

# 招商资管睿丰三个月持有期债券型集合资产管理计划

## 2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人:招商证券资产管理有限公司

基金托管人:中信银行股份有限公司

送出日期:2024 年 03 月 25 日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

集合计划托管人中信银行股份有限公司根据本集合计划合同规定，于2024年3月22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。

集合计划管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划资产，但不保证集合计划一定盈利。

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

根据《证券公司大集合资产管理业务适用<关于规范金融机构资产管理业务的指导意见>操作指引》，本集合计划于2021年2月2日合同变更生效。本集合计划按照相关规定，参照公募基金管理运作。

本报告中财务资料已经审计。德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）为本集合计划出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自2023年1月1日起至2023年12月31日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	12
§4 管理人报告	13
4.1 基金管理人及基金经理情况	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	18
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	18
§5 托管人报告	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	18
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	18
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	18
§6 审计报告	18
6.1 审计报告基本信息	18
6.2 审计报告的基本内容	19
§7 年度财务报表	21
7.1 资产负债表	21
7.2 利润表	23
7.3 净资产变动表	25
7.4 报表附注	27
§8 投资组合报告	59
8.1 期末基金资产组合情况	59
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	60
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	60
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	60
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	60
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	61
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	61
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	61
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	61
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	61

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	61
8.12 投资组合报告附注.....	62
§9 基金份额持有人信息.....	64
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	64
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	64
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	65
§10 开放式基金份额变动.....	65
§11 重大事件揭示.....	66
11.1 基金份额持有人大会决议.....	66
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	66
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	66
11.4 基金投资策略的改变.....	66
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	67
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	67
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	67
11.8 其他重大事件.....	68
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	71
12.1 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.....	71
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	71
§13 备查文件目录.....	71
13.1 备查文件目录.....	71
13.2 存放地点.....	72
13.3 查阅方式.....	72

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	招商资管睿丰三个月持有期债券型集合资产管理计划		
基金简称	招商资管睿丰三个月持有期债券		
基金主代码	880009		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2021年02月02日		
基金管理人	招商证券资产管理有限公司		
基金托管人	中信银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	147,036,651.30份		
基金合同存续期	本集合计划自本集合计划合同变更生效日起存续期不得超过3年。本集合计划自集合计划合同变更生效日起3年后，按照中国证监会有关规定执行。		
下属分级基金的基金简称	招商资管睿丰 三个月持有期 债券D	招商资管睿丰 三个月持有期 债券A	招商资管睿丰 三个月持有期 债券C
下属分级基金的交易代码	880009	881010	881011
报告期末下属分级基金的份额总额	12,415,731.35 份	73,972,181.88 份	60,648,738.07 份

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

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本集合计划主要投资于具有良好流动性的债券类资产及现金管理类工具，在控制投资风险前提下，努力为委托人谋求收益，实现集合计划资产的长期稳定增值。
投资策略	本集合计划通过对债券类资产和现金类资产的合理配置实现严控风险、稳健增值的目的。本集合计划

	主要投资于各种债券类品种以及现金管理类金融产品。同时，管理人会在分析宏观经济、政府经济政策变化及证券市场趋势的基础上，动态调整集合计划的资产配置。具体包括：（1）资产配置策略；（2）债券投资策略；（3）资产支持证券投资策略；（4）现金管理类投资策略；（5）国债期货投资策略。
业绩比较基准	中债-综合全价(1-3年)指数收益率*100%
风险收益特征	本集合计划是债券型集合资产管理计划，预期风险和预期收益与债券型基金相同，高于货币市场基金，低于股票型基金、混合型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	招商证券资产管理有限公司	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	唐佳强
	联系电话	0755-26951111
	电子邮箱	tangjq@cmschina.com.cn
客户服务电话	95565	95558
传真	-	010-85230024
注册地址	深圳市前海深港合作区南山街道听海大道5059号前海鸿荣源中心A座2501	北京市朝阳区光华路10号院1号楼6-30层、32-42层
办公地址	深圳市福田区福华一路111号招商证券大厦17、18楼	北京市朝阳区光华路10号院1号楼6-30层、32-42层
邮政编码	518026	100020
法定代表人	杨阳	方合英

### 2.4 信息披露方式

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

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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)	中国上海市黄浦区延安东路222号外滩中心30楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区锦什坊街26号

## §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2023年			2022年			2021年02月02日 (基金合同生效日)-2021年12月31日		
	招商资管睿丰三个月持有期债券D	招商资管睿丰三个月持有期债券A	招商资管睿丰三个月持有期债券C	招商资管睿丰三个月持有期债券D	招商资管睿丰三个月持有期债券A	招商资管睿丰三个月持有期债券C	招商资管睿丰三个月持有期债券D	招商资管睿丰三个月持有期债券A	招商资管睿丰三个月持有期债券C
本期已实现收益	126,311.79	1,763,608.86	1,803,770.08	284,809.22	10,218,896.83	7,140,576.46	248,972.74	8,526,068.51	5,321,758.37
本期利润	280,586.21	4,138,482.76	4,380,140.09	174,370.56	6,101,684.02	3,291,981.32	361,702.28	10,507,508.60	6,272,210.41
加权平均基金份额本期利润	0.0219	0.0378	0.0342	0.0122	0.0160	0.0103	0.0213	0.0288	0.0248

本期加权平均净值利润率	1.9 9%	3.5 5%	3.2 4%	1.1 2%	1.5 3%	0.9 9%	2.0 0%	2.8 3%	2.4 4%
本期基金份额净值增长率	1.9 7%	2.9 1%	2.5 9%	1.0 5%	1.9 5%	1.6 6%	2.0 4%	2.8 7%	2.5 8%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	2023年末			2022年末			2021年末		
期末可供分配利润	1,37 3,95 7.24	5,19 7,87 3.40	3,68 9,62 0.44	1,20 2,73 2.96	17,26 6,51 0.31	12,1 88,7 21.6 0	1,16 3,69 1.72	6,71 6,30 8.27	6,06 7,36 7.19
期末可供分配基金份额利润	0.110 7	0.070 3	0.06 08	0.089 2	0.048 8	0.04 28	0.077 9	0.022 8	0.02 00
期末基金资产净值	13,78 9,68 8.59	79,83 5,90 7.83	64,8 82,3 71.9 0	14,69 0,56 8.45	370,7 30,53 7.89	296, 810, 647. 74	16,10 7,69 4.24	302,5 75,11 7.46	311, 433, 124. 47
期末基金份额净值	1.110 7	1.079 3	1.06 98	1.089 2	1.048 8	1.04 28	1.077 9	1.028 7	1.02 58
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	2023年末			2022年末			2021年末		
基金份额累计净值增长率	5.1 4%	7.9 3%	6.9 8%	3.1 0%	4.8 8%	4.2 8%	2.0 4%	2.8 7%	2.5 8%

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

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

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

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

招商资管睿丰三个月持有期债券D

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标	业绩比较 基准收益	业绩比较 基准收益	①-③	②-④
----	--------------	--------------	--------------	--------------	-----	-----



		准差②	率③	率标准差④		
过去三个月	0.15%	0.03%	0.29%	0.03%	-0.14%	0.00%
过去六个月	0.33%	0.03%	0.04%	0.03%	0.29%	0.00%
过去一年	1.97%	0.03%	0.59%	0.03%	1.38%	0.00%
自基金合同生效起至今	5.14%	0.03%	0.61%	0.03%	4.53%	0.00%

## 招商资管睿丰三个月持有期债券A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.37%	0.03%	0.29%	0.03%	0.08%	0.00%
过去六个月	0.78%	0.03%	0.04%	0.03%	0.74%	0.00%
过去一年	2.91%	0.03%	0.59%	0.03%	2.32%	0.00%
自基金合同生效起至今	7.93%	0.03%	0.61%	0.03%	7.32%	0.00%

## 招商资管睿丰三个月持有期债券C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.30%	0.03%	0.29%	0.03%	0.01%	0.00%
过去六个月	0.63%	0.03%	0.04%	0.03%	0.59%	0.00%
过去一年	2.59%	0.03%	0.59%	0.03%	2.00%	0.00%
自基金合同生效起至今	6.98%	0.03%	0.61%	0.03%	6.37%	0.00%

注：（1）本集合计划属于债券型集合资产管理计划，本集合计划业绩比较基准为“中债-综合全价（1-3年）指数收益率”；

（2）本集合计划对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

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

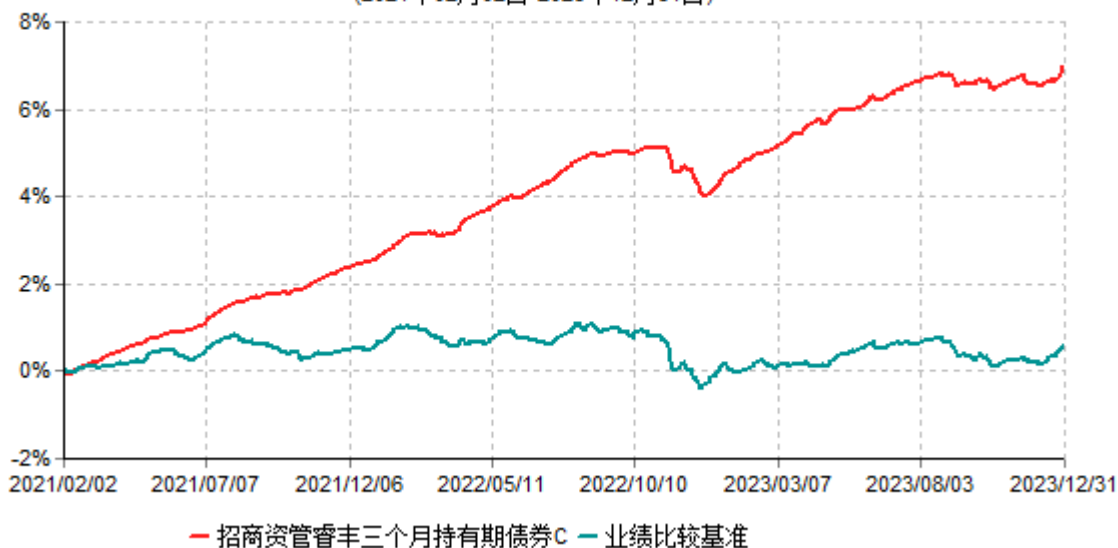
招商资管睿丰三个月持有期债券D累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2021年02月02日-2023年12月31日)



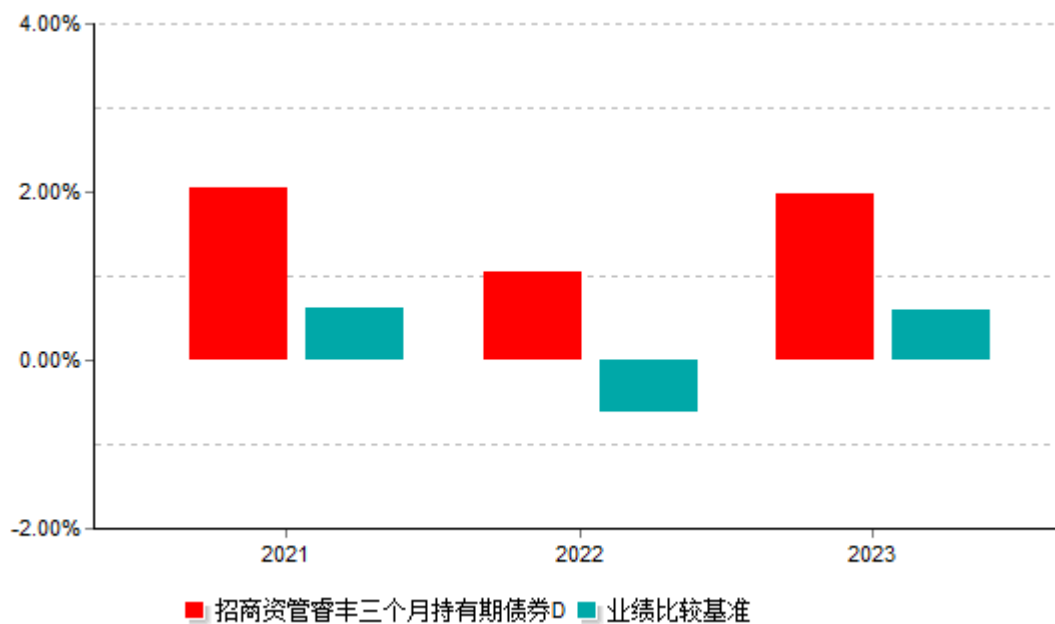
招商资管睿丰三个月持有期债券A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2021年02月02日-2023年12月31日)



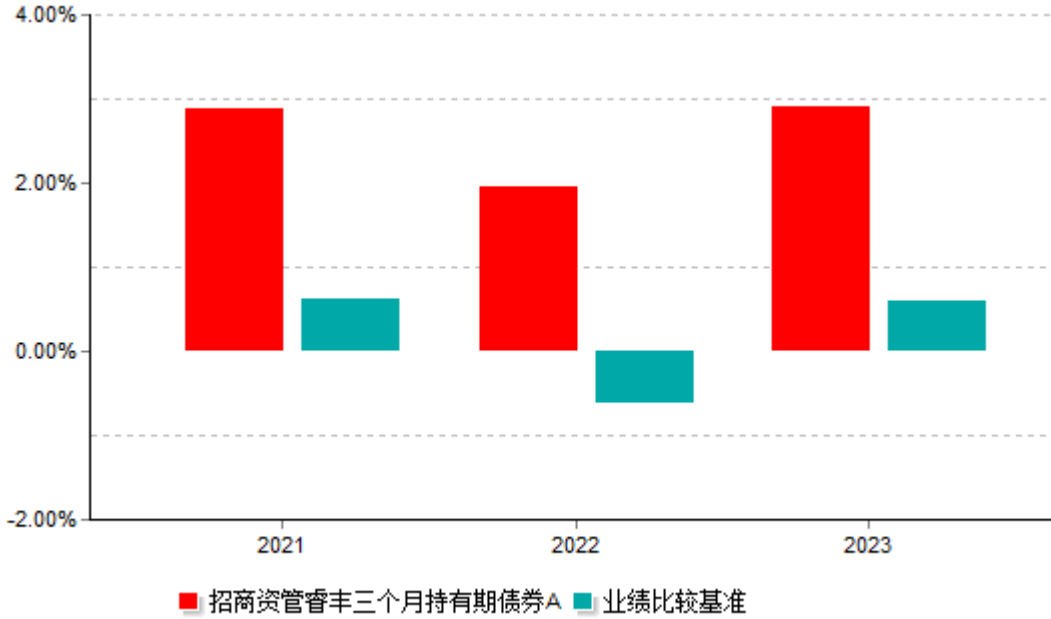
招商资管睿丰三个月持有期债券C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2021年02月02日-2023年12月31日)



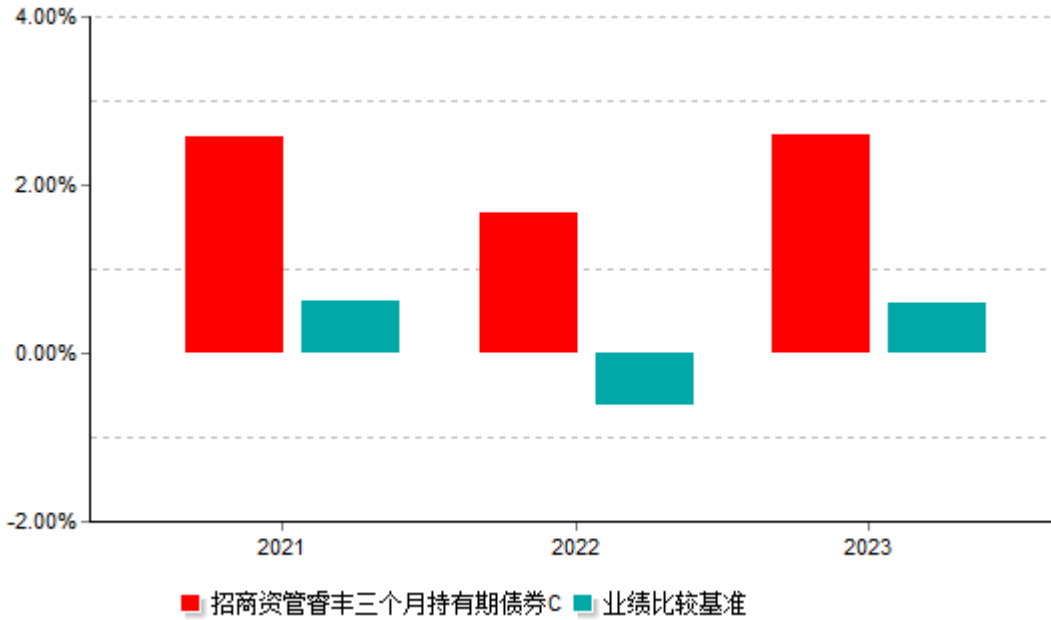
### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本集合计划合同于2021年2月2日生效，合同生效当年期间的相关数据和指标按实际存续期计算。



注：本集合计划合同于2021年2月2日生效，合同生效当年期间的相关数据和指标按实际存续期计算。



注：本集合计划合同于2021年2月2日生效，合同生效当年期间的相关数据和指标按实际存续期计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本集合计划自合同变更生效日（2021年2月2日）至本报告期末，未进行利润分配。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

招商证券资产管理有限公司（以下简称“招商资管”）经中国证券监督管理委员会批准（《关于核准招商证券股份有限公司设立资产管理子公司的批复》（证监许可〔2015〕123号）），于2015年4月成立，是招商证券股份有限公司全资子公司。注册资本10亿元，业务范围为证券资产管理业务。

招商资管作为招商证券股份有限公司100%控股的资管子公司，前身是招商证券资产管理总部，国内最早获得受托资产管理、创新试点、QDII资格的券商资产管理之一，业务实力长期居于行业第一梯队。

招商资管现有投资、策略、研究、交易专业人员数十位，多数拥有名校或海外教育背景，部分拥有在全球著名资产管理机构的专业工作经验。主要投资管理人员均具有多年研究及投资经历，在市场起伏中积累了丰富理论和实战经验，形成了较为成熟的投资理念和稳健的投资风格。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
郑少亮	本集合计划的基金经理	2021-02-02	-	7	北京大学硕士，拥有超过10年固定收益投研经验，现任公募投资部基金经理。2010年至2016年曾就职于招商银行股份有限公司总行金融市场部、资产管理部，从事国内外市场固定收益领域的研究及理财资金的投资管理工作；2017年加入本公司，从事固定收益类产品的投资管理工作。担任【招商资管睿丰三个月持有期债券型集合资产管理计划】基金经理（自2021年2月2日起任职）、【招商资管招朝鑫中短债债券型集合资产管理计划】基金

					经理（自2022年7月29日起任职）。
--	--	--	--	--	---------------------

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

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

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

本报告期末，本集合计划不存在基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情形。

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

本报告期内，本集合计划基金经理不存在兼任情况，亦不存在薪酬激励与私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩表现挂钩的情况。

### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《资产管理业务公平交易制度》，内容主要包括公平交易的适用范围、公平交易的原则和措施、公平交易执行、公平交易监测及报告等。

公平交易制度所规范的范围涵盖旗下各类资产组合，围绕境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，同时应包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。公平交易的原则包括：以资产委托人利益为重、公平的对待不同的资产委托人、严禁利益输送。

公平交易的实现措施和执行程序主要包括：为保证各投资组合在投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会，集合计划管理人合理设置各类资产管理业务之间以及各类资产管理业务内部的组织结构，在保证投资管理各投资组合的投资决策相对独立性的同时，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；建立科学的投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制；通过对投资交易

行为的监控、分析评估和披露来加强对公平交易过程和结果的监督；不断完善研究方法和投资决策流程，提高投资决策的科学性和客观性；健全投资授权制度，明确投资管理权限划分，合理确定各基金经理的投资权限；建立系统的交易方法。

集合计划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，相关基金经理需要提供决策依据，并留存记录备查。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本集合计划管理人通过合理设立组织架构，建立科学的投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，对投资交易行为的监控、分析评估，公平对待不同投资组合。

本集合计划管理人不断完善研究方法和投资决策流程，建立投资备选库和投资授权制度，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序，不同投资组合经理之间的持仓和交易重大非公开投资信息相互隔离，实行集中交易制度，遵循公平交易的原则。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好，在研究分析、投资决策、交易执行等各个环节，公平对待旗下所有投资组合。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未发生同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易。

本报告期内，未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023年债券市场总体走牛，长短端表现有所分化，短端利率呈先下后上的V型走势，长端则在年初小幅走高后持续下行，曲线呈牛平形态，全年各类利差持续压缩。2023年初债市延续“复苏预期”交易路径，长端利率冲高形成年内高点，但1月份之后经济修复从“强预期”转向“弱现实”、资金面长期维持宽松、机构“资产荒”的逻辑持续演绎，债牛趋势逐渐确立，收益率一路震荡下行至三季度。7月份政治局会议提出“加大宏观政策力度”，尤其对地产行业政策发生明显转变，导致收益率快速反弹。8月份开始长短端利率走势分化，长端受中旬央行超预期降息刺激下行至历史低点，短端受资金面收敛影响开始转为上行。之后受楼市放松多项政策出台、资金面有所收敛、地方债加速发行以及汇率承压影响，加上机构止盈和预防赎回操作等多重利空因素持续压制债市表现，收益率震荡调整。12月中旬在降息预期推动下机构抢跑开启配置行情，尤其中下

旬新一轮存款降息落地点燃债市情绪，长端先行短端接力走强，收益率快速陡峭化下行至年内低位。

在投资运作上，产品坚持稳健低波策略。一季度产品随着中短信用债券回暖逐步减持部分城投持仓以压降城投比例，置换买入利率债提升组合久期，同时动态调整转债仓位，先减后增，总体提升转债占组合比重。二、三季度继续调整组合结构，减持部分城投持仓，置换买入中短期限金融债券维持仓位水平，同时利用利率债进行波段交易；减持部分转债仓位以降低市场波动对产品净值的影响。四季度增配部分中短期限金融债券，同时利用利率债进行波段操作，转债资产则调整了部分持仓至双低及周期品种。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末招商资管睿丰三个月持有期债券D基金份额净值为1.1107元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.97%，同期业绩比较基准收益率为0.59%；截至报告期末招商资管睿丰三个月持有期债券A基金份额净值为1.0793元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为2.91%，同期业绩比较基准收益率为0.59%；截至报告期末招商资管睿丰三个月持有期债券C基金份额净值为1.0698元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为2.59%，同期业绩比较基准收益率为0.59%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，短期内基本面大势尚未观察到转向依据，最新PMI及通胀数据依然显示需求偏弱，而中央经济工作会议也没有释放强刺激信号：明年财政政策“适度加力、提质增效”，货币政策“灵活适度、精准有效”。面对需求侧偏弱、物价水平偏低的宏观背景，倾向于认为目前宽松的货币政策没有转向的基础，预计仍将配合财政政策而保持相对宽松，但重点将转向精准有效、盘活存量、提高效率等结构性措施。总体而言，增长不稳、预期偏弱、财政温和、通胀低位、货币易松难紧等宏观场景均对于债券资产相对友好，债市大趋势未变。但12月以来降息预期下机构配置盘的抢跑已较大程度对行情进行透支，短期市场恐将面临一定的回调压力，不过基本面和资产荒决定了回调幅度有限。后续利率再次突破下限的关键约束一是需要降息引导资金利率下行，二是存款利率需要继续下调降低银行负债成本，基准情景假设下预计2024年上半年仍会看到上述操作，遇调整仍可择机参与。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本集合计划管理人从维护集合计划份额持有人利益、保障集合计划合规运作角度出发，积极推动主动、全面的合规管理，持续完善内控机制，进一步加强内部风险的控制与防范的有效性。报告期内，主要从以下几个方面落实合规管理、强化监察稽核职能：

##### 1、持续完善内部控制体系



公司根据法律法规和监管机构的各项要求，对公司制定的各项规章制度、操作流程和业务系统功能、各部门协作等方面进行持续修订和优化，不断夯实以资产管理业务为主线的内控及风险管理体系。

## 2、强化业务合规审查

加强公司和集合计划日常运作的合规审核。做好集合计划产品开发、新投资品种及其他创新业务中法律、合规及风险控制方面的支持，坚持对投资、研究、交易、销售等各项业务实施事前、事中、事后的合规性审核。

## 3、加强投资合规监控

公司严格遵照法律法规、集合计划合同和公司制度要求对日常投资运作进行管理和监控，对集合计划运作合规情况进行监控并跟踪分析异常指标，及时沟通及风险提示，全方位防范控制集合计划运作风险。

## 4、开展各项稽核审计工作

公司根据监管要求组织开展内部审计、专项稽核，排查业务风险隐患，主动发现自身管理中的不足，促进公司整体业务合规运作、稳健经营。此外，积极配合监管检查与年度外部中介机构的评估和审计工作，通过问题反馈、实施整改，进一步完善公司内部控制管理机制。

## 5、持续合规督导与培训

通过组织合规培训、推送资管业务动态、法律法规、监管政策跟踪研究等形式加强对员工的合规教育，提升员工合规遵从意识，推动公司合规文化建设。

本集合计划管理人承诺将坚持诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划资产，积极健全内部管理制度，不断提高监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，切实保障法律法规、监管要求和各项规章制度的落实，保证集合计划合同得到严格履行，保护集合计划份额持有人的合法权益。

## 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本集合计划本报告期未进行利润分配。

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

本报告期内，本集合计划未出现连续二十个工作日集合计划份额持有人数量不满二百人或者集合计划资产净值低于五千万元的情形。

### §5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

作为本集合计划的托管人，中信银行严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对招商资管睿丰三个月持有期债券型集合资产管理计划2023年的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，招商证券资产管理有限公司在招商资管睿丰三个月持有期债券型集合资产管理计划的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，招商证券资产管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的2023年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

### §6 审计报告

#### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
------------	---

审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	德师报(审)字(24)第P00824号

## 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	招商资管睿丰三个月持有期债券型集合资产管理计划全体持有人
审计意见	我们审计了招商资管睿丰三个月持有期债券型集合资产管理计划的财务报表，包括2023年12月31日的资产负债表，2023年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于资产管理行业实务操作的有关规定编制，公允反映了招商资管睿丰三个月持有期债券型集合资产管理计划2023年12月31日的财务状况以及2023年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于招商资管睿丰三个月持有期债券型集合资产管理计划，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	招商证券资产管理有限公司(以下简称“资产管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括招商资管睿丰三个月持有期债券型集合资产管理计划年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任

	<p>何形式的鉴证结论。结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>资产管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于资产管理行业实务操作的有关规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。在编制财务报表时，资产管理人管理层负责评估招商资管睿丰三个月持有期债券型集合资产管理计划的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非资产管理人管理层计划清算招商资管睿丰三个月持有期债券型集合资产管理计划、终止运营或别无其他现实的选择。资产管理人治理层负责监督招商资管睿丰三个月持有期债券型集合资产管理计划的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：(1)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，</p>

	<p>作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。(2)了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。(3)评价资产管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。(4)对资产管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对招商资管睿丰三个月持有期债券型集合资产管理计划持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致招商资管睿丰三个月持有期债券型集合资产管理计划不能持续经营。(5)评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与资产管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	洪锐明	周瀚林
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区延安东路222号外滩中心30楼	
审计报告日期	2024-03-21	

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：招商资管睿丰三个月持有期债券型集合资产管理计划

报告截止日：2023年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	721,461.58	11,805,861.46
结算备付金		1,792,722.55	6,649,273.22
存出保证金		83,630.38	205,161.39
交易性金融资产	7.4.7.2	181,686,053.69	822,365,048.53
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		181,686,053.69	812,322,524.42
资产支持证券投资		-	10,042,524.11
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收清算款		1,994,882.21	1,031,102.05
应收股利		-	-
应收申购款		50,020.95	3,326.98
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		186,328,771.36	842,059,773.63
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年12月31日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-

卖出回购金融资产款		24,997,002.54	156,832,541.61
应付清算款		506,872.05	-
应付赎回款		2,083,888.23	2,310,183.31
应付管理人报酬		52,712.08	206,157.17
应付托管费		14,066.76	64,954.47
应付销售服务费		17,864.04	197,648.62
应付投资顾问费		-	-
应交税费		3,419.79	42,708.16
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	144,977.55	173,826.21
负债合计		27,820,803.04	159,828,019.55
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.7	147,036,651.30	651,573,789.21
未分配利润	7.4.7.8	11,471,317.02	30,657,964.87
净资产合计		158,507,968.32	682,231,754.08
负债和净资产总计		186,328,771.36	842,059,773.63

注：（1）报告截止日2023年12月31日，招商资管睿丰三个月持有期债券A份额净值1.0793元，集合计划份额总额73,972,181.88份；招商资管睿丰三个月持有期债券C份额净值1.0698元，集合计划份额总额60,648,738.07份；招商资管睿丰三个月持有期债券D份额净值1.1107元，集合计划份额总额12,415,731.35份；总份额合计147,036,651.30份。（2）截至报告期末，招商资管睿丰三个月持有期债券D份额未达到业绩报酬计提标准，无暂估业绩报酬金额。

## 7.2 利润表

会计主体：招商资管睿丰三个月持有期债券型集合资产管理计划

本报告期：2023年01月01日至2023年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2023年01月01日至2023年12月31日	2022年01月01日至2022年12月31日
一、营业总收入		11,044,096.20	15,094,989.48

1.利息收入		180,488.32	489,421.33
其中：存款利息收入	7.4.7.9	115,374.33	294,966.76
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		65,113.99	194,454.57
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		5,758,089.55	22,308,214.76
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-	-
基金投资收益	7.4.7.11	-	-
债券投资收益	7.4.7.12	5,801,633.82	21,963,181.18
资产支持证券投资	7.4.7.13	37,012.72	424,654.44
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-80,556.99	-79,620.86
股利收益	7.4.7.16	-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	5,105,518.33	-8,076,246.61
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-	373,600.00
<b>减：二、营业总支出</b>		2,244,887.14	5,526,953.58
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	939,067.98	2,382,559.09
2.托管费	7.4.10.2.2	270,638.46	747,281.19
3.销售服务费	7.4.10.2.3	413,276.54	999,085.89
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		428,417.41	1,076,768.20



其中：卖出回购金融资产支出		428,417.41	1,076,768.20
6.信用减值损失	7.4.7.19	-	-
7.税金及附加		13,769.48	66,465.94
8.其他费用	7.4.7.20	179,717.27	254,793.27
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		8,799,209.06	9,568,035.90
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		8,799,209.06	9,568,035.90
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		8,799,209.06	9,568,035.90

### 7.3 净资产变动表

会计主体：招商资管睿丰三个月持有期债券型集合资产管理计划

本报告期：2023年01月01日至2023年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	651,573,789.21	30,657,964.87	682,231,754.08
二、本期期初净资产	651,573,789.21	30,657,964.87	682,231,754.08
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-504,537,137.91	-19,186,647.85	-523,723,785.76
(一)、综合收益总额	-	8,799,209.06	8,799,209.06
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-504,537,137.91	-27,985,856.91	-532,522,994.82
其中：1.基金申购款	74,753,790.93	4,682,662.12	79,436,453.05

2.基金赎回款	-579,290,928.84	-32,668,519.03	-611,959,447.87
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动 (净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	147,036,651.30	11,471,317.02	158,507,968.32
项目	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	612,670,838.56	17,445,097.61	630,115,936.17
二、本期期初净资产	612,670,838.56	17,445,097.61	630,115,936.17
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	38,902,950.65	13,212,867.26	52,115,817.91
(一)、综合收益总额	-	9,568,035.90	9,568,035.90
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	38,902,950.65	3,644,831.36	42,547,782.01
其中：1.基金申购款	1,039,982,542.59	46,267,097.37	1,086,249,639.96
2.基金赎回款	-1,001,079,591.94	-42,622,266.01	-1,043,701,857.95
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动 (净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	651,573,789.21	30,657,964.87	682,231,754.08

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

杨阳

唐佳强

唐佳强

-----

-----

-----

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

招商资管睿丰三个月持有期债券型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）原为招商证券安康添利集合资产管理计划（以下简称“原集合计划”），原集合计划于2010年12月14日经中国证券监督管理委员会证监许可[2010]1820号文核准设立，于2011年3月23日正式成立。原集合计划在募集期间收到有效净参与资金为人民币2,411,701,570.77元，折合认购份额2,411,701,570.77份；参与金额在推广期内产生的利息为人民币1,026,596.56元，折合1,026,596.56份集合计划份额；自有资金参与金额100,000,000.00元，折合100,000,000.00份集合计划份额；以上实收资金共计人民币2,512,728,167.33元，折合2,512,728,167.33份集合计划份额。上述出资业经天职国际会计师事务所有限公司审验，并出具了天职深QJ[2011]337号验资报告。原集合计划成立时集合计划管理人为招商证券股份有限公司（2015年变更为招商证券资产管理有限公司），托管人为中信银行股份有限公司

根据中国证监会于2018年11月28日发布的《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》（证监会公告〔2018〕39号）的规定，招商证券安康添利集合资产管理计划已完成产品的规范验收并向中国证监会申请合同变更。

2021年1月22日，招商证券资产管理有限公司发布公告《关于“招商证券安康添利集合资产管理计划”变更为“招商资管睿丰三个月持有期债券型集合资产管理计划”及其法律文件变更的公告》。

经中国证监会批准，自2021年2月2日起，《招商资管睿丰三个月持有期债券型集合资产管理计划集合资产管理合同》（以下简称“集合计划合同”）生效，原《招商证券安康添利集合资产管理计划集合资产管理合同》自同日起失效。自合同变更生效日起，原招商证券安康添利集合资产管理计划份额变更为招商资管睿丰三个月持有期债券型集合资产管理计划的D类份额。本集合计划自本集合计划合同变更生效日起存续期不得超过3年。

本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括债券（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债、可转换债券（含可分离交易可转债的纯债部分）、可交换债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、国债期货，以及法律法规或中国证监会允许集合计划投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。

## 7.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本集合计划持续经营为基础列报。

## 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本集合计划财务报表符合企业会计准则和中国证监会发布的关于资产管理行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本集合计划2023年12月31日的财务状况以及2023年度的经营成果和净资产变动情况。

## 7.4.4 重要会计政策和会计估计

### 7.4.4.1 会计年度

本集合计划的会计年度为公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。

### 7.4.4.2 记账本位币

本集合计划记账本位币为人民币。

### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

#### (1) 金融资产的分类

根据本集合计划的业务特点和风险管理要求，本集合计划将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产，暂无金融资产划分为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

金融资产的合同条款规定在特定日期产生的现金流量仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付，且本集合计划管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标，则本集合计划将该金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产。此类金融资产主要包括货币资金、各类应收款项、买入返售金融资产等。

不符合分类为以摊余成本计量的金融资产以及以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产条件的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产计入“衍生金融资产”外，其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产计入“交易性金融资产”。

#### (2) 金融负债的分类

本集合计划将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本集合计划暂无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本集合计划成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。对于以常规方式购买或出售金融资产的，在交易日确认将收到的资产和为此将承担的负债，或者在交易日终止确认已出售的资产。金融资产和金融负债在初始确认时以公允价值计量。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券或资产支持证券已到付息期但尚未领取的利息，单独确认为应收项目。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，公允价值变动形成的利得或损失以及与该金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益。以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，发生减值或终止确认产生的利得或损失，计入当期损益。

本集合计划对分类为以摊余成本计量的金融资产以预期信用损失为基础确认损失准备。除购买或源生的已发生信用减值的金融资产外，本集合计划在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后的变动情况。若该金融工具的信用风险自初始确认后已显著增加，本集合计划按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备；若该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加，本集合计划按照相当于该金融工具未来12个月内预期信用损失的金额计量其损失准备。信用损失准备的增加或转回金额，作为减值损失或利得计入当期损益。

本集合计划在前一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形的，本集合计划在当期资产负债表日按照相当于未来12个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

本集合计划利用可获得的合理且有依据的前瞻性信息，通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止、该金融资产已转移且其所有权上几乎所有的风险和报酬已转移或虽然既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是未保留对该金融资产的控制，终止确认该金融资产。终止确认的

金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。若本集合计划既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有风险和报酬，且保留了对该金融资产控制的，则按照其继续涉入被转移金融资产的程度继续确认该被转移金融资产，并相应确认相关负债。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价(包括转出的非现金资产或承担的新金融负债)之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本集合计划持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 对存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种，在估值日有报价的，除会计准则规定的例外情况外，应将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量。估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，集合计划管理人不应考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 对不存在活跃市场的投资品种，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的集合计划资产净值的影响在0.25%以上的，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本集合计划具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本集合计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日确认。

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

##### （1）利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

##### （2）投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本与相关交易费用的差额确认。

债券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖债券价差收入。除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。买卖债券价差收入为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

资产支持证券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖资产支持证券价差收入。资产支持证券利息收入在持有期内，按资产支持证券的票面价值和预计收益率计算的利息逐日确认资产支持证券利息收入。在收到资产支持证券支付的款项时，其中属于证券投资收益的部分冲减应计利息(若有)后的差额，确认资产支持证券利息收入。买卖资产支持证券价差收入为卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本、相关交易费用与税费后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额确认，由上市公司代扣代缴的个人所得税于卖出交易日按实际代扣代缴金额确认。

##### （3）公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产卖出或到期时转出计入投资收益。

#### (4) 信用减值损失

本集合计划对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认信用损失准备。本集合计划所计提的信用减值损失计入当期损益。

#### **7.4.4.10 费用的确认和计量**

本集合计划的管理人报酬和托管费等费用在费用涵盖期间按集合计划合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的交易费用发生时按照确定的金额计入交易费用。

卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率逐日计提。

#### **7.4.4.11 基金的收益分配政策**

(1) 本集合计划收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的集合计划份额进行再投资；若投资者不选择，本集合计划默认的收益分配方式是现金分红；

(2) 本集合计划收益分配后各类集合计划份额净值不能低于面值；即集合计划收益分配基准日的各类集合计划份额净值减去每单位该类集合计划份额收益分配金额后不能低于面值；

(3) 由于本集合计划A类份额和C类份额收费方式不同，各集合计划份额类别对应的可供分配收益将有所不同。本集合计划同一类别的每一集合计划份额享有同等分配权；

(4) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### **7.4.4.12 外币交易**

本集合计划无外币交易。

#### **7.4.4.13 分部报告**

本集合计划无分部报告。

#### **7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计**



本集合计划确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》(中基协发[2017]6号)，在估值日按照该通知规定的流通受限股票公允价值计算模型进行估值。

(2) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，根据《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》(中国证监会公告[2017]13号)及《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》(中基协发[2013]13号)相关规定，本集合计划根据情况决定使用指数收益法、可比公司法、市场价格模型法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(3) 根据《关于发布〈中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准〉的通知》(中基协发[2014]24号)，在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)，采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本集合计划无会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本集合计划无会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本集合计划无差错更正。

## 7.4.6 税项

本集合计划目前比照证券投资基金的相关税务法规及其他相关国内税务法规计提和缴纳税款主要税项列示如下：

### (1) 增值税

根据财政部和国家税务总局2017年6月30日发布的《关于资管产品增值税有关问题的通知》，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税，通知自2018年1月1日起施行。对资管产品在2018

年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

本集合计划分别按实际缴纳的增值税额的7%、3%和2%缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

#### (2) 印花税

证券（股票）交易印花税税率为1‰，由出让方缴纳。

#### (3) 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
活期存款	721,461.58	11,805,861.46
等于：本金	720,077.97	11,803,020.17
加：应计利息	1,383.61	2,841.29
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	721,461.58	11,805,861.46

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2023年12月31日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		-	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	64,118,858.80	665,301.05	64,645,778.05	-138,381.80
	银行间市场	115,735,699.81	1,172,560.64	117,040,275.64	132,015.19
	合计	179,854,558.61	1,837,861.69	181,686,053.69	-6,366.61
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		179,854,558.61	1,837,861.69	181,686,053.69	-6,366.61
项目		上年度末 2022年12月31日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		-	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	193,381,710.12	2,038,299.88	193,582,964.96	-1,837,045.04
	银行间市场	616,336,261.90	5,581,582.46	618,739,559.46	-3,178,284.90
	合计	809,717,972.02	7,619,882.34	812,322,524.42	-5,015,329.94
资产支持证券		10,000,000.00	78,904.11	10,042,524.11	-36,380.00
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		819,717,972.02	7,698,786.45	822,365,048.53	-5,051,709.94

## 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

## 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	10,150,085.00	-	-	-
--国债期货	10,150,085.00	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	10,150,085.00	-	-	-
项目	上年度末 2022年12月31日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	10,024,000.00	-	-	-
--国债期货	10,024,000.00	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	10,024,000.00	-	-	-

## 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
TS2403	2年期中短期国债期货2403合约	4.00	8,105,760.00	13,500.00
T2403	10年期国债期货2403合约	2.00	2,057,000.00	-825.00

合计				12,675.00
减：可抵销 期货暂收 款				12,675.00
净额				-

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本集合计划本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本集合计划本报告期末及上年度末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 其他资产

本集合计划本报告期末及上年度末未持有其他资产。

#### 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	977.55	29,826.21
其中：交易所市场	-	8,876.67
银行间市场	977.55	20,949.54
应付利息	-	-
预提费用-审计费	15,000.00	15,000.00
预提费用-信息披露费	120,000.00	120,000.00
预提费用-账户维护费	9,000.00	9,000.00
合计	144,977.55	173,826.21

#### 7.4.7.7 实收基金

**7.4.7.7.1 招商资管睿丰三个月持有期债券D**

金额单位：人民币元

项目 (招商资管睿丰三个月持有期 债券D)	本期 2023年01月01日至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	13,487,835.49	13,487,835.49
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-1,072,104.14	-1,072,104.14
本期末	12,415,731.35	12,415,731.35

**7.4.7.7.2 招商资管睿丰三个月持有期债券A**

金额单位：人民币元

项目 (招商资管睿丰三个月持有期 债券A)	本期 2023年01月01日至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	353,464,027.58	353,464,027.58
本期申购	38,500,329.37	38,500,329.37
本期赎回（以“-”号填列）	-317,992,175.07	-317,992,175.07
本期末	73,972,181.88	73,972,181.88

**7.4.7.7.3 招商资管睿丰三个月持有期债券C**

金额单位：人民币元

项目 (招商资管睿丰三个月持有期 债券C)	本期 2023年01月01日至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	284,621,926.14	284,621,926.14
本期申购	36,253,461.56	36,253,461.56
本期赎回（以“-”号填列）	-260,226,649.63	-260,226,649.63
本期末	60,648,738.07	60,648,738.07

**7.4.7.8 未分配利润****7.4.7.8.1 招商资管睿丰三个月持有期债券D**

单位：人民币元

项目 (招商资管睿丰三个月 持有期债券D)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,506,863.60	-304,130.64	1,202,732.96
本期期初	1,506,863.60	-304,130.64	1,202,732.96
本期利润	126,311.79	154,274.42	280,586.21
本期基金份额交易产生的变动数	-122,546.83	13,184.90	-109,361.93
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-122,546.83	13,184.90	-109,361.93
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,510,628.56	-136,671.32	1,373,957.24

## 7.4.7.8.2 招商资管睿丰三个月持有期债券A

单位：人民币元

项目 (招商资管睿丰三个月 持有期债券A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	18,018,918.04	-752,407.73	17,266,510.31
本期期初	18,018,918.04	-752,407.73	17,266,510.31
本期利润	1,763,608.86	2,374,873.90	4,138,482.76
本期基金份额交易产生的变动数	-14,584,653.50	-956,613.62	-15,541,267.12
其中：基金申购款	2,283,683.82	371,247.53	2,654,931.35
基金赎回款	-16,868,337.32	-1,327,861.15	-18,196,198.47
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,197,873.40	665,852.55	5,863,725.95

## 7.4.7.8.3 招商资管睿丰三个月持有期债券C

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
----	-------	-------	---------

(招商资管睿丰三个月持有期债券C)			
上年度末	12,782,968.40	-594,246.80	12,188,721.60
本期期初	12,782,968.40	-594,246.80	12,188,721.60
本期利润	1,803,770.08	2,576,370.01	4,380,140.09
本期基金份额交易产生的变动数	-10,897,118.04	-1,438,109.82	-12,335,227.86
其中：基金申购款	1,747,359.34	280,371.43	2,027,730.77
基金赎回款	-12,644,477.38	-1,718,481.25	-14,362,958.63
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,689,620.44	544,013.39	4,233,633.83

#### 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日
活期存款利息收入	90,554.42	237,089.07
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	24,724.95	57,788.09
其他	94.96	89.60
合计	115,374.33	294,966.76

#### 7.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

本集合计划本报告期及上年度可比期间无股票投资收益。

#### 7.4.7.11 基金投资收益

本集合计划本报告期及上年度可比期间无基金投资收益。

#### 7.4.7.12 债券投资收益

##### 7.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元



项目	本期 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日
债券投资收益——利息收入	7,532,322.19	21,426,854.42
债券投资收益——买卖债券 （债转股及债券到期兑付） 差价收入	-1,730,688.37	536,326.76
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	5,801,633.82	21,963,181.18

#### 7.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月 31日
卖出债券（债转股 及债券到期兑付） 成交总额	827,665,603.61	885,613,134.97
减：卖出债券（债 转股及债券到期兑 付）成本总额	819,187,434.18	869,465,076.59
减：应计利息总额	10,195,979.02	15,531,200.59
减：交易费用	12,878.78	80,531.03
买卖债券差价收入	-1,730,688.37	536,326.76

#### 7.4.7.13 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年
----	-------------------------	------------------------------

	12月31日	12月31日
资产支持证券投资收益——利息收入	43,090.80	424,654.44
资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入	-6,078.08	-
资产支持证券投资收益——赎回差价收入	-	-
资产支持证券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	37,012.72	424,654.44

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

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日
卖出资产支持证券成交总额	10,117,209.59	10,348,230.14
减：卖出资产支持证券成本总额	10,000,000.00	10,000,000.00
减：应计利息总额	123,287.67	348,230.14
减：交易费用	-	-
资产支持证券投资收益	-6,078.08	-

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

本集合计划本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

##### 7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本集合计划本报告期及上年度可比期间无衍生工具买卖权证差价收入。

##### 7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2023年01月01日至2023年 12月31日	2022年01月01日至2022年 12月31日
期货投资	-80,556.99	-79,620.86

#### 7.4.7.16 股利收益

本集合计划本报告期及上年度可比期间无股利收益。

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年01月01日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12 月31日
1.交易性金融资产	5,045,343.33	-8,129,136.44
——股票投资	-	-
——债券投资	5,008,963.33	-8,088,316.44
——资产支持证券投资	36,380.00	-40,820.00
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	60,175.00	-47,500.00
——权证投资	-	-
——期货投资	60,175.00	-47,500.00
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允 价值变动产生的预估增 值税	-	-100,389.83
合计	5,105,518.33	-8,076,246.61

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日
----	-----------------------------------	--

基金赎回费收入	-	-
其他	-	373,600.00
合计	-	373,600.00

#### 7.4.7.19 信用减值损失

本集合计划本报告期及上年度可比期间无信用减值损失。

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日
审计费用	15,000.00	15,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
汇划手续费	7,517.27	24,093.27
账户查询费	1,200.00	1,200.00
账户维护费_中债登	18,000.00	18,000.00
账户维护费_上清所	18,000.00	18,000.00
其他	-	58,500.00
合计	179,717.27	254,793.27

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本集合计划无需要披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本集合计划无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
招商证券资产管理有限公司	集合计划管理人
中信银行股份有限公司	集合计划托管人

招商证券股份有限公司

集合计划管理人的控股股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

**7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易****7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****7.4.10.1.1 股票交易**

本集合计划本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

**7.4.10.1.2 权证交易**

本集合计划本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

**7.4.10.1.3 债券交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
招商证券股份有限公司	156,006,536.93	100.00%	141,159,817.26	100.00%

**7.4.10.1.4 债券回购交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
招商证券股份有限公司	2,649,323,000.00	100.00%	8,236,460,000.00	100.00%

**7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
招商证券股份有限公司	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
招商证券股份有限公司	59,623.65	100.00%	8,876.67	100.00%

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

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	939,067.98	2,382,559.09
其中：应支付销售机构的客户维护费	390,430.37	985,624.34
应支付基金管理人的净管理费	548,637.61	1,396,934.75

注：本集合计划的A类、C类份额管理费按前一日集合计划资产净值的0.3%年费率计提。本集合计划的D类份额管理费按前一日集合计划资产净值的1.2%年费率计提。本集合计划各类份额的管理费按该类份额前一日集合计划资产净值对应的管理费年费率分别计提。

管理费的计算方法如下：

$$H = E \times I \div \text{当年天数}$$

H为各类份额每日应计提的集合计划管理费

E为该类份额前一日的集合计划资产净值

I为该类份额的管理费年费率

集合计划管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由集合计划管理人向集合计划托管人发送集合计划管理费划款指令，集合计划托管人复核后于次月前5个工作日内从集合计划财产中一次性支付给集合计划管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

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

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年01月01日至2023年12月31日	2022年01月01日至2022年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	270,638.46	747,281.19

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

$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$ ，其中：

H为每日应计提的集合计划托管费

E为前一日集合计划资产净值

集合计划托管费每日计提，逐日累计，按月支付。由管理人向托管人发送集合计划托管费划付指令，托管人复核后于次月的首日起5个工作日内从集合计划资产中一次性支付给托管人。

#### 7.4.10.2.3 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01月01日至2023年12月31日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	招商资管睿丰三	招商资管睿丰三	招商资管睿丰三	合计

	个月持有期债券D	个月持有期债券A	个月持有期债券C	
招商证券股份有限公司	0.00	0.00	61,217.30	61,217.30
中信银行股份有限公司	0.00	0.00	0.00	0.00
合计	0.00	0.00	61,217.30	61,217.30
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	招商资管睿丰三个月持有期债券D	招商资管睿丰三个月持有期债券A	招商资管睿丰三个月持有期债券C	合计
招商证券股份有限公司	0.00	0.00	178,549.23	178,549.23
中信银行股份有限公司	0.00	0.00	0.00	0.00
合计	0.00	0.00	178,549.23	178,549.23

注：本集合计划A类份额、D类份额不收取销售服务费，C类份额的销售服务费年费率为0.3%。本销售服务费将专门用于本集合计划C类份额的销售与C类集合计划份额持有人服务，管理人将在集合计划年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。销售服务费计提的计算公式如下：

$$H=E \times 0.3\% \div \text{当年天数}$$

H为C类份额每日应计提的销售服务费

E为C类份额前一日的资产净值

销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经管理人与托管人双方核对无误后，托管人按照与管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从集合计划财产中一次性支付给集合计划管理人，由集合计划管理人按规定支付给各销售机构。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本集合计划本报告期及上年度可比期间未发生与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。



**7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明****7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

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

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

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

**7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况****7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

招商资管睿丰三个月持有期债券D

份额单位：份

项目	本期 2023年01月01日至 2023年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至 2022年12月31日
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	-	-

招商资管睿丰三个月持有期债券A

份额单位：份

项目	本期 2023年01月01日至 2023年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至 2022年12月31日
报告期初持有的基金份额	9,999,000.00	9,999,000.00
报告期间申购/买入总份额	9,299,520.78	-
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	19,298,520.78	9,999,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	26.09%	2.83%

招商资管睿丰三个月持有期债券C

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2023年01月01日至 2023年12月31日	2022年01月01日至 2022年12月31日
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	-	-

注:1、关联方投资本集合计划的费率按照集合计划合同和招募说明书规定的确定,符合公允性要求;2、本集合计划本报告期内及上年度可比期间均无集合计划管理人运用自有资金投资招商资管睿丰三个月持有期债券C、招商资管睿丰三个月持有期债券D的情况。

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

本报告期末及上年度末,除集合计划管理人之外的其他关联方无投资本集合计划的情况。

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2023年01月01日至2023年12月31日		2022年01月01日至2022年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信银行股份有限公司	721,461.58	90,554.42	11,805,861.46	237,089.07

注：本集合计划的银行存款由集合计划托管人中信银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

#### **7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本集合计划于本报告期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### **7.4.10.8 其他关联交易事项的说明**

本集合计划本报告期及上年度可比期间无其他关联交易事项的说明。

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

本集合计划本报告期末未进行利润分配。

#### **7.4.12 期末（2023年12月31日）本基金持有的流通受限证券**

##### **7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本集合计划本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

##### **7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

本集合计划本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### **7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

###### **7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

本集合计划本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

###### **7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

截至本报告期末2023年12月31日止，集合计划从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币24,997,002.54元，于2024年1月2日到期。该类交易要求本集合计划在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

##### **7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券**

本集合计划本报告期末未持有因参与转融通证券出借业务而出借的证券。

#### **7.4.13 金融工具风险及管理**

##### **7.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

本集合计划在日常经营活动中涉及的风险主要包括市场风险、流动性风险及信用风险。本集合计划管理人制定了相应的政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本集合计划管理人建立了由风险管理部、法律合规部组成的风险控制职能部门，独立开展对业务和相关操作的风险评价。风险管理部、法律合规部等互相配合，建立信息沟通机制，从事前、事中、事后全面进行业务风险监控。此外，业务部门也建立了自身的内部控制机制，主要由授权体系和业务后台部门信息监控机制组成。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指集合计划在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者集合计划所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致集合计划资产损失和收益变化的风险。本集合计划均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本集合计划在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，在银行间同业市场交易前对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
A-1	-	20,120,870.14
A-1以下	-	-
未评级	80,797,285.52	508,653,787.60
合计	80,797,285.52	528,774,657.74

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级；2、以上未评级的债券为偿还期限在一年以内的企业债、政策性金融债、短期融资券；3、债券投资以净价列示。

##### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-

未评级	-	10,042,524.11
合计	-	10,042,524.11

注：1、资产支持证券评级取自第三方评级机构的优先级资产支持证券债项评级；2、资产支持证券投资以净价列示。

#### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本集合计划本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

#### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
AAA	75,718,352.46	118,569,853.02
AAA以下	14,788,216.97	95,274,554.75
未评级	10,382,198.74	69,703,458.91
合计	100,888,768.17	283,547,866.68

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级；2、以上未评级的债券为偿还期限在一年以上的国债、中期票据；3、债券投资以净价列示。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本集合计划本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本集合计划本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是在市场或持有资产流动性不足的情况下，集合计划管理人可能无法迅速、低成本地调整集合计划投资组合，从而对集合计划收益造成不利影响。流动性风险一般存在两种形式：资产变现风险和现金流风险。

#### (1) 资产变现风险

资产变现风险是指由于集合计划持有的某个券种的头寸相对于市场正常的交易量过大，或由于停牌造成交易无法在当前的市场价格下成交。本集合计划管理人应用定量方法对各持仓品种的变现能力进行测算和分析，以对资产变现风险进行管理。

## (2) 现金流风险

现金流风险是指集合计划因现金流不足导致无法应对正常集合计划支付义务的风险。本集合计划管理人对集合计划每日和每周净退出比例进行测算和分析，以对该风险进行跟踪和管理。此外，本集合计划管理人建立了现金头寸控制机制，以确保退出款项的及时支付。

### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本集合计划的管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本集合计划组合资产的流动性风险进行管理。

本报告期内，本集合计划未发生重大流动性风险事件。

### 7.4.13.4 市场风险

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

#### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指集合计划的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本集合计划持有的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金等，其余金融资产及金融负债不计息。本集合计划的管理人定期对本集合计划面临的利率风险敞口进行监控，以对该风险进行管理。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年 12月31 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	721,461.58	-	-	-	-	-	721,461.58
结算备付金	530,532.74	-	-	-	-	1,262,189.81	1,792,722.55
存出保证金	83,630.38	-	-	-	-	-	83,630.38

## 招商资管睿丰三个月持有期债券型集合资产管理计划2023年年度报告

交易性金融资产	411,497.97	12,920,173.37	126,494,296.31	31,477,887.30	10,382,198.74	-	181,686,053.69
应收清算款	-	-	-	-	-	1,994,882.21	1,994,882.21
应收申购款	-	-	-	-	-	50,020.95	50,020.95
资产总计	1,747,122.67	12,920,173.37	126,494,296.31	31,477,887.30	10,382,198.74	3,307,092.97	186,328,771.36
负债							
卖出回购金融资产款	24,997,002.54	-	-	-	-	-	24,997,002.54
应付清算款	-	-	-	-	-	506,872.05	506,872.05
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,083,888.23	2,083,888.23
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	52,712.08	52,712.08
应付托管费	-	-	-	-	-	14,066.76	14,066.76
应付销售服务费	-	-	-	-	-	17,864.04	17,864.04
应交税费	-	-	-	-	-	3,419.79	3,419.79
其他负债	-	-	-	-	-	144,977.55	144,977.55
负债总计	24,997,002.54	-	-	-	-	2,823,800.50	27,820,803.04
利率敏感度缺口	-23,249,879.87	12,920,173.37	126,494,296.31	31,477,887.30	10,382,198.74	483,292.47	158,507,968.32
上年度末 2022年 12月31 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	11,805,861.46	-	-	-	-	-	11,805,861.46

## 招商资管睿丰三个月持有期债券型集合资产管理计划2023年年度报告

结算备付金	5,485,512.62	-	-	-	-	1,163,760.60	6,649,273.22
存出保证金	205,161.39	-	-	-	-	-	205,161.39
交易性金融资产	38,540,299.27	57,596,530.54	551,063,989.20	163,479,501.28	11,684,728.24	-	822,365,048.53
应收清算款	-	-	-	-	-	1,031,102.05	1,031,102.05
应收申购款	-	-	-	-	-	3,326.98	3,326.98
资产总计	56,036,834.74	57,596,530.54	551,063,989.20	163,479,501.28	11,684,728.24	2,198,189.63	842,059,773.63
负债							
卖出回购金融资产款	156,832,541.61	-	-	-	-	-	156,832,541.61
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,310,183.31	2,310,183.31
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	206,157.17	206,157.17
应付托管费	-	-	-	-	-	64,954.47	64,954.47
应付销售服务费	-	-	-	-	-	197,648.62	197,648.62
应交税费	-	-	-	-	-	42,708.16	42,708.16
其他负债	-	-	-	-	-	173,826.21	173,826.21
负债总计	156,832,541.61	-	-	-	-	2,995,477.94	159,828,019.55
利率敏感度缺口	-100,795,706.87	57,596,530.54	551,063,989.20	163,479,501.28	11,684,728.24	-797,288.31	682,231,754.08

注：上表统计了本集合计划交易的利率风险敞口。表中所示为本集合计划资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1.若市场利率平行上升或下降25个基点；
----	----------------------



假设	2.其他市场变量保持不变；		
假设	3.仅存在公允价值变动对集合计划资产净值的影响(即平移收益率曲线)。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
	1.市场利率平行上升25个基点	-456,323.95	-1,656,074.73
	2.市场利率平行下降25个基点	461,473.35	1,667,227.54

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金资产 净值比例(%)	公允价值	占基金资产 净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	-	-	-	-
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	8,840,041.06	5.58	22,113,698.50	3.24
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	8,840,041.06	5.58	22,113,698.50	3.24

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

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本集合计划本报告期末及上年度末其他价格风险对集合计划资产净值无重大影响。

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的公开报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	8,268,516.54	22,113,698.50
第二层次	173,417,537.15	800,251,350.03
第三层次	-	-
合计	181,686,053.69	822,365,048.53

###### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本集合计划以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本集合计划不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；本集

合计划根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

#### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

无。

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本集合计划本报告期末及上年度末未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

#### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括银行存款、结算备付金和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本集合计划无需要说明的其他重要事项。

## §8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	181,686,053.69	97.51
	其中：债券	181,686,053.69	97.51
	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	2,514,184.13	1.35
8	其他各项资产	2,128,533.54	1.14
9	合计	186,328,771.36	100.00

本集合计划本报告期末未持有港股通交易机制投资的港股。

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本集合计划本报告期末未持有境内股票投资组合。

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本集合计划本报告期末未持有港股通投资股票投资组合。

## 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本集合计划本报告期末未持有股票。

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

本集合计划本报告期内未进行买入股票投资交易。

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

本集合计划本报告期内未进行卖出股票投资交易。

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本集合计划本报告期内未进行买入、卖出股票投资交易。

## 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	117,385,732.06	74.06
	其中：政策性金融债	20,511,842.18	12.94
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	55,460,280.57	34.99

6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	8,840,041.06	5.58
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	181,686,053.69	114.62

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	220210	22国开10	100,000	10,382,198.74	6.55
2	2028033	20建设银行二级	100,000	10,371,485.57	6.54
3	2028018	20交通银行二级	100,000	10,275,364.26	6.48
4	2028013	20农业银行二级01	100,000	10,259,512.95	6.47
5	149508	21华股02	100,000	10,199,406.03	6.43

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

本集合计划本报告期末未持有资产支持证券。

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

本集合计划本报告期末未持有贵金属。

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

本集合计划本报告期末未持有权证。

### 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本集合计划本报告期末未参与股指期货交易。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本集合计划根据风险管理的原则，在风险可控的前提下，以套期保值为目的，投资国债期货。本集合计划充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析，对国债期货和现货的基差、国

债期货的流动性、波动水平等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现委托财产的长期稳定增值。

### 8.11.2 本期国债期货投资评价

本集合计划本报告期内根据对中长期国债利率走势研判，在判断国债利率可能上升时阶段性开出国债期货品种空仓对现券持仓进行套期保值，并在判断利率上升趋势可能结束时进行平仓操作。另外当组合仓位较低时，在判断利率可能下行而阶段性开出国债期货多头防止踏空风险，并在仓位提升后进行平仓操作。

### 8.12 投资组合报告附注

**8.12.1** 本集合计划投资的前十名证券的发行主体中，中国建设银行股份有限公司本年度被中国银行间市场交易商协会立案调查，且受到国家金融监督管理总局及其派出机构的处罚，中国银行股份有限公司曾受到中国人民银行、国家金融监督管理总局及其派出机构的处罚，中国农业银行股份有限公司曾受到国家金融监督管理总局、国家外汇管理局及其派出机构的处罚，华西证券股份有限公司曾受到中国人民银行及其派出机构的处罚。其性质对该公司长期经营业绩未产生重大负面影响，不影响相关证券标的长期投资价值。本集合计划对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规的要求。

除上述主体外，未发现期末投资的其他前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

**8.12.2** 本集合计划本报告期末投资股票，因此不存在投资的前十名股票超出集合计划合同规定的备选股票库情况。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	83,630.38
2	应收清算款	1,994,882.21
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	50,020.95
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	2,128,533.54

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113044	大秦转债	1,163,280.14	0.73
2	113055	成银转债	785,858.64	0.50
3	113066	平煤转债	777,699.37	0.49
4	128133	奇正转债	607,285.27	0.38
5	132026	G三峡EB2	571,524.52	0.36
6	113046	金田转债	531,948.63	0.34
7	118034	晶能转债	514,746.10	0.32
8	113051	节能转债	455,216.49	0.29
9	113053	隆22转债	411,497.97	0.26
10	127050	麒麟转债	379,433.34	0.24
11	127027	能化转债	350,430.99	0.22
12	127056	中特转债	309,905.34	0.20
13	113631	皖天转债	250,284.03	0.16
14	110045	海澜转债	243,241.15	0.15
15	127086	恒邦转债	240,641.97	0.15
16	127020	中金转债	237,989.29	0.15
17	110062	烽火转债	223,490.71	0.14
18	110085	通22转债	216,845.32	0.14
19	113641	华友转债	207,861.32	0.13

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本集合计划本报告期末未持有股票。

#### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
招商资管睿丰三个月持有期债券D	120	103,464.43	0.00	0.00%	12,415,731.35	100.00%
招商资管睿丰三个月持有期债券A	8,764	8,440.46	38,025,949.79	51.41%	35,946,232.09	48.59%
招商资管睿丰三个月持有期债券C	4,132	14,677.82	274,450.34	0.45%	60,374,287.73	99.55%
合计	13,016	11,296.61	38,300,400.13	26.05%	108,736,251.17	73.95%

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

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人	招商资管睿丰三个月	0.00	0.00%



员持有本基金	持有期债券D		
	招商资管睿丰三个月持有期债券A	96.55	0.00%
	招商资管睿丰三个月持有期债券C	1,892.24	0.00%
	合计	1,988.79	0.00%

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

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	招商资管睿丰三个月持有期债券D	0
	招商资管睿丰三个月持有期债券A	0
	招商资管睿丰三个月持有期债券C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	招商资管睿丰三个月持有期债券D	0
	招商资管睿丰三个月持有期债券A	0
	招商资管睿丰三个月持有期债券C	0
	合计	0

### §10 开放式基金份额变动

单位：份

	招商资管睿丰三个月持有期债券D	招商资管睿丰三个月持有期债券A	招商资管睿丰三个月持有期债券C
基金合同生效日(2021年02月02日)基	20,274,185.18	-	-

金份额总额			
本报告期期初基金份额总额	13,487,835.49	353,464,027.58	284,621,926.14
本报告期基金总申购份额	-	38,500,329.37	36,253,461.56
减：本报告期基金总赎回份额	1,072,104.14	317,992,175.07	260,226,649.63
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	12,415,731.35	73,972,181.88	60,648,738.07

## §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本集合计划本报告期未召开份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本集合计划管理人于2023年1月11日发布公告，自2023年1月10日起，范文孟先生离任公司副总经理。

本集合计划管理人于2023年7月19日发布公告，自2023年7月17日起，张良勇先生新任公司董事长，杨阳先生不再任公司董事长，仍继续担任公司董事、总经理。

本集合计划管理人于2023年8月12日发布公告，自2023年8月10日起，宗鹏先生新任公司副总经理。

本集合计划管理人于2023年9月29日发布公告，自2023年9月28日起，张亚非女士新任公司副总经理。

本报告期内，本集合计划托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生涉及本集合计划管理人、本集合计划财产或本集合计划托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本集合计划的投资策略未发生重大变化。

## 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本集合计划提供审计服务的机构由信永中和会计师事务所（特殊普通合伙）变更为德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙），本年为提供审计服务的首年。本集合计划本年度支付给德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）的审计费用为15,000.00元。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，本集合计划管理人及相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，本集合计划托管人的托管业务部门及相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
招商证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-

注：（1）本报告期本集合计划交易单元未发生变更。

（2）交易单元的选择标准：

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

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

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
招商证券股份有限公司	156,006,536.93	100.00%	2,649,323,000.00	100.00%	-	-	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	招商证券资产管理有限公司董事变更情况公告	中国证监会基金电子披露网站、中国证监会规定报刊、管理人网站	2023-11-04
2	招商证券资产管理有限公司关于旗下参照公募基金管理运作的集合资产管理计划2023年3季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊、管理人网站	2023-10-24
3	招商资管睿丰三个月持有期债券型集合资产管理计划2023年第3季度报告	中国证监会基金电子披露网站、管理人网站	2023-10-24
4	招商证券资产管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会基金电子披露网站、中国证监会规定报刊、管理人网站	2023-09-29
5	招商证券资产管理有限公司关于旗下部分参照公募基金	中国证监会基金电子披露网站、中国证监会规定报刊、	2023-09-22

	管理运作集合资产管理计划增加博时财富基金销售有限公司为销售机构及参加其费率优惠活动的公告	管理人网站	
6	招商证券资产管理有限公司关于旗下参照公募基金管理运作的集合资产管理计划2023年中期报告提示性公告	中国证监会规定报刊、管理人网站	2023-08-29
7	招商资管睿丰三个月持有期债券型集合资产管理计划2023年中期报告	中国证监会基金电子披露网站、管理人网站	2023-08-29
8	招商证券资产管理有限公司关于运用自有资金投资旗下参照公募基金管理运作集合资产管理计划的公告	中国证监会基金电子披露网站、中国证监会规定报刊、管理人网站	2023-08-21
9	招商证券资产管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会基金电子披露网站、中国证监会规定报刊、管理人网站	2023-08-12
10	招商证券资产管理有限公司关于旗下参照公募基金管理运作的集合资产管理计划2023年2季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊、管理人网站	2023-07-20
11	招商资管睿丰三个月持有期债券型集合资产管理计划2023年第2季度报告	中国证监会基金电子披露网站、管理人网站	2023-07-20
12	招商证券资产管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会基金电子披露网站、中国证监会规定报刊、管理人网站	2023-07-19
13	招商证券资产管理有限公司住所变更公告	中国证监会基金电子披露网站、中国证监会规定报刊、管理人网站	2023-07-13
14	招商证券资产管理有限公司关于旗下参照公募基金管理	中国证监会规定报刊、管理人网站	2023-04-21

	运作的集合资产管理计划2023年1季度报告提示性公告		
15	招商资管睿丰三个月持有期债券型集合资产管理计划2023年第1季度报告	中国证监会基金电子披露网站、管理人网站	2023-04-21
16	关于招商资管睿丰三个月持有期债券型集合资产管理计划暂停大额申购的公告	中国证监会基金电子披露网站、中国证监会规定报刊、管理人网站	2023-04-14
17	招商证券资产管理有限公司关于旗下参照公募基金管理运作的集合资产管理计划2022年年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊、管理人网站	2023-03-24
18	招商资管睿丰三个月持有期债券型集合资产管理计划2022年年度报告	中国证监会基金电子披露网站、管理人网站	2023-03-24
19	招商证券资产管理有限公司住所变更公告	中国证监会基金电子披露网站、中国证监会规定报刊、管理人网站	2023-03-07
20	招商证券资产管理有限公司关于旗下部分参照公募基金管理运作集合资产管理计划增加东方财富证券股份有限公司为销售机构及参加其费率优惠活动的公告	中国证监会基金电子披露网站、中国证监会规定报刊、管理人网站	2023-02-08
21	招商证券资产管理有限公司关于旗下参照公募基金管理运作的集合资产管理计划2022年4季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊、管理人网站	2023-01-20
22	招商资管睿丰三个月持有期债券型集合资产管理计划2022年第4季度报告	中国证监会基金电子披露网站、管理人网站	2023-01-20
23	招商资管睿丰三个月持有期债券型集合资产管理计划招	中国证监会规定报刊、管理人网站	2023-01-17

	募说明书（更新）及产品资料概要（更新）提示性公告		
24	招商证券资产管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会基金电子披露网站、中国证监会规定报刊、管理人网站	2023-01-11

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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	2023年01月01日-2023年01月12日	144,937,763.88	0.00	144,937,763.88	0.00	0.00%
产品特有风险							
报告期内，本集合计划存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况。报告期内，未发现本集合计划实质上存在特有风险。							

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

1. 中国证券监督管理委员会关于准予招商证券安康添利集合资产管理计划合同变更的回函；
2. 《招商资管睿丰三个月持有期债券型集合资产管理计划集合资产管理合同》；

3. 《招商资管睿丰三个月持有期债券型集合资产管理计划托管协议》；
4. 《招商资管睿丰三个月持有期债券型集合资产管理计划招募说明书》；
5. 《招商资管睿丰三个月持有期债券型集合资产管理计划产品资料概要》；
6. 集合计划管理人业务资格批件、营业执照；
7. 中国证券监督管理委员会要求的其他文件。

### 13.2 存放地点

备查文件存放于集合计划管理人和集合计划托管人的办公场所，并登载于集合计划管理人互联网站<https://amc.cmschina.com/>。

### 13.3 查阅方式

投资者可登录集合计划管理人互联网站查阅，或在营业时间内至集合计划管理人或集合计划托管人的办公场所免费查阅。

投资者对本报告如有疑问，敬请致电或登录管理人网站了解相关情况，咨询电话：95565，公司网站：<https://amc.cmschina.com/>。

招商证券资产管理有限公司  
二〇二四年三月二十五日