

长安宏观策略混合型证券投资基金

2024 年年度报告

2024 年 12 月 31 日

基金管理人:长安基金管理有限公司

基金托管人:中国邮政储蓄银行股份有限公司

送出日期:2025 年 03 月 31 日

§1 重要提示及目录

1.1 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。本报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2025年03月28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。

本报告中财务资料已经会计师事务所审计。

本报告期自2024年01月01日起至2024年12月31日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介.....	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	11
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明.....	16
4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	16
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
§6 审计报告.....	16
6.1 审计报告基本信息.....	16
6.2 审计报告的基本内容	17
§7 年度财务报表.....	19
7.1 资产负债表.....	19
7.2 利润表	21
7.3 净资产变动表	23
7.4 报表附注	25
§8 投资组合报告	54
8.1 期末基金资产组合情况.....	54
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	54
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	55
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	56
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	69
8.6 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	69
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	69
8.8 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贵金属投资明细	69
8.9 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	69

8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	69
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	69
8.12 投资组合报告附注.....	69
§9 基金份额持有人信息.....	70
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	70
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	71
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	71
§10 开放式基金份额变动.....	71
§11 重大事件揭示.....	72
11.1 基金份额持有人大会决议.....	72
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	72
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	72
11.4 基金投资策略的改变.....	72
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	72
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	72
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	73
11.8 其他重大事件.....	74
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	77
12.1 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.....	77
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	78
§13 备查文件目录.....	78
13.1 备查文件目录.....	78
13.2 存放地点.....	78
13.3 查阅方式.....	78

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长安宏观策略混合型证券投资基金	
基金简称	长安宏观策略混合	
基金主代码	740001	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年03月09日	
基金管理人	长安基金管理有限公司	
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	18,273,083.59份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	长安宏观策略混合A	长安宏观策略混合C
下属分级基金的交易代码	740001	016579
报告期末下属分级基金的份额总额	16,923,794.75份	1,349,288.84份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在宏观策略研判的基础上，通过强化配置景气行业及精选基本面良好、成长性突出的上市公司，在有效控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>本基金从全球视野的角度出发，把握全球经济一体化、国际产业格局调整与转移以及国内经济工业化、城市化、产业结构升级与消费结构升级所带来的投资机遇，自上而下地实施股票、债券、现金等大类资产之间的战略配置和各行业之间的优化配置，并结合自下而上的个股精选策略和债券投资策略，构建投资组合，力争获取超额投资收益。</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金通过深入分析宏观经济、政策环境、估值水平和市场情绪等因素，综合评判股票、债券等各类资产的风险收益特征的相对变化，根据不同的市场形势，适时动态地调整股票、债券、现金之间的配置比例。</p> <p>2、行业配置策略</p>

	<p>本基金在大类资产配置框架下，实施积极主动的行业配置策略。本基金将首先确定宏观经济及产业政策等因素对不同行业的潜在影响，通过行业生命周期分析和行业景气度分析，筛选出处于成长期和景气度上升的行业，进行重点配置和动态调整。</p> <p>3、个股选择策略</p> <p>本基金在行业配置的基础上，将充分发挥基金管理人在股票研究方面的专业优势，采用定量分析与定性分析相结合的方法，精选基本面良好、成长性突出的上市公司，构建投资组合。</p> <p>4、债券投资策略</p> <p>本基金将债券投资作为控制基金整体投资风险和提高非股票资产收益率的重要手段，在控制流动性风险的基础上，通过久期管理、期限结构配置、类属配置和个券选择等层次进行积极主动的组合管理。</p> <p>5、权证投资策略</p> <p>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以对应的标的证券的基本面为基础，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对权证进行定价，利用权证衍生工具的特性，通过权证与证券的组合投资，来达到改善组合风险收益特征的目的。</p> <p>6、股指期货投资策略</p> <p>本基金将根据有关法律法规和政策的规定，在严格控制风险的前提下，本着谨慎原则，以套期保值为主要目的，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善投资组合的风险收益特征。基金管理人制定了股指期货投资决策流程和风险控制制度并经董事会审议通过。此外，基金管理人建立了股指期货交易决策小组，授权相关管理人员负责股指期货的投资审批事项。</p> <p>7、其他金融工具的投资策略</p> <p>对于监管机构允许基金投资的其他金融工具，本基金将在谨慎分析收益率、风险水平、流动性和金融工具自身特征的基础上进行稳健投资，以降低组合风险，实现基金资产的保值增值。</p>
<p>业绩比较基准</p>	<p>沪深300指数收益率×80% + 中证全债指数收益率×20%</p>
<p>风险收益特征</p>	<p>本基金为混合型证券投资基金，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，属于证券投资基金中具有较高风险、较高预期收益品种。</p>

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		长安基金管理有限公司	中国邮政储蓄银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李永波	张立学
	联系电话	021-20329700	010-68858113
	电子邮箱	service@cafund.com	zhanglixue@psbcoa.com.cn
客户服务电话		400-820-9688	95580
传真		021-50598018	010-86353609
注册地址		上海市虹口区丰镇路806号3幢371室	北京市西城区金融大街3号
办公地址		上海市浦东新区芳甸路1088号紫竹国际大厦16层	北京市西城区金融大街3号A座
邮政编码		201204	100808
法定代表人		崔晓健	刘建军

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.cafund.com
基金年度报告备置地点	上海市浦东新区芳甸路1088号紫竹国际大厦16层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	天健会计师事务所(特殊普通合伙)	浙江省杭州市西湖区灵隐街道西溪路128号
注册登记机构	长安基金管理有限公司	上海市浦东新区芳甸路1088号紫竹国际大厦16层

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2024年		2023年		2022年	
	长安宏观策略混合A	长安宏观策略混合C	长安宏观策略混合A	长安宏观策略混合C	长安宏观策略混合A	长安宏观策略混合C
本期已实现收益	-1,334,642.55	-190,280.53	-2,071,441.19	-2,605,922.50	-6,637,936.24	-398,869.15
本期利润	-809,144.16	-147,428.19	219,721.92	-5,097,724.37	-6,648,783.70	-401,103.54
加权平均基金份额本期利润	-0.0404	-0.0618	0.0094	-0.6947	-0.3466	-0.1426
本期加权平均净值利润率	-3.38%	-5.26%	0.67%	-48.48%	-26.30%	-10.74%
本期基金份额净值增长率	-2.85%	-3.34%	3.94%	3.37%	-14.48%	-5.96%
3.1.2 期末数据和指标	2024年末		2023年末		2022年末	
期末可供分配利润	1,386,176.45	32,798.77	3,118,007.46	364,626.50	4,382,422.82	454,388.80
期末可供分配基金份额利润	0.0819	0.0243	0.1430	0.0912	0.2089	0.1636
期末基金资产净值	20,800,842.02	1,639,512.34	27,577,570.87	5,026,382.85	25,531,573.83	3,376,553.31
期末基金份额净值	1.229	1.215	1.265	1.257	1.217	1.216
3.1.3 累计期末指标	2024年末		2023年末		2022年末	
基金份额累计净值增长率	101.14%	-6.03%	107.04%	-2.78%	99.18%	-5.96%

- 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

长安宏观策略混合A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	-5.46%	2.31%	-1.05%	1.39%	-4.41%	0.92%
过去六个月	6.13%	2.04%	11.74%	1.32%	-5.61%	0.72%
过去一年	-2.85%	1.71%	13.24%	1.07%	-16.09%	0.64%
过去三年	-13.63%	1.97%	-14.67%	0.94%	1.04%	1.03%
过去五年	9.24%	1.94%	0.06%	0.98%	9.18%	0.96%
自基金合同生效起至今	101.14%	1.69%	47.69%	1.09%	53.45%	0.60%

本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%

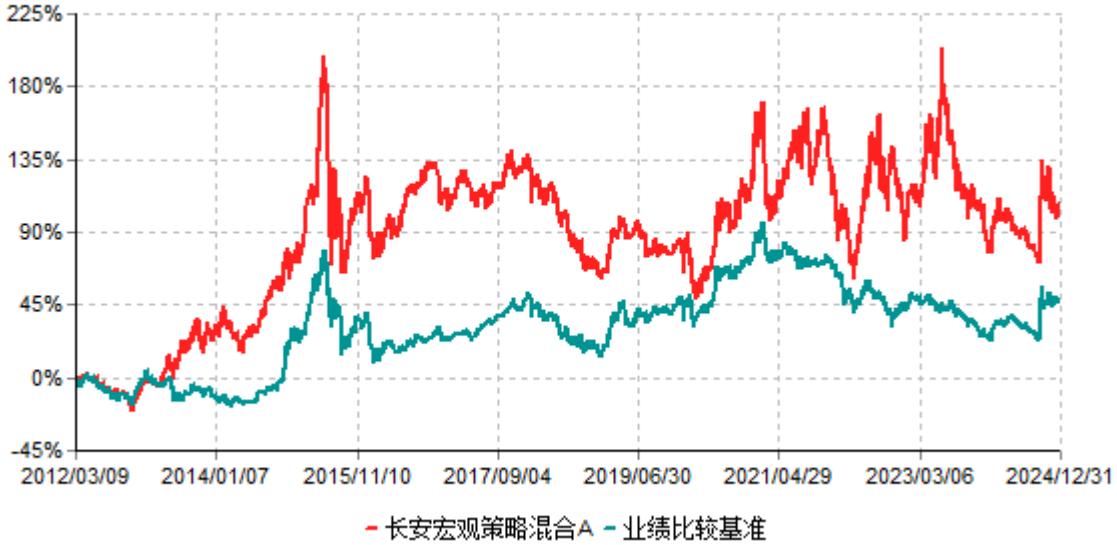
长安宏观策略混合C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	-5.59%	2.30%	-1.05%	1.39%	-4.54%	0.91%
过去六个月	5.84%	2.03%	11.74%	1.32%	-5.90%	0.71%
过去一年	-3.34%	1.71%	13.24%	1.07%	-16.58%	0.64%
自基金合同生效起至今	-6.03%	1.92%	2.49%	0.91%	-8.52%	1.01%

本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

长安宏观策略混合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
(2012年03月09日-2024年12月31日)



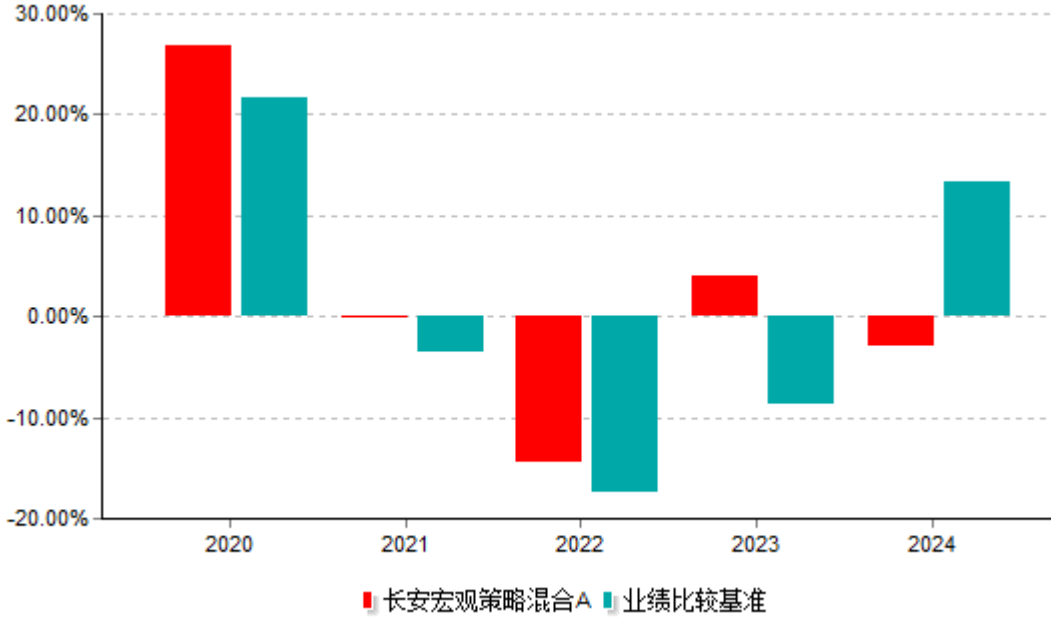
根据基金合同的规定,自基金合同生效之日起6个月内基金各项资产配置比例需符合基金合同要求。本基金在建仓期结束后,各项资产配置比例已符合基金合同有关投资比例的约定。基金合同生效日至报告期期末,本基金运作时间超过一年。图示日期为2012年3月9日至2024年12月31日。

长安宏观策略混合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
(2022年09月22日-2024年12月31日)

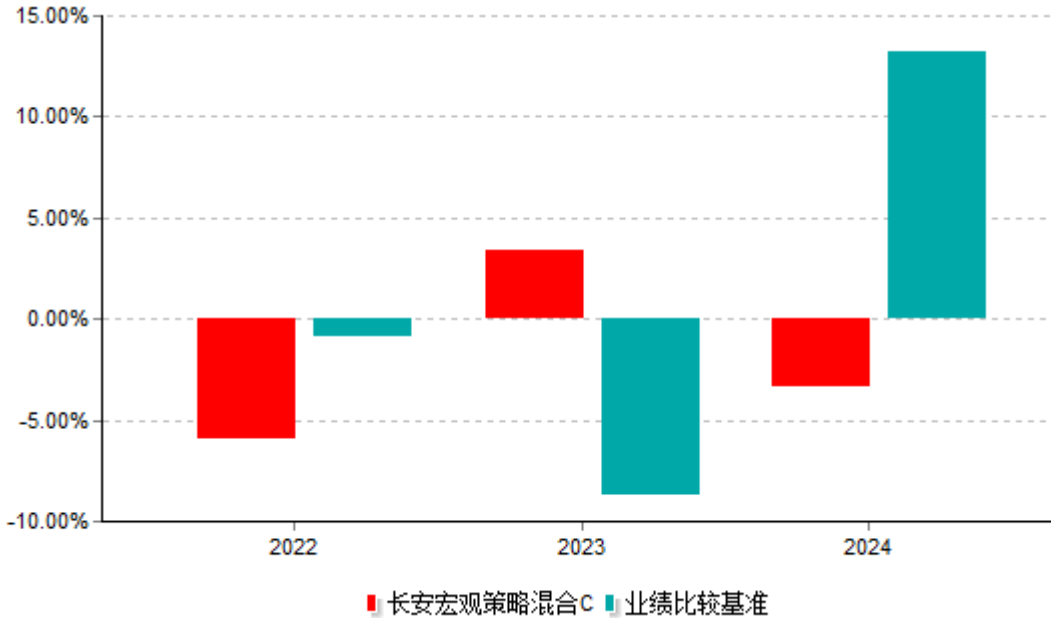


长安宏观策略混合C于2022年9月19日公告新增,实际首笔C类份额申购申请于2022年9月22日确认,图示日期为2022年9月22日至2024年12月31日。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



本基金合同生效日为2012年03月09日，合同生效日当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。



长安宏观策略混合C于2022年09月19日公告新增，实际首笔C类份额申购申请于2022年09月22日确认,该份额生效日当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

长安基金管理有限公司成立于2011年9月5日，公司的股东分别为：长安国际信托股份有限公司、杭州景林景淳企业管理合伙企业（有限合伙）、上海恒嘉美联发展有限公司、五星控股集团有限公司、兵器装备集团财务有限责任公司。截至2024年12月31日，本基金管理人共管理长安宏观策略混合型证券投资基金、长安沪深300非周期行业指数证券投资基金、长安货币市场证券投资基金、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、长安鑫益增强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、长安泓源纯债债券型证券投资基金、长安泓沅中短债债券型证券投资基金、长安鑫旺价值灵活配置混合型证券投资基金、长安鑫兴灵活配置混合型证券投资基金、长安裕盛灵活配置混合型证券投资基金、长安裕泰灵活配置混合型证券投资基金、长安鑫禧灵活配置混合型证券投资基金、长安裕腾灵活配置混合型证券投资基金、长安泓润纯债债券型证券投资基金、长安裕隆灵活配置混合型证券投资基金、长安鑫盈灵活配置混合型证券投资基金、长安鑫悦消费驱动混合型证券投资基金、长安鑫瑞科技先锋6个月定期开放混合型证券投资基金、长安成长优选混合型证券投资基金、长安先进制造混合型证券投资基金、长安优势行业混合型证券投资基金、长安行业成长混合型证券投资基金等24只证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王浩聿	本基金的基金经理	2024-01-16	-	8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。

肖洁	本基金的基金经理	2023-11-24	2024-12-27	13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。
----	----------	------------	------------	-----	---

1、上述任职日期为根据公司决定确定的聘任日期，离任日期为根据公司决定确定的解聘日期；首任基金经理任职日期为基金合同生效日。

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。

4.1.3 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

截至本报告期末，本基金的基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

在本报告期内，本基金严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，投资管理和交易执行相隔离，实行集中交易制度，公平对待所管理的所有基金和投资组合，未出现违反公平交易制度的情况。

4.3.2 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。

4.3.3 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2024年，整个市场震荡上行。在9月24日之前，内需持续疲弱和通缩螺旋是市场的主要压制因素，市场的主线以红利、算力、出海为主。在9月26日政治局会议一锤定音之后，中长期的宏观预期随之改变，市场在短期内快速上涨。四季度人大会议、经济工作会议、政治局会议都验证了政策的转向，市场在四季度整体保持强势。

报告期内，本基金继续专注于科技行业，尤其是AI产业。随着国内算力需求的逐渐爆发，我们增加了国内算力产业链的配置比例，降低了海外算力的持仓比例。另外，我们也逐渐加大了对AI应用、端侧AI、半导体国产化的配置力度。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末长安宏观策略混合A基金份额净值为1.229元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-2.85%，同期业绩比较基准收益率为13.24%；截至报告期末长安宏观策略混合C基金份额净值为1.215元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-3.34%，同期业绩比较基准收益率为13.24%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2025年，在政策不断落地的背景下，宏观经济会逐渐企稳，同时适度宽松的货币政策也会让市场的流动性持续充裕。在这种背景下，我们对今年A股的回报非常有信心。

产业层面，随着Deepseek的横空出世，我们认为算力需求会加速从训练侧向推理侧倾斜，推理有望接力训练，成为下一阶段算力需求的主要驱动力。在推理芯片领域，互联网厂商自研ASIC芯片的市占率会逐渐提升，从而带来很多新的投资机会。应用方面，Deepseek的开源属性将大幅降低了模型部署的门槛，这使得更多的企业，尤其是中小企业，能够更容易地将AI应用到自身的业务中，推动AI在各个行业的广泛落地，包括医疗、金融、自动驾驶等多个领域。

半导体的核心成长逻辑仍然是国产替代。特朗普上任之后，外部环境的变化更趋复杂化，先进制造、半导体设备及零部件、半导体材料等半导体产业链“卡脖子”核心环

节自主可控需求迫切，国产替代有望加速推进。尤其在先进制程中持续突破的国产厂商，将会迎来重大发展机遇。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，为保证公司合规运作、加强内部控制、防范经营风险、保障基金份额持有人的利益，监察稽核人员按照独立、客观、公正的原则，依据相关法律法规、基金合同和管理制度，采用例行检查与专项检查、定期检查和不定期检查相结合的方式，对公司内控制度的合法性和合规性、执行的有效性和完整性、风险的防范和控制等进行了持续的监察稽核，对发现的问题进行提示和追踪落实，并向董事会、管理层以及监管部门进行报告。

本基金管理人采取的主要措施包括：

(1) 积极落实监管要求和精神，采取外部法律顾问授课和稽核、合规部门培训相结合的方式，多次组织全体员工开展法律法规、公司内控制度的学习。通过上述学习宣传活动，使员工加深了对法律法规的认识，并进一步将法律法规与内控制度落实到日常工作中，确保其行为守法合规、严格自律，恪守勤勉尽责原则，充分维护基金份额持有人的利益。

(2) 对市场销售、投资研究、后台运营及人员管理等业务和相关部门开展定期稽核和专项稽核，从而识别问题、防范风险、推动解决，促进公司业务合规运作、稳健经营。

(3) 不断完善规章制度体系，根据国家的有关法律法规和基金管理公司实际运作的要求，对现有的规章制度体系不断进行完善，对经营管理活动的决策、执行和监督程序进行规范，明确不同决策层和执行层的权利与责任，细化研究、投资、交易等各项工作流程，为杜绝人为偏差、合法合规运作、强化风险控制提供了制度保证。

本基金管理人将规范运作基金资产，加强风险控制，持续提高监察稽核工作的科学性和有效性，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人制订了健全、有效的估值政策和程序，清算登记部按照管理层批准后的估值政策进行估值。对于在交易所上市的证券(除固定收益品种外)，采用交易所发布的行情信息来估值。对本基金所持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所和银行间上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)采用第三方估值机构提供的价格进行估值。除了投资总监外，其他基金经理不参与估值政策的决策。但是对于非活跃投资品种，基金经理可以提供估值建议。上述参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金在本报告期内未进行过利润分配。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

本基金本报告期审计报告为标准无保留意见审计报告。

4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金从2024年1月1日至2024年12月31日连续242个工作日出现资产净值低于五千万情形，未出现连续20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将采取适当措施。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在长安宏观策略混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内，本基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
------------	---

审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	天健审（2025）6-63号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	长安宏观策略混合型证券投资基金全体持有人
审计意见	<p>我们审计了长安宏观策略混合型证券投资基金（以下简称长安宏观策略混合基金）财务报表，包括2024年12月31日的资产负债表，2024年度的利润表、净资产变动表，以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称企业会计准则）及财务报表附注7.4.2所列示的中国证券监督管理委员会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了长安宏观策略混合基金2024年12月31日的财务状况，以及2024年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于长安宏观策略混合基金及其管理人长安基金管理有限公司（以下简称基金管理人），并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	<p>基金管理人管理层（以下简称管理层）对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p>

	<p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估长安宏观策略混合基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层（以下简称治理层）负责监督长安宏观策略混合基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p>

	<p>(四) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对长安宏观策略混合基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致长安宏观策略混合基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	天健会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	曹智春	李幸玮
会计师事务所的地址	浙江省杭州市西湖区灵隐街道西溪路128号	
审计报告日期	2025-03-25	

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：长安宏观策略混合型证券投资基金

报告截止日：2024年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	4,301,579.19	7,914,354.09
结算备付金		227,271.06	145,663.18
存出保证金		67,510.52	90,461.45
交易性金融资产	7.4.7.2	18,234,708.73	25,796,086.00
其中：股票投资		18,234,708.73	25,796,086.00

基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		7,313.56	18,324.87
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		22,838,383.06	33,964,889.59
负债和净资产	附注号	本期末 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	976,943.73
应付赎回款		131,029.40	108,994.50
应付管理人报酬		23,503.31	33,764.46
应付托管费		3,917.23	5,627.44
应付销售服务费		722.99	2,269.90
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	238,855.77	233,335.84

负债合计		398,028.70	1,360,935.87
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	18,273,083.59	25,807,908.72
未分配利润	7.4.7.8	4,167,270.77	6,796,045.00
净资产合计		22,440,354.36	32,603,953.72
负债和净资产总计		22,838,383.06	33,964,889.59

报告截止日2024年12月31日，长安宏观策略混合A份额净值1.229元，基金份额总额16,923,794.75份，长安宏观策略混合C份额净值1.215元，基金份额总额1,349,288.84份，总份额合计18,273,083.59份。

7.2 利润表

会计主体：长安宏观策略混合型证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年01月01日至2 024年12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2 023年12月31日
一、营业总收入		-555,591.93	-4,101,695.80
1.利息收入		52,285.36	42,074.80
其中：存款利息收入	7.4.7.9	52,285.36	42,074.80
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收 入		-	-
买入返售金融资产收 入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填 列）		-1,210,404.95	-4,096,709.16
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-1,528,115.34	-4,296,426.44
基金投资收益	7.4.7.11	-	-
债券投资收益	7.4.7.12	-	2,479.26

资产支持证券投资收益	7.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	317,710.39	197,238.02
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	568,350.73	-200,638.76
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	34,176.93	153,577.32
减：二、营业总支出		400,980.42	776,306.65
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	321,839.27	599,327.45
2.托管费	7.4.10.2.2	53,639.99	99,887.92
3.销售服务费	7.4.10.2.3	14,173.29	52,091.28
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.信用减值损失	7.4.7.19	-	-
7.税金及附加		-	-
8.其他费用	7.4.7.20	11,327.87	25,000.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-956,572.35	-4,878,002.45
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-956,572.35	-4,878,002.45
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-956,572.35	-4,878,002.45

7.3 净资产变动表

会计主体：长安宏观策略混合型证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	25,807,908.72	6,796,045.00	32,603,953.72
二、本期期初净资产	25,807,908.72	6,796,045.00	32,603,953.72
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-7,534,825.13	-2,628,774.23	-10,163,599.36
（一）、综合收益总额	-	-956,572.35	-956,572.35
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-7,534,825.13	-1,672,201.88	-9,207,027.01
其中：1.基金申购款	7,732,885.84	1,551,361.45	9,284,247.29
2.基金赎回款	-15,267,710.97	-3,223,563.33	-18,491,274.30
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	18,273,083.59	4,167,270.77	22,440,354.36
项目	上年度可比期间		

	2023年01月01日至2023年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	23,757,670.07	5,150,457.07	28,908,127.14
二、本期期初净资产	23,757,670.07	5,150,457.07	28,908,127.14
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	2,050,238.65	1,645,587.93	3,695,826.58
（一）、综合收益总额	-	-4,878,002.45	-4,878,002.45
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	2,050,238.65	6,523,590.38	8,573,829.03
其中：1.基金申购款	56,931,679.45	31,493,225.92	88,424,905.37
2.基金赎回款	-54,881,440.80	-24,969,635.54	-79,851,076.34
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	25,807,908.72	6,796,045.00	32,603,953.72

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

孙晔伟

闫世新

欧鹏

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

长安宏观策略股票型证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2011]第1950号《关于核准长安宏观策略股票型证券投资基金募集的批复》核准,由长安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《长安宏观策略股票型证券投资基金基金合同》《长安宏观策略股票型证券投资基金招募说明书》等的规定公开募集。

本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息的净认购资金为383,969,236.76元,经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)KPMG-B(2012)CRNo.0011号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《长安宏观策略股票型证券投资基金基金合同》于2012年3月9日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为383,988,929.19份基金份额,其中认购资金利息折合19,692.43份基金份额。本基金的基金管理人为长安基金管理有限公司,基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。

根据自2014年8月8日起施行的《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定,本基金自2015年8月7日起由"长安宏观策略股票型证券投资基金"变更名称为"长安宏观策略混合型证券投资基金"。根据自2017年10月1日起施行的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》,本基金相应修改投资交易限制,设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施,增加特定情形下流动性管理的辅助措施,增加向投资者披露基金产品主要的流动性风险及其管理方法等。根据自2019年9月1日起施行的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》,本基金新增集中信息披露指定网站,建立基金产品资料概要制度,调整招募说明书定期更新时点,新增部分重大事项临时公告要求等。根据自2020年8月1日起施行的《公开募集证券投资基金侧袋机制指引(试行)》,本基金在基金合同中基金份额的申购与赎回、基金份额持有人大会、基金的投资、基金的估值、基金费用与税收、基金的信息披露等部分增加侧袋机制相关内容,并在招募说明书中增加相关风险揭示内容。根据《长安基金管理有限公司关于长安宏观策略混合型证券投资基金增设C类基金份额并修改基金合同、托管协议的公告》,自2022年9月19日起本基金增加C类基金份额。根据《长安基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》,自2023年8月14日起本基金基金管理费率由1.50%/年下调为1.20%/年,基金托管费率由0.25%/年下调为0.20%/年。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《长安宏观策略混合型证券投资基金基金合同》和《长安宏观策略混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围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(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、银行存款、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金

融工具，但需符合中国证监会的相关规定。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60%-95%，债券、货币市场工具、银行存款、权证、资产支持证券以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为0-40%，其中权证占基金资产净值的0%-3%，任何交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%，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。

本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为编制基础。本基金财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称"财政部")颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称"企业会计准则")的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》以及中国证券投资基金业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注7.4.2中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金2024年12月31日的财务状况、2024年度的经营成果和净资产变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历1月1日至12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

本基金的金融工具包括股票投资等。

本基金通常根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征，在初始确认时将金融资产分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以摊余成本计量的金融资产。

除非本基金改变管理金融资产的业务模式，在此情形下，所有受影响的相关金融资产在业务模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类，否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 1) 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；
- 2) 该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。本基金现无分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。管理金融资产的业务模式，是指本基金如何管理金融资产以产生现金流量。业务模式决定本基金所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本基金以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础，确定管理金融资产的业务模式。

本基金对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定时期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本基金对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

(2) 金融负债的分类

本基金将金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及以摊余成本计量的金融负债。

1) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债：该类金融负债包括交易性金融负债(含属于金融负债的衍生工具)和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

2) 以摊余成本计量的金融负债：初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

本基金现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

(1) 金融工具的初始确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

(2) 后续计量

1) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产：初始确认后，对于该类金融资产以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失(包括利息和股利收入)计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

2) 以摊余成本计量的金融资产：初始确认后，对于该类金融资产采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

3) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债：初始确认后，对于该类金融负债以公允价值进行后续计量，除与套期会计有关外，产生的利得或损失(包括利息费用)计入当期损益。

4) 以摊余成本计量的金融负债：初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

(3) 金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；
- 3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 1) 所转移金融资产在终止确认日的账面价值；
- 2) 因转移金融资产而收到的对价。

金融负债(或其一部分)的现时义务已经解除的，本基金终止确认该金融负债(或该部分金融负债)。

(4) 金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

1) 以摊余成本计量的金融资产：本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

① 预期信用损失的计量

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

在计量预期信用损失时，本基金需考虑的最长期限为面临信用风险的最长合同期限(包括考虑续约选择权)。

整个存续期预期信用损失，是指因金融工具整个预计存续期内所有可能发生的违约事件而导致的预期信用损失。

未来12个月内预期信用损失，是指因资产负债表日后12个月内(若金融工具的预计存续期少于12个月，则为预计存续期)可能发生的金融工具违约事件而导致的预期信用损失，是整个存续期预期信用损失的一部分。

本基金对满足下列情形的金融工具按照相当于未来12个月内预期信用损失的金额计量其损失准备，对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备：该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险或该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

② 预期信用损失准备的列报

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化，本基金在每个资产负债表日重新计量预期信用损失，由此形成的损失准备的增加或转回金额，应当作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产，损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

③ 核销

如果本基金不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回，则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本基金确定债务人没有资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是，被减记的金融资产仍可能受到本基金催收到期款项相关执行活动的影响。已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据企业会计准则的规定采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的

报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- (1) 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- (2) 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

1. 利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

2. 投资收益

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其初始计量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资，在其持有期间，按票面金额和票面利率计算的利息计入投资收益。

3. 公允价值变动收益

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、衍生工具、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。不包括本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资在持有期间按票面利率计算的利息。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

根据《长安宏观策略混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金同份额类别每份基金份额享有同等分配权。在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为12次，每份基金份额每次分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的25%；若基金合同生效不满3个月，可不进行收益分配。基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，基金投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资，且基金份额持有人可对A类、C类基金份额分别选择不同分红方式；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

编制财务报表时，本基金需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入和支出的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本基金对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》(中国证监会公告〔2017〕13号)，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。对于在发行时明确一定期限限售期的股票，根据《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》(中基协发〔2017〕6号)，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。根据《关于固定收益品种的估值处理标准》在银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所及中国证券监督管理委员会认可的其他交易场所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)，采用第三方估值基准服务机构提供的价格数据进行估值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》(财税〔2002〕128号)、《关于证券投资基金税收政策的通知》(财税〔2004〕78号)、《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》(财税〔2012〕85号)、《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》(财税〔2015〕101号)、《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》(财政部、税务总局、证监会公告〔2019〕78号)、深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、《关于企业所得税若干优惠政策

的通知》(财税〔2008〕1号)、《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》(财税〔2016〕36号)、《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》(财税〔2016〕46号)、《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》(财税〔2016〕70号)、《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》(财税〔2016〕140号)、《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税〔2017〕2号)、《关于资管产品增值税有关问题的通知》(财税〔2017〕56号)、《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》(财税〔2017〕90号)、《关于减半征收证券交易印花税的公告》(财税〔2023〕39号)及其他相关税务法规和实务操作, 本基金适用的主要税项列示如下:

(一) 资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为, 以管理人为增值税纳税人, 暂适用简易计税方法, 按照3%的征收率缴纳增值税。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税; 对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税; 同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(二) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入, 包括买卖股票、债券的差价收入, 股权的股息、红利收入, 债券的利息收入及其他收入, 暂不征收企业所得税。

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入, 暂不征收企业所得税。

(三) 对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司(“挂牌公司”)取得的股息红利所得, 持股期限在1个月以内(含1个月)的, 其股息红利所得全额计入应纳税所得额; 持股期限在1个月以上至1年(含1年)的, 暂减按50%计入应纳税所得额; 持股期限超过1年的, 暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股, 解禁后取得的股息、红利收入, 按照上述规定计算纳税, 持股时间自解禁日起计算; 解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

对基金取得的企业债券利息收入, 应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

(四) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税, 买入股票不征收股票交易印花税。自2023年8月28日起, 证券交易印花税实施减半征收。

(五) 对基金运营过程中缴纳的增值税, 分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率, 计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位: 人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------

	2024年12月31日	2023年12月31日
活期存款	4,301,579.19	7,914,354.09
等于：本金	4,300,138.67	7,912,562.17
加：应计利息	1,440.52	1,791.92
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
其中：存款期限1个月以内	-	-
存款期限1-3个月	-	-
存款期限3个月以上	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计	4,301,579.19	7,914,354.09

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年12月31日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	17,563,098.81	-	18,234,708.73	671,609.92
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
合计	17,563,098.81	-	18,234,708.73	671,609.92
项目	上年度末			
	2023年12月31日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	25,692,826.81	-	25,796,086.00	103,259.19
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	25,692,826.81	-	25,796,086.00	103,259.19

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本报告期末及上年度末均未持有任何衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均未通过买断式逆回购交易取得债券。

7.4.7.5 其他资产

本基金于本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
----	--------------------	---------------------

应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	171.72	219.21
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	116,977.98	97,738.43
其中：交易所市场	116,977.98	97,738.43
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用-审计费	1,491.80	25,000.00
预提费用-信息披露费	99,836.07	90,000.00
其他应付	20,378.20	20,378.20
合计	238,855.77	233,335.84

7.4.7.7 实收基金

7.4.7.7.1 长安宏观策略混合A

金额单位：人民币元

项目 (长安宏观策略混合A)	本期 2024年01月01日至2024年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	21,807,949.74	21,807,949.74
本期申购	5,258,677.62	5,258,677.62
本期赎回（以“-”号填列）	-10,142,832.61	-10,142,832.61
本期末	16,923,794.75	16,923,794.75

7.4.7.7.2 长安宏观策略混合C

金额单位：人民币元

项目 (长安宏观策略混合C)	本期 2024年01月01日至2024年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,999,958.98	3,999,958.98
本期申购	2,474,208.22	2,474,208.22
本期赎回（以“-”号填列）	-5,124,878.36	-5,124,878.36

本期末	1,349,288.84	1,349,288.84
-----	--------------	--------------

申购含红利再投资、转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.8 未分配利润

7.4.7.8.1 长安宏观策略混合A

单位：人民币元

项目 (长安宏观策略混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,118,007.46	2,651,613.67	5,769,621.13
本期期初	3,118,007.46	2,651,613.67	5,769,621.13
本期利润	-1,334,642.55	525,498.39	-809,144.16
本期基金份额交易产生的变动数	-397,188.46	-686,241.24	-1,083,429.70
其中：基金申购款	430,911.73	749,915.52	1,180,827.25
基金赎回款	-828,100.19	-1,436,156.76	-2,264,256.95
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,386,176.45	2,490,870.82	3,877,047.27

7.4.7.8.2 长安宏观策略混合C

单位：人民币元

项目 (长安宏观策略混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	364,626.50	661,797.37	1,026,423.87
本期期初	364,626.50	661,797.37	1,026,423.87
本期利润	-190,280.53	42,852.34	-147,428.19
本期基金份额交易产生的变动数	-141,547.20	-447,224.98	-588,772.18
其中：基金申购款	-29,190.58	399,724.78	370,534.20
基金赎回款	-112,356.62	-846,949.76	-959,306.38
本期已分配利润	-	-	-
本期末	32,798.77	257,424.73	290,223.50

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年 12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年 12月31日
活期存款利息收入	46,977.87	34,261.03
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	4,180.90	6,269.73
其他	1,126.59	1,544.04
合计	52,285.36	42,074.80

其他为结算保证金利息收入。

7.4.7.10 股票投资收益**7.4.7.10.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年 12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年 12月31日
卖出股票成交总额	414,271,372.41	527,043,299.73
减：卖出股票成本总额	415,011,268.04	529,962,443.38
减：交易费用	788,219.71	1,377,282.79
买卖股票差价收入	-1,528,115.34	-4,296,426.44

7.4.7.10.2 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无股票投资收益证券出借差价收入。

7.4.7.11 基金投资收益

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无基金投资收益。

7.4.7.12 债券投资收益**7.4.7.12.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年 12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年 12月31日
债券投资收益——利息收入	-	2,877.26
债券投资收益——买卖债券 (债转股及债券到期兑付) 差价收入	-	-398.00
债券投资收益——赎回差价 收入	-	-
债券投资收益——申购差价 收入	-	-
合计	-	2,479.26

7.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年12月 31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年12月 31日
卖出债券（债转股 及债券到期兑付） 成交总额	-	407,220.00
减：卖出债券（债 转股及债券到期兑 付）成本总额	-	400,398.00
减：应计利息总额	-	7,220.00
减：交易费用	-	-
买卖债券差价收入	-	-398.00

7.4.7.12.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间均无债券投资收益-赎回差价收入。

7.4.7.12.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间均无债券投资收益-申购差价收入。

7.4.7.13 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间均未获得资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间均未获得贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无衍生工具收益买卖权证差价收入。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无衍生工具收益其他投资收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024 年12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023 年12月31日
股票投资产生的股利收益	317,710.39	197,238.02
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	317,710.39	197,238.02

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年01月01日至2024年12 月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年12 月31日
1.交易性金融资产	568,350.73	-200,638.76
——股票投资	568,350.73	-201,232.76
——债券投资	-	594.00
——资产支持证券投资	-	-

——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	568,350.73	-200,638.76

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年 12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年 12月31日
基金赎回费收入	33,888.49	151,411.04
转换费收入	288.44	2,166.28
合计	34,176.93	153,577.32

7.4.7.19 信用减值损失

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无信用减值损失。

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年 12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年 12月31日
审计费用	1,491.80	25,000.00
信息披露费	9,836.07	-
证券出借违约金	-	-
合计	11,327.87	25,000.00

自2024年7月1日起，基金管理人以自有资金承担该基金在小微基金状态下的审计费、信息披露费、持有人大会费、银行间账户维护费、注册登记费等各类固定费用。本年度，公司以自有资金承担该基金的审计费1,508.20元，信息披露费136.61元。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
长安基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国邮政储蓄银行股份有限公司	基金托管人
长安国际信托股份有限公司	基金管理人的股东
杭州景林景淳企业管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
上海恒嘉美联发展有限公司	基金管理人的股东
兵器装备集团财务有限责任公司	基金管理人的股东
五星控股集团有限公司	基金管理人的股东
长安财富资产管理有限公司	基金管理人的子公司

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

基金管理人股东杭州景林投资管理合伙企业（有限合伙）于2023年2月更名为杭州景林景淳企业管理合伙企业（有限合伙）。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.10.1.2 权证交易

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.10.1.5 基金交易

本基金在本报告期内及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过基金交易。

7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无应支付给关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至20 24年12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至20 23年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	321,839.27	599,327.45
其中：应支付销售机构的客户维护费	110,555.47	220,714.52
应支付基金管理人的净管理费	211,283.80	378,612.93

1、自2023年1月1日至2023年8月13日，支付基金管理人长安基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×1.50%/当年天数

根据《长安基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》，自2023年8月14日起，支付基金管理人的基金管理费按前一日基金资产净值1.20%的年费率计提，计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×1.20%/当年天数

2、客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年01月01日至2024年12月31日	2023年01月01日至2023年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	53,639.99	99,887.92

自2023年1月1日至2023年8月13日，支付基金托管人邮储银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25% / 当年天数

根据《长安基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》，自2023年8月14日起，支付基金托管人邮储银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.20%的年费率计提，计算公式为：

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.20% / 当年天数

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2024年01月01日至2024年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长安宏观策略混合A	长安宏观策略混合C	合计
长安基金管理有限公司	0.00	2,561.99	2,561.99
合计	0.00	2,561.99	2,561.99
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2023年01月01日至2023年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长安宏观策略混合A	长安宏观策略混合C	合计
长安基金管理有限公司	0.00	14,497.83	14,497.83
合计	0.00	14,497.83	14,497.83

本基金A类基金份额不收取销售服务费。

支付销售机构的基金销售服务费按前一日C类资产净值0.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

长安宏观策略混合C日基金销售服务费=前一日C类基金资产净值×0.5%/当年天数

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

长安宏观策略混合A

份额单位：份

项目	本期 2024年01月01日至 2024年12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至 2023年12月31日
报告期初持有的基金份额	4,880,312.85	3,173,968.25
报告期间申购/买入总份额	-	1,706,344.60
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	4,880,312.85	4,880,312.85
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	26.71%	18.91%

长安宏观策略混合C

份额单位：份

项目	本期 2024年01月01日至 2024年12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至 2023年12月31日
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末及上年度末均未持有本基金。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年12月31日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国邮政储蓄银行股份有限公司	4,301,579.19	46,977.87	7,914,354.09	34,261.03

本基金通过“邮储银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于2024年12月31日的相关余额为人民币227,271.06元（2023年12月31日：人民币145,663.18元）。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金在本报告期内及上年度可比期间内均无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况--固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金在本报告期末进行过利润分配。

7.4.12 期末（2024年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

根据中国证监会相关规定，证券投资基金参与网下配售，可与发行人、承销商自主约定网下配售股票的持有期限并公开披露。持有期自公开发行的股票上市之日起计算。在持有期内的股票为流动受限制而不能自由转让的资产。证券投资基金获配的科创板股票及创业板股票需要锁定的，锁定期根据相关法规及交易所相关规定执行。证券投资基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起在法规规定的限售期内不得转让。证券投资基金对上述非公开发行股票的减持还需根据交易所相关规定执行。

于2024年12月31日，本基金未持有因认购新发或增发证券而受上述规定约束的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

于2024年12月31日，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

于2024年12月31日，本基金未持有因银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

于2024年12月31日，本基金未持有因交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

于2024年12月31日，本基金未持有参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括：

- 信用风险
- 流动性风险
- 市场风险

本基金管理人按照“健全、合理、制衡、独立”的原则，建立了合规与风险管理委员会(董事会层面)、督察长、法律合规部、监察稽核部、风险管理部和相关部门构成的全方位、多层级的合规风险管理架构。本基金管理人秉承全面风险管理的理念，将风险管理贯穿日常经营活动的整个过程，渗透到各个业务环节，覆盖所有部门和岗位，建立了集风险识别、风险测量、风险控制、风险评价、风险报告为一体的风险管理机制，全面、及时识别、分析和评估各类风险，有效防范日常经营和基金运作过程中可能面临的各种风险，最大限度地保护基金份额持有人的合法权益。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的银行存款存放在邮储银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，本基金投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并采用券款对付交割方式以控制相应的信用风险。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的债券投资。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的债券投资。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现，另一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金管理人对流通受限证券的投资交易进行限制和控制，对缺乏流动性的证券投资比率事先确定最高上限，控制基金的流动性结构；加强对投资组合变现周期和冲击成本的定量分析，定期揭示基金的流动性风险；通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。本基金所持证券均可在证券交易所或银行间同业市场交易，除本报告期末本基金持有的流通受限证券章节中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金管理人根据申购赎回变动情况，制定现金头寸预测表，及时采取措施满足流动性需要；分析基金持有人结构，加强与主要持有机构的沟通，及时揭示可能的赎回需求；在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于本期末，除卖出回购金融资产款余额(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

报告期内，本基金主要投资于在国内依法公开发行上市的股票等，基金组合资产中的主要标的属于《公开募集证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“流动性新规”）中定义的7个工作日可变现资产的范围，基金管理人每日对基金组合资产中的7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估和测算，保证本基金每日净赎回申请不超

过基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值。本基金主动投资于流动性新规中定义的流动性受限资产的市值不超过基金的资产净值的15%。本基金根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》和流动性新规的要求严格执行开放式基金资金头寸管理的相关规定，每日保持不低于5%的现金和到期日在一年以内的政府债券（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等），以备支付基金份额持有人的赎回款。报告期内本基金组合资产的流动性和变现能力较强，流动性风险较小。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金等。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过对所持投资品种修正久期等参数的监控进行利率风险管理。

下表统计了本基金面临的利率风险敞口，表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类：

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	4,301,579.19	-	-	-	-	-	4,301,579.19
结算备付金	227,271.06	-	-	-	-	-	227,271.06
存出保证金	67,510.52	-	-	-	-	-	67,510.52
交易性金融资产	-	-	-	-	-	18,234,708.73	18,234,708.73
应收申购款	-	-	-	-	-	7,313.56	7,313.56
资产总计	4,596,360.77	-	-	-	-	18,242,022.29	22,838,383.06
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	131,029.40	131,029.40
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	23,503.31	23,503.31
应付托管费	-	-	-	-	-	3,917.23	3,917.23

应付销售服务费	-	-	-	-	-	722.99	722.99
其他负债	-	-	-	-	-	238,855.77	238,855.77
负债总计	-	-	-	-	-	398,028.70	398,028.70
利率敏感度缺口	4,596,360.77	-	-	-	-	17,843,993.59	22,440,354.36
上年度末 2023年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	7,914,354.09	-	-	-	-	-	7,914,354.09
结算备付金	145,663.18	-	-	-	-	-	145,663.18
存出保证金	90,461.45	-	-	-	-	-	90,461.45
交易性金融资产	-	-	-	-	-	25,796,086.00	25,796,086.00
应收申购款	-	-	-	-	-	18,324.87	18,324.87
资产总计	8,150,478.72	-	-	-	-	25,814,410.87	33,964,889.59
负债							
应付清算款	-	-	-	-	-	976,943.73	976,943.73
应付赎回款	-	-	-	-	-	108,994.50	108,994.50
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	33,764.46	33,764.46
应付托管费	-	-	-	-	-	5,627.44	5,627.44
应付销售服务费	-	-	-	-	-	2,269.90	2,269.90
其他负债	-	-	-	-	-	233,335.84	233,335.84
负债总计	-	-	-	-	-	1,360,935.87	1,360,935.87
利率敏感度缺口	8,150,478.72	-	-	-	-	24,453,475.00	32,603,953.72

表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本年末未持有债券投资，无重大利率风险，因而未进行敏感性分析。银行存款及结算备付金之浮动利率根据中国人民银行的基准利率和相关机构的相关政策浮动。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

本基金承受的其他价格风险，主要是基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金的其他价格风险，主要受到证券交易所上市的股票整体涨跌趋势的影响，由所持有的金融工具的

公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，通过组合估值、行业配置分析等进行市场价格风险管理。

于2024年12月31日，本基金面临的其他价格风险列示如下：

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年12月31日		上年度末 2023年12月31日	
	公允价值	占基金资产 净值比例(%)	公允价值	占基金资产净 值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	18,234,708.73	81.26	25,796,086.00	79.12
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	18,234,708.73	81.26	25,796,086.00	79.12

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除敏感度分析基准（见注释）以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
	沪深300指数上升5%	1,268,988.12	1,150,195.98
	沪深300指数下降5%	-1,268,988.12	-1,150,195.98

本基金以沪深300指数作为其他价格波动风险的敏感度分析基准。

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。

三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	18,234,708.73	25,796,086.00
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	18,234,708.73	25,796,086.00

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

于本报告期间，本基金无公允价值所属层次间的重大变动。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

于本报告期内，本基金无第三层次公允价值余额及变动情况。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2024年12月31日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(2023年12月31日：无)。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于2024年12月31日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	18,234,708.73	79.84
	其中：股票	18,234,708.73	79.84
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	4,528,850.25	19.83
8	其他各项资产	74,824.08	0.33
9	合计	22,838,383.06	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	10,985,808.53	48.96
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	3,885,137.20	17.31
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	2,406,260.00	10.72
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	957,503.00	4.27
S	综合	-	-
	合计	18,234,708.73	81.26

8.2.2 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。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

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	688256	寒武纪	3,415	2,247,070.00	10.01
2	002027	分众传媒	260,800	1,833,424.00	8.17
3	000063	中兴通讯	41,600	1,680,640.00	7.49

4	600104	上汽集团	61,400	1,274,664.00	5.68
5	688041	海光信息	8,241	1,234,419.39	5.50
6	688981	中芯国际	11,687	1,105,823.94	4.93
7	000977	浪潮信息	21,000	1,089,480.00	4.86
8	300442	润泽科技	19,200	997,632.00	4.45
9	688608	恒玄科技	2,660	865,484.20	3.86
10	002843	泰嘉股份	34,800	741,936.00	3.31
11	688343	云天励飞	12,912	640,435.20	2.85
12	688502	茂莱光学	2,989	601,984.60	2.68
13	300805	电声股份	51,700	572,836.00	2.55
14	601098	中南传媒	32,500	487,825.00	2.17
15	601928	凤凰传媒	40,700	469,678.00	2.09
16	000333	美的集团	6,000	451,320.00	2.01
17	688332	中科蓝讯	3,210	418,905.00	1.87
18	301392	汇成真空	6,400	395,264.00	1.76
19	688320	禾川科技	9,046	351,889.40	1.57
20	688205	德科立	3,849	350,259.00	1.56
21	603236	移远通信	3,100	212,164.00	0.95
22	300638	广和通	10,500	211,575.00	0.94

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600900	长江电力	13,313,142.00	40.83
2	300394	天孚通信	10,755,520.00	32.99
3	300308	中际旭创	8,048,170.80	24.68
4	601138	工业富联	6,575,303.00	20.17
5	600150	中国船舶	6,555,502.00	20.11
6	600114	东睦股份	6,046,774.66	18.55

7	300502	新易盛	5,781,503.00	17.73
8	002027	分众传媒	5,534,089.00	16.97
9	688111	金山办公	5,385,734.88	16.52
10	601728	中国电信	5,249,923.00	16.10
11	000100	TCL科技	4,741,710.00	14.54
12	000651	格力电器	4,565,070.87	14.00
13	603871	嘉友国际	4,513,039.00	13.84
14	601985	中国核电	4,210,582.00	12.91
15	300750	宁德时代	4,130,001.00	12.67
16	601989	中国重工	4,066,695.00	12.47
17	603325	博隆技术	3,898,919.00	11.96
18	300161	华中数控	3,771,561.00	11.57
19	603977	国泰集团	3,757,594.00	11.52
20	002463	沪电股份	3,711,035.00	11.38
21	002154	报喜鸟	3,690,669.00	11.32
22	003816	中国广核	3,447,272.00	10.57
23	688256	寒武纪	3,398,525.32	10.42
24	601288	农业银行	3,381,420.00	10.37
25	300033	同花顺	3,314,481.00	10.17
26	002371	北方华创	3,233,040.00	9.92
27	002840	华统股份	3,151,574.00	9.67
28	000333	美的集团	3,133,939.00	9.61
29	600975	新五丰	3,133,760.00	9.61
30	002073	软控股份	3,071,630.00	9.42
31	000528	柳工	3,068,529.00	9.41
32	605098	行动教育	2,981,491.00	9.14
33	002624	完美世界	2,949,125.04	9.05
34	601777	千里科技	2,893,910.00	8.88
35	688072	拓荆科技	2,864,547.77	8.79
36	000858	五粮液	2,751,248.00	8.44
37	601928	凤凰传媒	2,705,124.00	8.30

38	000063	中兴通讯	2,683,776.00	8.23
39	601098	中南传媒	2,418,622.14	7.42
40	688981	中芯国际	2,404,342.57	7.37
41	600733	北汽蓝谷	2,398,970.00	7.36
42	601058	赛轮轮胎	2,374,288.00	7.28
43	601398	工商银行	2,372,613.00	7.28
44	600745	闻泰科技	2,315,760.00	7.10
45	601595	上海电影	2,307,033.00	7.08
46	688244	永信至诚	2,229,474.06	6.84
47	601689	拓普集团	2,178,957.00	6.68
48	300364	中文在线	2,146,636.00	6.58
49	300604	长川科技	2,133,941.64	6.55
50	600661	昂立教育	2,111,891.00	6.48
51	002179	中航光电	2,096,277.91	6.43
52	603993	洛阳钼业	2,064,467.00	6.33
53	300430	诚益通	2,053,042.00	6.30
54	002011	盾安环境	2,036,821.00	6.25
55	688372	伟测科技	1,979,580.42	6.07
56	300298	三诺生物	1,977,633.80	6.07
57	000921	海信家电	1,933,009.00	5.93
58	688041	海光信息	1,928,733.19	5.92
59	002475	立讯精密	1,895,142.00	5.81
60	600276	恒瑞医药	1,880,602.20	5.77
61	000568	泸州老窖	1,862,349.00	5.71
62	300002	神州泰岳	1,832,409.00	5.62
63	688347	华虹公司	1,790,115.52	5.49
64	600938	中国海油	1,774,479.00	5.44
65	300395	菲利华	1,727,435.00	5.30
66	688502	茂莱光学	1,718,086.09	5.27
67	688047	龙芯中科	1,712,598.92	5.25
68	603822	嘉澳环保	1,605,772.00	4.93

69	603198	迎驾贡酒	1,567,181.00	4.81
70	002409	雅克科技	1,542,945.00	4.73
71	002273	水晶光电	1,536,640.00	4.71
72	688498	源杰科技	1,528,286.41	4.69
73	601677	明泰铝业	1,504,484.00	4.61
74	600482	中国动力	1,503,172.00	4.61
75	003021	兆威机电	1,502,662.24	4.61
76	600131	国网信通	1,493,581.00	4.58
77	600872	中炬高新	1,491,558.00	4.57
78	601500	通用股份	1,486,984.00	4.56
79	000526	学大教育	1,455,114.36	4.46
80	600025	华能水电	1,448,710.00	4.44
81	601857	中国石油	1,448,046.00	4.44
82	600552	凯盛科技	1,422,523.00	4.36
83	603009	北特科技	1,404,744.00	4.31
84	603268	松发股份	1,317,556.00	4.04
85	603008	喜临门	1,316,704.00	4.04
86	688312	燕麦科技	1,295,654.56	3.97
87	300337	银邦股份	1,286,300.00	3.95
88	600609	金杯汽车	1,256,488.00	3.85
89	000975	山金国际	1,238,693.00	3.80
90	688766	普冉股份	1,230,320.88	3.77
91	688361	中科飞测	1,222,667.26	3.75
92	300757	罗博特科	1,219,513.00	3.74
93	002035	华帝股份	1,219,340.00	3.74
94	600129	太极集团	1,215,718.00	3.73
95	688609	九联科技	1,214,444.49	3.72
96	688418	震有科技	1,203,818.69	3.69
97	300593	新雷能	1,198,005.00	3.67
98	688166	博瑞医药	1,195,199.89	3.67
99	301171	易点天下	1,193,415.00	3.66

100	000422	湖北宜化	1,185,008.00	3.63
101	688687	凯因科技	1,184,761.18	3.63
102	603225	新凤鸣	1,165,948.00	3.58
103	002517	恺英网络	1,161,355.00	3.56
104	603019	中科曙光	1,157,807.00	3.55
105	605296	神农集团	1,155,109.00	3.54
106	002025	航天电器	1,148,077.00	3.52
107	600104	上汽集团	1,147,932.00	3.52
108	688777	中控技术	1,146,813.33	3.52
109	002567	唐人神	1,119,022.00	3.43
110	300408	三环集团	1,096,091.00	3.36
111	300476	胜宏科技	1,086,673.00	3.33
112	300059	东方财富	1,055,780.00	3.24
113	600418	江淮汽车	1,047,167.00	3.21
114	300181	佐力药业	1,044,194.00	3.20
115	603083	剑桥科技	1,034,912.00	3.17
116	300247	融捷健康	1,034,783.00	3.17
117	000938	紫光股份	1,032,247.00	3.17
118	300803	指南针	1,024,139.00	3.14
119	600383	金地集团	1,023,654.00	3.14
120	688017	绿的谐波	1,014,032.90	3.11
121	000977	浪潮信息	1,013,481.00	3.11
122	603697	有友食品	1,008,903.00	3.09
123	688691	灿芯股份	988,348.44	3.03
124	688235	百济神州	952,410.58	2.92
125	601939	建设银行	949,907.00	2.91
126	000657	中钨高新	939,711.00	2.88
127	002984	森麒麟	939,025.00	2.88
128	603218	日月股份	937,704.00	2.88
129	002415	海康威视	937,380.00	2.88
130	300049	福瑞股份	933,404.00	2.86

131	601808	中海油服	928,906.00	2.85
132	688608	恒玄科技	927,016.41	2.84
133	002602	ST华通	926,315.00	2.84
134	300679	电连技术	923,423.00	2.83
135	603099	长白山	922,541.00	2.83
136	600435	北方导航	918,885.00	2.82
137	000725	京东方A	918,816.00	2.82
138	603199	九华旅游	916,787.00	2.81
139	603998	方盛制药	906,116.00	2.78
140	300442	润泽科技	899,179.00	2.76
141	688187	时代电气	895,858.64	2.75
142	688150	莱特光电	880,934.14	2.70
143	600262	北方股份	880,507.00	2.70
144	601766	中国中车	876,394.00	2.69
145	002714	牧原股份	861,632.00	2.64
146	600886	国投电力	842,807.00	2.58
147	688036	传音控股	841,036.60	2.58
148	300418	昆仑万维	836,247.00	2.56
149	605589	圣泉集团	819,793.00	2.51
150	601390	中国中铁	819,398.00	2.51
151	601186	中国铁建	816,740.00	2.51
152	000598	兴蓉环境	816,255.00	2.50
153	600536	中国软件	797,339.28	2.45
154	300433	蓝思科技	786,025.25	2.41
155	000553	安道麦A	782,929.00	2.40
156	301040	中环海陆	780,295.00	2.39
157	600667	太极实业	776,252.00	2.38
158	300454	深信服	769,865.00	2.36
159	603728	鸣志电器	767,182.00	2.35
160	300624	万兴科技	765,394.61	2.35
161	603283	赛腾股份	764,560.00	2.34

162	603931	格林达	759,481.00	2.33
163	600316	洪都航空	753,058.00	2.31
164	688627	精智达	750,315.89	2.30
165	688631	莱斯信息	749,547.12	2.30
166	603979	金诚信	740,060.00	2.27
167	600438	通威股份	737,105.00	2.26
168	688343	云天励飞	729,989.05	2.24
169	002843	泰嘉股份	713,100.00	2.19
170	300805	电声股份	690,311.00	2.12
171	000888	峨眉山A	687,226.00	2.11
172	601100	恒立液压	683,506.00	2.10
173	688018	乐鑫科技	683,438.65	2.10
174	600760	中航沈飞	675,381.00	2.07
175	601601	中国太保	673,315.00	2.07

买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600900	长江电力	13,394,945.00	41.08
2	300394	天孚通信	11,289,184.00	34.63
3	300308	中际旭创	8,060,015.00	24.72
4	601138	工业富联	6,968,950.00	21.37
5	688111	金山办公	6,394,889.96	19.61
6	600150	中国船舶	6,199,773.00	19.02
7	600114	东睦股份	6,178,008.00	18.95
8	300502	新易盛	6,156,925.00	18.88
9	601728	中国电信	5,424,267.00	16.64
10	000100	TCL科技	4,968,400.00	15.24
11	000651	格力电器	4,725,150.00	14.49

12	300750	宁德时代	4,507,627.00	13.83
13	603871	嘉友国际	4,490,322.60	13.77
14	601985	中国核电	4,346,778.09	13.33
15	002463	沪电股份	4,021,763.90	12.34
16	603325	博隆技术	3,875,611.00	11.89
17	002027	分众传媒	3,866,638.00	11.86
18	603977	国泰集团	3,811,624.00	11.69
19	300161	华中数控	3,639,512.00	11.16
20	601989	中国重工	3,631,811.00	11.14
21	002154	报喜鸟	3,625,092.00	11.12
22	003816	中国广核	3,575,253.00	10.97
23	002073	软控股份	3,509,081.00	10.76
24	601288	农业银行	3,471,227.00	10.65
25	300033	同花顺	3,455,774.00	10.60
26	300604	长川科技	3,409,299.00	10.46
27	000528	柳工	3,260,213.40	10.00
28	002371	北方华创	3,225,682.00	9.89
29	688687	凯因科技	3,160,716.62	9.69
30	600975	新五丰	3,068,326.00	9.41
31	605098	行动教育	3,046,766.00	9.34
32	002624	完美世界	2,975,666.00	9.13
33	002840	华统股份	2,913,382.00	8.94
34	601777	千里科技	2,849,413.95	8.74
35	688072	拓荆科技	2,752,452.76	8.44
36	000333	美的集团	2,701,682.00	8.29
37	000858	五粮液	2,598,931.00	7.97
38	601595	上海电影	2,485,795.00	7.62
39	600733	北汽蓝谷	2,453,073.00	7.52
40	601398	工商银行	2,446,093.00	7.50
41	601058	赛轮轮胎	2,370,752.00	7.27
42	601928	凤凰传媒	2,279,698.00	6.99

43	000921	海信家电	2,238,355.00	6.87
44	600661	昂立教育	2,208,192.00	6.77
45	600745	闻泰科技	2,150,359.00	6.60
46	688372	伟测科技	2,109,807.24	6.47
47	300364	中文在线	2,108,728.00	6.47
48	300430	诚益通	2,096,466.00	6.43
49	688244	永信至诚	2,050,398.86	6.29
50	002011	盾安环境	2,002,340.00	6.14
51	002179	中航光电	1,969,309.00	6.04
52	603993	洛阳钼业	1,963,002.00	6.02
53	601689	拓普集团	1,960,479.00	6.01
54	300298	三诺生物	1,958,304.00	6.01
55	688347	华虹公司	1,932,144.34	5.93
56	601098	中南传媒	1,902,404.00	5.83
57	300395	菲利华	1,900,576.00	5.83
58	688177	百奥泰	1,859,465.31	5.70
59	002475	立讯精密	1,849,194.00	5.67
60	600276	恒瑞医药	1,797,206.80	5.51
61	300002	神州泰岳	1,782,353.00	5.47
62	688047	龙芯中科	1,764,338.85	5.41
63	603662	柯力传感	1,730,415.00	5.31
64	600938	中国海油	1,728,302.00	5.30
65	000568	泸州老窖	1,703,439.00	5.22
66	000526	学大教育	1,651,096.00	5.06
67	003021	兆威机电	1,602,714.50	4.92
68	688256	寒武纪	1,601,199.40	4.91
69	601500	通用股份	1,562,726.00	4.79
70	603822	嘉澳环保	1,481,766.00	4.54
71	600131	国网信通	1,457,934.00	4.47
72	000050	深天马 A	1,454,806.00	4.46
73	002273	水晶光电	1,421,192.00	4.36

74	600552	凯盛科技	1,413,880.00	4.34
75	603198	迎驾贡酒	1,411,001.00	4.33
76	002387	维信诺	1,404,148.00	4.31
77	600609	金杯汽车	1,398,006.00	4.29
78	002409	雅克科技	1,396,688.00	4.28
79	600872	中炬高新	1,393,188.04	4.27
80	688981	中芯国际	1,392,727.60	4.27
81	601677	明泰铝业	1,388,182.00	4.26
82	603009	北特科技	1,380,378.00	4.23
83	600025	华能水电	1,376,617.00	4.22
84	601857	中国石油	1,360,658.00	4.17
85	600482	中国动力	1,355,287.00	4.16
86	688766	普冉股份	1,318,683.21	4.04
87	688498	源杰科技	1,313,933.63	4.03
88	603008	喜临门	1,303,446.00	4.00
89	688020	方邦股份	1,302,563.42	4.00
90	600129	太极集团	1,291,424.00	3.96
91	002241	歌尔股份	1,273,620.00	3.91
92	605296	神农集团	1,269,281.00	3.89
93	688160	步科股份	1,261,863.03	3.87
94	688609	九联科技	1,254,951.35	3.85
95	002035	华帝股份	1,249,525.00	3.83
96	603697	有友食品	1,242,729.00	3.81
97	002517	恺英网络	1,237,643.00	3.80
98	603019	中科曙光	1,222,611.00	3.75
99	000422	湖北宜化	1,214,587.00	3.73
100	688312	燕麦科技	1,197,034.62	3.67
101	300337	银邦股份	1,190,454.00	3.65
102	300757	罗博特科	1,187,442.00	3.64
103	688418	震有科技	1,186,684.55	3.64
104	600418	江淮汽车	1,171,789.00	3.59

105	000063	中兴通讯	1,165,346.00	3.57
106	603501	韦尔股份	1,160,754.00	3.56
107	688166	博瑞医药	1,154,567.64	3.54
108	300803	指南针	1,150,045.00	3.53
109	603225	新凤鸣	1,146,487.00	3.52
110	688502	茂莱光学	1,142,690.94	3.50
111	688777	中控技术	1,135,782.07	3.48
112	300723	一品红	1,130,040.00	3.47
113	600435	北方导航	1,122,399.00	3.44
114	000975	山金国际	1,116,150.00	3.42
115	300593	新雷能	1,111,994.00	3.41
116	688382	益方生物	1,096,990.22	3.36
117	688631	莱斯信息	1,092,929.66	3.35
118	002025	航天电器	1,088,480.00	3.34
119	301171	易点天下	1,085,139.00	3.33
120	688361	中科飞测	1,076,608.05	3.30
121	300408	三环集团	1,074,599.00	3.30
122	603268	松发股份	1,066,627.00	3.27
123	000938	紫光股份	1,065,694.00	3.27
124	300059	东方财富	1,059,316.00	3.25
125	000725	京东方A	1,040,146.00	3.19
126	688017	绿的谐波	1,011,186.31	3.10
127	300247	融捷健康	1,008,806.00	3.09
128	601939	建设银行	1,008,220.00	3.09
129	300476	胜宏科技	1,004,490.00	3.08
130	600383	金地集团	999,217.00	3.06
131	603099	长白山	993,766.00	3.05
132	300679	电连技术	992,082.00	3.04
133	688389	普门科技	991,186.61	3.04
134	300122	智飞生物	970,017.00	2.98
135	603259	药明康德	963,496.00	2.96

136	300181	佐力药业	949,503.00	2.91
137	605589	圣泉集团	946,955.00	2.90
138	002567	唐人神	922,876.00	2.83
139	603199	九华旅游	919,824.00	2.82
140	601808	中海油服	919,006.00	2.82
141	002602	ST华通	913,408.00	2.80
142	002984	森麒麟	903,132.40	2.77
143	002415	海康威视	900,319.00	2.76
144	688036	传音控股	896,517.05	2.75
145	300418	昆仑万维	896,295.00	2.75
146	600316	洪都航空	890,192.00	2.73
147	000657	中钨高新	884,754.00	2.71
148	600886	国投电力	878,561.50	2.69
149	688235	百济神州	868,923.63	2.67
150	688029	南微医学	860,774.66	2.64
151	600667	太极实业	856,078.00	2.63
152	688691	灿芯股份	852,438.09	2.61
153	603218	日月股份	849,316.00	2.60
154	601766	中国中车	847,314.00	2.60
155	688187	时代电气	835,900.82	2.56
156	603979	金诚信	825,627.00	2.53
157	300049	福瑞股份	823,828.00	2.53
158	688041	海光信息	820,301.59	2.52
159	688150	莱特光电	812,816.43	2.49
160	603083	剑桥科技	812,214.00	2.49
161	603998	方盛制药	809,377.00	2.48
162	603309	维力医疗	807,319.00	2.48
163	300624	万兴科技	802,333.57	2.46
164	600262	北方股份	802,153.00	2.46
165	603728	鸣志电器	798,181.00	2.45
166	601601	中国太保	795,939.00	2.44

167	600760	中航沈飞	795,665.00	2.44
168	002714	牧原股份	786,489.00	2.41
169	601100	恒立液压	776,345.00	2.38
170	603283	赛腾股份	772,009.00	2.37
171	300454	深信服	768,980.00	2.36
172	601186	中国铁建	765,068.00	2.35
173	601390	中国中铁	752,822.00	2.31
174	600536	中国软件	749,721.00	2.30
175	300433	蓝思科技	740,226.00	2.27
176	603508	思维列控	739,991.00	2.27
177	000598	兴蓉环境	720,540.00	2.21
178	000888	峨眉山A	697,600.00	2.14
179	603931	格林达	688,473.00	2.11
180	301040	中环海陆	687,355.00	2.11
181	300366	创意信息	687,336.00	2.11
182	300015	爱尔眼科	682,214.50	2.09
183	000553	安道麦A	681,449.00	2.09
184	300432	富临精工	677,250.00	2.08
185	600183	生益科技	675,744.00	2.07
186	002483	润邦股份	675,229.00	2.07
187	001301	尚太科技	674,190.00	2.07
188	603108	润达医疗	668,657.00	2.05
189	688627	精智达	663,209.32	2.03
190	688018	乐鑫科技	660,824.11	2.03
191	301261	恒工精密	656,995.00	2.02

卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	406,881,540.04
卖出股票收入（成交）总额	414,271,372.41

买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 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。

8.6 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。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

8.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未进行贵金属投资。

8.9 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。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未进行股指期货交易。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未进行国债期货交易。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未进行国债期货交易。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	67,510.52
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	7,313.56
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	74,824.08

8.12.4 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。

8.12.5 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。

8.12.6 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
长安宏观	4,313	3,923.90	4,880,312.85	28.84%	12,043,481.90	71.16%

策略混合A						
长安宏观策略混合C	1,692	797.45	0.00	0.00%	1,349,288.84	100.00%
合计	6,005	3,042.98	4,880,312.85	26.71%	13,392,770.74	73.29%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	长安宏观策略混合A	59,043.42	0.35%
	长安宏观策略混合C	283,586.12	21.02%
	合计	342,629.54	1.88%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	长安宏观策略混合A	0~10
	长安宏观策略混合C	10~50
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	长安宏观策略混合A	0
	长安宏观策略混合C	0
	合计	0

§10 开放式基金份额变动

单位：份

	长安宏观策略混合A	长安宏观策略混合C
基金合同生效日(2012年03月09日)基金份额总额	383,988,929.19	-

本报告期期初基金份额总额	21,807,949.74	3,999,958.98
本报告期基金总申购份额	5,258,677.62	2,474,208.22
减：本报告期基金总赎回份额	10,142,832.61	5,124,878.36
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	16,923,794.75	1,349,288.84

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。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人于2024年4月19日披露《长安基金管理有限公司财务负责人任职公告》，王娟于2024年4月17日起担任公司财务负责人职务。

2、基金管理人于2024年4月19日披露《长安基金管理有限公司副总经理离任公告》，王健于2024年4月17日起不再担任公司副总经理职务。

3、基金管理人于2024年5月17日披露《长安基金管理有限公司总经理助理任职公告》，周密于2024年5月15日起担任公司总经理助理职务。

4、本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的，与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金提供审计服务的机构由毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)变更为天健会计师事务所(特殊普通合伙)。天健会计师事务所(特殊普通合伙)自2024年起为本基金提供审计服务，本基金报告年度应支付给天健会计师事务所(特殊普通合伙)的报酬为人民币壹仟肆佰玖拾壹元捌角。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内无基金管理人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况**11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东方证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	65,609,458.00	7.99%	48,938.33	9.26%	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	202,027,897.42	24.60%	183,453.84	34.72%	-
国泰君安证券	1	44,304,368.85	5.40%	33,047.21	6.25%	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	2	469,321,008.82	57.15%	245,203.40	46.40%	-
光大证券	3	39,890,179.36	4.86%	17,786.69	3.37%	-
海通证券	3	-	-	-	-	-

1、基金租用席位的选择标准是：

- (1) 资金实力雄厚，财务状况良好；
- (2) 经营行为稳健规范且具有较强的合规风控能力，在业内有良好的声誉；

(3) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；

(4) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员。

2、基金租用席位的选择程序是：

投研部门遵照选择标准确定拟合作的证券公司，并经法律合规部、分管领导、督察长及总经理审核。

投研部门根据投资组合交易需要，起草协议并经法律合规部等相关部门会签，经分管领导、督察长及总经理审核同意后，与证券公司签订协议，由中央交易室、清算登记部、信息技术部等部门办理交易单元租用或退租的相关手续。券商交易模式的相关经纪协议的签订和终止，比照执行。

投研部门根据各证券公司提供的研究服务情况及评估结果，拟订选择证券公司参与证券交易的计划，经法律合规部、相关分管领导及督察长审核后报总经理办公会审议，经总经理办公会审议通过后提交至中央交易室执行。

3、上述租用的券商交易单元中，本基金本报告期退租恒泰证券的交易单元，无新增交易单元。

4、本部分的数据统计时间区间与本报告的报告期一致。本公司网站披露的《长安基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024年度）》的报告期为2024年7月1日至2024年12月31日。敬请投资者关注上述报告统计时间区间的口径差异。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期末租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于长安宏观策略混合型证券投资基金变更基金经理的公告	上海证券报、公司官网	2024-01-16
2	长安宏观策略混合型证券投资基金招募说明书更新	公司官网	2024-01-19
3	740001_长安宏观策略混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	公司官网	2024-01-19

4	740001_长安宏观策略混合型证券投资基金2023年第4季度报告	公司官网	2024-01-20
5	关于增加奕丰金融服务（深圳）有限公司为旗下部分基金销售机构并参与费率优惠活动的公告	上海证券报、公司官网	2024-02-06
6	关于新增上海陆亨基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构并参与费率优惠活动的公告	上海证券报、公司官网	2024-02-28
7	关于新增山西证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构并参与费率优惠活动的公告	上海证券报、公司官网	2024-03-22
8	关于增加北京创金启富基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	上海证券报、公司官网	2024-03-27
9	740001_长安宏观策略混合型证券投资基金2023年年度报告	公司官网	2024-03-30
10	长安基金管理有限公司副总经理离任公告	上海证券报、公司官网	2024-04-19
11	长安基金管理有限公司财务负责人任职公告	上海证券报、公司官网	2024-04-19
12	740001_长安宏观策略混合型证券投资基金2024年第1季度报告	公司官网	2024-04-20
13	长安基金管理有限公司关于增加上海中正达广基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	上海证券报、公司官网	2024-04-29
14	长安基金管理有限公司总经理助理任职公告	上海证券报、公司官网	2024-05-17
15	关于增加上海云湾基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	上海证券报、公司官网	2024-05-24
16	740001_长安宏观策略混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	公司官网	2024-06-27

17	长安基金管理有限公司关于提醒投资者更新、完善身份信息的公告	上海证券报、公司官网	2024-06-28
18	关于旗下基金2024年6月30日基金份额净值及基金份额累计净值的公告	公司官网	2024-06-30
19	740001_长安宏观策略混合型证券投资基金2024年第2季度报告	公司官网	2024-07-19
20	关于增加深圳腾元基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	上海证券报、公司官网	2024-07-29
21	关于增加上海国信嘉利基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	上海证券报、公司官网	2024-08-02
22	关于旗下部分基金的销售机构由北京中植基金销售有限公司变更为华源证券股份有限公司的公告	上海证券报、公司官网	2024-08-29
23	740001_长安宏观策略混合型证券投资基金2024年中期报告	公司官网	2024-08-30
24	长安基金管理有限公司关于暂停武汉佰崑基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	上海证券报、公司官网	2024-09-12
25	长安基金管理有限公司关于公司官方网站变更的公告	上海证券报、公司官网	2024-09-23
26	长安基金管理有限公司关于旗下基金改聘会计师事务所的公告	上海证券报、公司官网	2024-10-17
27	740001_长安宏观策略混合型证券投资基金2024年第3季度报告	公司官网	2024-10-25
28	长安宏观策略混合型证券投资基金招募说明书更新	公司官网	2024-11-02
29	关于增加中国邮政储蓄银行股份有限公司邮你同赢平台为旗下部分基金销售机构的公告	上海证券报、公司官网	2024-11-28

30	长安基金管理有限公司关于终止与乾道基金销售有限公司销售合作关系的公告	上海证券报、公司官网	2024-12-03
31	长安基金管理有限公司关于关闭直销网上交易平台、微信交易平台开户、认购、申购（含定期定额投资）、赎回、基金转换业务的公告	上海证券报、公司官网	2024-12-11
32	长安基金管理有限公司关于提醒投资者更新、完善身份信息的公告	上海证券报、公司官网	2024-12-20
33	长安基金管理有限公司关于长安宏观策略混合型证券投资基金变更基金经理的公告	上海证券报、公司官网	2024-12-28
34	长安宏观策略混合型证券投资基金招募说明书更新	公司官网	2024-12-31
35	740001_长安宏观策略混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	公司官网	2024-12-31
36	关于旗下基金2024年12月31日基金份额净值及基金份额累计净值的公告	公司官网	2024-12-31

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	2024/3/6-2024/3/11&2024/5/20-2024/12/31	4,880,312.85	-	-	4,880,312.85	26.71%
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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、《长安宏观策略混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长安宏观策略混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《长安宏观策略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和营业执照；
- 6、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

13.2 存放地点

上海市浦东新区芳甸路1088号紫竹国际大厦16层。

13.3 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
二〇二五年三月三十一日