招商银行股份有限公司集合型企业年金计划管理情况

2023 年 3 季度

一、2023 年 3 季度集合计划基本情况表

序号	计划登记号	计划名称	期末企业数（个）	期末职工人数（人）	期末资产金额（万元）	设立组合数（个）	本期投资收益（万元）	本年累计投资收益（万元）
1	99JH20110030	招商银行金色人生尊享企业年金集合计划	6	13,944	70,001.21	8	-221.52	776.46
2	99JH20110031	招商银行金色人生荣享企业年金集合计划	69	21,439	92,329.03	10	-21.85	1,121.86
3	99JH20110032	招商银行金色人生乐享企业年金集合计划	542	69,309	271,823.14	10	-1,469.77	2,846.08

4	合计	——	617	104,692	434,153.38	28	-1,713.14	4,744.40

注：1.期末资产金额包含受托户资金余额。

2.投资收益为所有组合投资收益合计数。投资收益=当期投资资产利息收入+投资处置收益+公允价值变动损益+其他收入-受托费-托管费-投资管理费-交易费用-利息支出-其他费用。本期投资收益以本季度为期间，本年累计投资收益以年初到本季度末为期间。

二、2023 年 3 季度集合计划组合明细表

序号	计划登记号	计划名称	组合序号	组合名称	组合类型	组合代码	投资管理人名称	组合期末资产净值（万元）	本年以来投资收益率（%）
1	99JH20110030	招商银行金色人生尊享企业年金集合计划	1	泰康标准型组合	含权益类	I49Q0156	泰康资产管理有限责任公司	63,720.38	1.42
			2	博时标准型组合	含权益类	-	博时基金管理有限公司	-	-
			3	银华标准型组合	含权益类	-	银华基金管理股份有限公司	-	-
			4	国泰标准型组合	含权益类	-	国泰基金管理有限公司	-	-

			5	中信标准型组合	含权益类	-	中信证券股份有限公司	-	-
			6	国泰债券型组合	固定收益类	-	国泰基金管理有限公司	-	-
			7	国泰货币型组合	固定收益类	-	国泰基金管理有限公司	-	-
			8	国泰存款型组合	固定收益类	-	国泰基金管理有限公司	-	-
2	99JH20110031	招商银行金色人生荣享企业年金集合计划	1	人保存款型组合	固定收益类	I54Q0017	中国人民养老保险有限责任公司	11,146.61	2.58
			2	人保货币型组合	固定收益类	I54Q0006	中国人民养老保险有限责任公司	7,611.31	1.92

			3	泰康标准型组合	含权益类	I49Q0183	泰康资产管理有限责任公司	24,070.21	1.17
			4	国泰标准型组合	含权益类	I46Q0034	国泰基金管理有限公司	675.66	3.48
			5	中信标准型组合	含权益类	-	中信证券股份有限公司	-	-
			6	基金行业高风险组合	含权益类	I36Q0028	招商基金管理有限公司	23,660.54	0.84
			7	易方达标准型组合	含权益类	I34Q0210	易方达基金管理有限公司	12,253.95	1.31
			8	招商标准型组合	含权益类	-	招商基金管理有限公司	-	-

			9	工银瑞信标准型组合	含权益类	I47Q0243	工银瑞信基金管理有限公司	11,505.42	1.75
			10	太平标准型组合	含权益类	-	太平养老保险股份有限公司	-	-
3	99JH20110032	招商银行金色人生乐享企业年金集合计划	1	招商标准型组合	含权益类	I36Q0014	招商基金管理有限公司	31,012.93	0.72
			2	招商货币型组合	固定收益类	I36Q0026	招商基金管理有限公司	1,733.72	1.67
			3	招商固收型组合	固定收益类	I36Q0027	招商基金管理有限公司	45,676.72	2.83
			4	华夏标准型组合	含权益类	I32Q0070	华夏基金管理有限公司	4,107.49	0.62

			5	嘉实标准型组合	含权益类	I35Q0058	嘉实基金管理有限公司	5,782.69	0.79
			6	博时标准型组合	含权益类	I38Q2003	博时基金管理有限公司	887.70	-0.03
			7	博时债券型组合	固定收益类	I38Q2008	博时基金管理有限公司	1,151.73	2.54
			8	泰康标准型组合	含权益类	I49Q0210	泰康资产管理有限责任公司	173,551.73	0.99
			9	南方标准型组合	含权益类	-	南方基金管理股份有限公司	-	-
			10	国寿标准型组合	含权益类	I52Q1132	中国人寿养老保险股份有限公司	2,971.76	-

注：1. 组合类型按是否含权益类投资标的分为固定收益类和含权益类，以期初合同或备忘录为准，明确约定不能投资权益类的组合为固定收益类；没有明确约定或期间发生类别变动的，都为含权益类。

2. 本年以来投资收益率为该组合单位净值增长率。

对因分红、净值归一等非正常业务影响组合单位净值的，收益率分阶段计算。

（1）分红情况

期间多段分红收益率公式：R=（期内第1次分红前一天单位净值 / 期初单位净值）*（期内第2次分红前一天单位净值 /（期内第1次分红前一天单位净值 - 第一次单位份额分红金额））* ... *（期末单位净值 /（期内第 n 次分红前一天单位净值 - 第 n 次单位份额分红金额））- 1

其中，单位份额分红金额 = 分红当天分红金额 / 分红前总份额

（2）净值归一情况

期间多段净值归一收益率公式：R=（（期内第1次归一当天单位净值 * 第1次净值归一系数）/ 期初单位净值）*（（期内第2次归一当天单位净值 *第2次净值归一系数）/ 期内第1次归一当天单位净值）* ... *（期末单位净值 / 期内第 n 次归一当天单位净值）- 1

其中，净值归一系数 = 净值归一当天总份额 / 净值归一前一天总份额

（3）期内混合发生分红、净值归一时，按上述公式进行混合分段并计算期间收益率。

3. 本年以来投资收益率空缺的为 2023 年 1 月 1 日及以后正式运作的组合。

三、2023 年 3 季度集合计划分组合类型收益情况表

序号	计划登记号	计划名称	组合类型	样本组合数（个）	样本组合期末资产净值（万元）	本年以来加权平均收益率（%）
1	99JH20110030	招商银行金色人生尊享企业年金集合计划	固定收益类	-	-	-
			含权益类	1	63,720.38	1.42
			综合	1	63,720.38	1.42

2	99JH20110031	招商银行金色人生荣享企业年金集合计划	固定收益类	2	18,757.92	2.31
			含权益类	5	72,165.78	1.20
			综合	7	90,923.70	1.43
3	99JH20110032	招商银行金色人生乐享企业年金集合计划	固定收益类	3	48,562.17	2.78
			含权益类	5	215,342.54	0.93
			综合	8	263,904.71	1.27
4	合计	——	固定收益类	5	67,320.09	2.65
			含权益类	11	351,228.70	1.08

注：1.样本为 2023 年 1 月 1 日以前正式运作的投资组合。

2.本年以来加权平均收益率计算方法为符合条件样本组合收益率的规模加权，以上年末和本年各季度末平均资产规模为权重；各组合收益率为单位净值增长率。