

招商瑞智优选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（原招商3年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF））2021年第3季度报告

2021年09月30日

基金管理人：招商基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2021年10月26日

§ 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 10 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

根据《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）基金合同》约定，本基金合同生效后的前三年为封闭运作期，封闭运作期届满后，本基金将转为上市开放式基金（LOF），基金名称将调整为“招商瑞智优选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）”。自 2021 年 8 月 3 日起，《招商瑞智优选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同》生效，原《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）基金合同》失效。

本报告中财务资料未经审计。

原招商 3 年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）报告期自 2021 年 7 月 1 日起至 2021 年 8 月 2 日止，招商瑞智优选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）报告期自 2021 年 8 月 3 日（基金合同生效日）起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况（转型后）

基金简称	招商瑞智优选混合（LOF）
场内简称	招商优选 LOF
基金主代码	161728
交易代码	161728
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 8 月 3 日
报告期末基金份额总额	2,368,828,305.31 份
投资目标	本基金通过将基金资产在不同投资资产类别之间灵活配置，在控制下行风险的前提下为投资人获取稳健回报。
投资策略	本基金的资产配置将根据宏观经济形势、金融要素运行情况、中国经济发展情况，在权益类资产、固定收益类

	资产和现金三大类资产类别间进行积极的配置,并根据风险的评估和建议适度调整资产配置比例。 其它投资策略包括:A股投资策略、港股投资策略、债券投资策略、国债期货投资策略、股指期货投资策略、资产支持证券投资策略、存托凭证投资策略。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*60%+恒生综合指数收益率(经汇率调整后)*20%+中债综合(全价)指数收益率*20%
风险收益特征	本基金是混合型基金,预期收益和预期风险高于货币市场基金和债券型基金。 本基金资产投资于港股通标的股票,会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险,包括港股市场股价波动较大的风险(港股市场实行T+0回转交易,且对个股不设涨跌幅限制,港股股价可能表现出比A股更为剧烈的股价波动)、汇率风险(汇率波动可能对基金的投资收益造成损失)、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险(在内地开市香港休市的情形下,港股通不能正常交易,港股不能及时卖出,可能带来一定的流动性风险)等。
基金管理人	招商基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

2.2 基金基本情况（转型前）

基金简称	招商3年封闭运作战略配售（LOF）
场内简称	招商配售
基金主代码	161728
交易代码	161728
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年7月5日
报告期末基金份额总额	2,909,244,683.59份
投资目标	在严格控制风险的前提下,追求超越业绩比较基准的投资回报,力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金主要投资通过战略配售取得的股票,本基金封闭运作期内,主要采用资产配置策略、战略配售策略和固定收益策略三种投资策略。 1、资产配置策略 本基金的资产配置将根据宏观经济形势、金融要素运行情况、中国经济发展情况,在权益类资产、固定收益类资产和现金三大类资产类别间进行相对灵活的配置,并根据风险的评估和建议适度调整资产配置比例。 2、战略配售策略 基于对宏观经济、资本市场的深入分析和理解,通过对战略配售股票的深入研究,精选具有估值优势和成长优势的战略配售股票进行投资,追求基金资产的长期稳定

	增值。 3、固定收益策略 本基金采用的固定收益策略包括债券投资策略、债券回购投资策略，其中债券投资策略包括：久期策略、期限结构策略和个券选择策略等。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*60%+中债总指数收益率*40%
风险收益特征	本基金是混合型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。本基金以投资战略配售股票为主要投资策略，需参与并接受发行人战略配售股票，由此产生的投资风险与价格波动由投资者自行承担。
基金管理人	招商基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标（转型后）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2021年8月3日—2021年9月30日）
1.本期已实现收益	11,939,938.32
2.本期利润	-25,415,636.12
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0100
4.期末基金资产净值	2,767,416,404.48
5.期末基金份额净值	1.1683

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认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、招商瑞智优选混合（LOF）合同于2021年8月3日生效，截至本报告期末基金成立未满一季度。

3.2 主要财务指标（转型前）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2021年7月1日—2021年8月2日）
1.本期已实现收益	63,356,720.73
2.本期利润	60,394,050.41
3.加权平均基金份额本期利润	0.0076
4.期末基金资产净值	3,432,487,440.40
5.期末基金份额净值	1.1799

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认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。

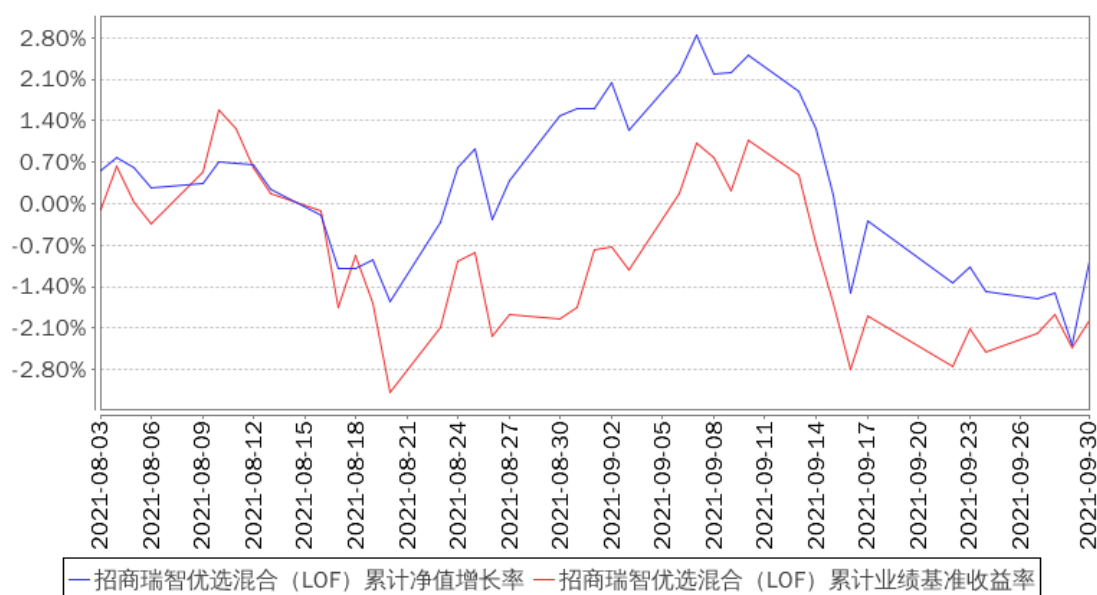
3.3 基金净值表现（转型后）

3.3.1 本报告期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
自成立至今	-0.98%	0.73%	-1.98%	0.81%	1.00%	-0.08%

3.3.2 自基金转型以来基金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

招商瑞智优选混合（LOF）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：招商瑞智优选混合（LOF）合同于2021年8月3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，截至报告期末基金建仓期尚未结束。

3.4 基金净值表现（转型前）

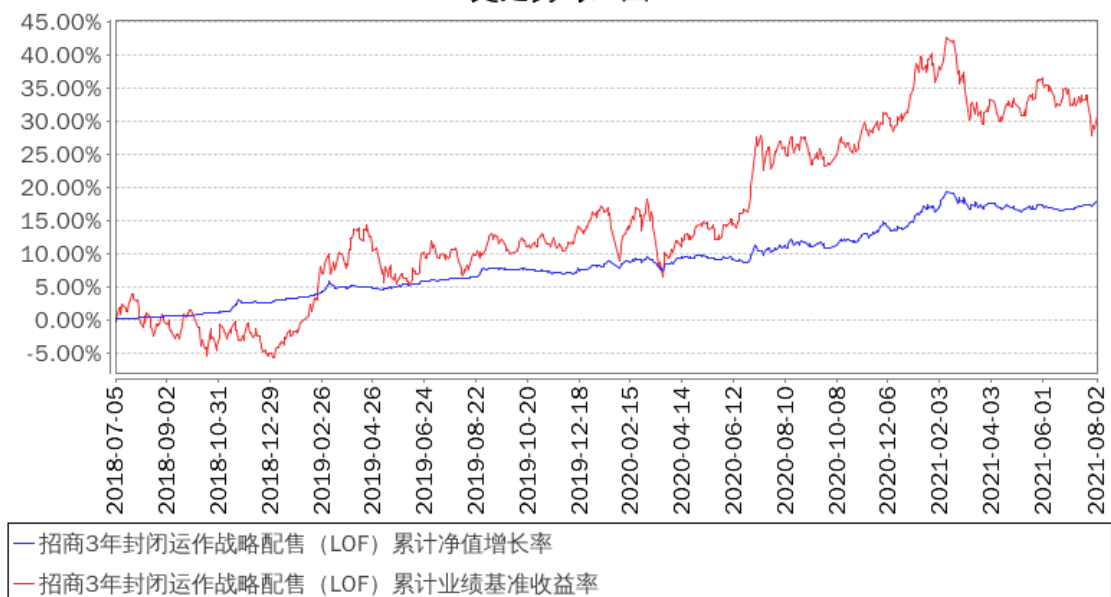
3.4.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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3个月	1.04%	0.13%	-1.46%	0.73%	2.50%	-0.60%

过去6个月	0.85%	0.24%	-5.32%	0.80%	6.17%	-0.56%
过去1年	6.58%	0.24%	4.21%	0.74%	2.37%	-0.50%
过去3年	17.58%	0.18%	30.37%	0.81%	-12.79%	-0.63%
自成立至今	17.99%	0.18%	30.97%	0.81%	-12.98%	-0.63%

3.4.2 自基金合同生效以来基金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3年封闭运作战略配售（LOF）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 基金经理（或基金经理小组）简介（转型后）

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王景	本基金基金经理	2021年8月3日	-	18	女，经济学硕士。曾任职于中国石化乌鲁木齐石油化工总厂物资装备公司及国家环境保护总局对外合作中心；2003年起，先后于金鹰基金管理有限公司、中信基金管理有限公司及华夏基金管理有限公司工作，任行业研究员；2009年8月起，任东兴证券股份有限公司资产管理部投资经理；2010年8月加入招商基金管理有限公司，曾任招商安瑞进取债券型证券投资基金、招商安本增利债券型证券投资基金、招商安泰偏股混合型

				<p>投资基金、招商境远灵活配置混合型证券投资基金、招商安弘灵活配置混合型证券投资基金、招商康泰灵活配置混合型证券投资基金、招商安博保本混合型证券投资基金、招商安荣保本混合型证券投资基金、招商丰茂灵活配置混合型发起式证券投资基金、招商中国机遇股票型证券投资基金基金经理，现任总经理助理兼投资管理一部总监、招商制造业转型灵活配置混合型证券投资基金、招商3年封闭运作瑞利灵活配置混合型证券投资基金、招商瑞泽一年持有期混合型证券投资基金、招商瑞德一年持有期混合型证券投资基金、招商品质升级混合型证券投资基金、招商品质生活混合型证券投资基金、招商瑞智优选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、招商金安成长严选1年封闭运作混合型证券投资基金、招商蓝筹精选股票型证券投资基金基金经理。</p>
--	--	--	--	--

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。

4.3 报告期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量(只)	资产净值(元)	任职时间
王景	公募基金	9	31,190,887,052.84	2011年9月20日
	私募资产管理计划	1	556,134,962.57	2021年8月26日
	其他组合	2	21,145,930,976.28	2015年6月30日
	合计	12	52,892,952,991.69	-

4.4 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。

4.5 公平交易专项说明

4.5.1 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。

4.5.2 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，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易不存在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。报告期内亦未发现其他有可能导致不公平交易和利益输送的重大异常交易行为。

4.6 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，国内生产回升速度稳中趋缓，消费缓慢复苏，原材料和能源价格上涨，出口继续扮演需求的重要支柱，地产链条呈现收缩态势。货币环境边际放松，利率小幅下行。

期内权益市场成交依旧活跃，行业分化之下，科技、医药、消费、地产等行业表现迥异。基金在此期间重点布局新能源、电动车、先进制造和医药生物板块，对于煤炭、电力、化工等周期性板块配置较少。

展望未来，疫情后全球经济恢复还在进行，国内新旧动能切换进程持续，但也面临发达市场货币政策和跨境资本流动的挑战，基金将重点聚焦充分利用国内要素优势、具备全球竞争力的行业，选择成长路径清晰、行业壁垒坚实、业绩确定性较高的个股。

4.7 报告期内基金的业绩表现

截至转型后报告期末，本报告期（2021年08月03日-2021年09月30日）本基金份额净值增长率为-0.98%，同期业绩基准增长率为-1.98%。

截至转型前报告期末，本报告期（2021年07月01日-2021年08月02日）本基金份额净值增长率为1.11%，同期业绩基准增长率为-2.74%。

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 投资组合报告（转型后）

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,815,187,991.64	65.08
	其中：股票	1,815,187,991.64	65.08
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	518,280,695.40	18.58
	其中：债券	518,280,695.40	18.58
	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	300,000,000.00	10.76
	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	141,103,283.69	5.06
8	其他资产	14,417,574.78	0.52
9	合计	2,788,989,545.51	100.00

注：上表权益投资中通过港股通交易机制投资的港股金额人民币 279,692,605.73 元，占基金净值比例 10.11%。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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	12,350.52	0.00
B	采矿业	66,319,723.53	2.40

C	制造业	1,108,974,118.87	40.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	20,978.92	0.00
F	批发和零售业	19,344,877.40	0.70
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	3,345.12	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	143,198,044.71	5.17
J	金融业	65,127,997.20	2.35
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	67,340,000.00	2.43
M	科学研究和技术服务业	12,751.20	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	65,136,171.04	2.35
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	5,027.40	0.00
S	综合	-	-
	合计	1,535,495,385.91	55.48

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
通信服务	27,751,794.42	1.00
消费者非必需品	37,752,029.94	1.36
消费者常用品	120,826,455.92	4.37
能源	-	-
金融	-	-
医疗保健	21,941,842.39	0.79
工业	-	-
信息技术	58,314,733.16	2.11
基础材料	13,105,749.90	0.47
地产业	-	-
公用事业	-	-
合计	279,692,605.73	10.11

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	300122	智飞生物	931,500	148,099,185.00	5.35
2	600438	通威股份	2,852,508	145,306,757.52	5.25

3	300496	中科创达	1,192,677	143,094,745.63	5.17
4	06186	中国飞鹤	11,038,000	120,826,455.92	4.37
5	600176	中国巨石	6,316,297	111,040,501.26	4.01
6	002271	东方雨虹	2,125,687	94,210,447.84	3.40
7	600690	海尔智家	3,274,800	85,636,020.00	3.09
8	000538	云南白药	875,051	85,571,237.29	3.09
9	300529	健帆生物	1,213,820	71,081,299.20	2.57
10	601888	中国中免	259,000	67,340,000.00	2.43

5.4 报告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	10,426,000.00	0.38
2	央行票据	-	-
3	金融债券	232,016,000.00	8.38
	其中：政策性金融债	232,016,000.00	8.38
4	企业债券	61,150,000.00	2.21
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	19,986,000.00	0.72
7	可转债（可交换债）	222,695.40	0.01
8	同业存单	194,480,000.00	7.03
9	其他	-	-
10	合计	518,280,695.40	18.73

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	210201	21 国开 01	700,000	70,042,000.00	2.53
2	210204	21 国开 04	600,000	60,666,000.00	2.19
3	112109020	21 浦发银行 CD020	500,000	48,655,000.00	1.76
4	112110052	21 兴业银行 CD052	500,000	48,625,000.00	1.76
5	112109127	21 浦发银行 CD127	500,000	48,610,000.00	1.76

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名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。

5.7 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。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金采取套期保值的方式参与股指期货的投资交易，以管理市场风险和调节股票仓位为主要目的。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

报告期内基金投资的前十名证券除 21 国开 01（证券代码 210201）、云南白药（证券代码 000538）、中国巨石（证券代码 600176）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、21 国开 01（证券代码 210201）

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，多次受到监管机构的处罚。

2、云南白药（证券代码 000538）

根据2021年8月6日发布的相关公告，该证券发行人因产品不合格被云南省药品监督管理局处以罚款，并没收违法所得。

3、中国巨石（证券代码 600176）

根据2020年11月9日发布的相关公告，该证券发行人因违反海关监管规定被洋山海关没收违法所得。

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。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

金额单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	5,417,461.81
2	应收证券清算款	40,763.40
3	应收股利	352,924.94
4	应收利息	8,348,885.11
5	应收申购款	257,539.52
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,417,574.78

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	300496	中科创达	83,031,463.00	3.00	大宗交易受限

§ 6 投资组合报告（转型前）

6.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
----	----	-------	--------------

1	权益投资	489,940,627.78	13.26
	其中：股票	489,940,627.78	13.26
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,461,154,000.00	39.55
	其中：债券	1,461,154,000.00	39.55
	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	1,714,493,786.61	46.40
8	其他资产	29,056,232.42	0.79
9	合计	3,694,644,646.81	100.00

6.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

6.2.1 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	7,498.53	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	351,920,560.21	10.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	19,761.78	0.00
F	批发和零售业	11,908,833.96	0.35
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	22,308,182.94	0.65
J	金融业	44,410,995.00	1.29
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	34,801,490.00	1.01
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	24,563,305.36	0.72
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	489,940,627.78	14.27

6.2.2 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。

6.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	300122	智飞生物	699,700	108,124,641.00	3.15
2	600176	中国巨石	4,948,911	78,588,706.68	2.29
3	600690	海尔智家	1,458,200	37,767,380.00	1.10
4	601888	中国中免	145,400	34,801,490.00	1.01
5	603338	浙江鼎力	553,828	34,215,493.84	1.00
6	000887	中鼎股份	1,385,600	21,130,400.00	0.62
7	300059	东方财富	557,600	18,417,528.00	0.54
8	603588	高能环境	1,175,050	17,802,007.50	0.52
9	300782	卓胜微	44,700	17,708,799.00	0.52
10	300496	中科创达	105,300	15,227,433.00	0.44

6.4 报告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	10,440,000.00	0.30
2	央行票据	-	-
3	金融债券	323,888,000.00	9.44
	其中：政策性金融债	293,381,000.00	8.55
4	企业债券	280,118,000.00	8.16
5	企业短期融资券	60,106,000.00	1.75
6	中期票据	345,722,000.00	10.07
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	440,880,000.00	12.84
9	其他	-	-
10	合计	1,461,154,000.00	42.57

6.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	112185736	21 南京银行 CD140	1,000,000	99,810,000.00	2.91
2	112008284	20 中信银行 CD284	1,000,000	97,680,000.00	2.85
3	210203	21 国开 03	700,000	71,057,000.00	2.07
4	210201	21 国开 01	700,000	70,119,000.00	2.04

5	210204	21 国开 04	600,000	60,822,000.00	1.77
---	--------	----------	---------	---------------	------

6.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名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。

6.7 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。

6.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

6.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

6.9.1 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，本基金封闭运作期内不参与股指期货交易。

6.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金合同规定，本基金封闭运作期内不参与股指期货交易。

6.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

6.10.1 本期国债期货投资政策

根据本基金合同规定，本基金封闭运作期内不参与国债期货交易。

6.10.2 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，本基金封闭运作期内不参与国债期货交易。

6.10.3 本期国债期货投资评价

根据本基金合同规定，本基金封闭运作期内不参与国债期货交易。

6.11 投资组合报告附注

6.11.1

报告期内基金投资的前十名证券除 20 中信银行 CD284（证券代码 112008284）、21 国开 01（证券代码 210201）、21 国开 03（证券代码 210203）、21 国开 04（证券代码 210204）、21 南京银行 CD140（证券代码 112185736）、中国巨石（证券代码 600176）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 中信银行 CD284（证券代码 112008284）

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。

2、21 国开 01（证券代码 210201）

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，多次受到监管机构的处罚。

3、21 国开 03（证券代码 210203）

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，多次受到监管机构的处罚。

4、21 国开 04（证券代码 210204）

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，多次受到监管机构的处罚。

5、21 南京银行 CD140（证券代码 112185736）

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、未依法履行职责等原因，多次受到监管机构的处罚。

6、中国巨石（证券代码 600176）

根据 2020 年 11 月 9 日发布的相关公告，该证券发行人因违反海关监管规定被洋山海关没收违法所得。

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。

6.11.2

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。

6.11.3 其他资产构成

金额单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	3,932,645.81
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	25,123,586.61
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	29,056,232.42

6.11.4 报告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。

6.11.5 报告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。

§ 7 开放式基金份额变动（转型后）

单位：份

基金合同生效日(2021年8月3日)基金份额总额	2,909,244,683.59
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	9,200,487.67
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	549,616,865.95
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）	-
报告期期末基金份额总额	2,368,828,305.31

§ 8 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

报告期期初基金份额总额	24,716,595,033.20
报告期期间基金总申购份额	-
减：报告期期间基金总赎回份额	21,807,350,349.61
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	2,909,244,683.59

§ 9 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型后）

9.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

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。

9.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的交易明细。

§ 10 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型前）

10.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

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。

10.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的交易明细。

§ 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 3 年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）设立的文件；
- 3、《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）基金合同》；
- 4、《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）托管协议》；
- 5、《招商瑞智优选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 6、《招商瑞智优选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）托管协议》；
- 7、《招商瑞智优选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）招募说明书》；
- 8、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 10 月 26 日