

# 招商招利一年期理财债券型证券投资 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：中国银行股份有限公司

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。

基金托管人中国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 1 月 1 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.....                              | 5  |
| §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.....              | 8  |
| 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.....      | 12 |
| §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.....                                | 16 |
| §7 投资组合报告.....                               | 31 |
| 7.1 期末基金资产组合情况.....                          | 31 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....                    | 31 |
| 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.....       | 32 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                     | 32 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                    | 32 |
| 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.....      | 32 |
| 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.....   | 33 |
| 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.....   | 33 |
| 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.....      | 33 |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....                     | 33 |

|      |                                    |    |
|------|------------------------------------|----|
| 7.11 | 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....          | 33 |
| 7.12 | 投资组合报告附注.....                      | 33 |
| §8   | 基金份额持有人信息.....                     | 36 |
| 8.1  | 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....             | 36 |
| 8.2  | 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....          | 36 |
| 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.....  | 36 |
| §9   | 开放式基金份额变动.....                     | 36 |
| §10  | 重大事件揭示.....                        | 36 |
| 10.1 | 基金份额持有人大会决议.....                   | 37 |
| 10.2 | 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....   | 37 |
| 10.3 | 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....        | 37 |
| 10.4 | 基金投资策略的改变.....                     | 37 |
| 10.5 | 为基金进行审计的会计师事务所情况.....              | 37 |
| 10.6 | 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....      | 37 |
| 10.7 | 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....             | 37 |
| 10.8 | 其他重大事件.....                        | 41 |
| §11  | 影响投资者决策的其他重要信息.....                | 42 |
| 11.1 | 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况..... | 42 |
| §12  | 备查文件目录.....                        | 42 |
| 12.1 | 存放地点.....                          | 43 |
| 12.2 | 查阅方式.....                          | 43 |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                    |
|------------|--------------------|
| 基金名称       | 招商招利一年期理财债券型证券投资基金 |
| 基金简称       | 招商招利一年理财债券         |
| 基金主代码      | 004780             |
| 交易代码       | 004780             |
| 基金运作方式     | 契约型开放式             |
| 基金合同生效日    | 2017 年 8 月 17 日    |
| 基金管理人      | 招商基金管理有限公司         |
| 基金托管人      | 中国银行股份有限公司         |
| 报告期末基金份额总额 | 7,959,118,798.62 份 |
| 基金合同存续期    | 不定期                |

### 2.2 基金产品说明

|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 本基金严格采用持有到期策略，将基金资产配置于到期日（或回售期限）在封闭期结束之前的固定收益资产，力求实现基金资产的持续稳定增值。  |
| 投资策略   | 本基金以封闭期为周期进行投资运作。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。在封闭期内，本基金严格采用持有到期策略构建投资组合，基本保持大类品种配置的比例稳定。本基金资产投资于到期日（或回售期限）在封闭期结束之前的债券类资产、债券回购和银行存款，力求基金资产在开放前可完全变现。 |
| 业绩比较基准 | 每个封闭期同期对应的一年期定期存款利率(税后)*1.1   |
| 风险收益特征 | 本基金是债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。   |

### 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        | 中国银行股份有限公司       |
| 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      | 95566            |
| 传真      | 0755-83196475     | 010-66594942     |
| 注册地址    | 深圳市福田区深南大道 7088 号 | 北京市西城区复兴门内大街 1 号 |
| 办公地址    | 深圳市福田区深南大道 7088 号 | 北京市西城区复兴门内大街 1 号 |
| 邮政编码    | 518040            | 100818           |

|       |     |     |
|-------|-----|-----|
| 法定代表人 | 王小青 | 葛海蛟 |
|-------|-----|-----|

## 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   |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | <a href="http://www.cmfchina.com">http://www.cmfchina.com</a> |
| 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 1 月 1 日 - 2023 年 6 月 30 日) |
| 本期已实现收益       | 61,424,397.42                         |
| 本期利润          | 61,424,397.42                         |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0077                                |
| 本期加权平均净值利润率   | 0.77%                                 |
| 本期基金份额净值增长率   | 0.77%                                 |
| 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      | 956,961,358.88                        |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.1202                                |
| 期末基金资产净值      | 8,043,497,013.96                      |
| 期末基金份额净值      | 1.0106                                |
| 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   | 22.28%                                |

注：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，由于本基金采用摊余成本法核算，所以，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

### 3.2 基金净值表现

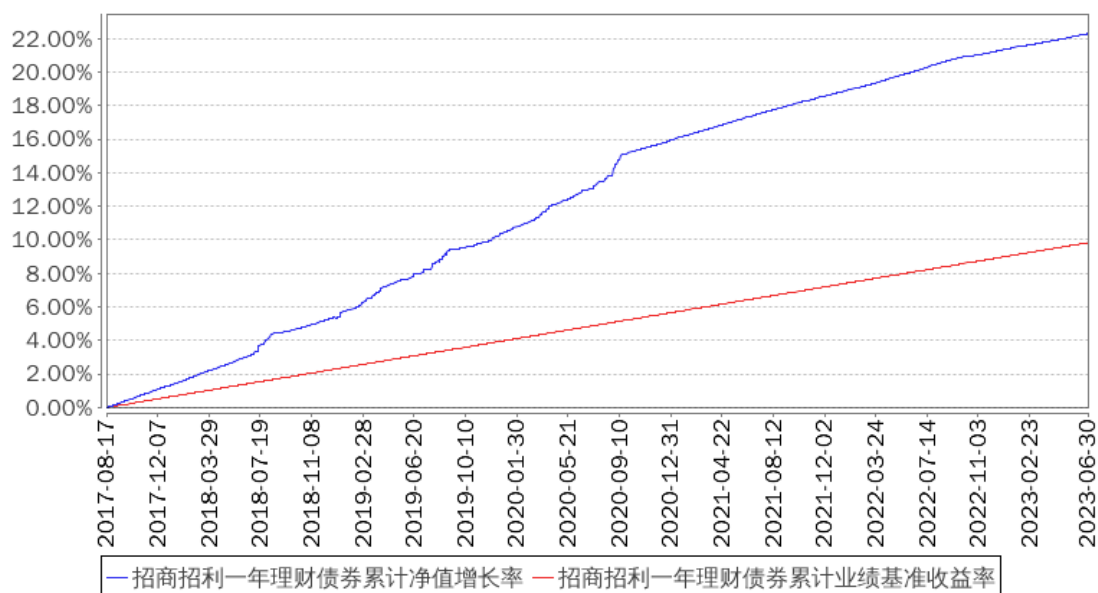
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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 | ①-③ | ②-④ |
|----|----------|-------------|------------|--------------|-----|-----|
|----|----------|-------------|------------|--------------|-----|-----|

|            |        |       |       | ④     |        |       |
|------------|--------|-------|-------|-------|--------|-------|
| 过去一个月      | 0.13%  | 0.01% | 0.14% | 0.01% | -0.01% | 0.00% |
| 过去三个月      | 0.39%  | 0.01% | 0.42% | 0.00% | -0.03% | 0.01% |
| 过去六个月      | 0.77%  | 0.01% | 0.83% | 0.01% | -0.06% | 0.00% |
| 过去一年       | 1.78%  | 0.01% | 1.67% | 0.01% | 0.11%  | 0.00% |
| 过去三年       | 8.25%  | 0.02% | 5.02% | 0.01% | 3.23%  | 0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 22.28% | 0.02% | 9.83% | 0.01% | 12.45% | 0.01% |

### 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

招商招利一年理财债券累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金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，公司注册资本金为人民币 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            |        |  |
| 曹晋文 | 本基金基金经理      | 2023 年 2 月 14 日 | -               | 9      | 男，硕士。曾任中国人寿资产管理有限公司账户助理、信诚人寿保险有限公司投资经理、民生加银基金管理有限公司固定收益部基金经理、格林基金管理有限公司固定收益部基金经理、部门副总监。2020 年 1 月加入招商基金管理有限公司固定收益投资部，现任招商保证金快线货币市场基金、招商理财 7 天债券型证券投资基金、招商招福宝货币市场基金、招商招禧宝货币市场基金、招商招利 1 个月期理财债券型证券投资基金、招商中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、招商招景纯债债券型证券投资基金、招商招利一年期理财债券型证券投资基金基金经理。  |
| 郭敏  | 本基金基金经理（已离任） | 2018 年 12 月 7 日 | 2023 年 2 月 14 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 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 0.77%，同期业绩基准增长率为 0.83%。

#### 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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在招商招利一年期理财债券型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《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有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

### 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，本托管人根据《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，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## § 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：招商招利一年期理财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 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|----------|---------|---------------------|-----------------------|
| 资产：      |         |                     |                       |
| 银行存款     | 6.4.7.1 | 1,272,298.50        | 6,277,010.88          |
| 结算备付金    |         | -                   | -                     |
| 存出保证金    |         | -                   | -                     |
| 交易性金融资产  | 6.4.7.2 | -                   | -                     |
| 其中：股票投资  |         | -                   | -                     |
| 基金投资     |         | -                   | -                     |
| 债券投资     |         | -                   | -                     |
| 资产支持证券投资 |         | -                   | -                     |
| 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 | 10,871,516,241.90   | 10,769,349,669.66     |
| 其中：债券投资  |         | 10,871,516,241.90   | 10,769,349,669.66     |
| 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     |         | 10,872,788,540.40   | 10,775,626,680.54     |
| 负债和净资产   | 附注号     | 本期末 2023 年 6 月 30 日 | 上年度末 2022 年 12 月      |

|           |         | 日                 | 31 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 |         | 2,826,762,253.75  | 2,790,890,456.70  |
| 应付清算款     |         | -                 | -                 |
| 应付赎回款     |         | -                 | -                 |
| 应付管理人报酬   |         | 1,982,057.07      | 2,032,286.05      |
| 应付托管费     |         | 330,342.83        | 338,714.29        |
| 应付销售服务费   |         | -                 | -                 |
| 应付投资顾问费   |         | -                 | -                 |
| 应交税费      |         | -                 | -                 |
| 应付利润      |         | -                 | -                 |
| 递延所得税负债   |         | -                 | -                 |
| 其他负债      | 6.4.7.7 | 216,872.79        | 292,606.96        |
| 负债合计      |         | 2,829,291,526.44  | 2,793,554,064.00  |
| 净资产：      |         |                   |                   |
| 实收基金      | 6.4.7.8 | 7,086,535,655.08  | 7,086,535,655.08  |
| 其他综合收益    |         | -                 | -                 |
| 未分配利润     | 6.4.7.9 | 956,961,358.88    | 895,536,961.46    |
| 净资产合计     |         | 8,043,497,013.96  | 7,982,072,616.54  |
| 负债和净资产总计  |         | 10,872,788,540.40 | 10,775,626,680.54 |

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0106 元，基金份额总额 7,959,118,798.62 份。

## 6.2 利润表

会计主体：招商招利一年期理财债券型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目         | 附注号      | 本期 2023 年 1 月 1 日至<br>2023 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2022 年<br>1 月 1 日至 2022 年 6 月<br>30 日 |
|------------|----------|---------------------------------------|---|
| 一、营业总收入    |          | 102,012,015.32                        | 205,646,839.37                                |
| 1.利息收入     |          | 102,012,015.32                        | 205,646,839.37                                |
| 其中：存款利息收入  | 6.4.7.10 | 3,630.32                              | 1,265,603.65                                  |
| 债券利息收入     |          | 102,008,385.00                        | 204,373,510.51                                |
| 资产支持证券利息收入 |          | -                                     | -   |
| 买入返售金融资产收入 |          | -                                     | 7,725.21                                      |

|                               |            |               |                |
|-------------------------------|------------|---------------|----------------|
| 证券出借利息收入                      |            | -             | -              |
| 其他利息收入                        |            | -             | -              |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）              |            | -             | -              |
| 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   | -             | -              |
| 资产支持证券投资<br>收益                | 6.4.7.13   | -             | -              |
| 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<br>金融资产终止确认产生的<br>收益 |            | -             | -              |
| 其他投资收益                        |            | -             | -              |
| 3.公允价值变动收益（损<br>失以“-”号填列）     | 6.4.7.17   | -             | -              |
| 4.汇兑收益（损失以“-”<br>号填列）         |            | -             | -              |
| 5.其他收入（损失以“-”<br>号填列）         | 6.4.7.18   | -             | -              |
| 减：二、营业总支出                     |            | 40,587,617.90 | 63,447,305.09  |
| 1.管理人报酬                       | 6.4.10.2.1 | 11,919,829.11 | 18,278,318.14  |
| 2.托管费                         | 6.4.10.2.2 | 1,986,638.13  | 3,046,386.33   |
| 3.销售服务费                       |            | -             | -              |
| 4.投资顾问费                       |            | -             | -              |
| 5.利息支出                        |            | 26,707,672.07 | 42,309,236.14  |
| 其中：卖出回购金融资产<br>支出             |            | 26,707,672.07 | 42,309,236.14  |
| 6.信用减值损失                      | 6.4.7.19   | -158,187.24   | -332,310.64    |
| 7.税金及附加                       |            | -             | -              |
| 8.其他费用                        | 6.4.7.20   | 131,665.83    | 145,675.12     |
| 三、利润总额（亏损总额<br>以“-”号填列）       |            | 61,424,397.42 | 142,199,534.28 |
| 减：所得税费用                       |            | -             | -              |
| 四、净利润（净亏损以“-”<br>号填列）         |            | 61,424,397.42 | 142,199,534.28 |
| 五、其他综合收益的税后<br>净额             |            | -             | -              |
| 六、综合收益总额                      |            | 61,424,397.42 | 142,199,534.28 |

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：招商招利一年期理财债券型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                       | 本期 2023 年 1 月 1 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）                          | 7,086,535,655.08                        | -      | 895,536,961.46   | 7,982,072,616.54  |
| 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）                          | 7,086,535,655.08                        | -      | 895,536,961.46   | 7,982,072,616.54  |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | -                                       | -      | 61,424,397.42    | 61,424,397.42     |
| （一）、综合收益总额                               | -                                       | -      | 61,424,397.42    | 61,424,397.42     |
| （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）                          | 7,086,535,655.08                        | -      | 956,961,358.88   | 8,043,497,013.96  |
| 项目                                       | 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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）                          | 10,697,314,769.41                       | -      | 1,521,303,508.79 | 12,218,618,278.20 |
| 加：会计政策变更                                 | -                                       | -      | -451,571.91      | -451,571.91       |
| 前期差错更正                                   | -                                       | -      | -                | -                 |
| 其他                                       | -                                       | -      | -                | -                 |
| 二、本期期初净资产（基金净值）                          | 10,697,314,769.41                       | -      | 1,520,851,936.88 | 12,218,166,706.29 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | -                                       | -      | 142,199,534.28   | 142,199,534.28    |
| （一）、综合收益总额                               | -                                       | -      | 142,199,534.28   | 142,199,534.28    |
| （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）                          | 10,697,314,769.41 | - | 1,663,051,471.16 | 12,360,366,240.57 |

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

招商招利一年期理财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》、《招商招利一年期理财债券型证券投资基金基金合同》(以下简称“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[2014]930号文准予公开募集注册。本基金为契约型定期开放式基金,存续期限为不定期。本基金首次设立募集基金份额为2,338,592,831.06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(17)第00147号验资报告。基金合同于2017年8月17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,基金托管人为中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”)。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《招商招利一年期理财债券型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行的债券、货币市场工具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。本基金投资于固定收益类金融工具,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、中小企业私募债、资产支持证券、分离交易可转债纯债、债券回购、银行存款等。本基金投资于到期日(或回售期限)在封闭期结束之前的债券类资产、债券回购、银行存款。本基金不进行股票等权益类资产的投资,也不投资可转换债券,但可以投资分离交易可转债上市后分离出来的债券。本基金对债券的投资比例不低于基金资产的80%,但在每个封闭期运作满3个月内、每个封闭期届满前1个月及每个开放期内,基金投

资不受上述比例限制。本基金的业绩比较基准为：每个封闭期同期对应的一年期定期存款利率（税后） $\times 1.1$ 。

#### 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 1 月 1 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

本报告期所采用的会计政策，会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 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

根据财政部、国家税务总局财税[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]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]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; 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, 暂不缴纳企业所得税。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位: 人民币元

| 项目              | 本期末 2023 年 6 月 30 日 |
|-----------------|---------------------|
| 活期存款            | 1,272,298.50        |
| 等于: 本金          | 1,272,179.46        |
| 加: 应计利息         | 119.04              |
| 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              | 1,272,298.50        |

### 6.4.7.2 交易性金融资产

本基金本报告期末无交易性金融资产。

### 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 | -                   | -              | -              | -          | -                 |
|        | 银行间市场 | 10,760,000,000.00   | -14,330,237.18 | 125,950,340.82 | 103,861.74 | 10,871,516,241.90 |
|        | 小计    | 10,760,000,000.00   | -14,330,237.18 | 125,950,340.82 | 103,861.74 | 10,871,516,241.90 |
| 资产支持证券 |       | -                   | -              | -              | -          | -                 |
| 其他     |       | -                   | -              | -              | -          | -                 |
| 合计     |       | 10,760,000,000.00   | -14,330,237.18 | 125,950,340.82 | 103,861.74 | 10,871,516,241.90 |

### 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      | 262,048.98     | -                    | -                    | 262,048.98 |
| 本期从其他阶段转入 | -              | -                    | -                    | -          |
| 本期转出至其他阶段 | -              | -                    | -                    | -          |
| 本期新增      | 13,323.05      | -                    | -                    | 13,323.05  |
| 本期转回      | 171,510.29     | -                    | -                    | 171,510.29 |
| 其他变动      | -              | -                    | -                    | -          |
| 期末余额      | 103,861.74     | -                    | -                    | 103,861.74 |

### 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      | 107,365.42          |
| 其中：交易所市场    | -                   |
| 银行间市场       | 107,365.42          |
| 应付利息        | -                   |
| 预提费用        | 109,507.37          |

|    |            |
|----|------------|
| 合计 | 216,872.79 |
|----|------------|

#### 6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |                  |
|---------------|------------------------------------|------------------|
|               | 基金份额（份）                            | 账面金额             |
| 上年度末          | 7,959,118,798.62                   | 7,086,535,655.08 |
| 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           | 7,959,118,798.62                   | 7,086,535,655.08 |

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。

#### 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        |
|----------------|----------------|-------|----------------|
| 上年度末           | 895,536,961.46 | -     | 895,536,961.46 |
| 本期利润           | 61,424,397.42  | -     | 61,424,397.42  |
| 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            | 956,961,358.88 | -     | 956,961,358.88 |

#### 6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|-----------|------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 3,630.32                           |
| 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 | -                                  |
| 其他        | -                                  |
| 合计        | 3,630.32                           |

#### 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**

本基金本报告期内无债券投资收益。

##### **6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

本基金本报告期内无买卖债券差价收入。

##### **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**

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

##### **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**

本基金本报告期内无公允价值变动收益。

**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 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|----------|------------------------------------|
| 银行存款     | -                                  |
| 买入返售金融资产 | -                                  |
| 债权投资     | -158,187.24                        |
| 其他债权投资   | -                                  |
| 其他       | -                                  |
| 合计       | -158,187.24                        |

**6.4.7.20 其他费用**

单位：人民币元

| 项目      | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|---------|------------------------------------|
| 审计费用    | 50,000.00                          |
| 信息披露费   | 59,507.37                          |
| 证券出借违约金 | -                                  |

|      |            |
|------|------------|
| 银行费用 | 3,558.46   |
| 其他   | 18,600.00  |
| 合计   | 131,665.83 |

#### 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    |
| 中国银行股份有限公司             | 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 |

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

本基金本报告期内及上年度可比期间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

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债券交易。

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

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债券回购交易。

###### 6.4.10.1.4 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。

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间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 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|-----------------|------------------------------------|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 11,919,829.11                      | 18,278,318.14                           |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 1,889,105.35                       | 4,749,320.82                            |
| 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 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------------------|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,986,638.13                       | 3,046,386.33                            |

注：支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值×0.05%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：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

**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。

**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**

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

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

本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。

**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。

**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**

份额单位：份

| 关联方名称      | 本期末 2023 年 6 月 30 日 |                  | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |                  |
|------------|---------------------|------------------|-----------------------|------------------|
|            | 持有的基金份额             | 持有的基金份额占基金总份额的比例 | 持有的基金份额               | 持有的基金份额占基金总份额的比例 |
| 招商银行股份有限公司 | 745,829,196.96      | 9.37%            | 745,829,196.96        | 9.37%            |

注：表格中的比例为四舍五入的结果。

**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 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |          | 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |          |
|---------|------------------------------------|----------|---|----------|
|         | 期末余额                               | 当期利息收入   | 期末余额                                    | 当期利息收入   |
| 中国银行-活期 | 1,272,298.50                       | 3,630.32 | 1,501,023,867.85                        | 6,145.92 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国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**

本基金本报告期内及上年度可比期间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**

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

**6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

本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 2,826,762,253.75 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           |
|--------|----------|----------------|--------|------------|------------------|
| 220216 | 22 国开 16 | 2023 年 7 月 3 日 | 100.90 | 10,639,000 | 1,073,495,207.79 |
| 220408 | 22 农发 08 | 2023 年 7 月 3 日 | 101.33 | 19,427,000 | 1,968,553,881.83 |
| 合计     | -        | -              | -      | 30,066,000 | 3,042,049,089.62 |

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

#### 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、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。

#### 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

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度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

本基金本报告期末及上年度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 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|--------|---------------------|-----------------------|
| AAA    | 328,124,733.25      | 326,108,562.70        |
| AAA 以下 | -                   | -                     |
| 未评级    | -                   | -                     |
| 合计     | 328,124,733.25      | 326,108,562.70        |

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

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|--------|---------------------|-----------------------|
| AAA    | 1,500,057,460.64    | 1,484,648,553.88      |
| AAA 以下 | -                   | -                     |
| 未评级    | -                   | -                     |
| 合计     | 1,500,057,460.64    | 1,484,648,553.88      |

注：同业存单投资评级以其主体评级进行列示。

### 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所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                | 1,272,298.50      | -     | -     | -   | 1,272,298.50      |
| 结算备付金               | -                 | -     | -     | -   | -                 |
| 存出保证金               | -                 | -     | -     | -   | -                 |
| 交易性金融资产             | -                 | -     | -     | -   | -                 |
| 衍生金融资产              | -                 | -     | -     | -   | -                 |
| 买入返售金融资产            | -                 | -     | -     | -   | -                 |
| 债权投资                | 10,871,516,241.90 | -     | -     | -   | 10,871,516,241.90 |
| 应收股利                | -                 | -     | -     | -   | -                 |
| 应收申购款               | -                 | -     | -     | -   | -                 |
| 应收清算款               | -                 | -     | -     | -   | -                 |
| 其他资产                | -                 | -     | -     | -   | -                 |

|                       |                   |       |       |               |                   |
|-----------------------|-------------------|-------|-------|---------------|-------------------|
| 资产总计                  | 10,872,788,540.40 | -     | -     | -             | 10,872,788,540.40 |
| 负债                    |                   |       |       |               |                   |
| 应付赎回款                 | -                 | -     | -     | -             | -                 |
| 应付管理人报酬               | -                 | -     | -     | 1,982,057.07  | 1,982,057.07      |
| 应付托管费                 | -                 | -     | -     | 330,342.83    | 330,342.83        |
| 应付清算款                 | -                 | -     | -     | -             | -                 |
| 卖出回购金融资产款             | 2,826,762,253.75  | -     | -     | -             | 2,826,762,253.75  |
| 应付销售服务费               | -                 | -     | -     | -             | -                 |
| 应付投资顾问费               | -                 | -     | -     | -             | -                 |
| 应付利润                  | -                 | -     | -     | -             | -                 |
| 应交税费                  | -                 | -     | -     | -             | -                 |
| 其他负债                  | -                 | -     | -     | 216,872.79    | 216,872.79        |
| 负债总计                  | 2,826,762,253.75  | -     | -     | 2,529,272.69  | 2,829,291,526.44  |
| 利率敏感度缺口               | 8,046,026,286.65  | -     | -     | -2,529,272.69 | 8,043,497,013.96  |
| 上年度末 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                  | 6,277,010.88      | -     | -     | -             | 6,277,010.88      |
| 结算备付金                 | -                 | -     | -     | -             | -                 |
| 存出保证金                 | -                 | -     | -     | -             | -                 |
| 交易性金融资产               | -                 | -     | -     | -             | -                 |
| 衍生金融资产                | -                 | -     | -     | -             | -                 |
| 买入返售金融资产              | -                 | -     | -     | -             | -                 |
| 债权投资                  | 10,769,349,669.66 | -     | -     | -             | 10,769,349,669.66 |
| 应收股利                  | -                 | -     | -     | -             | -                 |
| 应收申购款                 | -                 | -     | -     | -             | -                 |
| 应收清算款                 | -                 | -     | -     | -             | -                 |
| 其他资产                  | -                 | -     | -     | -             | -                 |
| 资产总计                  | 10,775,626,680.54 | -     | -     | -             | 10,775,626,680.54 |
| 负债                    |                   |       |       |               |                   |
| 应付赎回款                 | -                 | -     | -     | -             | -                 |
| 应付管理人报酬               | -                 | -     | -     | 2,032,286.05  | 2,032,286.05      |
| 应付托管费                 | -                 | -     | -     | 338,714.29    | 338,714.29        |
| 应付清算款                 | -                 | -     | -     | -             | -                 |
| 卖出回购金融资产款             | 2,790,890,456.70  | -     | -     | -             | 2,790,890,456.70  |
| 应付销售服务费               | -                 | -     | -     | -             | -                 |
| 应付投资顾问费               | -                 | -     | -     | -             | -                 |
| 应付利润                  | -                 | -     | -     | -             | -                 |
| 应交税费                  | -                 | -     | -     | -             | -                 |
| 其他负债                  | -                 | -     | -     | 292,606.96    | 292,606.96        |

|         |                  |   |   |               |                  |
|---------|------------------|---|---|---------------|------------------|
| 负债总计    | 2,790,890,456.70 | - | - | 2,663,607.30  | 2,793,554,064.00 |
| 利率敏感度缺口 | 7,984,736,223.84 | - | - | -2,663,607.30 | 7,982,072,616.54 |

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。

#### 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）        | 上年度末（2022 年 12 月 31 日） |
|                    | 1. 市场利率平行上升 50 个基点    | -12,768,723.44              | -38,868,637.87         |
| 2. 市场利率平行下降 50 个基点 | 12,801,262.67         | 39,153,747.40               |                        |

#### 6.4.13.4.2 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并以摊余成本法估值，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

本基金本报告期末及上年度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

本基金未持有持续的以公允价值计量的金融工具。

###### 6.4.14.2.2 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。

#### 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            | 10,871,516,241.90 | 99.99        |
|    | 其中：债券             | 10,871,516,241.90 | 99.99        |
|    | 资产支持证券            | -                 | -            |
| 4  | 贵金属投资             | -                 | -            |
| 5  | 金融衍生品投资           | -                 | -            |
| 6  | 买入返售金融资产          | -                 | -            |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -                 | -            |
| 7  | 银行存款和结算备付金合计      | 1,272,298.50      | 0.01         |
| 8  | 其他资产              | -                 | -            |
| 9  | 合计                | 10,872,788,540.40 | 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

本基金报告期内无买卖股票。

### 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      | 9,371,458,781.26  | 116.51       |
|    | 其中：政策性金融债 | 9,043,334,048.01  | 112.43       |
| 4  | 企业债券      | -                 | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | -                 | -            |
| 6  | 中期票据      | -                 | -            |
| 7  | 可转债（可交换债） | -                 | -            |
| 8  | 同业存单      | 1,500,057,460.64  | 18.65        |
| 9  | 其他        | -                 | -            |
| 10 | 合计        | 10,871,516,241.90 | 135.16       |

### 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 | 220408    | 22 农发 08      | 61,000,000 | 6,181,180,150.92 | 76.85 |
| 2 | 220216    | 22 国开 16      | 23,300,000 | 2,351,014,037.17 | 29.23 |
| 3 | 210322    | 21 进出 22      | 4,300,000  | 439,038,578.42   | 5.46  |
| 4 | 112289379 | 22 宁波银行 CD300 | 3,700,000  | 367,585,513.57   | 4.57  |
| 5 | 112289388 | 22 杭州银行 CD283 | 3,700,000  | 367,585,513.57   | 4.57  |
| 6 | 112212152 | 22 北京银行 CD152 | 2,500,000  | 248,362,086.22   | 3.09  |

## 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 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

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

### 7.11.2 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。

## 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 20 工商银行双创债（证券代码 2028036）、20 兴业银行小微债 05（证券代码 2028030）、21 进出 22（证券代码 210322）、22 北京银行 CD152（证券代码 112212152）、22 国开 16（证券代码 220216）、22 杭州银行 CD283（证券代码 112289388）、22 杭州银行 CD284（证券代码 112289504）、22 杭州银行 CD285（证券代码 112289618）、22 宁波银行 CD300（证券代码 112289379）、22 农发 08（证券代码 220408）

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 工商银行双创债（证券代码 2028036）

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。

2、20 兴业银行小微债 05（证券代码 2028030）

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

3、21 进出 22（证券代码 210322）

根据 2022 年 9 月 1 日发布的相关公告，该证券发行人因违规经营被山东省青岛市市南区市场监管局责令改正。

根据 2022 年 9 月 19 日发布的相关公告，该证券发行人因未依法履行职责被福建银保监局处以罚款。

根据 2023 年 4 月 11 日发布的相关公告，该证券发行人因未依法履行职责被广西银保监局处以罚款。

根据 2023 年 5 月 5 日发布的相关公告，该证券发行人因涉嫌违反法律法规被国家外汇管理局海南省分局处以罚款、警告，并责令改正。

根据 2023 年 5 月 9 日发布的相关公告，该证券发行人因涉嫌违反法律法规被中国银行间市场交易商协会立案调查。

4、22 北京银行 CD152（证券代码 112212152）

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。

5、22 国开 16（证券代码 220216）

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。

6、22 杭州银行 CD283（证券代码 112289388）

根据 2022 年 7 月 8 日发布的相关公告，该证券发行人因未依法履行职责被浙江省绍兴市上虞区综合行政执法局处以罚款。

根据 2022 年 8 月 5 日发布的相关公告，该证券发行人因未依法履行职责被深圳银保监局处以罚款。

根据 2022 年 11 月 4 日发布的相关公告，该证券发行人因未依法履行职责被安徽银保监局处以罚款，并没收违法所得。

7、22 杭州银行 CD284（证券代码 112289504）

根据 2022 年 7 月 8 日发布的相关公告，该证券发行人因未依法履行职责被浙江省绍兴市上虞区综合行政执法局处以罚款。

根据 2022 年 8 月 5 日发布的相关公告，该证券发行人因未依法履行职责被深圳银保监局处以罚款。

根据 2022 年 11 月 4 日发布的相关公告，该证券发行人因未依法履行职责被安徽银保监局处以罚款, 并没收违法所得。

8、22 杭州银行 CD285（证券代码 112289618）

根据 2022 年 7 月 8 日发布的相关公告，该证券发行人因未依法履行职责被浙江省绍兴市上虞区综合行政执法局处以罚款。

根据 2022 年 8 月 5 日发布的相关公告，该证券发行人因未依法履行职责被深圳银保监局处以罚款。

根据 2022 年 11 月 4 日发布的相关公告，该证券发行人因未依法履行职责被安徽银保监局处以罚款, 并没收违法所得。

9、22 宁波银行 CD300（证券代码 112289379）

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

10、22 农发 08（证券代码 220408）

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、违规提供担保及财务资助、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。

## 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

本基金本报告期末未持有其他资产。

## 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<br>(户) | 户均持有的基<br>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 |
| 3,140        | 2,534,751.21  | 7,904,315,085.6<br>9 | 99.31% | 54,803,712.93 | 0.69%  |

### 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 | 18.42     | 0.0000%  |

### 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                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 0                 |

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                            |                  |
|----------------------------|------------------|
| 基金合同生效日(2017年8月17日)基金份额总额  | 2,338,592,831.06 |
| 本报告期期初基金份额总额               | 7,959,118,798.62 |
| 本报告期基金总申购份额                | -                |
| 减：报告期基金总赎回份额               | -                |
| 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               | 7,959,118,798.62 |

## § 10 重大事件揭示

## 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期未召开基金份额持有人大会。

## 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

## 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期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。

## 10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

## 10.5 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。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 10.6.1 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。

### 10.6.2 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，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 |              | 应支付该券商的佣金 |            | 备注 |
|------|--------|------|--------------|-----------|------------|----|
|      |        | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金        | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 安信证券 | 6      | -    | -            | -         | -          | -  |

|      |   |   |   |   |   |   |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 财通证券 | 3 | - | - | - | - | - |
| 长城证券 | 3 | - | - | - | - | - |
| 长江证券 | 6 | - | - | - | - | - |
| 诚通证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 大通证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 德邦证券 | 4 | - | - | - | - | - |
| 第一创业 | 3 | - | - | - | - | - |
| 东北证券 | 3 | - | - | - | - | - |
| 东方财富 | 3 | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | 3 | - | - | - | - | - |
| 东海证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 东吴证券 | 6 | - | - | - | - | - |
| 东兴证券 | 3 | - | - | - | - | - |
| 方正证券 | 7 | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | 3 | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | 7 | - | - | - | - | - |
| 国海证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国联证券 | 4 | - | - | - | - | - |
| 国盛证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 | 3 | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | 3 | - | - | - | - | - |
| 国元证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | 4 | - | - | - | - | - |
| 宏信证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 华安证券 | 5 | - | - | - | - | - |
| 华宝证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 华创证券 | 4 | - | - | - | - | - |
| 华金证券 | 4 | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | 4 | - | - | - | - | - |
| 华西证券 | 3 | - | - | - | - | - |
| 华鑫证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 江海证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 金元证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 九州证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 开源证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 民生证券 | 5 | - | - | - | - | - |
| 南京证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 平安证券 | 3 | - | - | - | - | - |
| 瑞信方正 | 2 | - | - | - | - | - |
| 山西证券 | 6 | - | - | - | - | - |
| 上海证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 申港证券 | 2 | - | - | - | - | - |

|        |   |   |   |   |   |   |
|--------|---|---|---|---|---|---|
| 申万宏源   | 2 | - | - | - | - | - |
| 世纪证券   | 1 | - | - | - | - | - |
| 首创证券   | 2 | - | - | - | - | - |
| 太平洋证券  | 2 | - | - | - | - | - |
| 天风证券   | 7 | - | - | - | - | - |
| 万和证券   | 1 | - | - | - | - | - |
| 五矿证券   | 2 | - | - | - | - | - |
| 西部证券   | 1 | - | - | - | - | - |
| 湘财证券   | 2 | - | - | - | - | - |
| 信达证券   | 5 | - | - | - | - | - |
| 兴业证券   | 2 | - | - | - | - | - |
| 银河证券   | 1 | - | - | - | - | - |
| 英大证券   | 1 | - | - | - | - | - |
| 粤开证券   | 1 | - | - | - | - | - |
| 招商证券   | 5 | - | - | - | - | - |
| 浙商证券   | 2 | - | - | - | - | - |
| 中航证券   | 2 | - | - | - | - | - |
| 中金财富证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中金公司   | 3 | - | - | - | - | - |
| 中泰证券   | 3 | - | - | - | - | - |
| 中信建投证券 | 5 | - | - | - | - | - |
| 中信证券   | 6 | - | - | - | - | - |
| 中银国际证券 | 4 | - | - | - | - | - |
| 甬兴证券   | 2 | - | - | - | - | - |

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。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 |              | 债券回购交易 |                | 权证交易 |              |
|------|------|--------------|--------|----------------|------|--------------|
|      | 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 |
| 安信证券 | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 财通证券 | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 长城证券 | -    | -            | -      | -              | -    | -            |



|      |   |   |   |   |   |   |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 长江证券 | - | - | - | - | - | - |
| 诚通证券 | - | - | - | - | - | - |
| 大通证券 | - | - | - | - | - | - |
| 德邦证券 | - | - | - | - | - | - |
| 第一创业 | - | - | - | - | - | - |
| 东北证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东方财富 | - | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东海证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东吴证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东兴证券 | - | - | - | - | - | - |
| 方正证券 | - | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | - | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国海证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国联证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国盛证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国元证券 | - | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | - | - | - | - | - | - |
| 宏信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华安证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华宝证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华创证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华金证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华西证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华鑫证券 | - | - | - | - | - | - |
| 江海证券 | - | - | - | - | - | - |
| 金元证券 | - | - | - | - | - | - |
| 九州证券 | - | - | - | - | - | - |
| 开源证券 | - | - | - | - | - | - |
| 民生证券 | - | - | - | - | - | - |
| 南京证券 | - | - | - | - | - | - |
| 平安证券 | - | - | - | - | - | - |
| 瑞信方正 | - | - | - | - | - | - |
| 山西证券 | - | - | - | - | - | - |
| 上海证券 | - | - | - | - | - | - |
| 申港证券 | - | - | - | - | - | - |
| 申万宏源 | - | - | - | - | - | - |
| 世纪证券 | - | - | - | - | - | - |

|        |   |   |   |   |   |   |
|--------|---|---|---|---|---|---|
| 首创证券   | - | - | - | - | - | - |
| 太平洋证券  | - | - | - | - | - | - |
| 天风证券   | - | - | - | - | - | - |
| 万和证券   | - | - | - | - | - | - |
| 五矿证券   | - | - | - | - | - | - |
| 西部证券   | - | - | - | - | - | - |
| 湘财证券   | - | - | - | - | - | - |
| 信达证券   | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证券   | - | - | - | - | - | - |
| 银河证券   | - | - | - | - | - | - |
| 英大证券   | - | - | - | - | - | - |
| 粤开证券   | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券   | - | - | - | - | - | - |
| 浙商证券   | - | - | - | - | - | - |
| 中航证券   | - | - | - | - | - | - |
| 中金财富证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中金公司   | - | - | - | - | - | - |
| 中泰证券   | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券   | - | - | - | - | - | - |
| 中银国际证券 | - | - | - | - | - | - |
| 甬兴证券   | - | - | - | - | - | - |

## 10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项                                 | 法定披露方式                      | 法定披露日期     |
|----|--------------------------------------|-----------------------------|------------|
| 1  | 招商招利一年期理财债券型证券投资基金 2022 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 | 2023-01-18 |
| 2  | 招商基金管理有限公司旗下基金 2022 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               | 2023-01-18 |
| 3  | 关于招商招利一年期理财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基金电子披露网站 | 2023-02-14 |
| 4  | 招商招利一年期理财债券型证券投资基金更新的招募说明书（二零二三年第一号） | 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 | 2023-02-17 |
| 5  | 招商招利一年期理财债券型证券投资基金基金                 | 上海证券报、基金管                   | 2023-02-17 |

|    |                                    |                             |            |
|----|------------------------------------|-----------------------------|------------|
|    | 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          |            |
| 6  | 招商招利一年期理财债券型证券投资基金 2022 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 | 2023-03-30 |
| 7  | 招商基金管理有限公司旗下基金 2022 年年度报告提示性公告     | 上海证券报及基金管理人网站               | 2023-03-30 |
| 8  | 招商基金管理有限公司旗下基金 2023 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               | 2023-04-21 |
| 9  | 招商招利一年期理财债券型证券投资基金 2023 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 | 2023-04-21 |
| 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     | 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 | 2023-05-12 |
| 11 | 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 | 2023-06-22 |

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 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              | 20230101-20230630        | 2,440,288,927.20 | -    | -    | 2,440,288,927.20 | 30.66% |
| 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。

## § 12 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招利一年期理财债券型证券投资基金设立的文件；

3、《招商招利一年期理财债券型证券投资基金基金合同》；

4、《招商招利一年期理财债券型证券投资基金托管协议》；

5、《招商招利一年期理财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。

## 12.1 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

## 12.2 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