

# 招商金融债 3 个月定期开放债券型证 券投资基金 2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：招商基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

送出日期：2024 年 3 月 29 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。本年度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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 3 月 28 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。

本报告财务资料已经审计，德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了 2023 年度无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况.....                 | 5  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标.....                         | 5  |
| 3.2 基金净值表现.....                              | 6  |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况.....                       | 7  |
| §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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....                 | 12 |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....                | 12 |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....                 | 13 |
| 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....       | 14 |
| §5 托管人报告.....                                | 14 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....                  | 14 |
| 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..... | 14 |
| 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....      | 14 |
| §6 审计报告.....                                 | 14 |
| 6.1 审计报告的基本内容.....                           | 14 |
| §7 年度财务报表.....                               | 16 |
| 7.1 资产负债表.....                               | 16 |
| 7.2 利润表.....                                 | 18 |
| 7.3 净资产变动表.....                              | 19 |
| 7.4 报表附注.....                                | 21 |
| §8 投资组合报告.....                               | 43 |
| 8.1 期末基金资产组合情况.....                          | 43 |
| 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....                    | 44 |
| 8.3 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.....       | 44 |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                     | 44 |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                    | 44 |
| 8.6 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.....      | 45 |

|      |  |    |
|------|--|----|
| 8.7  | 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..... | 45 |
| 8.8  | 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..... | 45 |
| 8.9  | 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.....    | 45 |
| 8.10 | 本基金投资股指期货的投资政策.....                    | 45 |
| 8.11 | 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....              | 45 |
| 8.12 | 投资组合报告附注.....                          | 45 |
| §9   | 基金份额持有人信息.....                         | 47 |
| 9.1  | 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....                 | 47 |
| 9.2  | 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....              | 47 |
| 9.3  | 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.....      | 47 |
| §10  | 开放式基金份额变动.....                         | 47 |
| §11  | 重大事件揭示.....                            | 48 |
| 11.1 | 基金份额持有人大会决议.....                       | 48 |
| 11.2 | 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.....       | 48 |
| 11.3 | 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....            | 48 |
| 11.4 | 基金投资策略的改变.....                         | 48 |
| 11.5 | 为基金进行审计的会计师事务所情况.....                  | 48 |
| 11.6 | 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....          | 49 |
| 11.7 | 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....                 | 49 |
| 11.8 | 其他重大事件.....                            | 50 |
| §12  | 影响投资者决策的其他重要信息.....                    | 52 |
| 12.1 | 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.....     | 52 |
| §13  | 备查文件目录.....                            | 52 |
| 13.1 | 备查文件目录.....                            | 52 |
| 13.2 | 存放地点.....                              | 53 |
| 13.3 | 查阅方式.....                              | 53 |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                         |
|------------|-------------------------|
| 基金名称       | 招商金融债 3 个月定期开放债券型证券投资基金 |
| 基金简称       | 招商金融债 3 个月定开债           |
| 基金主代码      | 011944                  |
| 交易代码       | 011944                  |
| 基金运作方式     | 契约型、以定期开放方式运作           |
| 基金合同生效日    | 2021 年 4 月 28 日         |
| 基金管理人      | 招商基金管理有限公司              |
| 基金托管人      | 兴业银行股份有限公司              |
| 报告期末基金份额总额 | 7,315,534,137.87 份      |
| 基金合同存续期    | 不定期                     |

### 2.2 基金产品说明

|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 本基金在严格控制风险的前提下，力争基金资产长期稳健增值，为基金份额持有人提供超越业绩比较基准的投资回报。  |
| 投资策略   | <p>本基金以封闭期为周期进行投资运作。本基金在封闭期与开放期采取不同的投资策略。</p> <p>1、封闭期投资策略</p> <p>本基金封闭期的投资组合久期与封闭期剩余期限进行适当匹配的基础上，基金管理人将视债券、银行存款、债券回购等大类资产的市场环境确定债券投资组合管理策略，确定部分债券采取持有到期策略，部分债券将采取积极的投资策略，以获取较高的债券组合投资收益。</p> <p>本基金的具体投资策略包括：（1）资产配置策略；（2）久期策略；（3）期限结构策略；（4）类属配置策略；（5）信用债投资策略；（6）杠杆投资策略；（7）资产支持证券的投资策略；（8）行业配置策略；（9）个券挖掘策略。</p> <p>2、开放期投资策略</p> <p>开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种，防范流动性风险，满足开放期流动性的需求。</p> |
| 业绩比较基准 | 中债-金融债券总全价（总值）指数收益率   |
| 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。   |

### 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 | 兴业银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名         | 潘西里        |
|         |            | 龚小武        |

|        |      |                   |                            |
|--------|------|-------------------|----------------------------|
|        | 联系电话 | 0755-83196666     | 021-52629999-212056        |
|        | 电子邮箱 | cmf@cmfchina.com  | gongxiaowu@cib.com.cn      |
| 客户服务电话 |      | 400-887-9555      | 95561                      |
| 传真     |      | 0755-83196475     | 021-62159217               |
| 注册地址   |      | 深圳市福田区深南大道 7088 号 | 福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦 |
| 办公地址   |      | 深圳市福田区深南大道 7088 号 | 上海市浦东新区银城路 167 号 4 楼       |
| 邮政编码   |      | 518040            | 200120                     |
| 法定代表人  |      | 王小青               | 吕家进                        |

## 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  |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | <a href="http://www.cmfchina.com">http://www.cmfchina.com</a> |
| 基金年度报告备置地点          | 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                     |
|--------|--------------------|--------------------------|
| 会计师事务所 | 德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙） | 中国上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼 |
| 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、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2023 年           | 2022 年            | 2021 年 4 月 28 日<br>-2021 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------|-------------------|--------------------------------------|
| 本期已实现收益       | 211,351,240.12   | 346,919,540.95    | 364,322,766.05                       |
| 本期利润          | 243,592,867.53   | 238,684,179.79    | 466,464,197.21                       |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0303           | 0.0260            | 0.0353                               |
| 本期加权平均净值利润率   | 2.99%            | 2.54%             | 3.49%                                |
| 本期基金份额净值增长率   | 3.08%            | 2.78%             | 3.71%                                |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2023 年末          | 2022 年末           | 2021 年末                              |
| 期末可供分配利润      | 83,905,319.87    | 142,511,115.89    | 137,190,047.54                       |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0115           | 0.0123            | 0.0151                               |
| 期末基金资产净值      | 7,414,263,961.69 | 11,720,140,686.92 | 9,275,160,577.60                     |
| 期末基金份额净值      | 1.0135           | 1.0123            | 1.0239                               |
| 3.1.3 累计期末指标  | 2023 年末          | 2022 年末           | 2021 年末                              |

|             |       |       |       |
|-------------|-------|-------|-------|
| 基金份额累计净值增长率 | 9.87% | 6.59% | 3.71% |
|-------------|-------|-------|-------|

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。

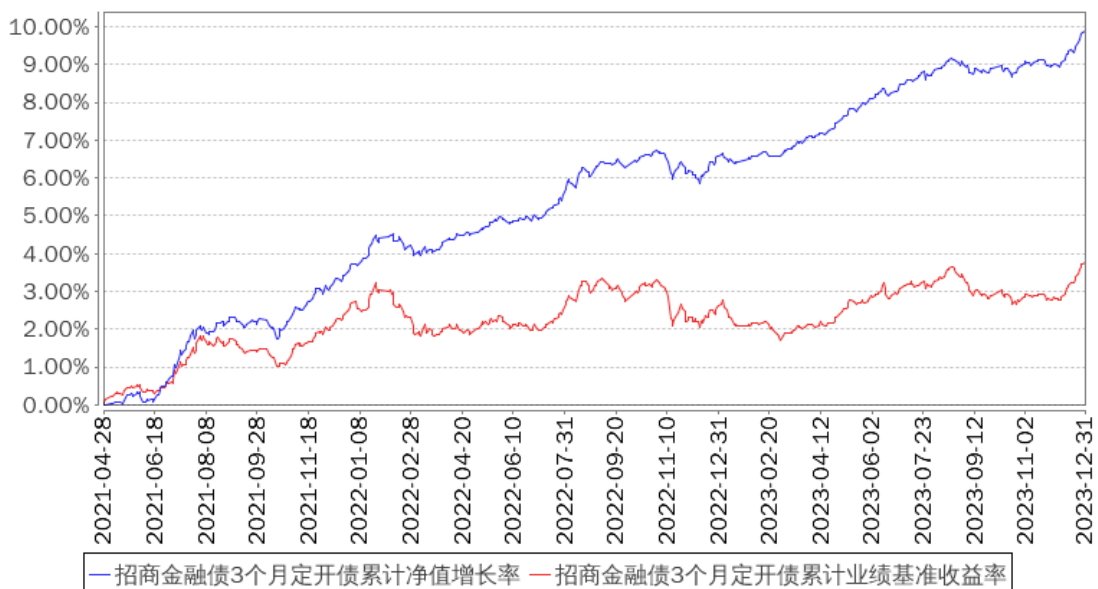
## 3.2 基金净值表现

### 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    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|-------|--------|
| 过去三个月      | 0.88%    | 0.05%       | 0.83%      | 0.05%         | 0.05% | 0.00%  |
| 过去六个月      | 1.29%    | 0.05%       | 0.66%      | 0.06%         | 0.63% | -0.01% |
| 过去一年       | 3.08%    | 0.04%       | 1.12%      | 0.06%         | 1.96% | -0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | 9.87%    | 0.06%       | 3.76%      | 0.07%         | 6.11% | -0.01% |

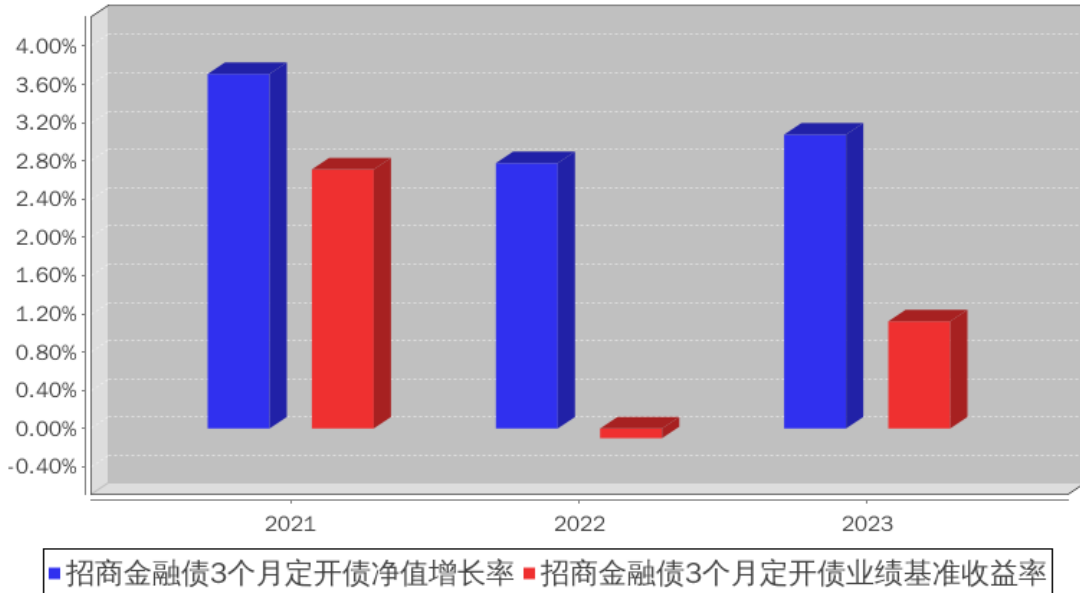
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

招商金融债3个月定开债累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

招商金融债3个月定开债基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金于 2021 年 4 月 28 日成立，截至 2021 年 12 月 31 日基金成立未满 1 年，故成立当年净值增长率按当年实际存续期计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

| 年度     | 每 10 份基金份额分红数 | 现金形式发放总额       | 再投资形式发放总额    | 年度利润分配合计       | 备注 |
|--------|---------------|----------------|--------------|----------------|----|
| 2023 年 | 0.2950        | 231,093,238.50 | 2,888,523.70 | 233,981,762.20 | -  |
| 2022 年 | 0.3980        | 334,143,066.70 | 3,988.25     | 334,147,054.95 | -  |
| 2021 年 | 0.1300        | 190,548,717.77 | 0.13         | 190,548,717.90 | -  |
| 合计     | 0.8230        | 755,785,022.97 | 2,892,512.08 | 758,677,535.05 | -  |

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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



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

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务           | 任本基金的基金经理（助理）期限 |            | 证券从业年限 | 说明  |
|----|--------------|-----------------|------------|--------|---|
|    |              | 任职日期            | 离任日期       |        |   |
| 王闯 | 本基金基金经理      | 2023年7月18日      | -          | 9      | 男，硕士。2010年7月至2010年12月任中国南山开发(集团)股份有限公司会计，2010年12月至2013年7月任德勤华永会计师事务所审计员，2013年8月至2014年12月在中国平安财产保险股份有限公司从事财务工作。2014年12月加入招商基金管理有限公司，曾任基金会计、交易员，先后从事债券核算及交易工作。2018年6月起加入固定收益投资部，曾任研究员、投资经理，现任招商添锦1年定期开放债券型发起式证券投资基金、招商招裕纯债债券型证券投资基金、招商添旭3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、招商中证政策性金融债3-5年交易型开放式指数证券投资基金、招商招丰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、招商中债1-5年进出口行债券指数证券投资基金、招商金融债3个月定期开放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CFETS银行间绿色债券指数证券投资基金基金经理。 |
| 王刚 | 本基金基金经理（已离任） | 2021年8月2日       | 2023年7月18日 | 12     | 男，硕士。2011年7月加入中国人保资产管理股份有限公司，曾任助理组合经理、产品经理；2014年5月加入泰康资产管理有限责任公司，曾任资产管理部高级经理；2015年7月加入招商基金管理有限公司，曾任固定收益投资部研究员，招商可转债债券型证券投资基金、招商丰嘉灵活配置混合型证券投资基金、招商丰融灵活配置混合型证券投资基金、招商丰泰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、招商添瑞1年定期开放债券型发起式证券投资基金、招商添盛78个  |

|  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|
|  |  |  |  | 月定期开放债券型证券投资基金、招商金融债 3 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理，现任招商丰美灵活配置混合型证券投资基金、招商丰泽灵活配置混合型证券投资基金、招商瑞丰灵活配置混合型发起式证券投资基金、招商安荣灵活配置混合型证券投资基金、招商安德灵活配置混合型证券投资基金、招商享诚增强债券型证券投资基金、招商安鼎平衡 1 年持有期混合型证券投资基金、招商稳锦混合型证券投资基金、招商安悦 1 年持有期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遵规守信情况的说明

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 公平交易制度和控制方法

基金管理人根据《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》和《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》（2011 年修订）的规定，制定了《招商基金管理有限公司公平交易管理办法》，对投资决策的内部控制、交易执行的内部控制、公平交易实施情况的监控与检查稽核、异常交易的监控等进行了规定。为保证各投资组合在投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会，基金管理人合理设置了各类资产管理业务之间以及各类资产管理业务内部的组织结构，建立了科学的投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

### 4.3.2 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。

### 4.3.3 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 28 次，其中 21 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，7 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，国内经济由于低基数原因同比增速表现尚可，从绝对水平看依然处于筑底修复期。投资方面，12 月固定资产投资完成额累计同比增长 3.0%，其中 12 月房地产开发投资累计同比下降 9.6%，单月投资同比下降 24%，在地产销售持续较弱的背景下，房企整体拿地和新开工意愿仍相对低迷；12 月基建投资累计同比增长 8.2%，增速虽略有放缓，但能对投资端形成重要支撑，全国人大常委会批准增发万亿国债也表明政府使用基建支持经济的意愿依旧较强；12 月制造业投资累计同比增长 6.5%，考虑到目前库存周期处于低位，加之 8 月以来工业企业利润当月同比回正，制造业投资韧性较强。消费方面，12 月社会消费品零售总额当月同比增速为 7.4%，主要系低基数导致，以 2021 年为基准考虑两年平均后的

社零当月同比增速为 2.7%，消费表现相对疲弱。对外贸易方面，12 月出口金额当月同比增长 2.3%，增速有所改善，主要与去年同期低基数以及对美、金砖国家出口仍具韧性有关。生产方面，2024 年 1 月 PMI 指数为 49.2%，连续四个月在荣枯线以下，1 月的生产指数和新订单指数分别为 51.3%和 49%，经济修复动能环比有所改善但依然偏弱，预计 2024 年经济将继续处于筑底修复状态，重点关注后续地产、化债、财政支出政策对经济增速的边际影响。

#### 债券市场回顾：

2023 年全年，债券市场整体呈现出震荡下行的牛市格局。一季度市场对经济复苏预期较强、票据利率持续高企预示信贷表现尚可，但同时市场对利空因素有所钝化、加之央行超额续作 MLF 叠加降准使得银行间流动性状况有所好转，10 年国债收益率持续在 2.8%-2.9% 区间内震荡；二季度债券市场上涨趋势较强，经济数据显示出服务业修复、固定资产投资边际走弱，地产、钢铁等高频数据趋弱，且银行通知存款、协定存款利率上限下调，同时 6 月央行实施降息操作，10 年国债收益率二季度整体下行幅度达 20bp；三季度债券市场有所波动，10 年国债利率呈现先下后上态势，8 月央行降息使得 10 年国债利率最低达到 2.54% 水平，后续随着地产宽信用政策加码、债市止盈盘增多，10 年国债利率再次触底回升，10 年国债利率在 9 月下旬最高触及 2.7% 水平；四季度由于人大常委会批准年内新增万亿国债、特殊再融资债发行提速，资金面边际收紧，10 年国债利率维持高位，后由于经济数据趋弱、通胀数据降幅走阔，叠加资金面边际有所好转、大行先后宣布下调存款利率，10 年国债利率迎来一波下行趋势，在 12 月底降至 2.56%。

分品种看，信用债利差全年整体呈现压缩态势，5 年、3 年和 1 年 AAA 信用债收益率全年分别下行 56bp、46bp 和 19bp。由于 2022 年底理财赎回潮影响，2023 年初信用利差较高，基于票息优势，一季度信用利差快速压缩，二三季度信用利差维持震荡，尤其 8 月随着债市收益率上行、出现了一定的赎回冲击，导致信用债收益率有一定调整，但进入四季度，由于债券市场资产荒加剧，信用利差继续呈现出压缩态势。

#### 基金操作回顾：

回顾 2023 年的基金操作，我们严格遵照基金合同的相关约定，按照既定的投资流程进行了规范运作。债券投资方面，本组合在市场收益率波动过程中积极调整仓位，顺应市场趋势，优化资产配置结构，努力提高组合收益。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金份额净值增长率为 3.08%，同期业绩基准增长率为 1.12%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

#### 市场展望：

展望后市，大行在 2023 年第三次降低存款利率，前两次降低存款利率都伴随着降低 MLF 利率，加之当前物价和经济高频数据偏弱，预计 2024 年一二季度降息概率较大，降息预期将成为推动债市走强的重要因素。我们对债市态度整体偏向乐观，但考虑到资金面未必转向明显宽松，中短期限品种债券收益率可能下行有限，长久期品种具备相对优势，不过若后续降息实际落地或收益率下行幅度较大，需要关注机构止盈对债市的影响。基本面方面，国债增发配套项目陆续下达，且 PSL 有新增规模，2024 年年初预计基建有所发力，对基本面形成一定支撑，后续主要关注财政政策的节奏对债市的边际影响。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人本着诚实信用、勤勉尽责、合法经营和保障基金持有人利益的原则，经营管理和业务运作稳健、合规，基金的投资、交易、后台等运作规范有序。基金管理人的风险管理及合规控制部门依据独立、客观、公正的原则，主要从以下几个方面进一步加强了公司内部控制和基金投资风险管理工作：

1、公司实施了员工全面培训和形式多样的专题培训，包括不定期推送监管动态和风险案例，持续整理风险点录入系统定期推送，定期或不定期组织法规考试，不定期开展各类合规主题培训等，丰富培训形式，不断提升员工合规与风控意识；

2、公司合规风控部门通过事中合规控制系统、事后投资风险管理系统、风险管理模型等对基金投资合规情况及风险情况进行严格的内部监控和管理；

3、定期稽核方面，除了每季度会对各业务领域进行一次全面的稽核，公司合规审计部门还根据监察稽核计划，对公司的关键业务部门及业务流程进行了专项稽核和检查；

4、根据法律法规的更新及业务的发展变化情况，公司各业务部门对相关内部控制制度提出修改意见和建议，并关注内部控制制度的健全性和有效性，进一步完善了公司内控制度体系，更好的防范法律风险和合规风险。

报告期内，本基金的投资运作符合国家相关法律法规、监管部门的有关规定以及公司相关制度的规定。本基金的投资目标、投资决策依据和投资管理程序均符合相关基金合同和招募说明书的约定，未发现重大异常交易、利益输送、内幕交易及其他有损基金投资者利益的情形。报告期内，本基金若曾因市场波动、申购赎回等原因出现了相关投资比例限制被动突破的情形，均在法规规定的时间内完成了调整，符合法律法规和基金合同的规定和要求。报告期内，本基金未出现因权证未行权、可转债未及时卖出或转股等有损基金份额持有人利益的投资失误行为。本基金管理人承诺将一如既往本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产，在规范经营、控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。

#### 4.7 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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《招商金融债 3 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》及最新的招募说明书约定“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”。

本基金于 2023 年 3 月 22 日实施利润分配，每份基金份额分红 0.0075 元，上述利润分配符合合同规定。

本基金于 2023 年 5 月 25 日实施利润分配，每份基金份额分红 0.0060 元，上述利润分配符合合同规定。

本基金于 2023 年 9 月 1 日实施利润分配，每份基金份额分红 0.0100 元，上述利润分配符合合同规定。

本基金于 2023 年 12 月 8 日实施利润分配，每份基金份额分红 0.0060 元，上述利润分配符合合同规定。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

#### 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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

#### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

### § 6 审计报告

#### 6.1 审计报告的基本内容

| 审计报告标题  | 审计报告  |
|---------|---|
| 审计报告收件人 | 招商金融债 3 个月定期开放债券型证券投资基金全体持有人  |
| 审计意见    | 我们审计了招商金融债 3 个月定期开放债券型证券投资基金的财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 |

|                 |   |
|-----------------|---|
|                 | 我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,公允反映了招商金融债 3 个月定期开放债券型证券投资基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。  |
| 形成审计意见的基础       | 我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于招商金融债 3 个月定期开放债券型证券投资基金,并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。  |
| 强调事项            | -   |
| 其他事项            | -   |
| 其他信息            | 招商基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括招商金融债 3 个月定期开放债券型证券投资基金年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。<br>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。<br>结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。<br>基于我们已执行的工作,如果我们确定其他信息存在重大错报,我们应当报告该事实。在这方面,我们无任何事项需要报告。           |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | 基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。<br>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估招商金融债 3 个月定期开放债券型证券投资基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算招商金融债 3 个月定期开放债券型证券投资基金、终止运营或别无其他现实的选择。<br>基金管理人治理层负责监督招商金融债 3 个月定期开放债券型证券投资基金的财务报告过程。 |
| 注册会计师对财务报表审计的责任 | 我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错   |



|           |  |
|-----------|--|
|           | <p>报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2)了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3)评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4)对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对招商金融债 3 个月定期开放债券型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致招商金融债 3 个月定期开放债券型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5)评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p> |
| 会计师事务所的名称 | 德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）   |
| 注册会计师的姓名  | 吴凌志   陈峻逸  |
| 会计师事务所的地址 | 中国上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼   |
| 审计报告日期    | 2024 年 3 月 28 日  |

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：招商金融债 3 个月定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2023 年 12 月 31 | 上年度末 2022 年 12 月 |
|----|-----|--------------------|------------------|
|----|-----|--------------------|------------------|

|           |         | 日                    | 31 日                  |
|-----------|---------|----------------------|-----------------------|
| 资产：       |         |                      |                       |
| 货币资金      | 7.4.7.1 | 5,092,318.10         | 5,572,177.35          |
| 结算备付金     |         | -                    | -                     |
| 存出保证金     |         | -                    | -                     |
| 交易性金融资产   | 7.4.7.2 | 8,445,619,092.92     | 12,756,069,848.55     |
| 其中：股票投资   |         | -                    | -                     |
| 基金投资      |         | -                    | -                     |
| 债券投资      |         | 8,445,619,092.92     | 12,756,069,848.55     |
| 资产支持证券投资  |         | -                    | -                     |
| 贵金属投资     |         | -                    | -                     |
| 其他投资      |         | -                    | -                     |
| 衍生金融资产    | 7.4.7.3 | -                    | -                     |
| 买入返售金融资产  | 7.4.7.4 | -                    | -                     |
| 债权投资      |         | -                    | -                     |
| 其中：债券投资   |         | -                    | -                     |
| 资产支持证券投资  |         | -                    | -                     |
| 其他投资      |         | -                    | -                     |
| 其他债权投资    |         | -                    | -                     |
| 其他权益工具投资  |         | -                    | -                     |
| 应收清算款     |         | -                    | -                     |
| 应收股利      |         | -                    | -                     |
| 应收申购款     |         | -                    | -                     |
| 递延所得税资产   |         | -                    | -                     |
| 其他资产      | 7.4.7.5 | -                    | -                     |
| 资产总计      |         | 8,450,711,411.02     | 12,761,642,025.90     |
| 负债和净资产    | 附注号     | 本期末 2023 年 12 月 31 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    | 7.4.7.3 | -                    | -                     |
| 卖出回购金融资产款 |         | 1,033,653,641.64     | 1,037,161,803.92      |
| 应付清算款     |         | -                    | -                     |
| 应付赎回款     |         | -                    | -                     |
| 应付管理人报酬   |         | 1,882,376.57         | 2,981,245.97          |
| 应付托管费     |         | 627,458.86           | 993,748.64            |
| 应付销售服务费   |         | -                    | -                     |
| 应付投资顾问费   |         | -                    | -                     |
| 应交税费      |         | -                    | -                     |
| 应付利润      |         | -                    | -                     |
| 递延所得税负债   |         | -                    | -                     |
| 其他负债      | 7.4.7.6 | 283,972.26           | 364,540.45            |

|          |         |                  |                   |
|----------|---------|------------------|-------------------|
| 负债合计     |         | 1,036,447,449.33 | 1,041,501,338.98  |
| 净资产：     |         |                  |                   |
| 实收基金     | 7.4.7.7 | 7,315,534,137.87 | 11,577,629,571.03 |
| 其他综合收益   |         | -                | -                 |
| 未分配利润    | 7.4.7.8 | 98,729,823.82    | 142,511,115.89    |
| 净资产合计    |         | 7,414,263,961.69 | 11,720,140,686.92 |
| 负债和净资产总计 |         | 8,450,711,411.02 | 12,761,642,025.90 |

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0135 元，基金份额总额 7,315,534,137.87 份。

## 7.2 利润表

会计主体：招商金融债3个月定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2023年1月1日至2023年12月31日

单位：人民币元

| 项目                    | 附注号      | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 |
|-----------------------|----------|-------------------------------------|--|
| 一、营业总收入               |          | 289,544,849.94                      | 283,653,973.59                           |
| 1.利息收入                |          | 598,885.42                          | 809,675.81                               |
| 其中：存款利息收入             | 7.4.7.9  | 79,060.19                           | 190,598.08                               |
| 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            |          | 519,825.23                          | 619,077.73                               |
| 其他利息收入                |          | -                                   | -  |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）      |          | 256,704,323.05                      | 391,079,658.94                           |
| 其中：股票投资收益             | 7.4.7.10 | -                                   | -  |
| 基金投资收益                |          | -                                   | -  |
| 债券投资收益                | 7.4.7.11 | 256,704,323.05                      | 391,079,658.94                           |
| 资产支持证券投资              | 7.4.7.12 | -                                   | -  |
| 收益                    |          |                                     |  |
| 贵金属投资收益               | 7.4.7.13 | -                                   | -  |
| 衍生工具收益                | 7.4.7.14 | -                                   | -  |
| 股利收益                  | 7.4.7.15 | -                                   | -  |
| 以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益 |          | -                                   | -  |
| 其他投资收益                |          | -                                   | -  |
| 3.公允价值变动收益（损          | 7.4.7.16 | 32,241,627.41                       | -108,235,361.16                          |

|                     |            |                |                |
|---------------------|------------|----------------|----------------|
| 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)   | 7.4.7.17   | 14.06          | -              |
| 减:二、营业总支出           |            | 45,951,982.41  | 44,969,793.80  |
| 1.管理人报酬             | 7.4.10.2.1 | 24,638,343.21  | 28,076,501.47  |
| 其中:暂估管理人报酬          |            | -              | -              |
| 2.托管费               | 7.4.10.2.2 | 8,212,781.12   | 9,358,833.82   |
| 3.销售服务费             |            | -              | -              |
| 4.投资顾问费             |            | -              | -              |
| 5.利息支出              |            | 12,823,324.26  | 7,252,421.80   |
| 其中:卖出回购金融资产支出       |            | 12,823,324.26  | 7,252,421.80   |
| 6.信用减值损失            | 7.4.7.18   | -              | -              |
| 7.税金及附加             |            | -              | -              |
| 8.其他费用              | 7.4.7.19   | 277,533.82     | 282,036.71     |
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) |            | 243,592,867.53 | 238,684,179.79 |
| 减:所得税费用             |            | -              | -              |
| 四、净利润(净亏损以“-”号填列)   |            | 243,592,867.53 | 238,684,179.79 |
| 五、其他综合收益的税后净额       |            | -              | -              |
| 六、综合收益总额            |            | 243,592,867.53 | 238,684,179.79 |

注:根据最新《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》中的利润表格式的要求:上年度可比期间“证券出借利息收入”项目的“本期”金额列示于本期“其他利息收入”项目的“上年度可比期间”金额中。

### 7.3 净资产变动表

会计主体:招商金融债3个月定期开放债券型证券投资基金

本报告期:2023年1月1日至2023年12月31日

单位:人民币元

| 项目        | 本期2023年1月1日至2023年12月31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 | 11,577,629,571.03       | -      | 142,511,115.89 | 11,720,140,686.92 |
| 加:会计政策变更  | -                       | -      | -              | -                 |
| 前期差错更正    | -                       | -      | -              | -                 |
| 其他        | -                       | -      | -              | -                 |
| 二、本期期初净资产 | 11,577,629,571.03       | -      | 142,511,115.89 | 11,720,140,686.92 |
| 三、本期增减变动额 | -4,262,095,433.16       | -      | -43,781,292.07 | -4,305,876,725.23 |

|  |                              |        |                 |                   |
|--|------------------------------|--------|-----------------|-------------------|
| (减少以“-”号填列)                              |                              |        |                 |                   |
| (一)、综合收益总额                               | -                            | -      | 243,592,867.53  | 243,592,867.53    |
| (二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)      | -4,262,095,433.16            | -      | -53,392,397.40  | -4,315,487,830.56 |
| 其中:1.基金申购款                               | 1,289,765,195.67             | -      | 13,123,328.03   | 1,302,888,523.70  |
| 2.基金赎回款                                  | -5,551,860,628.83            | -      | -66,515,725.43  | -5,618,376,354.26 |
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列) | -                            | -      | -233,981,762.20 | -233,981,762.20   |
| (四)、其他综合收益结转留存收益                         | -                            | -      | -               | -                 |
| 四、本期期末净资产                                | 7,315,534,137.87             | -      | 98,729,823.82   | 7,414,263,961.69  |
| 项目                                       | 上年度可比期间2022年1月1日至2022年12月31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                                | 9,058,612,725.09             | -      | 216,547,852.51  | 9,275,160,577.60  |
| 加:会计政策变更                                 | -                            | -      | -               | -                 |
| 前期差错更正                                   | -                            | -      | -               | -                 |
| 其他                                       | -                            | -      | -               | -                 |
| 二、本期期初净资产                                | 9,058,612,725.09             | -      | 216,547,852.51  | 9,275,160,577.60  |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | 2,519,016,845.94             | -      | -74,036,736.62  | 2,444,980,109.32  |
| (一)、综合收益总额                               | -                            | -      | 238,684,179.79  | 238,684,179.79    |
| (二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)      | 2,519,016,845.94             | -      | 21,426,138.54   | 2,540,442,984.48  |
| 其中:1.基金申购款                               | 6,279,064,051.66             | -      | 121,810,266.64  | 6,400,874,318.30  |
| 2.基金赎回款                                  | -3,760,047,205.72            | -      | -100,384,128.10 | -3,860,431,333.82 |
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列) | -                            | -      | -334,147,054.95 | -334,147,054.95   |
| (四)、其他综合收益结转留存收益                         | -                            | -      | -               | -                 |
| 四、本期期末净资产                                | 11,577,629,571.03            | -      | 142,511,115.89  | 11,720,140,686.92 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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     |

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

招商金融债 3 个月定期开放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》、《招商金融债 3 个月定期开放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[2021]949 号文准予公开募集注册。本基金为契约型定期开放式基金,存续期限为不定期。本基金首次设立募集基金份额为 14,199,016,480.05 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(21)第 00203 号验资报告。《招商金融债 3 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)于 2021 年 4 月 28 日正式生效。本基金的基金管理人为招商基金管理有限公司,基金托管人为兴业银行股份有限公司(以下简称“兴业银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及截至报告期末最新公告的招募说明书的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行的债券(包括国债、地方政府债、金融债、央行票据、公司债、企业债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。本基金不投资于股票等资产,也不投资可转换债券、可交换债券。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。基金的投资组合比例为:本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%,其中,投资于金融债的比例不低于非现金基金资产的 80%,但在每次开放期前 10 个工作日、开放期及开放期结束后 10 个工作日的期间内,不受前述投资组合比例的限制。开放期内,本基金每个交易日日终持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%;封闭期内,本基金不受上述 5%的限制。其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金所界定的金融债券是指由银行和其他金融机构发行的债券,包括政策性银行、商业银行、证券公司、保险公司、财务公司及其他金融机构发行的债券。如法律法规的相关规定发生变更,基金管理人在履行适当程序后,可对上述资产配置比例进行调整。

本基金的业绩比较基准为:中债-金融债券总全价(总值)指数收益率。

### 7.4.2 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”)、中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及自 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 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。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

#### 7.4.4.3 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的业务模式是以收取合同现金流量为目标,则本基金将该金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产。此类金融资产主要包括货币资金、各类应收款项、买入返售金融资产等。

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

#### 7.4.4.4 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。

#### 7.4.4.5 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。

#### 7.4.4.6 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。

#### 7.4.4.7 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。

#### 7.4.4.8 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)。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

##### 1) 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

##### 2) 投资收益

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

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

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

#### 3) 公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产卖出或到期时转出计入投资收益。

#### 4) 信用减值损失

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认信用损失准备。本基金所计提的信用减值损失计入当期损益。

### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬、基金托管费和销售服务费（如适用）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。

### 7.4.4.11 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。

### 7.4.4.12 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。

#### 7.4.4.13 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。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

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。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 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。

#### 7.4.5.2 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。

#### 7.4.5.3 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。

### 7.4.6 税项

根据财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖债券免征增值税；2018 年 1 月 1 日起，公开募集证券投资基金管理人运营公开募集证券投资基金过程中发生的资管产品运营业务，以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不计缴企业所得税。

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

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

| 项目             | 本期末 2023 年 12 月 31 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|----------------|----------------------|-----------------------|
| 活期存款           | 5,092,318.10         | 5,572,177.35          |
| 等于：本金          | 5,091,690.92         | 5,571,235.17          |
| 加：应计利息         | 627.18               | 942.18                |
| 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             | 5,092,318.10         | 5,572,177.35          |

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末 2023 年 12 月 31 日 |                  |                |                  |               |
|---------------|----------------------|------------------|----------------|------------------|---------------|
|               | 成本                   | 应计利息             | 公允价值           | 公允价值变动           |               |
| 股票            | -                    | -                | -              | -                |               |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                    | -                | -              | -                |               |
| 债券            | 交易所市场                | -                | -              | -                |               |
|               | 银行间市场                | 8,258,160,802.59 | 161,310,592.92 | 8,445,619,092.92 | 26,147,697.41 |
|               | 合计                   | 8,258,160,802.59 | 161,310,592.92 | 8,445,619,092.92 | 26,147,697.41 |
| 资产支持证券        | -                    | -                | -              | -                |               |
| 基金            | -                    | -                | -              | -                |               |
| 其他            | -                    | -                | -              | -                |               |

|               |                       |                   |                |                   |               |
|---------------|-----------------------|-------------------|----------------|-------------------|---------------|
| 合计            |                       | 8,258,160,802.59  | 161,310,592.92 | 8,445,619,092.92  | 26,147,697.41 |
| 项目            | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |                   |                |                   |               |
|               |                       | 成本                | 应计利息           | 公允价值              | 公允价值变动        |
| 股票            |                       | -                 | -              | -                 | -             |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |                       | -                 | -              | -                 | -             |
| 债券            | 交易所市场                 | -                 | -              | -                 | -             |
|               | 银行间市场                 | 12,520,518,930.00 | 241,644,848.55 | 12,756,069,848.55 | -6,093,930.00 |
|               | 合计                    | 12,520,518,930.00 | 241,644,848.55 | 12,756,069,848.55 | -6,093,930.00 |
| 资产支持证券        |                       | -                 | -              | -                 | -             |
| 基金            |                       | -                 | -              | -                 | -             |
| 其他            |                       | -                 | -              | -                 | -             |
| 合计            |                       | 12,520,518,930.00 | 241,644,848.55 | 12,756,069,848.55 | -6,093,930.00 |

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融工具。

### 7.4.7.4 买入返售金融资产

#### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末无各项买入返售金融资产。

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

### 7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

### 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末 2023 年 12 月 31 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 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      | 63,972.26            | 144,540.45            |
| 其中：交易所市场    | -                    | -                     |
| 银行间市场       | 63,972.26            | 144,540.45            |
| 应付利息        | -                    | -                     |

|      |            |            |
|------|------------|------------|
| 预提费用 | 220,000.00 | 220,000.00 |
| 合计   | 283,972.26 | 364,540.45 |

#### 7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日 |                   |
|---------------|-------------------------------------|-------------------|
|               | 基金份额（份）                             | 账面金额              |
| 上年度末          | 11,577,629,571.03                   | 11,577,629,571.03 |
| 本期申购          | 1,289,765,195.67                    | 1,289,765,195.67  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -5,551,860,628.83                   | -5,551,860,628.83 |
| 基金份额折算变动份额    | -                                   | -                 |
| 本期末           | 7,315,534,137.87                    | 7,315,534,137.87  |

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。

#### 7.4.7.8 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         |
|----------------|-----------------|----------------|-----------------|
| 上年度末           | 168,341,428.80  | -25,830,312.91 | 142,511,115.89  |
| 加：会计政策变更       | -               | -              | -               |
| 前期差错更正         | -               | -              | -               |
| 其他             | -               | -              | -               |
| 本期期初           | 168,341,428.80  | -25,830,312.91 | 142,511,115.89  |
| 本期利润           | 211,351,240.12  | 32,241,627.41  | 243,592,867.53  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -61,805,586.85  | 8,413,189.45   | -53,392,397.40  |
| 其中：基金申购款       | 15,697,290.01   | -2,573,961.98  | 13,123,328.03   |
| 基金赎回款          | -77,502,876.86  | 10,987,151.43  | -66,515,725.43  |
| 本期已分配利润        | -233,981,762.20 | -              | -233,981,762.20 |
| 本期末            | 83,905,319.87   | 14,824,503.95  | 98,729,823.82   |

#### 7.4.7.9 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 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 |
|-----------|-------------------------------------|--|
| 活期存款利息收入  | 79,060.19                           | 190,598.08                               |
| 定期存款利息收入  | -                                   | -  |
| 其他存款利息收入  | -                                   | -  |
| 结算备付金利息收入 | -                                   | -  |
| 其他        | -                                   | -  |
| 合计        | 79,060.19                           | 190,598.08                               |

### 7.4.7.10 股票投资收益

#### 7.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

本基金本报告期内及上年度可比期间无股票投资收益。

#### 7.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无买卖股票差价收入。

#### 7.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无股票赎回差价收入。

#### 7.4.7.10.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无股票申购差价收入。

#### 7.4.7.10.5 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无证券出借差价收入。

### 7.4.7.11 债券投资收益

#### 7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                                    | 本期 2023 年 1 月 1 日至<br>2023 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2022 年 1 月<br>1 日至 2022 年 12 月 31 日 |
|---------------------------------------|--|---|
| 债券投资收益——利息收入                          | 248,442,471.51                         | 290,081,547.76                              |
| 债券投资收益——买卖债券<br>(债转股及债券到期兑付) 差<br>价收入 | 8,261,851.54                           | 100,998,111.18                              |
| 债券投资收益——赎回差价收<br>入                    | -                                      | -   |
| 债券投资收益——申购差价收<br>入                    | -                                      | -   |
| 合计                                    | 256,704,323.05                         | 391,079,658.94                              |

#### 7.4.7.11.2 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 1 月 1 日至<br>2023 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2022 年 1<br>月 1 日至 2022 年 12 月 31<br>日 |
|-----------------------------|--|--|
| 卖出债券(债转股及债券到<br>期兑付)成交总额    | 28,594,422,198.73                      | 30,139,148,462.80                              |
| 减: 卖出债券(债转股及债<br>券到期兑付)成本总额 | 28,227,000,338.41                      | 29,586,993,728.84                              |
| 减: 应计利息总额                   | 358,877,428.78                         | 450,852,072.78                                 |



|          |              |                |
|----------|--------------|----------------|
| 减：交易费用   | 282,580.00   | 304,550.00     |
| 买卖债券差价收入 | 8,261,851.54 | 100,998,111.18 |

#### 7.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无债券赎回差价收入。

#### 7.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无债券申购差价收入。

#### 7.4.7.12 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

##### 7.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无买卖资产支持证券差价收入。

##### 7.4.7.12.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券赎回差价收入。

##### 7.4.7.12.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券申购差价收入。

#### 7.4.7.13 贵金属投资收益

##### 7.4.7.13.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

##### 7.4.7.13.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无买卖贵金属差价收入。

##### 7.4.7.13.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属赎回差价收入。

##### 7.4.7.13.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属申购差价收入。

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

##### 7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具买卖权证差价收入。

##### 7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具其他投资收益。

#### 7.4.7.15 股利收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无股利收益。

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                       | 本期 2023 年 1 月 1 日至<br>2023 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2022 年 1<br>月 1 日至 2022 年 12 月 31<br>日 |
|----------------------------|--|--|
| 1.交易性金融资产                  | 32,241,627.41                          | -108,235,361.16                                |
| ——股票投资                     | -                                      | -  |
| ——债券投资                     | 32,241,627.41                          | -108,235,361.16                                |
| ——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<br>变动产生的预估增值税 | -                                      | -  |
| 合计                         | 32,241,627.41                          | -108,235,361.16                                |

#### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期 2023 年 1 月 1 日至<br>2023 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2022 年 1 月<br>1 日至 2022 年 12 月 31 日 |
|---------|--|---|
| 基金赎回费收入 | 14.06                                  | -   |
| 合计      | 14.06                                  | -   |

#### 7.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内及上年度可比期间无信用减值损失。

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期 2023 年 1 月 1 日至<br>2023 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2022 年 1<br>月 1 日至 2022 年 12 月 31<br>日 |
|---------|--|--|
| 审计费用    | 100,000.00                             | 100,000.00                                     |
| 信息披露费   | 120,000.00                             | 120,000.00                                     |
| 证券出借违约金 | -                                      | -  |
| 银行费用    | 20,333.82                              | 24,036.71                                      |
| 其他      | 37,200.00                              | 38,000.00                                      |

|    |            |            |
|----|------------|------------|
| 合计 | 277,533.82 | 282,036.71 |
|----|------------|------------|

## 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 7.4.8.1 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。

### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

2024 年 1 月 16 日，本基金管理人发布《招商金融债 3 个月定期开放债券型证券投资基金 2024 年度第一次分红公告》，收益分配基准日为 2024 年 1 月 11 日，权益登记日为 2024 年 1 月 17 日、除息日为 2024 年 1 月 17 日，现金红利发放日为 2024 年 1 月 18 日，收益分配方案为招商金融债 3 个月定开债份额基金每 10 份基金份额派发红利人民币 0.050 元。

2024 年 3 月 13 日，本基金管理人发布《招商金融债 3 个月定期开放债券型证券投资基金 2024 年度第二次分红公告》，收益分配基准日为 2024 年 3 月 7 日，权益登记日为 2024 年 3 月 15 日、除息日为 2024 年 3 月 15 日，现金红利发放日为 2024 年 3 月 18 日，收益分配方案为招商金融债 3 个月定开债份额基金每 10 份基金份额派发红利人民币 0.090 元。

## 7.4.9 关联方关系

| 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        |
| 兴业银行股份有限公司             | 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     |
| 招商财富资产管理有限公司           | 基金管理人的全资子公司  |
| 博时基金(国际)有限公司           | 基金管理人的参股经营机构 |

注：1、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。

2、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。

## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.10.1.1 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。

#### 7.4.10.1.2 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。

#### 7.4.10.1.3 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。

#### 7.4.10.1.4 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。

#### 7.4.10.1.5 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。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目               | 本期 2023 年 1 月 1 日至<br>2023 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2022 年 1<br>月 1 日至 2022 年 12 月 31<br>日 |
|------------------|--|--|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 24,638,343.21                          | 28,076,501.47                                  |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 6,539,840.52                           | 219,891.20                                     |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 18,098,502.69                          | 27,856,610.27                                  |
| 应支付投资顾问的投资顾问费    | -                                      | -  |

注：支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值×0.30%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日基金管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期 2023 年 1 月 1 日至<br>2023 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2022 年 1<br>月 1 日至 2022 年 12 月 31<br>日 |
|----------------|--|--|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 8,212,781.12                           | 9,358,833.82                                   |

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：

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

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

单位：人民币元

| 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日 |        |      |       |      |       |      |
|-------------------------------------|--------|------|-------|------|-------|------|
| 银行<br>间市<br>场交<br>易的                | 债券交易金额 |      | 基金逆回购 |      | 基金正回购 |      |
|                                     | 基金买入   | 基金卖出 | 交易金额  | 利息收入 | 交易金额  | 利息支出 |
|                                     |        |      |       |      |       |      |

|        |                |   |   |   |                  |           |
|--------|----------------|---|---|---|------------------|-----------|
| 各关联方名称 |                |   |   |   |                  |           |
| 兴业银行   | 199,217,358.90 | - | - | - | 1,548,200,000.00 | 89,333.15 |

| 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 |                |      |       |      |                  |           |
|--|----------------|------|-------|------|------------------|-----------|
| 银行间市场交易的各关联方名称                           | 债券交易金额         |      | 基金逆回购 |      | 基金正回购            |           |
|  | 基金买入           | 基金卖出 | 交易金额  | 利息收入 | 交易金额             | 利息支出      |
| 兴业银行                                     | 161,516,977.26 | -    | -     | -    | 1,715,000,000.00 | 75,454.99 |

#### 7.4.10.4 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

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

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

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

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

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

本报告期内及上年度可比期间基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

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

份额单位：份

| 关联方名称      | 本期末 2023 年 12 月 31 日 |                  | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |                  |
|------------|----------------------|------------------|-----------------------|------------------|
|            | 持有的基金份额              | 持有的基金份额占基金总份额的比例 | 持有的基金份额               | 持有的基金份额占基金总份额的比例 |
| 兴业银行股份有限公司 | 1,984,236,839.52     | 27.12%           | 2,984,236,839.52      | 25.78%           |
| 招商银行股份有限公司 | 2,068,208,825.37     | 28.27%           | 3,068,208,825.37      | 26.50%           |

注：表格中的比例为四舍五入的结果。

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称   | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年<br>12 月 31 日 |           | 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日<br>至 2022 年 12 月 31 日 |            |
|---------|--|-----------|--|------------|
|         | 期末余额                                   | 当期利息收入    | 期末余额   | 当期利息收入     |
| 兴业银行-活期 | 5,092,318.10                           | 79,060.19 | 5,572,177.35                                 | 190,598.08 |

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

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 7.4.11 利润分配情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 权益登记日                 | 场内除息日 | 场外除息日                 | 每 10 份<br>基金份额<br>分红数 | 现金形式发放总<br>额   | 再投资形式发放<br>总额 | 本期利润分配合<br>计   | 备注 |
|----|-----------------------|-------|-----------------------|-----------------------|----------------|---------------|----------------|----|
| 1  | 2023 年<br>3 月 22<br>日 | -     | 2023 年<br>3 月 22<br>日 | 0.0750                | 66,948,875.68  | 724,517.89    | 67,673,393.57  | -  |
| 2  | 2023 年<br>5 月 25<br>日 | -     | 2023 年<br>5 月 25<br>日 | 0.0600                | 53,556,148.24  | 586,878.82    | 54,143,027.06  | -  |
| 3  | 2023 年<br>9 月 1<br>日  | -     | 2023 年<br>9 月 1<br>日  | 0.1000                | 67,291,743.81  | 983,931.70    | 68,275,675.51  | -  |
| 4  | 2023 年<br>12 月 8<br>日 | -     | 2023 年<br>12 月 8<br>日 | 0.0600                | 43,296,470.77  | 593,195.29    | 43,889,666.06  | -  |
| 合计 | -                     | -     | -                     | 0.2950                | 231,093,238.50 | 2,888,523.70  | 233,981,762.20 | -  |

#### 7.4.12 期末（2023 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 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。

##### 7.4.12.2 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。

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 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 1,033,653,641.64 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<br>单价 | 数量（张）      | 期末估值总额           |
|--------|----------|-------------------|------------|------------|------------------|
| 230203 | 23 国开 03 | 2024 年 1 月<br>2 日 | 103.67     | 5,613,000  | 581,872,798.35   |
| 210203 | 21 国开 03 | 2024 年 1 月<br>3 日 | 104.80     | 4,211,000  | 441,316,941.97   |
| 230208 | 23 国开 08 | 2024 年 1 月<br>3 日 | 101.74     | 1,053,000  | 107,133,946.23   |
| 合计     | -        | -                 | -          | 10,877,000 | 1,130,323,686.55 |

#### 7.4.12.3.2 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。

#### 7.4.12.4 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。

### 7.4.13 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。

#### 7.4.13.1 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。

#### 7.4.13.2 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、债券投资及其他。

本基金的银行存款存放在本基金的基金托管人开立的托管账户中，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。本基金所持有的债券投资的信用评级情况参见附注 7.4.13.2.1 至 7.4.13.2.6，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。

#### **7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

#### **7.4.13.2.2 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。

#### **7.4.13.2.3 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。

#### **7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的债券投资。

#### **7.4.13.2.5 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。

#### **7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

### **7.4.13.3 流动性风险**

#### **7.4.13.3.1 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 7.4.12 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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值或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负债的账面价值，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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2023 年 12 月 31 日 | 1 年以内         | 1-5 年            | 5 年以上          | 不计息 | 合计               |
|----------------------|---------------|------------------|----------------|-----|------------------|
| 资产                   |               |                  |                |     |                  |
| 货币资金                 | 5,092,318.10  | -                | -              | -   | 5,092,318.10     |
| 结算备付金                | -             | -                | -              | -   | -                |
| 存出保证金                | -             | -                | -              | -   | -                |
| 交易性金融资产              | 55,747,114.75 | 7,512,490,565.04 | 877,381,413.13 | -   | 8,445,619,092.92 |
| 衍生金融资产               | -             | -                | -              | -   | -                |
| 买入返售金融资产             | -             | -                | -              | -   | -                |
| 债权投资                 | -             | -                | -              | -   | -                |
| 应收股利                 | -             | -                | -              | -   | -                |
| 应收申购款                | -             | -                | -              | -   | -                |
| 应收清算款                | -             | -                | -              | -   | -                |
| 其他资产                 | -             | -                | -              | -   | -                |
| 资产总计                 | 60,839,432.85 | 7,512,490,565.04 | 877,381,413.13 | -   | 8,450,711,411.02 |
| 负债                   |               |                  |                |     |                  |
| 应付赎回款                | -             | -                | -              | -   | -                |

|                       |                  |                   |                |               |                   |
|-----------------------|------------------|-------------------|----------------|---------------|-------------------|
| 应付管理人报酬               | -                | -                 | -              | 1,882,376.57  | 1,882,376.57      |
| 应付托管费                 | -                | -                 | -              | 627,458.86    | 627,458.86        |
| 应付清算款                 | -                | -                 | -              | -             | -                 |
| 卖出回购金融资产款             | 1,033,653,641.64 | -                 | -              | -             | 1,033,653,641.64  |
| 应付销售服务费               | -                | -                 | -              | -             | -                 |
| 应付投资顾问费               | -                | -                 | -              | -             | -                 |
| 应付利润                  | -                | -                 | -              | -             | -                 |
| 应交税费                  | -                | -                 | -              | -             | -                 |
| 其他负债                  | -                | -                 | -              | 283,972.26    | 283,972.26        |
| 负债总计                  | 1,033,653,641.64 | -                 | -              | 2,793,807.69  | 1,036,447,449.33  |
| 利率敏感度缺口               | -972,814,208.79  | 7,512,490,565.04  | 877,381,413.13 | -2,793,807.69 | 7,414,263,961.69  |
| 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                    |                  |                   |                |               |                   |
| 货币资金                  | 5,572,177.35     | -                 | -              | -             | 5,572,177.35      |
| 结算备付金                 | -                | -                 | -              | -             | -                 |
| 存出保证金                 | -                | -                 | -              | -             | -                 |
| 交易性金融资产               | 699,620,289.61   | 11,927,582,838.39 | 128,866,720.55 | -             | 12,756,069,848.55 |
| 衍生金融资产                | -                | -                 | -              | -             | -                 |
| 买入返售金融资产              | -                | -                 | -              | -             | -                 |
| 债权投资                  | -                | -                 | -              | -             | -                 |
| 应收股利                  | -                | -                 | -              | -             | -                 |
| 应收申购款                 | -                | -                 | -              | -             | -                 |
| 应收清算款                 | -                | -                 | -              | -             | -                 |
| 其他资产                  | -                | -                 | -              | -             | -                 |
| 资产总计                  | 705,192,466.96   | 11,927,582,838.39 | 128,866,720.55 | -             | 12,761,642,025.90 |
| 负债                    |                  |                   |                |               |                   |
| 应付赎回款                 | -                | -                 | -              | -             | -                 |
| 应付管理人报酬               | -                | -                 | -              | 2,981,245.97  | 2,981,245.97      |
| 应付托管费                 | -                | -                 | -              | 993,748.64    | 993,748.64        |
| 应付清算款                 | -                | -                 | -              | -             | -                 |
| 卖出回购金融资产款             | 1,037,161,803.92 | -                 | -              | -             | 1,037,161,803.92  |
| 应付销售服务费               | -                | -                 | -              | -             | -                 |
| 应付投资顾问费               | -                | -                 | -              | -             | -                 |
| 应付利润                  | -                | -                 | -              | -             | -                 |
| 应交税费                  | -                | -                 | -              | -             | -                 |
| 其他负债                  | -                | -                 | -              | 364,540.45    | 364,540.45        |
| 负债总计                  | 1,037,161,803.92 | -                 | -              | 4,339,535.06  | 1,041,501,338.98  |
| 利率敏感度缺口               | -331,969,336.96  | 11,927,582,838.39 | 128,866,720.55 | -4,339,535.06 | 11,720,140,686.92 |

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。

#### 7.4.13.4.1.2 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 12 月 31 日）       | 上年度末（2022 年 12 月 31 日） |
|    | 1. 市场利率平行上升 50 个基点    | -125,293,556.28             | -124,683,878.44        |
|    | 2. 市场利率平行下降 50 个基点    | 128,542,191.03              | 126,933,988.88         |

#### 7.4.13.4.2 其他价格风险

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

##### 7.4.13.4.2.1 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。

##### 7.4.13.4.2.2 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。

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 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。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 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 12 月 31 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|---------------|----------------------|-----------------------|
| 第一层次          | -                    | -                     |
| 第二层次          | 8,445,619,092.92     | 12,756,069,848.55     |
| 第三层次          | -                    | -                     |
| 合计            | 8,445,619,092.92     | 12,756,069,848.55     |

#### 7.4.14.2.2 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。

#### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

##### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

本报告期内及上年度可比期间，本基金无第三层次公允价值余额及变动情况。

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 7.4.14.4 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。

#### 7.4.15 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。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目             | 金额（元）            | 占基金总资产的比例（%） |
|----|----------------|------------------|--------------|
| 1  | 权益投资           | -                | -            |
|    | 其中：股票          | -                | -            |
| 2  | 基金投资           | -                | -            |
| 3  | 固定收益投资         | 8,445,619,092.92 | 99.94        |
|    | 其中：债券          | 8,445,619,092.92 | 99.94        |
|    | 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 | 5,092,318.10     | 0.06   |
| 8 | 其他资产         | -                | -      |
| 9 | 合计           | 8,450,711,411.02 | 100.00 |

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

## 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金报告期末未持有股票。

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金报告期内无买入股票。

### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金报告期内无卖出股票。

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金报告期内无买卖股票。

## 8.5 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      | 624,776,273.23   | 8.43         |
| 2  | 央行票据      | -                | -            |
| 3  | 金融债券      | 7,820,842,819.69 | 105.48       |
|    | 其中：政策性金融债 | 7,820,842,819.69 | 105.48       |
| 4  | 企业债券      | -                | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | -                | -            |
| 6  | 中期票据      | -                | -            |
| 7  | 可转债（可交换债） | -                | -            |
| 8  | 同业存单      | -                | -            |

|    |    |                  |        |
|----|----|------------------|--------|
| 9  | 其他 | -                | -      |
| 10 | 合计 | 8,445,619,092.92 | 113.91 |

## 8.6 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  | 230203 | 23 国开 03 | 9,600,000 | 995,185,972.60 | 13.42        |
| 2  | 210203 | 21 国开 03 | 9,200,000 | 964,169,049.18 | 13.00        |
| 3  | 230303 | 23 进出 03 | 9,100,000 | 932,930,508.20 | 12.58        |
| 4  | 230305 | 23 进出 05 | 8,400,000 | 873,742,224.66 | 11.78        |
| 5  | 230208 | 23 国开 08 | 7,300,000 | 742,713,967.21 | 10.02        |

## 8.7 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。

## 8.8 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。

## 8.9 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。

## 8.10 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。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

### 8.11.2 本期国债期货投资评价

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1

报告期内基金投资的前十名证券除 21 国开 03（证券代码 210203）、22 国开 02（证券代码 220202）、23 国开 03（证券代码 230203）、23 国开 07（证券代码 230207）、23 国开 08（证券代码 230208）、23 进出 02（证券代码 230302）、23 进出 03（证券代码 230303）、23 进出 05（证券代码 230305）、23 农发清发 02（证券代码 092318002）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、21 国开 03（证券代码 210203）

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 国开 02（证券代码 220202）

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。

3、23 国开 03（证券代码 230203）

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。

4、23 国开 07（证券代码 230207）

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。

5、23 国开 08（证券代码 230208）

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

6、23 进出 02（证券代码 230302）

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

7、23 进出 03（证券代码 230303）

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

8、23 进出 05（证券代码 230305）

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

9、23 农发清发 02（证券代码 092318002）

根据发布的相关公告，该证券发行人在报告期内因未依法履行职责、未按期申报税款、违反税收管理规定等原因，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。

### 8.12.2

根据基金合同规定，本基金的投资范围不包括股票。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

本基金本报告期末未持有其他资产。

### 8.12.4 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。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数<br>(户) | 户均持有的基<br>金份额 | 持有人结构            |         |           |        |
|--------------|---------------|------------------|---------|-----------|--------|
|              |               | 机构投资者            |         | 个人投资者     |        |
|              |               | 持有份额             | 占总份额比例  | 持有份额      | 占总份额比例 |
| 267          | 27,399,004.26 | 7,315,479,957.25 | 100.00% | 54,180.62 | 0.00%  |

### 9.2 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 | 10,066.42 | 0.0001%  |

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份



|                                |                   |
|--------------------------------|-------------------|
| 基金合同生效日(2021 年 4 月 28 日)基金份额总额 | 14,199,016,480.05 |
| 本报告期期初基金份额总额                   | 11,577,629,571.03 |
| 本报告期基金总申购份额                    | 1,289,765,195.67  |
| 减：报告期基金总赎回份额                   | 5,551,860,628.83  |
| 本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）     | -                 |
| 本报告期期末基金份额总额                   | 7,315,534,137.87  |

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末召开基金份额持有人大会。

### 11.2 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，同意钟文岳先生辞任公司常务副总经理、财务负责人职务。

根据本基金管理人 2023 年 8 月 30 日的公告，经招商基金管理有限公司第六届董事会 2023 年第五次会议审议通过，同意聘任孙明霞女士为公司副总经理。

根据本基金管理人 2023 年 9 月 28 日的公告，经招商基金管理有限公司第六届董事会 2023 年第七次会议审议通过，同意聘任董方先生为公司副总经理。

根据本基金管理人 2023 年 12 月 30 日的公告，经招商基金管理有限公司第七届董事会 2023 年第一次会议审议通过，同意聘任孙明霞女士为公司财务负责人。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动如下：

自 2023 年 4 月 11 日起，陈启女士担任基金托管人资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作，叶文煌先生不再担任基金托管人资产托管部总经理。

### 11.3 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。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金的审计事务所无变化，目前德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）已为本基金提供审计服务3年，本报告期应支付给德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为人民币100,000.00元。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 11.6.1 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。

### 11.6.2 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。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 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 |    |
| 长江证券 | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 方正证券 | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 招商证券 | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 中信证券 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |

注：基金交易佣金根据券商季度综合评分结果给与分配，券商综合评分根据研究报告质量、路演质量、联合调研质量等维度进行打分，从多家服务券商中选取符合法律规范经营的综合能力靠前的券商给与佣金分配，季度评分和佣金分配分别由专人负责。

### 11.7.2 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 |
| 长江证券 | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 方正证券 | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 招商证券 | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 中信证券 | -    | -            | -      | -              | -    | -            |

## 11.8 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 |
| 2  | 招商金融债 3 个月定期开放债券型证券投资基金 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 |
| 3  | 关于招商金融债 3 个月定期开放债券型证券投资基金第六个开放期开放申购赎回及转换业务的公告 | 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 | 2023-02-03 |
| 4  | 招商金融债 3 个月定期开放债券型证券投资基金 2023 年度第一次分红公告        | 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 | 2023-03-21 |
| 5  | 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 |
| 6  | 招商金融债 3 个月定期开放债券型证券投资基金 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  | 招商金融债 3 个月定期开放债券型证券投资基金 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 |
| 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  | 招商金融债 3 个月定期开放债券型证券投资基金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 | 2023-04-27 |
| 10 | 招商金融债 3 个月定期开放债券型证券投资基金更新的招募说明书（二零二三年第一号）     | 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 | 2023-04-27 |
| 11 | 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 |
| 12 | 关于招商金融债 3 个月定期开放债券型证券投资基金第七个开放期开放申购赎回及转换业务的公告 | 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 | 2023-05-13 |
| 13 | 关于招商金融债 3 个月定期开放债券型证券投资基金延长开放期的公告             | 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 | 2023-05-20 |
| 14 | 关于暂停招商金融债 3 个月定期开放债券型证券投资基金大额申购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 | 2023-05-23 |
| 15 | 招商金融债 3 个月定期开放债券型证券投资基金                       | 证券日报、基金管理                  | 2023-05-24 |

|    |   |                                    |            |
|----|---|------------------------------------|------------|
|    | 金 2023 年度第二次分红公告                                      | 人网站及中国证监会<br>基金电子披露网站              |            |
| 16 | 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<br>人网站及中国证监会<br>基金电子披露网站 | 2023-06-22 |
| 17 | 关于招商金融债 3 个月定期开放债券型证券投资<br>基金基金经理变更的公告                | 证券日报、基金管理<br>人网站及中国证监会<br>基金电子披露网站 | 2023-07-18 |
| 18 | 招商金融债 3 个月定期开放债券型证券投资基<br>金 2023 年第 2 季度报告            | 证券日报、基金管理<br>人网站及中国证监会<br>基金电子披露网站 | 2023-07-20 |
| 19 | 招商基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 2<br>季度报告提示性公告                 | 证券日报及基金管理<br>人网站                   | 2023-07-20 |
| 20 | 招商金融债 3 个月定期开放债券型证券投资基<br>金基金产品资料概要更新                 | 证券日报、基金管理<br>人网站及中国证监会<br>基金电子披露网站 | 2023-07-21 |
| 21 | 招商金融债 3 个月定期开放债券型证券投资基<br>金更新的招募说明书（二零二三年第二号）         | 证券日报、基金管理<br>人网站及中国证监会<br>基金电子披露网站 | 2023-07-21 |
| 22 | 招商基金管理有限公司关于运用自有资金投资<br>旗下公募基金的公告                     | 证券日报、基金管理<br>人网站及中国证监会<br>基金电子披露网站 | 2023-08-21 |
| 23 | 招商金融债 3 个月定期开放债券型证券投资基<br>金 2023 年中期报告                | 证券日报、基金管理<br>人网站及中国证监会<br>基金电子披露网站 | 2023-08-30 |
| 24 | 招商基金管理有限公司关于高级管理人员变更<br>的公告                           | 证券日报、基金管理<br>人网站及中国证监会<br>基金电子披露网站 | 2023-08-30 |
| 25 | 关于招商金融债 3 个月定期开放债券型证券投<br>资基金第八个开放期开放申购赎回及转换业务<br>的公告 | 证券日报、基金管理<br>人网站及中国证监会<br>基金电子披露网站 | 2023-08-30 |
| 26 | 招商基金管理有限公司旗下基金 2023 年中期<br>报告提示性公告                    | 证券日报及基金管理<br>人网站                   | 2023-08-30 |
| 27 | 招商金融债 3 个月定期开放债券型证券投资基<br>金 2023 年度第三次分红公告            | 证券日报、基金管理<br>人网站及中国证监会<br>基金电子披露网站 | 2023-08-31 |
| 28 | 招商基金管理有限公司关于终止南京途牛基金<br>销售有限公司办理旗下基金销售业务的公告           | 证券日报、基金管理<br>人网站及中国证监会<br>基金电子披露网站 | 2023-09-05 |
| 29 | 招商基金管理有限公司关于终止凤凰金信（海<br>口）基金销售有限公司办理旗下基金销售业务<br>的公告   | 证券日报、基金管理<br>人网站及中国证监会<br>基金电子披露网站 | 2023-09-07 |
| 30 | 招商基金管理有限公司关于高级管理人员变更<br>的公告                           | 证券日报、基金管理<br>人网站及中国证监会             | 2023-09-28 |

|    |  |                            |            |
|----|--|----------------------------|------------|
|    |  | 基金电子披露网站                   |            |
| 31 | 招商基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 3 季度报告提示性公告     | 证券日报及基金管理人网站               | 2023-10-24 |
| 32 | 招商金融债 3 个月定期开放债券型证券投资基金 2023 年第 3 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 | 2023-10-24 |
| 33 | 招商基金管理有限公司关于运用自有资金投资旗下公募基金的公告          | 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 | 2023-10-30 |
| 34 | 招商金融债 3 个月定期开放债券型证券投资基金 2023 年度第四次分红公告 | 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 | 2023-12-07 |
| 35 | 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 | 2023-12-30 |

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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              | 20230208-20230911       | 1,982,994,200.33 | -    | 800,000,000.00   | 1,182,994,200.33 | 16.17% |
| 机构   | 2              | 20230101-20231231       | 2,984,236,839.52 | -    | 1,000,000,000.00 | 1,984,236,839.52 | 27.12% |
| 机构   | 3              | 20230207-20231231       | 3,068,208,825.37 | -    | 1,000,000,000.00 | 2,068,208,825.37 | 28.27% |
| 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。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 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金融债 3 个月定期开放债券型证券投资基金设立的文件；
- 3、《招商金融债 3 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》；
- 4、《招商金融债 3 个月定期开放债券型证券投资基金托管协议》；
- 5、《招商金融债 3 个月定期开放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。

### 13.2 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

### 13.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人招商基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-887-9555

网址：<http://www.cmfcchina.com>

招商基金管理有限公司

2024 年 3 月 29 日