

长安裕腾灵活配置混合型证券投资基金

2024年第3季度报告

2024年09月30日

基金管理人:长安基金管理有限公司

基金托管人:中国农业银行股份有限公司

报告送出日期:2024年10月25日

目录

| | |
|--|----|
| §1 重要提示 | 3 |
| §2 基金产品概况 | 3 |
| §3 主要财务指标和基金净值表现 | 5 |
| 3.1 主要财务指标 | 5 |
| 3.2 基金净值表现 | 6 |
| §4 管理人报告 | 8 |
| 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介 | 8 |
| 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 公平交易专项说明 | 8 |
| 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析 | 9 |
| 4.5 报告期内基金的业绩表现 | 10 |
| 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明 | 10 |
| §5 投资组合报告 | 10 |
| 5.1 报告期末基金资产组合情况 | 10 |
| 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 10 |
| 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 | 11 |
| 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合 | 12 |
| 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 | 12 |
| 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 | 12 |
| 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 | 13 |
| 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 | 13 |
| 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 | 13 |
| 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 13 |
| 5.11 投资组合报告附注 | 13 |
| §6 开放式基金份额变动 | 14 |
| §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况 | 14 |
| 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况 | 14 |
| 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细 | 14 |
| §8 影响投资者决策的其他重要信息 | 14 |
| 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 | 14 |
| 8.2 影响投资者决策的其他重要信息 | 14 |
| §9 备查文件目录 | 15 |
| 9.1 备查文件目录 | 15 |
| 9.2 存放地点 | 15 |
| 9.3 查阅方式 | 15 |

§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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024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，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新和重要提示。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2024年7月1日起至2024年9月30日止。

§2 基金产品概况

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 长安裕腾混合 |
| 基金主代码 | 005588 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2018年06月06日 |
| 报告期末基金份额总额 | 100,157,314.12份 |
| 投资目标 | 在严格控制风险和保持流动性的前提下，把握中国资本市场开放带来的投资机会，精选具有价值优势的上市公司进行投资，追求基金资产的长期稳健增值。 |
| 投资策略 | <p>本基金投资策略包括五大方面，即大类资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略和衍生品投资策略。</p> <p>（一）大类资产配置策略</p> <p>本基金的大类资产配置采用“自上而下”的多因素分析决策支持系统，结合定性分析和定量分析，确定基金资产在股票、债券及货币市场工具等类别资产的配置比例，并随着各类证券风险收益特征的相对变化动态调整配置比例，以平衡投资组合的风险和收益。本基金进行大类资产配置时，重点考察宏观经济状况、政府政策和资本市场等三方面的因素。</p> <p>（二）股票投资策略</p> <p>本基金A股和港股通股票采用同一投资策略，均按照以下策</p> |

略进行投资，以更好发挥基金管理人的投资优势。在A股和港股通股票的投资上，基金管理人坚持价值投资理念，自下而上精选个股。通过案头分析和实地调研，进行深入的基本面研究，分析不同类型企业的价值驱动因素，估算其内在价值，密切关注其价值实现的方式和时机，综合考虑可能影响企业价值及市场价格的因素，把握投资时机，投资于同时具有内在价值优势和估值优势的公司，并根据市场价格的变化和价值的实现程度，把握更为确定的投资机会，以更好控制风险，实现基金资产的长期稳健增值。

（三）债券投资策略

1、普通债券投资策略

本基金在分析宏观经济走势、财政货币政策的前提下，进行积极主动的债券投资，以实现在一定程度上规避股票市场的系统性风险、提高基金投资组合整体收益的目的。

2、可转换债券投资策略

本基金在综合分析可转换债券的股性特征、债性特征、流动性等因素的基础上，采用数量化估值工具评定其投资价值，选择安全边际较高、发行条款相对优惠、流动性良好以及基础股票基本面优良的品种进行投资。

（四）资产支持证券投资策略

本基金将通过分析市场利率、发行条款、资产池结构及其资产池所处行业的景气变化和提前偿还率等影响资产支持证券价值的相关要素，并综合运用久期管理、收益率曲线变动分析和收益率利差分析等方法，在严格控制风险的情况下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益较高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

（五）衍生品投资策略

1、股指期货投资策略

本基金将在风险可控的前提下，本着谨慎原则，以套期保值为主要目的，适度参与股指期货投资。本基金管理人将根据持有的股票投资组合状况，通过对现货和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货定价模型对其估值水平合理性的评估，并通过与现货资产进行匹配，选择合适的投资时机，采用多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

2、国债期货投资策略

本基金主要利用国债期货管理债券组合的久期、流动性和风险水平。

3、权证投资策略

| | | |
|-----------------|--|----------------|
| | 本基金对权证的投资以对冲下跌风险、实现保值和锁定收益为主要目的。 | |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数收益率*50%+中债综合全价指数收益率*30%+恒生综合指数收益率*20% | |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。 本基金除了投资A股外，还可投资港股通股票，因此本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。 | |
| 基金管理人 | 长安基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国农业银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 长安裕腾混合A | 长安裕腾混合C |
| 下属分级基金的交易代码 | 005588 | 005592 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 9,507,269.82份 | 90,650,044.30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(2024年07月01日 - 2024年09月30日) | |
|----------------|--------------------------------|----------------|
| | 长安裕腾混合A | 长安裕腾混合C |
| 1.本期已实现收益 | 27,259.70 | 195,869.44 |
| 2.本期利润 | 20,612.55 | 149,883.70 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0019 | 0.0015 |
| 4.期末基金资产净值 | 10,790,278.85 | 100,884,164.96 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.1350 | 1.1129 |

- 1、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。
- 2、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。
- 3、对期末可供分配利润，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。

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

长安裕腾混合A净值表现

| 阶段 | 净值增长率① | 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 | 0.23% | 0.04% | 11.69% | 0.99% | -11.46% | -0.95% |
| 过去六个月 | 0.12% | 0.07% | 12.42% | 0.80% | -12.30% | -0.73% |
| 过去一年 | 0.91% | 0.07% | 9.33% | 0.75% | -8.42% | -0.68% |
| 过去三年 | 5.83% | 0.05% | -9.60% | 0.80% | 15.43% | -0.75% |
| 过去五年 | 14.80% | 0.04% | 5.75% | 0.83% | 9.05% | -0.79% |
| 自基金合同生效起至今 | 13.50% | 0.31% | 3.01% | 0.85% | 10.49% | -0.54% |

本基金整体业绩比较基准构成为：沪深300指数收益率*50%+中债综合全价指数收益率*30%+恒生综合指数收益率*20%

长安裕腾混合C净值表现

| 阶段 | 净值增长率① | 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 | 0.17% | 0.04% | 11.69% | 0.99% | -11.52% | -0.95% |
| 过去六个月 | 0.02% | 0.07% | 12.42% | 0.80% | -12.40% | -0.73% |
| 过去一年 | 0.70% | 0.07% | 9.33% | 0.75% | -8.63% | -0.68% |
| 过去三年 | 5.19% | 0.05% | -9.60% | 0.80% | 14.79% | -0.75% |
| 过去五年 | 13.64% | 0.04% | 5.75% | 0.83% | 7.89% | -0.79% |
| 自基金合同生效起至今 | 11.29% | 0.31% | 3.01% | 0.85% | 8.28% | -0.54% |

本基金整体业绩比较基准构成为：沪深300指数收益率*50%+中债综合全价指数收益率*30%+恒生综合指数收益率*20%

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

长安裕腾混合A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2018年06月06日-2024年09月30日)



根据基金合同的规定,自基金合同生效之日起6个月内基金各项资产配置比例需符合基金合同要求。本基金在建仓期结束后,各项资产配置比例已符合基金合同有关投资比例的约定。基金合同生效日至报告期末,本基金运作时间已满一年。图示日期为2018年06月06日至2024年09月30日。

长安裕腾混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2018年06月06日-2024年09月30日)



根据基金合同的规定,自基金合同生效之日起6个月内基金各项资产配置比例需符合基金合同要求。本基金在建仓期结束后,各项资产配置比例已符合基金合同有关投资比例的约定。基金合同生效日至报告期末,本基金运作时间已满一年。图示日期为2018年06月06日至2024年09月30日。

§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 | | |
| 孟楠 | 本基金的基金经理 | 2023-05-26 | - | 11年 | 法律硕士。曾任东证融汇证券资产管理有限公司（原东北证券股份有限公司上海分公司）投研助理、投资经理助理及投资主办等职。现任长安基金管理有限公司固定收益部基金经理。 |

- 1、任职日期和离任日期均指公司做出决定后正式对外公告之日；
- 2、证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人树立价值投资理念，设置合理的组织架构和科学的投资决策体系，确保投资、研究、交易各个环节的独立性。同时，建立健全公司适用的投资对象备选库和交易对手备选库，共享研究成果，在确保投资组合间的信息隔离与保密的情况下，保证建立信息公开、资源共享的公平投资管理环境。

公司建立了专门的公平交易制度，并在交易系统中采用公平交易模块，保证公平交易的严格执行。对异常交易的监控包括事前、事中和事后三个环节，并经过严格的报告和审批程序，防范和控制异常交易。

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《长安基金管理有限公司公平交易管理办法》的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度，央行两度超预期降息，同时持续丰富货币政策工具箱，设立临时隔夜正、逆回购工具，开展国债借入并卖出国债，正式开展公开市场国债买卖操作等。资金面整体较为平稳，流动性分层不大，存单利率先下后上，期初期末收益率基本持平。利率债市场先下后上，整体波动较大。7月上半月，受经济修复仍然偏弱、通胀低位等因素影响，债券收益率呈现缓慢下行的震荡走势。7月下旬，央行调降公开市场政策利率，同时银行存款利率也有所下调，带动收益率快速下行，短端下行幅度更大，期限利差走阔。进入8月，上半月受政策利率下调、经济数据欠佳等因素影响，债券收益率延续下行趋势，并突破前期低点，下行至年内低位。但下半月，随着央行对超长端债券风险的提示及机构止盈需求的增加，债券收益率从低位反弹，短端上行幅度更大，收益率曲线走平，期限利差收窄。9月5日，央行在国新办新闻发布会上明确降准还有空间，期间叠加存量房贷利率下调预期增强，发布的8月金融数据疲弱，市场对后续货币政策宽松预期上升，机构单边做多，利率不断下行，10年期国债收益率最低触及2.0%附近。直至9月24日，央行宣布降准降息落地后，此前一直抢跑的利率点位有了明显回调。9月末央行、金融监管总局、证监会出台了多项金融支持实体经济的强力政策，市场风险偏好升高，股市走牛，十年期国债利率开始强力回弹，短期内一度升至2.25%点位，后在9月30日回落至2.15%，回到了月初的区间水平上。

信用债收益率走势波动更大，7月初延续下行趋势，这主要是由配置力量所带动。跨季之后，理财规模有所回升，广义基金的增持促使信用债收益率下行。在低利率的环境当中，票息策略得以延续，信用债的久期策略和下沉策略极致演绎，低等级、中长久期品种下行幅度更大。8月以来，受大行卖债、交易商协会调查国债违规交易等因素影响，债券收益率低位反弹，流动性偏弱的信用债市场调整时长和幅度明显高于利率债，信用利差全面走扩，尤其是3-5年期品种。前期信用利差极致压缩，利差保护空间不足，进而放大估值波动。9月末多项支持实体经济的强力政策发布后，基本面预期有转向的可能性，市场风险偏好升温，理财、基金抛售债券，信用债剧烈回调，超长债和信用债跌幅居前。

三季度末权益市场迎来罕见反转，一举扭转了7月至9月中旬缩量下跌的颓势。回顾反转前，A股交易冷清，经济数据走弱，增量政策如家电补贴、地方专项债审批加速等并未能给市场带来变化，风格上高分红板块整体回调。直至9月下旬，各部门先后出台对于实体经济支持的各种举措，特别是在央行联合金融监管总局和证监会的发布会上，降低存款准备金率和政策利率、降低存量房贷利率和统一房贷最低首付比例、创设新的货币政策工具支持股票市场稳定发展三项举措，为A股市场注入了强心剂。转债市场同样跟随权益大幅反转，风险得以缓释，投资逻辑转变，反转过后的转债市场，部分面临回售、清偿压力的转债得以喘息，同时伴随着权益资产的火热，转债放量上涨。

整体来看，基于对市场的判断，本产品纯债部分在2024年三季度增配了短久期信用债，致力于获取安全稳健的票息收益。在7-8月市场下跌过程中减持了转债及股票仓位，权益部分个券持仓较为分散，以银行、保险等高股息标的为主。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末长安裕腾混合A基金份额净值为1.1350元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.23%，同期业绩比较基准收益率为11.69%；截至报告期末长安裕腾混合C基金份额净值为1.1129元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.17%，同期业绩比较基准收益率为11.69%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金无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 | 2,835,620.00 | 2.52 |
| | 其中：股票 | 2,835,620.00 | 2.52 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 92,643,894.67 | 82.27 |
| | 其中：债券 | 92,643,894.67 | 82.27 |
| | 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 | -5,791.78 | -0.01 |
| | 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 | 6,979,105.82 | 6.20 |
| 8 | 其他资产 | 10,150,032.91 | 9.01 |
| 9 | 合计 | 112,602,861.62 | 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

| 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 | 388,800.00 | 0.35 |

| | | | |
|---|------------------|--------------|------|
| C | 制造业 | 814,720.00 | 0.73 |
| 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 | - | - |
| 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 | 1,632,100.00 | 1.46 |
| 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 | 2,835,620.00 | 2.54 |

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

| 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 | 600036 | 招商银行 | 20,000 | 752,200.00 | 0.67 |
| 2 | 300308 | 中际旭创 | 4,000 | 619,440.00 | 0.55 |
| 3 | 601318 | 中国平安 | 10,000 | 570,900.00 | 0.51 |
| 4 | 601398 | 工商银行 | 50,000 | 309,000.00 | 0.28 |

| | | | | | |
|---|--------|------|--------|------------|------|
| 5 | 600489 | 中金黄金 | 15,000 | 228,000.00 | 0.20 |
| 6 | 600362 | 江西铜业 | 8,000 | 195,280.00 | 0.17 |
| 7 | 601808 | 中海油服 | 10,000 | 160,800.00 | 0.14 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 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 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 10,207,049.18 | 9.14 |
| | 其中：政策性金融债 | 10,207,049.18 | 9.14 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | 47,567,061.24 | 42.59 |
| 6 | 中期票据 | 28,803,569.18 | 25.79 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 6,066,215.07 | 5.43 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 92,643,894.67 | 82.96 |

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

| 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 | 132480002 | 24水发集团GN001 | 100,000 | 10,361,963.93 | 9.28 |
| 2 | 102480136 | 24津城建MTN004 | 100,000 | 10,319,680.87 | 9.24 |
| 3 | 012480095 | 24曲江金融SCP001 | 100,000 | 10,294,327.87 | 9.22 |
| 4 | 012480312 | 24陕建集团SCP001(科创票据) | 100,000 | 10,215,076.50 | 9.15 |
| 5 | 092218005 | 22农发清发05 | 100,000 | 10,207,049.18 | 9.14 |

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

本基金本报告期内未进行股指期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未进行国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2 报告期内本基金投资前十名股票中不存在超出合同规定备选股票库之外的情况。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | 6,388.33 |
| 2 | 应收证券清算款 | 9,588,765.42 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 554,879.16 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 10,150,032.91 |

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 | 110059 | 浦发转债 | 2,493,239.18 | 2.23 |
| 2 | 113052 | 兴业转债 | 1,641,889.73 | 1.47 |
| 3 | 113037 | 紫银转债 | 863,094.79 | 0.77 |
| 4 | 113056 | 重银转债 | 537,754.11 | 0.48 |

| | | | | |
|---|--------|------|------------|------|
| 5 | 127083 | 山路转债 | 530,237.26 | 0.47 |
|---|--------|------|------------|------|

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限股票。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，本报告中涉及比例计算的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

| | 长安裕腾混合A | 长安裕腾混合C |
|-------------------------------|---------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 11,488,472.41 | 105,461,064.62 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 108,134.23 | 2,128,935.40 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 2,089,336.82 | 16,939,955.72 |
| 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 | 9,507,269.82 | 90,650,044.30 |

总申购份额包含红利再投、转换入份额，总赎回份额包含转换出份额。

§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，基金管理人未申购或赎回本基金。

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，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§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

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额达到或超过20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、《长安裕腾灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长安裕腾灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《长安裕腾灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内披露的各项公告。

9.2 存放地点

上海市浦东芳甸路1088号紫竹国际大厦16楼。

9.3 查阅方式

投资者可到基金管理人、基金托管人的办公场所或基金管理人网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本管理人。

咨询电话：400-820-9688

公司网址：www.cafund.com。

长安基金管理有限公司

2024年10月25日