

长安裕盛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:兴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 | 6 |
| 3.1 主要财务指标 | 6 |
| 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 | 9 |
| 4.3 公平交易专项说明 | 9 |
| 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 | 11 |
| 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 | 12 |
| 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 | 12 |
| 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 | 12 |
| 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 | 12 |
| 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 12 |
| 5.11 投资组合报告附注 | 13 |
| §6 开放式基金份额变动 | 13 |
| §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 | 14 |
| 9.1 备查文件目录 | 14 |
| 9.2 存放地点 | 14 |
| 9.3 查阅方式 | 14 |

§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。

基金托管人兴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 | 长安裕盛混合 |
| 基金主代码 | 005343 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2017年11月29日 |
| 报告期末基金份额总额 | 635,939,336.76份 |
| 投资目标 | 通过个股精选和资产配置，在严格控制风险和保持流动性的前提下，追求基金资产的长期稳健增值。 |
| 投资策略 | <p>本基金投资策略主要包括三大方面，即大类资产配置策略、股票投资策略和债券投资策略。</p> <p>（一）大类资产配置策略</p> <p>相对于债券和货币市场工具，股票资产波动较大，风险较大，但潜在收益相对较高，在大类资产配置上，本基金着力把握股票市场的投资机会，优先配置满足股票投资标准的个股，其余资产配置于债券或货币市场工具。在基金管理人通过定性和定量分析认为股票市场风险较大、满足投资标准的个股较少或投资组合中的个股已不适合继续持有时，将降低股票资产的配置比例或将全部资产投资于债券或货币市场工具。同时，本基金将从重点关注大陆和香港股票市场的资金供求、投资者构成、市场情绪、流动性和不同市场的相对估值等指标，在基金合同约定的范围内，调整A股和港股通股票</p> |

的配置比例。

（二）股票投资策略

在不同的经济发展阶段和发展周期、不同的行业环境、不同的市场中，总是有一些个股凭借其基本面优势、事件性因素或估值优势等，实现较好的回报。因此，本基金A股和港股通股票的投资策略，主要采用自下而上的个股精选策略。

基金管理人坚持价值投资理念，通过案头分析和实地调研，对个股进行深入的基本面研究，分析不同企业的业务发展模式、进入壁垒、行业地位、产品线、营销渠道、研发实力、管理能力及资产价值和结构等价值驱动或决定因素，结合经济发展情况、所处行业的景气度等因素，评估个股的内在投资价值，并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内在投资价值及市场价格的因素，把握投资时机，投资于具有内在价值优势和估值优势的公司。同时，根据市场价格的变化和价值的实现程度，选择卖出时机，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

本基金将通过分析利率变动趋势及市场信用环境变化方向，综合考虑不同债券品种的收益率水平、流动性、税赋特点、信用风险等因素，精选安全边际较高的个券进行投资，以获取债券市场的长期稳健收益。

2、可转债投资策略

本基金在综合分析可转债的股性特征、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。

3、中小企业私募债投资策略

本基金将根据审慎原则，密切跟踪中小企业私募债的信用风险变化和流动性情况，通过对中小企业私募债进行信用评级控制，通过对投资单只中小企业私募债的比例限制，严格控制风险，并充分考虑单只中小企业私募债对基金资产流动性造成的影响，通过信用研究和流动性管理后，决定投资品种。

（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

| | |
|--------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| | <p>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。</p> <p>（五）衍生品投资策略</p> <p>1、股指期货投资策略</p> <p>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。</p> <p>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。本基金还将利用股指期货作为组合流动性管理工具，降低现货市场流动性不足导致的冲击成本过高的风险，提高基金的建仓或变现效率。</p> <p>2、国债期货投资策略</p> <p>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。基金管理人将根据法律法规的规定，以套期保值为主要目的，结合对宏观经济运行情况和政策趋势的分析，预测债券市场变动趋势。基金管理人通过对国债期货的流动性、波动水平、风险收益特征、国债期货和现货基差、套期保值的有效性等指标进行持续跟踪，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。</p> <p>3、权证投资策略</p> <p>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。本基金在权证投资中综合考虑股票合理价值、标的股票价格，结合权证定价模型、市场供求关系、交易制度设计等多种因素估计权证合理价值，采用杠杆交易策略、看跌保护组合策略、保护组合成本策略、获利保护策略、买入跨式投资等策略达到改善组合风险收益特征的目的。</p> |
| 业绩比较基准 | <p>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%</p> |
| 风险收益特征 | <p>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。</p> <p>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。</p> |
| 基金管理人 | <p>长安基金管理有限公司</p> |

| | | |
|-----------------|----------------|-----------------|
| 基金托管人 | 兴业银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 长安裕盛混合A | 长安裕盛混合C |
| 下属分级基金的交易代码 | 005343 | 005344 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 65,841,531.45份 | 570,097,805.31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) | |
|----------------|--------------------------------|----------------|
| | 长安裕盛混合A | 长安裕盛混合C |
| 1.本期已实现收益 | -364,024.89 | -3,170,391.29 |
| 2.本期利润 | 6,684,607.76 | 56,209,946.44 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0969 | 0.0908 |
| 4.期末基金资产净值 | 37,817,371.18 | 323,400,977.64 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.5744 | 0.5673 |

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

长安裕盛混合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 | 21.75% | 2.41% | 11.69% | 0.99% | 10.06% | 1.42% |
| 过去六个月 | 0.30% | 2.13% | 12.42% | 0.80% | -12.12% | 1.33% |
| 过去一年 | -7.93% | 2.26% | 9.33% | 0.75% | -17.26% | 1.51% |

| | | | | | | |
|------------|---------|-------|--------|-------|---------|-------|
| 过去三年 | -50.61% | 2.28% | -9.60% | 0.80% | -41.01% | 1.48% |
| 过去五年 | -44.12% | 1.96% | 5.75% | 0.83% | -49.87% | 1.13% |
| 自基金合同生效起至今 | -42.56% | 1.73% | 2.12% | 0.84% | -44.68% | 0.89% |

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%

长安裕盛混合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 | 21.69% | 2.41% | 11.69% | 0.99% | 10.00% | 1.42% |
| 过去六个月 | 0.23% | 2.12% | 12.42% | 0.80% | -12.19% | 1.32% |
| 过去一年 | -8.07% | 2.26% | 9.33% | 0.75% | -17.40% | 1.51% |
| 过去三年 | -50.82% | 2.28% | -9.60% | 0.80% | -41.22% | 1.48% |
| 过去五年 | -44.56% | 1.96% | 5.75% | 0.83% | -50.31% | 1.13% |
| 自基金合同生效起至今 | -43.27% | 1.73% | 2.12% | 0.84% | -45.39% | 0.89% |

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

长安裕盛混合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
(2017年11月29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期末,本基金运作时间超过一年。图示日期为2017年11月29日至2024年09月30日。

长安裕盛混合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
(2017年11月29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期末,本基金运作时间超过一年。图示日期为2017年11月29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 | | |
| 袁苇 | 本基金的基金经理 | 2021-07-07 | - | 14年 | 经济学硕士。曾任东海证券股份有限公司自营分公司、立溢股权投资中心、华泰资产管理有限公司、太平资产管理有限公司的权益投资经理等职。现任长安基金管理有限公司权益投资部基金经理。 |

- 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合规守信情况的说明

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

“金九银十”传统旺季和“以旧换新”政策推动下，9月新能源汽车产销双旺，动力电池产销同环比保持增长。根据乘联会数据，9月新能源乘用车零售112.3万辆，同比增长50.9%，环比增长9.6%，零售渗透率达53.3%，同比增加16.4个百分点。据电池联盟发布，9月中国动力电池装车量同比增长49.6%达54.5GWh，今年前三季度动力电池累计装机量同比增长35.6%达346.6GWh。新能源乘用车市场持续扩大，消费者对新能源汽车的接受度和需求不断上升。

马斯克正式发布了名为Cybercab的无人驾驶出租车（Robotaxi）、无人驾驶货车Robovan，人形机器人Optimus。其中Cybercab没有方向盘和油门刹车踏板。这标志着汽车行业的竞争阶段已由电动化竞争时代升级到全智能化竞争时代。FSD入华和ADS3.0上车后，全路况端到端的自动驾驶技术或将给新能源汽车的渗透率注入新的强劲推力。固态电池技术继续向前发展。低空经济和人形机器人仍是潜在增长点。

锂矿供给端将在本轮期货和现货下探过程中进一步倒逼产能去化，原有部分高成本旧产能和在扩在建新产能都可能在压力下面临重新再考量的境地。新能源板块对未来利空预期在风险补偿上已基本充分反应，在剔除指数风险后，任何边际上超预期的微小变化都可能带来一波像样的行情。智能化是建立在电动化的基石之上，锂电池的长逻辑依然没变，并且各种增量逻辑愈发清晰明朗，考虑到股价表现在过往历史上大幅领先碳酸锂价格筑底数月，看好新能源汽车上游原材料在未来的表现。在配置上继续重点关注以锂矿为代表的新能源汽车产业链上游。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末长安裕盛混合A基金份额净值为0.5744元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为21.75%，同期业绩比较基准收益率为11.69%；截至报告期末长安裕盛混合C基金份额净值为0.5673元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为21.69%，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 | 335,167,485.24 | 88.67 |
| | 其中：股票 | 335,167,485.24 | 88.67 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 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 | 31,053,280.69 | 8.22 |

| | | | |
|---|------|----------------|--------|
| 8 | 其他资产 | 11,769,207.61 | 3.11 |
| 9 | 合计 | 377,989,973.54 | 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 | 58,858,502.14 | 16.29 |
| C | 制造业 | 255,405,733.10 | 70.71 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 20,903,250.00 | 5.79 |
| 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 | - | - |
| 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 | 335,167,485.24 | 92.79 |

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 | 300390 | 天华新能 | 1,655,660 | 40,861,688.80 | 11.31 |
| 2 | 002466 | 天齐锂业 | 1,015,704 | 35,752,780.80 | 9.90 |
| 3 | 002460 | 赣锋锂业 | 1,031,940 | 35,570,971.80 | 9.85 |
| 4 | 002756 | 永兴材料 | 847,890 | 35,280,702.90 | 9.77 |
| 5 | 002192 | 融捷股份 | 925,487 | 35,057,447.56 | 9.71 |
| 6 | 002738 | 中矿资源 | 951,220 | 34,757,578.80 | 9.62 |
| 7 | 002240 | 盛新锂能 | 1,998,300 | 30,554,007.00 | 8.46 |
| 8 | 000408 | 藏格矿业 | 914,100 | 26,280,375.00 | 7.28 |
| 9 | 000762 | 西藏矿业 | 1,013,242 | 23,801,054.58 | 6.59 |
| 10 | 000155 | 川能动力 | 1,779,000 | 20,903,250.00 | 5.79 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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，本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | 22,384.90 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 11,746,822.71 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 11,769,207.61 |

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各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

| | 长安裕盛混合A | 长安裕盛混合C |
|-------------------------------|---------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 71,526,016.56 | 650,513,935.73 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 6,645,237.18 | 162,311,196.65 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 12,329,722.29 | 242,727,327.07 |
| 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 | 65,841,531.45 | 570,097,805.31 |
|-------------|---------------|----------------|

总申购份额包含红利再投资、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、《长安裕盛灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长安裕盛灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《长安裕盛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

上海市浦东新区芳甸路1088号紫竹国际大厦16层。

9.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公场所、基金托管人的住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