

招商恒鑫 30 个月封闭式债券型证券投资 基金 2023 年中期报告

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：中信银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 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。本中期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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 2 月 22 日（基金合同生效日）起至 6 月 30 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 主要财务指标和基金净值表现..... | 5 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 5 |
| 3.2 基金净值表现..... | 6 |
| §4 管理人报告..... | 6 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况..... | 6 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明..... | 7 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 8 |
| 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..... | 8 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 10 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 10 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 11 |
| 4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明..... | 11 |
| §5 托管人报告..... | 11 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... | 11 |
| 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..... | 11 |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见..... | 11 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计）..... | 12 |
| 6.1 资产负债表..... | 12 |
| 6.2 利润表..... | 13 |
| 6.3 净资产（基金净值）变动表..... | 14 |
| 6.4 报表附注..... | 15 |
| §7 投资组合报告..... | 39 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 39 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合..... | 40 |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细..... | 40 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 40 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 40 |
| 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细..... | 40 |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细..... | 41 |
| 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细..... | 41 |
| 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细..... | 41 |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策..... | 41 |

| | | |
|------|-----------------------------------|----|
| 7.11 | 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 41 |
| 7.12 | 投资组合报告附注..... | 42 |
| §8 | 基金份额持有人信息..... | 43 |
| 8.1 | 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 43 |
| 8.2 | 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 43 |
| 8.3 | 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况..... | 43 |
| §9 | 重大事件揭示..... | 43 |
| 9.1 | 基金份额持有人大会决议..... | 44 |
| 9.2 | 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..... | 44 |
| 9.3 | 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 44 |
| 9.4 | 基金投资策略的改变..... | 44 |
| 9.5 | 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 44 |
| 9.6 | 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况..... | 44 |
| 9.7 | 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 44 |
| 9.8 | 其他重大事件..... | 46 |
| §10 | 备查文件目录..... | 47 |
| 10.1 | 存放地点..... | 47 |
| 10.2 | 查阅方式..... | 47 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|------------------------|
| 基金名称 | 招商恒鑫 30 个月封闭式债券型证券投资基金 |
| 基金简称 | 招商恒鑫 30 个月封闭债 |
| 基金主代码 | 017800 |
| 交易代码 | 017800 |
| 基金运作方式 | 契约型封闭式 |
| 基金合同生效日 | 2023 年 2 月 22 日 |
| 基金管理人 | 招商基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中信银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 7,925,622,949.55 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|---|
| 投资目标 | 本基金在严格控制风险的前提下，力争基金资产长期稳健增值，为基金份额持有人提供超越业绩比较基准的投资回报。 |
| 投资策略 | <p>本基金在封闭期初，将视债券、银行存款、债券回购等大类资产的市场环境进行封闭期组合构建。</p> <p>本基金的具体投资策略包括：（一）资产配置策略、（二）子单元管理策略、（三）持有到期型单元的投资策略、（四）采用市值法估值债券的投资策略、（五）信用债投资策略、（六）杠杆投资策略、（七）国债期货投资策略、（八）可转换债券和可交换债券投资策略。</p> <p>未来，随着市场的发展和基金管理运作的需要，基金管理人可以在不改变投资目标的前提下，遵循法律法规的规定，在履行适当程序后，相应调整或更新投资策略，并在招募说明书更新中公告。</p> |
| 业绩比较基准 | 中债综合（全价）指数收益率*90%+两年期定期存款利率（税后）*10% |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---------|---------------|-------------------|
| 名称 | 招商基金管理有限公司 | 中信银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 潘西里 |
| | 联系电话 | 0755-83196666 |
| | 电子邮箱 | cmf@cmfchina.com |
| 客户服务电话 | 400-887-9555 | 95558 |
| 传真 | 0755-83196475 | 010-85230024 |
| 注册地址 | 深圳市福田区深南大道 | 北京市朝阳区光华路 10 号院 1 |

| | | |
|-------|----------------------|--|
| | 7088 号 | 号楼 6-30 层、32-42 层 |
| 办公地址 | 深圳市福田区深南大道 7088 号 | 北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层 |
| 邮政编码 | 518040 | 100020 |
| 法定代表人 | 王小青 | 朱鹤新 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 证券时报 |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | http://www.cmfcchina.com |
| 基金中期报告备置地点 | 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 |
|--------|------------|-------------------|
| 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 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| | |
|---------------|--|
| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2023 年 2 月 22 日 - 2023 年 6 月 30 日) |
| 本期已实现收益 | 80,714,815.62 |
| 本期利润 | 82,356,263.38 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0104 |
| 本期加权平均净值利润率 | 1.03% |
| 本期基金份额净值增长率 | 1.04% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2023 年 6 月 30 日) |
| 期末可供分配利润 | 80,714,815.62 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0102 |
| 期末基金资产净值 | 8,007,979,212.93 |
| 期末基金份额净值 | 1.0104 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2023 年 6 月 30 日) |
| 基金份额累计净值增长率 | 1.04% |

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、本基金合同于 2023 年 2 月 22 日生效，截至本报告期末成立未满半年。

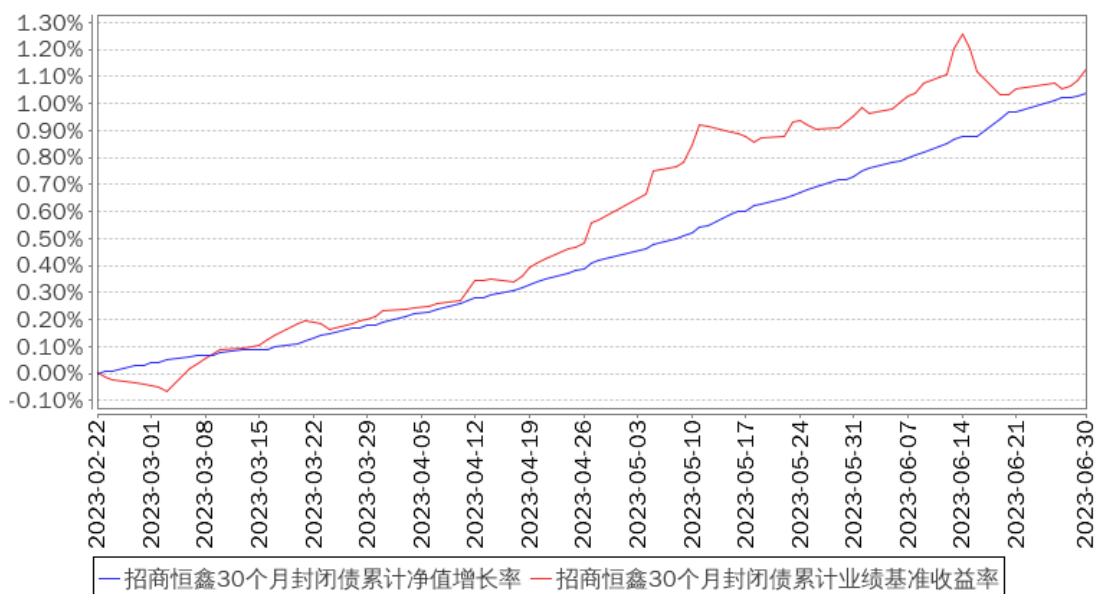
3.2 基金净值表现

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

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月 | 0.31% | 0.01% | 0.18% | 0.04% | 0.13% | -0.03% |
| 过去三个月 | 0.85% | 0.01% | 0.90% | 0.03% | -0.05% | -0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | 1.04% | 0.01% | 1.13% | 0.03% | -0.09% | -0.02% |

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

招商恒鑫30个月封闭债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 22 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 | | |
| 李家辉 | 本基金基金经理 | 2023 年 2 月 22 日 | - | 5 | 男，博士。2017 年 7 月加入招商基金管理有限公司固定收益投资部，曾任研究员，从事债券研究分析工作。现任招商鑫福中短债债券型证券投资基金、招商添利两年定期开放债券型证券投资基金、招商添瑞 1 年定期开放债券型发起式证券投资基金、招商招诚半年定期开放债券型发起式证券投资基金、招商添文 1 年定期开放债券型发起式证券投资基金、招商鑫诚短债债券型证券投资基金、招商添润 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、招商添琪 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、招商招盛纯债债券型证券投资基金、招商鑫嘉中短债债券型证券投资基金、招商鑫利中短债债券型证券投资基金、招商恒鑫 30 个月封闭式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。

4.3.2 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 18 次，其中 14 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，4 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：

2023 年上半年，国内经济有所复苏，但二季度开始增长动力有所趋弱。投资方面，6 月固定资产投资完成额累计同比增长 3.8%，其中 6 月房地产开发投资累计同比下降 7.9%，

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；6 月基建投资累计同比增长 10.7%，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；6 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，6 月社会消费品零售总额当月同比上升 3.1%，消费有所复苏但动能不强。对外贸易方面，6 月出口金额当月同比下降 12.4%，主要系去年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 年一季度，债券市场波动幅度收窄，10 年国债收益率呈现先上后下态势，持续在 2.8%-2.9% 区间内震荡。1 月份市场对经济复苏预期较强，且票据利率持续高企预示 1 月信贷不弱，这导致 10 年国债收益率在 1 月份走出一个近 10bp 左右的调整行情，从月初 2.81% 的低位上行至月末 2.93% 的阶段高点。2 月至 3 月，债券市场对利空因素有所钝化，国债利率上行阻力较大，较强的金融数据和经济数据已经反映在前期预期中，3 月中下旬随着央行超额续作 MLF、降准 25bp 释放 5000 亿长期流动性资金举措的实施，银行间流动性状况有所好转，10 年国债利率在 2 月至 3 月小幅波动向下，3 月底降至 2.86% 水平。在一季度国债利率的低波动背景下，信用债由于其票息优势，表现优于利率债，尤其 AA+ 和 AA 信用债表现较好，具体看，3 年 AAA、AA+ 和 AA 信用债收益率在一季度分别下行 11bp、38bp 和 36bp。

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。虽然 4 月份公布的 3 月份和一季度宏观经济数据表现较好，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基本跟随利率调整，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。

基金操作：

回顾 2023 年上半年的基金操作，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。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金份额净值增长率为 1.04%，同期业绩基准增长率为 1.13%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

市场展望：

展望后市，从基本面看，地产销售高频数据、各项生产开工率数据显示 6 月经济修复仍然比较脆弱，端午期间的消费显示居民消费力量的修复仍然较为缓慢，不过 6 月 PMI 环比小幅回升、开工率数据有涨有跌而非大部分回落、信贷数据表现较好，显示基本面暂时低位运行，并没有在 5 月基础上再快速回落。从政策上看，政治局会议对稳增长政策的定调较为积极，需警惕后续超预期政策出台对债市的调整风险。另一方面，目前银行整体净息差已经降至低位水平，未来银行业有动力去推动存款利率下行以维护净息差，这为引导利率下行提供空间。整体看，债市短期突破 2022 年收益率低点仍有难度，票息策略相对占优，后续需持续跟踪关注政策出台及具体实施效果情况。

4.6 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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规的规定和基金合同的约定，以及本基金的实际运作情况，本基金报告期末未进行利润分配。在符合分红条件的前提下，本基金已实现尚未分配的可供分配收益部分，将严格按照基金合同的约定适时向投资者予以分配。

4.8 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 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对招商恒鑫 30 个月封闭式债券型证券投资基金 2023 年上半年的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，招商基金管理有限公司在招商恒鑫 30 个月封闭式债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：招商恒鑫 30 个月封闭式债券型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 |
|----------|---------|---------------------|
| 资产： | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 4,493,059.62 |
| 结算备付金 | | 32,183,521.68 |
| 存出保证金 | | 213,532.53 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 2,399,594,974.86 |
| 其中：股票投资 | | - |
| 基金投资 | | - |
| 债券投资 | | 2,368,393,703.63 |
| 资产支持证券投资 | | 31,201,271.23 |
| 贵金属投资 | | - |
| 其他投资 | | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | - |
| 债权投资 | 6.4.7.5 | 8,095,873,810.60 |
| 其中：债券投资 | | 8,095,873,810.60 |
| 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 | | - |
| 应收股利 | | - |
| 应收申购款 | | - |
| 递延所得税资产 | | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - |
| 资产总计 | | 10,532,358,899.29 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 |
| 负债： | | |
| 短期借款 | | - |

| | | |
|-----------|---------|-------------------|
| 交易性金融负债 | | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - |
| 卖出回购金融资产款 | | 2,520,583,445.37 |
| 应付清算款 | | - |
| 应付赎回款 | | - |
| 应付管理人报酬 | | 1,971,537.09 |
| 应付托管费 | | 657,179.06 |
| 应付销售服务费 | | - |
| 应付投资顾问费 | | - |
| 应交税费 | | 1,042,121.19 |
| 应付利润 | | - |
| 递延所得税负债 | | - |
| 其他负债 | 6.4.7.7 | 125,403.65 |
| 负债合计 | | 2,524,379,686.36 |
| 净资产： | | |
| 实收基金 | 6.4.7.8 | 7,925,622,949.55 |
| 其他综合收益 | | - |
| 未分配利润 | 6.4.7.9 | 82,356,263.38 |
| 净资产合计 | | 8,007,979,212.93 |
| 负债和净资产总计 | | 10,532,358,899.29 |

注：1. 报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0104 元，基金份额总额 7,925,622,949.55 份；

2. 本财务报表的实际编制期间为 2023 年 2 月 22 日(基金合同生效日)至 2023 年 6 月 30 日止期间。

6.2 利润表

会计主体：招商恒鑫 30 个月封闭式债券型证券投资基金

本报告期：2023 年 2 月 22 日(基金合同生效日)至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2023 年 2 月 22 日(基金合同生效日)至 2023 年 6 月 30 日 |
|------------|----------|--|
| 一、营业总收入 | | 106,871,800.86 |
| 1.利息收入 | | 84,594,014.27 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.10 | 8,417,997.52 |
| 债券利息收入 | | 74,255,495.45 |
| 资产支持证券利息收入 | | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 1,920,521.30 |
| 证券出借利息收入 | | - |

| | | |
|---------------------------|------------|---------------|
| 其他利息收入 | | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 20,636,338.83 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.11 | - |
| 基金投资收益 | | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.12 | 20,685,927.59 |
| 资产支持证券投资收 益 | 6.4.7.13 | 159,626.79 |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.14 | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.15 | - |
| 股利收益 | 6.4.7.16 | - |
| 以摊余成本计量的金 融资产终止确认产生的收益 | | -209,215.55 |
| 其他投资收益 | | - |
| 3.公允价值变动收益（损失以 “-”号填列） | 6.4.7.17 | 1,641,447.76 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号 填列） | | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填 列） | 6.4.7.18 | - |
| 减：二、营业总支出 | | 24,515,537.48 |
| 1.管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 8,375,099.05 |
| 2.托管费 | 6.4.10.2.2 | 2,791,699.74 |
| 3.销售服务费 | | - |
| 4.投资顾问费 | | - |
| 5.利息支出 | | 9,238,185.13 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 9,238,185.13 |
| 6.信用减值损失 | 6.4.7.19 | 3,729,890.97 |
| 7.税金及附加 | | 315,006.42 |
| 8.其他费用 | 6.4.7.20 | 65,656.17 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-” 号填列） | | 82,356,263.38 |
| 减：所得税费用 | | - |
| 四、净利润（净亏损以“-” 号填列） | | 82,356,263.38 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - |
| 六、综合收益总额 | | 82,356,263.38 |

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：招商恒鑫 30 个月封闭式债券型证券投资基金

本报告期：2023 年 2 月 22 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| | |
|----|--|
| 项目 | 本期 2023 年 2 月 22 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日 |
|----|--|

| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
|--|------------------|--------|---------------|------------------|
| 一、上期期末净资产（基金净值） | - | - | - | - |
| 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） | 7,925,622,949.55 | - | - | 7,925,622,949.55 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | - | - | 82,356,263.38 | 82,356,263.38 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | 82,356,263.38 | 82,356,263.38 |
| （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） | - | - | - | - |
| 其中：1.基金申购款 | - | - | - | - |
| 2.基金赎回款 | - | - | - | - |
| （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） | 7,925,622,949.55 | - | 82,356,263.38 | 8,007,979,212.93 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

招商恒鑫 30 个月封闭式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》、《招商恒鑫 30 个月封闭式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”)证监许可[2022]3249 号文准予公开募集注册。本基金为契约型封闭式基金，存续期限为 30 个月，即基金合同生效日起至封闭期到期日止。本基金首次设立募集基金份额为 7,925,622,949.55 份，经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(23)第 00052 号验资报告。《招商恒鑫 30 个月封闭式债券型

证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)于 2023 年 2 月 22 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,基金托管人为中信银行股份有限公司(以下简称“中信银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及截至报告期末最新公告的基金招募说明书的有关规定,本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行的债券(包括国债、地方政府债、金融债、央行票据、公司债、企业债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、政府支持机构债、政府支持债券、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、国债期货、现金以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为:本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%,本基金采用摊余成本法估值的债券资产不低于基金净资产的 50%(如因基金资产价格波动等原因导致摊余成本法计量的债券资产被动低于上述比例的,应在 2 个月内调整至符合比例要求),采用交易策略且相应以市价法估值的债券资产不低于基金净资产的 20%。本基金不投资于股票等资产,本基金投资于可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券的比例不超过基金资产总值的 10%。本基金每个交易日日终在扣除国债期货需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金;其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规的相关规定发生变更,基金管理人在履行适当程序后,可对上述资产配置比例进行调整。

本基金业绩比较基准为:中债综合(全价)指数收益率 \times 90%+两年期定期存款利率(税后) \times 10%。

6.4.2 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。

6.4.3 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 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2023 年 2 月 22 日(基金合同生效日)至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本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。本期财务报表的实际编制期间为自 2023 年 2 月 22 日(基金合同生效日)至 2023 年 6 月 30 日止期间。

6.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

6.4.4.3 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。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本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。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金以摊余成本法计量的债券资产，均以实际利率法计算的摊余成本进行估值并评估预期信用损失。

本基金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。本基金以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债的估值原则如下：

(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。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 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。

6.4.4.8 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)。

6.4.4.9 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。

基金持有的付息债券、贴现券及资产支持证券按摊余成本和实际利率计算确定利息收入。

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

债券投资收益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、应收利息(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、应收利息(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。

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。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬和基金托管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。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

1) 本基金的收益分配，每年不得少于一次，年度收益分配比例不得低于本基金年度可供分配利润的百分之九十；

2) 本基金收益分配方式为现金分红；

3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4) 本基金每份基金份额享有同等分配权；

5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不影响基金份额持有人利益的情况下，基金管理人可在不违反法律法规的前提下酌情调整以上基金收益分配原则，此项调整不需要召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在规定媒介公告。

6.4.4.12 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。

6.4.4.13 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。

6.4.4.14 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、债券投资和基金投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

1) 对于基金投资，根据中基协发[2017]3 号《关于发布〈基金中基金估值业务指引(试行)〉的通知》之附件《基金中基金估值业务指引(试行)》的规定在估值日对非上市基金和上市基金进行估值。

2) 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。

3) 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。

4) 对于中国证券投资基金业协会《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》(中基协字[2022]566 号)所规定的固定收益品种,本基金按照相关规定,对以公允价值计量的固定收益品种选取第三方估值基准服务机构提供估值全价进行估值;对以摊余成本计量的固定收益品种用第三方估值基准服务机构提供的预期信用损失减值计量结果。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 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。

6.4.6 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》、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]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、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) 对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖债券的差价收入,债券的利息收入及其他收入,暂不计缴企业所得税。

(3) 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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

| 项目 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 |
|----------------|---------------------|
| 活期存款 | 4,493,059.62 |
| 等于：本金 | 4,489,749.92 |
| 加：应计利息 | 3,309.70 |
| 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 | 4,493,059.62 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 | | | | |
|---------------|---------------------|------------------|------------------|------------------|--------------|
| | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 | |
| 股票 | - | - | - | - | |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - | - | |
| 债券 | 交易所市场 | 1,029,177,830.65 | 15,359,690.97 | 1,045,143,243.57 | 605,721.95 |
| | 银行间市场 | 1,306,757,181.86 | 15,551,960.06 | 1,323,250,460.06 | 941,318.14 |
| | 合计 | 2,335,935,012.51 | 30,911,651.03 | 2,368,393,703.63 | 1,547,040.09 |
| 资产支持证券 | 30,999,192.33 | 107,671.23 | 31,201,271.23 | 94,407.67 | |
| 基金 | - | - | - | - | |
| 其他 | - | - | - | - | |
| 合计 | 2,366,934,204.84 | 31,019,322.26 | 2,399,594,974.86 | 1,641,447.76 | |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末无衍生金融工具。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无各项买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 债权投资**6.4.7.5.1 债权投资情况**

单位：人民币元

| 项目 | | 本期末 2023 年 6 月 30 日 | | | | |
|--------|-------|---------------------|---------------|---------------|--------------|------------------|
| | | 初始成本 | 利息调整 | 应计利息 | 减值准备 | 账面价值 |
| 债券 | 交易所市场 | 2,889,000,000.00 | 148,445.96 | 32,382,275.09 | 1,463,273.11 | 2,920,067,447.94 |
| | 银行间市场 | 5,093,000,000.00 | 23,907,813.68 | 61,165,166.84 | 2,266,617.86 | 5,175,806,362.66 |
| | 小计 | 7,982,000,000.00 | 24,056,259.64 | 93,547,441.93 | 3,729,890.97 | 8,095,873,810.60 |
| 资产支持证券 | | - | - | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - | - | - |
| 合计 | | 7,982,000,000.00 | 24,056,259.64 | 93,547,441.93 | 3,729,890.97 | 8,095,873,810.60 |

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

单位：人民币元

| 减值准备 | 第一阶段 | 第二阶段 | 第三阶段 | 合计 |
|-----------|----------------|----------------------|----------------------|--------------|
| | 未来 12 个月预期信用损失 | 整个存续期预期信用损失(未发生信用减值) | 整个存续期预期信用损失(已发生信用减值) | |
| 期初余额 | - | - | - | - |
| 本期从其他阶段转入 | - | - | - | - |
| 本期转出至其他阶段 | - | - | - | - |
| 本期新增 | 6,036,839.29 | - | - | 6,036,839.29 |
| 本期转回 | 2,306,948.32 | - | - | 2,306,948.32 |
| 其他变动 | - | - | - | - |
| 期末余额 | 3,729,890.97 | - | - | 3,729,890.97 |

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 |
|-------------|---------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | - |
| 应付证券出借违约金 | - |

| | |
|----------|------------|
| 应付交易费用 | 76,280.01 |
| 其中：交易所市场 | - |
| 银行间市场 | 76,280.01 |
| 应付利息 | - |
| 预提费用 | 49,123.64 |
| 合计 | 125,403.65 |

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023 年 2 月 22 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日 | |
|---------------|--|------------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 基金合同生效日 | 7,925,622,949.55 | 7,925,622,949.55 |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回（以“-”号填列） | - | - |
| 基金份额折算变动份额 | - | - |
| 本期末 | 7,925,622,949.55 | 7,925,622,949.55 |

注：1、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。

2、本基金自 2023 年 2 月 2 日至 2023 年 2 月 20 日止期间公开发售，有效净认购金额人民币 7,925,575,798.75 元，折算为 7,925,575,798.75 份基金份额。根据《招商恒鑫 30 个月封闭式债券型证券投资基金基金合同》的规定，经本基金注册登记人计算并确认，本基金认购资金在募集期内产生的利息人民币 47,150.80 元，折算为 47,150.80 份基金份额，划入基金持有人账户，两者合计 7,925,622,949.55 份基金份额。

6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|---------------|--------------|---------------|
| 基金合同生效日 | - | - | - |
| 本期利润 | 80,714,815.62 | 1,641,447.76 | 82,356,263.38 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | - | - | - |
| 其中：基金申购款 | - | - | - |
| 基金赎回款 | - | - | - |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 80,714,815.62 | 1,641,447.76 | 82,356,263.38 |

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023 年 2 月 22 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日 |
|----------|--|
| 活期存款利息收入 | 384,083.97 |

| | |
|-----------|--------------|
| 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 | 8,033,152.71 |
| 其他 | 760.84 |
| 合计 | 8,417,997.52 |

6.4.7.11 股票投资收益

6.4.7.11.1 股票投资收益项目构成

本基金本报告期内无股票投资收益。

6.4.7.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期内无买卖股票差价收入。

6.4.7.11.3 股票投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无股票赎回差价收入。

6.4.7.11.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无股票申购差价收入。

6.4.7.11.5 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内无证券出借差价收入。

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023 年 2 月 22 日（基金合同生效日） 至 2023 年 6 月 30 日 |
|-------------------------------|--|
| 债券投资收益——利息收入 | 20,899,728.98 |
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入 | -213,801.39 |
| 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 | 20,685,927.59 |

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023 年 2 月 22 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|---|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额 | 394,179,953.71 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到 | 385,591,650.83 |

| | |
|-----------|--------------|
| 期兑付) 成本总额 | |
| 减: 应计利息总额 | 8,783,091.77 |
| 减: 交易费用 | 19,012.50 |
| 买卖债券差价收入 | -213,801.39 |

6.4.7.12.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

6.4.7.12.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券申购差价收入。

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

单位: 人民币元

| 项目 | 本期 2023 年 2 月 22 日 (基金合同生效日) 至 2023 年 6 月 30 日 |
|--------------------------|---|
| 资产支持证券投资收益——利息收入 | 159,626.79 |
| 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 | 159,626.79 |

6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内无买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券赎回差价收入。

6.4.7.13.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券申购差价收入。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无买卖贵金属差价收入。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无贵金属赎回差价收入。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无贵金属申购差价收入。

6.4.7.15 衍生工具收益**6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期内无衍生工具买卖权证差价收入。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具其他投资收益。

6.4.7.16 股利收益

本基金本报告期内无股利收益。

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2023 年 2 月 22 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日 |
|------------------------|--|
| 1.交易性金融资产 | 1,641,447.76 |
| ——股票投资 | - |
| ——债券投资 | 1,547,040.09 |
| ——资产支持证券投资 | 94,407.67 |
| ——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 | 1,641,447.76 |

6.4.7.18 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

6.4.7.19 信用减值损失

| 项目 | 本期 2023 年 2 月 22 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日 |
|----------|--|
| 银行存款 | - |
| 买入返售金融资产 | - |
| 债权投资 | 3,729,890.97 |
| 其他债权投资 | - |
| 其他 | - |

| | |
|----|--------------|
| 合计 | 3,729,890.97 |
|----|--------------|

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023 年 2 月 22 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日 |
|---------|--|
| 审计费用 | 49,123.64 |
| 信息披露费 | - |
| 证券出借违约金 | - |
| 银行费用 | 16,132.53 |
| 其他 | 400.00 |
| 合计 | 65,656.17 |

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 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。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|------------------------|----------|
| 招商基金管理有限公司 | 基金管理人 |
| 中信银行股份有限公司 | 基金托管人 |
| 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 |

注：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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2023 年 2 月 22 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日 | |
|-------|--|--------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 |

| | | |
|------|------------------|--------|
| 招商证券 | 2,679,937,950.00 | 78.74% |
|------|------------------|--------|

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2023 年 2 月 22 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日 | |
|-------|--|----------------|
| | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 |
| 招商证券 | 3,793,516,000.00 | 96.26% |

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023 年 2 月 22 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日 |
|-----------------|--|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 8,375,099.05 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 1,227,722.78 |
| 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×0.30%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：

$$\text{日基金管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023 年 2 月 22 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日 |
|----------------|--|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 2,791,699.74 |

注：支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值×0.10%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：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期内无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

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。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2023 年 2 月 22 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日 | |
|---------|--|------------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中信银行-活期 | 4,493,059.62 | 384,083.97 |

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.11 利润分配情况**6.4.11.1 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金**

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2023 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.1 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 |
| - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 6.4.12.1.2 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 |
|--------|----------|-----------------|----------|--------|-------|--------|----------|---------------|---------------|----|
| 148341 | 23 鞍钢 Y3 | 2023 年 6 月 21 日 | 1 个月内(含) | 新债未上市 | 99.99 | 100.07 | 200,000 | 19,998,452.60 | 20,013,926.57 | - |

6.4.12.2 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。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日止, 本基金从事银行间债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币 2,249,787,914.53 元, 是以如下债券作为质押:

金额单位: 人民币元

| 债券代码 | 债券名称 | 回购到期日 | 期末估值单价 | 数量(张) | 期末估值总额 |
|-----------|---------------------|----------------|--------|---------|---------------|
| 102000453 | 20 石国投 MTN001A | 2023 年 7 月 3 日 | 102.20 | 100,000 | 10,220,195.27 |
| 102001315 | 20 晋煤 MTN009 | 2023 年 7 月 3 日 | 107.63 | 100,000 | 10,763,491.72 |
| 102001450 | 20 建发地产 MTN003 | 2023 年 7 月 3 日 | 105.56 | 600,000 | 63,338,499.20 |
| 102101135 | 21 厦国贸控 MTN004 | 2023 年 7 月 3 日 | 101.32 | 400,000 | 40,526,413.54 |
| 102101851 | 21 晋能装备 MTN003 | 2023 年 7 月 3 日 | 105.89 | 100,000 | 10,589,150.68 |
| 102102088 | 21 潞安 MTN003B | 2023 年 7 月 3 日 | 106.53 | 200,000 | 21,305,188.22 |
| 102102183 | 21 晋能电力 MTN011 | 2023 年 7 月 3 日 | 107.36 | 300,000 | 32,206,863.07 |
| 102102264 | 21 河钢集 MTN005(革命老区) | 2023 年 7 月 3 日 | 103.32 | 600,000 | 61,991,178.19 |
| 102103051 | 21 河钢集 MTN006(革命老区) | 2023 年 7 月 3 日 | 102.76 | 600,000 | 61,658,471.46 |
| 102281179 | 22 建发集 MTN002 | 2023 年 7 月 3 日 | 101.24 | 100,000 | 10,124,163.93 |
| 102281307 | 22 首钢 MTN003 | 2023 年 7 月 3 日 | 99.80 | 223,000 | 22,255,605.51 |
| 102281448 | 22 鲁钢铁 MTN002 | 2023 年 7 月 3 日 | 100.56 | 100,000 | 10,055,891.80 |
| 102281589 | 22 陆家嘴 | 2023 年 7 月 | 101.87 | 151,000 | 15,383,012.57 |

| | | | | | |
|-----------|-----------------------------|-------------------|--------|-----------|----------------|
| | MTN001 | 3 日 | | | |
| 102380152 | 23 晋能电力 MTN002 | 2023 年 7 月 3 日 | 101.46 | 1,000,000 | 101,456,196.01 |
| 102380528 | 23 晋能煤业 MTN002A | 2023 年 7 月 3 日 | 100.75 | 1,000,000 | 100,752,783.59 |
| 102381455 | 23 淮河能源 MTN003 | 2023 年 7 月 3 日 | 100.55 | 100,000 | 10,055,442.62 |
| 132280020 | 22 湖南钢铁 GN001 | 2023 年 7 月 3 日 | 100.11 | 379,000 | 37,941,281.32 |
| 132280046 | 22 湖南钢铁 GN002 | 2023 年 7 月 3 日 | 99.38 | 500,000 | 49,690,187.76 |
| 132280048 | 22 融和融资 GN002(碳中和债) | 2023 年 7 月 3 日 | 100.41 | 211,000 | 21,187,476.06 |
| 1928002 | 19 民生银行二级 01 | 2023 年 7 月 3 日 | 102.42 | 1,464,000 | 149,949,712.00 |
| 102280101 | 22 河钢集 MTN001 | 2023 年 7 月 4 日 | 101.74 | 1,200,000 | 122,084,545.09 |
| 102280275 | 22 鞍钢集 MTN001 | 2023 年 7 月 4 日 | 100.65 | 1,053,000 | 105,983,381.96 |
| 102281312 | 22 河钢集 MTN009 | 2023 年 7 月 4 日 | 100.22 | 1,300,000 | 130,292,295.84 |
| 102281709 | 22 晋能煤业 MTN018(科创票 据) | 2023 年 7 月 4 日 | 103.03 | 132,000 | 13,599,340.21 |
| 101900343 | 19 供销 MTN001 | 2023 年 7 月 5 日 | 102.68 | 177,000 | 18,174,857.02 |
| 102000327 | 20 铁建房产 MTN001 | 2023 年 7 月 5 日 | 102.31 | 1,500,000 | 153,469,404.09 |
| 102001002 | 20 陕煤化 MTN002 | 2023 年 7 月 5 日 | 101.12 | 2,000,000 | 202,246,368.58 |
| 102281172 | 22 晋能煤业 MTN008 | 2023 年 7 月 5 日 | 100.96 | 1,000,000 | 100,958,224.43 |
| 102281296 | 22 光大控股 MTN001 | 2023 年 7 月 5 日 | 100.07 | 946,000 | 94,664,023.47 |
| 102281559 | 22 铁建房产 MTN002 | 2023 年 7 月 5 日 | 103.23 | 396,000 | 40,880,870.29 |
| 102281571 | 22 晋能煤业 MTN015(科创票 据) | 2023 年 7 月 5 日 | 103.00 | 38,000 | 3,913,998.91 |
| 102281709 | 22 晋能煤业 MTN018(科创票 据) | 2023 年 7 月 5 日 | 103.03 | 1,068,000 | 110,031,025.38 |
| 1928013 | 19 民生银行永续 债 | 2023 年 7 月 5 日 | 101.61 | 1,100,000 | 111,766,852.46 |

| | | | | | |
|-----------|-----------------------------|-------------------|--------|------------|------------------|
| 102103281 | 21 河钢集 MTN008 | 2023 年 7 月 6 日 | 102.74 | 600,000 | 61,642,044.21 |
| 102281280 | 22 新建元 MTN001 | 2023 年 7 月 6 日 | 100.17 | 202,000 | 20,234,861.00 |
| 102281307 | 22 首钢 MTN003 | 2023 年 7 月 6 日 | 99.80 | 1,377,000 | 137,425,869.01 |
| 102281432 | 22 晋能煤业 MTN014(科创票 据) | 2023 年 7 月 6 日 | 100.63 | 700,000 | 70,438,174.97 |
| 102281571 | 22 晋能煤业 MTN015(科创票 据) | 2023 年 7 月 6 日 | 103.00 | 962,000 | 99,085,972.52 |
| 102380852 | 23 晋能煤业 MTN001A | 2023 年 7 月 6 日 | 101.00 | 370,000 | 37,369,433.88 |
| 合计 | - | - | - | 24,349,000 | 2,475,712,747.84 |

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 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 270,795,530.84 元，在 2023 年 7 月 4 日、2023 年 7 月 10 日、2023 年 7 月 28 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。

6.4.12.4 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。

6.4.13 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、资产支持证券投资等。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。

6.4.13.1 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。

6.4.13.2 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、资产支持证券投资及其他。

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并采用券款对付交割方式，以控制相应的信用风险。

对于与债券投资、资产支持证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。附注 6.4.13.2.1 至 6.4.13.2.6 列示了本基金所持有的债券投资及资产支持证券投资的信用评级，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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 |
|--------|---------------------|
| A-1 | - |
| A-1 以下 | - |
| 未评级 | 121,420,994.40 |
| 合计 | 121,420,994.40 |

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。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 |
|--------|---------------------|
| AAA | 6,681,416,833.04 |
| AAA 以下 | 423,373,455.55 |

| | |
|-----|-------------------|
| 未评级 | 3,290,160,762.57 |
| 合计 | 10,394,951,051.16 |

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。

6.4.13.2.5 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 2023 年 6 月 30 日 |
|--------|---------------------|
| AAA | 31,201,271.23 |
| AAA 以下 | - |
| 未评级 | - |
| 合计 | 31,201,271.23 |

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。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

6.4.13.3.1 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 6.4.12 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(所有者权益)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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及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交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2023 年 6 月 30 日 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|---------------------|-------------------|------------------|----------------|---------------|-------------------|
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 4,493,059.62 | - | - | - | 4,493,059.62 |
| 结算备付金 | 32,183,521.68 | - | - | - | 32,183,521.68 |
| 存出保证金 | 213,532.53 | - | - | - | 213,532.53 |
| 交易性金融资产 | 1,061,127,500.89 | 1,184,830,473.97 | 153,637,000.00 | - | 2,399,594,974.86 |
| 衍生金融资产 | - | - | - | - | - |
| 买入返售金融资产 | - | - | - | - | - |
| 债权投资 | 313,703,836.95 | 7,751,072,479.60 | 31,097,494.05 | - | 8,095,873,810.60 |
| 应收股利 | - | - | - | - | - |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - |
| 应收清算款 | - | - | - | - | - |
| 其他资产 | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 1,411,721,451.67 | 8,935,902,953.57 | 184,734,494.05 | - | 10,532,358,899.29 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 1,971,537.09 | 1,971,537.09 |
| 应付托管费 | - | - | - | 657,179.06 | 657,179.06 |
| 应付清算款 | - | - | - | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | 2,520,583,445.37 | - | - | - | 2,520,583,445.37 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - |
| 应付投资顾问费 | - | - | - | - | - |
| 应付利润 | - | - | - | - | - |
| 应交税费 | - | - | - | 1,042,121.19 | 1,042,121.19 |
| 其他负债 | - | - | - | 125,403.65 | 125,403.65 |
| 负债总计 | 2,520,583,445.37 | - | - | 3,796,240.99 | 2,524,379,686.36 |
| 利率敏感度缺口 | -1,108,861,993.70 | 8,935,902,953.57 | 184,734,494.05 | -3,796,240.99 | 8,007,979,212.93 |

注：上表按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 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（2023 年 6 月 30 日） |
| | 1. 市场利率平行上升 50 个基点 | -81,483,224.80 |
| 2. 市场利率平行下降 50 个基点 | 82,592,534.41 | |

6.4.13.4.2 其他价格风险

其他价格风险是指以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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的债券，其他价格风险对于本基金的基金净值无重大影响。

6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

本基金本报告期末无其他价格风险敞口。

6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末无其他价格风险的敏感性分析。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 |
|---------------|---------------------|
| 第一层次 | - |
| 第二层次 | 2,399,594,974.86 |
| 第三层次 | - |

| | |
|----|------------------|
| 合计 | 2,399,594,974.86 |
|----|------------------|

6.4.14.2 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。

6.4.14.3 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。

6.4.14.4 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。

6.4.15 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。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|-------------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | - | - |
| | 其中：股票 | - | - |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 10,495,468,785.46 | 99.65 |
| | 其中：债券 | 10,464,267,514.23 | 99.35 |
| | 资产支持证券 | 31,201,271.23 | 0.30 |
| 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 | 36,676,581.30 | 0.35 |
| 8 | 其他资产 | 213,532.53 | 0.00 |

| | | | |
|---|----|-------------------|--------|
| 9 | 合计 | 10,532,358,899.29 | 100.00 |
|---|----|-------------------|--------|

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金报告期内无买入股票。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金报告期内无卖出股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金报告期内无股票投资变动。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 公允价值（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 | 162,569,967.21 | 2.03 |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | 3,459,934,592.69 | 43.21 |
| 5 | 企业短期融资券 | 121,420,994.40 | 1.52 |
| 6 | 中期票据 | 6,010,320,444.57 | 75.05 |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | 710,021,515.36 | 8.87 |
| 10 | 合计 | 10,464,267,514.23 | 130.67 |

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 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 | 163260 | 20 海国 02 | 2,900,000 | 297,575,709.52 | 3.72 |
| 2 | 102280275 | 22 鞍钢集 MTN001 | 2,500,000 | 251,622,464.30 | 3.14 |
| 3 | 102281316 | 22 奔驰财务 MTN002BC | 2,500,000 | 250,742,112.30 | 3.13 |
| 4 | 137648 | 22 安信 C3 | 2,100,000 | 213,275,999.88 | 2.66 |
| 5 | 102001002 | 20 陕煤化 MTN002 | 2,000,000 | 202,246,368.58 | 2.53 |

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 证券代码 | 证券名称 | 数量（份） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 199553 | TBI8A1 | 200,000 | 20,153,594.52 | 0.25 |
| 2 | 199495 | 徐租 5 优 2 | 110,000 | 11,047,676.71 | 0.14 |

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

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。

7.11.2 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

报告期内基金投资的前十名证券除 19 民生银行永续债（证券代码 1928013）、22 安信 C3（证券代码 137648）、22 首钢 MTN003（证券代码 102281307）外其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

1、19 民生银行永续债（证券代码 1928013）

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、违规提供担保及财务资助、未依法履行职责等原因，多次受到监管机构的处罚。

2、22 安信 C3（证券代码 137648）

根据 2022 年 7 月 21 日发布的相关公告，该证券发行人因未依法履行职责被四川证监局给予警示。

根据 2023 年 6 月 8 日发布的相关公告，该证券发行人因内部制度不完善被广东证监局给予警示。

根据 2023 年 6 月 14 日发布的相关公告，该证券发行人因未依法履行职责被山东证监局责令改正。

3、22 首钢 MTN003（证券代码 102281307）

根据 2022 年 9 月 15 日发布的相关公告，该证券发行人因违反税收管理规定被国家税务总局长沙市岳麓区税务局责令改正。

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。

7.12.2

根据基金合同规定，本基金的投资范围不包括股票。

7.12.3 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 | 213,532.53 |
| 2 | 应收清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | - |

| | | |
|---|-------|------------|
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 213,532.53 |

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金的固定收益投资采用摊余成本法或市价法进行估值，本报告投资组合报告公允价值和占基金资产净值比例是以各固定收益投资的摊余成本或市值计算所得。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 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 |
| 803 | 9,870,016.13 | 7,923,018,549.28 | 99.97% | 2,604,400.27 | 0.03% |

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 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 | 74,743.61 | 0.0009% |

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目 | 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 | 0~10 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 0 |

§ 9 重大事件揭示

9.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末未召开基金份额持有人大会。

9.2 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 2023 年 6 月 22 日的公告，经招商基金管理有限公司第六届董事会 2023 年第四次会议审议通过，钟文岳先生离任公司常务副总经理、财务负责人职务。

本报告期内，基金托管人中信银行股份有限公司董事会于 2023 年 4 月 17 日收到董事长、非执行董事朱鹤新先生的辞呈。董事会选举本行党委书记、副董事长、董事方合英先生为本行董事长，将自中国银行业监管机构核准其董事长任职资格之日起正式就任。

本报告期内，基金托管人中信银行股份有限公司董事会于 2023 年 4 月 17 日收到本行行长方合英先生的辞呈。董事会聘任本行党委副书记、董事、常务副行长刘成先生为本行行长，将自中国银行业监管机构核准其行长任职资格之日起正式就任。

9.3 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。

9.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

9.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

9.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

9.6.1 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。

9.6.2 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，托管人及其高级管理人员未受到稽查或处罚等情况。

9.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

9.7.1 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 | |
| 渤海证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 川财证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东兴证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国海证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 恒泰证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华龙证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华鑫证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 联储证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 瑞银证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 申万宏源 | 1 | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信建投证券 | 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。

9.7.2 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 |
| 渤海证券 | - | - | - | - | - | - |
| 川财证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东兴证券 | - | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国海证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|------------|------------------|--------|------------------|--------|---|---|
| 恒泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华龙证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华鑫证券 | - | - | - | - | - | - |
| 联储证券 | - | - | - | - | - | - |
| 瑞银证券 | - | - | - | - | - | - |
| 申万宏源 | 723,526,170.00 | 21.26% | 147,534,000.00 | 3.74% | - | - |
| 招商证券 | 2,679,937,950.00 | 78.74% | 3,793,516,000.00 | 96.26% | - | - |
| 中金公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投 证券 | - | - | - | - | - | - |

9.8 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 | 招商恒鑫 30 个月封闭式债券型证券投资基金基金合同 | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2023-01-30 |
| 2 | 招商恒鑫 30 个月封闭式债券型证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告 | 证券时报及基金管理人网站 | 2023-01-30 |
| 3 | 招商基金管理有限公司关于养老金客户通过直销柜台认购旗下招商恒鑫 30 个月封闭式债券型证券投资基金费率优惠的公告 | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2023-01-30 |
| 4 | 招商恒鑫 30 个月封闭式债券型证券投资基金托管协议 | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2023-01-30 |
| 5 | 招商恒鑫 30 个月封闭式债券型证券投资基金招募说明书 | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2023-01-30 |
| 6 | 招商恒鑫 30 个月封闭式债券型证券投资基金产品资料概要 | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2023-01-30 |
| 7 | 招商恒鑫 30 个月封闭式债券型证券投资基金基金份额发售公告 | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2023-01-30 |
| 8 | 关于招商恒鑫 30 个月封闭式债券型证券投资基金提前结束募集的公告 | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2023-02-21 |
| 9 | 招商恒鑫 30 个月封闭式债券型证券投资基金基金合同生效公告 | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2023-02-23 |
| 10 | 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 | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会 | 2023-05-12 |

| | | | |
|----|-------------------------|----------------------------|------------|
| | | 基金电子披露网站 | |
| 11 | 招商基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告 | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2023-06-22 |

§ 10 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恒鑫 30 个月封闭式债券型证券投资基金设立的文件；
- 3、《招商恒鑫 30 个月封闭式债券型证券投资基金基金合同》；
- 4、《招商恒鑫 30 个月封闭式债券型证券投资基金托管协议》；
- 5、《招商恒鑫 30 个月封闭式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。

10.1 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

10.2 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 8 月 30 日