招商安盈债券型证券投资基金 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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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 5
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 8
4.1 基金管理人及基金经理情况 8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 10
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 11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 12
4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明 12
§5 托管人报告 13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 13
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 13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 13
§6 半年度财务会计报告（未经审计） 13
6.1 资产负债表 13
6.2 利润表 15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 16
6.4 报表附注 18
§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 37
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 39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 42
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 42
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 43
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 43
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 43
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 43

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 43
7.12 投资组合报告附注 43
§8 基金份额持有人信息 46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 46
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 46
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 46
§9 开放式基金份额变动 46
§10 重大事件揭示 47
10.1 基金份额持有人大会决议 47
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 47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 47
10.4 基金投资策略的改变 47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 47
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 47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 48
10.8 其他重大事件 50
§11 影响投资者决策的其他重要信息 52
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 52
§12 备查文件目录 52
12.1 备查文件目录 52
12.2 存放地点 53
12.3 查阅方式 53

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	招商安盈债券型证券投资基金	
基金简称	招商安盈债券	
基金主代码	217024	
交易代码	217024	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 9 月 22 日	
基金管理人	招商基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,904,082,940.97 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	招商安盈债券 A	招商安盈债券 C
下属分级基金的交易代码	217024	012233
报告期末下属分级基金的份额总额	1,903,985,302.22 份	97,638.75 份

注：本基金从 2021 年 5 月 13 日起新增 C 类份额，C 类份额自 2021 年 5 月 18 日起存续。

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求持续稳健的投资收益。
投资策略	1、资产配置策略：本基金依据宏观经济数据和金融运行数据、货币政策、财政政策、以及债券市场和股票市场风险收益特征，分析判断市场利率水平变动趋势和股票市场走势。并根据宏观经济、基准利率水平、股票市场整体估值水平，预测债券、可转债、新股申购等大类资产下一阶段的预期收益率水平，结合各类别资产的波动性以及流动性状况分析，进行大类资产配置。 2、债券（不含可转换公司债）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、期权策略、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。 3、可转换公司债投资策略：由于可转债兼具债性和股性，本基金通过对可转债相对价值的分析，确定不同市场环境下可转债股性和债性的相对价值，把握可转债的价值走向，选择相应券种，从而获取较高投资收益。 4、股票投资策略：本基金充分发挥基金管理人的研究优势，将严谨、规范化的选股方法与积极主动的投资风格相结合，在分析和判断宏观经济运行和行业景气变化、以及上市公司成长潜力的基础上，通过优选具有良好成长性、质量优良、定价相对合理的股票进行投资，以谋求超额收

	益。
业绩比较基准	中债综合全价（总值）指数收益率
风险收益特征	本基金预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于一般混合型基金和股票型基金。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	潘西里	郭明
	联系电话	0755－83196666	（010）66105799
	电子邮箱	cmf@cmfchina.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-887-9555	95588
传真		0755－83196475	（010）66105798
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 55 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 55 号
邮政编码		518040	100140
法定代表人		王小青	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
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	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

1、招商安盈债券 A

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	28,859,216.46
本期利润	80,750,323.09

加权平均基金份额本期利润	0.0480
本期加权平均净值利润率	3.87%
本期基金份额净值增长率	3.72%
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	995,204,597.67
期末可供分配基金份额利润	0.5227
期末基金资产净值	2,401,599,607.06
期末基金份额净值	1.2614
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	25.24%

2、招商安盈债券C

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021年5月18日 - 2021年6月30日)
本期已实现收益	146.61
本期利润	1,056.51
加权平均基金份额本期利润	0.0403
本期加权平均净值利润率	3.21%
本期基金份额净值增长率	1.16%
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	25,518.89
期末可供分配基金份额利润	0.2614
期末基金资产净值	123,157.64
期末基金份额净值	1.2614
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	1.16%

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。

4、本基金从2021年5月13日起新增C类份额，C类份额自2021年5月18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

招商安盈债券 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	0.40%	0.21%	-0.04%	0.03%	0.44%	0.18%
过去三个月	1.58%	0.17%	0.45%	0.03%	1.13%	0.14%
过去六个月	3.72%	0.22%	0.65%	0.04%	3.07%	0.18%
过去一年	8.57%	0.28%	1.28%	0.05%	7.29%	0.23%
自基金合同生效起至今	25.24%	0.29%	11.57%	0.07%	13.67%	0.22%

招商安盈债券 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	0.39%	0.21%	-0.04%	0.03%	0.43%	0.18%
自基金合同生效起至今	1.16%	0.20%	0.10%	0.03%	1.06%	0.17%

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 2021 年 5 月 13 日起新增 C 类份额，C 类份额自 2021 年 5 月 18 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		
尹晓红	本基金基金经理	2018 年 9 月 22 日	-	7	女，硕士。2013 年 7 月加入招商基金管理有限公司，曾任交易部交易员；2015 年 2 月工作调动至招商财富资产管理有限公司（招商基金全资子公司），任投资经理；2016 年 4 月加入招商基金管理有限公司投资支持与创新部，曾任高级研究员，招商安瑞进取债券型证券投资基金、招商安润灵活配置混合型证券投资基金、招商 3 年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金经理，现任招商安盈债券型证券投资基金、招商安庆债券型证券投资基金、招商安阳债券型证券投资基金、招商增浩一年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。
姚爽	本基金基金经理	2018 年 9 月 22 日	-	9	男，经济学硕士。2011 年 7 月加入国泰基金管理有限公司研究部，任宏观策略研究员；2013 年 12 月加入北京弘毅远方投资顾问有限公司，任分析师、投资经理；2015 年 7 月加入招商基金管理有限公司，曾任研究部高级研究员，招商丰庆灵活配置混合型发起式证券投资基金、招商睿乾混合型证券投资基金基金经理，现任招商安盈债券型证券投资基金、招商安庆债券型证券投资基金、招商安元灵活配置混合型证券投资基金、招商安阳债券型证券投资基金、招商瑞和 1 年持有期混合型证券投资基金基金经理。

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；

3、报告截止日至批准送出日期间，自 2021 年 8 月 5 日起姚爽先生离任本基金的基金经理；

4、报告截止日至批准送出日期间，自 2021 年 8 月 5 日起蔡振先生新任本基金的基金经理。

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

上半年权益市场整体震荡，结构分化剧烈。鉴于部分行业高估，宏观政策逐步回收，本组合坚决回避了高估值、高持仓的板块和个股，转而在受益经济和通胀回升的金融、周期板块和中小市值中挖掘机会，因此有效控制了组合净值的波动率，但在二季度末市场的反弹行情中显得进攻性不足。转债方面，鉴于转债作为一类大类资产的性价比并不突出，因而在控制较低仓位的同时，更多自下而上挖掘个券，主要配置债底保护较为突出和正股估值和成长性相匹配、溢价率合理的标的。上半年债券市场行情比较分化，对于信用资质很好的品种，受益于资金面的稳定偏松以及优质资产相对稀缺的逻辑，整体收益率呈现下行趋势，组合在二季度加配了相关资产，规避了信用资质有瑕疵的资产，为组合贡献了稳定的收益率。

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 3.72%，同期业绩基准增长率为 0.65%，本基金 C 类份额净值增长率为 1.16%，同期业绩基准增长率为 0.10%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

虽然中国经济在二季度呈现小幅边际走弱的态势，但我们认为不宜对这种趋势进行简单的线性外推。海外尤其是欧美市场的复苏方兴未艾，整体库存偏低，出口景气即使不能继续冲高，也还有望高位维持。与此同时，国内投资、消费事实上尚未完全恢复，政策使用也是非常克制，存在发力和改善的空间。鉴于以上判断，我们认为下半年政策环境相比于上半年有一定收紧的风险，尤其是美债实际利率的回升可能改变全球资产定价的水位，高估值资产将面临压力。具体到 A 股市场，我们认为今年整体涨盈利、杀估值，震荡市、结构市的格局不变。核心矛盾在于成长风格相对于价值风格、部分行业相对于全市场、龙头公司相对于行业其他公司的估值溢价在历史最高位附近，隐含的中长期预期较为充分，在宏观环境出现边际变化时，难免出现大幅波动。债券方面，三季度的资金面预期分歧较大，同时由于三季度地方债供给会上升，因此债券市场的不确定因素在增多。又因为长期

来看，优质资产的稀缺仍然是主要矛盾，所以对债券市场并不悲观。整体上看，组合仍然以高信用资质的品种配置为主。

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，本基金托管人在对招商安盈债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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，招商安盈债券型证券投资基金的管理人——招商基金管理有限公司在招商安盈债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对招商基金管理有限公司编制和披露的招商安盈债券型证券投资基金 2021 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、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：招商安盈债券型证券投资基金

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	3,234,569.29	43,580,554.15
结算备付金		23,532,500.28	7,632,096.57

存出保证金		273,963.85	60,010.64
交易性金融资产	6.4.7.2	2,817,999,940.44	1,112,871,387.06
其中：股票投资		464,839,786.10	181,132,403.73
基金投资		-	-
债券投资		2,353,160,154.34	931,738,983.33
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		6,575,786.27	69,877,792.04
应收利息	6.4.7.5	37,692,513.85	11,673,155.40
应收股利		-	-
应收申购款		72,862.76	249,062.04
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,889,382,136.74	1,245,944,057.90
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		478,900,000.00	192,000,000.00
应付证券清算款		904,755.93	103,432,475.86
应付赎回款		962,001.12	1,627,501.12
应付管理人报酬		1,371,398.38	533,367.45
应付托管费		391,828.10	152,390.71
应付销售服务费		7.76	-
应付交易费用	6.4.7.7	3,085,300.19	263,424.45
应交税费		1,767,596.93	1,694,502.66
应付利息		186,596.51	-4,152.78
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-

其他负债	6.4.7.8	89,887.12	170,762.84
负债合计		487,659,372.04	299,870,272.31
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	1,406,492,648.14	574,602,296.30
未分配利润	6.4.7.10	995,230,116.56	371,471,489.29
所有者权益合计		2,401,722,764.70	946,073,785.59
负债和所有者权益总计		2,889,382,136.74	1,245,944,057.90

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，招商安盈债券 A 份额净值 1.2614 元，基金份额总额 1,903,985,302.22 份；招商安盈债券 C 份额净值 1.2614 元，基金份额总额 97,638.75 份；总份额合计 1,904,082,940.97 份。

6.2 利润表

会计主体：招商安盈债券型证券投资基金

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		99,326,103.13	6,427,964.68
1.利息收入		28,062,954.70	4,803,553.07
其中：存款利息收入	6.4.7.11	142,222.41	47,590.62
债券利息收入		27,796,644.45	4,753,161.94
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		124,087.84	2,800.51
其他利息收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		19,284,227.73	13,032,564.85
其中：股票投资收益	6.4.7.12	1,465,835.38	4,702,622.59
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	14,505,025.85	6,906,679.80

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	3,313,366.50	1,423,262.46
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	51,892,016.53	-11,449,402.11
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	86,904.17	41,248.87
减：二、费用		18,574,723.53	2,999,867.08
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	7,207,263.45	1,448,140.15
2.托管费	6.4.10.2.2	2,059,218.05	413,754.33
3.销售服务费	6.4.10.2.3	7.76	-
4.交易费用	6.4.7.20	6,047,240.75	418,537.40
5.利息支出		3,066,990.61	594,251.80
其中：卖出回购金融资产支出		3,066,990.61	594,251.80
6.税金及附加		75,704.26	13,400.61
7.其他费用	6.4.7.21	118,298.65	111,782.79
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		80,751,379.60	3,428,097.60
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		80,751,379.60	3,428,097.60

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：招商安盈债券型证券投资基金

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）	574,602,296.30	371,471,489.29	946,073,785.59
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	80,751,379.60	80,751,379.60
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）	831,890,351.84	543,007,247.67	1,374,897,599.51
其中：1.基金申购款	1,058,402,817.73	695,858,029.67	1,754,260,847.40
2.基金赎回款	-226,512,465.89	-152,850,782.00	-379,363,247.89
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）	1,406,492,648.14	995,230,116.56	2,401,722,764.70
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）	139,010,320.00	84,517,423.57	223,527,743.57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,428,097.60	3,428,097.60
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）	219,363,261.75	142,416,638.16	361,779,899.91
其中：1.基金申购款	320,647,827.46	206,993,779.67	527,641,607.13
2.基金赎回款	-101,284,565.71	-64,577,141.51	-165,861,707.22
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）	358,373,581.75	230,362,159.33	588,735,741.08

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

招商安盈债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)系由招商安盈保本混合型证券投资基金转型而来。根据原《招商安盈保本混合型证券投资基金基金合同》的约定，2018 年 9 月 21 日，本基金第二个保本周期到期后，未能符合保本基金存续条件，自 2018 年 9 月 22 日起本基金转型为招商安盈债券型证券投资基金，同时，基金的投资目标、投资范围、投资策略以及基金费率等相关内容根据《招商安盈保本混合型证券投资基金基金合同》的相关约定作相应修改。自 2018 年 9 月 22 日起，原基金合同失效，《招商安盈债券型证券投资基金合同》于同一日生效。本基金为契约型开放式基金，存续期不定。本基金的基金管理人为招商基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称“中国工商银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《招商安盈债券型证券投资基金基金合同》及截至报告期末最新公告的《招商安盈债券型证券投资基金招募说明书》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债券（包括可转换债券及可分离转债、国债、央行票据、公司债、企业债、短期融资券、政府机构债、政策性金融机构金融债、商业银行金融债、资产支持证券等)、股票、权证、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金可参与一级市场新股申购或增发新股，也可在二级市场上投资股票、权证等权益类证券。如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金对固定收益类证券的投资比例不低于基金资产的 80%，股票、权证等权益类资产的投资比例不高于基金资产的 20%，基金保留不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中债综合全价（总值）指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度和中期报告>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

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

本基金在本报告期内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

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85 号文《财政部、国家税务总局、证监会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《财政部、国家税务总局、证监会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[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》、上证交字[2008]16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《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[2008]1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号文《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 号文《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》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a)对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(b)自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税(以下称营改增)试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

2018 年 1 月 1 日(含)以后，资管产品管理人(以下称管理人)运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以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。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日以前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(c)基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d)对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入个人所得税应纳税所得额。

(e)基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(f)对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(g)对基金在 2018 年 1 月 1 日(含)以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

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	3,234,569.29
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	3,234,569.29

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		444,074,855.65	464,839,786.10	20,764,930.45
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	1,017,956,696.65	1,023,760,154.34	5,803,457.69
	银行间市场	1,321,670,722.75	1,329,400,000.00	7,729,277.25
	合计	2,339,627,419.40	2,353,160,154.34	13,532,734.94
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		2,783,702,275.05	2,817,999,940.44	34,297,665.39

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	1,931.60
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	9,579.66
应收债券利息	37,680,891.62

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	110.97
合计	37,692,513.85

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	3,080,386.78
银行间市场应付交易费用	4,913.41
合计	3,085,300.19

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	626.97
应付证券出借违约金	-
预提费用	89,260.15
合计	89,887.12

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

招商安盈债券 A		
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	777,898,017.51	574,602,296.30
本期申购	1,432,741,220.03	1,058,305,178.98
本期赎回（以“-”号填列）	-306,653,935.32	-226,512,465.89
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	1,903,985,302.22	1,406,395,009.39

招商安盈债券 C		
项目	本期 2021 年 5 月 18 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	-	-

本期申购	97,638.75	97,638.75
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	97,638.75	97,638.75

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

招商安盈债券 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	400,991,296.46	-29,519,807.17	371,471,489.29
本期利润	28,859,216.46	51,891,106.63	80,750,323.09
本期基金份额交易产生的变动数	579,974,643.09	-36,991,857.80	542,982,785.29
其中：基金申购款	739,805,271.76	-43,971,704.47	695,833,567.29
基金赎回款	-159,830,628.67	6,979,846.67	-152,850,782.00
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,009,825,156.01	-14,620,558.34	995,204,597.67

招商安盈债券 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	146.61	909.90	1,056.51
本期基金份额交易产生的变动数	26,123.78	-1,661.40	24,462.38
其中：基金申购款	26,123.78	-1,661.40	24,462.38
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	26,270.39	-751.50	25,518.89

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	60,413.90
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	80,707.82
其他	1,100.69
合计	142,222.41

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	1,465,835.38
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	1,465,835.38

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	1,906,461,855.10
减：卖出股票成本总额	1,904,996,019.72
买卖股票差价收入	1,465,835.38

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	14,505,025.85
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	14,505,025.85

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	535,358,587.37
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	514,980,319.34
减：应收利息总额	5,873,242.18

买卖债券差价收入	14,505,025.85

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	3,313,366.50
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	3,313,366.50

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	51,892,016.53
——股票投资	33,411,715.24
——债券投资	18,480,301.29
——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	51,892,016.53

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	86,904.17
合计	86,904.17

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	6,037,728.25
银行间市场交易费用	9,512.50
合计	6,047,240.75

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	10,738.50
其他	18,300.00
合计	118,298.65

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

2021 年 7 月 27 日，本基金管理人发布《招商安盈债券型证券投资基金 2021 年度第一次分红公告》，收益分配基准日为 2021 年 7 月 22 日，权益登记日为 2021 年 7 月 29 日、除息日为 2021 年 7 月 29 日，现金红利发放日为 2021 年 7 月 30 日，收益分配方案为招商安盈债券 C 份额基金每 10 份基金份额派发红利人民币 0.573 元，招商安盈债券 A 份额基金每 10 份基金份额派发红利人民币 0.573 元。

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
中国工商银行股份有限公司	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	159,678,248.32	3.94%	56,808,851.50	18.98%

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	254,503,612.13	27.13%	96,938,498.05	26.33%

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 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	1,032,200,000.00	11.85%	451,000,000.00	27.96%

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	148,710.85	3.95%	49,050.29	1.59%
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	47,682.16	17.43%	45,017.29	30.54%

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	7,207,263.45	1,448,140.15
其中：支付销售机构的客户维护费	455,213.26	463,740.21

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×0.70%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×0.70%÷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	2,059,218.05	413,754.33

注：支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值×0.20%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×0.20%÷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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	招商安盈债券 A	招商安盈债券 C	合计
招商基金管理有限公司	-	7.76	7.76
合计	-	7.76	7.76
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	招商安盈债券 A	招商安盈债券 C	合计
招商基金管理有限公司	-	-	-
合计	-	-	-

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.20%，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

C 类日基金销售服务费=前一日 C 类基金资产净值×0.20%÷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	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	招商安盈债券 A	招商安盈债券 C

基金合同生效日（2018 年 9 月 22 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	18,578,860.44	-
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	18,578,860.44	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.98%	-

项目	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	招商安盈债券 A	招商安盈债券 C
基金合同生效日（2018 年 9 月 22 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
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	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

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
中国工商银行	3,234,569.29	60,413.90	15,572,253.28	36,009.33

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商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

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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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	100.00	100.00	6,830	682,991.02	682,991.02	-

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

截至本报告期末2021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 478,900,000.00 元，在 2021 年 7 月 1 日、2021 年 7 月 2 日、2021 年 7 月 5 日、2021 年 7 月 6 日、2021 年 7 月 7 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、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列示了于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，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	2,002,873,935.85	743,302,306.12
AAA 以下	160,803,554.79	105,087,345.61
未评级	-	-
合计	2,163,677,490.64	848,389,651.73

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

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金流动性风险来源于开放式基金每日兑付赎回资金的流动性风险，以及因部分投资品种交易不活跃而出现的变现风险以及因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理价格变现投资的风险。本基金所持有的交易性金融资产分别在证券交易所和银行间同业市场交易，除附注 6.4.12 所披露的流通受限不能自由转让的基金资产外，本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。除卖出回购金融资产款外，本基金所持有的全部金融负债无固定到期日或合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人在基金合同约定巨额赎回条款，设计了非常情况下赎回资金的处理模式，控制因开放模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。日常流动性风险管理中，本基金的基金管理人每日监控和预测本基金的流动性指标，通过对投资品种的流动性指标来持续地评估、选择、跟踪和控制基金投资的流动性风险。同时，本基金通过预留一定的现金头寸，并且在需要时可通过卖出回购金融资产方式融入短期资金，以缓解流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的利率敏感性资产主要是银行存款、债券投资；持有的利率敏感性负债主要是卖出回购金融资产款。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 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	3,234,569.29	-	-	-	3,234,569.29
结算备付金	23,532,500.28	-	-	-	23,532,500.28
存出保证金	273,963.85	-	-	-	273,963.85
交易性金融资产	390,548,250.70	1,852,305,032.61	110,306,871.03	464,839,786.10	2,817,999,940.44
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	37,692,513.85	37,692,513.85
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	72,862.76	72,862.76
应收证券清算款	-	-	-	6,575,786.27	6,575,786.27
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	417,589,284.12	1,852,305,032.61	110,306,871.03	509,180,948.98	2,889,382,136.74
负债					
应付赎回款	-	-	-	962,001.12	962,001.12
应付管理人报酬	-	-	-	1,371,398.38	1,371,398.38
应付托管费	-	-	-	391,828.10	391,828.10
应付证券清算款	-	-	-	904,755.93	904,755.93
卖出回购金融资产款	478,900,000.00	-	-	-	478,900,000.00
应付销售服务费	-	-	-	7.76	7.76
应付交易费用	-	-	-	3,085,300.19	3,085,300.19
应付利息	-	-	-	186,596.51	186,596.51
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	1,767,596.93	1,767,596.93
其他负债	-	-	-	89,887.12	89,887.12

负债总计	478,900,000.00	-	-	8,759,372.04	487,659,372.04
利率敏感度缺口	-61,310,715.88	1,852,305,032.61	110,306,871.03	500,421,576.94	2,401,722,764.70
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	43,580,554.15	-	-	-	43,580,554.15
结算备付金	7,632,096.57	-	-	-	7,632,096.57
存出保证金	60,010.64	-	-	-	60,010.64
交易性金融资产	178,781,447.00	669,049,899.05	83,907,637.28	181,132,403.73	1,112,871,387.06
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	11,673,155.40	11,673,155.40
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	249,062.04	249,062.04
应收证券清算款	-	-	-	69,877,792.04	69,877,792.04
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	230,054,108.36	669,049,899.05	83,907,637.28	262,932,413.21	1,245,944,057.90
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,627,501.12	1,627,501.12
应付管理人报酬	-	-	-	533,367.45	533,367.45
应付托管费	-	-	-	152,390.71	152,390.71
应付证券清算款	-	-	-	103,432,475.86	103,432,475.86
卖出回购金融资产款	192,000,000.00	-	-	-	192,000,000.00
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	263,424.45	263,424.45
应付利息	-	-	-	-4,152.78	-4,152.78
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	1,694,502.66	1,694,502.66
其他负债	-	-	-	170,762.84	170,762.84
负债总计	192,000,000.00	-	-	107,870,272.31	299,870,272.31
利率敏感度缺口	38,054,108.36	669,049,899.05	83,907,637.28	155,062,140.90	946,073,785.59

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	-56,658,734.16	-19,785,469.01

	2. 市场利率平行下降 50 个基点	58,841,139.82	20,531,235.49

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 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	464,839,786.10	19.35	181,132,403.73	19.15
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	464,839,786.10	19.35	181,132,403.73	19.15

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%	23,241,989.31	9,056,620.19
	2. 权益性投资的市场价格下降 5%	-23,241,989.31	-9,056,620.19

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	464,839,786.10	16.09
	其中：股票	464,839,786.10	16.09
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,353,160,154.34	81.44
	其中：债券	2,353,160,154.34	81.44
	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	26,767,069.57	0.93
8	其他资产	44,615,126.73	1.54
9	合计	2,889,382,136.74	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	-	-
B	采矿业	46,747,415.80	1.95
C	制造业	258,741,958.46	10.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	86,815,146.72	3.61
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	4,046,395.00	0.17
G	交通运输、仓储和邮政业	28,619,629.92	1.19
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	20,073,694.00	0.84
J	金融业	8,977,288.00	0.37
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	6,392,540.00	0.27
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	4,425,718.20	0.18
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	464,839,786.10	19.35

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	600795	国电电力	14,743,100	35,825,733.00	1.49
2	000960	锡业股份	1,928,696	30,916,996.88	1.29
3	600699	均胜电子	886,400	22,620,928.00	0.94
4	002048	宁波华翔	802,984	15,658,188.00	0.65
5	601139	深圳燃气	2,299,800	15,086,688.00	0.63
6	601000	唐山港	5,517,100	13,296,211.00	0.55
7	002128	露天煤业	1,206,000	12,554,460.00	0.52
8	600362	江西铜业	529,110	11,841,481.80	0.49
9	600025	华能水电	2,043,000	11,828,970.00	0.49
10	000983	山西焦煤	1,312,380	10,905,877.80	0.45
11	600143	金发科技	504,400	10,521,784.00	0.44
12	002422	科伦药业	514,042	10,255,137.90	0.43
13	603160	汇顶科技	73,927	9,583,157.01	0.40
14	000050	深天马Ａ	645,000	9,146,100.00	0.38
15	300033	同花顺	79,600	8,977,288.00	0.37
16	000429	粤高速Ａ	1,236,635	8,866,672.95	0.37
17	002262	恩华药业	577,300	8,861,555.00	0.37
18	601001	晋控煤业	1,200,500	8,715,630.00	0.36
19	601088	中国神华	434,900	8,489,248.00	0.35
20	300206	理邦仪器	519,500	8,260,050.00	0.34
21	601012	隆基股份	90,540	8,043,573.60	0.33
22	688599	天合光能	268,600	7,614,810.00	0.32
23	600741	华域汽车	267,900	7,037,733.00	0.29
24	000999	华润三九	257,273	6,882,052.75	0.29
25	600742	一汽富维	674,000	6,868,060.00	0.29
26	000598	兴蓉环境	1,283,500	6,687,035.00	0.28
27	300676	华大基因	53,900	6,392,540.00	0.27

28	002236	大华股份	295,300	6,230,830.00	0.26
29	002155	湖南黄金	784,800	6,082,200.00	0.25
30	002938	鹏鼎控股	168,917	6,060,741.96	0.25
31	603886	元祖股份	345,500	6,022,065.00	0.25
32	688016	心脉医疗	13,200	6,000,852.00	0.25
33	002230	科大讯飞	84,900	5,737,542.00	0.24
34	300274	阳光电源	49,200	5,660,952.00	0.24
35	300685	艾德生物	52,450	5,458,996.00	0.23
36	000938	紫光股份	249,300	5,454,684.00	0.23
37	688777	中控技术	57,100	5,375,965.00	0.22
38	300119	瑞普生物	156,358	5,288,027.56	0.22
39	600329	中新药业	182,200	5,117,998.00	0.21
40	600597	光明乳业	354,600	5,109,786.00	0.21
41	002008	大族激光	123,200	4,976,048.00	0.21
42	600674	川投能源	366,900	4,523,877.00	0.19
43	002583	海能达	886,100	4,465,944.00	0.19
44	300244	迪安诊断	115,554	4,425,718.20	0.18
45	603689	皖天然气	457,800	4,394,880.00	0.18
46	300454	深信服	16,800	4,359,264.00	0.18
47	300658	延江股份	387,750	4,335,045.00	0.18
48	600461	洪城环境	594,022	4,312,599.72	0.18
49	600886	国投电力	432,400	4,155,364.00	0.17
50	601607	上海医药	191,500	4,046,395.00	0.17
51	600196	复星医药	51,600	3,721,908.00	0.15
52	688561	奇安信	36,800	3,397,008.00	0.14
53	600298	安琪酵母	56,700	3,083,346.00	0.13
54	300558	贝达药业	21,500	2,327,160.00	0.10
55	600521	华海药业	106,200	2,217,456.00	0.09
56	600377	宁沪高速	225,400	2,199,904.00	0.09
57	600897	厦门空港	129,461	2,151,641.82	0.09
58	600004	白云机场	188,300	2,105,194.00	0.09
59	300124	汇川技术	26,400	1,960,464.00	0.08
60	002439	启明星辰	41,500	1,203,915.00	0.05
61	600887	伊利股份	30,900	1,138,047.00	0.05
62	600350	山东高速	1	6.15	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	600795	国电电力	85,436,855.15	9.03

2	000960	锡业股份	59,995,778.84	6.34
3	601688	华泰证券	52,887,681.00	5.59
4	601668	中国建筑	49,554,522.20	5.24
5	601139	深圳燃气	46,467,309.68	4.91
6	600585	海螺水泥	45,401,055.71	4.80
7	601088	中国神华	42,606,589.00	4.50
8	000598	兴蓉环境	42,441,814.94	4.49
9	600461	洪城环境	41,423,806.64	4.38
10	000999	华润三九	39,489,466.92	4.17
11	600699	均胜电子	38,913,967.07	4.11
12	600362	江西铜业	36,019,503.30	3.81
13	600741	华域汽车	32,314,099.34	3.42
14	000429	粤高速 A	30,312,872.71	3.20
15	600383	金地集团	29,419,675.26	3.11
16	603730	岱美股份	29,124,247.81	3.08
17	002422	科伦药业	28,902,923.95	3.06
18	002048	宁波华翔	28,416,044.00	3.00
19	002236	大华股份	28,327,444.10	2.99
20	600028	中国石化	28,148,097.80	2.98
21	002966	苏州银行	27,557,417.79	2.91
22	601601	中国太保	27,337,940.38	2.89
23	603368	柳药股份	26,490,588.81	2.80
24	002439	启明星辰	26,429,639.00	2.79
25	600027	华电国际	26,133,812.00	2.76
26	601012	隆基股份	25,965,173.54	2.74
27	000656	金科股份	25,361,524.84	2.68
28	000977	浪潮信息	25,156,547.97	2.66
29	603639	海利尔	24,676,413.70	2.61
30	603995	甬金股份	23,518,592.00	2.49
31	002697	红旗连锁	21,703,770.00	2.29
32	002230	科大讯飞	21,323,001.85	2.25
33	600887	伊利股份	21,180,147.50	2.24
34	601939	建设银行	21,166,579.00	2.24
35	002396	星网锐捷	20,725,323.11	2.19
36	002384	东山精密	20,397,693.24	2.16
37	300737	科顺股份	20,122,410.89	2.13
38	603160	汇顶科技	19,607,699.89	2.07
39	600048	保利地产	19,364,634.19	2.05
40	000933	神火股份	19,329,626.00	2.04

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	601668	中国建筑	59,118,282.00	6.25
2	601688	华泰证券	51,372,670.83	5.43
3	600795	国电电力	50,119,020.93	5.30
4	600585	海螺水泥	44,585,783.17	4.71
5	600461	洪城环境	36,223,317.66	3.83
6	000598	兴蓉环境	35,224,371.00	3.72
7	000429	粤高速Ａ	34,995,923.72	3.70
8	600383	金地集团	34,611,330.81	3.66
9	603368	柳药股份	34,522,960.25	3.65
10	600027	华电国际	34,425,256.99	3.64
11	601088	中国神华	33,644,512.00	3.56
12	000999	华润三九	32,839,524.12	3.47
13	600028	中国石化	32,516,648.00	3.44
14	000960	锡业股份	32,030,529.28	3.39
15	601139	深圳燃气	31,697,390.67	3.35
16	000977	浪潮信息	29,506,932.80	3.12
17	603730	岱美股份	27,034,135.17	2.86
18	601939	建设银行	26,983,032.00	2.85
19	002966	苏州银行	26,858,734.84	2.84
20	000933	神火股份	26,674,752.58	2.82
21	601601	中国太保	26,027,382.15	2.75
22	300737	科顺股份	25,944,469.00	2.74
23	002439	启明星辰	25,356,117.11	2.68
24	603639	海利尔	25,330,158.81	2.68
25	600741	华域汽车	25,076,863.20	2.65
26	600699	均胜电子	24,487,420.79	2.59
27	000656	金科股份	24,276,754.00	2.57
28	603995	甬金股份	23,335,236.00	2.47
29	601166	兴业银行	22,568,930.00	2.39
30	600362	江西铜业	22,274,075.05	2.35
31	002396	星网锐捷	22,165,332.15	2.34
32	002697	红旗连锁	21,490,519.00	2.27
33	002236	大华股份	21,432,607.72	2.27
34	603018	华设集团	21,082,069.20	2.23
35	002081	金 螳 螂	20,769,263.35	2.20

36	600887	伊利股份	20,054,696.00	2.12
37	601012	隆基股份	19,892,226.29	2.10
38	601111	中国国航	19,890,189.73	2.10
39	300451	创业慧康	19,735,592.72	2.09
40	002384	东山精密	19,205,228.00	2.03

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	2,155,291,686.85
卖出股票收入（成交）总额	1,906,461,855.10

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	103,898,142.80	4.33
2	央行票据	-	-
3	金融债券	472,033,520.90	19.65
	其中：政策性金融债	85,584,520.90	3.56
4	企业债券	404,294,000.00	16.83
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	881,699,000.00	36.71
7	可转债（可交换债）	491,235,490.64	20.45
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,353,160,154.34	97.98

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	102100078	21 邮政 MTN001	1,200,000	121,044,000.00	5.04
2	2028037	20 光大银行永续债	1,100,000	113,256,000.00	4.72
3	102001323	20 中电投 MTN011	1,000,000	101,020,000.00	4.21
4	2128017	21 中信银行永续债	900,000	90,648,000.00	3.77
5	2028048	20 中国银行永续债 02	800,000	82,256,000.00	3.42

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除 20 光大银行永续债（证券代码 2028037）、20 中国银行永续债 02（证券代码 2028048）、21 邮政 MTN001（证券代码 102100078）、21 中信银行永续债（证券代码 2128017）、光大转债（证券代码 113011）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、20 光大银行永续债（证券代码 2028037）

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、未依法履行职责等原因，多次受到监管机构的处罚。

2、20 中国银行永续债 02（证券代码 2028048）

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、违反反洗钱法等原因，多次受到监管机构的处罚。

3、21 邮政 MTN001（证券代码 102100078）

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。

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、未依法履行职责、违反反洗钱法等原因，多次受到监管机构的处罚。

5、光大转债（证券代码 113011）

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、未依法履行职责等原因，多次受到监管机构的处罚。

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

7.12.2

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	273,963.85
2	应收证券清算款	6,575,786.27
3	应收股利	-
4	应收利息	37,692,513.85
5	应收申购款	72,862.76
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	44,615,126.73

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	113011	光大转债	72,536,852.20	3.02
2	132015	18 中油 EB	55,720,115.00	2.32
3	132007	16 凤凰 EB	51,674,385.00	2.15
4	132008	17 山高 EB	50,094,148.40	2.09
5	132004	15 国盛 EB	33,824,472.00	1.41
6	132011	17 浙报 EB	30,708,780.00	1.28
7	110051	中天转债	17,911,183.40	0.75
8	128141	旺能转债	15,807,356.04	0.66
9	113599	嘉友转债	11,886,932.70	0.49
10	128138	侨银转债	11,613,250.00	0.48
11	113602	景 20 转债	10,265,291.10	0.43
12	123049	维尔转债	8,574,977.86	0.36
13	110053	苏银转债	8,534,035.20	0.36
14	127016	鲁泰转债	8,400,800.00	0.35
15	110033	国贸转债	8,158,403.60	0.34
16	132017	19 新钢 EB	7,144,178.00	0.30
17	128109	楚江转债	7,007,178.36	0.29
18	110077	洪城转债	5,643,709.20	0.23
19	123083	朗新转债	5,509,490.80	0.23
20	113550	常汽转债	5,369,258.70	0.22
21	110059	浦发转债	5,282,315.10	0.22
22	120002	18 中原 EB	4,942,704.25	0.21
23	110045	海澜转债	3,995,237.70	0.17
24	128105	长集转债	3,934,908.80	0.16
25	127018	本钢转债	3,603,980.88	0.15
26	128096	奥瑞转债	3,585,282.00	0.15
27	110072	广汇转债	3,416,942.50	0.14
28	128078	太极转债	2,718,774.00	0.11
29	127024	盈峰转债	2,631,659.22	0.11
30	113608	威派转债	2,238,044.90	0.09
31	128083	新北转债	1,666,646.80	0.07
32	123002	国祯转债	725,414.16	0.03
33	113530	大丰转债	452,961.60	0.02

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
招商安盈债券 A	5,649	337,048.20	1,753,997,332.51	92.12%	149,987,969.71	7.88%
招商安盈债券 C	5	19,527.75	-	-	97,638.75	100.00%
合计	5,654	336,767.41	1,753,997,332.51	92.12%	150,085,608.46	7.88%

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	招商安盈债券 A	2,970.00	0.0002%
	招商安盈债券 C	-	-
	合计	2,970.00	0.0002%

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	招商安盈债券 A	0
	招商安盈债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	招商安盈债券 A	0
	招商安盈债券 C	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	招商安盈债券 A	招商安盈债券 C
基金合同生效日(2018 年 9 月 22 日)基金份额总额	1,243,171,477.92	-
本报告期期初基金份额总额	777,898,017.51	-
本报告期基金总申购份额	1,432,741,220.03	97,638.75
减：报告期基金总赎回份额	306,653,935.32	-
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	1,903,985,302.22	97,638.75

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

根据本基金管理人 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。

中国工商银行股份有限公司根据工作需要，任命刘彤女士担任资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任资产托管部总经理职务。

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、托管人及其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	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
广发证券	2	922,607,516.29	22.75%	859,229.72	22.83%	-
华泰证券	2	533,287,404.64	13.15%	496,652.46	13.20%	-
万联证券	2	533,052,838.88	13.15%	496,439.46	13.19%	-
安信证券	1	516,663,129.81	12.74%	481,170.04	12.79%	-
中信建投证券	3	450,752,403.38	11.12%	419,788.30	11.15%	-
国海证券	1	284,850,313.12	7.02%	265,281.23	7.05%	-
招商证券	4	159,678,248.32	3.94%	148,710.85	3.95%	-
财信证券	1	130,707,738.07	3.22%	121,729.24	3.23%	-
东北证券	2	123,928,520.21	3.06%	115,414.47	3.07%	-
国盛证券	1	72,189,237.28	1.78%	67,229.06	1.79%	-
申万宏源	3	69,234,594.01	1.71%	64,479.21	1.71%	-
野村证券	1	65,690,699.70	1.62%	48,039.71	1.28%	-
中信证券	3	43,694,672.07	1.08%	40,693.00	1.08%	-
中金公司	1	42,854,887.72	1.06%	39,912.21	1.06%	-
华福证券	2	37,828,018.68	0.93%	35,229.35	0.94%	-
光大证券	1	35,956,550.06	0.89%	33,486.70	0.89%	-
东莞证券	1	13,763,603.72	0.34%	12,817.96	0.34%	-
东方证券	1	12,062,067.89	0.30%	11,233.32	0.30%	-
浙商证券	1	6,166,390.00	0.15%	5,742.71	0.15%	-
东海证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
华融证券	2	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-

民生证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	3	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
中金财富证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	3	-	-	-	-	-
中银国际证券	1	-	-	-	-	-
中邮证券	1	-	-	-	-	-

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
广发证券	57,154,670.89	6.09%	447,000,000.00	5.13%	-	-
华泰证券	40,580,691.56	4.33%	35,000,000.00	0.40%	-	-
万联证券	49,525,896.94	5.28%	953,100,000.00	10.94%	-	-
安信证券	29,055,212.79	3.10%	-	-	-	-
中信建投证券	12,129,603.20	1.29%	485,000,000.00	5.57%	-	-
国海证券	16,118,362.63	1.72%	54,000,000.00	0.62%	-	-
招商证券	254,503,612.13	27.13%	1,032,200,000.00	11.85%	-	-
财信证券	95,580,591.10	10.19%	822,900,000.00	9.44%	-	-
东北证券	166,425,398.31	17.74%	932,400,000.00	10.70%	-	-
国盛证券	36,629,906.50	3.90%	490,600,000.00	5.63%	-	-
申万宏源	31,495,729.70	3.36%	858,100,000.00	9.85%	-	-
野村证券	17,710,609.37	1.89%	-	-	-	-
中信证券	38,115,090.40	4.06%	218,000,000.00	2.50%	-	-
中金公司	9,028,342.50	0.96%	1,045,000,000.00	11.99%	-	-
华福证券	20,577,714.71	2.19%	1,089,000,000.00	12.50%	-	-
光大证券	24,248,947.45	2.58%	108,000,000.00	1.24%	-	-
东莞证券	25,391,298.81	2.71%	143,393,000.00	1.65%	-	-
东方证券	5,097,302.20	0.54%	-	-	-	-

浙商证券	6,772,064.71	0.72%	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	2,117,766.60	0.23%	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中金财富证券	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中银国际证券	-	-	-	-	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-

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	中国证券报、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	中国证券报及基金管理人网站	2021-01-21
3	招商安盈债券型证券投资基金2020年第4季度报告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-21
4	招商基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-06
5	招商基金管理有限公司旗下部分基金增加度小满为销售机构及开通定投和转换业务并参与其	中国证券报、基金管理人网站及中国证监	2021-03-26

	费率优惠活动的公告	会基金电子披露网站	
6	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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-29
7	招商安盈债券型证券投资基金 2020 年年度报告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-30
8	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	中国证券报及基金管理人网站	2021-03-30
9	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	中国证券报及基金管理人网站	2021-04-21
10	招商安盈债券型证券投资基金2021年第1季度报告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-04-21
11	招商基金管理有限公司关于提醒投资者持续完善身份信息资料的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-05-07
12	招商基金管理有限公司关于招商安盈债券型证券投资基金增加基金份额类别并修改基金合同和托管协议的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-05-11
13	招商安盈债券型证券投资基金基金合同（2021 年 5 月 13 日修订）	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-05-11
14	招商安盈债券型证券投资基金托管协议（2021 年 5 月 13 日修订）	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-05-11
15	招商安盈债券型证券投资基金更新的招募说明书（二零二一年第一号）	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-05-18
16	招商安盈债券型证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要更新	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-05-18
17	招商安盈债券型证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要更新	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-05-18
18	招商基金管理有限公司关于修订招商安盈债券型证券投资基金基金合同的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-05-26
19	招商安盈债券型证券投资基金托管协议（2021 年 5 月 26 日修订）	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-05-26
20	招商安盈债券型证券投资基金基金合同（2021 年 5 月 26 日修订）	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-05-26

21	招商安盈债券型证券投资基金更新的招募说明书（二零二一年第二号）	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-05-31
22	招商安盈债券型证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要更新	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-05-31
23	招商安盈债券型证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要更新	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-05-31
24	招商基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-06-05
25	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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-06-08

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20210114-20210630	-	896,522,741.73	-	896,522,741.73	47.08%
产品特有风险							
本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况，可能会出现集中赎回甚至巨额赎回从而引发基金净值剧烈波动，甚至引发基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。							

注：报告期末持有份额占比按照四舍五入方法保留至小数点后第 2 位。

§12 备查文件目录

12.1 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盈债券型证券投资基金设立的文件；

3、《招商安盈债券型证券投资基金基金合同》；

4、《招商安盈债券型证券投资基金托管协议》；

5、《招商安盈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。

12.2 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

12.3 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

2021 年 8 月 30 日