

长安鑫旺价值灵活配置混合型证券投资基金

2020 年中期报告

2020 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

送出日期:2020 年 08 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。

基金托管人广发银行股份有限公司（以下简称：广发银行）根据本基金合同规定，于2020年8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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2020年01月01日起至2020年06月30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 | 8 |
| 2.4 信息披露方式 | 8 |
| 2.5 其他相关资料 | 9 |
| §3 主要财务指标和基金净值表现 | 9 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 | 9 |
| 3.2 基金净值表现 | 10 |
| §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 | 13 |
| 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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 14 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 15 |
| 4.8 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 | 15 |
| §5 托管人报告 | 15 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 | 15 |
| 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 | 15 |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 | 15 |
| §6 中期财务会计报告(未经审计) | 15 |
| 6.1 资产负债表 | 15 |
| 6.2 利润表 | 17 |
| 6.3 所有者权益(基金净值)变动表 | 19 |
| 6.4 报表附注 | 20 |
| §7 投资组合报告 | 46 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 46 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 46 |
| 7.3 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 | 47 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 49 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 54 |
| 7.6 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 | 54 |
| 7.7 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 | 54 |
| 7.8 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 | 54 |
| 7.9 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 | 54 |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 | 54 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 54 |
| 7.12 投资组合报告附注 | 55 |
| §8 基金份额持有人信息 | 55 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 55 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 56 |

| | |
|---|----|
| 8.3 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..... | 56 |
| §9 开放式基金份额变动..... | 57 |
| §10 重大事件揭示..... | 57 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 57 |
| 10.2 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..... | 57 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 57 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 57 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 58 |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况..... | 58 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 58 |
| 10.8 其他重大事件..... | 60 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息..... | 61 |
| 11.1 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..... | 62 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息..... | 62 |
| §12 备查文件目录..... | 62 |
| 12.1 备查文件目录..... | 62 |
| 12.2 存放地点..... | 62 |
| 12.3 查阅方式..... | 62 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|---------------------|----------------|
| 基金名称 | 长安鑫旺价值灵活配置混合型证券投资基金 | |
| 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 | |
| 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 | |
| 报告期末基金份额总额 | 41,146,021.05份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 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 | 18,632,156.16份 | 22,513,864.89份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|------|--|
| 投资目标 | <p>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。</p> |
| 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：</p> <p>1、宏观经济状况：重点关注GDP、工业增加值、C</p> |

PI、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和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

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。 |
| 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。 |

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 | 广发银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 李永波 |
| | 联系电话 | 021-20329700 |
| | 电子邮箱 | service@changanfunds.com |
| 客户服务电话 | 400-820-9688 | 400-830-8003 |
| 传真 | 021-50598018 | 010-65169555 |
| 注册地址 | 上海市虹口区丰镇路806号3幢371室 | 广东省广州市越秀区东风东路713号 |
| 办公地址 | 上海市浦东芳甸路1088号紫竹大厦16楼 | 北京市西城区菜市口大街1号院2号楼信托大厦 |
| 邮政编码 | 201204 | 100053 |
| 法定代表人 | 万跃楠 | 尹兆君 |

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》 |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | http://www.changanfunds.com |
| 基金中期报告备置地 | 上海市浦东芳甸路1088号紫竹大厦16楼 |

| | |
|---|--|
| 点 | |
|---|--|

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|------------|--------------------------|
| 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 主要财务指标和基金净值表现

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 | 报告期(2020年01月01日-2020年06月30日) | |
|---------------|------------------------------|---------------|
| | 长安鑫旺价值混合A | 长安鑫旺价值混合C |
| 本期已实现收益 | 4,836,387.22 | 5,862,625.53 |
| 本期利润 | 8,309,782.73 | 9,170,878.83 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.4021 | 0.3666 |
| 本期加权平均净值利润率 | 23.17% | 21.00% |
| 本期基金份额净值增长率 | 25.15% | 25.06% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2020年06月30日) | |
| 期末可供分配利润 | 13,138,565.86 | 16,084,356.44 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.7052 | 0.7144 |
| 期末基金资产净值 | 37,281,493.35 | 45,263,948.22 |
| 期末基金份额净值 | 2.0009 | 2.0105 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2020年06月30日) | |
| 基金份额累计净值增长率 | 100.09% | 101.05% |

- 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 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

| 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 |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月 | 7.26% | 1.52% | 3.31% | 0.44% | 3.95% | 1.08% |
| 过去三个月 | 24.20% | 1.43% | 5.80% | 0.45% | 18.40% | 0.98% |
| 过去六个月 | 25.15% | 2.07% | 1.59% | 0.74% | 23.56% | 1.33% |
| 过去一年 | 62.61% | 1.75% | 5.81% | 0.60% | 56.80% | 1.15% |
| 自基金合同生效起至今 | 100.09% | 1.50% | 8.70% | 0.64% | 91.39% | 0.86% |

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

| 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 |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月 | 7.24% | 1.52% | 3.31% | 0.44% | 3.93% | 1.08% |
| 过去三个月 | 24.16% | 1.43% | 5.80% | 0.45% | 18.36% | 0.98% |
| 过去六个月 | 25.06% | 2.07% | 1.59% | 0.74% | 23.47% | 1.33% |
| 过去一年 | 63.39% | 1.75% | 5.81% | 0.60% | 57.58% | 1.15% |
| 自基金合同生效起至今 | 101.05% | 1.50% | 8.70% | 0.64% | 92.35% | 0.86% |

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,本基金运作时间已满一年。图示日期为2017年9月21日至2020年6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,本基金运作时间已满一年。图示日期为 2017 年 9 月 21 日至 2020 年 6 月 30 日。

§ 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、杭州景林投资管理合伙企业(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2020年6月30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、长安泓泽纯债债券型证券投资基金、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等19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 | | |
| 徐小勇 | 本基金的基金经理 | 2018-12-24 | - | 25年 | 中国人民大学工商管理硕士。曾就职于建设银行总行信托投资公司、中国信达信托投资公司、中国银河证券有限责任公司,曾 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|--|
| | | | | | 任银河基金管理有限公司研究员、基金经理，华泰证券（上海）资产管理有限公司权益部负责人、长安基金管理有限公司总经理助理等职，现任长安基金管理有限公司副总经理、投资总监、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 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 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

2020年上半年国内A股市场整体呈现宽幅振荡随后突破的态势，以创业板为代表的成长股表现强劲，在大幅振荡中持续上涨。我们长期围绕成长股展开研究和投资工作，但在各种风险因素冲击、市场的剧烈波动、以及股价与估值的大幅波动与上升中出现了相当大的犹豫与迟缓，没有充分把握科技股的投资机会，而是更多向消费转移。在年中基金形成以消费为主，各个科技方向适度均衡布局的组合结构。我们在选股中自上而下形成研究思路和定性分析，自下而上进行财务筛选，并通过基本面因素持续跟踪进行验证，希望能够在合适的风险暴露下获得长期投资收益。

我们在年初均衡布局在消费、科技、制造等各个方向的龙头股，2月集中于科技股，3月以后增加了基于业绩驱动的消费股；之后调整组合结构，优化组合中的消费股，增加了主要科技方向股票，形成适度均衡的消费科技为主体的成长组合。

4.4.2 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2.0009元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为25.15%，同期业绩比较基准收益率为1.59%；截至报告期末长安鑫旺价值混合C基金份额净值为2.0105元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为25.06%，同期业绩比较基准收益率为1.59%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

国内宏观经济经过了比较长时间的下行周期，在最近两年有多次企稳的迹象，但因外部因素或突发情况而中断，我们认为，经济企稳回升在时间上越来越接近了。在政策上，积极的财政政策和行业政策对经济转型升级的支持是有力的，并将逐步产生效果。内循环为主体，积极实现内外循环互动的发展思路是当前环境下的有效选择，随后的政策落地将继续推动以消费和科技创新为动力的新的增长方式的形成与发展。资本市场双向扩容，引进长线投资者和增量资金，扩大市场的有效供给，可能形成供需两旺的格局，会产生更多的投资机会，同时也增加了投资标的筛选的难度，容易产生过度情绪化的风险。

基于宏观经济的周期特征、资产配置的需求和政策的有力支持，中国市场相比全球其他市场更有吸引力，我们认为A股市场的中期趋势是良好的；叠加复杂的影响因素，市场继续保持振荡向上态势的可能性是非常大的。我们认为，国内A股市场在今年年中进入新阶段，增量资金流入，投资者情绪高涨，出现行业轮动，市场热点扩散，波动加大，增加投资难度。我们中长期看好消费和科技，认为其是成长股的重要来源。我们也将根据宏观、行业、公司基本面的变化，积极寻找各个领域成长股的投资机会，丰富投资组合，争取适度均衡。

4.6 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。

4.7 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。

4.8 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

本基金无连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情形。

§ 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，广发银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对长安鑫旺价值灵活配置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，不存在任何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方面进行了必要的监督，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。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、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 中期财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：长安鑫旺价值灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2020年06月30日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2020年06月30日 | 上年度末 2019年12月31日 |
|-----------------|------------|----------------------------|-----------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 8,005,556.52 | 9,195,442.13 |
| 结算备付金 | | 440,831.33 | 303,170.87 |
| 存出保证金 | | 129,574.05 | 97,711.69 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 76,541,670.52 | 74,755,597.80 |
| 其中：股票投资 | | 76,541,670.52 | 74,755,597.80 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | - | - |
| 应收证券清算款 | | 1,873,676.30 | 672,810.66 |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 7,458.90 | 7,720.57 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 392,700.29 | 222,461.66 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 87,391,467.91 | 85,254,915.38 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2020年06月30日 | 上年度末 2019年12月31日 |
| 负债： | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - | - |

| | | | |
|---------------|----------|---------------|---------------|
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付证券清算款 | | 3,061,517.01 | 174,606.69 |
| 应付赎回款 | | 783,123.32 | 1,181,489.67 |
| 应付管理人报酬 | | 65,910.44 | 67,167.12 |
| 应付托管费 | | 6,591.04 | 6,716.70 |
| 应付销售服务费 | | 5,465.48 | 5,644.27 |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 730,812.24 | 282,929.29 |
| 应交税费 | | 8.04 | - |
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 192,598.77 | 245,116.12 |
| 负债合计 | | 4,846,026.34 | 1,963,669.86 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 41,146,021.05 | 51,949,587.29 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 41,399,420.52 | 31,341,658.23 |
| 所有者权益合计 | | 82,545,441.57 | 83,291,245.52 |
| 负债和所有者权益总计 | | 87,391,467.91 | 85,254,915.38 |

1、报告截止日2020年6月30日，本基金A类份额和C类份额的单位净值分别为2.0009元和2.0105元，基金份额分别为18,632,156.16份和22,513,864.89份。

2、本基金基金合同生效日为2017年9月21日，本财务报表的实际编制期间为2020年1月1日至2020年6月30日。

6.2 利润表

会计主体：长安鑫旺价值灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2020年01月01日至2020年06月30日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期2020年01月01日至2020年06月30日 | 上年度可比期间2019年01月01日至2019年06月30日 |
|------|-----|---------------------------|--------------------------------|
| 一、收入 | | 18,781,812.30 | 20,192,764.57 |

| | | | |
|------------------------|------------|---------------|---------------|
| 1. 利息收入 | | 42,455.49 | 71,013.43 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 40,999.38 | 34,550.53 |
| 债券利息收入 | | 248.44 | 19.22 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 1,207.67 | 36,443.68 |
| 证券出借利息收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | 11,674,076.47 | 12,399,111.80 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | 11,078,382.77 | 12,045,018.75 |
| 基金投资收益 | 6.4.7.13 | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.14 | 176,376.13 | 18,354.26 |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.14.3 | - | - |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.15 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.16 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.17 | 419,317.57 | 335,738.79 |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.18 | 6,781,648.81 | 7,668,436.21 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.19 | 283,631.53 | 54,203.13 |
| 减：二、费用 | | 1,301,150.74 | 1,098,253.74 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 397,792.46 | 305,198.88 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 39,779.24 | 30,519.88 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | 32,666.55 | 20,853.23 |

| | | | |
|----------------------------|----------|---------------|---------------|
| 4. 交易费用 | 6.4.7.20 | 778,697.64 | 690,790.09 |
| 5. 利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6. 税金及附加 | | 0.87 | 0.07 |
| 7. 其他费用 | 6.4.7.21 | 52,213.98 | 50,891.59 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 17,480,661.56 | 19,094,510.83 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 17,480,661.56 | 19,094,510.83 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长安鑫旺价值灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2020年01月01日至2020年06月30日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020年01月01日至2020年06月30日 | | |
|-----------------------------------|-------------------------------|----------------|----------------|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 51,949,587.29 | 31,341,658.23 | 83,291,245.52 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 17,480,661.56 | 17,480,661.56 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列） | -10,803,566.24 | -7,422,899.27 | -18,226,465.51 |
| 其中：1. 基金申购款 | 34,701,110.71 | 26,029,885.82 | 60,730,996.53 |
| 2. 基金赎回款 | -45,504,676.95 | -33,452,785.09 | -78,957,462.04 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产 | - | - | - |

| | | | |
|--|------------------------------------|---------------|----------------|
| 生的基金净值变动 (净值减少以“-” 号填列) | | | |
| 五、期末所有者权益 (基金净值) | 41,146,021.05 | 41,399,420.52 | 82,545,441.57 |
| 项 目 | 上年度可比期间 2019年01月01日至2019年06月30日 | | |
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益 (基金净值) | 75,145,721.84 | -5,400,558.92 | 69,745,162.92 |
| 二、本期经营活动产 生的基金净值变动 数(本期利润) | - | 19,094,510.83 | 19,094,510.83 |
| 三、本期基金份额交 易产生的基金净值 变动数(净值减少以 “-”号填列) | -32,202,953.49 | -3,796,103.25 | -35,999,056.74 |
| 其中: 1. 基金申购款 | 15,049,159.97 | 2,216,001.77 | 17,265,161.74 |
| 2. 基金赎回款 | -47,252,113.46 | -6,012,105.02 | -53,264,218.48 |
| 四、本期向基金份额 持有人分配利润产 生的基金净值变动 (净值减少以“-” 号填列) | - | - | - |
| 五、期末所有者权益 (基金净值) | 42,942,768.35 | 9,897,848.66 | 52,840,617.01 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

袁丹旭

吴纓

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

长安鑫旺价值灵活配置混合型证券投资基金(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”)《关于准予长安鑫旺价值灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2017]1338号文)注册,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》及其配套规则和《长安鑫旺价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于2017年9月21日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定期,首次设立募集规模为260,779,632.78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,基金托管人为广发银行股份有限公司。

本基金于2017年8月17日至2017年9月15日募集,募集期间净认购资金260,723,045.20元,认购资金在募集期间产生利息56,587.58元,募集的有效认购份额及利息结转的基金份额合计260,779,632.78份。上述募集资金已由毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)验资,并出具了毕马威华振验字第1700321号验资报告。

根据2017年8月31日颁布的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》,相应修改基金合同中投资交易限制,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等。根据2019年7月26日颁布的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》,在基金合同中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内容。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《长安鑫旺价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《长安鑫旺价值灵活配置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(包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票)、衍生工具(包括权证、股指期货、国债期货等)、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换公司债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、中小企业私募债等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。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:股票投资占基金资产的比例0% - 95%;每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后,保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,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*50%+中债综合指数收益率*50%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注6.4.2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2020年6月30日的财务状况、2020年1月1日-2020年6月30日的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为自2020年1月1日至2020年6月30日止。

6.4.4.2 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。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的,把金融资产和金融负债分为不同类别:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。本基金现无金融资产分类为持有至到期投资和可供出售金融资产。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。

本基金目前持有的股票投资和债券投资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。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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。

初始确认后，金融资产和金融负债的后续计量如下：

-以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值计量，公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。

-应收款项以实际利率法按摊余成本计量。

-除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债采用实际利率法按摊余成本进行后续计量。

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

-收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

-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；

-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：

-所转移金融资产的账面价值

-因转移而收到的对价

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

6.4.4.5 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。

6.4.4.6 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：

- 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；
- 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。

6.4.4.7 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。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。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。

6.4.4.8 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和公允价值变动损益，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基金净值比例计算的金额。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基金净值比例计算的金额。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。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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成本的差额确认。

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。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税(如适用)后的净额确认,在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债,根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后,逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异,按实际利率计算利息收入。

利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额,在回购期内按实际利率法逐日确认,直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

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变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且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。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费、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。

本基金的交易费用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额,在资金实际占用期间内以实际利率法逐日确认,直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

本基金的其他费用如不影响估值日基金份额净值小数点后第四位,发生时直接计入基金损益;如果影响基金份额净值小数点后第四位的,应采用待摊或预提的方法,待摊或预提计入基金损益。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

根据《长安鑫旺价值灵活配置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,基金管理人可以根据实际情况进行收益分配,具体分配方案以公告为准,若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配;基金收益分配后基金份额净值不能低于面值,即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类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,基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资;若基金份额持有人不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红。

6.4.4.12 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。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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[2017]13号《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》，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，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据中基协发[2017]6号《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》，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《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》（以下简称“估值处理标准”），在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场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数据进行估值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本年度未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本会计年度未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本期间未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

(1) 主要税项说明

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]

85号文《财政部、国家税务总局、证监会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[2015] 101号《财政部、国家税务总局、证监会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[2005] 103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008] 16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于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》、财税[2008] 1号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016] 36号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46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]70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] 140号文《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[2017] 2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017] 56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》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：

(a) 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(b) 自2016年5月1日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

2018年1月1日（含）以后，资管产品管理人（以下称管理人）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。对资管产品在2018年1月1日以前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入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。

(c) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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%计入个人所得税应纳税所得额。

(e) 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。

(f) 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。

(g) 对基金在2018年1月1日（含）以后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费附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2020年06月30日 |
|--------------|--------------------|
| 活期存款 | 8,005,556.52 |
| 定期存款 | - |
| 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 | - |
| 合计 | 8,005,556.52 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末2020年06月30日 | | |
|---------------|----------------|---------------|---------------|
| | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 59,704,135.02 | 76,541,670.52 | 16,837,535.50 |
| 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 | 59,704,135.02 | 76,541,670.52 | 16,837,535.50 |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有任何衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 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。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有任何买断式逆回购交易取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2020年06月30日 |
|------------|--------------------|
| 应收活期存款利息 | 1,228.25 |
| 应收定期存款利息 | - |
| 应收其他存款利息 | 58.30 |
| 应收结算备付金利息 | 198.30 |
| 应收债券利息 | - |
| 应收资产支持证券利息 | - |
| 应收买入返售证券利息 | - |
| 应收申购款利息 | 5,974.05 |
| 应收黄金合约拆借孳息 | - |
| 应收出借证券利息 | - |
| 其他 | - |
| 合计 | 7,458.90 |

6.4.7.6 其他资产

本基金本年度及上年度均未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2020年06月30日 |
|-------------|--------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 730,812.24 |
| 银行间市场应付交易费用 | - |
| 合计 | 730,812.24 |

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2020年06月30日 |
|-------------|--------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | 384.79 |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 预提费用 | 192,213.98 |
| 合计 | 192,598.77 |

预提费用为：预提审计费用12,432.42元，预提信息披露费179,781.56元。

6.4.7.9 实收基金**6.4.7.9.1 长安鑫旺价值混合A**

金额单位：人民币元

| 项目 (长安鑫旺价值混合A) | 本期2020年01月01日至2020年06月30日 | |
|-------------------|---------------------------|----------------|
| | 基金份额(份) | 账面金额 |
| 上年度末 | 25,311,334.36 | 25,311,334.36 |
| 本期申购 | 8,649,704.51 | 8,649,704.51 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -15,328,882.71 | -15,328,882.71 |
| 本期末 | 18,632,156.16 | 18,632,156.16 |

6.4.7.9.2 长安鑫旺价值混合C

金额单位：人民币元

| 项目 (长安鑫旺价值混合C) | 本期2020年01月01日至2020年06月30日 | |
|-------------------|---------------------------|----------------|
| | 基金份额(份) | 账面金额 |
| 上年度末 | 26,638,252.93 | 26,638,252.93 |
| 本期申购 | 26,051,406.20 | 26,051,406.20 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -30,175,794.24 | -30,175,794.24 |
| 本期末 | 22,513,864.89 | 22,513,864.89 |

本基金于2017年8月17日至2017年9月15日募集，募集期间净认购资金人民币260,723,045.20元，认购资金在募集期间产生的利息人民币56,587.58元，募集的有效认购份额及利息结转的基金份额合计260,779,632.78份。上述募集资金已由毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)验资，并出具了毕马威华振验字第1700321号验资报告。此处申购含红利再投资、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

6.4.7.10.1 长安鑫旺价值混合A

单位：人民币元

| 项目 (长安鑫旺价值混合A) | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|-------------------|---------------|---------------|----------------|
| 上年度末 | 11,961,674.04 | 3,194,554.77 | 15,156,228.81 |
| 本期利润 | 4,836,387.22 | 3,473,395.51 | 8,309,782.73 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -3,659,495.40 | -1,157,178.95 | -4,816,674.35 |
| 其中：基金申购款 | 5,051,342.81 | 1,278,053.47 | 6,329,396.28 |
| 基金赎回款 | -8,710,838.21 | -2,435,232.42 | -11,146,070.63 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 13,138,565.86 | 5,510,771.33 | 18,649,337.19 |

6.4.7.10.2 长安鑫旺价值混合C

单位：人民币元

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----|-------|-------|---------|
|----|-------|-------|---------|

| | | | |
|----------------|----------------|---------------|----------------|
| (长安鑫旺价值混合C) | | | |
| 上年度末 | 12,836,967.36 | 3,348,462.06 | 16,185,429.42 |
| 本期利润 | 5,862,625.53 | 3,308,253.30 | 9,170,878.83 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -2,615,236.45 | 9,011.53 | -2,606,224.92 |
| 其中：基金申购款 | 15,454,058.15 | 4,246,431.39 | 19,700,489.54 |
| 基金赎回款 | -18,069,294.60 | -4,237,419.86 | -22,306,714.46 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 16,084,356.44 | 6,665,726.89 | 22,750,083.33 |

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期2020年01月01日至2020年06月30日 |
|-----------|---------------------------|
| 活期存款利息收入 | 36,108.34 |
| 定期存款利息收入 | - |
| 其他存款利息收入 | 962.40 |
| 结算备付金利息收入 | 3,775.24 |
| 其他 | 153.40 |
| 合计 | 40,999.38 |

其他为存出保证金利息收入和应收申购款利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020年01月01日至2020年06月30日 |
|------------|-------------------------------|
| 卖出股票成交总额 | 282,241,872.36 |
| 减：卖出股票成本总额 | 271,163,489.59 |
| 买卖股票差价收入 | 11,078,382.77 |

6.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期末进行基金投资交易。

6.4.7.14 债券投资收益**6.4.7.14.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020年01月01日至2020年06月30日 |
|-------------------------------|-------------------------------|
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入 | 176,376.13 |
| 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 | 176,376.13 |

6.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020年01月01日至2020年06月30日 |
|-------------------------|-------------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额 | 671,231.74 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 494,600.00 |
| 减：应收利息总额 | 255.61 |
| 买卖债券差价收入 | 176,376.13 |

6.4.7.14.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内未持有资产支持证券。

6.4.7.15 贵金属投资收益**6.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成**

本基金本报告期未进行贵金属投资交易。

6.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期内未持有衍生工具。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020年01月01日至2020年06月30日 |
|---------------|-------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 419,317.57 |
| 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 | 419,317.57 |

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2020年01月01日至2020年06月30日 |
|------------------------|-------------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | 6,781,648.81 |
| ——股票投资 | 6,781,648.81 |
| ——债券投资 | - |
| ——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 | 6,781,648.81 |

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----|----|
|----|----|

| | 2020年01月01日至2020年06月30日 |
|---------|-------------------------|
| 基金赎回费收入 | 263,663.45 |
| 转换费收入 | 19,968.08 |
| 合计 | 283,631.53 |

本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额最少25%归入基金资产。

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-----------|-------------------------|
| | 2020年01月01日至2020年06月30日 |
| 交易所市场交易费用 | 778,697.64 |
| 银行间市场交易费用 | - |
| 合计 | 778,697.64 |

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|---------|-------------------------|
| | 2020年01月01日至2020年06月30日 |
| 审计费用 | 12,432.42 |
| 信息披露费 | 39,781.56 |
| 证券出借违约金 | - |
| 合计 | 52,213.98 |

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要在财务报表附注中说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

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。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 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 |
| 广发银行股份有限公司 | 基金托管人、基金销售机构 |
| 长安国际信托股份有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 杭州景林投资管理合伙企业（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 |
| 五星控股集团有限公司 | 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 |
| 长安财富资产管理有限公司 | 基金管理人的子公司 |

上述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。并以一般交易价格为定价基础。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间内均无应支付给关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020年01月01日至2020年06月30日 | 上年度可比期间 2019年01月01日至2019年06月30日 |
|-----------------|-------------------------------|------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 397,792.46 | 305,198.88 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 136,506.46 | 106,111.39 |

1、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1.00%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为： $\text{日基金管理费} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.00\% / \text{当年天数}$ ；

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020年01月01日至2020年06月30日 | 上年度可比期间 2019年01月01日至2019年06月30日 |
|----------------|-------------------------------|------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 39,779.24 | 30,519.88 |

支付基金托管人广发银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为： $\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}$

6.4.10.2.3 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 2020年01月01日至2020年06月30日 | | |
|----------------|-------------------------------|-----------|----------|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 长安鑫旺价值混合A | 长安鑫旺价值混合C | 合计 |
| 长安基金管理有限公司 | 0.00 | 2,535.04 | 2,535.04 |

| | | | |
|----------------------------|------------------------------------|-----------|----------|
| 合计 | 0.00 | 2,535.04 | 2,535.04 |
| 获得销售 服务费的 各关联方 名称 | 上年度可比期间 2019年01月01日至2019年06月30日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 长安鑫旺价值混合A | 长安鑫旺价值混合C | 合计 |
| 长安基金 管理有限 公司 | 0.00 | 266.90 | 266.90 |
| 合计 | 0.00 | 266.90 | 266.90 |

长安鑫旺价值A类不计算基金销售服务费。长安鑫旺价值C类支付销售机构的基金销售服务费按前一日基金资产净值0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金销售服务费=前一日基金资产净值×0.15%/当年天数；

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内没有与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的管理人在本报告期内未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 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

本基金本报告期末没有除基金管理人之外的其他关联方投资本基金。

6.4.10.5 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 2020年01月01日至2020年06月30日 | | 上年度可比期间 2019年01月01日至2019年06月30日 | |
|--------------------|-------------------------------|-----------|------------------------------------|-----------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 广发银行 股份有限 公司 | 8,005,556.52 | 36,108.34 | 4,725,387.21 | 28,831.40 |

本基金通过“广发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2020年6月30日的相关余额为人民币440,831.33元。（2019年6月30日：人民币425,312.15元）

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内均未参与关联方承销证券的买卖。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间内均无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况——按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

本基金在本报告期末未进行过利润分配。

6.4.12 期末（2020年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票 | | | | | | | | | | |
|----------------------|------|------------|------------|--------|-------|--------|----------|----------|----------|----|
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 可流通日 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量（单位：股） | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| 300845 | 捷安高科 | 2020-06-24 | 2020-07-03 | 新股未上市 | 17.63 | 17.63 | 470 | 8,286.10 | 8,286.10 | - |
| 300843 | 胜蓝股份 | 2020-06-23 | 2020-07-02 | 新股未上市 | 10.01 | 10.01 | 751 | 7,517.51 | 7,517.51 | - |
| 300840 | 酷特智能 | 2020-06-30 | 2020-07-08 | 新股未上市 | 5.94 | 5.94 | 1,185 | 7,038.90 | 7,038.90 | - |
| 300846 | 首都在线 | 2020-06-22 | 2020-07-01 | 新股未上市 | 3.37 | 3.37 | 1,131 | 3,811.47 | 3,811.47 | - |

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如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期根据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。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有银行间债券正回购。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所债券正回购。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 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、监察稽核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。

6.4.13.2 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同责任，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本基金的广发银行，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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

未评级债券为国债、央行票据及政策性金融债等免评级债券。根据中国人民银行2006年3月29日发布的“银发[2006]95号”文《中国人民银行信用评级管理指导意见》，以及2006年11月21日发布的《信贷市场和银行间债券市场信用评级规范》等文件的有关规定，短期债券信用评级等级划分为四等六级，符号表示为：A-1、A-2、A-3、B、C、D。每一个信用等级均不进行微调。本基金于本报告期末未持有短期信用评级的债券。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

未评级债券为国债、央行票据及政策性金融债等免评级债券。根据中国人民银行2006年3月29日发布的“银发[2006]95号”文《中国人民银行信用评级管理指导意见》，以及2006年11月21日发布的《信贷市场和银行间债券市场信用评级规范》等文件的有关规定，中长期债券信用等级划分成三等九级，分别用AAA、AA、A、BBB、BB、B、CCC、CC和C表示，其中，除AAA级、CCC级（含）以下等级外，每一个信用等级可用“+”、“-”符号进行微调，表示略高或略低于本等级。本基金于本报告期末未持有长期信用评级的债券。

6.4.13.3 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，除附注6.4.12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；按照有关法律法规规定应对固定赎回，并进行适当报告和披露；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。

本基金所持有的全部金融负债无固定到期日或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（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 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，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，保证该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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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、存出保证金及债券投资等。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：

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

长安鑫旺价值灵活配置混合型证券投资基金 2020 年中期报告

| 本期末2020年06月30日 | 1年以内 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
|-----------------|--------------|------|------|---------------|---------------|
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 8,005,556.52 | - | - | - | 8,005,556.52 |
| 结算备付金 | 440,831.33 | - | - | - | 440,831.33 |
| 存出保证金 | 129,574.05 | - | - | - | 129,574.05 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 76,541,670.52 | 76,541,670.52 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 1,873,676.30 | 1,873,676.30 |
| 应收利息 | - | - | - | 7,458.90 | 7,458.90 |
| 应收申购款 | - | - | - | 392,700.29 | 392,700.29 |
| 资产总计 | 8,575,961.90 | - | - | 78,815,506.01 | 87,391,467.91 |
| 负债 | | | | | |
| 应付证券清算款 | - | - | - | 3,061,517.01 | 3,061,517.01 |
| 应付赎回款 | - | - | - | 783,123.32 | 783,123.32 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 65,910.44 | 65,910.44 |
| 应付托管费 | - | - | - | 6,591.04 | 6,591.04 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 5,465.48 | 5,465.48 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 730,812.24 | 730,812.24 |
| 应交税费 | - | - | - | 8.04 | 8.04 |
| 其他负债 | - | - | - | 192,598.77 | 192,598.77 |
| 负债总计 | - | - | - | 4,846,026.34 | 4,846,026.34 |
| 利率敏感度缺口 | 8,575,961.90 | - | - | 73,969,479.67 | 82,545,441.57 |
| 上年度末2019年12月31日 | 1年以内 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 9,195,442.13 | - | - | - | 9,195,442.13 |
| 结算备付金 | 303,170.87 | - | - | - | 303,170.87 |
| 存出保证金 | 97,711.69 | - | - | - | 97,711.69 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 74,755,597.80 | 74,755,597.80 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 672,810.66 | 672,810.66 |
| 应收利息 | - | - | - | 7,720.57 | 7,720.57 |
| 应收申购款 | - | - | - | 222,461.66 | 222,461.66 |
| 资产总计 | 9,596,324.69 | - | - | 75,658,590.69 | 85,254,915.38 |
| 负债 | | | | | |
| 应付证券清算款 | - | - | - | 174,606.69 | 174,606.69 |
| 应付赎回款 | - | - | - | 1,181,489.67 | 1,181,489.67 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 67,167.12 | 67,167.12 |
| 应付托管费 | - | - | - | 6,716.70 | 6,716.70 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 5,644.27 | 5,644.27 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 282,929.29 | 282,929.29 |
| 其他负债 | - | - | - | 245,116.12 | 245,116.12 |
| 负债总计 | - | - | - | 1,963,669.86 | 1,963,669.86 |
| 利率敏感度缺口 | 9,596,324.69 | - | - | 73,694,920.83 | 83,291,245.52 |

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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

截止本报告期末，本基金未持有受重大利率风险影响的投资品种。

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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2020年6月30日，本基金投资组合中股票投资比例为基金资产净值的92.73%，无债券投资和衍生金融资产。于2020年6月30日，本基金面临的其他价格风险列示如下：

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2020年06月30日 | | 上年度末 2019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 | 76,541,670.52 | 92.73 | 74,755,597.80 | 89.75 |
| 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 | 76,541,670.52 | 92.73 | 74,755,597.80 | 89.75 |

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 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 2020年06月30日 | 上年度末 2019年12月31日 |
| | 沪深300指数上升5% | 3,751,540.26 | 3,988,861.84 |
| | 沪深300指数下降5% | -3,751,540.26 | -3,988,861.84 |

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。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。对于本基金投资的证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况时，本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值的层次。第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

(ii) 各层次金融工具公允价值

于2020年6月30日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为76,515,016.54元，属于第二层级的余额为26,653.98元，无属于第三层级的余额。

(iii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层级未发生重大变动。

(iv) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 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 | 76,541,670.52 | 87.58 |
| | 其中：股票 | 76,541,670.52 | 87.58 |
| 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 | 8,446,387.85 | 9.67 |
| 8 | 其他各项资产 | 2,403,409.54 | 2.75 |
| 9 | 合计 | 87,391,467.91 | 100.00 |

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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 | 65,421,827.03 | 79.26 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 12,715.92 | 0.02 |
| 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 | 6,151,927.57 | 7.45 |
| J | 金融业 | - | - |
| 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 | 4,955,200.00 | 6.00 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 76,541,670.52 | 92.73 |

7.2.2 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。

7.3 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 | 600519 | 贵州茅台 | 3,900 | 5,705,232.00 | 6.91 |
| 2 | 603027 | 千禾味业 | 168,000 | 5,305,440.00 | 6.43 |
| 3 | 300750 | 宁德时代 | 30,000 | 5,230,800.00 | 6.34 |
| 4 | 002475 | 立讯精密 | 100,998 | 5,186,247.30 | 6.28 |
| 5 | 300413 | 芒果超媒 | 76,000 | 4,955,200.00 | 6.00 |
| 6 | 600809 | 山西汾酒 | 33,000 | 4,785,000.00 | 5.80 |
| 7 | 002007 | 华兰生物 | 89,950 | 4,507,394.50 | 5.46 |
| 8 | 002555 | 三七互娱 | 96,000 | 4,492,800.00 | 5.44 |
| 9 | 002705 | 新宝股份 | 100,000 | 3,648,000.00 | 4.42 |
| 10 | 300122 | 智飞生物 | 36,000 | 3,605,400.00 | 4.37 |
| 11 | 002511 | 中顺洁柔 | 150,000 | 3,345,000.00 | 4.05 |
| 12 | 600882 | 广泽股份 | 90,000 | 3,266,100.00 | 3.96 |
| 13 | 002557 | 洽洽食品 | 60,000 | 3,251,400.00 | 3.94 |
| 14 | 300529 | 健帆生物 | 45,000 | 3,127,500.00 | 3.79 |
| 15 | 002216 | 三全食品 | 120,000 | 2,868,000.00 | 3.47 |
| 16 | 002847 | 盐津铺子 | 30,000 | 2,856,600.00 | 3.46 |
| 17 | 002661 | 克明面业 | 120,000 | 2,781,600.00 | 3.37 |
| 18 | 688399 | 硕世生物 | 7,000 | 1,946,000.00 | 2.36 |
| 19 | 002698 | 博实股份 | 150,000 | 1,912,500.00 | 2.32 |
| 20 | 603444 | 吉比特 | 3,000 | 1,647,030.00 | 2.00 |
| 21 | 002734 | 利民股份 | 60,000 | 898,200.00 | 1.09 |
| 22 | 600966 | 博汇纸业 | 80,000 | 812,000.00 | 0.98 |
| 23 | 600584 | 长电科技 | 10,000 | 312,700.00 | 0.38 |
| 24 | 603087 | 甘李药业 | 258 | 25,877.40 | 0.03 |
| 25 | 300842 | 帝科股份 | 455 | 18,527.60 | 0.02 |
| 26 | 600956 | 新天绿能 | 2,523 | 12,715.92 | 0.02 |
| 27 | 300839 | N博汇 | 502 | 11,751.82 | 0.01 |
| 28 | 300845 | 捷安高科 | 470 | 8,286.10 | 0.01 |
| 29 | 300843 | 胜蓝股份 | 751 | 7,517.51 | 0.01 |
| 30 | 300840 | 酷特智能 | 1,185 | 7,038.90 | 0.01 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-------|----------|------|
| 31 | 300846 | 首都在线 | 1,131 | 3,811.47 | 0.00 |
|----|--------|------|-------|----------|------|

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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 | 300253 | 卫宁健康 | 8,788,256.00 | 10.55 |
| 2 | 603019 | 中科曙光 | 8,429,843.47 | 10.12 |
| 3 | 300750 | 宁德时代 | 8,232,769.00 | 9.88 |
| 4 | 300413 | 芒果超媒 | 6,832,945.04 | 8.20 |
| 5 | 002475 | 立讯精密 | 5,832,573.60 | 7.00 |
| 6 | 600585 | 海螺水泥 | 5,690,686.00 | 6.83 |
| 7 | 300737 | 科顺股份 | 5,224,616.32 | 6.27 |
| 8 | 002028 | 思源电气 | 5,148,996.43 | 6.18 |
| 9 | 002705 | 新宝股份 | 4,948,297.00 | 5.94 |
| 10 | 300010 | 立思辰 | 4,552,013.64 | 5.47 |
| 11 | 600519 | 贵州茅台 | 4,521,651.00 | 5.43 |
| 12 | 600809 | 山西汾酒 | 4,332,041.10 | 5.20 |
| 13 | 300497 | 富祥药业 | 4,269,703.44 | 5.13 |
| 14 | 002812 | 恩捷股份 | 3,858,066.80 | 4.63 |
| 15 | 300122 | 智飞生物 | 3,813,612.00 | 4.58 |
| 16 | 002734 | 利民股份 | 3,764,564.20 | 4.52 |
| 17 | 002007 | 华兰生物 | 3,748,728.00 | 4.50 |
| 18 | 002555 | 三七互娱 | 3,718,033.00 | 4.46 |
| 19 | 002216 | 三全食品 | 3,694,036.00 | 4.44 |
| 20 | 601689 | 拓普集团 | 3,639,331.12 | 4.37 |
| 21 | 600597 | 光明乳业 | 3,618,158.00 | 4.34 |
| 22 | 002371 | 北方华创 | 3,474,624.00 | 4.17 |
| 23 | 002241 | 歌尔股份 | 3,353,649.00 | 4.03 |
| 24 | 600183 | 生益科技 | 3,347,858.08 | 4.02 |

| | | | | |
|----|--------|-------|--------------|------|
| 25 | 002050 | 三花智控 | 3,270,344.00 | 3.93 |
| 26 | 603916 | 苏博特 | 3,267,601.24 | 3.92 |
| 27 | 300677 | 英科医疗 | 3,235,993.00 | 3.89 |
| 28 | 603659 | 璞泰来 | 3,157,961.00 | 3.79 |
| 29 | 300451 | 创业慧康 | 3,156,034.06 | 3.79 |
| 30 | 002661 | 克明面业 | 3,115,529.00 | 3.74 |
| 31 | 000858 | 五 粮 液 | 3,068,632.00 | 3.68 |
| 32 | 603697 | 有友食品 | 3,050,916.00 | 3.66 |
| 33 | 603027 | 千禾味业 | 3,040,254.12 | 3.65 |
| 34 | 002156 | 通富微电 | 3,004,282.58 | 3.61 |
| 35 | 002557 | 洽洽食品 | 2,973,406.00 | 3.57 |
| 36 | 300782 | 卓胜微 | 2,966,157.00 | 3.56 |
| 37 | 002912 | 中新赛克 | 2,944,222.20 | 3.53 |
| 38 | 002223 | 鱼跃医疗 | 2,929,963.00 | 3.52 |
| 39 | 600745 | 闻泰科技 | 2,870,466.16 | 3.45 |
| 40 | 600498 | 烽火通信 | 2,835,852.00 | 3.40 |
| 41 | 002916 | 深南电路 | 2,830,763.00 | 3.40 |
| 42 | 002456 | 欧菲光 | 2,792,967.00 | 3.35 |
| 43 | 300036 | 超图软件 | 2,786,832.04 | 3.35 |
| 44 | 600298 | 安琪酵母 | 2,761,388.00 | 3.32 |
| 45 | 300529 | 健帆生物 | 2,713,259.00 | 3.26 |
| 46 | 603606 | 东方电缆 | 2,647,999.44 | 3.18 |
| 47 | 603313 | 梦百合 | 2,632,774.00 | 3.16 |
| 48 | 000739 | 普洛药业 | 2,620,750.62 | 3.15 |
| 49 | 600216 | 浙江医药 | 2,575,747.00 | 3.09 |
| 50 | 002332 | 仙琚制药 | 2,564,550.00 | 3.08 |
| 51 | 002626 | 金达威 | 2,528,074.00 | 3.04 |
| 52 | 002398 | 垒知集团 | 2,516,969.00 | 3.02 |
| 53 | 002511 | 中顺洁柔 | 2,399,285.00 | 2.88 |
| 54 | 300308 | 中际旭创 | 2,325,261.99 | 2.79 |
| 55 | 002230 | 科大讯飞 | 2,316,227.00 | 2.78 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 56 | 300271 | 华宇软件 | 2,293,771.00 | 2.75 |
| 57 | 600380 | 健康元 | 2,219,836.76 | 2.67 |
| 58 | 601872 | 招商轮船 | 2,167,323.00 | 2.60 |
| 59 | 002946 | 新乳业 | 2,083,511.00 | 2.50 |
| 60 | 600882 | 广泽股份 | 2,038,380.00 | 2.45 |
| 61 | 000513 | 丽珠集团 | 1,975,365.53 | 2.37 |
| 62 | 002465 | 海格通信 | 1,953,444.00 | 2.35 |
| 63 | 300715 | 凯伦股份 | 1,923,869.60 | 2.31 |
| 64 | 300661 | 圣邦股份 | 1,896,493.00 | 2.28 |
| 65 | 688399 | 硕世生物 | 1,847,581.40 | 2.22 |
| 66 | 002847 | 盐津铺子 | 1,823,945.00 | 2.19 |
| 67 | 002698 | 博实股份 | 1,812,011.00 | 2.18 |
| 68 | 002174 | 游族网络 | 1,725,080.00 | 2.07 |
| 69 | 002562 | 兄弟科技 | 1,668,966.80 | 2.00 |

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。

7.4.2 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 | 002812 | 恩捷股份 | 9,556,517.56 | 11.47 |
| 2 | 300750 | 宁德时代 | 9,548,244.06 | 11.46 |
| 3 | 300253 | 卫宁健康 | 8,041,302.04 | 9.65 |
| 4 | 603019 | 中科曙光 | 8,003,295.80 | 9.61 |
| 5 | 000858 | 五粮液 | 7,117,359.00 | 8.55 |
| 6 | 600585 | 海螺水泥 | 6,721,722.20 | 8.07 |
| 7 | 603659 | 璞泰来 | 6,171,605.94 | 7.41 |
| 8 | 603916 | 苏博特 | 6,163,970.34 | 7.40 |
| 9 | 300413 | 芒果超媒 | 5,789,837.80 | 6.95 |
| 10 | 300308 | 中际旭创 | 5,063,825.09 | 6.08 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 11 | 002028 | 思源电气 | 4,922,079.31 | 5.91 |
| 12 | 300737 | 科顺股份 | 4,908,874.65 | 5.89 |
| 13 | 002241 | 歌尔股份 | 4,794,513.51 | 5.76 |
| 14 | 300010 | 立思辰 | 4,715,037.00 | 5.66 |
| 15 | 002156 | 通富微电 | 4,639,062.00 | 5.57 |
| 16 | 002174 | 游族网络 | 4,512,708.64 | 5.42 |
| 17 | 600519 | 贵州茅台 | 4,362,199.00 | 5.24 |
| 18 | 002475 | 立讯精密 | 4,271,504.00 | 5.13 |
| 19 | 300497 | 富祥药业 | 4,165,400.12 | 5.00 |
| 20 | 600580 | 卧龙电驱 | 4,063,973.43 | 4.88 |
| 21 | 300496 | 中科创达 | 3,896,997.00 | 4.68 |
| 22 | 600745 | 闻泰科技 | 3,662,045.00 | 4.40 |
| 23 | 600597 | 光明乳业 | 3,557,592.00 | 4.27 |
| 24 | 601689 | 拓普集团 | 3,460,362.80 | 4.15 |
| 25 | 002465 | 海格通信 | 3,456,453.02 | 4.15 |
| 26 | 002624 | 完美世界 | 3,436,232.00 | 4.13 |
| 27 | 300271 | 华宇软件 | 3,190,605.15 | 3.83 |
| 28 | 300677 | 英科医疗 | 3,159,423.00 | 3.79 |
| 29 | 002371 | 北方华创 | 3,103,480.85 | 3.73 |
| 30 | 002734 | 利民股份 | 3,078,673.60 | 3.70 |
| 31 | 002050 | 三花智控 | 3,010,724.00 | 3.61 |
| 32 | 600298 | 安琪酵母 | 2,973,928.00 | 3.57 |
| 33 | 600801 | 华新水泥 | 2,912,669.15 | 3.50 |
| 34 | 600183 | 生益科技 | 2,887,160.00 | 3.47 |
| 35 | 600498 | 烽火通信 | 2,885,277.64 | 3.46 |
| 36 | 002916 | 深南电路 | 2,882,952.00 | 3.46 |
| 37 | 002912 | 中新赛克 | 2,799,803.00 | 3.36 |
| 38 | 002223 | 鱼跃医疗 | 2,766,420.64 | 3.32 |
| 39 | 000425 | 徐工机械 | 2,756,836.00 | 3.31 |
| 40 | 603697 | 有友食品 | 2,738,600.00 | 3.29 |
| 41 | 300782 | 卓胜微 | 2,722,451.00 | 3.27 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 42 | 300451 | 创业慧康 | 2,704,558.00 | 3.25 |
| 43 | 000739 | 普洛药业 | 2,652,005.00 | 3.18 |
| 44 | 002456 | 欧菲光 | 2,651,088.00 | 3.18 |
| 45 | 002332 | 仙琚制药 | 2,647,630.00 | 3.18 |
| 46 | 002946 | 新乳业 | 2,644,259.00 | 3.17 |
| 47 | 600216 | 浙江医药 | 2,538,875.68 | 3.05 |
| 48 | 688111 | 金山办公 | 2,450,317.10 | 2.94 |
| 49 | 300036 | 超图软件 | 2,446,985.00 | 2.94 |
| 50 | 002626 | 金达威 | 2,440,356.00 | 2.93 |
| 51 | 603606 | 东方电缆 | 2,408,466.00 | 2.89 |
| 52 | 603313 | 梦百合 | 2,392,428.00 | 2.87 |
| 53 | 002398 | 垒知集团 | 2,383,157.00 | 2.86 |
| 54 | 600031 | 三一重工 | 2,361,180.00 | 2.83 |
| 55 | 601636 | 旗滨集团 | 2,349,053.00 | 2.82 |
| 56 | 002230 | 科大讯飞 | 2,272,366.54 | 2.73 |
| 57 | 600380 | 健康元 | 2,244,994.00 | 2.70 |
| 58 | 000338 | 潍柴动力 | 2,235,800.00 | 2.68 |
| 59 | 600885 | 宏发股份 | 2,224,198.18 | 2.67 |
| 60 | 601872 | 招商轮船 | 2,159,124.00 | 2.59 |
| 61 | 002705 | 新宝股份 | 2,148,233.00 | 2.58 |
| 62 | 603986 | 兆易创新 | 2,133,334.00 | 2.56 |
| 63 | 300715 | 凯伦股份 | 2,109,522.00 | 2.53 |
| 64 | 000513 | 丽珠集团 | 1,952,082.89 | 2.34 |
| 65 | 300661 | 圣邦股份 | 1,782,500.00 | 2.14 |
| 66 | 300182 | 捷成股份 | 1,731,300.00 | 2.08 |

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。

7.4.3 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 | 265,244,970.39 |
|--------------|----------------|

| | |
|--------------|----------------|
| 卖出股票收入（成交）总额 | 282,241,872.36 |
|--------------|----------------|

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。

7.5 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。

7.6 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。

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未进行股指期货交易。

7.10.2 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.11.3 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

7.12.3 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 | 129,574.05 |
| 2 | 应收证券清算款 | 1,873,676.30 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 7,458.90 |
| 5 | 应收申购款 | 392,700.29 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 2,403,409.54 |

7.12.4 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。

7.12.5 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。

7.12.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 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 |
| 长安鑫旺价值混合A | 1,390 | 13,404.43 | 5,284,177.21 | 28.36% | 13,347,978.95 | 71.64% |
| 长安鑫旺价值混合C | 2,946 | 7,642.18 | 1,443,288.56 | 6.41% | 21,070,576.33 | 93.59% |
| 合计 | 4,336 | 9,489.40 | 6,727,465.77 | 16.35% | 34,418,555.28 | 83.65% |

8.2 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 | 长安鑫旺价值混合A | 76,775.91 | 0.41% |
| | 长安鑫旺价值混合C | 655,786.03 | 2.91% |
| | 合计 | 732,561.94 | 1.78% |

8.3 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 | 长安鑫旺价值混合A | 0~10 |
| | 长安鑫旺价值混合C | 50~100 |
| | 合计 | 50~100 |

| | | |
|-----------------|------------|---|
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 长安鑫旺价值混合 A | 0 |
| | 长安鑫旺价值混合 C | 0 |
| | 合计 | 0 |

§ 9 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 |
|----------------------------|----------------|----------------|
| 基金合同生效日(2017年09月21日)基金份额总额 | 114,298,406.68 | 146,481,226.10 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 25,311,334.36 | 26,638,252.93 |
| 本报告期基金总申购份额 | 8,649,704.51 | 26,051,406.20 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 15,328,882.71 | 30,175,794.24 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 18,632,156.16 | 22,513,864.89 |

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。

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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

2020年5月11日，徐小勇正式担任长安基金管理有限公司副总经理。

除此之外，本报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 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。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)(原“毕马威华振会计师事务所”)自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务。

10.6 管理人、托管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、基金托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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 | |
| 国盛证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | 1 | 49,014,784.32 | 8.95% | 45,647.95 | 10.19% | - |
| 中信建投 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | 1 | 108,015,389.14 | 19.73% | 100,594.93 | 22.46% | - |
| 安信证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 东兴 | 2 | 284,893,065.68 | 52.04% | 224,563.53 | 50.14% | - |

| | | | | | | |
|----------------|---|----------------|--------|-----------|--------|---|
| 证券 | | | | | | |
| 上海 证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 申万 宏源 证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 万联 证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 浙商 证券 | 2 | 105,540,080.10 | 19.28% | 77,076.54 | 17.21% | - |
| 中金 公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 海通 证券 | 3 | - | - | - | - | - |

1、基金租用席位的选择标准是：

- (1) 资质雄厚，信誉良好，财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (2) 经营行为规范，在最近一年内无重大违规经营行为；
- (3) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (4) 公司具有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供具有相当质量的关于宏观经济面分析、行业发展趋势及证券市场走向、个股分析的研究报告以及丰富全面的信息服务；能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

选择程序是：根据对各券商提供的各项投资、研究服务情况的考评结果，符合席位券商标准的，由公司研究部提出席位券商的调整意见（调整名单及调整原因），并经公司批准。

2、在上述租用的券商交易单元中，本基金本期没有新增券商的交易单元，无退租的券商交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | | 基金交易 | |
|------|------|--------------|--------|----------------|------|--------------|------|--------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期基金成交总额的比例 |
| 国盛证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | - | - | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | | | |
|------------|------------|--------|---------------|---------|---|---|---|---|
| 中信证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 安信证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 东兴证券 | 572,072.64 | 85.23% | 12,000,000.00 | 100.00% | - | - | - | - |
| 上海证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 申万宏源证 券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 万联证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 浙商证券 | 99,159.10 | 14.77% | - | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |

10.8 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 | 关于旗下基金参加交通银行股份有限公司手机银行申购和定期定额投资手续费率优惠活动的公告 | 上海证券报 | 2020-01-02 |
| 2 | 005049_长安鑫旺价值灵活配置混合型证券投资基金2019年第四季度报告 | 上海证券报 | 2020-01-18 |
| 3 | 关于旗下基金在粤开证券股份有限公司开通申购、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 | 上海证券报 | 2020-03-25 |
| 4 | 005049_长安鑫旺价值灵活配置混合型证券投资基金2019年年度报告 | 上海证券报 | 2020-03-31 |
| 5 | 关于旗下基金在上海挖财基金销售有限公司开通申购、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 | 上海证券报 | 2020-04-02 |
| 6 | 关于暂停泰诚财富基金销售（大连）有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告 | 上海证券报 | 2020-04-09 |
| 7 | 005049_长安鑫旺价值灵活配置混合型证券投资基金2020年第一季度报告 | 上海证券报 | 2020-04-22 |

| | | | |
|----|---|-------|------------|
| 8 | 关于旗下基金在洪泰财富（青岛）基金销售有限责任公司开通申购、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 | 上海证券报 | 2020-04-27 |
| 9 | 关于旗下基金在中信证券华南股份有限公司参与费率优惠活动的公告 | 上海证券报 | 2020-04-28 |
| 10 | 关于旗下基金在喜鹊财富基金销售有限公司开通申购、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 | 上海证券报 | 2020-05-08 |
| 11 | 长安基金管理有限公司副总经理徐小勇任职公告 | 上海证券报 | 2020-05-12 |
| 12 | 关于旗下基金在万联证券股份有限公司开通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 | 上海证券报 | 2020-05-18 |
| 13 | 关于旗下基金在和耕传承基金销售有限公司开通申购、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 | 上海证券报 | 2020-05-27 |
| 14 | 长安基金管理有限公司关于包商银行转让相关业务的提示性公告 | 上海证券报 | 2020-05-28 |
| 15 | 关于旗下基金2020年6月30日基金份额净值及基金份额累计净值的公告 | 上海证券报 | 2020-06-30 |

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 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。

12.2 存放地点

上海市浦东新区芳甸路1088号紫竹国际大厦16层。

12.3 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
二〇二〇年八月三十一日