

招商行业领先混合型证券投资基金 2021 年中期报告

2021 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：2021 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 2021 年 8 月 27 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 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§2 基金简介.....	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
§4 管理人报告.....	6
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	6
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	7
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	7
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	8
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	9
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	10
4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	10
§5 托管人报告.....	10
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	10
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	11
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	11
6.1 资产负债表.....	11
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	15
§7 投资组合报告.....	37
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	38
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	47
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.....	47
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.....	47
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.....	47
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.....	47
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	47

7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	48
7.12	投资组合报告附注.....	48
§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.....	49
§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.....	50
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.....	50
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	50
10.8	其他重大事件.....	53
§11	备查文件目录.....	55
11.1	备查文件目录.....	55
11.2	存放地点.....	55
11.3	查阅方式.....	55

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	招商行业领先混合型证券投资基金
基金简称	招商行业领先混合
基金主代码	217012
交易代码	217012
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009 年 6 月 19 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	147,995,134.63 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	把握行业发展趋势、行业景气度变化以及市场运行状况，精选发展前景良好或周期复苏行业中的领先企业，在控制风险的前提下，为基金持有人谋求长期、稳定的资本增值。
投资策略	本基金充分借鉴国际先进的投资理念与技术，借鉴行业生命周期及行业竞争结构的五力分析，采取主动投资管理模式，通过定性/定量严谨分析的有机结合，深入分析经济景气周期特征和行业景气变化前景，重点挖掘行业景气度趋于改善或者长期增长前景良好的优势行业进行行业配置。借鉴 SWOT 模型，通过深入的股票基本面分析，精选价值被低估的股票，构建股票组合。 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	沪深 300 指数收益率*75%+中债综合全价(总值)指数收益率*25%
风险收益特征	本基金是一只主动管理的混合型基金，在证券投资基金中属于预期风险较高、收益较高的基金产品。

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
	联系电话	0755-83196666
	电子邮箱	cmf@cmfchina.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	中国深圳深南大道 7088 号招商银行大厦	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	刘连舸

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
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	中国深圳深南大道 7088 号招商银行大厦

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021 年 1 月 1 日 - 2021 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	26,104,797.31
本期利润	5,306,179.82
加权平均基金份额本期利润	0.0343
本期加权平均净值利润率	1.27%
本期基金份额净值增长率	1.11%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	242,390,492.77
期末可供分配基金份额利润	1.6378
期末基金资产净值	417,264,380.27
期末基金份额净值	2.819
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	249.39%

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。

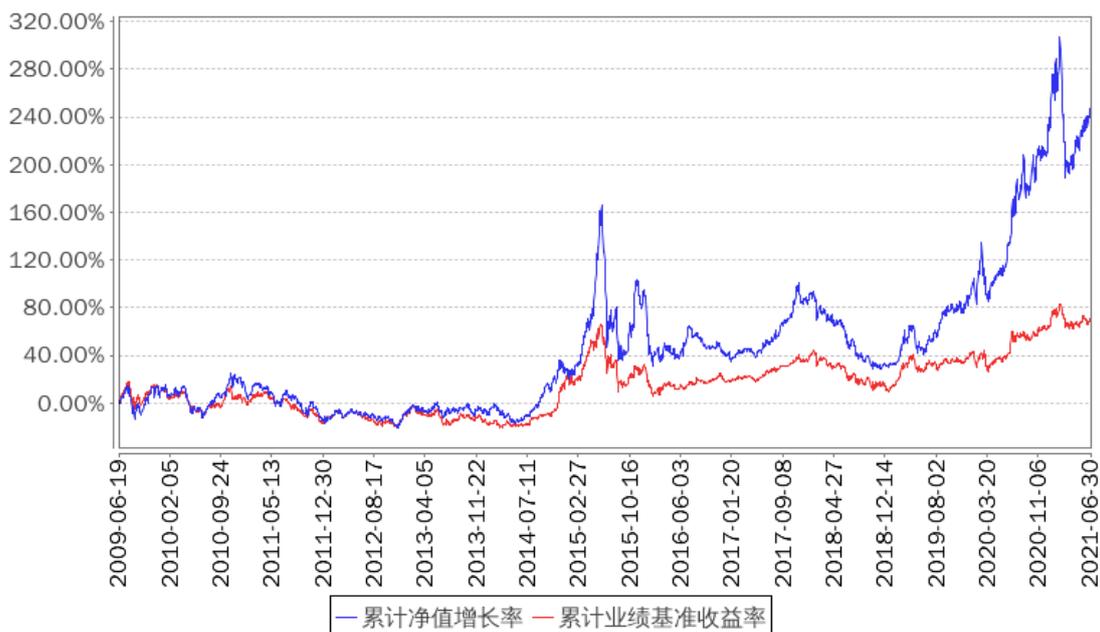
3.2 基金净值表现

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
过去一个月	4.02%	1.27%	-1.52%	0.60%	5.54%	0.67%
过去三个月	16.34%	1.31%	2.77%	0.73%	13.57%	0.58%
过去六个月	1.11%	1.93%	0.54%	0.99%	0.57%	0.94%
过去一年	45.84%	1.84%	18.97%	1.00%	26.87%	0.84%
过去三年	129.93%	1.58%	38.04%	1.02%	91.89%	0.56%
自基金合同生效起至今	249.39%	1.55%	69.91%	1.11%	179.48%	0.44%

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

招商行业领先混合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



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

招商基金管理有限公司首批获得企业年金基金投资管理人资格、基本养老保险基金投资管理资格；2004 年获得全国社保基金投资管理人资格；同时拥有 QDII(合格境内机构投资者)资格、专户理财(特定客户资产管理业务)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		
吴昊	本基金基金经理	2014年10月31日	-	15	男，工学硕士。2006年6月起任职于华泰联合证券有限责任公司研究所，任研究员，从事机械行业研究工作，2009年6月加入国泰君安证券股份有限公司，任研究所机械行业研究员。2010年加入招商基金管理有限公司，曾任高级行业研究员、助理基金经理，招商中小盘精选混合型证券投资基金、招商安盈保本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基金经理，现任招商行业领先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行业协会《证券业从业人员资格管理办法》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% 的情形共发生过七次，原因是指数量化投资组合为满足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

报告期内，随着疫苗大范围接种，新冠肺炎疫情控制取得了初步成效，全球新增感染病例逐步走低，海外复产势头明显，以美国经济为代表，宏观经济出现较为明显的反弹，通胀趋势有所抬头，对流动性宽松的预期出现了分歧。今年上半年，中国经济复苏较为强劲，同时，CPI 和 PPI 等价格指数出现了较为明显的上涨，由于国内货币政策之前较为克制，即便通胀预期抬头，国内流动性不用过于担心。

对于股票市场，美国股市各大指数在上半年均有一定幅度的上涨。相对而言，国内股市表现比较分化，代表经济周期的沪深 300 指数上涨 0.24%，代表新兴经济的创业板指数上涨 17.22%。值得一提的是 2 月底，创业板也曾一度高点回撤 25%。

出于对经济向好和货币不急转弯的考虑，本基金运作较为积极，在报告期保持了高仓位运行。在大盘波动较大的 2 月底前后，仓位也处于较高水平，本基金希望淡化大盘和风格判断，回归到行业景气及公司成长的本源逻辑，通过优质公司中长期确定性的增长，穿越股票市场的各种波动。

行业选择上，本基金主要关注快速增长的成长性子行业，这些行业伴随着渗透率的显著提升，存在较长时间的投资甜蜜期。本基金持有的医药和白酒，在一季度上半段收益较大，随后的市场下跌过程中，也遭遇了较大回撤。当时出于平衡组合考虑，换仓了部分中游制造业，效果并不是太好，虽说估值和成长性更为匹配，但由于原材料成本上涨等负面因素影响，不少标的出现负收益，而之前持仓的部分医药和白酒，在后面反弹中甚至创出新高。这是本基金目前收益较低和排名落后的主要原因，需要总结和反思。公司选择上，本基金一直倾向于优势企业，这类公司具备创造持续超越同业价值的价值。本报告期持仓也集中在快速增长子行业的优势公司，需要指出的是，市场关注的主要子行业优质公司股票高度重叠，资金配置效应驱动下，股价在短期达到甚至超过内在价值，达到泡沫状态，透支未来三年甚至是十年的业绩。股价短期极度演绎给买入并持有的成长股投资策略带来了挑战。总结下来还是深度研究及左侧布局更为合理。报告期内，本基金持仓方向及标的仍是依据上述投资框架构建，持仓主要方向包括高端酒、创新药、新能源汽车、光伏及电子等行业。重仓股以相关子行业优势公司为主。

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 1.11%，同期业绩基准增长率为 0.54%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我国宏观经济仍然在逐步恢复之中，宏观政策较为稳定，转向风险不是太大。随着海外疫苗投入使用，新冠疫情缓解，海外流动性存在收紧的可能。产业层面，国家产业政策仍比较积极，对制造业尤其是关键领域技术创新仍是前所未有的大力度扶持，经济领域积极的结构性变化仍然值得重点关注和研究。

展望 2021 年下半年，预计国内证券市场仍呈震荡走势，类似于 2020 年的估值扩张难度较大，本基金将更加关注中观和微观层面的业绩变化。行业配置方面仍然坚持上述投资框架，一方面寻找快速增长的成长性行业，另外关注成熟期行业的景气积极变化。然后从符合上述特征的行业中选取优势公司进行投资。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金的估值业务严格按照相关的法律法规、基金合同以及《招商基金管理有限公司基金估值委员会管理制度》进行。基金核算部负责日常的基金资产的估值业务，执行基金估值政策。另外，公司设立由投资和研究部门、风险管理部、基金核算部、法律合规部负责人和基金经理代表组成的估值委员会。公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历。公司估值委员会主要负责制定、修订和完善基金估值政策和程序，定期评价现有估值政策和程序的适用性及对估值程序执行情况进行监督。

投资和研究部门以及基金核算部共同负责关注相关投资品种的动态，评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种；投资和研究部门定期审核公允价值的确认和计量；研究部提出合理的数量分析模型对需要进行估值测算或者调整的投资品种进行公允价值定价与计量并定期对估值政策和程序进行评价，以保证其持续适用；基金核算部定期审核估值政策和程序的一致性，并负责与托管行沟通估值调整事项；风险管理部负责估值委员会工作流程中的风险控制；法律合规部负责日常的基金估值调整结果的事后复核监督工作；法律合规部与基金核算部共同负责估值调整事项的信息披露工作。

基金经理代表向估值委员会提供估值参考信息，参与估值政策讨论；对需采用特别估值程序的证券，基金及时启动特别估值程序，由公司估值委员会集体讨论议定特别估值方案，咨询会计事务所的专业意见，并与托管行沟通后由基金核算部具体执行。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。截止报告期末本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供相关债券品种、流通受限股票的估值参考数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规的规定和基金合同的约定，以及本基金的实际运作情况，本基金报告期末未进行利润分配。在符合分红条件的前提下，本基金已实现尚未分配的可供分配收益部分，将严格按照基金合同的约定适时向投资者予以分配。

4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在招商行业领先混合型证券投资基金（以下称“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合规守信、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：招商行业领先混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	7,255,543.27	8,076,095.11
结算备付金		1,782,383.41	2,865,901.45
存出保证金		312,216.86	267,538.36
交易性金融资产	6.4.7.2	407,169,493.53	457,844,599.07
其中：股票投资		384,478,732.42	438,123,102.51
基金投资		-	-
债券投资		22,690,761.11	19,721,496.56
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-

应收证券清算款		3,814,258.15	4,830,348.85
应收利息	6.4.7.5	400,675.19	431,303.12
应收股利		-	-
应收申购款		309,161.30	784,780.22
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		421,043,731.71	475,100,566.18
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 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		-	-
应付证券清算款		-	2,004,684.15
应付赎回款		1,803,398.82	2,269,341.41
应付管理人报酬		501,302.45	557,012.99
应付托管费		83,550.42	92,835.47
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,296,603.72	1,556,681.92
应交税费		0.26	0.35
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	94,495.77	184,598.23
负债合计		3,779,351.44	6,665,154.52
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	147,995,134.63	168,035,739.16
未分配利润	6.4.7.10	269,269,245.64	300,399,672.50
所有者权益合计		417,264,380.27	468,435,411.66
负债和所有者权益总计		421,043,731.71	475,100,566.18

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.819 元，基金份额总额 147,995,134.63 份。

6.2 利润表

会计主体：招商行业领先混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		14,018,899.27	106,459,740.47
1. 利息收入		426,073.84	446,596.18
其中：存款利息收入	6.4.7.11	66,131.08	108,688.08
债券利息收入		293,329.57	275,357.68
资产支持证券利息 收入		-	-
买入返售金融资产 收入		66,613.19	62,550.42
其他利息收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		34,231,491.58	81,293,445.86
其中：股票投资收益	6.4.7.12	32,711,325.22	83,630,830.13
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	338,215.70	-4,231,577.41
资产支持证券投资 收益	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	1,181,950.66	1,894,193.14
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.18	-20,798,617.49	24,673,191.06
4. 汇兑收益（损失以 “-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.19	159,951.34	46,507.37

减：二、费用		8,712,719.45	10,683,922.26
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,130,495.03	2,943,480.55
2. 托管费	6.4.10.2.2	521,749.17	490,580.08
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.20	4,945,127.73	7,133,664.97
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		1.75	17.90
7. 其他费用	6.4.7.21	115,345.77	116,178.76
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		5,306,179.82	95,775,818.21
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		5,306,179.82	95,775,818.21

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：招商行业领先混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	168,035,739.16	300,399,672.50	468,435,411.66
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	5,306,179.82	5,306,179.82
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-20,040,604.53	-36,436,606.68	-56,477,211.21
其中：1. 基金申购款	38,451,344.43	69,714,738.34	108,166,082.77
2. 基金赎回款	-58,491,948.96	-106,151,345.02	-164,643,293.98

四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“－”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	147,995,134.63	269,269,245.64	417,264,380.27
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	267,394,068.43	138,863,570.56	406,257,638.99
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	95,775,818.21	95,775,818.21
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“－”号填列）	-50,011,552.85	-31,827,429.48	-81,838,982.33
其中：1. 基金申购款	23,981,721.83	16,292,454.39	40,274,176.22
2. 基金赎回款	-73,993,274.68	-48,119,883.87	-122,113,158.55
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“－”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	217,382,515.58	202,811,959.29	420,194,474.87

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：

____王小青____ ____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

招商行业领先混合型证券投资基金(原名招商行业领先股票型证券投资基金,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》、《招商行业领先股票型证券投资基金基金合同》(以下简称“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[2009]331号文批准公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限为不定期,首次设立募集基金份额为 4,475,304,323.21 份,经德勤华永会计师事务所有限公司验证,并出具了编号为德师报(验)字(09)第 0011 号验资报告。基金合同于 2009 年 6 月 19 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”)。本基金于 2015 年 8 月 7 日起更名为招商行业领先混合型证券投资基金。根据 2015 年 12 月 31 日发布的《招商基金管理有限公司关于招商行业领先混合型证券投资基金新增基金份额并相应修订基金合同部分条款的公告》,从 2015 年 12 月 31 日起,本基金增设 H 类基金份额(以下简称“招商行业领先 H”),招商行业领先 H 是指仅在中国香港地区销售,并收取申购和赎回费用的本基金基金份额。截至 2020 年 12 月 31 日,本基金未对外发行 H 类基金。根据《中华人民共和国证券投资基金法》、截至报告期末最新公告的基金合同及《招商行业领先混合型证券投资基金更新的招募说明书》的有关规定,本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市交易的股票和存托凭证、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中,股票和存托凭证主要投资于处于景气回升或受益于国家政策导向而成长前景良好的相关行业;债券主要投资于基金管理人认为具有相对投资价值的固定收益品种,包括国债、金融债、企业(公司)债、可转换债券与资产支持证券等。本基金的投资组合为基金资产的 60-95% 投资于股票和存托凭证等权益类资产(其中,权证投资比例不超过基金资产净值的 3%),将基金资产的 5-40% 投资于现金和债券等固定收益类资产(其中,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%,其中,现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)。基金投资于景气回升或受益于国家政策导向而成长前景良好的相关行业的资产比例不低于基金股票和存托凭证资产的 80%。本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数收益率 \times 75%+中债综合全价(总值)指数收益率 \times 25%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)以及中国证监会发布的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 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策，会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

(2) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。

(3)对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在收到相关扣收税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳；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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	7,255,543.27
定期存款	-
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	-
合计	7,255,543.27

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	355,356,698.65	384,478,732.42	29,122,033.77
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	22,726,979.22	22,690,761.11
	银行间市场	-	-
	合计	22,726,979.22	22,690,761.11
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	378,083,677.87	407,169,493.53	29,085,815.66

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融工具。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无各项买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	827.86
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	721.89
应收债券利息	398,998.99
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	126.45
合计	400,675.19

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	1,296,603.72
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,296,603.72

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	5,235.62
应付证券出借违约金	-
预提费用	89,260.15
合计	94,495.77

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	168,035,739.16	168,035,739.16
本期申购	38,451,344.43	38,451,344.43
本期赎回 (以“-”号填列)	-58,491,948.96	-58,491,948.96
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	147,995,134.63	147,995,134.63

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。

6.4.7.10 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	248,414,411.42	51,985,261.08	300,399,672.50
本期利润	26,104,797.31	-20,798,617.49	5,306,179.82
本期基金份额交易产生的变动数	-32,128,715.96	-4,307,890.72	-36,436,606.68
其中：基金申购款	61,167,822.47	8,546,915.87	69,714,738.34
基金赎回款	-93,296,538.43	-12,854,806.59	-106,151,345.02
本期已分配利润	-	-	-
本期末	242,390,492.77	26,878,752.87	269,269,245.64

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	37,405.43
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	26,503.58
其他	2,222.07
合计	66,131.08

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	32,711,325.22
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	32,711,325.22

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,685,692,087.50
减：卖出股票成本总额	1,652,980,762.28
买卖股票差价收入	32,711,325.22

6.4.7.12.3 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。

6.4.7.12.4 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。

6.4.7.12.5 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。

6.4.7.13 债券投资收益**6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	338,215.70
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	338,215.70

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	28,106,102.06
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	27,315,191.98
减：应收利息总额	452,694.38
买卖债券差价收入	338,215.70

6.4.7.13.3 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。

6.4.7.13.4 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。

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.15 贵金属投资收益

6.4.7.15.1 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。

6.4.7.15.2 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。

6.4.7.15.3 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。

6.4.7.15.4 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。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 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。

6.4.7.16.2 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。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,181,950.66
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	1,181,950.66

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-20,798,617.49
——股票投资	-20,849,353.52
——债券投资	50,736.03
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-

3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-20,798,617.49

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	159,951.34
合计	159,951.34

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	4,945,127.73
银行间市场交易费用	-
合计	4,945,127.73

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	17,085.62
其他	9,000.00
合计	115,345.77

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
招商证券股份有限公司(以下简称“招商证券”)	基金管理人的股东

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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	-	-	320,308,984.63	6.89%

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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	-	-	366,507.00	0.33%

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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	298,303.96	6.94%	-	-

注：1、本基金与关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立；

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,130,495.03	2,943,480.55
其中：支付销售机构的客户维护费	1,248,547.39	715,293.46

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×1.50%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：

$$\text{日基金管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	521,749.17	490,580.08

注：支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值×0.25%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：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

6.4.10.4 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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2009 年 06 月 19 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	3,196,291.56
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	-	3,196,291.56
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	1.47%

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

6.4.10.6 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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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	7,255,543.27	37,405.43	16,200,702.52	72,946.27

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

单位：人民币元

本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
招商证券	001201	东瑞股份	网下申购	477	30,232.26
招商证券	300960	通业科技	网下申购	2,332	28,170.56
招商证券	300968	格林精密	网下申购	11,620	79,829.40
招商证券	300991	创益通	网下申购	2,535	33,107.10
招商证券	688517	金冠电气	网下申购	2,892	22,297.32

上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额

-	-	-	-	-	-
---	---	---	---	---	---

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2021 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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300614	百川畅银	2021 年 5 月 18 日	2021 年 11 月 25 日	新股锁定	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300919	中伟股份	2020 年 12 月 15 日	2021 年 7 月 2 日	新股锁定	24.60	163.00	521	12,816.60	84,923.00	-
300926	博俊科技	2020 年 12 月 29 日	2021 年 7 月 7 日	新股锁定	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-
300927	江天化学	2020 年 12 月 29 日	2021 年 7 月 7 日	新股锁定	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
300929	华骐环保	2021 年 1 月 12 日	2021 年 7 月 20 日	新股锁定	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
300932	三友联众	2021 年 1 月 15 日	2021 年 7 月 22 日	新股锁定	24.69	31.71	453	11,184.57	14,364.63	-
300933	中辰股份	2021 年 1 月 15 日	2021 年 7 月 22 日	新股锁定	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
300937	药易购	2021 年 1 月 20 日	2021 年 7 月 27 日	新股锁定	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
300940	南极光	2021 年 1 月 27 日	2021 年 8 月 3 日	新股锁定	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-
300941	创识科技	2021 年 2 月 2 日	2021 年 8 月 9 日	新股锁定	21.31	49.94	399	8,502.69	19,926.06	-
300942	易瑞生物	2021 年	2021 年	新股锁	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-

		2月2日	8月9日	定						
300943	春晖智控	2021年2月3日	2021年8月10日	新股锁定	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300945	曼卡龙	2021年2月3日	2021年8月10日	新股锁定	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中生态	2021年2月18日	2021年8月25日	新股锁定	13.00	27.42	324	2,808.00	8,884.08	-
300950	德固特	2021年2月24日	2021年9月3日	新股锁定	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
300952	恒辉安防	2021年3月3日	2021年9月13日	新股锁定	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-
300953	震裕科技	2021年3月11日	2021年9月22日	新股锁定	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	-
300955	嘉亨家化	2021年3月16日	2021年9月24日	新股锁定	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300956	英力股份	2021年3月16日	2021年9月27日	新股锁定	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	-
300957	贝泰妮	2021年3月18日	2021年9月27日	新股锁定	47.33	251.96	283	13,394.39	71,304.68	-
300958	建工修复	2021年3月18日	2021年9月29日	新股锁定	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300960	通业科技	2021年3月22日	2021年9月29日	新股锁定	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
300961	深水海纳	2021年3月23日	2021年9月30日	新股锁定	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300962	中金辐照	2021年3月29日	2021年10月11日	新股锁定	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300963	中洲特材	2021年3月30日	2021年10月11日	新股锁定	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-

300966	共同药业	2021 年 3 月 31 日	2021 年 10 月 11 日	新股锁 定	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300967	晓鸣股份	2021 年 4 月 2 日	2021 年 10 月 13 日	新股锁 定	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-
300968	格林精密	2021 年 4 月 6 日	2021 年 10 月 15 日	新股锁 定	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	-
300971	博亚精工	2021 年 4 月 7 日	2021 年 10 月 15 日	新股锁 定	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	-
300973	立高食品	2021 年 4 月 8 日	2021 年 10 月 15 日	新股锁 定	28.28	115.7 1	360	10,180.80	41,655.60	-
300975	商络电子	2021 年 4 月 14 日	2021 年 10 月 21 日	新股锁 定	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300978	东箭科技	2021 年 4 月 15 日	2021 年 10 月 26 日	新股锁 定	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300979	华利集团	2021 年 4 月 15 日	2021 年 10 月 26 日	新股锁 定	33.22	87.50	504	16,742.88	44,100.00	-
300981	中红医疗	2021 年 4 月 19 日	2021 年 10 月 27 日	新股锁 定	48.59	90.39	322	15,645.98	29,105.58	-
300982	苏文电能	2021 年 4 月 19 日	2021 年 10 月 27 日	新股锁 定	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300985	致远新能	2021 年 4 月 21 日	2021 年 10 月 29 日	新股锁 定	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95	-
300986	志特新材	2021 年 4 月 21 日	2021 年 11 月 1 日	新股锁 定	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300987	川网传媒	2021 年 4 月 28 日	2021 年 11 月 11 日	新股锁 定	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-
300991	创益通	2021 年 5 月 12 日	2021 年 11 月 22 日	新股锁 定	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
300992	泰福泵业	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 25 日	新股锁 定	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-

		日	日							
300993	玉马遮阳	2021年 5月17 日	2021年 11月24 日	新股锁 定	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-
300995	奇德新材	2021年 5月17 日	2021年 11月26 日	新股锁 定	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
300996	普联软件	2021年 5月26 日	2021年 12月3 日	新股锁 定	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	-
300997	欢乐家	2021年 5月26 日	2021年 12月2 日	新股锁 定	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-
300998	宁波方正	2021年 5月25 日	2021年 12月2 日	新股锁 定	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301002	崧盛股份	2021年 5月27 日	2021年 12月7 日	新股锁 定	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
301004	嘉益股份	2021年 6月18 日	2021年 12月27 日	新股锁 定	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	-
301007	德迈仕	2021年 6月4 日	2021年 12月16 日	新股锁 定	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
301009	可靠股份	2021年 6月8 日	2021年 12月17 日	新股锁 定	12.54	27.89	801	10,044.54	22,339.89	-
301010	晶雪节能	2021年 6月9 日	2021年 12月20 日	新股锁 定	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
301011	华立科技	2021年 6月9 日	2021年 12月17 日	新股锁 定	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
301012	扬电科技	2021年 6月15 日	2021年 12月22 日	新股锁 定	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
301015	百洋医药	2021年 6月22 日	2021年 12月30 日	新股锁 定	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
301016	雷尔伟	2021年 6月23 日	2021年 12月30 日	新股锁 定	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
301018	申菱环境	2021年	2021年	新股锁	8.29	8.29	7,029	58,270.41	58,270.41	-

		6月28日	7月7日	定						
301018	申菱环境	2021年6月28日	2022年1月7日	新股锁定	8.29	8.29	782	6,482.78	6,482.78	-
301020	密封科技	2021年6月28日	2021年7月6日	新股锁定	10.64	10.64	3,789	40,314.96	40,314.96	-
301020	密封科技	2021年6月28日	2022年1月6日	新股锁定	10.64	10.64	421	4,479.44	4,479.44	-
301021	英诺激光	2021年6月28日	2021年7月6日	新股锁定	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14	-
301021	英诺激光	2021年6月28日	2022年1月6日	新股锁定	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	-
605162	新中港	2021年6月29日	2021年7月7日	新股锁定	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
605287	德才股份	2021年6月28日	2021年7月6日	新股锁定	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
688067	爱威科技	2021年6月7日	2021年12月16日	新股锁定	14.71	24.83	1,259	18,519.89	31,260.97	-
688070	纵横股份	2021年2月2日	2021年8月10日	新股锁定	23.16	34.47	2,407	55,746.12	82,969.29	-
688201	信安世纪	2021年4月13日	2021年10月21日	新股锁定	26.78	45.41	2,129	57,014.62	96,677.89	-
688226	威腾电气	2021年6月28日	2021年7月7日	新股锁定	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
688276	百克生物	2021年6月17日	2021年12月27日	新股锁定	36.35	79.48	2,842	103,306.70	225,882.16	-
688533	上声电子	2021年4月9日	2021年10月19日	新股锁定	7.72	19.11	3,493	26,965.96	66,751.23	-
688601	力芯微	2021年6月18日	2021年12月28日	新股锁定	36.48	133.69	1,174	42,827.52	156,952.06	-

688609	九联科技	2021 年 3 月 15 日	2021 年 9 月 23 日	新股锁 定	3.99	15.29	10,372	41,384.28	158,587.88	-
688621	阳光诺和	2021 年 6 月 11 日	2021 年 12 月 21 日	新股锁 定	26.89	63.99	1,485	39,931.65	95,025.15	-
688630	芯碁微装	2021 年 3 月 25 日	2021 年 10 月 8 日	新股锁 定	15.23	58.42	3,397	51,736.31	198,452.74	-
688660	电气风电	2021 年 5 月 11 日	2021 年 11 月 19 日	新股锁 定	5.44	7.26	24,492	133,236.48	177,811.92	-
688819	天能股份	2021 年 1 月 7 日	2021 年 7 月 19 日	新股锁 定	41.79	43.69	7,450	311,335.50	325,490.50	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认 购日	可流通 日	流通受 限类型	认购 价格	期末 估值 单价	数量（单 位：张）	期末成本 总额	期末估值 总额	备注
113050	南银转债	2021 年 6 月 17 日	2021 年 7 月 1 日	新债未 上市	100.0 0	100.0 0	1,130	112,998.51	112,998.51	-

注：以上“可流通日”中，部分证券的日期是根据上市公司公告估算的流通日期。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.4 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

本基金为混合型基金，本基金的运作涉及的金融工具主要包括股票投资、银行存款等。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。与本基金相关的市场风险主要包括利率风险和市场价格风险。

本基金的基金管理人以全面、独立、互相制约为基本原则，建立了全面的合规及风险管理组织架构，包括：董事会及下设专门委员会、监事会、督察长、法律合规部、监察审计部及风险管理部等。

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，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。本报告期末及上年度末本基金所持有的债券投资的信用评级情况参见附注 6.4.13.2.1 至附注 6.4.13.2.6，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。

6.4.13.2.1 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。

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 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	112,998.51	-
AAA 以下	12,025.00	251,443.76

未评级	-	-
合计	125,023.51	251,443.76

注：上述评级均由经中国证监会核准从事证券市场资信评级业务的评级机构做出。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

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

流动性风险是指没有足够资金以满足到期债务支付的风险。本基金流动性风险来源于开放式基金每日兑付赎回资金的流动性风险，以及因部分投资品种交易不活跃而出现的变现风险以及因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理价格变现投资的风险。本基金所持有的交易性金融资产分别在证券交易所和银行间同业市场交易，除附注 6.4.12 所披露的流通受限不能自由转让的基金资产外，本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。本基金所持有的金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息。

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。本基金持有的利率敏感性资产主要是银行存款、债券投资和买入返售金融资产。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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	7,255,543.27	-	-	-	7,255,543.27
结算备付金	1,782,383.41	-	-	-	1,782,383.41
存出保证金	312,216.86	-	-	-	312,216.86
交易性金融资产	22,565,737.60	12,025.00	112,998.51	384,478,732.42	407,169,493.53
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	400,675.19	400,675.19
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	309,161.30	309,161.30
应收证券清算款	-	-	-	3,814,258.15	3,814,258.15
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	31,915,881.14	12,025.00	112,998.51	389,002,827.06	421,043,731.71
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,803,398.82	1,803,398.82
应付管理人报酬	-	-	-	501,302.45	501,302.45
应付托管费	-	-	-	83,550.42	83,550.42
应付证券清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	1,296,603.72	1,296,603.72
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	0.26	0.26
其他负债	-	-	-	94,495.77	94,495.77
负债总计	-	-	-	3,779,351.44	3,779,351.44
利率敏感度缺口	31,915,881.14	12,025.00	112,998.51	385,223,475.62	417,264,380.27
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	8,076,095.11	-	-	-	8,076,095.11
结算备付金	2,865,901.45	-	-	-	2,865,901.45
存出保证金	267,538.36	-	-	-	267,538.36
交易性金融资产	19,470,052.80	-	251,443.76	438,123,102.51	457,844,599.07
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	431,303.12	431,303.12
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	784,780.22	784,780.22

应收证券清算款	-	-	-	4,830,348.85	4,830,348.85
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	30,679,587.72	-	251,443.76	444,169,534.70	475,100,566.18
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,269,341.41	2,269,341.41
应付管理人报酬	-	-	-	557,012.99	557,012.99
应付托管费	-	-	-	92,835.47	92,835.47
应付证券清算款	-	-	-	2,004,684.15	2,004,684.15
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	1,556,681.92	1,556,681.92
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	0.35	0.35
其他负债	-	-	-	184,598.23	184,598.23
负债总计	-	-	-	6,665,154.52	6,665,154.52
利率敏感度缺口	30,679,587.72	-	251,443.76	437,504,380.18	468,435,411.66

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（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
		1. 市场利率平行上升 50 个基点	-46,381.73
	2. 市场利率平行下降 50 个基点	46,794.25	9,918.82

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和股票，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 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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	384,478,732.42	92.14	438,123,102.51	93.53
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	384,478,732.42	92.14	438,123,102.51	93.53

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（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	1. 权益性投资的市场价格上升 5%	19,223,936.62	21,906,155.13
	2. 权益性投资的市场价格下降 5%	-19,223,936.62	-21,906,155.13

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无需要说明有助于理解和分析会计报表的其他事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	384,478,732.42	91.32
	其中：股票	384,478,732.42	91.32
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	22,690,761.11	5.39
	其中：债券	22,690,761.11	5.39

	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	9,037,926.68	2.15
8	其他资产	4,836,311.50	1.15
9	合计	421,043,731.71	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	33,198.70	0.01
B	采矿业	10,512.39	0.00
C	制造业	313,643,027.41	75.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	71,286.79	0.02
E	建筑业	47,572.87	0.01
F	批发和零售业	46,404.58	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	18,850.59	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	174,418.99	0.04
J	金融业	21,959,270.10	5.26
K	房地产业	10,095.90	0.00
L	租赁和商务服务业	65,464.36	0.02
M	科学研究和技术服务业	10,195,080.15	2.44
N	水利、环境和公共设施管理业	105,207.95	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	38,080,100.00	9.13
R	文化、体育和娱乐业	18,241.64	0.00
S	综合	-	-
	合计	384,478,732.42	92.14

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	300347	泰格医药	197,000	38,080,100.0 0	9.13
2	002271	东方雨虹	558,000	30,868,560.0 0	7.40
3	300014	亿纬锂能	278,569	28,951,676.1 7	6.94
4	002812	恩捷股份	108,269	25,345,772.9 0	6.07
5	002371	北方华创	79,700	22,107,186.0 0	5.30
6	300408	三环集团	518,200	21,982,044.0 0	5.27
7	688169	石头科技	15,699	19,796,439.0 0	4.74
8	002415	海康威视	301,800	19,466,100.0 0	4.67
9	600809	山西汾酒	35,500	15,904,000.0 0	3.81
10	000858	五 粮 液	52,000	15,490,280.0 0	3.71
11	300750	宁德时代	28,500	15,241,800.0 0	3.65
12	300122	智飞生物	81,200	15,162,476.0 0	3.63
13	603690	至纯科技	375,200	15,161,832.0 0	3.63
14	600919	江苏银行	1,926,000	13,674,600.0 0	3.28
15	688076	诺泰生物	180,547	12,315,110.87	2.95
16	600699	均胜电子	428,100	10,925,112.00	2.62
17	601058	赛轮轮胎	1,064,000	10,629,360.0 0	2.55
18	300601	康泰生物	70,800	10,549,200.0 0	2.53
19	603392	万泰生物	40,082	10,388,452.7 6	2.49
20	603259	药明康德	64,500	10,100,055.0 0	2.42
21	000568	泸州老窖	38,900	9,178,066.00	2.20
22	002142	宁波银行	211,700	8,249,949.00	1.98

23	688063	派能科技	3,179	625,627.20	0.15
24	688819	天能股份	7,450	325,490.50	0.08
25	688276	百克生物	2,842	225,882.16	0.05
26	688630	芯碁微装	3,397	198,452.74	0.05
27	688660	电气风电	24,492	177,811.92	0.04
28	688609	九联科技	10,372	158,587.88	0.04
29	605499	东鹏饮料	632	158,505.60	0.04
30	688601	力芯微	1,174	156,952.06	0.04
31	688201	信安世纪	2,129	96,677.89	0.02
32	688621	阳光诺和	1,485	95,025.15	0.02
33	688560	明冠新材	3,832	92,351.20	0.02
34	300919	中伟股份	521	84,923.00	0.02
35	688070	纵横股份	2,407	82,969.29	0.02
36	605117	德业股份	627	80,005.20	0.02
37	688355	明志科技	2,710	72,384.10	0.02
38	300957	贝泰妮	283	71,304.68	0.02
39	688533	上声电子	3,493	66,751.23	0.02
40	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.02
41	301007	德迈仕	3,022	60,305.15	0.01
42	688195	腾景科技	2,693	58,626.61	0.01
43	300910	瑞丰新材	474	49,556.70	0.01
44	601156	东航物流	2,090	49,470.30	0.01
45	688597	煜邦电力	3,907	49,306.34	0.01
46	605337	李子园	788	46,886.00	0.01
47	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.01
48	688565	力源科技	2,464	44,376.64	0.01
49	300979	华利集团	504	44,100.00	0.01
50	300894	火星人	628	42,704.00	0.01
51	300973	立高食品	360	41,655.60	0.01
52	605090	九丰能源	1,090	35,326.90	0.01
53	688681	科汇股份	1,899	34,903.62	0.01
54	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.01
55	603799	华友钴业	300	34,260.00	0.01
56	003040	楚天龙	1,101	33,470.40	0.01
57	300871	回盛生物	855	33,345.00	0.01
58	300900	广联航空	879	32,857.02	0.01
59	688067	爱威科技	1,259	31,260.97	0.01
60	300981	中红医疗	322	29,105.58	0.01
61	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.01
62	001201	东瑞股份	668	27,347.92	0.01
63	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.01
64	603759	海天股份	1,119	22,939.50	0.01
65	001207	联科科技	682	22,581.02	0.01

66	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.01
67	300911	亿田智能	309	21,407.52	0.01
68	601279	英利汽车	2,004	20,901.72	0.01
69	605389	长龄液压	356	20,890.08	0.01
70	300884	狄耐克	749	20,133.12	0.00
71	300941	创识科技	399	19,926.06	0.00
72	605305	中际联合	368	19,364.16	0.00
73	001205	盛航股份	577	18,850.59	0.00
74	300878	维康药业	401	18,714.67	0.00
75	603511	爱慕股份	553	18,249.00	0.00
76	300860	锋尚文化	313	18,241.64	0.00
77	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
78	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
79	605179	一鸣食品	939	16,836.27	0.00
80	300909	汇创达	386	16,636.60	0.00
81	300864	南大环境	298	16,392.98	0.00
82	605377	华旺科技	1,050	16,212.00	0.00
83	605300	佳禾食品	576	16,012.80	0.00
84	603836	海程邦达	733	15,994.06	0.00
85	300925	法本信息	600	15,774.00	0.00
86	300890	翔丰华	286	15,615.60	0.00
87	300908	仲景食品	257	15,314.63	0.00
88	300932	三友联众	453	14,364.63	0.00
89	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
90	605016	百龙创园	445	14,222.20	0.00
91	605180	华生科技	384	14,208.00	0.00
92	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
93	605060	联德股份	883	13,933.74	0.00
94	605319	无锡振华	764	13,706.16	0.00
95	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
96	003030	祖名股份	480	13,516.80	0.00
97	605500	森林包装	762	13,464.54	0.00
98	605133	嵘泰股份	618	13,398.24	0.00
99	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
100	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
101	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
102	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
103	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
104	605286	同力日升	597	12,208.65	0.00
105	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
106	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
107	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
108	300895	铜牛信息	340	11,563.40	0.00

109	605228	神通科技	1,217	11,464.14	0.00
110	300879	大叶股份	466	11,267.88	0.00
111	605303	园林股份	610	11,242.30	0.00
112	300918	南山智尚	1,063	11,065.83	0.00
113	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
114	605289	罗曼股份	380	10,959.20	0.00
115	605055	迎丰股份	1,146	10,909.92	0.00
116	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
117	605277	新亚电子	507	10,662.21	0.00
118	605259	绿田机械	295	10,516.75	0.00
119	605086	龙高股份	443	10,512.39	0.00
120	605005	合兴股份	634	10,321.52	0.00
121	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
122	300917	特发服务	365	10,095.90	0.00
123	300922	天秦装备	287	9,996.21	0.00
124	003041	真爱美家	349	9,876.70	0.00
125	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
126	003033	征和工业	301	9,538.69	0.00
127	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
128	300893	松原股份	414	9,240.48	0.00
129	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
130	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
131	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
132	003023	彩虹集团	296	8,968.80	0.00
133	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
134	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
135	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
136	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
137	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
138	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
139	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
140	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
141	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
142	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
143	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
144	605298	必得科技	391	7,847.37	0.00
145	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
146	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
147	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
148	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
149	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
150	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
151	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00

152	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
153	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
154	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
155	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
156	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
157	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
158	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
159	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
160	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
161	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
162	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300014	亿纬锂能	63,020,456.08	13.45
2	000568	泸州老窖	57,729,132.18	12.32
3	300347	泰格医药	57,209,524.94	12.21
4	600809	山西汾酒	54,922,779.18	11.72
5	002415	海康威视	52,055,946.35	11.11
6	000858	五粮液	49,656,459.89	10.60
7	603259	药明康德	47,016,725.03	10.04
8	002371	北方华创	39,691,712.58	8.47
9	603392	万泰生物	39,111,896.79	8.35
10	000100	TCL 科技	36,103,339.00	7.71
11	002271	东方雨虹	35,536,418.98	7.59
12	601009	南京银行	35,277,884.00	7.53
13	300450	先导智能	33,690,241.71	7.19
14	601012	隆基股份	32,906,809.52	7.02
15	600438	通威股份	32,648,474.06	6.97
16	300601	康泰生物	29,895,344.61	6.38
17	601888	中国中免	28,881,609.00	6.17
18	600900	长江电力	28,387,652.00	6.06
19	300750	宁德时代	28,120,755.00	6.00
20	000651	格力电器	28,039,575.18	5.99
21	300316	晶盛机电	27,908,675.27	5.96
22	002812	恩捷股份	26,715,846.67	5.70
23	002311	海大集团	25,397,709.54	5.42
24	601939	建设银行	25,332,991.00	5.41
25	002340	格林美	23,894,001.12	5.10

26	002405	四维图新	23,282,335.52	4.97
27	603799	华友钴业	23,249,133.96	4.96
28	300593	新雷能	22,856,259.00	4.88
29	300408	三环集团	22,428,989.75	4.79
30	002142	宁波银行	22,322,271.00	4.77
31	601318	中国平安	22,059,005.67	4.71
32	002821	凯莱英	21,563,048.00	4.60
33	601398	工商银行	20,803,803.07	4.44
34	300122	智飞生物	20,211,472.00	4.31
35	688169	石头科技	20,099,866.72	4.29
36	600884	杉杉股份	19,987,214.90	4.27
37	603690	至纯科技	19,870,593.83	4.24
38	002541	鸿路钢构	19,492,105.40	4.16
39	000799	酒鬼酒	18,512,663.25	3.95
40	603588	高能环境	18,210,549.00	3.89
41	601111	中国国航	17,795,887.00	3.80
42	002460	赣锋锂业	17,564,719.60	3.75
43	601966	玲珑轮胎	17,497,472.50	3.74
44	603127	昭衍新药	16,724,444.46	3.57
45	000768	中航西飞	15,762,342.06	3.36
46	600919	江苏银行	14,441,914.90	3.08
47	688696	极米科技	14,255,275.63	3.04
48	600316	洪都航空	13,977,737.00	2.98
49	600009	上海机场	13,244,099.39	2.83
50	688076	诺泰生物	12,892,731.48	2.75
51	300775	三角防务	12,744,220.00	2.72
52	002493	荣盛石化	12,335,360.00	2.63
53	002240	盛新锂能	10,945,477.00	2.34
54	601601	中国太保	10,898,632.56	2.33
55	601058	赛轮轮胎	10,884,358.00	2.32
56	600519	贵州茅台	10,768,262.00	2.30
57	300363	博腾股份	10,383,103.00	2.22
58	002138	顺络电子	10,088,532.76	2.15
59	603893	瑞芯微	9,951,808.00	2.12
60	603026	石大胜华	9,659,601.77	2.06
61	688208	道通科技	9,642,357.08	2.06
62	600674	川投能源	9,582,812.48	2.05
63	600196	复星医药	9,443,643.00	2.02

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	300014	亿纬锂能	74,461,746.15	15.90
2	603259	药明康德	67,661,202.85	14.44
3	000568	泸州老窖	63,777,805.33	13.62
4	000100	TCL 科技	61,960,652.00	13.23
5	600519	贵州茅台	50,047,057.20	10.68
6	000858	五粮液	49,650,726.00	10.60
7	603799	华友钴业	48,409,385.51	10.33
8	002821	凯莱英	42,557,169.22	9.08
9	002460	赣锋锂业	39,756,520.08	8.49
10	600809	山西汾酒	37,331,992.80	7.97
11	000725	京东方 A	37,127,946.98	7.93
12	300347	泰格医药	35,948,594.00	7.67
13	002475	立讯精密	35,866,910.13	7.66
14	601009	南京银行	35,791,180.66	7.64
15	603392	万泰生物	34,641,410.53	7.40
16	002415	海康威视	32,089,852.89	6.85
17	300450	先导智能	30,250,564.28	6.46
18	000651	格力电器	29,650,781.00	6.33
19	600900	长江电力	29,535,934.00	6.31
20	601012	隆基股份	27,639,007.22	5.90
21	002311	海大集团	26,784,404.43	5.72
22	601888	中国中免	26,596,978.60	5.68
23	601939	建设银行	25,265,956.30	5.39
24	300408	三环集团	24,712,346.18	5.28
25	600438	通威股份	24,249,957.65	5.18
26	002240	盛新锂能	23,185,464.00	4.95
27	002340	格林美	23,173,175.59	4.95
28	002405	四维图新	22,951,838.13	4.90
29	300316	晶盛机电	22,538,850.10	4.81
30	601398	工商银行	20,621,263.19	4.40
31	300750	宁德时代	20,494,188.10	4.38
32	601318	中国平安	20,348,406.00	4.34
33	300593	新雷能	20,084,238.23	4.29
34	601111	中国国航	19,789,758.00	4.22
35	000799	酒鬼酒	19,621,302.87	4.19
36	600703	三安光电	19,163,919.02	4.09
37	603588	高能环境	18,862,912.00	4.03
38	002541	鸿路钢构	17,681,917.00	3.77

39	688696	极米科技	17,255,090.73	3.68
40	600884	杉杉股份	16,694,186.70	3.56
41	601966	玲珑轮胎	16,539,886.00	3.53
42	300015	爱尔眼科	16,485,537.70	3.52
43	603127	昭衍新药	16,255,202.60	3.47
44	300601	康泰生物	15,768,351.48	3.37
45	002371	北方华创	14,893,640.00	3.18
46	600316	洪都航空	14,343,809.00	3.06
47	000596	古井贡酒	14,120,602.00	3.01
48	002142	宁波银行	13,388,091.35	2.86
49	603893	瑞芯微	13,176,439.00	2.81
50	000768	中航西飞	13,039,060.40	2.78
51	600009	上海机场	12,504,681.00	2.67
52	300775	三角防务	12,070,987.00	2.58
53	600763	通策医疗	11,713,573.51	2.50
54	300363	博腾股份	11,262,895.00	2.40
55	600038	中直股份	10,928,139.00	2.33
56	601899	紫金矿业	10,578,811.00	2.26
57	601601	中国太保	10,249,627.80	2.19
58	688686	奥普特	10,194,015.54	2.18
59	600196	复星医药	10,104,320.00	2.16
60	002812	恩捷股份	9,719,364.00	2.07
61	002493	荣盛石化	9,614,302.00	2.05
62	600674	川投能源	9,529,319.52	2.03
63	688208	道通科技	9,520,151.21	2.03
64	600711	盛屯矿业	9,482,376.00	2.02

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	1,620,185,745.71
卖出股票收入（成交）总额	1,685,692,087.50

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	22,565,737.60	5.41
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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）	125,023.51	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	22,690,761.11	5.44

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	019645	20 国债 15	224,960	22,565,737.60	5.41
2	113050	南银转债	1,130	112,998.51	0.03
3	128108	蓝帆转债	100	12,025.00	0.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

根据本基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

7.10.2 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

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

7.11.3 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。

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。

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	312,216.86
2	应收证券清算款	3,814,258.15
3	应收股利	-
4	应收利息	400,675.19
5	应收申购款	309,161.30
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,836,311.50

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	128108	蓝帆转债	12,025.00	0.00

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末投资前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
19,538	7,574.73	106,209.50	0.07%	147,888,925.13	99.93%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	430.30	0.0003%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2009年6月19日)基金份额总额	4,475,304,323.21
本报告期期初基金份额总额	168,035,739.16
本报告期基金总申购份额	38,451,344.43
减：报告期基金总赎回份额	58,491,948.96
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	147,995,134.63

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

根据本基金管理人 2021 年 3 月 6 日的公告，经招商基金管理有限公司第六届董事会 2021 年第二次会议审议通过，同意沙骏先生离任副总经理。

根据本基金管理人 2021 年 6 月 5 日的公告，经招商基金管理有限公司第六届董事会 2021 年第六次会议审议通过，同意选举王小青先生担任公司董事长，刘辉女士不再担任公司董事长。

本基金本报告期内基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的重大诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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、托管人的托管业务部门及其相关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。

10.7 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	佣金	占当期佣金总量的比例	

			额的比例			
华泰证券	4	657,025,642.49	19.92%	568,223.83	19.31%	-
中信证券	3	416,111,129.49	12.62%	387,524.78	13.17%	-
光大证券	3	310,505,535.32	9.42%	277,619.33	9.43%	-
方正证券	5	177,404,934.20	5.38%	165,217.06	5.61%	-
中信建投 证券	6	173,103,723.53	5.25%	161,212.04	5.48%	-
国信证券	3	162,783,435.06	4.94%	137,294.20	4.67%	-
长江证券	4	155,009,712.75	4.70%	144,360.62	4.91%	-
东北证券	3	142,663,679.51	4.33%	132,862.77	4.51%	-
中泰证券	2	134,065,510.08	4.07%	98,040.91	3.33%	-
华西证券	3	124,693,038.95	3.78%	101,564.10	3.45%	-
长城证券	3	104,776,966.04	3.18%	97,578.47	3.32%	-
安信证券	2	99,610,316.62	3.02%	92,767.36	3.15%	-
粤开证券	1	96,910,690.42	2.94%	90,253.36	3.07%	-
申万宏源	4	71,254,145.21	2.16%	66,359.30	2.26%	-
海通证券	3	70,054,364.49	2.12%	65,241.47	2.22%	-
天风证券	2	62,820,128.79	1.91%	58,504.74	1.99%	-
中航证券	2	62,584,356.62	1.90%	58,285.09	1.98%	-
西部证券	1	60,826,900.67	1.84%	56,648.07	1.93%	-
开源证券	2	57,982,383.98	1.76%	53,998.65	1.84%	-
东方财富	3	56,670,928.30	1.72%	41,443.60	1.41%	-
国盛证券	2	40,831,673.75	1.24%	38,027.00	1.29%	-
中金财富 证券	2	30,716,018.36	0.93%	22,462.40	0.76%	-
银河证券	1	29,222,522.30	0.89%	27,215.06	0.92%	-
大通证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	3	-	-	-	-	-
东方证券	3	-	-	-	-	-
东兴证券	3	-	-	-	-	-
广发证券	3	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安 证券	3	-	-	-	-	-
华安证券	3	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	3	-	-	-	-	-
瑞信方正	2	-	-	-	-	-
上海证券	2	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-

太平洋证券	2	-	-	-	-	-
湘财证券	2	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	5	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	3	-	-	-	-	-
中银国际证券	4	-	-	-	-	-

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华泰证券	-	-	77,800,000.00	9.81%	-	-
中信证券	-	-	142,800,000.00	18.01%	-	-
光大证券	7,530,790.90	19.65%	124,300,000.00	15.68%	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	321,300,000.00	40.52%	-	-
国信证券	7,978,450.40	20.81%	25,200,000.00	3.18%	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	32,000,000.00	4.04%	-	-
华西证券	217,531.66	0.57%	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	8,100,000.00	1.02%	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	22,603,980.80	58.97%	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-

开源证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	22,000,000.00	2.77%	-	-
中金财富 证券	-	-	39,400,000.00	4.97%	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安 证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
瑞信方正	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证 券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
新时代证 券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中银国际 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基金直销账户信息变更的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-13

2	招商行业领先混合型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-21
3	招商基金管理有限公司旗下基金 2020 年第 4 季度报告提示性公告	证券时报及基金管理人网站	2021-01-21
4	招商基金管理有限公司旗下部分基金增加和耕传承为销售机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-02-03
5	招商基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-06
6	招商基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-24
7	招商基金管理有限公司旗下部分基金增加南洋商业银行(中国)有限公司为销售机构的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-29
8	招商行业领先混合型证券投资基金 2020 年年度报告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-30
9	招商基金管理有限公司旗下基金 2020 年年度报告提示性公告	证券时报及基金管理人网站	2021-03-30
10	招商基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-04-08
11	招商基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-04-17
12	招商行业领先混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-04-21
13	招商基金管理有限公司旗下基金 2021 年第 1 季度报告提示性公告	证券时报及基金管理人网站	2021-04-21
14	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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-05-07
15	招商基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-05-13
16	招商基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-06-05
17	招商基金管理有限公司关于降低旗下部分基金业务最低限额的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会	2021-06-08

		基金电子披露网站	
18	招商基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-06-11
19	招商行业领先混合型证券投资基金(A类份额)基金产品资料概要更新	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-06-18
20	招商行业领先混合型证券投资基金更新的招募说明书(二零二一年第一号)	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-06-18

§ 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行业领先混合型证券投资基金设立的文件；
- 3、《招商行业领先混合型证券投资基金基金合同》；
- 4、《招商行业领先混合型证券投资基金托管协议》；
- 5、《招商行业领先混合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：中国深圳深南大道 7088 号招商银行大厦

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.cmfcchina.com>

招商基金管理有限公司

2021 年 8 月 30 日