

招商瑞利灵活配置混合型证券投资基金 （LOF）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..... | 5 |
| 2.4 信息披露方式..... | 6 |
| 2.5 其他相关资料..... | 6 |
| §3 主要财务指标和基金净值表现..... | 6 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 6 |
| 3.2 基金净值表现..... | 7 |
| §4 管理人报告..... | 9 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况..... | 9 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明..... | 10 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 11 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明..... | 11 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 12 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 12 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 13 |
| 4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明..... | 13 |
| §5 托管人报告..... | 13 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... | 13 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明..... | 13 |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见..... | 14 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计）..... | 14 |
| 6.1 资产负债表..... | 14 |
| 6.2 利润表..... | 15 |
| 6.3 净资产（基金净值）变动表..... | 17 |
| 6.4 报表附注..... | 18 |
| §7 投资组合报告..... | 45 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 45 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合..... | 46 |
| 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..... | 47 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 50 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 53 |
| 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..... | 54 |
| 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..... | 54 |
| 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..... | 54 |
| 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..... | 54 |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策..... | 54 |

| | |
|---------------------------------------|----|
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 54 |
| 7.12 投资组合报告附注..... | 55 |
| §8 基金份额持有人信息..... | 56 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 56 |
| 8.2 期末上市基金前十名持有人..... | 56 |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 57 |
| 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况..... | 57 |
| §9 开放式基金份额变动..... | 57 |
| §10 重大事件揭示..... | 58 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 58 |
| 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..... | 58 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 58 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 58 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 58 |
| 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..... | 58 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 59 |
| 10.8 其他重大事件..... | 60 |
| §11 备查文件目录..... | 61 |
| 11.1 存放地点..... | 61 |
| 11.2 查阅方式..... | 62 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|------------------------|------------------|
| 基金名称 | 招商瑞利灵活配置混合型证券投资基金（LOF） | |
| 基金简称 | 招商瑞利灵活配置混合（LOF） | |
| 场内简称 | 招商瑞利 LOF | |
| 基金主代码 | 161729 | |
| 交易代码 | 161729 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2019 年 7 月 18 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 | 1,676,811,447.13 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 基金份额上市的证券交易所 | 深圳证券交易所 | |
| 上市日期 | 2020 年 1 月 15 日 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 招商瑞利灵活配置混合（LOF）A | 招商瑞利灵活配置混合（LOF）C |
| 下属分级基金的场内简称 | 招商瑞利 LOF | - |
| 下属分级基金的交易代码 | 161729 | 018007 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 1,341,513,878.75 份 | 335,297,568.38 份 |

注：本基金从 2023 年 2 月 24 日起新增 C 类份额，C 类份额自 2023 年 2 月 27 日起存续。

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 | <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金的资产配置将根据宏观经济形势、货币政策运行情况、资本市场的环境，在股票资产和其他类资产间进行相对灵活的配置。具体而言，我们将根据股票市场估值水平和上市公司盈利能力变化趋势来决定股票资产的配置比例。</p> <p>2、股票投资策略：（1）A 股投资策略；（2）港股投资策略。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>本基金采用的债券投资策略包括：久期策略、收益率曲线策略、个券选择策略和信用策略等，对于可转换债券等特殊品种，将根据其特点采取相应的投资策略。</p> <p>4、资产支持证券投资策略</p> <p>在控制风险的前提下，本基金对资产支持证券从五个方面综合定价，选择低估的品种进行投资。五个方面包括信用因素、流动性因素、利率因</p> |

| | |
|--------|---|
| | <p>素、税收因素和提前还款因素。</p> <p>5、权证投资策略 本基金的权证投资以权证的市场价值分析为基础，配以权证定价模型寻求其合理估值水平，以主动式的科学投资管理为手段，充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征，通过资产配置、品种与类属选择，追求稳定的当期收益。</p> <p>6、股指期货投资策略 本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。通过对股指期货的投资，实现管理市场风险和改善投资组合风险收益特性的目的。</p> <p>7、国债期货投资策略 本基金参与国债期货投资是为了有效控制债券市场的系统性风险，本基金将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，适度运用国债期货提高投资组合运作效率。在国债期货投资过程中，基金管理人通过对宏观经济和利率市场走势的分析与判断，并充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置，谨慎进行投资，以调整债券组合的久期，降低投资组合的整体风险。</p> <p>8、存托凭证投资策略 在控制风险的前提下，本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础 证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。</p> |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率*60%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）*10%+中证全债指数收益率*30% |
| 风险收益特征 | <p>本基金是混合型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金和债券型基金。</p> <p>本基金资产投资于港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险（港股市场实行 T+0 回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股股价可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动）、汇率风险（汇率波动可能对基金的投资收益造成损失）、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险（在内地开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险）等。</p> |

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 | 潘西里 |
| | 联系电话 | 0755-83196666 |
| | 电子邮箱 | cmf@cmfchina.com |
| 客户服务电话 | 400-887-9555 | 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 | 证券时报 |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | http://www.cmfchina.com |
| 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 | 招商瑞利灵活配置混合（LOF） A:中国证券登记结算有限责任公 司 招商瑞利灵活配置混合（LOF） C:招商基金管理有限公司 | 北京市西城区太平桥大街 17 号 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

1、招商瑞利灵活配置混合（LOF）A

| | |
|---------------|---------------------------------------|
| 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 | 217,437,843.95 |
| 本期利润 | 32,583,139.29 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0250 |
| 本期加权平均净值利润率 | 0.99% |
| 本期基金份额净值增长率 | 6.74% |
| 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 | 1,569,064,564.73 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 1.1696 |
| 期末基金资产净值 | 3,298,177,118.65 |
| 期末基金份额净值 | 2.4585 |
| 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 | 145.85% |

2、招商瑞利灵活配置混合（LOF）C

| | |
|---------------|---------------------------------|
| 3.1.1 期间数据和指标 | 2023 年 2 月 27 日-2023 年 6 月 30 日 |
| 本期已实现收益 | 24,089,251.15 |

| | |
|---------------|-----------------------|
| 本期利润 | -70,928,745.68 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.2708 |
| 本期加权平均净值利润率 | -10.74% |
| 本期基金份额净值增长率 | -3.39% |
| 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 | 391,919,698.83 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 1.1689 |
| 期末基金资产净值 | 824,834,051.94 |
| 期末基金份额净值 | 2.4600 |
| 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 | -3.39% |

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；

4、本基金从 2023 年 2 月 24 日起新增 C 类份额，C 类份额自 2023 年 2 月 27 日起存续，该类份额本报告期的相关数据和指标按实际存续期计算。

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

招商瑞利灵活配置混合（LOF）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 | 2.83% | 1.89% | 1.46% | 0.63% | 1.37% | 1.26% |
| 过去三个月 | -8.96% | 1.45% | -2.72% | 0.59% | -6.24% | 0.86% |
| 过去六个月 | 6.74% | 1.49% | 0.44% | 0.60% | 6.30% | 0.89% |
| 过去一年 | 19.07% | 1.43% | -7.89% | 0.72% | 26.96% | 0.71% |
| 过去三年 | 69.75% | 1.52% | -2.04% | 0.82% | 71.79% | 0.70% |
| 自基金合同生效起至今 | 145.85% | 1.47% | 4.16% | 0.83% | 141.69% | 0.64% |

招商瑞利灵活配置混合（LOF）C

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|----|----------|-------------|------------|---------------|-----|-----|
|----|----------|-------------|------------|---------------|-----|-----|

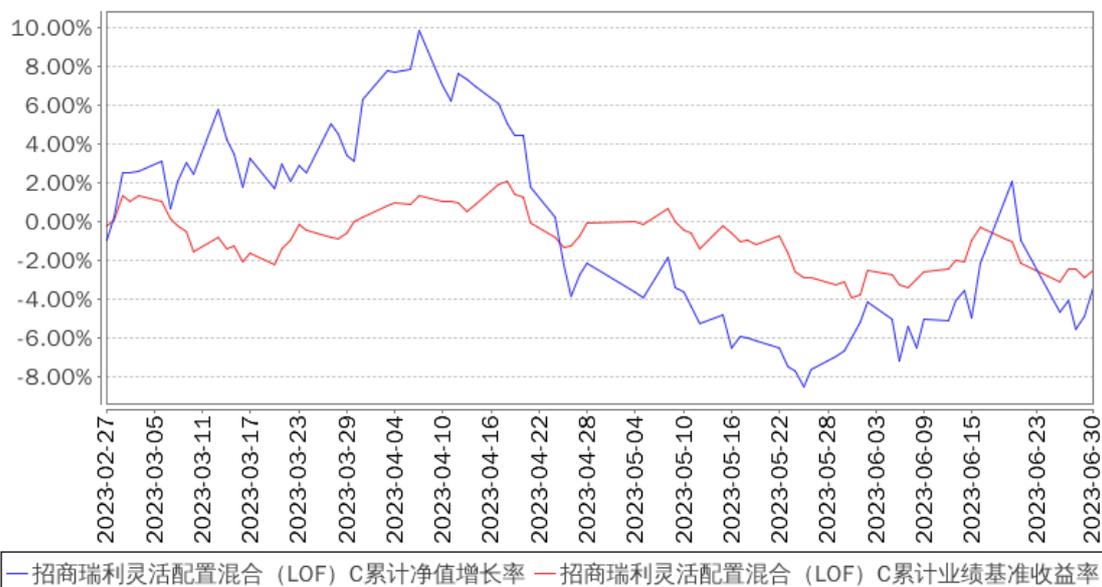
| | | | | ④ | | |
|------------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 过去一个月 | 2.78% | 1.89% | 1.46% | 0.63% | 1.32% | 1.26% |
| 过去三个月 | -9.10% | 1.45% | -2.72% | 0.59% | -6.38% | 0.86% |
| 自基金合同生效起至今 | -3.39% | 1.47% | -2.49% | 0.59% | -0.90% | 0.88% |

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

招商瑞利灵活配置混合（LOF）A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



招商瑞利灵活配置混合（LOF）C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



注：本基金从2023年2月24日起新增C类份额，C类份额自2023年2月27日起存续，该类份额本报告期的相关数据和指标按实际存续期计算。

§ 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 | | |
| 陆文凯 | 本基金基金经理 | 2022 年 8 月 20 日 | - | 12 | 男，硕士。2009 年 10 月至 2011 年 5 月在德勤华永会计师事务所有限公司工作；2011 年 5 月至 2013 年 2 月在上海申银万国证券研究所有限公司工作，任助理分析师；2013 年 3 月至 2015 年 4 月在汇丰晋信基金管理有限公司工作，任高级研究员；2015 年 5 月至 2018 年 1 月在上海道仁资产管理有限公司工作，任投资经理；2018 年 1 月至 2022 年 3 月在北信瑞丰基金管理有限公司工作，任权益投资部基金经理；2022 年 3 月加入招商基金管理有限公司，现任招商瑞利灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、招商产业升级 1 年持有期混合型证券投资基金基金经理。 |
| 王景 | 本基金基金经理（已离任） | 2019 年 7 月 18 日 | 2023 年 1 月 20 日 | 20 | 女，经济学硕士。曾任职于中国石化乌鲁木齐石油化工总厂物资装备公司及国家环境保护总局对外合作中心；2003 年起，先后于金鹰基金管理有限公司、中信基金管理有限公司及华夏基金管理有限公司工作，任行业研究员；2009 年 8 月起，任东兴证券股份有限公司资产管理部投资经理；2010 年 8 月加入招商基金管理有限公司，曾任招商安瑞进取债 |

| | | | | |
|----|-----------|-----------------|-----|---|
| | | | | 券型证券投资基金、招商安本增利债券型证券投资基金、招商安泰偏股混合型证券投资基金、招商安泰平衡型证券投资基金、招商境远灵活配置混合型证券投资基金、招商安弘灵活配置混合型证券投资基金、招商康泰灵活配置混合型证券投资基金、招商安博保本混合型证券投资基金、招商安荣保本混合型证券投资基金、招商丰茂灵活配置混合型发起式证券投资基金、招商中国机遇股票型证券投资基金、招商瑞利灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、招商瑞智优选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金经理，现任总经理助理兼投资管理一部总监、招商制造业转型灵活配置混合型证券投资基金、招商瑞泽一年持有期混合型证券投资基金、招商瑞德一年持有期混合型证券投资基金、招商品质升级混合型证券投资基金、招商品质生活混合型证券投资基金、招商金安成长严选混合型证券投资基金、招商蓝筹精选股票型证券投资基金基金经理，兼任投资经理。 |
| 周欣 | 本基金基金经理助理 | 2022 年 4 月 12 日 | - 7 | 男，经济学硕士。曾任中意资产管理有限责任公司研究员、助理投资经理；2022 年 1 月加入招商基金管理有限公司，现任招商制造业转型灵活配置混合型证券投资基金、招商瑞智优选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、招商瑞利灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、招商品质升级混合型证券投资基金、招商品质生活混合型证券投资基金、招商金安成长严选 1 年封闭运作混合型证券投资基金、招商蓝筹精选股票型证券投资基金的基金经理助理。 |

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 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

2023 年上半年宏观经济先经历了防疫政策优化后的脉冲式修复，随后在补库周期结束后出现复苏放缓的情况。A 股市场同样在年初延续了去年以来的上行态势，但从 2 月之后就一直在震荡下行的状态中，中间虽然不乏人工智能为代表的科技产业主题的机会，但市场整体仍然在经济复苏不达预期的情况下持续作出负面反馈。

本组合在报告期内维持去年以来对于市场整体的看好态度，在持仓延续去年以软件为代表的科技股为主的基础上，在年初积极增配受益于顺经济周期的相关行业，在一季度伴随着经济复苏以及数字经济、人工智能等产业主题要素持续催化下，净值录得一定正收益；进入二季度，在经济复苏节奏放缓的情况下，无论是顺周期相关以及受政府支出影响较大的政、企端软件公司均受到一定盈利端负面影响，导致净值出现一定回撤。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金 A 类份额净值增长率为 6.74%，同期业绩基准增长率为 0.44%，C 类份额净值增长率为-3.39%，同期业绩基准增长率为-2.49%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2023 年下半年我们认为在经历了一个季度的去库存后，经济已经在 6 月开始出现筑底迹象，整体下半年经济应该呈现底部企稳回升，同时我们认为海外衰退的时间点可能比想象中还要往后延。因此大部分行业的景气度与盈利水平也都在相对底部区域，出现修复乃至重启一轮上行周期的概率较高，流动性与政策端也较为正面，因而我们对于中国权益资产整体维持乐观态度。行业配置层面，我们维持对于软件行业的重点看好，长期来看数字化会成为驱动经济持续增长的重要生产要素，中短期来看政策引导下的政、企端 IT 投入的加速将提供足够的需求支撑，AI 技术的潜在应用也给提升用户付费意愿带来一定可能性。二季度经济复苏不及预期导致的市场回调后，总量相关行业的悲观预期已经被充分甚至过度定价，考虑到中国经济复苏的边际增量，在供给相对难以扩张的周期领域，或产生对于相关行业与公司盈利层面的正面影响，包括油运、快运等方向的龙头公司。

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：招商瑞利灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

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 | 386,532,643.66 | 175,634,642.72 |
| 结算备付金 | | 1,836,210.35 | 12,093,460.16 |
| 存出保证金 | | 1,158,321.15 | 295,493.80 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 3,770,715,162.29 | 1,256,104,651.16 |
| 其中：股票投资 | | 3,754,392,847.77 | 1,234,883,488.97 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 16,322,314.52 | 21,221,162.19 |
| 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 | - | - |
| 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 | | 97,948,731.49 | - |
| 应收股利 | | 15.25 | 129,188.16 |

| | | | |
|-----------|---------|---------------------|-----------------------|
| 应收申购款 | | 3,152,558.61 | 23,762,447.52 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.5 | - | - |
| 资产总计 | | 4,261,343,642.80 | 1,468,019,883.52 |
| 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 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付清算款 | | - | 75,198,216.22 |
| 应付赎回款 | | 127,537,195.11 | 1,293,659.95 |
| 应付管理人报酬 | | 5,211,700.96 | 1,333,719.83 |
| 应付托管费 | | 694,893.46 | 177,829.31 |
| 应付销售服务费 | | 382,701.02 | - |
| 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 | 6.4.7.6 | 4,505,981.66 | 1,523,247.21 |
| 负债合计 | | 138,332,472.21 | 79,526,672.52 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.7 | 1,676,811,447.13 | 602,821,827.39 |
| 其他综合收益 | | - | - |
| 未分配利润 | 6.4.7.8 | 2,446,199,723.46 | 785,671,383.61 |
| 净资产合计 | | 4,123,011,170.59 | 1,388,493,211.00 |
| 负债和净资产总计 | | 4,261,343,642.80 | 1,468,019,883.52 |

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，招商瑞利灵活配置混合（LOF）A 份额净值 2.4585 元，基金份额总额 1,341,513,878.75 份；招商瑞利灵活配置混合（LOF）C 份额净值 2.4600 元，基金份额总额 335,297,568.38 份；总份额合计 1,676,811,447.13 份。

6.2 利润表

会计主体：招商瑞利灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

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 | | -5,636,665.36 | -40,420,245.33 |
| 1.利息收入 | | 720,373.85 | 133,154.91 |

| | | | |
|-----------------------|------------|-----------------|----------------|
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.9 | 720,373.85 | 133,154.91 |
| 债券利息收入 | | - | - |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | - | - |
| 证券出借利息收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 266,199,935.81 | 24,841,180.01 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.10 | 252,393,599.37 | 18,914,100.75 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.11 | 1,866,833.92 | 1,007,686.19 |
| 资产支持证券投资 | 6.4.7.12 | - | - |
| 收益 | | | |
| 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 | 11,939,502.52 | 4,919,393.07 |
| 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） | 6.4.7.16 | -279,872,701.49 | -65,394,580.25 |
| 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 | 7,315,726.47 | - |
| 减：二、营业总支出 | | 32,708,941.03 | 4,707,394.24 |
| 1.管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 27,528,689.41 | 4,063,691.74 |
| 2.托管费 | 6.4.10.2.2 | 3,670,491.93 | 541,825.54 |
| 3.销售服务费 | 6.4.10.2.3 | 1,375,135.34 | - |
| 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 | 6.4.7.18 | - | - |
| 7.税金及附加 | | 4.96 | 1.76 |
| 8.其他费用 | 6.4.7.19 | 134,619.39 | 101,875.20 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | -38,345,606.39 | -45,127,639.57 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-” | | -38,345,606.39 | -45,127,639.57 |

| | | | |
|---------------|--|----------------|----------------|
| 号填列) | | | |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | -38,345,606.39 | -45,127,639.57 |

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：招商瑞利灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

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） | 602,821,827.39 | - | 785,671,383.61 | 1,388,493,211.00 |
| 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） | 602,821,827.39 | - | 785,671,383.61 | 1,388,493,211.00 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | 1,073,989,619.74 | - | 1,660,528,339.85 | 2,734,517,959.59 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | -38,345,606.39 | -38,345,606.39 |
| （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） | 1,073,989,619.74 | - | 1,698,873,946.24 | 2,772,863,565.98 |
| 其中：1.基金申购款 | 2,358,417,311.91 | - | 3,748,163,020.91 | 6,106,580,332.82 |
| 2.基金赎回款 | -1,284,427,692.17 | - | -2,049,289,074.67 | -3,333,716,766.84 |
| （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） | 1,676,811,447.13 | - | 2,446,199,723.46 | 4,123,011,170.59 |
| 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） | 284,367,630.28 | - | 347,936,469.49 | 632,304,099.77 |
| 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） | 284,367,630.28 | - | 347,936,469.49 | 632,304,099.77 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | - | - | -45,127,639.57 | -45,127,639.57 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | -45,127,639.57 | -45,127,639.57 |
| （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） | - | - | - | - |
| 其中：1.基金申购款 | - | - | - | - |
| 2.基金赎回款 | - | - | - | - |
| （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） | 284,367,630.28 | - | 302,808,829.92 | 587,176,460.20 |

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 3 年封闭运作瑞利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 3 年封闭运作瑞利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》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[2019]450 号文准予公开募集注册。本基金为契约型封闭式基金，存续期限为不定期。本基金首次设立募集基金份额为 284,367,630.28 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(19)第 00322 号验资报告。《招商 3 年封闭运作瑞利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”)于 2019 年 7 月 18 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”)。

根据基金合同和《招商基金管理有限公司关于招商瑞利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)增加基金份额类别并修改基金合同和托管协议的公告》的有关规定，本基金自 2023

年 2 月 24 日起增设 C 类基金份额，C 类基金份额在投资者申购时不收取申购费，在投资者赎回时收取赎回费用，同时本基金 C 类基金份额按照合同约定费率收取销售服务费；原有的基金份额在增加 C 类基金份额后，全部自动转换为招商瑞利灵活配置混合型证券投资基金（LOF）A 类基金份额。

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《招商 3 年封闭运作瑞利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股票和存托凭证（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票和存托凭证）、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许投资的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（简称“港股通标的股票”）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、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、可分离交易可转债、可交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、同业存单、银行存款、货币市场工具、权证、股指期货、国债期货，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，但须符合中国证监会的相关规定。封闭期内，本基金投资组合中股票、存托凭证投资比例为基金资产的 0-100%（其中投资于国内依法发行上市的股票、存托凭证的比例占基金资产的 0-100%，投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0-50%）。封闭期届满后，本基金投资组合中股票、存托凭证投资比例为基金资产的 0-95%（其中投资于国内依法发行上市的股票、存托凭证的比例占基金资产的 0-95%，投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0-50%）。投资于权证的比例为基金资产净值的 0%-3%。封闭期届满后，本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债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。在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制，封闭期内每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。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、国债期货的投资比例遵循国家相关法律法规。本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数收益率×60%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×10%+中证全债指数收益率×30%。

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[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》、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[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]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]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》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税；2018 年 1 月 1 日起，公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务，以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。

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

(3)对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在收到相关扣收税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳；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。对基金通过沪港通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册，H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利，由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。

(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。对于基金通过沪港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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 | 386,532,643.66 |
| 等于：本金 | 386,500,682.04 |
| 加：应计利息 | 31,961.62 |
| 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 | 386,532,643.66 |

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 | 4,003,541,011.26 | - | 3,754,392,847.77 | -249,148,163.49 |

| | | | | | |
|---------------|-------|------------------|------------|------------------|-----------------|
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | | - | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 16,050,840.00 | 283,914.52 | 16,322,314.52 | -12,440.00 |
| | 银行间市场 | - | - | - | - |
| | 合计 | 16,050,840.00 | 283,914.52 | 16,322,314.52 | -12,440.00 |
| 资产支持证券 | | - | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - | - |
| 合计 | | 4,019,591,851.26 | 283,914.52 | 3,770,715,162.29 | -249,160,603.49 |

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

本基金本报告期末无各项买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本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 2023 年 6 月 30 日 |
|-------------|---------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | 470,332.51 |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 应付交易费用 | 3,926,141.78 |
| 其中：交易所市场 | 3,926,141.78 |
| 银行间市场 | - |
| 应付利息 | - |
| 预提费用 | 109,507.37 |
| 合计 | 4,505,981.66 |

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

| 招商瑞利灵活配置混合（LOF）A | | |
|------------------|------------------------------------|-------------------|
| 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 | 602,821,827.39 | 602,821,827.39 |
| 本期申购 | 1,922,495,783.85 | 1,922,495,783.85 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -1,183,803,732.49 | -1,183,803,732.49 |
| 基金份额折算变动份额 | - | - |
| 本期末 | 1,341,513,878.75 | 1,341,513,878.75 |

| 招商瑞利灵活配置混合（LOF）C | | |
|------------------|--|-----------------|
| 项目 | 本期 2023 年 2 月 27 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日 | |
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | - | - |
| 本期申购 | 435,921,528.06 | 435,921,528.06 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -100,623,959.68 | -100,623,959.68 |
| 基金份额折算变动份额 | - | - |
| 本期末 | 335,297,568.38 | 335,297,568.38 |

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

| 招商瑞利灵活配置混合（LOF）A | | | |
|------------------|-------------------|-----------------|-------------------|
| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
| 上年度末 | 611,286,893.08 | 174,384,490.53 | 785,671,383.61 |
| 本期利润 | 217,437,843.95 | -184,854,704.66 | 32,583,139.29 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 740,339,827.70 | 398,068,889.30 | 1,138,408,717.00 |
| 其中：基金申购款 | 2,081,377,093.21 | 951,181,152.15 | 3,032,558,245.36 |
| 基金赎回款 | -1,341,037,265.51 | -553,112,262.85 | -1,894,149,528.36 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 1,569,064,564.73 | 387,598,675.17 | 1,956,663,239.90 |

| 招商瑞利灵活配置混合（LOF）C | | | |
|------------------|-----------------|----------------|-----------------|
| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
| 上年度末 | - | - | - |
| 本期利润 | 24,089,251.15 | -95,017,996.83 | -70,928,745.68 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 367,830,447.68 | 192,634,781.56 | 560,465,229.24 |
| 其中：基金申购款 | 486,060,202.03 | 229,544,573.52 | 715,604,775.55 |
| 基金赎回款 | -118,229,754.35 | -36,909,791.96 | -155,139,546.31 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 391,919,698.83 | 97,616,784.73 | 489,536,483.56 |

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|-----------|------------------------------------|
| 活期存款利息收入 | 554,590.21 |
| 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 | 98,473.16 |
| 其他 | 67,310.48 |
| 合计 | 720,373.85 |

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 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 | 252,393,599.37 |
| 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 | 252,393,599.37 |

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|------------|------------------------------------|
| 卖出股票成交总额 | 4,065,925,596.13 |
| 减：卖出股票成本总额 | 3,799,627,700.93 |
| 减：交易费用 | 13,904,295.83 |
| 买卖股票差价收入 | 252,393,599.37 |

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|----|------------------------------------|
|----|------------------------------------|

| | |
|-------------------------------|--------------|
| 债券投资收益——利息收入 | 253,430.82 |
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入 | 1,613,403.10 |
| 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 | 1,866,833.92 |

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|-------------------------|------------------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额 | 14,765,817.93 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 13,022,055.42 |
| 减：应计利息总额 | 129,972.38 |
| 减：交易费用 | 387.03 |
| 买卖债券差价收入 | 1,613,403.10 |

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|---------------|------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 11,939,502.52 |
| 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 | 11,939,502.52 |

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|------------------------|------------------------------------|
| 1.交易性金融资产 | -279,872,701.49 |
| ——股票投资 | -279,875,109.49 |
| ——债券投资 | 2,408.00 |
| ——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 | -279,872,701.49 |

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|---------|------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 7,315,726.47 |
| 合计 | 7,315,726.47 |

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|---------|------------------------------------|
| 审计费用 | 50,000.00 |
| 信息披露费 | 59,507.37 |
| 证券出借违约金 | - |
| 证券组合费 | 8,150.99 |
| 银行费用 | 7,961.03 |
| 其他 | 9,000.00 |
| 合计 | 134,619.39 |

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 |
| 招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”) | 基金管理人的股东 |
| 招商证券股份有限公司(以下简称“招商证券”) | 基金管理人的股东 |

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 | 6,379,596,855.92 | 59.90% | 284,818,481.33 | 37.45% |

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 | 9,637,317.93 | 100.00% | - | - |

6.4.10.1.3 债券回购交易

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债券回购交易。

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 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 | 4,699,093.83 | 55.09% | 2,095,393.57 | 53.37% |
| 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 | 220,198.21 | 34.83% | 104,773.84 | 29.71% |

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 | 27,528,689.41 | 4,063,691.74 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 5,904,330.05 | 1,848,364.75 |
| 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 | 3,670,491.93 | 541,825.54 |

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：

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

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | | |
|----------------|---|------------------|--------------|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 招商瑞利灵活配置混合（LOF）A | 招商瑞利灵活配置混合（LOF）C | 合计 |
| 招商基金管理有限公司 | - | 875,906.89 | 875,906.89 |
| 招商银行 | - | 252,546.10 | 252,546.10 |
| 招商证券 | - | 251.52 | 251.52 |
| 合计 | - | 1,128,704.51 | 1,128,704.51 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 招商瑞利灵活配置混合（LOF）A | 招商瑞利灵活配置混合（LOF）C | 合计 |
| 招商基金管理有限公司 | - | - | - |
| 招商银行 | - | - | - |
| 招商证券 | - | - | - |
| 合计 | - | - | - |

注：本基金的C类基金份额的年销售服务费率为0.60%，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

C 类份额日销售服务费=前一日 C 类基金资产净值×0.60%÷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 | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | |
|---------------------------------|---------------------------------|-----------------------|
| | 招商瑞利灵活配置混合 (LOF) A | 招商瑞利灵活配置混合 (LOF) C |
| 基金合同生效日（2019 年 7 月 18 日）持有的基金份额 | - | - |
| 报告期初持有的基金份额 | 4,527,138.92 | - |
| 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 | 4,527,138.92 | - |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 0.34% | - |

| 项目 | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | |
|---------------------------------|---------------------------------|-----------------------|
| | 招商瑞利灵活配置混合 (LOF) A | 招商瑞利灵活配置混合 (LOF) C |
| 基金合同生效日（2019 年 7 月 18 日）持有的基金份额 | - | - |
| 报告期初持有的基金份额 | - | - |
| 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 | - | - |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | - | - |

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 | 386,532,643.66 | 554,590.21 | 156,482,063.99 | 117,283.13 |

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 |
| 招商证券 | 301305 | 朗坤环境 | 新股获配 | 7,523 | 189,955.75 |
| 招商证券 | 301428 | 世纪恒通 | 新股获配 | 2,289 | 60,315.15 |

| 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 |
| 招商证券 | 001323 | 慕思股份 | 网下申购 | 573 | 22,306.89 |
| 招商证券 | 301123 | 奕东电子 | 网下申购 | 5,713 | 212,694.99 |

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

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票 | | | | | | | | | | |
|----------------------|------|------------|-----|--------|-------|--------|----------|-----------|-----------|----|
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 受限期 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量（单位：股） | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| 001282 | 三联锻造 | 2023年5月15日 | 6个月 | 新股流通受限 | 27.93 | 33.03 | 105 | 2,932.65 | 3,468.15 | - |
| 001286 | 陕西能源 | 2023年3月31日 | 6个月 | 新股流通受限 | 9.60 | 9.41 | 3,767 | 36,163.20 | 35,447.47 | - |
| 001287 | 中电港 | 2023年3月30日 | 6个月 | 新股流通受限 | 11.88 | 21.02 | 1,386 | 16,465.68 | 29,133.72 | - |
| 001324 | 长青科技 | 2023年5月12日 | 6个月 | 新股流通受限 | 18.88 | 19.60 | 114 | 2,152.32 | 2,234.40 | - |
| 001328 | 登康口腔 | 2023年3月29日 | 6个月 | 新股流通受限 | 20.68 | 25.49 | 145 | 2,998.60 | 3,696.05 | - |
| 001360 | 南矿集团 | 2023年3月31日 | 6个月 | 新股流通受限 | 15.38 | 14.87 | 177 | 2,722.26 | 2,631.99 | - |
| 001367 | 海森药业 | 2023年3月30日 | 6个月 | 新股流通受限 | 44.48 | 39.48 | 55 | 2,446.40 | 2,171.40 | - |
| 001380 | 华纬科技 | 2023年5月9日 | 6个月 | 新股流通受限 | 28.84 | 30.78 | 170 | 4,902.80 | 5,232.60 | - |
| 300804 | 广康生化 | 2023年6月15日 | 6个月 | 新股流通受限 | 42.45 | 32.97 | 226 | 9,593.70 | 7,451.22 | - |
| 301141 | 中科磁业 | 2023年3月27日 | 6个月 | 新股流通受限 | 41.20 | 42.69 | 262 | 10,794.40 | 11,184.78 | - |
| 301157 | 华塑科技 | 2023年3月1日 | 6个月 | 新股流通受限 | 56.50 | 52.93 | 150 | 8,475.00 | 7,939.50 | - |
| 301170 | 锡南科技 | 2023年6月16日 | 6个月 | 新股流通受限 | 34.00 | 34.93 | 250 | 8,500.00 | 8,732.50 | - |
| 301202 | 朗威股份 | 2023年6月28日 | 6个月 | 新股流通受限 | 25.82 | 25.82 | 306 | 7,900.92 | 7,900.92 | - |
| 301202 | 朗威股份 | 2023年 | 1个月 | 新股流通 | 25.82 | 25.82 | 2,754 | 71,108.28 | 71,108.28 | - |

| | | | | | | | | | | | |
|--------|------|-------------|---------|--------|--------|-------|-------|------------|------------|---|--|
| | | 6月28日 | 内(含) | 受限 | | | | | | | |
| 301203 | 国泰环保 | 2023年3月28日 | 6个月 | 新股流通受限 | 46.13 | 34.40 | 225 | 10,379.25 | 7,740.00 | - | |
| 301232 | 飞沃科技 | 2023年6月8日 | 6个月 | 新股流通受限 | 72.50 | 58.42 | 165 | 11,962.50 | 9,639.30 | - | |
| 301246 | 宏源药业 | 2023年3月10日 | 6个月 | 新股流通受限 | 50.00 | 30.71 | 931 | 46,550.00 | 28,591.01 | - | |
| 301261 | 恒工精密 | 2023年6月29日 | 6个月 | 新股流通受限 | 36.90 | 36.90 | 198 | 7,306.20 | 7,306.20 | - | |
| 301261 | 恒工精密 | 2023年6月29日 | 1个月内(含) | 新股流通受限 | 36.90 | 36.90 | 1,775 | 65,497.50 | 65,497.50 | - | |
| 301292 | 海科新源 | 2023年6月29日 | 6个月 | 新股流通受限 | 19.99 | 19.99 | 583 | 11,654.17 | 11,654.17 | - | |
| 301292 | 海科新源 | 2023年6月29日 | 1个月内(含) | 新股流通受限 | 19.99 | 19.99 | 5,241 | 104,767.59 | 104,767.59 | - | |
| 301293 | 三博脑科 | 2023年4月25日 | 6个月 | 新股流通受限 | 29.60 | 71.42 | 333 | 9,856.80 | 23,782.86 | - | |
| 301295 | 美硕科技 | 2023年6月19日 | 6个月 | 新股流通受限 | 37.40 | 36.07 | 215 | 8,041.00 | 7,755.05 | - | |
| 301301 | 川宁生物 | 2022年12月20日 | 6个月 | 新股流通受限 | 5.00 | 8.96 | 3,574 | 17,870.00 | 32,023.04 | - | |
| 301305 | 朗坤环境 | 2023年5月15日 | 6个月 | 新股流通受限 | 25.25 | 19.69 | 753 | 19,013.25 | 14,826.57 | - | |
| 301315 | 威士顿 | 2023年6月13日 | 6个月 | 新股流通受限 | 32.29 | 51.12 | 226 | 7,297.54 | 11,553.12 | - | |
| 301320 | 豪江智能 | 2023年6月1日 | 6个月 | 新股流通受限 | 13.06 | 20.62 | 642 | 8,384.52 | 13,238.04 | - | |
| 301322 | 绿通科技 | 2023年2月27日 | 6个月 | 新股流通受限 | 131.11 | 53.24 | 392 | 34,219.71 | 20,870.08 | - | |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|-----------------------|------|------------|-------|--------|-------|-----------|-----------|---|
| 301323 | 新莱福 | 2023 年 5 月 29 日 | 6 个月 | 新股流通 受限 | 39.06 | 39.36 | 228 | 8,905.68 | 8,974.08 | - |
| 301325 | 曼恩斯特 | 2023 年 5 月 4 日 | 6 个月 | 新股流通 受限 | 76.80 | 107.95 | 364 | 27,955.20 | 39,293.80 | - |
| 301332 | 德尔玛 | 2023 年 5 月 9 日 | 6 个月 | 新股流通 受限 | 14.81 | 13.73 | 1,122 | 16,616.82 | 15,405.06 | - |
| 301337 | 亚华电子 | 2023 年 5 月 16 日 | 6 个月 | 新股流通 受限 | 32.60 | 30.37 | 232 | 7,563.20 | 7,045.84 | - |
| 301345 | 涛涛车业 | 2023 年 3 月 10 日 | 6 个月 | 新股流通 受限 | 73.45 | 46.64 | 266 | 19,537.70 | 12,406.24 | - |
| 301355 | 南王科技 | 2023 年 6 月 2 日 | 6 个月 | 新股流通 受限 | 17.55 | 16.75 | 563 | 9,880.65 | 9,430.25 | - |
| 301357 | 北方长龙 | 2023 年 4 月 11 日 | 6 个月 | 新股流通 受限 | 50.00 | 48.39 | 190 | 9,500.00 | 9,194.10 | - |
| 301358 | 湖南裕能 | 2023 年 2 月 1 日 | 6 个月 | 新股流通 受限 | 23.77 | 42.89 | 2,023 | 48,086.71 | 86,766.47 | - |
| 301360 | 荣旗科技 | 2023 年 4 月 17 日 | 6 个月 | 新股流通 受限 | 71.88 | 92.60 | 134 | 9,631.92 | 12,408.40 | - |
| 301373 | 凌玮科技 | 2023 年 1 月 20 日 | 6 个月 | 新股流通 受限 | 33.73 | 31.85 | 277 | 9,343.21 | 8,822.45 | - |
| 301376 | 致欧科技 | 2023 年 6 月 14 日 | 6 个月 | 新股流通 受限 | 24.66 | 22.51 | 420 | 10,357.20 | 9,454.20 | - |
| 301386 | 未来电器 | 2023 年 3 月 21 日 | 6 个月 | 新股流通 受限 | 29.99 | 23.79 | 378 | 11,336.22 | 8,992.62 | - |
| 301408 | 华人健康 | 2023 年 2 月 22 日 | 6 个月 | 新股流通 受限 | 16.24 | 16.95 | 879 | 14,274.96 | 14,899.05 | - |
| 301419 | 阿莱德 | 2023 年 2 月 2 日 | 6 个月 | 新股流通 受限 | 24.80 | 43.85 | 330 | 8,184.00 | 14,470.50 | - |
| 301428 | 世纪恒通 | 2023 年 5 月 10 | 6 个月 | 新股流通 受限 | 26.35 | 30.60 | 229 | 6,034.15 | 7,007.40 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|-----------------------|--------------|------------|-------|-------|-------|------------|------------|---|
| | | 日 | | | | | | | | |
| 301439 | 泓淋电力 | 2023 年 3 月 10 日 | 6 个月 | 新股流通 受限 | 19.99 | 16.90 | 949 | 18,970.51 | 16,038.10 | - |
| 301486 | 致尚科技 | 2023 年 6 月 30 日 | 6 个月 | 新股流通 受限 | 57.66 | 57.66 | 482 | 27,792.12 | 27,792.12 | - |
| 301486 | 致尚科技 | 2023 年 6 月 30 日 | 1 个月 内(含) | 新股流通 受限 | 57.66 | 57.66 | 4,338 | 250,129.08 | 250,129.08 | - |
| 301488 | 豪恩汽电 | 2023 年 6 月 26 日 | 6 个月 | 新股流通 受限 | 39.78 | 39.78 | 262 | 10,422.36 | 10,422.36 | - |
| 301488 | 豪恩汽电 | 2023 年 6 月 26 日 | 1 个月 内(含) | 新股流通 受限 | 39.78 | 39.78 | 2,356 | 93,721.68 | 93,721.68 | - |
| 601061 | 中信金属 | 2023 年 3 月 30 日 | 6 个月 | 新股流通 受限 | 6.58 | 7.58 | 4,016 | 26,425.28 | 30,441.28 | - |
| 601065 | 江盐集团 | 2023 年 3 月 31 日 | 6 个月 | 新股流通 受限 | 10.36 | 11.84 | 875 | 9,065.00 | 10,360.00 | - |
| 601133 | 柏诚股份 | 2023 年 3 月 31 日 | 6 个月 | 新股流通 受限 | 11.66 | 12.26 | 664 | 7,742.24 | 8,140.64 | - |
| 603125 | 常青科技 | 2023 年 3 月 30 日 | 6 个月 | 新股流通 受限 | 25.98 | 24.53 | 160 | 4,156.80 | 3,924.80 | - |
| 603137 | 恒尚节能 | 2023 年 4 月 10 日 | 6 个月 | 新股流通 受限 | 15.90 | 17.09 | 139 | 2,210.10 | 2,375.51 | - |
| 603172 | 万丰股份 | 2023 年 4 月 28 日 | 6 个月 | 新股流通 受限 | 14.58 | 16.13 | 122 | 1,778.76 | 1,967.86 | - |
| 688146 | 中船特气 | 2023 年 4 月 13 日 | 6 个月 | 新股流通 受限 | 36.15 | 38.13 | 1,011 | 36,547.65 | 38,549.43 | - |
| 688249 | 晶合集成 | 2023 年 4 月 24 日 | 6 个月 | 新股流通 受限 | 19.86 | 18.06 | 7,405 | 147,063.30 | 133,734.30 | - |
| 688334 | 西高院 | 2023 年 6 月 9 日 | 6 个月 | 新股流通 受限 | 14.16 | 16.21 | 888 | 12,574.08 | 14,394.48 | - |
| 688352 | 颀中科技 | 2023 年 | 6 个月 | 新股流通 | 12.10 | 12.07 | 2,361 | 28,568.10 | 28,497.27 | - |

| | | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|-----|--------|--------|--------|--------|-----------|------------|---|--|
| | | 4月11日 | | 受限 | | | | | | | |
| 688361 | 中科飞测 | 2023年5月12日 | 6个月 | 新股流通受限 | 23.60 | 64.67 | 831 | 19,611.60 | 53,740.77 | - | |
| 688429 | 时创能源 | 2023年6月20日 | 6个月 | 新股流通受限 | 19.20 | 25.53 | 346 | 6,643.20 | 8,833.38 | - | |
| 688433 | 华曙高科 | 2023年4月7日 | 6个月 | 新股流通受限 | 26.66 | 31.50 | 418 | 11,143.88 | 13,167.00 | - | |
| 688458 | 美芯晟 | 2023年5月15日 | 6个月 | 新股流通受限 | 75.00 | 90.76 | 221 | 16,575.00 | 20,057.96 | - | |
| 688469 | 中芯集成 | 2023年4月28日 | 6个月 | 新股流通受限 | 5.69 | 5.41 | 13,800 | 78,522.00 | 74,658.00 | - | |
| 688472 | 阿特斯 | 2023年6月2日 | 6个月 | 新股流通受限 | 11.10 | 17.04 | 6,261 | 69,497.10 | 106,687.44 | - | |
| 688478 | 晶升股份 | 2023年4月13日 | 6个月 | 新股流通受限 | 32.52 | 42.37 | 402 | 13,073.04 | 17,032.74 | - | |
| 688479 | 友车科技 | 2023年5月4日 | 6个月 | 新股流通受限 | 33.99 | 29.49 | 332 | 11,284.68 | 9,790.68 | - | |
| 688507 | 索辰科技 | 2023年4月10日 | 6个月 | 新股流通受限 | 245.56 | 122.11 | 222 | 36,834.00 | 27,108.42 | - | |
| 688512 | 慧智微 | 2023年5月8日 | 6个月 | 新股流通受限 | 20.92 | 19.16 | 721 | 15,083.32 | 13,814.36 | - | |
| 688523 | 航天环宇 | 2023年5月26日 | 6个月 | 新股流通受限 | 21.86 | 23.85 | 472 | 10,317.92 | 11,257.20 | - | |
| 688531 | 日联科技 | 2023年3月24日 | 6个月 | 新股流通受限 | 152.38 | 135.97 | 346 | 52,723.48 | 47,045.62 | - | |
| 688535 | 华海诚科 | 2023年3月28日 | 6个月 | 新股流通受限 | 35.00 | 51.23 | 161 | 5,635.00 | 8,248.03 | - | |
| 688543 | 国科军工 | 2023年6月14日 | 6个月 | 新股流通受限 | 43.67 | 53.05 | 410 | 17,904.70 | 21,750.50 | - | |

| 688562 | 航天软件 | 2023 年 5 月 15 日 | 6 个月 | 新股流通 受限 | 12.68 | 22.31 | 726 | 9,205.68 | 16,197.06 | - |
|----------------------|------|-----------------------|--------------|------------|----------|------------|--------------|------------|------------|----|
| 688570 | 天玛智控 | 2023 年 5 月 29 日 | 6 个月 | 新股流通 受限 | 30.26 | 25.33 | 884 | 26,749.84 | 22,391.72 | - |
| 688581 | 安杰思 | 2023 年 5 月 12 日 | 6 个月 | 新股流通 受限 | 125.80 | 118.03 | 163 | 20,505.40 | 19,238.89 | - |
| 688582 | 芯动联科 | 2023 年 6 月 21 日 | 6 个月 | 新股流通 受限 | 26.74 | 40.68 | 648 | 17,327.52 | 26,360.64 | - |
| 688593 | 新相微 | 2023 年 5 月 25 日 | 6 个月 | 新股流通 受限 | 11.18 | 14.59 | 959 | 10,721.62 | 13,991.81 | - |
| 688603 | 天承科技 | 2023 年 6 月 30 日 | 6 个月 | 新股流通 受限 | 55.00 | 55.00 | 140 | 7,700.00 | 7,700.00 | - |
| 688603 | 天承科技 | 2023 年 6 月 30 日 | 1 个月 内（含） | 新股流通 受限 | 55.00 | 55.00 | 1,251 | 68,805.00 | 68,805.00 | - |
| 688620 | 安凯微 | 2023 年 6 月 15 日 | 6 个月 | 新股流通 受限 | 10.68 | 12.34 | 1,016 | 10,850.88 | 12,537.44 | - |
| 688623 | 二元科技 | 2023 年 5 月 31 日 | 6 个月 | 新股流通 受限 | 125.88 | 86.79 | 178 | 22,406.64 | 15,448.62 | - |
| 688629 | 华丰科技 | 2023 年 6 月 16 日 | 6 个月 | 新股流通 受限 | 9.26 | 18.59 | 708 | 6,556.08 | 13,161.72 | - |
| 688631 | 莱斯信息 | 2023 年 6 月 19 日 | 6 个月 | 新股流通 受限 | 25.28 | 29.87 | 336 | 8,494.08 | 10,036.32 | - |
| 6.4.12.1.2 受限证券类别：债券 | | | | | | | | | | |
| 证券代 码 | 证券名称 | 成功认 购日 | 受限期 | 流通受限 类型 | 认购价 格 | 期末估 值单价 | 数量（单 位：张） | 期末成本总 额 | 期末估值总 额 | 备注 |
| - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |

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

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的债券投资。

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

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

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约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 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 | 386,532,643.66 | - | - | - | 386,532,643.66 |
| 结算备付金 | 1,836,210.35 | - | - | - | 1,836,210.35 |
| 存出保证金 | 1,158,321.15 | - | - | - | 1,158,321.15 |
| 交易性金融资产 | 16,322,314.52 | - | - | 3,754,392,847.77 | 3,770,715,162.29 |
| 衍生金融资产 | - | - | - | - | - |
| 买入返售金融资产 | - | - | - | - | - |
| 债权投资 | - | - | - | - | - |
| 应收股利 | - | - | - | 15.25 | 15.25 |
| 应收申购款 | - | - | - | 3,152,558.61 | 3,152,558.61 |
| 应收清算款 | - | - | - | 97,948,731.49 | 97,948,731.49 |
| 其他资产 | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 405,849,489.68 | - | - | 3,855,494,153.12 | 4,261,343,642.80 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 127,537,195.11 | 127,537,195.11 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 5,211,700.96 | 5,211,700.96 |
| 应付托管费 | - | - | - | 694,893.46 | 694,893.46 |
| 应付清算款 | - | - | - | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | - | - | - | - | - |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 382,701.02 | 382,701.02 |
| 应付投资顾问费 | - | - | - | - | - |
| 应付利润 | - | - | - | - | - |
| 应交税费 | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | 4,505,981.66 | 4,505,981.66 |
| 负债总计 | - | - | - | 138,332,472.21 | 138,332,472.21 |

| | | | | | |
|-----------------------|----------------|-------|-------|------------------|------------------|
| 利率敏感度缺口 | 405,849,489.68 | - | - | 3,717,161,680.91 | 4,123,011,170.59 |
| 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 | 175,634,642.72 | - | - | - | 175,634,642.72 |
| 结算备付金 | 12,093,460.16 | - | - | - | 12,093,460.16 |
| 存出保证金 | 295,493.80 | - | - | - | 295,493.80 |
| 交易性金融资产 | 21,221,162.19 | - | - | 1,234,883,488.97 | 1,256,104,651.16 |
| 衍生金融资产 | - | - | - | - | - |
| 买入返售金融资产 | - | - | - | - | - |
| 债权投资 | - | - | - | - | - |
| 应收股利 | - | - | - | 129,188.16 | 129,188.16 |
| 应收申购款 | - | - | - | 23,762,447.52 | 23,762,447.52 |
| 应收清算款 | - | - | - | - | - |
| 其他资产 | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 209,244,758.87 | - | - | 1,258,775,124.65 | 1,468,019,883.52 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 1,293,659.95 | 1,293,659.95 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 1,333,719.83 | 1,333,719.83 |
| 应付托管费 | - | - | - | 177,829.31 | 177,829.31 |
| 应付清算款 | - | - | - | 75,198,216.22 | 75,198,216.22 |
| 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 | - | - | - | 1,523,247.21 | 1,523,247.21 |
| 负债总计 | - | - | - | 79,526,672.52 | 79,526,672.52 |
| 利率敏感度缺口 | 209,244,758.87 | - | - | 1,179,248,452.13 | 1,388,493,211.00 |

注：上表按金融资产或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 | -24,802.59 |
| | 2. 市场利率平行下降 50 个基点 | 24,882.53 | 73,632.03 |

6.4.13.4.2 外汇风险

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 | | | | | |
|---------------|---------------------|----------------|---------|---------|-----------|----------------|
| | 美元折合人民币 | 港币折合人民币 | 欧元折合人民币 | 日元折合人民币 | 其他币种折合人民币 | 合计 |
| 以外币计价的资产 | | | | | | |
| 银行存款 | - | - | - | - | - | - |
| 结算备付金 | - | - | - | - | - | - |
| 存出保证金 | - | - | - | - | - | - |
| 交易性金融资产 | - | 254,972,783.24 | - | - | - | 254,972,783.24 |
| 衍生金融资产 | - | - | - | - | - | - |
| 债权投资 | - | - | - | - | - | - |
| 应收股利 | - | 15.25 | - | - | - | 15.25 |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - | - |
| 应收清算款 | - | - | - | - | - | - |
| 其他资产 | - | - | - | - | - | - |
| 资产合计 | - | 254,972,798.49 | - | - | - | 254,972,798.49 |
| 以外币计价的负债 | | | | | | |
| 应付清算款 | - | - | - | - | - | - |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | - |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | - |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | - |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - | - |
| 应付投资顾问费 | - | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | - |
| 负债合计 | - | - | - | - | - | - |
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | - | 254,972,798.49 | - | - | - | 254,972,798.49 |

| 项目 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 | | | | | |
|----|-----------------------|---------|---------|---------|-----------|----|
| | 美元折合人民币 | 港币折合人民币 | 欧元折合人民币 | 日元折合人民币 | 其他币种折合人民币 | 合计 |
| | | | | | | |

| | | | 币 | 币 | | |
|---------------|---|----------------|---|---|---|----------------|
| 以外币计价的资产 | | | | | | |
| 银行存款 | - | - | - | - | - | - |
| 结算备付金 | - | - | - | - | - | - |
| 存出保证金 | - | - | - | - | - | - |
| 交易性金融资产 | - | 145,693,325.63 | - | - | - | 145,693,325.63 |
| 衍生金融资产 | - | - | - | - | - | - |
| 债权投资 | - | - | - | - | - | - |
| 应收股利 | - | 129,188.16 | - | - | - | 129,188.16 |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - | - |
| 应收清算款 | - | - | - | - | - | - |
| 其他资产 | - | - | - | - | - | - |
| 资产合计 | - | 145,822,513.79 | - | - | - | 145,822,513.79 |
| 以外币计价的负债 | | | | | | |
| 应付清算款 | - | - | - | - | - | - |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | - |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | - |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | - |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - | - |
| 应付投资顾问费 | - | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | - |
| 负债合计 | - | - | - | - | - | - |
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | - | 145,822,513.79 | - | - | - | 145,822,513.79 |

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

| 假设 | 除汇率以外的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. 所有外币相对人民币升值 5% | 12,748,639.92 | 7,291,125.69 |
| 2. 所有外币相对人民币贬值 5% | -12,748,639.92 | -7,291,125.69 | |

6.4.13.4.3 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，也有可能与整体投资品种相关。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的债券和股票，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金在构建资产配置和基金资产投资组合的基础上，通过建立事前和事后跟踪误差的方式，对基金资产的市场价格风险进行管理。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 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 | 3,754,392,847.77 | 91.06 | 1,234,883,488.97 | 88.94 |
| 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 | 3,754,392,847.77 | 91.06 | 1,234,883,488.97 | 88.94 |

6.4.13.4.3.2 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% | 187,719,642.39 | 61,744,174.45 |
| | 2. 权益性投资的市场价格下降 5% | -187,719,642.39 | -61,744,174.45 |

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 | 3,752,273,172.61 |
| 第二层次 | 17,049,119.42 |
| 第三层次 | 1,392,870.26 |
| 合计 | 3,770,715,162.29 |

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 | 3,754,392,847.77 | 88.10 |
| | 其中：股票 | 3,754,392,847.77 | 88.10 |

| | | | |
|---|-------------------|------------------|--------|
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 16,322,314.52 | 0.38 |
| | 其中：债券 | 16,322,314.52 | 0.38 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 388,368,854.01 | 9.11 |
| 8 | 其他资产 | 102,259,626.50 | 2.40 |
| 9 | 合计 | 4,261,343,642.80 | 100.00 |

注：上表权益投资中通过港股通交易机制投资的港股金额人民币 254,972,783.24 元，占基金净值比例 6.18%。

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 | 48,840,530.22 | 1.18 |
| C | 制造业 | 699,797,593.61 | 16.97 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 35,447.47 | 0.00 |
| E | 建筑业 | 112,010,516.15 | 2.72 |
| F | 批发和零售业 | 83,928.25 | 0.00 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 454,780,000.00 | 11.03 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 2,183,811,304.92 | 52.97 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 14,394.48 | 0.00 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 22,566.57 | 0.00 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 23,782.86 | 0.00 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 3,499,420,064.53 | 84.88 |

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

金额单位：人民币元

| 行业类别 | 公允价值（人民币元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----------|----------------|--------------|
| 通信服务 | - | - |
| 非日常生活消费品 | 60,850,680.00 | 1.48 |
| 日常消费品 | - | - |
| 能源 | 28,987,051.20 | 0.70 |
| 金融 | - | - |
| 医疗保健 | - | - |
| 工业 | - | - |
| 信息技术 | 165,134,915.82 | 4.01 |
| 原材料 | 136.22 | 0.00 |
| 房地产 | - | - |
| 公用事业 | - | - |
| 合计 | 254,972,783.24 | 6.18 |

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

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 | 600026 | 中远海能 | 25,000,000 | 316,000,000.00 | 7.66 |
| 1 | 01138 | 中远海能 | 4,000,000 | 28,987,051.20 | 0.70 |
| 2 | 300451 | 创业慧康 | 35,500,926 | 297,497,759.88 | 7.22 |
| 3 | 688246 | 嘉和美康 | 5,500,056 | 230,287,344.72 | 5.59 |
| 4 | 300525 | 博思软件 | 15,000,042 | 230,100,644.28 | 5.58 |
| 5 | 300253 | 卫宁健康 | 19,999,990 | 216,399,891.80 | 5.25 |
| 6 | 688232 | 新点软件 | 4,000,000 | 215,240,000.00 | 5.22 |
| 7 | 301117 | 佳缘科技 | 2,700,000 | 174,474,000.00 | 4.23 |
| 8 | 00268 | 金蝶国际 | 15,000,000 | 144,935,256.00 | 3.52 |
| 9 | 603056 | 德邦股份 | 9,000,000 | 138,780,000.00 | 3.37 |
| 10 | 600570 | 恒生电子 | 3,000,004 | 132,870,177.16 | 3.22 |
| 11 | 300986 | 志特新材 | 4,000,075 | 112,002,100.00 | 2.72 |
| 12 | 603383 | 顶点软件 | 2,000,048 | 110,842,660.16 | 2.69 |
| 13 | 688369 | 致远互联 | 1,660,058 | 91,801,207.40 | 2.23 |
| 14 | 688789 | 宏华数科 | 1,000,026 | 88,332,296.58 | 2.14 |
| 15 | 300996 | 普联软件 | 2,773,600 | 85,149,520.00 | 2.07 |
| 16 | 002840 | 华统股份 | 5,076,281 | 79,393,034.84 | 1.93 |
| 17 | 688311 | 盟升电子 | 1,119,030 | 78,264,958.20 | 1.90 |
| 18 | 600150 | 中国船舶 | 2,000,000 | 65,820,000.00 | 1.60 |
| 19 | 688201 | 信安世纪 | 1,500,000 | 64,110,000.00 | 1.55 |
| 20 | 600970 | 中材国际 | 5,000,000 | 63,750,000.00 | 1.55 |

| | | | | | |
|----|--------|------|------------|---------------|------|
| 21 | 300659 | 中孚信息 | 3,000,043 | 60,960,873.76 | 1.48 |
| 22 | 03998 | 波司登 | 20,000,000 | 60,850,680.00 | 1.48 |
| 23 | 002439 | 启明星辰 | 2,000,008 | 59,520,238.08 | 1.44 |
| 24 | 600764 | 中国海防 | 2,000,037 | 54,441,007.14 | 1.32 |
| 25 | 688018 | 乐鑫科技 | 400,018 | 51,930,336.76 | 1.26 |
| 26 | 688099 | 晶晨股份 | 600,094 | 50,599,926.08 | 1.23 |
| 27 | 600339 | 中油工程 | 12,000,046 | 48,840,187.22 | 1.18 |
| 28 | 000928 | 中钢国际 | 5,000,000 | 48,250,000.00 | 1.17 |
| 29 | 688169 | 石头科技 | 150,000 | 48,102,000.00 | 1.17 |
| 30 | 000503 | 国新健康 | 4,000,000 | 47,960,000.00 | 1.16 |
| 31 | 300762 | 上海瀚讯 | 4,000,039 | 47,080,459.03 | 1.14 |
| 32 | 002929 | 润建股份 | 1,000,000 | 43,410,000.00 | 1.05 |
| 33 | 002463 | 沪电股份 | 2,000,060 | 41,881,256.40 | 1.02 |
| 34 | 688981 | 中芯国际 | 800,000 | 40,416,000.00 | 0.98 |
| 35 | 688132 | 邦彦技术 | 800,044 | 21,745,195.92 | 0.53 |
| 36 | 01675 | 亚信科技 | 2,010,000 | 20,199,659.82 | 0.49 |
| 37 | 603189 | 网达软件 | 1,200,000 | 17,628,000.00 | 0.43 |
| 38 | 600419 | 天润乳业 | 980,980 | 15,911,495.60 | 0.39 |
| 39 | 688175 | 高凌信息 | 136,886 | 4,533,664.32 | 0.11 |
| 40 | 601728 | 中国电信 | 522,200 | 2,939,986.00 | 0.07 |
| 41 | 301486 | 致尚科技 | 4,820 | 277,921.20 | 0.01 |
| 42 | 688249 | 晶合集成 | 7,405 | 133,734.30 | 0.00 |
| 43 | 301292 | 海科新源 | 5,824 | 116,421.76 | 0.00 |
| 44 | 688472 | 阿特斯 | 6,261 | 106,687.44 | 0.00 |
| 45 | 301488 | 豪恩汽电 | 2,618 | 104,144.04 | 0.00 |
| 46 | 301358 | 湖南裕能 | 2,023 | 86,766.47 | 0.00 |
| 47 | 301202 | 朗威股份 | 3,060 | 79,009.20 | 0.00 |
| 48 | 688603 | 天承科技 | 1,391 | 76,505.00 | 0.00 |
| 49 | 688469 | 中芯集成 | 13,800 | 74,658.00 | 0.00 |
| 50 | 301261 | 恒工精密 | 1,973 | 72,803.70 | 0.00 |
| 51 | 688361 | 中科飞测 | 831 | 53,740.77 | 0.00 |
| 52 | 688531 | 日联科技 | 346 | 47,045.62 | 0.00 |
| 53 | 301325 | 曼恩斯特 | 364 | 39,293.80 | 0.00 |
| 54 | 688146 | 中船特气 | 1,011 | 38,549.43 | 0.00 |
| 55 | 001286 | 陕西能源 | 3,767 | 35,447.47 | 0.00 |
| 56 | 301301 | 川宁生物 | 3,574 | 32,023.04 | 0.00 |
| 57 | 601061 | 中信金属 | 4,016 | 30,441.28 | 0.00 |
| 58 | 001287 | 中电港 | 1,386 | 29,133.72 | 0.00 |
| 59 | 301246 | 宏源药业 | 931 | 28,591.01 | 0.00 |
| 60 | 688352 | 颀中科技 | 2,361 | 28,497.27 | 0.00 |
| 61 | 688507 | 索辰科技 | 222 | 27,108.42 | 0.00 |
| 62 | 688582 | 芯动联科 | 648 | 26,360.64 | 0.00 |
| 63 | 301293 | 三博脑科 | 333 | 23,782.86 | 0.00 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-------|-----------|------|
| 64 | 688570 | 天玛智控 | 884 | 22,391.72 | 0.00 |
| 65 | 688543 | 国科军工 | 410 | 21,750.50 | 0.00 |
| 66 | 301322 | 绿通科技 | 392 | 20,870.08 | 0.00 |
| 67 | 688458 | 美芯晟 | 221 | 20,057.96 | 0.00 |
| 68 | 688581 | 安杰思 | 163 | 19,238.89 | 0.00 |
| 69 | 688478 | 晶升股份 | 402 | 17,032.74 | 0.00 |
| 70 | 688562 | 航天软件 | 726 | 16,197.06 | 0.00 |
| 71 | 301439 | 泓淋电力 | 949 | 16,038.10 | 0.00 |
| 72 | 688623 | 双元科技 | 178 | 15,448.62 | 0.00 |
| 73 | 301332 | 德尔玛 | 1,122 | 15,405.06 | 0.00 |
| 74 | 301408 | 华人健康 | 879 | 14,899.05 | 0.00 |
| 75 | 301305 | 朗坤环境 | 753 | 14,826.57 | 0.00 |
| 76 | 301419 | 阿莱德 | 330 | 14,470.50 | 0.00 |
| 77 | 688334 | 西高院 | 888 | 14,394.48 | 0.00 |
| 78 | 688593 | 新相微 | 959 | 13,991.81 | 0.00 |
| 79 | 688512 | 慧智微 | 721 | 13,814.36 | 0.00 |
| 80 | 301320 | 豪江智能 | 642 | 13,238.04 | 0.00 |
| 81 | 688433 | 华曙高科 | 418 | 13,167.00 | 0.00 |
| 82 | 688629 | 华丰科技 | 708 | 13,161.72 | 0.00 |
| 83 | 688620 | 安凯微 | 1,016 | 12,537.44 | 0.00 |
| 84 | 301360 | 荣旗科技 | 134 | 12,408.40 | 0.00 |
| 85 | 301345 | 涛涛车业 | 266 | 12,406.24 | 0.00 |
| 86 | 301315 | 威士顿 | 226 | 11,553.12 | 0.00 |
| 87 | 688523 | 航天环宇 | 472 | 11,257.20 | 0.00 |
| 88 | 301141 | 中科磁业 | 262 | 11,184.78 | 0.00 |
| 89 | 601065 | 江盐集团 | 875 | 10,360.00 | 0.00 |
| 90 | 688631 | 莱斯信息 | 336 | 10,036.32 | 0.00 |
| 91 | 688479 | 友车科技 | 332 | 9,790.68 | 0.00 |
| 92 | 301232 | 飞沃科技 | 165 | 9,639.30 | 0.00 |
| 93 | 301376 | 致欧科技 | 420 | 9,454.20 | 0.00 |
| 94 | 301355 | 南王科技 | 563 | 9,430.25 | 0.00 |
| 95 | 301357 | 北方长龙 | 190 | 9,194.10 | 0.00 |
| 96 | 301386 | 未来电器 | 378 | 8,992.62 | 0.00 |
| 97 | 301323 | 新莱福 | 228 | 8,974.08 | 0.00 |
| 98 | 688429 | 时创能源 | 346 | 8,833.38 | 0.00 |
| 99 | 301373 | 凌玮科技 | 277 | 8,822.45 | 0.00 |
| 100 | 301170 | 锡南科技 | 250 | 8,732.50 | 0.00 |
| 101 | 688535 | 华海诚科 | 161 | 8,248.03 | 0.00 |
| 102 | 601133 | 柏诚股份 | 664 | 8,140.64 | 0.00 |
| 103 | 301157 | 华塑科技 | 150 | 7,939.50 | 0.00 |
| 104 | 301295 | 美硕科技 | 215 | 7,755.05 | 0.00 |
| 105 | 301203 | 国泰环保 | 225 | 7,740.00 | 0.00 |
| 106 | 300804 | 广康生化 | 226 | 7,451.22 | 0.00 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-----|----------|------|
| 107 | 301337 | 亚华电子 | 232 | 7,045.84 | 0.00 |
| 108 | 301428 | 世纪恒通 | 229 | 7,007.40 | 0.00 |
| 109 | 001380 | 华纬科技 | 170 | 5,232.60 | 0.00 |
| 110 | 603125 | 常青科技 | 160 | 3,924.80 | 0.00 |
| 111 | 001328 | 登康口腔 | 145 | 3,696.05 | 0.00 |
| 112 | 001282 | 三联锻造 | 105 | 3,468.15 | 0.00 |
| 113 | 001360 | 南矿集团 | 177 | 2,631.99 | 0.00 |
| 114 | 603137 | 恒尚节能 | 139 | 2,375.51 | 0.00 |
| 115 | 001324 | 长青科技 | 114 | 2,234.40 | 0.00 |
| 116 | 001367 | 海森药业 | 55 | 2,171.40 | 0.00 |
| 117 | 603172 | 万丰股份 | 122 | 1,967.86 | 0.00 |
| 118 | 601233 | 桐昆股份 | 136 | 1,802.00 | 0.00 |
| 119 | 600256 | 广汇能源 | 50 | 343.00 | 0.00 |
| 120 | 00639 | 首钢资源 | 75 | 136.22 | 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 | 600026 | 中远海能 | 340,485,376.35 | 24.52 |
| 2 | 01138 | 中远海能 | 63,893,351.39 | 4.60 |
| 3 | 688232 | 新点软件 | 275,554,223.42 | 19.85 |
| 4 | 300451 | 创业慧康 | 273,903,761.00 | 19.73 |
| 5 | 600570 | 恒生电子 | 235,077,850.10 | 16.93 |
| 6 | 600150 | 中国船舶 | 230,039,981.03 | 16.57 |
| 7 | 300253 | 卫宁健康 | 223,806,946.19 | 16.12 |
| 8 | 300525 | 博思软件 | 215,778,904.41 | 15.54 |
| 9 | 301117 | 佳缘科技 | 209,262,244.66 | 15.07 |
| 10 | 00268 | 金蝶国际 | 161,950,898.11 | 11.66 |
| 11 | 603056 | 德邦股份 | 153,057,221.27 | 11.02 |
| 12 | 603383 | 顶点软件 | 151,010,668.88 | 10.88 |
| 13 | 688246 | 嘉和美康 | 146,472,613.29 | 10.55 |
| 14 | 688789 | 宏华数科 | 133,926,554.02 | 9.65 |
| 15 | 002840 | 华统股份 | 128,889,115.58 | 9.28 |
| 16 | 601728 | 中国电信 | 128,002,532.00 | 9.22 |
| 17 | 300659 | 中孚信息 | 124,926,172.07 | 9.00 |
| 18 | 688018 | 乐鑫科技 | 118,302,856.07 | 8.52 |
| 19 | 688369 | 致远互联 | 117,771,471.45 | 8.48 |
| 20 | 300986 | 志特新材 | 115,352,072.15 | 8.31 |
| 21 | 603678 | 火炬电子 | 113,890,229.02 | 8.20 |
| 22 | 603477 | 巨星农牧 | 111,019,768.80 | 8.00 |

| | | | | |
|----|--------|------|----------------|------|
| 23 | 600256 | 广汇能源 | 110,817,447.24 | 7.98 |
| 24 | 600754 | 锦江酒店 | 110,314,728.93 | 7.94 |
| 25 | 002439 | 启明星辰 | 110,225,804.32 | 7.94 |
| 26 | 600764 | 中国海防 | 108,846,358.49 | 7.84 |
| 27 | 000768 | 中航西飞 | 99,668,957.96 | 7.18 |
| 28 | 688311 | 盟升电子 | 95,331,224.72 | 6.87 |
| 29 | 603225 | 新凤鸣 | 92,865,239.00 | 6.69 |
| 30 | 601233 | 桐昆股份 | 90,335,406.45 | 6.51 |
| 31 | 300996 | 普联软件 | 85,411,942.00 | 6.15 |
| 32 | 601838 | 成都银行 | 84,737,876.00 | 6.10 |
| 33 | 300677 | 英科医疗 | 77,290,202.76 | 5.57 |
| 34 | 600050 | 中国联通 | 76,962,875.00 | 5.54 |
| 35 | 600941 | 中国移动 | 73,945,291.30 | 5.33 |
| 36 | 002929 | 润建股份 | 68,935,691.72 | 4.96 |
| 37 | 600316 | 洪都航空 | 63,955,386.97 | 4.61 |
| 38 | 600970 | 中材国际 | 63,655,704.00 | 4.58 |
| 39 | 688201 | 信安世纪 | 62,674,147.94 | 4.51 |
| 40 | 600258 | 首旅酒店 | 60,664,735.52 | 4.37 |
| 41 | 603712 | 七一二 | 60,408,475.00 | 4.35 |
| 42 | 600482 | 中国动力 | 55,186,523.00 | 3.97 |
| 43 | 301236 | 软通动力 | 54,657,297.95 | 3.94 |
| 44 | 688175 | 高凌信息 | 54,011,033.76 | 3.89 |
| 45 | 000560 | 我爱我家 | 53,144,988.43 | 3.83 |
| 46 | 688099 | 晶晨股份 | 52,332,244.43 | 3.77 |
| 47 | 002701 | 奥瑞金 | 52,021,455.77 | 3.75 |
| 48 | 603189 | 网达软件 | 51,201,982.00 | 3.69 |
| 49 | 000503 | 国新健康 | 50,902,402.82 | 3.67 |
| 50 | 688169 | 石头科技 | 49,067,024.54 | 3.53 |
| 51 | 605377 | 华旺科技 | 48,023,904.00 | 3.46 |
| 52 | 600037 | 歌华有线 | 47,327,450.83 | 3.41 |
| 53 | 600339 | 中油工程 | 47,286,405.00 | 3.41 |
| 54 | 000928 | 中钢国际 | 46,889,081.00 | 3.38 |
| 55 | 688132 | 邦彦技术 | 46,698,240.29 | 3.36 |
| 56 | 688981 | 中芯国际 | 44,549,646.30 | 3.21 |
| 57 | 003029 | 吉大正元 | 42,799,470.00 | 3.08 |
| 58 | 002463 | 沪电股份 | 41,989,249.30 | 3.02 |
| 59 | 03998 | 波司登 | 41,987,713.56 | 3.02 |
| 60 | 300762 | 上海瀚讯 | 38,283,074.15 | 2.76 |
| 61 | 600419 | 天润乳业 | 35,322,968.20 | 2.54 |
| 62 | 301153 | 中科江南 | 28,857,224.31 | 2.08 |

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 | 600150 | 中国船舶 | 276,915,712.28 | 19.94 |
| 2 | 600570 | 恒生电子 | 195,884,882.24 | 14.11 |
| 3 | 01138 | 中远海能 | 101,675,076.27 | 7.32 |
| 4 | 600026 | 中远海能 | 53,616,220.55 | 3.86 |
| 5 | 603383 | 顶点软件 | 147,320,333.00 | 10.61 |
| 6 | 600941 | 中国移动 | 76,676,344.10 | 5.52 |
| 7 | 00941 | 中国移动 | 65,919,976.55 | 4.75 |
| 8 | 601728 | 中国电信 | 138,344,968.17 | 9.96 |
| 9 | 603477 | 巨星农牧 | 135,404,530.34 | 9.75 |
| 10 | 688369 | 致远互联 | 130,412,408.21 | 9.39 |
| 11 | 688232 | 新点软件 | 115,129,202.18 | 8.29 |
| 12 | 000768 | 中航西飞 | 112,901,727.52 | 8.13 |
| 13 | 600256 | 广汇能源 | 101,761,718.18 | 7.33 |
| 14 | 301236 | 软通动力 | 99,127,628.67 | 7.14 |
| 15 | 301153 | 中科江南 | 96,641,188.78 | 6.96 |
| 16 | 600754 | 锦江酒店 | 95,875,037.80 | 6.90 |
| 17 | 600050 | 中国联通 | 91,171,373.92 | 6.57 |
| 18 | 688111 | 金山办公 | 90,122,950.45 | 6.49 |
| 19 | 003029 | 吉大正元 | 89,493,869.00 | 6.45 |
| 20 | 603225 | 新凤鸣 | 89,294,596.37 | 6.43 |
| 21 | 601233 | 桐昆股份 | 86,675,046.20 | 6.24 |
| 22 | 601838 | 成都银行 | 80,653,263.00 | 5.81 |
| 23 | 300677 | 英科医疗 | 78,447,748.01 | 5.65 |
| 24 | 603678 | 火炬电子 | 76,720,916.68 | 5.53 |
| 25 | 300634 | 彩讯股份 | 71,199,503.80 | 5.13 |
| 26 | 688018 | 乐鑫科技 | 65,786,095.08 | 4.74 |
| 27 | 300253 | 卫宁健康 | 65,146,993.03 | 4.69 |
| 28 | 600482 | 中国动力 | 62,005,177.00 | 4.47 |
| 29 | 603712 | 七一二 | 57,492,383.00 | 4.14 |
| 30 | 600316 | 洪都航空 | 55,567,771.20 | 4.00 |
| 31 | 300659 | 中孚信息 | 54,873,977.62 | 3.95 |
| 32 | 600764 | 中国海防 | 53,455,177.90 | 3.85 |
| 33 | 600258 | 首旅酒店 | 53,154,116.10 | 3.83 |
| 34 | 002439 | 启明星辰 | 48,966,920.00 | 3.53 |
| 35 | 002701 | 奥瑞金 | 47,782,271.70 | 3.44 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 36 | 600037 | 歌华有线 | 47,620,911.63 | 3.43 |
| 37 | 002840 | 华统股份 | 46,109,363.80 | 3.32 |
| 38 | 000560 | 我爱我家 | 45,798,061.31 | 3.30 |
| 39 | 301117 | 佳缘科技 | 41,269,845.19 | 2.97 |
| 40 | 605377 | 华旺科技 | 39,916,896.00 | 2.87 |
| 41 | 688175 | 高凌信息 | 38,753,341.65 | 2.79 |
| 42 | 600419 | 天润乳业 | 35,217,600.00 | 2.54 |
| 43 | 688311 | 盟升电子 | 35,155,214.36 | 2.53 |
| 44 | 688227 | 品高股份 | 32,508,863.98 | 2.34 |
| 45 | 002465 | 海格通信 | 31,378,078.60 | 2.26 |
| 46 | 300996 | 普联软件 | 30,691,574.04 | 2.21 |
| 47 | 000932 | 华菱钢铁 | 28,840,091.00 | 2.08 |
| 48 | 603189 | 网达软件 | 28,291,943.00 | 2.04 |

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

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

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 | 6,599,012,169.22 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 4,065,925,596.13 |

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 | 16,322,314.52 | 0.40 |
| 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 | 16,322,314.52 | 0.40 |

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 | 019663 | 21 国债 15 | 160,000 | 16,322,314.52 | 0.40 |

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

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。通过对股指期货的投资，实现管理市场风险和改善投资组合风险收益特性的目的。

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

本基金参与国债期货投资是为了有效控制债券市场的系统性风险，本基金将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，适度运用国债期货提高投资组合运作效率。在国债期货投资过程中，基金管理人通过对宏观经济和利率市场走势的分析与判断，并充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置，谨慎进行投资，以调整债券组合的久期，降低投资组合的整体风险。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

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德邦股份（证券代码 603056）、中远海能（证券代码 600026）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、德邦股份（证券代码 603056）

根据 2023 年 4 月 14 日发布的相关公告，该证券发行人因未依法履行职责被江苏省邮政管理局给予警示。

根据 2023 年 5 月 9 日发布的相关公告，该证券发行人因财务会计报告违规，信息披露虚假或严重误导性陈述被上海证券交易所通报批评。

2、中远海能（证券代码 600026）

根据 2022 年 9 月 14 日发布的相关公告，该证券发行人因未依法履行职责被中华人民共和国曹妃甸海事局处以罚款。

根据 2022 年 10 月 10 日发布的相关公告，该证券发行人因未依法履行职责被中华人民共和国南疆海事局处以罚款。

根据 2022 年 11 月 15 日发布的相关公告，该证券发行人因未依法履行职责被中华人民共和国浦东海事局给予警告。

根据 2022 年 12 月 7 日发布的相关公告，该证券发行人因未依法履行职责被中华人民共和国浦东海事局处以罚款。

根据 2023 年 3 月 30 日发布的相关公告，该证券发行人因未依法履行职责被中华人民共和国宁波海事局处以罚款。

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 | 1,158,321.15 |
| 2 | 应收清算款 | 97,948,731.49 |
| 3 | 应收股利 | 15.25 |

| | | |
|---|-------|----------------|
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 3,152,558.61 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 102,259,626.50 |

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

| 份额级别 | 持有人户数（户） | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 | | | |
|------------------|----------|-----------|----------------|--------|----------------|--------|
| | | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | | 持有份额 | 占总份额比例 | 持有份额 | 占总份额比例 |
| 招商瑞利灵活配置混合（LOF）A | 162,637 | 8,248.52 | 667,757,550.68 | 49.78% | 673,756,328.07 | 50.22% |
| 招商瑞利灵活配置混合（LOF）C | 9,829 | 34,113.09 | 251,410,754.46 | 74.98% | 83,886,813.92 | 25.02% |
| 合计 | 172,466 | 9,722.56 | 919,168,305.14 | 54.82% | 757,643,141.99 | 45.18% |

注：机构投资者/个人投资者持有份额占总份额比例计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.2 期末上市基金前十名持有人

| 序号 | 持有人名称 | 持有份额（份） | 占上市总份额比例 |
|----|-------|------------|----------|
| 1 | 谢西就 | 755,771.00 | 4.96% |
| 2 | 赵斐 | 500,058.00 | 3.28% |
| 3 | 谷端欣 | 448,876.00 | 2.95% |

| | | | |
|----|-----|------------|-------|
| 4 | 杨凯 | 438,329.00 | 2.88% |
| 5 | 王冰 | 383,638.00 | 2.52% |
| 6 | 狄洪涛 | 381,883.00 | 2.51% |
| 7 | 张琳 | 300,000.00 | 1.97% |
| 8 | 张立 | 231,900.00 | 1.52% |
| 9 | 钱书娟 | 200,009.00 | 1.31% |
| 10 | 黎雄波 | 196,412.00 | 1.29% |

注：以上数据由中国证券登记结算公司提供，持有人为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 份额级别 | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|------------------|------------------|--------------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 招商瑞利灵活配置混合（LOF）A | 2,430,910.00 | 0.1812% |
| | 招商瑞利灵活配置混合（LOF）C | 142,840.53 | 0.0426% |
| | 合计 | 2,573,750.53 | 0.1535% |

注：分级基金机构投资者/个人投资者持有份额占总份额比例计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目 | 份额级别 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 招商瑞利灵活配置混合（LOF）A | 10~50 |
| | 招商瑞利灵活配置混合（LOF）C | 0 |
| | 合计 | 10~50 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 招商瑞利灵活配置混合（LOF）A | 0 |
| | 招商瑞利灵活配置混合（LOF）C | 0 |
| | 合计 | 0 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 招商瑞利灵活配置混合（LOF）A | 招商瑞利灵活配置混合（LOF）C |
|---------------------|------------------|------------------|
| 基金合同生效日(2019年7月18日) | 284,367,630.28 | - |

| | | |
|--------------------------------|------------------|----------------|
| 基金份额总额 | | |
| 本报告期期初基金份额总额 | 602,821,827.39 | - |
| 本报告期基金总申购份额 | 1,922,495,783.85 | 435,921,528.06 |
| 减：报告期基金总赎回份额 | 1,183,803,732.49 | 100,623,959.68 |
| 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 | 1,341,513,878.75 | 335,297,568.38 |

§ 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 | 6,379,596,855.92 | 59.90% | 4,699,093.83 | 55.09% | - |
| 广发证券 | 2 | 1,740,392,949.20 | 16.34% | 1,620,826.83 | 19.00% | - |
| 西部证券 | 1 | 1,111,794,581.56 | 10.44% | 1,035,400.62 | 12.14% | - |
| 中泰证券 | 2 | 683,102,112.40 | 6.41% | 636,181.03 | 7.46% | - |
| 长江证券 | 2 | 399,263,997.71 | 3.75% | 291,987.36 | 3.42% | - |
| 江海证券 | 2 | 336,427,825.34 | 3.16% | 246,031.26 | 2.88% | - |
| 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 | 9,637,317.93 | 100.00% | - | - | - | - |
| 广发证券 | - | - | - | - | - | - |
| 西部证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 长江证券 | - | - | - | - | - | - |
| 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 | 招商瑞利灵活配置混合型证券投资基金（LOF）2022 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 | 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 | 证券时报及基金管理人网站 | 2023-01-18 |
| 3 | 关于招商瑞利灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金经理变更的公告 | 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 | 2023-01-20 |
| 4 | 招商瑞利灵活配置混合型证券投资基金（LOF）更新的招募说明书（二零二三年第一号） | 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 | 2023-02-01 |
| 5 | 招商瑞利灵活配置混合型证券投资基金（LOF）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 | 2023-02-01 |
| 6 | 招商基金管理有限公司关于招商瑞利灵活配置混合型证券投资基金（LOF）增加基金份额类别并修改基金合同和托管协议的公告 | 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 | 2023-02-24 |
| 7 | 招商瑞利灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同（2023 年 2 月 24 日修订） | 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 | 2023-02-24 |
| 8 | 招商瑞利灵活配置混合型证券投资基金（LOF）托管协议（2023 年 2 月 24 日修订） | 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 | 2023-02-24 |
| 9 | 招商瑞利灵活配置混合型证券投资基金（LOF）更新的招募说明书（二零二三年第二号） | 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 | 2023-02-24 |
| 10 | 招商瑞利灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（A 类份额）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 | 2023-02-24 |
| 11 | 招商瑞利灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（C 类份额）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 | 2023-02-24 |
| 12 | 关于暂停招商瑞利灵活配置混合型证券投资基金（LOF）大额申购（含定期定额投资）和转换转入业务的公告 | 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 | 2023-02-25 |
| 13 | 关于调整招商瑞利灵活配置混合型证券投资基金（LOF）大额申购（含定期定额投资）和转换转入业务的公告 | 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 | 2023-03-28 |

| | | | |
|----|--|----------------------------|------------|
| 14 | 招商瑞利灵活配置混合型证券投资基金（LOF）2022 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 | 2023-03-30 |
| 15 | 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 | 证券时报及基金管理人网站 | 2023-03-30 |
| 16 | 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 | 证券时报及基金管理人网站 | 2023-04-21 |
| 17 | 招商瑞利灵活配置混合型证券投资基金（LOF）2023 年第 1 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 | 2023-04-21 |
| 18 | 招商基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告 | 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 | 2023-05-11 |
| 19 | 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 | 2023-05-12 |
| 20 | 招商基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告 | 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 | 2023-05-16 |
| 21 | 关于调整招商瑞利灵活配置混合型证券投资基金（LOF）大额申购（含定期定额投资）和转换转入业务的公告 | 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 | 2023-05-30 |
| 22 | 招商基金管理有限公司关于招商瑞利灵活配置混合型证券投资基金（LOF）A 类基金份额在交通银行恢复原申购费率的公告 | 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 | 2023-06-01 |
| 23 | 招商基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告 | 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 | 2023-06-22 |

§ 11 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瑞利灵活配置混合型证券投资基金（LOF）设立的文件；
- 3、《招商瑞利灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 4、《招商瑞利灵活配置混合型证券投资基金（LOF）托管协议》；
- 5、《招商瑞利灵活配置混合型证券投资基金（LOF）招募说明书》；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照。

11.1 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

11.2 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