

招商安庆债券型证券投资基金 2022 年 第 3 季度报告

2022 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2022 年 10 月 25 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 10 月 24 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 2022 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 招商安庆债券 |
| 基金主代码 | 006650 |
| 交易代码 | 006650 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2019 年 1 月 31 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 675,802,076.97 份 |
| 投资目标 | 在保持资产流动性的基础上,通过积极主动的投资管理,合理配置债券等固定收益类资产和权益类资产,追求基金资产的长期稳健增值。 |
| 投资策略 | <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金在合同约定的范围内实施稳健的整体资产配置,通过对国内外宏观经济状况、证券市场走势、市场利率走势以及市场资金供求情况、信用风险情况、风险预算和有关法律法规等因素的综合分析,预测各类资产在长、中、短期内的风险收益特征,进而进行合理资产配置。</p> <p>2、可转换债券和可交换债券投资策略</p> <p>可转换债券和可交换债券投资是基于对宏观经济形势、国家财政政策、货币政策深入分析的基础上,对各类市场大势做出判断的前提下,一方面对可转换债券和可交换债券所对应的基础股票进行分析和研究,对盈利能力较强或成长性较好的行业和上市公司的可转债进行重点关注,另一方面,应用招商基金可转换债券和可交换</p> |

债券评价体系，定量分析和定性分析相结合，选择具有较高投资价值的可转换债券和可交换债券进行投资，主要包括：基于二叉树模型的可转换债券和可交换债券价值分析、可转换债券和可交换债券的债/股性和隐含波动率分析、对可转换债券和可交换债券条款的定性分析等。

3、债券（不含可转换债券、可交换债券）投资策略

本基金在债券投资中主要基于对国家财政政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济的动态跟踪，采用久期匹配下的主动性投资策略，主要包括：久期匹配、期限结构配置、信用策略，相对价值判断、动态优化等管理手段，对债券市场、债券收益率曲线以及各种债券价格的变化进行预测，相机而动、积极调整。

4、股票投资策略

本基金对股票的投资，以价值投资理念为导向，采取“自上而下”的多主题投资和“自下而上”的个股精选方法，灵活运用多种股票投资策略，深度挖掘经济结构转型过程中具有核心竞争力和发展潜力的行业和公司，实现基金资产的长期稳定增值。

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、资产支持证券的投资策略

资产支持类证券的定价受市场利率、流动性、发行条款、标的资产的构成及质量、提前偿还率及其它附加条款等多种因素的影响。本基金将在利率基本面分析、市场流动性分析和信用评级支持的基础上，辅以与国债、企业债等债券品种的相对价值比较，审慎投资资产支持证券类资产。

7、中小企业私募债券投资策略

本基金将根据审慎原则投资中小企业私募债。本基金以持有到期中小企业私募债为主，以获得本金和票息收入为投资目的，同时，密切关注债券的信用风险变化，力争在控制风险的前提下，获得较高收益。

8、国债期货投资策略

为有效控制债券投资的系统性风险，本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目的，适度运用国债期货，提高投资组合的运作效率。在国债期货投资时，本基金将首先分析国债期货各合约价格与最便宜可交割券的关系，选择定价合理的国债期货合约，其次，考虑国债期货各合约的流动性情况，最终确定与现货组合的合适匹配，以达到风险管理的目标。

| | |
|--------|---|
| 业绩比较基准 | 中债综合指数收益率×80%+沪深 300 指数收益率×20% |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、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 | 中国建设银行股份有限公司 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2022 年 7 月 1 日—2022 年 9 月 30 日） |
|----------------|-------------------------------------|
| 1.本期已实现收益 | 6,380,911.88 |
| 2.本期利润 | -855,358.36 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0013 |
| 4.期末基金资产净值 | 856,814,797.71 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.2678 |

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

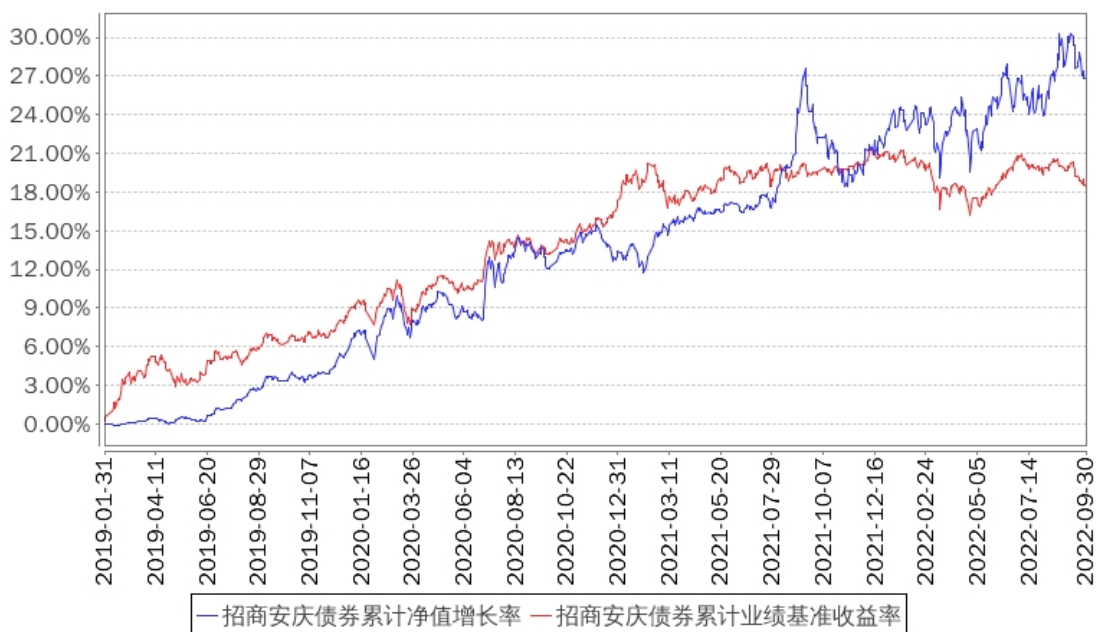
3.2 基金净值表现

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

| 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 | -0.01% | 0.60% | -2.05% | 0.18% | 2.04% | 0.42% |
| 过去六个月 | 2.42% | 0.61% | 0.07% | 0.24% | 2.35% | 0.37% |
| 过去一年 | 3.70% | 0.55% | -1.05% | 0.24% | 4.75% | 0.31% |
| 过去三年 | 22.69% | 0.41% | 11.51% | 0.25% | 11.18% | 0.16% |
| 自基金合同生效起至今 | 26.78% | 0.37% | 18.31% | 0.25% | 8.47% | 0.12% |

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

招商安庆债券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

| 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 | | |
| 尹晓红 | 本基金基金经理 | 2019年1月31日 | - | 9 | 女，硕士。2013年7月加入招商基金管理有限公司，曾任交易部交易员；2015年2月工作调动至招商财富资产管理有限公司（招商基金全资子公司），任投资经理；2016年4月加入招商基金管理有限公司，曾任高级研究员，招商安瑞进取债券型证券投资基金、招商安润灵活配置混合型证券投资基金、招商3年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金经理，现任招商安盈债券型证券投资基金、招商安庆债券型证券投资基金、招商安阳债券型证券投资基金、招商增浩一年定期开放混合型证券投资基金、招商瑞和1年持有期混合型证券投资基金基金经理。 |
| 李崑 | 本基金基金经理 | 2021年7月27日 | - | 19 | 男，工商管理硕士。2002年7月加入中国工商银行股份有限公司；2003年9月加入长盛基金管理有限公司，曾任交易 |

| | | | | |
|--|--|--|--|--|
| | | | | 部总监、行业研究员以及投资经理；2013 年 12 月加入国投财务有限公司，任权益投资总监；2015 年 12 月加入招商基金管理有限公司，曾任招商安润保本混合型证券投资基金、招商睿诚定期开放混合型证券投资基金基金经理，现任投资管理一部专业总监兼招商安泰平衡型证券投资基金、招商睿逸稳健配置混合型证券投资基金、招商安庆债券型证券投资基金、招商稳健平衡混合型证券投资基金、招商臻选平衡混合型证券投资基金、招商精选平衡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）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中国证监会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》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 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，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

报告期内，国内宏观进入缓慢复苏，PMI 回到荣枯线以上，基建和出口表现亮眼，但地产销售、日常消费数据等依旧比较疲弱。海外市场波动加大，美债收益率持续上行，美元指数连创近年新高，股票市场承压，主要股票市场指数下跌。国际能源价格持续高企，海外市场 CPI、PPI 持续维持高位。报告期内国内股票市场下跌，成长类个股调整较多，低估值板块相对表现较好。报告期内国内流动性宽松，受对经济承压的担忧影响，十年期国债收益率下跌 6 个 BP 至 2.76。

报告期内，国外形势仍然复杂，美国通胀预期维持高位，美联储加息预期仍强，海外的衰退预期进一步增强。由于能源供给减少叠加俄乌冲突的影响，原油和天然气等能源价格维持高位。国内三季度 LPR 降息，基建持续发力，房地产释放积极的信号，消费承压，货币政策维持宽松。

回顾第三季度的资本市场，债券市场先是受到降息的影响，利率下行，后又受到稳增长预期加码的影响，利率有所上行，10 年期国债收益率收在 2.76% 附近。股票市场，市场持续下跌，上证综指、中小综指、创业板指分别下跌 11.01%、12.93% 和 18.56%。本基金报告期内股票仓位基本保持稳定，继续重仓持有上游能源类优势公司，并逐步加仓了部分成长性行业，如高端装备制造、新零售、小家电等。利率债部分操作不多，维持流动性管理，保持较低久期，以票息策略为主。转债部分减持了部分涨幅明显的品种。债券投资方面，由于债券市场波动加大，操作上组合在降息后控制久期和杠杆，以票息策略为主。

4.5 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-0.01%，同期业绩基准增长率为-2.05%。

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 | 168,611,409.54 | 18.20 |
| | 其中:股票 | 168,611,409.54 | 18.20 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 744,405,384.44 | 80.36 |
| | 其中:债券 | 744,405,384.44 | 80.36 |
| | 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 | 5,861,115.29 | 0.63 |
| 8 | 其他资产 | 7,469,069.58 | 0.81 |
| 9 | 合计 | 926,346,978.85 | 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 | 115,105,502.00 | 13.43 |
| C | 制造业 | 41,881,783.54 | 4.89 |
| 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 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 10,604,430.00 | 1.24 |
| 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 | 1,019,694.00 | 0.12 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 168,611,409.54 | 19.68 |

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 | 601666 | 平煤股份 | 3,172,100 | 43,267,444.00 | 5.05 |
| 2 | 600188 | 兖矿能源 | 564,800 | 28,336,016.00 | 3.31 |
| 3 | 600395 | 盘江股份 | 2,166,000 | 18,367,680.00 | 2.14 |
| 4 | 601225 | 陕西煤业 | 475,000 | 10,815,750.00 | 1.26 |
| 5 | 000983 | 山西焦煤 | 721,400 | 10,806,572.00 | 1.26 |
| 6 | 000703 | 恒逸石化 | 1,245,321 | 9,601,424.91 | 1.12 |
| 7 | 600026 | 中远海能 | 396,200 | 7,167,258.00 | 0.84 |
| 8 | 000519 | 中兵红箭 | 261,900 | 5,853,465.00 | 0.68 |
| 9 | 600172 | 黄河旋风 | 556,695 | 4,381,189.65 | 0.51 |
| 10 | 600522 | 中天科技 | 184,400 | 4,143,468.00 | 0.48 |

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 | 43,987,125.20 | 5.13 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 134,687,248.22 | 15.72 |
| | 其中：政策性金融债 | 40,969,712.33 | 4.78 |
| 4 | 企业债券 | 30,900,739.18 | 3.61 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | 72,910,427.95 | 8.51 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 451,397,882.25 | 52.68 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | 10,521,961.64 | 1.23 |
| 10 | 合计 | 744,405,384.44 | 86.88 |

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 | 110079 | 杭银转债 | 542,850 | 66,815,643.73 | 7.80 |
| 2 | 113052 | 兴业转债 | 512,350 | 54,612,341.01 | 6.37 |
| 3 | 113050 | 南银转债 | 447,750 | 53,812,692.68 | 6.28 |
| 4 | 127032 | 苏行转债 | 402,569 | 47,495,410.47 | 5.54 |
| 5 | 110043 | 无锡转债 | 357,380 | 43,459,278.13 | 5.07 |

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

根据本基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

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

为有效控制债券投资的系统性风险，本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目的，适度运用国债期货，提高投资组合的运作效率。在国债期货投资时，本基金将首先分析国债期货各合约价格与最便宜可交割券的关系，选择定价合理的国债期货合约，其次，考虑国债期货各合约的流动性情况，最终确定与现货组合的合适匹配，以达到风险管理的目标。

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 中国银行永续债 01（证券代码 2128019）、杭银转债（证券代码 110079）、南银转债（证券代码 113050）、苏行转债（证券代码 127032）、苏银转债（证券代码 110053）、无锡转债（证券代码 110043）、兴业转债（证券代码 113052）、尧矿能源（证券代码 600188）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 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。

2、杭银转债（证券代码 110079）

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

3、南银转债（证券代码 113050）

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。

4、苏行转债（证券代码 127032）

根据 2021 年 10 月 18 日发布的相关公告，该证券发行人因未依法履行职责被江苏省市场监管局处以罚款、警告，并没收违法所得。

根据 2021 年 12 月 31 日发布的相关公告，该证券发行人因违规经营被淮安银保监分局处以罚款、没收违法所得，并责令改正。

5、苏银转债（证券代码 110053）

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、内部制度不完善等原因，多次受到监管机构的处罚。

6、无锡转债（证券代码 110043）

根据 2021 年 12 月 29 日发布的相关公告，该证券发行人因违反反洗钱法被央行常州市中心支行处以罚款。

7、兴业转债（证券代码 113052）

根据发布的相关公告，该证券发行人在报告期内因违规经营、未依法履行职责、涉嫌违反法律法规等原因，多次受到监管机构的处罚。

8、兖矿能源（证券代码 600188）

根据 2022 年 8 月 9 日发布的相关公告，该证券发行人因产品不合格被济宁市能源局责令改正。

根据 2022 年 8 月 19 日发布的相关公告，该证券发行人因违规经营，违反安全生产行为被济宁市能源局处以罚款、警告，并责令改正。

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。

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 | 69,918.35 |
| 2 | 应收清算款 | 6,823,471.14 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 575,680.09 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 7,469,069.58 |

5.11.4 报告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 | 110079 | 杭银转债 | 66,815,643.73 | 7.80 |
| 2 | 113052 | 兴业转债 | 54,612,341.01 | 6.37 |
| 3 | 113050 | 南银转债 | 53,812,692.68 | 6.28 |
| 4 | 127032 | 苏行转债 | 47,495,410.47 | 5.54 |
| 5 | 110043 | 无锡转债 | 43,459,278.13 | 5.07 |
| 6 | 127022 | 恒逸转债 | 39,408,855.85 | 4.60 |
| 7 | 110053 | 苏银转债 | 32,512,355.51 | 3.79 |
| 8 | 128034 | 江银转债 | 17,759,501.26 | 2.07 |
| 9 | 132015 | 18 中油 EB | 17,188,960.23 | 2.01 |
| 10 | 113042 | 上银转债 | 10,824,630.18 | 1.26 |
| 11 | 128129 | 青农转债 | 10,265,487.67 | 1.20 |
| 12 | 113011 | 光大转债 | 9,681,031.36 | 1.13 |

| | | | | |
|----|--------|----------|--------------|------|
| 13 | 113055 | 成银转债 | 7,530,321.24 | 0.88 |
| 14 | 128048 | 张行转债 | 6,776,219.93 | 0.79 |
| 15 | 113516 | 苏农转债 | 5,776,922.72 | 0.67 |
| 16 | 113037 | 紫银转债 | 5,265,615.10 | 0.61 |
| 17 | 127016 | 鲁泰转债 | 4,137,453.23 | 0.48 |
| 18 | 110076 | 华海转债 | 2,813,867.75 | 0.33 |
| 19 | 120002 | 18 中原 EB | 1,311,585.94 | 0.15 |
| 20 | 110047 | 山鹰转债 | 1,195,061.30 | 0.14 |
| 21 | 128138 | 侨银转债 | 977,770.23 | 0.11 |
| 22 | 127024 | 盈峰转债 | 767,841.55 | 0.09 |
| 23 | 128131 | 崇达转 2 | 758,469.13 | 0.09 |
| 24 | 127027 | 靖远转债 | 591,206.71 | 0.07 |
| 25 | 128083 | 新北转债 | 557,832.76 | 0.07 |
| 26 | 110072 | 广汇转债 | 527,191.82 | 0.06 |
| 27 | 128015 | 久其转债 | 518,128.57 | 0.06 |
| 28 | 113045 | 环旭转债 | 508,067.10 | 0.06 |
| 29 | 110077 | 洪城转债 | 464,890.19 | 0.05 |
| 30 | 123096 | 思创转债 | 445,638.58 | 0.05 |
| 31 | 110059 | 浦发转债 | 445,262.10 | 0.05 |
| 32 | 110068 | 龙净转债 | 404,040.39 | 0.05 |
| 33 | 113519 | 长久转债 | 397,046.41 | 0.05 |
| 34 | 128078 | 太极转债 | 371,128.05 | 0.04 |
| 35 | 113578 | 全筑转债 | 366,378.29 | 0.04 |
| 36 | 127033 | 中装转 2 | 364,897.50 | 0.04 |
| 37 | 128074 | 游族转债 | 363,428.12 | 0.04 |
| 38 | 113563 | 柳药转债 | 358,199.75 | 0.04 |
| 39 | 113608 | 威派转债 | 348,706.52 | 0.04 |
| 40 | 110045 | 海澜转债 | 265,844.47 | 0.03 |
| 41 | 113505 | 杭电转债 | 55,524.13 | 0.01 |
| 42 | 123049 | 维尔转债 | 48,869.89 | 0.01 |
| 43 | 110038 | 济川转债 | 1,114.05 | 0.00 |

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

| | |
|---------------------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 662,450,827.97 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 350,013,031.94 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 336,661,782.94 |
| 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 | 675,802,076.97 |
|-------------|----------------|

§ 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 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过百分之二十的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|-------|----------------|--------------------------------------|----------------|------|---------------|----------------|--------|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 |
| 机构 | 1 | 20220701-20220811, 20220825-20220907 | 154,682,655.35 | - | 20,000,000.00 | 134,682,655.35 | 19.93% |

产品特有风险

本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况,可能会出现集中赎回甚至巨额赎回从而引发基金净值剧烈波动,甚至引发基金的流动性风险,基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请,基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。

注:报告期末持有份额占比按照四舍五入方法保留至小数点后第 2 位。

§ 9 备查文件目录

9.1 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庆债券型证券投资基金设立的文件;
- 3、《招商安庆债券型证券投资基金基金合同》;

- 4、《招商安庆债券型证券投资基金托管协议》；
- 5、《招商安庆债券型证券投资基金招募说明书》；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照。

9.2 存放地点

招商基金管理有限公司

地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

9.3 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

2022 年 10 月 25 日