

# 招商现金增值开放式证券投资基金

## 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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§2 基金简介.....	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	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.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	12
§5 托管人报告.....	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
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.....	13
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.....	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
§7 投资组合报告.....	33
7.1 期末基金资产组合情况.....	33
7.2 债券回购融资情况.....	34
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	34
7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明.....	35
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	35
7.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明 细.....	35
7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离.....	36
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明 细.....	36
7.9 投资组合报告附注.....	36
§8 基金份额持有人信息.....	38

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	38
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....	39
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	39
8.4 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.....	39
§9 开放式基金份额变动.....	40
§10 重大事件揭示.....	40
10.1 基金份额持有人大会决议.....	40
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.....	40
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	40
10.4 基金投资策略的改变.....	40
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	40
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.....	40
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	41
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况 .....	41
10.9 其他重大事件.....	41
§11 备查文件目录.....	42
11.1 备查文件目录.....	42
11.2 存放地点.....	42
11.3 查阅方式.....	43

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	招商现金增值开放式证券投资基金	
基金简称	招商现金增值货币	
基金主代码	217004	
交易代码	217004	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2004 年 1 月 14 日	
基金管理人	招商基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	13,954,751,119.46 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	招商现金增值货币 A	招商现金增值货币 B
下属分级基金的交易代码	217004	217014
报告期末下属分级基金的份 额总额	12,578,148,090.40 份	1,376,603,029.06 份

注：本基金 B 类份额自 2009 年 12 月 2 日起存续。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	保持本金的安全性与资产的流动性，追求稳定的当期收益。
投资策略	以严谨的市场价值分析为基础，采用稳健的投资组合策略，通过对短期金融工具的操作，在保持本金的安全性与资产流动性的同时，追求稳定的当期收益。
业绩比较基准	一年期银行定期储蓄存款的税后利率： $(1 - \text{利息税后}) \times \text{一年期银行定期储蓄存款利率}$
风险收益特征	本基金流动性好、安全性高、收益稳定。

### 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	招商银行股份有限公司
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	95555
传真	0755-83196475	0755-83195201
注册地址	深圳市福田区深南大道 7088 号	深圳市深南大道 7088 号招商银 行大厦
办公地址	深圳市福田区深南大道	深圳市深南大道 7088 号招商银

	7088 号	行大厦
邮政编码	518040	518040
法定代表人	王小青	缪建民

## 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

#### 1、招商现金增值货币 A

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日 - 2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	105,173,635.56
本期利润	105,173,635.56
本期净值收益率	0.8434%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末基金资产净值	12,578,148,090.40
期末基金份额净值	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
累计净值收益率	70.9005%

#### 2、招商现金增值货币 B

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日 - 2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	13,983,359.72
本期利润	13,983,359.72
本期净值收益率	0.9635%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末基金资产净值	1,376,603,029.06
期末基金份额净值	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
累计净值收益率	54.0420%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值

变动收益，由于货币市场基金采用摊余成本法核算，所以，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等；

- 2、本基金无持有人认购或交易基金的各项费用；
- 3、本基金收益分配为按日结转份额。

### 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

招商现金增值货币 A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.1360%	0.0003%	0.1250%	0.0000%	0.0110%	0.0003%
过去三个月	0.4280%	0.0006%	0.3792%	0.0000%	0.0488%	0.0006%
过去六个月	0.8434%	0.0006%	0.7542%	0.0000%	0.0892%	0.0006%
过去一年	1.5665%	0.0006%	1.5208%	0.0000%	0.0457%	0.0006%
过去三年	5.5525%	0.0009%	4.5625%	0.0000%	0.9900%	0.0009%
自基金合同生效起至今	70.9005%	0.0039%	42.8142%	0.0021%	28.0863%	0.0018%

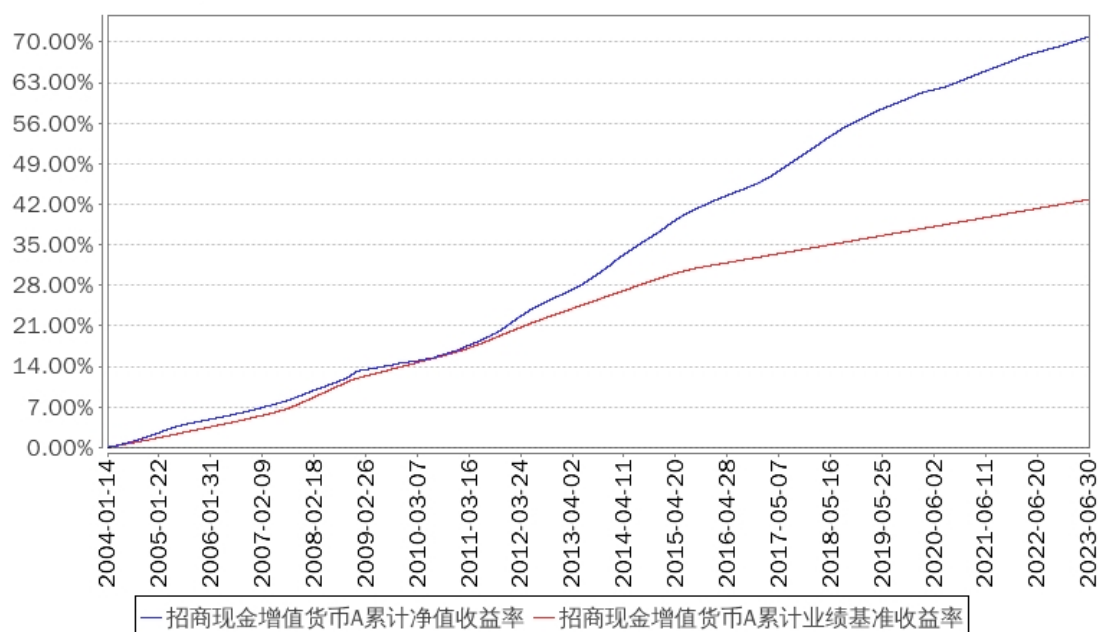
招商现金增值货币 B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.1558%	0.0003%	0.1250%	0.0000%	0.0308%	0.0003%
过去三个月	0.4881%	0.0006%	0.3792%	0.0000%	0.1089%	0.0006%
过去六个月	0.9635%	0.0006%	0.7542%	0.0000%	0.2093%	0.0006%
过去一年	1.8105%	0.0006%	1.5208%	0.0000%	0.2897%	0.0006%
过去三年	6.3150%	0.0009%	4.5625%	0.0000%	1.7525%	0.0009%
自基金合同生效起至今	54.0420%	0.0034%	28.7493%	0.0020%	25.2927%	0.0014%

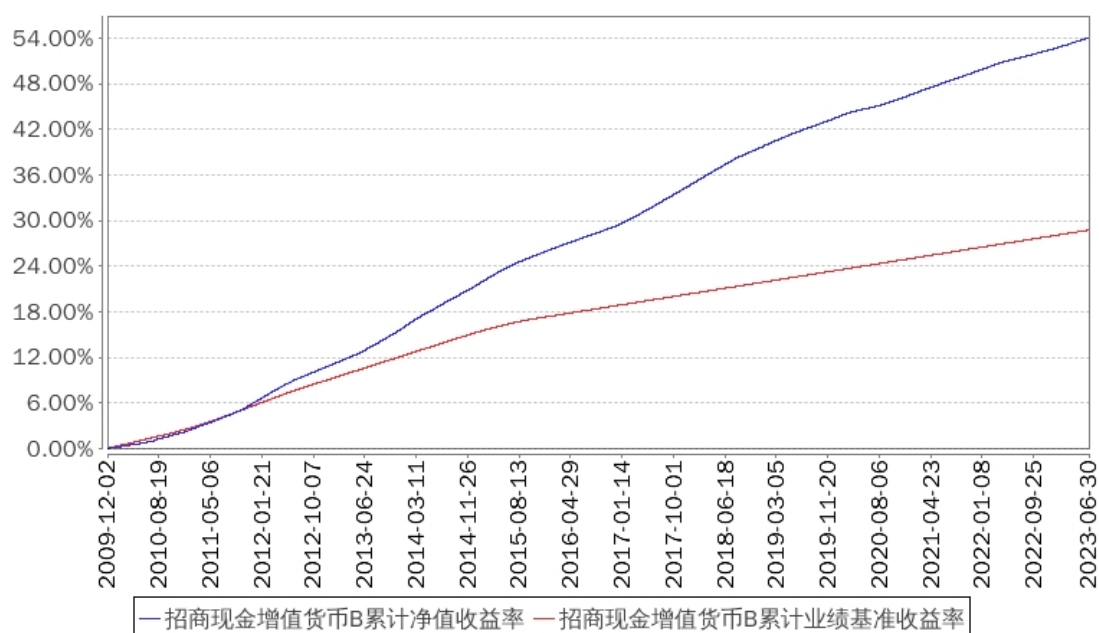
注：本基金收益分配为按日结转份额。

#### 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

招商现金增值货币A累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



招商现金增值货币B累计净值收益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B类份额自2009年12月2日起存续。

## § 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		
许强	本基金基金经理	2021 年 12 月 22 日	-	12	男，管理学学士。2008 年 9 月加入毕马威华振会计师事务所，从事审计工作；2010 年 9 月加入招商基金管理有限公司，曾任基金核算部基金会计、固定收益投资部研究员，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、招商招恒纯债债券型证券投资基金、招商招裕纯债债券型证券投资基金、招商招悦纯债债券型证券投资基金、招商招元纯债债券型证券投资基金、招商招庆纯债债券型证券投资基金、招商招通纯债债券型证券投资基金、招商招盛纯债债券型证券投资基金、招商招旺纯债债券型证券投资基金、招商招怡纯债债券型证券投资基金、招商招丰纯债债券型证券投资基金、招商招惠纯债债券型证券投资基金、招商招顺纯债债券型证券投资基金、招商招祥纯债债券型证券投资基金、招商招琪纯债债券型证券投资基金、招商招旭纯债债券型证券投资基金、招商招华纯债债券型证券投资基金、招商招弘纯债债券型证券投资基金、招商招益宝货币市场基金、招商招景纯债债券型证券投资基金、招商招享纯债债券型证券投资基金、招商招禧宝货币市场基金、招商招诚半年定期开放债券型发起式证券投资基金、招商招轩纯债债券型证券投资基金基金经理，现任招商招金宝货币市场基金、招商财富宝交易型货币市场基金、招商招信 3 个月定

					期开放债券型发起式证券投资基金、招商招利宝货币市场基金、招商定期宝六个月期理财债券型证券投资基金、招商现金增值开放式证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

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

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

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

基金管理人已建立较完善的研究方法和投资决策流程，确保各投资组合享有公平的投资决策机会。基金管理人建立了所有组合适用的投资对象备选库，制定明确的备选库建立、维护程序。基金管理人拥有健全的投资授权制度，明确投资决策委员会、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限划分，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。基金管理人的相关研究成果向内部所有投资组合开放，在投资研究层面不存在各投资组合间不公平的问题。

基金管理人按照法规要求，对连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3日内、5日内）公司管理的不同投资组合间的同向交易的交易价差进行分析，相关投资组合经理也对分析中发现的价格差异次数占比超过正常范围的情况进行了合理性解释。报告期内，公司旗下投资组合同向交易价差分析中未发现异常情形。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，本基金各项交易均严格按照相关法律法规、基金合同的有关要求执行，公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 18 次，其中 14 次为旗下指数及量化组合因投资策略需要而发生反向交易，4 次为不同基金经理管理的基金因投资策略不同而发生的反向交易。报告期内未发现有可能导致不公平交易和利益输送的重大异常交易行为。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

宏观经济回顾：

2023 年上半年，国内经济有所复苏，但二季度开始增长动力有所趋弱。投资方面，6 月固定资产投资完成额累计同比增长 3.8%，其中 6 月房地产开发投资累计同比下降 7.9%，较一季度地产投资同比降幅进一步扩大，由于商品房销售疲弱带来的房企拿地及新开工意愿下降，地产投资仍处于低迷状态；6 月基建投资累计同比增长 10.7%，政府使用基建支持经济的能力和意愿依旧较强，基建投资具有一定韧性；6 月制造业投资累计同比增长 6.0%，较 2023 年一季度 7.0% 的累计同比增速有所回落，主要与地产链和出口链相关制造业企业投资意愿趋弱有关。消费方面，在去年低基数影响下，6 月社会消费品零售总额当月同比上升 3.1%，消费有所复苏但动能不强。对外贸易方面，6 月出口金额当月同比下降 12.4%，主要系去年高基数以及全球加息周期背景下外需回落导致，未来出口增速可能继续承压。生产方面，6 月 PMI 指数为 49%，连续三个月位于荣枯线以下，6 月生产指数和新订单指数分别为 50.3% 和 48.6%，反映经济边际复苏动能略显不足，预计 2023 年三季度国内经济将处于筑底期，重点关注后续可能出台的经济刺激与稳增长政策。

货币市场回顾：

2023 年一季度，随着宏观经济逐渐修复、银行信贷投放同比增幅较大以及地方债发行节奏前置等原因，银行间资金利率中枢较 2022 年四季度有所抬升，DR007 利率基本围绕 7 天 OMO 利率波动。具体来看，2023 年 1 月和 2 月新增人民币贷款与 2022 年同期相比有所增长，尤其是企业中长期融资增幅明显，大量的信贷投放需求对银行间超储形成消耗，加之疫情冲突减退后，春节期间居民取现需求旺盛，导致 M0 波动较大，对资金面形成一定影响，1 年期 AAA 存单利率相应从年初 2.41% 的低位上行至 2 月底 2.73% 的阶段高点。进入 3 月，随着央行强调把握好信贷投放节奏、M0 逐渐回流银行表内，加之月内央行超额续作 MLF、并在月末宣布降低金融机构存款准备金率 0.25 个百分点，银行间资金利率环比略有下降，1 年期 AAA 存单利率也降至 3 月底 2.6% 左右水平。

2023 年二季度，随着宏观经济动能有所趋弱，银行间资金利率中枢较上个季度略有下降，但基本维持在政策利率附近偏宽松的状态，DR001 中枢在 1.5%、DR007 中枢在 1.9% 左右。具体来看，4 月份国股行票据转贴利率从高位回落，显示信贷投放疲弱，另一方面 4 月作为

缴税大月，对资金面形成一定扰动，公布的 3 月份宏观数据显示经济仍相对较强，整体看 4 月银行间资金利率环比 3 月变动不大。5 月份随着各项核心宏观经济金融数据出现回落，PMI 数据显示经济运行偏弱，央行维稳流动性意愿较强，大行融出规模出现上升，1 年 AAA 存单利率由 4 月底的 2.59% 下行至 5 月底的 2.4% 附近。6 月份中上旬资金利率环比变动不大，降息操作并未对资金面形成较大影响，资金利率仍维持在政策利率附近偏宽松水平，体现出央行引导资金面平稳的意愿较强，进入下旬资金利率主要受跨季影响有所波动，1 年 AAA 存单利率则在 6 月份继续波动下行至 2.3% 左右。

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 A 类份额净值收益率为 0.8434%，同期业绩基准收益率为 0.7542%，B 类份额净值收益率为 0.9635%，同期业绩基准收益率为 0.7542%。

#### 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，目前在经济依然处于筑底期的背景下，央行呵护资金面的意愿较强，大行净融出依然处于高位。尽管 6 月信贷总量和结构数据表现较好，但 7 月以来票据利率仍低位运行，信贷投放的增量持续性仍需观察，短期内资金面上行风险有限，不过考虑到出口下行状态下汇率压力增大，以及类似去年的大量财政资金支出导致资金面充裕的情况难以出现，预计未来资金面在政策利率附近略宽松水平波动的可能性较大。

#### 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

本报告期内，根据法律法规及《基金合同》的约定，本基金每日计算投资人账户当日所产生的收益，运作期末将投资人账户累计的收益结转为其基金份额，计入该投资人账户的本基金份额中。本报告期内，招商现金增值货币 A 共分配利润人民币 105,173,635.56 元，招商现金增值货币 B 共分配利润人民币 13,983,359.72 元，不存在应分配但尚未实施分配的情况。

#### 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

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

### 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

### 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

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 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：招商现金增值开放式证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	5,408,786,477.85	3,013,989,014.51
结算备付金		13,500.00	19,048,708.47
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	5,356,388,762.34	7,484,788,435.52
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		5,356,388,762.34	7,484,788,435.52
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	4,955,283,883.54	3,222,927,702.83
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		30,597,056.38	230,390.80
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		15,751,069,680.11	13,740,984,252.13
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		1,785,180,507.53	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		61,630.30	42,940.00
应付管理人报酬		3,791,524.37	3,716,932.78
应付托管费		1,148,946.81	1,126,343.28
应付销售服务费		2,596,323.44	2,539,498.43
应付投资顾问费		-	-
应交税费		3,077,490.93	3,076,787.66
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	462,137.27	359,167.71
负债合计		1,796,318,560.65	10,861,669.86
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	13,954,751,119.46	13,730,122,582.27
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-	-
净资产合计		13,954,751,119.46	13,730,122,582.27
负债和净资产总计		15,751,069,680.11	13,740,984,252.13

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，招商现金增值货币 A 份额净值 1.0000 元，基金份额总额 12,578,148,090.40 份；招商现金增值货币 B 份额净值 1.0000 元，基金份额总额 1,376,603,029.06 份；总份额合计 13,954,751,119.46 份。

## 6.2 利润表

会计主体：招商现金增值开放式证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		167,466,514.43	193,601,222.99

1.利息收入		110,137,221.44	95,851,571.05
其中：存款利息收入	6.4.7.9	55,900,571.54	65,174,970.17
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		54,236,649.90	30,676,600.88
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		57,329,292.99	97,749,651.94
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.10	57,329,292.99	97,749,651.94
资产支持证券投资	6.4.7.11	-	-
收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		-	-
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）		-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.12	-	-
减：二、营业总支出		48,309,519.15	55,009,104.26
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	22,894,439.52	25,620,882.82
2.托管费	6.4.10.2.2	6,937,708.89	7,763,903.92
3.销售服务费	6.4.10.2.3	15,605,243.69	17,388,642.76
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		2,701,629.61	4,067,425.53
其中：卖出回购金融资产支出		2,701,629.61	4,067,425.53
6.信用减值损失	6.4.7.13	-	-
7.税金及附加		145.83	-
8.其他费用	6.4.7.14	170,351.61	168,249.23
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		119,156,995.28	138,592,118.73
减：所得税费用		-	-



四、净利润（净亏损以“-”号填列）		119,156,995.28	138,592,118.73
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		119,156,995.28	138,592,118.73

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：招商现金增值开放式证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	13,730,122,582.27	-	-	13,730,122,582.27
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）	13,730,122,582.27	-	-	13,730,122,582.27
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	224,628,537.19	-	-	224,628,537.19
（一）、综合收益总额	-	-	119,156,995.28	119,156,995.28
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	224,628,537.19	-	-	224,628,537.19
其中：1.基金申购款	28,082,855,431.62	-	-	28,082,855,431.62
2.基金赎回款	-27,858,226,894.43	-	-	-27,858,226,894.43
（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）	-	-	-119,156,995.28	-119,156,995.28
（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）	13,954,751,119.46	-	-	13,954,751,119.46
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	15,169,809,546.74	-	-	15,169,809,546.74
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）	15,169,809,546.74	-	-	15,169,809,546.74
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-852,652,434.90	-	-	-852,652,434.90
（一）、综合收益总额	-	-	138,592,118.73	138,592,118.73
（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）	-852,652,434.90	-	-	-852,652,434.90
其中：1.基金申购款	38,840,731,127.99	-	-	38,840,731,127.99
2.基金赎回款	-39,693,383,562.89	-	-	-39,693,383,562.89
（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）	-	-	-138,592,118.73	-138,592,118.73
（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）	14,317,157,111.84	-	-	14,317,157,111.84

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

招商现金增值开放式证券投资基金(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》、《招商现金增值开放式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”)证监基金字[2003]136号文批准公开发行。本基金为契约型开放式基金,存续期限为不定期,首次设立募集基金份额为4,644,530,480.68份,经德勤华永会计师事务所有限公司验证,并出具了编号为德师报(验)字(04)第003号验资报告。《招商现金增值开放式证券投资基金基金合同》于2004年1月14日正式生效。本基金因自2007年7月1日起执行财政部于2006年2月15日颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”),于2007年9月28日公告了修改后的基金合同(以下简称“修改后的基金合同”)。本基金的基金管理人为招商基金管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)。

根据 2009 年 11 月 25 日发布的《招商基金管理有限公司关于招商现金增值开放式证券投资基金实施基金份额分级的公告》，从 2009 年 12 月 1 日起，本基金增设 B 级基金份额(以下简称“招商现金增值货币 B”)，招商现金增值货币 B 的年销售服务费率为 0.01%。于 2009 年 12 月 1 日持有本基金的投资者，单个基金账户分级前保留的基金份额余额为 A 级基金份额(以下简称“招商现金增值货币 A”)，招商现金增值货币 A 的年销售服务费率为 0.25%。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、修改后的基金合同及截至报告期末最新公告的《招商现金增值开放式证券投资基金更新的招募说明书》的有关规定，本基金投资于法律法规或监管机构允许投资的金融工具，包括：现金，期限在 1 年以内(含 1 年)的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单，剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券，及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日都不得超过 120 天，平均剩余存续期不得超过 240 天。基金的投资组合为：央行票据 0%-80%；回购 0%-80%；短期债券 0%-80%；现金资产或者到期日在一年以内的政府债券(包括政策性金融债)的比例为 5%-80%。本基金的业绩比较基准为一年期银行定期储蓄存款的税后利率=(1-利息税率)×一年期银行定期储蓄存款利率。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策，会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间未发生重大会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期间未发生重大会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖债券免征增值税；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，暂不缴纳企业所得税。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	5,124,720.27
等于：本金	5,122,780.28
加：应计利息	1,939.99
减：坏账准备	-
定期存款	5,403,661,757.58
等于：本金	5,390,000,000.00
加：应计利息	13,661,757.58
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	5,003,195,979.85
存款期限 3 个月以上	400,465,777.73
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	5,408,786,477.85

#### 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			
		按实际利率计算的账面价值	影子定价	偏离金额	偏离度(%)
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	5,356,388,762.34	5,356,842,181.64	453,419.30	0.0032
	合计	5,356,388,762.34	5,356,842,181.64	453,419.30	0.0032
资产支持证券		-	-	-	-
合计		5,356,388,762.34	5,356,842,181.64	453,419.30	0.0032

### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	4,955,283,883.54	-
合计	4,955,283,883.54	-

#### 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	223,629.90
其中：交易所市场	-
银行间市场	223,629.90
应付利息	-
预提费用	238,507.37
合计	462,137.27

## 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

招商现金增值货币 A		
项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	12,253,782,797.02	12,253,782,797.02
本期申购	26,274,872,071.90	26,274,872,071.90
本期赎回（以“-”号填列）	-25,950,506,778.52	-25,950,506,778.52
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	12,578,148,090.40	12,578,148,090.40

招商现金增值货币 B		
项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,476,339,785.25	1,476,339,785.25
本期申购	1,807,983,359.72	1,807,983,359.72
本期赎回（以“-”号填列）	-1,907,720,115.91	-1,907,720,115.91
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	1,376,603,029.06	1,376,603,029.06

注：本期申购含红利再投、转换入份（金）额，本期赎回含转换出份（金）额。

## 6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

招商现金增值货币 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	105,173,635.56	-	105,173,635.56
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-105,173,635.56	-	-105,173,635.56
本期末	-	-	-

招商现金增值货币 B			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	13,983,359.72	-	13,983,359.72
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-

本期已分配利润	-13,983,359.72	-	-13,983,359.72
本期末	-	-	-

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
活期存款利息收入			26,865.34
定期存款利息收入			55,273,479.89
其他存款利息收入			-
结算备付金利息收入			600,226.31
其他			-
合计			55,900,571.54

#### 6.4.7.10 债券投资收益

##### 6.4.7.10.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
债券投资收益——利息收入		57,316,159.95
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入		13,133.04
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		57,329,292.99

##### 6.4.7.10.2 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 1 月 1 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		11,722,419,728.50
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额		11,658,368,198.20
减：应计利息总额		64,038,397.26
减：交易费用		-
买卖债券差价收入		13,133.04

##### 6.4.7.10.3 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。

##### 6.4.7.10.4 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。

#### 6.4.7.11 资产支持证券投资收益

**6.4.7.11.1 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。

**6.4.7.11.2 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。

**6.4.7.11.3 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。

**6.4.7.11.4 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。

**6.4.7.12 其他收入**

本基金本报告期内无其他收入。

**6.4.7.13 信用减值损失**

本基金本报告期内无信用减值损失。

**6.4.7.14 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	50,000.00
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	41,177.24
其他	19,667.00
合计	170,351.61

**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
招商银行股份有限公司	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

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券交易。

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

###### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	22,894,439.52	25,620,882.82
其中：支付销售机构的客户维护费	7,521,554.91	6,618,866.32
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×0.33%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：

$$\text{日基金管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.33\% \div 365$$

###### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	6,937,708.89	7,763,903.92

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：

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

#### 6.4.10.2.3 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	招商现金增值货币 A	招商现金增值货币 B	合计
招商基金管理有限公司	8,036,761.59	50,947.56	8,087,709.15
招商银行	3,589,004.52	13,969.43	3,602,973.95
招商证券	23,166.32	508.73	23,675.05
合计	11,648,932.43	65,425.72	11,714,358.15
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	招商现金增值货币 A	招商现金增值货币 B	合计
招商基金管理有限公司	7,611,901.43	54,276.65	7,666,178.08
招商银行	4,890,783.63	12,845.63	4,903,629.26
招商证券	23,681.30	501.23	24,182.53
合计	12,526,366.36	67,623.51	12,593,989.87

注：本基金的 A 类基金份额的年销售服务费率为 0.25%，B 类基金份额的年销售服务费率为 0.01%，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{A 类份额日销售服务费} = \text{前一日 A 类基金资产净值} \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

$$\text{B 类份额日销售服务费} = \text{前一日 B 类基金资产净值} \times 0.01\% \div \text{当年天数}$$

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

项目	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	招商现金增值货币 A	招商现金增值货币 B

基金合同生效日（2004 年 1 月 14 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	14.33	-
报告期内申购/买入总份额	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	14.33	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	-

项目	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	招商现金增值货币 A	招商现金增值货币 B
基金合同生效日（2004 年 1 月 14 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	74,397.28	241,692.36
报告期内申购/买入总份额	654.26	191,091,864.60
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	75,037.21	191,333,556.96
报告期末持有的基金份额	14.33	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	-

#### 6.4.10.4.2 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

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行-活期	5,124,720.27	26,865.34	7,991,326.84	52,276.92

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

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.11 利润分配情况

##### 6.4.11.1 利润分配情况——固定净值型货币市场基金

单位：人民币元

招商现金增值货币 A

已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付赎回款 转出金额	应付利润本年变动	本期利润分配合计	备注
105,173,635.56	-	-	105,173,635.56	-

招商现金增值货币 B

已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付赎回款 转出金额	应付利润本年变动	本期利润分配合计	备注
13,983,359.72	-	-	13,983,359.72	-

#### 6.4.12 期末（2023 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币 1,785,180,507.53 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
112204026	22 中国银行 CD026	2023 年 7 月 3 日	99.83	1,000,000	99,829,105.48
112204033	22 中国银行 CD033	2023 年 7 月 3 日	99.72	7,000,000	698,013,069.08
112205130	22 建设银行 CD130	2023 年 7 月 3 日	99.83	272,000	27,154,806.54
112216132	22 上海银行 CD132	2023 年 7 月 3 日	99.83	2,000,000	199,656,564.91
112216156	22 上海银行 CD156	2023 年 7 月 3 日	99.63	412,000	41,047,573.92
112303120	23 农业银行 CD120	2023 年 7 月 3 日	98.42	1,076,000	105,901,265.00
112303134	23 农业银行 CD134	2023 年 7 月 3 日	99.47	522,000	51,923,499.68
2028029	20 交通银行 01	2023 年 7 月 3 日	102.42	169,000	17,309,385.41
220216	22 国开 16	2023 年 7 月 3 日	101.04	1,100,000	111,148,050.49
220306	22 进出 06	2023 年 7 月	101.52	600,000	60,909,894.97

		3 日			
220408	22 农发 08	2023 年 7 月 3 日	101.33	500,000	50,663,154.22
230401	23 农发 01	2023 年 7 月 3 日	101.03	2,600,000	262,668,559.62
239922	23 贴现国 债 22	2023 年 7 月 3 日	99.93	1,500,000	149,887,554.04
239929	23 贴现国 债 29	2023 年 7 月 3 日	99.80	800,000	79,837,139.91
合计	-	-	-	19,551,000	1,955,949,623.27

#### 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。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

本基金为货币型基金，本基金的运作涉及的金融工具主要包括债券投资、银行存款与买入返售金融资产。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	上年度末 2022 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	220,679,712.76	-
合计	220,679,712.76	-

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

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	152,792,872.25	-
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	152,792,872.25	-

注：上述评级均由经中国证监会核准从事证券市场资信评级业务的评级机构做出。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	3,732,920,684.60	5,529,254,232.56
AAA 以下	534,881,139.48	1,234,622,258.84
未评级	-	-
合计	4,267,801,824.08	6,763,876,491.40

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开放式基金每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。本基金所持有的交易性金融资产分别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。本基金所持有的全部金融负债无固定到期日或合同约定到期日均为一个月以内且不计息，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	5,408,786,477.85	-	-	-	5,408,786,477.85
结算备付金	13,500.00	-	-	-	13,500.00
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	5,356,388,762.34	-	-	-	5,356,388,762.34

衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	4,955,283,883.54	-	-	-	4,955,283,883.54
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	30,597,056.38	30,597,056.38
应收清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	15,720,472,623.73	-	-	30,597,056.38	15,751,069,680.11
负债					
应付赎回款	-	-	-	61,630.30	61,630.30
应付管理人报酬	-	-	-	3,791,524.37	3,791,524.37
应付托管费	-	-	-	1,148,946.81	1,148,946.81
应付清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	1,785,180,507.53	-	-	-	1,785,180,507.53
应付销售服务费	-	-	-	2,596,323.44	2,596,323.44
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	3,077,490.93	3,077,490.93
其他负债	-	-	-	462,137.27	462,137.27
负债总计	1,785,180,507.53	-	-	11,138,053.12	1,796,318,560.65
利率敏感度缺口	13,935,292,116.20	-	-	19,459,003.26	13,954,751,119.46
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,013,989,014.51	-	-	-	3,013,989,014.51
结算备付金	19,048,708.47	-	-	-	19,048,708.47
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	7,484,788,435.52	-	-	-	7,484,788,435.52
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	3,222,927,702.83	-	-	-	3,222,927,702.83
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	230,390.80	230,390.80
应收清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	13,740,753,861.33	-	-	230,390.80	13,740,984,252.13
负债					
应付赎回款	-	-	-	42,940.00	42,940.00
应付管理人报酬	-	-	-	3,716,932.78	3,716,932.78
应付托管费	-	-	-	1,126,343.28	1,126,343.28



应付清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	2,539,498.43	2,539,498.43
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	3,076,787.66	3,076,787.66
其他负债	-	-	-	359,167.71	359,167.71
负债总计	-	-	-	10,861,669.86	10,861,669.86
利率敏感度缺口	13,740,753,861.33	-	-	-10,631,279.06	13,730,122,582.27

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1.若市场利率平行上升或下降 50 个基点		
	2.其他市场变量保持不变		
	3.仅存在公允价值变动对基金资产净值的影响		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
		1. 市场利率平行上升 50 个基点	-7,058,168.94
	2. 市场利率平行下降 50 个基点	7,087,504.58	11,615,097.82

#### 6.4.13.4.2 其他价格风险

其他价格风险是指金融工具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组合相关。对本基金而言，其他价格风险表现在当投资组合的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动导致与其摊余成本发生重大差异时对损益的影响。本基金管理人通过对加强投资组合管理、优化品种配置、每日跟踪偏离程度等方法对其他价格风险进行管理。

于 2023 年 6 月 30 日，本基金投资组合的摊余成本与可参考公允价值的偏离程度绝对值为 0.0032% (2022 年 12 月 31 日该值为：0.0522%)。本基金管理人将视情况调整组合以控制风险，规避出现投资组合的摊余成本与可参考公允价值产生重大偏差的可能。

##### 6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

本基金本报告期末及上年度末无其他价格风险敞口。

##### 6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末无其他价格风险的敏感性分析。

#### 6.4.14 公允价值

#### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

#### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位:人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日
第一层次	-
第二层次	5,356,388,762.34
第三层次	-
合计	5,356,388,762.34

##### 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

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例
----	----	-------	-----------

			(%)
1	固定收益投资	5,356,388,762.34	34.01
	其中：债券	5,356,388,762.34	34.01
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	4,955,283,883.54	31.46
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	5,408,799,977.85	34.34
4	其他资产	30,597,056.38	0.19
5	合计	15,751,069,680.11	100.00

## 7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	2.73	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额 (元)	占基金资产净值的比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	1,785,180,507.53	12.79
	其中：买断式回购融资	-	-

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

### 7.2.1 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

本基金本报告期内债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

## 7.3 基金投资组合平均剩余期限

### 7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	63
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	84
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	42

### 7.3.2 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本基金本报告期内投资组合平均剩余期限未超过 120 天。

### 7.3.3 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30 天以内	40.56	12.79

	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）-60 天	12.11	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）-90 天	37.27	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）-120 天	11.77	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）-397 天（含）	10.94	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	112.65	12.79

#### 7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本基金本报告期内投资组合平均剩余存续期未超过 240 天。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	229,724,693.95	1.65
2	央行票据	-	-
3	金融债券	638,182,531.55	4.57
	其中：政策性金融债	485,389,659.30	3.48
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	220,679,712.76	1.58
6	中期票据	-	-
7	同业存单	4,267,801,824.08	30.58
8	其他	-	-
9	合计	5,356,388,762.34	38.38
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

#### 7.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

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

1	112204033	22 中国银行 CD033	7,000,000	698,013,069.08	5.00
2	112303134	23 农业银行 CD134	6,000,000	596,821,835.35	4.28
3	112283517	22 上海农商 银行 CD063	5,000,000	499,436,460.71	3.58
4	112322030	23 邮储银行 CD030	4,000,000	397,881,223.57	2.85
5	112303120	23 农业银行 CD120	3,000,000	295,263,749.99	2.12
6	230401	23 农发 01	2,600,000	262,668,559.62	1.88
7	112216132	22 上海银行 CD132	2,000,000	199,656,564.91	1.43
8	239922	23 贴现国债 22	1,500,000	149,887,554.04	1.07
9	112289589	22 汉口银行 CD138	1,200,000	119,122,602.44	0.85
10	220216	22 国开 16	1,100,000	111,148,050.49	0.80

## 7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25（含）-0.5%间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	0.0045%
报告期内偏离度的最低值	-0.0661%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0260%

### 7.7.1 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本基金本报告期内无负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

### 7.7.2 报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本基金本报告期内无正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

## 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.9 投资组合报告附注

### 7.9.1

本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余存续期内摊销，每日计提损益。本基金通过每日分红使基金份额净值维持在 1.0000 元。

## 7.9.2

报告期内基金投资的前十名证券除 22 国开 16（证券代码 220216）、22 汉口银行 CD138（证券代码 112289589）、22 上海农商银行 CD063（证券代码 112283517）、22 上海银行 CD132（证券代码 112216132）、22 中国银行 CD033（证券代码 112204033）、23 农发 01（证券代码 230401）、23 农业银行 CD120（证券代码 112303120）、23 农业银行 CD134（证券代码 112303134）、23 邮储银行 CD030（证券代码 112322030）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、22 国开 16（证券代码 220216）

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

### 2、22 汉口银行 CD138（证券代码 112289589）

根据 2022 年 9 月 15 日发布的相关公告，该证券发行人因违规经营被国家外汇管理局鄂州市中心支局处以罚款，并没收违法所得。

根据 2023 年 6 月 21 日发布的相关公告，该证券发行人因违规经营被宜昌银保监分局处以罚款。

### 3、22 上海农商银行 CD063（证券代码 112283517）

根据 2022 年 10 月 31 日发布的相关公告，该证券发行人因未依法履行职责被国家外汇管理局上海市分局处以罚款，警告，没收违法所得，并责令改正。

根据 2022 年 12 月 22 日发布的相关公告，该证券发行人因涉嫌违反法律法规被上海银保监局处以罚款，并责令改正。

根据 2023 年 6 月 28 日发布的相关公告，该证券发行人因未依法履行职责被上海银保监局处以罚款，并责令改正。

### 4、22 上海银行 CD132（证券代码 112216132）

根据 2022 年 7 月 5 日发布的相关公告，该证券发行人因违反反洗钱法被央行天津分行处以罚款，并警告。

根据 2023 年 4 月 21 日发布的相关公告，该证券发行人因违规经营被国家外汇管理局上海市分局处以罚款，没收违法所得，并给予警告。

### 5、22 中国银行 CD033（证券代码 112204033）

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、涉嫌违反法律法规、违反税收管理规定、未依法履行职责等原因，多次受到监管机构的处罚。

## 6、23 农发 01（证券代码 230401）

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。

## 7、23 农业银行 CD120（证券代码 112303120）

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。

## 8、23 农业银行 CD134（证券代码 112303134）

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。

## 9、23 邮储银行 CD030（证券代码 112322030）

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。

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。

### 7.9.3 期末其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	30,597,056.38
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	30,597,056.38

## § 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

份额级别	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
招商现金增值货币 A	1,529,990	8,221.07	6,805,701,212.32	54.11%	5,772,446,878.08	45.89%
招商现金	215	6,402,804.79	1,204,747,443.42	87.52%	171,855,585.64	12.48%

增值货币 B						
合计	1,530,205	9,119.53	8,010,448,655.74	57.40%	5,944,302,463.72	42.60%

注：机构投资者/个人投资者持有份额占总份额比例计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

## 8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额（份）	占总份额比例
1	信托类机构	221,547,227.81	1.59%
2	信托类机构	124,948,508.60	0.90%
3	信托类机构	112,997,518.21	0.81%
4	信托类机构	111,082,208.27	0.80%
5	信托类机构	80,746,984.51	0.58%
6	个人	66,151,903.12	0.47%
7	信托类机构	61,700,805.77	0.44%
8	基金类机构	61,010,157.29	0.44%
9	其他机构	57,948,869.12	0.42%
10	信托类机构	54,190,390.04	0.39%

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	招商现金增值货币 A	110,807.67	0.0009%
	招商现金增值货币 B	-	-
	合计	110,807.67	0.0008%

注：分级基金机构投资者/个人投资者持有份额占总份额比例计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

## 8.4 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	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	招商现金增值货币 A	0~10
	招商现金增值货币 B	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	招商现金增值货币 A	0~10
	招商现金增值货币 B	0
	合计	0~10



## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	招商现金增值货币 A	招商现金增值货币 B
基金合同生效日(2004 年 1 月 14 日)基金份额总额	4,644,961,266.61	-
本报告期期初基金份额总额	12,253,782,797.02	1,476,339,785.25
本报告期期间基金总申购份额	26,274,872,071.90	1,807,983,359.72
减:本报告期基金总赎回份额	25,950,506,778.52	1,907,720,115.91
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-	-
本报告期期末基金份额总额	12,578,148,090.40	1,376,603,029.06

## § 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，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

## 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	
海通证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	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
海通证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	2,355,861,000.00	100.00%	-	-

## 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金本报告期内不存在偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

## 10.9 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	招商现金增值开放式证券投资基金更新的招募说明书（二零二三年第一号）	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	2023-01-13
2	招商现金增值开放式证券投资基金（A 类份额）	证券日报、基金管理	2023-01-13

	基金产品资料概要更新	人网站及中国证监会基金电子披露网站	
3	招商现金增值开放式证券投资基金(B类份额)基金产品资料概要更新	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	2023-01-13
4	招商基金管理有限公司旗下基金2022年第4季度报告提示性公告	证券日报及基金管理人网站	2023-01-18
5	招商现金增值开放式证券投资基金2022年第4季度报告	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	2023-01-18
6	招商现金增值开放式证券投资基金2022年年度报告	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	2023-03-30
7	招商基金管理有限公司旗下基金2022年年度报告提示性公告	证券日报及基金管理人网站	2023-03-30
8	招商基金管理有限公司旗下基金2023年第1季度报告提示性公告	证券日报及基金管理人网站	2023-04-21
9	招商现金增值开放式证券投资基金2023年第1季度报告	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	2023-04-21
10	招商基金管理有限公司关于提醒投资者持续完善身份信息资料的公告	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
11	招商基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证券日报、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 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现金增值开放式证券投资基金设立的文件；
- 3、《招商现金增值开放式证券投资基金基金合同》；
- 4、《招商现金增值开放式证券投资基金托管协议》；
- 5、《招商现金增值开放式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.cmfchina.com>

招商基金管理有限公司

2023 年 8 月 30 日