

长安产业精选灵活配置混合型发起式证券投资基金2015年年度报告摘要

2015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：广发银行股份有限公司

送出日期：2016年03月26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。

基金托管人广发银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年3月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料经会计师事务所审计。毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自2015年1月1日起至12月31日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|------------------------|-------------------|
| 基金名称 | 长安产业精选灵活配置混合型发起式证券投资基金 | |
| 基金简称 | 长安产业精选混合 | |
| 基金主代码 | 000496 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2014年05月07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 | 2,084,239,004.49份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 长安产业精选混合A | 长安产业精选混合C |
| 下属分级基金的交易代码 | 000496 | 002071 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 40,254,941.79份 | 2,043,984,062.70份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|------|--|
| 投资目标 | 本基金通过把握宏观经济转折点，灵活配置权益类资产和固定收益类资产，并在严格控制下行风险的基础上，力争实现基金资产较高的长期稳健回报。 |
| 投资策略 | <p>1、大类资产配置策略</p> <p>本基金管理人将综合分析宏观经济状况、国家政策取向、资本市场资金状况和市场情绪等因素，评估不同投资标的的风险收益特征，通过战略资产配置策略和战术资产配置策略的有机结合，确定股票、债券和现金类资产在基金资产中的配置比例。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>在股票投资组合的构建和管理过程中，本基金将在大类资产配置的基础上，通过分析产业升级和产业转移的趋势，精选具有良好发展前景的产业；然后在产业精选的基础上进行行业分析和配置；最后，在细分行业内选择兼具估值和成长优势的个股构建股票投资组</p> |

| | |
|--------|--|
| | 合。 |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数收益率×65%+中证全债指数收益率×35%。 |
| 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，属于证券投资基金中等风险水平的投资品种。 |

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 | 李春磊 |
| | 联系电话 | 021-20329761 | 010-65169830 |
| | 电子邮箱 | liyongbo@changanfunds.com | lichunlei@cgbchina.com.cn |
| 客户服务电话 | | 400-820-9688 | 95508 |
| 传真 | | 021-20329888 | 010-65169555 |

2.4 信息披露方式

| | |
|-----------------------|---|
| 登载基金年度报告正文的基金管理人互联网网址 | http://www.changanfunds.com |
| 基金年度报告备置地点 | 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、基金净值表现及利润分配情况

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 | 长安产业精选混合A | |
|---------------|----------------|-------------------------|
| | 2015年 | 2014年05月07日-2014年12月31日 |
| 本期已实现收益 | 241,855,438.63 | 30,626,237.53 |
| 本期利润 | 242,745,225.97 | 30,864,346.14 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.1210 | 0.1001 |

| | | |
|----------------------|---------------|----------------|
| 本期基金加权平均净值利润率 | 10.52% | 9.72% |
| 本期基金份额净值增长率 | 8.30% | 10.90% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2015年末 | 2014年末 |
| 期末可供分配利润 | -1,040,231.94 | 26,432,403.88 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.0258 | 0.1089 |
| 期末基金资产净值 | 41,911,077.75 | 269,104,145.96 |
| 期末基金份额净值 | 1.0410 | 1.1090 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 2015年末 | 2014年末 |
| 基金份额累计净值增长率 | 20.10% | 10.90% |

| 3.1.4 期间数据和指标 | 长安产业精选混合C | |
|----------------------|------------------|-------------------------|
| | 2015年 | 2014年05月07日-2014年12月31日 |
| 本期已实现收益 | 671,597.92 | — |
| 本期利润 | 3,452,316.04 | — |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0016 | — |
| 本期基金加权平均净值利润率 | 0.15% | — |
| 本期基金份额净值增长率 | 0.19% | — |
| 3.1.5 期末数据和指标 | 2015年末 | 2014年末 |
| 期末可供分配利润 | -55,818,024.07 | — |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.0273 | — |
| 期末基金资产净值 | 2,124,937,190.65 | — |
| 期末基金份额净值 | 1.0400 | — |
| 3.1.6 累计期末指标 | 2015年末 | 2014年末 |
| 基金份额累计净值增长率 | 0.19% | — |

注：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

| 阶段 (长安产业精选混合A) | 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 |
|--------------------------------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|--------|
| 过去三个月 | 2.36% | 0.17% | 11.29% | 1.08% | -8.93% | -0.91% |
| 过去六个月 | 1.43% | 0.21% | -9.21% | 1.74% | 10.64% | -1.53% |
| 过去一年 | 8.30% | 0.21% | 6.91% | 1.61% | 1.39% | -1.40% |
| 自基金合同生效日起至今(2014年05月07日-2015年12月31日) | 20.10% | 0.21% | 49.65% | 1.35% | -29.55% | -1.14% |

注：1、本基金基金合同生效日为2014年05月07日。

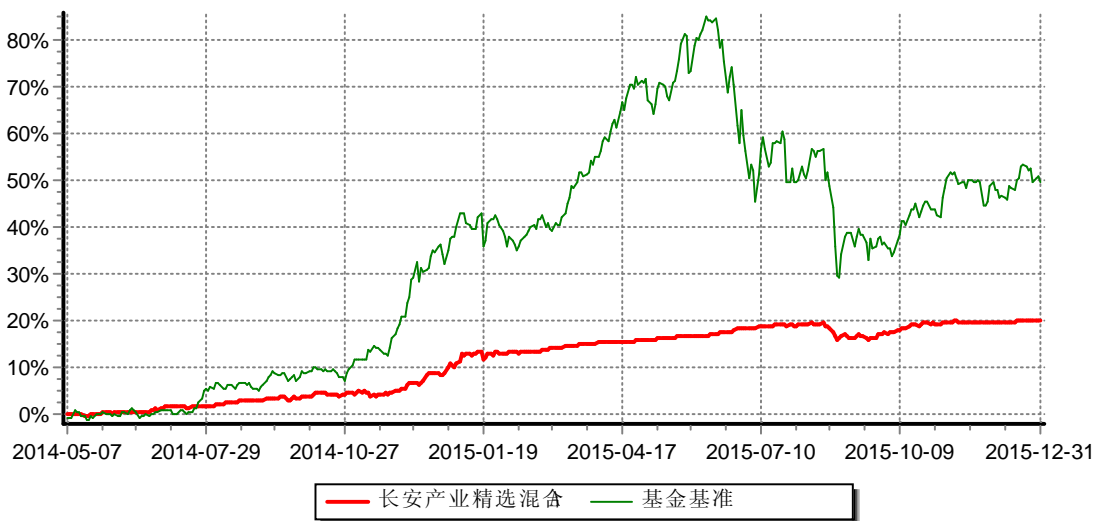
2、本基金业绩比较基准为：沪深300指数收益率*0.65+中证全债指数收益率*0.35。

| 阶段 (长安产业精选混合C) | 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 |
|--------------------------------------|----------|-------------|------------|---------------|-------|--------|
| 过去三个月 | 0.19% | 0.05% | 0.01% | 1.06% | 0.18% | -1.01% |
| 自基金合同生效日起至今(2015年11月16日-2015年12月31日) | 0.19% | 0.05% | 0.01% | 1.06% | 0.18% | -1.01% |

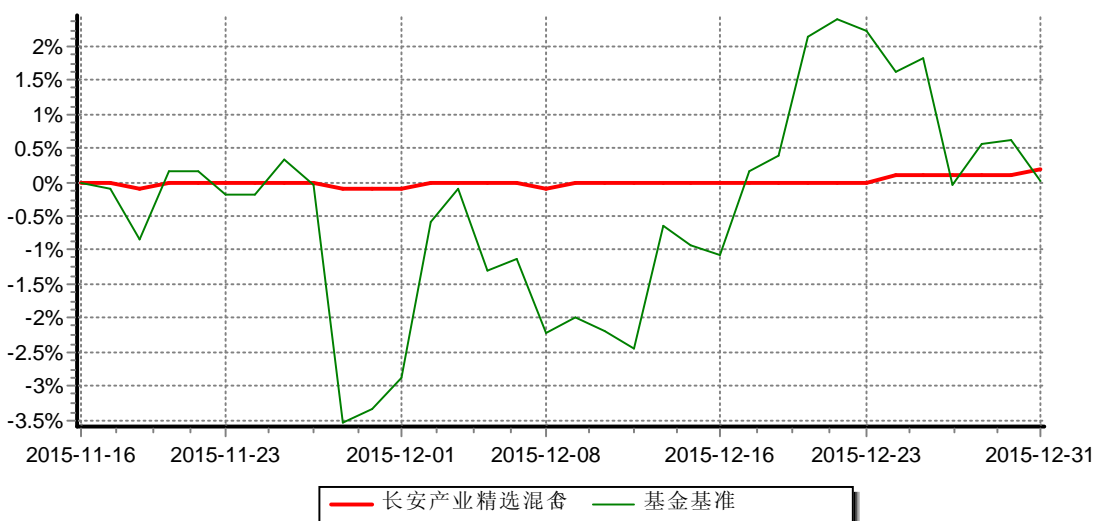
注：1、本基金于2015年11月16日公告新增C类份额。

2、本基金业绩比较基准为：沪深300指数收益率*0.65+中证全债指数收益率*0.35。

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

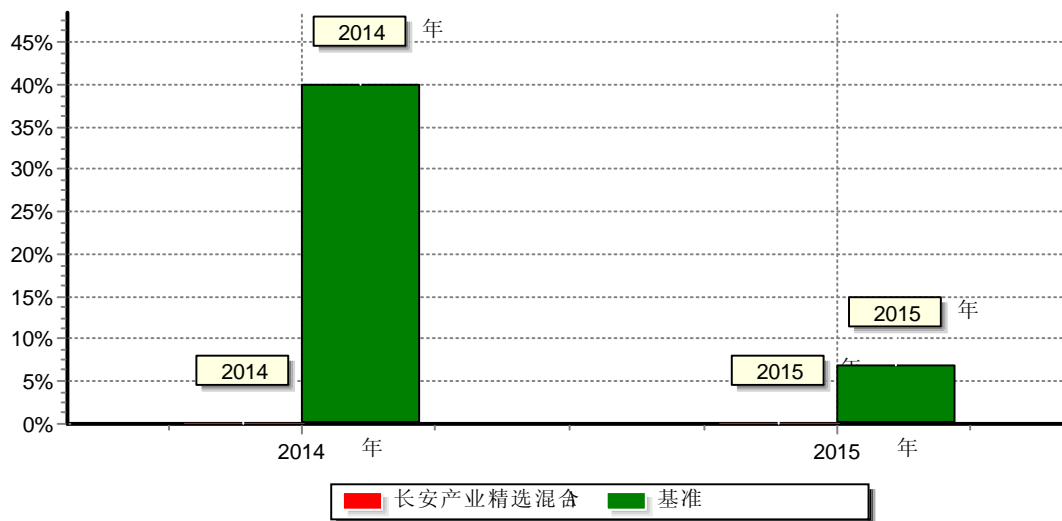


注：本基金合同生效日为2014年5月7日，基金合同生效日至报告期期末，本基金运作时间超过一年。图示日期为2014年5月7日至2015年12月31日。

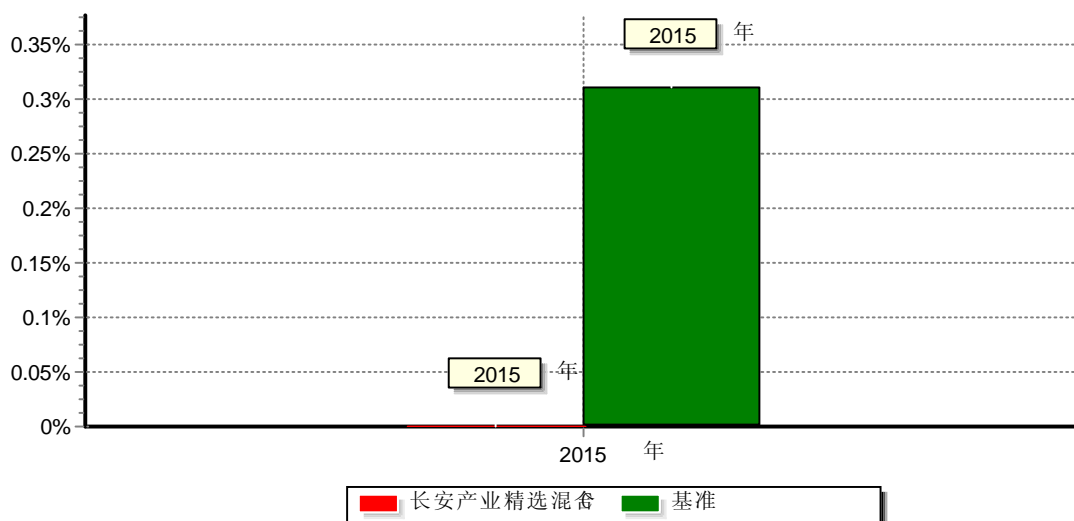


注：本基金C类份额生效日为2015年11月16日，自本基金C类份额生效日至报告期期末，运作时间未满一年。图示日期为2015年11月16日至2015年12月31日。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金合同生效日为2014年5月7日，合同生效发当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。



注：本基金C类份额生效日为2015年11月16日，合同生效发当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

| 年度 (长安产业精选混合A) | 每10份基金份额分红数 | 现金形式发放总额 | 再投资形式发放总额 | 年度利润分配合计 | 备注 |
|-------------------|-------------|------------|------------|---------------|----|
| 2015年 | 1.600 | 824,825.05 | 1,944,772. | 826,769,832.4 | |

| | | | | | |
|----|-------|--------------------|------------------|--------------------|--|
| | | 9.84 | 61 | 5 | |
| 合计 | 1.600 | 824,825,05 9.84 | 1,944,772. 61 | 826,769,832.4 5 | |

注：本基金合同生效日为2014年5月7日，本基金于2014年末进行利润分配。本基金于2015年7月10日进行了利润分配。另外，本基金于2015年11月16日公告增加C类份额，因此C类份额未能参与本次利润分配。

§ 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、上海景林投资发展有限公司、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。

目前，除本基金外，长安基金管理有限公司另管理4只开放式证券投资基金，基本情况如下：

1、长安宏观策略混合型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

成立日期：2012年3月9日

投资目标：本基金在宏观策略研判的基础上，通过强化配置景气行业及精选基本面良好、成长性突出的上市公司，在有效控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。

2、长安沪深300非周期行业指数证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

成立日期：2012年6月25日

投资目标：本基金为股票型指数基金，力求通过对沪深300非周期行业指数进行完全复制，在严格控制跟踪误差的基础上，为投资者提供一个投资于沪深300非周期行业指数的有效工具。

3、长安货币市场证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

成立日期：2013年1月25日

投资目标：本基金在保持基金资产的安全性和流动性的前提下，通过主动式管理，力求获得超过基金业绩比较基准的稳定回报。

4、长安鑫利优选灵活配置混合型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

成立日期：2015年5月18日

投资目标：本基金在深入分析宏观经济形势和资本市场变动趋势的基础上，充分挖掘市场潜在的投资机会，追求基金资产的长期稳定增值。

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 | | |
| 雷宇 | 本基金的前任基金经理 | 2014年05月07日 | 2015年06月16日 | 14年 | 中国人民大学经济学硕士。曾任中国技术进出口总公司项目经理、研究员，上海中技投资顾问有限公司研究员、投资经理，通用技术集团投资管理有限公司投资经理、投资部副总监，国金通用基金管理有限公司筹备期基金经理助理、风险管理部负责人等职。2011年8月-2015年6月任职于长安基金管理有限公司，曾任基金经理助理、基金投资部副总经理、长安基金联席投资总监、长安宏观策略股票型证券投资基金、长安产业精选灵活配置混合型发起式基金及长安沪深300非周期行业指数证券投资基金的基金经理等职。 |
| 栾绍菲 | 本基金的基金经理 | 2015年05月25日 | — | 4年 | 经济学硕士。曾任长安基金管理有限公司研究部研究员、基金经理助理。现任长安基金管理有限公司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的基金经理。 |
| 林忠晶 | 本基金的基金经理 | 2015年05月26日 | — | 5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、战略及产品部副总经理等职，现任长安基金管理有限公司量化投资部（筹）总经理，长安沪深300非周期行业指数证券投资基金、长安产业精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、长安鑫利优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。 |

注：1、任职日期和离任日期均指公司做出决定后正式对外公告之日；

2、证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金运作管理办法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

在本报告期内，本基金严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，投资管理和交易执行相隔离，实行集中交易制度，公平对待所管理的所有基金和投资组

合，未出现违反公平交易制度的情况，亦未受到监管机构的相关调查。

4.3.2 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。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本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说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年A股市场呈现暴涨暴跌的极端行情。其中，一季度A股市场整体受到流动性和政策面利好影响，期间市场出现普涨行情，以轻工制造、电子、纺织服装为首的中小盘个股涨幅居前，而以采掘、钢铁、有色为首的强周期类个股涨幅落后。受宏观经济数据下降幅度超预期、流动性冲击导致估值下挫以及股市配资清理整顿的影响，A股市场从2015年第二、三季度末开始出现调整。2015年第四季度受稳定经济增长措施的影响，权益类市场参与者情绪逐步好转，A股市场估值开始恢复，市场震荡上行，创业板表现优异。

报告期内，本基金出于获取绝对收益方面的考虑，在控制权益类投资比例的前提下，精选业绩预期较为明确的股票进行投资。另外，在新股集中申购期间，选择行业前景较好、估值合理的新股进行投资。

中国经济自2011年以来经历了一轮持续下行，目前仍处于虚弱状态，旧产能仍未出清，新的经济增长模式仍未确立。经济增长的“三驾马车”中，受高库存和产能过剩的影响，房地产和制造业将继续下滑，投资增速将持续放缓；在消费预期和收入增长没有明显改善的背景下，消费增速难以有明显改善；世界主要经济体复苏缓慢，外部需求疲软的影响，出口改善将有限。整体看，2016年我国经济面临周期性下行压力，结构性矛盾将进一步凸显，政府将在适当扩大总需求的同时，加强供给侧改革的力度，并辅以积极的

财政政策和相对宽松的货币政策，需要特别关注美国退出宽松引发的新兴市场波动以及国内的信用风险恶化对市场的冲击。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2015年12月31日，本基金A份额单位净值为1.041元，报告期内，本基金份额净值增长率为8.3%，同期业绩基准增长率为6.91%；

截至2015年12月31日，本基金C份额单位净值为1.040元，报告期内，本基金份额净值增长率为0.19%，同期业绩基准增长率为0.01%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2016年，在经济处于结构调整的基调上，我们认为A股部分行业将出现结构化的投资机会。2016年供给侧改革将是政策主线，传统过剩行业如钢铁、化工、水泥、煤炭等去产能的趋势仍将延续，具有产能整合优势的细分行业中的龙头公司或积极向其上下游转型的公司业绩将出现反转。2016年作为“十三五”开局之年，在全球经济进入深度调整的大背景下，经济增长的新动能从过去的点点滴滴不断积聚，正逐渐形成一股趋势性力量，创新、转型有望成为新时代产生新蓝筹股票的长坡，智能制造、高端装备、节能环保、生物技术、信息技术、新能源和新消费服务等产业将持续得到政策扶持，行业景气程度将持续上升，有望形成结构性投资亮点。

我们认为，未来随着经济转型的深入，经济结构将更加优化，代表政策方向的部分传统行业将重新展现活力，同时代表未来发展方向的新兴产业成长股将具有长期投资价值。我们珍惜基金份额持有人的每一分投资和每一份信任，我们将继续规范运作，审慎投资，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求长期、稳定的回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，为了保证公司合规运作、加强内部控制、防范经营风险、保障基金份额持有人的利益，监察稽核人员按照独立、客观、公正的原则，依据国家相关法律法规、基金合同和管理制度，采用例行检查与专项检查、定期检查和不定期检查相结合的方式，对公司内控制度的合法性和合规性、执行的有效性和完整性、风险的防范和控制等进行了持续的监察稽核，对发现的问题进行提示和追踪落实，定期制作监察稽核报告，及时呈报公司领导层和上级监管部门。

本基金管理人采取的主要措施包括：

(1) 积极响应中国证监会关于加强市场监管的号召，采取外部法律顾问授课和内部监察部门培训相结合的方式，多次组织全体员工开展《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》及其配套法规、公司内控制度等的学习。通过上述学习宣传活动，使员工加深了对法律法规的认识，并进一步将法律法规与内控制度落实到日常工作中，确保其行为守法合规、严格自律，恪守诚实信用原则，以充分维护基金持有人的利益。

(2) 继续完善公司治理结构，严格按照现代企业制度的要求，以规范经营运作、保护基金份额持有人利益为目标，建立、健全了组织结构和运行机制，明确界定董事会、监事会职责范围，认真贯彻了独立董事制度，重大经营决策的制定都征得了所有独立董事的同意，保证了独立董事在公司法人治理结构中作用的切实发挥，保证了各项重大决策的客观公正。

(3) 不断完善规章制度体系，根据国家的有关法律法规和基金管理公司实际运作的要求，对现有的规章制度体系不断进行完善，对经营管理活动的决策、执行和监督程序进行规范，明确不同决策层和执行层的权利与责任，细化研究、投资、交易等各项工作流程，为杜绝人为偏差、合法合规运作、强化风险控制提供了制度保证。

4.7 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，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）的估值方法进行调整，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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金于2015年7月10日进行了利润分配，每10份基金份额分配1.60元，其中以现金形式发放总额为824,825,059.84元，以再投资形式发放总额为1,944,772.61元，本次利润分配合计826,769,832.45元。本基金于2015年11月16日公告增加C类份额，因此C类份额未能参与本次利润分配。

§ 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”）在对长安产业精选灵活配置混合型发起式证券投资基金（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，完全尽职尽责地履行了应尽的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、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、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

本基金2015年年度财务报告已经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)审计，注册会计师签字出具了标准无保留意见的审计报告。投资者欲了解本基金审计报告详细内容，应阅读年度报告正文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：长安产业精选灵活配置混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2015年12月31日

单位：人民币元

| 资 产 | 本期末 2015年12月31日 | 上年度末 2014年12月31日 |
|-------------|--------------------|---------------------|
| 资 产： | | |
| 银行存款 | 2,158,436,488.13 | 63,000,527.19 |
| 结算备付金 | 612,169.22 | 1,077,839.46 |
| 存出保证金 | 1,201,400.74 | 549,070.38 |
| 交易性金融资产 | 16,166,815.84 | 109,256,752.17 |
| 其中：股票投资 | 16,166,815.84 | 109,256,752.17 |
| 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 | — | — |
| 买入返售金融资产 | 800,000,000.00 | 120,000,000.00 |

| | | |
|-----------------|--------------------|--------------------|
| 应收证券清算款 | — | — |
| 应收利息 | 926,022.07 | 92,068.25 |
| 应收股利 | — | — |
| 应收申购款 | 22,965.52 | 53,201.98 |
| 递延所得税资产 | — | — |
| 其他资产 | — | — |
| 资产总计 | 2,977,365,861.52 | 294,029,459.43 |
| 负债和所有者权益 | 本期末 | 上年度末 |
| | 2015年12月31日 | 2014年12月31日 |
| 负 债: | | |
| 短期借款 | — | — |
| 交易性金融负债 | — | — |
| 衍生金融负债 | — | — |
| 卖出回购金融资产款 | — | — |
| 应付证券清算款 | 805,955,598.20 | 23,404,663.91 |
| 应付赎回款 | 86,555.68 | 68,646.74 |
| 应付管理人报酬 | 2,541,286.84 | 346,344.15 |
| 应付托管费 | 529,434.79 | 57,724.05 |
| 应付销售服务费 | 1,022,409.60 | — |
| 应付交易费用 | 142,278.57 | 902,675.89 |
| 应交税费 | — | — |
| 应付利息 | — | — |
| 应付利润 | — | — |
| 递延所得税负债 | — | — |
| 其他负债 | 240,029.44 | 145,258.73 |
| 负债合计 | 810,517,593.12 | 24,925,313.47 |
| 所有者权益: | | |
| 实收基金 | 2,084,239,004.49 | 242,671,742.08 |
| 未分配利润 | 82,609,263.91 | 26,432,403.88 |
| 所有者权益合计 | 2,166,848,268.40 | 269,104,145.96 |
| 负债和所有者权益总计 | 2,977,365,861.52 | 294,029,459.43 |

注：截止2015年12月31日，本基金A类份额单位净值1.041元，份额总额40,254,941.79份；本基金C类份额单位净值1.040元，份额总额2,084,239,004.49份。

7.2 利润表

会计主体：长安产业精选灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2015年01月01日至2015年12月31日

单位：人民币元

| 项 目 | 本期 2015年01月01日至 2015年12月31日 | 上年度可比期间 2014年05月07日至 2014年12月31日 |
|------------------------|-----------------------------------|--|
| 一、收入 | 288,128,660.42 | 36,860,254.06 |
| 1. 利息收入 | 24,565,859.37 | 2,978,392.31 |
| 其中：存款利息收入 | 16,179,933.52 | 804,856.80 |
| 债券利息收入 | — | — |
| 资产支持证券利息收入 | — | — |
| 买入返售金融资产收入 | 8,385,925.85 | 2,173,535.51 |
| 其他利息收入 | — | — |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | 216,825,034.66 | 33,511,777.73 |
| 其中：股票投资收益 | 213,127,380.70 | 32,970,823.09 |
| 基金投资收益 | — | — |
| 债券投资收益 | — | — |
| 资产支持证券投资收益 | — | — |
| 贵金属投资收益 | — | — |
| 衍生工具收益 | — | — |
| 股利收益 | 3,697,653.96 | 540,954.64 |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 3,670,505.46 | 238,108.61 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号 | — | — |

| | | |
|----------------------------|-----------------------|----------------------|
| 填列) | | |
| 5. 其他收入 (损失以“-”号填列) | 43,067,260.93 | 131,975.41 |
| 减: 二、费用 | 41,931,118.41 | 5,995,907.92 |
| 1. 管理人报酬 | 30,992,399.52 | 3,100,389.73 |
| 2. 托管费 | 6,265,157.18 | 516,731.63 |
| 3. 销售服务费 | 1,399,677.97 | — |
| 4. 交易费用 | 3,123,883.74 | 2,232,886.56 |
| 5. 利息支出 | — | — |
| 其中: 卖出回购金融资产支出 | — | — |
| 6. 其他费用 | 150,000.00 | 145,900.00 |
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) | 246,197,542.01 | 30,864,346.14 |
| 减: 所得税费用 | — | — |
| 四、净利润(净亏损以“-”号填列) | 246,197,542.01 | 30,864,346.14 |

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 长安产业精选灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期: 2015年01月01日至2015年12月31日

单位: 人民币元

| 项目 | 本期 2015年01月01日至2015年12月31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) | 242,671,742.08 | 26,432,403.88 | 269,104,145.96 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | | 246,197,542.01 | 246,197,542.01 |
| 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) | 1,841,567,262.41 | 636,749,150.47 | 2,478,316,412.88 |
| 其中: 1. 基金申购款 | 13,368,694,559.16 | 1,885,080,0 | 15,253,774,579.75 |

| | | | |
|--|--------------------------------|-------------------|--------------------|
| | | 20.59 | |
| 2. 基金赎回款 | -11,527,127,296.75 | -1,248,330,870.12 | -12,775,458,166.87 |
| 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） | — | -826,769,832.45 | -826,769,832.45 |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 2,084,239,004.49 | 82,609,263.91 | 2,166,848,268.40 |
| 项 目 | 上年度可比期间2014年05月07日至2014年12月31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） | 341,643,228.06 | — | 341,643,228.06 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | — | 30,864,346.14 | 30,864,346.14 |
| 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） | -98,971,485.98 | -4,431,942.26 | -103,403,428.24 |
| 其中：1. 基金申购款 | 2,049,523.19 | 91,007.94 | 2,140,531.13 |
| 2. 基金赎回款 | -101,021,009.17 | -4,522,950.20 | -105,543,959.37 |
| 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） | 242,671,742.08 | 26,432,403.88 | 269,104,145.96 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

黄陈

李卫

欧鹏

基金管理公司负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

长安产业精选灵活配置混合型发起式证券投资基金(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”)《关于核准长安产业精选灵活配置混合型发起式证券投资基金募集的批复》(证监许可[2013]1329号文)的批准,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《长安产业精选灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》发售,基金合同于2014年5月7日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集规模为341,643,228.06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(以下简称“广发银行”)。

本基金于2014年4月1日至2014年4月30日募集,募集期间净认购资金人民币341,611,699.67元,认购资金在募集期间产生的利息人民币31,528.39元,募集的有效认购份额及利息结转的基金份额合计341,643,228.06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)验证,并出具了毕马威华振验字第1400625号验资报告。根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《长安产业精选市场券投资基金基金合同》和《长安产业精选市场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(权证、股指期货等)、债券(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款等货币市场工具,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)。基金的投资组合比例为:股票投资占基金资产的比例为0%-95%;权证投资占基金资产净值的比例为0%-3%;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;其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

本基金的股票投资部分的业绩比较基准为沪深300指数,债券投资部分为中证全债指数收益率,复合业绩比较基准为:沪深300指数收益率 \times 65%+中证全债指数收益率 \times 35%。根据《证券投资基金信息披露管理办法》,本基金定期报告在公开披露的第二个工作日,报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。根据《关于长安产业精选灵活配置混合型发起式证券投资基金增加C类基金份额并修改基金合同的公告》,本基金基金管理人于2015年11月16日起对本基金增加收取销售服务费的C类收费模式,并对本基金基金合同作相应修改。本基金将基金份额分为A类基金份额和C类基金份额两个不同的类别。在投资者认购、申购基金时收取认购、申购费用而不计提销售服务费的,称为A类基金份额;在投资者申购基金份额时不收取申购费用而是从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为C类基金份额。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)于2006年2月15

日颁布的《企业会计准则-基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)的要求编制,同时亦按照中国证监会公告[2010]5号《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2015年12月31日的财务状况、自2015年1月1日至2015年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历2015年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2015年1月1日至2014年12月31日止。

7.4.4.2 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。

7.4.4.3 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。

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(包括交易性金融资产或金融负债):本基金持有为了近期内出售或回购的金融资产和金融负债属于此类。衍生工具所产生的金融资产和金融负债在资产负债表中以衍生金融资产和衍生金融负债列示。应收款项:应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。持有至到期投资:本基金将有明确意图和能力持有至到期的且到期日固定、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产分类为持有至到期投资。可供出售金融资产:本基金将在初始确认时即被指定为可供出售的非衍生金融资产以及没有归类到其他类别的金融资产分类为可供出售金融资产。其他金融负债:其他金融负债是指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。

7.4.4.4 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，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。

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；对于支付价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。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，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；应收款项和其他金融负债以实际利率法按摊余成本计量。

当收取某项金融资产的现金流量的合同权利终止或将所有权上几乎所有的风险和报酬转移时，本基金终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

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。

7.4.4.5 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。

本基金估计公允价值时，考虑市场参与者在计量日对相关资产或负债进行定价时考虑的特征(包括资产状况及所在位置、对资产出售或者使用的限制等)，并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。

存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了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，调整最近交易市价以确定公允价值。

当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 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，且该种法定权利现在是可执行的；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。

7.4.4.7 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。

7.4.4.8 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，并于年末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资收益/（损失）、债券投资收益/（损失）和衍生工具收益/（损失）按相关金融资产于处置日以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（适用于企业债和可转债等）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/(损失)核算基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、衍生金融资产、交易性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。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管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，在回购期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。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

根据《长安产业精选灵活配置混合型发起式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，本基金每年收益分配次数最多为4次，每份基金份额每次分配比例不得低于该次可供分配利润的30%；若基金合同生效不满3个月，可不进行收益分配。基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位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，基金投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从持有人权益转出。

7.4.4.12 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。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。

7.4.4.13 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[2008]38号《关于进一步规范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。

对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》（以下简称“《证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价的通知》”），若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易所交易天数占锁定期内总交易所交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

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。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本年度未发生重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本年度未发生过重大会计差错。

7.4.6 税项

(1) 主要税项说明

根据财税字[1998]55号文《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收问题的通知》、财税字[2002]128号文《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[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》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) 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(b) 证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。

(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)对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入，由上市公司、发行债券的企业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，股权登记日为自2013年1月1日起至2015年9月7日期间的，暂减按25%计入应纳税所得额，股权登记日在2015年9月8日及以后的，暂免征收个人所得税。

(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(包括个人和机构投资者)从基金分配中取得的收入，暂不征收个人所得税和企业所得税。

(2)于2015年12月31日，本基金无应交税费。

7.4.7 关联方关系

| 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 |
| 广发银行股份有限公司 | 基金托管人 |
| 长安国际信托股份有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 上海景林投资发展有限公司 | 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 |
| 广发银行托管专户-长安基金安盈万韬资产管理计划 | 基金管理人管理的专户产品 |
| 长安弘哲亿信深蓝启明灵活对冲6号分级资产管理计划 | 基金管理人管理的专户产品 |
| 长安基金安盈舜耕天禾1号资产管理计划 | 基金管理人管理的专户产品 |
| 长安基金-浦发-长安茂源启明灵活对冲5号分级资产管理计划 | 基金管理人管理的专户产品 |
| 长安基金-浦发-长安深蓝启明灵活对冲 | 基金管理人管理的专户产品 |

| | |
|----------------------------------|--------------|
| 9号分级资产管理计划 | |
| 长安基金-浦发-长安先盈启明灵活对冲 8号分级资产管理计划 | 基金管理人管理的专户产品 |

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

本基金在本年度及自2014年5月7日(基金合同生效日)至2014年12月31日止期间无应支付给关联方的佣金。

7.4.8.1.4 债券交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.8.1.5 债券回购交易

本基金在本年度及自2014年5月7日(基金合同生效日)至2014年12月31日止期间均无通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2015年01月01日至2015年12 月31日 | 上年度可比期间 2014年05月07日至2014年12 月31日 |
|-----------------|-----------------------------------|--|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 30,992,399.52 | 3,100,389.73 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 145,126.24 | 184,032.40 |

注：1、支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%的年费率计提（2015年4月30

日及以前)或1.2%(2015年5月1日及以后)的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×1.5%(或1.2%)/当年天数。本基金已经于2015年4月27日公告自2015年5月1日起年管理费率从1.5%降为1.20%。

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。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2015年01月01日至2015年12 月31日 | 上年度可比期间 2014年05月07日至2014年12 月31日 |
|----------------|-----------------------------------|--|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 6,265,157.18 | 516,731.63 |

注:支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

7.4.8.2.3 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 2015年01月01日至2015年12月31日 | | |
|--------------------|-------------------------------|---------------|--------------|
| | 长安产业精选混合 A | 长安产业精选混合 C | 合计 |
| 广发银行 | — | | — |
| 长安基金 | — | 1,399,670.47 | 1,399,670.47 |
| 合计 | | 1,399,670.47 | 1,399,670.47 |

注:本基金A类份额不计算销售服务费。本基金C类份额支付基金销售机构的销售服务费按前一日C类基金资产净值0.5%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日基金销售服务费=前一日C类基金资产净值×0.5%/当年天数。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金在本年度及自2014年5月7日(基金合同生效日)至2014年12月31日止期间均未通过关联方交易单元进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2015年01月01日至2015年12月31日 | | 上年度可比期间 2014年05月07日至2014年12月31日 | |
|-------------------|-------------------------------|-----------|------------------------------------|-----------|
| | 长安产业精选混合A | 长安产业精选混合C | 长安产业精选混合A | 长安产业精选混合C |
| 基金合同生效日持有的基金份额 | 10,001,400.00 | — | 10,001,400.00 | — |
| 期初持有的基金份额 | 10,001,400.00 | — | — | — |
| 期间申购/买入总份额 | — | — | — | — |
| 期间因拆分变动份额 | — | — | — | — |
| 减：期间赎回/卖出总份额 | — | — | — | — |
| 期末持有的基金份额 | 10,001,400.00 | — | 10,001,400.00 | — |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 0.48% | — | 4.12% | — |

7.4.8.4.2 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

份额单位：人民币元

| 关联方名称 | | 本期末 2015年12月31日 | | 上年度末 2014年12月31日 | |
|-----------|---------------|--------------------|------------------|---------------------|------------------|
| | | 持有的基金份额 | 持有的基金份额占基金总份额的比例 | 持有的基金份额 | 持有的基金份额占基金总份额的比例 |
| 长安产业精选混合A | 长安基金公司高级管理人员 | 3,786.06 | — | 9,884.24 | — |
| 长安产业 | 长安民晟1号分级资产管理计 | 0 | — | 89,013,240.00 | 3.67% |

| | | | | | |
|-----------|------------------|---|---|---------------|-------|
| 精选混合A | 划 | | | | |
| 长安产业精选混合A | 长安浓谷善德4号分级资产管理计划 | 0 | — | 62,500,250.00 | 2.58% |
| 长安产业精选混合A | 长安芝麻财富1号分级资产管理计划 | 0 | — | 53,500,070.00 | 2.21% |

7.4.8.5 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 2015年01月01日至2015年12月31日 | | 上年度可比期间 2014年05月07日至2014年12月31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 | 1,658,436,488.13 | 13,387,238.35 | 63,000,527.19 | 777,526.83 |

注：本基金的银行存款由基金托管人广发银行保管，按银行同业利率计息。

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2015年12月31日的相关余额为人民币元1,813,569.96元(2014年12月31日：人民币1,626,909.84元)。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未参与关联方承销证券的买卖。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

7.4.9 期末（2015年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 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

| 7.4.12.1.1 受限证券类别： | | | | | | | | | |
|--------------------|------|------------|------------|--------|------|--------|----------|-----------|-----------|
| 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 |
| 002778 | 高科石化 | 2015-12-28 | 2016-01-06 | 公开发行 | 8.50 | 8.50 | 5,600 | 47,600.00 | 47,600.00 |

注：根据《证券发行与承销管理办法(2012年修订)》，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。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。基金通过网上申购获配的新股，从新股获配日至该新股上市日期间，为流通受限制而不能自由转让的资产。此外，基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起12个月内不得转让。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

| 股票代码 | 股票名称 | 停牌日期 | 停牌原因 | 期末估值单价 | 复牌日期 | 复牌开盘单价 | 数量（股） | 期末成本总额 | 期末估值总额 |
|--------|------|------------|--------|--------|------|--------|--------|------------|------------|
| 000002 | 万科A | 2015-12-18 | 重大资产重组 | 24.43 | | | 34,700 | 483,718.00 | 847,721.00 |

注：本基金截至2015年12月31日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

于2015年12月31日，本基金未持有正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

§8 投资组合报告

8.1 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 | 16,166,815.84 | 0.54 |
| | 其中：股票 | 16,166,815.84 | 0.54 |
| 2 | 固定收益投资 | — | — |
| | 其中：债券 | — | — |
| | 资产支持证券 | — | — |
| 3 | 贵金属投资 | — | — |
| 4 | 金融衍生品投资 | — | — |
| 5 | 买入返售金融资产 | 800,000,000.00 | 26.87 |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | — | — |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计 | 2,159,048,657.35 | 72.52 |
| 7 | 其他各项资产 | 2,150,388.33 | 0.07 |
| 8 | 合计 | 2,977,365,861.52 | 100.00 |

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别 | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|--------------|---------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | 1,005,480.00 | 0.05 |
| B | 采矿业 | — | — |
| C | 制造业 | 4,685,145.27 | 0.22 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | — | — |
| E | 建筑业 | 1,571,551.95 | 0.07 |
| F | 批发和零售业 | 222,304.44 | 0.01 |
| 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 | 5,843,229.18 | 0.27 |

| | | | |
|---|---------------|---------------|------|
| J | 金融业 | 1,991,384.00 | 0.09 |
| K | 房地产业 | 847,721.00 | 0.04 |
| 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 | 16,166,815.84 | 0.75 |

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------|--------------|--------------|
| 1 | 601398 | 工商银行 | 434,800 | 1,991,384.00 | 0.09 |
| 2 | 000423 | 东阿阿胶 | 30,300 | 1,584,690.00 | 0.07 |
| 3 | 002230 | 科大讯飞 | 38,500 | 1,426,425.00 | 0.07 |
| 4 | 603508 | 思维列控 | 14,605 | 1,136,853.20 | 0.05 |
| 5 | 002458 | 益生股份 | 26,600 | 1,005,480.00 | 0.05 |
| 6 | 300075 | 数字政通 | 31,700 | 993,795.00 | 0.05 |
| 7 | 002123 | 荣信股份 | 38,100 | 977,265.00 | 0.05 |
| 8 | 300496 | 中科创达 | 6,560 | 918,465.60 | 0.04 |
| 9 | 000002 | 万科A | 34,700 | 847,721.00 | 0.04 |
| 10 | 002781 | 奇信股份 | 21,600 | 807,192.00 | 0.04 |

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于长安基金管理有限公司网站（<http://www.changanfunds.com>）的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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 | 601211 | 国泰君安 | 162,116,259.38 | 60.24 |
| 2 | 600000 | 浦发银行 | 101,187,022.22 | 37.60 |
| 3 | 601988 | 中国银行 | 88,648,703.00 | 32.94 |
| 4 | 600016 | 民生银行 | 82,318,189.58 | 30.59 |
| 5 | 601985 | 中国核电 | 32,649,100.17 | 12.13 |
| 6 | 600028 | 中国石化 | 26,074,476.67 | 9.69 |
| 7 | 601088 | 中国神华 | 17,406,393.53 | 6.47 |
| 8 | 600399 | 抚顺特钢 | 15,073,589.21 | 5.60 |
| 9 | 600837 | 海通证券 | 13,288,551.40 | 4.94 |
| 10 | 600030 | 中信证券 | 12,332,538.00 | 4.58 |
| 11 | 600219 | 南山铝业 | 11,669,973.00 | 4.34 |
| 12 | 600787 | 中储股份 | 9,486,411.00 | 3.53 |
| 13 | 600316 | 洪都航空 | 7,510,146.00 | 2.79 |
| 14 | 002458 | 益生股份 | 7,397,696.00 | 2.75 |
| 15 | 600315 | 上海家化 | 7,215,000.00 | 2.68 |
| 16 | 300245 | 天玑科技 | 6,935,000.00 | 2.58 |
| 17 | 002491 | 通鼎互联 | 6,885,622.00 | 2.56 |
| 18 | 600125 | 铁龙物流 | 6,588,563.00 | 2.45 |
| 19 | 601398 | 工商银行 | 6,340,080.00 | 2.36 |
| 20 | 600685 | 中船防务 | 6,180,560.00 | 2.30 |
| 21 | 002520 | 日发精机 | 5,703,315.00 | 2.12 |
| 22 | 000001 | 平安银行 | 5,539,343.58 | 2.06 |

注：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。

8.4.2 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 | 601211 | 国泰君安 | 213,041,249.71 | 79.17 |

| | | | | |
|----|--------|------|----------------|-------|
| 2 | 601985 | 中国核电 | 130,147,281.10 | 48.36 |
| 3 | 600000 | 浦发银行 | 111,854,968.13 | 41.57 |
| 4 | 601988 | 中国银行 | 91,592,610.00 | 34.04 |
| 5 | 600016 | 民生银行 | 80,934,927.44 | 30.08 |
| 6 | 601088 | 中国神华 | 30,138,492.79 | 11.20 |
| 7 | 600028 | 中国石化 | 25,138,637.97 | 9.34 |
| 8 | 002496 | 辉丰股份 | 19,090,190.52 | 7.09 |
| 9 | 002023 | 海特高新 | 17,128,223.36 | 6.36 |
| 10 | 300178 | 腾邦国际 | 16,035,827.18 | 5.96 |
| 11 | 600399 | 抚顺特钢 | 15,311,106.52 | 5.69 |
| 12 | 600316 | 洪都航空 | 15,081,895.66 | 5.60 |
| 13 | 601668 | 中国建筑 | 14,509,985.56 | 5.39 |
| 14 | 600837 | 海通证券 | 13,438,047.79 | 4.99 |
| 15 | 600219 | 南山铝业 | 11,279,150.42 | 4.19 |
| 16 | 600030 | 中信证券 | 10,459,780.19 | 3.89 |
| 17 | 002292 | 奥飞动漫 | 10,427,562.79 | 3.87 |
| 18 | 600787 | 中储股份 | 10,157,369.52 | 3.77 |
| 19 | 000001 | 平安银行 | 7,776,226.00 | 2.89 |
| 20 | 600818 | 中路股份 | 7,149,885.40 | 2.66 |
| 21 | 002520 | 日发精机 | 7,088,071.67 | 2.63 |
| 22 | 600315 | 上海家化 | 7,050,366.89 | 2.62 |
| 23 | 002458 | 益生股份 | 6,685,521.00 | 2.48 |
| 24 | 600125 | 铁龙物流 | 6,682,214.48 | 2.48 |
| 25 | 300245 | 天玑科技 | 6,636,564.91 | 2.47 |
| 26 | 300463 | 迈克生物 | 6,523,862.00 | 2.42 |
| 27 | 002491 | 通鼎互联 | 6,194,963.00 | 2.30 |
| 28 | 600685 | 中船防务 | 6,020,013.00 | 2.24 |
| 29 | 603567 | 珍宝岛 | 5,925,768.00 | 2.20 |
| 30 | 600547 | 山东黄金 | 5,394,633.91 | 2.00 |

注：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。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

| | |
|--------------|------------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 873,781,302.12 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 1,183,691,862.83 |

注：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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

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

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

8.8 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。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未进行股指期货交易。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未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。

8.12.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 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 | 1,201,400.74 |
| 2 | 应收证券清算款 | — |
| 3 | 应收股利 | — |
| 4 | 应收利息 | 926,022.07 |
| 5 | 应收申购款 | 22,965.52 |
| 6 | 其他应收款 | — |
| 7 | 待摊费用 | — |
| 8 | 其他 | — |
| 9 | 合计 | 2,150,388.33 |

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|-------------|---------------|----------|
| 1 | 000002 | 万科A | 847,721.00 | 0.04 | 重大事项 |

8.12.6 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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 |
| 长安产业精选混合A | 599 | 67,203.58 | 27,346,586.47 | 67.93% | 12,908,355.32 | 32.07% |
| 长安产业精选混合C | 33 | 61,938,910.99 | 2,042,593,613.63 | 99.93% | 1,390,449.07 | 0.07% |
| 合计 | 632 | 3,297,846.53 | 2,069,940,200.10 | 99.31% | 14,298,804.39 | 0.69% |

9.2 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 | 长安产业精选混合A | 127,010.74 | 0.32% |
| | 长安产业精选混合C | 11,661.68 | — |

| | | | |
|--|----|------------|-------|
| | 合计 | 138,672.42 | 0.01% |
|--|----|------------|-------|

9.3 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 | 长安产业精 选混合A | 0~10 |
| | 长安产业精 选混合C | |
| | 合计 | 0~10 |
| 本基金基金经理持有本开放 式基金 | 长安产业精 选混合A | 0~10 |
| | 长安产业精 选混合C | |
| | 合计 | 0~10 |

9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目 | 持有份额总数 | 持有份 额占基 金总份 额比例 | 发起份额总 数 | 发起份额占 基金总份额 比例 | 发起份额承 诺持有期限 |
|-----------------|---------------|--------------------------|---------------|----------------------|----------------|
| 基金管理人固有资 金 | 10,001,400.00 | 0.48% | 10,001,400.00 | 4.12% | 3年 |
| 基金管理人高级管 理人员 | 3,786.06 | — | — | — | |
| 基金经理等人员 | 9,881.42 | — | — | — | |
| 基金管理人股东 | — | — | — | — | |
| 其他 | — | — | — | — | |
| 合计 | 10,011,284.24 | 0.48% | 10,001,400.00 | 4.12% | 3年 |

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

| | | |
|--|-----------|-----------|
| | 长安产业精选混合A | 长安产业精选混合C |
|--|-----------|-----------|

| | | |
|--------------------------------|-------------------|------------------|
| 基金合同生效日(2014年05月07日) 基金份额总额 | 341,643,228.06 | — |
| 本报告期期初基金份额总额 | 242,671,742.08 | — |
| 本报告期期间基金总申购份额 | 10,968,150,595.51 | 2,400,543,963.65 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 11,170,567,395.80 | 356,559,900.95 |
| 本报告期期间基金拆分变动份额 | — | — |
| 本报告期期末基金份额总额 | 40,254,941.79 | 2,043,984,062.70 |

注：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。

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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

一、报告期内基金管理人发生以下重大人事变动：

1、2015年3月11日，在《上海证券报》上刊登了《长安基金管理有限公司关于由黄陈代为履行公司督察长职务的公告》，同意袁明辞去督察长职务，由总经理黄陈代行公司督察长职务。

2、2015年6月27日，在《上海证券报》上刊登了《长安基金管理有限公司督察长刘玉生任职公告》，同意刘玉生担任公司督察长职务，总经理黄陈不再代行公司督察长职务。

二、报告期内基金托管人发生如下重大变动：

本报告期内，基金托管人于2015年2月10日发布公告，聘任蒋柯先生担任本行资产托管部副总经理。相关变更事项已按规定向中国基金业协会办理相关手续并向中国证监会和上海证监局报告。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 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,本基金报告年度应支付给毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)的报酬为人民币陆万元整。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况

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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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 | 占股票成交总额比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 中信建投 | 1 | 1,466,903,988.24 | 77.47% | 1,339,323.87 | 77.36% | |
| 中信证券 | 1 | 395,576,674.16 | 20.89% | 363,144.32 | 20.97% | |
| 兴业证券 | 1 | 16,030,251.91 | 0.85% | 14,929.01 | 0.86% | |
| 东兴证券 | 1 | 14,972,003.25 | 0.79% | 13,943.42 | 0.81% | |

注: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,兴业证券和东兴证券为本基金本期新增交易单元,无剔除的交易单元。

11.7.2 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 | |
|------|------|-----------|--------|-------------|------|-----------|
| | 成交金额 | 占债券成交总额比例 | 成交金额 | 占债券回购成交总额比例 | 成交金额 | 占权证成交总额比例 |
| | | | | | | |

| | | | | | | |
|------|--|---|-----------------------|--------|--|---|
| 中信建投 | | — | 19,166,500 .000.00 | 95.99% | | — |
| 中信证券 | | — | 1,000.00 | — | | — |
| 兴业证券 | | — | | — | | — |
| 东兴证券 | | — | 800,000,00 0.00 | 4.01% | | — |

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

长安基金管理有限公司于2015年3月7日在指定报刊和网站上披露了关于变更注册资本和股权的公告。经长安基金管理有限公司（以下简称“本公司”）股东会审议通过，并经中国证券监督管理委员会证监许可[2015]248号文批复同意，本公司注册资本由2亿元增加到2.7亿元，上海景林投资发展有限公司认购出资7000万元。本次注册资本变更后，本公司的股东及股权比例为：长安国际信托股份有限公司持有本公司全部股权的29.63%，上海景林投资发展有限公司持有本公司全部股权的25.93%，上海恒嘉美联发展有限公司持有本公司全部股权的24.44%，五星控股集团有限公司持有本公司全部股权的13.33%，兵器装备集团财务有限责任公司持有本公司全部股权的6.67%。公司章程已随公司变更注册资本和股权进行了相应的修改。目前，本次变更注册资本和股权的相关工商变更登记手续已办理完毕。

长安基金管理有限公司
二〇一六年三月二十六日