

长安优势行业混合型证券投资基金

2024年第2季度报告

2024年06月30日

基金管理人:长安基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

报告送出日期:2024年07月19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 | 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 | 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年07月18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04月01日起至2024年06月30日止。

§2 基金产品概况

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 长安优势行业混合 |
| 基金主代码 | 015343 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2022年09月01日 |
| 报告期末基金份额总额 | 68,853,507.45份 |
| 投资目标 | 本基金通过挖掘优势行业，精选个股，在严格控制风险和保持基金资产流动性的前提下，力求基金资产的长期稳健增值。 |
| 投资策略 | <p>(一) 大类资产配置策略</p> <p>资本市场是经济的晴雨表，本基金综合分析宏观经济环境、政策形势、证券市场走势，判断经济周期与趋势，并据此主动判断市场方向，进行积极的资产配置。本基金将在宏观经济衰退末期、复苏和繁荣周期阶段，积极增加权益类资产的投资比例；在宏观经济衰退阶段，适度降低权益类资产的投资比例。</p> <p>(二) 股票投资策略</p> <p>1、优势行业选择</p> <p>基金管理人将对宏观经济、产业周期、行业成长性、行业竞争力和估值等进行分析，综合评判行业所处的状况和未来发展趋势，精选具有较高增长潜力且估值合理、具有综合性比</p> |

较优势的优势行业，并根据经济发展趋势和行业整体情况，动态调整行业配置。

2、个股选择

在优势行业选择并配置的基础上，本基金坚持“优选成长股”的选股理念，主要采取“自下而上”的精选个股策略，通过定量分析和定性分析，优选成长性良好且股价没有充分反映其长期投资价值的上市公司进行投资，力求实现基金资产的长期稳健增值。

本基金将对行业和个股的综合性比较优势进行持续评估，以准确把握优势行业及优势个股的变化趋势，根据国内外政治经济环境与行业景气状况的最新变化，重新评估优势行业，并据此对投资组合当中的行业和个股进行及时调整。

3、港股通标的股票的投资策略

考虑到香港股票市场与A股股票市场的差异，对于香港联交所上市的股票，本基金除按照上述股票的投资策略外，还将结合公司基本面、国内经济和相关行业发展前景、香港市场资金面和投资者行为，以及世界主要经济体经济发展前景和货币政策、主流资本市场对投资者的相对吸引力等因素，精选符合本基金投资目标的香港联交所上市公司股票。

4、存托凭证的投资策略

本基金将根据投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的研究判断，进行存托凭证的投资。

（三）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、可转债和可交债投资策略

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

| | |
|---------------|---|
| | <p>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>可交换债券同样具有股性和债性，本基金将重点关注可交换债券对应股票的投资价值，综合分析可交换债券的债性特征、股性特征等因素，通过对目标公司股票的投资价值分析和可交换债券的纯债部分价值分析综合开展投资决策。</p> <p>（四）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>（五）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>（六）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>业绩比较基准</p> | <p>沪深300指数收益率*60%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*20%+中债-综合全价（总值）指数收益率*20%</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> <p>本基金除了投资A股外，还可投资港股通标的股票，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 | 长安基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 长安优势行业混合A | 长安优势行业混合C |
| 下属分级基金的交易代码 | 015343 | 015344 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 66,452,187.66份 | 2,401,319.79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04月01日 - 2024年06月30日) | |
|----------------|--------------------------------|--------------|
| | 长安优势行业混合A | 长安优势行业混合C |
| 1.本期已实现收益 | -534,430.87 | -22,047.78 |
| 2.本期利润 | -1,547,904.21 | -62,084.89 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0232 | -0.0254 |
| 4.期末基金资产净值 | 46,181,538.22 | 1,643,971.40 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.6950 | 0.6846 |

- 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

长安优势行业混合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 | -3.24% | 1.08% | 0.52% | 0.60% | -3.76% | 0.48% |

| | | | | | | |
|------------|---------|-------|--------|-------|---------|-------|
| 过去六个月 | -1.75% | 1.26% | 2.44% | 0.72% | -4.19% | 0.54% |
| 过去一年 | -22.86% | 1.13% | -6.35% | 0.71% | -16.51% | 0.42% |
| 自基金合同生效起至今 | -30.50% | 0.96% | -9.18% | 0.77% | -21.32% | 0.19% |

本基金整体业绩比较基准构成为：沪深 300 指数收益率*60%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*20%+中债-综合全价（总值）指数收益率*20%

长安优势行业混合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 | -3.46% | 1.08% | 0.52% | 0.60% | -3.98% | 0.48% |
| 过去六个月 | -2.14% | 1.26% | 2.44% | 0.72% | -4.58% | 0.54% |
| 过去一年 | -23.49% | 1.13% | -6.35% | 0.71% | -17.14% | 0.42% |
| 自基金合同生效起至今 | -31.54% | 0.96% | -9.18% | 0.77% | -22.36% | 0.19% |

本基金整体业绩比较基准构成为：沪深 300 指数收益率*60%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*20%+中债-综合全价（总值）指数收益率*20%

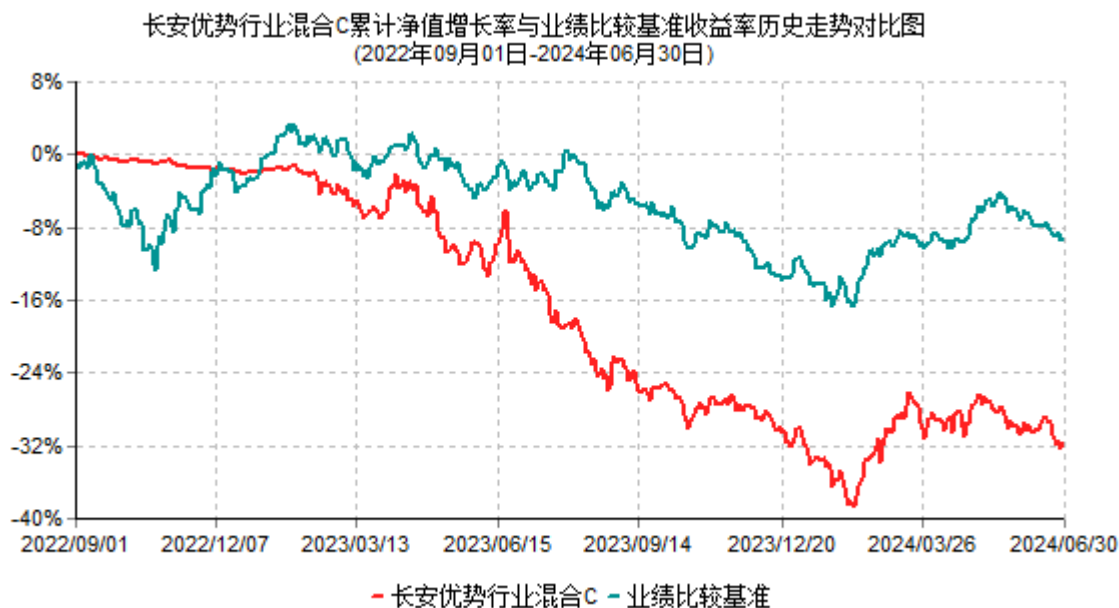
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

长安优势行业混合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
(2022年09月01日-2024年06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。本基金于 2022 年 09 月 01 日成立，基金合同生效日至报告期末，本基金运作时间已满一年。图示日期为 2022 年 09 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日止。



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。本基金于 2022 年 09 月 01 日成立,基金合同生效日至报告期末,本基金运作时间已满一年。图示日期为 2022 年 09 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日止。

§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 | | |
| 林忠晶 | 本基金的基金经理 | 2022-09-01 | - | 14年 | 经济学博士。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、总经理等职。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》、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

报告期内，国内经济复苏放缓、美联储降息时点的不断修正，成为影响权益市场波动主要因素。2024年以来，海外发达经济体经济增长的韧性使得通货膨胀率持续反弹，导致美联储降息预期一直向后修正，短端利率上行带动长端利率调整。而市场对国内经济前景悲观预期，使得国债利率持续下行，中美国债利差持续加大，海外资金持续流出，叠加权益市场赚钱效应未出现明显好转，导致权益指数呈现波动状态。

报告期内，从2023年报和2024年一季报情况看，A股上市公司盈利继续面临压力，整体资本开支继续下滑，但股利支付率保持上行趋势。报告期内，本基金在现金流充裕、分红能力强的行业寻找投资机会。如：公用事业、煤炭和银行等。其次，考虑到原来持有的家电个股的估值修复较多，且市场对国内和出口增量预期较为充分，更换为股息率较高个股且降低家电行业持仓比重。再次，科技创新是推动经济增长的关键因素，科技进步使得生产效率大幅提升，并且有利于减少人力需求、降低生产成本、塑造新的生活方式。我们持续关注全球科技创新的进展，并寻找受益于科技浪潮带来的投资机会，行业主要分布在通信、电子和汽车等。另外，部分全球定价的有色金属行业长期资本开支

不足，叠加矿石品位下滑带来的资源禀赋下滑，供给存在较大预期差。海外供应链的重构，叠加印度、墨西哥等新兴区域需求占比持续提升，导致需求超预期的增长，可能带来供给与需求缺口持续加大，尤其以铜为代表的有色金属表现较为突出，本基金持续关注有色金属行业中具有成本优势、符合ESG要求企业的投资机会。最后，人口结构趋势性变动，销售体系的重构，将带动医药行业收入和盈利出现好转，本基金关注医药行业的投资机会。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末长安优势行业混合A基金份额净值为0.6950元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-3.24%，同期业绩比较基准收益率为0.52%；截至报告期末长安优势行业混合C基金份额净值为0.6846元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-3.46%，同期业绩比较基准收益率为0.52%。

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05月22日至2024年06月30日连续二十七个工作日出现基金资产净值低于五千万情形，未出现连续二十个工作日（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 | 39,556,536.36 | 74.03 |
| | 其中：股票 | 39,556,536.36 | 74.03 |
| 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 | 3,841,000.00 | 7.19 |
| | 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 | 9,188,941.16 | 17.20 |
| 8 | 其他资产 | 846,666.47 | 1.58 |

| | | | |
|---|----|---------------|--------|
| 9 | 合计 | 53,433,143.99 | 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 | 6,643,792.00 | 13.89 |
| C | 制造业 | 26,636,727.36 | 55.70 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 3,095,044.00 | 6.47 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 1,758,669.00 | 3.68 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | - | - |
| J | 金融业 | 1,422,304.00 | 2.97 |
| 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 | 39,556,536.36 | 82.71 |

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 | 20,580 | 2,837,570.40 | 5.93 |
| 2 | 601138 | 工业富联 | 96,300 | 2,638,620.00 | 5.52 |
| 3 | 601899 | 紫金矿业 | 124,300 | 2,183,951.00 | 4.57 |
| 4 | 002475 | 立讯精密 | 49,900 | 1,961,569.00 | 4.10 |
| 5 | 300181 | 佐力药业 | 118,400 | 1,790,208.00 | 3.74 |
| 6 | 600575 | 淮河能源 | 452,100 | 1,758,669.00 | 3.68 |
| 7 | 300750 | 宁德时代 | 9,600 | 1,728,288.00 | 3.61 |
| 8 | 001286 | 陕西能源 | 144,200 | 1,662,626.00 | 3.48 |
| 9 | 688347 | 华虹公司 | 44,936 | 1,610,955.60 | 3.37 |
| 10 | 688766 | 普冉股份 | 16,372 | 1,590,867.24 | 3.33 |

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

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持有国债期货。

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 | 48,938.62 |
| 2 | 应收证券清算款 | 795,714.76 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 2,013.09 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 846,666.47 |

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

| | 长安优势行业混合A | 长安优势行业混合C |
|-------------------------------|---------------|--------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 67,387,986.57 | 2,615,872.64 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 34,731.42 | 63,947.40 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 970,530.33 | 278,500.25 |
| 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 | 66,452,187.66 | 2,401,319.79 |

总申购份额包含红利再投、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

| | 长安优势行业混合A | 长安优势行业混合C |
|--------------------------|---------------|-----------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 16,073,831.94 | - |
| 报告期期间买入/申购总份额 | 0.00 | - |
| 报告期期间卖出/赎回总份额 | 0.00 | - |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | 16,073,831.94 | - |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 23.34 | - |

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 | 2024/04/01 - 2024/06/30 | 16,073,831.94 | 0.00 | 0.00 | 16,073,831.94 | 23.34% |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| <p>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：</p> <p>（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；</p> <p>（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；</p> <p>（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；</p> <p>（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；</p> <p>（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</p> | | | | | | | |

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、长安优势行业混合型证券投资基金基金合同；
- 3、长安优势行业混合型证券投资基金托管协议；
- 4、长安优势行业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

上海市浦东芳甸路1088号紫竹大厦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。

长安基金管理有限公司

2024年07月19日