 6.4.7.10.4 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。

##### 6.4.7.11 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	518,724.76
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	518,724.76

#### 6.4.7.12 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 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-940,415.90
——股票投资	-941,603.90
——债券投资	1,188.00
——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	-940,415.90

#### 6.4.7.13 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	9,032.58
合计	9,032.58

#### 6.4.7.14 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

#### 6.4.7.15 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	10,000.00
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	621.16
合计	70,128.53

#### 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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	108,597,368.50	38.66%	23,526,462.68	22.16%

##### 6.4.10.1.2 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 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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	9,917,622.00	100.00%	-	-

##### 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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	203,437,000.00	24.00%	59,400,000.00	10.13%

##### 6.4.10.1.4 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 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	79,418.42	33.46%	55,853.48	30.45%
关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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	17,205.17	19.89%	109.20	0.28%

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。

### 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	528,251.82	345,013.11
其中：支付销售机构的客户维护费	148,664.29	136,214.93
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×1.50%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：

$$\text{日基金管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	88,042.01	57,502.16

注：支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值×0.25%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：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

### 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

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。

##### 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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	13,462,858.73	26,368.40	19,294,571.02	20,629.80

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

单位：人民币元

本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 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 6 月 30 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
-	-	-	-	-	-

				股/张)	
招商证券	001323	慕思股份	网下申购	573	22,306.89

注：本表已包含托管人的关联方承销期内承销的证券。

#### 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（2023 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 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.2.1 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。

###### 6.4.12.2.2 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。

##### 6.4.12.3 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。

### **6.4.13.3 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开放式基金每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。本基金所持有的交易性金融资产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。本基金所持有的全部金融负债无固定到期日或合同约定到期日均为一个月以内且不计息，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 2023 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	13,462,858.73	-	-	-	13,462,858.73
结算备付金	1,880,875.40	-	-	-	1,880,875.40
存出保证金	24,551.36	-	-	-	24,551.36
交易性金融资产	9,922,357.73	-	-	99,223,621.53	109,145,979.26
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-7,145.87	-	-	-	-7,145.87
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	13,334.52	13,334.52
应收清算款	-	-	-	23,765,148.14	23,765,148.14
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	25,283,497.35	-	-	123,002,104.19	148,285,601.54
负债					
应付赎回款	-	-	-	10,998.39	10,998.39
应付管理人报酬	-	-	-	152,800.30	152,800.30
应付托管费	-	-	-	25,466.72	25,466.72
应付清算款	-	-	-	-	-
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	-	-	-	252,919.08	252,919.08
负债总计	-	-	-	442,184.49	442,184.49
利率敏感度缺口	25,283,497.35	-	-	122,559,919.70	147,843,417.05
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					
银行存款	8,353,362.51	-	-	-	8,353,362.51

结算备付金	635,570.26	-	-	-	635,570.26
存出保证金	9,810.80	-	-	-	9,810.80
交易性金融资产	-	-	-	46,204,594.10	46,204,594.10
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	4,963,000.00	-	-	-	4,963,000.00
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	309.55	309.55
应收清算款	-	-	-	369,217.33	369,217.33
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	13,961,743.57	-	-	46,574,120.98	60,535,864.55
负债					
应付赎回款	-	-	-	433,912.76	433,912.76
应付管理人报酬	-	-	-	70,301.75	70,301.75
应付托管费	-	-	-	11,716.93	11,716.93
应付清算款	-	-	-	4,753,368.18	4,753,368.18
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	-	-	-	150,621.77	150,621.77
负债总计	-	-	-	5,419,921.39	5,419,921.39
利率敏感度缺口	13,961,743.57	-	-	41,154,199.59	55,115,943.16

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（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	1. 市场利率平行上升 50 个基点	-47,867.69	-
2. 市场利率平行下降 50 个基点	48,101.36	-	

#### 6.4.13.4.2 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 2023 年 6 月 30 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	99,223,621.53	67.11	46,204,594.10	83.83
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	99,223,621.53	67.11	46,204,594.10	83.83

#### 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（2023 年 6 月 30 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%	4,961,181.08	2,310,229.71
	2. 权益性投资的市场价格下降 5%	-4,961,181.08	-2,310,229.71

### 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 2023 年 6 月 30 日
第一层次	99,223,621.53
第二层次	9,922,357.73
第三层次	-
合计	109,145,979.26

#### 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（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	99,223,621.53	66.91
	其中：股票	99,223,621.53	66.91
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	9,922,357.73	6.69
	其中：债券	9,922,357.73	6.69
	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	-7,145.87	0.00

	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	15,343,734.13	10.35
8	其他资产	23,803,034.02	16.05
9	合计	148,285,601.54	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	411,160.00	0.28
B	采矿业	262,750.00	0.18
C	制造业	78,307,088.26	52.97
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,304,942.00	0.88
E	建筑业	2,042,228.00	1.38
F	批发和零售业	826,290.00	0.56
G	交通运输、仓储和邮政业	3,167,503.80	2.14
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,637,570.64	3.81
J	金融业	2,108,088.00	1.43
K	房地产业	901,588.00	0.61
L	租赁和商务服务业	276,325.00	0.19
M	科学研究和技术服务业	873,448.83	0.59
N	水利、环境和公共设施管理业	1,835,135.00	1.24
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	1,269,504.00	0.86
	合计	99,223,621.53	67.11

### 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	605589	圣泉集团	174,700	3,797,978.00	2.57



2	603517	绝味食品	94,500	3,510,675.00	2.37
3	002402	和而泰	182,400	3,097,152.00	2.09
4	600183	生益科技	211,700	3,006,140.00	2.03
5	603707	健友股份	218,700	2,952,450.00	2.00
6	601702	华峰铝业	189,200	2,588,256.00	1.75
7	002415	海康威视	69,700	2,307,767.00	1.56
8	002410	广联达	59,120	1,920,808.80	1.30
9	600315	上海家化	62,700	1,818,927.00	1.23
10	603588	高能环境	150,800	1,412,996.00	0.96
11	603811	诚意药业	113,160	1,406,578.80	0.95
12	600426	华鲁恒升	44,300	1,356,909.00	0.92
13	002675	东诚药业	91,600	1,347,436.00	0.91
14	600603	广汇物流	182,400	1,269,504.00	0.86
15	002922	伊戈尔	86,500	1,241,275.00	0.84
16	000768	中航西飞	44,900	1,201,075.00	0.81
17	300196	长海股份	80,600	1,116,310.00	0.76
18	002643	万润股份	61,800	1,075,938.00	0.73
19	000651	格力电器	27,000	985,770.00	0.67
20	002271	东方雨虹	35,700	973,182.00	0.66
21	002773	康弘药业	49,900	954,088.00	0.65
22	603338	浙江鼎力	16,900	946,569.00	0.64
23	002255	海陆重工	154,900	938,694.00	0.63
24	603987	康德莱	72,600	937,992.00	0.63
25	688085	三友医疗	33,671	884,200.46	0.60
26	688029	南微医学	9,841	802,631.96	0.54
27	300347	泰格医药	12,000	774,480.00	0.52
28	600298	安琪酵母	20,800	753,168.00	0.51
29	605166	聚合顺	80,800	753,056.00	0.51
30	601089	福元医药	45,800	746,540.00	0.50
31	600887	伊利股份	26,200	741,984.00	0.50
32	600351	亚宝药业	103,800	736,980.00	0.50
33	601601	中国太保	28,100	730,038.00	0.49
34	002424	贵州百灵	79,500	713,910.00	0.48
35	688283	坤恒顺维	10,615	706,109.80	0.48
36	603337	杰克股份	37,000	704,480.00	0.48
37	603713	密尔克卫	7,900	703,811.00	0.48
38	301227	森鹰窗业	24,900	690,477.00	0.47
39	603209	兴通股份	32,480	688,900.80	0.47
40	600180	瑞茂通	114,700	685,906.00	0.46
41	601058	赛轮轮胎	60,200	685,678.00	0.46
42	688658	悦康药业	32,781	682,172.61	0.46
43	600905	三峡能源	126,600	679,842.00	0.46
44	600062	华润双鹤	38,800	675,896.00	0.46

45	002601	龙佰集团	40,800	673,200.00	0.46
46	601117	中国化学	80,600	667,368.00	0.45
47	603520	司太立	39,800	663,864.00	0.45
48	301296	新巨丰	37,700	636,376.00	0.43
49	300320	海达股份	80,900	633,447.00	0.43
50	300957	贝泰妮	7,100	631,048.00	0.43
51	603538	美诺华	34,000	626,280.00	0.42
52	603181	皇马科技	55,800	621,612.00	0.42
53	601916	浙商银行	234,400	618,816.00	0.42
54	688212	澳华内镜	9,061	615,241.90	0.42
55	688114	华大智造	6,930	599,860.80	0.41
56	601668	中国建筑	103,200	592,368.00	0.40
57	300986	志特新材	21,000	588,000.00	0.40
58	002001	新 和 成	38,100	586,740.00	0.40
59	688019	安集科技	3,353	552,674.99	0.37
60	603187	海容冷链	27,580	551,324.20	0.37
61	300653	正海生物	15,800	543,362.00	0.37
62	301195	北路智控	11,550	537,768.00	0.36
63	601177	杭齿前进	43,800	534,360.00	0.36
64	688356	键凯科技	5,013	534,135.15	0.36
65	688227	品高股份	21,386	531,014.38	0.36
66	603173	福斯达	18,000	530,100.00	0.36
67	605305	中际联合	15,100	526,386.00	0.36
68	600216	浙江医药	47,900	524,505.00	0.35
69	002352	顺丰控股	11,600	523,044.00	0.35
70	300841	康华生物	7,800	513,942.00	0.35
71	688107	安路科技	9,005	498,786.95	0.34
72	600461	洪城环境	59,600	486,932.00	0.33
73	603456	九洲药业	16,900	462,722.00	0.31
74	601669	中国电建	80,400	461,496.00	0.31
75	001238	浙江正特	19,600	461,188.00	0.31
76	688018	乐鑫科技	3,543	459,952.26	0.31
77	600309	万华化学	5,200	456,768.00	0.31
78	300638	广和通	19,880	450,878.40	0.30
79	601339	百隆东方	80,400	450,240.00	0.30
80	603583	捷昌驱动	20,900	450,186.00	0.30
81	000002	万 科 A	31,000	434,620.00	0.29
82	603112	华翔股份	35,900	422,184.00	0.29
83	600323	瀚蓝环境	22,300	422,139.00	0.29
84	603217	元利科技	16,300	419,725.00	0.28
85	603125	常青科技	14,500	412,525.00	0.28
86	300511	雪榕生物	54,100	411,160.00	0.28
87	002507	涪陵榨菜	22,450	411,059.50	0.28

88	688296	和达科技	22,594	403,302.90	0.27
89	002092	中泰化学	62,000	399,900.00	0.27
90	002463	沪电股份	19,000	397,860.00	0.27
91	603057	紫燕食品	15,700	394,541.00	0.27
92	688588	凌志软件	24,746	384,800.30	0.26
93	603589	口子窖	7,700	379,995.00	0.26
94	002129	TCL 中环	11,300	375,160.00	0.25
95	688531	日联科技	2,465	366,077.15	0.25
96	300138	晨光生物	20,000	358,000.00	0.24
97	603885	吉祥航空	23,200	357,976.00	0.24
98	603956	威派格	44,000	351,560.00	0.24
99	000683	远兴能源	47,600	342,244.00	0.23
100	000069	华侨城 A	77,700	341,880.00	0.23
101	688059	华锐精密	3,980	333,325.00	0.23
102	300699	光威复材	10,600	327,010.00	0.22
103	002649	博彦科技	21,500	303,795.00	0.21
104	603816	顾家家居	7,900	301,385.00	0.20
105	603733	仙鹤股份	14,400	300,240.00	0.20
106	600059	古越龙山	28,200	292,716.00	0.20
107	002938	鹏鼎控股	12,000	291,480.00	0.20
108	688439	振华风光	2,623	288,057.86	0.19
109	688363	华熙生物	3,110	277,287.60	0.19
110	601888	中国中免	2,500	276,325.00	0.19
111	605020	永和股份	10,600	273,586.00	0.19
112	603308	应流股份	14,900	272,670.00	0.18
113	301322	绿通科技	4,800	269,520.00	0.18
114	000860	顺鑫农业	7,900	266,151.00	0.18
115	601233	桐昆股份	20,000	265,000.00	0.18
116	002153	石基信息	18,920	264,880.00	0.18
117	601168	西部矿业	25,000	262,750.00	0.18
118	605007	五洲特纸	17,000	257,720.00	0.17
119	601318	中国平安	5,500	255,200.00	0.17
120	000776	广发证券	17,200	253,012.00	0.17
121	601868	中国能建	107,700	252,018.00	0.17
122	601988	中国银行	64,200	251,022.00	0.17
123	603056	德邦股份	16,200	249,804.00	0.17
124	605377	华旺科技	13,800	249,090.00	0.17
125	001205	盛航股份	11,600	246,152.00	0.17
126	600380	健康元	19,200	244,032.00	0.17
127	002123	梦网科技	17,500	232,575.00	0.16
128	001322	箭牌家居	13,800	231,012.00	0.16
129	300747	锐科激光	7,300	222,504.00	0.15
130	688269	凯立新材	3,474	221,606.46	0.15

131	688123	聚辰股份	4,116	221,111.52	0.15
132	600570	恒生电子	4,800	212,592.00	0.14
133	688190	云路股份	2,858	208,634.00	0.14
134	600409	三友化工	37,700	205,465.00	0.14
135	603666	亿嘉和	4,500	203,175.00	0.14
136	688295	中复神鹰	5,493	201,483.24	0.14
137	603565	中谷物流	18,500	199,800.00	0.14
138	603297	永新光学	2,500	199,750.00	0.14
139	600233	圆通速递	13,600	198,016.00	0.13
140	002841	视源股份	2,900	193,836.00	0.13
141	688503	聚和材料	1,912	186,420.00	0.13
142	600872	中炬高新	5,000	183,950.00	0.12
143	600741	华域汽车	9,900	182,754.00	0.12
144	300973	立高食品	2,600	177,892.00	0.12
145	601208	东材科技	14,000	177,800.00	0.12
146	003029	吉大正元	5,300	171,985.00	0.12
147	688308	欧科亿	4,288	171,520.00	0.12
148	688049	炬芯科技	4,331	159,380.80	0.11
149	002572	索菲亚	9,000	156,780.00	0.11
150	002185	华天科技	16,800	154,560.00	0.10
151	002986	宇新股份	5,300	146,174.00	0.10
152	002156	通富微电	6,400	144,640.00	0.10
153	688157	松井股份	2,703	142,177.80	0.10
154	301266	宇邦新材	2,000	140,620.00	0.10
155	600710	苏美达	16,400	140,384.00	0.09
156	000883	湖北能源	30,300	138,168.00	0.09
157	000661	长春高新	1,000	136,300.00	0.09
158	300870	欧陆通	2,200	131,846.00	0.09
159	603113	金能科技	16,100	130,249.00	0.09
160	300726	宏达电子	2,900	129,688.00	0.09
161	001979	招商蛇口	9,600	125,088.00	0.08
162	000503	国新健康	10,300	123,497.00	0.08
163	002648	卫星化学	7,300	109,208.00	0.07
164	002138	顺络电子	4,200	100,422.00	0.07
165	688576	西山科技	724	96,335.44	0.07
166	300454	深信服	800	90,600.00	0.06
167	002508	老板电器	3,200	80,928.00	0.05
168	002139	拓邦股份	6,000	78,300.00	0.05
169	603055	台华新材	6,700	74,437.00	0.05
170	002020	京新药业	5,800	74,356.00	0.05
171	688381	帝奥微	2,299	74,211.72	0.05
172	688293	奥浦迈	1,549	73,840.83	0.05
173	600566	济川药业	2,500	72,600.00	0.05

174	300007	汉威科技	3,400	71,910.00	0.05
175	301373	凌玮科技	2,200	71,258.00	0.05
176	601390	中国中铁	9,100	68,978.00	0.05
177	688110	东芯股份	1,909	68,914.90	0.05
178	688033	天宜上佳	3,576	68,373.12	0.05
179	300408	三环集团	2,100	61,635.00	0.04
180	688628	优利德	834	40,524.06	0.03
181	688581	安杰思	243	29,765.07	0.02
182	603806	福斯特	800	29,752.00	0.02
183	301080	百普赛斯	400	25,128.00	0.02
184	300820	英杰电气	300	24,714.00	0.02
185	301029	怡合达	500	22,340.00	0.02

## 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	603517	绝味食品	3,581,536.00	6.50
2	605589	圣泉集团	3,461,674.00	6.28
3	600183	生益科技	3,164,654.00	5.74
4	603707	健友股份	2,990,247.20	5.43
5	002402	和而泰	2,933,472.00	5.32
6	601702	华峰铝业	2,580,298.00	4.68
7	002415	海康威视	2,412,337.00	4.38
8	002410	广联达	2,083,320.00	3.78
9	600426	华鲁恒升	1,851,669.00	3.36
10	600315	上海家化	1,828,978.00	3.32
11	002439	启明星辰	1,812,139.00	3.29
12	688059	华锐精密	1,645,757.42	2.99
13	000768	中航西飞	1,477,482.00	2.68
14	002922	伊戈尔	1,426,433.72	2.59
15	601138	工业富联	1,404,958.00	2.55
16	300653	正海生物	1,401,338.00	2.54
17	000858	五粮液	1,399,486.86	2.54
18	603588	高能环境	1,396,202.28	2.53
19	002675	东诚药业	1,378,609.00	2.50
20	300525	博思软件	1,360,604.50	2.47
21	603369	今世缘	1,351,364.00	2.45
22	603811	诚意药业	1,346,446.00	2.44
23	002271	东方雨虹	1,304,360.00	2.37
24	300101	振芯科技	1,284,737.00	2.33

25	600603	广汇物流	1,269,065.00	2.30
26	688107	安路科技	1,231,855.77	2.24
27	002179	中航光电	1,218,948.00	2.21
28	600298	安琪酵母	1,218,001.00	2.21
29	600050	中国联通	1,143,975.00	2.08
30	300196	长海股份	1,111,804.00	2.02

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	600132	重庆啤酒	4,096,357.00	7.43
2	600809	山西汾酒	4,093,018.00	7.43
3	002179	中航光电	3,872,257.16	7.03
4	601888	中国中免	2,930,066.00	5.32
5	688777	中控技术	2,795,986.48	5.07
6	300347	泰格医药	2,783,257.00	5.05
7	000568	泸州老窖	2,645,863.00	4.80
8	600378	昊华科技	2,356,616.00	4.28
9	688677	海泰新光	2,326,157.63	4.22
10	688244	永信至诚	2,305,878.34	4.18
11	300101	振芯科技	1,954,091.00	3.55
12	002371	北方华创	1,898,253.00	3.44
13	000576	甘化科工	1,894,681.00	3.44
14	601138	工业富联	1,848,192.38	3.35
15	002439	启明星辰	1,792,952.39	3.25
16	601988	中国银行	1,533,120.00	2.78
17	600872	中炬高新	1,531,803.00	2.78
18	600050	中国联通	1,491,732.00	2.71
19	002517	恺英网络	1,475,805.00	2.68
20	600426	华鲁恒升	1,467,471.00	2.66
21	688175	高凌信息	1,412,454.01	2.56
22	300253	卫宁健康	1,343,555.00	2.44
23	688107	安路科技	1,303,359.84	2.36
24	603369	今世缘	1,297,454.00	2.35
25	000858	五粮液	1,288,513.00	2.34
26	000799	酒鬼酒	1,241,754.00	2.25
27	688059	华锐精密	1,164,326.96	2.11

28	300525	博思软件	1,157,172.00	2.10
29	688311	盟升电子	1,149,211.34	2.09
30	300672	国科微	1,141,945.00	2.07
31	301117	佳缘科技	1,124,892.70	2.04
32	600197	伊力特	1,106,959.00	2.01

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	165,381,811.50
卖出股票收入（成交）总额	115,791,618.06

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	9,922,357.73	6.71
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	9,922,357.73	6.71

### 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	019678	22 国债 13	99,000	9,922,357.73	6.71

### 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,以管理市场风险和调节股票仓位为主要目的。

### 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广联达(证券代码 002410)、和而泰(证券代码 002402)、绝味食品(证券代码 603517)、上海家化(证券代码 600315)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、广联达(证券代码 002410)

根据 2022 年 7 月 8 日发布的相关公告,该证券发行人因违规经营被北京市公安局海淀分局给予警告。

##### 2、和而泰(证券代码 002402)



根据 2023 年 1 月 31 日发布的相关公告,该证券发行人因欠税被国家税务总局佛山市顺德区税务局大良税务分局责令改正。

### 3、绝味食品（证券代码 603517）

根据 2023 年 4 月 28 日发布的相关公告,该证券发行人因未及时披露公司重大事件,资金占用被湖南证监局给予警示。

### 4、上海家化（证券代码 600315）

根据 2022 年 11 月 18 日发布的相关公告,该证券发行人因未依法履行职责被国家税务总局上海市青浦区税务局第二十税务所责令改正。

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	24,551.36
2	应收清算款	23,765,148.14
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	13,334.52
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	23,803,034.02

## 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

## 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
835	121,930.90	74,928,300.80	73.59%	26,884,000.76	26.41%

## 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	1,670,964.77	1.6412%

## 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

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	招商安益灵活配置混合 A
基金合同生效日(2018年7月17日)基金份额总额	699,324,273.74
本报告期期初基金份额总额	39,232,480.74
本报告期基金总申购份额	71,579,186.40
减：报告期基金总赎回份额	8,999,365.58
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	101,812,301.56

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 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。

### 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

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，钟文岳先生离任公司常务副总经理、财务负责人职务。

报告期内基金托管人未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期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。

### 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	2	108,597,368.50	38.66%	79,418.42	33.46%	-
西部证券	1	69,045,670.40	24.58%	64,302.67	27.09%	-
中泰证券	2	60,268,809.86	21.46%	56,128.53	23.65%	-
广发证券	2	30,372,962.78	10.81%	28,286.65	11.92%	-
江海证券	2	9,156,232.73	3.26%	6,695.92	2.82%	-
长江证券	2	3,460,435.49	1.23%	2,530.66	1.07%	-
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：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	9,917,622.00	100.00%	203,437,000.00	24.00%	-	-
西部证券	-	-	451,889,000.00	53.31%	-	-
中泰证券	-	-	10,954,000.00	1.29%	-	-
广发证券	-	-	124,659,000.00	14.71%	-	-
江海证券	-	-	1,723,000.00	0.20%	-	-
长江证券	-	-	55,015,000.00	6.49%	-	-
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	招商安益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
2	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
3	招商安益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
4	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
5	招商安益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

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20230629-20230630	-	24,042,275.38	-	24,042,275.38	23.61%

#### 产品特有风险

本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况，可能会出现集中赎回甚至巨额赎回从而引发基金净值剧烈波动，甚至引发基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。

注：报告期末持有份额占比按照四舍五入方法保留至小数点后第 2 位。

## § 12 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益灵活配置混合型证券投资基金设立的文件；
- 3、《招商安益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 4、《招商安益灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 5、《招商安益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。

### 12.1 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

## 12.2 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

2023 年 8 月 30 日