

# 招商安心收益债券型证券投资基金

## 2022 年第 2 季度报告

2022 年 06 月 30 日

基金管理人：招商基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2022 年 7 月 20 日

## § 1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 7 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

|            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
|------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称       | 招商安心收益债券                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
| 基金主代码      | 217011                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 交易代码       | 217011                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 基金合同生效日    | 2008 年 10 月 22 日                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
| 报告期末基金份额总额 | 6,803,475,473.89 份                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 投资目标       | 在严格控制投资风险的基础上，追求稳定的当期收益和基金资产的稳健增值。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 投资策略       | <p>（一）资产配置：本基金对债券等固定收益类品种的投资比例不低于 80%（其中，企业债投资比例为 0-40%，可转债投资比例为 0-40%），股票等权益类品种的投资比例不高于 20%，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于 5%。</p> <p>（二）组合构建：本基金在货币市场工具投资方面，将采用稳健的投资组合策略，通过对短期金融工具的组合操作，在保持资产流动性的同时，追求稳定的投资收益；在债券（不含可转债）投资方面，将采取积极主动的投资策略，以中长期利率趋势分析为基础，结合中长期的经济周期、宏观政策方向及收益率曲线分析，实施积极的债券投资组合管理，以获取较高的债券组合投资收益。在可转债投资方面，主要采用可转债相对价值分析策略；在参与股票一级市场和新股增发投资方面，将在深入研究的基础上，发掘新股内在价值，发挥本基金作为机构投资者在新股询价发行过程中的对新股定价</p> |

|                 |                                                                |                    |
|-----------------|----------------------------------------------------------------|--------------------|
|                 | 所起的积极作用，积极参与新股的申购、询价，以获取较好收益。                                  |                    |
| 业绩比较基准          | 中债综合全价(总值)指数收益率                                                |                    |
| 风险收益特征          | 本基金为主动管理的债券型基金，在证券投资基金中属于中低风险品种，其预期风险收益水平低于股票基金及混合基金，高于货币市场基金。 |                    |
| 基金管理人           | 招商基金管理有限公司                                                     |                    |
| 基金托管人           | 中国工商银行股份有限公司                                                   |                    |
| 下属分级基金的基金简称     | 招商安心收益债券 A                                                     | 招商安心收益债券 C         |
| 下属分级基金的交易代码     | 008383                                                         | 217011             |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 4,551,154,265.72 份                                             | 2,252,321,208.17 份 |

注：本基金从 2019 年 11 月 28 日起新增 A 类份额，A 类份额自 2019 年 12 月 2 日起存续。

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标         | 报告期（2022 年 4 月 1 日—2022 年 6 月 30 日） |                  |
|----------------|-------------------------------------|------------------|
|                | 招商安心收益债券 A                          | 招商安心收益债券 C       |
| 1.本期已实现收益      | 68,429,243.58                       | 35,265,683.07    |
| 2.本期利润         | 83,884,790.35                       | 44,935,851.40    |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0201                              | 0.0192           |
| 4.期末基金资产净值     | 8,004,965,358.27                    | 3,930,760,637.68 |
| 5.期末基金份额净值     | 1.7589                              | 1.7452           |

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

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

#### 3.2 基金净值表现

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

招商安心收益债券 A

| 阶段    | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③   | ②-④    |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|-------|--------|
| 过去三个月 | 1.19%    | 0.03%       | 0.29%      | 0.04%         | 0.90% | -0.01% |
| 过去六个月 | 1.91%    | 0.04%       | 0.38%      | 0.05%         | 1.53% | -0.01% |
| 过去一年  | 5.02%    | 0.04%       | 1.83%      | 0.05%         | 3.19% | -0.01% |

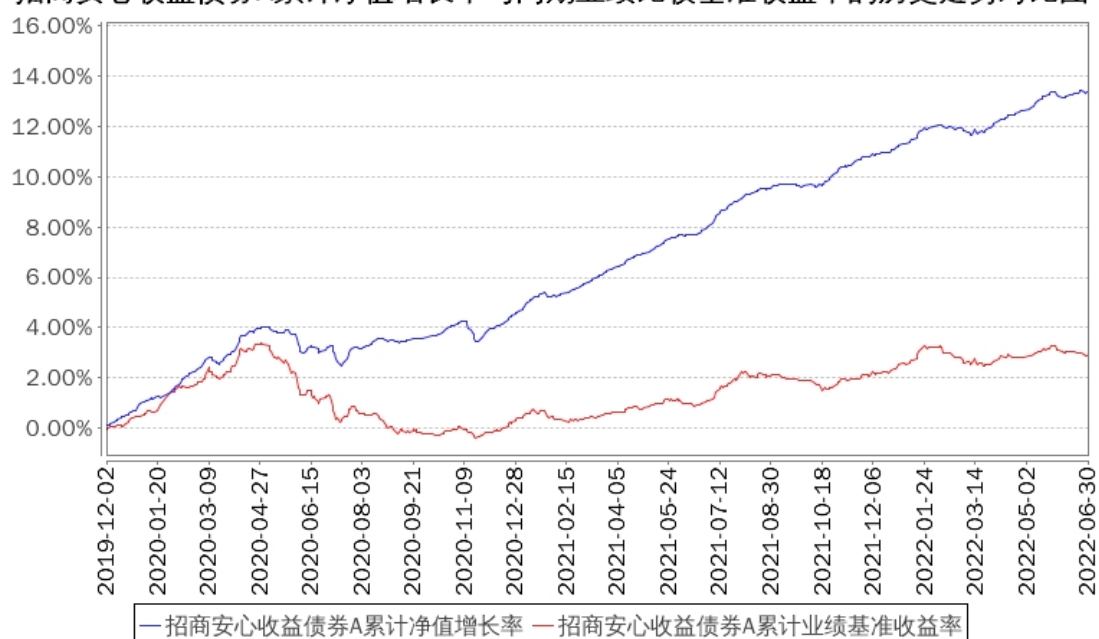
|            |        |       |       |       |        |        |
|------------|--------|-------|-------|-------|--------|--------|
| 自基金合同生效起至今 | 13.39% | 0.05% | 2.93% | 0.07% | 10.46% | -0.02% |
|------------|--------|-------|-------|-------|--------|--------|

招商安心收益债券 C

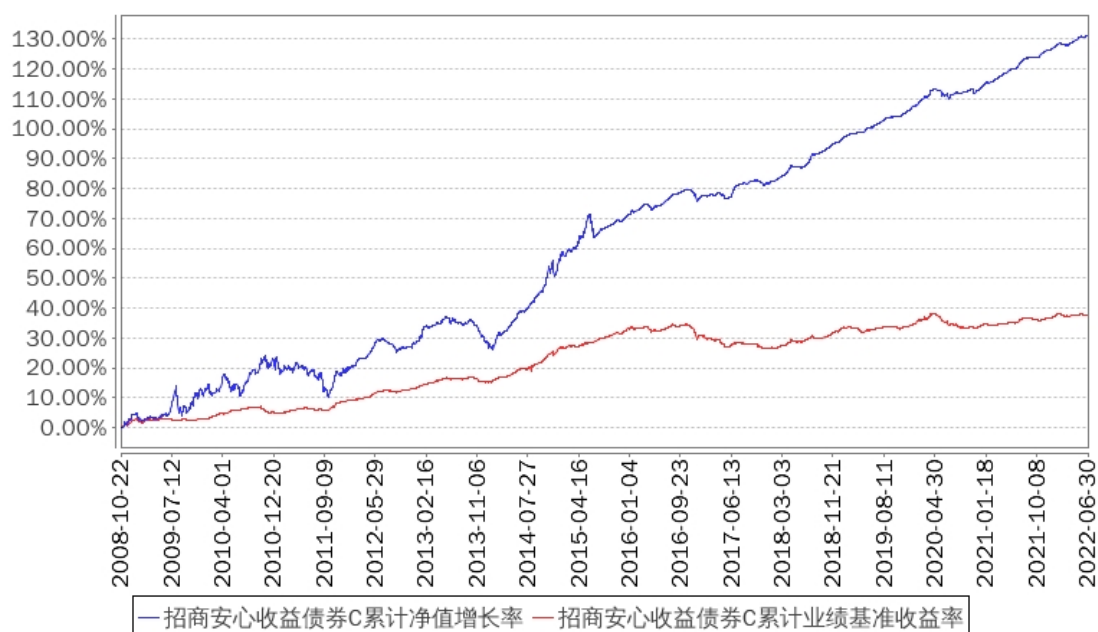
| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月      | 1.11%    | 0.03%       | 0.29%      | 0.04%         | 0.82%  | -0.01% |
| 过去六个月      | 1.75%    | 0.04%       | 0.38%      | 0.05%         | 1.37%  | -0.01% |
| 过去一年       | 4.70%    | 0.04%       | 1.83%      | 0.05%         | 2.87%  | -0.01% |
| 过去三年       | 14.82%   | 0.05%       | 3.53%      | 0.06%         | 11.29% | -0.01% |
| 过去五年       | 28.15%   | 0.05%       | 7.32%      | 0.06%         | 20.83% | -0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 131.02%  | 0.24%       | 37.68%     | 0.08%         | 93.34% | 0.16%  |

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

招商安心收益债券A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



招商安心收益债券C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金从 2019 年 11 月 28 日起新增 A 类份额，A 类份额自 2019 年 12 月 2 日起存续。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务      | 任本基金的基金经理期限     |      | 证券从业年限 | 说明                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |
|----|---------|-----------------|------|--------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    |         | 任职日期            | 离任日期 |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 马龙 | 本基金基金经理 | 2014 年 3 月 27 日 | -    | 12     | 男，经济学博士。2009 年 7 月加入泰达宏利基金管理有限公司，任研究员，从事宏观经济、债券市场策略、股票市场策略研究工作，2012 年 11 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，招商招利 1 个月期理财债券型证券投资基金、招商安盈保本混合型证券投资基金、招商可转债分级债券型证券投资基金、招商安益灵活配置混合型证券投资基金、招商安弘灵活配置混合型证券投资基金、招商安德保本混合型证券投资基金、招商安荣灵活配置混合型证券投资基金、招商睿祥定期开放混合型证券投资基金、招商定期宝六个月期理财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、招商招丰纯债债券型证券投资基金、招商 3 |

|  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
|--|--|--|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  | <p>年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、招商稳祯定期开放混合型证券投资基金、招商金鸿债券型证券投资基金、招商添盈纯债债券型证券投资基金、招商添旭 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理，现任固定收益投资部副总监兼招商安心收益债券型证券投资基金、招商产业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、招商瑞泽一年持有期混合型证券投资基金、招商瑞德一年持有期混合型证券投资基金、招商招祥纯债债券型证券投资基金、招商瑞盈 9 个月持有期混合型证券投资基金、招商添福 1 年定期开放债券型证券投资基金、招商添安 1 年定期开放债券型证券投资基金、招商安鼎平衡 1 年持有期混合型证券投资基金基金经理。</p> |
|--|--|--|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

注：1、本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告（生效）日期；

2、证券从业年限计算标准遵从中国证监会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

## 4.3 公平交易专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，本基金各项交易均严格按照相关法律法规、基金合同的有关要求执行，公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形共发生过两次，原因是指数量化投资组合为满足投资策略需要而发生反向交易。报告期内未发现有可能导致不公平交易和利益输送的重大异常交易行为。

## 4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

宏观经济回顾：

2022 年二季度，国内经济在 4 月份各地疫情频出的背景下触及低点，后又因政府稳增长措施发力、各地加快复工复产，于 5 月份开始出现边际好转。投资方面，最新的 5 月固定资产投资完成额累计同比增长 6.2%，其中 5 月房地产开发投资累计同比下降 4%，单月投资同比下降 7.8%，较 4 月份单月-10% 的同比增速略有回暖，但由于房企拿地和新开工意愿下滑，整体地产投资仍处于低迷状态；在今年发改委强调适度超前开展基建投资、专项债发行节奏前置的情况下，5 月基建投资累计同比增长 8.2%，2022 年至今基建投资力度持续位于高位，较 2021 年全年 0.2% 的同比增速出现明显好转，在政府持续宽财政的背景下，预计基建投资仍有一定韧性；5 月制造业投资累计同比增长 10.6%，表现依旧亮眼，对整体固定资产投资形成支撑。消费方面，5 月社会消费品零售总额当月同比下降 6.7%，虽然表现依旧疲弱，但较 4 月份单月-11% 的同比增速低点边际回升，预计随着后续疫情缓解和复工复产，消费增速短期内回升概率较大。对外贸易方面，5 月出口金额当月同比增长 16.9%，环比 4 月修复幅度较大，主要可能系前期疫情反复造成订单积压、复工复产后供应链恢复导致，但随着全球通胀普遍高企、美联储加息预期抬升、全球经济衰退压力显现，未来出口增速仍有较大下行压力。生产方面，6 月 PMI 指数为 50.2%，时隔 4 个月再次回到荣枯线以上，4 月以来 PMI 指数持续呈上行态势，其中 6 月生产指数和新订单指数分别为 52.8% 和 50.4%，反映经济在边际上的弱复苏状态。整体来看，月度经济数据改善叠加地产销售、煤炭日耗等高频数据在 6 月份转暖的情形下，预计 2022 年三季度经济增长将处于边际复苏状态，但经济复苏的高点仍有待进一步跟踪观察。

债券市场回顾：

2022 年二季度，债券市场整体呈现震荡行情，10 年国债波动幅度在 10bp 以内，波动范围较小，体现出长端对基本面的反应相对钝化。4 月份在全国各地疫情频出情形下，基本面预期弱化，10 年国债收益率下探至 2.74%，随后在央行发布“二十三条”、政治局会议提出增量政策等措施下，10 年国债收益率回到 2.82%附近震荡。直到 5 月中下旬，随着统计局发布的 4 月经济数据超预期弱、稳定经济大盘会议召开，叠加期限利差高企、资金面持续宽松，10 年国债收益率又迎来一波下行，5 月底达到 2.7%的低点水平。进入 6 月，在疫情后复工复产推动经济环比改善、美国通胀压力持续导致美联储鹰派预期抬升的情形下，加之地产销售、煤炭日耗等高频数据显示经济基本面环比改善明显，特别国债、新增政策性金融债支持等预期仍在演绎，导致 10 年国债收益率再次回到 2.83%左右局部高点水平，市场对于债市风险的担忧加剧。分品种看，二季度信用债的波动幅度较利率债更大，5 年、3 年和 1 年 AAA 中债中短期票据收益率分别下降 15bp、13bp 和 27bp，短久期信用债收益率压缩幅度较大，后续随着基本面改善和资金面趋于收紧，信用债回调压力相对较大。

#### 基金操作：

回顾 2022 年二季度的基金操作，我们严格遵照基金合同的相关约定，按照既定的投资流程进行了规范运作。债券投资方面，本组合在市场收益率波动过程中积极调整仓位，顺应市场趋势，优化资产配置结构，提高组合收益。

### 4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金 A 类份额净值增长率为 1.19%，同期业绩基准增长率为 0.29%，C 类份额净值增长率为 1.11%，同期业绩基准增长率为 0.29%。

### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

## § 5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目     | 金额（元）             | 占基金总资产的比例（%） |
|----|--------|-------------------|--------------|
| 1  | 权益投资   | -                 | -            |
|    | 其中：股票  | -                 | -            |
| 2  | 基金投资   | -                 | -            |
| 3  | 固定收益投资 | 14,367,168,520.09 | 99.54        |
|    | 其中：债券  | 14,164,994,814.60 | 98.14        |



|   |                   |                   |        |
|---|-------------------|-------------------|--------|
|   | 资产支持证券            | 202,173,705.49    | 1.40   |
| 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      | 54,647,899.58     | 0.38   |
| 8 | 其他资产              | 11,888,108.31     | 0.08   |
| 9 | 合计                | 14,433,704,527.98 | 100.00 |

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

### 5.2.2 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。

## 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

## 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值（元）           | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|-------------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 516,396,124.33    | 4.33         |
| 2  | 央行票据      | -                 | -            |
| 3  | 金融债券      | 4,535,629,361.80  | 38.00        |
|    | 其中：政策性金融债 | 444,912,288.30    | 3.73         |
| 4  | 企业债券      | 2,569,339,320.83  | 21.53        |
| 5  | 企业短期融资券   | 502,400,848.78    | 4.21         |
| 6  | 中期票据      | 5,665,057,985.48  | 47.46        |
| 7  | 可转债（可交换债） | 5,865,173.38      | 0.05         |
| 8  | 同业存单      | -                 | -            |
| 9  | 其他        | 370,306,000.00    | 3.10         |
| 10 | 合计        | 14,164,994,814.60 | 118.68       |

## 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------|------|-------|---------|--------------|
|----|------|------|-------|---------|--------------|

|   |         |               |           |                |      |
|---|---------|---------------|-----------|----------------|------|
| 1 | 2028051 | 20 浦发银行永续债    | 6,700,000 | 719,783,753.42 | 6.03 |
| 2 | 2128017 | 21 中信银行永续债    | 6,100,000 | 631,701,126.03 | 5.29 |
| 3 | 2028037 | 20 光大银行永续债    | 5,800,000 | 624,040,432.88 | 5.23 |
| 4 | 2128019 | 21 中国银行永续债 01 | 5,400,000 | 556,062,440.55 | 4.66 |
| 5 | 200006  | 20 付息国债 06    | 3,400,000 | 336,051,195.65 | 2.82 |

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

| 序号 | 证券代码    | 证券名称          | 数量（份）   | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|---------|---------------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 2189616 | 21 建鑫 10 优先   | 400,000 | 39,505,209.71 | 0.33         |
| 2  | 2189624 | 21 东元 1 优先_bc | 400,000 | 31,660,743.98 | 0.27         |
| 3  | 183210  | 21 六局 1A      | 200,000 | 20,063,150.68 | 0.17         |
| 4  | 183226  | 新铁 01 优       | 200,000 | 19,969,654.79 | 0.17         |
| 5  | 169736  | 玺悦 01 优       | 800,000 | 16,129,551.50 | 0.14         |
| 6  | 137269  | 20 中交 A       | 200,000 | 14,818,050.65 | 0.12         |
| 7  | 183220  | 21 天恒 1A      | 100,000 | 10,000,057.53 | 0.08         |
| 8  | 165418  | PR 和 1A       | 900,000 | 9,921,987.65  | 0.08         |
| 9  | 136922  | 22 中交 4A      | 80,000  | 8,111,559.45  | 0.07         |
| 10 | 136793  | 21 徐矿 2A      | 80,000  | 8,040,854.79  | 0.07         |

## 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

根据本基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

### 5.10.3 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。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1

报告期内基金投资的前十名证券除 20 光大银行永续债（证券代码 2028037）、20 浦发银行永续债（证券代码 2028051）、20 兴业银行永续债（证券代码 2028042）、21 中国银行永续债 01（证券代码 2128019）、21 中信银行永续债（证券代码 2128017）、22 建设银行二级 02（证券代码 2228040）、22 农业银行永续债 01（证券代码 2228011）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 光大银行永续债（证券代码 2028037）

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、未依法履行职责等原因，多次受到监管机构的处罚。

#### 2、20 浦发银行永续债（证券代码 2028051）

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

#### 3、20 兴业银行永续债（证券代码 2028042）

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。

#### 4、21 中国银行永续债 01（证券代码 2128019）

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、违反反洗钱法等原因，多次受到监管机构的处罚。

#### 5、21 中信银行永续债（证券代码 2128017）

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

#### 6、22 建设银行二级 02（证券代码 2228040）

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。

#### 7、22 农业银行永续债 01（证券代码 2228011）

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

对上述证券的投资决策程序的说明：本基金投资上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

### 5.11.2

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

### 5.11.3 其他资产构成

金额单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额（元）         |
|----|---------|---------------|
| 1  | 存出保证金   | 61,055.84     |
| 2  | 应收证券清算款 | -             |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | -             |
| 5  | 应收申购款   | 11,827,052.47 |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |
| 8  | 其他      | -             |
| 9  | 合计      | 11,888,108.31 |

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称 | 公允价值（元）    | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|------------|--------------|
| 1  | 110067 | 华安转债 | 376,733.43 | 0.00         |
| 2  | 113024 | 核建转债 | 238,334.67 | 0.00         |
| 3  | 110081 | 闻泰转债 | 234,049.76 | 0.00         |
| 4  | 128137 | 洁美转债 | 142,206.37 | 0.00         |
| 5  | 113519 | 长久转债 | 5,869.79   | 0.00         |

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末投资前十名股票中不存在流通受限情况。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                            | 招商安心收益债券 A       | 招商安心收益债券 C       |
|-------------------------------|------------------|------------------|
| 报告期期初基金份额总额                   | 3,886,206,389.18 | 2,352,225,383.64 |
| 报告期期间基金总申购份额                  | 1,006,946,658.83 | 165,975,702.22   |
| 减：报告期期间基金总赎回份额                | 341,998,782.29   | 265,879,877.69   |
| 报告期期间基金拆分变动份额<br>（份额减少以“-”填列） | -                | -                |
| 报告期期末基金份额总额                   | 4,551,154,265.72 | 2,252,321,208.17 |

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的交易明细。

## § 8 备查文件目录

### 8.1 备查文件目录

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

### 8.2 存放地点

招商基金管理有限公司

地址：中国深圳深南大道 7088 号招商银行大厦

### 8.3 查阅方式

上述文件可在招商基金管理有限公司互联网站上查阅，或者在营业时间内到招商基金管理有限公司查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人招商基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-887-9555

网址：<http://www.cmfcchina.com>

招商基金管理有限公司

2022 年 7 月 20 日