

长安鑫瑞科技先锋6个月定期开放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:中国民生银行股份有限公司

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.....	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.....	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.....	12
§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.....	13
7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况.....	13
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。

基金托管人中国民生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	长安鑫瑞科技6个月定开混合
基金主代码	011899
基金运作方式	契约型定期开放式
基金合同生效日	2021年06月03日
报告期末基金份额总额	460,762,005.79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，精选科技先锋主题股票进行投资，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	<p>(一)封闭期投资策略</p> <p>1、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。本基金主要考虑的因素包括：</p> <p>(1) 宏观经济政策：包括货币政策、财政政策、投资政策、外贸政策、消费政策、就业政策、经济改革政策等；</p> <p>(2) 经济基本面指标：包括国内生产总值增速、居民消费价格指数、工业附加值、货币供给量、失业率、通胀率、固定资产投资增速、进出口贸易数据等；</p> <p>(3) 证券市场运行状况：主要关注市场估值和技术指标分</p>

析，考量因素包括但不限于市场整体估值水平、各行业及板块相对估值水平、一致预期估值水平、大势型技术指标、趋势型技术指标、成交量型技术指标、均线型技术指标等。

2、股票投资策略

（1）科技先锋主题界定

在全球化的科技竞争浪潮下，我国不断加强科技创新能力，在关键核心技术上不断突破，在诸多前沿领域已具备全球领先水平，推进着我国经济发展新旧动能的转换。在此过程中，有望成长出一批具备全球领先技术水平和长期投资价值的公司。

（2）个股精选策略

本基金将采用定量与定性分析相结合的方法，充分发挥基金管理人研究团队和投资团队的选股能力，精选拥有核心技术、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。

3、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

	<p>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。</p> <p>4、资产支持证券投资策略</p> <p>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。</p> <p>5、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。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>6、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，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。</p> <p>（二）开放期投资策略</p> <p>开放期内，为了保证投资组合具有较高的流动性，方便投资人安排投资，本基金将在遵守有关投资限制与投资比例的前提下，主要投资于具有较高流动性的投资品种。</p>
<p>业绩比较基准</p>	<p>中国战略新兴产业成份指数收益率*70%+中债综合全价指数收益率*30%</p>
<p>风险收益特征</p>	<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>

基金管理人	长安基金管理有限公司	
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	长安鑫瑞科技6个月定开混合A	长安鑫瑞科技6个月定开混合C
下属分级基金的交易代码	011899	011900
报告期末下属分级基金的份额总额	335,388,430.52份	125,373,575.27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)	
	长安鑫瑞科技6个月定开混合A	长安鑫瑞科技6个月定开混合C
1.本期已实现收益	-15,577,963.57	-5,840,774.53
2.本期利润	14,389,041.63	5,163,338.92
3.加权平均基金份额本期利润	0.0416	0.0398
4.期末基金资产净值	204,548,631.61	75,200,062.92
5.期末基金份额净值	0.6099	0.5998

- 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

长安鑫瑞科技6个月定开混合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	7.99%	1.78%	15.37%	1.53%	-7.38%	0.25%

过去六个月	4.74%	1.48%	10.60%	1.24%	-5.86%	0.24%
过去一年	-1.93%	1.42%	1.89%	1.14%	-3.82%	0.28%
过去三年	-40.86%	1.85%	-32.28%	1.05%	-8.58%	0.80%
自基金合同生效起至今	-39.01%	1.87%	-33.32%	1.06%	-5.69%	0.81%

本基金的业绩比较基准为：中国战略新兴产业成份指数收益率*70%+中债综合全价指数收益率*30%

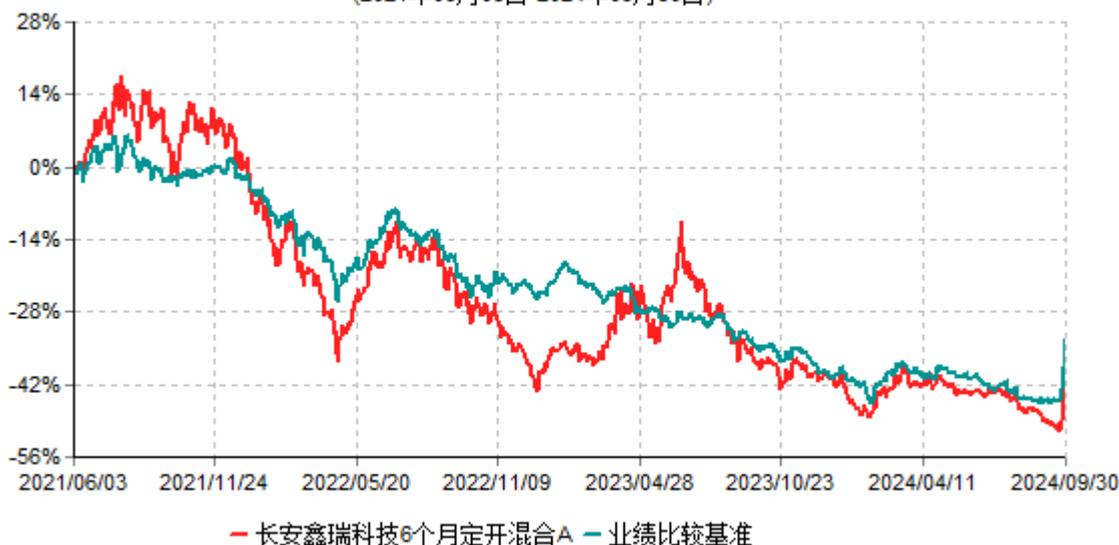
长安鑫瑞科技6个月定开混合C净值表现

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	7.86%	1.78%	15.37%	1.53%	-7.51%	0.25%
过去六个月	4.48%	1.48%	10.60%	1.24%	-6.12%	0.24%
过去一年	-2.42%	1.42%	1.89%	1.14%	-4.31%	0.28%
过去三年	-41.74%	1.85%	-32.28%	1.05%	-9.46%	0.80%
自基金合同生效起至今	-40.02%	1.87%	-33.32%	1.06%	-6.70%	0.81%

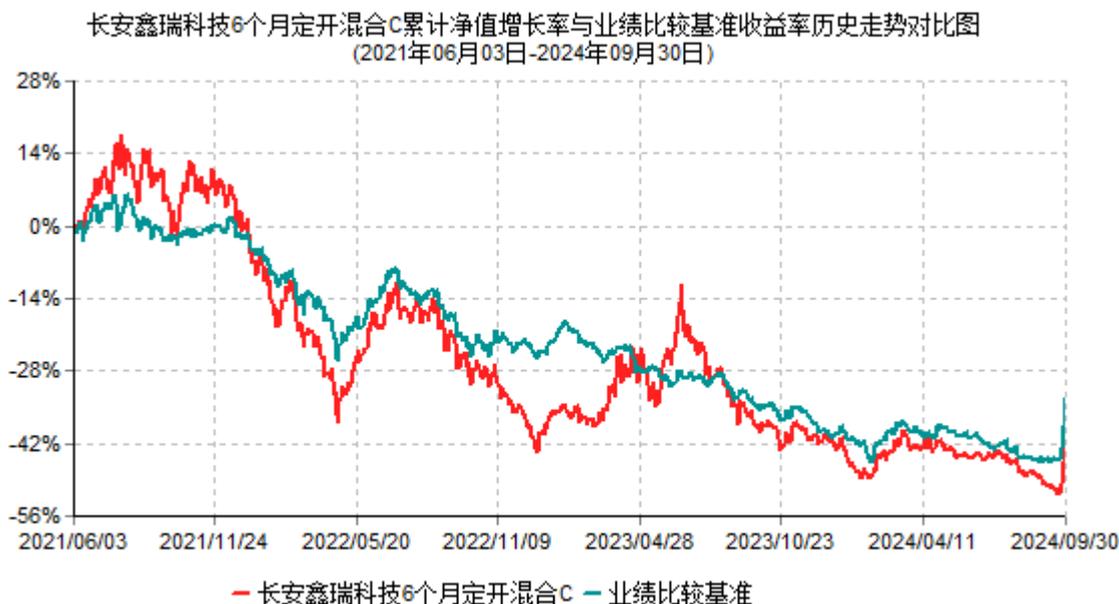
本基金的业绩比较基准为：中国战略新兴产业成份指数收益率*70%+中债综合全价指数收益率*30%

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

长安鑫瑞科技6个月定开混合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06月03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 2021 年 6 月 3 日至 2024 年 9 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 2021 年 6 月 3 日至 2024 年 9 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		
肖洁	本基金的基金经理	2023-11-24	-	12年	工商管理硕士。曾任德摩资本有限公司交易经理、长安基金管理有限公司研究部研究员、权益投资部基金经理助理等职。现任长安基金管理有限公司权益投资部基金经理。
王浩聿	本基金的基金经理	2024-01-16	-	7年	金融学硕士。曾任永赢基金管理有限公司权益投资部

					研究员，瀚亚投资管理（上海）有限公司股票研究员。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

2024年三季度市场企稳回升。九月底，央行、证监会等部门出台了一揽子增量政策以提振资本市场。中央政治局会议也强调，要促进房地产市场止跌回稳，努力完成全年经济社会发展目标任务。市场随之快速反弹，证券、科技等行业领涨。

三季度，我们对组合进行了一定程度的调整。基于目前的宏观背景，我们大幅增加了组合的弹性，主要布局了算力、军工、计算机、半导体等高成长板块。

展望未来，我们认为随着一系列政策的出台，宏观经济会逐渐企稳，而科技行业将重新成为市场的主角。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末长安鑫瑞科技6个月定开混合A基金份额净值为0.6099元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为7.99%，同期业绩比较基准收益率为15.37%；截至报告期末长安鑫瑞科技6个月定开混合C基金份额净值为0.5998元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为7.86%，同期业绩比较基准收益率为15.37%。

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	252,901,130.68	90.28
	其中：股票	252,901,130.68	90.28
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	27,244,055.24	9.72
8	其他资产	-	-
9	合计	280,145,185.92	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	218,412,891.82	78.07
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	18,056,429.86	6.45
J	金融业	3,571,360.00	1.28
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	7,371,889.00	2.64
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	5,488,560.00	1.96
S	综合	-	-
	合计	252,901,130.68	90.40

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	300308	中际旭创	156,000	24,158,160.00	8.64
2	300394	天孚通信	238,900	24,009,450.00	8.58
3	300750	宁德时代	60,100	15,138,589.00	5.41
4	003021	兆威机电	273,200	12,272,144.00	4.39

5	002463	沪电股份	276,000	11,084,160.00	3.96
6	000422	湖北宜化	760,700	10,946,473.00	3.91
7	688631	莱斯信息	121,213	8,826,730.66	3.16
8	688472	阿特斯	605,350	8,456,739.50	3.02
9	600435	北方导航	763,900	8,334,149.00	2.98
10	600760	中航沈飞	175,300	8,188,263.00	2.93

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

本基金本报告期末未进行国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金本报告期内不存在投资的前十名证券的发行主体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 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

本基金本报告期末未持有其他资产。

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情况。

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

	长安鑫瑞科技6个月定期混合A	长安鑫瑞科技6个月定期混合C
报告期期初基金份额总额	358,339,677.62	134,963,126.82
报告期期间基金总申购份额	250,640.48	140,895.90
减：报告期期间基金总赎回份额	23,201,887.58	9,730,447.45
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	335,388,430.52	125,373,575.27

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

	长安鑫瑞科技6个月定期混合A	长安鑫瑞科技6个月定期混合C
报告期期初管理人持有的本基金份额	13,533,775.22	-
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	13,533,775.22	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	2.94	-

本报告期内，基金管理人未运用自有资金申购或赎回本基金。

7.2 基金管理人运用自有资金投资本基金交易明细

本报告期内，基金管理人未运用自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

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、《长安鑫瑞科技先锋6个月定期开放混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长安鑫瑞科技先锋6个月定期开放混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《长安鑫瑞科技先锋6个月定期开放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。

长安基金管理有限公司

2024年10月25日