

招商安本增利债券型证券投资基金 2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人：招商基金管理有限公司

基金托管人：中国光大银行股份有限公司

送出日期：2023 年 3 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 3 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

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

本报告财务资料已经审计，德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了 2022 年度无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

| | |
|----------------------------------------------|----|
| §1 重要提示及目录..... | 1 |
| 1.1 重要提示..... | 1 |
| 1.2 目录..... | 2 |
| §2 基金简介..... | 4 |
| 2.1 基金基本情况..... | 4 |
| 2.2 基金产品说明..... | 4 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人..... | 4 |
| 2.4 信息披露方式..... | 5 |
| 2.5 其他相关资料..... | 5 |
| §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况..... | 5 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 5 |
| 3.2 基金净值表现..... | 6 |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况..... | 9 |
| §4 管理人报告..... | 9 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况..... | 9 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明..... | 11 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 11 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明..... | 12 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 15 |
| 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..... | 17 |
| 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的真实、准确和完整发表意见..... | 18 |
| §6 审计报告..... | 19 |
| 6.1 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..... | 22 |
| 7.3 净资产（基金净值）变动表..... | 24 |
| 7.4 报表附注..... | 25 |
| §8 投资组合报告..... | 52 |
| 8.1 期末基金资产组合情况..... | 53 |
| 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合..... | 53 |
| 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..... | 54 |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 55 |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 57 |
| 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..... | 57 |

| | | |
|------|----------------------------------------|----|
| 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..... | 57 |
| 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..... | 57 |
| 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..... | 58 |
| 8.10 | 本基金投资股指期货的投资政策..... | 58 |
| 8.11 | 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 58 |
| 8.12 | 投资组合报告附注..... | 58 |
| §9 | 基金份额持有人信息..... | 60 |
| 9.1 | 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 60 |
| 9.2 | 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 60 |
| 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..... | 61 |
| §10 | 开放式基金份额变动..... | 61 |
| §11 | 重大事件揭示..... | 61 |
| 11.1 | 基金份额持有人大会决议..... | 61 |
| 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..... | 61 |
| 11.3 | 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 62 |
| 11.4 | 基金投资策略的改变..... | 62 |
| 11.5 | 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 62 |
| 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..... | 62 |
| 11.7 | 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 62 |
| 11.8 | 其他重大事件..... | 63 |
| §12 | 影响投资者决策的其他重要信息..... | 65 |
| 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..... | 66 |
| §13 | 备查文件目录..... | 66 |
| 13.1 | 备查文件目录..... | 66 |
| 13.2 | 存放地点..... | 66 |
| 13.3 | 查阅方式..... | 66 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|---------------------|--------------------|--------------------|
| 基金名称 | 招商安本增利债券型证券投资基金 | |
| 基金简称 | 招商安本增利债券 | |
| 基金主代码 | 217008 | |
| 交易代码 | 217008 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2006 年 7 月 11 日 | |
| 基金管理人 | 招商基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国光大银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 4,406,029,477.98 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 招商安本增利债券 A | 招商安本增利债券 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 014775 | 217008 |
| 报告期末下属分级基金的份 额总额 | 2,401,972,238.05 份 | 2,004,057,239.93 份 |

注：本基金从 2022 年 1 月 5 日起新增 A 类份额，A 类份额自 2022 年 1 月 6 日起存续。

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标 | 在严格控制投资风险、维护基金本金安全的基础上，为基金份额持有人谋求持续稳健的投资收益。 |
| 投资策略 | 本基金对债券等固定收益类品种的投资比例为 80%-100%（其中现金或到期日在一年以内的政府债券不低于 5%）；股票、存托凭证等权益类品种的投资比例为 0%-20%。当本基金管理人判断市场出现明显的投资机会，或行业（个股）的投资价值被明显低估时，本基金可以直接参与股票二级市场投资，努力获取超额收益。在构建二级市场股票投资组合时，本基金管理人强调将定量的股票筛选和定性的公司研究有机结合，挖掘价值被低估的股票。具体投资策略包括：（1）资产配置策略；（2）货币市场工具投资策略；（3）债券（不含可转债）投资策略；（4）可转债投资策略；（5）股票投资策略；（6）存托凭证投资策略。 |
| 业绩比较基准 | 三年期银行定期存款利率(税后)+0.2% |
| 风险收益特征 | 本基金为流动性好、低风险、稳健收益类产品，可以满足追求本金安全基础上持续稳健收益的个人和机构投资者的投资需求。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| | | |
|---------|------------|--------------|
| 项目 | 基金管理人 | 基金托管人 |
| 名称 | 招商基金管理有限公司 | 中国光大银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 潘西里 |
| | | 石立平 |

| | | | |
|--------|------|-------------------|-------------------------------|
| | 联系电话 | 0755-83196666 | 010-63639180 |
| | 电子邮箱 | cmf@cmfchina.com | shiliping@cebbank.com |
| 客户服务电话 | | 400-887-9555 | 95595 |
| 传真 | | 0755-83196475 | 010-63639132 |
| 注册地址 | | 深圳市福田区深南大道 7088 号 | 北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心 |
| 办公地址 | | 深圳市福田区深南大道 7088 号 | 北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心 |
| 邮政编码 | | 518040 | 100033 |
| 法定代表人 | | 王小青 | 王江 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|---------------------------------------------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 上海证券报 |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | http://www.cmfchina.com |
| 基金年度报告备置地点 | 基金管理人及基金托管人住所 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|--------------------|--------------------------|
| 会计师事务所 | 德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙） | 中国上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼 |
| 注册登记机构 | 招商基金管理有限公司 | 深圳市福田区深南大道 7088 号 |

§ 3 主要财务指标、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

单位：人民币元

1、招商安本增利债券 A

| | |
|---------------|---------------------------------|
| 3.1.1 期间数据和指标 | 2022 年 1 月 6 日-2022 年 12 月 31 日 |
| 本期已实现收益 | 4,855,543.65 |
| 本期利润 | -72,249,600.00 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.0777 |
| 本期加权平均净值利润率 | -4.81% |
| 本期基金份额净值增长率 | -2.24% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2022 年末 |
| 期末可供分配利润 | 780,232,796.68 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.3248 |
| 期末基金资产净值 | 3,574,700,294.35 |
| 期末基金份额净值 | 1.4882 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 2022 年末 |

| | |
|-------------|--------|
| 基金份额累计净值增长率 | -2.24% |
|-------------|--------|

2、招商安本增利债券 C

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2022 年 | 2021 年 | 2020 年 |
|---------------|------------------|------------------|----------------|
| 本期已实现收益 | 18,553,684.08 | 30,929,868.00 | 40,012,227.59 |
| 本期利润 | -133,975,016.21 | 49,692,844.44 | 28,272,916.09 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.0731 | 0.1688 | 0.0893 |
| 本期加权平均净值利润率 | -4.48% | 10.58% | 6.03% |
| 本期基金份额净值增长率 | -2.59% | 10.11% | 7.42% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2022 年末 | 2021 年末 | 2020 年末 |
| 期末可供分配利润 | 641,901,177.68 | 512,396,551.38 | 88,307,992.78 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.3203 | 0.4511 | 0.3399 |
| 期末基金资产净值 | 2,973,728,121.19 | 1,898,027,872.45 | 394,260,826.68 |
| 期末基金份额净值 | 1.4839 | 1.6709 | 1.5175 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 2022 年末 | 2021 年末 | 2020 年末 |
| 基金份额累计净值增长率 | 172.21% | 179.45% | 153.80% |

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

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

3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数；

4、本基金从 2022 年 1 月 5 日起新增 A 类份额，A 类份额自 2022 年 1 月 6 日起存续，截至本报告期末存续未满足 1 年，本报告期为非完整会计年度。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

招商安本增利债券 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 | -0.26% | 0.26% | 0.74% | 0.01% | -1.00% | 0.25% |
| 过去六个月 | -1.49% | 0.26% | 1.49% | 0.01% | -2.98% | 0.25% |
| 自基金合同生效起至今 | -2.24% | 0.34% | 2.91% | 0.01% | -5.15% | 0.33% |

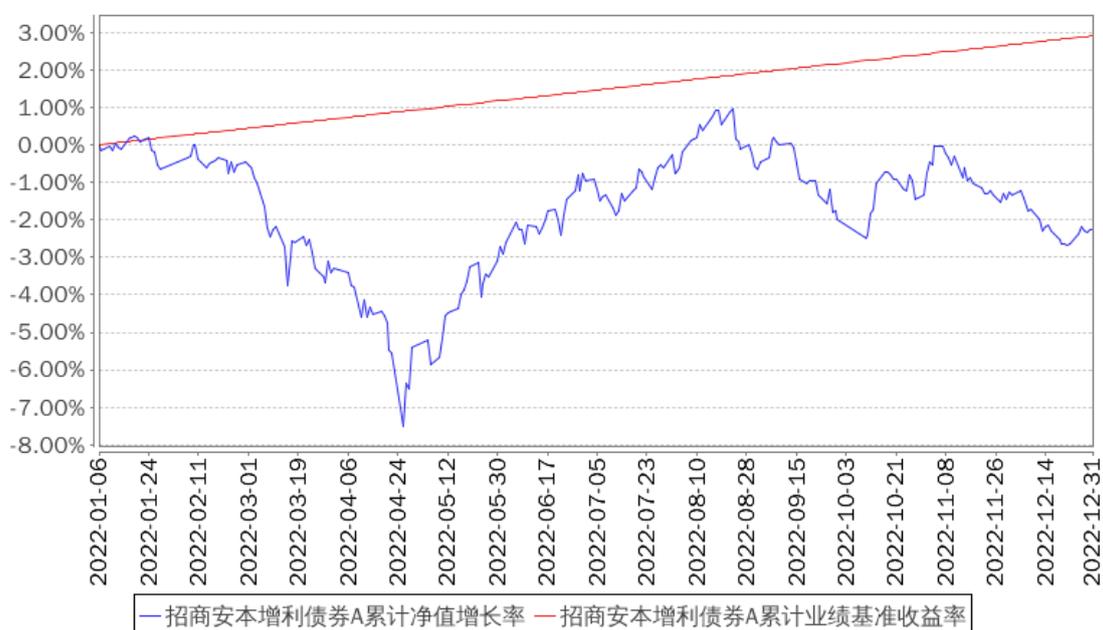
招商安本增利债券 C

| 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 | -0.26% | 0.26% | 0.74% | 0.01% | -1.00% | 0.25% |
| 过去六个月 | -1.49% | 0.26% | 1.49% | 0.01% | -2.98% | 0.25% |
| 自基金合同生效起至今 | -2.24% | 0.34% | 2.91% | 0.01% | -5.15% | 0.33% |

| | | 准差② | 率③ | 率标准差 ④ | | |
|----------------|---------|-------|--------|-----------|---------|-------|
| 过去三个月 | -0.33% | 0.26% | 0.74% | 0.01% | -1.07% | 0.25% |
| 过去六个月 | -1.63% | 0.26% | 1.49% | 0.01% | -3.12% | 0.25% |
| 过去一年 | -2.59% | 0.34% | 2.95% | 0.01% | -5.54% | 0.33% |
| 过去三年 | 15.21% | 0.27% | 8.85% | 0.01% | 6.36% | 0.26% |
| 过去五年 | 18.91% | 0.35% | 14.75% | 0.01% | 4.16% | 0.34% |
| 自基金合同 生效起至今 | 172.21% | 0.39% | 60.73% | 0.01% | 111.48% | 0.38% |

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

招商安本增利债券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



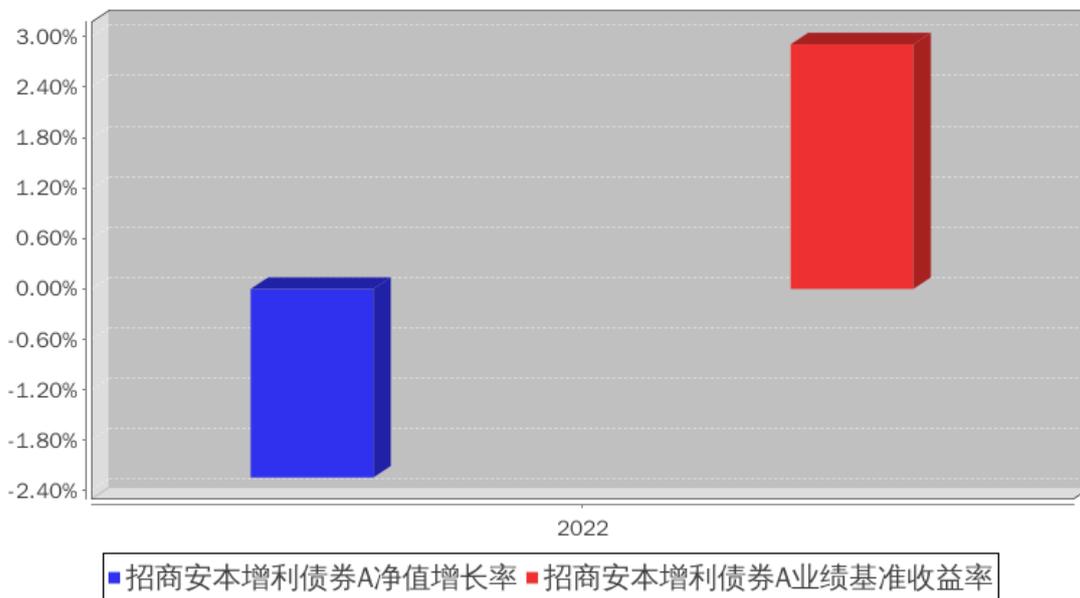
招商安本增利债券C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



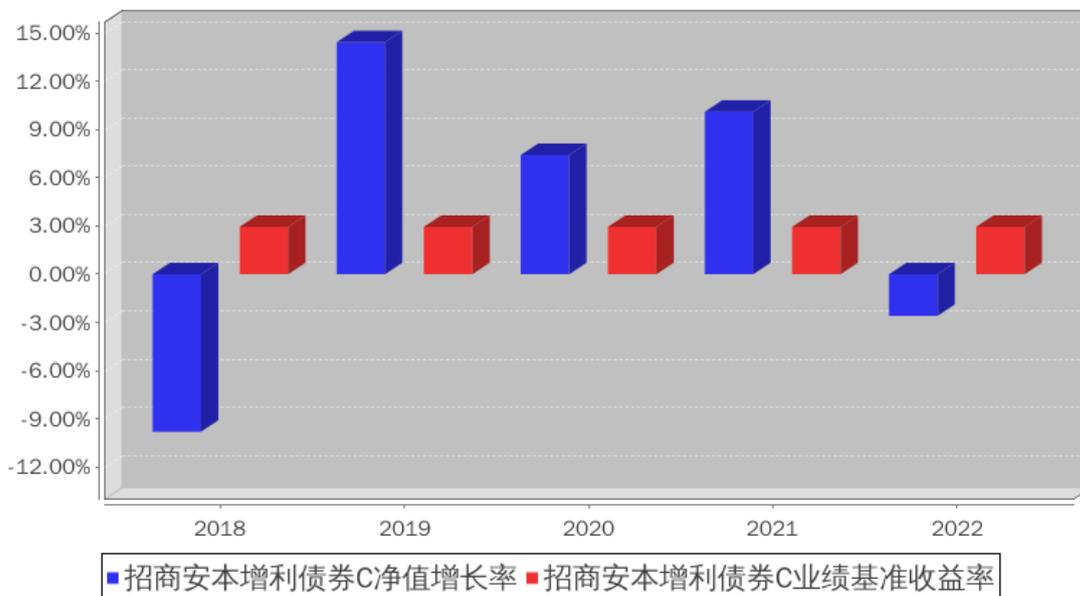
注：本基金从 2022 年 1 月 5 日起新增 A 类份额，A 类份额自 2022 年 1 月 6 日起存续。

3.2.3 过去五年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

招商安本增利债券A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



招商安本增利债券C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金从 2022 年 1 月 5 日起新增 A 类份额，A 类份额自 2022 年 1 月 6 日起存续，截至本报告期末 A 类份额存续未满 1 年，故本报告期净值增长率按当年实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

招商安本增利债券 A

| 年度 | 每 10 份基金份额分红数 | 现金形式发放总额 | 再投资形式发放总额 | 年度利润分配合计 | 备注 |
|--------|---------------|---------------|----------------|----------------|----|
| 2022 年 | 1.4400 | 63,840,320.97 | 266,771,250.61 | 330,611,571.58 | - |
| 合计 | 1.4400 | 63,840,320.97 | 266,771,250.61 | 330,611,571.58 | - |

招商安本增利债券 C

| 年度 | 每 10 份基金份额分红数 | 现金形式发放总额 | 再投资形式发放总额 | 年度利润分配合计 | 备注 |
|--------|---------------|----------------|---------------|----------------|----|
| 2022 年 | 1.4400 | 199,365,783.08 | 99,285,578.59 | 298,651,361.67 | - |
| 2021 年 | - | - | - | - | - |
| 2020 年 | - | - | - | - | - |
| 合计 | 1.4400 | 199,365,783.08 | 99,285,578.59 | 298,651,361.67 | - |

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

招商基金管理有限公司于 2002 年 12 月 27 日经中国证监会【2002】100 号文批准设立。目前，公司注册资本为人民币 13.1 亿元，招商银行股份有限公司持有公司全部股权的 55%，招商证券股份有限公司持有公司全部股权的 45%。

招商基金管理有限公司首批获得企业年金基金投资管理人资格、基本养老保险基金投资管理人资格；2004 年获得全国社保基金投资管理人资格；同时拥有合格境内机构投资者（QDII）业务资格、专户理财（特定客户资产管理业务）资格、公募基金投顾业务资格，在主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、海外投资、FOF 投资等领域全面布局。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理（助理）期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|---------|-----------------|------|--------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 滕越 | 本基金基金经理 | 2017 年 7 月 29 日 | - | 13 | 女，硕士。2009 年 7 月加入民生证券股份有限公司，曾任分析师；2014 年 9 月加入华创证券有限责任公司，曾任高级分析师；2016 年 3 月加入招商基金管理有限公司固定收益投资部，从事固定收益类产品研究及投资组合辅助管理相关工作，曾任招商安达灵活配置混合型证券投资基金、招商稳盛定期开放灵活配置混合型证券投资基金、招商稳阳定期开放灵活配置混合型证券投资基金、招商稳乾定期开放灵活配置混合型证券投资基金、招商稳泰定期开放灵活配置混合型证券投资基金、招商稳祥定期开放灵活配置混合型证券投资基金、招商添德 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理，现任招商安本增利债券型证券投资基金、招商信用增强债券型证券投资基金、招商民安增益债券型证券投资基金、招商添浩纯债债券型证券投资基金、招商盛合灵活配置混合型证券投资基金、招商丰凯灵活配置混合型证券投资基金、招商稳恒中短债 60 天持有期债券型证券投资基金基金经理。 |
| 王娟娟 | 本基金基金经理 | 2022 年 1 月 14 日 | - | 15 | 女，硕士。曾任职于中航三星人寿保险有限公司、天安人寿保险股份有限公司、中荷人寿保险有限公司，主要从事债券市场研究、债券等固定收益投资相关工作。2015 年 5 月加入招商基金管理有限公司。 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|---------------------------------------------------------------------------------------|
| | | | | | 公司固定收益投资部，曾任投资经理，现任招商安华债券型证券投资基金、招商招悦纯债债券型证券投资基金、招商安本增利债券型证券投资基金、招商亨利增强债券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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

基金管理人声明：在本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关法律法规及其各项实施准则的规定以及本基金的基金合同等基金法律文件的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的前提下，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围以及投资运作符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

基金管理人根据《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》和《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》（2011 年修订）的规定，制定了《招商基金管理有限公司公平交易管理办法》，对投资决策的内部控制、交易执行的内部控制、公平交易实施情况的监控与检查稽核、异常交易的监控等进行了规定。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，基金管理人合理设置了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，建立了科学的投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

基金管理人已建立较完善的研究方法和投资决策流程，确保各投资组合享有公平的投资决策机会。基金管理人建立了所有组合适用的投资对象备选库，制定明确的备选库建立、维护程序。基金管理人拥有健全的投资授权制度，明确投资决策委员会、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限划分，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资

权限的操作需要经过严格的审批程序。基金管理人的相关研究成果向内部所有投资组合开放，在投资研究层面不存在各投资组合间不公平的问题。

基金管理人按照法规要求，对连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合间的同向交易的交易价差进行分析，相关投资组合经理也对分析中发现的价格差异次数占比超过正常范围的情况进行了合理性解释。报告期内，公司旗下投资组合同向交易价差分析中未发现异常情形。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

基金管理人严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。确因投资组合的投资策略或流动性等需要而发生的同日反向交易，基金管理人要求相关投资组合经理提供决策依据，并留存记录备查，完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合等除外。

本报告期内，本基金各项交易均严格按照相关法律法规、基金合同的有关要求执行，公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形共发生过七次，原因是指数量化投资组合为满足投资策略需要而发生反向交易。报告期内未发现有可能导致不公平交易和利益输送的重大异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

宏观经济回顾：

2022 年，国内经济由于疫情扰动的影响，增长略显疲弱，全年 GDP 同比增长 3%，增速较上年下降 5.1%。分季度看，四个季度 GDP 增速分别为 4.8%、0.4%、3.9% 和 2.9%，第二季度和第四季度由于受疫情影响较大，增速明显偏低。投资方面，12 月固定资产投资完成额累计同比增长 5.1%，增速在 2022 年呈现持续下滑态势。其中房地产投资负增长幅度持续走阔，12 月房地产开发投资累计同比下降 10%，虽然地产行业需求和供给端改善政策频出，但在行业整体销售依然低迷的背景下，地产企业拿地和新开工意愿仍较为低迷；12 月基建投资累计同比增长 11.5%，随着宽财政政策不断推出，基建投资依然是经济增长的重要稳定器；12 月制造业投资累计同比增长 9.1%，增速同样在 2022 年表现为趋势性下行，主要系在出口下滑及工业企业利润同比转负的情形下，制造业企业投资意愿趋弱所致。消费方面，12 月社会消费品零售总额累计同比下降 0.2%，消费受疫情散发影响在 2022 年表现疲弱。对外贸易方面，随着全球加息周期下欧美国家经济普遍即将进入衰退周期，叠加前期国内出口高基数影响，12 月出口金额当月同比增速已降至 9.9%，出口增速承压明显。生产方面，2022 年 12 月 PMI 指数为 47%，依旧在荣枯线以下，经济增长相对疲弱，12 月生产指数和新订单指数分别为 44.6% 和 43.9%。整体来看，随着优化政策出台后疫情在国内迅速达峰，叠

加服务性消费恢复较好，预计 2023 年经济增长将迎来筑底修复，但地产销售持续疲弱和出口增速对经济形成拖累仍值得关注。

债券市场回顾：

2022 年债市整体基于弱现实和强预期两条逻辑线进行博弈，上半年国债收益率呈现窄幅震荡行情，下半年波动幅度明显加大，尤其 11 月疫情防控优化政策和地产支持政策的出台对债券市场形成较大冲击。

具体来看，2022 年上半年 10 年国债收益率波动幅度基本在 10bp 以内，长端对基本面的反应较为钝化。1 月份在经济数据持续低迷、央行下调 MLF 和 OMO 利率、市场预期央行降准降息可能性较大的情形下，10 年国债收益率从 2.8% 下行至 1 月下旬 2.68% 的低点水平，2 月份由于社融数据超预期、降息预期落空、地产放松政策频出带动稳增长预期提振，10 年国债收益率又重新上行至 2.8% 左右。3-4 月债市开始进入震荡行情，随着统计局发布的 4 月经济数据超预期弱、稳定经济大盘会议召开，叠加期限利差高企、资金面持续宽松，10 年国债收益率又迎来一波下行，5 月底达到 2.7% 低位。进入 6 月，在经济数据有所改善、美国通胀压力持续导致美联储鹰派预期抬升的情形下，10 年国债收益率在 6 月底回到 2.83% 左右的阶段性高点水平。

进入下半年，7 月份随着地产销售高频数据并未出现改善，且资金面仍维持宽松，10 年国债收益率由 2.84% 下探至 2.72% 附近。8 月份 PMI 超预期回落、社融数据不及预期进一步加重市场对经济担忧，同时 MLF 和 OMO 降息 10bp 带动债市快速走强，10 年国债收益率于 8 月中旬触及 2.58% 的底部水平。9 月份，经济数据脉冲式企稳、资金面边际收紧压力、欧美债市下跌等多重利空使得 10 年国债收益率又从底部回调至 2.76% 水平，但 10 月份由于消费、地产数据表现不佳，疫情在全国多地散发等因素，10 年国债收益率回落至 2.64%。11-12 月，在疫情防控二十条和央行支持地产十六条政策推出后，债券市场利率大幅调整，迎来一波行情调整，10 年国债收益率最高触及 2.92% 水平。

分品种看，信用债波动幅度较利率债更大，上半年在资产荒和流动性宽松背景下，信用债收益率整体呈下行趋势，信用利差持续压缩，但 11 月债市调整以来，由于理财产品普遍净值回撤面临赎回潮，且理财机构信用债持仓占比更高，这一轮赎回潮中信用债调整幅度明显大于利率债，且调整时间更长，直至 12 月下旬信用债收益率的上行趋势已基本企稳。

股票市场回顾：

2022 年一季度，由于内外部的各方面影响，经济加速下探。至 3 月，制造业和服务业 PMI 均回落至临界点之下。疫情管控程度超过新冠爆发以来的最高水平。此轮病毒的高传染特征显著增加了未来经济恢复的不确定性。而价格方面，由于俄乌冲突、海外经济持续修复等因素叠加，大宗商品遭受巨大供给冲击，上游价格上涨明显，对中游企业利润造成挤压。美联储加息和缩表进程中，中美息差快速缩窄，对汇率也会造成一定制约，对国内

的政策造成约束，以及影响大类资产之间的估值性价比。面对各方面的冲击扰动，A 股市场年初开始一路震荡下行，3 月以后加速下跌，整体一季度跌幅较大。整体一季度成交量略微缩窄，北上资金 2 月后快速流出，但 3 月末已经企稳。全市场赚钱效应较差。

运行至二季度，疫情继续对国内造成影响。但 5 月以来，疫情影响逐渐消退，国内经济迎来反弹修复。6 月开始，工业生产、消费、投资、出口均出现不同程度的改善。而 PPI 进一步回落，降低了一部分中游企业的压力。从信用端看，社融增速继续保持较高水平，政府债继续高增。政府也出台了一揽子稳经济的政策，我国经济呈现出比较强的韧性。反观海外，通胀因素不断超预期，海外资产开始对衰退进行定价。美联储的快速收紧也导致全球金融市场的波动性和不确定性上升。这一方面导致下半年出口面临压力，且海外风险资产下跌会降低全球风险偏好；另一方面，考虑到国内相对稳健的货币和财政政策以及稳定的增长趋势，中国资产也会吸引一定的海外资金配置。从市场来看，整个二季度，四月市场快速杀跌，5-6 月 V 型反弹后持续上涨。这一轮反弹中，新能源车、光伏等行业领涨市场，传统经济板块有不同程度的跑输。

三季度后，市场震荡下行，特别是九月份市场加速下行，成交量快速收窄。海外方面，由于美国通胀持续超预期，联储加息预期上修，美元指数持续上涨至 110 以上高位，人民币汇率承压。欧美的衰退预期增强，国内出口新订单进入下行趋势，预计拖累未来出口。俄乌冲突仍然有较大不确定性，对欧洲能源安全及全球供应链造成冲击。国内方面，三季度疫情虽然没有大规模爆发，但仍散点状在全国范围持续，使得疫情管控较为严格，居民出行及消费受到一定影响。而稳增长政策持续推出，对于相关企业未来盈利预期有逐步改善趋势。另外，国内部分产业升级趋势持续，高端制造业有较强竞争力，经济发展动力稳固。估值层面，市场各类宽基指数估值接近历史最低分位，股票市场性价比凸显。从市场表现来看，仅煤炭行业表现较好，取得正收益。公用事业、石化、交运等板块跌幅较小。建材、新能源、电子、汽车、传媒等板块表现相对较差。

2022 年四季度，市场二次探底后震荡上行。板块上，线下出行和服务等疫后复苏行业表现较好。煤炭、石化、新能源等行业表现较弱。海外方面，美国通胀的拐点逐步显现，未来的回落幅度和节奏仍有分歧，同时美元指数开始回落。国内方面，疫情成为最大变量，超预期放开造成短期冲击。12 月 PMI 降至年内低点，但随着年底部分城市疫情达峰，冲击逐渐消退，市场逐步交易后疫情时代的复苏逻辑。中央经济工作会议的表态较为积极，主要目标为提振信心，扩大内需，稳定增长，以及重点产业链高质量发展。市场对未来刺激政策持乐观预期。

基金操作回顾：

2022 年全年，我们严格遵照基金合同的相关约定，按照既定的投资流程进行了规范运作。债券投资方面，本组合在市场收益率波动过程中积极调整仓位，顺应市场趋势，优化资产配置结构，提高组合收益。股票投资方面，在震荡过程中积极寻找个股机会，对组合

适度分散、动态调整、优化配置结构，持续关注估值和成长性匹配度较好的优质公司。具体来说，一季度市场快速调整，一些所处行业景气度高，成长性好的优质成长公司的估值回调到了较为有吸引力的水平，我们在市场快速下跌中逐步增加了配置。除此之外，随着疫情逐步见顶，管控力度加码，疫情短期对消费和居民正常出行活动的限制边际改善，我们也择机对相关板块进行了波段操作。6 月以后，随着市场加速反弹，我们逐步减持了新能源等成长板块的仓位，虽然该板块景气度仍然很好，但热度和交易拥挤度偏高，适当规避一些回撤风险。另外，随着疫情的影响因素逐步淡化，我们逐步兑现了一些前期布局的出行、旅游、线下服务板块公司。另一方面，我们在二季度转而布局一些消费品、金融板块、中游制造品。一些消费行业出现复苏迹象，一些优质消费公司的经营得到改善。银行板块位于估值低位，仓位较低，随着下半年宽信用逐步兑现存在一定的收益。而部分中游制造公司同时受益于上游成本改善以及下游需求恢复。运行至七八月份，我们维持相对积极的仓位。结构方面，逐步降低了新能源、电子等板块的配置，增加了计算机、化工、医药、能源等领域的比例。9 月份以后，市场快速调整，组合在下跌中适当降低仓位，努力降低回撤，对组合适度分散、动态调整。在三季度末，我们关注到市场在快速下跌过程中，一些优质个股出现较好的风险收益比，因此也逢低布局了一些估值和成长性匹配度较好的优质公司。十月及十一月，考虑到疫情的冲击和政策的不明朗，我们保持较为谨慎的仓位，降低了部分偏向外需的成长行业配置，增加了受益于国内政策刺激提振，以及与疫情相关的配置。十二月份后，随着疫情达峰临近，我们逐步提高了仓位，逢低布局了一些估值和成长性匹配度较好的优质公司。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金 A 类份额净值增长率为-2.24%，同期业绩基准增长率为 2.91%，本基金 C 类份额净值增长率为-2.59%，同期业绩基准增长率为 2.95%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

市场展望：

对于债券市场，展望 2023 年，在基本面改善预期下，我们认为债市情绪可能整体偏弱，应重点关注资金面的不确定性、高频数据的改善幅度、政策制定、债市收益率绝对水平以及股债跷跷板效应。具体分析如下：第一，在信贷开门红的背景下，后续的资金面仍有不确定性，预计资金利率中枢小幅抬升，财政前置地方债发行等都对流动性不利，且 2023 年没有 2022 年减税政策对流动性的支持；第二，高频数据看，高炉开工率偏强，主要是工业部门需求所致，疫后消费好转有助于内需制造业板块修复；第三，从政策视角看，2023 年稳增长政策诉求较强，若后续经济修复较好，债市收益率有上行压力，若修复略弱，则预计在地产、消费上有进一步的刺激政策出台，对债市依然不利；第四，从绝对水平看，目

前 10 年国债收益率仅比 2022 年 3 月时略高，且过去几轮牛熊市从收益率低点反弹幅度看，本次 10 年国债收益率从低点反弹仅 30bp，这是一个偏低的水平；第五，沪深 300 指数连续两年走弱，股市估值处在相对较低的状态，且 2023 年 1 月股市已有一定上涨，应注意股债跷跷板效应的影响。

对于权益市场，展望 2023 年，国内走出三年的疫情阴霾，居民生活工作逐步恢复，带动部分消费复苏。但是地产行业的修复目前还不算明显，汽车的消费由于去年的政策刺激，今年景气度有待观察。超额储蓄的释放有待验证。国内是否还会面临疫情扰动目前也有一些担忧。海外方面，欧美的经济呈现了一定的韧性，软着陆的预期在上升，带动部分出口产业链有回升预期。今年的地缘因素仍在发酵，俄乌冲突仍未看到结束迹象，中美摩擦以及产业领域冲突也会持续。国内的产业升级趋势还将持续，高端制造、新能源等领域预计仍维持较快发展速度。政策方面，两会以及后续配套政策部署可能为今年的经济复苏提供助力。权益市场目前处在估值较低，预期升温，犹豫中上涨的阶段。全年我们看好权益市场的表现，但是考虑到我们前面阐述的风险与顾虑，预计市场并非单边上涨行情，会出现较多结构性机会。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人本着诚实信用、勤勉尽责、合法经营和保障基金持有人利益的原则，经营管理和业务运作稳健、合规，基金的投资、交易、后台等运作规范有序。基金管理人的风险管理及合规控制部门依据独立、客观、公正的原则，主要从以下几个方面进一步加强了公司内部控制和基金投资风险管理工作：

1、公司实施了员工全面培训和形式多样的专题培训，包括不定期推送监管动态和风险案例，持续整理风险点录入系统定期推送，定期或不定期组织法规考试，不定期开展各类合规主题培训等，丰富培训形式，不断提升员工合规与风控意识；

2、公司合规风控部门通过事中合规控制系统、事后投资风险管理系统、风险管理模型等对基金投资合规情况及风险情况进行严格的内部监控和管理；

3、定期稽核方面，除了每季度会对各业务领域进行一次全面的稽核，公司合规审计部门还根据监察稽核计划，对公司的关键业务部门及业务流程进行了专项稽核和检查；

4、根据法律法规的更新及业务的发展变化情况，公司各业务部门对相关内部控制制度提出修改意见和建议，并关注内部控制制度的健全性和有效性，进一步完善了公司内控制度体系，更好的防范法律风险和合规风险。

报告期内，本基金的投资运作符合国家相关法律法规、监管部门的有关规定以及公司相关制度的规定。本基金的投资目标、投资决策依据和投资管理程序均符合相关基金合同和招募说明书的约定，未发现重大异常交易、利益输送、内幕交易及其他有损基金投资者利益的情形。报告期内，本基金若曾因市场波动、申购赎回等原因出现了相关投资比例限

制被动突破的情形，均在法规规定的时间内完成了调整，符合法律法规和基金合同的规定和要求。报告期内，本基金未出现因权证未行权、可转债未及时卖出或转股等有损基金份额持有人利益的投资失误行为。本基金管理人承诺将一如既往本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产，在规范经营、控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金的估值业务严格按照相关的法律法规、基金合同以及《招商基金管理有限公司基金估值委员会管理制度》进行。基金核算部负责日常的基金资产的估值业务，执行基金估值政策。另外，公司设立由投资和研究部门、风险管理部、基金核算部、法律合规部负责人和基金经理代表组成的估值委员会。公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历。公司估值委员会主要负责制定、修订和完善基金估值政策和程序，定期评价现有估值政策和程序的适用性及对估值程序执行情况进行监督。

投资和研究部门以及基金核算部共同负责关注相关投资品种的动态，评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种；投资和研究部门定期审核公允价值的确认和计量；研究部提出合理的数量分析模型对需要进行估值测算或者调整的投资品种进行公允价值定价与计量并定期对估值政策和程序进行评价，以保证其持续适用；基金核算部定期审核估值政策和程序的一致性，并负责与托管行沟通估值调整事项；风险管理部负责估值委员会工作流程中的风险控制；法律合规部负责日常的基金估值调整结果的事后复核监督工作；法律合规部与基金核算部共同负责估值调整事项的信息披露工作。

基金经理代表向估值委员会提供估值参考信息，参与估值政策讨论；对需采用特别估值程序的证券，基金及时启动特别估值程序，由公司估值委员会集体讨论议定特别估值方案，咨询会计师事务所的专业意见，并与托管行沟通后由基金核算部具体执行。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。截止报告期末本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供相关债券品种、流通受限股票的估值参考数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《招商安本增利债券型证券投资基金基金合同》及最新的招募说明书约定“在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，基金合同生效不满 3 个月，收益可不分配，基金每次收益分配比例不低于当期已实现净收益的 50%”。

本基金于 2022 年 11 月 29 日实施利润分配, A 类份额每份基金份额分红 0.0740 元, C 类份额每份基金份额分红 0.0740 元, 上述利润分配符合合同规定。

本基金于 2022 年 12 月 20 日实施利润分配, A 类份额每份基金份额分红 0.0700 元, C 类份额每份基金份额分红 0.0700 元, 上述利润分配符合合同规定。

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

报告期内, 本基金未发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内, 中国光大银行股份有限公司在招商安本增利债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)托管过程中, 严格遵守了《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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定, 依法安全保管了基金的全部资产, 对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督, 对发现的问题及时提出了意见和建议。同时, 按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告, 没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为, 诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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

本报告期内, 中国光大银行股份有限公司依据《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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定, 对基金管理人的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督, 未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求, 各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

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

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《招商安本增利债券型证券投资基金 2022 年年度报告》进行了复核, 认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告(注:

财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等内容真实、准确。

§ 6 审计报告

6.1 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 | 招商安本增利债券型证券投资基金全体持有人 |
| 审计意见 | <p>我们审计了招商安本增利债券型证券投资基金的财务报表，包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表，2022 年度的利润表、净资产(基金净值)变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>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基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了招商安本增利债券型证券投资基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p> |
| 形成审计意见的基础 | <p>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，我们独立于招商安本增利债券型证券投资基金，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。</p> |
| 强调事项 | - |
| 其他事项 | - |
| 其他信息 | <p>招商基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括招商安本增利债券型证券投资基金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。</p> <p>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何形式的鉴证结论。</p> <p>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。</p> <p>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> |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | <p>基金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基金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</p> |

| | |
|-----------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| | <p>必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估招商安本增利债券型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算招商安本增利债券型证券投资基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督招商安本增利债券型证券投资基金的财务报告过程。</p> |
| 注册会计师对财务报表审计的责任 | <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。</p> <p>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：</p> <p>(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，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。</p> <p>(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。</p> <p>(3)评价基金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。</p> <p>(4)对基金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，就可能对招商安本增利债券型证券投资基金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安本增利债券型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(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。</p> <p>我们与基金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 | 江丽雅 | 林婷婷 |
| 会计师事务所的地址 | 中国上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼 | |
| 审计报告日期 | 2023 年 3 月 29 日 | |

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：招商安本增利债券型证券投资基金

报告截止日：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2022 年 12 月 31 日 | 上年度末 2021 年 12 月 31 日 |
|----------|---------|----------------------|-----------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 7.4.7.1 | 15,893,284.15 | 44,552,497.05 |
| 结算备付金 | | 6,582,323.96 | 3,381,992.24 |
| 存出保证金 | | 676,208.02 | 71,474.79 |
| 交易性金融资产 | 7.4.7.2 | 6,700,855,350.13 | 1,813,105,854.38 |
| 其中：股票投资 | | 832,330,622.48 | 249,621,073.74 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 5,851,843,990.80 | 1,543,484,780.64 |
| 资产支持证券投资 | | 16,680,736.85 | 20,000,000.00 |
| 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 | 71,032,072.45 | 50,065,395.10 |
| 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 | | 1,125,465.17 | - |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 29,691.73 | 51,340,976.36 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 7.4.7.5 | - | 10,218,554.71 |
| 资产总计 | | 6,796,194,395.61 | 1,972,736,744.63 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2022 年 12 月 31 日 | 上年度末 2021 年 12 月 31 日 |
| 负债： | | | |
| 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 | | 180,177,777.46 | 30,999,864.50 |
| 应付清算款 | | 6,546,288.57 | 36,851,984.76 |
| 应付赎回款 | | 53,097,942.21 | 4,198,946.65 |
| 应付管理人报酬 | | 4,060,964.38 | 746,416.73 |
| 应付托管费 | | 870,206.69 | 159,946.47 |
| 应付销售服务费 | | 814,048.91 | 319,892.90 |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | 975,768.82 | 869,277.09 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 7.4.7.6 | 1,222,983.03 | 562,543.08 |
| 负债合计 | | 247,765,980.07 | 74,708,872.18 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 7.4.7.7 | 4,406,029,477.98 | 1,135,947,783.97 |
| 其他综合收益 | | - | - |
| 未分配利润 | 7.4.7.8 | 2,142,398,937.56 | 762,080,088.48 |
| 净资产合计 | | 6,548,428,415.54 | 1,898,027,872.45 |
| 负债和净资产总计 | | 6,796,194,395.61 | 1,972,736,744.63 |

注：1、报告截止日 2022 年 12 月 31 日，招商安本增利债券 A 份额净值 1.4882 元，基金份额总额 2,401,972,238.05 份；招商安本增利债券 C 份额净值 1.4839 元，基金份额总额 2,004,057,239.93 份；总份额合计 4,406,029,477.98 份；

2、以下比较数据已根据本年《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>》中的资产负债表格式的要求进行列示：上年度资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目“本期末”余额合并列示在本期资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，上年度资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本期资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额中。

7.2 利润表

会计主体：招商安本增利债券型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 |
|-----------|---------|----------------------------------------|------------------------------------------------|
| 一、营业总收入 | | -154,828,166.83 | 57,192,923.30 |
| 1.利息收入 | | 1,213,497.14 | 15,556,598.56 |
| 其中：存款利息收入 | 7.4.7.9 | 469,400.21 | 144,208.61 |

| | | | |
|-----------------------|------------|-----------------|---------------|
| 债券利息收入 | | - | 15,260,618.86 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | 13,214.51 |
| 买入返售金融资产收入 | | 744,096.93 | 138,556.58 |
| 证券出借利息收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 72,536,930.35 | 22,811,972.49 |
| 其中：股票投资收益 | 7.4.7.10 | -58,232,762.22 | 19,822,670.56 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 7.4.7.11 | 123,103,560.95 | 2,471,808.89 |
| 资产支持证券投资 | 7.4.7.12 | 569,442.93 | - |
| 收益 | | | |
| 贵金属投资收益 | 7.4.7.13 | - | - |
| 衍生工具收益 | 7.4.7.14 | - | - |
| 股利收益 | 7.4.7.15 | 7,096,688.69 | 517,493.04 |
| 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） | 7.4.7.16 | -229,633,843.94 | 18,762,976.44 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 7.4.7.17 | 1,055,249.62 | 61,375.81 |
| 减：二、营业总支出 | | 51,396,449.38 | 7,500,078.86 |
| 1.管理人报酬 | 7.4.10.2.1 | 30,898,591.01 | 3,216,539.18 |
| 2.托管费 | 7.4.10.2.2 | 6,621,126.69 | 689,258.42 |
| 3.销售服务费 | 7.4.10.2.3 | 8,935,204.50 | 1,378,516.72 |
| 4.投资顾问费 | | - | - |
| 5.利息支出 | | 4,539,235.47 | 580,847.60 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 4,539,235.47 | 580,847.60 |
| 6.信用减值损失 | 7.4.7.18 | - | - |
| 7.税金及附加 | | 165,091.71 | 43,427.27 |
| 8.其他费用 | 7.4.7.19 | 237,200.00 | 1,591,489.67 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | -206,224,616.21 | 49,692,844.44 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | -206,224,616.21 | 49,692,844.44 |

| | | | |
|---------------|--|-----------------|---------------|
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | -206,224,616.21 | 49,692,844.44 |

注：以下比较数据已根据本年《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〉》中的利润表格式的要求进行列示：上年度可比期间利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本期利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：招商安本增利债券型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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） | 1,135,947,783.97 | - | 762,080,088.48 | 1,898,027,872.45 |
| 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） | 1,135,947,783.97 | - | 762,080,088.48 | 1,898,027,872.45 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | 3,270,081,694.01 | - | 1,380,318,849.08 | 4,650,400,543.09 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | -206,224,616.21 | -206,224,616.21 |
| （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） | 3,270,081,694.01 | - | 2,215,806,398.54 | 5,485,888,092.55 |
| 其中：1.基金申购款 | 6,165,564,978.01 | - | 4,009,119,939.14 | 10,174,684,917.15 |
| 2.基金赎回款 | -2,895,483,284.00 | - | -1,793,313,540.60 | -4,688,796,824.60 |
| （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） | - | - | -629,262,933.25 | -629,262,933.25 |
| （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） | 4,406,029,477.98 | - | 2,142,398,937.56 | 6,548,428,415.54 |
| 项目 | 上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 | | | |
| | 实收基金 | 其他综合 | 未分配利润 | 净资产合计 |

| | | 收益 | | |
|------------------------------------------------------|------------------|----|------------------|-------------------|
| 一、上期期末净资产 (基金净值) | 259,809,439.26 | - | 134,451,387.42 | 394,260,826.68 |
| 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) | 259,809,439.26 | - | 134,451,387.42 | 394,260,826.68 |
| 三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列) | 876,138,344.71 | - | 627,628,701.06 | 1,503,767,045.77 |
| (一)、综合收益总额 | - | - | 49,692,844.44 | 49,692,844.44 |
| (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) | 876,138,344.71 | - | 577,935,856.62 | 1,454,074,201.33 |
| 其中: 1.基金申购款 | 1,691,649,930.21 | - | 1,095,867,131.81 | 2,787,517,062.02 |
| 2.基金赎回款 | -815,511,585.50 | - | -517,931,275.19 | -1,333,442,860.69 |
| (三)、本期向基金份 额持有人分配利润产 生的基金净值变动(净 值减少以“-”号填列) | - | - | - | - |
| (四)、其他综合收益 结转留存收益 | - | - | - | - |
| 四、本期期末净资产 (基金净值) | 1,135,947,783.97 | - | 762,080,088.48 | 1,898,027,872.45 |

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:

_____ 徐勇 _____ 欧志明 _____ 何剑萍 _____
 基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

招商安本增利债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人招商基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《招商安本增利债券型证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规的规定,经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2006]99 号文批准公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限为不定期,首次设立募集基金份额为 3,097,655,129.20 份,经德勤华永会计师事务所有限公司(现更名为“德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)”)验证,并出具了编号为德师报(验)字(06)第 0026 号验资报告。《招商安本增利债券型证券投资基金基金合同》(以下简称“基

金合同”)于 2006 年 7 月 11 日正式生效。本基金的基金管理人为招商基金管理有限公司，基金托管人为中国光大银行股份有限公司(以下简称“中国光大银行”)。

根据基金合同及招募说明书的有关规定，本基金自 2022 年 1 月 5 日起增设 A 类基金份额，A 类基金份额不收取销售服务费，在投资者申购基金份额时收取申购费用、赎回时收取赎回费用；原有的基金份额在增加 A 类基金份额后，全部自动转换为招商安本增利债券型证券投资基金 C 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、修改后的基金合同及截至报告期末最新公告的招募说明书的有关规定，本基金投资于具有良好流动性的固定收益类品种，包括国债、金融债、信用等级为投资级以上的企业债和次级债、可转换债券、短期融资券、债券回购、央行票据、同业存款等，以及股票和存托凭证等权益类品种和法律法规或监管机构允许基金投资的其它金融工具。法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金对债券等固定收益类品种的投资比例为 80%-100%(其中现金或到期日在一年以内的政府债券不低于 5%，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)；股票、存托凭证等权益类品种的投资比例为 0%-20%。本基金业绩比较基准为：三年期银行定期存款税后利率+0.2%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金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

本基金以人民币为记账本位币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1) 金融资产的分类

根据本基金的金融资产业务模式和金融资产的合同现金流量特征，本基金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，且本基金管理该金融资产业务模式是以收取合同现金流量为目标，则本基金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

本基金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。本基金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

本基金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和金融负债，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。

本基金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，本基金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

基金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，本基金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。

本基金在上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，本基金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。

本基金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。若本基金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

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，将其公允价值划分为三个层次。第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值是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；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值原则如下：

(1)对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市价不能真实反映公允价值的，应对市价进行调整，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，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当投资品种不存在活跃市场，基金管理人估值委员会认为必要时，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

(3) 经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整，确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金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基金份额所对应的金额。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认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

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基金份额变动时，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基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，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后的差额确认。

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

本基金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。本基金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

本基金的基金管理人报酬、基金托管费和销售服务费按基金合同及相关公告约定的费率和计算方法逐日计提。

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) 基金收益分配方式有现金方式和红利再投资方式。其中，红利再投资方式是指基金份额持有人可以事先选择将所获分配的现金收益，按照基金合同有关基金份额申购的约定转为基金份额；

2) 本基金默认的收益分配方式是现金分红，基金份额持有人事先未做出分红方式选择的，基金管理人应向基金份额持有人分配现金收益；

3) 由于本基金 A 类基金份额不收取而 C 类基金份额收取销售服务费，将导致各基金份额类别对应的可供分配利润有所不同；本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

4) 基金收益分配后每各类基金份额净值不能低于面值；

5) 在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年不超过 12 次，基金合同生效不满 3 个月，收益可不分配；

6) 基金每次收益分配比例不低于当期已实现净收益的 50%；

7) 法律、法规或监管机构另有规定的从其规定。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，与所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策与计量基础一致。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金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,本基金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

根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认计量》、《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”)相关规定,以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》(财会[2020]22 号),公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。本基金在编制 2022 年度财务报表时已采用新金融工具准则,并采用准则允许的实务简便方法,调整期初基金净值,2021 年的比较数据将不作重述。

于首次执行日,本基金因执行新金融工具准则调减期初基金净值人民币 0.00 元,本基金执行新金融工具准则的影响如下:

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融工具包括银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、应收申购款、应收利息、卖出回购金融资产款和应付利息,金额分别为人民币 44,552,497.05 元、人民币 3,381,992.24 元、人民币 71,474.79 元、人民币 50,065,395.10 元、人民币 51,340,976.36 元、人民币 10,218,554.71 元、人民币 30,999,864.50 元和人民币-3,349.46 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融工具包括银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、应收申购款、其他资产-应收利息、卖出回购金融资产款和其他负债-应付利息。本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中,并反映在银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、应收申购款和卖出回购金融资产款等项目中,不单独列示应收利息项目或应付利息项目。新金融工具准则下,银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、应收申购款、其他资产-应收利息、卖出回购金融资产款和其他负债-应付利息的金额分别为人民币 44,561,154.31 元、人民币 3,383,514.14 元、人民币 71,506.89 元、人民币 50,078,998.64 元、人民币 51,340,976.36 元、人民币 0.00 元、人民币 30,996,515.04 元和人民币 0.00 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融工具为交易性金融资产,金额为人民币 1,813,105,854.38 元,归属于交易性金融资产的应收利息金额为人

人民币 10,194,739.91 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融工具为交易性金融资产，金额为人民币 1,823,300,594.29 元。

本基金自 2022 年 7 月 1 日起施行《资产管理产品相关会计处理规定》，并按相关衔接规定进行了处理。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期间未发生重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

(3) 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司代扣代缴个人所得税；从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(4) 对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10% 的税率缴纳证券(股票)交易印花税，对受让方不再缴纳印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022 年 12 月 31 日 | 上年度末 2021 年 12 月 31 日 |
|----------------|----------------------|-----------------------|
| 活期存款 | 15,893,284.15 | 44,552,497.05 |
| 等于：本金 | 15,889,600.75 | 44,552,497.05 |
| 加：应计利息 | 3,683.40 | - |
| 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 | 15,893,284.15 | 44,552,497.05 |

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022 年 12 月 31 日 | | | | |
|---------------|----------------------|------------------|------------------|------------------|----------------|
| | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 | |
| 股票 | 957,045,088.26 | - | 832,330,622.48 | -124,714,465.78 | |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - | - | |
| 债券 | 交易所市场 | 920,247,927.09 | 8,127,258.87 | 896,040,031.04 | -32,335,154.92 |
| | 银行间市场 | 4,957,425,476.17 | 55,583,459.76 | 4,955,803,959.76 | -57,204,976.17 |
| | 合计 | 5,877,673,403.26 | 63,710,718.63 | 5,851,843,990.80 | -89,540,131.09 |
| 资产支持证券 | 16,470,000.00 | 206,736.85 | 16,680,736.85 | 4,000.00 | |
| 基金 | - | - | - | - | |
| 其他 | - | - | - | - | |
| 合计 | 6,851,188,491.52 | 63,917,455.48 | 6,700,855,350.13 | -214,250,596.87 | |

| 项目 | 上年度末 2021 年 12 月 31 日 | | | | |
|---------------|-----------------------|------------------|------------------|------------------|--------------|
| | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 | |
| 股票 | 243,855,101.35 | - | 249,621,073.74 | 5,765,972.39 | |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - | - | |
| 债券 | 交易所市场 | 316,390,417.19 | - | 317,575,780.64 | 1,185,363.45 |
| | 银行间市场 | 1,217,477,088.77 | - | 1,225,909,000.00 | 8,431,911.23 |
| | 合计 | 1,533,867,505.96 | - | 1,543,484,780.64 | 9,617,274.68 |
| 资产支持证券 | 20,000,000.00 | - | 20,000,000.00 | - | |
| 基金 | - | - | - | - | |
| 其他 | - | - | - | - | |
| 合计 | 1,797,722,607.31 | - | 1,813,105,854.38 | 15,383,247.07 | |

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

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融工具。

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

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022 年 12 月 31 日 | |
|-------|-----------------------|-----------|
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | - | - |
| 银行间市场 | 71,032,072.45 | - |
| 合计 | 71,032,072.45 | - |
| 项目 | 上年度末 2021 年 12 月 31 日 | |
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | - | - |
| 银行间市场 | 50,065,395.10 | - |
| 合计 | 50,065,395.10 | - |

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022 年 12 月 31 日 | 上年度末 2021 年 12 月 31 日 |
|-------|----------------------|-----------------------|
| 应收利息 | - | 10,218,554.71 |
| 其他应收款 | - | - |
| 待摊费用 | - | - |

| | | |
|----|---|---------------|
| 合计 | - | 10,218,554.71 |
|----|---|---------------|

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022 年 12 月 31 日 | 上年度末 2021 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 | 1,022,983.03 | 385,892.54 |
| 其中：交易所市场 | 960,326.52 | 366,306.80 |
| 银行间市场 | 62,656.51 | 19,585.74 |
| 应付利息 | - | -3,349.46 |
| 预提费用 | 200,000.00 | 180,000.00 |
| 合计 | 1,222,983.03 | 562,543.08 |

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

| 招商安本增利债券 A | | |
|---------------|----------------------------------------------|------------------|
| 项目 | 本期 2022 年 1 月 6 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日 | |
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | - | - |
| 本期申购 | 3,060,339,095.47 | 3,060,339,095.47 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -658,366,857.42 | -658,366,857.42 |
| 基金份额折算变动份额 | - | - |
| 本期末 | 2,401,972,238.05 | 2,401,972,238.05 |

| 招商安本增利债券 C | | |
|---------------|-------------------------------------|-------------------|
| 项目 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 | |
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 1,135,947,783.97 | 1,135,947,783.97 |
| 本期申购 | 3,105,225,882.54 | 3,105,225,882.54 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -2,237,116,426.58 | -2,237,116,426.58 |
| 基金份额折算变动份额 | - | - |
| 本期末 | 2,004,057,239.93 | 2,004,057,239.93 |

注：本期申购含红利再投、转换入份（金）额，本期赎回含转换出份（金）额。

7.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

| 招商安本增利债券 A | | | |
|------------|--------------|----------------|----------------|
| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
| 本期期初 | - | - | - |
| 本期利润 | 4,855,543.65 | -77,105,143.65 | -72,249,600.00 |

| | | | |
|----------------|------------------|----------------|------------------|
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 1,105,988,824.61 | 469,600,403.27 | 1,575,589,227.88 |
| 其中：基金申购款 | 1,410,452,563.07 | 567,874,542.26 | 1,978,327,105.33 |
| 基金赎回款 | -304,463,738.46 | -98,274,138.99 | -402,737,877.45 |
| 本期已分配利润 | -330,611,571.58 | - | -330,611,571.58 |
| 本期末 | 780,232,796.68 | 392,495,259.62 | 1,172,728,056.30 |

| 招商安本增利债券 C | | | |
|----------------|-------------------|-----------------|-------------------|
| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
| 本期期初 | 512,396,551.38 | 249,683,537.10 | 762,080,088.48 |
| 本期利润 | 18,553,684.08 | -152,528,700.29 | -133,975,016.21 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 409,602,303.89 | 230,614,866.77 | 640,217,170.66 |
| 其中：基金申购款 | 1,430,987,591.45 | 599,805,242.36 | 2,030,792,833.81 |
| 基金赎回款 | -1,021,385,287.56 | -369,190,375.59 | -1,390,575,663.15 |
| 本期已分配利润 | -298,651,361.67 | - | -298,651,361.67 |
| 本期末 | 641,901,177.68 | 327,769,703.58 | 969,670,881.26 |

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 |
|-----------|-------------------------------------|------------------------------------------|
| 活期存款利息收入 | 355,560.17 | 127,007.66 |
| 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 | 107,734.21 | 15,912.76 |
| 其他 | 6,105.83 | 1,288.19 |
| 合计 | 469,400.21 | 144,208.61 |

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 |
|------------------|-------------------------------------|------------------------------------------|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | -58,232,762.22 | 19,822,670.56 |
| 股票投资收益——赎回差价收入 | - | - |
| 股票投资收益——申购差价收入 | - | - |
| 股票投资收益——证券出借差价收入 | - | - |
| 合计 | -58,232,762.22 | 19,822,670.56 |

7.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 |
|------------|----------------------------------------|---------------------------------------------|
| 卖出股票成交总额 | 1,694,678,764.78 | 399,580,397.28 |
| 减：卖出股票成本总额 | 1,747,586,106.59 | 379,757,726.72 |
| 减：交易费用 | 5,325,420.41 | - |
| 买卖股票差价收入 | -58,232,762.22 | 19,822,670.56 |

7.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无股票赎回差价收入。

7.4.7.10.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无股票申购差价收入。

7.4.7.10.5 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无证券出借差价收入。

7.4.7.11 债券投资收益**7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 |
|----------------------------------|----------------------------------------|---------------------------------------------|
| 债券投资收益——利息收入 | 112,993,340.61 | - |
| 债券投资收益——买卖债券（债 转股及债券到期兑付）差价收入 | 10,110,220.34 | 2,471,808.89 |
| 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 | 123,103,560.95 | 2,471,808.89 |

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 |
|----------------------------|----------------------------------------|---------------------------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到 期兑付）成交总额 | 7,769,711,792.58 | 689,606,256.04 |
| 减：卖出债券（债转股及债 券到期兑付）成本总额 | 7,665,678,220.90 | 675,196,508.30 |
| 减：应计利息总额 | 93,785,401.88 | 11,937,938.85 |
| 减：交易费用 | 137,949.46 | - |
| 买卖债券差价收入 | 10,110,220.34 | 2,471,808.89 |

7.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无债券赎回差价收入。

7.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无债券申购差价收入。

7.4.7.12 资产支持证券投资收益**7.4.7.12.1 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 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 |
|--------------------------|-------------------------------------|------------------------------------------|
| 资产支持证券投资收益——利息收入 | 569,442.93 | - |
| 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 | 569,442.93 | - |

7.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 |
|----------------|-------------------------------------|------------------------------------------|
| 卖出资产支持证券成交总额 | 3,844,564.38 | - |
| 减：卖出资产支持证券成本总额 | 3,530,000.00 | - |
| 减：应计利息总额 | 314,564.38 | - |
| 减：交易费用 | - | - |
| 资产支持证券投资收益 | - | - |

7.4.7.12.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券赎回差价收入。

7.4.7.12.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券申购差价收入。

7.4.7.13 贵金属投资收益**7.4.7.13.1 贵金属投资收益项目构成**

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.13.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无买卖贵金属差价收入。

7.4.7.13.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属赎回差价收入。

7.4.7.13.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属申购差价收入。

7.4.7.14 衍生工具收益**7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具买卖权证差价收入。

7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具其他投资收益。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 |
|---------------|----------------------------------------|---------------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 7,096,688.69 | 517,493.04 |
| 其中：证券出借权益补偿收入 | - | - |
| 基金投资产生的股利收益 | - | - |
| 合计 | 7,096,688.69 | 517,493.04 |

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 |
|----------------------------|----------------------------------------|---------------------------------------------|
| 1.交易性金融资产 | -229,633,843.94 | 18,762,976.44 |
| ——股票投资 | -130,480,438.17 | 5,882,919.45 |
| ——债券投资 | -99,157,405.77 | 12,880,056.99 |
| ——资产支持证券投资 | 4,000.00 | - |
| ——贵金属投资 | - | - |
| ——其他 | - | - |
| 2.衍生工具 | - | - |
| ——权证投资 | - | - |
| 3.其他 | - | - |
| 减：应税金融商品公允价值 变动产生的预估增值税 | - | - |
| 合计 | -229,633,843.94 | 18,762,976.44 |

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 |
|---------|----------------------------------------|---------------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 1,055,249.62 | 61,375.81 |
| 合计 | 1,055,249.62 | 61,375.81 |

7.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内及上年度可比期间无信用减值损失。

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 |
|---------|----------------------------------------|---------------------------------------------|
| 审计费用 | 80,000.00 | 60,000.00 |
| 信息披露费 | 120,000.00 | 120,000.00 |
| 证券出借违约金 | - | - |
| 银行费用 | - | - |
| 交易费用 | - | 1,374,439.67 |
| 其他 | 37,200.00 | 37,050.00 |
| 合计 | 237,200.00 | 1,591,489.67 |

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，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报告批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|------------------------|--------------|
| 招商基金管理有限公司 | 基金管理人 |
| 中国光大银行股份有限公司 | 基金托管人 |
| 招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”) | 基金管理人的股东 |
| 招商证券股份有限公司(以下简称“招商证券”) | 基金管理人的股东 |
| 招商财富资产管理有限公司 | 基金管理人的全资子公司 |
| 招商资产管理(香港)有限公司 | 基金管理人的全资子公司 |
| 博时基金(国际)有限公司 | 基金管理人的参股经营机构 |

注：1、2022 年 12 月 30 日，招商资产管理(香港)有限公司的股权发生变更，基金管理人不再持有该公司的股权。同日，基金管理人新增持有博时基金(国际)有限公司 45% 的股权。

2、基金的主要关联方包含基金管理人、基金管理人的股东及子公司、基金托管人等。

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

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 | | 上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 | |
|-------|-------------------------------------|--------------|------------------------------------------|--------------|
| | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 |
| 招商证券 | 2,863,275,888.81 | 68.99% | 204,735,651.92 | 21.07% |

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 | | 上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 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 | 851,598,954.07 | 67.80% | 29,161,040.30 | 9.84% |

7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 | | 上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 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 | 5,200,128,000.00 | 49.78% | 51,000,000.00 | 2.93% |

7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

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 2022 年 1 月 1 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 | 2,093,908.25 | 63.59% | 590,288.88 | 61.47% |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 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 | 149,723.41 | 17.33% | 149,723.41 | 40.87% |

注：1、本基金与关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立；

2、基金对该类交易的佣金的计算方式是按合同约定的佣金率计算。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供研究成果和市场信息等证券综合服务，并不收取额外对价。

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 |
|-----------------|-------------------------------------|------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 30,898,591.01 | 3,216,539.18 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 2,350,032.84 | 735,567.62 |
| 支付投资顾问的投资顾问费 | - | - |

注：支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值×0.70%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日基金管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.70\% \div \text{当年天数}$$

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 |
|----------------|-------------------------------------|------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 6,621,126.69 | 689,258.42 |

注：支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值×0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 | | |
|----------------|------------------------------------------|--------------|--------------|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 招商安本增利债券 A | 招商安本增利债券 C | 合计 |
| 光大银行 | - | 69,095.55 | 69,095.55 |
| 招商基金管理有限 公司 | - | 6,078,331.97 | 6,078,331.97 |
| 招商银行 | - | 322,105.13 | 322,105.13 |
| 招商证券 | - | 1,671.82 | 1,671.82 |
| 合计 | - | 6,471,204.47 | 6,471,204.47 |
| 获得销售服务费的 | 上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 | | |

| 各关联方名称 | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
|----------------|------------------|------------|------------|
| | 招商安本增利债券 A | 招商安本增利债券 C | 合计 |
| 光大银行 | - | 62,586.40 | 62,586.40 |
| 招商基金管理有限 公司 | - | 664,149.03 | 664,149.03 |
| 招商银行 | - | 252,425.78 | 252,425.78 |
| 招商证券 | - | 1,027.49 | 1,027.49 |
| 合计 | - | 980,188.70 | 980,188.70 |

注：本基金的 C 类基金份额的年销售服务费率为 0.30%，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：

$$C \text{ 类份额日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金资产净值} \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

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

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

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

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

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

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

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

本报告期内及上年度可比期间基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

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基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 | | 上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 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 |
| | | | | |

| | | | | |
|---------|---------------|------------|---------------|------------|
| 光大银行-活期 | 15,893,284.15 | 355,560.17 | 44,552,497.05 | 127,007.66 |
|---------|---------------|------------|---------------|------------|

注：本基金的银行存款由基金托管人中国光大银行股份有限公司保管，按银行约定利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

单位：人民币元

| 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 | | | | | |
|-------------------------------------|--------|----------|------|------------|--------------|
| 关联方名称 | 证券代码 | 证券名称 | 发行方式 | 基金在承销期内买入 | |
| | | | | 数量（单位：股/张） | 总金额 |
| 光大证券 | 132026 | G 三峡 EB2 | 债券分销 | 32,270 | 3,227,000.00 |

| 上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 | | | | | |
|------------------------------------------|------|------|------|------------|-----|
| 关联方名称 | 证券代码 | 证券名称 | 发行方式 | 基金在承销期内买入 | |
| | | | | 数量（单位：股/张） | 总金额 |
| - | - | - | - | - | - |

注：本表已包含托管人的关联方承销期内承销的证券。

7.4.11 利润分配情况

金额单位：人民币元

招商安本增利债券 A

| 序号 | 权益登记日 | 场内除息日 | 场外除息日 | 每 10 份基金份额分红数 | 现金形式发放总额 | 再投资形式发放总额 | 本期利润分配合计 | 备注 |
|----|------------------|-------|------------------|---------------|---------------|----------------|----------------|----|
| 1 | 2022 年 11 月 29 日 | - | 2022 年 11 月 29 日 | 0.7400 | 34,552,156.86 | 134,474,865.18 | 169,027,022.04 | - |
| 2 | 2022 年 12 月 20 日 | - | 2022 年 12 月 20 日 | 0.7000 | 29,288,164.11 | 132,296,385.43 | 161,584,549.54 | - |
| 合计 | - | - | - | 1.4400 | 63,840,320.97 | 266,771,250.61 | 330,611,571.58 | - |

招商安本增利债券 C

| 序号 | 权益登记日 | 场内除息日 | 场外除息日 | 每 10 份基金份额分红数 | 现金形式发放总额 | 再投资形式发放总额 | 本期利润分配合计 | 备注 |
|----|------------------|-------|------------------|---------------|----------------|---------------|----------------|----|
| 1 | 2022 年 11 月 29 日 | - | 2022 年 11 月 29 日 | 0.7400 | 104,389,999.63 | 50,741,122.30 | 155,131,121.93 | - |

| | | | | | | | | |
|----|------------------------|---|------------------------|--------|----------------|---------------|----------------|---|
| 2 | 2022 年 12 月 20 日 | - | 2022 年 12 月 20 日 | 0.7000 | 94,975,783.45 | 48,544,456.29 | 143,520,239.74 | - |
| 合计 | - | - | - | 1.4400 | 199,365,783.08 | 99,285,578.59 | 298,651,361.67 | - |

7.4.12 期末（2022 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

金额单位：人民币元

| 7.4.12.1.1 受限证券类别：股票 | | | | | | | | | | |
|----------------------|------|------------------------|-----------|--------|--------|--------|----------|--------------|--------------|----|
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 受限期 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量（单位：股） | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 7.4.12.1.2 受限证券类别：债券 | | | | | | | | | | |
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 受限期 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量（单位：张） | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| 118030 | 睿创转债 | 2022 年 12 月 30 日 | 1-6 个月（含） | 新债未上市 | 100.00 | 100.00 | 21,270 | 2,126,986.01 | 2,127,013.98 | - |

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 12 月 31 日止，基金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 180,177,777.46 元，在 2023 年 1 月 4 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券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

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

本基金为债券型基金，本基金的运作涉及的金融工具主要包括债券投资、银行存款等。与这些金融工具有关的风险，以及本基金的基金管理人管理这些风险所采取的风险管理政策如下所述。

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人从事风险管理的目标是提升本基金风险调整后收益水平，保证本基金的基金资产安全，维护基金份额持有人利益。基于该风险管理目标，本基金的基金管理人风险管理的基本策略是识别和分析本基金运作时本基金面临各种类型的风险，确定适当的风险容忍度，并及时可靠地对各种风险进行监督，将风险控制在限定的范围之内。本基金目前面临的主要风险包括：市场风险、信用风险和流动性风险。

本基金的基金管理人建立了以全面、独立、互相制约以及定性和定量相结合为原则的，监事会、董事会及下设风险控制委员会、督察长、风险管理委员会、法律合规部和风险管理部等多层次的风险管理组织架构体系。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指金融工具的一方到期无法履行约定义务致使本基金遭受损失的风险。本基金的信用风险主要存在于银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资及其他。

本基金的银行存款存放于本基金的基金托管人，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在证券交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

对于与债券投资等投资品种相关的信用风险，本基金的基金管理人通过对投资品种的信用等级评估来选择适当的投资对象，并限制单个投资品种的持有比例来管理信用风险。本基金所持有的债券投资的信用评级情况参见附注 7.4.13.2.1 至 7.4.13.2.6，该信用评级不包括本基金所持有的国债、央行票据、政策性金融债。

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 2022 年 12 月 31 日 | 上年度末 2021 年 12 月 31 日 |
|--------|----------------------|-----------------------|
| A-1 | - | - |
| A-1 以下 | - | - |
| 未评级 | - | 80,021,000.00 |
| 合计 | - | 80,021,000.00 |

注：上述评级均由经中国证监会核准从事证券市场资信评级业务的评级机构做出。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

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 2022 年 12 月 31 日 | 上年度末 2021 年 12 月 31 日 |
|--------|----------------------|-----------------------|
| AAA | 4,320,401,175.88 | 1,086,667,502.63 |
| AAA 以下 | 282,695,151.09 | 46,109,621.31 |
| 未评级 | 283,481,965.20 | 55,306,000.00 |
| 合计 | 4,886,578,292.17 | 1,188,083,123.94 |

注：上述评级均由经中国证监会核准从事证券市场资信评级业务的评级机构做出。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2022 年 12 月 31 日 | 上年度末 2021 年 12 月 31 日 |
|--------|----------------------|-----------------------|
| AAA | 16,680,736.85 | 20,000,000.00 |
| AAA 以下 | - | - |
| 未评级 | - | - |
| 合计 | 16,680,736.85 | 20,000,000.00 |

注：上述评级均由经中国证监会核准从事证券市场资信评级业务的评级机构做出。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.3 流动性风险

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金流动性风险来源于基金约定开放日兑付赎回资金的流动性风险，以及因部分投资品种交易不活跃而出现的变现风险以及因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理价格变现投资的风险。本基金所持有的金融资产主要在证券交易市场和银行间同业市场交易。除附注 7.4.12 所披露的流通受限不能自由转让的基金资产外，本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。除卖出回购金融资产外，本基金所持有的金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人在基金合同约定巨额赎回条款，设计了非常情况下赎回资金的处理模式，控制因开放模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

日常流动性风险管理中，本基金的基金管理人每日监控和预测本基金的流动性指标，通过对投资品种的流动性指标来持续地评估、选择、跟踪和控制基金投资的流动性风险。同时，本基金通过预留一定的现金头寸，并且在需要时可通过卖出回购金融资产方式融入短期资金，以缓解流动性风险。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值或将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的基金管理人日常通过对利率水平的预测、分析收益率曲线及优化利率重新定价日组合等方法对上述利率风险进行管理。

下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的账面价值，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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2022 年 12 月 31 日 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|----------------------|------------------|------------------|------------------|----------------|------------------|
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 15,893,284.15 | - | - | - | 15,893,284.15 |
| 结算备付金 | 6,582,323.96 | - | - | - | 6,582,323.96 |
| 存出保证金 | 676,208.02 | - | - | - | 676,208.02 |
| 交易性金融资产 | 1,128,860,313.45 | 3,259,861,663.26 | 1,479,802,750.94 | 832,330,622.48 | 6,700,855,350.13 |
| 衍生金融资产 | - | - | - | - | - |
| 买入返售金融资产 | 71,032,072.45 | - | - | - | 71,032,072.45 |
| 债权投资 | - | - | - | - | - |
| 应收股利 | - | - | - | - | - |
| 应收申购款 | - | - | - | 29,691.73 | 29,691.73 |
| 应收清算款 | - | - | - | 1,125,465.17 | 1,125,465.17 |
| 其他资产 | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 1,223,044,202.03 | 3,259,861,663.26 | 1,479,802,750.94 | 833,485,779.38 | 6,796,194,395.61 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 53,097,942.21 | 53,097,942.21 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 4,060,964.38 | 4,060,964.38 |
| 应付托管费 | - | - | - | 870,206.69 | 870,206.69 |
| 应付清算款 | - | - | - | 6,546,288.57 | 6,546,288.57 |
| 卖出回购金融资产款 | 180,177,777.46 | - | - | - | 180,177,777.46 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 814,048.91 | 814,048.91 |
| 应付投资顾问费 | - | - | - | - | - |
| 应付利润 | - | - | - | - | - |
| 应交税费 | - | - | - | 975,768.82 | 975,768.82 |
| 其他负债 | - | - | - | 1,222,983.03 | 1,222,983.03 |

| | | | | | |
|-----------------------|------------------|------------------|------------------|----------------|------------------|
| 负债总计 | 180,177,777.46 | - | - | 67,588,202.61 | 247,765,980.07 |
| 利率敏感度缺口 | 1,042,866,424.57 | 3,259,861,663.26 | 1,479,802,750.94 | 765,897,576.77 | 6,548,428,415.54 |
| 上年度末 2021 年 12 月 31 日 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 44,552,497.05 | - | - | - | 44,552,497.05 |
| 结算备付金 | 3,381,992.24 | - | - | - | 3,381,992.24 |
| 存出保证金 | 71,474.79 | - | - | - | 71,474.79 |
| 交易性金融资产 | 415,688,856.70 | 630,456,255.60 | 517,339,668.34 | 249,621,073.74 | 1,813,105,854.38 |
| 衍生金融资产 | - | - | - | - | - |
| 买入返售金融资产 | 50,065,395.10 | - | - | - | 50,065,395.10 |
| 应收利息 | - | - | - | 10,218,554.71 | 10,218,554.71 |
| 应收股利 | - | - | - | - | - |
| 应收申购款 | - | - | - | 51,340,976.36 | 51,340,976.36 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - | - |
| 其他资产 | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 513,760,215.88 | 630,456,255.60 | 517,339,668.34 | 311,180,604.81 | 1,972,736,744.63 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 4,198,946.65 | 4,198,946.65 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 746,416.73 | 746,416.73 |
| 应付托管费 | - | - | - | 159,946.47 | 159,946.47 |
| 应付证券清算款 | - | - | - | 36,851,984.76 | 36,851,984.76 |
| 卖出回购金融资产款 | 30,999,864.50 | - | - | - | 30,999,864.50 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 319,892.90 | 319,892.90 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 385,892.54 | 385,892.54 |
| 应付利息 | - | - | - | -3,349.46 | -3,349.46 |
| 应付利润 | - | - | - | - | - |
| 应交税费 | - | - | - | 869,277.09 | 869,277.09 |
| 其他负债 | - | - | - | 180,000.00 | 180,000.00 |
| 负债总计 | 30,999,864.50 | - | - | 43,709,007.68 | 74,708,872.18 |
| 利率敏感度缺口 | 482,760,351.38 | 630,456,255.60 | 517,339,668.34 | 267,471,597.13 | 1,898,027,872.45 |

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

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 50 个基点 | | |
| | 2.其他市场变量保持不变 | | |
| | 3.仅存在公允价值变动对基金资产净值的影响 | | |
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） | |
| | | 本期末（2022 年 12 月 31 日） | 上年度末（2021 年 12 月 31 日） |

| | | |
|--------------------|----------------|----------------|
| 1. 市场利率平行上升 50 个基点 | -84,221,283.63 | -27,661,070.12 |
| 2. 市场利率平行下降 50 个基点 | 86,345,578.57 | 28,776,903.79 |

7.4.13.4.2 其他价格风险

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险，该风险可能与特定投资品种相关，也有可能与整体投资品种相关。本基金所持有以公允价值计量的金融资产，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金在构建资产配置和基金资产投资组合的基础上，通过建立事前和事后跟踪误差的方式，对基金资产的市场价格风险进行管理。

7.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022 年 12 月 31 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 | 832,330,622.48 | 12.71 | 249,621,073.74 | 13.15 |
| 交易性金融资产-基金投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产-贵金属投资 | - | - | - | - |
| 衍生金融资产-权证投资 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 832,330,622.48 | 12.71 | 249,621,073.74 | 13.15 |

7.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 1.若对市场价格敏感的权益性投资的市场价格上升或下降 5% | | |
|----|-------------------------------|-----------------------------|------------------------|
| | 2.其他市场变量保持不变 | | |
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） | |
| | | 本期末（2022 年 12 月 31 日） | 上年度末（2021 年 12 月 31 日） |
| | 1. 权益性投资的市场价格上升 5% | 41,616,531.12 | 12,481,053.69 |
| | 2. 权益性投资的市场价格下降 5% | -41,616,531.12 | -12,481,053.69 |

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 2022 年 12 月 31 日 | 上年度末 2021 年 12 月 31 日 |
|---------------|----------------------|-----------------------|
| 第一层次 | 1,189,464,991.84 | 299,086,921.28 |
| 第二层次 | 5,511,390,358.29 | 1,514,018,933.10 |
| 第三层次 | - | - |
| 合计 | 6,700,855,350.13 | 1,813,105,854.38 |

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

报告期间，本基金无第三层次公允价值余额及变动情况。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

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工具主要包括应收款项、卖出回购金融资产和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无需要说明有助于理解和分析会计报表的其他事项。

§ 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（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|------------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 832,330,622.48 | 12.25 |
| | 其中：股票 | 832,330,622.48 | 12.25 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 5,868,524,727.65 | 86.35 |
| | 其中：债券 | 5,851,843,990.80 | 86.10 |
| | 资产支持证券 | 16,680,736.85 | 0.25 |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | 71,032,072.45 | 1.05 |
| | 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 | 22,475,608.11 | 0.33 |
| 8 | 其他资产 | 1,831,364.92 | 0.03 |
| 9 | 合计 | 6,796,194,395.61 | 100.00 |

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

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 | 33,108,743.20 | 0.51 |
| B | 采矿业 | 74,754,467.00 | 1.14 |
| C | 制造业 | 579,391,753.88 | 8.85 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 14,111,032.00 | 0.22 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 28,080,628.26 | 0.43 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 11,275,172.00 | 0.17 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 16,537,833.00 | 0.25 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 11,524,962.24 | 0.18 |
| 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 | 63,546,030.90 | 0.97 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 832,330,622.48 | 12.71 |

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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

| 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 | 600426 | 华鲁恒升 | 1,462,289 | 48,474,880.35 | 0.74 |
| 2 | 002415 | 海康威视 | 1,357,600 | 47,081,568.00 | 0.72 |
| 3 | 600585 | 海螺水泥 | 1,577,100 | 43,180,998.00 | 0.66 |
| 4 | 600547 | 山东黄金 | 2,223,700 | 42,606,092.00 | 0.65 |
| 5 | 300251 | 光线传媒 | 4,810,865 | 41,662,090.90 | 0.64 |
| 6 | 300122 | 智飞生物 | 473,000 | 41,543,590.00 | 0.63 |
| 7 | 002597 | 金禾实业 | 1,226,100 | 39,848,250.00 | 0.61 |
| 8 | 300498 | 温氏股份 | 1,686,640 | 33,108,743.20 | 0.51 |
| 9 | 002155 | 湖南黄金 | 2,482,500 | 32,148,375.00 | 0.49 |
| 10 | 600150 | 中国船舶 | 1,402,900 | 31,256,612.00 | 0.48 |
| 11 | 002353 | 杰瑞股份 | 1,115,500 | 31,133,605.00 | 0.48 |
| 12 | 002049 | 紫光国微 | 202,316 | 26,669,295.12 | 0.41 |
| 13 | 002735 | 王子新材 | 1,144,060 | 23,945,175.80 | 0.37 |
| 14 | 000661 | 长春高新 | 143,400 | 23,868,930.00 | 0.36 |
| 15 | 600718 | 东软集团 | 2,327,100 | 23,154,645.00 | 0.35 |
| 16 | 688002 | 睿创微纳 | 606,368 | 22,550,825.92 | 0.34 |
| 17 | 300144 | 宋城演艺 | 1,498,900 | 21,883,940.00 | 0.33 |
| 18 | 603986 | 兆易创新 | 205,496 | 21,057,175.12 | 0.32 |
| 19 | 603063 | 禾望电气 | 680,100 | 18,961,188.00 | 0.29 |
| 20 | 002241 | 歌尔股份 | 987,495 | 16,619,540.85 | 0.25 |
| 21 | 300384 | 三联虹普 | 1,087,300 | 16,537,833.00 | 0.25 |
| 22 | 002648 | 卫星化学 | 1,010,196 | 15,658,038.00 | 0.24 |
| 23 | 600973 | 宝胜股份 | 3,006,657 | 14,341,753.89 | 0.22 |
| 24 | 600026 | 中远海能 | 1,171,040 | 14,111,032.00 | 0.22 |
| 25 | 002273 | 水晶光电 | 1,127,400 | 13,292,046.00 | 0.20 |
| 26 | 002960 | 青鸟消防 | 464,348 | 12,997,100.52 | 0.20 |
| 27 | 603588 | 高能环境 | 1,171,236 | 11,524,962.24 | 0.18 |
| 28 | 002027 | 分众传媒 | 1,687,900 | 11,275,172.00 | 0.17 |
| 29 | 300408 | 三环集团 | 363,045 | 11,149,111.95 | 0.17 |
| 30 | 601058 | 赛轮轮胎 | 1,110,384 | 11,126,047.68 | 0.17 |
| 31 | 002408 | 齐翔腾达 | 1,203,700 | 8,474,048.00 | 0.13 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-----------|--------------|------|
| 32 | 688065 | 凯赛生物 | 133,640 | 8,190,795.60 | 0.13 |
| 33 | 300888 | 稳健医疗 | 107,200 | 7,664,800.00 | 0.12 |
| 34 | 002386 | 天原股份 | 1,115,100 | 7,538,076.00 | 0.12 |
| 35 | 002938 | 鹏鼎控股 | 232,000 | 6,366,080.00 | 0.10 |
| 36 | 688550 | 瑞联新材 | 117,617 | 5,482,128.37 | 0.08 |
| 37 | 300829 | 金丹科技 | 242,900 | 5,297,649.00 | 0.08 |
| 38 | 002841 | 视源股份 | 89,300 | 5,272,272.00 | 0.08 |
| 39 | 688536 | 思瑞浦 | 17,886 | 4,925,983.26 | 0.08 |
| 40 | 688007 | 光峰科技 | 197,131 | 4,900,676.66 | 0.07 |
| 41 | 300572 | 安车检测 | 347,869 | 3,983,100.05 | 0.06 |
| 42 | 000403 | 派林生物 | 40,600 | 924,056.00 | 0.01 |
| 43 | 603516 | 淳中科技 | 41,400 | 542,340.00 | 0.01 |

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例（%） |
|----|--------|--------|---------------|----------------|
| 1 | 600426 | 华鲁恒升 | 90,027,239.20 | 4.74 |
| 2 | 601965 | 中国汽研 | 80,036,922.01 | 4.22 |
| 3 | 600958 | 东方证券 | 72,627,208.02 | 3.83 |
| 4 | 600588 | 用友网络 | 68,558,274.71 | 3.61 |
| 5 | 601628 | 中国人寿 | 65,658,140.24 | 3.46 |
| 6 | 000887 | 中鼎股份 | 64,517,818.75 | 3.40 |
| 7 | 300122 | 智飞生物 | 64,240,076.84 | 3.38 |
| 8 | 002597 | 金禾实业 | 64,034,206.48 | 3.37 |
| 9 | 002049 | 紫光国微 | 62,798,149.94 | 3.31 |
| 10 | 002129 | TCL 中环 | 62,120,046.00 | 3.27 |
| 11 | 603076 | 乐惠国际 | 61,287,760.00 | 3.23 |
| 12 | 601111 | 中国国航 | 52,438,862.40 | 2.76 |
| 13 | 601058 | 赛轮轮胎 | 52,030,050.69 | 2.74 |
| 14 | 300251 | 光线传媒 | 47,857,062.30 | 2.52 |
| 15 | 002353 | 杰瑞股份 | 47,211,890.13 | 2.49 |
| 16 | 600150 | 中国船舶 | 46,836,766.06 | 2.47 |
| 17 | 600585 | 海螺水泥 | 45,920,607.76 | 2.42 |
| 18 | 000776 | 广发证券 | 43,167,363.00 | 2.27 |
| 19 | 002415 | 海康威视 | 42,440,784.07 | 2.24 |
| 20 | 601838 | 成都银行 | 39,807,886.58 | 2.10 |
| 21 | 600547 | 山东黄金 | 39,339,031.40 | 2.07 |
| 22 | 300012 | 华测检测 | 38,720,162.62 | 2.04 |

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票；

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

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例（%） |
|----|--------|--------|---------------|----------------|
| 1 | 601965 | 中国汽研 | 94,001,011.91 | 4.95 |
| 2 | 603076 | 乐惠国际 | 76,570,210.07 | 4.03 |
| 3 | 601628 | 中国人寿 | 69,778,059.65 | 3.68 |
| 4 | 600588 | 用友网络 | 66,793,979.50 | 3.52 |
| 5 | 600958 | 东方证券 | 64,779,396.60 | 3.41 |
| 6 | 000887 | 中鼎股份 | 63,949,909.34 | 3.37 |
| 7 | 002129 | TCL 中环 | 63,558,172.35 | 3.35 |
| 8 | 601111 | 中国国航 | 61,949,796.22 | 3.26 |
| 9 | 600426 | 华鲁恒升 | 55,521,315.98 | 2.93 |
| 10 | 601838 | 成都银行 | 47,417,224.32 | 2.50 |
| 11 | 300776 | 帝尔激光 | 45,137,391.80 | 2.38 |
| 12 | 002158 | 汉钟精机 | 42,407,459.81 | 2.23 |
| 13 | 002153 | 石基信息 | 42,313,264.43 | 2.23 |
| 14 | 601058 | 赛轮轮胎 | 41,760,399.09 | 2.20 |
| 15 | 300012 | 华测检测 | 40,288,611.00 | 2.12 |
| 16 | 000001 | 平安银行 | 39,035,500.00 | 2.06 |
| 17 | 000776 | 广发证券 | 38,622,734.00 | 2.03 |
| 18 | 000657 | 中钨高新 | 34,527,771.89 | 1.82 |
| 19 | 002049 | 紫光国微 | 33,988,721.00 | 1.79 |
| 20 | 600150 | 中国船舶 | 24,657,554.00 | 1.30 |

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

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

| | |
|--------------|------------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 2,460,776,093.50 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 1,694,678,764.78 |

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票；

2、“买入股票成本（成交）总额”、“卖出股票收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|------------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 2,903,869,023.58 | 44.34 |
| | 其中：政策性金融债 | 965,265,698.63 | 14.74 |
| 4 | 企业债券 | 495,956,973.72 | 7.57 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | 1,015,294,797.54 | 15.50 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 359,261,383.34 | 5.49 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | 1,077,461,812.62 | 16.45 |
| 10 | 合计 | 5,851,843,990.80 | 89.36 |

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（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|----------------|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 200313 | 20 进出 13 | 2,700,000 | 275,073,115.07 | 4.20 |
| 2 | 2228055 | 22 平安银行 02 | 2,500,000 | 248,293,904.11 | 3.79 |
| 3 | 2128044 | 21 工商银行永续债 02 | 2,500,000 | 248,070,000.00 | 3.79 |
| 4 | 092280065 | 22 工行二级资本债 03A | 2,400,000 | 235,808,955.62 | 3.60 |
| 5 | 2028051 | 20 浦发银行永续债 | 2,000,000 | 205,852,054.79 | 3.14 |

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

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（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|---------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 183235 | ZJ 即墨 A | 200,000 | 16,680,736.85 | 0.25 |

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

本基金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

本基金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

根据本基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

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

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

8.11.2 本期国债期货投资评价

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

报告期基金投资的前十名证券除 18 国开 11（证券代码 180211）、20 进出 13（证券代码 200313）、20 农业银行永续债 01（证券代码 2028017）、20 浦发银行永续债（证券代码 2028051）、21 工商银行永续债 02（证券代码 2128044）、21 进出 22（证券代码 210322）、22 工行二级资本债 03A（证券代码 092280065）、22 国开行二级资本债 01A（证券代码 092202005）、22 农业银行永续债 01（证券代码 2228011）、22 平安银行 02（证券代码 2228055）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、18 国开 11（证券代码 180211）

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，多次受到监管机构的处罚。

2、20 进出 13（证券代码 200313）

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 农业银行永续债 01（证券代码 2028017）

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、未依法履行职责等原因，多次受到监管机构的处罚。

4、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。

5、21 工商银行永续债 02（证券代码 2128044）

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、未依法履行职责等原因，多次受到监管机构的处罚。

6、21 进出 22（证券代码 210322）

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。

7、22 工行二级资本债 03A（证券代码 092280065）

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、未依法履行职责等原因，多次受到监管机构的处罚。

8、22 国开行二级资本债 01A（证券代码 092202005）

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，多次受到监管机构的处罚。

9、22 农业银行永续债 01（证券代码 2228011）

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、未依法履行职责等原因，多次受到监管机构的处罚。

10、22 平安银行 02（证券代码 2228055）

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、未依法履行职责、涉嫌违反法律法规、信息披露虚假或严重误导性陈述等原因，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。

8.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库，本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

8.12.3 期末其他各项资产构成

金额单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|-------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 676,208.02 |
| 2 | 应收清算款 | 1,125,465.17 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 29,691.73 |

| | | |
|---|-------|--------------|
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 1,831,364.92 |

8.12.4 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 | 110076 | 华海转债 | 73,705,724.71 | 1.13 |
| 2 | 128128 | 齐翔转 2 | 52,738,956.90 | 0.81 |
| 3 | 123117 | 健帆转债 | 52,264,059.56 | 0.80 |
| 4 | 110085 | 通 22 转债 | 47,420,664.63 | 0.72 |
| 5 | 110075 | 南航转债 | 28,900,568.36 | 0.44 |
| 6 | 123121 | 帝尔转债 | 19,936,905.09 | 0.30 |
| 7 | 110081 | 闻泰转债 | 16,527,298.85 | 0.25 |
| 8 | 113055 | 成银转债 | 15,211,680.74 | 0.23 |
| 9 | 110053 | 苏银转债 | 14,834,910.40 | 0.23 |
| 10 | 113050 | 南银转债 | 14,215,655.75 | 0.22 |
| 11 | 128136 | 立讯转债 | 7,851,830.67 | 0.12 |
| 12 | 123145 | 药石转债 | 7,398,145.14 | 0.11 |
| 13 | 123101 | 拓斯转债 | 2,724,551.56 | 0.04 |

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末投资前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 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 |
| 招商安本增利债券 A | 54 | 44,480,967.37 | 2,401,433,148.15 | 99.98% | 539,089.90 | 0.02% |
| 招商安本增利债券 C | 9,596 | 208,842.98 | 1,832,942,087.39 | 91.46% | 171,115,152.54 | 8.54% |
| 合计 | 9,650 | 456,583.37 | 4,234,375,235.54 | 96.10% | 171,654,242.44 | 3.90% |

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

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员持有本基金 | 招商安本增利债券 A | 49.61 | 0.0000% |
| | 招商安本增利债券 C | 12,948.33 | 0.0006% |
| | 合计 | 12,997.94 | 0.0003% |

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

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 | 招商安本增利债券 A | 0 |
| | 招商安本增利债券 C | 0 |
| | 合计 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 招商安本增利债券 A | 0 |
| | 招商安本增利债券 C | 0 |
| | 合计 | 0 |

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 招商安本增利债券 A | 招商安本增利债券 C |
|----------------------------|------------------|------------------|
| 基金合同生效日(2006年7月11日)基金份额总额 | - | 3,097,655,129.20 |
| 本报告期期初基金份额总额 | - | 1,135,947,783.97 |
| 本报告期基金总申购份额 | 3,060,339,095.47 | 3,105,225,882.54 |
| 减：报告期基金总赎回份额 | 658,366,857.42 | 2,237,116,426.58 |
| 本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 2,401,972,238.05 | 2,004,057,239.93 |

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末召开基金份额持有人大会。

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

根据本基金管理人 2022 年 7 月 30 日的公告，经招商基金管理有限公司第六届董事会 2022 年第五次会议审议通过，同意聘任徐勇先生为公司总经理。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的重大诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金的审计事务所无变化，目前德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）已为本基金提供审计服务 17 年，本报告期应支付给德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为人民币 80,000.00 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，基金管理人没有受到监管部门的稽查或处罚，亦未收到关于基金管理人的高级管理人员受到监管部门的稽查或处罚的书面通知或文件。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中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 | 2 | 2,863,275,888.81 | 68.99% | 2,093,908.25 | 63.59% | - |
| 中信建投证券 | 1 | 1,183,744,622.39 | 28.52% | 1,102,413.13 | 33.48% | - |
| 银河证券 | 1 | 103,412,254.20 | 2.49% | 96,307.86 | 2.92% | - |
| 海通证券 | 1 | - | - | - | - | - |

注：基金交易佣金根据券商季度综合评分结果给与分配，券商综合评分根据研究报告质量、路演质量、联合调研质量等维度进行打分，从多家服务券商中选取符合法律规范经营的综合能力靠前的券商给与佣金分配，季度评分和佣金分配分别由专人负责。

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 | |
|--------|----------------|--------------|------------------|----------------|------|--------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 招商证券 | 851,598,954.07 | 67.80% | 5,200,128,000.00 | 49.78% | - | - |
| 中信建投证券 | 377,150,543.72 | 30.03% | 4,940,300,000.00 | 47.30% | - | - |
| 银河证券 | 27,316,073.84 | 2.17% | 305,000,000.00 | 2.92% | - | - |
| 海通证券 | - | - | - | - | - | - |

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 | 招商基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告 | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2022-01-01 |
| 2 | 招商安本增利债券型证券投资基金基金合同（2022年1月5日修订） | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2022-01-05 |
| 3 | 招商基金管理有限公司关于招商安本增利债券型证券投资基金增加基金份额类别并修改基金合同和托管协议的公告 | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2022-01-05 |
| 4 | 招商安本增利债券型证券投资基金托管协议（2022年1月5日修订） | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2022-01-05 |
| 5 | 招商安本增利债券型证券投资基金（C类份额）基金产品资料概要更新 | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2022-01-05 |
| 6 | 招商安本增利债券型证券投资基金更新的招募说明书（二零二二年第一号） | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2022-01-05 |
| 7 | 招商安本增利债券型证券投资基金（A类份额）基金产品资料概要更新 | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2022-01-05 |
| 8 | 关于招商安本增利债券型证券投资基金基金经理变更的公告 | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会 | 2022-01-14 |

| | | | |
|----|------------------------------------------|-----------------------------|------------|
| | | 会基金电子披露网站 | |
| 9 | 招商安本增利债券型证券投资基金更新的招募说明书（二零二二年第二号） | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2022-01-19 |
| 10 | 招商安本增利债券型证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要更新 | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2022-01-19 |
| 11 | 招商安本增利债券型证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要更新 | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2022-01-19 |
| 12 | 招商基金管理有限公司旗下基金 2021 年第 4 季度报告提示性公告 | 上海证券报及基金管理人网站 | 2022-01-21 |
| 13 | 招商安本增利债券型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告 | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2022-01-21 |
| 14 | 招商基金管理有限公司关于公司自有资金投资旗下公募基金的公告 | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2022-01-27 |
| 15 | 关于警惕冒用招商基金管理有限公司名义进行诈骗活动的特别提示公告 | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2022-03-22 |
| 16 | 招商基金管理有限公司旗下基金 2021 年年度报告提示性公告 | 上海证券报及基金管理人网站 | 2022-03-30 |
| 17 | 招商安本增利债券型证券投资基金 2021 年年度报告 | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2022-03-30 |
| 18 | 招商基金管理有限公司旗下基金 2022 年第 1 季度报告提示性公告 | 上海证券报及基金管理人网站 | 2022-04-21 |
| 19 | 招商安本增利债券型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告 | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2022-04-21 |
| 20 | 招商基金管理有限公司关于提醒投资者持续完善身份信息资料的公告 | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2022-05-13 |
| 21 | 招商基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告 | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2022-06-02 |
| 22 | 招商基金管理有限公司关于养老金客户通过直销柜台申购旗下基金开展费率优惠活动的公告 | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2022-06-09 |
| 23 | 招商安本增利债券型证券投资基金更新的招募说明书（二零二二年第三号） | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2022-07-08 |
| 24 | 招商安本增利债券型证券投资基金（C 类份额） | 上海证券报、基金管 | 2022-07-08 |

| | | | |
|----|--------------------------------------------|-----------------------------|------------|
| | 基金产品资料概要更新 | 理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | |
| 25 | 招商安本增利债券型证券投资基金(A类份额)基金产品资料概要更新 | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2022-07-08 |
| 26 | 招商安本增利债券型证券投资基金2022年第2季度报告 | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2022-07-20 |
| 27 | 招商基金管理有限公司旗下基金2022年第2季度报告提示性公告 | 上海证券报及基金管理人网站 | 2022-07-20 |
| 28 | 招商基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告 | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2022-07-30 |
| 29 | 招商基金管理有限公司旗下基金2022年中期报告提示性公告 | 上海证券报及基金管理人网站 | 2022-08-30 |
| 30 | 招商安本增利债券型证券投资基金2022年中期报告 | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2022-08-30 |
| 31 | 招商基金管理有限公司关于运用自有资金投资旗下公募基金的公告 | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2022-10-17 |
| 32 | 招商安本增利债券型证券投资基金2022年第3季度报告 | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2022-10-25 |
| 33 | 招商基金管理有限公司旗下基金2022年第3季度报告提示性公告 | 上海证券报及基金管理人网站 | 2022-10-25 |
| 34 | 关于暂停招商安本增利债券型证券投资基金大额申购(含定期定额投资)和转换转入业务的公告 | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2022-11-02 |
| 35 | 关于调整招商安本增利债券型证券投资基金大额申购(含定期定额投资)和转换转入业务的公告 | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2022-11-22 |
| 36 | 招商安本增利债券型证券投资基金2022年度第一次分红公告 | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2022-11-26 |
| 37 | 招商安本增利债券型证券投资基金2022年度第二次分红公告 | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2022-12-19 |
| 38 | 关于恢复招商安本增利债券型证券投资基金大额申购(含定期定额投资)和转换转入业务的公告 | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2022-12-20 |

§ 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 | 20220316-20220320, 20220322-20220424 | 60,128,675.36 | 1,293,465,810.88 | 787,674,834.64 | 565,919,651.60 | 12.84% |
| 机构 | 2 | 20221027-20221231 | - | 1,856,770,319.98 | - | 1,856,770,319.98 | 42.14% |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| 本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况,可能会出现集中赎回甚至巨额赎回从而引发基金净值剧烈波动,甚至引发基金的流动性风险,基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请,基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。 | | | | | | | |

注：报告期末持有份额占比按照四舍五入方法保留至小数点后第 2 位。

§ 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批准设立招商基金管理有限公司的文件；
- 2、中国证券监督管理委员会批准招商安本增利债券型证券投资基金设立的文件；
- 3、《招商安本增利债券型证券投资基金基金合同》；
- 4、《招商安本增利债券型证券投资基金托管协议》；
- 5、《招商安本增利债券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。

13.2 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

13.3 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，或者在营业时间内到招商基金管理有限公司查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人招商基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-887-9555

网址：<http://www.cmfchina.com>

招商基金管理有限公司

2023 年 3 月 30 日