

**长安裕腾灵活配置混合型证券投资基金
招募说明书摘要
(2018 年第 1 次更新)**

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

重要提示

1、长安裕腾灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会2018年1月4日证监许可〔2018〕14号文（《关于准予长安裕腾灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》）准予注册。

2、基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

3、证券投资基金是一种长期投资工具，其主要功能是分散投资，降低投资单一证券所带来的个别风险。本基金投资于证券/期货市场，基金份额净值会因为证券/期货市场波动等因素产生波动。投资有风险，投资人在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性并认真阅读本招募说明书和基金合同等信息披露文件，根据自身的投资目的、风险承受能力、投资期限、投资经验、资产状况等，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。

4、基金在投资运作过程中可能面临各种风险，既包括市场风险，也包括基金自身的管理风险、估值风险、流动性风险以及技术风险和本基金的特定风险和其他风险等。

5、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。

6、本基金投资港股通股票的资产占股票资产的比例为0-50%，本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股通股票或选择不将基金资产投资于港股通股票，基金资产并非必然投资港股通股票。

本基金投资港股通股票，会面临因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于市场联动的风险、汇率风险、股价波动较大的风险、港股通额度限制的风险、港股通可投资标的范围调整带来的风险、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险、交收制度带来的风险、港股通下对公司行为的处理规则带来的风险、香港联合交易所停牌、退市等制度性差异带来的风险、港股通规则变动带来的风险和其他可能的风险等。

7、投资者应通过本基金管理人或指定的销售机构购买基金。本基金在募集期内按1.00元面值发售并不改变基金的风险收益特征。投资者按1.00元面值购买基金份额以后，有可能面临基金份额净值跌破1.00元、从而遭受损失的风险。

8、基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资者注意基

金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。投资人应当认真阅读基金合同、基金招募说明书等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。

9、单一投资者持有本基金基金份额数不得达到或超过基金总份额的50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过50%的除外。

10、本招募说明书所载内容截止日为2018年12月6日，有关财务数据和净值表现截止日为2018年9月30日。

一、基金管理人

一、基金管理人情况

名称：长安基金管理有限公司

住所：上海市虹口区丰镇路806号3幢371室

办公地址：上海市浦东新区芳甸路1088号紫竹国际大厦16层

法定代表人：万跃楠

成立日期：2011年9月5日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监许可[2011]1351号

组织形式：有限责任公司

注册资本：2.7亿元人民币

存续期限：持续经营

联系人：曹玫

联系电话：021-2032 9688

股权结构：

股东名称	股权比例
长安国际信托股份有限公司	29.63%
杭州景林投资管理合伙企业（有限合伙）	25.93%
上海恒嘉美联发展有限公司	24.44%
五星控股集团有限公司	13.33%
兵器装备集团财务有限责任公司	6.67%
合计	100%

二、主要人员情况

1、董事会成员

万跃楠先生，董事，经济学博士。曾任南昌保险学校教师，中国证监会机构监管部处长，长沙通程实业集团有限公司总裁，特华投资控股有限公司执行总裁，兵器装备集团财务有限责任公司副总经理和安信期货有限责任公司董事长等职，现任长安基金管理有限公司董事长，长安财富资产管理有限公司董事。

姜燕女士，董事，金融学硕士。曾任中信实业银行信贷部信贷员、信贷主管，美林国际有限公司全球市场部副总监，中国农业银行伦敦子行筹备组顾问，花旗银行全球市场部副总监，现任长安国际信托股份有限公司总裁助理，兼任投资总监、家族信托事业部总经理、家

族信托投资配置部总经理等职。

高斌先生，董事，硕士。曾任中国证监会市场监管部主任科员、副处长、处长，中国证监会驻深圳证券交易所督察员，中国证券登记结算公司总经理助理、党委委员、常务副总经理，期间兼任中国证券登记结算公司上海分公司总经理，现任上海景林投资发展有限公司总裁。

范欢欢女士，董事，管理学学士。曾任上海景林投资发展有限公司市场营销部产品经理、投资研究部研究助理、总裁办投后管理等岗位，现任上海景林投资发展有限公司总裁办高级经理。

李莉女士，董事，经济学硕士、工商管理硕士。曾任中国招商银行总行离岸业务部经理、同业机构部高级经理，美国 PIMCO 总部香港公司副总裁，现任上海国和现代服务业股权投资管理有限公司董事总经理，上海正阳国际经贸有限公司董事长、法人代表，通联网络支付股份有限公司监事。

袁丹旭先生，董事，金融工程硕士。曾任美国富国银行资深经理、招商银行总行零售部副总经理、深圳发展银行（平安银行）总监、工商银行总行私人银行部副总经理、交通银行总行私人银行部副总经理，现任长安基金管理有限公司总经理，长安财富资产管理有限公司董事长。

田高良先生，独立董事，管理学博士。曾任西安秦川机械厂厂部办公室经济秘书，陕西财经学院会计系讲师，西安交通大学会计学院财务管理系讲师、副教授，现任西安交通大学会计学院财务管理系教授。

田轩先生，独立董事，金融学博士。曾任美国印第安纳大学凯利商学院终身教授，现任清华大学五道口金融学院昆吾九鼎金融学讲席教授，教育部“长江学者”特聘教授，博士生导师，保利能源控股有限公司独立董事。

傅蔚冈先生，独立董事，法学博士。曾任上海金融与法律研究院院长助理，现任上海金融与法律研究院执行院长，北京鸿儒金融教育基金会副秘书长。

2、监事会成员

孔舰先生，监事，经济学博士。曾任中国核工业集团原子能研究院资产经营处项目经理，兵器装备集团财务有限责任公司战略研究部战略研究员、行业研究员，现任兵器装备集团财务有限责任公司战略研究部副总经理。

吴缨女士，职工监事，上海财经大学金融学研究生，理学学士。曾任江西电力职大助教，亚龙湾开发股份有限公司董事会秘书兼资金证券部经理，海南欣龙无纺股份有限公司董事会秘书，上海君创财经顾问有限公司副总经理，上海鼎立实业投资有限公司副总经理等职。现任长安基金管理有限公司综合管理部总经理。

3、高级管理人员

万跃楠先生，董事长，简历同上。

袁丹旭先生，总经理，简历同上。

李永波先生，督察长。法学学士、民商法学硕士，十一年以上法律及基金从业经历。曾任上海市源泰律师事务所律师、上海市通力律师事务所律师，上海市律师协会基金业务委员会委员，长安基金管理有限公司监察稽核部副总经理、监察稽核部总经理等职，现任长安基金管理有限公司督察长、党支部书记。

王健先生，副总经理。工商管理博士，十六年基金行业从业经历。曾任长信基金管理有限公司市场开发部总监，金元比联基金管理有限公司渠道销售部总监，长安基金管理有限公司市场总监等职。

4、本基金基金经理

徐小勇先生，工商管理硕士，二十三年以上金融行业从业经历。曾就职于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等职，现任长安基金管理有限公司总经理助理、投资总监，长安裕腾灵活配置混合型证券投资基金及长安裕隆灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

5、投资决策委员会成员

袁丹旭先生，简历同上。

徐小勇先生，简历同上。

吴土金先生，经济学硕士，十年以上金融行业从业经历。曾任长城证券股份有限公司研究员，国投瑞银基金管理有限公司研究员，平安养老保险有限公司组合经理，财通证券资产管理有限公司基金经理，德邦基金管理有限公司事业部总监，现任长安基金管理有限公司总经理助理。

林忠晶先生，经济学博士，八年以上金融行业从业经历。曾任安信期货有限责任公司高级分析师，中海石油气电集团有限责任公司贸易部研究员，长安基金管理有限公司产品经理、战略及产品部副总经理、量化投资部（筹）总经理、基金投资部副总经理等职，现任长安基金管理有限公司基金投资部总经理，长安沪深300非周期行业指数证券投资基金、长安产业精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、长安鑫利优选灵活配置混合型证券投资基金、长安鑫富领先灵活配置混合型证券投资基金、长安鑫垚主题轮动混合型证券投资基金、长安鑫恒回报混合型证券投资基金、长安鑫旺价值灵活配置混合型证券投资基金、长安宏观策略混合型证券投资基金、长安鑫兴灵活配置混合型证券投资基金及长安鑫禧灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

栾绍菲先生，金融与经济学硕士，七年以上金融行业从业经历。曾任长安基金管理有限公司研究部研究员、基金经理助理等职，现任长安基金管理有限公司研究部副总经理，长安宏观策略混合型证券投资基金及长安产业精选灵活配置混合型发起式证券投资基金的基金经理。

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

三、基金管理人的职责

1、依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

2、办理基金备案手续；

3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；

4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；

5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

6、编制基金季度、半年度和年度报告；

7、计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；

8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；

9、按照规定召集基金份额持有人大会；

10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

11、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

12、有关法律法规、中国证监会规定的其他职责。

四、基金管理人的承诺

1、基金管理人将遵守《中华人民共和国证券法》、《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》等法律法规的相关规定，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违法违规行为的发生。

2、基金管理人承诺防止下列行为的发生：

（1）将基金管理人固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；

（2）不公平地对待其管理的不同基金财产；

（3）利用基金财产或职务之便为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；

（4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；

（5）侵占、挪用基金财产；

（6）泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

（7）玩忽职守，不按照规定履行职责；

（8）法律、行政法规有关规定和中国证监会规定禁止的其他行为。

3、基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律、法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下活动：

（1）越权或违规经营；

（2）违反基金合同或托管协议；

- (3) 故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法权益；
- (4) 在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；
- (5) 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
- (6) 玩忽职守、滥用职权；
- (7) 违反现行有效的有关法律法规、基金合同和中国证监会的有关规定，泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
- (8) 除按基金管理人制度进行基金运作投资外，直接或间接进行其他股票投资；
- (9) 协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易；
- (10) 违反证券交易所业务规则，利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；
- (11) 贬损同行，以抬高自己；
- (12) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；
- (13) 以不正当手段谋求业务发展；
- (14) 有悖社会公德，损害证券投资基金从业人员形象；
- (15) 其他法律、行政法规和中国证监会禁止的行为。

4、基金经理承诺

- (1) 依照有关法律法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；
- (2) 不利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者牟取利益；
- (3) 不泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
- (4) 不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

五、基金管理人的内部控制制度

1、内部控制的目标

- (1) 保证公司经营运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规定，坚持基金份额持有人利益最大化原则，自觉形成守法经营、规范运作的意识和理念；
- (2) 防范和化解经营风险，提高经营管理效益，确保经营业务的稳健运行和受托资产的安全完整，实现公司的持续、稳定、健康发展；
- (3) 确保基金、公司财务和其它信息真实、准确、完整和及时披露；
- (4) 确保投资管理活动中公平对待不同投资组合，保护投资者合法权益。

2、内部控制的原则

- (1) 健全性原则。内部控制包括公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员，并涵

盖到决策、执行、监督、反馈等各个环节；

（2）有效性原则。通过科学的内控手段和方法，建立合理的内控程序，维护内控制度的有效执行；

（3）独立性原则。公司各机构、部门和岗位职责保持相对独立，公司基金资产、自有资产、其它资产的运作严格分离；

（4）相互制约原则。公司各机构、部门和岗位的设置权责分明、相互制衡；

（5）成本效益原则。公司运用科学化的经营管理方法降低运作成本，提高经济效益，以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

3、制订内部控制制度的原则

（1）合法合规性原则。公司内控制度符合国家法律法规、规章和各项规定，必须把国家的法律法规、规章和各项政策体现到内控制度中；

（2）全面性原则。内部控制制度涵盖公司经营管理的各个环节，不得留有制度上的空白或漏洞；

（3）审慎性原则。公司内部的核心是风险控制，制定内部控制制度以审慎经营、防范和化解风险为出发点；

（4）适时性原则。公司内部控制制度必须随着有关法律法规的调整和公司经营战略、经营方针、经营理念等内外部环境的变化及时地进行修改或完善。

4、内部控制的制度体系

公司内部控制的制度体系由内部控制大纲、基本管理制度和部门业务规章三个层次的制度系列构成，这三个不同层次的内部管理制度既相互独立又互相联系，在公司章程的指引和约束下构成了公司总体的内部控制的制度体系。

内部控制大纲是对公司章程的原则规定的细化和展开，同时又是对公司各项基本管理制度的总揽和原则指导。

基本管理制度是依据内部控制大纲对各项业务活动和公司管理的基本规范，涵盖公司各项业务及管理活动的各个方面，为部门管理制度和业务工作手册的制定提供了依据。基本管理制度主要包括风险控制制度、投资管理制度、基金运营制度、信息披露制度、监察稽核制度、信息技术管理制度、公司财务制度、行政管理制度、人力资源管理制度和反洗钱制度等。

部门业务规章则直接对员工日常工作进行约束和指导。

三层内部控制制度体系在不同的控制层次上，对公司经营管理活动的决策、执行和监督进行规范，将公司在经营管理活动中可能发生的风险，根据不同的决策层和执行层的权利与责任进行分解，并对决策和执行过程中的风险点和风险因素，通过相应的内部控制制度予以防范和控制，实现公司的合法合规运行，强化公司的内部风险控制，从而维护公司股东和基金份额持有人的利益。

5、内部控制的监控防线

公司依据自身经营特点设立顺序递进、权责统一、严密有效的三道监控防线：

（1）建立以各岗位目标责任制为基础的第一道监控防线。明确各岗位职责，并制定详细的岗位说明和业务流程，各岗位人员上岗前必须声明已知悉并承诺遵守，在授权范围内承担岗位责任；

（2）建立相关部门、相关岗位之间相互监督制衡的第二道监控防线。公司建立重要业务处理凭据传递和信息沟通制度，相关部门和岗位之间相互监督制衡；

（3）建立以督察长和监察稽核部对各岗位、各部门、各机构、各项业务全面实施监督反馈的第三道监控防线。督察长、监察稽核部独立于其它部门和业务活动，并对内部控制制度的执行情况实行严格的检查和反馈。

6、基金管理人关于内部控制制度的声明

基金管理人确知建立内部控制系统、维持其有效性以及有效执行内部控制制度是公司董事会及管理层的责任，董事会承担最终责任；基金管理人特别声明以上关于风险管理和内部控制的披露真实、准确，并承诺根据市场的变化和基金管理人的发展不断完善风险管理和内部控制制度。

二、基金托管人

一、基金托管人情况

1、基本情况

名称：中国农业银行股份有限公司（简称中国农业银行）

住所：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座

法定代表人：周慕冰

成立日期：2009 年 1 月 15 日

批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复[2009]13 号

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]23 号

注册资本：32,479,411.7 万元人民币

存续期间：持续经营

联系电话：010-66060069

传真：010-68121816

联系人：贺倩

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分,总行设在北京。经国务院批准,中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于 2009 年 1 月 15 日依法成立。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。

中国农业银行网点遍布中国城乡，成为国内网点最多、业务辐射范围最广，服务领域最广，服务对象最多，业务功能齐全的大型国有商业银行之一。在海外，中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉，每年位居《财富》世界 500 强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行，中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念，坚持审慎稳健经营、可持续发展，立足县域和城市两大市场，实施差异化竞争策略，着力打造“伴你成长”服务品牌，依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品，致力为广大客户提供优质的金融服务，与广大客户共创价值、共同成长。

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行，经验丰富，服务优质，业绩突出，2004 年被英国《全球托管人》评为中国“最佳托管银行”。2007 年中国农业银行通过了美国 SAS70 内部控制审计，并获得无保留意见的 SAS70 审计报告。自 2010 年起中国农业银行连续通过托管业务国际内控标准（ISAE3402）认证，表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强能力建设，品牌声誉进一步提升，在 2010 年首届“‘金牌理财’ TOP10 颁奖盛典”中成绩突出，获“最佳托管银行”奖。2010 年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的“最佳资产托管奖”。2012 年荣获第十届中国财经风云榜“最佳资产托管银行”称号；2013 年至 2017 年连续荣获上海清算所授予的“托管银行优秀奖”和中央国债登记结算有限责任公司授予的“优秀托管机构奖”称号；2015 年、2016 年荣获中国银行业协会授予的“养老金业务最佳发展奖”称号；2018 年荣获中国基金报授予的公募基金 20 年“最佳基金托管银行”奖。

中国农业银行证券投资基金托管部于 1998 年 5 月经中国证监会和中国人民银行批准成立，2014 年更名为托管业务部/养老金管理中心，内设综合管理部、业务管理部、客户一部、客户二部、客户三部、客户四部、风险合规部、产品研发与信息技术部、营运一部、营运二部、市场营销部、内控监管部、账户管理部，拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

2、主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工近 240 名，其中具有高级职称的专家 30 余名，服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强，高级管理层均有 20 年以上金融从业经验和高级技术职称，精通国内外证券市场的运作。

3、基金托管业务经营情况

截止到 2018 年 9 月 30 日，中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共 419 只。

（二）基金托管人的内部风险控制制度说明

1、内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金财产的安全完整，确保有关信息的真

实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

2、内部控制组织结构

中国农业银行风险管理委员会总体负责中国农业银行的风险管理与内部控制工作，对托管业务风险管理和内部控制工作进行监督和评价。托管业务部专门设置了风险管理处，配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，独立行使监督稽核职权。

3、内部控制制度及措施

中国农业银行具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理实行严格的复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

（三）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

基金托管人通过参数设置将《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议规定的投资比例和禁止投资品种输入监控系统，每日登录监控系统监督基金管理人的投资运作，并通过基金资金账户、基金管理人的投资指令等监督基金管理人的其他行为。

当基金出现异常交易行为时，基金托管人应当针对不同情况进行以下方式的处理：

1、电话提示。对媒体和舆论反映集中的问题，电话提示基金管理人；

2、书面警示。对本基金投资比例接近超标、资金头寸不足等问题，以书面方式对基金管理人进行提示；

3、书面报告。对投资比例超标、清算资金透支以及其他涉嫌违规交易等行为，书面提示有关基金管理人并报中国证监会。

三、相关服务机构

一、基金份额销售机构

1、直销机构

名称：长安基金管理有限公司

注册地址：上海市虹口区丰镇路 806 号 3 幢 371 室

办公地址：上海市浦东新区芳甸路 1088 号紫竹国际大厦 16 楼

法定代表人：万跃楠

电话：021-2032 9866

传真：021-2032 9899

联系人：吴昱

客户服务电话：400-820-9688

网上交易平台：www.changanfunds.com

投资人可以通过直销机构网上交易系统办理本基金的开户、申购及赎回等业务，具体交易细则请参阅直销机构网站公告。

2、其他销售机构

(1) 交通银行股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号

法定代表人：彭纯

客户服务电话：95559

公司网址：<http://www.bankcomm.com/>

(2) 上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：高国富

客户服务电话：95528

公司网址：<http://www.spdb.com.cn/>

(3) 河南和信证券投资顾问股份有限公司

注册地址：郑州市郑东新区金水东路南、农业东西路 1 号楼美盛中心 24 层 2405

法定代表人：石磊

客服电话：0371-61777558

公司网址：www.hexinsec.com

(4) 深圳众禄基金销售有限公司

注册地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

办公地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

法定代表人：薛峰

客服电话：400-6788-887

公司网址：www.zlfund.cn 及 www.jjmmw.com

(5) 上海天天基金销售有限公司

办公地址：上海市徐汇区龙田路195号3C座9楼

法定代表人：其实

客服电话：400-181-8188

公司网址：www.1234567.com.cn

(6) 上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室

办公地址：上海市浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦9楼

法定代表人：杨文斌

客服电话：400-700-9665

公司网址：www.ehowbuy.com

(7) 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

注册地址：杭州市余杭区仓前街道海曙路东2号

法定代表人：陈柏青

客服电话：400-076-6123

公司网址：www.fund123.cn

(8) 上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路526号2幢220室

办公地址：上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层

法定代表人：张跃伟

公司网址：www.erichfund.com

(9) 一路财富（北京）信息科技股份有限公司

注册地址：北京市西城区阜成门外大街2号1幢A2208室

法定代表人：吴雪秀

客服电话：4000011566

公司网址：www.yilucaifu.com

(10) 上海联泰资产管理有限公司

注册地址：上海自由贸易实验区富特北路277号3层310室

法定代表人：燕斌

客服电话：4000-466-788

公司网址：www.66zichan.com

（11） 上海陆金所资产管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

法定代表人：郭坚

客服电话：400-821-9031

公司网站：www.lufunds.com

（12） 大泰金石投资管理有限公司

注册地址：南京市建邺区江东中路 359 号国睿大厦 1 号楼 B 区 4 楼 A506 室

办公地址：上海市浦东新区峨山路 505 号东方纯一大厦 15 楼

法定代表人：袁顾明

客服电话：400-928-2266

公司网址：www.dtfunds.com

（13） 珠海盈米财富管理有限公司

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际大厦南塔 12 楼

法定代表人：肖雯

客服电话：020-89629066

公司网址：www.yingmi.cn

（14） 中信期货有限公司

注册地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、
14 层

法定代表人：张磊

客服电话：400-990-8826

公司网址：www.citicsf.com

（15） 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区商城路 618 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼

法定代表人：万建华

客服电话：400-888-8666

公司网址：www.gtja.com

（16） 中信建投证券有限责任公司

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：王常青

客服电话：400-888-8108

公司网址：www.csc108.com

(17) 国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人：何如

客服电话：95536

公司网址：www.guosen.com.cn

(18) 招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 38-45 层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 38-45 层

法定代表人：宫少林

客服务电话：95565

公司网址：www.newone.com.cn

(19) 广发证券股份有限公司

注册地址：广州天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼（4301-4316 房）

办公地址：广东省广州天河北路大都会广场 5、18、19、36、38、39、41、42、43、44 楼

法定代表人：孙树明

客服电话：95575

公司网址：www.gf.com.cn

(20) 中信证券股份有限公司

注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 A 层

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法定代表人：王东明

客服电话：95558

公司网址：www.cs.ecitic.com

(21) 中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

办公地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：陈有安

客服电话：400-888-8888

公司网址：www.chinastock.com.cn

(22) 申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人：李梅

客服电话：95523 或 4008895523

电话委托：021-962505

公司网址：www.swhysc.com

（23） 安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 34 层、28 层 A02 单元

办公地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层

法定代表人：牛冠兴

客服电话：400-800-1001

公司网址：www.essence.com.cn

（24） 万联证券有限责任公司

注册地址：广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 F 栋 18、19 层

办公地址：广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 F 栋 18、19 层

法定代表人：张建军

客服电话：400-888-8133

公司网址：www.wlzq.com.cn

（25） 中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区苗岭路 29 号澳柯玛大厦 15 层(1507-1510 室)

办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 20 层

法定代表人：张智河

客服电话：0532-96577

公司网址：www.zxwt.com.cn

（26） 信达证券股份有限公司

住所：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

办公地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人：高冠江

客服电话：400-800-8899

公司网址：www.cindasc.com

（27） 光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：薛峰

客服电话：95525

公司网址：www.ebscn.com

(28) 浙商证券股份有限公司

注册地址：浙江省杭州市江干区五星路 201 号

法定代表人：吴承根

客服电话：95345

公司网址：www.stocke.com.cn

(29) 华安证券股份有限公司

注册地址：安徽省合肥市长江中路 357 号

办公地址：安徽省合肥市阜南路 166 号润安大厦 A 座

法定代表人：李工

客服电话：400-809-6518

公司网址：www.hazq.com

(30) 申万宏源西部证券有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室

办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室

法定代表人：许建平

客服电话：400-800-0562

公司网址：www.hysec.com

(31) 中泰证券股份有限公司

注册地址：济南市经七路 86 号

办公地址：济南市经七路 86 号 23 层

法定代表人：李玮

客户电话：95538

公司网址：www.qlzq.com.cn

(32) 上海华信证券有限责任公司

注册地址：上海浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 9 楼

法定代表人：郭林

客服热线：400-820-5999

公司网址：www.shhxzq.com

(33) 国金证券股份有限公司

注册地址：成都市青羊区东城根上街 95 号

办公地址：成都市青羊区东城根上街 95 号

法定代表人：冉云

客服电话：400-160-0109

公司网址：www.gjzq.com.cn

（34） 天风证券股份有限公司

注册地址：湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路 2 号高科大厦四楼

办公地址：中国武汉市武昌区中南路 99 号保利广场 A 座 37 楼

法定代表人：余磊

客服电话：400-800-5000

公司网站：www.tfzq.com

（35） 广州证券股份有限公司

注册地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层

法定代表人：胡伏云

客服电话：95396

公司网址：www.gzs.com.cn

（36） 北京唐鼎耀华基金销售有限公司

注册地址：北京市延庆区延庆经济开发区百泉街 10 号 2 栋 236 室

法定代表人：张冠宇

客服电话：400-819-9868

公司网址：www.tdyhfund.com

（37） 上海万得基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座

法定代表人：王廷富

客服电话：400-799-1888

公司网址：www.520fund.com.cn

（38） 上海证券有限责任公司

注册地址：上海市黄浦区四川中路 213 号 7 楼

法定代表人：李俊杰

客服电话：021-962518

公司网址：www.962518.com

（39） 华鑫证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01（b）单元

法定代表人：俞洋

客服电话：400-109-9918

公司网址：www.cfsc.com.cn

（40） 华金证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 759 号 30 层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 759 号 30 层

法定代表人：宋卫东

客服电话：4008-211-357

公司网址：www.huajinsc.cn

基金管理人可根据有关法律法规的要求，变更或增减其他符合要求的机构销售本基金，并及时公告。

二、登记机构

名称：长安基金管理有限公司

注册地址：上海市虹口区丰镇路806号3幢371室

办公地址：上海市浦东新区芳甸路1088号紫竹国际大厦16楼

法定代表人：万跃楠

联系电话：021-2032 9771

传真：021-2032 9741

联系人：欧鹏

三、出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

注册地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

办公地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

负责人：俞卫锋

联系电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：陆奇

经办律师：安冬、陆奇

四、审计基金财产的会计师事务所

名称：毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）

注册地址：北京市东长安街1号东方广场东2座8层

办公地址：上海市南京西路1266号恒隆广场1期50楼

法定代表人：邹俊

电话：021-22122888

传真：021-62881889

联系人：黄小熠

经办注册会计师：水青、黄小熠

四、基金的名称

长安裕腾灵活配置混合型证券投资基金

五、基金的类型

混合型证券投资基金

六、基金的投资目标

在严格控制风险和保持流动性的前提下，把握中国资本市场开放带来的投资机会，精选具有价值优势的上市公司进行投资，追求基金资产的长期稳健增值。

七、基金的投资范围

本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、港股通股票、衍生工具（包括权证、股指期货、国债期货等）、债券（包括国债、地方政府债、政府支持机构债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换公司债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0-95%，其中投资于港股通股票的资产占股票资产的比例为 0-50%；每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，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、应收申购款等。其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

如法律法规或中国证监会变更投资品种的比例限制的，基金管理人可依据相关规定履行适当程序后调整本基金的投资比例规定。

八、基金的投资策略

本基金投资策略包括五大方面，即大类资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略和衍生品投资策略。

（一）大类资产配置策略

本基金的大类资产配置采用“自上而下”的多因素分析决策支持系统，结合定性分析和定量分析，确定基金资产在股票、债券及货币市场工具等类别资产的配置比例，并随着各类证券风险收益特征的相对变化动态调整配置比例，以平衡投资组合的风险和收益。本基金进行大类资产配置时，重点考察宏观经济状况、政府政策和资本市场等三方面的因素：

1、宏观经济状况：重点关注GDP、工业增加值、CPI、PPI、投资、消费、进出口、流动性状况、利率、汇率等经济指标，同时关注香港和海外经济发展的数据，以评估大陆和香港经济发展所处阶段及宏观经济变化趋势；

2、政府政策：重点关注大陆和香港及其他海外主要经济体的货币政策、财政政策、产业政策和资本市场政策的变动趋势，评估其对大陆和香港经济发展及各行业和资本市场的影响；

3、资本市场因素：重点关注大陆和香港资金供求、投资者构成、市场情绪、流动性和不同市场的相对估值等指标，以判断未来市场变动趋势。

（二）股票投资策略

本基金A股和港股通股票采用同一投资策略，均按照以下策略进行投资，以更好发挥基金管理人的投资优势。

在A股和港股通股票的投资上，基金管理人坚持价值投资理念，自下而上精选个股。通过案头分析和实地调研，进行深入的基本面研究，分析不同类型的企业的价值驱动因素，估算其内在价值，密切关注其价值实现的方式和时机，综合考虑可能影响企业价值及市场价格的因素，把握投资时机，投资于同时具有内在价值优势和估值优势的公司，并根据市场价格的变化和价值的实现程度，把握更为确定的投资机会，以更好控制风险，实现基金资产的长期稳健增值。

1、个股选择策略

本基金将上市公司分成6种类型，根据不同类型公司的特点，采用不同的投资策略和投资方法。同时，本基金采用事件驱动策略，把握事件带来的套利交易的机会。

（1）6种不同类型公司的投资策略

1) 缓慢增长型公司

缓慢增长型公司的特点是公司的增长速度较低，增长速度通常与 GDP 增速相当，此类型公司大多属于蓝筹类公司，其显著特征是定期支付较高比例的股息。

对于此类型公司，投资目的主要是获取较高的股息，对于股价波动较大的市场，需要谨慎选择投资标的。

2) 稳定增长型公司

稳定增长型公司通常是大型公司，成长速度不高，但高于缓慢增长型公司。此类型公司的业务增长不会随着经济周期而大起大落，在没有突发性事件冲击的情况下，基本能够保持盈利稳定增长，投资此类型公司能够在经济衰退或低迷时期为基金资产提供较好的保护作用。

此类型公司不具备获取短期超额收益的机会，但具有较高的中长期投资价值。对于此类型公司，投资时点很重要，在偏负面的突发性事件冲击后的一段时间买入此类型公司往往能带来更高收益。本基金将持续跟踪此类型公司，在突发事件发生时分析突发事件对公司业务和内在价值的影响，等待较好的买入时机。

3) 快速增长型公司

快速增长型公司一般成立时间相对较短，公司规模较小。此类型公司通常商业模式独特，所处行业处于爆发式增长的阶段，业务成长性强。

投资此类型公司需要关注公司所处行业的景气周期和公司自身的综合实力，把握其快速增长期结束的大致时间，根据基金的投资目标和投资期限等确定所能介入的买入价格。

4) 周期型公司

周期型公司的销售收入和盈利以一种并非完全可以准确预测但却相当有规律的方式上涨和下跌，其业务发展过程是扩张，收缩，再扩张，再收缩，循环往复。此类型公司长期利润几乎没有趋势性增长，利润的波动性基本与宏观经济增速保持一致的变动方向。

此类型公司价值波动非常显著，通常与国内外宏观经济增长及政策的关系密切，具备显著的买入卖出信号。此类型公司不适合中长期持有，仅可作为短期获取超额收益的工具，投资时机的选择非常重要。

5) 困境反转型公司

困境反转型公司通常是公司业务受到严重打击而一蹶不振、几乎要申请破产的公司。

投资此类型公司需要把握促使公司基本面发生显著转变的事件或因素，这种转变能够反映在价格上是获利的关键，投资的信号包括但不限于公司治理机制改善、管理层换届和不良

业务剥离等事件。

6) 隐蔽资产型公司

隐蔽资产型公司通常拥有仅少数投资者关注到而市场还未关注到的价值不菲的资产，由于会计准则或政策影响，这部分资产并未计入资产负债表或面临价值重估机会，会为公司带来巨额隐形资产，对公司价值形成显著支撑。

投资此类型公司不仅需要发现财务报表中资产的价值，也需要把握资产被市场重估的时机，正确的事件选择是获取较高收益的关键因素。

(2) 事件驱动套利策略

事件驱动套利策略是通过分析特定或突发事件发生前后对投资标的投资价值 and 价格的影响而进行的套利交易，一般需要估算事件发生的概率及其对标的资产价格的影响，并提前介入等待事件的发生，然后择机退出，锁定收益。

本基金主要关注能带来价值变化的事件，包括但不限于：收购海外优质资产、推出新产品、实施股权激励、剥离不良业务、引入战略投资者等事件。

本基金通过信息收集、公司基本面分析、政策研判以及实地调研等定性和定量分析方法，并结合公司的类型和市场情况，仔细分析和考察主要的事件驱动因素，分析其对公司价值的可能影响，辨别是否有确定性获利机会，精选价值被市场低估的上市公司进行投资。

2、投资组合构建

本基金主要以稳定增长型公司、快速增长型公司、困境反转型公司和隐蔽资产型公司等四类公司为基础，构建投资组合，并把握缓慢增长型公司和周期型公司阶段性、短期的投资机会，同时把握事件性的套利交易机会，进行套利投资。

(三) 债券投资策略

1、普通债券投资策略

本基金在分析宏观经济走势、财政货币政策的前提下，进行积极主动的债券投资，以实现在一定程度上规避股票市场的系统性风险、提高基金投资组合整体收益的目的。本基金将通过分析利率变动趋势及市场信用环境变化方向，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，构造债券投资组合。在实际的投资运作中，本基金将采取久期策略、收益率曲线策略、息差策略、骑乘策略、类别选择策略、个券选择策略等多种策略，精选安全边际较高的个券进行投资，以获取债券市场的长期稳健收益。

2、可转换债券投资策略

本基金在综合分析可转换债券的股性特征、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优良的品种进行投资。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”特征的可转换债券品种，捕捉相关套利机会。

（四）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和提前偿还率等影响资产支持证券价值的相关要素，并综合运用久期管理、收益率曲线变动分析和收益率利差分析等方法，在严格控制风险的情况下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益较高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

（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。基金管理人将根据法律法规的规定，以套期保值为主要目的，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。基金管理人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。

3、权证投资策略

本基金对权证的投资以对冲下跌风险、实现保值和锁定收益为主要目的。本基金在权证投资中综合考虑股票合理价值、标的股票价格，结合权证定价模型、市场供求关系、交易制度设计等多种因素估计权证合理价值，采用杠杆交易策略、看跌保护组合策略、保护组合成本策略、获利保护策略、买入跨式投资等策略达到改善组合风险收益特征的目的。

九、业绩比较基准

沪深 300 指数收益率*50%+中债综合全价指数收益率*30%+恒生综合指数收益率*20%

沪深 300 指数是由沪深 A 股中规模大、流动性好的最具代表性的 300 只股票组成，综合反映沪深 A 股市场整体表现，对 A 股市场总体走势具有较强代表性，适合作为本基金 A 股投资部分的业绩比较基准。

中债综合全价指数是综合反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央票及短期融资券等整体走势的跨市场债券指数，能够反映债券市场总体走势，适合作为本基金债券投资部分的业绩比较基准。

恒生综合指数是恒生指数有限公司编制的反映在香港联合交易所上市股票表现的综合指数，涵盖了香港主板上市、总市值排名前 95%且流动性较好的股票，是一个全面反映香港证券市场的指数，具有广泛代表性，适合作为本基金港股通股票投资部分的业绩比较基准。

本基金为灵活配置混合型基金，根据本基金投资比例和投资范围规定，沪深 300 指数收益率*50%+中债综合全价指数收益率*30%+恒生综合指数收益率*20%的业绩比较基准能够较为客观地衡量本基金的投资绩效。

如果今后法律法规发生变化，或未来市场发生变化导致此业绩比较基准不再适用，或有其他代表性更强、更科学客观的业绩比较基准适用于本基金，或指数停止编制时，基金管理人可根据本基金的投资策略或投资范围，经和基金托管人协商一致并按照监管部门要求履行适当程序后变更或调整业绩比较基准并及时公告，无需召开基金份额持有人大会。

十、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。

十一、基金投资组合报告

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，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。

本投资组合报告所载数据截至 2018 年 9 月 30 日（未经审计），报告期为 2018 年 6 月 6 日至 2018 年 9 月 30 日。

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	7,219,101.55	78.81
	其中：股票	7,219,101.55	78.81
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,006,000.00	10.98
	其中：债券	1,006,000.00	10.98
	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	683,798.34	7.46
8	其他资产	251,596.60	2.75
9	合计	9,160,496.49	100.00

2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	409,000.00	4.51
B	采矿业	1,161,600.00	12.82
C	制造业	3,917,301.55	43.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,442,800.00	15.92
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	288,400.00	3.18
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	-	-
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	7,219,101.55	79.64

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。

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	603393	新天然气	20,000	815,400.00	9.00
2	000852	石化机械	50,000	556,000.00	6.13
3	000968	蓝焰控股	30,000	417,600.00	4.61
4	000860	顺鑫农业	9,000	410,400.00	4.53
5	002299	圣农发展	25,000	409,000.00	4.51
6	600583	海油工程	60,000	405,600.00	4.47
7	600803	新奥股份	26,000	391,560.00	4.32
8	002007	华兰生物	10,000	379,000.00	4.18
9	000895	双汇发展	13,997	366,021.55	4.04
10	600236	桂冠电力	60,000	365,400.00	4.03

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	1,006,000.00	11.10

	其中：政策性金融债	1,006,000.00	11.10
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	1,006,000.00	11.10

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	018005	国开1701	10,000	1,006,000.00	11.10

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。

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。

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。

9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末进行股指期货交易。

9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末进行股指期货交易。

10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末进行国债期货交易。

10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未进行国债期货交易。

10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未进行国债期货交易。

11 投资组合报告附注

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。

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。

11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,922.55
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	18,674.05
5	应收申购款	230,000.00
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	251,596.60

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。

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未存在流通受限股票。

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。

十二、基金的业绩

基金管理人承诺以恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不向投资者保证最低收益。

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。

1、本基金合同生效日为 2018年06月06日，基金业绩截止日为2018年9月30日。

长安裕腾混合A类净值表现

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	-1.11%	0.52%	-1.87%	0.86%	0.76%	-0.34%
自基金合同生效起至今	-1.04%	0.45%	-7.56%	0.87%	6.52%	-0.42%

本基金整体业绩比较基准构成为：沪深300指数收益率*50%+中债综合全价指数收益率*30%+恒生综合指数收益率*20%。

长安裕腾混合C类净值表现

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	-1.61%	0.53%	-1.87%	0.86%	0.26%	-0.33%
自基金合同生效起至今	-1.55%	0.41%	-7.56%	0.87%	6.01%	-0.46%

本基金整体业绩比较基准构成为：沪深300指数收益率*50%+中债综合全价指数收益率*30%+恒生综合指数收益率*20%。

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

长安裕腾混合A类累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2018年06月06日-2018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。本基金仍在建仓期。图示日期为2018年06月06日至2018年09月30日。

长安裕腾混合C类累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2018年06月06日-2018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。本基金仍在建仓期。图示日期为2018年06月06日至2018年09月30日。

十三、基金的费用与税收

一、基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、C类基金份额的销售服务费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券、期货交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、基金的账户开户费用、账户维护费用；
- 10、因投资港股通股票而产生的各项合理费用；
- 11、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.20%年费率计提。基金管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人与基金托管人核对一致后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.10%的年费率计提。基金托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人与基金托管人核对一致后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

3、C 类基金份额的销售服务费

基金销售服务费可用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额销售服务费年费率为 0.20%，按前一日 C 类基金份额基金资产净值的 0.20% 年费率计提。销售服务费计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人与基金托管人核对一致后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 3 个工作日内从基金财产中支付给登记机构，再由登记机构分别支付给各个销售机构。若遇法定节假日、公休日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

上述“一、基金费用的种类”中第 4—11 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

四、基金税收

本基金运作过程中涉及各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十四、对招募说明书更新部分的说明

（一）“重要提示”部分

更新了本招募说明书所载内容截止日及有关财务数据和净值表现的截止日期信息。

（二）“第三部分基金管理人”部分

更新了基金管理人主要人员情况。

（三）“第四部分基金托管人”部分

更新了基金托管人基本情况。

（四）“第六部分基金的募集”

更新了基金的募集情况。

（五）“第七部分基金合同的生效”

更新了基金合同的生效情况等。

（六）“第九部分基金的投资”部分

更新了基金投资组合报告，本报告期自 2018 年 6 月 6 日起至 2018 年 9 月 30 日止。

（七）“第十部分基金的业绩”部分

更新了基金的业绩，基金业绩截止日为 2018 年 9 月 30 日。

（九）“第二十二部分其他应披露事项”部分

更新了 2018 年 6 月 6 日至 2018 年 12 月 6 日期间涉及本基金的相关公告。

长安基金管理有限公司

2019 年 1 月 12 日