招商安华债券型证券投资基金 2024 年中期报告

2024 年 06 月 30 日

基金管理人：招商基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2024 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024 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 2024 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 5
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6
§3 主要财务指标和基金净值表现 6
3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 7
§4 管理人报告 9
4.1 基金管理人及基金经理情况 9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 11
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 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 13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 14
4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明 14
§5 托管人报告 14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 15
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 15
§6 半年度财务会计报告（未经审计） 15
6.1 资产负债表 15
6.2 利润表 17
6.3 净资产变动表 18
6.4 报表附注 20
§7 投资组合报告 42
7.1 期末基金资产组合情况 42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 42
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 45
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 46
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 46
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 46
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 46
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 46

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 47
7.12 投资组合报告附注 47
§8 基金份额持有人信息 49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 49
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 49
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 49
§9 开放式基金份额变动 50
§10 重大事件揭示 50
10.1 基金份额持有人大会决议 50
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 50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 50
10.4 基金投资策略的改变 50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 51
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 51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 51
10.8 其他重大事件 55
§11 备查文件目录 56
11.1 备查文件目录 56
11.2 存放地点 56
11.3 查阅方式 56

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	招商安华债券型证券投资基金		
基金简称	招商安华债券		
基金主代码	008791		
交易代码	008791		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2020 年 3 月 25 日		
基金管理人	招商基金管理有限公司		
基金托管人	中国银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	17,009,465,235.26 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	招商安华债券 A	招商安华债券 C	招商安华债券 D
下属分级基金的交易代码	008791	008792	016779
报告期末下属分级基金的份额总额	14,902,238,547.63 份	833,177,217.91 份	1,274,049,469.72 份

注：本基金从 2022 年 9 月 28 日起新增 D 类份额，D 类份额自 2022 年 11 月 21 日起存续。

2.2 基金产品说明

投资目标	在保持资产流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，合理配置债券等固定收益类资产和权益类资产，追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	1、资产配置策略 本基金在合同约定的范围内实施稳健的整体资产配置，通过对国内外宏观经济状况、证券市场走势、市场利率走势以及市场资金供求情况、信用风险情况、风险预算和有关法律法规等因素的综合分析，预测各类资产在长、中、短期内的风险收益特征，进而进行合理资产配置。 2、可转换债券和可交换债券投资策略 可转换债券和可交换债券投资是基于对宏观经济形势、国家财政政策、货币政策深入分析的基础上，对各类市场大势做出判断的前提下，一方面对可转换债券和可交换债券所对应的基础股票进行分析和研究，对盈利能力较强或成长性较好的行业和上市公司的可转债进行重点关注，另一方面，应用招商基金可转换债券和可交换债券评价体系，定量分析和定性分析相结合，选择具有较高投资价值的可转换债券和可交换债券进行投资，主要包括：基于二叉树模型的可转换债券和可交换债券价值分析、可转换债券和可交换债券的债/股性和隐含波动率分析、对可转换债券和可交换债券条款的定性分析等。 3、债券（不含可转换债券、可交换债券）投资策略

	本基金在债券投资中主要基于对国家财政政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济的动态跟踪，采用久期匹配下的主动性投资策略，主要包括：久期匹配、期限结构配置、信用策略，相对价值判断、动态优化等管理手段，对债券市场、债券收益率曲线以及各种债券价格的变化进行预测，相机而动、积极调整。 4、股票投资策略 本基金对股票的投资，以价值投资理念为导向，采取“自上而下”的多主题投资和“自下而上”的个股精选方法，灵活运用多种股票投资策略，深度挖掘经济结构转型过程中具有核心竞争力和发展潜力的行业和公司，实现基金资产的长期稳定增值。 5、资产支持证券投资策略 资产支持类证券的定价受市场利率、流动性、发行条款、标的资产的构成及质量、提前偿还率及其它附加条款等多种因素的影响。本基金将在利率基本面分析、市场流动性分析和信用评级支持的基础上，辅以与国债、企业债等债券品种的相对价值比较，审慎投资资产支持证券类资产 6、国债期货投资策略 为有效控制债券投资的系统性风险，本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目的，适度运用国债期货，提高投资组合的运作效率。在国债期货投资时，本基金将首先分析国债期货各合约价格与最便宜可交割券的关系，选择定价合理的国债期货合约，其次，考虑国债期货各合约的流动性情况，最终确定与现货组合的合适匹配，以达到风险管理的目标。 7、存托凭证投资策略 在控制风险的前提下，本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。
业绩比较基准	中债综合指数收益率×80%+沪深 300 指数收益率×20%
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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	潘西里	许俊
	联系电话	0755－83196666	010-66596688
	电子邮箱	cmf@cmfchina.com	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		400-887-9555	95566
传真		0755－83196475	010－66594942
注册地址		深圳市福田区深南大道 7088 号	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		深圳市福田区深南大道 7088 号	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		518040	100818
法定代表人		王小青	葛海蛟

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.cmfchina.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	招商基金管理有限公司	深圳市福田区深南大道 7088 号

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

1、招商安华债券 A

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024 年 1 月 1 日 - 2024 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	286,831,137.93
本期利润	149,952,990.47
加权平均基金份额本期利润	0.0084
本期加权平均净值利润率	0.73%
本期基金份额净值增长率	0.92%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	2,089,142,493.16
期末可供分配基金份额利润	0.1402
期末基金资产净值	17,116,641,576.26
期末基金份额净值	1.1486
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	18.40%

2、招商安华债券 C

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024 年 1 月 1 日 - 2024 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	15,416,446.27
本期利润	6,410,489.33
加权平均基金份额本期利润	0.0060
本期加权平均净值利润率	0.53%
本期基金份额净值增长率	0.76%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	105,061,230.08
期末可供分配基金份额利润	0.1261
期末基金资产净值	945,350,155.64
期末基金份额净值	1.1346

3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	16.88%

3、招商安华债券 D

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024 年 1 月 1 日 - 2024 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	16,856,801.94
本期利润	-12,532,536.14
加权平均基金份额本期利润	-0.0092
本期加权平均净值利润率	-0.81%
本期基金份额净值增长率	0.72%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	168,858,060.31
期末可供分配基金份额利润	0.1325
期末基金资产净值	1,453,780,448.12
期末基金份额净值	1.1411
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	2.02%

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

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

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

4、本基金从2022年9月28日起新增D类份额，D类份额自2022年11月21日起存续。

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

招商安华债券 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.93%	0.22%	0.02%	0.10%	-0.95%	0.12%
过去三个月	0.10%	0.26%	0.98%	0.14%	-0.88%	0.12%
过去六个月	0.92%	0.29%	3.26%	0.17%	-2.34%	0.12%
过去一年	0.53%	0.24%	2.71%	0.17%	-2.18%	0.07%
过去三年	7.60%	0.22%	4.08%	0.21%	3.52%	0.01%
自基金合同生效起至今	18.40%	0.20%	14.95%	0.22%	3.45%	-0.02%

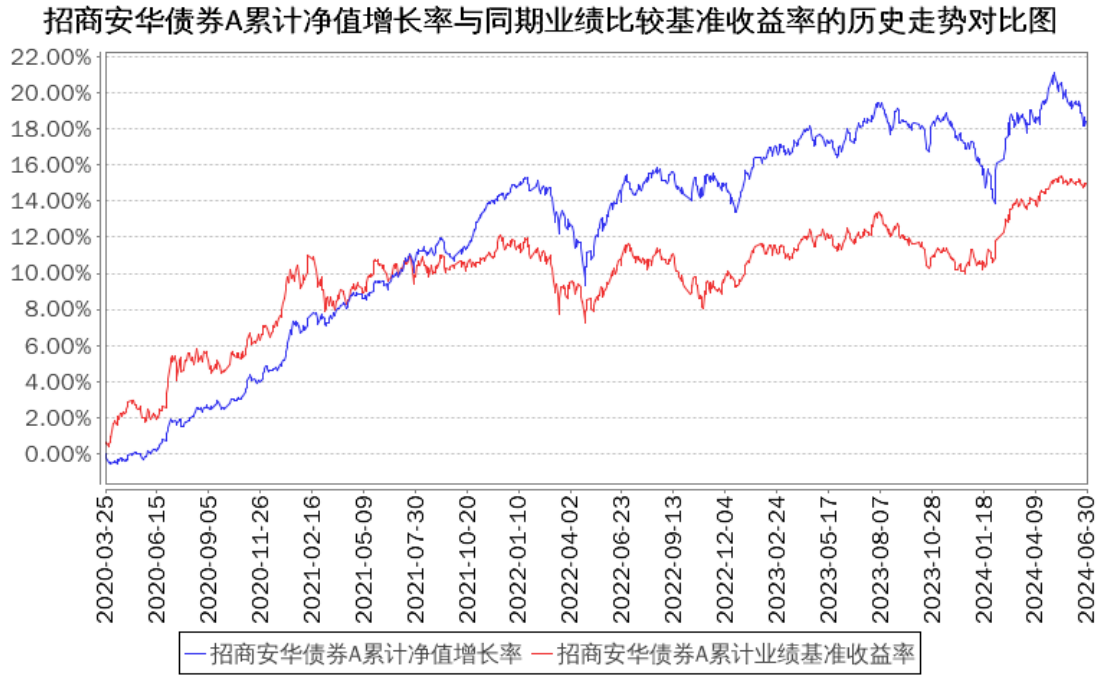
招商安华债券 C

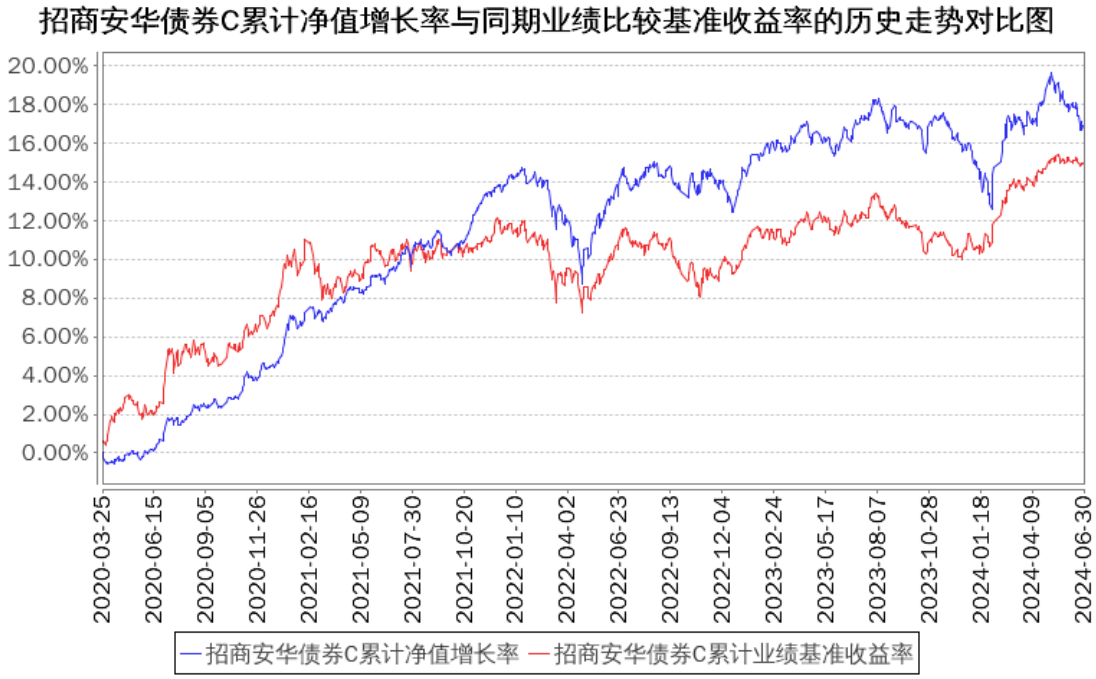
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.96%	0.22%	0.02%	0.10%	-0.98%	0.12%
过去三个月	0.02%	0.25%	0.98%	0.14%	-0.96%	0.11%
过去六个月	0.76%	0.29%	3.26%	0.17%	-2.50%	0.12%
过去一年	0.22%	0.24%	2.71%	0.17%	-2.49%	0.07%
过去三年	6.63%	0.22%	4.08%	0.21%	2.55%	0.01%
自基金合同生效起至今	16.88%	0.20%	14.95%	0.22%	1.93%	-0.02%

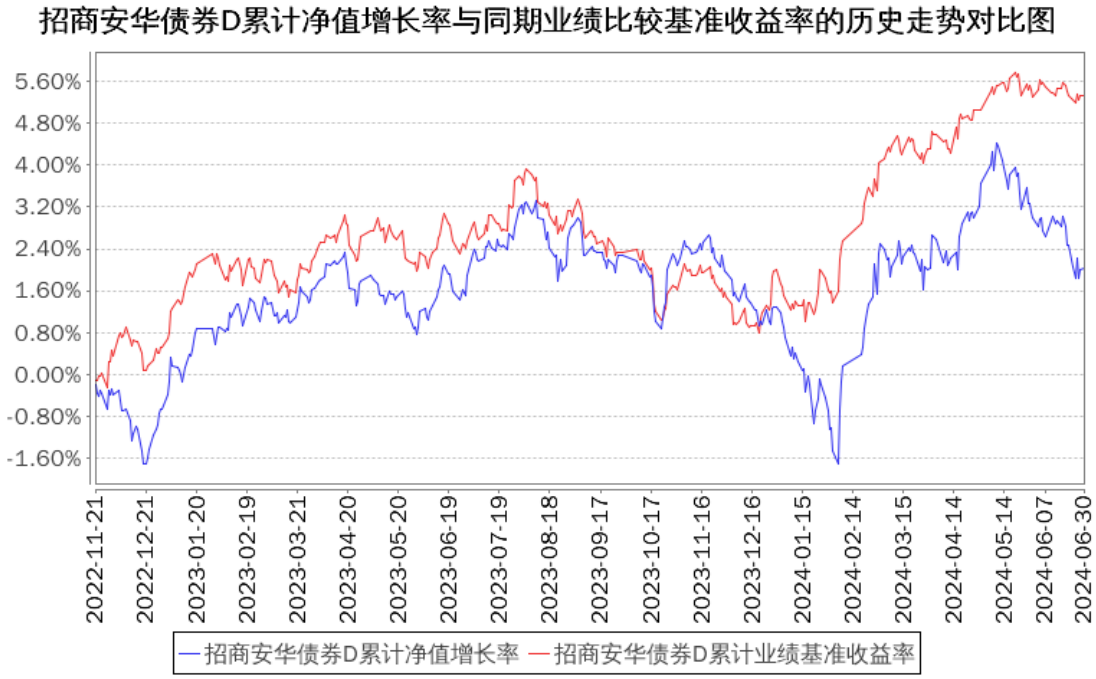
招商安华债券 D

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.95%	0.22%	0.02%	0.10%	-0.97%	0.12%
过去三个月	0.00%	0.26%	0.98%	0.14%	-0.98%	0.12%
过去六个月	0.72%	0.29%	3.26%	0.17%	-2.54%	0.12%
过去一年	0.12%	0.24%	2.71%	0.17%	-2.59%	0.07%
自基金合同生效起至今	2.02%	0.22%	5.34%	0.17%	-3.32%	0.05%

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







注：本基金从 2022 年 9 月 28 日起新增 D 类份额，D 类份额自 2022 年 11 月 21 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拥有公开募集证券投资基金管理、基金销售、全国社会保障基金境内委托管理、企业年金和职业年金基金投资管理、合格境内机构投资者、特定客户资产管理、保险资金投资管理、基本养老保险基金投资管理、公募基金投资顾问业务试点资格。

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		
侯杰	本基金基金经理	2020 年 3 月 25 日	-	21	男，经济学硕士。2002 年 7 月加入北京首创融资担保有限公司，历任首创担保资本运营部职员、部门副经理、主管副总经理（主持工作），曾负责宏观经济研究、公司股票投资、债券投资及基金投资等工作。2017 年 9 月加入招商基金管理有限公司，曾任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、招商民安增益债券型证券投资基金、招商稳祯定期开放混合型证券投资基金、招商瑞和 1 年持有期混合型证券投资基金基金经理，现任固定收益投资部专业总监兼招商安裕灵活配置混合型证券投资基金、招商丰拓灵活配置混合型证券投资基金、招商瑞阳股债配置混合型证券投资基金、招商安华债券型证券投资基金、招商瑞德一年持有期混合型证券投资基金、招商瑞盈 9 个月持有期混合型证券投资基金、招商享利增强债券型证券投资基金、招商稳旺混合型证券投资基金、招商盛合灵活配置混合型证券投资基金、招商精选企业混合型证券投资基金基金经理。
王娟娟	本基金基金经理	2021 年 12 月 31 日	-	17	女，硕士。2007 年 6 月至 2011 年 12 月任职于中航三星人寿保险有限公司（现中银三星人寿保险有限公司），主要从事债券市场研究、固定收益投资相关工作；2011 年 12 月至 2014 年 10 月任职于天安人寿保险股份有限公司，从事固定收益投资管理工作；2014 年 10 月至 2015 年

					5 月任职于中荷人寿保险有限公司，任投资部固定收益投资室负责人，从事固定收益投资管理工作；2015 年 5 月加入招商基金管理有限公司固定收益投资部，曾任投资经理，现任招商安华债券型证券投资基金、招商招悦纯债债券型证券投资基金、招商安本增利债券型证券投资基金、招商享利增强债券型证券投资基金、招商安福 1 年定期开放债券型发起式证券投资基金、招商安颐稳健债券型证券投资基金、招商安泽稳利 9 个月持有期混合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 6 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。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：

2024 年上半年，国内经济先向上修复，一季度表现尚可，进入二季度后边际上有所走弱，地产仍相对低迷，制造业和出口链条表现尚可。投资方面，6 月固定资产投资完成额累计同比增长 3.9%，投资端数据上半年呈现走弱态势，其中房地产开发投资累计同比下降 10.1%，地产投资表现仍然低迷，随着近期一系列地产新政推出，部分城市二手房交易量出现明显抬升，持续关注后续地产销售表现；6 月不含电力的基建投资累计同比增长 5.4%，由于当前地方债务管控力度较强、新增项目审批严格，基建增速上半年呈现下行趋势；6 月制造业投资累计同比增长 9.5%，上半年制造业投资表现相对较好，考虑当前中美库存周期位于底部、重点领域技改及设备更新项目在持续推进、政策扶持力度大，制造业投资韧性较强。消费方面，6 月社会消费品零售总额累计同比增长 3.7%，上半年消费数据持续在偏弱区间运行。对外贸易方面，6 月出口金额累计同比增速为 3.6%，上半年出口仍具韧性，主要与外需表现较好有关。生产方面，6 月 PMI 指数为 49.5%，5 月以来连续两个月转为荣枯线以下，6 月的生产指数和新订单指数分别为 50.6%和 49.5%，生产表现略好于需求。

债券市场回顾：

2024 年一季度债市整体走强，在地产销售和地产链条高频数据表现持续偏弱、债市资产荒现象明显的背景下，各债券品种收益率普遍下行，10 年期国债收益率从 2.56%下行至 2.29%。期限结构上，长期品种表现更好，尤其是 30 年期国债。信用利差整体表现为压窄，等级利差同样压窄。二季度债市延续走强趋势，各等级各期限债券收益率均下行，10 年国债收益率从 2.29%下行约 8bp 至 2.21%，且中短端利率品种收益率下行幅度大于长端和超长端。由于禁止手工补息导致的非银资金面宽松，信用债表现整体好于利率债，信用利差收窄，且中低等级信用利差收窄幅度大于高等级。

股票市场回顾：

2024 年开年后市场震荡加剧，春节前后市场见底反弹收复失地，整体看一季度成交量有所上升。北上资金持续流入，超过去年全年。市场分化程度高，上游资源品及红利类资产表现较强，新质生产力相关行业有较多结构性机会，AI 的产业趋势持续。港股整体底部企稳。

2024 年二季度市场企稳并宽幅震荡，成交量逐步缩窄。市场分化程度加剧，红利类、盈利稳定类资产表现较强，新质生产力相关行业有较多结构性机会，AI 产业趋势扩散至终端产品，大宗商品相关的股票高位震荡。港股冲高回落。

基金操作回顾：

2024 年上半年，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。

股票投资方面，我们在震荡过程中积极寻找个股机会，对组合适度分散、动态调整、优化配置结构，持续关注估值和成长性匹配度较好的优质公司。具体来说，我们坚持自下而上的投资框架，长期坚守一些深度价值标的。同时，市场底部波动较大，我们适时捕捉机会，在1月快速下跌中择优布局了一些优质制造业公司，在反弹中有较好表现。在3月以后，我们进行了仓位控制，并布局了黄金资源及消费公司。整个二季度，我们在并不强势的市场中，坚守安全边际，适当降低调仓频率。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金 A 类份额净值增长率为 0.92%，同期业绩基准增长率为 3.26%，C 类份额净值增长率为0.76%，同期业绩基准增长率为3.26%，D类份额净值增长率为0.72%，同期业绩基准增长率为 3.26%。

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：

展望三季度，我们关注到美国经济的衰退迹象上升，未来有转弱和下行可能，这或许将影响到美国的货币政策以及对外政策，或将从多方面利好中国，缓解我们暂时的压力。另外市场在经历了两个月的回调后，一些公司出现了超跌，我们需要积极挖掘，适当左侧布局。我们继续看好部分出海公司，短期出海产业链由于全球地缘政治冲突边际增多而受挫，但一些公司有较广泛的产业链布局和较强竞争力。另外军工行业未来将持续受益于更有挑战性的地缘政治环境中。

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办法》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

本基金本报告期内未实施利润分配。

4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本托管人在本基金的托管过程中，严格遵守《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有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：招商安华债券型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	942,351.49	82,812,812.88
结算备付金		20,974,817.80	13,987,649.96
存出保证金		1,090,716.68	830,018.94
交易性金融资产	6.4.7.2	22,772,994,822.53	32,279,170,828.60
其中：股票投资		3,763,938,414.54	5,820,554,487.85
基金投资		-	-
债券投资		18,926,724,850.54	26,349,069,265.72
资产支持证券投资		82,331,557.45	109,547,075.03
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	16,713,543.44	-
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		87,360,000.00	996,170,818.33
应收股利		-	-
应收申购款		493,877.13	25,734,822.61
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		22,900,570,129.07	33,398,706,951.32
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 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		3,272,086,688.84	2,029,520,667.38
应付清算款		-	61,742,030.80
应付赎回款		104,009,850.76	982,038,306.97
应付管理人报酬		4,949,808.11	8,373,451.39
应付托管费		1,649,936.03	2,791,150.45
应付销售服务费		766,414.71	1,255,352.09
应付投资顾问费		-	-
应交税费		669,291.77	1,003,527.20
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	665,958.83	2,017,756.34
负债合计		3,384,797,949.05	3,088,742,242.62
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	17,009,465,235.26	26,655,631,116.21
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	2,506,306,944.76	3,654,333,592.49
净资产合计		19,515,772,180.02	30,309,964,708.70
负债和净资产总计		22,900,570,129.07	33,398,706,951.32

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，招商安华债券 A 份额净值 1.1486 元，基金份额总额 14,902,238,547.63 份；招商安华债券 C 份额净值 1.1346 元，基金份额总额 833,177,217.91 份；招商安华债券 D 份额净值 1.1411 元，基金份额总额 1,274,049,469.72 份；总份额合计 17,009,465,235.26 份。

6.2 利润表

会计主体：招商安华债券型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		224,741,033.22	855,910,914.78
1.利息收入		771,138.82	2,184,101.70
其中：存款利息收入	6.4.7.9	448,213.19	831,322.79
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		322,925.63	1,352,778.91
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		388,924,839.65	657,745,594.80
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-155,708,962.11	188,585,045.82
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	492,001,719.60	403,391,709.45
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	1,730,758.65	3,373,536.17
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	50,901,323.51	62,395,303.36
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-175,273,442.48	190,910,145.90
4.汇兑收益（损失以“－”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	10,318,497.23	5,071,072.38
减：二、营业总支出		80,910,089.56	78,354,645.77
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	34,573,093.28	43,988,085.46
其中：暂估管理人报酬		-	-
2.托管费	6.4.10.2.2	11,524,364.36	14,662,695.15
3.销售服务费	6.4.10.2.3	4,869,249.77	4,372,039.82
4.投资顾问费		-	-

5.利息支出		29,224,365.40	14,615,349.79
其中：卖出回购金融资产支出		29,224,365.40	14,615,349.79
6.信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7.税金及附加		547,939.10	535,477.36
8.其他费用	6.4.7.19	171,077.65	180,998.19
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		143,830,943.66	777,556,269.01
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		143,830,943.66	777,556,269.01
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		143,830,943.66	777,556,269.01

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。

6.3 净资产变动表

会计主体：招商安华债券型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	26,655,631,116.21	-	3,654,333,592.49	30,309,964,708.70
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	26,655,631,116.21	-	3,654,333,592.49	30,309,964,708.70
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-9,646,165,880.95	-	-1,148,026,647.73	-10,794,192,528.68
（一）、综合收益总额	-	-	143,830,943.66	143,830,943.66
（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）	-9,646,165,880.95	-	-1,291,857,591.39	-10,938,023,472.34

其中：1.基金申购款	2,782,135,648.06	-	414,017,479.73	3,196,153,127.79
2.基金赎回款	-12,428,301,529.01	-	-1,705,875,071.12	-14,134,176,600.13
（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）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	17,009,465,235.26	-	2,506,306,944.76	19,515,772,180.02
项目	上年度可比期间 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	26,202,610,749.70	-	2,914,101,311.92	29,116,712,061.62
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	26,202,610,749.70	-	2,914,101,311.92	29,116,712,061.62
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	993,814,945.45	-	941,108,123.99	1,934,923,069.44
（一）、综合收益总额	-	-	777,556,269.01	777,556,269.01
（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）	993,814,945.45	-	163,551,854.98	1,157,366,800.43
其中：1.基金申购款	9,070,710,970.14	-	1,220,831,774.84	10,291,542,744.98
2.基金赎回款	-8,076,896,024.69	-	-1,057,279,919.86	-9,134,175,944.55
（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）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	27,196,425,695.15	-	3,855,209,435.91	31,051,635,131.06

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

____徐勇___	____欧志明_____	____何剑萍____
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

招商安华债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人招商基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《招商安华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[2019]2841 号文准予公开募集注册。本基金为契约型开放式基金，存续期限为不定期。本基金根据是否收取认购费、申购费和销售服务费，将基金份额分为A类基金份额和C类基金份额。本基金首次设立募集基金份额为 863,010,769.27 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(20)第 00128 号验资报告。《招商安华债券型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)于 2020 年 3 月 25 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，基金托管人为中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”)。

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，包括国内依法发行上市的股票和存托凭证(包括主板、中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票和存托凭证)、债券(含国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、地方政府债、政府支持机构债、政府支持债券、永续债、永续中票等)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、国债期货，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%；投资于股票、存托凭证等资产的比例不超过基金资产的 20%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律规或监管机构的规定执行。

本基金的业绩比较基准为：中债综合指数收益率×80%+沪深 300 指数收益率×20%。

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”)、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。

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 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

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

根据财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[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]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》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税；2018 年 1 月 1 日起，公开募集证券投资基金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)对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不计缴企业所得税。

(3)对基金取得的股票股息红利所得，由上市公司代扣代缴个人所得税；从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(4)对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，对受让方不再缴纳印花税；自 2023 年 8 月 28 日起，出让方减按 0.05%的税率缴纳证券(股票)交易印花税。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	942,351.49
等于：本金	941,067.17
加：应计利息	1,284.32
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	942,351.49

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2024 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		5,148,617,726.88	-	3,763,938,414.54	-1,384,679,312.34
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	4,274,172,052.96	58,013,052.11	4,458,963,052.11	126,777,947.04
	银行间市场	13,997,717,390.05	191,585,798.43	14,467,761,798.43	278,458,609.95
	合计	18,271,889,443.01	249,598,850.54	18,926,724,850.54	405,236,556.99
资产支持证券		80,796,000.00	923,557.45	82,331,557.45	612,000.00
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		23,501,303,169.89	250,522,407.99	22,772,994,822.53	-978,830,755.35

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 2024 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	16,713,543.44	-
合计	16,713,543.44	-

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 2024 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	556,286.49
其中：交易所市场	500,292.58
银行间市场	55,993.91
应付利息	-
预提费用	109,672.34
合计	665,958.83

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

招商安华债券 A		
项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	23,327,177,878.99	23,327,177,878.99
本期申购	1,415,969,410.79	1,415,969,410.79
本期赎回（以“-”号填列）	-9,840,908,742.15	-9,840,908,742.15
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期末	14,902,238,547.63	14,902,238,547.63

招商安华债券 C		
项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,501,247,839.48	1,501,247,839.48
本期申购	123,879,653.79	123,879,653.79
本期赎回（以“-”号填列）	-791,950,275.36	-791,950,275.36
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期末	833,177,217.91	833,177,217.91

招商安华债券 D		
项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,827,205,397.74	1,827,205,397.74
本期申购	1,242,286,583.48	1,242,286,583.48
本期赎回（以“-”号填列）	-1,795,442,511.50	-1,795,442,511.50
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期末	1,274,049,469.72	1,274,049,469.72

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

招商安华债券 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计

上年度末	2,898,040,565.21	324,232,944.97	3,222,273,510.18
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	2,898,040,565.21	324,232,944.97	3,222,273,510.18
本期利润	286,831,137.93	-136,878,147.46	149,952,990.47
本期基金份额交易产生的变动数	-1,095,729,209.98	-62,094,262.04	-1,157,823,472.02
其中：基金申购款	186,172,383.88	23,246,470.36	209,418,854.24
基金赎回款	-1,281,901,593.86	-85,340,732.40	-1,367,242,326.26
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,089,142,493.16	125,260,535.47	2,214,403,028.63

招商安华债券 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	168,163,382.39	20,979,081.22	189,142,463.61
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	168,163,382.39	20,979,081.22	189,142,463.61
本期利润	15,416,446.27	-9,005,956.94	6,410,489.33
本期基金份额交易产生的变动数	-78,518,598.58	-4,861,416.63	-83,380,015.21
其中：基金申购款	14,863,253.97	2,358,191.40	17,221,445.37
基金赎回款	-93,381,852.55	-7,219,608.03	-100,601,460.58
本期已分配利润	-	-	-
本期末	105,061,230.08	7,111,707.65	112,172,937.73

招商安华债券 D			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	217,349,681.69	25,567,937.01	242,917,618.70
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	217,349,681.69	25,567,937.01	242,917,618.70
本期利润	16,856,801.94	-29,389,338.08	-12,532,536.14
本期基金份额交易产生的变动数	-65,348,423.32	14,694,319.16	-50,654,104.16
其中：基金申购款	158,842,774.81	28,534,405.31	187,377,180.12
基金赎回款	-224,191,198.13	-13,840,086.15	-238,031,284.28
本期已分配利润	-	-	-
本期末	168,858,060.31	10,872,918.09	179,730,978.40

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	117,989.15
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	321,659.64
其他	8,564.40
合计	448,213.19

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-155,708,962.11
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-155,708,962.11

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	2,085,459,846.28
减：卖出股票成本总额	2,237,860,925.40
减：交易费用	3,307,882.99
买卖股票差价收入	-155,708,962.11

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无股票赎回差价收入。

6.4.7.10.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无股票申购差价收入。

6.4.7.10.5 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内无证券出借差价收入。

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

债券投资收益——利息收入	320,277,687.93
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	171,724,031.67
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	492,001,719.60

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	11,709,851,962.12
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	11,386,012,244.73
减：应计利息总额	152,025,635.72
减：交易费用	90,050.00
买卖债券差价收入	171,724,031.67

6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券申购差价收入。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
资产支持证券投资收益——利息收入	1,730,758.65
资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入	-
资产支持证券投资收益——赎回差价收入	-
资产支持证券投资收益——申购差价收入	-
合计	1,730,758.65

6.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出资产支持证券成交总额	28,417,872.84
减：卖出资产支持证券成本总额	27,807,000.00
减：应计利息总额	610,872.84
减：交易费用	-

资产支持证券投资收益	-

6.4.7.12.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券赎回差价收入。

6.4.7.12.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券申购差价收入。

6.4.7.13 贵金属投资收益

6.4.7.13.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.13.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无买卖贵金属差价收入。

6.4.7.13.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无贵金属赎回差价收入。

6.4.7.13.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无贵金属申购差价收入。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具买卖权证差价收入。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具其他投资收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	50,901,323.51
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	50,901,323.51

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-175,273,442.48

——股票投资	-319,144,323.04
——债券投资	143,626,880.56
——资产支持证券投资	244,000.00
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-175,273,442.48

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	10,318,497.23
合计	10,318,497.23

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	50,000.00
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
其他	61,405.31
合计	171,077.65

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
中国银行股份有限公司	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

注：基金的主要关联方包含基金管理人、基金管理人的股东及子公司、基金托管人等。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
招商证券	1,128,577,787.10	43.64%	3,761,959,715.42	45.83%

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
招商证券	110,620,050.00	50.90%	135,176,934.24	37.13%

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
招商证券	13,157,468,000.00	26.65%	5,091,598,000.00	28.73%

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
招商证券	849,942.24	40.49%	295,455.70	59.06%
关联方名称	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
招商证券	2,825,236.05	43.60%	942,633.78	26.52%

注：1、本报告期内，本基金与关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立；

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	34,573,093.28	43,988,085.46
其中：应支付销售机构的客户维护费	3,887,894.26	6,440,617.25
应支付基金管理人的净管理费	30,685,199.02	37,547,468.21
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：

日基金管理人报酬＝前一日基金资产净值×0.30%÷当年天数

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	11,524,364.36	14,662,695.15

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：

日基金托管费＝前一日基金资产净值×0.10%÷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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	招商安华债券 A	招商安华债券 C	招商安华债券 D	合计
招商基金管理有限公司	-	467,220.45	2,629,069.25	3,096,289.70
招商银行	-	290,045.81	47,966.86	338,012.67
招商证券	-	135.94	-	135.94
中国银行	-	89,375.69	-	89,375.69
合计	-	846,777.89	2,677,036.11	3,523,814.00
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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			
	招商安华债券 A	招商安华债券 C	招商安华债券 D	合计
招商基金管理有限公司	-	673,280.66	1,443,754.83	2,117,035.49
招商银行	-	115,664.21	1,399.20	117,063.41
招商证券	-	405.69	-	405.69
中国银行	-	75,366.74	-	75,366.74
合计	-	864,717.30	1,445,154.03	2,309,871.33

注：本基金的 C 类基金份额的年销售服务费率为 0.30%，D 类基金份额的年销售服务费率为 0.40%，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

C 类份额日销售服务费=前一日 C 类基金资产净值×0.30%÷当年天数

D 类份额日销售服务费=前一日 D 类基金资产净值×0.40%÷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

单位：人民币元

本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 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
中国银行	-	-	-	-	-	-

上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的	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						
中国银行	110,010,387.98	-	-	-	-	-

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期内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。

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

本基金本报告期内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。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	招商安华债券 A	招商安华债券 C	招商安华债券 D
基金合同生效日（2020 年 3 月 25 日）持有的基金份额	-	-	-
报告期初持有的基金份额	40,101,360.12	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-	-
报告期末持有的基金份额	40,101,360.12	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.27%	-	-

项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	招商安华债券 A	招商安华债券 C	招商安华债券 D

基金合同生效日（2020 年 3 月 25 日）持有的基金份额	-	-	-
报告期初持有的基金份额	40,101,360.12	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-	-
报告期末持有的基金份额	40,101,360.12	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.17%	-	-

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	招商安华债券 A			
	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 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
招商财富资产管理有限公司	16,584,638.30	0.11%	16,584,638.30	0.07%

注：表格中的比例为四舍五入的结果。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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
中国银行-活期	942,351.49	117,989.15	165,167,620.06	308,153.20

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内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之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2024 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2024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633,415,448.06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
102381043	23 江西交投 MTN002	2024 年 7 月 17 日	102.61	761,000	78,083,432.87
102382539	23 晋焦煤 MTN002	2024 年 7 月 17 日	105.14	900,000	94,626,540.98
102383120	23 广核国际 MTN001	2024 年 7 月 17 日	105.19	1,600,000	168,307,707.10
2128038	21 农业银行永续债 01	2024 年 7 月 17 日	106.09	2,000,000	212,187,672.13
2128044	21 工商银行永续债 02	2024 年 7 月 17 日	105.71	1,620,000	171,248,960.66
合计	-	-	-	6,881,000	724,454,313.74

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2024年6月30日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额2,638,671,240.78元，在2024年7月1日、2024年7月2日、2024年7月3日、2024年7月4日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

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

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	150,698,740.98
合计	-	150,698,740.98

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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
AAA	13,985,795,992.29	20,324,404,515.90
AAA 以下	-	-
未评级	2,041,234,043.33	2,718,478,972.26
合计	16,027,030,035.62	23,042,883,488.16

注：上述评级均由经中国证监会核准从事证券市场资信评级业务的评级机构做出。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
AAA	82,331,557.45	109,547,075.03
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	82,331,557.45	109,547,075.03

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。

6.4.13.2.6 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。

6.4.13.3 流动性风险

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金流动性风险来源于基金约定开放日兑付赎回资金的流动性风险，以及因部分投资品种交易不活跃而出现的变现风险以及因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理价格变现投资的风险。本基金所持有的金融资产主要在证券交易所和银行间同业市场交易。除附注 6.4.12 所披露的流通受限不能自由转让的基金资产外，本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。除卖出回购金融资产外，本基金所持有的金融负债的合约约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人在基金合同约定巨额赎回条款，设计了非常情况下赎回资金的处理模式，控制因开放模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

日常流动性风险管理中，本基金的基金管理人每日监控和预测本基金的流动性指标，通过对投资品种的流动性指标来持续地评估、选择、跟踪和控制基金投资的流动性风险。同时，本基金通过预留一定的现金头寸，并且在需要时可通过卖出回购金融资产方式融入短期资金，以缓解流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的基金管理人日常通过对利率水平的预测、分析收益率曲线及优化利率重新定价日组合等方法对上述利率风险进行管理。

下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	942,351.49	-	-	-	942,351.49
结算备付金	20,974,817.80	-	-	-	20,974,817.80
存出保证金	1,090,716.68	-	-	-	1,090,716.68
交易性金融资产	3,107,495,988.43	12,047,614,251.33	3,853,946,168.23	3,763,938,414.54	22,772,994,822.53
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	16,713,543.44	-	-	-	16,713,543.44
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	493,877.13	493,877.13
应收清算款	-	-	-	87,360,000.00	87,360,000.00
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	3,147,217,417.84	12,047,614,251.33	3,853,946,168.23	3,851,792,291.67	22,900,570,129.07
负债					
应付赎回款	-	-	-	104,009,850.76	104,009,850.76

应付管理人报酬	-	-	-	4,949,808.11	4,949,808.11
应付托管费	-	-	-	1,649,936.03	1,649,936.03
应付清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	3,272,086,688.84	-	-	-	3,272,086,688.84
应付销售服务费	-	-	-	766,414.71	766,414.71
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	669,291.77	669,291.77
其他负债	-	-	-	665,958.83	665,958.83
负债总计	3,272,086,688.84	-	-	112,711,260.21	3,384,797,949.05
利率敏感度缺口	-124,869,271.00	12,047,614,251.33	3,853,946,168.23	3,739,081,031.46	19,515,772,180.02
上年度末 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	82,812,812.88	-	-	-	82,812,812.88
结算备付金	13,987,649.96	-	-	-	13,987,649.96
存出保证金	830,018.94	-	-	-	830,018.94
交易性金融资产	3,883,940,507.15	16,937,429,459.87	5,637,246,373.73	5,820,554,487.85	32,279,170,828.60
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	-	-	-	25,734,822.61	25,734,822.61
应收清算款	-	-	-	996,170,818.33	996,170,818.33
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	3,981,570,988.93	16,937,429,459.87	5,637,246,373.73	6,842,460,128.79	33,398,706,951.32
负债					
应付赎回款	-	-	-	982,038,306.97	982,038,306.97
应付管理人报酬	-	-	-	8,373,451.39	8,373,451.39
应付托管费	-	-	-	2,791,150.45	2,791,150.45
应付清算款	-	-	-	61,742,030.80	61,742,030.80
卖出回购金融资产款	2,029,520,667.38	-	-	-	2,029,520,667.38
应付销售服务费	-	-	-	1,255,352.09	1,255,352.09
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	1,003,527.20	1,003,527.20
其他负债	-	-	-	2,017,756.34	2,017,756.34
负债总计	2,029,520,667.38	-	-	1,059,221,575.24	3,088,742,242.62
利率敏感度缺口	1,952,050,321.55	16,937,429,459.87	5,637,246,373.73	5,783,238,553.55	30,309,964,708.70

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（ 2024 年 6 月 30 日 ）	上年度末（ 2023 年 12 月 31 日 ）
	1. 市场利率平行上升 50 个基点	-244,552,069.18	-341,592,838.17
	2. 市场利率平行下降 50 个基点	250,436,016.50	349,060,771.80

6.4.13.4.2 其他价格风险

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险，该风险可能与特定投资品种相关，也有可能与整体投资品种相关。本基金所持有的金融资产以公允价值计量，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金在构建资产配置和基金资产投资组合的基础上，通过建立事前和事后跟踪误差的方式，对基金资产的市场价格风险进行管理。

6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产-股票投资	3,763,938,414.54	19.29	5,820,554,487.85	19.20
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	3,763,938,414.54	19.29	5,820,554,487.85	19.20

6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1.若对市场价格敏感的权益性投资的市场价格上升或下降 5%		
	2.其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（ 2024 年 6 月	上年度末（ 2023 年 12

		30 日 ）	月 31 日 ）
	1. 权益性投资的市场价格上升 5%	188,196,920.73	291,027,724.39
	2. 权益性投资的市场价格下降 5%	-188,196,920.73	-291,027,724.39

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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	3,763,938,414.54	5,785,357,191.56
第二层次	19,009,056,407.99	26,458,616,340.75
第三层次	-	35,197,296.29
合计	22,772,994,822.53	32,279,170,828.60

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括应收款项、卖出回购金融资产和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无需要说明有助于理解和分析会计报表的其他事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	3,763,938,414.54	16.44
	其中：股票	3,763,938,414.54	16.44
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	19,009,056,407.99	83.01
	其中：债券	18,926,724,850.54	82.65
	资产支持证券	82,331,557.45	0.36
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	16,713,543.44	0.07
	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	21,917,169.29	0.10
8	其他各项资产	88,944,593.81	0.39
9	合计	22,900,570,129.07	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	19,323,814.00	0.10
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,494,734,263.07	12.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,901,472.00	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	549,179,192.00	2.81
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	567,043,659.79	2.91
J	金融业	-	-
K	房地产业	21,045,900.00	0.11
L	租赁和商务服务业	106,780,717.68	0.55

M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	3,929,396.00	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,763,938,414.54	19.29

7.2.2 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。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601058	赛轮轮胎	39,001,596	546,022,344.00	2.80
2	603613	国联股份	27,740,095	543,983,262.95	2.79
3	601111	中国国航	50,906,800	375,692,184.00	1.93
4	002049	紫光国微	4,539,615	238,783,749.00	1.22
5	002541	鸿路钢构	12,518,418	212,437,553.46	1.09
6	000733	振华科技	5,063,916	210,304,431.48	1.08
7	000661	长春高新	1,875,583	172,122,251.91	0.88
8	002415	海康威视	5,494,593	169,837,869.63	0.87
9	002648	卫星化学	9,279,411	166,843,809.78	0.85
10	600029	南方航空	28,221,000	166,221,690.00	0.85
11	002311	海大集团	3,178,959	149,570,020.95	0.77
12	603300	华铁应急	19,556,908	106,780,717.68	0.55
13	002597	金禾实业	4,606,821	91,629,669.69	0.47
14	000860	顺鑫农业	5,163,739	86,440,990.86	0.44
15	300699	光威复材	2,749,300	68,265,119.00	0.35
16	603345	安井食品	765,700	56,899,167.00	0.29
17	603236	移远通信	1,191,060	55,658,233.80	0.29
18	600521	华海药业	2,588,043	44,126,133.15	0.23
19	002001	新 和 成	2,086,000	40,051,200.00	0.21
20	002747	埃斯顿	2,798,000	39,787,560.00	0.20
21	000581	威孚高科	1,874,700	30,520,116.00	0.16
22	002735	王子新材	2,887,391	28,383,053.53	0.15
23	688122	西部超导	685,046	26,250,962.72	0.13
24	600426	华鲁恒升	795,779	21,199,552.56	0.11
25	600048	保利发展	2,402,500	21,045,900.00	0.11

26	600166	福田汽车	8,988,000	20,223,000.00	0.10
27	000998	隆平高科	1,965,800	19,323,814.00	0.10
28	688561	奇安信	432,682	10,219,948.84	0.05
29	600718	东软集团	1,174,400	9,712,288.00	0.05
30	601233	桐昆股份	591,200	9,435,552.00	0.05
31	600115	中国东航	1,811,800	7,265,318.00	0.04
32	601633	长城汽车	236,558	5,984,917.40	0.03
33	688269	凯立新材	154,873	3,957,005.15	0.02
34	603588	高能环境	625,700	3,929,396.00	0.02
35	600986	浙文互联	744,800	3,128,160.00	0.02
36	300755	华致酒行	139,200	1,901,472.00	0.01

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	603613	国联股份	165,307,137.57	0.55
2	603300	华铁应急	122,460,127.48	0.40
3	603345	安井食品	74,978,462.32	0.25
4	600958	东方证券	29,894,458.60	0.10
5	000776	广发证券	29,886,337.92	0.10
6	300896	爱美客	29,145,709.24	0.10
7	002422	科伦药业	19,287,307.00	0.06
8	000661	长春高新	12,053,100.00	0.04
9	600718	东软集团	10,147,513.00	0.03
10	601163	三角轮胎	4,821,725.00	0.02
11	300755	华致酒行	2,407,297.00	0.01

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

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601058	赛轮轮胎	257,693,479.80	0.85
2	002714	牧原股份	244,918,658.31	0.81
3	000661	长春高新	230,523,367.12	0.76
4	002415	海康威视	184,285,194.13	0.61

5	600079	人福医药	160,009,060.80	0.53
6	601318	中国平安	137,960,084.43	0.46
7	600958	东方证券	120,069,601.89	0.40
8	000776	广发证券	94,962,944.80	0.31
9	300498	温氏股份	73,419,007.74	0.24
10	601111	中国国航	73,053,958.00	0.24
11	600029	南方航空	68,041,375.00	0.22
12	601633	长城汽车	53,497,110.68	0.18
13	600521	华海药业	51,114,876.21	0.17
14	000938	紫光股份	36,937,414.08	0.12
15	002311	海大集团	31,465,809.00	0.10
16	300896	爱美客	28,371,065.73	0.09
17	600988	赤峰黄金	28,312,093.32	0.09
18	601233	桐昆股份	27,137,454.00	0.09
19	600426	华鲁恒升	24,791,216.24	0.08
20	002648	卫星化学	24,042,135.24	0.08

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

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	500,389,175.13
卖出股票收入（成交）总额	2,085,459,846.28

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

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	9,939,892,680.00	50.93
	其中：政策性金融债	2,899,694,814.92	14.86
4	企业债券	3,904,753,345.01	20.01
5	企业短期融资券	-	-

6	中期票据	5,082,078,825.53	26.04
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	18,926,724,850.54	96.98

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	2128038	21 农业银行永续债 01	8,050,000	854,055,380.33	4.38
2	2128044	21 工商银行永续债 02	6,650,000	702,966,412.57	3.60
3	222380003	23 兴业银行绿债 01	4,200,000	428,528,945.75	2.20
4	210218	21 国开 18	4,000,000	408,671,803.28	2.09
5	2128017	21 中信银行永续债	3,500,000	365,706,465.75	1.87

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	112887	G 中交泰 A	300,000	30,281,064.36	0.16
2	183210	21 六局 1A	300,000	30,149,794.52	0.15
3	183235	ZJ 即墨 A	300,000	18,155,210.75	0.09
4	183474	新铁 02 优	100,000	3,745,487.82	0.02

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

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

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期未持有国债期货合约。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

报告期内基金投资的前十名证券除 21 工商银行永续债 02（证券代码 2128044）、21 国开 18（证券代码 210218）、21 农业银行永续债 01（证券代码 2128038）、21 中信银行永续债（证券代码 2128017）、23 国开 15（证券代码 230215）、23 兴业银行绿债 01（证券代码 222380003）、24 国开 05（证券代码 240205）、国联股份（证券代码 603613）、中国国航（证券代码 601111）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 工商银行永续债 02（证券代码 2128044）

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

2、21 国开 18（证券代码 210218）

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、21 农业银行永续债 01（证券代码 2128038）

根据发布的相关公告，该证券发行人在报告期内因未依法履行职责、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。

4、21 中信银行永续债（证券代码 2128017）

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

5、23 国开 15（证券代码 230215）

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 兴业银行绿债 01（证券代码 222380003）

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

7、24 国开 05（证券代码 240205）

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。

8、国联股份（证券代码 603613）

根据 2023 年 8 月 8 日发布的相关公告，该证券发行人因财务会计报告违规,业绩预测结果不准确或不及时被上海证券交易所公开谴责。

根据 2023 年 12 月 26 日发布的相关公告，该证券发行人因财务会计报告违规被北京证监局给予警示。

9、中国国航（证券代码 601111）

根据 2023 年 10 月 12 日发布的相关公告，该证券发行人因未依法履行职责被中国民用航空华北地区管理局处以罚款。

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

7.12.2

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

金额单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,090,716.68
2	应收清算款	87,360,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	493,877.13
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	88,944,593.81

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末投资前十名股票中不存在流通受限情况。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
招商安华债券 A	89,455	166,589.22	14,049,652,100.91	94.28%	852,586,446.72	5.72%
招商安华债券 C	68,332	12,193.08	283,544,992.24	34.03%	549,632,225.67	65.97%
招商安华债券 D	67	19,015,663.73	1,273,613,181.56	99.97%	436,288.16	0.03%
合计	157,854	107,754.41	15,606,810,274.71	91.75%	1,402,654,960.55	8.25%

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	招商安华债券 A	2,316,277.61	0.0155%
	招商安华债券 C	19,365.23	0.0023%
	招商安华债券 D	-	-
	合计	2,335,642.84	0.0137%

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）。

8.3 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	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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	招商安华债券 A	>100
	招商安华债券 C	0
	招商安华债券 D	0
	合计	>100

本基金基金经理持有本开放式基金	招商安华债券 A	0~10
	招商安华债券 C	0
	招商安华债券 D	0
	合计	0~10

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	招商安华债券 A	招商安华债券 C	招商安华债券 D
基金合同生效日(2020 年 3 月 25 日)基金份额总额	842,176,142.98	20,834,626.29	-
本报告期期初基金份额总额	23,327,177,878.99	1,501,247,839.48	1,827,205,397.74
本报告期基金总申购份额	1,415,969,410.79	123,879,653.79	1,242,286,583.48
减：本报告期基金总赎回份额	9,840,908,742.15	791,950,275.36	1,795,442,511.50
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	14,902,238,547.63	833,177,217.91	1,274,049,469.72

§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

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，经中国银行股份有限公司研究决定，郭德秋先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的重大诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金管理人没有受到监管部门的稽查或处罚，亦未收到关于基金管理人的高级管理人员受到监管部门的稽查或处罚的书面通知或文件。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
招商证券	6	1,128,577,787.10	43.64%	849,942.24	40.49%	-
开源证券	2	260,813,101.48	10.09%	246,679.56	11.75%	-
华创证券	4	256,435,656.17	9.92%	242,556.64	11.55%	-
民生证券	5	209,283,110.57	8.09%	156,112.52	7.44%	-
国信证券	3	206,826,447.44	8.00%	154,285.50	7.35%	-
国泰君安	3	133,139,571.44	5.15%	125,934.48	6.00%	-
东吴证券	6	132,963,006.85	5.14%	99,173.98	4.72%	-
国盛证券	2	118,956,404.47	4.60%	112,523.05	5.36%	-
国新证券	2	65,454,787.89	2.53%	48,822.65	2.33%	-
天风证券	5	28,849,811.00	1.12%	27,287.59	1.30%	-
浙商证券	2	20,463,600.00	0.79%	15,262.69	0.73%	-
中信证券	11	13,839,769.00	0.54%	13,092.04	0.62%	-
华泰证券	4	10,245,968.00	0.40%	7,644.56	0.36%	-
财通证券	3	-	-	-	-	-
长城证券	3	-	-	-	-	-
长江证券	4	-	-	-	-	-
诚通证券	1	-	-	-	-	-
大通证券	1	-	-	-	-	-

德邦证券	4	-	-	-	-	-
第一创业	3	-	-	-	-	-
东北证券	3	-	-	-	-	-
东方财富	3	-	-	-	-	-
东方证券	3	-	-	-	-	-
东海证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	3	-	-	-	-	-
方正证券	7	-	-	-	-	-
光大证券	3	-	-	-	-	-
广发证券	7	-	-	-	-	-
国海证券	3	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	4	-	-	-	-	-
国投证券	6	-	-	-	-	-
国元证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	4	-	-	-	-	-
宏信证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	5	-	-	-	-	-
华宝证券	2	-	-	-	-	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
华金证券	4	-	-	-	-	-
华西证券	3	-	-	-	-	-
华源证券	2	-	-	-	-	-
华鑫证券	2	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
金元证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	3	-	-	-	-	-
瑞信方正	2	-	-	-	-	-
山西证券	6	-	-	-	-	-
上海证券	2	-	-	-	-	-
申港证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
首创证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
万和证券	1	-	-	-	-	-
五矿证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	3	-	-	-	-	-
信达证券	7	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-

银河证券	1	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
粤开证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	2	-	-	-	-	-
中金财富证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	5	-	-	-	-	-
中泰证券	3	-	-	-	-	-
中信建投证券	5	-	-	-	-	-
中银国际证券	4	-	-	-	-	-
中邮证券	2	-	-	-	-	-
甬兴证券	2	-	-	-	-	-

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
招商证券	110,620,050.00	50.90%	13,157,468,000.00	26.65%	-	-
开源证券	40,865,200.00	18.80%	7,441,490,000.00	15.07%	-	-
华创证券	-	-	3,434,254,000.00	6.96%	-	-
民生证券	-	-	3,650,442,000.00	7.39%	-	-
国信证券	-	-	1,109,090,000.00	2.25%	-	-
国泰君安	-	-	2,250,571,000.00	4.56%	-	-
东吴证券	-	-	2,612,200,000.00	5.29%	-	-
国盛证券	35,605,800.00	16.38%	666,990,000.00	1.35%	-	-
国新证券	-	-	4,087,290,000.00	8.28%	-	-
天风证券	-	-	2,911,060,000.00	5.90%	-	-
浙商证券	-	-	290,260,000.00	0.59%	-	-
中信证券	30,251,700.00	13.92%	178,410,000.00	0.36%	-	-
华泰证券	-	-	1,875,180,000.00	3.80%	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
诚通证券	-	-	-	-	-	-

大通证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	725,570,000.00	1.47%	-	-
广发证券	-	-	1,268,080,000.00	2.57%	-	-
国海证券	-	-	476,420,000.00	0.97%	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
华源证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
瑞信方正	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
万和证券	-	-	-	-	-	-
五矿证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-

兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
中金财富证券	-	-	3,232,740,000.00	6.55%	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
中银国际证券	-	-	-	-	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-
甬兴证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	招商基金管理有限公司关于终止北京中期时代基金销售有限公司办理旗下基金销售业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-01-18
2	招商基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 4 季度报告提示性公告	上海证券报及基金管理人网站	2024-01-19
3	招商安华债券型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-01-19
4	招商安华债券型证券投资基金更新的招募说明书（二零二四年第一号）	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-03-22
5	招商安华债券型证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要更新	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-03-22
6	招商安华债券型证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要更新	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-03-22
7	招商安华债券型证券投资基金（D 类份额）基金产品资料概要更新	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-03-22
8	招商安华债券型证券投资基金 2023 年年度报告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-03-29
9	招商基金管理有限公司旗下基金 2023 年年度	上海证券报及基金管	2024-03-29

	报告提示性公告	理人网站	
10	招商安华债券型证券投资基金2024年第1季度报告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-04-19
11	招商基金管理有限公司旗下基金 2024 年第 1 季度报告提示性公告	上海证券报及基金管理人网站	2024-04-19
12	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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-05-18
13	招商安华债券型证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要更新	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-06-28
14	招商安华债券型证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要更新	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-06-28
15	招商安华债券型证券投资基金（D 类份额）基金产品资料概要更新	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-06-28

§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安华债券型证券投资基金设立的文件；

3、《招商安华债券型证券投资基金基金合同》；

4、《招商安华债券型证券投资基金托管协议》；

5、《招商安华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。

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

2024 年 8 月 30 日