

# 招商安达灵活配置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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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.....	7
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	8
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.....	9
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.....	10
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.....	11
§5 托管人报告.....	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
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.....	15
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告.....	34
7.1 期末基金资产组合情况.....	34
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	35
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.....	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	37
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	39
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.....	39
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.....	40
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.....	40
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.....	40
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	40

7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	40
7.12	投资组合报告附注.....	40
§8	基金份额持有人信息.....	42
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	42
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	42
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.....	42
§9	开放式基金份额变动.....	42
§10	重大事件揭示.....	42
10.1	基金份额持有人大会决议.....	42
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.....	43
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	43
10.4	基金投资策略的改变.....	43
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	43
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.....	43
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	43
10.8	其他重大事件.....	44
§11	备查文件目录.....	45
11.1	备查文件目录.....	45
11.2	存放地点.....	46
11.3	查阅方式.....	46

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	招商安达灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	招商安达灵活配置混合
基金主代码	217020
交易代码	217020
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 10 月 10 日
基金管理人	招商基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	65,045,187.27 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过灵活动态的资产配置，在股市和债市之间选择投资机会，精选股票和债券品种，适当集中投资，致力于在多种市场环境下为投资者创造超额收益。
投资策略	<p>资产配置方法：在资产配置方法上，投资组合管理人在借鉴国际先进投资技术的基础上，结合国内实际情况和自身的投资管理经验，建立了自己的资产配置体系。招商基金的资产配置体系分为战略资产配置和战术资产配置。</p> <p>股票投资策略：本基金的股票投资采取自下而上的方法，以深入的基本面研究为基础，精选具有一定核心优势的且成长性良好、价值被低估的上市公司股票，构建投资组合，以寻求超越业绩基准的超额收益。</p> <p>货币市场工具投资：在本基金的货币市场工具投资过程中，将以严谨的市场价值分析为基础，采用稳健的投资组合策略，通过对短期金融工具的组合操作，在保持资产流动性的同时，追求稳定的投资收益。</p> <p>债券投资策略：根据国内外宏观经济形势、财政、货币政策、市场资金与债券供求状况、央行公开市场操作等方面情况，采用定性与定量相结合的方式，确定债券投资的组合久期，并根据通胀预期确定浮息债与固定收益债比例；在满足组合久期设置的基础上，投资团队分析债券收益率曲线变动、各期限品种收益率及收益率基差波动等因素，预测收益率曲线的变动趋势，并结合流动性偏好、信用分析等多种市场因素进行分析，综合评判个券的投资价值。在个券选择的基础上，投资团队构建模拟组合，并比较不同模拟组合之间的收益和风险匹配情况，确定风险、收益最佳匹配的组合。</p> <p>权证投资策略：本基金对权证资产的投资主要是通过分析影响权证内在价值最重要的两种因素——标的资产价格以及市场隐含波动率的变化，灵活构建避险策略，波动率差策略以及套利策略。</p> <p>存托凭证投资策略：在控制风险的前提下，本基金将根据本基金的投资</p>

	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*55%+标普中国全债指数收益率*45%
风险收益特征	本基金是混合型基金，属于基金中的中高风险品种。

## 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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	潘西里	秦一楠
	联系电话	0755-83196666	010-66060069
	电子邮箱	cmf@cmfchina.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-887-9555	95599
传真		0755-83196475	010-68121816
注册地址		深圳市福田区深南大道 7088 号	北京市东城区建国门内大街 69 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 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		518040	100031
法定代表人		王小青	谷澍

## 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	<a href="http://www.cmfchina.com">http://www.cmfchina.com</a>
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	28,605,203.51
本期利润	5,062,782.49
加权平均基金份额本期利润	0.0752
本期加权平均净值利润率	2.77%

本期基金份额净值增长率	3.15%
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	123,385,463.69
期末可供分配基金份额利润	1.8969
期末基金资产净值	192,821,539.55
期末基金份额净值	2.9644
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	142.59%

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。

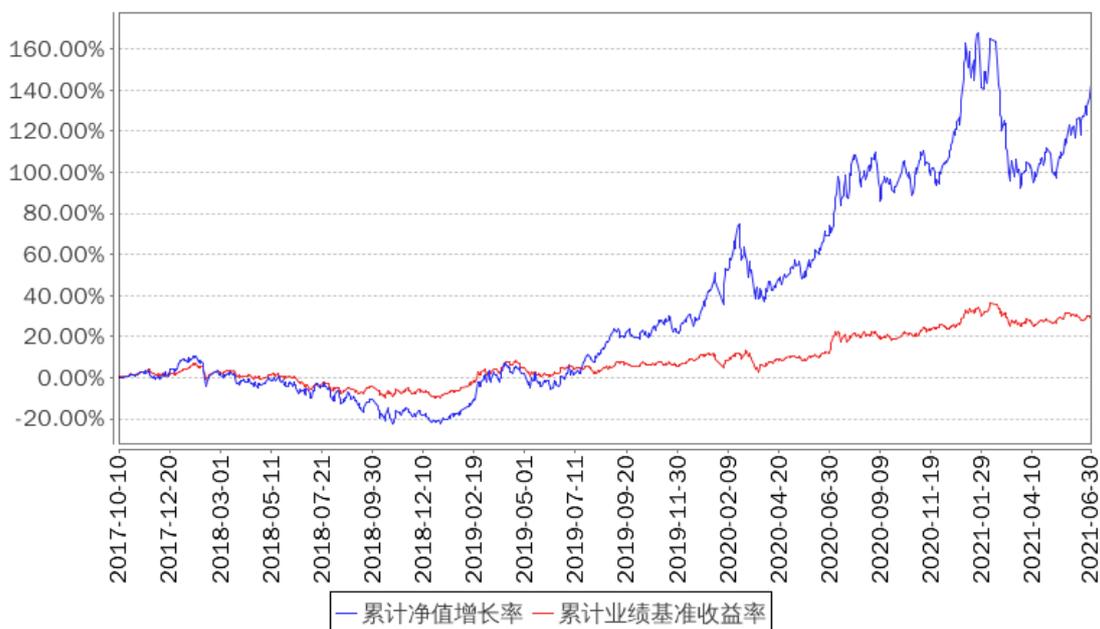
## 3.2 基金净值表现

### 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	8.63%	1.72%	-1.03%	0.45%	9.66%	1.27%
过去三个月	20.88%	1.60%	2.61%	0.54%	18.27%	1.06%
过去六个月	3.15%	2.18%	1.35%	0.72%	1.80%	1.46%
过去一年	39.23%	1.97%	15.33%	0.73%	23.90%	1.24%
过去三年	157.42%	1.78%	34.89%	0.75%	122.53%	1.03%
自基金合同生效起至今	142.59%	1.66%	30.05%	0.72%	112.54%	0.94%

### 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

招商安达灵活配置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		
王奇玮	本基金基金经理	2017年11月30日	-	9	男，硕士。2011 年加入长江证券股份有限公司研究部，曾任分析师、高级分析师、资深分析师，食品饮料小组组长；2014 年 12 月加入招商基金管理有限公司，曾任研究部高级研究员，招商安泰偏股混合型证券投资基金基金经理，现

					任招商安达灵活配置混合型证券投资基金、招商丰盛稳定增长灵活配置混合型证券投资基金、招商商业模式优选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合规守信情况的说明

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

2021 年上半年，国内经济延续后疫情时代恢复改善的趋势，但基数和节奏原因导致环比动能有所减弱。特别体现在结构上依然不够均衡，尤其是制造业和消费尚不及疫情前水平。前者由于去年有逆周期调节政策托底，而今年地方债发放较慢，导致以工程机械为代表的制造业 PMI 尽管在整个上半年均处于荣枯线以上的扩张区间，但数值从 2 季度以来有所回落。后者以餐饮连锁为代表，由于国内疫情零星反复导致外出就餐和超市购物或仅为疫情前 8~9 成。流动性方面，央行在今年 1 月一度将短端流动性收归正常，市场对此预期不足，曾在 1 月底出现极短时间内资金利率大幅波动情况；不过在此之后，以 DR007 为代表的短端流动性总体保持平稳，且波动率较小，体现了央行在经济结构不均衡状态下的呵护心态。海外方面，年初疫苗陆续接种叠加通胀预期上行一度催生美债 10 年期收益率飙升，但变异毒株导致接种效果大打折扣，或间接导致美联储政策退出的时间点比预期延后。

市场回顾：

上半年股票市场一波三折，年初白马股先上后下，整体回调较多，与此同时，低估值个股在春节后迎来估值修复的行情，而 4 月起，连续 3 个月成长股显著跑赢价值。截止上半年末，上证综指上涨 3.40%，创业板上涨 17.22%。

上半年债券市场整体收益率先上后下，1 月底 2 月初受资金利率上行、经济复苏、美债收益率上行的影响，利率有一波上行，但 3 月开始受流动性充裕的影响，利率债和信用债都出现了买盘旺盛的情形，仅在 6 月流动性小幅收紧的过程中有调整。

基金操作回顾：

本基金的主要配置资产为股票和可转债。2021 年上半年，我们严格遵照基金合同的相关约定，按照既定的投资流程进行了规范运作。目前在中性仓位配置了一些业绩高增长的成长股，主要分布在半导体、电动车、白酒和医药等行业。转债方面，继续持有弹性转债。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金份额净值增长率为 3.15%，同期业绩基准增长率为 1.35%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2021 年下半年，我们认为经济仍将环比继续恢复，上半年发放较慢的专项债或刺激基建投资有所改善，而低成本的信贷资金支持下企业的资本支出也会呈现加速。消费的复苏则需要更长的时间，下半年或很难看到明显的回升；地产在三条红线的压力下或难有表现。需要重视的是价格因素的扰动，我们认为下半年上游原材料居高不下的局面或有所缓解，从而给中游更多的利润回补空间。最大的不确定性还是来源于外需，出口对于经济的拉动取决于海外复苏的情况及疫情的反复。政策方面，国内外疫情反复或导致政策退出的节奏和方式比之前市场的预期更为缓和，即流动性环境或对资本市场趋向于友好，7 月初的降准给市场带来很多遐想空间。往前看，经济结构分化依然是比总量更为重要的核心问题，预计之后会逐步好转。

#### 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，由其按约定提供在银行间同业市场和交易所市场交易的债券品种的估值数据。

#### 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—招商基金管理有限公司 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，招商基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，招商基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## § 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：招商安达灵活配置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	2,910,726.92	2,668,217.66
结算备付金		1,814,547.87	1,710,959.03
存出保证金		77,888.57	66,514.65
交易性金融资产	6.4.7.2	202,684,420.15	213,490,515.32
其中：股票投资		155,801,012.36	158,550,914.78
基金投资		-	-
债券投资		46,883,407.79	54,939,600.54
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		198,164.50	-
应收利息	6.4.7.5	312,888.86	196,001.74
应收股利		-	-
应收申购款		146,713.38	111,712.60
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		208,145,350.25	218,243,921.00
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		14,141,000.00	17,329,000.00
应付证券清算款		-	1,384,928.75
应付赎回款		644,029.33	343,907.69

应付管理人报酬		223,029.77	235,399.83
应付托管费		37,171.63	39,233.28
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	186,461.66	197,761.28
应交税费		6,978.35	7,173.48
应付利息		-	-6,104.80
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	85,139.96	170,683.28
负债合计		15,323,810.70	19,701,982.79
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	50,132,767.19	53,245,593.69
未分配利润	6.4.7.10	142,688,772.36	145,296,344.52
所有者权益合计		192,821,539.55	198,541,938.21
负债和所有者权益总计		208,145,350.25	218,243,921.00

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.9644 元，基金份额总额 65,045,187.27 份。

## 6.2 利润表

会计主体：招商安达灵活配置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		7,791,006.22	52,803,808.90
1. 利息收入		244,731.14	241,532.22
其中：存款利息收入	6.4.7.11	31,372.37	30,669.28
债券利息收入		213,358.77	210,862.94
资产支持证券利息 收入		-	-
买入返售金融资产 收入		-	-

其他利息收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		30,946,837.25	39,668,324.59
其中：股票投资收益	6.4.7.12	26,172,056.34	35,667,338.26
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	4,556,014.97	3,599,872.58
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	218,765.94	401,113.75
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-23,542,421.02	12,575,554.17
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	141,858.85	318,397.92
减：二、费用		2,728,223.73	3,048,810.03
1. 管理人报酬	6.4.10.2 .1	1,371,222.80	1,331,234.94
2. 托管费	6.4.10.2 .2	228,537.16	221,872.44
3. 销售服务费	6.4.10.2 .3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.20	854,247.33	1,292,523.08
5. 利息支出		167,345.99	94,837.20
其中：卖出回购金融资产 支出		167,345.99	94,837.20
6. 税金及附加		95.86	233.82
7. 其他费用	6.4.7.21	106,774.59	108,108.55
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		5,062,782.49	49,754,998.87

减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		5,062,782.49	49,754,998.87

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：招商安达灵活配置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）	53,245,593.69	145,296,344.52	198,541,938.21
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	5,062,782.49	5,062,782.49
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）	-3,112,826.50	-7,670,354.65	-10,783,181.15
其中：1. 基金申购款	11,580,689.90	32,261,259.22	43,841,949.12
2. 基金赎回款	-14,693,516.40	-39,931,613.87	-54,625,130.27
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）	50,132,767.19	142,688,772.36	192,821,539.55
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）	76,561,026.24	80,661,771.48	157,222,797.72
二、本期经营活动产	-	49,754,998.87	49,754,998.87

生的基金净值变动数 (本期利润)			
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)	-8,788,041.48	-10,969,826.72	-19,757,868.20
其中: 1. 基金申购款	30,732,337.94	43,996,591.22	74,728,929.16
2. 基金赎回款	-39,520,379.42	-54,966,417.94	-94,486,797.36
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)	67,772,984.76	119,446,943.63	187,219,928.39

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

招商安达灵活配置混合型证券投资基金(原名招商安达保本混合型证券投资基金,以下简称“本基金”)系由基金管理人招商基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《招商安达保本混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“原基金合同”)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[2011]966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。本基金首次设立募集基金份额为1,032,286,589.43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(11)第0066号验资报告。原基金合同于2011年9月1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,基金托管人为中国农业银行股份有限公司(以下简称“中国农业银行”)。招商安达保本混合型证券投资基金根据2014年10月9日《招商基金管理有限公司关于招商安达保本混合型证券投资基金转入下一保本期过渡期折算结果及进入下一保本期的公告》,招商安达保本混合型证券投资基金在第一个保本期到期日和第二个保本期开始之间设置过渡期,过渡期最后一个工作日(2014年9月29日)收

市后进行基金份额折算，折算后基金份额净值调整为 1.000 元，依据合同规定的折算规则确定的折算比例为 1:1.297878557。

依据招商安达保本混合型证券投资基金基金管理人于 2017 年 9 月 20 日发布的《招商安达保本混合型证券投资基金保本期到期安排及转型为招商安达灵活配置混合型证券投资基金的第一次提示性公告》，自 2017 年 10 月 10 日起，“招商安达保本混合型证券投资基金”将更名为“招商安达灵活配置混合型证券投资基金”，《招商安达灵活配置混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“新基金合同”)及托管协议亦于该日同时生效。根据《中华人民共和国证券投资基金法》、新基金合同及截至报告期末最新公告的招募说明书的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票和存托凭证(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票和存托凭证)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券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，但需符合中国证监会的相关规定。本基金投资于股票、存托凭证的比例为基金资产的 30%-80%；债券、货币市场工具等固定收益类资产占基金资产的 20%-70%，其中，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沪深 300 指数收益率×55%+标普中国全债指数收益率×45%。

#### 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	2,910,726.92

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	2,910,726.92

#### 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	113,094,139.01	155,801,012.36	42,706,873.35
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	46,883,407.79	4,134,954.46
	银行间市场	-	-
	合计	46,883,407.79	4,134,954.46
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	155,842,592.34	202,684,420.15	46,841,827.81

#### 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	651.46
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	734.85
应收债券利息	311,470.96
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	31.59
合计	312,888.86

#### 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	186,461.66
银行间市场应付交易费用	-
合计	186,461.66

#### 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	837.40
应付证券出借违约金	-
预提费用	84,302.56
合计	85,139.96

#### 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	69,084,130.24	53,245,593.69
本期申购	15,025,307.31	11,580,689.90
本期赎回（以“-”号填列）	-19,064,250.28	-14,693,516.40
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	65,045,187.27	50,132,767.19

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	102,422,286.28	42,874,058.24	145,296,344.52
本期利润	28,605,203.51	-23,542,421.02	5,062,782.49
本期基金份额交易产生的变动数	-7,642,026.10	-28,328.55	-7,670,354.65

其中：基金申购款	24,900,518.24	7,360,740.98	32,261,259.22
基金赎回款	-32,542,544.34	-7,389,069.53	-39,931,613.87
本期已分配利润	-	-	-
本期末	123,385,463.69	19,303,308.67	142,688,772.36

#### 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	15,303.42
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	15,528.06
其他	540.89
合计	31,372.37

#### 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	26,172,056.34
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	26,172,056.34

##### 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	283,041,844.53
减：卖出股票成本总额	256,869,788.19
买卖股票差价收入	26,172,056.34

##### 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	4,556,014.97
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	4,556,014.97

**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	121,676,838.62
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	116,944,206.12
减：应收利息总额	176,617.53
买卖债券差价收入	4,556,014.97

**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	218,765.94
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	218,765.94

**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	-23,542,421.02
——股票投资	-20,311,951.73
——债券投资	-3,230,469.29
——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	-23,542,421.02

**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	141,858.85
合计	141,858.85

**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	854,247.33
银行间市场交易费用	-

合计	854,247.33
----	------------

#### 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	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	3,872.03
其他	18,600.00
合计	106,774.59

#### 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
中国农业银行股份有限公司	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

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券交易。

###### 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

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

### 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	1,371,222.80	1,331,234.94
其中：支付销售机构的客户维护费	636,611.89	644,431.00

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	228,537.16	221,872.44

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

本报告期内及上年度可比期间基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

##### 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
中国农业银行	2,910,726.92	15,303.42	3,908,592.82	17,212.27

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业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	300991	创益通	网下申购	2,535	33,107.10

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	217	5,338.20	35,371.00	-
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	-
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	-
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	883	4,362.02	11,523.15	-
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	557	6,984.78	15,534.73	-
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	2021年	新股锁	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-

		6月9日	12月17日	定						
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6月28日	2021年7月7日	新股锁定	8.29	8.29	7,029	58,270.41	58,270.41	-
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	-
688314	康拓医疗	2021年5月11日	2021年11月18日	新股锁定	17.34	74.48	1,085	18,813.90	80,810.80	-
688607	康众医疗	2021年1月25日	2021年8月2日	新股锁定	23.21	44.50	1,890	43,866.90	84,105.00	-
688613	奥精医疗	2021年5月13日	2021年11月22日	新股锁定	16.43	63.50	2,617	42,997.31	166,179.50	-

688619	罗普特	2021 年 2 月 8 日	2021 年 8 月 23 日	新股锁 定	19.31	26.74	3,967	76,602.77	106,077.58	-
688669	聚石化学	2021 年 1 月 15 日	2021 年 7 月 26 日	新股锁 定	36.65	32.39	2,183	80,006.95	70,707.37	-
688686	奥普特	2020 年 12 月 24 日	2021 年 7 月 1 日	新股锁 定	78.49	451.00	815	63,969.35	367,565.00	-

## 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
127038	国微转债	2021 年 6 月 10 日	2021 年 7 月 14 日	新债未 上市	100.0 0	100.00	660	65,999.71	65,999.71	-

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 14,141,000.00 元，在 2021 年 7 月 1 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、债券投资等。与这些金融工具有关的风险，以及本基金的基金管理人管理这些风险所采取的风险管理政策如下所述。

## 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金的银行存款存放于本基金的基金托管人，定期存款分别存放于信用良好的股份制商业银行，与银行存款相关的信用风险不重大。

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，并由交易对手向中央国债登记结算公司提交充足的债券进行质押，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及资产支持证券投资的信用评级，该信用评级不包括本基金所持有的国债、央行票据、政策性金融债。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

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	7,493,618.00	15,248,015.40
AAA 以下	27,995,411.59	29,524,890.34

未评级	-	-
合计	35,489,029.59	44,772,905.74

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，有效保障基金份额持有人利益。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。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	2,910,726.92	-	-	-	2,910,726.92
结算备付金	1,814,547.87	-	-	-	1,814,547.87
存出保证金	77,888.57	-	-	-	77,888.57
交易性金融资产	11,372,109.80	14,500,588.00	21,010,709.99	155,801,012.36	202,684,420.15
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	312,888.86	312,888.86
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	146,713.38	146,713.38
应收证券清算款	-	-	-	198,164.50	198,164.50
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	16,175,273.16	14,500,588.00	21,010,709.99	156,458,779.10	208,145,350.25
负债					
应付赎回款	-	-	-	644,029.33	644,029.33
应付管理人报酬	-	-	-	223,029.77	223,029.77
应付托管费	-	-	-	37,171.63	37,171.63
应付证券清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	14,141,000.00	-	-	-	14,141,000.00
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	186,461.66	186,461.66
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	6,978.35	6,978.35
其他负债	-	-	-	85,139.96	85,139.96
负债总计	14,141,000.00	-	-	1,182,810.70	15,323,810.70
利率敏感度缺口	2,034,273.16	14,500,588.00	21,010,709.99	155,275,968.40	192,821,539.55
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	2,668,217.66	-	-	-	2,668,217.66
结算备付金	1,710,959.03	-	-	-	1,710,959.03
存出保证金	66,514.65	-	-	-	66,514.65
交易性金融资产	10,166,694.80	4,030,682.70	40,742,223.04	158,550,914.78	213,490,515.32
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	196,001.74	196,001.74
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	111,712.60	111,712.60

应收证券清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	14,612,386.14	4,030,682.70	40,742,223.04	158,858,629.12	218,243,921.00
负债					
应付赎回款	-	-	-	343,907.69	343,907.69
应付管理人报酬	-	-	-	235,399.83	235,399.83
应付托管费	-	-	-	39,233.28	39,233.28
应付证券清算款	-	-	-	1,384,928.75	1,384,928.75
卖出回购金融资产款	17,329,000.00	-	-	-	17,329,000.00
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	197,761.28	197,761.28
应付利息	-	-	-	-6,104.80	-6,104.80
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	7,173.48	7,173.48
其他负债	-	-	-	170,683.28	170,683.28
负债总计	17,329,000.00	-	-	2,372,982.79	19,701,982.79
利率敏感度缺口	-2,716,613.86	4,030,682.70	40,742,223.04	156,485,646.33	198,541,938.21

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	-977,529.15	-1,322,164.52
2. 市场利率平行下降 50 个基点	1,011,098.23	1,369,222.48	

#### 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	155,801,012.36	80.80	158,550,914.78	79.86
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	155,801,012.36	80.80	158,550,914.78	79.86

#### 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%	7,790,050.62	7,927,545.74
	2. 权益性投资的市场价格下降 5%	-7,790,050.62	-7,927,545.74

#### 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	155,801,012.36	74.85
	其中：股票	155,801,012.36	74.85
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	46,883,407.79	22.52
	其中：债券	46,883,407.79	22.52

	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	4,725,274.79	2.27
8	其他资产	735,655.31	0.35
9	合计	208,145,350.25	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	-	-
C	制造业	133,695,216.22	69.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.01
E	建筑业	11,014.44	0.01
F	批发和零售业	251,115.78	0.13
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,658,879.41	6.57
J	金融业	34,721.10	0.02
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	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	13,285.02	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	9,123,760.00	4.73
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	155,801,012.36	80.80

### 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	300750	宁德时代	36,400	19,466,720.00	10.10
2	002812	恩捷股份	49,078	11,489,159.80	5.96
3	300450	先导智能	191,040	11,489,145.60	5.96
4	600809	山西汾酒	25,300	11,334,400.00	5.88
5	000799	酒鬼酒	38,300	9,789,480.00	5.08
6	002371	北方华创	33,634	9,329,398.92	4.84
7	300347	泰格医药	47,200	9,123,760.00	4.73
8	300760	迈瑞医疗	18,395	8,830,519.75	4.58
9	603501	韦尔股份	27,300	8,790,600.00	4.56
10	002709	天赐材料	81,897	8,728,582.26	4.53
11	300496	中科创达	45,500	7,146,230.00	3.71
12	300014	亿纬锂能	68,400	7,108,812.00	3.69
13	002920	德赛西威	60,200	6,626,816.00	3.44
14	002791	坚朗五金	29,800	5,782,690.00	3.00
15	688188	柏楚电子	12,349	5,384,164.00	2.79
16	002402	和而泰	201,100	4,820,367.00	2.50
17	600779	水井坊	37,400	4,725,490.00	2.45
18	002049	紫光国微	26,700	4,116,873.00	2.14
19	688686	奥普特	815	367,565.00	0.19
20	301015	百洋医药	4,614	251,115.78	0.13
21	688613	奥精医疗	2,617	166,179.50	0.09
22	301016	雷尔伟	2,747	115,711.58	0.06
23	688619	罗普特	3,967	106,077.58	0.06
24	688607	康众医疗	1,890	84,105.00	0.04
25	688314	康拓医疗	1,085	80,810.80	0.04
26	688678	福立旺	3,156	74,797.20	0.04
27	688669	聚石化学	2,183	70,707.37	0.04
28	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.03
29	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.02
30	300919	中伟股份	217	35,371.00	0.02
31	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.02
32	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.01
33	001207	联科科技	682	22,581.02	0.01
34	301009	可靠股份	557	15,534.73	0.01
35	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.01
36	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.01
37	603171	税友股份	637	12,230.40	0.01
38	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.01
39	300997	欢乐家	883	11,523.15	0.01

40	300918	南山智尚	1,063	11,065.83	0.01
41	605287	德才股份	349	11,014.44	0.01
42	300996	普联软件	241	10,177.43	0.01
43	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
44	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
45	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
46	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
47	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
48	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
49	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
50	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
51	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
52	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
53	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	600426	华鲁恒升	12,219,591.53	6.15
2	300450	先导智能	10,935,172.75	5.51
3	600809	山西汾酒	10,615,552.00	5.35
4	600346	恒力石化	10,014,078.12	5.04
5	002352	顺丰控股	9,715,837.44	4.89
6	600660	福耀玻璃	9,370,467.00	4.72
7	300122	智飞生物	9,200,789.00	4.63
8	603005	晶方科技	8,645,815.29	4.35
9	000301	东方盛虹	8,163,495.00	4.11
10	002709	天赐材料	8,001,438.90	4.03
11	000799	酒鬼酒	7,837,791.00	3.95
12	300347	泰格医药	7,335,022.00	3.69
13	300014	亿纬锂能	6,925,112.00	3.49
14	000858	五粮液	6,497,453.00	3.27
15	688388	嘉元科技	6,400,371.69	3.22
16	002371	北方华创	6,253,770.20	3.15
17	300496	中科创达	5,820,725.00	2.93
18	002812	恩捷股份	5,760,925.36	2.90
19	600176	中国巨石	5,749,209.00	2.90
20	601330	绿色动力	5,693,851.00	2.87
21	002920	德赛西威	5,526,458.00	2.78
22	600183	生益科技	4,802,789.00	2.42

23	600779	水井坊	4,716,825.00	2.38
24	002791	坚朗五金	4,703,021.00	2.37
25	601689	拓普集团	4,638,212.00	2.34
26	603338	浙江鼎力	4,462,015.00	2.25
27	600845	宝信软件	4,286,239.97	2.16
28	002402	和而泰	4,242,837.38	2.14
29	300408	三环集团	4,240,602.00	2.14
30	603337	杰克股份	4,158,186.78	2.09
31	300782	卓胜微	4,141,526.00	2.09
32	600323	瀚蓝环境	4,098,374.00	2.06
33	601799	星宇股份	4,007,641.00	2.02
34	002833	弘亚数控	3,972,737.00	2.00

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	600809	山西汾酒	13,928,995.00	7.02
2	601100	恒立液压	13,125,258.70	6.61
3	002475	立讯精密	12,497,431.70	6.29
4	688388	嘉元科技	12,447,856.76	6.27
5	603638	艾迪精密	11,191,024.25	5.64
6	688111	金山办公	10,771,818.57	5.43
7	600893	航发动力	9,588,583.57	4.83
8	600426	华鲁恒升	9,527,808.00	4.80
9	002352	顺丰控股	8,912,789.00	4.49
10	688036	传音控股	8,898,405.58	4.48
11	600276	恒瑞医药	8,547,804.00	4.31
12	300122	智飞生物	8,536,910.00	4.30
13	002304	洋河股份	8,487,675.00	4.28
14	600346	恒力石化	8,129,625.00	4.09
15	603005	晶方科技	7,659,600.06	3.86
16	600660	福耀玻璃	7,271,309.00	3.66
17	000858	五粮液	6,913,400.00	3.48
18	000301	东方盛虹	6,214,946.00	3.13
19	300866	安克创新	5,784,378.30	2.91
20	603187	海容冷链	5,578,237.00	2.81
21	601330	绿色动力	5,552,524.26	2.80

22	688396	华润微	5,551,331.95	2.80
23	600176	中国巨石	4,793,788.00	2.41
24	600183	生益科技	4,789,277.00	2.41
25	603338	浙江鼎力	4,196,956.63	2.11
26	600845	宝信软件	4,165,109.70	2.10
27	300782	卓胜微	4,073,030.50	2.05
28	600323	瀚蓝环境	4,063,020.53	2.05

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	274,431,837.50
卖出股票收入（成交）总额	283,041,844.53

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	4,837,168.00	2.51
2	央行票据	-	-
3	金融债券	6,557,210.20	3.40
	其中：政策性金融债	6,557,210.20	3.40
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）	35,489,029.59	18.41
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	46,883,407.79	24.31

### 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	128095	恩捷转债	29,320	10,573,378.40	5.48
2	123111	东财转 3	45,158	6,609,324.88	3.43
3	113611	福 20 转债	35,370	6,086,823.30	3.16
4	128134	鸿路转债	34,510	4,659,885.30	2.42
5	110053	苏银转债	32,360	3,927,209.60	2.04

## 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 XD 韦尔股（证券代码 603501）、酒鬼酒（证券代码 000799）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、XD 韦尔股（证券代码 603501）

根据 2021 年 5 月 6 日发布的相关公告，该证券发行人因未及时披露公司重大事件被上海证监局给予警示。

#### 2、酒鬼酒（证券代码 000799）

根据 2021 年 4 月 6 日发布的相关公告，该证券发行人因未依法履行职责被国家税务总局湘西州税务局第二税务分局责令改正。

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	77,888.57
2	应收证券清算款	198,164.50
3	应收股利	-
4	应收利息	312,888.86
5	应收申购款	146,713.38
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	735,655.31

### 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	128095	恩捷转债	10,573,378.40	5.48
2	113611	福 20 转债	6,086,823.30	3.16
3	128134	鸿路转债	4,659,885.30	2.42
4	110053	苏银转债	3,927,209.60	2.04

### 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
5,354	12,148.90	-	-	65,045,187.27	100.00%

### 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	8,837.38	0.0136%

### 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(2017年10月10日)基金份额总额	602,042,667.94
本报告期期初基金份额总额	69,084,130.24
本报告期基金总申购份额	15,025,307.31
减：报告期基金总赎回份额	19,064,250.28
本报告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	65,045,187.27

## § 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。

2021 年 5 月，中国农业银行总行决定谭敦宇任托管业务部总裁。

## 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	
华泰证券	2	176,992,919.04	31.97%	164,834.23	32.62%	-
方正证券	1	144,113,925.91	26.03%	134,211.46	26.56%	-
山西证券	1	121,537,517.98	21.96%	113,188.14	22.40%	-
东方财富	1	51,214,506.41	9.25%	37,454.02	7.41%	-
天风证券	1	28,342,650.91	5.12%	26,395.37	5.22%	-
川财证券	2	18,101,438.75	3.27%	16,857.86	3.34%	-
海通证券	1	13,251,025.63	2.39%	12,340.96	2.44%	-

东方证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
中信建投 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
华泰证券	86,907,615.20	37.58%	550,364,000.00	37.18%	-	-
方正证券	44,061,310.30	19.05%	174,500,000.00	11.79%	-	-
山西证券	57,117,951.55	24.70%	316,822,000.00	21.40%	-	-
东方财富	14,313,737.20	6.19%	181,500,000.00	12.26%	-	-
天风证券	13,892,452.63	6.01%	113,715,000.00	7.68%	-	-
川财证券	14,767,291.76	6.39%	119,451,000.00	8.07%	-	-
海通证券	184,680.00	0.08%	24,100,000.00	1.63%	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
中信建投 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	招商安达灵活配置混合型证券投资基金 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
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	中国证券报及基金管理人网站	2021-01-21
4	招商基金管理有限公司关于旗下部分基金增加植信基金为销售机构的公告	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	2021-01-22
5	招商基金管理有限公司关于旗下部分基金增加	中国证券报、基金管	2021-01-27

	上海中欧财富为销售机构的公告	理人网站及中国证监会基金电子披露网站	
6	招商基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中正达广为销售机构的公告	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	2021-02-04
7	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
8	招商安达灵活配置混合型证券投资基金 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
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	中国证券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	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	2021-04-17
11	招商安达灵活配置混合型证券投资基金 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
12	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
13	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
14	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	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	2021-05-13
15	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
16	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 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会批准设立招商基金管理有限公司的文件；
- 2、中国证券监督管理委员会批准招商安达灵活配置混合型证券投资基金设立的文件；
- 3、《招商安达灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 4、《招商安达灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；

- 5、《招商安达灵活配置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