

长安行业成长混合型证券投资基金

2022年第4季度报告

2022年12月31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:2023年01月20日

目录

| | |
|--|----|
| §1 重要提示 | 3 |
| §2 基金产品概况 | 3 |
| §3 主要财务指标和基金净值表现 | 6 |
| 3.1 主要财务指标 | 6 |
| 3.2 基金净值表现 | 7 |
| §4 管理人报告 | 8 |
| 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介 | 9 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 | 9 |
| 4.3 公平交易专项说明 | 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序的前十名资产支持证券投资明细 | 12 |
| 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 | 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 | 14 |
| 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况 | 14 |
| 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细 | 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 | 14 |
| §9 备查文件目录 | 15 |
| 9.1 备查文件目录 | 15 |
| 9.2 存放地点 | 15 |
| 9.3 查阅方式 | 15 |

§ 1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年1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及其更新和重要提示。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2022年10月1日起至2022年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 长安行业成长 |
| 基金主代码 | 016345 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2022年09月29日 |
| 报告期末基金份额总额 | 43,446,425.42份 |
| 投资目标 | 在严格控制风险和保持基金资产流动性的前提下，重点投资成长性行业，力求实现基金资产的长期稳健增值。 |
| 投资策略 | <p>（一） 大类资产配置策略</p> <p>资本市场是经济的晴雨表，本基金综合分析宏观经济环境、政策形势、证券市场走势，判断经济周期与趋势，并据此主动判断市场方向，进行积极的资产配置。本基金将在宏观经济衰退末期、复苏和繁荣周期阶段，积极增加权益类资产的投资比例；在宏观经济衰退阶段，适度降低权益类资产的投资比例。</p> <p>（二） 股票投资策略</p> <p>1、行业配置</p> <p>本基金主要投资于成长性行业，成长性行业主要包括以下两种类型：一是从行业的生命周期来看，处</p> |

于快速成长期和成熟成长期的行业，处于这两个阶段的行业增长率快速提高，企业利润水平超出市场平均水平，获得超额收益的可能性很高；二是短期内处于复苏景气阶段的行业，部分行业虽然从长期来看并不处于成长阶段，但由于经济周期波动、供求关系变化等因素仍存在阶段性景气复苏的可能性，从较长时间来看，投资于此类行业的收益率水平往往趋于市场平均值，但若能够准确预计行业的阶段性复苏，则有可能抓住行业阶段性成长的机会。基金管理人将在申万一级行业分类基础上，以定性和定量分析相结合的方法综合分析行业的成长性，精选成长性较高的行业。

2、个股选择

在个股选择层面，通过定量分析和定性分析，优选成长性良好且股价没有充分反映其长期投资价值的上市公司进行投资。

3、港股通标的股票的投资策略

考虑到香港股票市场与A股股票市场的差异，对于香港联交所上市的股票，本基金除按照上述股票的投资策略外，还将结合公司基本面、国内经济和相关行业发展前景、香港市场资金面和投资者行为，以及世界主要经济体经济发展前景和货币政策、主流资本市场对投资者的相对吸引力等因素，精选符合本基金投资目标的香港联交所上市公司股票，重点关注。

4、存托凭证的投资策略

本基金将根据投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的研究判断，进行存托凭证的投资。

（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、可转债和可交债投资策略

可转换债券（含可交易分离可转债）兼具权益类证券与固定收益类证券的特性，具有抵御下行风险、分享股票价格上涨收益的特点。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良好的品种进行投资。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）资产支持证券投资策略

本基金将深入研究资产支持证券的市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率水平等基本面因素，并且结合债券市场宏观分析的结果，评估资产支持证券的信用风险、利率风险、流动性风险和提前偿付风险，辅以量化模型分析，评估其内在价值进行投资。

（五）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，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。

（六）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，以套期保值为主要目的参与国债期货交易。基金管理人将根据法律法规的规定，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。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。 | |
| 业绩比较基准 | 中证500指数收益率*60%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*20%+中债综合全价（总值）指数收益率*20%。 | |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。本基金除了投资A股外，还可投资港股通标的股票，还面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。 | |
| 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 | 长安行业成长混合A | 长安行业成长混合C |
| 下属分级基金的交易代码 | 016345 | 016346 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 36,869,817.95份 | 6,576,607.47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(2022年10月01日 - 2022年12月31日) | |
|-----------------|--------------------------------|--------------|
| | 长安行业成长混合A | 长安行业成长混合C |
| 1. 本期已实现收益 | -329,916.81 | -54,960.73 |
| 2. 本期利润 | -305,459.57 | -49,728.44 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0046 | -0.0009 |
| 4. 期末基金资产净值 | 36,667,427.15 | 6,533,121.61 |
| 5. 期末基金份额净值 | 0.9945 | 0.9934 |

- 1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
- 2、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

长安行业成长混合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 | -0.55% | 0.05% | 4.59% | 0.89% | -5.14% | -0.84% |
| 自基金合同生效起至今 | -0.55% | 0.05% | 3.33% | 0.89% | -3.88% | -0.84% |

本基金整体业绩比较基准构成为：中证 500 指数收益率*60%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*20%+中债综合全价（总值）指数收益率*20%。

长安行业成长混合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 | -0.65% | 0.05% | 4.59% | 0.89% | -5.24% | -0.84% |
| 自基金合同生效起至今 | -0.66% | 0.05% | 3.33% | 0.89% | -3.99% | -0.84% |

本基金整体业绩比较基准构成为：中证 500 指数收益率*60%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*20%+中债综合全价（总值）指数收益率*20%。

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

长安行业成长混合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。本基金于2022年9月29日成立,现在仍在建仓期。图示日期为2022年9月29日至2022年12月31日止。

长安行业成长混合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。本基金于2022年9月29日成立,现在仍在建仓期。图示日期为2022年9月29日至2022年12月31日止。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|----------|-------------|------|--------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 林忠晶 | 本基金的基金经理 | 2022-09-29 | - | 12年 | 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，长安基金管理有限公司产品经理、战略及产品部副总经理、量化投资部（筹）总经理、基金投资部副总经理、总经理等职。现任长安基金管理有限公司权益投资部总监、基金经理。 |

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

报告期内，市场担心多数国家的经济增长面临压力，但面临增长下行和通货膨胀的双重压力。其中，欧洲国家受俄乌争端的影响，能源和电力价格高企，导致工业生产面临停产风险，电力价格高企使得居民生活价格指数高企。北美国家受服务价格影响，通货膨胀保持高位。国内的通货膨胀率相对低位，但生产和需求受疫情不时散发影响较大，出口和消费面临较大的压力，同时投资受地产和需求负面影响。因此，全球不同经济体采取的政策差异较大，国内央行货币政策持续保持适当宽松，着力推动信贷增长并改善信贷结构。但房地产、出口和消费均面临较大压力，企业盈利下降趋势仍未出现根本性变化，景气行业数量有限，权益市场处于博弈状态。报告期内，本基金处于建仓期，鉴于权益市场行业轮动较快，权益资产仓位保持低位，权益资产主要投资于电动车产业链和光伏，适当配置超跌的保险、社会服务、食品饮料、化工、风电、地产产业链、医药、计算机和农林牧渔。鉴于国内经济已经企稳，流动性维持宽松状态，部分行业估值处于低位，未来将逐步提高权益资产的仓位。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末长安行业成长混合A基金份额净值为0.9945元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-0.55%，同期业绩比较基准收益率为4.59%；截至报告期末长安行业成长混合C基金份额净值为0.9934元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-0.65%，同期业绩比较基准收益率为4.59%。

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2022年12月2日至2022年12月31日连续21个工作日出现基金资产净值低于五千万情形，未出现连续20个工作日（含）以上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 | 2,370,558.69 | 5.45 |

| | | | |
|---|-------------------|---------------|--------|
| | 其中：股票 | 2,370,558.69 | 5.45 |
| 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 | 16,004,111.78 | 36.77 |
| | 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 | 24,972,303.96 | 57.38 |
| 8 | 其他资产 | 172,398.48 | 0.40 |
| 9 | 合计 | 43,519,372.91 | 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) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------------------|--------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | 84,790.00 | 0.20 |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 1,923,989.69 | 4.45 |
| 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 | - | - |
| 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 | 93,058.00 | 0.22 |
| J | 金融业 | 117,500.00 | 0.27 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 151,221.00 | 0.35 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管 | - | - |

| | | | |
|---|---------------|--------------|------|
| | 理业 | | |
| 0 | 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 | 2,370,558.69 | 5.49 |

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 | 300014 | 亿纬锂能 | 2,200 | 193,380.00 | 0.45 |
| 2 | 601888 | 中国中免 | 700 | 151,221.00 | 0.35 |
| 3 | 301168 | 通灵股份 | 2,000 | 144,740.00 | 0.34 |
| 4 | 601318 | 中国平安 | 2,500 | 117,500.00 | 0.27 |
| 5 | 601966 | 玲珑轮胎 | 5,600 | 114,688.00 | 0.27 |
| 6 | 002965 | 祥鑫科技 | 1,900 | 110,599.00 | 0.26 |
| 7 | 002518 | 科士达 | 1,900 | 109,440.00 | 0.25 |
| 8 | 000596 | 古井贡酒 | 400 | 106,760.00 | 0.25 |
| 9 | 002531 | 天顺风能 | 6,900 | 104,397.00 | 0.24 |
| 10 | 002706 | 良信股份 | 7,100 | 104,015.00 | 0.24 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金本报告期内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

本基金本报告期内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**

本基金本报告期内未进行国债期货交易。

5.10.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未进行国债期货交易。

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 | 824.76 |
| 2 | 应收证券清算款 | 171,573.72 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 172,398.48 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限股票。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| | 长安行业成长混合A | 长安行业成长混合C |
|-------------------------------|----------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 132,041,471.30 | 173,609,386.82 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 11,462.01 | 19,255.34 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 95,183,115.36 | 167,052,034.69 |
| 报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列) | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 36,869,817.95 | 6,576,607.47 |

总申购份额包含红利再投资、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

本报告期内，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

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

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 |
| 个人 | 1 | 2022/12/07 - 2022/12/31 | 9,916,813.80 | - | - | 9,916,813.80 | 22.83% |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| <p>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：</p> <p>(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；</p> <p>(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</p> | | | | | | | |

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。

§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、长安行业成长混合型证券投资基金基金合同；
- 3、长安行业成长混合型证券投资基金托管协议；
- 4、长安行业成长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

2023年01月20日