

招商瑞乐 6 个月持有期混合型证券投资 基金 2024 年第 1 季度报告

2024 年 03 月 31 日

基金管理人：招商基金管理有限公司

基金托管人：中信银行股份有限公司

送出日期：2024 年 4 月 19 日

§ 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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 4 月 18 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 招商瑞乐 6 个月持有期混合 |
| 基金主代码 | 010942 |
| 交易代码 | 010942 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2021 年 7 月 13 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 440,981,652.74 份 |
| 投资目标 | 本基金以追求绝对收益为目标，在严格控制风险的前提下，追求基金资产的长期稳定增值。 |
| 投资策略 | 本基金以获取绝对收益为投资目的，采取稳健的投资策略，在控制投资风险的基础之上确定大类资产配置比例，力争使投资者获得较为合理的绝对收益。 具体投资策略包括：（1）大类资产配置策略；（2）股票投资策略；（3）债券投资策略；（4）资产支持证券投资策略；（5）股指期货投资策略；（6）国债期货投资策略；（7）参与融资业务的投资策略；（8）存托凭证投资策略。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率*10%+恒生综合指数收益率（经汇率调整后）*5%+中债综合（全价）指数收益率*85% |
| 风险收益特征 | 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。 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。 | |
| 基金管理人 | 招商基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中信银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 招商瑞乐 6 个月持有期混合 A | 招商瑞乐 6 个月持有期混合 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 010942 | 010943 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 329,272,147.49 份 | 111,709,505.25 份 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2024 年 1 月 1 日—2024 年 3 月 31 日） | |
|----------------|-------------------------------------|------------------|
| | 招商瑞乐 6 个月持有期混合 A | 招商瑞乐 6 个月持有期混合 C |
| 1.本期已实现收益 | -6,026,425.04 | -2,156,636.81 |
| 2.本期利润 | -5,689,109.99 | -2,041,852.16 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0169 | -0.0178 |
| 4.期末基金资产净值 | 325,736,258.03 | 109,311,776.90 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.9893 | 0.9785 |

注：1、上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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

招商瑞乐 6 个月持有期混合 A

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | -1.60% | 0.25% | 1.35% | 0.16% | -2.95% | 0.09% |

| | | | | | | |
|------------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 过去六个月 | -2.21% | 0.21% | 1.07% | 0.15% | -3.28% | 0.06% |
| 过去一年 | -3.28% | 0.21% | 0.57% | 0.14% | -3.85% | 0.07% |
| 自基金合同生效起至今 | -1.07% | 0.17% | -1.21% | 0.17% | 0.14% | 0.00% |

招商瑞乐 6 个月持有期混合 C

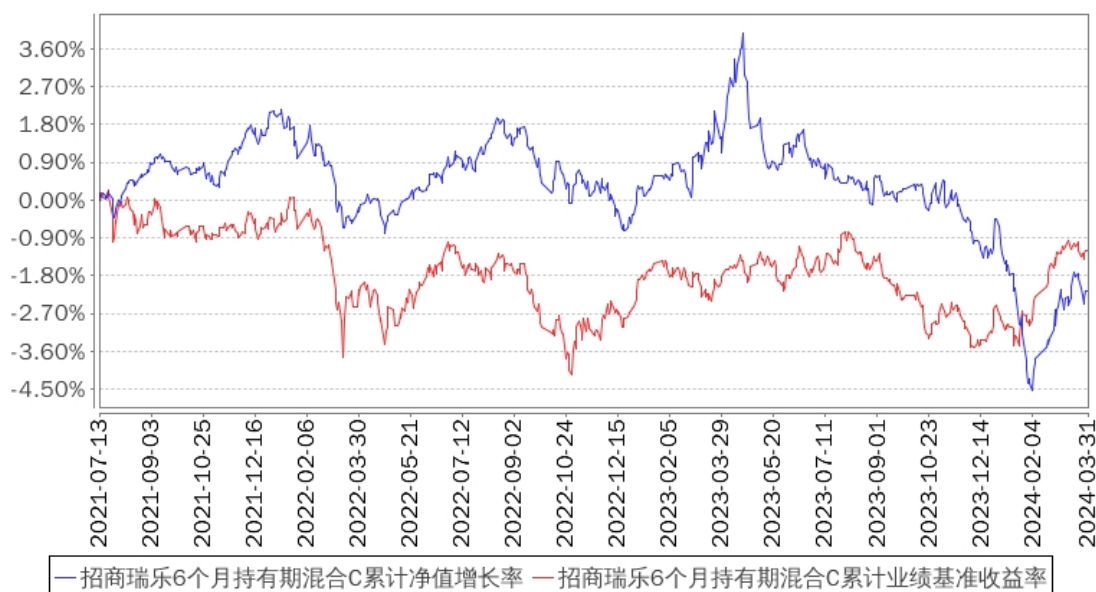
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | -1.71% | 0.25% | 1.35% | 0.16% | -3.06% | 0.09% |
| 过去六个月 | -2.41% | 0.21% | 1.07% | 0.15% | -3.48% | 0.06% |
| 过去一年 | -3.67% | 0.21% | 0.57% | 0.14% | -4.24% | 0.07% |
| 自基金合同生效起至今 | -2.15% | 0.17% | -1.21% | 0.17% | -0.94% | 0.00% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

招商瑞乐6个月持有期混合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



招商瑞乐6个月持有期混合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



§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|---------|-------------|------|--------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 余芽芳 | 本基金基金经理 | 2021年7月13日 | - | 11 | 女，博士。2012年7月加入华创证券有限责任公司，曾任宏观助理分析师、宏观分析师，对国内宏观经济有较全面的研究经验；2016年4月加入招商基金管理有限公司，曾任固定收益投资部高级研究员、招商丰和灵活配置混合型证券投资基金、招商丰乐灵活配置混合型证券投资基金、招商丰源灵活配置混合型证券投资基金、招商丰达灵活配置混合型证券投资基金、招商丰睿灵活配置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基金经理，现任招商瑞庆灵活配置混合型证券投资基金、招商瑞文混合型证券投资基金、招商瑞恒一年持有期混合型证券投资基金、招商瑞信稳健配置混合型证券投资基金、招商瑞安1年持有期混合型证券投资基金、招商瑞乐6个月持有期混合型证券投资基金、招商瑞泰1年持有期混合型证券投资基金、招商瑞鸿6个月持有期混合型证券投资基金、招商瑞享1年持有期混合型证券投资基金基金经理。 |
| 吴德瑄 | 本基金基金经理 | 2023年4月12日 | - | 10 | 男，硕士。2013年7月至2015年1月在广州证券股份有限公司工作，任资产管理总部研究员；2015年1月至2020年12月在金鹰基金管理有限公司工作，历任行业研究员、 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|--|
| | | | | | 基金经理助理、基金经理等职；2021 年 1 月至 2023 年 1 月在信泰人寿保险股份有限公司工作，任资产管理中心股票投资经理；2023 年 1 月加入招商基金管理有限公司，现任招商瑞乐 6 个月持有期混合型证券投资基金、招商瑞庆灵活配置混合型证券投资基金、招商瑞文混合型证券投资基金、招商瑞享 1 年持有期混合型证券投资基金基金经理。 |
|--|--|--|--|--|--|

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作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 公平交易专项说明

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。

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，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易不存在成交较少的单边交易量超过

该证券当日成交量的 5% 的情形。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 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，市场整体波动较大，一月市场整体快速下行，特别是成长方向跌幅较大，高股息红利方向表现突出。二月份春节之后，市场见底反弹，以人工智能为代表的成长方向快速上行，同时诸如低空经济、智能驾驶、设备更新换代等政策鼓励的成长方向均有良好的表现。报告期内我们的持仓方向经过了比较明显的调整，一月份我们的持仓整体偏向小盘成长，因此在年初市场快速下行的过程中，净值受损比较严重。春节之后，我们及时调整组合配置方向，重点配置业绩能快速释放的人工智能品种、绝对估值较低的资源品种以及部分公用事业及医药。

2024 年一季度，政策维稳市场动作明显，因此也快速将市场从 2635 点拉回到 3000 点平台。但是，交易层面的因素更多的是短期影响，长期决定市场的因素仍然是经济情况和制度情况。好的方面是，看到了经济见底企稳的迹象，同时制度层面上进一步开放和规范的表态给予市场乐观的展望。但是，整体无论是经济层面还是制度层面的变化均是中长期变量，市场乐观的反应之后需要等待基本面的持续性验证，这可能需要一定的时间，因此可预见市场可能将进入震荡阶段。

我们认为人工智能已经逐渐渗透到诸多行业，无疑已经成为新的科技增长方向，虽然目前看仍处于产业革命的早期，后期伴随着智能升级、现有应用的改造升级，人工智能产业产能全面进入质变阶段，但是，站在产业革命浪潮的面前，不能对其视而不见，因此我们认为人工智能仍然是未来中期的主线。同时 2024 年人工智能产业链可能会迎来业绩确认的阶段，意味着人工智能方向从估值提升阶段或进入估值业绩双升阶段。

另外，资源品由于全球错综复杂的关系、去美元化、产能周期等一系列原因，明显低估，因此重点增配了资源品。由于医药、公用事业等之前调整进入价值区间，我们认为若基本面出现边际改善，具有反弹甚至反转的可能。

债券方面，市场出现明显上涨，特别是久期长的券种，收益率下降较为显著。开年以后，权益市场表现不佳，地方债等政府债券发行进度偏慢，加上市场本身对经济基本面下行较为担忧，在此背景下，叠加资金面宽松，整体债券市场表现较好。组合操作上，固定收益类资产整体配置较为中性，整体跟上市场节奏，主要是纯债品种配置久期和市场中位数相比略短，同时组合配置了一定大盘低价转债取得一定收益。

4.5 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-1.60%，同期业绩基准增长率为 1.35%，C 类份额净值增长率为-1.71%，同期业绩基准增长率为 1.35%。

4.6 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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例(%) |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 62,646,565.02 | 14.14 |
| | 其中:股票 | 62,646,565.02 | 14.14 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 367,745,344.16 | 82.98 |
| | 其中:债券 | 367,745,344.16 | 82.98 |
| | 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 | 5,452,771.67 | 1.23 |
| 8 | 其他资产 | 7,319,146.63 | 1.65 |
| 9 | 合计 | 443,163,827.48 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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 | 6,586,038.00 | 1.51 |
| C | 制造业 | 41,526,908.42 | 9.55 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 14,533,618.60 | 3.34 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | - | - |
| 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 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 62,646,565.02 | 14.40 |

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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 | 300308 | 中际旭创 | 45,100 | 7,060,856.00 | 1.62 |
| 2 | 688166 | 博瑞医药 | 229,633 | 6,723,654.24 | 1.55 |
| 3 | 300049 | 福瑞股份 | 125,800 | 6,179,296.00 | 1.42 |
| 4 | 600027 | 华电国际 | 810,200 | 5,566,074.00 | 1.28 |
| 5 | 300394 | 天孚通信 | 31,700 | 4,795,259.00 | 1.10 |
| 6 | 300502 | 新易盛 | 60,200 | 4,033,400.00 | 0.93 |
| 7 | 603993 | 洛阳钼业 | 435,900 | 3,626,688.00 | 0.83 |
| 8 | 000543 | 皖能电力 | 404,780 | 3,367,769.60 | 0.77 |
| 9 | 601600 | 中国铝业 | 452,300 | 3,347,020.00 | 0.77 |
| 10 | 002281 | 光迅科技 | 86,800 | 3,343,536.00 | 0.77 |

5.4 报告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 | 24,470,907.83 | 5.62 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 103,856,047.40 | 23.87 |
| | 其中：政策性金融债 | 20,443,377.05 | 4.70 |
| 4 | 企业债券 | 102,429,305.20 | 23.54 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | 71,870,902.74 | 16.52 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 6,286,339.08 | 1.44 |
| 8 | 同业存单 | 58,831,841.91 | 13.52 |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 367,745,344.16 | 84.53 |

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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 | 112406074 | 24 交通银行 CD074 | 400,000 | 39,205,410.49 | 9.01 |
| 2 | 2028042 | 20 兴业银行永续债 | 200,000 | 21,113,451.37 | 4.85 |
| 3 | 2028051 | 20 浦发银行永续债 | 200,000 | 21,063,945.36 | 4.84 |
| 4 | 185731 | 22 铁建 Y1 | 200,000 | 20,621,849.86 | 4.74 |
| 5 | 185703 | 22 建材 Y3 | 200,000 | 20,595,358.90 | 4.73 |

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名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。

5.7 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。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

金额单位：人民币元

| 代码 | 名称 | 持仓量（买/卖） | 合约市值（元） | 公允价值变动（元） | 风险指标说明 |
|-------------------|--------------|----------|---------------|------------|------------|
| T2406 | 10 年期国债 2406 | -2 | -2,081,200.00 | -39,500.00 | - |
| TL2406 | 30 年期国债 2406 | -1 | -1,063,600.00 | -31,600.00 | - |
| TL2409 | 30 年期国债 2409 | -5 | -5,320,000.00 | 16,800.00 | - |
| 公允价值变动总额合计（元） | | | | | -54,300.00 |
| 国债期货投资本期收益（元） | | | | | -18.90 |
| 国债期货投资本期公允价值变动（元） | | | | | -41,400.00 |

5.10.3 本期国债期货投资评价

本报告期内，本基金投资国债期货符合既定的投资政策和投资目的。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

报告期内基金投资的前十名证券除 19 华夏银行永续债（证券代码 1928014）、20 浦发银行永续债（证券代码 2028051）、20 兴业银行永续债（证券代码 2028042）、21 农发 06（证券代码 210406）、22 铁建 Y1（证券代码 185731）、24 光大银行 CD020（证券代码 112417020）、24 交通银行 CD074（证券代码 112406074）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、19 华夏银行永续债（证券代码 1928014）

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

2、20 浦发银行永续债（证券代码 2028051）

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

3、20 兴业银行永续债（证券代码 2028042）

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

4、21 农发 06（证券代码 210406）

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

5、22 铁建 Y1（证券代码 185731）

根据 2023 年 4 月 26 日发布的相关公告,该证券发行人因未按期申报税款被国家税务总局广州市白云区税务局钟落潭税务所责令改正。

根据 2023 年 5 月 26 日发布的相关公告,该证券发行人因欠税被国家税务总局南通市税务局第三税务分局责令改正。

根据 2023 年 5 月 31 日发布的相关公告,该证券发行人因未按期申报税款被国家税务总局广州市白云区税务局钟落潭税务所责令改正。

根据 2023 年 6 月 26 日发布的相关公告,该证券发行人因欠税被国家税务总局南通市税务局第三税务分局责令改正。

根据 2023 年 6 月 28 日发布的相关公告,该证券发行人因未按期申报税款被国家税务总局广州市白云区税务局钟落潭税务所责令改正。

6、24 光大银行 CD020 (证券代码 112417020)

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

7、24 交通银行 CD074 (证券代码 112406074)

根据发布的相关公告,该证券发行人在报告期内因违规经营、违反反洗钱法、信息披露虚假或严重误导性陈述多次受到监管机构的处罚。

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

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

金额单位:人民币元

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|-------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 334,216.60 |
| 2 | 应收清算款 | 6,984,870.03 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 60.00 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 7,319,146.63 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|--------------|--------------|
| 1 | 110059 | 浦发转债 | 5,224,232.12 | 1.20 |

| | | | | |
|---|--------|------|------------|------|
| 2 | 113055 | 成银转债 | 540,057.43 | 0.12 |
| 3 | 127022 | 恒逸转债 | 258,894.41 | 0.06 |
| 4 | 118034 | 晶能转债 | 247,945.54 | 0.06 |
| 5 | 128136 | 立讯转债 | 15,209.58 | 0.00 |

5.11.5 报告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。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 招商瑞乐 6 个月持有期混合 A | 招商瑞乐 6 个月持有期混合 C |
|-------------------------------|---------------------|---------------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 350,132,698.27 | 118,042,335.07 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 13,393.02 | 6,058.81 |
| 减：报告期期间基金总赎回 份额 | 20,873,943.80 | 6,338,888.63 |
| 报告期期间基金拆分变动份 额（份额减少以“-”填列） | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 329,272,147.49 | 111,709,505.25 |

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的交易明细。

§ 8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会批准设立招商基金管理有限公司的文件；
- 2、中国证券监督管理委员会批准招商瑞乐 6 个月持有期混合型证券投资基金设立的文件；
- 3、《招商瑞乐 6 个月持有期混合型证券投资基金基金合同》；
- 4、《招商瑞乐 6 个月持有期混合型证券投资基金托管协议》；

- 5、《招商瑞乐 6 个月持有期混合型证券投资基金招募说明书》；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照。

8.2 存放地点

招商基金管理有限公司

地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

8.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人招商基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-887-9555

网址：<http://www.cmfcchina.com>

招商基金管理有限公司

2024 年 4 月 19 日