

长安先进制造混合型证券投资基金

2022年第3季度报告

2022年09月30日

基金管理人: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:2022年10月26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..... | 7 |
| §4 管理人报告..... | 9 |
| 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介..... | 9 |
| 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..... | 10 |
| 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..... | 11 |
| §5 投资组合报告..... | 11 |
| 5.1 报告期末基金资产组合情况..... | 11 |
| 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..... | 13 |
| 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..... | 13 |
| 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..... | 13 |
| 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..... | 14 |
| 5.11 投资组合报告附注..... | 14 |
| §6 开放式基金份额变动..... | 15 |
| §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况..... | 15 |
| 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况..... | 15 |
| 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细..... | 15 |
| §8 影响投资者决策的其他重要信息..... | 15 |
| 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..... | 15 |
| 8.2 影响投资者决策的其他重要信息..... | 16 |
| §9 备查文件目录..... | 16 |
| 9.1 备查文件目录..... | 16 |
| 9.2 存放地点..... | 16 |
| 9.3 查阅方式..... | 16 |

§ 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2022年10月25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2022年7月1日起至2022年9月30日止。

§ 2基金产品概况

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 长安先进制造混合 |
| 基金主代码 | 013513 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2021年10月28日 |
| 报告期末基金份额总额 | 405,138,054.70份 |
| 投资目标 | 在严格控制风险和保证基金资产流动性的前提下，精选先进制造业相关股票进行投资，追求超越业绩比较基准的投资回报。 |
| 投资策略 | <p>（一）大类资产配置策略</p> <p>本基金将对宏观经济政策、经济基本面、证券市场运行状况等因素进行定量与定性相结合的分析研究，综合判断各类资产的风险收益水平，确定投资组合中股票资产的配置比例。</p> <p>（二）股票投资策略</p> <p>1、先进制造行业界定</p> <p>本基金所定义的先进制造业上市公司是指在制造业中具有先进核心技术、产品创新能力、高技术附加值和能够引领产业发展方向的企业，以及为上述企业提供相关服务和产品的企业。</p> <p>2、个股精选策略</p> <p>本基金将采用定量与定性分析相结合的方法，充分</p> |

发挥基金管理人研究团队和投资团队的选股能力，精选具有先进核心技术、产品创新能力、高技术附加值和能够引领产业发展方向、在所处行业或细分行业居于领先地位、基本面良好、具备较强竞争力、公司治理结构合理的个股构建投资组合。

3、组合构建策略

本基金将对筛选出的股票按照行业进行分类，重点选择所属行业符合经济发展趋势和方向、具有较大增长潜力或发展空间的公司构建股票组合，并适度追求行业的分散性，控制组合内同一行业公司的数量。

本基金将根据股票筛选标准，定期更新入选股票池，并根据经济和社会发展趋势与方向、国家宏观经济政策、资本市场发展等情况，动态调整股票组合。

4、港股通标的股票的投资策略

考虑到香港股票市场与A股股票市场的差异，对于香港联交所上市的股票，本基金除按照上述股票的投资策略外，还将结合公司基本面、国内经济和相关行业发展前景、香港市场资金面和投资者行为，以及世界主要经济体经济发展前景和货币政策、主流资本市场对投资者的相对吸引力等因素，精选符合本基金投资目标的香港联交所上市公司股票。

5、存托凭证的投资策略

本基金将根据投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的研究判断，进行存托凭证的投资。

（三）债券投资策略

1、普通债券投资策略

本基金将通过分析宏观经济发展趋势、利率变动趋势及市场信用环境变化方向和长期利率的发展趋势，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，采取久期策略、收益率曲线策略、息差策略、骑乘策略、类别选择策略、个券选择策略、回购套利策略等多种策略，精选安全边际较高的个券进行投资，同时根据宏观经济、货币政策和流动性等情况的变化，调整组合利率债和信用债的投资比例、组合的久期等，以获取债券市场的长期稳健收益。

2、可转债投资策略

可转换债券（含可交易分离可转债）兼具权益类证券与固定收益类证券的特性，具有抵御下行风险、分享股票价格上涨收益的特点。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良好的品种进行投资。

本基金还将密切关注转股溢价率、纯债溢价率等指标的变化情况，积极寻找转股溢价率和纯债溢价率呈现“双低”特征的可转债品种，捕捉相关套利机会。其中，转股溢价率=（可转债价格-转换价值）/转换价值，转换价值=股票现行价格*100/转换价格，转股溢价率是衡量可转债股性的重要指标；纯债溢价率=（可转债价格-纯债价值）/纯债价值，纯债溢价率是衡量可转债债性的重要指标。

（四）资产支持证券投资策略

本基金将深入研究资产支持证券的市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率水平等基本面因素，并且结合债券市场宏观分析的结果，评估资产支持证券的信用风险、利率风险、流动性风险和提前偿付风险，辅以量化模型分析，评估其内在价值进行投资。

（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。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。

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，以套期保值为主要目的参与国债期货交易。基金管理人将根据法律法规的规定，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。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。 | |
| 业绩比较基准 | 中证TMT产业主题指数收益率*40%+中国战略新兴产业成份指数收益率*20%+中证港股通综合指数(人民币)收益率*20%+中债综合全价指数收益率*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，还可投资港股通标的股票，还面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。 | |
| 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 | 长安先进制造混合A | 长安先进制造混合C |
| 下属分级基金的交易代码 | 013513 | 013514 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 338,986,320.95份 | 66,151,733.75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(2022年07月01日-2022年09月30日) | |
|-----------------|------------------------------|---------------|
| | 长安先进制造混合A | 长安先进制造混合C |
| 1. 本期已实现收益 | -7,138,881.25 | -1,434,003.89 |
| 2. 本期利润 | -40,610,909.93 | -7,837,132.94 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.1182 | -0.1178 |
| 4. 期末基金资产净值 | 220,590,032.97 | 42,847,861.44 |
| 5. 期末基金份额净值 | 0.6507 | 0.6477 |

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

长安先进制造混合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 | -15.49% | 1.94% | -14.62% | 0.89% | -0.87% | 1.05% |
| 过去六个月 | -6.41% | 2.09% | -11.73% | 1.17% | 5.32% | 0.92% |
| 自基金合同生效起至今 | -34.93% | 1.91% | -22.73% | 1.13% | -12.20% | 0.78% |

本基金的业绩比较基准为：中证 TMT 产业主题指数收益率*40%+中国战略新兴产业成份指数收益率*20%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*20%+中债综合全价指数收益率*20%

长安先进制造混合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 | -15.60% | 1.94% | -14.62% | 0.89% | -0.98% | 1.05% |
| 过去六个月 | -6.64% | 2.09% | -11.73% | 1.17% | 5.09% | 0.92% |
| 自基金合同生效起至今 | -35.23% | 1.91% | -22.73% | 1.13% | -12.50% | 0.78% |

本基金的业绩比较基准为：中证 TMT 产业主题指数收益率*40%+中国战略新兴产业成份指数收益率*20%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*20%+中债综合全价指数收益率*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

长安先进制造混合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
(2021年10月28日-2022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,本基金运作时间未满一年。图示日期为 2021 年 10 月 28 日至 2022 年 09 月 30 日。

长安先进制造混合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
(2021年10月28日-2022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,本基金运作时间未满一年。图示日期为 2021 年 10 月 28 日至 2022 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 | | |
| 徐小勇 | 本基金的基金经理 | 2021-10-28 | - | 27 年 | 工商管理硕士。曾就职于中国建设银行总行信托投资公司，中国信达信托投资公司，中国银河证券有限责任公司；曾任银河基金管理有限公司研究员、基金经理，华泰证券（上海）资产管理有限公司权益部负责人，长安基金管理有限公司总经理助理等职。现任长安基金管理有限公司副总经理、投资总监、基金经理。 |

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制度》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

2022年3季度国内股票市场呈现单边回落走势。7月初市场见反弹高点，逐步回落，持续到季末。美国加息坚决，美元指数表现强劲，全球市场回落。地缘冲突导致的能源危机依然困扰欧洲和全球，缺少缓解苗头。市场资金面持续清淡，公司中报业绩整体趋弱。上涨的行业稀少，个股出现普遍下跌。能源系列强势，集中在煤炭、油运、石油天然气等方向。部分信息技术行业股票回升，集中在通信、计算机、半导体零部件。部分价值股稳健，主要在龙头地产、区域银行、保险等。消费行业有企稳迹象，主要在食品饮料、旅游交通、家电等。新能源系列冲高回落，电动车系列走势较弱。从行业看，本季度煤炭、通信上涨，跌幅小的有石油石化、电力与公用事业、房地产、交通、机械、国防军工、银行；跌幅居前的有建材、汽车、零售、计算机、化工、传媒、建筑、医药、电子、有色。

我们在本季度卖出了煤炭股、化肥股，增加了机械股，调整了光伏系列个股。3季度末组合持仓集中在光伏系列和电动车系列，在行业层面集中在电气设备、汽车与零部件、机械、钢铁有色等。组合相对集中，3季度压力加大。

我们认为市场依然面临众多不确定性，包括美国加息、世界局势演绎程度与影响，对中国经济周期阶段判断的分歧、各项政策变化与影响，以及市场自身的演绎。市场受多种因素交织影响，以及预期变化，导致判断困难。我们基于经验及对利空演绎的分析，倾向于认为市场可能处于构建双底阶段。目前市场结构特征同样复杂化。市场可能在几个方向上发展。一是策略性的低估值与能源危机品种，主要在以金融地产为主的价值股，以传统能源为主的系列品种；二是高景气，长期前景良好，但受逆全球化影响，机构持仓过重的成长方向，主要在新能源与电动车系列；三是重新回到投资者视野的自主可控方向，机构持仓低，但具有业绩欠缺、历史表现一般的不足。我们计划坚持基本仓位，持有基于行业景气、长期价值的品种，主要是光伏和电动车系列品种。积极在个股层面进行修正，基于股票的价值判断调整持仓个股；以开放的心态和价值的思维寻找新品种，丰富组合。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末长安先进制造混合A基金份额净值为0.6507元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-15.49%，同期业绩比较基准收益率为-14.62%；截至报告期末长安

先进制造混合C基金份额净值为0.6477元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-15.60%，同期业绩比较基准收益率为-14.62%。

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 | 246,345,141.35 | 92.84 |
| | 其中：股票 | 246,345,141.35 | 92.84 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 657,235.24 | 0.25 |
| | 其中：债券 | 657,235.24 | 0.25 |
| | 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 | 18,160,666.79 | 6.84 |
| 8 | 其他资产 | 185,821.12 | 0.07 |
| 9 | 合计 | 265,348,864.50 | 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 | - | - |
| C | 制造业 | 245,462,229.35 | 93.18 |
| 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 | 762,000.00 | 0.29 |
| 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 | 120,912.00 | 0.05 |
| 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 | 246,345,141.35 | 93.51 |

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 | 002756 | 永兴材料 | 187,820 | 23,085,766.40 | 8.76 |
| 2 | 002594 | 比亚迪 | 90,000 | 22,680,900.00 | 8.61 |
| 3 | 002459 | 晶澳科技 | 350,000 | 22,414,000.00 | 8.51 |
| 4 | 688223 | 晶科能源 | 1,001,688 | 16,698,138.96 | 6.34 |
| 5 | 601689 | 拓普集团 | 210,000 | 15,498,000.00 | 5.88 |
| 6 | 300750 | 宁德时代 | 35,000 | 14,031,150.00 | 5.33 |
| 7 | 000625 | 长安汽车 | 1,082,958 | 13,601,952.48 | 5.16 |

| | | | | | |
|----|--------|------|---------|---------------|------|
| 8 | 002006 | 精功科技 | 500,000 | 12,500,000.00 | 4.74 |
| 9 | 002466 | 天齐锂业 | 120,000 | 12,048,000.00 | 4.57 |
| 10 | 603596 | 伯特利 | 130,000 | 11,165,700.00 | 4.24 |

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 | - | - |
| | 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） | 657,235.24 | 0.25 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 657,235.24 | 0.25 |

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 | 113061 | 拓普转债 | 4,760 | 657,235.24 | 0.25 |

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

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未进行国债期货交易。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未进行国债期货交易。

5.10.3 本期国债期货投资评价

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 | 77,078.95 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 108,742.17 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 185,821.12 |

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

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值 (元) | 占基金资产净值比例 (%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|--------------------|------------------|----------|
| 1 | 002756 | 永兴材料 | 3,213,766.40 | 1.22 | 非公开发行限售 |

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

| | 长安先进制造混合A | 长安先进制造混合C |
|-------------------------------|----------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 347,054,930.52 | 68,579,826.63 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 5,979,773.90 | 5,985,513.25 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 14,048,383.47 | 8,413,606.13 |
| 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 | 338,986,320.95 | 66,151,733.75 |

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

单位：份

| | 长安先进制造混合A | 长安先进制造混合C |
|---------------------------|--------------|-----------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 4,999,200.00 | - |
| 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 | 4,999,200.00 | - |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%) | 1.23 | - |

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，基金管理人未申购或赎回本基金。

§ 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、《长安先进制造混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长安先进制造混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《长安先进制造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、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.changanfunds.com。

长安基金管理有限公司
2022年10月26日