

# 长安鑫兴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:广发银行股份有限公司

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	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	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	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	15
§9 备查文件目录	15
9.1 备查文件目录	15
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。

基金托管人广发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，投资者在作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	长安鑫兴混合
基金主代码	005186
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	16,800,294.66份
投资目标	在严格控制风险和保持流动性的前提下，重点投资于受益于产业升级、消费升级和技术升级相关的行业和个股，力争实现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三个大的方面，即资产配置策略、股票投资策略和债券投资策略。</p> <p>（一）资产配置策略</p> <p>本基金通过对中国经济长期增长的内在逻辑分析、对GDP、工业增加值、投资和消费增速、进出口以及财政和货币政策的综合分析，判断中国经济的发展路径和所处的发展阶段，结合资本市场的发展及股票和债券的相对估值以及市场因素等，决定本基金股票、债券和货币市场工具等大类资产的配置比例，动态跟踪各类证券风险收益特征的相对变化，调整具体配置比例，以平衡投资组合的风险和收益。</p> <p>（二）股票投资策略</p> <p>1、行业配置策略经济发展到一定阶段，经济增长方式的转</p>

变和经济结构的升级调整将带动产业升级和技术升级，居民收入的提高将带来消费的升级，伴随升级的推进和深入，必将创造新的经济增长点，带来新的投资机会。本基金将结合定量与定性分析，前瞻性地研究与分析宏观经济中制度性、结构性的发展趋势，挖掘代表整个经济发展趋势的行业或主题，重点关注战略性新兴产业、消费升级行业和传统行业中的技术升级所带来的投资机会。本基金将根据国民经济和社会发展规划、产业调整与振兴规划以及区域发展战略等，发掘国家重点发展的战略性新兴产业。本基金将对影响居民收入水平及消费结构的因素以及消费结构的变化趋势进行跟踪分析，发掘不同时期的消费升级受益行业。本基金将重点关注技术升级、盈利模式创新和产品更新换代等对传统行业、企业的影响，挖掘技术升级带来的投资机会。本基金管理人将筛选出与上述产业或机会相关度较大或者从上述产业或机会受益较大的相关行业，通过跟踪各行业整体的收入增速、利润增速、毛利率的变动幅度等数据，再结合各行业整体的估值、市场预期以及机构配置等情况，综合考虑各行业的配置比例。

2、个股选择策略本基金坚持集中持股策略，以定量分析为基础，筛选出具有较大增长潜力且估值合理的公司。本基金将通过以下标准对股票进行分析，筛选出成长能力较强、盈利质量较高同时估值合理的公司。

(1)成长能力较强 本基金主要利用主营业务收入增长率、净利润增长率、经营性现金流量增长率指标来考量公司的历史成长性，作为判断公司未来成长性的依据。本基金主要考察公司最新报告期的主营业务收入与上年同期的比较，并与同行业公司相比较；主要考察公司最新报告期的净利润与上年同期的比较，并与同行业公司相比较；主要考察公司最新报告期的经营性现金流量与上年同期的比较，并与同行业公司相比较。

(2)盈利质量较高 本基金利用总资产报酬率和净资产收益率指标来考量公司的盈利能力和质量。本基金考察公司过去两年的总资产报酬率和净资产收益率，并与同行业平均水平进行比较。此外，本基金还将关注公司盈利的构成、盈利的主要来源等，全面分析其盈利能力和质量。

(3)估值水平合理 本基金将根据公司所处的行业，采用市盈率、动态市盈率、市净率等估值指标，对公司股票价值进行动态评估，分析该公司的股价是否处于合理的估值区间，以

	<p>规避股票价值被过分高估所隐含的投资风险。</p> <p>(三) 债券投资策略</p> <p>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。</p> <p>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，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。</p> <p>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。</p> <p>(四) 衍生品投资策略</p> <p>包括股指期货投资策略、国债期货投资策略、权证投资策略。</p> <p>(五) 资产支持证券投资策略</p> <p>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、违约率、提前偿还率等影响资产支持证券内在价值的相关要素，并综合运用久期管理、收益率曲线变动分析、收益率利差分析和期权定价模型等方法，选择经风险调整后相对价值较高的品种进行投资。</p>	
业绩比较基准	沪深300指数收益率×50%+中债综合指数收益率×50%	
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。	
基金管理人	长安基金管理有限公司	
基金托管人	广发银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	长安鑫兴混合A	长安鑫兴混合C
下属分级基金的交易代	005186	005187

码		
报告期末下属分级基金的份额总额	13,194,171.42份	3,606,123.24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)	
	长安鑫兴混合A	长安鑫兴混合C
1.本期已实现收益	-123,324.09	-415,170.22
2.本期利润	2,737,125.35	184,481.08
3.加权平均基金份额本期利润	0.1887	0.0156
4.期末基金资产净值	22,461,813.04	6,070,033.74
5.期末基金份额净值	1.7024	1.6833

- 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

长安鑫兴混合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	14.32%	1.25%	8.10%	0.76%	6.22%	0.49%
过去六个月	10.73%	0.94%	7.55%	0.61%	3.18%	0.33%
过去一年	11.12%	0.67%	6.58%	0.54%	4.54%	0.13%
过去三年	-10.49%	0.78%	-5.42%	0.54%	-5.07%	0.24%
过去五年	51.85%	1.11%	9.08%	0.58%	42.77%	0.53%
自基金合同生效起至今	70.24%	1.11%	9.86%	0.61%	60.38%	0.50%

基金整体业绩比较基准构成为：沪深 300 指数收益率\*50%+中债综合指数收益率\*50%。

长安鑫兴混合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	14.28%	1.25%	8.10%	0.76%	6.18%	0.49%
过去六个月	10.66%	0.94%	7.55%	0.61%	3.11%	0.33%
过去一年	10.96%	0.67%	6.58%	0.54%	4.38%	0.13%
过去三年	-10.91%	0.78%	-5.42%	0.54%	-5.49%	0.24%
过去五年	50.71%	1.11%	9.08%	0.58%	41.63%	0.53%
自基金合同生效起至今	68.33%	1.11%	9.86%	0.61%	58.47%	0.50%

基金整体业绩比较基准构成为：沪深 300 指数收益率\*50%+中债综合指数收益率\*50%。

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

长安鑫兴混合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。截止到建仓期结束时,本基金的各项投资组合比例已符合基金合同的相关规定。基金合同生效日至报告期期末,本基金运作时间已满一年。图示日期为2017年11月29日至2024年09月30日。

长安鑫兴混合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。截止到建仓期结束时,本基金的各项投资组合比例已符合基金合同的相关规定。基金合同生效日至报告期期末,本基金运作时间已满一年。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		
杨严	本基金的基金经理	2023-04-28	-	9年	经济学博士。曾任招商银行杭州分行国际业务部结算员,民生通惠资产管理有限公司信用研究员,德邦基金管理有限公司债券研究员、基金经理等职。现任长安基金管理有限公司固定收益部总监助理、基金经理。
张云凯	本基金的基金经理	2024-05-15	-	7年	金融学硕士。曾任四川信托有限公司机构客户部信托助理,上海国际信托有限公司信托业务三部信托经理,东北证券股份有限公司研究所房地产行业首席分析师,招银理财有限责任公司研究

					部宏观策略资深研究员，长安基金管理有限公司研究部高级研究员、专户投资部投资经理等职，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

报告期内，A股整体低开高走，市场波动较为剧烈，7、8月国内经济数据不及预期，经济下行压力较大，出口是为数不多的亮点。在此背景下，A股持续走低，主要指数已接近2月份的低位，对应A股的估值已处于历史极低分位数，权益资产已具备很好的配置价值，但市场情绪依然较为低迷。直至季度末9月份，美联储超预期降息落地，外部流动性改善，市场出现筑底企稳的迹象。9月24日，中国人民银行、国家金融监督管理总局、中国证券监督管理委员会三部委联合在国务院新闻办公室举行新闻发布会，出台一揽子重磅金融支持政策，相关政策强度超市场预期，大幅提振市场信心，市场情绪回暖，

风险偏好快速修复，A股开始快速反弹。9月26日，中央政治局会议政策再度强化政策预期，市场快速上涨，成交量能创新高。

报告期内，在9月底政策强度超预期，市场整体风险偏好快速修复的背景下，本基金从9月开始，逐步提升权益配置的比例至高仓位，增加配置的方向包括有色、汽车及汽车零部件、地产链、建筑、设备更新以及新质生产力等相关行业。我们认为后续财政的发力在老基建、房地产、消费品以旧换新上都会有所体现。结构上，政策重点支持的“两重”“两新”方向体现会更加显著，如国内经济基本面得以企稳，在政策支持的情况下，相关公司的基本面预期将有所提升，当下具备更好的配置性价比。

往后展望，货币政策已先行落地，9月“双降”落地，同时存量房贷利率批量调整，四季度重点关注财政政策跟进和落地情况，以及12月政治局会议和中央经济工作会议对来年经济工作的定调，我们总体保持较为乐观的预期。海外方面，我们认为在通胀数据有所反弹的背景下，美联储降息的节奏可能会有所反复，但宽松的大方向应不变。同时，关注美国大选结果对国内相关行业的影响。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末长安鑫兴混合A基金份额净值为1.7024元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为14.32%，同期业绩比较基准收益率为8.10%；截至报告期末长安鑫兴混合C基金份额净值为1.6833元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为14.28%，同期业绩比较基准收益率为8.10%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金从2024年7月23日至2024年9月30日连续48个工作日出现基金资产净值低于五千万元情形，未出现连续20个工作日（含）以上基金份额持有人数量不满二百人的情形。基金管理人已持续关注并拟采取适当措施。

## §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	25,545,860.00	81.76
	其中：股票	25,545,860.00	81.76
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	505,670.55	1.62
	其中：债券	505,670.55	1.62
	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	4,637,085.40	14.84
8	其他资产	556,583.21	1.78
9	合计	31,245,199.16	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	1,252,400.00	4.39
B	采矿业	1,065,000.00	3.73
C	制造业	18,672,660.00	65.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	2,550,000.00	8.94
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	1,092,300.00	3.83
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	913,500.00	3.20
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	25,545,860.00	89.53

### 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	688187	时代电气	25,000	1,326,750.00	4.65
2	600482	中国动力	55,000	1,326,050.00	4.65
3	601390	中国中铁	200,000	1,314,000.00	4.61
4	603801	志邦家居	100,000	1,289,000.00	4.52
5	002738	中矿资源	35,000	1,278,900.00	4.48
6	000831	中国稀土	45,000	1,273,950.00	4.47
7	605296	神农集团	40,000	1,252,400.00	4.39
8	601689	拓普集团	27,000	1,249,020.00	4.38
9	600111	北方稀土	60,000	1,237,800.00	4.34
10	601117	中国化学	150,000	1,236,000.00	4.33

### 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	505,670.55	1.77
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	505,670.55	1.77

**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	019631	20国债05	5,000	505,670.55	1.77

**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	62,854.50
2	应收证券清算款	472,410.69
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	21,318.02
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	556,583.21

**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

	长安鑫兴混合A	长安鑫兴混合C
报告期期初基金份额总额	14,942,439.14	19,389,102.44
报告期期间基金总申购份额	27,233.06	495,944.52
减：报告期期间基金总赎回份额	1,775,500.78	16,278,923.72
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	13,194,171.42	3,606,123.24

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

	长安鑫兴混合A	长安鑫兴混合C
报告期期初管理人持有的本基金份额	7,805,750.71	-
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	7,805,750.71	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	46.46	-

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

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	2024/07/01-2024/09/30	7,805,750.71	-	-	7,805,750.71	46.46%

#### 产品特有风险

本基金由于存在上述单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况，存在以下特有风险：

(1) 当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对重大事项进行投票表决时可能拥有较大话语权；

(2) 在极端情况下，当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于5000万元，进而可能导致本基金终止或与其他基金合并或转型为另外的基金，其他基金份额持有人丧失继续投资本基金的机会；

(3) 当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，更容易触发巨额赎回条款，基金份额持有人将无法及时赎回所持有的全部基金份额；

(4) 当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，基金为支付赎回款项而卖出所持有的证券，可能造成证券价格波动，导致本基金的收益水平发生波动。同时，巨额赎回、份额净值小数保留位数是采用四舍五入、管理费及托管费等费用是按前一日资产计提，会导致基金份额净值出现大幅波动；

(5) 当某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金规模的50%时，本基金管理人将不再接受该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。在其他基金份额持有人赎回基金份额导致某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金规模50%的情况下，该基金份额持有人将面临所提出的对本基金基金份额的申购及转换转入申请被拒绝的风险。如果投资人某笔申购或转换转入申请导致其持有本基金基金份额达到或超过本基金规模的50%，该笔申购或转换转入申请可能被确认失败。

### 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、《长安鑫兴灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长安鑫兴灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《长安鑫兴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、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](http://www.cafund.com)。

长安基金管理有限公司

2024年10月25日