

长安鑫利优选灵活配置混合型证券投资基金

2016年第2季度报告

2016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：上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期：2016年07月20日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人上海浦东发展银行根据本基金合同规定，于2016年7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，投资者在作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2016年4月1日起至6月30日止。

## § 2 基金产品概况

|            |   |
|------------|---|
| 基金简称       | 长安鑫利优选混合  |
| 基金主代码      | 001281  |
| 基金运作方式     | 契约型开放式  |
| 基金合同生效日    | 2015年05月18日   |
| 报告期末基金份额总额 | 59,233,870.27份  |
| 投资目标       | 本基金在深入分析宏观经济形势和资本市场变动趋势的基础上，充分挖掘市场潜在的投资机会，追求基金资产的长期稳定增值。  |
| 投资策略       | <p>本基金管理人将综合分析宏观经济状况、国家政策取向、资本市场资金环境和市场情绪等因素，重点研究国内生产总值、工业增加值、经济增长率、物价指数、国际收支、货币供应和收益率期限结构等指标，并结合资本市场资金环境和市场情绪等研究结果，分析和评估不同投资标的的风险收益特征，确定股票、债券和现金类资产在基金资产中的配置比例。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>(1) 基本面选股策略</p> |

本基金将充分发挥基金管理人在个股选择方面的优势，通过定性与定量分析的有机结合，精选基本面良好、具有估值优势、成长性突出的上市公司进行投资。

1) 定性分析

行业驱动因素分析：在深入分析商业模式、创新能力和产业政策等影响行业增长的驱动要素的基础上，寻找在这些驱动要素作用下能够继续保持或者出现趋势性转折机会、并在未来将保持领先或者获得领先优势的上市公司。

上市公司竞争力分析：通过对上市公司的资源禀赋、经营能力、盈利模式和业绩表现潜力等方面进行总体评价的基础上，筛选具有竞争优势上市公司。

公司的发展可持续性分析：本基金管理人将定性地从股权结构、公司治理、内控机制、经营战略等方面出发，分析和比较上市公司发展的可持续性，精选发展的可持续性较强的上市公司。

2) 定量分析

本基金管理人将重点考察以下定量指标对个股的成长性和估值水平进行分析：

成长指标：本基金管理人将采用过去两年归属母公司固定的净利润（ROE）、最近四个季度归属母公司的滚动净利润增长率（净利润增长率）、最近四个季度主营业务收入增长率和最近四个季度归属母公司销售净利率等指标衡量上市公司的成长性。

估值指标：本基金管理人将采用市盈率、市净率、PEG、EV/EBITDA等相对估值方法评估上市公司的估值水平，并通过业内比较、历史比较和成长性分析对上市公司的估值水平进行横向和纵向对比。

(2) 类套利投资策略

1) 定向增发套利策略

对于投资者而言，定向增发将带来上市公司资源整合、优化，业绩提升的预期，并且触发市场对股价的预期出现变化。一般而言，定向增发获得超额收益主要有两种策略：一是投资者在一级市场直接参与定向增发

项目；二是在二级市场买入拟进行增发的股票进行投资。本基金主要采用第二种方式进行定向增发套利。本基金在分析二级市场股票买入时点、定向增发融资目的、卖方一致预期盈利的变化率、规模因子、价值因子等因素的基础上，精选套利机会的确定性较高的股票进行投资。

### 2) 事件驱动策略

事件驱动策略的运用前提是目标公司发生了某些特定或突发事件，导致目标公司证券价格出现大幅波动，通过对局势的分析和判断，做出投资决策。本基金通过信息收集、公司基本面分析、政策研判以及实地调研等定向和定量的研究方法，对可获利的时间进行识别，精选低估的上市公司进行投资。目前关注的事件包括资产重组、股权变动、股权激励、高管/股东增持、高送转以及业绩超预期等，后期将根据资本市场的发展，寻找更适用市场环境的事件驱动策略。

### 3) 大宗交易策略

本基金的大宗交易策略是指通过大宗交易市场折价买入股票，较适当的时间内通过二级市场卖出，赚取大宗交易价格与二级市场价格之间的套利空间。本基金将积极寻找大宗交易机会，并综合考虑股票基本面因素、交易对手、折价情况、流动性和二级市场流动性等指标，谨慎参与大宗交易。

### 3、普通债券投资策略

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

|               |   |
|---------------|---|
|               | <p><b>4、可转换债券投资策略</b></p> <p>本基金在综合分析可转换债券的股性特征、债性特征、流动性等因素的基础上，采用数量化估值工具评定其投资价值，选择安全边际较高、发行条款相对优惠、流动性良好，以及基础股票基本面优良的品种进行投资。本基金还将密切关注转股溢价率、纯债溢价率等指标的变化情况，积极寻找转股溢价率和纯债溢价率呈现“双低”特征的可转换债券品种，捕捉相关套利机会。</p> <p><b>5、股指期货投资策略</b></p> <p>本基金投资股指期货将本着风险管理的原则，以套期保值为目的，选择流动性好、交易活跃的合约进行投资。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。</p> <p><b>6、权证投资策略</b></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综合考虑股票合理价值、标的股票价格，结合权证定价模型、市场供求关系、交易制度设计等多种因素估计权证合理价值，采用杠杆交易策略、看跌保护组合策略、保护组合成本策略、获利保护策略、买入跨式投资等策略达到改善组合风险收益特征的目的。</p> <p><b>7、资产支持证券投资策略</b></p> <p>资产支持证券包括资产抵押贷款支持证券（ABS）、住房抵押贷款支持证券（MBS）等，其定价受多种因素影响，包括市场利率、发行条款、资产池结构及其资产池所处行业的景气变化、提前偿还率等。本基金将在宏观经济分析和债券基本面分析的基础上，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益较高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。</p> |
| <p>业绩比较基准</p> | <p>一年期银行定期存款利率（税后）+1.5%。</p>  |

|                 |   |   |
|-----------------|---|---|
| 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           | 上海浦东发展银行股份有限公司  |   |
| 下属分级基金的基金简称     | 长安鑫利优选混合A   | 长安鑫利优选混合C   |
| 下属分级基金的交易代码     | 001281  | 002072  |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 50,822,174.19份  | 8,411,696.08份   |
| 下属分级基金的风险收益特征   | 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。 | 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。 |

### § 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（2016年04月01日-2016年06月30日） |              |
|-----------------|------------------------------|--------------|
|                 | 长安鑫利优选混合A                    | 长安鑫利优选混合C    |
| 1. 本期已实现收益      | 114,665.65                   | 13,936.10    |
| 2. 本期利润         | 244,962.09                   | 39,345.26    |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0053                       | 0.0018       |
| 4. 期末基金资产净值     | 54,923,426.27                | 9,116,338.19 |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.081                        | 1.084        |

注：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。

#### 3.2 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

长安鑫利优选混合A

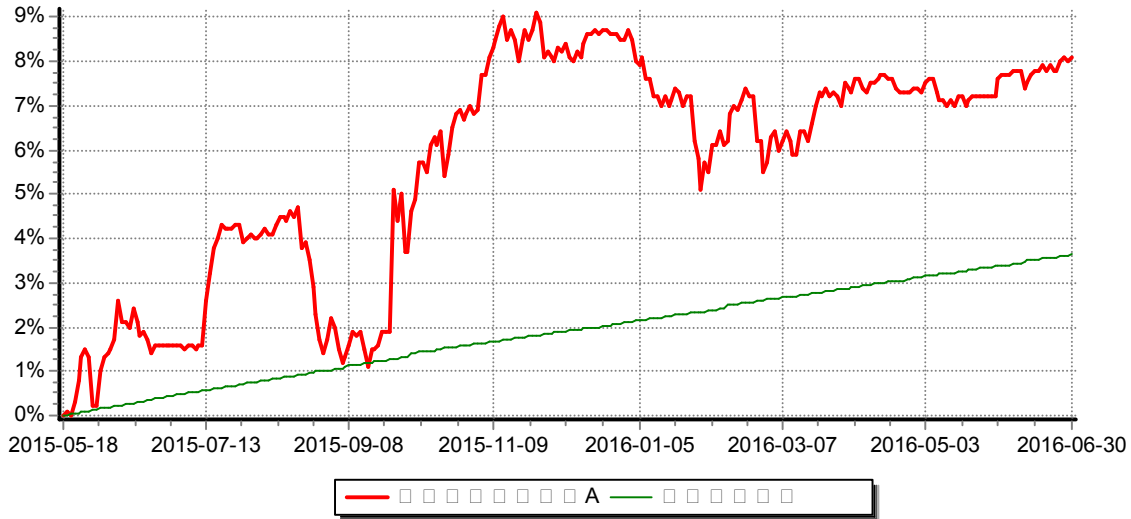
| 阶段                            | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④   |
|-------------------------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月（2016年04月1日-2016年06月30日） | 0.65%  | 0.13%     | 0.76%      | 0.01%         | -0.11% | 0.12% |

长安鑫利优选混合C

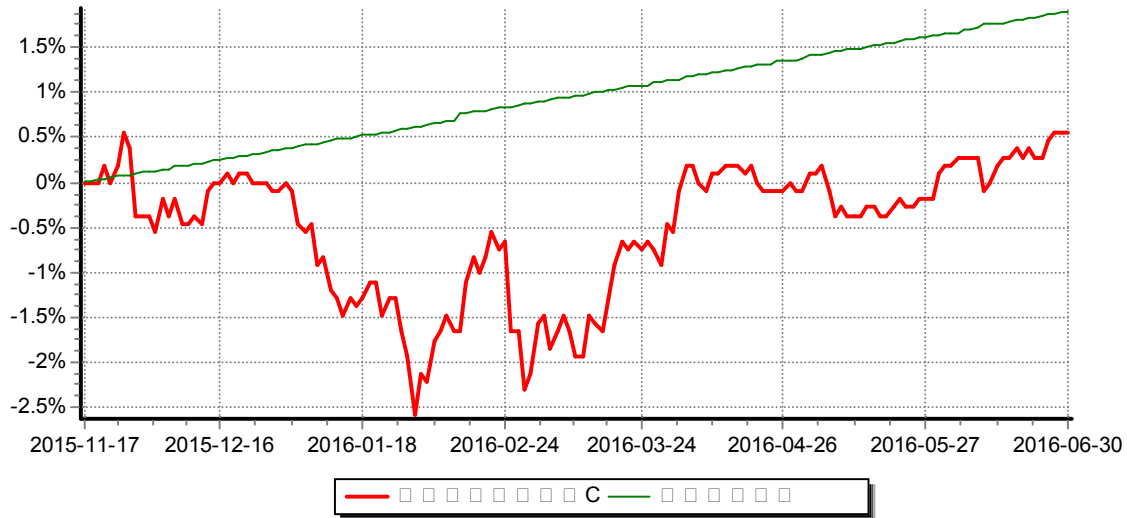
| 阶段                            | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④   |
|-------------------------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月（2016年04月1日-2016年06月30日） | 0.56%  | 0.12%     | 0.76%      | 0.01%         | -0.20% | 0.11% |

注：本基金整体业绩比较基准构成为：一年期银行定期存款利率（税后）+1.5%。一年期银行定期存款利率是指中国人民银行公布并执行的金融机构一年期人民币存款基准利率。

### 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



注：本基金基金合同生效日为2015年5月18日，按基金合同规定，本基金自基金合同生效起6个月为建仓期，截止到建仓期结束时，本基金的各项投资组合比例已符合基金合同的相关规定。图示日期为2015年5月18日至2016年6月30日。



注：本基金于2015年11月17日公告新增加C类份额，实际C类份额申购申请于2015年11月20日确认，图示日期为2015年11月17日至2016年6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 | 2015年05月    |      | 6年     | 北京大学国民经济学 |



|  |     |     |  |   |
|--|-----|-----|--|---|
|  | 金经理 | 18日 |  | <p>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。</p> <p>2011年6月加入长安基金管理有限公司，曾任产品开发部产品经理、基金投资部基金经理助理、战略及产品部副总经理等职，现任长安基金管理有限公司量化投资部（筹）总经理，长安沪深300非周期行业指数证券投资基金、长安产业精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、长安鑫利优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。</p> |
|--|-----|-----|--|---|

注：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》、《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

年初以来，在稳增长、调结构的双重政策目标下，受国内经济面临严重下行压力的影响，政府将工作重心更多放在稳增长。稳增长的政策加大去产能、去杠杆的难度，使得市场出清较为缓慢，经济转型在艰难中进行。尽管经济在二季度保持回升态势，但民间投资依然没有出现起色。另外，二季度的货币投放并没有进入实体经济，出现物价上涨、大宗商品回升、房价较快上涨的态势，导致通胀预期逐步加强。在此背景下，权威人士强调供给侧结构性改革重要性，积极稳妥推进去杠杆，并且强调货币政策回归稳健。在此背景下，二季度权益类资产出现震荡向下，但板块结果分化严重，其中新能源汽车产业链、电子等板块表现强势。债券市场受到信用债违约事件频发的影响，高低等级信用利差扩大，信用债与利率债表现出现分化。

报告期内，基于本基金以追求绝对收益为投资目标，在控制权益类投资比例的前提下，精选业绩较为稳定股票进行投资，并适当参与主题投资，控制投资组合净值回撤幅度，以获得稳健收益。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金A类份额和C类份额的净值增长率分别为0.65%和0.56%，同期本基金的业绩比较基准上涨0.76%。

#### 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2016年4月1日至2016年4月14日连续9个工作日出现基金资产净值低于五千万情形。本基金从2016年4月1日至2016年4月6日连续3个工作日出现持有人人数不足200人的情形。基金管理人已持续关注并已采取适当措施。

#### 4.7 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

由于实体经济赚钱效应缺乏，预计民间投资仍将处于低位，固定资产投资将出现回落。受外围经济持续疲弱影响，三季度出口依然面临较大的不确定性。政策重心仍将在稳增长和调结构直接寻找平衡，将导致市场预期出现反复。受英国脱欧影响，全球经济复苏不确定性增加，美元被动走强，输入性通胀可能性减弱，货币政策操作空间加大，需要持续关注全球金融市场走势，在资本流出较大，经济持续恶化的情形下，不排除政府采用宽松货币政策对冲流动性和刺激经济。权益市场经过前期调整，虽然估值依然整体较高，但部分个股调整已经到位，相当一批优质成长股已经见底。

2016年3季度寻找被低估的优质个股进行投资，主要集中在医药、军工、化工和消费类个股，并关注国企改革带来的投资机会。由于债券兑付风险仍未过去，对于固定收益投资相对较为谨慎。

未来一季度，本基金以追求绝对收益为目标，在控制严格投资组合下行风险的前提下，把握市场调整后带来的投资机会。我们珍惜基金份额持有人的每一分投资和每一份信任，我们将继续规范运作，审慎投资，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求长期、稳定的回报。

### § 5 投资组合报告

#### 5.1 报告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           | 5,481,238.10 | 8.53          |
|    | 其中：股票          | 5,481,238.10 | 8.53          |
| 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 | 58,708,655.76 | 91.41  |
| 8 | 其他资产         | 34,542.90     | 0.05   |
| 9 | 合计           | 64,224,436.76 | 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

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别             | 公允价值         | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|--------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | 145,345.00   | 0.23         |
| B  | 采矿业              | —            | —            |
| C  | 制造业              | 4,030,481.00 | 6.29         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | —            | —            |
| E  | 建筑业              | 95,294.10    | 0.15         |
| F  | 批发和零售业           | 70,860.00    | 0.11         |
| 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  | 910,848.00   | 1.42         |
| J  | 金融业              | 228,410.00   | 0.36         |
| 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 | 5,481,238.10 | 8.56 |
|--|----|--------------|------|

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

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       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|-------|------------|--------------|
| 1  | 300285 | 国瓷材料 | 4,500 | 179,505.00 | 0.28         |
| 2  | 002383 | 合众思壮 | 5,000 | 179,150.00 | 0.28         |
| 3  | 002657 | 中科金财 | 3,000 | 164,820.00 | 0.26         |
| 4  | 300037 | 新宙邦  | 2,200 | 143,418.00 | 0.22         |
| 5  | 300136 | 信维通信 | 6,200 | 129,952.00 | 0.20         |
| 6  | 002673 | 西部证券 | 5,000 | 129,300.00 | 0.20         |
| 7  | 002055 | 得润电子 | 4,200 | 128,604.00 | 0.20         |
| 8  | 002405 | 四维图新 | 5,000 | 123,000.00 | 0.19         |
| 9  | 002292 | 奥飞娱乐 | 4,000 | 119,800.00 | 0.19         |
| 10 | 002230 | 科大讯飞 | 3,400 | 111,690.00 | 0.17         |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|------|--------------|
| 1  | 国家债券      | —    | —            |
| 2  | 央行票据      | —    | —            |
| 3  | 金融债券      | —    | —            |
|    | 其中：政策性金融债 | —    | —            |
| 4  | 企业债券      | —    | —            |
| 5  | 企业短期融资券   | —    | —            |
| 6  | 中期票据      | —    | —            |
| 7  | 可转债       | —    | —            |
| 8  | 同业存单      | —    | —            |
| 9  | 其他        | —    | —            |

|    |    |   |   |
|----|----|---|---|
| 10 | 合计 | — | — |
|----|----|---|---|

注：本基金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**

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额       |
|----|---------|----------|
| 1  | 存出保证金   | 4,292.31 |
| 2  | 应收证券清算款 | —        |
| 3  | 应收股利    | —        |

|   |       |           |
|---|-------|-----------|
| 4 | 应收利息  | 30,250.59 |
| 5 | 应收申购款 | —         |
| 6 | 其他应收款 | —         |
| 7 | 待摊费用  | —         |
| 8 | 其他    | —         |
| 9 | 合计    | 34,542.90 |

**5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金报告期末未持有可转换债券。

**5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金报告期末未持有流通受限的股票。

**§ 6 开放式基金份额变动**

单位：份

|                               | 长安鑫利优选混合A     | 长安鑫利优选混合C     |
|-------------------------------|---------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额                   | 14,918,252.60 | 391,532.54    |
| 报告期期间基金总申购份额                  | 38,408,434.10 | 35,228,030.70 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额                | 2,504,512.51  | 27,207,867.16 |
| 报告期期间基金拆分变动份额<br>(份额减少以“-”填列) | —             | —             |
| 报告期期末基金份额总额                   | 50,822,174.19 | 8,411,696.08  |

**§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况**

**7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况**

本报告期内，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**

本报告期内，基金管理人根据《证券投资基金信息披露管理办法》的有关规定，在《证券时报》及管理人网站进行了如下信息披露：

1、2016年4月2日，长安基金管理有限公司关于由黄陈代为履行公司督察长职务的公告。

2、2016年4月6日，关于旗下基金在大泰金石投资管理有限公司开通申购和赎回业

务并参与费率优惠活动的公告以及关于旗下基金参加深圳市新兰德证券投资咨询有限公司费率优惠活动的公告。

3、2016年4月16日，长安宏观策略混合型证券投资基金招募说明书2016年第1次更新及摘要。

4、2016年4月22日，长安鑫利优选灵活配置混合型证券投资基金2016年第1季度报告。

5、2016年5月12日，关于增加杭州数米基金销售有限公司为长安产业精选混合C类、长安鑫利优选混合C类、长安鑫益增强混合A类和C类代销机构并开通申购、赎回和定期定额投资业务并参与费率优惠活动的公告以及关于增加珠海盈米财富管理有限公司为长安产业精选混合C类、长安鑫利优选混合C类、长安鑫益增强混合A类和C类代销机构并开通申购、赎回和定期定额投资业务并参与费率优惠活动的公告。

6、2016年5月18日，关于长安基金管理有限公司旗下基金在北京汇成基金销售有限公司开通申购、赎回和定投业务并参与费率优惠活动的公告。

7、2016年5月27日，关于旗下部分开放式基金参加盈米财富转换费率优惠活动的公告。

8、2016年5月31日，关于旗下基金在上海联泰资产管理有限公司开通申购、赎回、转换和定投业务并参与费率优惠活动的公告。

9、2016年6月1日，关于长安基金管理有限公司旗下基金在深圳富济财富管理有限公司开通申购、赎回和定投业务并参与费率优惠活动的公告。

10、2016年6月8日，长安基金管理有限公司督察长李永波任职公告。

11、2016年6月24日，关于旗下基金在上海凯石财富基金销售有限公司开通申购、赎回、基金转换和定投业务并参与费率优惠活动的公告。

12、2016年6月25日，长安鑫利优选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（2016年第1次更新）以及长安鑫利优选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书摘要（2016年第1次更新）。

13、2016年6月30日，长安基金管理有限公司关于旗下基金2016年6月30日基金资产净值、基金份额净值及基金份额累计净值的公告。

## §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、长安鑫利优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同；
- 3、长安鑫利优选灵活配置混合型证券投资基金托管协议；
- 4、长安鑫利优选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

上海市浦东新区芳甸路1088号紫竹国际大厦16层。

## 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  
二〇一六年七月二十日