

招商中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期 证券投资基金 2022 年中期报告

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：交通银行股份有限公司

送出日期：2022 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 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 2022 年 4 月 28 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..... | 7 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况..... | 7 |
| 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..... | 9 |
| 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..... | 10 |
| 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）..... | 11 |
| 6.1 资产负债表..... | 11 |
| 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..... | 36 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 36 |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合..... | 37 |
| 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..... | 37 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 37 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 37 |
| 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..... | 38 |
| 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..... | 38 |
| 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..... | 38 |
| 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..... | 38 |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策..... | 38 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 38 |

| | |
|---------------------------------------|----|
| 7.12 投资组合报告附注..... | 39 |
| §8 基金份额持有人信息..... | 40 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 40 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 41 |
| 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..... | 41 |
| §9 开放式基金份额变动..... | 41 |
| §10 重大事件揭示..... | 41 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 41 |
| 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..... | 41 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 42 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 42 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 42 |
| 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..... | 42 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 42 |
| 10.8 其他重大事件..... | 43 |
| §11 备查文件目录..... | 44 |
| 11.1 备查文件目录..... | 44 |
| 11.2 存放地点..... | 44 |
| 11.3 查阅方式..... | 44 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|------------------------------|
| 基金名称 | 招商中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金 |
| 基金简称 | 招商中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期 |
| 基金主代码 | 015643 |
| 交易代码 | 015643 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2022 年 4 月 28 日 |
| 基金管理人 | 招商基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 交通银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 8,794,292,334.62 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 本基金通过指数化投资，争取在扣除各项费用之前获得与标的指数相似的总回报，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。 |
| 投资策略 | <p>本基金为指数基金，主要采用抽样复制和动态最优化的方法，投资于标的指数中具有代表性和流动性的成份券和备选成份券，或选择非成份券作为替代，构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合，以实现对标的指数的有效跟踪。</p> <p>在正常市场情况下，本基金力争追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，将年化跟踪误差控制在 2% 以内。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过了上述范围，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪误差进一步扩大。</p> <p>当标的指数成份券发生明显负面事件面临退市或违约风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份券进行调整。</p> <p>本基金的具体投资策略包括：（1）优化抽样复制策略；（2）替代性策略；（3）债券投资策略。</p> |
| 业绩比较基准 | 中证同业存单 AAA 指数收益率×95%+银行人民币一年定期存款利率(税后)×5% |
| 风险收益特征 | 本基金风险与收益低于股票型基金、偏股混合型基金，高于货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份券及备选成份券，具有与标的指数相似的风险收益特征。 |

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 | 交通银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 潘西里 | 陆志俊 |
| | 联系电话 | 0755-83196666 | 95559 |
| | 电子邮箱 | cmf@cmfchina.com | luzj@bankcomm.com |
| 客户服务电话 | | 400-887-9555 | 95559 |
| 传真 | | 0755-83196475 | 021-62701216 |
| 注册地址 | | 深圳市福田区深南大道 7088 号 | 中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号 |
| 办公地址 | | 深圳市福田区深南大道 7088 号 | 中国（上海）长宁区仙霞路 18 号 |
| 邮政编码 | | 518040 | 200336 |
| 法定代表人 | | 王小青 | 任德奇 |

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.cmfchina.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(2022 年 4 月 28 日 - 2022 年 6 月 30 日) |
| 本期已实现收益 | 31,387,440.10 |
| 本期利润 | 32,991,192.78 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0035 |
| 本期加权平均净值利润率 | 0.35% |
| 本期基金份额净值增长率 | 0.35% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2022 年 6 月 30 日) |
| 期末可供分配利润 | 28,934,552.04 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0033 |
| 期末基金资产净值 | 8,824,868,074.61 |
| 期末基金份额净值 | 1.0035 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2022 年 6 月 30 日) |
| 基金份额累计净值增长率 | 0.35% |

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 2022 年 4 月 28 日生效，截至本报告期末成立未满半年。

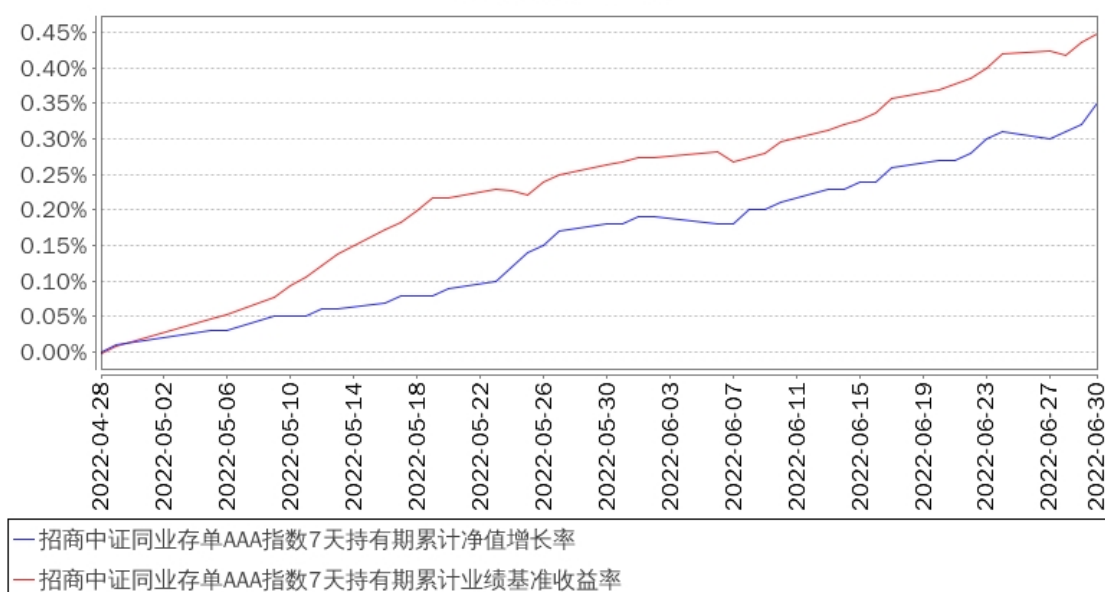
3.2 基金净值表现

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 | 0.17% | 0.01% | 0.18% | 0.01% | -0.01% | 0.00% |
| 自基金合同生效起至今 | 0.35% | 0.01% | 0.45% | 0.01% | -0.10% | 0.00% |

3.2.2 自基金合同生效/自基金转型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

招商中证同业存单AAA指数7天持有期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 2022 年 4 月 28 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资格；2004 年获得全国社保基金投资管理人资格；同时拥有 QDII（合格境内机构投资者）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 | 2022 年 4 月 28 日 | - | 8 | 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% 的情形共发生过五次，原因是指数量化投资组合为满足投资策略需要而发生反向交易。报告期内未发现有可能导致不公平交易和利益输送的重大异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

宏观经济回顾：

2022 年上半年，地产投资相对疲弱，基建和制造业投资持续高企，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 6 月固定资产投资完成额累计同比增长 6.1%，其

中 6 月房地产开发投资累计同比下降 5.4%，单月投资同比下降 9.4%，由于房企拿地和新开工意愿下滑，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，6 月基建投资累计同比增长 9.3%，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；6 月制造业投资累计同比增长 10.4%，表现依旧亮眼，对固定资产投资形成支撑。消费方面，6 月社会消费品零售总额当月同比增长 3.1%，较 4 月份单月-11% 的同比增速低点边际回升较多，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，6 月出口金额当月同比增长 17.9%，增速依然处于高位，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，在各项月度经济数据出现边际好转的背景下，预计 2022 年下半年经济增长处于边际复苏状态，但经济复苏的高点仍有待进一步跟踪观察。

市场回顾：

2022 年上半年，除月末和季末小幅扰动外，银行间市场资金持续保持充裕，资金利率中枢不断下探，一季度内 DR001 维持在 1.95% 附近、DR007 维持在 2.1% 附近，存单利率仍随着市场预期变动处于震荡状态，1 月份由于央行宣布 1 年期 MLF 利率和 7 天逆回购利率均调降 10bp、叠加当时较强的继续降准降息预期，1 年存单利率下探至 2.41% 低位，而后 2 月和 3 月降息预期落空，叠加房企违约、转债和股市下挫导致债基和固收+产品赎回压力提升，存单利率在 3 月中旬回调至 2.62% 高位。进入二季度后，随着央行上缴利润、财政开始大规模实施留抵退税，加之央行宣布下调金融机构存款准备金率 0.25 个百分点，银行间流动性愈发宽松，二季度 DR001 中枢下探至 1.4% 附近、DR007 为 1.7% 附近，存单利率也持续处于下行趋势中，1 年期存单利率在 5 月中旬达到 2.3% 的低位水平。此后虽然 5-6 月新增专项债发行提速导致流动性加快回笼，但财政支出力度加大、信贷投放不畅也导致银行间资金淤积，资金利率在 5 月中下旬至 6 月底基本处于窄幅震荡状态，1 年期存单利率在 2.3%-2.4% 之间波动。

基金操作：

本基金在报告期内，在满足法律法规及流动性需求的情况下，积极寻找利率曲线上高收益资产，尽可能拉长久期和提高杠杆，以增厚组合收益。

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 0.35%，同期业绩基准增长率为 0.45%。

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：

整体看，目前在经济低位运行到弱复苏的过渡期内，央行呵护资金面的态度仍较为明显，7 月央行等量续作 1000 亿 MLF，DR001 进一步降至 1.3% 附近，加之地方政府新增专项债已基本发行完毕，目前对资金面形成压力的因素相对有限。我们认为在当前稳增长诉求仍较强的情形下，下半年资金利率维持低位以促进实体经济复苏的概率较大，但考虑到目前 DR007 与 7 天逆回购利率持续存在较大差距、且银行间质押式回购成交量持续处于高位，若后续经济边际恢复较好，需要警惕资金面边际收紧的可能性。

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，基金托管人在对招商中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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的复核，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”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：招商中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金
报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2022 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------|---------------------|
| 资产： | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 1,179,773,236.72 |
| 结算备付金 | | 16,776,370.05 |
| 存出保证金 | | 27,126.87 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 11,339,164,367.38 |
| 其中：股票投资 | | - |
| 基金投资 | | - |
| 债券投资 | | 11,339,164,367.38 |
| 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 | | - |
| 其中：债券投资 | | - |
| 资产支持证券投资 | | - |
| 其他投资 | | - |
| 其他债权投资 | | - |
| 其他权益工具投资 | | - |
| 应收清算款 | | - |
| 应收股利 | | - |
| 应收申购款 | | 368,886,452.28 |
| 递延所得税资产 | | - |
| 其他资产 | 6.4.7.5 | - |
| 资产总计 | | 12,904,627,553.30 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2022 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 | | 2,105,624,059.74 |
| 应付清算款 | | - |
| 应付赎回款 | | 543,097.60 |
| 应付管理人报酬 | | 1,481,479.35 |
| 应付托管费 | | 370,369.85 |
| 应付销售服务费 | | 1,481,479.35 |
| 应付投资顾问费 | | - |
| 应交税费 | | 17,904.32 |
| 应付利润 | | - |
| 递延所得税负债 | | - |
| 其他负债 | 6.4.7.6 | 1,970,241,088.48 |
| 负债合计 | | 4,079,759,478.69 |

| | | |
|----------|---------|-------------------|
| 净资产： | | |
| 实收基金 | 6.4.7.7 | 8,794,292,334.62 |
| 其他综合收益 | | - |
| 未分配利润 | 6.4.7.8 | 30,575,739.99 |
| 净资产合计 | | 8,824,868,074.61 |
| 负债和净资产总计 | | 12,904,627,553.30 |

注：1. 报告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0035 元，基金份额总额 8,794,292,334.62 份；

2. 本财务报表的实际编制期间为 2022 年 4 月 28 日(基金合同生效日)至 2022 年 6 月 30 日止期间。

6.2 利润表

会计主体：招商中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金

本报告期：2022 年 4 月 28 日(基金合同生效日)至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2022 年 4 月 28 日(基金合同生效日)至 2022 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|----------|--|
| 一、营业总收入 | | 43,729,173.36 |
| 1.利息收入 | | 15,383,479.50 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.9 | 8,999,196.56 |
| 债券利息收入 | | - |
| 资产支持证券利息收入 | | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 6,384,282.94 |
| 其他利息收入 | | - |
| 证券出借利息收入 | | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 26,741,941.18 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.10 | - |
| 基金投资收益 | | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.11 | 26,741,941.18 |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.12 | - |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.13 | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.14 | - |
| 股利收益 | 6.4.7.15 | - |
| 以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益 | | - |
| 其他投资收益 | | - |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.16 | 1,603,752.68 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17 | - |

| | | |
|---------------------|------------|---------------|
| 减：二、营业总支出 | | 10,737,980.58 |
| 1.管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 3,287,627.52 |
| 2.托管费 | 6.4.10.2.2 | 821,906.86 |
| 3.销售服务费 | 6.4.10.2.3 | 3,287,627.52 |
| 4.投资顾问费 | | - |
| 5.利息支出 | | 3,328,153.06 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 3,328,153.06 |
| 6.信用减值损失 | 6.4.7.18 | - |
| 7.税金及附加 | | 1,943.06 |
| 8.其他费用 | 6.4.7.19 | 10,722.56 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 32,991,192.78 |
| 减：所得税费用 | | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 32,991,192.78 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - |
| 六、综合收益总额 | | 32,991,192.78 |

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：招商中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金

本报告期：2022 年 4 月 28 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022 年 4 月 28 日（基金合同生效日）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） | - | - | - | - |
| 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） | 10,000,280,598.73 | - | - | 10,000,280,598.73 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -1,205,988,264.11 | - | 30,575,739.99 | -1,175,412,524.12 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | 32,991,192.78 | 32,991,192.78 |
| （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） | -1,205,988,264.11 | - | -2,415,452.79 | -1,208,403,716.90 |
| 其中：1.基金申购款 | 5,829,182,804.94 | - | 14,322,414.29 | 5,843,505,219.23 |
| 2.基金赎回款 | -7,035,171,069.05 | - | -16,737,867.08 | -7,051,908,936.13 |
| （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) | 8,794,292,334.62 | - | 30,575,739.99 | 8,824,868,074.61 |

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

招商中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金(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》、《招商中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期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]781 号文准予公开募集注册。本基金为契约型开放式基金,存续期限为不定期。本基金首次设立募集基金份额为 10,000,280,598.73 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(22)第 00208 号验资报告。《招商中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)于 2022 年 4 月 28 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,基金托管人为交通银行股份有限公司(以下简称“交通银行”)。

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《招商中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金主要投资于标的指数成份券及备选成份券。为了更好地实现投资目标,本基金还可投资于非属成份券及备选成份券的其他同业存单、债券(包括国债、地方政府债券、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、政府支持债券、政府支持机构债券等)、短期融资券(含超短期融资券)、中期票据等非金融企业债务融资工具、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括定期存款、协议存款、通知存款等)、现金等货币市场工具等,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)。

本基金投资于同业存单的比例不低于基金资产的 80%;本基金投资于标的指数成份券和备选成份券的比例不低于非现金基金资产的 80%;本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为:中证同业存单 AAA 指数收益率×95%+银行人民币一年定期存款利率(税后)×5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)以及中国证监会发布的基金行业实务操作的有关规定编制,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 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 4 月 28 日(基金合同生效日)至 2022 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 2022 年 4 月 28 日(基金合同生效日)至 2022 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

根据本基金的业务特点和风险管理要求,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的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，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。

本基金在前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

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

(1) 对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市价不能真实反映公允价值的，应对市价进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

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

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。

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

债券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖债券价差收入。除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。买卖债券价差收入为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

资产支持证券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖资产支持证券价差收入。资产支持证券利息收入在持有期内，按资产支持证券的票面价值和预计收益率计算的利息逐日确认资产支持证券利息收入。在收到资产支持证券支付的款项时，其中属于证券投资收益的部分冲减应计利息(若有)后的差额，确认资产支持证券利息收入。买卖资产支持证券价差收入为卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本、相关交易费用与税费后的差额确认。

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) 在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

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) 投资者的现金红利和红利再投资形成的基金份额均保留到小数点后第 2 位，小数点后第 3 位开始舍去，舍去部分归基金资产；

6) 法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 外币交易

本基金本报告期内无外币交易。

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债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

根据《关于发布〈中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准〉的通知》（中基协发[2014]24 号），在上海证券交易所、深圳证券交

易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外),采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

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

根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》(以下简称“新金融工具准则”)相关规定,以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》,公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。本基金在编制本中期财务报表时已采用该准则。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内未发生重大会计差错更正。

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 2022 年 6 月 30 日 |
|----------------|---------------------|
| 活期存款 | 677,906,569.84 |
| 等于：本金 | 677,892,253.70 |
| 加：应计利息 | 14,316.14 |
| 减：坏账准备 | - |
| 定期存款 | 501,866,666.88 |
| 等于：本金 | 500,000,000.00 |
| 加：应计利息 | 1,866,666.88 |
| 减：坏账准备 | - |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | 501,866,666.88 |
| 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 | 1,179,773,236.72 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022 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 | 98,537,539.14 | 1,262,648.70 | 99,805,241.20 | 5,053.36 |
| | 银行间市场 | 11,144,582,300.68 | 93,178,126.18 | 11,239,359,126.18 | 1,598,699.32 |
| | 合计 | 11,243,119,839.82 | 94,440,774.88 | 11,339,164,367.38 | 1,603,752.68 |
| 资产支持证券 | - | - | - | - | |
| 基金 | - | - | - | - | |
| 其他 | - | - | - | - | |
| 合计 | 11,243,119,839.82 | 94,440,774.88 | 11,339,164,367.38 | 1,603,752.68 | |

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 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022 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 | 144,921.24 |
| 其中：交易所市场 | - |
| 银行间市场 | 144,921.24 |
| 应付利息 | - |
| 预提费用 | 10,322.56 |
| 其他 | 1,970,085,844.68 |
| 合计 | 1,970,241,088.48 |

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022 年 4 月 28 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日 | |
|---------------|--|-------------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 基金合同生效日 | 10,000,280,598.73 | 10,000,280,598.73 |
| 本期申购 | 5,829,182,804.94 | 5,829,182,804.94 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -7,035,171,069.05 | -7,035,171,069.05 |
| 基金份额折算变动份额 | - | - |
| 本期末 | 8,794,292,334.62 | 8,794,292,334.62 |

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 2022 年 4 月 25 日至 2022 年 4 月 26 日止期间公开发售，有效净认购金额人民币 9,999,939,810.99 元，折算为 9,999,939,810.99 份基金份额。根据《招商中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期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 340,787.74 元，折算为 340,787.74 份基金份额，划入基金持有人账户，两者合计 10,000,280,598.73 份基金份额。

6.4.7.8 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 | 31,387,440.10 | 1,603,752.68 | 32,991,192.78 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -2,452,888.06 | 37,435.27 | -2,415,452.79 |
| 其中：基金申购款 | 15,651,135.23 | -1,328,720.94 | 14,322,414.29 |
| 基金赎回款 | -18,104,023.29 | 1,366,156.21 | -16,737,867.08 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 28,934,552.04 | 1,641,187.95 | 30,575,739.99 |

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022 年 4 月 28 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日 |
|-----------|--|
| 活期存款利息收入 | 1,652,710.02 |
| 定期存款利息收入 | 3,424,027.99 |
| 其他存款利息收入 | - |
| 结算备付金利息收入 | 3,922,406.24 |
| 其他 | 52.31 |
| 合计 | 8,999,196.56 |

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 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。

6.4.7.10.2 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。

6.4.7.10.3 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。

6.4.7.10.4 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。

6.4.7.10.5 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。

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022 年 4 月 28 日（基金合同生效日） 至 2022 年 6 月 30 日 |
|-------------------------------|--|
| 债券投资收益——利息收入 | 24,000,923.69 |
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入 | 2,741,017.49 |
| 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 | 26,741,941.18 |

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022 年 4 月 28 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日 |
|-------------------------|---|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额 | 6,929,325,031.57 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 6,848,224,680.75 |
| 减：应计利息总额 | 78,268,091.62 |
| 减：交易费用 | 91,241.71 |
| 买卖债券差价收入 | 2,741,017.49 |

6.4.7.11.3 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。

6.4.7.11.4 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。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 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。

6.4.7.12.2 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。

6.4.7.12.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券赎回差价收入。

6.4.7.12.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券申购差价收入。

6.4.7.13 贵金属投资收益

6.4.7.13.1 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。

6.4.7.13.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无买卖贵金属差价收入。

6.4.7.13.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无贵金属赎回差价收入。

6.4.7.13.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无贵金属申购差价收入。

6.4.7.14 衍生工具收益**6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期内无衍生工具买卖权证差价收入。

6.4.7.14.2 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。

6.4.7.15 股利收益

本基金本报告期内无股利收益。

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2022 年 4 月 28 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日 |
|------------------------|--|
| 1.交易性金融资产 | 1,603,752.68 |
| ——股票投资 | - |
| ——债券投资 | 1,603,752.68 |
| ——资产支持证券投资 | - |
| ——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 | 1,603,752.68 |

6.4.7.17 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022 年 4 月 28 日(基金合同生效日)至 2022 年 6 月 30 日 |
|---------|--|
| 审计费用 | 10,322.56 |
| 信息披露费 | - |
| 证券出借违约金 | - |
| 其他 | 400.00 |
| 合计 | 10,722.56 |

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 |
| 交通银行股份有限公司 | 基金托管人 |
| 招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”) | 基金管理人的股东 |
| 招商证券股份有限公司(以下简称“招商证券”) | 基金管理人的股东 |

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 2022 年 4 月 28 日（基金合同生效日）至 2022 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 | 902,897,777.94 | 100.00% |

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 2022 年 4 月 28 日（基金合同生效日）至 2022 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 | 6,923,700,000.00 | 100.00% |

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 2022 年 4 月 28 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日 |
|-----------------|--|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 3,287,627.52 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 1,585,418.75 |
| 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×0.20%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：

$$\text{日基金管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022 年 4 月 28 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日 |
|----------------|--|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 821,906.86 |

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：

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

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| | |
|----------------|---|
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期 2022 年 4 月 28 日(基金合同生效日)至 2022 年 6 月 30 日 |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 |
| 交通银行 | 275,794.82 |
| 招商基金管理有限公司 | 2,611.30 |
| 招商银行 | 2,097,737.55 |
| 招商证券 | 25,437.58 |
| 合计 | 2,401,581.25 |

注：本基金的年销售服务费率为 0.20%，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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自有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人无运用自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 2022 年 4 月 28 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日 | |
|---------|--|--------------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 交通银行-活期 | 677,906,569.84 | 1,652,710.02 |

注：本基金的银行存款由基金托管人交通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（2022 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 2022 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 2,105,624,059.74 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 |
|-----------|---------------|----------------|--------|-----------|----------------|
| 112105214 | 21 建设银行 CD214 | 2022 年 7 月 1 日 | 99.45 | 1,000,000 | 99,447,934.52 |
| 112108160 | 21 中信银行 CD160 | 2022 年 7 月 1 日 | 99.37 | 1,000,000 | 99,370,926.03 |
| 112108181 | 21 中信银行 CD181 | 2022 年 7 月 1 日 | 99.09 | 414,000 | 41,022,422.93 |
| 112109298 | 21 浦发银行 CD298 | 2022 年 7 月 1 日 | 99.23 | 1,000,000 | 99,228,095.89 |
| 112110493 | 21 兴业银行 CD493 | 2022 年 7 月 1 日 | 99.17 | 2,500,000 | 247,933,154.11 |
| 112118246 | 21 华夏银行 CD246 | 2022 年 7 月 1 日 | 99.46 | 1,000,000 | 99,457,146.30 |
| 112203004 | 22 农业银行 CD004 | 2022 年 7 月 1 日 | 98.72 | 783,000 | 77,296,197.22 |
| 112203005 | 22 农业银行 CD055 | 2022 年 7 月 1 日 | 97.86 | 45,000 | 4,403,501.09 |
| 112203006 | 22 农业银行 CD056 | 2022 年 7 月 1 日 | 97.85 | 174,000 | 17,025,676.61 |
| 112205008 | 22 建设银行 CD008 | 2022 年 7 月 1 日 | 98.84 | 2,465,000 | 243,645,319.29 |

| | | | | | |
|-----------|---------------|----------------|--------|------------|------------------|
| 112205094 | 22 建设银行 CD094 | 2022 年 7 月 1 日 | 98.50 | 2,000,000 | 197,007,923.08 |
| 112208058 | 22 中信银行 CD058 | 2022 年 7 月 1 日 | 98.43 | 1,076,000 | 105,915,331.63 |
| 112212091 | 22 北京银行 CD091 | 2022 年 7 月 1 日 | 99.08 | 2,000,000 | 198,166,802.19 |
| 112214087 | 22 江苏银行 CD087 | 2022 年 7 月 1 日 | 97.80 | 2,718,000 | 265,822,117.93 |
| 112216015 | 22 上海银行 CD015 | 2022 年 7 月 1 日 | 99.44 | 538,000 | 53,499,836.20 |
| 180309 | 18 进出 09 | 2022 年 7 月 1 日 | 102.35 | 964,000 | 98,668,939.07 |
| 200018 | 20 附息国债 18 | 2022 年 7 月 1 日 | 102.11 | 1,300,000 | 132,742,430.14 |
| 200217 | 20 国开 17 | 2022 年 7 月 1 日 | 100.73 | 2,000,000 | 201,462,826.09 |
| 合计 | - | - | - | 22,977,000 | 2,282,116,580.32 |

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

本基金是指数型基金，本基金的运作涉及的金融工具主要包括债券投资（主要是指数成份券、备选成份券）。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。与本基金相关的市场风险主要包括利率风险和市场价格风险。

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 2022 年 6 月 30 日 |
|--------|---------------------|
| A-1 | - |
| A-1 以下 | - |
| 未评级 | 422,049,717.26 |
| 合计 | 422,049,717.26 |

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 2022 年 6 月 30 日 |
|--------|---------------------|
| AAA | 93,229,980.28 |
| AAA 以下 | - |
| 未评级 | - |
| 合计 | 93,229,980.28 |

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 2022 年 6 月 30 日 |
|--------|---------------------|
| AAA | 10,287,520,501.18 |
| AAA 以下 | - |
| 未评级 | - |
| 合计 | 10,287,520,501.18 |

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 2022 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 | 1,179,773,236.72 | - | - | - | 1,179,773,236.72 |
| 结算备付金 | 16,776,370.05 | - | - | - | 16,776,370.05 |
| 存出保证金 | 27,126.87 | - | - | - | 27,126.87 |
| 交易性金融资产 | 11,339,164,367.38 | - | - | - | 11,339,164,367.38 |
| 衍生金融资产 | - | - | - | - | - |
| 买入返售金融资产 | - | - | - | - | - |
| 债权投资 | - | - | - | - | - |
| 应收股利 | - | - | - | - | - |
| 应收申购款 | - | - | - | 368,886,452.28 | 368,886,452.28 |
| 应收清算款 | - | - | - | - | - |
| 其他资产 | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 12,535,741,101.02 | - | - | 368,886,452.28 | 12,904,627,553.30 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 543,097.60 | 543,097.60 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 1,481,479.35 | 1,481,479.35 |
| 应付托管费 | - | - | - | 370,369.85 | 370,369.85 |
| 应付清算款 | - | - | - | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | 2,105,624,059.74 | - | - | - | 2,105,624,059.74 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 1,481,479.35 | 1,481,479.35 |
| 应付投资顾问费 | - | - | - | - | - |
| 应付利润 | - | - | - | - | - |
| 应交税费 | - | - | - | 17,904.32 | 17,904.32 |
| 其他负债 | - | - | - | 1,970,241,088.48 | 1,970,241,088.48 |
| 负债总计 | 2,105,624,059.74 | - | - | 1,974,135,418.95 | 4,079,759,478.69 |
| 利率敏感度缺口 | 10,430,117,041.28 | - | - | -1,605,248,966.67 | 8,824,868,074.61 |

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（2022 年 6 月 30 日） |
| | 1. 市场利率平行上升 50 个基点 | -33,233,708.06 |
| | 2. 市场利率平行下降 50 个基点 | 33,477,118.28 |

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和股票，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金在构建资产配置和基金资产投资组合的基础上，通过建立事前和事后跟踪误差的方式，对基金资产的市场价格风险进行管理。

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

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末 2022 年 6 月 30 日 |
|---------------|---------------------|
| 第一层次 | - |
| 第二层次 | 11,339,164,367.38 |
| 第三层次 | - |
| 合计 | 11,339,164,367.38 |

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资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其公允价值和账面价值相若。

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 | 11,339,164,367.38 | 87.87 |
| | 其中：债券 | 11,339,164,367.38 | 87.87 |
| | 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 | 1,196,549,606.77 | 9.27 |
| 8 | 其他资产 | 368,913,579.15 | 2.86 |
| 9 | 合计 | 12,904,627,553.30 | 100.00 |

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

本基金不投资于股票。

7.2.2 期末积极投资按行业分类境内股票投资组合

本基金不投资于股票。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金不投资于股票。

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

7.3.1 报告期末指数投资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。

7.3.2 期末积极投资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

本基金不投资于股票。

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 | 232,547,671.34 | 2.64 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 303,816,497.32 | 3.44 |
| | 其中：政策性金融债 | 303,816,497.32 | 3.44 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | 422,049,717.26 | 4.78 |
| 6 | 中期票据 | 93,229,980.28 | 1.06 |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | 10,287,520,501.18 | 116.57 |
| 9 | 其他 | - | - |

| | | | |
|----|----|-------------------|--------|
| 10 | 合计 | 11,339,164,367.38 | 128.49 |
|----|----|-------------------|--------|

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 | 112214087 | 22江苏银行 CD087 | 4,500,000 | 440,102,844.25 | 4.99 |
| 2 | 112220121 | 22广发银行 CD121 | 3,000,000 | 293,566,739.18 | 3.33 |
| 3 | 112205008 | 22建设银行 CD008 | 2,900,000 | 286,641,552.11 | 3.25 |
| 4 | 112216015 | 22上海银行 CD015 | 2,500,000 | 248,605,186.81 | 2.82 |
| 5 | 112110493 | 21兴业银行 CD493 | 2,500,000 | 247,933,154.11 | 2.81 |

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 国开 17（证券代码 200217）、21 兴业银行 CD493（证券代码 112110493）、22 北京银行 CD091（证券代码 112212091）、22 广发银行 CD121（证券代码 112220121）、22 建设银行 CD008（证券代码 112205008）、22 建设银行 CD094（证券代码 112205094）、22 江苏银行 CD087（证券代码 112214087）、22 浦发银行 CD118（证券代码 112209118）、22 上海银行 CD015（证券代码 112216015）、22 中信银行 CD058（证券代码 112208058）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 国开 17（证券代码 200217）

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

2、21 兴业银行 CD493（证券代码 112110493）

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、22 北京银行 CD091（证券代码 112212091）

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。

4、22 广发银行 CD121（证券代码 112220121）

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、违规提供担保及财务资助、涉嫌违反法律法规，多次受到监管机构的处罚。

5、22 建设银行 CD008（证券代码 112205008）

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

6、22 建设银行 CD094（证券代码 112205094）

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 江苏银行 CD087（证券代码 112214087）

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、内部制度不完善等原因，多次受到监管机构的处罚。

8、22 浦发银行 CD118（证券代码 112209118）

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。

9、22 上海银行 CD015（证券代码 112216015）

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、未依法履行职责等原因，多次受到监管机构的处罚。

10、22 中信银行 CD058（证券代码 112208058）

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。

对上述证券的投资决策程序的说明：本基金为指数型基金，因复制指数被动持有，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 | 27,126.87 |
| 2 | 应收清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 368,886,452.28 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 368,913,579.15 |

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

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况说明

本基金不投资于股票。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金不投资于股票。

§ 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 | 持有份额 | 占总份 |
| | | | | | |

| | | | 额比例 | | 额比例 |
|--------|------------|----------------|-------|------------------|--------|
| 28,473 | 308,864.27 | 401,455,618.01 | 4.56% | 8,392,836,716.61 | 95.44% |

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 | 148,055.42 | 0.0017% |

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(2022年4月28日)基金份额总额 | 10,000,280,598.73 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额 | 5,829,182,804.94 |
| 减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额 | 7,035,171,069.05 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列) | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 8,794,292,334.62 |

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末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

本基金本报告期内基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，徐铁任交通银行股份有限公司资产托管部总经理。

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

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、托管人及其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。

10.7 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 | |
| 方正证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | 3 | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | 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。

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 |
| 方正证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | 902,897,777.94 | 100.00% | 6,923,700,000.00 | 100.00% | - | - |
| 中信证券 | - | - | - | - | - | - |

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 | 招商中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期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 | 2022-04-22 |
| 2 | 招商中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金产品资料概要 | 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 | 2022-04-22 |
| 3 | 招商中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期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 | 2022-04-22 |
| 4 | 招商中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金份额发售公告 | 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 | 2022-04-22 |
| 5 | 招商中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期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 | 2022-04-22 |
| 6 | 招商中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期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 | 2022-04-22 |
| 7 | 关于招商中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期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 | 2022-04-26 |
| 8 | 关于招商中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金认购申请确认比例结果公告 | 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 | 2022-04-28 |
| 9 | 招商中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期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 | 2022-04-29 |
| 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基金电子披露网站 | 2022-05-13 |
| 11 | 关于开放招商中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期基金日常申购赎回及转换转出和定期定额投资业务的公告 | 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 | 2022-05-24 |
| 12 | 关于招商中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金规模控制的公告 | 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 | 2022-05-25 |
| 13 | 关于招商中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金暂停申购业务的公告 | 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 | 2022-05-31 |
| 14 | 招商基金管理有限公司关于养老金客户通过直销柜台申购旗下基金开展费率优惠活动的公告 | 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 | 2022-06-09 |
| 15 | 关于暂停招商中证同业存单 AAA 指数 7 天持 | 证券时报、基金管理 | 2022-06-23 |

| | | | |
|----|--|----------------------------|------------|
| | 有期证券投资基金大额申购(含定期定额投资)业务的公告 | 人网站及中国证监会基金电子披露网站 | |
| 16 | 关于恢复招商中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金大额申购(含定期定额投资)业务的公告 | 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 | 2022-06-29 |

§ 11 备查文件目录

11.1 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中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金设立的文件；
- 3、《招商中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金合同》；
- 4、《招商中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金托管协议》；
- 5、《招商中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期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。

11.2 存放地点

招商基金管理有限公司

地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

11.3 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，或在营业时间内到招商基金管理有限公司查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人招商基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-887-9555

网址：<http://www.cmfchina.com>

招商基金管理有限公司

2022 年 8 月 30 日