

---

# 长安鑫旺价值灵活配置混合型证券投资基金

## 2018 年第 2 季度报告

### 2018 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:广发银行股份有限公司

报告送出日期:2018 年 07 月 20 日

## 目录

|   |    |
|---|----|
| §1 重要提示 .....                                       | 2  |
| §2 基金产品概况 .....                                     | 2  |
| 2.1 基金基本情况 .....                                    | 2  |
| §3 主要财务指标和基金净值表现 .....                              | 6  |
| 3.2 基金净值表现 .....                                    | 6  |
| 3.2.1 本报告期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 .....          | 6  |
| 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 ..... | 7  |
| §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合规守信情况说明 .....                     | 8  |
| 4.3 公平交易专项说明 .....                                  | 9  |
| 4.3.1 公平交易制度的执行情况 .....                             | 9  |
| 4.3.2 异常交易行为的专项说明 .....                             | 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 .....                               | 9  |
| 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明 .....                     | 9  |
| §5 投资组合报告 .....                                     | 9  |
| 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 .....                          | 10 |
| 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 .....                         | 14 |
| §8 影响投资者决策的其他重要信息 .....                             | 14 |
| 8.1 影响投资者决策的其他重要信息 .....                            | 14 |
| §9 备查文件目录 .....                                     | 14 |
| 9.1 备查文件目录 .....                                    | 14 |
| 9.2 存放地点 .....                                      | 14 |
| 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。

基金托管人广发银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年07月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年04月01日起至2018年06月30日止。

## § 2 基金产品概况

### 2.1 基金基本情况

|            |   |
|------------|---|
| 基金简称       | 长安鑫旺价值混合  |
| 基金主代码      | 005049  |
| 基金运作方式     | 契约型开放式  |
| 基金合同生效日    | 2017年09月21日   |
| 报告期末基金份额总额 | 136,044,966.42份   |
| 投资目标       | 在严格控制风险和保持流动性的前提下，在科学的大类资产配置的基础上，重点把握股息率较高的上市公司的投资机会，追求基金资产的长期稳健增值。   |
| 投资策略       | <p>本基金投资策略包括三个大的方面，即资产配置策略、股票投资策略和债券投资策略。</p> <p>（一）资产配置策略</p> <p>资产配置即决定基金资产在股票、债券和货币市场工具等大类资产的配置比例和动态调整。</p> <p>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</p> |

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个方面的因素：

- 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，同时关注海外经济发展的数据，以评估我国经济发展所处阶段及宏观经济变化趋势；
- 2、政府政策：重点关注我国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

资本利得和股息收入是投资股票的两种收益来源，从长期投资的角度看，股息回报在股票的总投资回报中占据重要地位。股息率一般是指股票过去一年的总现金分红额与其股价的比率，股息率是衡量上市公司是否具有投资价值的重要标尺之一，能够持续发放较高股息的公司大多已进入成熟发展阶段，经营稳健，股价的波动相对较小，股息收益在熊市中能够缓冲股价波动所带来的损失，使其收益率相对更为稳定，高股息率的股票风险收益比相对更好。

本基金充分发挥基金管理人在精选个股方面的优势，采用“自下而上”的视角，通过定量与定性分析，运用不同的分析方法和指标评估行业 and 上市公司的成长潜力和发展阶段，重点把握具有较高股息率的上市公司的投资价值和投资机会。

### 1、筛选具有较好现金分红记录的股票

过去具有持续现金分红记录 and 能力的公司表现更稳健，未来持续分红的概率更大。本基金运用定量分析，筛选过去3-5年实现了持续分红，且分红以现金分红为主、分红数量较高的股票，形成初选股票池。

### 2、分析所选股票所在行业的成长空间

行业的成长空间是决定上市公司未来发展和持续分红的重要因素。本基金运用定量和定性分析相结合，从人口结构、经济发展阶段、国家的产业政策等方面分析所筛选股票所属行业的成长性，选取所属行业仍然具有较大成长空间的上市公司。

### 3、分析上市公司的发展阶段

在所在行业中具有较强竞争力且已进入稳定发展阶段的公司，未来盈利大幅波动的可能性较小，业绩相对更为稳健。本基金运用定量和定性分析相结合，分析所选上市公司所处的发展阶段，选取公司处于行业龙头地位、进入成熟发展期、增长稳健且经营性现金流稳定的上市公司，重点分析上市公司市场占有率的变化情况、营业收入增长速度的变化趋势、净资产回报率的变化等。

### 4、分析上市公司的相对价值

估值是判断股票安全边际的重要指标，本基金重点投资投资估值合理、价值被低估的股票。本基金计算上市公司的市盈率、市净率、市销率以及行业或同行业同类公司的估值比较，判断公司的相对市场价值，选取具有较高估值优势的上市公司。

## （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、可转债投资策略

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，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。

### 3、中小企业私募债投资策略

|        |   |
|--------|---|
|        | <p>本基金将根据审慎原则，密切跟踪中小企业私募债的信用风险变化和流动性情况，通过对中小企业私募债进行信用评级控制，通过对投资单只中小企业私募债的比例限制，严格控制风险，并充分考虑单只中小企业私募债对基金资产流动性造成的影响，通过信用研究和流动性管理后，决定投资品种。</p> <p>（四）衍生品投资策略</p> <p>1、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。</p> <p>2、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。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 and 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。</p> <p>3、权证投资策略</p> <p>本基金将充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征，通过资产配置、品种与类属选择，谨慎进行投资，追求较稳定的当期收益。</p> <p>（五）资产支持证券投资策略</p> <p>本基金将通过分析市场利率、发行条款、资产池结构及其资产池所处行业的景气变化、违约率、提前偿还率等影响资产支持证券内在价值的相关要素，并综合运用久期管理、收益率曲线变动分析、收益率利差分析和期权定价模型等方法，选择经风险调整后相对价值较高的品种进行投资。</p> |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数收益率*50%+中债综合指数收益率*50%  |
| 风险收益特征 | 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，  |

|                 |                       |                |
|-----------------|-----------------------|----------------|
|                 | 属于较高预期风险、较高预期收益的投资品种。 |                |
| 基金管理人           | 长安基金管理有限公司            |                |
| 基金托管人           | 广发银行股份有限公司            |                |
| 下属分级基金的基金简称     | 长安鑫旺价值混合A             | 长安鑫旺价值混合C      |
| 下属分级基金的交易代码     | 005049                | 005050         |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 49,344,014.75份        | 86,700,951.67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(2018年04月01日 - 2018年06月30日) |               |
|-----------------|--------------------------------|---------------|
|                 | 长安鑫旺价值混合A                      | 长安鑫旺价值混合C     |
| 1. 本期已实现收益      | 1,557,022.95                   | 2,849,377.19  |
| 2. 本期利润         | -731,326.78                    | -1,305,384.23 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0139                        | -0.0137       |
| 4. 期末基金资产净值     | 53,051,973.28                  | 93,262,060.71 |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.0751                         | 1.0757        |

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 本报告期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

###### 长安鑫旺价值混合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 | -1.78% | 1.18%     | -4.52%     | 0.57%         | 2.74% | 0.61% |

|   |  |  |  |  |  |  |
|---|--|--|--|--|--|--|
| 月 |  |  |  |  |  |  |
|---|--|--|--|--|--|--|

本基金整体业绩比较基准构成为：沪深 300 指数收益率\*50%+中债综合指数收益率\*50%  
**长安鑫旺价值混合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 | -1.76% | 1.18%     | -4.52%     | 0.57%         | 2.76% | 0.61% |

本基金整体业绩比较基准构成为：沪深 300 指数收益率\*50%+中债综合指数收益率\*50%

### 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

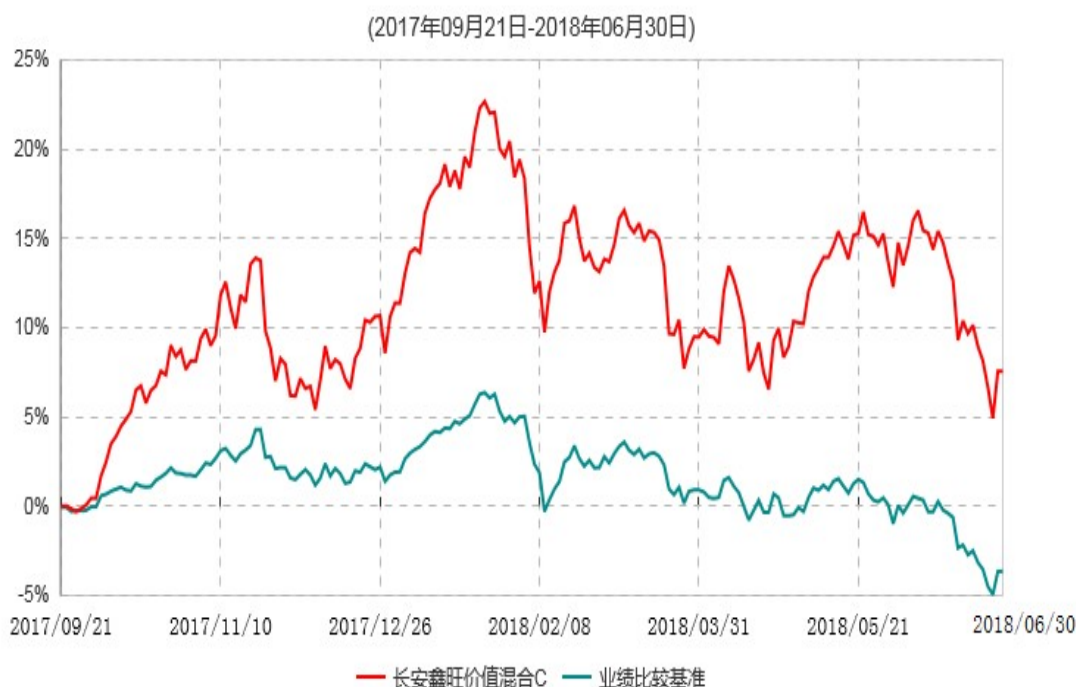
长安鑫旺价值混合A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



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末,本基金运作时间未满一年。图示日期为 2017 年 9 月 21 日至 2018 年 06 月 30 日。



长安鑫旺价值混合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



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末,本基金运作时间未满一年。图示日期为2017年9月21日至2018年06月30日。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名  | 职务       | 任本基金的基金经理期限 |      | 证券从业年限 | 说明   |
|-----|----------|-------------|------|--------|--|
|     |          | 任职日期        | 离任日期 |        |  |
| 林忠晶 | 本基金的基金经理 | 2017-09-21  | -    | 8年     | 北京大学国民经济学博士。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等职。2011年6月加入长安基金管理有限公司,曾任产品经理、战略及产品部副总经理、量化投资部(筹)总经理等职,现任基金投资部副总经理,长安沪深300非周期行业指数证券投资基金、长安宏观策略混合 |

|  |  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|--|
|  |  |  |  |  | 型证券投资基金、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、长安鑫恒回报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、长安鑫禧灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。 |
|--|--|--|--|--|--|

- 1、任职日期和离任日期均指公司做出决定后正式对外公告之日；
- 2、证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金运作管理办法》、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、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有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，本基金适当加大对于医药和食品饮料等消费行业配置比例，以期获得消费升级带来的回报。由于地产调控趋严，地产投资和销售受到一定程度影响，报告期内适当降低相关产业链公司配置比例，但考虑到部分投资标的经过2018年1季度和2季度中旬下跌已经体现投资价值，在临近季末时适当增加配置比例，整体相比1季度末配置比例有所下降。另外，由于电子和计算机等相关行业受贸易摩擦影响较大，适当降低相关行业配置比例。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末长安鑫旺价值混合A基金份额净值为1.0751元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-1.78%，同期业绩比较基准收益率为-4.52%；截至报告期末长安鑫旺价值混合C基金份额净值为1.0757元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-1.76%，同期业绩比较基准收益率为-4.52%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元和持有人人数不足200人的情形。

### § 5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额(元)          | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|----------------|---------------|
| 1  | 权益投资              | 104,582,257.08 | 61.07         |
|    | 其中：股票             | 104,582,257.08 | 61.07         |
| 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          | 26,000,000.00  | 15.18         |
|    | 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      | 40,438,720.62  | 23.62         |

|   |      |                |        |
|---|------|----------------|--------|
| 8 | 其他资产 | 219,890.64     | 0.13   |
| 9 | 合计   | 171,240,868.34 | 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)        | 占基金资产净值的比例<br>(%) |
|----|------------------|----------------|-------------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | 8,843,094.00   | 6.04              |
| B  | 采矿业              | -              | -                 |
| C  | 制造业              | 69,851,550.09  | 47.74             |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 71,559.85      | 0.05              |
| E  | 建筑业              | 9,018,000.00   | 6.16              |
| F  | 批发和零售业           | 1,679,100.00   | 1.15              |
| 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  | -              | -                 |
| J  | 金融业              | 15,037,727.00  | 10.28             |
| 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    | 81,226.14      | 0.06              |
| 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               | 104,582,257.08 | 71.48             |

### 股票投资组合

#### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资

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  | 600519 | 贵州茅台 | 15,700    | 11,483,922.00 | 7.85         |
| 2  | 600566 | 济川药业 | 220,370   | 10,619,630.30 | 7.26         |
| 3  | 002372 | 伟星新材 | 583,901   | 10,329,208.69 | 7.06         |
| 4  | 002415 | 海康威视 | 278,000   | 10,322,140.00 | 7.05         |
| 5  | 600036 | 招商银行 | 385,800   | 10,200,552.00 | 6.97         |
| 6  | 600970 | 中材国际 | 1,350,000 | 9,018,000.00  | 6.16         |
| 7  | 002714 | 牧原股份 | 198,900   | 8,843,094.00  | 6.04         |
| 8  | 000661 | 长春高新 | 33,700    | 7,673,490.00  | 5.24         |
| 9  | 600104 | 上汽集团 | 210,615   | 7,369,418.85  | 5.04         |
| 10 | 601939 | 建设银行 | 738,500   | 4,837,175.00  | 3.31         |

### 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

#### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未进行股指期货交易。

#### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未进行股指期货交易。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未进行国债期货交易。

### 5.10.2 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。

### 5.10.3 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。

## 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体除中材国际（600970）外，没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2017年7月26日，上海证券交易所发布公告称，因中国中材国际工程股份有限公司在信息披露方面存在违规行为，上海证券交易所对该公司处以通报批评的纪律处分。

对上述股票投资决策程序的说明：本基金投资上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

5.11.2 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。

### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额(元)      |
|----|---------|------------|
| 1  | 存出保证金   | 142,107.08 |
| 2  | 应收证券清算款 | -          |
| 3  | 应收股利    | -          |
| 4  | 应收利息    | 8,748.56   |
| 5  | 应收申购款   | 69,035.00  |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 其他      | -          |
| 8  | 合计      | 219,890.64 |

### 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**

本基金本报告期末前十名股票中未持有流通受限股票。

**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

|                               | 长安鑫旺价值混合A     | 长安鑫旺价值混合C      |
|-------------------------------|---------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额                   | 55,761,422.33 | 122,239,835.10 |
| 报告期期间基金总申购份额                  | 1,967,394.89  | 4,619,357.41   |
| 减：报告期期间基金总赎回份额                | 8,384,802.47  | 40,158,240.84  |
| 报告期期间基金拆分变动份额（<br>份额减少以“-”填列） | 0.00          | 0.00           |
| 报告期期末基金份额总额                   | 49,344,014.75 | 86,700,951.67  |

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

|                          |   |
|--------------------------|---|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额         | - |
| 报告期期间买入/申购总份额            | - |
| 报告期期间卖出/赎回总份额            | - |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额         | - |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | - |

本报告期内，本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

**§ 8 影响投资者决策的其他重要信息****8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况**

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额达到或超过20%的情况。

## 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、长安鑫旺价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同；
- 3、长安鑫旺价值灵活配置混合型证券投资基金托管协议；
- 4、长安鑫旺价值灵活配置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](http://www.changanfunds.com)。

长安基金管理有限公司  
二〇一八年七月二十日