

景顺长城安瑞混合型证券投资基金

2024 年第 3 季度报告

2024 年 9 月 30 日

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

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

§ 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，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

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	景顺长城安瑞混合
基金主代码	012137
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022 年 9 月 23 日
报告期末基金份额总额	66,195,701.71 份
投资目标	本基金主要通过投资于固定收益类资产获得稳健收益，同时投资于具备良好盈利能力的上市公司所发行的股票以增强收益，在严格控制风险的前提下力争获取高于业绩比较基准的投资收益，为投资者提供长期稳定的回报。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金依据定期公布的宏观和金融数据以及投资部门对于宏观经济、股市政策、市场趋势的综合分析，重点关注包括、GDP 增速、固定资产投资增速、净出口增速、通胀率、货币供应、利率等宏观指标的变化趋势，同时强调金融市场投资者行为分析，关注资本市场资金供求关系变化等因素，在深入分析和充分论证的基础上评估宏观经济运行及政策对资本市场的影响方向和力度，运用宏观经济模型（MEM）做出对于宏观经济的评价，结合投资制度的要求提出资产配置建议，经投资决策委员会审核后形成资产配置方案。</p> <p>2、债券投资策略</p> <p>债券投资在保证资产流动性的基础上，采取利率预期策略、信用债投资策略和时机策略相结合的积极性投资方法，力求在控制各类风险的基础上获取稳定的收益。</p>

	<p>3、资产支持证券投资策略</p> <p>本基金将通过对宏观经济、提前偿还率、资产池结构以及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，预测资产池未来现金流变化，并通过研究标的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响。</p> <p>4、股票投资策略</p> <p>本基金以基本面为核心，确定行业配置方向，并结合宏观政策、情绪与技术面指标，在风险可控的范围内积极进行战术性仓位管理，使得风险收益比最大化。</p> <p>5、股指期货投资策略</p> <p>本基金参与股指期货交易，将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，制定相应的投资策略。</p> <p>6、国债期货投资策略</p> <p>本基金可基于谨慎原则，将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，运用国债期货对基本投资组合进行管理，提高投资效率。</p> <p>7、股票期权投资策略</p> <p>本基金将按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的参与股票期权交易。本基金将结合投资目标、比例限制、风险收益特征以及法律法规的相关限定和要求，确定参与股票期权交易的投资时机和投资比例。</p> <p>8、信用衍生品投资策略</p> <p>本基金按照风险管理原则，以风险对冲为目的，参与信用衍生品交易。</p> <p>9、融资策略</p> <p>本基金参与融资业务将严格遵守中国证监会及相关法律法规的约束，合理利用融资发掘可能的增值机会。</p>	
业绩比较基准	中证综合债指数收益率×80%+沪深 300 指数收益率*15%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×5%	
风险收益特征	<p>本基金为混合型基金，其预期收益和风险高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。</p> <p>本基金还可投资港股通标的股票。除了需要承担与内地证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金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。</p>	
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司	
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	景顺长城安瑞混合 A	景顺长城安瑞混合 C
下属分级基金的交易代码	012137	014926
报告期末下属分级基金的份额总额	33,169,509.92 份	33,026,191.79 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 7 月 1 日-2024 年 9 月 30 日）	
	景顺长城安瑞混合 A	景顺长城安瑞混合 C
1. 本期已实现收益	1,054,252.03	1,039,413.01
2. 本期利润	1,955,957.87	1,815,322.51
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0566	0.0515
4. 期末基金资产净值	38,297,679.78	37,825,296.96
5. 期末基金份额净值	1.1546	1.1453

注：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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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。

3.2 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

景顺长城安瑞混合 A

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	5.64%	0.84%	4.18%	0.27%	1.46%	0.57%
过去六个月	10.15%	0.71%	5.73%	0.22%	4.42%	0.49%
过去一年	12.48%	0.60%	7.62%	0.21%	4.86%	0.39%
自基金合同生效起至今	15.46%	0.49%	9.95%	0.21%	5.51%	0.28%

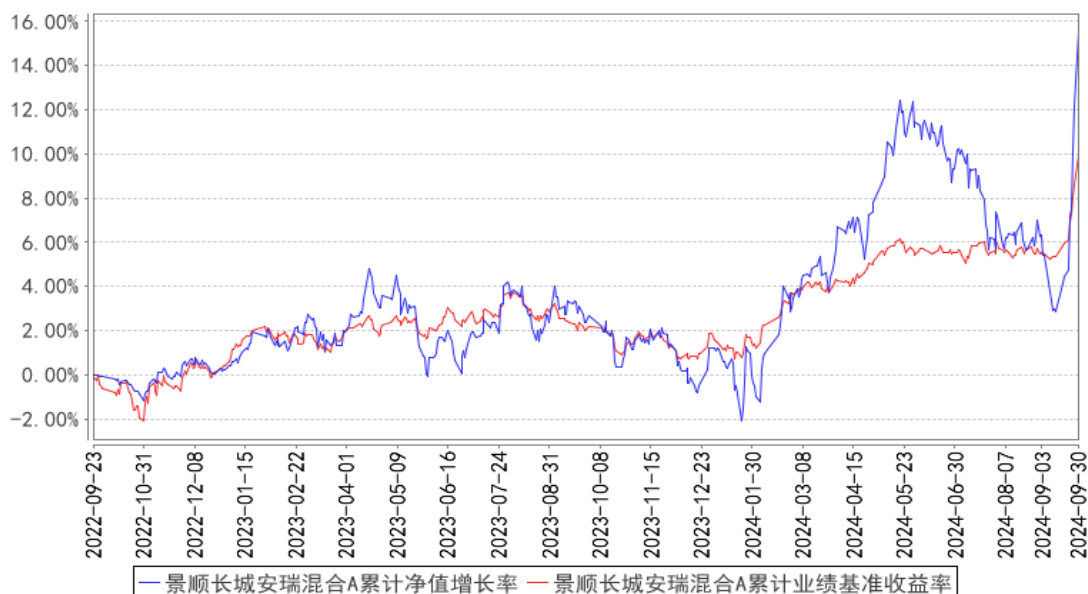
景顺长城安瑞混合 C

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	5.54%	0.84%	4.18%	0.27%	1.36%	0.57%
过去六个月	9.93%	0.71%	5.73%	0.22%	4.20%	0.49%
过去一年	12.02%	0.60%	7.62%	0.21%	4.40%	0.39%
自基金合同生效起至今	14.53%	0.49%	9.95%	0.21%	4.58%	0.28%

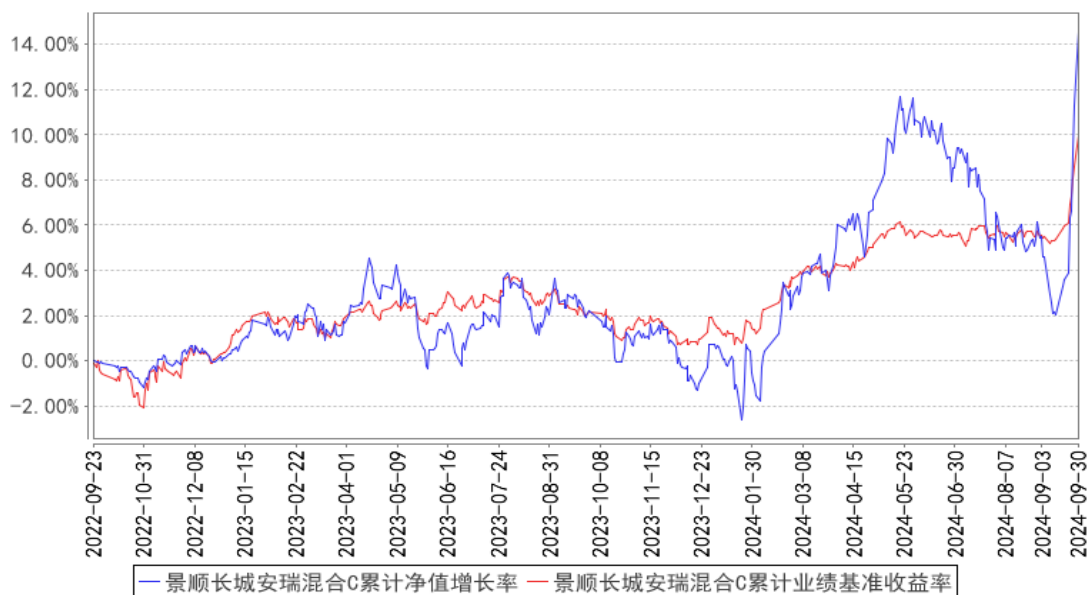
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益

率变动的比较

景顺长城安瑞混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



景顺长城安瑞混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的比例范围为 0-40%，其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%；投资于同业存单比例不超过基金资产的 20%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。本基金的建仓期为自 2022 年 9 月 23 日基金合同生效日起 6 个月。建仓期结束时，本基金投资组合达到上述投资组合比例的要求。

3.3 其他指标

无。

§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		
李怡文	本基金的基金经理	2022年9月23日	-	18年	工商管理硕士。曾任国家外汇管理局会计处组合分析师，佛罗里瑞伟投资管理公司研究员，中国建设银行香港组合管理经理，国投瑞银基金管理有限公司固定收益部副总监、基金经理。2020年4月加入本公司，担任固定收益部稳定收益业务投资负责人，自2021年4月起担任固定收益部基金经理，现任混合资产投资部总经理、基金经理。具有18年证券、基金行业从业经验。

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”按基金合同生效日填写，“离任日期”为根据公司决定的解聘日期（公告前一日）；对此后的非首任基金经理，“任职日期”指根据公司决定聘任后的公告日期，“离任日期”指根据公司决定的解聘日期（公告前一日）；

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》和《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《景顺长城安瑞混合型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011年修订）》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平

执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本管理人管理的所有投资组合参与的交易公开竞价，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 14 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要而发生的同日反向交易。

本报告期内，未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

今年三季度国内经济基本面仍承压。制造业 PMI 处于荣枯线下方，7~9 月分别为 49.4、49.1、49.8。8 月广义财政支出再次下滑，基建增速随之下滑至 1.2%。8 月社会消费品零售总额同比增速从前值 2.7% 回落至 2.1%，季调环比增速再次负增长，环比下跌 0.01%，指向居民消费下行，与核心 CPI 环比增速节奏一致。三季度以来消费者信心指数和就业预期指数继续下行。在经济面临进一步下行风险的背景下，货币政策出现超预期的调整，在 9 月 24 日的国新办发布会上，央行公布一系列超预期货币政策，包括降准降息、调降存量房贷利率和购房首付比例，并创设两项结构性货币工具支持股市。随后 9 月 26 日中央政治局会议召开，会议强调“加大财政货币政策逆周期调节力度”的同时，就地产、消费等领域做出了积极表态，地产层面出现“促进房地产市场止跌回稳”的新表述，并提出“要努力提振资本市场”等。由此市场风险偏好持续的显著提升，股市出现连日上涨，9 月 24 日至 9 月 30 日期间，上证指数累计涨幅 21.37%，创业板指累计涨幅更是高达 42.12%；与此同时，债市出现剧烈调整，30 年国债期货期间累计下跌 4.57%。海外方面，美联储在 9 月宣布降息 50BP。根据鲍威尔的表述，这次 50BP 的降息幅度，市场可以看做是美联储确保货币政策不落后于经济的承诺，鲍威尔坚定地表明了预防性降息以及全力保持经济强劲的立场。鲍威尔在会议中明确表示，从目前美国经济数据来看，美国没有任何衰退迹象，美国经济处于良好状态，而美联储致力于保持当前的增长韧性。操作方面，我们将债券久期调整至中性偏低的水平，减持了部分久期偏长的信用债和利率债；转债方面，我们持续增加转债仓位至较高水平，重点关注平衡型和信用资质良好的偏债型标的；股票方面总体高仓位运作，结构较为均衡。

展望四季度，我们密切关注已出台政策的效果和增量政策的持续出台，同时也注意到外部环境仍面临诸多不确定性。以“以旧换新”为代表的存量政策效果显现，8 月乘用车销量环比增加，家电及音像器材零售额同比转正。房地产市场成交量明显回暖，但价格尚未明显企稳回升。往后看，我们预计货币政策总基调延续宽松，更多需紧密关注增量财政政策的规模和节奏，以及外部环境变化对国内经济基本面产生的潜在影响。操作方面，我们预计债券部分预期保持中性偏低久

期，积极参与利率债波段交易的机会；转债方面，将持仓不断调整至性价比更高、基本面有所改善的标的中去；股票方面，在市场短期估值明显修复后，我们将关注组合个股的估值和景气度的匹配情况，除了估值不贵、行业供需结构保持平衡的上游资源行业外，未来将继续重点关注具有全球核心竞争力的高端制造业以及受益于政策调整的内需方向。

4.5 报告期内基金的业绩表现

2024 年 3 季度，景顺长城安瑞混合 A 类份额净值增长率为 5.64%，业绩比较基准收益率为 4.18%。

2024 年 3 季度，景顺长城安瑞混合 C 类份额净值增长率为 5.54%，业绩比较基准收益率为 4.18%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§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	30,560,060.44	39.31
	其中：股票	30,560,060.44	39.31
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	36,392,683.29	46.82
	其中：债券	36,392,683.29	46.82
	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	5,232,053.06	6.73
	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	3,099,766.67	3.99
8	其他资产	2,447,200.65	3.15
9	合计	77,731,764.11	100.00

注：1、权益投资中通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 13,952,605.83 元，占基金资产净值的比例为 18.33%；

2、报告期末，本基金因证券市值变动，导致股票资产的投资比例高于基金资产的 40%，已在法规及合同规定的期限内调整达标。

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	4,956,947.00	6.51
C	制造业	9,492,424.61	12.47
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	189,357.00	0.25
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	38,350.00	0.05
J	金融业	-	-
K	房地产业	1,323,000.00	1.74
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	607,376.00	0.80
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	16,607,454.61	21.82

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
原材料	806,590.74	1.06
周期性消费品	2,258,794.58	2.97
非周期性消费品	1,174,892.60	1.54
综合	264,909.83	0.35
能源	6,565,590.32	8.62
金融	1,028,414.85	1.35
基金	-	-
工业	1,326,947.91	1.74
信息技术	526,465.00	0.69
公用事业	-	-
通讯	-	-
合计	13,952,605.83	18.33

注：以上行业分类采用彭博行业分类标准。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 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	01898	中煤能源	405,000	3,542,682.02	4.65
2	601225	陕西煤业	117,300	3,235,134.00	4.25
3	00883	中国海洋石油	170,000	2,977,169.51	3.91
4	000858	五粮液	11,600	1,885,116.00	2.48
5	00753	中国国航	416,000	1,628,127.74	2.14
6	300750	宁德时代	6,100	1,536,529.00	2.02
7	001979	招商蛇口	108,000	1,323,000.00	1.74
8	00525	广深铁路股份	654,000	1,315,188.57	1.73
9	601899	紫金矿业	71,600	1,298,824.00	1.71
10	600961	株冶集团	140,000	1,230,600.00	1.62

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	5,700,581.65	7.49
2	央行票据	-	-
3	金融债券	5,109,361.64	6.71
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	8,787,217.48	11.54
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	2,002,255.89	2.63
7	可转债（可交换债）	14,793,266.63	19.43
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	36,392,683.29	47.81

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	2028023	20 招商银行永续债 01	50,000	5,109,361.64	6.71
2	019740	24 国债 09	41,000	4,132,087.84	5.43
3	148382	23 蛇口 01	40,000	4,044,745.21	5.31
4	148362	23 润置 01	20,000	2,024,944.11	2.66
5	102400784	24 晋能煤业 MTN008	20,000	2,002,255.89	2.63

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

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金参与股指期货交易，将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，制定相应的投资策略。

1、时点选择：基金管理人在交易股指期货时，重点关注当前经济状况、政策倾向、资金流向、和技术指标等因素。

2、套保比例：基金管理人根据对指数点位区间判断，在符合法律法规的前提下，决定套保比例。再根据基金股票投资组合的贝塔值，具体得出参与股指期货交易的买卖张数。

3、合约选择：基金管理人根据股指期货当时的成交金额、持仓量和基差等数据，选择和基金组合相关性高的股指期货合约为交易标的。

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

本基金可基于谨慎原则，将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，运用国债期货对基本投资组合进行管理，提高投资效率。本基金主要采用流动性好、交易活跃的国债期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量 (买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险指标说明
TL2412	TL2412	-1	-1,107,200.00	18,266.66	根据公募基金相关法规和本基金合同，我们可以以套期保值为目的，适度参与国债期货投资。本报告期间，我们选择持有一定比例的国债期货空头，对冲组合久期风险。
公允价值变动总额合计(元)					18,266.66

国债期货投资本期收益（元）	36,820.59
国债期货投资本期公允价值变动（元）	17,734.62

注：买入持仓以正数表示，卖出持仓以负数表示。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金可基于谨慎原则，将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，运用国债期货对基本投资组合进行管理，提高投资效率。本基金主要采用流动性好、交易活跃的国债期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现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

招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局地方分局的处罚。

本基金基金经理依据基金合同及公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对上述主体所发行证券进行了投资。本基金投资前十名证券的其余发行主体本报告期内未出现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 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	45,258.88
2	应收证券清算款	978,479.36
3	应收股利	182,742.23
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,240,720.18
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	2,447,200.65

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	113050	南银转债	1,469,480.40	1.93
2	113066	平煤转债	1,434,084.21	1.88
3	110079	杭银转债	1,352,294.36	1.78

4	110073	国投转债	1,139,494.64	1.50
5	127020	中金转债	1,114,988.60	1.46
6	110075	南航转债	1,114,756.26	1.46
7	113043	财通转债	666,130.95	0.88
8	127085	韵达转债	540,730.64	0.71
9	118024	冠宇转债	412,577.33	0.54
10	127073	天赐转债	406,968.55	0.53
11	110089	兴发转债	388,219.04	0.51
12	110085	通 22 转债	383,078.16	0.50
13	118034	晶能转债	362,894.52	0.48
14	113065	齐鲁转债	328,142.23	0.43
15	123108	乐普转 2	306,417.82	0.40
16	127066	科利转债	280,660.61	0.37
17	113666	爱玛转债	274,576.52	0.36
18	113062	常银转债	270,436.51	0.36
19	118030	睿创转债	258,167.87	0.34
20	113044	大秦转债	257,704.98	0.34
21	127038	国微转债	198,014.62	0.26
22	123107	温氏转债	182,175.43	0.24
23	113053	隆 22 转债	169,040.57	0.22
24	113655	欧 22 转债	151,166.00	0.20
25	113059	福莱转债	145,853.45	0.19
26	113675	新 23 转债	143,342.51	0.19
27	123090	三诺转债	115,666.39	0.15
28	128134	鸿路转债	85,693.03	0.11
29	123121	帝尔转债	82,123.10	0.11
30	113527	维格转债	81,976.50	0.11
31	127027	能化转债	70,245.32	0.09
32	118000	嘉元转债	69,546.83	0.09
33	123216	科顺转债	65,796.39	0.09
34	110082	宏发转债	65,437.38	0.09
35	113682	益丰转债	60,796.31	0.08
36	128136	立讯转债	54,577.11	0.07
37	113623	凤 21 转债	52,333.57	0.07
38	127056	中特转债	46,126.11	0.06
39	113605	大参转债	44,650.60	0.06
40	113061	拓普转债	39,050.84	0.05
41	123145	药石转债	37,711.33	0.05
42	118025	奕瑞转债	21,418.67	0.03
43	123154	火星转债	16,506.39	0.02
44	123115	捷捷转债	14,821.05	0.02
45	110076	华海转债	14,086.12	0.02

46	113633	科沃转债	2,114.77	0.00
47	123114	三角转债	1,192.04	0.00

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的情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	景顺长城安瑞混合 A	景顺长城安瑞混合 C
报告期期初基金份额总额	37,586,209.38	39,202,227.60
报告期期间基金总申购份额	2,365,397.53	542,519.92
减：报告期期间基金总赎回份额	6,782,096.99	6,718,555.73
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	33,169,509.92	33,026,191.79

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

§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

基金管理人本期末未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人本期末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

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	20240911-20240930	13,304,424.95	-	-	13,304,424.95	20.10
产品特有风险							
本基金由于存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20%的情况，可能会							

出现如下风险：

1、大额申购风险

在出现投资者大额申购时，如本基金所投资的标的资产未及时准备，则可能降低基金净值涨幅。

2、如面临大额赎回的情况，可能导致以下风险：

(1) 基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；

(2) 如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20% 的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回，如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；

(3) 基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平；

(4) 因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，导致基金净值出现较大波动；

(5) 基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略；

(6) 大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。

本基金管理人将建立完善的风险管理机制，以有效防止和化解上述风险，最大限度地保护基金份额持有人的合法权益。投资者在投资本基金前，请认真阅读本风险提示及基金合同等信息披露文件，全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策，获得基金投资收益，亦自行承担基金投资中出现的各类风险。

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、中国证监会准予景顺长城安瑞混合型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城安瑞混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城安瑞混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城安瑞混合型证券投资基金托管协议》；
- 5、景顺长城基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程；
- 6、其他在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值、定期报告及临时公告。

9.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

9.3 查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅。

景顺长城基金管理有限公司

2024 年 10 月 25 日