

# 长安泓沅中短债债券型证券投资基金

2024年第1季度报告

2024年03月31日

基金管理人:长安基金管理有限公司

基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期:2024年04月20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                         | 5  |
| 3.1 主要财务指标                               | 5  |
| 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                      | 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                | 10 |
| §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     | 11 |
| 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合                   | 11 |
| 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                       | 15 |
| §9 备查文件目录                                | 15 |
| 9.1 备查文件目录                               | 15 |
| 9.2 存放地点                                 | 15 |
| 9.3 查阅方式                                 | 15 |

## §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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年4月19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1月1日起至2024年3月31日止。

## §2 基金产品概况

|            |   |
|------------|---|
| 基金简称       | 长安泓沅中短债债券   |
| 基金主代码      | 004907  |
| 基金运作方式     | 契约型开放式  |
| 基金合同生效日    | 2019年05月10日   |
| 报告期末基金份额总额 | 2,324,141,188.62份   |
| 投资目标       | 在严格控制风险和保持良好流动性的前提下，重点投资中短债主题证券，力争获得超越业绩比较基准的投资收益，实现基金资产的长期稳健增值。  |
| 投资策略       | 1、类属配置策略<br>类属配置策略即决定资金在不同类属债券间的配置。<br>本基金将根据对经济周期和市场环境的把握，基于对财政政策、货币政策的深入分析及对宏观经济发展的持续跟踪，结合市场上主要的债券配置机构的资金情况，并根据不同类型债券的风险来源、收益率水平、利息支付方式、利息税务处理、附加选择权价值、类属资产收益差异、市场偏好及流动性等因素，在债券一级市场和二级市场，银行间市场和交易所市场，银行存款、信用债券、利率债券等资产类别之间进行类属配置，确定具有最优风险收益 |

特征的资产组合。

## 2、久期策略

久期策略主要指确定债券组合的久期水平。

本基金将全面、深入研究影响利率变化的宏观因素，如经济增长率、通货膨胀、国际收支等的变化，进而判断经济政策的基调和走向，结合债券市场资金供给结构、流动性充裕情况以及投资人避险情绪等的变化，判断和预测未来利率的可能走势，在一定范围内适当调整投资组合的久期水平。

## 3、期限结构策略

期限结构策略指通过预测收益率曲线的形状和变化趋势，对不同期限的债券进行合理配置。

本基金将分析同一类属债券的收益率曲线形态和期限结构变动，在给定组合久期以及其他组合约束条件的情形下，确定最优的期限结构。

## 4、信用债券策略

信用债券收益率等于基准收益率加信用利差，信用利差收益主要受两方面影响，一是该信用债券对应信用水平的市场平均信用利差曲线走势；二是该信用债券本身的信用变化。基于上述两方面因素，本基金采用以下投资策略：

基于信用利差曲线变化的策略：一是分析经济周期和相关市场变化对信用利差曲线的影响，二是分析信用债券市场容量、结构、流动性等变化趋势对信用利差曲线的影响，综合各种因素，分析信用利差曲线整体及分行业走势，确定信用债券总的投资比例及分行业的投资比例。

基于信用债券信用变化的策略：发行人信用发生变化后，本基金将采用变化后的债券信用级别所对应的信用利差曲线对信用债券定价。影响信用债券信用风险的因素包括行业风险、公司风险、现金流风险、资产负债风险和其他风险等。

## 5、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、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

|                 |  |               |                   |
|-----------------|--|---------------|-------------------|
|                 | <p>率利差分析和期权定价模型等方法，在严格控制风险的前提下，通过信用研究和流动性管理，选择经风险调整后相对价值较高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。</p> <p>6、回购套利策略</p> <p>本基金将在考虑债券投资的风险收益情况以及回购成本等因素的情况下，在风险可控及法律法规允许的范围内，通过债券回购融入和滚动短期资金，投资于收益率高于融资成本的债券等其他金融工具，获得杠杆放大收益。</p> |               |                   |
| 业绩比较基准          | 中债总财富（1-3年）指数收益率×80%+一年期定期存款利率（税后）×20%   |               |                   |
| 风险收益特征          | 本基金为债券型基金，预期风险和预期收益低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。   |               |                   |
| 基金管理人           | 长安基金管理有限公司   |               |                   |
| 基金托管人           | 上海浦东发展银行股份有限公司   |               |                   |
| 下属分级基金的基金简称     | 长安泓沅中短债债券A   | 长安泓沅中短债债券C    | 长安泓沅中短债债券E        |
| 下属分级基金的交易代码     | 004907   | 004908        | 012618            |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 665,513,560.64份  | 7,516,587.01份 | 1,651,111,040.97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01月01日 - 2024年03月31日) |              |                  |
|----------------|--------------------------------|--------------|------------------|
|                | 长安泓沅中短债债券A                     | 长安泓沅中短债债券C   | 长安泓沅中短债债券E       |
| 1.本期已实现收益      | 7,936,726.62                   | 103,276.75   | 26,849,305.56    |
| 2.本期利润         | 5,915,543.10                   | 91,354.55    | 20,243,356.32    |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0096                         | 0.0115       | 0.0103           |
| 4.期末基金资产净值     | 774,399,223.63                 | 8,638,781.74 | 1,913,463,915.84 |

|            |        |        |        |
|------------|--------|--------|--------|
| 5.期末基金份额净值 | 1.1636 | 1.1493 | 1.1589 |
|------------|--------|--------|--------|

- 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

长安泓沅中短债债券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      | 1.02%  | 0.06%     | 0.87%      | 0.02%         | 0.15% | 0.04% |
| 过去六个月      | 1.99%  | 0.04%     | 1.58%      | 0.03%         | 0.41% | 0.01% |
| 过去一年       | 4.88%  | 0.03%     | 2.98%      | 0.03%         | 1.90% | 0.00% |
| 过去三年       | 13.57% | 0.03%     | 8.87%      | 0.03%         | 4.70% | 0.00% |
| 自基金合同生效起至今 | 24.42% | 0.07%     | 14.81%     | 0.03%         | 9.61% | 0.04% |

本基金业绩标准为：中债总财富（1-3年）指数收益率×80%+一年期定期存款利率（税后）×20%。

长安泓沅中短债债券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      | 0.99%  | 0.06%     | 0.87%      | 0.02%         | 0.12% | 0.04% |
| 过去六个月      | 1.92%  | 0.04%     | 1.58%      | 0.03%         | 0.34% | 0.01% |
| 过去一年       | 4.73%  | 0.03%     | 2.98%      | 0.03%         | 1.75% | 0.00% |
| 过去三年       | 13.05% | 0.03%     | 8.87%      | 0.03%         | 4.18% | 0.00% |
| 自基金合同生效起至今 | 23.50% | 0.07%     | 14.81%     | 0.03%         | 8.69% | 0.04% |

本基金业绩标准为：中债总财富（1-3年）指数收益率×80%+一年期定期存款利率（税后）×20%。

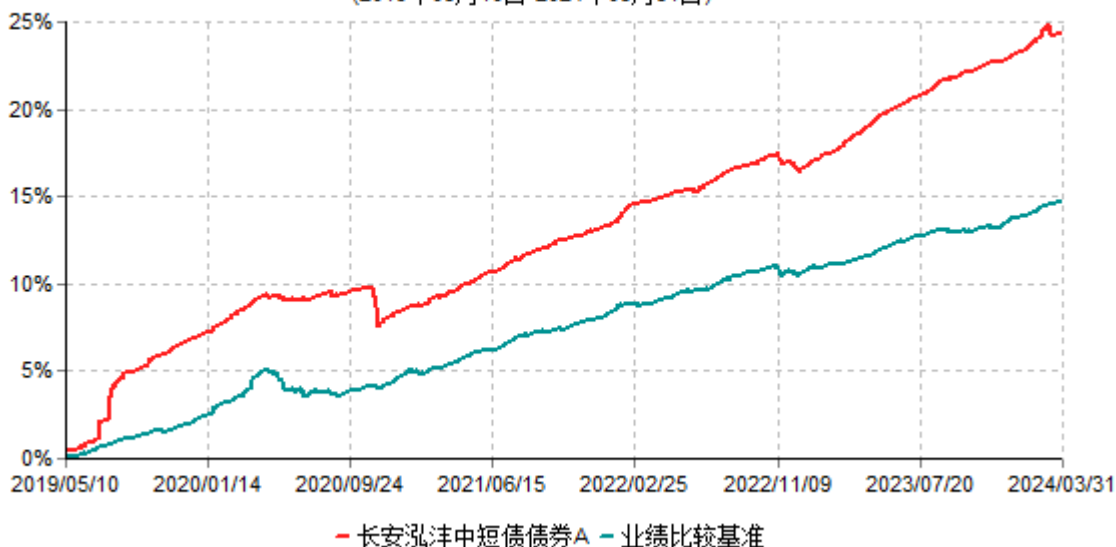
长安泓沅中短债债券E净值表现

| 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      | 0.99%  | 0.06%     | 0.87%      | 0.02%         | 0.12% | 0.04% |
| 过去六个月      | 1.91%  | 0.04%     | 1.58%      | 0.03%         | 0.33% | 0.01% |
| 过去一年       | 4.73%  | 0.03%     | 2.98%      | 0.03%         | 1.75% | 0.00% |
| 自基金合同生效起至今 | 9.55%  | 0.03%     | 6.24%      | 0.03%         | 3.31% | 0.00% |

本基金业绩标准为：中债总财富（1-3年）指数收益率×80%+一年期定期存款利率（税后）×20%。

3.2.2 自基金转型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

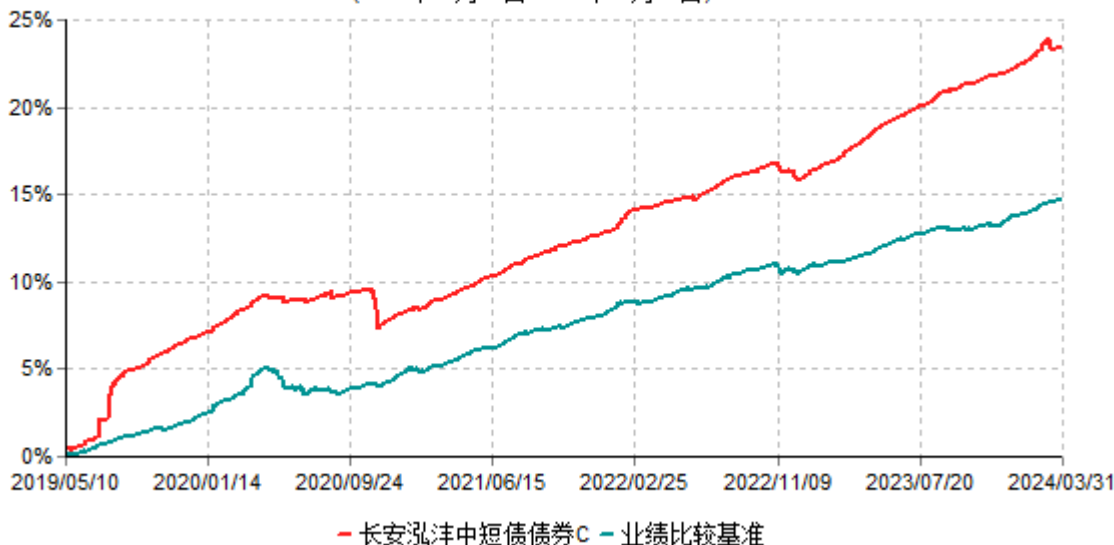
长安泓沅中短债债券A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2019年05月10日-2024年03月31日)



1、本基金由“长安鑫珏主题轮动混合型证券投资基金”转型而来，基金合同于2019年05月10日生效，截止本报告期末本基金运作时间已满一年。

2、根据基金合同的规定，自基金合同生效日起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。图示日期为2019年05月10日至2024年3月31日。

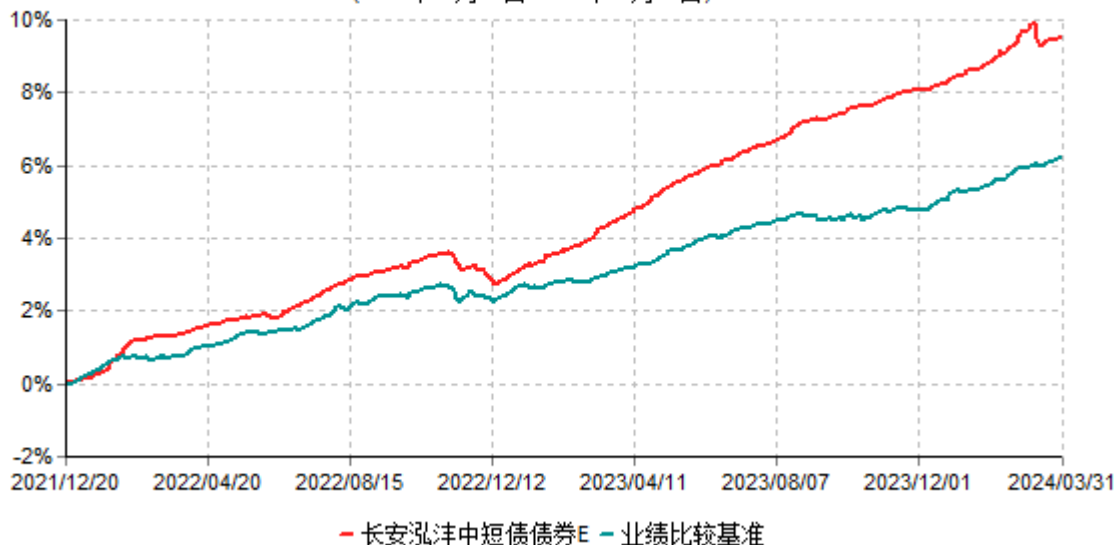
长安泓沅中短债债券C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2019年05月10日-2024年03月31日)



1、本基金由“长安鑫垚主题轮动混合型证券投资基金”转型而来，基金合同于 2019 年 05 月 10 日生效，截止本报告期末本基金运作时间已满一年。

2、根据基金合同的规定，自基金合同生效日起 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。图示日期为 2019 年 05 月 10 日至 2024 年 3 月 31 日。

长安泓沅中短债债券E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12月20日-2024年03月31日)



1、本基金由“长安鑫垚主题轮动混合型证券投资基金”转型而来，基金合同于 2019 年 05 月 10 日生效，截止本报告期末本基金运作时间已满一年。

2、长安泓沅中短债债券型证券投资基金于 2021 年 12 月 17 日公告新增 E 类份额，实际首笔 E 类份额申购申请于 2021 年 12 月 20 日确认，图示日期为 2021 年 12 月 20 日至 2024 年 3 月 31 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 | 2022-10-24  | -    | 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。 |

- 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

3月初政府工作报告提出今年GDP目标增速为5%，政策基调保持积极但力度温和，财政政策适度加力提质增效，赤字率维持3%，新增地方专项债规模有限，特别国债发行超预期。货币政策强调降成本，灵活适度，结构性货币工具将加强。2023年末央行第三次降低存款挂牌利率，1月初在降准降息的预期下，债市收益率快速下行，但1月公开市场操作利率不变，债市预期落空出现回调，1月24日央行宣布降准，降准幅度超市场预期，债市收益率再次进入下行通道。2月股市企稳回升，市场风险偏好抬升，债市收益率再次出现回调，但随着5年LPR超预期下调25bp，长端收益率再次向下突破。3月上旬长债继续走强，但长债绝对水平很低，10年和30年与MLF利率均出现倒挂，交易拥挤，在出现回调后诱发大量交易盘踩踏式止盈，导致长端利率出现了较大幅度的连续回调。央行两周内三次提及法定存款准备金仍有下降空间，且社融表现一般，债市收益率再次下行，但随后在超长期国债供给节奏和供给方式等消息面的扰动下，长端利率波动加大。总体来看，一季度长端利率走出了较大的牛市行情，10年期国债下行26bp至2.29%，30年国债收益率下行37bp至2.45%。一季度资金面均衡偏宽松，央行在公开市场的操作比较重视合理均衡，资金面在跨年、跨季和税期均没有出现大幅收紧，但资金面也并未出现大幅宽松，资金价格中枢没有明显下行，1年期国债收益率下行36BP至1.72%，结合久期来看，一季度短端收益率表现远不及长端和超长端利率，利率曲线走平。

信用债方面：一季度资产荒格局延续，信用债收益率整体压缩，1月、2月收益率持续震荡下行，3月触底后低位窄幅波动，短端收益极致挖掘后，市场向久期要收益，等级、期限利差显著收敛；信用利差方面，除短久期利差小幅走阔外其余全面收窄，产业债估值也继续压缩。从全季度来看，各等级1年期收益率下行20bp左右，AAA级5年下行31bp，AA级5年下行53bp，期限利差全面压缩，收益率曲线继续平坦化。

一季度因对长端和超长端利率走势较为乐观，加大了对长久期利率债的配置比例，但3月中旬长端利率出现急调后，没有及时减仓导致产品出现了较为明显的回撤。虽然整体来看，一季度利率债投资对产品业绩的贡献很大，但产品的波动也相应加大。本产品将遵循信用策略为主，利率择时增厚为辅，坚持中短债的产品定位，更加严格控制长端利率的敞口，努力控制回撤并维持产品收益的稳定增长。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末长安泓沅中短债债券A基金份额净值为1.1636元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.02%，同期业绩比较基准收益率为0.87%；截至报告期末长安泓沅中短债债券C基金份额净值为1.1493元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.99%，同期业绩比较基准收益率为0.87%；截至报告期末长安泓沅中短债债券E基金份额净值为1.1589元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.99%，同期业绩比较基准收益率为0.87%。

#### 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              | -                | -             |
|    | 其中：股票             | -                | -             |
| 2  | 基金投资              | -                | -             |
| 3  | 固定收益投资            | 2,909,992,869.75 | 96.22         |
|    | 其中：债券             | 2,909,992,869.75 | 96.22         |
|    | 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          | 91,036,649.32    | 3.01          |
|    | 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      | 11,765,212.18    | 0.39          |
| 8  | 其他资产              | 11,629,791.02    | 0.38          |
| 9  | 合计                | 3,024,424,522.27 | 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

本基金本报告期末未持有股票。

#### 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

本基金本报告期末未持有股票。

### 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      | 200,931,544.05   | 7.45   |
| 2  | 央行票据      | -                | -      |
| 3  | 金融债券      | 702,567,035.78   | 26.05  |
|    | 其中：政策性金融债 | 702,567,035.78   | 26.05  |
| 4  | 企业债券      | 84,997,319.47    | 3.15   |
| 5  | 企业短期融资券   | 731,434,479.92   | 27.13  |
| 6  | 中期票据      | 1,190,062,490.53 | 44.13  |
| 7  | 可转债（可交换债） | -                | -      |
| 8  | 同业存单      | -                | -      |
| 9  | 其他        | -                | -      |
| 10 | 合计        | 2,909,992,869.75 | 107.92 |

#### 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  | 210203 | 21国开03   | 1,500,000 | 153,888,287.67 | 5.71         |
| 2  | 200203 | 20国开03   | 1,000,000 | 101,793,661.20 | 3.78         |
| 3  | 240401 | 24农发01   | 1,000,000 | 100,098,306.01 | 3.71         |
| 4  | 230023 | 23付息国债23 | 800,000   | 90,140,196.72  | 3.34         |
| 5  | 200405 | 20农发05   | 800,000   | 81,944,721.31  | 3.04         |

#### 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

本基金本报告期末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 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票库之外的情况。

#### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额(元)         |
|----|---------|---------------|
| 1  | 存出保证金   | 508.21        |
| 2  | 应收证券清算款 | -             |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | -             |
| 5  | 应收申购款   | 11,629,282.81 |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 其他      | -             |
| 8  | 合计      | 11,629,791.02 |

#### 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

本报告期内本基金投资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

|              | 长安泓沅中短债债券A     | 长安泓沅中短债债券C   | 长安泓沅中短债债券E       |
|--------------|----------------|--------------|------------------|
| 报告期期初基金份额总额  | 646,807,007.67 | 8,200,198.02 | 1,959,677,191.51 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 460,478,881.98 | -            | 1,709,074,811.32 |
| 减：报告期期间基     | 441,772,329.01 | 683,611.01   | 2,017,640,961.86 |

|                           |                |              |                  |
|---------------------------|----------------|--------------|------------------|
| 金总赎回份额                    |                |              |                  |
| 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               | 665,513,560.64 | 7,516,587.01 | 1,651,111,040.97 |

## §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

| 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    | 01             | 20240101-20240331      | 826,632,444.95 | 431,816,219.01 | 402,220,255.81 | 856,228,408.15 | 36.84% |

#### 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、长安泓沅中短债债券型证券投资基金基金合同；
- 3、长安泓沅中短债债券型证券投资基金托管协议；
- 4、长安泓沅中短债债券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

上海市浦东芳甸路1088号紫竹国际大厦16楼。

### 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](http://www.changanfunds.com)。

长安基金管理有限公司

2024年04月20日