

# 长安鑫恒回报混合型证券投资基金

## 2017 年第 3 季度报告

2017 年 09 月 30 日

基金管理人:长安基金管理有限公司

基金托管人:中国农业银行股份有限公司

报告送出日期:2017 年 10 月 27 日

## 目录

§1 重要提示.....	3
§2 基金产品概况.....	3
2.1 基金基本情况.....	3
§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遵规守信情况说明.....	9
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.....	10
4.5 报告期内基金的业绩表现.....	10
4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	10
§5 投资组合报告.....	10
5.1 报告期末基金资产组合情况.....	10
5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	11
5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细.....	12
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名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.....	13
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	13
5.11 投资组合报告附注.....	13
§6 开放式基金份额变动.....	14
§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 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.....	16
§9 备查文件目录.....	16
9.1 备查文件目录.....	16
9.2 存放地点.....	16
9.3 查阅方式.....	16

## § 1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年10月26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2017年7月27日起至9月30日止。

## § 2 基金产品概况

### 2.1 基金基本情况

基金简称	长安鑫恒回报混合
基金主代码	004897
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年07月27日
报告期末基金份额总额	193,162,892.91份
投资目标	在严格控制风险和保持流动性的前提下，通过主动的投资管理，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金投资策略包括三个大的方面，即大类资产配置策略、股票投资策略和债券投资策略。（一）大类资产配置策略 本基金将综合分析宏观经济、国家政策、资本市场等影响证券市场的重要因素，评估各类资产的收益和风险，从而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范围，并动态跟踪各类证券风险收益特征的相对变化动态，调整具体配置比例，平衡投资组合的风险和收益。（二）股票投资策略 本基金将结合定量和定性分析，筛选出具有行业领先地位、业绩优良、估值合理、表现稳健的公司，并重点选择所属行业符合经济发展趋势和方向、具有较大增长潜力或发展

空间的公司构建股票组合。

1、股票选择策略 本基金将结合定量和定性分析，从业务发展、治理结构以及公司规模、估值等方面进行综合评估，筛选出具有行业领先地位、业绩优良、估值合理、表现稳健的公司。本基金股票选择标准如下：（1）具有较高市场占有率，主营业务收入是公司收入的主要来源，主营业务收入位于所属行业前二分之一；（2）具有较强的核心竞争力，在商业模式、产品开发、服务体系、技术水平、营销网络、资源优势、品牌影响等方面培育了较强的核心竞争力；（3）具有较好的盈利能力，公司的销售毛利率、资产回报率（ROA）等处于所属行业前列，且盈利能力较为稳定，股息率相对较高；（4）具有良好的治理结构，管理规范，信息透明，管理层较为稳定；（5）具有较长时间的经营历史，能够较好适应不同的经济发展环境；（6）估值合理，公司的PE、PB或EV/EBIT等估值指标合理或低于市场平均水平。

2、组合构建策略 本基金将对筛选出的股票按照行业进行分类，重点选择所属行业符合经济发展趋势和方向、具有较大增长潜力或发展空间的公司构建股票组合，并适度追求行业的分散性，控制组合内同一行业公司的数量。本基金将根据股票筛选标准，定期更新入选股票池，并根据经济和社会发展趋势与方向、国家宏观经济政策、资本市场发展等情况，动态调整股票组合。

（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、

	<p>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。（四）资产支持证券投资策略 本基金将通过分析市场利率、发行条款、资产池结构及其资产池所处行业的景气变化、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。（五）衍生品投资策略 1、股指期货投资策略 本基金将在风险可控的前提下，本着谨慎原则，以套期保值为主要目的，适度参与股指期货投资。本基金管理人将根据持有的股票投资组合状况，通过对现货和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货定价模型对其估值水平合理性的评估，并通过与现货资产进行匹配，选择合适的投资时机。2、国债期货投资策略 本基金主要利用国债期货管理债券组合的久期、流动性和风险水平。基金管理人将根据法律法规的规定，以套期保值为主要目的，结合对宏观经济运行情况和政策趋势的分析，预测债券市场变动趋势。基金管理人通过对国债期货的流动性、波动水平、风险收益特征、国债期货和现货基差、套期保值的有效性等指标进行持续跟踪，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。3、权证投资策略 本基金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>	
业绩比较基准	沪深300指数收益率*60%+中债综合指数收益率*40%	
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。	
基金管理人	长安基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	长安鑫恒回报A类	长安鑫恒回报C类
下属分级基金的交易代码	004897	004898
报告期末下属分级基金的份额总额	12,633,323.49份	180,529,569.42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(2017年07月27日 - 2017年09月30日)	
	长安鑫恒回报A类	长安鑫恒回报C类
1. 本期已实现收益	250.01	-86,079.27
2. 本期利润	444,144.75	6,682,131.18
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0350	0.0355
4. 期末基金资产净值	13,076,145.99	186,800,920.42
5. 期末基金份额净值	1.0351	1.0347

- 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

## 长安鑫恒回报A类净值表现

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
自基金合同生效起至今	3.51%	0.58%	2.05%	0.33%	1.46%	0.25%

## 长安鑫恒回报C类净值表现

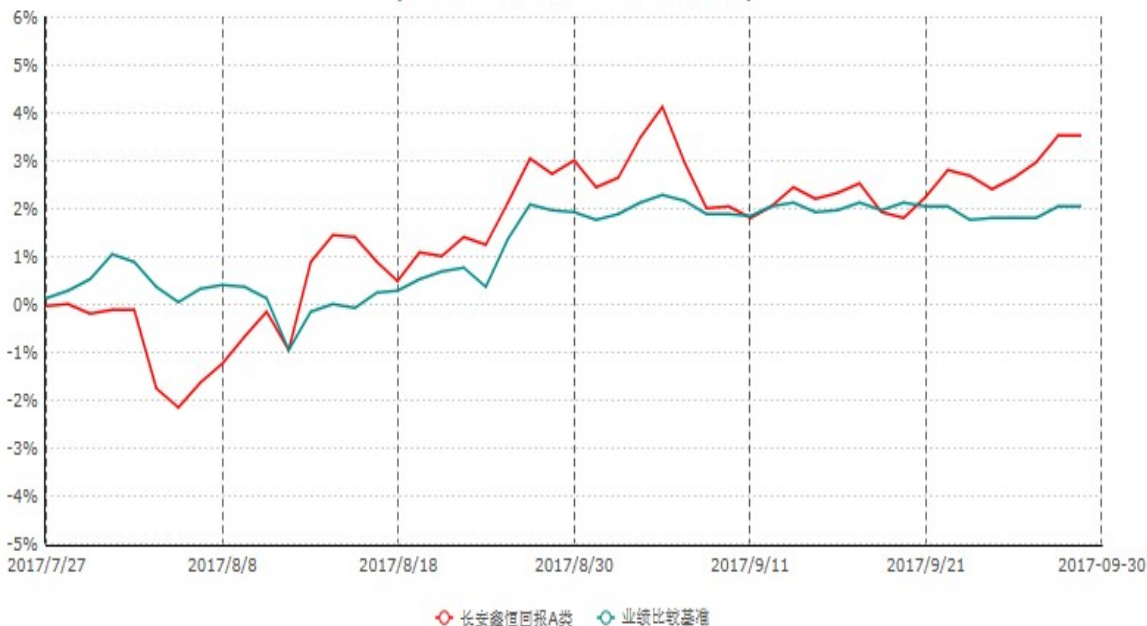
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自基金合同	3.47%	0.58%	2.05%	0.33%	1.42%	0.25%

生效起至今					
-------	--	--	--	--	--

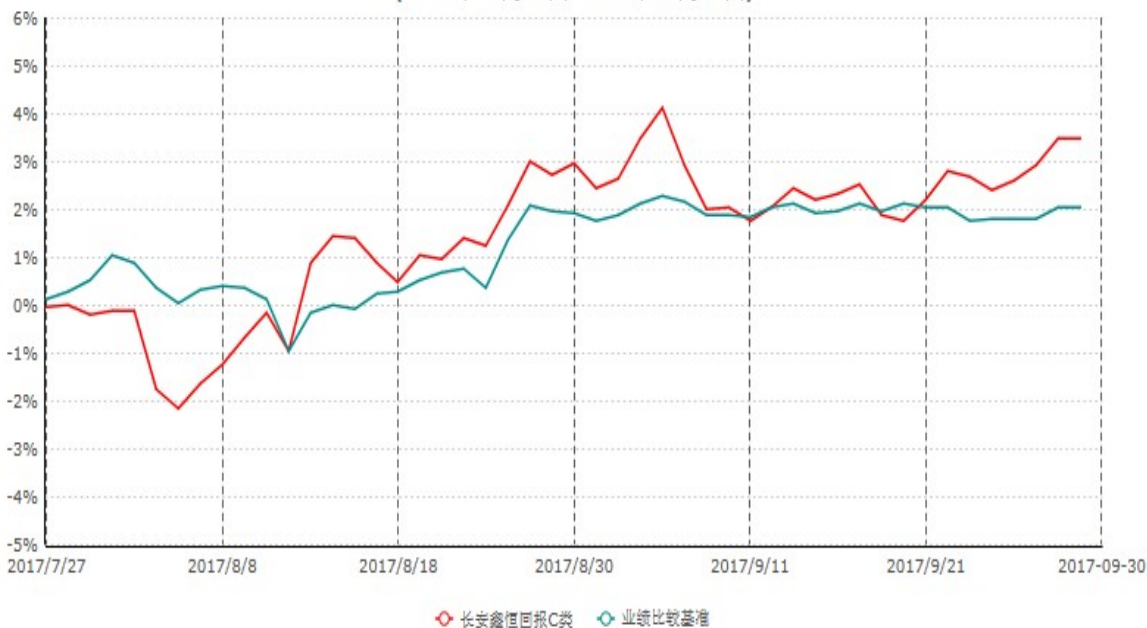
本基金整体业绩比较基准构成为：沪深300指数收益率\*60%+中债综合指数收益率\*40%

### 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

长安鑫恒回报A类份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2017年07月27日-2017年09月30日)



长安鑫恒回报C类份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2017年07月27日-2017年09月30日)



本基金基金合同生效日为2017年7月27日，基金合同生效日至报告期期末，本基金运作时间未满一年。图示日期为2017年7月27日至2017年9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		
陈立秋	本基金的基金经理	2017-07-27	-	11年	工商管理硕士及工学硕士学位，曾任Blue Pool Capital 投资经理，江海证券有限公司研究主管等，人保资产管理有限公司高级投资经理，上海知几资产管理有限公司投资总监，鸿商资本股权投资有限公司董事总经理（期间委派至旗下控股的中法人寿保险有限责任公司担任投资总监）等职。现任长安基金管理有限公司投资总监，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及长安鑫垚主题轮动混合型证券投资基金的基金经理。
林忠晶	本基金的基金经理	2017-08-30	-	7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、战略及产品部副经理



					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、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、长安鑫珪主题轮动混合型证券投资基金及长安鑫旺价值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合规守信情况说明

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

供给测改革实施以来，煤炭、有色和钢铁等行业的低效产能持续出清，供需结构发生改善，推动产能利用率提升、企业盈利能力出现趋势性改善。预计需求端将出现一定程度下行，周期品价格上行程度受到一定抑制，因此对于周期行业上市公司相对谨慎。随着经济企稳，企业财务状况逐渐改善，上市银行资产不良率上升趋势减缓，利润将保持增长，并且估值具有一定优势，本基金持续关注资产质量较好上市银行的投资机会。

另外，在消费升级的背景下，能够贴合消费者习惯，具有较强品牌优势、较好创新能力和产品优势的家电、食品饮料和电子等行业龙头公司具有长期投资价值，本基金重点关注龙头公司的所处行业竞争格局变化，并选择管理层优秀、产品议价能力强的标的进行投资。随着国内医改政策的逐步展开，医药行业竞争格局将出现明显变化，具有渠道优势、研发能力较为突出的公司将出现利润高速增长，本基金选择业绩增长稳定、具有独特竞争优势的公司进行投资。今年三季度，我国仍然处于金融去杠杆阶段，货币政策保持中性，固定收益市场难以出现趋势性机会。因此，对于债券投资较为谨慎。

#### 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3.51%和3.47%，同期本基金的业绩比较基准的增长率为2.05%。

#### 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	183,816,910.64	91.78
	其中：股票	183,816,910.64	91.78
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	16,204,943.84	8.09
8	其他资产	258,586.32	0.13
	合计	200,280,440.80	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

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值的比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	129,014,383.64	64.55
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	15,477,841.47	7.74
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	580,793.03	0.29
J	金融业	38,699,892.00	19.36
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	44,000.50	0.02
S	综合	-	-

	合计	183,816,910.64	91.96
--	----	----------------	-------

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金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	38,900	20,136,196.00	10.07
2	601939	建设银行	2,812,600	19,603,822.00	9.81
3	600566	济川药业	525,908	19,384,968.88	9.70
4	600036	招商银行	747,400	19,096,070.00	9.55
5	002241	歌尔股份	880,942	17,830,266.08	8.92
6	002415	海康威视	525,100	16,803,200.00	8.41
7	000963	华东医药	314,886	15,451,456.02	7.73
8	002508	老板电器	363,383	15,352,931.75	7.68
9	002372	伟星新材	850,171	14,707,958.30	7.36
10	600104	上汽集团	417,900	12,616,401.00	6.31

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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名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

本基金本报告期末进行股指期货交易。

### 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

本基金本报告期末进行国债期货交易。

## 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

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	50,828.77
2	应收证券清算款	198,377.47
3	应收股利	-
4	应收利息	3,184.27
5	应收申购款	6,195.81
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	258,586.32

### 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

	长安鑫恒回报A类	长安鑫恒回报C类
基金合同生效日的基金份额总额	12,684,842.02	194,520,366.41
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	78,296.97	75,656.60
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	129,815.50	14,066,453.59
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	0.00	0.00
报告期期末基金份额总额	12,633,323.49	180,529,569.42

**§ 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，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《中国证券报》及管理人网站进行了如下信息披露：

1、2017年7月8日，长安鑫恒回报混合型证券投资基金基金合同、长安鑫恒回报混合型证券投资基金基金合同摘要、长安鑫恒回报混合型证券投资基金招募说明书、长安鑫恒回报混合型证券投资基金托管协议、长安鑫恒回报混合型证券投资基金基金份额发售公告。

2、2017年7月11日，关于旗下长安鑫恒回报混合型证券投资基金A类在长安基金网上直销系统开展费率优惠活动的公告。

3、2017年7月22日，关于旗下长安鑫恒回报混合型证券投资基金在上海天天基金销售有限公司开通认购、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。

4、2017年7月25日，长安基金管理有限公司关于长安鑫恒回报混合型证券投资基金提前结束募集的公告。

5、2017年7月28日，长安鑫恒回报混合型证券投资基金基金合同生效公告、长安鑫恒回报混合型证券投资基金封闭期内每周净值公告(20170728)。

6、2017年7月31日，长安基金管理有限公司关于由王健代为履行公司总经理职务的公告。

7、2017年8月4日，长安鑫恒回报混合型证券投资基金封闭期内每周净值公告(20170804)。

8、2017年8月11日，长安鑫恒回报混合型证券投资基金封闭期内每周净值公告(20170811)。

9、2017年8月17日，关于旗下所有开放式证券投资基金参与一路财富（北京）信息科技股份有限公司费率优惠活动的公告。

10、2017年8月18日，长安鑫恒回报混合型证券投资基金封闭期内每周净值公告(20170818)。

11、2017年8月25日，长安鑫恒回报混合型证券投资基金封闭期内每周净值公告(20170825)。

12、2017年8月29日，长安鑫恒回报混合型证券投资基金封闭期内每周净值公告(20170829)。

13、2017年8月30日，关于长安鑫恒回报混合型证券投资基金暂停大额申购、定期定额投资以及转换转入业务的公告、长安鑫恒回报混合型证券投资基金开放日常申购、赎回（转换、定期定额投资）业务的公告、长安基金管理有限公司关于长安鑫恒回报混合型证券投资基金增聘基金经理的公告。

14、2017年9月1日，长安鑫恒回报混合型证券投资基金在上海天天基金销售有限公司等代销机构开通申购、赎回、基金转换业务以及定期定额投资业务并参与费率优惠活动的公告。

15、2017年9月2日，长安鑫恒回报混合型证券投资基金在蚂蚁（杭州）基金销售有限公司等代销机构开通申购、赎回、基金转换业务以及定期定额投资业务并参与费率优惠活动的公告。

16、2017年9月6日，长安鑫恒回报混合型证券投资基金在国金证券股份有限公司等代销机构开通申购、赎回、基金转换业务以及定期定额投资业务并参与费率优惠活动的公告。

17、2017年9月8日，长安鑫恒回报混合型证券投资基金在和讯信息科技有限公司开通申购、赎回、基金转换业务以及定期定额投资业务并参与费率优惠活动的公告。

18、2017年9月11日，长安鑫恒回报混合型证券投资基金在上海陆金所资产管理有限公司开通申购、赎回、基金转换业务以及定期定额投资业务并参与费率优惠活动的公告。

19、2017年9月13日，长安鑫恒回报混合型证券投资基金在申万宏源证券有限公司等代销机构开通申购、赎回、基金转换业务以及定期定额投资业务并参与费率优惠活动的公告、关于旗下基金在天津万家财富资产管理有限公司开通认购、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。

### 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。

## §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、长安鑫恒回报混合型证券投资基金基金合同；
- 3、长安鑫恒回报混合型证券投资基金托管协议；
- 4、长安鑫恒回报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  
二〇一七年十月二十七日