

长安鑫珏主题轮动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:上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期:2018 年 07 月 20 日

目录

§1 重要提示.....	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.....	7
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.....	7
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.....	10
4.3 公平交易专项说明.....	10
4.3.1 公平交易制度的执行情况.....	10
4.3.2 异常交易行为的专项说明.....	10
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.....	11
§5 投资组合报告.....	11
5.1 报告期末基金资产组合情况.....	11
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.....	13
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.....	13
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.....	13
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.....	13
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.....	13
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.....	15
§8 影响投资者决策的其他重要信息.....	15
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.....	15
8.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	16
§9 备查文件目录.....	17
9.1 备查文件目录.....	17
9.2 存放地点.....	17
9.3 查阅方式.....	17

§ 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股份有限公司根据本基金合同规定，于2018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	长安鑫珏主题混合
基金主代码	004907
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年08月09日
报告期末基金份额总额	31,213,698.33份
投资目标	在严格控制风险和保持流动性的前提下，把握中国经济和资本市场发展过程中各种投资主题的投资机会，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>本基金将采用“自上而下”的大类资产配置策略和“自下而上”选股策略相结合的方法进行资产配置和组合风险管理。</p> <p>（一）大类资产配置策略</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</p>

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，以评估未来经济发展所处阶段及宏观经济变化趋势； 2、政府政策：重点关注政府货币政策、财政政策和产业政策的变动趋势，评估其对经济发展和各行业及资本市场的影响； 3、资本市场因素：重点关注资金供求、市场情绪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

随着中国经济增长方式的转变和经济机构的调整持续推进，中国的产业结构升级和自主创新速度不断加快，以及互联网对经济和公司运营管理的影响日益广泛和深入的背景下，在某些方面具有领先优势的企业将充分发挥其优势，保持快速成长。本基金将充分发挥基金管理人在个股选择方面的优势，采取“自下而上”为主的投资策略，通过定性与定量分析的有机结合，精选具有持续领先优势和估值合理的上市公司股票进行投资。

1、定性分析 定性分析方面，本基金将通过实地调研和案头工作，精选在以下某方面或几方面具有领先优势的企业：

- （1）行业地位领先：细分行业中的龙头企业，市场占有率高，能够更好把握行业发展的机会；
- （2）资源禀赋领先：企业在自然资源等稀缺资源的开发和销售等方面具有垄断优势；
- （3）运营管理领先：具有运作良好的管理理念、经营机制、制度流程，人才激励有效；
- （4）团队领先：管理层稳定，具有前瞻眼光和进取精神，制定了明确可执行的企业发展战略，具备领先的团队组织建设能力，实现对企业的有效治理；
- （5）技术领先：在技术上具有独特的领先优势，掌握专门技术或专利；
- （6）市场领先：企业提供的产品及服务在市场上处于领先地位，企业形成较高的品牌知名度，客户忠诚度较高；
- （7）商业模式领先：企业在商业模式、流程管理、业务创新等方面保持领先，竞争者难以模仿。

2、定量分析 本基金将通过主营业务收入增长率、净利润增长率、营业利润增长率、EBIT增长率等指标评估公司成长性。同时，通过分析公司的市盈率、市净率、P

EG、EV/EBITDA以及行业或同行业同类公司的估值比较，判断公司的估值，选取具有良好成长性且估值合理的公司构建股票投资组合。

（三）债券投资策略

1、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。

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，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”特征的可转债品种，捕捉相关套利机会。

（四）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，适度参与股指期货投资。本基金管理人将根据持有的股票投资组合状况，通过对现货和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货定价模型对其估值水平合理性的评估，并通过与现货资产进行匹配，选择合适的投资时机，采用多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金还将利用股指期货作为组合流动性管理工具，降低现货市场流动性不足导致的冲击成本过高的风险，提高基金的建仓或变现效率。

2、权证投资策略 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。 (五) 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和提前偿还率等影响资产支持证券价值的相关要素,并综合运用久期管理、收益率曲线变动分析和收益。	
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%	
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	长安鑫珏主题混合A	长安鑫珏主题混合C
下属分级基金的交易代码	004907	004908
报告期末下属分级基金的份额总额	3,656,500.65份	27,557,197.68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)	
	长安鑫珏主题混合A	长安鑫珏主题混合C
1. 本期已实现收益	528,779.21	5,617,874.60
2. 本期利润	-69,282.09	1,030,344.89
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0190	0.0253
4. 期末基金资产净值	4,157,170.39	31,248,261.25
5. 期末基金份额净值	1.1369	1.1339

- 1、本期已实现收益是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

长安鑫珏主题混合A净值表现

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.52%	1.21%	-5.62%	0.68%	4.10%	0.53%

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%。

长安鑫珏主题混合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	-1.36%	1.21%	-5.62%	0.68%	4.26%	0.53%

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

长安鑫珏主题混合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期末，本基金运作时间未满一年。图示日期为 2017 年 8 月 9 日至 2018 年 6 月 30 日。

长安鑫鑫主题混合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期末,本基金运作时间未满一年。图示日期为 2017 年 8 月 9 日至 2018 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		
陈立秋	本基金的基金经理	2017-08-22	-	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、长安鑫垚主题轮动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、长安裕腾灵活配置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	2017-08-09	-	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

2018年二季度以来，权益市场受流动性和贸易争端影响波动持续加大。虽然上游企业盈利持续好转，但固定资产投资增速回落导致市场担忧行业盈利性的持续性，房地产相关产业链相关行业受影响较大。本报告期内，本基金立足于金融行业作为底仓的基础上，加大了食品饮料、医药等大消费行业配置力度，并且适当降低建筑建材、装饰和电子等周期性行业配置比例。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末长安鑫垚主题混合A基金份额净值为1.1369元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-1.52%，同期业绩比较基准收益率为-5.62%；截至报告期末长安鑫垚主题混合C基金份额净值为1.1339元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-1.36%，同期业绩比较基准收益率为-5.62%。

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2018年5月10日至2018年6月30日连续36个工作日出现基金资产净值低于五千万情形，未出现基金份额持有人数量不满二百人的情形。基金管理人已持续关注并拟采取适当的措施。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	25,047,136.98	59.07
	其中：股票	25,047,136.98	59.07
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	6,600,000.00	15.57
	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	10,670,111.05	25.16
8	其他资产	83,535.76	0.20
9	合计	42,400,783.79	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 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,778,400.00	5.02
B	采矿业	-	-
C	制造业	17,685,301.82	49.95
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-

E	建筑业	1,671,082.16	4.72
F	批发和零售业	376,350.00	1.06
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	3,536,003.00	9.99
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	25,047,136.98	70.74

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股。

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	600036	招商银行	113,200	2,993,008.00	8.45
2	603156	养元饮品	52,804	2,896,827.44	8.18
3	600519	贵州茅台	3,255	2,380,902.30	6.72
4	002372	伟星新材	134,420	2,377,889.80	6.72
5	600566	济川药业	48,700	2,346,853.00	6.63
6	002415	海康威视	58,100	2,157,253.00	6.09
7	002714	牧原股份	40,000	1,778,400.00	5.02

8	600970	中材国际	250,162	1,671,082.16	4.72
9	000661	长春高新	7,252	1,651,280.40	4.66
10	600104	上汽集团	44,600	1,560,554.00	4.41

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进行贵金属交易。

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。

5.10.3 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	62,185.45
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,388.16
5	应收申购款	17,962.15
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	83,535.76

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	603156	养元饮品	2,896,827.44	8.18	网下新股申购

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

	长安鑫垚主题混合A	长安鑫垚主题混合C
报告期期初基金份额总额	3,694,373.24	59,134,285.49
报告期期间基金总申购份额	797,829.06	37,301,483.82
减：报告期期间基金总赎回份额	835,701.65	68,878,571.63
报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	0.00	0.00
报告期期末基金份额总额	3,656,500.65	27,557,197.68

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

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	20180331-2018050	21,306,930.00	-	21,306,930.00	-	-

		7					
2	20180331 -20180507	24,489,270.00	-	19,670,000.00	4,819,270.00	15.44%	
3	20180427 -20180513	9,690,294.32	15,995,974.30	25,686,268.62	-	-	
4	20180510 -20180630	-	10,146,275.47	-	10,146,275.47	32.51%	
5	20180514 -20180630	-	7,482,878.16	-	7,482,878.16	23.97%	

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，基金份额持有人将可能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。

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、长安鑫垚主题轮动混合型证券投资基金基金合同；
- 3、长安鑫垚主题轮动混合型证券投资基金托管协议；
- 4、长安鑫垚主题轮动混合型证券投资基金招募说明书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内披露的各项公告。

9.2 存放地点

上海市浦东芳甸路1088号紫竹大厦16楼

9.3 查阅方式

投资者可到基金管理人、基金托管人的办公场所或基金管理人网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本管理人。

咨询电话：400-820-9688

公司网址：www.changanfunds.com。

长安基金管理有限公司

二〇一八年七月二十日