# 招商安荣灵活配置混合型证券投资基金 2026 年第 3 季度报告

2026 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：中国民生银行股份有限公司

报告送出日期：2026 年 10 月 27 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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 10 月 26 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 2026 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

# §2 基金产品概况

| | | |
|---|---|---|
| 基金简称 | 招商安荣灵活配置混合 | |
| 基金主代码 | 002776 | |
| 交易代码 | 002776 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2018 年 7 月 17 日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 33,856,286.33 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。<br>具体包括：1、资产配置策略；2、股票投资策略；3、债券（不含可转换公司债）投资策略；4、可转换公司债投资策略；5、资产支持证券投资策略；6、权证投资策略；7、期货投资策略。 | |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×80%+中债-综合财富（1-3 年）指数收益率×15%+活期存款基准利率×5% | |
| 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 | 中国民生银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 招商安荣灵活配置混合 A | 招商安荣灵活配置混合 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 002776 | 002777 |

| | | |
|---|---|---|
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 25,791,546.34 份 | 8,064,739.99 份 |

注：根据《招商基金管理有限公司关于旗下部分基金调整业绩比较基准并修订基金合同等法律文件的公告》，本基金业绩比较基准自 2026 年 9 月 21 日起变更为“沪深 300 指数收益率×80%+中债-综合财富（1-3 年）指数收益率×15%+活期存款基准利率×5%”。

# §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（2026 年 7 月 1 日－2026 年 9 月 30 日） | |
|---|---|---|
| | 招商安荣灵活配置混合 A | 招商安荣灵活配置混合 C |
| 1.本期已实现收益 | -6,134,594.79 | -1,785,023.44 |
| 2.本期利润 | -21,919,231.81 | -6,885,953.21 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.8500 | -0.8392 |
| 4.期末基金资产净值 | 57,212,403.23 | 16,480,530.43 |
| 5.期末基金份额净值 | 2.2183 | 2.0435 |

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 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

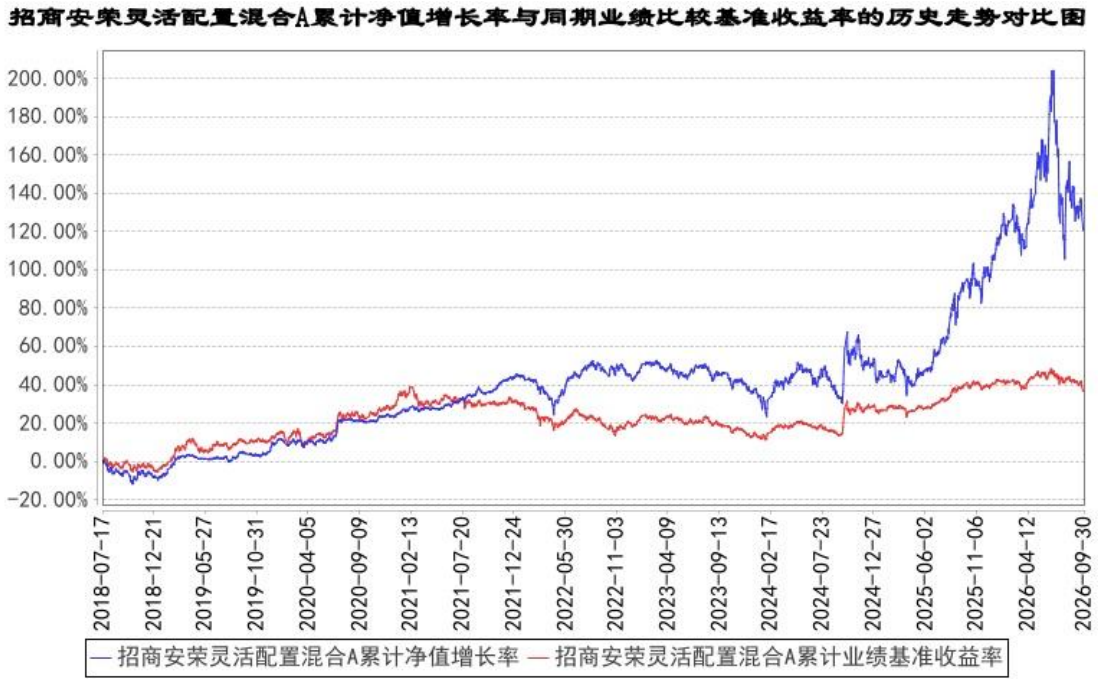
招商安荣灵活配置混合 A

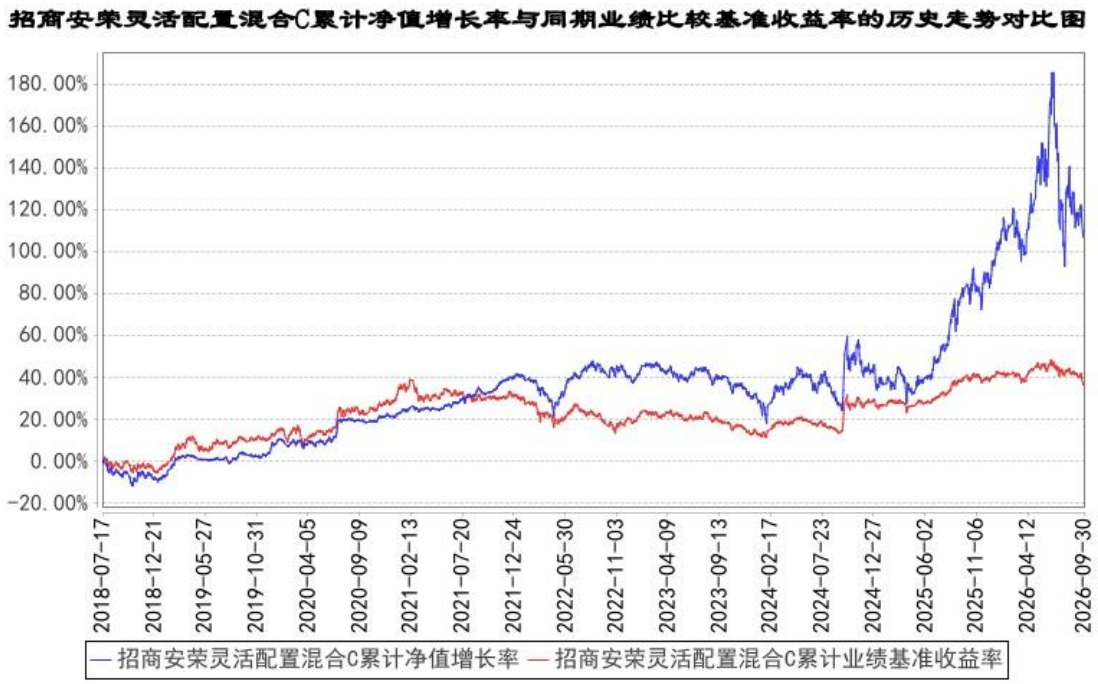
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | -27.47% | 2.92% | -6.83% | 0.68% | -20.64% | 2.24% |
| 过去六个月 | 4.44% | 2.77% | -0.74% | 0.66% | 5.18% | 2.11% |
| 过去一年 | 14.35% | 2.30% | -2.01% | 0.58% | 16.36% | 1.72% |
| 过去三年 | 50.80% | 1.74% | 15.85% | 0.57% | 34.95% | 1.17% |
| 过去五年 | 62.79% | 1.40% | 5.62% | 0.56% | 57.17% | 0.84% |
| 过去七年 | 111.98% | 1.21% | 25.50% | 0.58% | 86.48% | 0.63% |
| 自基金合同生效起至今 | 120.43% | 1.14% | 37.12% | 0.60% | 83.31% | 0.54% |

招商安荣灵活配置混合 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 | -27.62% | 2.92% | -6.83% | 0.68% | -20.79% | 2.24% |
| 过去六个月 | 4.02% | 2.77% | -0.74% | 0.66% | 4.76% | 2.11% |
| 过去一年 | 13.44% | 2.30% | -2.01% | 0.58% | 15.45% | 1.72% |
| 过去三年 | 47.22% | 1.74% | 15.85% | 0.57% | 31.37% | 1.17% |
| 过去五年 | 56.39% | 1.40% | 5.62% | 0.56% | 50.77% | 0.84% |
| 过去七年 | 100.40% | 1.21% | 25.50% | 0.58% | 74.90% | 0.63% |
| 自基金合同生效起至今 | 106.62% | 1.14% | 37.12% | 0.60% | 69.50% | 0.54% |

### 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






注：根据《招商基金管理有限公司关于旗下部分基金调整业绩比较基准并修订基金合同等法律文件的公告》，本基金业绩比较基准自 2026 年 9 月 21 日起变更为“沪深 300 指数收益率×80%+中债-综合财富（1-3 年）指数收益率×15%+活期存款基准利率×5%”。

# §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 | | |
| 程泉璋 | 本基金基金经理 | 2025 年 7 月 14 日 | - | 9 | 男，学士。2017 年 6 月加入招商基金管理有限公司，曾任固定收益投资部研究员，曾任招商瑞和 1 年持有期混合型证券投资基金基金经理，现任招商享利增强债券型证券投资基金、招商安德灵活配置混合型证券投资基金、招商安荣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、招商安拓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中国证监会《证券基金经营机构董事、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，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%的交易共有 16 次，为旗下指数及量化等组合因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 报告期内基金投资策略和运作分析

宏观经济回顾：

2026 年三季度，经济增速较上半年进一步放缓，总体延续外需偏强、内需偏弱、结构分化加深的特征。投资方面，8 月固定资产投资完成额累计同比为-7.2%，投资增速较上半年明显走弱，其中地产投资继续探底，8 月房地产开发投资累计同比为-19.9%，仍是总需求的主要拖累，基建投资增速也边际放缓，8 月基建投资累计同比为-4%，显示地方政府主导的实物工作量释放仍偏慢，制造业投资同样回落，8 月制造业投资累计同比为-2.3%，传统

制造业扩产意愿偏弱。消费方面，8 月社会消费品零售总额累计同比为 1.1%，较上半年进一步走弱，商品消费受汽车和地产后周期品类拖累更为明显。对外贸易方面，出口表现较为突出，8 月出口金额累计同比为 19.3%，增速较上半年仍有抬升，对整体经济增长形成支撑。

权益市场回顾：

A 股方面，2026 年三季度市场大幅回调、风格高低切换明显，二季度非常极致的科技上涨行情之后，市场变得较为脆弱，市场风格分化较二季度急剧逆转，大盘价值显著跑赢小盘成长，前期跌幅较多的红利以及微盘股指数小幅反弹。七月美联储鹰派立场持续发酵、AI 产业链获利盘集中涌出，叠加中报季部分业绩验证不及前期最乐观预期，TMT 方向遭遇系统性杀估值，煤炭、石油石化等资源红利方向逆势走强。八月超跌后市场迎来修复性反弹，电子、通信板块月内反弹较多，但高度有限。九月市场再度走弱，美联储加息预期升温压制风险偏好，科技方向二次探底，资金持续向高股息、低估值板块迁移，银行、公用事业等防御板块获持续增持。整体来看，由于中东局势冲突、高油价和海外 AI 持续投入，美联储加息的背景下，三季度 A 股由“AI 产业趋势”主导切换为“红利防御”主导。前期拥挤的算力、半导体方向经历深度估值消化，资源红利成为新的避风港。分板块看，三季度银行、煤炭、农林牧渔和石油石化板块涨幅居前；电子、通信、建材和电力设备及新能源板块跌幅居前。

港股方面，2026 年三季度先扬后抑、震荡企稳，整体呈“七月反弹、八月放缓、九月震荡走弱”格局。受到科技行情、A 股行情以及美联储货币政策的多重影响，也出现了比较极致的分化。行业层面半导体、消费电子方向受 A 股科技拖累再度承压，但传统互联网龙头凭借业绩超预期与南向持续增持展现韧性，金融、能源等价值板块获资金青睐。

可转债方面，三季度转债市场跟随权益大幅调整，明显弱于二季度表现。双低指数与高价科技转债跌幅居前，结构分化延续。风格上高评级、大盘、偏债型转债显著抗跌。供给端三季度新券上市明显提速，七月单月新券上市数量创两年多来的新高，强赎与到期退市节奏放缓，转债存量压降趋势边际企稳，审批持续提速。估值层面，高波区科技转债估值挤压最为充分，但整体估值仍处于历史偏高分位数水平。

基金操作：

本基金为灵活配置基金，在债券收益率的配置价值未达明显吸引力前，资产结构主要以权益资产为主。目前及未来相当长时间的市场和世界中，传统生产要素的切换持续影响着经济结构；地缘冲突、事件冲突发生的概率越来越高；市场资产价格的传导与传统经济框架的背离持续发生。本基金权益资产的仓位、板块及个股选择主要以量价系统进行动态调整，持续优化量价策略，努力在百年未有之大变局中，跟随市场而非以自身主观认知判断进行择股、择时。

值得注意的是，与上半年相比目前的全球宏观格局更加复杂。美联储的预期管理、长端美债利率的阶段性顶点、能源价格的中枢、地缘冲突的持续性等重要因素依旧处于模糊阶段，对于全球主要经济体们的影响仍然巨大。其中的每一个宏观问题牵扯着若干个系统性问题，

我们没有办法准确预测此类问题会以何种路径解决，但可以确定的是所有大类资产的波动率都将同步抬升，我们将同步降低高波动率板块的风险敞口。人性天然对于此类不可控、不可线性预知的问题产生厌恶、抵触，但这也总是超额收益的主要来源。我们将在相对可预期的范围、要点内进一步做好研究准备：原油价格可能会下降、海外高利率可能会下行、地缘冲突可能会解决、技术可能会普及，本基金有足够的空间与条件享受到此类自上而下的红利，主观上我们可以保持耐心、保持学习，争取在市场环境改善时在场。

### 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-27.47%，同期业绩基准增长率为-6.83%，C 类份额净值增长率为-27.62%，同期业绩基准增长率为-6.83%。

### 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

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 | 47,548,556.44 | 64.25 |
| | 其中：股票 | 47,548,556.44 | 64.25 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 4,465,813.16 | 6.03 |
| | 其中：债券 | 4,465,813.16 | 6.03 |
| | 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 | 15,296,411.42 | 20.67 |
| 8 | 其他资产 | 6,695,953.68 | 9.05 |
| 9 | 合计 | 74,006,734.70 | 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 | 5,458,203.00 | 7.41 |
| C | 制造业 | 30,619,174.44 | 41.55 |
| 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 | 3,106,763.00 | 4.22 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 2,567,440.00 | 3.48 |
| J | 金融业 | 5,796,976.00 | 7.87 |
| 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 | 47,548,556.44 | 64.52 |

### 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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

### 5.3.1 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 | 002475 | 立讯精密 | 65,100 | 3,217,893.00 | 4.37 |
| 2 | 600989 | 宝丰能源 | 120,300 | 2,701,938.00 | 3.67 |
| 3 | 601988 | 中国银行 | 398,000 | 2,678,540.00 | 3.63 |
| 4 | 002156 | 通富微电 | 47,000 | 2,674,300.00 | 3.63 |
| 5 | 688008 | 澜起科技 | 12,834 | 2,596,446.54 | 3.52 |
| 6 | 600941 | 中国移动 | 26,800 | 2,567,440.00 | 3.48 |
| 7 | 601138 | 工业富联 | 42,700 | 2,485,140.00 | 3.37 |
| 8 | 603986 | 兆易创新 | 6,400 | 2,264,960.00 | 3.07 |
| 9 | 601872 | 招商轮船 | 104,300 | 2,101,645.00 | 2.85 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 10 | 600150 | 中国船舶 | 51,613 | 2,018,068.30 | 2.74 |

## 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 | 4,465,813.16 | 6.06 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 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） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 4,465,813.16 | 6.06 |

## 5.5 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 | 019827 | 26 国债 01 | 35,000 | 3,530,299.45 | 4.79 |
| 2 | 019792 | 25 国债 19 | 5,000 | 506,685.34 | 0.69 |
| 3 | 019786 | 25 国债 14 | 4,240 | 428,828.37 | 0.58 |

## 5.6 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序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。

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

## 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

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。

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

### 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

本报告期内，本基金投资国债期货符合既定的投资政策和投资目的。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中，立讯精密工业股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家市场监督管理总局的处罚。宁夏宝丰能源集团股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到宁东镇人民政府、宁夏回族自治区宁东能源化工基地管理委员会、宁夏宁东能源化工基地市场监督管理局的处罚。中国银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。通富微电子股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中华人民共和国南通海关的处罚。澜起科技股份有限公司在报告期内被韩国首尔中央地方检察厅公平贸易调查部立案调查。招商局能源运输股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到上海证监局、上海证券交易所的处罚。

本基金对上述主体所发行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。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 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 | 90,530.31 |
| 2 | 应收证券清算款 | 6,593,942.40 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 10,248.06 |
| 6 | 其他应收款 | 1,232.91 |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 6,695,953.68 |

### 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 | 招商安荣灵活配置混合 A | 招商安荣灵活配置混合 C |
|---|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 26,197,003.46 | 9,052,734.36 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 1,111,931.43 | 1,106,131.03 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 1,517,388.55 | 2,094,125.40 |
| 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 | 25,791,546.34 | 8,064,739.99 |

## §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

单位：份

| 项目 | 份额 |
| --- | --- |
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 10,434,086.95 |
| 报告期期间买入/申购总份额 | - |
| 报告期期间卖出/赎回总份额 | - |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | 10,434,086.95 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 30.82 |

### 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 20%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 | 20260701-20260930 | 10,434,086.95 | - | - | 10,434,086.95 | 30.82% |
| 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：1、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；

2、申购份额包含申购、定期定额投资、转换转入、红利再投资或者买入等业务增加的份额，赎回份额包含赎回、转换转出或者卖出等业务减少的份额。

## §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荣灵活配置混合型证券投资基金设立的文件；

3、《招商安荣灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；

4、《招商安荣灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；

5、《招商安荣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。

## 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。

客户服务电话：400-887-9555

网址：http://www.cmfchina.com

招商基金管理有限公司

2026 年 10 月 27 日