招商安裕灵活配置混合型证券投资基金2021年第4季度报告

2021年12月31日

基金管理人：招商基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2022年1月21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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年1月20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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2021年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	招商安裕灵活配置混合
基金主代码	002657
交易代码	002657
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年6月21日
报告期末基金份额总额	1,608,989,815.96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	本基金在大类资产配置过程中，注重平衡投资的收益和风险水平，以实现基金份额净值的稳定增长。 1、资产配置策略：本基金的大类资产配置主要通过对宏观经济运行状况、国家财政和货币政策、国家产业政策以及资本市场资金环境、证券市场走势的分析，预测宏观经济的发展趋势，并据此评价未来一段时间股票、债券市场相对收益率，主动调整股票、债券类资产在给定区间内的动态配置，以使基金在保持总体风险水平相对稳定的基础上，优化投资组合。 2、股票投资策略：本基金将通过精选个股来构造股票组合，以实现在控制下行风险的前提下为投资人获取稳健回报的目的。本基金通过定性和定量相结合的方法来精选个股。 3、债券（不含可转换公司债）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；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、各期限段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。 4、资产支持证券投资策略：本基金将在宏观经济和基本面分析的基础上，对资产支持证券的质量和构成、利率风险、信用风险、流动性风险和提前偿付风险等进行定性和定量的全方面分析，评估其相对投资价值并作出相应的投资决策，力求在控制投资风险的前提下尽可能的提高本基金的收益。 5、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。 6、期货投资策略：为更好地实现投资目标，本基金在注重风险管理的前提下，以套期保值为目的，适度运用股指期货、国债期货等金融衍生品。本基金利用金融衍生品合约流动性好、交易成本低和杠杆操作等特点，提高投资组合运作效率。 7、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*50%+中债综合指数收益率*50%	
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。	
基金管理人	招商基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	招商安裕灵活配置混合 A	招商安裕灵活配置混合 C
下属分级基金的交易代码	002657	002658
报告期末下属分级基金的份额总额	1,375,393,760.52 份	233,596,055.44 份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2021 年 10 月 1 日－2021 年 12 月 31 日）	
	招商安裕灵活配置混合 A	招商安裕灵活配置混合 C
1.本期已实现收益	39,711,350.88	4,508,147.67
2.本期利润	106,255,966.28	13,435,582.18
3.加权平均基金份额本期利	0.0885	0.0846

润		
4.期末基金资产净值	2,317,223,896.46	380,486,641.82
5.期末基金份额净值	1.6848	1.6288

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

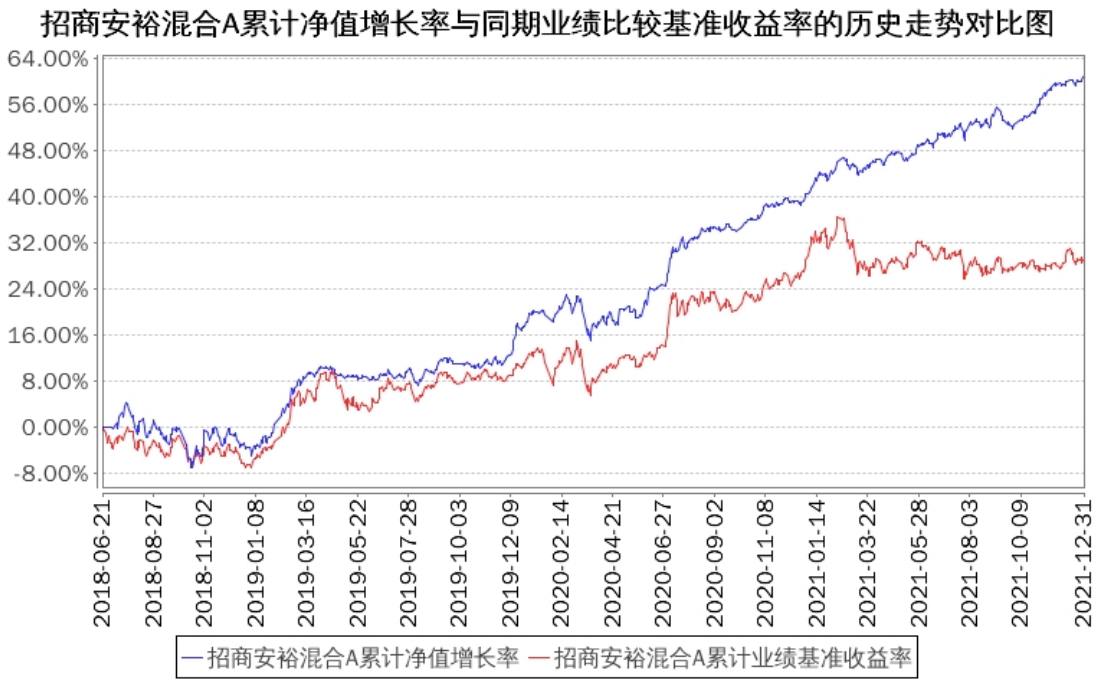
招商安裕灵活配置混合 A

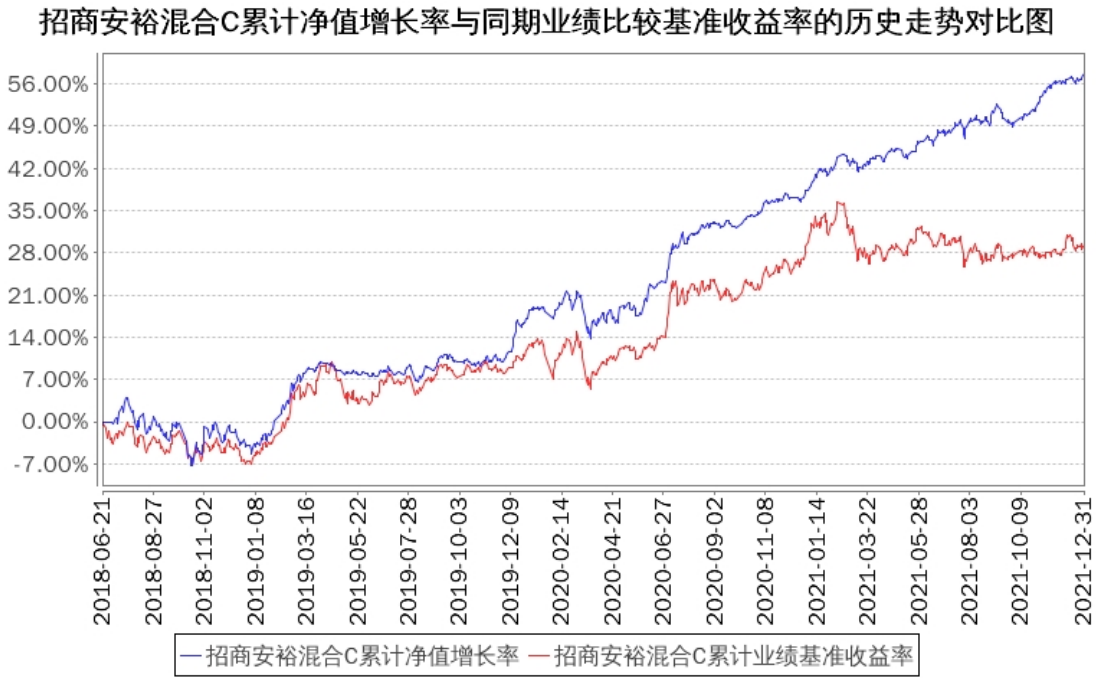
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	5.63%	0.23%	1.42%	0.39%	4.21%	-0.16%
过去六个月	6.57%	0.30%	-1.19%	0.51%	7.76%	-0.21%
过去一年	14.68%	0.30%	0.23%	0.59%	14.45%	-0.29%
过去三年	67.11%	0.41%	38.45%	0.64%	28.66%	-0.23%
自基金合同生效起至今	61.07%	0.50%	29.39%	0.65%	31.68%	-0.15%

招商安裕灵活配置混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	5.46%	0.23%	1.42%	0.39%	4.04%	-0.16%
过去六个月	6.24%	0.30%	-1.19%	0.51%	7.43%	-0.21%
过去一年	14.00%	0.30%	0.23%	0.59%	13.77%	-0.29%
过去三年	64.14%	0.41%	38.45%	0.64%	25.69%	-0.23%
自基金合同生效起至今	57.68%	0.50%	29.39%	0.65%	28.29%	-0.15%

3.2.2 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





§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

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		
侯杰	本基金	2018 年 10	-	19	男，经济学硕士。2002 年 7 月加入北京

	基金经理	月30日			首创融资担保有限公司，历任首创担保资本运营部职员、部门副经理、主管副总经理（主持工作），曾负责宏观经济研究、公司股票投资、债券投资及基金投资等工作。2017年9月加入招商基金管理有限公司，曾任招商安荣灵活配置混合型证券投资基金、招商安德灵活配置混合型证券投资基金、招商民安增益债券型证券投资基金、招商稳祯定期开放混合型证券投资基金基金经理，现任固定收益投资部总监助理兼招商安裕灵活配置混合型证券投资基金、招商丰拓灵活配置混合型证券投资基金、招商瑞阳股债配置混合型证券投资基金、招商安华债券型证券投资基金、招商瑞德一年持有期混合型证券投资基金、招商瑞和1年持有期混合型证券投资基金、招商瑞盈9个月持有期混合型证券投资基金、招商享利增强债券型证券投资基金基金经理。

注：1、本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告（生效）日期；

2、证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

基金管理人声明：在本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关法律法规及其各项实施准则的规定以及本基金的基金合同等基金法律文件的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的前提下，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围以及投资运作符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

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。

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，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。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

宏观经济回顾：

2021年四季度，国内经济增速持续放缓，年底边际略有好转。投资方面，最新的11月固定资产投资完成额累计同比增长5.2%，以2019年同期为基数来看，11月两年平均增长3.9%，投资端表现较三季度末4%的平均增速略有下滑。其中房地产投资自6月以来持续下滑，且下滑幅度较大，11月房地产开发投资累计同比增长6%，两年平均增长6.4%，主要是房企在融资端受限政策频出以及地产销售超预期下滑背景下拿地和新开工意愿下滑所致；基建投资在今年严控地方债务的背景下增长空间较小，虽然财政要求专项债发行尽快形成实物工作量，但落实到具体投资层面尚需一定时间，且2021年稳增长压力不大的背景下政府用基建托底的意愿不强，11月基建投资累计同比减少0.2%，两年平均增长1.6%，基建投资增速持续低迷，不过后续在财政前置的预期下有望抬升；地产和基建走弱带动固定资产投资整体下行，而制造业投资表现较好，对整体固定资产投资形成支撑，11月制造业投资累计同比增长13.7%，两年平均增长4.7%，较三季度末3.6%的平均增速上行1.1个百分点，这可能与原材料价格下行以及出口持续高景气拉动制造业投资有关。消费方面，11月社会消费品零售总额累计同比增长13.7%，两年平均增长4%，其中餐饮消费两年平均减少0.5%，消费数据在疫情反复和居民收入高不确定性的情况下依然偏弱。对外贸易方面，受海外主要国家经济高景气度影响，国内出口依然强劲，11月出口金额累计同比增长31.1%，两年平均增长15.7%，但在海外加息预期抬升、经济复苏态势趋缓以及高基数效应影响下，未来出口增速有较大下行压力。生产方面，国内供给端自6月份以来持续走弱，11月工业增加值累计同比增长10.1%，两年平均增长6.1%，较三季度末的6.4%下行0.3个百分点。12月PMI指

数为50.3%，11月以来PMI已连续两月回复至荣枯线以上，其中12月生产指数和新订单指数分别为51.4%和49.7%，反映经济在边际上呈现弱复苏态势。预计2022年一季度经济增长处于低位边际复苏的状态。

债券市场回顾：

2021年四季度，债券市场整体呈现出先下跌后持续上涨的行情。10月在PPI数据持续超预期的背景下市场对通胀担忧加剧，加之央行和银保监会等监管机构不断释放宽信用预期，债市出现一定幅度下跌，10年期国债收益率上行近10bp；11月至12月，随着发改委强力推进保供稳价措施，大宗商品价格明显回落，向下游传导的通胀压力缓解，加之经济数据持续低迷，地产销售超预期下滑带动房地产开发投资承压，债市收益率单边下行。同时，货币环境也保持宽松，央行不断进行大额逆回购投放，12月也先后迎来降准和1年期LPR利率下调，整体看两月内收益率下行20bp。信用债和利率债在四季度内各期限收益率均明显下行，其中高等级短久期信用债走强幅度强于利率债，而低等级长久期信用债收益率下行幅度则弱于利率债。

股票市场回顾：

2021年四季度，经济依然存在一定下行压力，煤炭等工业品价格震荡回落，政策维稳预期浮现，市场对滞胀风险、房地产风险担忧的悲观情绪修复。从行业表现来看，市场一方面继续关注新兴成长方向，传媒、VR/AR产业链借助元宇宙方向获得市场资金关注、汽车智能化趋势叠加短期补库节奏带动汽车零部件板块表现较好；另一方面存在价值股的估值修复，市场对地产的悲观预期有所修复，带动部分建材类龙头公司估值修复，PPI向CPI传导带动部分消费品公司、具备消费属性的医药类公司表现较好。综合来看，市场在经济下行中后阶段，机遇与挑战并存。

基金操作回顾：

回顾2021年四季度的基金操作，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。股票投资方面，四季度市场较为分化，我们更多的是自下而上找个股的机会，需要找低估值、长期有空间、短期有催化的个股，以一种较为分散的形式组合在一起，争取在中期不影响收益率的前提下，短期通过平衡来控制回撤。相较三季度而言，组合在四季度进行了一些结构上的调整，组合酌情布局了：（1）偏周期的板块；（2）与疫情好转有关板块；（3）成长性较高的科技相关板块。展望未来，成长板块明年或将延续今年的行情，但是有一定市场预期差的偏周期板块的确定性机会可能比成长板块更大，同时，疫情整体情况或将得到改善，与疫情好转相关的板块（医药生物、交通运输、社会服务等）将有一定的机会。

债券投资方面，四季度上旬以来，银行资本补充工具受理财市值法转型影响估值出现持续调整，本组合从绝对收益水平及信用利差历史分位角度出发，抓住相关调整机会进行配置，同时在下旬存单品种配置机会突显，本组合同样参与相应配置机会。在债券市场整体收益水

平偏低的背景下，本组合更注重挖掘出现超调机会的固收类标的进行配置，并赚取相应资本利得收益。

未来我们将随时关注海内外宏观政策的走向，通过及时、灵活的大类资产配置进行应对，争取组合净值能够较为稳定地增长。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金A类份额净值增长率为5.63%，同期业绩基准增长率为1.42%，C类份额净值增长率为5.46%，同期业绩基准增长率为1.42%。

4.6 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

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	557,023,140.55	20.38
	其中：股票	557,023,140.55	20.38
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,804,537,883.02	66.01
	其中：债券	1,804,537,883.02	66.01
	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	100,035,350.05	3.66
	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	222,008,756.79	8.12
8	其他资产	50,063,618.08	1.83
9	合计	2,733,668,748.49	100.00

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	-	-
B	采矿业	2,109,380.00	0.08
C	制造业	412,160,425.78	15.28
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	155,119.64	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	28,727,089.27	1.06
H	住宿和餐饮业	13,893,728.60	0.52
I	信息传输、软件和信息技术服务业	30,314,778.90	1.12
J	金融业	22,571,008.00	0.84
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	2,467,254.00	0.09
M	科学研究和技术服务业	125,080.26	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	44,452,866.51	1.65
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	46,409.59	0.00
S	综合	-	-
	合计	557,023,140.55	20.65

5.2.2 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。

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	002541	鸿路钢构	771,107	41,285,068.78	1.53
2	600521	华海药业	1,898,867	41,129,459.22	1.52
3	002266	浙富控股	5,502,540	39,178,084.80	1.45
4	600745	闻泰科技	296,643	38,355,939.90	1.42
5	600150	中国船舶	1,219,800	30,238,842.00	1.12
6	300776	帝尔激光	106,900	27,355,710.00	1.01
7	000725	京东方 A	4,576,800	23,112,840.00	0.86
8	600516	方大炭素	2,092,309	22,638,783.38	0.84
9	000001	平安银行	1,369,600	22,571,008.00	0.84
10	300476	胜宏科技	728,850	22,047,712.50	0.82

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	229,722,114.00	8.52
2	央行票据	-	-
3	金融债券	586,975,000.00	21.76
	其中：政策性金融债	122,851,000.00	4.55
4	企业债券	219,311,800.00	8.13
5	企业短期融资券	20,056,000.00	0.74
6	中期票据	520,647,000.00	19.30
7	可转债（可交换债）	2,355,969.02	0.09
8	同业存单	205,070,000.00	7.60
9	其他	20,400,000.00	0.76
10	合计	1,804,537,883.02	66.89

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	2128017	21 中信银行永续债	900,000	93,177,000.00	3.45
2	019649	21 国债 01	837,200	83,736,744.00	3.10
3	2128019	21 中国银行永续债 01	800,000	82,608,000.00	3.06
4	210013	21 附息国债 13	800,000	80,616,000.00	2.99
5	2028006	20 邮储银行永续债	600,000	61,230,000.00	2.27

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

为更好地实现投资目标，本基金在注重风险管理的前提下，以套期保值为目的，适度运用股指期货、国债期货等金融衍生品。本基金利用金融衍生品合约流动性好、交易成本低和杠杆操作等特点，提高投资组合运作效率。

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

为更好地实现投资目标，本基金在注重风险管理的前提下，以套期保值为目的，适度运用股指期货、国债期货等金融衍生品。本基金利用金融衍生品合约流动性好、交易成本低和杠杆操作等特点，提高投资组合运作效率。

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 20 光大银行永续债（证券代码 2028037）、20 邮储银行永续债（证券代码 2028006）、21 建设银行 CD140（证券代码 112105140）、21 浦发银行 CD239（证券代码 112109239）、21 中国银行永续债 01（证券代码 2128019）、21 中信银行永续债（证券代码 2128017）、鸿路钢构（证券代码 002541）外其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

1、20 光大银行永续债（证券代码 2028037）

根据发布的相关公告，该证券发行人在报告期内因违规经营、内部制度不完善、未依法履行职责等原因，多次受到监管机构的处罚。

2、20 邮储银行永续债（证券代码 2028006）

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、违反反洗钱法、未依法履行职责等原因,多次受到监管机构的处罚。

3、21 建设银行 CD140（证券代码 112105140）

根据发布的相关公告，该证券发行人在报告期内因违规经营、内部制度不完善、未依法履行职责等原因，多次受到监管机构的处罚。

4、21 浦发银行 CD239（证券代码 112109239）

根据发布的相关公告，该证券发行人在报告期内因违规经营、未依法履行职责、违反反洗钱法等原因，多次受到监管机构的处罚。

5、21中国银行永续债01（证券代码2128019）

根据发布的相关公告，该证券发行人在报告期内因违规经营、内部制度不完善、违反反洗钱法等原因，多次受到监管机构的处罚。

6、21中信银行永续债（证券代码2128017）

根据发布的相关公告，该证券发行人在报告期内因违规经营、未依法履行职责、违反反洗钱法等原因，多次受到监管机构的处罚。

7、鸿路钢构（证券代码002541）

根据2021年1月25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上海市崇明区税务局第二税务所责令改正。

根据2021年4月8日发布的相关公告，该证券发行人因未依法履行职责被亳州市城市管理局处以罚款。

根据2021年4月19日发布的相关公告，该证券发行人因拒不配合监管工作被金寨县消防救援大队处以罚款。

根据2021年5月20日发布的相关公告，该证券发行人因未依法履行职责被亳州市城市管理局处以罚款。

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	256,737.80
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	25,559,149.15
5	应收申购款	24,247,731.13
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	50,063,618.08

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

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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	招商安裕灵活配置混合 A	招商安裕灵活配置混合 C
报告期期初基金份额总额	1,151,126,709.20	181,609,686.20
报告期期间基金总申购份额	387,606,583.21	144,332,851.28
减：报告期期间基金总赎回份额	163,339,531.89	92,346,482.04
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	1,375,393,760.52	233,596,055.44

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 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。

7.2 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。

§8 备查文件目录

8.1 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裕灵活配置混合型证券投资基金设立的文件；

3、《招商安裕灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；

4、《招商安裕灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；

5、《招商安裕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。

8.2 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

8.3 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

2022 年 1 月 21 日