招商国证食品饮料行业交易型开放式指数证券投资基金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：申万宏源证券有限公司

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。

基金托管人申万宏源证券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25日（基金合同生效日）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遵规守信情况的说明.....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遵规守信情况声明.....11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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 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.....39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....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.....44
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.....44
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.....44
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.....45
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....45

7.12 投资组合报告附注.....45
§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 期末上市基金前十名持有人.....47
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....47
8.4 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.....47
§9 开放式基金份额变动.....47
§10 重大事件揭示.....48
10.1 基金份额持有人大会决议.....48
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.....48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....48
10.4 基金投资策略的改变.....48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....48
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.....48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....49
10.8 其他重大事件.....49
§11 备查文件目录.....51
11.1 备查文件目录.....51
11.2 存放地点.....52
11.3 查阅方式.....52

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	招商国证食品饮料行业交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	招商国证食品饮料ETF
场内简称	食品饮料
基金主代码	159843
交易代码	159843
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021年1月25日
基金管理人	招商基金管理有限公司
基金托管人	申万宏源证券有限公司
报告期末基金份额总额	248,955,141.00份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2021年2月5日

注：本基金自2021年8月23日起新增扩位证券简称，扩位证券简称为“食品饮料ETF”。

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.20%，年跟踪误差不超过2%。
投资策略	本基金采用完全复制标的指数的方法，进行被动式指数化投资。股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合复制标的指数，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。 本基金其他主要投资策略包括： 1、大类资产配置 2、股票投资策略 （1）股票投资组合构建；（2）股票投资组合的调整 3、债券投资策略 4、股指期货投资策略 5、国债期货投资策略 6、资产支持证券投资策略 7、参与融资及转融通证券出借业务策略
业绩比较基准	国证食品饮料行业指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险和收益高于债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

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	申万宏源证券有限公司
信息披露负责人	姓名	潘西里	刘尚文
	联系电话	0755－83196666	010-88085720
	电子邮箱	cmf@cmfchina.com	liushangwen@swhysc.com
客户服务电话		400-887-9555	010-88013540
传真		0755－83196475	010-88085221
注册地址		深圳市福田区深南大道 7088 号	上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层
办公地址		中国深圳深南大道 7088 号招商银行大厦	北京市西城区太平桥大街 19 号恒奥中心 B 座
邮政编码		518040	100033
法定代表人		王小青	杨玉成

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021 年 1 月 25 日 - 2021 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	12,850,770.92
本期利润	9,114,170.45
加权平均基金份额本期利润	0.0251
本期加权平均净值利润率	2.63%
本期基金份额净值增长率	-1.36%
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	-3,381,760.21
期末可供分配基金份额利润	-0.0136
期末基金资产净值	245,573,380.79
期末基金份额净值	0.9864

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	-1.36%

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、本基金合同于 2021 年 1 月 25 日生效，截至本报告期末成立未满半年。

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	-4.55%	1.40%	-6.24%	1.50%	1.69%	-0.10%
过去三个月	11.63%	1.61%	8.34%	1.66%	3.29%	-0.05%
自基金合同生效起至今	-1.36%	2.02%	-3.57%	2.14%	2.21%	-0.12%

3.2.2 自基金合同生效/自基金转型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

招商国证食品饮料ETF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

注：本基金合同于 2021 年 1 月 25 日生效，截至本报告期末基金成立未满一年；自基金成立日起 6 个月内为建仓期，截至报告期末基金尚未完成建仓。

§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		
刘重杰	本基金基金经理	2021 年 1 月 25 日	-	10	男，本科。曾任职于成都商报社、西南财经大学金融数据中心、南京大学金陵学院；2010 年 7 月加入华西期货有限责任公司，历任金融工程部高级研究员、部门负责人；2014 年 3 月加入西南证券股份有限公司，历任衍生品业务岗、平仓处置岗、策略研究岗、投资者教育及培训岗；2017 年 9 月加入招商基金管理有限公司，曾任深证电子信息传媒产业(TMT)50 交易型开放式指数证券投资基金、招商深证电子信息传媒产业(TMT)50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，现任招商深证 100 交易型开放式指数证券投资基金、招商中证红利交易型开放式指数证券投资基金、招商深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、招商中证浙江 100 交易型开放式指数证券投资基金、招商国证食品饮料行业交易型开放式指数证券投资基金、招商中证生物科技主题交易型

					开放式指数证券投资基金、招商中证畜牧养殖交易型开放式指数证券投资基金、招商中证云计算与大数据主题交易型开放式指数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，国内经济增长保持较强韧性，货币政策保持中性。报告期内A股表现分化相对较大，从行业来看，电气设备、电子、汽车、综合等行业板块涨幅相对较高，家用电器、农林牧渔、房地产、公用事业等行业板块跌幅较大。本基金跟踪的标的指数国证食品指数报告期内下跌1.69%。

关于本基金的运作，股票仓位维持在97%左右的水平，基本完成了对基准的跟踪。

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-1.36%，同期业绩基准增长率为-3.57%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

美国6月非农就业数据远超预期，6月季调后非农就业人口增85万，预期增70万，前值由增55.9万修正为增58.3万；失业率为5.9%，预期5.7%，前值5.8%；平均时薪环比上升0.3%，预期上升0.4%，劳动力市场的更快恢复有望缓解此前的紧张状况，失业率暂时性上升主要因为更多人处于重新回归寻找工作的过程中，预计后续仍将逐步下降；在财政刺激逐步落地、居民储蓄率仍较高的情况下，预计美国整体经济增速仍将较有韧性。欧元区方面,5月零售销售环比增4.6%，显著改善。这主要因为随着疫情的缓解和就业的修复，欧元区居民消费也随之修复；展望下半年，全球经济仍有较强的复苏动能。

报告期内,国内制造业PMI均处于荣枯线以上的扩张区间,数值从二季度以来见顶回落，但幅度不大。从需求结构上看，上半年的地产投资增长韧性依然亮眼，制造业投资在企业信心修复和政策鼓励帮扶的背景下进一步向上修复,基建投资虽然2年复合累计增速保持相对平稳，但相较经济总量依然偏弱。社会消费品零售总额所代表的消费也进一步向上修复，出口增速也整体保持强韧。当前经济仍处于较去年修复、短期出现弱势迹象的状态，与此同时结构依然不够均衡，制造业投资和消费还远不及疫情前水平。展望下半年，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。

报告期内，我国股票市场走势呈现宽幅震荡的态势。二季度的A股市场“休养生息”之下，成长与价值、周期与防御等不同风格之间的表现更加均衡。与今年一季度时周期行业独占鳌头所不同的是，海外经济复苏在二季度从预期变为现实，且中国的经济增速回归中长期

趋势也得到了基本面的确认。市场在修复了一季度的大起大落后表现平稳，期间各类新旧主题此起彼伏，各类题材和市场风格轮番表现，驱动市场风格在成长和价值间反复徘徊。展望下半年，考虑到国内外整体货币政策基调并未进一步收紧，且全球经济复苏前景良好，市场仍存在结构性的做多机会。需继续关注宏观经济深度复苏，景气度改善的低估值顺周期品种如银行和上游资源股的修复机会；对于新能源、白酒等近期涨幅较大的高景气行业，仍需对于估值和基本面景气度的匹配程度给予更高的筛选要求。

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，申万宏源证券有限公司（以下称“本托管人”）在对招商国证食品饮料行业交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务，不存在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。本报告期内，本基金未进行利润分配。

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”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：招商国证食品饮料行业交易型开放式指数证券投资基金

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
资产：		

银行存款	6.4.7.1	5,378,629.58
结算备付金		104,235.37
存出保证金		1,074,933.47
交易性金融资产	6.4.7.2	240,070,538.14
其中：股票投资		240,070,538.14
基金投资		-
债券投资		-
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		-
应收利息	6.4.7.5	1,368.83
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		246,629,705.39
负债和所有者权益	附注号	本期末2021年6月30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		859,216.57
应付赎回款		-
应付管理人报酬		103,689.15
应付托管费		20,737.80
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	46,265.64
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-

递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	26,415.44
负债合计		1,056,324.60
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	248,955,141.00
未分配利润	6.4.7.10	-3,381,760.21
所有者权益合计		245,573,380.79
负债和所有者权益总计		246,629,705.39

注：1.报告截止日2021年6月30日，基金份额净值0.9864元，基金份额总额248,955,141.00份；

2.本财务报表的实际编制期间为2021年1月25日(基金合同生效日)至2021年6月30日止期间。

6.2 利润表

会计主体：招商国证食品饮料行业交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021年1月25日(基金合同生效日)至2021年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2021年1月25日（基金合同生效日）至2021年6月30日
一、收入		11,006,183.11
1.利息收入		126,165.21
其中：存款利息收入	6.4.7.11	126,139.71
债券利息收入		25.50
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）		12,592,100.09
其中：股票投资收益	6.4.7.12	10,781,610.93

基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	24,278.58
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	1,786,210.58
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-3,736,600.47
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	2,024,518.28
减：二、费用		1,892,012.66
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	737,235.19
2.托管费	6.4.10.2.2	147,446.97
3.销售服务费	6.4.10.2.3	-
4.交易费用	6.4.7.20	980,515.03
5.利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6.税金及附加		0.03
7.其他费用	6.4.7.21	26,815.44
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		9,114,170.45
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		9,114,170.45

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：招商国证食品饮料行业交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021年1月25日(基金合同生效日)至2021年6月30日

单位：人民币元

项目	本期2021年1月25日（基金合同生效日）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）	701,955,141.00	-	701,955,141.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	9,114,170.45	9,114,170.45
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）	-453,000,000.00	-12,495,930.66	-465,495,930.66
其中：1.基金申购款	190,500,000.00	-12,735,803.17	177,764,196.83
2.基金赎回款	-643,500,000.00	239,872.51	-643,260,127.49
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）	248,955,141.00	-3,381,760.21	245,573,380.79

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

招商国证食品饮料行业交易型开放式指数证券投资基金(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》、《招商国证食品饮料行业交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规的规定，经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2020]3464号文准予公开募集注册。本基金为交易型开放式基金，存续期限为不定期。本基金根据认购方式的不同，将基金份额分为网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购。本基金首次设立募集基金份额为701,955,141.00份，经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证，并出具了编号为德师报(验)字(21)第00037号验资报告。《招商国证食品饮料行业交易型开放式指数证券投资基

金基金合同》(以下简称“基金合同”)于2021年1月25日正式生效。本基金的基金管理人为招商基金管理有限公司，基金托管人为申万宏源证券有限公司(以下简称“申万宏源证券”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及截至报告期末最新公告的《招商国证食品饮料行业交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股。为更好地实现基金的投资目标，本基金可能会少量投资于非成份股（包括国内依法发行上市的主板、中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券）、货币市场工具、同业存单、债券回购、资产支持证券、银行存款、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金可根据相关法律法规和基金合同的约定，参与融资业务和转融通证券出借业务。基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%，且不低于非现金基金资产的80%，每个交易日日终在扣除国债期货合约和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金投资于其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为：国证食品饮料行业指数收益率。

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25日(基金合同生效日)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

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为自2021年1月25日(基金合同生效日)至2021年6月30日止期间。

6.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1)金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和贷款及应收款项，暂无金融资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，其他以公允价值计量且其公允价值变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的各类应收款项、买入返售金融资产等在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产分类为贷款及应收款项。

2)金融负债的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

本基金目前持有的债券投资和资产支持证券分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。贷款及应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，贷款及应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止、该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移或虽然既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产的控制，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价(包括转出的非现金资产或承担的新金融负债)之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层次的输入值确定公允价值计量层次。第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

1)对于银行间市场交易的固定收益品种，以及交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)，按照第三方估值机构提供的估值确定公允价值。

2)对存在活跃市场的其他投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值；对于发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行时股票公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，按照监管机构或行业协会的有关规定确定公允价值。

3)对存在活跃市场的其他投资品种，如估值日无市价且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或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

4)当投资品种不再存在活跃市场，基金管理人估值委员会认为必要时，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

1)利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。资产支持证券利息收入在持有期内，按资产支持证券的票面价值和预计收益率计算的利息逐日确认资产支持证券利息收入。在收到资产支持证券支付的款项时，其中属于证券投资收益的部分冲减应计利息(若有)后的差额，确认资产支持证券利息收入。买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

2)投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认。

债券投资收益为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认。

资产支持证券投资收益为卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后净额确认。

3)公允价值变动收益公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产卖出或到期时转出计入投资收益。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬和基金托管费按基金合同及相关公告约定的费率和计算方法逐日计提。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的交易费用发生时按照确定的金额计入交易费用。

卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率逐日计提。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

1）每份基金份额享有同等分配权。

2)基金收益评价日核定的基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到1%以上时，基金管理人可以进行收益分配。

3）基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配。

4）基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补亏损为前提，收益分配后有可能使基金份额净值低于面值，即基金收益分配基准日（即收益评价日）的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后可能低于面值。

5）本基金收益分配采取现金方式。

6）法律法规、监管机构、登记机构、证券交易所另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 外币交易

本基金本报告期内无外币交易。

6.4.4.13 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策与计量基础一致。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

1)对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》(中基协发[2017]6 号)，在估值日按照该通知规定的流通受限股票公允价值计算模型进行估值。

2)对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，根据《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》(中国证监会公告[2017]13 号)及《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》(中基协发[2013]13 号)相关规定，本基金根据情况决定使用指数收益法、可比公司法、市场价格模型法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

3)根据《关于发布<中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准>的通知》(中基协发[2014]24 号)，在上海证券交易所、深圳证券

交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)，采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金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

本基金本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008年9月18日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、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]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》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，暂不计缴企业所得税。

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

(4)对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，对受让方不再缴纳印花税。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 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	5,378,629.58
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	5,378,629.58

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		243,807,138.61	240,070,538.14	-3,736,600.47
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		243,807,138.61	240,070,538.14	-3,736,600.47

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	880.43
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	53.07
应收债券利息	-
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	435.33
合计	1,368.83

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	46,265.64
银行间市场应付交易费用	-
合计	46,265.64

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	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	26,415.44
应退替代款	-
合计	26,415.44

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 25 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	701,955,141.00	701,955,141.00

本期申购	190,500,000.00	190,500,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-643,500,000.00	-643,500,000.00
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	248,955,141.00	248,955,141.00

注：1、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；

2、本基金自 2021 年 1 月 6 日至 2021 年 1 月 19 日止期间公开发售，有效净认购金额人民币 701,897,840.00 元，折算为 701,897,840.00 份基金份额。根据《招商国证食品饮料行业交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的规定，经本基金注册登记人计算并确认，本基金认购资金在募集期内产生的利息人民币 57,301.00 元，折算为 57,301.00 份基金份额，划入基金持有人账户，两者合计 701,955,141.00 份基金份额。

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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	12,850,770.92	-3,736,600.47	9,114,170.45
本期基金份额交易产生的变动数	-5,238,823.91	-7,257,106.75	-12,495,930.66
其中：基金申购款	3,101,127.96	-15,836,931.13	-12,735,803.17
基金赎回款	-8,339,951.87	8,579,824.38	239,872.51
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,611,947.01	-10,993,707.22	-3,381,760.21

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 25 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	104,051.55
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	9,491.58
其他	12,596.58
合计	126,139.71

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 25 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	7,032,876.11
股票投资收益——赎回差价收入	3,748,734.82

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	10,781,610.93

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 25 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	378,224,840.23
减：卖出股票成本总额	371,191,964.12
买卖股票差价收入	7,032,876.11

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 25 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	643,260,127.49
减：现金支付赎回款总额	359,137,604.49
减：赎回股票成本总额	280,373,788.18
赎回差价收入	3,748,734.82

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 25 日（基金合同生效日）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	24,278.58
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	24,278.58

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 25 日（基金合同生效日）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	257,304.30
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	232,996.94
减：应收利息总额	28.78
买卖债券差价收入	24,278.58

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 25 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日

股票投资产生的股利收益	1,786,210.58
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	1,786,210.58

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 25 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-3,736,600.47
——股票投资	-3,736,600.47
——债券投资	-
——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	-3,736,600.47

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 25 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	2,024,518.28
合计	2,024,518.28

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 25 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	980,515.03
银行间市场交易费用	-
合计	980,515.03

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 25 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	18,416.10

信息披露费	-
证券出借违约金	-
其他	8,399.34
合计	26,815.44

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
申万宏源证券有限公司	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 25 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
申万宏源	415,172,481.55	34.81%

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 25 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
申万宏源	206,908.00	80.41%

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内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 25 日（基金合同生效日）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
申万宏源	303,617.71	62.80%	11,245.73	24.31%

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 25 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	737,235.19
其中：支付销售机构的客户维护费	0.00

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×0.50%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：

日基金管理人报酬＝前一日基金资产净值×0.50%÷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 25 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	147,446.97

注：支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值×0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金托管费＝前一日基金资产净值×0.10%÷当年天数

6.4.10.3 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2021 年 6 月 30 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
申万宏源证券有限公司	5,109,618.00	2.05%
招商证券	15,892,215.00	6.38%

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 25 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
申万宏源证券有限公司	5,378,629.58	104,051.55

注：本基金的银行存款由基金托管人申万宏源证券有限公司保管，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 25 日（基金合同生效日）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	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

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	-
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	229	10,838.57	57,698.84	-
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	-
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	115.71	309	8,738.52	35,754.39	-
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	403	13,387.66	35,262.50	-
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	262	12,730.58	23,682.18	-
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	-
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 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	-
688117	圣诺生物	2021 年 5 月 26 日	2021 年 12 月 3 日	新股锁定	17.90	35.97	1,672	29,928.80	60,141.84	-
688161	威高骨科	2021 年 6 月 23 日	2021 年 12 月 30 日	新股锁定	36.22	82.27	1,731	62,696.82	142,409.37	-
688226	威腾电气	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 7 日	新股锁定	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
688316	青云科技	2021 年 3 月 5 日	2021 年 9 月 16 日	新股锁定	63.70	65.00	1,428	90,963.60	92,820.00	-
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	-
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	-
688625	呈和科技	2021 年 5 月 31 日	2021 年 12 月 7 日	新股锁定	16.48	42.63	2,672	44,034.56	113,907.36	-
688662	富信科技	2021 年 3 月 25 日	2021 年 10 月 8 日	新股锁定	15.61	29.51	2,556	39,899.16	75,427.56	-
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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

本基金是指数型基金，本基金的运作涉及的金融工具主要包括股票投资(主要是指数成份股、备选成份股)。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 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

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的债券投资。

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约约定到期日均为一个月以内且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息。

本基金申购赎回采用一篮子股票的形式，流动性风险相对较低。

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。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	5,378,629.58	-	-	-	5,378,629.58

结算备付金	104,235.37	-	-	-	104,235.37
存出保证金	1,074,933.47	-	-	-	1,074,933.47
交易性金融资产	-	-	-	240,070,538.14	240,070,538.14
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	1,368.83	1,368.83
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	6,557,798.42	-	-	240,071,906.97	246,629,705.39
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	103,689.15	103,689.15
应付托管费	-	-	-	20,737.80	20,737.80
应付证券清算款	-	-	-	859,216.57	859,216.57
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	46,265.64	46,265.64
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	26,415.44	26,415.44
负债总计	-	-	-	1,056,324.60	1,056,324.60
利率敏感度缺口	6,557,798.42	-	-	239,015,582.37	245,573,380.79

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

本基金本报告期末及上年度末无利率风险的敏感性分析。

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	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产-股票投资	240,070,538.14	97.76
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	240,070,538.14	97.76

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 ）
	1. 权益性投资的市场价格上升 5%	12,003,526.91
	2. 权益性投资的市场价格下降 5%	-12,003,526.91

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	240,070,538.14	97.34
	其中：股票	240,070,538.14	97.34
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	5,482,864.95	2.22
8	其他资产	1,076,302.30	0.44
9	合计	246,629,705.39	100.00

注：此处的股票投资项含可退替代款估值增值。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资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	237,592,440.91	96.75
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	446,648.00	0.18
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	-	-
J	金融业	-	-
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	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	238,039,088.91	96.93

7.2.2 期末积极投资按行业分类境内股票投资组合

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	5,850.78	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,541,514.81	0.63
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.01
E	建筑业	25,371.37	0.01
F	批发和零售业	257,526.54	0.10

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	123,297.64	0.05
J	金融业	34,721.10	0.01
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	30,146.60	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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,031,449.23	0.83

7.2.3 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

7.3.1 报告期末指数投资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	600519	贵州茅台	20,022	41,179,247.40	16.77
2	000858	五 粮 液	126,200	37,593,718.00	15.31
3	600887	伊利股份	602,130	22,176,447.90	9.03
4	000568	泸州老窖	82,500	19,465,050.00	7.93
5	603288	海天味业	119,295	15,383,090.25	6.26
6	600809	山西汾酒	27,000	12,096,000.00	4.93
7	002304	洋河股份	54,300	11,250,960.00	4.58
8	600132	重庆啤酒	32,500	6,433,375.00	2.62
9	000799	酒鬼酒	18,700	4,779,720.00	1.95
10	603369	今世缘	74,300	4,024,088.00	1.64
11	600600	青岛啤酒	34,000	3,932,100.00	1.60
12	600779	水井坊	28,100	3,550,435.00	1.45
13	600298	安琪酵母	62,800	3,415,064.00	1.39
14	000895	双汇发展	105,900	3,367,620.00	1.37
15	603517	绝味食品	32,024	2,699,302.96	1.10
16	300146	汤臣倍健	81,800	2,691,220.00	1.10

17	603345	安井食品	10,450	2,654,509.00	1.08
18	600702	舍得酒业	11,900	2,543,982.00	1.04
19	000860	顺鑫农业	60,100	2,535,018.00	1.03
20	002568	百润股份	26,620	2,523,309.80	1.03
21	002507	涪陵榨菜	60,550	2,280,313.00	0.93
22	000596	古井贡酒	9,400	2,251,300.00	0.92
23	603589	口子窖	32,000	2,166,080.00	0.88
24	600559	老白干酒	76,200	2,004,060.00	0.82
25	600872	中炬高新	45,582	1,915,355.64	0.78
26	300999	金龙鱼	20,100	1,707,696.00	0.70
27	603866	桃李面包	50,780	1,584,336.00	0.65
28	603198	迎驾贡酒	35,400	1,568,220.00	0.64
29	002557	洽洽食品	35,900	1,547,290.00	0.63
30	603027	千禾味业	58,500	1,537,965.00	0.63
31	600873	梅花生物	248,000	1,388,800.00	0.57
32	002597	金禾实业	40,000	1,388,000.00	0.57
33	603156	养元饮品	46,900	1,340,402.00	0.55
34	002626	金达威	28,600	1,278,420.00	0.52
35	600737	中粮糖业	126,900	1,270,269.00	0.52
36	600305	恒顺醋业	59,668	1,140,852.16	0.46
37	600597	光明乳业	71,500	1,030,315.00	0.42
38	002481	双塔食品	83,300	962,948.00	0.39
39	000729	燕京啤酒	132,100	956,404.00	0.39
40	002216	三全食品	37,040	610,048.80	0.25
41	002847	盐津铺子	5,400	538,488.00	0.22
42	300741	华宝股份	9,900	502,128.00	0.20
43	002461	珠江啤酒	45,700	499,958.00	0.20
44	603043	广州酒家	17,760	456,787.20	0.19
45	603317	天味食品	14,060	413,785.80	0.17
46	000869	张 裕Ａ	8,900	330,546.00	0.13
47	002946	新乳业	21,600	327,240.00	0.13
48	603919	金徽酒	7,300	300,176.00	0.12
49	603719	良品铺子	5,400	243,000.00	0.10
50	300783	三只松鼠	4,300	203,648.00	0.08

7.3.2 期末积极投资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	301015	百洋医药	4,614	251,115.78	0.10
2	688601	力芯微	1,174	216,133.40	0.09

3	688609	九联科技	10,372	158,587.88	0.06
4	688161	威高骨科	1,731	142,409.37	0.06
5	301016	雷尔伟	2,747	115,711.58	0.05
6	688625	呈和科技	2,672	113,907.36	0.05
7	688316	青云科技	1,428	92,820.00	0.04
8	688662	富信科技	2,556	75,427.56	0.03
9	688533	上声电子	3,493	66,751.23	0.03
10	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.03
11	688117	圣诺生物	1,672	60,141.84	0.02
12	300957	贝泰妮	229	57,698.84	0.02
13	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.02
14	688367	工大高科	1,717	37,035.69	0.02
15	300973	立高食品	309	35,754.39	0.01
16	300979	华利集团	403	35,262.50	0.01
17	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.01
18	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.01
19	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.01
20	300981	中红医疗	262	23,682.18	0.01
21	001207	联科科技	682	22,581.02	0.01
22	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.01
23	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.01
24	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.01
25	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.01
26	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.01
27	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
28	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
29	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
30	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
31	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
32	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
33	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
34	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
35	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
36	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
37	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
38	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
39	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
40	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
41	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
42	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
43	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
44	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
45	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00

46	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
47	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
48	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
49	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
50	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
51	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
52	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
53	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
54	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
55	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
56	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
57	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
58	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
59	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	占期末基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	134,276,127.57	54.68
2	000858	五 粮 液	101,907,357.42	41.50
3	600887	伊利股份	101,247,472.03	41.23
4	603288	海天味业	68,741,089.71	27.99
5	000568	泸州老窖	60,812,920.57	24.76
6	600809	山西汾酒	41,839,278.00	17.04
7	002304	洋河股份	37,468,489.08	15.26
8	603369	今世缘	16,336,556.39	6.65
9	000799	酒鬼酒	14,326,235.56	5.83
10	600872	中炬高新	14,281,105.61	5.82
11	000895	双汇发展	14,260,527.25	5.81
12	603345	安井食品	12,854,274.86	5.23
13	600600	青岛啤酒	11,080,630.00	4.51
14	600298	安琪酵母	10,578,191.00	4.31
15	000860	顺鑫农业	10,504,964.00	4.28
16	603589	口子窖	10,331,343.99	4.21
17	603517	绝味食品	10,122,696.71	4.12
18	600132	重庆啤酒	10,053,725.00	4.09
19	000596	古井贡酒	9,798,442.34	3.99
20	002568	百润股份	8,903,091.00	3.63
21	002507	涪陵榨菜	7,257,694.50	2.96
22	002557	洽洽食品	6,428,641.00	2.62

23	600559	老白干酒	6,345,778.00	2.58
24	603027	千禾味业	6,288,034.92	2.56
25	600779	水井坊	6,145,201.00	2.50
26	300146	汤臣倍健	5,782,145.00	2.35
27	600305	恒顺醋业	5,681,496.48	2.31
28	603156	养元饮品	5,433,373.00	2.21
29	600873	梅花生物	5,197,172.00	2.12

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	占期末基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	97,621,668.02	39.75
2	600887	伊利股份	70,699,663.00	28.79
3	603288	海天味业	47,561,307.97	19.37
4	600809	山西汾酒	33,994,628.22	13.84
5	603369	今世缘	12,052,398.45	4.91
6	603345	安井食品	10,749,325.62	4.38
7	600872	中炬高新	9,875,104.88	4.02
8	600600	青岛啤酒	8,005,772.14	3.26
9	603589	口子窖	7,994,785.00	3.26
10	603517	绝味食品	7,836,743.00	3.19
11	600298	安琪酵母	7,509,914.18	3.06
12	600132	重庆啤酒	6,105,089.00	2.49
13	603156	养元饮品	4,358,741.02	1.77
14	600559	老白干酒	4,205,314.00	1.71
15	600873	梅花生物	4,025,404.23	1.64
16	600779	水井坊	3,967,491.05	1.62
17	600305	恒顺醋业	3,962,558.36	1.61
18	603027	千禾味业	3,625,804.00	1.48
19	600597	光明乳业	3,061,226.00	1.25
20	600737	中粮糖业	2,939,981.00	1.20

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	819,698,979.91
卖出股票收入（成交）总额	378,224,840.23

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，有选择地投资于流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金在进行股指期货投资时，首先将基于对证券市场总体行情的判断

和组合风险收益的分析确定投资时机，并根据风险资产投资（或拟投资）的总体规模和风险系数决定股指期货的投资比例；其次，本基金将在综合考虑证券市场和期货市场运行趋势以及股指期货流动性、收益性、风险特征和估值水平的基础上进行投资品种选择，以对冲风险资产组合的系统性风险和流动性风险。

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

本基金参与国债期货投资是为了有效控制债券市场的系统性风险，本基金将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，适度运用国债期货提高投资组合运作效率。在国债期货投资过程中，基金管理人通过对宏观经济和利率市场走势的分析与判断，并充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置，谨慎进行投资，以调整债券组合的久期，降低投资组合的整体风险。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期未持有国债期货合约。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

报告期内基金投资的前十名证券除酒鬼酒（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。

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：本基金为指数型基金，因复制指数被动持有，上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

7.12.2

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

金额单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,074,933.47

2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,368.83
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,076,302.30

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688609	九联科技	158,587.88	0.06	新股锁定
2	688161	威高骨科	142,409.37	0.06	新股锁定
3	301015	百洋医药	17,939.46	0.01	新股锁定
4	301016	雷尔伟	9,069.50	0.00	新股锁定

§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
8,242	30,205.67	50,560,084.00	20.31%	198,395,057.00	79.69%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	招商证券股份有限公司	15,892,215.00	6.38%
2	东源(天津)股权投资基金管理股份有	13,044,000.00	5.24%

	限公司-东源投资中国成长价值套利增强型 1 号私募证券投资基金		
3	中信证券股份有限公司	5,541,492.00	2.23%
4	申万宏源证券有限公司	5,109,618.00	2.05%
5	王颖	4,588,000.00	1.84%
6	北京雪球永业投资管理中心(有限合伙)-北京雪球永业 1 号专项资产管理计划	4,197,000.00	1.69%
7	金鞍	3,938,005.00	1.58%
8	李广萍	3,500,000.00	1.41%
9	陈庆仪	1,994,290.00	0.80%
10	方正证券股份有限公司	1,924,192.00	0.77%

注：以上数据由中国证券登记结算公司提供，持有人为场内持有人。

8.3 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	-	-

8.4 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(2021 年 1 月 25 日)基金份额总额	701,955,141.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	190,500,000.00
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	643,500,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-
本报告期期末基金份额总额	248,955,141.00

§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。

2021年3月5日，本基金托管人申万宏源证券有限公司聘任王慧晶担任托管中心总经理，刘晔不再担任托管中心总经理。

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	
方正证券	2	777,596,281.64	65.19%	179,863.68	37.20%	-
申万宏源	2	415,172,481.55	34.81%	303,617.71	62.80%	-

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
方正证券	50,396.30	19.59%	-	-	-	-
申万宏源	206,908.00	80.41%	-	-	-	-

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	关于招商国证食品饮料行业交易型开放式指数证券投资基金增加网下现金、网下股票销售机构的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-06
2	招商国证食品饮料行业交易型开放式指数证券投资基金上网发售提示性公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-06
3	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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-13
4	招商国证食品饮料行业交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-26
5	招商国证食品饮料行业交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书提示性公告	上海证券报及基金管理人网站	2021-02-02
6	招商国证食品饮料行业交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-02-02
7	关于开放招商国证食品饮料行业交易型开放式指数证券投资基金日常申购赎回业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-02-02
8	招商基金管理有限公司关于招商国证食品饮料行业交易型开放式指数证券投资基金调整最小申购、赎回单位的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-02-05
9	关于招商国证食品饮料行业交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监	2021-02-05

		会基金电子披露网站	
10	招商国证食品饮料行业交易型开放式指数证券投资基金上市交易提示性公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-02-05
11	招商国证食品饮料行业交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-02-10
12	招商国证食品饮料行业交易型开放式指数证券投资基金更新的招募说明书（二零二一年第一号）	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-02-10
13	关于招商国证食品饮料行业交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-02-26
14	关于招商国证食品饮料行业交易型开放式指数证券投资基金增加中信建投证券股份有限公司为场内申购赎回代办券商的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-02
15	关于招商国证食品饮料行业交易型开放式指数证券投资基金增加招商证券股份有限公司为场内申购赎回代办券商的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-05
16	招商基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-06
17	关于招商国证食品饮料行业交易型开放式指数证券投资基金增加中国国际金融股份有限公司为场内申购赎回代办券商的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-18
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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-24
19	关于招商中证生物科技主题交易型开放式指数证券投资基金、招商国证食品饮料行业交易型开放式指数证券投资基金增加兴业证券股份有限公司为场内申购赎回代办券商的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-26
20	招商国证食品饮料行业交易型开放式指数证券投资基金基金合同（2021 年 3 月 31 日修订）	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-31
21	招商基金管理有限公司关于修订旗下部分公募基金基金合同的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-31
22	招商国证食品饮料行业交易型开放式指数证券投资基金更新的招募说明书（二零二一年第二号）	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-04-06
23	招商国证食品饮料行业交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-04-06

24	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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-04-17
25	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	上海证券报及基金管理人网站	2021-04-21
26	招商国证食品饮料行业交易型开放式指数证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-04-21
27	招商基金管理有限公司关于提醒投资者持续完善身份信息资料的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-05-07
28	关于招商基金管理有限公司旗下部分基金增加第一创业证券股份有限公司为场内申购赎回代办券商的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-05-10
29	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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-05-13
30	招商基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-06-05
31	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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-06-11

§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国证食品饮料行业交易型开放式指数证券投资基金设立的文件；

3、《招商国证食品饮料行业交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；

4、《招商国证食品饮料行业交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；

5、《招商国证食品饮料行业交易型开放式指数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.cmfchina.com

招商基金管理有限公司

2021 年 8 月 30 日