

招商安颐稳健 1 年封闭运作债券型证 券投资基金 2023 年第 2 季度报告

2023 年 06 月 30 日

基金管理人：招商基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2023 年 7 月 20 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 7 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 招商安颐稳健 1 年封闭运作债券 |
| 基金主代码 | 016957 |
| 交易代码 | 016957 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2023 年 2 月 7 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 362,030,646.65 份 |
| 投资目标 | 本基金以追求绝对收益为目标，在严格控制风险的前提下，追求基金资产的长期稳定增值。 |
| 投资策略 | 本基金以获取绝对收益为投资目的，采取稳健的投资策略，在控制投资风险的基础之上确定大类资产配置比例，力争使投资者获得较为合理的绝对收益。本基金的投资策略由大类资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、存托凭证投资策略、国债期货投资策略、基金投资策略等部分组成。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率*7%+恒生综合指数收益率（经汇率调整后）*3%+中债综合（全价）指数收益率*90% |
| 风险收益特征 | 本基金是债券型基金，预期收益和预期风险低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。 本基金资产投资于港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险（港股市场实行 T+0 回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股股价可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动）、汇率风险（汇率波动 |

| | | |
|-----------------|--|------------------|
| | 可能对基金的投资收益造成损失)、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险(在内地开市香港休市的情形下,港股通不能正常交易,港股不能及时卖出,可能带来一定的流动性风险)等。 | |
| 基金管理人 | 招商基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 招商安颐稳健1年封闭运作债券 A | 招商安颐稳健1年封闭运作债券 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 016957 | 016958 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 324,844,415.45 份 | 37,186,231.20 份 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

| 主要财务指标 | 报告期(2023年4月1日-2023年6月30日) | |
|----------------|---------------------------|------------------|
| | 招商安颐稳健1年封闭运作债券 A | 招商安颐稳健1年封闭运作债券 C |
| 1.本期已实现收益 | 2,897,568.14 | 313,040.52 |
| 2.本期利润 | -1,803,729.78 | -224,893.99 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0056 | -0.0060 |
| 4.期末基金资产净值 | 323,777,192.16 | 37,035,030.44 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.9967 | 0.9959 |

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

招商安颐稳健1年封闭运作债券 A

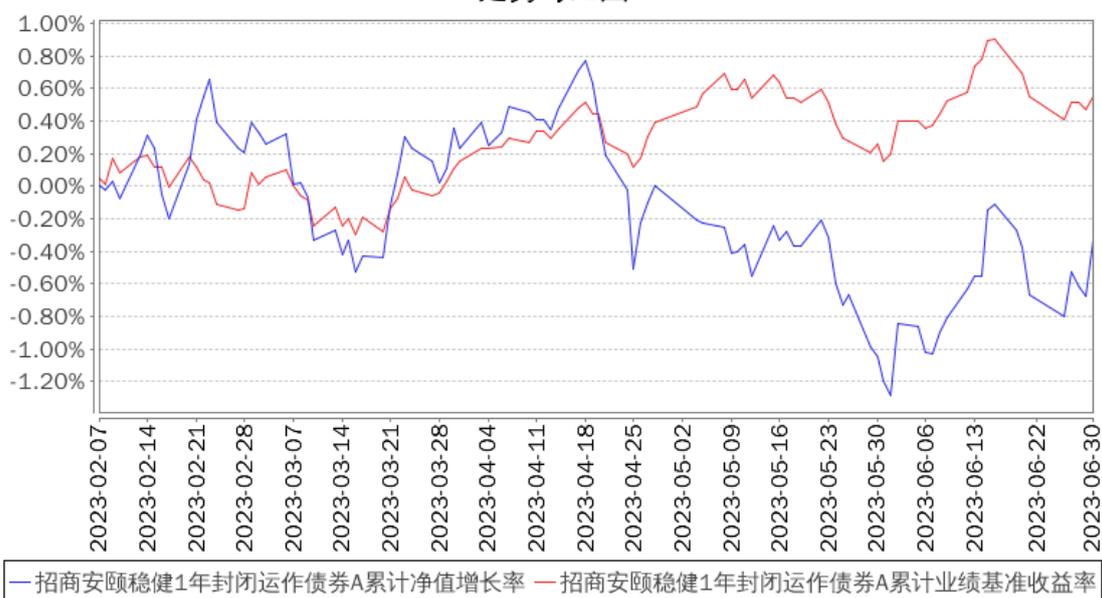
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | -0.56% | 0.18% | 0.40% | 0.09% | -0.96% | 0.09% |
| 自基金合同生效起至今 | -0.33% | 0.18% | 0.55% | 0.09% | -0.88% | 0.09% |

招商安颐稳健1年封闭运作债券C

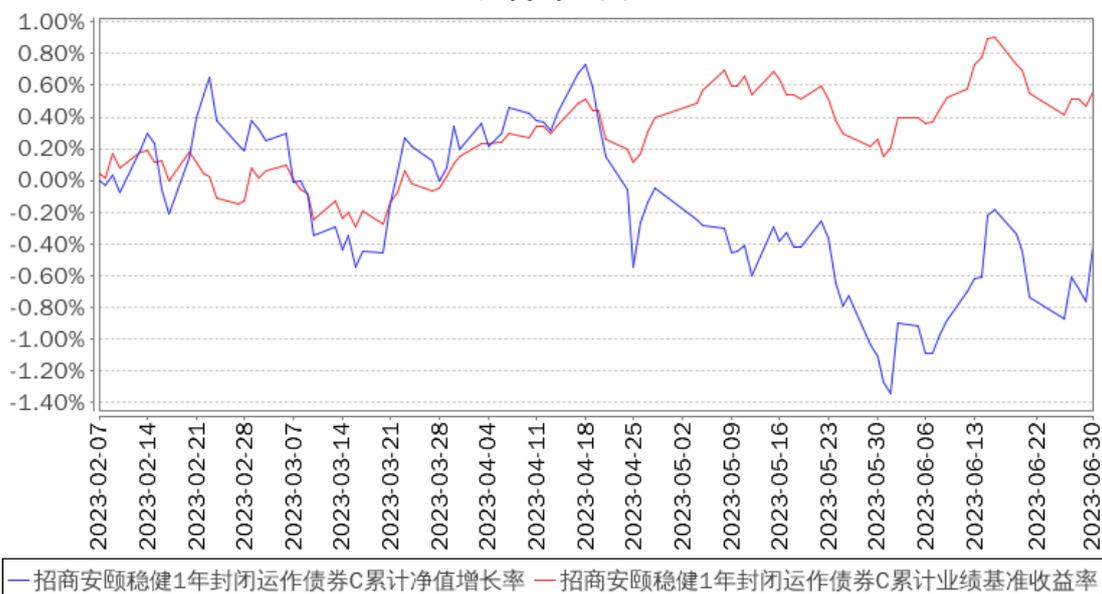
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | -0.61% | 0.18% | 0.40% | 0.09% | -1.01% | 0.09% |
| 自基金合同生效起至今 | -0.41% | 0.18% | 0.55% | 0.09% | -0.96% | 0.09% |

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

招商安颐稳健1年封闭运作债券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



招商安颐稳健1年封闭运作债券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：本基金合同于 2023 年 2 月 7 日生效，截至本报告期末基金成立未满一年；自基金成立日起 6 个月内为建仓期，截至报告期末基金建仓期尚未结束。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|----|---------|----------------|------|--------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 郭敏 | 本基金基金经理 | 2023 年 2 月 7 日 | - | 10 | 女，硕士。曾任职于安永（中国）企业咨询有限公司，从事咨询工作；2013 年 6 月加入中荷人寿保险有限公司，任投资部信用评估研究员，主要负责银行协议存款评级以及信用债内部评级和研究工作；2015 年 5 月加入招商基金管理有限公司固定收益投资部，曾任高级研究员，招商招利一年期理财债券型证券投资基金、招商招诚半年定期开放债券型发起式证券投资基金、招商中债-1-3 年高等级央企主题债券指数证券投资基金、招商鑫福中短债债券型证券投资基金、招商安锦债券型证券投资基金基金经理，现任招商招旭纯债债券型证券投资基金、招商鑫悦中短债债券型证券投资基金、招商招坤纯债债券型证券投资基金、招商瑞联 1 年持有期混合型证券投资基金、招商安颐稳健 1 年封闭运作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合规守信情况的说明

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

运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围以及投资运作符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

基金管理人已建立较完善的研究方法和投资决策流程，确保各投资组合享有公平的投资决策机会。基金管理人建立了所有组合适用的投资对象备选库，制定明确的备选库建立、维护程序。基金管理人拥有健全的投资授权制度，明确投资决策委员会、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限划分，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。基金管理人的相关研究成果向内部所有投资组合开放，在投资研究层面不存在各投资组合间不公平的问题。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，本基金各项交易均严格按照相关法律法规、基金合同的有关要求执行，公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 12 次，其中 9 次为旗下指数及量化组合因投资策略需要而发生反向交易，3 次为不同基金经理管理的基金因投资策略不同而发生的反向交易。报告期内未发现有可能会导致不公平交易和利益输送的重大异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

宏观经济回顾：

2023 年二季度，国内经济处于相对低迷的状态。投资方面，最新的 5 月固定资产投资完成额累计同比增长 4.0%，其中 5 月房地产开发投资累计同比下降 7.2%，单月投资同比下降 21.5%，较一季度地产投资同比降幅进一步扩大，由于商品房销售疲弱带来的房企拿地及新开工意愿下降，地产投资仍处于低迷状态；5 月基建投资累计同比增长 10.1%，政府使用基建支持经济的能力和意愿依旧较强，基建投资具有一定韧性；5 月制造业投资累计同比增长 6.0%，较 2023 年一季度 7.0% 的累计同比增速有所回落，主要与地产链和出口链相关制造业企业投资意愿趋弱有关。消费方面，在去年低基数影响下，5 月社会消费品零售总额当月同比上升 12.7%，其两年平均增速为 2.5%，较一季度表现略有下滑，消费有所复苏但动能不强。对外贸易方面，5 月出口金额当月同比下降 7.5%，主要系去年 5 月高基数以及

全球加息周期背景下外需回落导致，未来出口增速可能继续承压。生产方面，6 月 PMI 指数为 49%，连续三个月位于荣枯线以下，6 月生产指数和新订单指数分别为 50.3% 和 48.6%，反映经济边际复苏动能略显不足，预计 2023 年三季度国内经济仍将处于筑底期，重点关注后续可能出台的经济刺激与稳增长政策。

债券市场回顾：

2023 年二季度，债券市场上涨趋势较强，10 年国债收益率二季度整体下行幅度达 20bp。4 月份公布的 3 月份和一季度宏观经济数据表现较好，如出口数据超预期、信贷继续高增，但由于结构上显示出服务业修复、固定资产投资边际走弱，加之地产、钢铁等高频数据趋弱，资金面转松，10 年国债收益率在 4 月末下行突破 2.8%。5 月份发布的各项核心宏观经济金融数据出现回落，PMI 数据显示经济运行偏弱，加之 5 月上旬银行通知存款、协定存款利率上限下调，有利于银行负债成本降低，10 年国债收益率在 5 月末再次下行突破 2.7%。6 月份债市整体走强但有所波动，6 月 13 日 OMO 降息 10bp，债市快速走强，10 年国债收益率最低点触及 2.62%，随后在市场对政策稳增长预期提升的背景下有所回调，但端午节后伴随股市和汇率走弱，债市收益率再度下行。分品种看，二季度信用债收益率下行幅度与利率债基本类似，信用利差变化不大，5 年、3 年和 1 年 AAA 中债中短期票据收益率分别下降 24bp、29bp 和 30bp，短端下行幅度略大于长端，信用债在二季度处于跟随调整状态。

基金操作：

回顾 2023 年二季度的基金操作，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，追求提高组合收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金 A 类份额净值增长率为 -0.56%，同期业绩基准增长率为 0.40%，C 类份额净值增长率为 -0.61%，同期业绩基准增长率为 0.40%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|----|----|-------|--------------|
|----|----|-------|--------------|

| | | | |
|---|-------------------|----------------|--------|
| 1 | 权益投资 | 58,368,075.30 | 11.88 |
| | 其中：股票 | 58,368,075.30 | 11.88 |
| 2 | 基金投资 | 13,340,742.60 | 2.71 |
| 3 | 固定收益投资 | 414,646,087.80 | 84.39 |
| | 其中：债券 | 404,497,214.37 | 82.32 |
| | 资产支持证券 | 10,148,873.43 | 2.07 |
| 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 | 3,838,462.98 | 0.78 |
| 8 | 其他资产 | 1,179,709.08 | 0.24 |
| 9 | 合计 | 491,373,077.76 | 100.00 |

注：上表权益投资中通过港股通交易机制投资的港股金额人民币 5,166,554.65 元，占基金净值比例 1.43%。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|---------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | 4,237,625.00 | 1.17 |
| B | 采矿业 | 2,511,636.00 | 0.70 |
| C | 制造业 | 29,863,211.05 | 8.28 |
| 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 | 5,889,554.00 | 1.63 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 7,689,564.60 | 2.13 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | 3,009,930.00 | 0.83 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |

| | | |
|----|---------------|-------|
| 合计 | 53,201,520.65 | 14.74 |
|----|---------------|-------|

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

金额单位：人民币元

| 行业类别 | 公允价值（人民币元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----------|--------------|--------------|
| 通信服务 | - | - |
| 非日常生活消费品 | 2,886,613.36 | 0.80 |
| 日常消费品 | - | - |
| 能源 | - | - |
| 金融 | 1,500,983.44 | 0.42 |
| 医疗保健 | 778,957.85 | 0.22 |
| 工业 | - | - |
| 信息技术 | - | - |
| 原材料 | - | - |
| 房地产 | - | - |
| 公用事业 | - | - |
| 合计 | 5,166,554.65 | 1.43 |

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------|--------------|--------------|
| 1 | 603613 | 国联股份 | 208,220 | 7,689,564.60 | 2.13 |
| 2 | 601058 | 赛轮轮胎 | 533,300 | 6,074,287.00 | 1.68 |
| 3 | 02333 | 长城汽车 | 309,500 | 2,559,614.71 | 0.71 |
| 3 | 601633 | 长城汽车 | 23,000 | 578,910.00 | 0.16 |
| 4 | 600029 | 南方航空 | 499,800 | 3,013,794.00 | 0.84 |
| 5 | 600048 | 保利发展 | 231,000 | 3,009,930.00 | 0.83 |
| 6 | 603822 | 嘉澳环保 | 90,100 | 2,932,755.00 | 0.81 |
| 7 | 601111 | 中国国航 | 349,000 | 2,875,760.00 | 0.80 |
| 8 | 002541 | 鸿路钢构 | 99,400 | 2,863,714.00 | 0.79 |
| 9 | 600438 | 通威股份 | 79,400 | 2,724,214.00 | 0.76 |
| 10 | 000661 | 长春高新 | 19,700 | 2,685,110.00 | 0.74 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------|---------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 32,033,463.01 | 8.88 |

| | | | |
|----|-----------|----------------|--------|
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | 177,959,789.59 | 49.32 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | 162,984,049.44 | 45.17 |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | 31,519,912.33 | 8.74 |
| 10 | 合计 | 404,497,214.37 | 112.11 |

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|------------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 2028051 | 20浦发银行永续债 | 200,000 | 21,382,082.19 | 5.93 |
| 2 | 2128029 | 21邮储银行二级02 | 200,000 | 21,268,876.71 | 5.89 |
| 3 | 102101593 | 21中冶MTN002 | 200,000 | 20,740,666.30 | 5.75 |
| 4 | 188476 | 21首开02 | 200,000 | 20,575,460.82 | 5.70 |
| 5 | 137534 | 22铁建Y4 | 200,000 | 20,572,086.58 | 5.70 |

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

| 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 | 112887 | G中交泰A | 100,000 | 10,148,873.43 | 2.81 |

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

根据本基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

为有效控制债券投资的系统性风险，本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目的，适度运用国债期货，提高投资组合的运作效率。在国债期货投资时，本基金将首先分析国债期货各合约价格与最便宜可交割券的关系，选择定价合理的国债期货合约，其次，考虑国债期货各合约的流动性情况，最终确定与现货组合的合适匹配，以达到风险管理的目标。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

报告期内基金投资的前十名证券除 20 浦发银行永续债（证券代码 2028051）、21 邮储银行二级 02（证券代码 2128029）、22 铁建 Y4（证券代码 137534）、23 鞍钢 Y3（证券代码 148341）、23 中建 MTN001（证券代码 102300386）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、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。

2、21 邮储银行二级 02（证券代码 2128029）

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

3、22 铁建 Y4（证券代码 137534）

根据 2022 年 12 月 27 日发布的相关公告，该证券发行人因未依法履行职责被国家税务总局广州市白云区税务局钟落潭税务所责令改正。

4、23 鞍钢 Y3（证券代码 148341）

根据 2022 年 9 月 19 日发布的相关公告，该证券发行人因违规经营被鞍山经济开发区综合行政执法局处以行政处罚。

5、23 中建 MTN001（证券代码 102300386）

根据发布的相关公告，该证券发行人在报告期内因欠税、违规经营、未依法履行职责等原因，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。

5.11.2

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

5.11.3 其他资产构成

金额单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|-------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 23,660.49 |
| 2 | 应收清算款 | 1,080,394.34 |
| 3 | 应收股利 | 74,280.00 |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | 1,374.25 |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 1,179,709.08 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

§ 6 基金中基金

6.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

| 序号 | 基金代码 | 基金名称 | 运作方式 | 持有份额（份） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） | 是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金 |
|----|--------|------------|--------|--------------|--------------|--------------|------------------------|
| 1 | 004932 | 招商丰拓灵活混合 A | 契约型开放式 | 4,069,791.24 | 6,572,305.87 | 1.82 | 是 |
| 2 | 004933 | 招商丰拓灵活混合 C | 契约型开放式 | 3,759,085.75 | 5,862,294.23 | 1.62 | 是 |
| 3 | 512010 | 易方达沪深 | 交易型 | 2,132,100.00 | 906,142.50 | 0.25 | 否 |

| | | | | | | | |
|--|--|------------|--------------|--|--|--|--|
| | | 300 医药 ETF | 开放式 (ETF) | | | | |
|--|--|------------|--------------|--|--|--|--|

6.2 当期交易及持有基金产生的费用

| 项目 | 本期费用 2023-04-01 至 2023-06-30 | 其中:交易及持有基金管理人 以及管理人关联方所管理基 金产生的费用 |
|----------------------|------------------------------------|---|
| 当期交易基金产生的申购费(元) | - | - |
| 当期交易基金产生的赎回费(元) | - | - |
| 当期持有基金产生的应支付销售服务费(元) | 2,473.28 | 2,473.28 |
| 当期持有基金产生的应支付管理费(元) | 8,413.55 | 7,208.90 |
| 当期持有基金产生的应支付托管费(元) | 2,043.11 | 1,802.18 |
| 当期交易基金产生的交易费(元) | 43.42 | - |

注:当期持有基金产生的应支付销售服务费、应支付管理费、应支付托管费按照被投资基金基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值,上表列示金额为按照本基金对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金基金合同约定的相应费率计算得出。

根据相关法律法规及本基金合同的约定,基金管理人不得对基金中基金财产中持有的自身管理的基金部分收取基金中基金的管理费,基金托管人不得对基金中基金财产中持有的自身托管的基金部分收取基金中基金的托管费。基金管理人运用本基金财产申购自身管理的其他基金的(ETF除外),应当通过直销渠道申购且不收取申购费、赎回费(按照相关法规、基金招募说明书约定应当收取,并计入基金资产的赎回费用除外)、销售服务等销售费用,其中申购费、赎回费在实际申购、赎回时按上述规定执行,销售服务费由本基金管理人从被投资基金收取后返还至本基金基金资产。

6.3 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本基金本报告期持有的基金在持有期内未发生重大影响事件。

§ 7 开放式基金份额变动

单位:份

| 项目 | 招商安颐稳健1年封闭 运作债券 A | 招商安颐稳健1年封闭运作 债券 C |
|-------------------------------|----------------------|----------------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 324,844,415.45 | 37,186,231.20 |
| 报告期期间基金总申购份额 | - | - |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | - | - |
| 报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列) | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 324,844,415.45 | 37,186,231.20 |

§ 8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

8.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

8.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的交易明细。

§ 9 备查文件目录

9.1 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颐稳健1年封闭运作债券型证券投资基金设立的文件；
- 3、《招商安颐稳健1年封闭运作债券型证券投资基金基金合同》；
- 4、《招商安颐稳健1年封闭运作债券型证券投资基金托管协议》；
- 5、《招商安颐稳健1年封闭运作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。

9.2 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

9.3 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.cmfcchina.com>

招商基金管理有限公司

2023年7月20日