

# 招商安凯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：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通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 3 月 3 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.....                | 9  |
| 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.....               | 10 |
| §5 托管人报告.....                                | 10 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....                  | 10 |
| 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..... | 10 |
| 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.....                                 | 12 |
| 6.3 净资产（基金净值）变动表.....                        | 13 |
| 6.4 报表附注.....                                | 14 |
| §7 投资组合报告.....                               | 38 |
| 7.1 期末基金资产组合情况.....                          | 38 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....                    | 38 |
| 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.....       | 39 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                     | 41 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                    | 42 |
| 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.....      | 43 |
| 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.....   | 43 |
| 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.....   | 43 |
| 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.....      | 43 |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....                     | 43 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....               | 43 |

|                                         |    |
|-----------------------------------------|----|
| 7.12 投资组合报告附注.....                      | 44 |
| §8 基金份额持有人信息.....                       | 46 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....              | 46 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....           | 46 |
| 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.....   | 46 |
| §9 开放式基金份额变动.....                       | 46 |
| §10 重大事件揭示.....                         | 46 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议.....                   | 47 |
| 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.....   | 47 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....        | 47 |
| 10.4 基金投资策略的改变.....                     | 47 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....              | 47 |
| 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.....      | 47 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....             | 47 |
| 10.8 其他重大事件.....                        | 48 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息.....                 | 49 |
| 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..... | 49 |
| §12 备查文件目录.....                         | 49 |
| 12.1 存放地点.....                          | 50 |
| 12.2 查阅方式.....                          | 50 |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                    |
|------------|--------------------|
| 基金名称       | 招商安凯债券型证券投资基金      |
| 基金简称       | 招商安凯债券             |
| 基金主代码      | 017556             |
| 交易代码       | 017556             |
| 基金运作方式     | 契约型开放式             |
| 基金合同生效日    | 2023 年 3 月 3 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 | 1,600,185,837.94 份 |
| 基金合同存续期    | 不定期                |

### 2.2 基金产品说明

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                            |
|--------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 在保持资产流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，合理配置债券等固定收益类资产和权益类资产，在严格控制风险的前提下，追求基金资产的长期稳健增值。                                                                                                                                                                                                   |
| 投资策略   | 本基金在合同约定的范围内实施稳健的整体资产配置，通过对国内外宏观经济状况、证券市场走势、市场利率走势以及市场资金供求情况、信用风险情况、风险预算和有关法律法规等因素的综合分析，预测各类资产在长、中、短期内的风险收益特征，进而进行合理资产配置。<br>本基金其它投资策略包括：债券投资策略、股票投资策略、港股投资策略、国债期货投资策略、存托凭证投资策略。                                                                                           |
| 业绩比较基准 | 中债综合（全价）指数收益率×85%+沪深 300 指数收益率×10%+恒生综合指数收益率（经汇率调整后）×5%                                                                                                                                                                                                                    |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金。<br>本基金资产投资于港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险（港股市场实行 T+0 回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股股价可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动）、汇率风险（汇率波动可能对基金的投资收益造成损失）、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险（在内地开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险）等。 |

### 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                     |
|         | 联系电话              | 0755-83196666           |
|         | 电子邮箱              | cmf@cmfchina.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      | 证券日报                                                          |
| 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 3 月 3 日 - 2023 年 6 月 30 日) |
| 本期已实现收益       | 18,312,865.54                         |
| 本期利润          | 15,757,634.53                         |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0093                                |
| 本期加权平均净值利润率   | 0.92%                                 |
| 本期基金份额净值增长率   | 0.99%                                 |
| 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      | 15,837,559.11                         |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0099                                |
| 期末基金资产净值      | 1,616,023,397.05                      |
| 期末基金份额净值      | 1.0099                                |
| 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   | 0.99%                                 |

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

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

3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数；

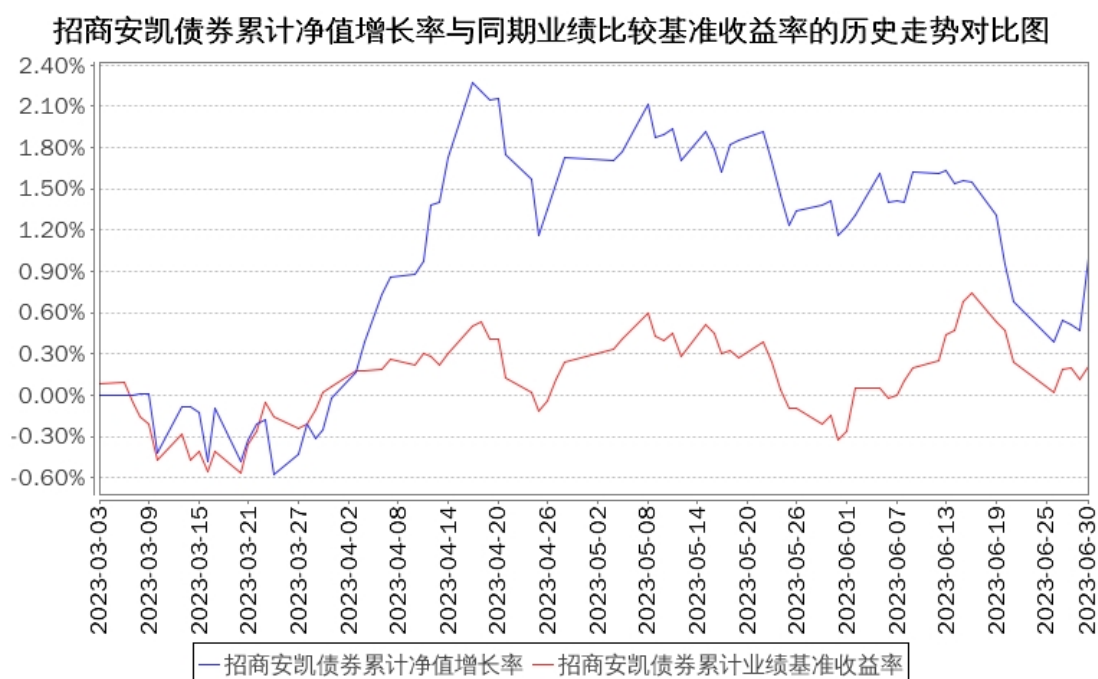
4、本基金合同于 2023 年 3 月 3 日生效，截至本报告期末成立未满半年。

## 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%   | 0.21%       | 0.54%      | 0.14%         | -0.71% | 0.07% |
| 过去三个月      | 1.01%    | 0.21%       | 0.15%      | 0.13%         | 0.86%  | 0.08% |
| 自基金合同生效起至今 | 0.99%    | 0.22%       | 0.21%      | 0.13%         | 0.78%  | 0.09% |

### 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



注：本基金合同于 2023 年 3 月 3 日生效，截至本报告期末基金成立未满一年；自基金成立日起 6 个月内为建仓期，截至报告期末基金建仓期尚未结束。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

招商基金管理有限公司于 2002 年 12 月 27 日经中国证监会【2002】100 号文批准设立。目前，公司注册资本为人民币 13.1 亿元，招商银行股份有限公司持有公司全部股权的 55%，招商证券股份有限公司持有公司全部股权的 45%。

招商基金管理有限公司首批获得企业年金基金投资管理人资格、基本养老保险基金投资管理人资格；2004 年获得全国社保基金投资管理人资格；同时拥有合格境内机构投资者（QDII）业务资格、专户理财（特定客户资产管理业务）资格、公募基金投顾业务资格，在主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、海外投资、FOF 投资等领域全面布局。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务      | 任本基金的基金经理（助理）期限 |      | 证券从业年限 | 说明                                                                                                                                                                                                      |
|----|---------|-----------------|------|--------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    |         | 任职日期            | 离任日期 |        |                                                                                                                                                                                                         |
| 蔡振 | 本基金基金经理 | 2023 年 3 月 3 日  | -    | 8      | 男，硕士。2014 年 7 月加入招商基金管理有限公司量化投资部，曾任 ETF 专员、研究员，主要从事量化投资策略的研究，现任招商安凯债券型证券投资基金、招商安盈债券型证券投资基金、招商中证 1000 指数增强型证券投资基金、招商安福 1 年定期开放债券型发起式证券投资基金、招商安嘉债券型证券投资基金、招商中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、招商安凯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

2023 年上半年股票整体上涨，板块分化大，万得全 A 上涨 3.06%，上证指数上涨 3.65%，创业板指下跌 5.61%。一季度受到消费复苏，房地产销售回暖等影响，股票走势稳中向好，二季度随着房地产销售开始下滑，科技创新成为市场主线。股票的操作是：坚持价值投资为核心，提高对现金流的重视度，不追逐热点，在没有更好投资机会时尽可能减少无效交易。

2023 年上半年债券市场先跌后涨，随着居民储蓄规模和理财规模的不断扩大，债券市场收益率稳步下行，组合在报告期内通过拉长组合久期和提高组合杠杆来提高组合收益率。我们对转债的配置维持在一个较低的位置，配置债券更看重企业的基本面质地，在追求稳定的基础上通过拉长久期提升弹性。

#### 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 0.99%，同期业绩基准增长率为 0.21%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2023 年下半年，将继续实施积极的财政政策和稳健的货币政策，积极扩大内需，大力推动现代化产业体系建设，对于经济形成有力支撑。

股票市场方面：在 TMT 板块分化后，市场基本没有形成一致预期的投资主线，市场波动率明显下降，下半年可能存在波动率放大的机会，看好权益市场下半年的投资回报。

债券市场方面：由于上半年债券的赚钱效应很好，下半年机构有强烈的止盈冲动，叠加经济预期稳中向好，可以阶段性的降低杠杆和久期，为利率调整后的加仓做准备。

#### 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安凯债券型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：招商安凯债券型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产       | 附注号     | 本期末 2023 年 6 月 30 日 |
|----------|---------|---------------------|
| 资产：      |         |                     |
| 银行存款     | 6.4.7.1 | 11,666,229.69       |
| 结算备付金    |         | 1,711,312.05        |
| 存出保证金    |         | 60,432.48           |
| 交易性金融资产  | 6.4.7.2 | 1,627,130,502.97    |
| 其中：股票投资  |         | 324,985,222.08      |
| 基金投资     |         | -                   |
| 债券投资     |         | 1,302,145,280.89    |
| 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     |         | 1,661,038.18        |
| 应收申购款    |         | -                   |
| 递延所得税资产  |         | -                   |
| 其他资产     | 6.4.7.5 | -                   |
| 资产总计     |         | 1,642,229,515.37    |
| 负债和净资产   | 附注号     | 本期末 2023 年 6 月 30 日 |
| 负债：      |         |                     |

|           |         |                  |
|-----------|---------|------------------|
| 短期借款      |         | -                |
| 交易性金融负债   |         | -                |
| 衍生金融负债    | 6.4.7.3 | -                |
| 卖出回购金融资产款 |         | 25,008,712.32    |
| 应付清算款     |         | 479,573.09       |
| 应付赎回款     |         | -                |
| 应付管理人报酬   |         | 465,700.09       |
| 应付托管费     |         | 133,057.18       |
| 应付销售服务费   |         | -                |
| 应付投资顾问费   |         | -                |
| 应交税费      |         | 16,326.58        |
| 应付利润      |         | -                |
| 递延所得税负债   |         | -                |
| 其他负债      | 6.4.7.6 | 102,749.06       |
| 负债合计      |         | 26,206,118.32    |
| 净资产：      |         |                  |
| 实收基金      | 6.4.7.7 | 1,600,185,837.94 |
| 其他综合收益    |         | -                |
| 未分配利润     | 6.4.7.8 | 15,837,559.11    |
| 净资产合计     |         | 1,616,023,397.05 |
| 负债和净资产总计  |         | 1,642,229,515.37 |

注：1. 报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0099 元，基金份额总额 1,600,185,837.94 份；

2. 本财务报表的实际编制期间为 2023 年 3 月 3 日(基金合同生效日)至 2023 年 6 月 30 日止期间。

## 6.2 利润表

会计主体：招商安凯债券型证券投资基金

本报告期：2023 年 3 月 3 日(基金合同生效日)至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目         | 附注号     | 本期 2023 年 3 月 3 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日 |
|------------|---------|---------------------------------------------|
| 一、营业总收入    |         | 18,405,102.90                               |
| 1.利息收入     |         | 3,626,330.10                                |
| 其中：存款利息收入  | 6.4.7.9 | 2,460,689.29                                |
| 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 |         | 1,165,640.81                                |

|                           |            |               |
|---------------------------|------------|---------------|
| 证券出借利息收入                  |            | -             |
| 其他利息收入                    |            | -             |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）          |            | 17,334,003.81 |
| 其中：股票投资收益                 | 6.4.7.10   | 1,584,973.32  |
| 基金投资收益                    |            | -             |
| 债券投资收益                    | 6.4.7.11   | 8,996,431.55  |
| 资产支持证券投资收<br>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   | 6,752,598.94  |
| 以摊余成本计量的金<br>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<br>“-”号填列） | 6.4.7.16   | -2,555,231.01 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号<br>填列）     |            | -             |
| 5.其他收入（损失以“-”号填<br>列）     | 6.4.7.17   | -             |
| 减：二、营业总支出                 |            | 2,647,468.37  |
| 1.管理人报酬                   | 6.4.10.2.1 | 1,926,383.04  |
| 2.托管费                     | 6.4.10.2.2 | 550,395.13    |
| 3.销售服务费                   |            | -             |
| 4.投资顾问费                   |            | -             |
| 5.利息支出                    |            | 132,485.57    |
| 其中：卖出回购金融资产支出             |            | 132,485.57    |
| 6.信用减值损失                  | 6.4.7.18   | -             |
| 7.税金及附加                   |            | 4,408.34      |
| 8.其他费用                    | 6.4.7.19   | 33,796.29     |
| 三、利润总额（亏损总额以<br>“-”号填列）   |            | 15,757,634.53 |
| 减：所得税费用                   |            | -             |
| 四、净利润（净亏损以“-”<br>号填列）     |            | 15,757,634.53 |
| 五、其他综合收益的税后净额             |            | -             |
| 六、综合收益总额                  |            | 15,757,634.53 |

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：招商安凯债券型证券投资基金

本报告期：2023 年 3 月 3 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                       | 本期 2023 年 3 月 3 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日 |        |               |                   |
|------------------------------------------|---------------------------------------------|--------|---------------|-------------------|
|                                          | 实收基金                                        | 其他综合收益 | 未分配利润         | 净资产合计             |
| 一、上期期末净资产（基金净值）                          | -                                           | -      | -             | -                 |
| 加：会计政策变更                                 | -                                           | -      | -             | -                 |
| 前期差错更正                                   | -                                           | -      | -             | -                 |
| 其他                                       | -                                           | -      | -             | -                 |
| 二、本期期初净资产（基金净值）                          | 2,735,066,085.35                            | -      | -             | 2,735,066,085.35  |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | -1,134,880,247.41                           | -      | 15,837,559.11 | -1,119,042,688.30 |
| （一）、综合收益总额                               | -                                           | -      | 15,757,634.53 | 15,757,634.53     |
| （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）      | -1,134,880,247.41                           | -      | 79,924.58     | -1,134,800,322.83 |
| 其中：1.基金申购款                               | 500,124,951.52                              | -      | 50,002.01     | 500,174,953.53    |
| 2.基金赎回款                                  | -1,635,005,198.93                           | -      | 29,922.57     | -1,634,975,276.36 |
| （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）                          | 1,600,185,837.94                            | -      | 15,837,559.11 | 1,616,023,397.05  |

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

招商安凯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》、《招商安凯债券型证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规的规定,经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2022]3028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2,735,066,085.35份,经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了编号为德师报(验)字(23)第00067号验资报告。《招商安凯债券型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)于2023年3月3日正式生效。本基金的基

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，包括国内依法发行上市的股票和存托凭证（包括主板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票和存托凭证）、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的香港证券市场股票（以下简称“港股通标的股票”）、债券（含国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债及其他中国证监会允许基金投资的债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、货币市场工具、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%；本基金投资于股票和存托凭证、可交换债券、可转换债券的比例不高于基金资产的 20%，投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%。每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例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。国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律规或监管机构的规定执行。本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股通标的股票或选择不将基金资产投资于港股通标的股票，基金资产并非必然投资港股通标的股票。如果法律法规对基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，待履行相应程序后，以变更后的规定为准。

本基金业绩比较基准为：中债综合（全价）指数收益率×85%+沪深 300 指数收益率×10%+恒生综合指数收益率（经汇率调整后）×5%。

#### 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 3 月 3 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。



## 6.4.4 重要会计政策和会计估计

### 6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为自 2023 年 3 月 3 日(基金合同生效日)至 2023 年 6 月 30 日止期间。

### 6.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

#### 1) 金融资产的分类

根据本基金的金融资产业务模式和金融资产的合同现金流量特征，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产，暂无金融资产划分为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

金融资产的合同条款规定在特定日期产生的现金流量仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付，且本基金管理该金融资产业务模式是以收取合同现金流量为目标，则本基金将该金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产。此类金融资产主要包括货币资金、各类应收款项、买入返售金融资产等。

不符合分类为以摊余成本计量的金融资产以及公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产条件的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产计入“衍生金融资产”外，其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产计入“交易性金融资产”。

#### 2) 金融负债的分类

本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。对于以常规方式购买或出售金融资产的，在交易日确认将收到的资产和为此将承担的负债，或者在交易日终止确认已出售的资产。金融资产和金融负债在初始确认时以公允价值计量。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额；支付的价款中包

含已宣告但尚未发放的现金股利或债券或资产支持证券已到付息期但尚未领取的利息，单独确认为应收项目。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，公允价值变动形成的利得或损失以及与该金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益。以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，发生减值或终止确认产生的利得或损失，计入当期损益。

本基金对分类为以摊余成本计量的金融资产以预期信用损失为基础确认损失准备。除购买或源生的已发生信用减值的金融资产外，本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后的变动情况。若该金融工具的信用风险自初始确认后已显著增加，本基金按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备；若该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加，本基金按照相当于该金融工具未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备。信用损失准备的增加或转回金额，作为减值损失或利得计入当期损益。

本基金在上一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形的，本基金在当期资产负债表日按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

本基金利用可获得的合理且有依据的前瞻性信息，通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止、该金融资产已转移且其所有权上几乎所有的风险和报酬已转移或虽然既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是未保留对该金融资产的控制，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。若本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有风险和报酬，且保留了对该金融资产控制的，则按照其继续涉入被转移金融资产的程度继续确认该被转移金融资产，并相应确认相关负债。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价（包括转出的非现金资产或承担的新金融负债）之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本与相关交易费用的差额确认。

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。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额确认，由上市公司代扣代缴的个人所得税于卖出交易日按实际代扣代缴金额确认。

##### 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。

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

#### 6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，与所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 6.4.4.13 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策与计量基础一致。

#### 6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和基金投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

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

2) 对于在发行时明确一定期限限售期的股票,包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等,不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票,根据《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》(中基协发[2017]6号),在估值日按照该通知规定的流通受限股票公允价值计算模型进行估值。

3) 对于证券交易所上市的股票,若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况,根据《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》(中国证监会公告[2017]13号)及《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》(中基协发[2013]13号)相关规定,本基金根据情况决定使用指数收益法、可比公司法、市场价格模型法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

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

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间未发生重大会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期间未发生重大会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

## 6.4.6 税项

根据财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008年9月18日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、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]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]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股票、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) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不计缴企业所得税。

(3) 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司代扣代缴个人所得税；从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。对基金通过港股通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过港股通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(4) 对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10% 的税率缴纳证券(股票)交易印花税，受让方不再缴纳印花税。对于基金通过港股通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目     | 本期末 2023 年 6 月 30 日 |
|--------|---------------------|
| 活期存款   | 11,666,229.69       |
| 等于：本金  | 11,664,216.90       |
| 加：应计利息 | 2,012.79            |

|                |               |
|----------------|---------------|
| 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             | 11,666,229.69 |

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末 2023 年 6 月 30 日 |                  |                  |                  |              |
|---------------|---------------------|------------------|------------------|------------------|--------------|
|               | 成本                  | 应计利息             | 公允价值             | 公允价值变动           |              |
| 股票            | 336,506,416.23      | -                | 324,985,222.08   | -11,521,194.15   |              |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                   | -                | -                | -                |              |
| 债券            | 交易所市场               | 329,812,940.54   | 5,197,785.80     | 336,899,355.80   | 1,888,629.46 |
|               | 银行间市场               | 945,082,666.32   | 13,085,925.09    | 965,245,925.09   | 7,077,333.68 |
|               | 合计                  | 1,274,895,606.86 | 18,283,710.89    | 1,302,145,280.89 | 8,965,963.14 |
| 资产支持证券        | -                   | -                | -                | -                |              |
| 基金            | -                   | -                | -                | -                |              |
| 其他            | -                   | -                | -                | -                |              |
| 合计            | 1,611,402,023.09    | 18,283,710.89    | 1,627,130,502.97 | -2,555,231.01    |              |

#### 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 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      | 86,237.21           |
| 其中：交易所市场    | 76,725.56           |
| 银行间市场       | 9,511.65            |
| 应付利息        | -                   |
| 预提费用        | 16,511.85           |
| 合计          | 102,749.06          |

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目             | 本期 2023 年 3 月 3 日(基金合同生效日)至 2023 年 6 月 30 日 |                   |
|----------------|---------------------------------------------|-------------------|
|                | 基金份额 (份)                                    | 账面金额              |
| 基金合同生效日        | 2,735,066,085.35                            | 2,735,066,085.35  |
| 本期申购           | 500,124,951.52                              | 500,124,951.52    |
| 本期赎回 (以“-”号填列) | -1,635,005,198.93                           | -1,635,005,198.93 |
| 基金份额折算变动份额     | -                                           | -                 |
| 本期末            | 1,600,185,837.94                            | 1,600,185,837.94  |

注：1、本期申购含红利再投、转换入份（金）额，本期赎回含转换出份（金）额。

2、本基金自 2023 年 2 月 20 日至 2023 年 3 月 1 日止期间公开发售，有效净认购金额人民币 2,735,066,083.06 元，折算为 2,735,066,083.06 份基金份额。根据《招商安凯债券型证券投资基金基金合同》的规定，经本基金注册登记人计算并确认，本基金认购资金在募集期内产生的利息人民币 2.29 元，折算为 2.29 份基金份额，划入基金持有人账户，两者合计 2,735,066,085.35 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           | 18,312,865.54 | -2,555,231.01 | 15,757,634.53 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -110,021.79   | 189,946.37    | 79,924.58     |
| 其中：基金申购款       | 50,002.01     | -             | 50,002.01     |

|         |               |               |               |
|---------|---------------|---------------|---------------|
| 基金赎回款   | -160,023.80   | 189,946.37    | 29,922.57     |
| 本期已分配利润 | -             | -             | -             |
| 本期末     | 18,202,843.75 | -2,365,284.64 | 15,837,559.11 |

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期 2023 年 3 月 3 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 563,430.00                                  |
| 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 | 1,896,929.46                                |
| 其他        | 329.83                                      |
| 合计        | 2,460,689.29                                |

#### 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

单位：人民币元

| 项目               | 本期 2023 年 3 月 3 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日 |
|------------------|---------------------------------------------|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | 1,584,973.32                                |
| 股票投资收益——赎回差价收入   | -                                           |
| 股票投资收益——申购差价收入   | -                                           |
| 股票投资收益——证券出借差价收入 | -                                           |
| 合计               | 1,584,973.32                                |

##### 6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目         | 本期 2023 年 3 月 3 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 49,954,663.56                               |
| 减：卖出股票成本总额 | 47,634,161.58                               |
| 减：交易费用     | 735,528.66                                  |
| 买卖股票差价收入   | 1,584,973.32                                |

##### 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 2023 年 3 月 3 日（基金合同生效日）<br>至 2023 年 6 月 30 日 |
|-------------------------------|-------------------------------------------------|
| 债券投资收益——利息收入                  | 8,634,499.05                                    |
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入 | 361,932.50                                      |
| 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                            | 8,996,431.55                                    |

#### 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 2023 年 3 月 3 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日 |
|-------------------------|---------------------------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额   | 101,198,706.86                              |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 100,040,790.00                              |
| 减：应计利息总额                | 785,946.86                                  |
| 减：交易费用                  | 10,037.50                                   |
| 买卖债券差价收入                | 361,932.50                                  |

#### 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

单位：人民币元

| 项目            | 本期 2023 年 3 月 3 日（基金合同生效日）<br>至 2023 年 6 月 30 日 |
|---------------|-------------------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 6,752,598.94                                    |
| 其中：证券出借权益补偿收入 | -                                               |
| 基金投资产生的股利收益   | -                                               |
| 合计            | 6,752,598.94                                    |

### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期 2023 年 3 月 3 日（基金合同生效日）至 2023 年 6<br>月 30 日 |
|------------|------------------------------------------------|
| 1.交易性金融资产  | -2,555,231.01                                  |
| ——股票投资     | -11,521,194.15                                 |
| ——债券投资     | 8,965,963.14                                   |
| ——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                     | -2,555,231.01 |

#### 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 2023 年 3 月 3 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------------|
| 审计费用    | 16,511.85                                   |
| 信息披露费   | -                                           |
| 证券出借违约金 | -                                           |
| 证券组合费   | 3,838.32                                    |
| 银行费用    | 13,046.12                                   |
| 其他      | 400.00                                      |
| 合计      | 33,796.29                                   |

### 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

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2023 年 3 月 3 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日 |              |
|-------|---------------------------------------------|--------------|
|       | 成交金额                                        | 占当期股票成交总额的比例 |
| 招商证券  | 434,095,241.37                              | 100.00%      |

#### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2023 年 3 月 3 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日 |              |
|-------|---------------------------------------------|--------------|
|       | 成交金额                                        | 占当期债券成交总额的比例 |
| 招商证券  | 308,964,077.00                              | 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 2023 年 3 月 3 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日 |                |
|-------|---------------------------------------------|----------------|
|       | 成交金额                                        | 占当期债券回购成交总额的比例 |
| 招商证券  | 2,631,335,000.00                            | 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

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2023 年 3 月 3 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日 |            |           |              |
|-------|---------------------------------------------|------------|-----------|--------------|
|       | 当期佣金                                        | 占当期佣金总量的比例 | 期末应付佣金余额  | 占期末应付佣金总额的比例 |
| 招商证券  | 374,308.17                                  | 100.00%    | 76,725.56 | 100.00%      |

注：1、本基金与关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立；

2、基金对该类交易的佣金的计算方式是按合同约定的佣金率计算。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供研究成果和市场信息等证券综合服务，并不收取额外对价。

### 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 3 月 3 日（基金合同生效日）至<br>2023 年 6 月 30 日 |
|-----------------|------------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 1,926,383.04                                   |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 17,837.08                                      |
| 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×0.35%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：

$$\text{日基金管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.35\% \div \text{当年天数}$$

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期 2023 年 3 月 3 日（基金合同生效日）至<br>2023 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 550,395.13                                     |

注：支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值×0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

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

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期内无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

#### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称   | 本期 2023 年 3 月 3 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日 |            |
|---------|---------------------------------------------|------------|
|         | 期末余额                                        | 当期利息收入     |
| 交通银行-活期 | 11,666,229.69                               | 563,430.00 |

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（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

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 25,008,712.32 元，在 2023 年 7 月 3 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理



本基金为债券型基金，本基金的运作涉及的金融工具主要包括债券投资、资产支持证券投资等。与这些金融工具有关的风险，以及本基金的基金管理人管理这些风险所采取的风险管理政策如下所述。

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人从事风险管理的目标是提升本基金风险调整后收益水平，保证本基金的基金资产安全，维护基金份额持有人利益。基于该风险管理目标，本基金的基金管理人风险管理的基本策略是识别和分析本基金运作时本基金面临各种类型的风险，确定适当的风险容忍度，并及时可靠地对各种风险进行监督，将风险控制在限定的范围之内。本基金目前面临的主要风险包括：市场风险、信用风险和流动性风险。

本基金的基金管理人建立了以全面、独立、互相制约以及定性和定量相结合为原则的，监事会、董事会及下设风险控制委员会、督察长、风险管理委员会、法律合规部和风险管理部等多层次的风险管理组织架构体系。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指金融工具的一方到期无法履行约定义务致使本基金遭受损失的风险。本基金的信用风险主要存在于银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资、资产支持证券投资及其他。

本基金的银行存款存放于本基金的基金托管人，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在证券交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并采用券款对付交割方式，以控制相应的信用风险。

对于与债券投资、资产支持证券投资等投资品种相关的信用风险，本基金的基金管理人通过对投资品种的信用等级评估来选择适当的投资对象，并限制单个投资品种的持有比例来管理信用风险。附注 6.4.13.2.1 至 6.4.13.2.6 列示了本基金所持有的债券投资及资产支持证券投资的信用评级，该信用评级不包括本基金所持有的国债、央行票据、政策性金融债。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 |
|--------|---------------------|
| A-1    | -                   |
| A-1 以下 | -                   |
| 未评级    | 10,058,504.11       |
| 合计     | 10,058,504.11       |

注：上述评级均由经中国证监会核准从事证券市场资信评级业务的评级机构做出。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 |
|--------|---------------------|
| AAA    | 856,295,474.59      |
| AAA 以下 | -                   |
| 未评级    | 86,181,606.57       |
| 合计     | 942,477,081.16      |

注：上述评级均由经中国证监会核准从事证券市场资信评级业务的评级机构做出。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

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

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

### 6.4.13.3 流动性风险

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金流动性风险来源于基金约定开放日兑付赎回资金的流动性风险，以及因部分投资品种交易不活跃而出现的变现风险以及因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理价格变现投资的风险。本基金所持有的金融资产主要在证券交易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                | 11,666,229.69  | -                | -             | -              | 11,666,229.69    |
| 结算备付金               | 1,711,312.05   | -                | -             | -              | 1,711,312.05     |
| 存出保证金               | 60,432.48      | -                | -             | -              | 60,432.48        |
| 交易性金融资产             | 142,336,050.84 | 1,075,459,198.66 | 84,350,031.39 | 324,985,222.08 | 1,627,130,502.97 |
| 衍生金融资产              | -              | -                | -             | -              | -                |
| 买入返售金融资产            | -              | -                | -             | -              | -                |
| 债权投资                | -              | -                | -             | -              | -                |
| 应收股利                | -              | -                | -             | 1,661,038.18   | 1,661,038.18     |
| 应收申购款               | -              | -                | -             | -              | -                |
| 应收清算款               | -              | -                | -             | -              | -                |
| 其他资产                | -              | -                | -             | -              | -                |
| 资产总计                | 155,774,025.06 | 1,075,459,198.66 | 84,350,031.39 | 326,646,260.26 | 1,642,229,515.37 |
| 负债                  |                |                  |               |                |                  |
| 应付赎回款               | -              | -                | -             | -              | -                |
| 应付管理人报酬             | -              | -                | -             | 465,700.09     | 465,700.09       |
| 应付托管费               | -              | -                | -             | 133,057.18     | 133,057.18       |
| 应付清算款               | -              | -                | -             | 479,573.09     | 479,573.09       |
| 卖出回购金融资产款           | 25,008,712.32  | -                | -             | -              | 25,008,712.32    |
| 应付销售服务费             | -              | -                | -             | -              | -                |
| 应付投资顾问费             | -              | -                | -             | -              | -                |
| 应付利润                | -              | -                | -             | -              | -                |
| 应交税费                | -              | -                | -             | 16,326.58      | 16,326.58        |
| 其他负债                | -              | -                | -             | 102,749.06     | 102,749.06       |

|         |                |                  |               |                |                  |
|---------|----------------|------------------|---------------|----------------|------------------|
| 负债总计    | 25,008,712.32  | -                | -             | 1,197,406.00   | 26,206,118.32    |
| 利率敏感度缺口 | 130,765,312.74 | 1,075,459,198.66 | 84,350,031.39 | 325,448,854.26 | 1,616,023,397.05 |

注：上表按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

|    |                       |                             |
|----|-----------------------|-----------------------------|
| 假设 | 1.若市场利率平行上升或下降 50 个基点 |                             |
|    | 2.其他市场变量保持不变          |                             |
|    | 3.仅存在公允价值变动对基金资产净值的影响 |                             |
| 分析 | 相关风险变量的变动             | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |
|    |                       | 本期末（2023 年 6 月 30 日）        |
|    | 1. 市场利率平行上升 50 个基点    | -17,000,969.08              |
|    | 2. 市场利率平行下降 50 个基点    | 17,339,307.50               |

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

| 项目       | 本期末 2023 年 6 月 30 日 |                |         |         |           | 合计             |
|----------|---------------------|----------------|---------|---------|-----------|----------------|
|          | 美元折合人民币             | 港币折合人民币        | 欧元折合人民币 | 日元折合人民币 | 其他币种折合人民币 |                |
| 以外币计价的资产 |                     |                |         |         |           |                |
| 银行存款     | -                   | -              | -       | -       | -         | -              |
| 结算备付金    | -                   | -              | -       | -       | -         | -              |
| 存出保证金    | -                   | -              | -       | -       | -         | -              |
| 交易性金融资产  | -                   | 160,924,871.15 | -       | -       | -         | 160,924,871.15 |
| 衍生金融资产   | -                   | -              | -       | -       | -         | -              |
| 债权投资     | -                   | -              | -       | -       | -         | -              |
| 应收股利     | -                   | 1,661,038.18   | -       | -       | -         | 1,661,038.18   |
| 应收申购款    | -                   | -              | -       | -       | -         | -              |
| 应收清算款    | -                   | -              | -       | -       | -         | -              |
| 其他资产     | -                   | -              | -       | -       | -         | -              |
| 资产合计     | -                   | 162,585,909.33 | -       | -       | -         | 162,585,909.33 |
| 以外币计价的负债 |                     |                |         |         |           |                |
| 应付清算款    | -                   | -              | -       | -       | -         | -              |

|                   |   |                |   |   |   |                |
|-------------------|---|----------------|---|---|---|----------------|
| 应付赎回款             | - | -              | - | - | - | -              |
| 应付管理人报酬           | - | -              | - | - | - | -              |
| 应付托管费             | - | -              | - | - | - | -              |
| 应付销售服务费           | - | -              | - | - | - | -              |
| 应付投资顾问费           | - | -              | - | - | - | -              |
| 其他负债              | - | -              | - | - | - | -              |
| 负债合计              | - | -              | - | - | - | -              |
| 资产负债表<br>外汇风险敞口净额 | - | 162,585,909.33 | - | - | - | 162,585,909.33 |

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

| 假设 | 除汇率以外的其他市场变量保持不变 |                             |
|----|------------------|-----------------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动        | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |
|    |                  | 本期末（2023年6月30日）             |
|    | 1. 所有外币相对人民币升值5% | 8,129,295.47                |
|    | 2. 所有外币相对人民币贬值5% | -8,129,295.47               |

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指以交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险，该风险可能与特定投资品种相关，也有可能与其他投资品种相关。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的债券，其他价格风险对于本基金的基金净值无重大影响。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期末 2023 年 6 月 30 日 |              |
|---------------|---------------------|--------------|
|               | 公允价值                | 占基金资产净值比例（%） |
| 交易性金融资产-股票投资  | 324,985,222.08      | 20.11        |
| 交易性金融资产-基金投资  | -                   | -            |
| 交易性金融资产-贵金属投资 | -                   | -            |
| 衍生金融资产-权证投资   | -                   | -            |
| 其他            | -                   | -            |
| 合计            | 324,985,222.08      | 20.11        |

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

|    |                              |                             |
|----|------------------------------|-----------------------------|
| 假设 | 1.若对市场价格敏感的权益性投资的市场价格上升或下降5% |                             |
|    | 2.其他市场变量保持不变                 |                             |
| 分析 | 相关风险变量的变动                    | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |
|    |                              | 本期末（2023年6月30日）             |
|    | 1. 权益性投资的市场价格上升 5%           | 16,249,261.10               |
|    | 2. 权益性投资的市场价格下降 5%           | -16,249,261.10              |

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 |
|---------------|---------------------|
| 第一层次          | 324,985,222.08      |
| 第二层次          | 1,302,145,280.89    |
| 第三层次          | -                   |
| 合计            | 1,627,130,502.97    |

###### 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              | 324,985,222.08   | 19.79        |
|    | 其中：股票             | 324,985,222.08   | 19.79        |
| 2  | 基金投资              | -                | -            |
| 3  | 固定收益投资            | 1,302,145,280.89 | 79.29        |
|    | 其中：债券             | 1,302,145,280.89 | 79.29        |
|    | 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      | 13,377,541.74    | 0.81         |
| 8  | 其他资产              | 1,721,470.66     | 0.10         |
| 9  | 合计                | 1,642,229,515.37 | 100.00       |

注：上表权益投资中通过港股通交易机制投资的港股金额人民币 160,924,871.15 元，占基金净值比例 9.96%。

### 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

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|---------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -             | -            |
| B  | 采矿业              | 41,816,417.00 | 2.59         |
| C  | 制造业              | 55,513,240.50 | 3.44         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 44,535,088.93 | 2.76         |
| E  | 建筑业              | -             | -            |

|   |                 |                |       |
|---|-----------------|----------------|-------|
| F | 批发和零售业          | 11,920,597.50  | 0.74  |
| G | 交通运输、仓储和邮政业     | 9,794,673.00   | 0.61  |
| H | 住宿和餐饮业          | -              | -     |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 480,334.00     | 0.03  |
| J | 金融业             | -              | -     |
| K | 房地产业            | -              | -     |
| L | 租赁和商务服务业        | -              | -     |
| M | 科学研究和技术服务业      | -              | -     |
| N | 水利、环境和公共设施管理业   | -              | -     |
| O | 居民服务、修理和其他服务业   | -              | -     |
| P | 教育              | -              | -     |
| Q | 卫生和社会工作         | -              | -     |
| R | 文化、体育和娱乐业       | -              | -     |
| S | 综合              | -              | -     |
|   | 合计              | 164,060,350.93 | 10.15 |

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

金额单位：人民币元

| 行业类别     | 公允价值（人民币元）     | 占基金资产净值比例（%） |
|----------|----------------|--------------|
| 通信服务     | 87,436,378.97  | 5.41         |
| 非日常生活消费品 | -              | -            |
| 日常消费品    | -              | -            |
| 能源       | 19,065,126.55  | 1.18         |
| 金融       | -              | -            |
| 医疗保健     | 13,162,363.49  | 0.81         |
| 工业       | -              | -            |
| 信息技术     | 33,281,449.64  | 2.06         |
| 原材料      | 2,903,720.69   | 0.18         |
| 房地产      | -              | -            |
| 公用事业     | 5,075,831.81   | 0.31         |
| 合计       | 160,924,871.15 | 9.96         |

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

### 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股）      | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|------------|---------------|--------------|
| 1  | 00762  | 中国联通 | 18,308,000 | 87,436,378.97 | 5.41         |
| 2  | 00981  | 中芯国际 | 1,769,500  | 33,281,449.64 | 2.06         |
| 3  | 601168 | 西部矿业 | 2,046,600  | 21,509,766.00 | 1.33         |
| 4  | 601001 | 晋控煤业 | 2,168,300  | 20,295,288.00 | 1.26         |



|    |        |        |           |               |      |
|----|--------|--------|-----------|---------------|------|
| 5  | 01898  | 中煤能源   | 3,553,000 | 19,065,126.55 | 1.18 |
| 6  | 600420 | 国药现代   | 1,620,500 | 18,295,445.00 | 1.13 |
| 7  | 600795 | 国电电力   | 4,512,300 | 17,282,109.00 | 1.07 |
| 8  | 000598 | 兴蓉环境   | 2,542,136 | 13,803,798.48 | 0.85 |
| 9  | 603883 | 老百姓    | 399,350   | 11,920,597.50 | 0.74 |
| 10 | 000960 | 锡业股份   | 697,900   | 10,852,345.00 | 0.67 |
| 11 | 002422 | 科伦药业   | 326,200   | 9,681,616.00  | 0.60 |
| 12 | 002039 | 黔源电力   | 528,535   | 7,436,487.45  | 0.46 |
| 13 | 00874  | 白云山    | 326,000   | 7,108,373.60  | 0.44 |
| 14 | 603987 | 康德莱    | 514,700   | 6,649,924.00  | 0.41 |
| 15 | 002352 | 顺丰控股   | 114,100   | 5,144,769.00  | 0.32 |
| 16 | 01083  | 港华智慧能源 | 1,582,000 | 5,075,831.81  | 0.31 |
| 17 | 02607  | 上海医药   | 333,600   | 4,773,525.63  | 0.30 |
| 18 | 000429 | 粤高速 A  | 593,100   | 4,649,904.00  | 0.29 |
| 19 | 000657 | 中钨高新   | 433,550   | 4,201,099.50  | 0.26 |
| 20 | 600283 | 钱江水利   | 139,500   | 2,029,725.00  | 0.13 |
| 21 | 000969 | 安泰科技   | 193,200   | 1,829,604.00  | 0.11 |
| 22 | 603053 | 成都燃气   | 168,600   | 1,697,802.00  | 0.11 |
| 23 | 01258  | 中国有色矿业 | 488,000   | 1,664,727.09  | 0.10 |
| 24 | 601139 | 深圳燃气   | 220,500   | 1,607,445.00  | 0.10 |
| 25 | 06821  | 凯莱英    | 15,800    | 1,280,464.26  | 0.08 |
| 26 | 01208  | 五矿资源   | 592,000   | 1,238,993.60  | 0.08 |
| 27 | 603986 | 兆易创新   | 7,500     | 796,875.00    | 0.05 |
| 28 | 603666 | 亿嘉和    | 16,800    | 758,520.00    | 0.05 |
| 29 | 300747 | 锐科激光   | 22,500    | 685,800.00    | 0.04 |
| 30 | 002911 | 佛燃能源   | 52,700    | 677,722.00    | 0.04 |
| 31 | 688002 | 睿创微纳   | 13,500    | 604,800.00    | 0.04 |
| 32 | 688018 | 乐鑫科技   | 3,700     | 480,334.00    | 0.03 |
| 33 | 688012 | 中微公司   | 2,900     | 453,705.00    | 0.03 |
| 34 | 002851 | 麦格米特   | 9,900     | 361,053.00    | 0.02 |
| 35 | 688728 | 格科微    | 20,600    | 325,892.00    | 0.02 |
| 36 | 688798 | 艾为电子   | 280       | 16,562.00     | 0.00 |
| 37 | 600489 | 中金黄金   | 1,100     | 11,363.00     | 0.00 |

## 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码  | 股票名称 | 本期累计买入金额      | 占期末基金资产净值比例（%） |
|----|-------|------|---------------|----------------|
| 1  | 00762 | 中国联通 | 97,486,952.83 | 6.03           |

|    |        |        |               |      |
|----|--------|--------|---------------|------|
| 2  | 00981  | 中芯国际   | 28,986,946.60 | 1.79 |
| 3  | 601001 | 晋控煤业   | 25,409,903.00 | 1.57 |
| 4  | 601168 | 西部矿业   | 22,997,186.02 | 1.42 |
| 5  | 603883 | 老百姓    | 22,363,856.97 | 1.38 |
| 6  | 01898  | 中煤能源   | 19,378,903.59 | 1.20 |
| 7  | 600795 | 国电电力   | 17,726,815.00 | 1.10 |
| 8  | 600420 | 国药现代   | 16,879,465.00 | 1.04 |
| 9  | 01099  | 国药控股   | 15,278,793.16 | 0.95 |
| 10 | 000598 | 兴蓉环境   | 13,229,599.93 | 0.82 |
| 11 | 02607  | 上海医药   | 11,147,643.98 | 0.69 |
| 12 | 601607 | 上海医药   | 558,750.00    | 0.03 |
| 13 | 000960 | 锡业股份   | 9,842,611.81  | 0.61 |
| 14 | 002422 | 科伦药业   | 9,254,756.00  | 0.57 |
| 15 | 002039 | 黔源电力   | 7,598,153.50  | 0.47 |
| 16 | 603987 | 康德莱    | 7,324,540.00  | 0.45 |
| 17 | 00874  | 白云山    | 6,957,270.07  | 0.43 |
| 18 | 01083  | 港华智慧能源 | 6,310,587.38  | 0.39 |
| 19 | 000969 | 安泰科技   | 6,215,198.47  | 0.38 |
| 20 | 002352 | 顺丰控股   | 6,151,999.00  | 0.38 |
| 21 | 00857  | 中国石油股份 | 4,825,498.92  | 0.30 |

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票；

2、基金持有的股票分类为交易性金融资产的，本项的“累计买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称   | 本期累计卖出金额      | 占期末基金资产净值比例（%） |
|----|--------|--------|---------------|----------------|
| 1  | 01099  | 国药控股   | 17,017,132.75 | 1.05           |
| 2  | 02607  | 上海医药   | 6,655,775.95  | 0.41           |
| 3  | 601607 | 上海医药   | 548,783.00    | 0.03           |
| 4  | 603883 | 老百姓    | 6,476,035.00  | 0.40           |
| 5  | 00857  | 中国石油股份 | 4,992,354.59  | 0.31           |
| 6  | 000969 | 安泰科技   | 4,937,767.00  | 0.31           |
| 7  | 00981  | 中芯国际   | 3,216,544.11  | 0.20           |
| 8  | 600283 | 钱江水利   | 1,301,899.00  | 0.08           |
| 9  | 002821 | 凯莱英    | 1,064,227.00  | 0.07           |
| 10 | 01083  | 港华智慧能源 | 660,932.66    | 0.04           |
| 11 | 01208  | 五矿资源   | 653,292.26    | 0.04           |
| 12 | 603986 | 兆易创新   | 627,540.00    | 0.04           |
| 13 | 688798 | 艾为电子   | 526,776.77    | 0.03           |

|    |        |      |            |      |
|----|--------|------|------------|------|
| 14 | 002851 | 麦格米特 | 398,181.00 | 0.02 |
| 15 | 688012 | 中微公司 | 373,450.00 | 0.02 |
| 16 | 688728 | 格科微  | 256,708.71 | 0.02 |
| 17 | 688018 | 乐鑫科技 | 237,914.76 | 0.01 |
| 18 | 600497 | 驰宏锌锗 | 5,863.00   | 0.00 |
| 19 | 002979 | 雷赛智能 | 2,196.00   | 0.00 |
| 20 | 002911 | 佛燃能源 | 1,290.00   | 0.00 |

注：1、卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票；

2、基金持有的股票分类为交易性金融资产的，本项“累计卖出金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

|              |                |
|--------------|----------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 384,140,577.81 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 49,954,663.56  |

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票；

2、“买入股票成本（成交）总额”、“卖出股票收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 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      | 101,741,530.19   | 6.30         |
| 2  | 央行票据      | -                | -            |
| 3  | 金融债券      | 766,818,587.53   | 47.45        |
|    | 其中：政策性金融债 | 247,868,165.43   | 15.34        |
| 4  | 企业债券      | 81,022,692.61    | 5.01         |
| 5  | 企业短期融资券   | -                | -            |
| 6  | 中期票据      | 177,876,851.37   | 11.01        |
| 7  | 可转债（可交换债） | -                | -            |
| 8  | 同业存单      | -                | -            |
| 9  | 其他        | 174,685,619.19   | 10.81        |
| 10 | 合计        | 1,302,145,280.89 | 80.58        |

### 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  | 2128044 | 21 工商银行永续债 02 | 1,000,000 | 103,846,000.00 | 6.43         |
| 2  | 230404  | 23 农发 04      | 800,000   | 81,284,153.01  | 5.03         |
| 3  | 019694  | 23 国债 01      | 803,000   | 81,191,044.00  | 5.02         |
| 4  | 1928023 | 19 农业银行永续债 02 | 500,000   | 52,606,219.18  | 3.26         |
| 5  | 150308  | 15 进出 08      | 500,000   | 52,183,155.74  | 3.23         |

### 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

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

#### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

### 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

报告期内基金投资的前十名证券除 15 进出 08（证券代码 150308）、19 华夏银行永续债（证券代码 1928014）、19 农业银行永续债 02（证券代码 1928023）、21 工商银行永续债 02（证券代码 2128044）、21 农业银行永续债 01（证券代码 2128038）、23 进出 03（证券代码 230303）、23 农发 04（证券代码 230404）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、15 进出 08（证券代码 150308）

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。

#### 2、19 华夏银行永续债（证券代码 1928014）

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。

#### 3、19 农业银行永续债 02（证券代码 1928023）

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。

#### 4、21 工商银行永续债 02（证券代码 2128044）

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。

#### 5、21 农业银行永续债 01（证券代码 2128038）

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、23 进出 03（证券代码 230303）

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。

#### 7、23 农发 04 (证券代码 230404)

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

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。

### 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 | 60,432.48    |
| 2  | 应收清算款 | -            |
| 3  | 应收股利  | 1,661,038.18 |
| 4  | 应收利息  | -            |
| 5  | 应收申购款 | -            |
| 6  | 其他应收款 | -            |
| 7  | 待摊费用  | -            |
| 8  | 其他    | -            |
| 9  | 合计    | 1,721,470.66 |

### 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

本基金本报告期末投资前十名股票中不存在流通受限情况。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数(户) | 户均持有的基金份额    | 持有人结构            |        |            |        |
|----------|--------------|------------------|--------|------------|--------|
|          |              | 机构投资者            |        | 个人投资者      |        |
|          |              | 持有份额             | 占总份额比例 | 持有份额       | 占总份额比例 |
| 220      | 7,273,571.99 | 1,599,950,004.99 | 99.99% | 235,832.95 | 0.01%  |

## 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 | 20,436.52 | 0.0013%  |

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目                             | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 0~10              |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 0                 |

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                                    |                  |
|------------------------------------|------------------|
| 基金合同生效日(2023年3月3日)基金份额总额           | 2,735,066,085.35 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额              | 500,124,951.52   |
| 减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额            | 1,635,005,198.93 |
| 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                       | 1,600,185,837.94 |

## § 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。

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 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 |    |
| 招商证券 | 3      | 434,095,241.37 | 100.00%      | 374,308.17 | 100.00%    | -  |
| 方正证券 | 2      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 华泰证券 | 2      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 中金公司 | 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 |
|------|----------------|--------------|------------------|----------------|------|--------------|
| 招商证券 | 308,964,077.00 | 100.00%      | 2,631,335,000.00 | 100.00%        | -    | -            |
| 方正证券 | -              | -            | -                | -              | -    | -            |
| 华泰证券 | -              | -            | -                | -              | -    | -            |
| 中金公司 | -              | -            | -                | -              | -    | -            |

## 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  | 招商安凯债券型证券投资基金基金份额发售公告                               | 证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2023-02-17 |
| 2  | 招商安凯债券型证券投资基金基金产品资料概要                               | 证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2023-02-17 |
| 3  | 招商基金管理有限公司关于养老金客户通过直销柜台认购旗下招商安凯债券型证券投资基金基金份额费率优惠的公告 | 证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2023-02-17 |
| 4  | 招商安凯债券型证券投资基金招募说明书                                  | 证券日报、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  | 招商安凯债券型证券投资基金托管协议                                   | 证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2023-02-17 |
| 6  | 招商安凯债券型证券投资基金基金合同                                   | 证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2023-02-17 |
| 7  | 招商安凯债券型证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告                        | 证券日报及基金管理人网站               | 2023-02-17 |
| 8  | 关于招商安凯债券型证券投资基金提前结束募集的公告                            | 证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2023-03-02 |
| 9  | 招商安凯债券型证券投资基金基金合同生效公告                               | 证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2023-03-04 |
| 10 | 关于开放招商安凯债券型证券投资基金日常申购赎回及转换和定期定额投资业务的公告              | 证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2023-03-07 |
| 11 | 关于暂停招商安凯债券型证券投资基金个人投资者申购(含定期定额投资)和转换转入业务的           | 证券日报、基金管理人网站及中国证监会         | 2023-03-13 |

|    |                                               |                            |            |
|----|-----------------------------------------------|----------------------------|------------|
|    | 公告                                            | 基金电子披露网站                   |            |
| 12 | 关于暂停招商安凯债券型证券投资基金机构投资者大额申购（含定期定额投资）和转换转入业务的公告 | 证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2023-04-11 |
| 13 | 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                | 证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2023-05-12 |
| 14 | 招商基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告                       | 证券日报、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              | 20230303-20230630        | 1,000,000,000.00 | 499,950,004.99 | -    | 1,499,950,004.99 | 93.74% |

#### 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安凯债券型证券投资基金设立的文件；
- 3、《招商安凯债券型证券投资基金基金合同》；
- 4、《招商安凯债券型证券投资基金托管协议》；
- 5、《招商安凯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