

# 招商资管睿丰三个月持有期债券型集合资产管理计划

## 2022 年中期报告

2022 年 06 月 30 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:2022 年 08 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、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。本中期报告已经三分之二以上董事签字同意，并由董事长签发。

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2022年8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。

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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2022年1月1日起至6月30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 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.8 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	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 净资产（基金净值）变动表	19
6.4 报表附注	22
§7 投资组合报告	51
7.1 期末基金资产组合情况	51
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	51
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	52
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	52
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	52
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	53
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	53
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	53
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53
7.12 投资组合报告附注	54
§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 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	57

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	57
§9 开放式基金份额变动.....	58
§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.....	59
10.4 基金投资策略的改变.....	59
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	59
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.....	59
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 影响投资者决策的其他重要信息.....	60
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	60
§12 备查文件目录.....	61
12.1 备查文件目录.....	61
12.2 存放地点.....	61
12.3 查阅方式.....	61

## § 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	595,340,096.50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	14,635,971.77份	340,892,848.47份	239,811,276.26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品种。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
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	0755-83082008
	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前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）	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	朱鹤新

### 2.4 信息披露方式

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

基金中期报告备置地点	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
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2022年01月01日-2022年06月30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
本期已实现收益	191,631.62	5,598,748.62	3,412,919.48
本期利润	211,073.67	6,041,565.33	3,804,159.71
加权平均基金份额本期利润	0.0143	0.0181	0.0167
本期加权平均净值利润率	1.32%	1.74%	1.62%
本期基金份额净值增长率	1.33%	1.78%	1.63%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2022年06月30日)		
期末可供分配利润	1,349,079.91	13,599,334.42	8,505,194.88
期末可供分配基金份额利润	0.0922	0.0399	0.0355
期末基金资产净值	15,985,051.68	356,910,983.86	250,015,025.72
期末基金份额净值	1.0922	1.0470	1.0425
3.1.3 累计期末指标	报告期末		

	(2022年06月30日)		
基金份额累计净值增长率	3.39%	4.70%	4.25%

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	0.20%	0.02%	-0.23%	0.02%	0.43%	0.00%
过去三个月	0.83%	0.02%	0.05%	0.03%	0.78%	-0.01%
过去六个月	1.33%	0.02%	0.04%	0.03%	1.29%	-0.01%
过去一年	2.59%	0.02%	0.28%	0.03%	2.31%	-0.01%
自基金合同生效起至今	3.39%	0.02%	0.67%	0.03%	2.72%	-0.01%

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
过去一个月	0.27%	0.02%	-0.23%	0.02%	0.50%	0.00%
过去三个月	1.06%	0.02%	0.05%	0.03%	1.01%	-0.01%
过去六个月	1.78%	0.02%	0.04%	0.03%	1.74%	-0.01%
过去一年	3.50%	0.02%	0.28%	0.03%	3.22%	-0.01%
自基金合同	4.70%	0.02%	0.67%	0.03%	4.03%	-0.01%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

## 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
过去一个月	0.24%	0.02%	-0.23%	0.02%	0.47%	0.00%
过去三个月	0.98%	0.02%	0.05%	0.03%	0.93%	-0.01%
过去六个月	1.63%	0.02%	0.04%	0.03%	1.59%	-0.01%
过去一年	3.19%	0.02%	0.28%	0.03%	2.91%	-0.01%
自基金合同 生效起至今	4.25%	0.02%	0.67%	0.03%	3.58%	-0.01%

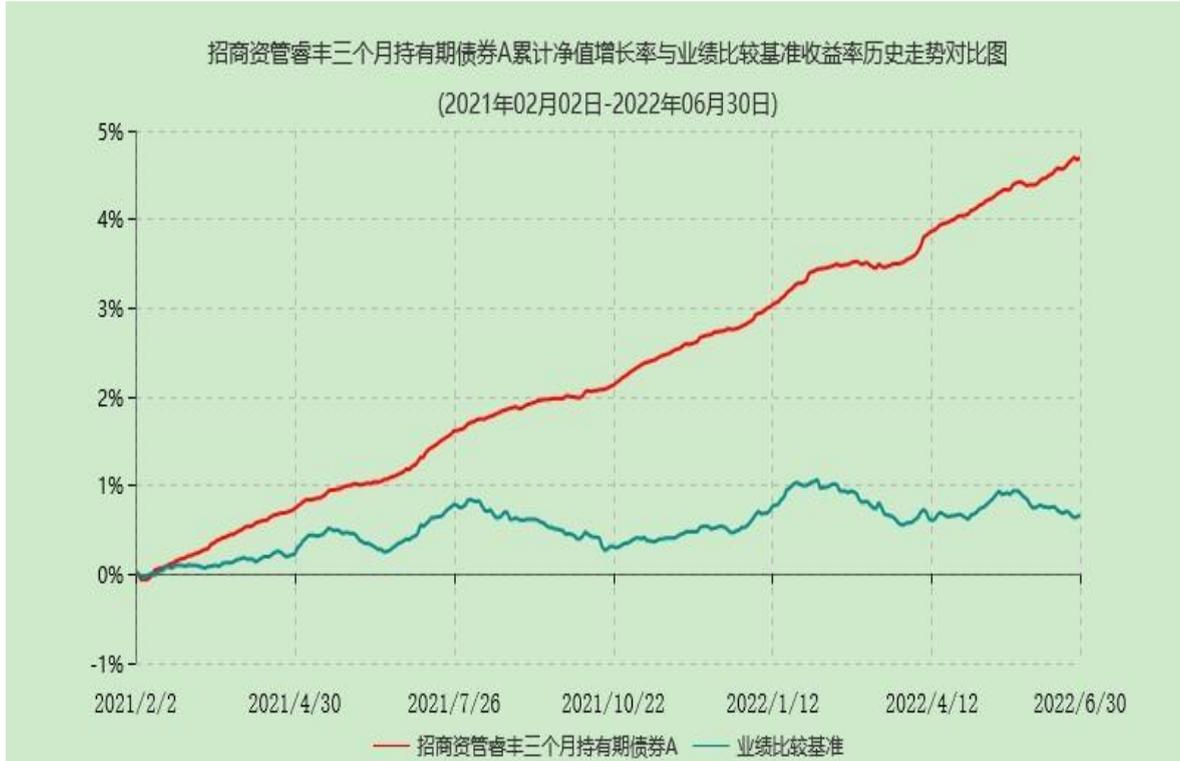
注：（1）本集合计划属于债券型集合资产管理计划，本集合计划业绩比较基准为“中债-综合全价（1-3年）指数收益率”；

（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



注：按集合计划合同和招募说明书的约定，本集合计划建仓期为合同生效后6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同有关规定。



注：按集合计划合同和招募说明书的约定，本集合计划建仓期为合同生效后6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同有关规定。



注：按集合计划合同和招募说明书的约定，本集合计划建仓期为合同生效后6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同有关规定。

## § 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，注册地址为深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室，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、交易等专业人员数十位，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	投资经理、本基金的基金经理	2021-02-02	-	6	北京大学硕士，拥有超过10年固定收益投研经验，现任固定收益投资部基金经理、投资经理。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）。
--	--	--	--	--	---

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

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
郑少亮	公募基金	1	622,911,061.26	2021-02-02
	私募资产管理计划	-	-	-
	其他组合	1	802,886,476.03	2022-06-22
	合计	2	1,425,797,537.29	-

注：（1）其他组合为未完成公募化改造的大集合产品；（2）“任职时间”为同时兼任多种类型产品的基金经理/投资经理在招商证券资产管理有限公司首次开始管理本类产品的时间。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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，无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。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本公司禁止不同投资组合之间或同一投资组合在同一交易日内进行反向交易。（完全复制指数组合、量化组合及其他经公司严格审批的产品除外）

报告期内，公司旗下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。

### 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

回顾上半年债券市场，一季度在经济下行、货币政策依然处于宽松周期的大背景下，市场呈现先涨后跌再修复的震荡走势。年初货币先行、为宽信用保驾护航意愿显著，OMO、MLF降息直接带来债市做多行情。2月以来，随着经济压力加大，托底经济的政策信号持续出现，多地尝试放松房地产需求端限制政策，宽信用担忧主导债市，利率开始步入调整阶段。直至3月中旬，公布的2月金融数据大幅低于预期，市场对于货币政策将进一步宽松的预期再起，债券市场连续两天大幅上涨一举修复到年初点位，之后市场重新在疫情影响经济及地产边际放松带来的宽信用担忧之间来回拉锯，震荡整理。全季度来看，1年期国债收益率下行11bp至2.13%；10年期国债收益率上行1bp至2.79%；1年期国开债收益率下行3bp至2.28%；10年期国开债收益率下行5bp至3.04%。第二季度的债市收益率延续震荡格局，十年国债收益率在2.7%-2.85%的历史底部区间内窄幅徘徊。但长短端表现分化，短端受4月以来超预期宽松的资金面持续支撑，而长端则在疫情拖累经济和宽信用预期两股力量之间来回拉锯，始终处在震荡行情之中，收益率曲线总体走陡。

投资方面，1月份临近农历春节假期，客户对产品申赎操作较为频繁，投资上以保证组合流动性需要为主，同时也保持了一定的杠杆水平享受债市上涨带来的业绩稳健增长。2、3月份产品暂缓了新增投资，并随着持仓资产到期而仓位略有下降，产品净值在

票息收益推动下得以缓步增长。二季度产品补充配置了短期限中高等级城投债券作为信用底仓获取稳健票息收益，同时择机买入5年期利率债用于交易目的；此外鉴于纯债收益率已处于历史极低水平，5月起产品开始建仓了少量转债仓位用于增加产品收益弹性及对冲纯债风险。二季度产品净值保持稳健增长。

#### 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1.0922元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.33%，同期业绩比较基准收益率为0.04%；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1.0470元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.78%，同期业绩比较基准收益率为0.04%；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1.0425元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.63%，同期业绩比较基准收益率为0.04%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

后续基本面方面，经济逐步走出二季度疫情影响，边际修复在进行中，但疫情影响存在长尾效应，经济修复进程及高度或不及预期，因此债市宏观环境尚好；当前债券市场呈现资金宽松+资产荒的行情，背后是宽货币和宽信用预期的来回博弈。短期来看，资金面宽松、政策处于观望期仍是债市面临的有利因素。

投资策略上，产品将继续坚持自身产品定位，保持中短久期运作，继续以短期限信用债作为底仓，后续视市场调整情况，将对组合久期、杠杆水平及时进行调整，短期内择机参与利率债波段交易机会；另外将在严控波动率前提下继续少量参与转债市场的投资机会。

#### 4.6 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。集合计划投资经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与自身担任投资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。

#### 4.7 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。

#### 4.8 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2022年上半年的投资运作，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2022年中期报告中的财务指标、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 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：2022年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	12,544,084.88	7,396,801.17
结算备付金		6,063,004.49	4,497,060.33
存出保证金		127,913.93	5,617.08
交易性金融资产	6.4.7.2	617,834,282.36	668,126,131.00
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		607,552,120.44	658,121,691.00
资产支持证券投资		10,282,161.92	10,004,440.00
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		-	5,483,791.78
应收股利		-	-
应收申购款		3,904,830.48	523,104.44
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	9,349,811.12
资产总计		640,474,116.14	695,382,316.92
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年06月30日</b>	<b>上年度末 2021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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		7,000,000.00	54,578,869.96
应付清算款		8,002,254.09	-
应付赎回款		805,032.56	8,847,089.92
应付管理人报酬		163,663.98	230,911.38
应付托管费		50,618.95	72,765.12
应付销售服务费		1,054,773.44	703,691.51
应付投资顾问费		-	-
应交税费		365,127.44	806,973.86
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.5	121,584.42	26,079.00
负债合计		17,563,054.88	65,266,380.75
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.6	595,340,096.50	612,670,838.56
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.7	27,570,964.76	17,445,097.61
净资产合计		622,911,061.26	630,115,936.17
负债和净资产总计		640,474,116.14	695,382,316.92

注：于报告截止日2022年6月30日，A类份额净值人民币1.0470元，份额总额340,892,848.47份；C类份额净值人民币1.0425元，份额总额239,811,276.26份；D类份额净值人民币1.0922元，份额总额14,635,971.77份；集合计划份额总额595,340,096.50份。

## 6.2 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：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
-----	-----	----	---------

		2022年01月01日至 2022年06月30日	2021年02月02日（基金 合同生效日）至2021 年06月30日
<b>一、营业总收入</b>		12,207,954.86	3,881,435.12
1. 利息收入		253,177.92	3,367,503.83
其中：存款利息收入	6.4.7.8	150,069.83	214,965.00
债券利息收入		-	2,579,112.23
资产支持证券利息 收入		-	244,595.13
买入返售金融资产 收入		103,108.09	328,831.47
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		10,727,677.95	-75,244.91
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.9	10,490,910.32	-75,244.91
资产支持证券投资 收益	6.4.7.10	190,421.92	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.11	46,345.71	-
股利收益		-	-
以摊余成本计量的 金融资产终止确认 产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.12	853,498.99	589,176.20
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”	6.4.7.13	373,600.00	-

号填列)			
<b>减：二、营业总支出</b>		2,151,156.15	720,765.05
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	960,975.77	425,171.63
2. 托管费	6.4.10.2.2	296,525.52	118,014.85
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	351,081.93	52,928.38
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		355,497.06	9,258.93
其中：卖出回购金融资产支出		355,497.06	9,258.93
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		32,541.14	9,544.10
8. 其他费用	6.4.7.14	154,534.73	105,847.16
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		10,056,798.71	3,160,670.07
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		10,056,798.71	3,160,670.07
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		10,056,798.71	3,160,670.07

### 6.3 净资产（基金净值）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：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2022年01月01日至2022年06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)	612,670,838. 56	-	17,445,097.6 1	630,115,936. 17
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)	612,670,838. 56	-	17,445,097.6 1	630,115,936. 17
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填 列)	-17,330,742. 06	-	10,125,867.1 5	-7,204,874.9 1
(一)、综合收益总 额	-	-	10,056,798.7 1	10,056,798.7 1
(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)	-17,330,742. 06	-	69,068.44	-17,261,673. 62
其中：1. 基金申购款	432,261,983. 78	-	15,796,734.0 4	448,058,717. 82
2. 基金赎回 款	-449,592,72 5.84	-	-15,727,665. 60	-465,320,39 1.44
(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)	595,340,096. 50	-	27,570,964.7 6	622,911,061. 26
项 目	上年度可比期间			
	2021年02月02日(基金合同生效日)至2021年06月30日			
	实收基金	其他综合收	未分配利润	净资产合计

		益		
一、上期期末净资产 (基金净值)	20,274,185.1 8	-	1,144,089.55	21,418,274.7 3
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)	20,274,185.1 8	-	1,144,089.55	21,418,274.7 3
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填 列)	528,691,065. 15	-	5,909,752.90	534,600,818. 05
(一)、综合收益总 额	-	-	3,160,670.07	3,160,670.07
(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)	528,691,065. 15	-	2,749,082.83	531,440,147. 98
其中: 1. 基金申购款	682,764,212. 73	-	4,234,156.30	686,998,369. 03
2. 基金赎回 款	-154,073,14 7.58	-	-1,485,073.4 7	-155,558,22 1.05
(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)	548,965,250. 33	-	7,053,842.45	556,019,092. 78

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:

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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 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”或“集合计划”）由招商证券安康添利集合资产管理计划变更而来。

招商证券安康添利集合资产管理计划为非限定性集合资产管理计划，经管理人和托管人协商一致于2016年8月18日由招商证券智远避险集合资产管理计划变更而来，招商证券智远避险集合资产管理计划于2010年12月14日经中国证监会证监许可[2010]1820号文核准设立，自2011年2月18日起开始募集，于2011年3月18日结束募集工作，并于2011年3月23日正式成立。

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。

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。本集合计划可以继续沿用原有的托管账户、证券账户、资金账户、期货账户等，也可以使用集合计划的新名称重新开立相关账户。关于集合计划合同变更的相关条款，若后续中国证监会会有相关要求、政策等，按中国证监会要求执行。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部颁布的《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、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于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修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本集合计划持续经营为基础列报。

### 6.4.3 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的要求，真实、完整地反映了本集合计划 2022年6月30日的财务状况以及2022年1月1日至2022年6月30日的经营成果和所有者权益（计划净值）变动情况。

### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 6.4.4.1 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。本会计期间为自2022年1月1日至2022年6月30日止期间。

#### 6.4.4.2 记账本位币

本集合计划记账本位币为人民币。

#### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成集合计划的金融资产（负债），并形成其他单位的金融负债（资产）或权益工具的合同。

##### （1）金融资产分类

本集合计划的金融资产于初始确认时分为以下两类：交易性金融资产、贷款和应收款项。金融资产分类取决于本集合计划管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。

本集合计划的股票投资、债券投资和基金投资等项目于初始确认时即划分为交易性金融资产。

本集合计划将持有的其他金融资产划分为贷款和应收款项，包括银行存款和各类应收款项等。

##### （2）金融负债分类

本集合计划的金融负债于初始确认时分为以下两类：交易性金融负债和其他金融负债。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本集合计划于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。

金融资产满足下列条件之一的，终止确认：

- （1）收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- （2）该金融资产已转移，且符合下述金融资产转移的终止确认条件。

金融资产转移，是指本集合计划将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方（转入方）。本集合计划已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产。

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的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，终止确认该金融负债或其一部分。

本集合计划主要金融工具的成本计价方法具体如下：

金融资产及金融负债初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益。其他类别的金融资产相关交易费用计入其初始确认金额。

处置金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。

按移动加权平均法计算库存证券成本。当日有买入和卖出时，先计算成本后计算买卖证券价差。

#### （1）证券

证券投资买入于成交日确认为证券投资。证券投资成本按成交的价款金额入账。卖出证券于成交日确认证券差价收入。出售证券的成本按移动加权平均法于成交日结转。

#### （2）买入返售金融资产

买入返售金融资产成本，按应付或实际支付的价款确认买入返售金融资产投资。

#### （3）其他投资

买入央行票据和零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算。

### 6.4.4.5 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：

集合计划管理人在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，应符合《企业会计准则》、监管部门有关规定。

（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。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当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。

#### 6.4.4.7 实收基金

本集合计划的份额面值为人民币1.00元。实收基金为对外发行基金份额总额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入实收基金增加和转出实收基金减少。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回计划份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占计划净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回计划份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占计划净值比例计算的金额。损益平准金于计划申购确认日或计划赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### 6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际

收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/（损失）系本集合计划持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### 6.4.4.10 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。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 本集合计划在符合分红条件的前提下可进行收益分配，每次收益分配比例等具体分红方案见集合计划管理人届时发布的相关分红公告；若本集合计划合同生效不满3个月可不进行收益分配；

(2) 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；

(3) 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；

(4) 由于本集合计划A类份额、C类份额和D类份额的收费方式不同，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；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规且对集合计划份额持有人利益无实质不利影响的前提下，集合计划管理人与集合计划托管人协商一致后，可对集合计划收益分配原则进行调整，并及时公告，不需召开集合计划份额持有人大会。

#### 6.4.4.12 分部报告

本集合计划无分部报告。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本集合计划无其他重要的会计政策和会计估计。

### 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

财政部于2017年颁布了修订后的《企业会计准则第22号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第23号—金融资产转移》、《企业会计准则第24号—套期会计》和《企业会计准则第37号—金融工具列报》（以下简称“新金融工具准则”）。

根据财政部《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》（2020年12月30日下发）的规定，本集合计划首次施行上述新金融工具准则的日期为2022年1月1日，该变化构成了会计政策变更。该会计政策变更事项未对本集合计划的财务报表构成重大影响。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本集合计划无会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本集合计划无差错更正。

#### 6.4.6 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。

#### 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 2022年06月30日
活期存款	12,544,084.88
等于：本金	12,540,161.41
加：应计利息	3,923.47
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	12,544,084.88

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30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	167,127,151.22	2,687,285.44	171,636,933.05	1,822,496.39
	银行间市场	428,662,469.71	5,112,947.39	435,915,187.39	2,139,770.29
	合计	595,789,620.93	7,800,232.83	607,552,120.44	3,962,266.68
资产支持证券	10,000,000.00	267,221.92	10,282,161.92	14,940.00	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	605,789,620.93	8,067,454.75	617,834,282.36	3,977,206.68	

#### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	10,114,500.00	-	-	-
--国债期货	10,114,500.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	10,114,500.00	-	-	-

#### 6.4.7.3.2 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
TF2209	5年期国债期货2209合约	-10.00	-10,114,500.00	-17,500.00
合计				-17,500.00
减：可抵销 期货暂收款				-17,500.00
净额				-

#### 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

本集合计划于本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本集合计划于本报告期末未持有买断式逆回购。

#### 6.4.7.5 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30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	37,637.95
其中：交易所市场	32,319.88
银行间市场	5,318.07
应付利息	-
预提费用	83,946.47
合计	121,584.42

#### 6.4.7.6 实收基金

##### 6.4.7.6.1 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 2022年01月01日至2022年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	14,944,002.52	14,944,002.52
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-308,030.75	-308,030.75
本期末	14,635,971.77	14,635,971.77

##### 6.4.7.6.2 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 2022年01月01日至2022年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	294,138,201.66	294,138,201.66
本期申购	233,439,023.98	233,439,023.98
本期赎回（以“-”号填列）	-186,684,377.17	-186,684,377.17
本期末	340,892,848.47	340,892,848.47

##### 6.4.7.6.3 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 2022年01月01日至2022年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	303,588,634.38	303,588,634.38
本期申购	198,822,959.80	198,822,959.80
本期赎回(以“-”号填列)	-262,600,317.92	-262,600,317.92
本期末	239,811,276.26	239,811,276.26

## 6.4.7.7 未分配利润

## 6.4.7.7.1 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
本期期初	1,376,699.48	-213,007.76	1,163,691.72
本期利润	191,631.62	19,442.05	211,073.67
本期基金份额交易产生的变动数	-29,507.39	3,821.91	-25,685.48
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-29,507.39	3,821.91	-25,685.48
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,538,823.71	-189,743.80	1,349,079.91

## 6.4.7.7.2 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
本期期初	6,716,308.27	1,720,607.53	8,436,915.80
本期利润	5,598,748.62	442,816.71	6,041,565.33
本期基金份额交易产	1,284,277.53	255,376.73	1,539,654.26

生的变动数			
其中：基金申购款	7,202,459.07	1,557,217.47	8,759,676.54
基金赎回款	-5,918,181.54	-1,301,840.74	-7,220,022.28
本期已分配利润	-	-	-
本期末	13,599,334.42	2,418,800.97	16,018,135.39

## 6.4.7.7.3 招商资管睿丰三个月持有期债券C

单位：人民币元

项目 (招商资管睿丰三个月 持有期债券C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	6,067,367.19	1,777,122.90	7,844,490.09
本期利润	3,412,919.48	391,240.23	3,804,159.71
本期基金份额交易产 生的变动数	-975,091.79	-469,808.55	-1,444,900.34
其中：基金申购款	5,662,586.71	1,374,470.79	7,037,057.50
基金赎回款	-6,637,678.50	-1,844,279.34	-8,481,957.84
本期已分配利润	-	-	-
本期末	8,505,194.88	1,698,554.58	10,203,749.46

## 6.4.7.8 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
活期存款利息收入	121,241.60
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	28,776.44
其他	51.79
合计	150,069.83

## 6.4.7.9 债券投资收益

## 6.4.7.9.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
债券投资收益——利息收入	9,670,119.39
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	820,790.93
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	10,490,910.32

## 6.4.7.9.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	396,411,802.48
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	386,828,314.18
减：应计利息总额	8,740,473.20
减：交易费用	22,224.17
买卖债券差价收入	820,790.93

## 6.4.7.10 资产支持证券投资收益

## 6.4.7.10.1 资产支持证券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
资产支持证券投资收益——	190,421.92

利息收入	
资产支持证券投资收益—— 买卖资产支持证券差价收入	-
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	190,421.92

#### 6.4.7.11 衍生工具收益

##### 6.4.7.11.1 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2022年01月01日至2022年06月30日
期货投资	46,345.71

#### 6.4.7.12 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
1. 交易性金融资产	899,780.18
——股票投资	-
——债券投资	889,280.18
——资产支持证券投资	10,500.00
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-17,500.00
——权证投资	-
——期货投资	-17,500.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增	28,781.19

值税	
合计	853,498.99

#### 6.4.7.13 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
基金赎回费收入	-
其他	373,600.00
合计	373,600.00

#### 6.4.7.14 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
审计费用	7,439.10
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	10,488.26
帐户维护费	77,100.00
合计	154,534.73

#### 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，本集合计划无需要披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 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。

#### 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。

**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**

本集合计划于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。

**6.4.10.1.2 权证交易**

本集合计划于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。

**6.4.10.1.3 债券交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日		上年度可比期间 2021年02月02日（基金合同生效日） 至2021年06月30日	
	成交金额	占当期 债券买 卖成交 总额的 比例	成交金额	占当期 债券买 卖成交 总额的 比例
招商证券 股份有限 公司	43,872,875.64	100.00%	52,516,673.04	100.00%

**6.4.10.1.4 债券回购交易**

金额单位：人民币元

关联方名	本期	上年度可比期间
------	----	---------

称	2022年01月01日至2022年06月30日		2021年02月02日（基金合同生效日） 至2021年06月30日	
	成交金额	占当期 债券回 购成交 总额的 比例	成交金额	占当期 债券回 购成交 总额的 比例
招商证券 股份有限 公司	3,258,300,000.00	100.00%	1,283,000,000.00	100.00%

## 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 2022年01月01日至2022年06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 股份有限 公司	16,498.62	100.00%	32,319.88	100.00%
关联方名 称	上年度可比期间 2021年02月02日（基金合同生效日）至2021年06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 股份有限 公司	8,265.57	100.00%	1,841.74	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。

## 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 2022年01月01日 至2022年06月30 日	上年度可比期间 2021年02月02日（基金合同 生效日）至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	960,975.77	425,171.63
其中：支付销售机构的客户维护费	194,174.48	161,658.78

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。

## 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日 至2022年06月30 日	上年度可比期间 2021年02月02日（基金合同生 效日）至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	296,525.52	118,014.85

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：

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

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。

#### 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 2022年01月01日至2022年06月30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	90,163.71	90,163.71
中信银行股份有限公司	0.00	0.00	0.00	0.00
合计	-	-	90,163.71	90,163.71
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021年02月02日（基金合同生效日）至2021年06月30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	47,382.48	47,382.48
中信银行股份有限公司	0.00	0.00	0.00	0.00
合计	-	-	47,382.48	47,382.48

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。

#### 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

本集合计划于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。

#### 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。

##### 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。

#### 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

招商资管睿丰三个月持有期债券D

份额单位：份

项目	本期 2022年01月01 日至2022年06 月30日	上年度可比期间 2021年02月02日（基金 合同生效日）至2021年0 6月30日

基金合同生效日（2021年02月02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	-	-

## 招商资管睿丰三个月持有期债券A

份额单位：份

项目	本期 2022年01月01 日至2022年06 月30日	上年度可比期间 2021年02月02日（基金 合同生效日）至2021年0 6月30日
基金合同生效日（2021年02月02日）持有的基金份额	-	9,999,000.00
报告期初持有的基金份额	9,999,000.00	-
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	9,999,000.00	9,999,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.93%	2.67%

## 招商资管睿丰三个月持有期债券C

份额单位：份

项目	本期 2022年01月01 日至2022年06 月30日	上年度可比期间 2021年02月02日（基金 合同生效日）至2021年0 6月30日
基金合同生效日（2021年02月02日）持有的基金份额	-	-

报告期初持有的基金份额	-	-
报告期内申购/买入总份额	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/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：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）。

#### 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，没有除集合计划管理人之外的其他关联方投资本集合计划的情况。

#### 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 2022年01月01日至2022年06月30日		上年度可比期间 2021年02月02日（基金合同生效日） 至2021年06月30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	12,544,084.88	121,241.60	37,758,313.34	207,862.38

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本集合计划于本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本集合计划于本报告期无其他关联交易事项。

#### 6.4.11 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内未发生利润分配。

#### 6.4.12 期末（2022年06月30日）本基金持有的流通受限证券

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

本集合计划本报告期末未持有流通受限证券。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本集合计划本报告期末未持有流通受限股票。

#### 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。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本集合计划本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 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。

##### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指计划在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者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。

##### 6.4.13.2.1 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 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
A-1	20,308,447.12	-

A-1以下	-	-
未评级	262,407,356.43	411,157,390.00
合计	282,715,803.55	411,157,390.00

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。

#### 6.4.13.2.2 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 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	10,282,161.92	10,004,440.00
合计	10,282,161.92	10,004,440.00

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。

#### 6.4.13.2.3 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短期同业存单。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	175,187,183.76	123,072,289.00
AAA以下	109,104,660.80	123,892,012.00
未评级	40,544,472.33	-
合计	324,836,316.89	246,964,301.00

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。

#### 6.4.13.2.5 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长期资产支持证券。

#### 6.4.13.2.6 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长期同业存单。

#### 6.4.13.3 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，计划管理人可能无法迅速、低成本地调整计划投资组合，从而对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

现金流风险是指计划因现金流不足导致无法应对正常计划支付义务的风险。本集合计划管理人对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。

#### 6.4.13.3.1 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。

#### 6.4.13.4 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。

##### 6.4.13.4.1 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计划面临的利率风险敞口进行监控，以对该风险进行管理。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 06 月 30 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							
银行存款	12,544,084.88	-	-	-	-	-	12,544,084.88
结算备付金	4,664,171.32	-	-	-	-	1,398,833.17	6,063,004.49
存出保证金	127,913.93	-	-	-	-	-	127,913.93
交易性金融资产	40,971,369.18	62,930,440.28	297,980,499.98	211,932,995.92	4,018,977.00	-	617,834,282.36
应收清算款	-	-	-	-	-	17,500.00	17,500.00
应收申购款	-	-	-	-	-	3,904,830.48	3,904,830.48
资产总计	58,307,539.31	62,930,440.28	297,980,499.98	211,932,995.92	4,018,977.00	5,321,163.65	640,491,616.14
负债							
卖出回购金融资产款	7,000,000.00	-	-	-	-	-	7,000,000.00
应付清算款	-	-	-	-	-	8,002,254.09	8,002,254.09
应付赎回款	-	-	-	-	-	805,032.56	805,032.56
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	163,663.98	163,663.98
应付托管费	-	-	-	-	-	50,618.95	50,618.95
应付销售服务费	-	-	-	-	-	1,054,773.44	1,054,773.44
应交税费	-	-	-	-	-	365,127.44	365,127.44
其他负债	-	-	-	-	-	121,584.42	121,584.42
负债总计	7,000,000.00	-	-	-	-	10,563,054.88	17,563,054.88
利率敏感度缺口	51,307,539.31	62,930,440.28	297,980,499.98	211,932,995.92	4,018,977.00	-5,241,891.23	622,928,561.26
上年度末 2021 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

## 招商资管睿丰三个月持有期债券型集合资产管理计划 2022 年中期报告

资产							
银行存款	7,396,801.17	-	-	-	-	-	7,396,801.17
结算备付金	3,007,096.93	-	-	-	-	1,489,963.40	4,497,060.33
存出保证金	5,617.08	-	-	-	-	-	5,617.08
交易性金融资产	10,063,250.00	100,467,370.00	320,566,630.00	237,028,881.00	-	-	668,126,131.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	5,483,791.78	5,483,791.78
应收利息	-	-	-	-	-	9,349,811.12	9,349,811.12
应收申购款	-	-	-	-	-	523,104.44	523,104.44
资产总计	20,472,765.18	100,467,370.00	320,566,630.00	237,028,881.00	-	16,846,670.74	695,382,316.92
负债							
卖出回购金融资产款	54,578,869.96	-	-	-	-	-	54,578,869.96
应付赎回款	-	-	-	-	-	8,847,089.92	8,847,089.92
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	230,911.38	230,911.38
应付托管费	-	-	-	-	-	72,765.12	72,765.12
应付销售服务费	-	-	-	-	-	703,691.51	703,691.51
应付交易费用	-	-	-	-	-	27,452.10	27,452.10
应交税费	-	-	-	-	-	806,973.86	806,973.86
应付利息	-	-	-	-	-	-9,373.10	-9,373.10
其他负债	-	-	-	-	-	8,000.00	8,000.00
负债总计	54,578,869.96	-	-	-	-	10,687,510.79	65,266,380.75
利率敏感度缺口	-34,106,104.78	100,467,370.00	320,566,630.00	237,028,881.00	-	6,159,159.95	630,115,936.17

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。

## 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利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 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
	利率上升25个基点	-1, 570, 755. 30	-1, 522, 843. 98
	利率下降25个基点	1, 575, 851. 94	1, 526, 483. 49

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本集合计划持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 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。

##### 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 2022年06月30日		上年度末 2021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	21, 534, 964. 25	3. 46	-	-
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	21,534,964.25	3.46	-	-

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

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本集合计划主要投资于固定收益类金融工具，因此无重大其他价格风险。

#### 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

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	21,534,964.25	-
第二层次	596,299,318.11	668,126,131.00
第三层次	-	-
合计	617,834,282.36	668,126,131.00

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本集合计划公允价值所属层次间不存在重大变动。

###### 6.4.14.3 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**

本集合计划未持有不以公允价值计量的金融工具。

**6.4.15 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。

**§ 7 投资组合报告****7.1 期末基金资产组合情况**

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	617,834,282.36	96.47
	其中：债券	607,552,120.44	94.86
	资产支持证券	10,282,161.92	1.61
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	18,607,089.37	2.91
8	其他各项资产	4,032,744.41	0.63
9	合计	640,474,116.14	100.00

注：本集合计划本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

**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**

本集合计划本报告期末未持有境内股票投资组合。

**7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合**

本集合计划本报告期末未持有港股通投资股票投资组合。

### 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

本集合计划本报告期末未持有股票。

### 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

本集合计划本报告期内未进行买入股票投资交易。

#### 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

本集合计划本报告期内未进行卖出股票投资交易。

#### 7.4.3 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。

### 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	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	132,481,077.67	21.27
	其中：政策性金融债	81,203,252.19	13.04
4	企业债券	168,447,679.07	27.04
5	企业短期融资券	232,041,697.53	37.25
6	中期票据	53,046,701.92	8.52
7	可转债(可交换债)	21,534,964.25	3.46
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	607,552,120.44	97.53

### 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

金额单位：人民币元

序	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净
---	------	------	-------	------	--------

号					值比例 (%)
1	102101717	21成都国投MT N003	200,000	21,226,115.0 7	3.41
2	188393	21东莞01	200,000	20,826,279.4 5	3.34
3	127438	PR望城建	500,000	20,703,123.9 8	3.32
4	188712	21安信C3	200,000	20,665,599.7 3	3.32
5	210208	21国开08	200,000	20,478,121.3 7	3.29

#### 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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	193508	信州1优	100,000	10,282,161.9 2	1.65

#### 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

本集合计划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

本集合计划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

本集合计划本报告期内未参与股指期货交易。

#### 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。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本集合计划本报告期内结合对5年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5年期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。

### 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本集合计划投资的前十名证券的发行主体中，在报告编制日前一年内，安信证券股份有限公司曾受到深圳证券交易所的通报批评，国家开发银行曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚，上海浦东发展银行股份有限公司曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚，处罚力度和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。

7.12.2 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。

### 7.12.3 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	127,913.93
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,904,830.48
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,032,744.41

## 7.12.4 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	110075	南航转债	1,398,370.68	0.22
2	127045	牧原转债	1,393,198.22	0.22
3	127032	苏行转债	1,136,001.37	0.18
4	123107	温氏转债	1,050,376.11	0.17
5	127029	中钢转债	1,033,409.42	0.17
6	113048	晶科转债	1,022,364.93	0.16
7	113044	大秦转债	981,522.74	0.16
8	127018	本钢转债	943,996.60	0.15
9	110060	天路转债	924,507.62	0.15
10	113049	长汽转债	854,414.67	0.14
11	110043	无锡转债	825,391.67	0.13
12	113051	节能转债	778,573.22	0.12
13	127005	长证转债	694,409.51	0.11
14	110080	东湖转债	674,296.73	0.11
15	110064	建工转债	619,315.07	0.10
16	127049	希望转2	614,098.22	0.10
17	113505	杭电转债	591,207.95	0.09
18	113579	健友转债	506,604.93	0.08
19	110053	苏银转债	503,917.92	0.08
20	113588	润达转债	449,362.74	0.07
21	113623	凤21转债	355,638.37	0.06
22	110081	闻泰转债	246,368.16	0.04
23	113033	利群转债	218,858.90	0.04

## 7.12.5 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。

## 7.12.6 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。

## § 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 资管 睿丰 三个 月持 有期 债券D	141	103,801.22	0.00	0.00%	14,635,971.77	100.0 0%
招商 资管 睿丰 三个 月持 有期 债券A	5,368	63,504.63	248,015,198.80	72.7 5%	92,877,649.67	27.25%
招商 资管 睿丰 三个 月持 有期 债券C	3,512	68,283.39	2,662,052.30	1.11%	237,149,223.96	98.89%
合计	9,021	65,994.91	250,677,251.10	42.1 1%	344,662,845.40	57.89%

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。

## 8.2 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员持有本基金	招商资管睿丰三个月持有期债券D	0.00	0.00%
	招商资管睿丰三个月持有期债券A	1,011.26	0.00%
	招商资管睿丰三个月持有期债券C	3,800.56	0.00%
	合计	4,811.82	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）。

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	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

	月持有期债券C	
	合计	0

## § 9 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)基金份额总额	20,274,185.18	-	-
本报告期期初基金份额总额	14,944,002.52	294,138,201.66	303,588,634.38
本报告期基金总申购份额	-	233,439,023.98	198,822,959.80
减：本报告期基金总赎回份额	308,030.75	186,684,377.17	262,600,317.92
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	14,635,971.77	340,892,848.47	239,811,276.26

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 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。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本集合计划管理人于2022年4月26日发布公告，自2022年4月25日起，熊志钢先生离任公司总经理，杨阳先生新任公司总经理。

本集合计划管理人于2022年5月14日发布公告，自2022年5月13日起，杨阳先生新任公司董事长。

本集合计划管理人于2022年6月7日发布公告，自2022年6月2日起，熊志钢先生新任公司副董事长。

本集合计划管理人于2022年7月2日发布公告，自2022年6月30日起，吴曼女士离任公司合规总监，熊志钢先生新任公司合规总监。

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。

### 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。

### 10.4 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。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本集合计划未改聘会计师事务所。

### 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

本报告期内，本集合计划管理人、托管人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

### 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	
招商证券股份有限公司	2	-	-	16,498.62	100.00%	-

#### 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		基金交易	
	成交金额	占当	成交金额	占当	成交	占当	成交	占当

		期债券成交总额的比例		期债券回购成交总额的比例	金额	期权证成交总额的比例	金额	期基金成交总额的比例
招商证券股份有限公司	43,872,875.64	100.00%	3,258,300,000.00	100.00%	-	-	-	-

## 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	中国证监会规定报刊及网站	2022-07-02
2	招商证券资产管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-06-07
3	招商证券资产管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-05-14
4	招商证券资产管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-04-26
5	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（更新）及产品资料概要（更新）提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-02-28
6	招商证券资产管理有限公司旗下资产管理产品执行新金融工具相关会计准则的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-01-01

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本集合计划本报告期未出现单一投资者持有集合计划份额比例达到或超过20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

自2022年5月23日起，本管理人的法定代表人由邓晓力变更为杨阳。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 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、中国证监会要求的其他文件。

### 12.2 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/>。

### 12.3 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  
二〇二二年八月三十日