

长安沪深300非周期行业指数证券投资基金2016年半年度报告摘要

2016年6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：2016年8月25日

## § 1 重要提示

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。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2016年8月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经会计师事务所审计。

本报告期自2016年1月1日起至6月30日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	长安沪深300非周期行业指数证券投资基金
基金简称	长安沪深300非周期
基金主代码	740101
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年6月25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	57,513,574.43份

### 2.2 基金产品说明

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。
投资策略	本基金采用完全复制方法跟踪标的指数，即按照沪深300非周期行业指数的成分股组成及权重构建股票投资组合，进行被动指数化投资。
业绩比较基准	沪深300非周期行业指数收益率*95%+活期存款利率（税后）*5%
风险收益特征	本基金为跟踪指数的股票型基金，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，属于证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。

### 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	021-20329761
	电子邮箱	liyongbo@changanfunds.com
		李春磊
		010-65169830
		lichunlei@cgbchina.com.cn

客户服务电话	400-820-9688	010-65169830
传真	021-50598018	010-65169555

## 2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.changanfunds.com">http://www.changanfunds.com</a>
基金半年度报告备置地点	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（2016年1月1日至2016年6月30日）
本期已实现收益	-1,775,705.70
本期利润	-13,740,967.98
加权平均基金份额本期利润	-0.2238
本期加权平均净值利润率	-18.66%
本期基金份额净值增长率	-14.80%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2016年6月30日）
期末可供分配利润	13,334,665.03
期末可供分配基金份额利润	0.2319
期末基金资产净值	70,848,239.46
期末基金份额净值	1.232
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2016年6月30日）
基金份额累计净值增长率	32.25%

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。

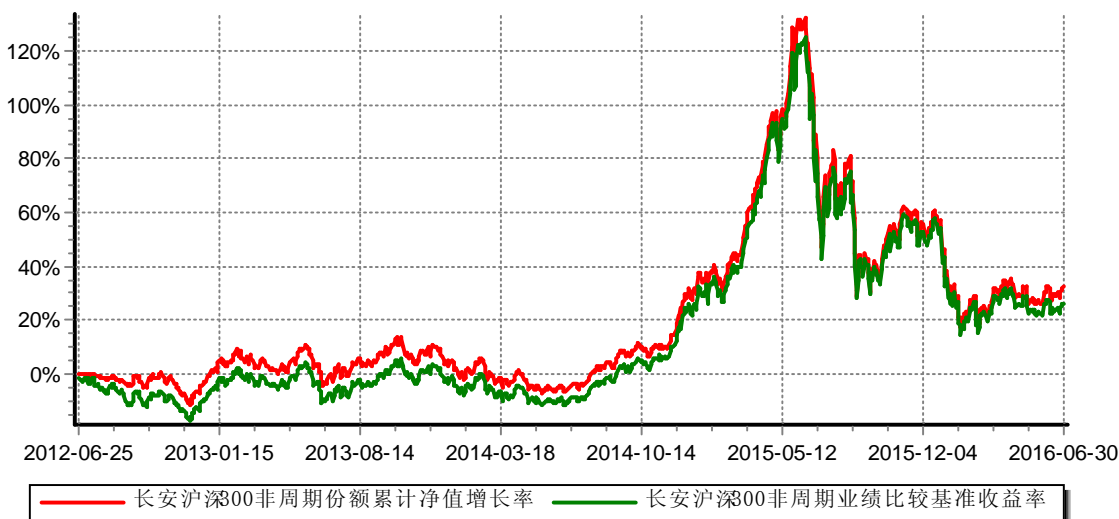
### 3.2 基金净值表现

### 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	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	1.82%	1.18%	0.52%	1.16%	1.30%	0.02%
过去三个月	-0.16%	1.17%	-2.33%	1.16%	2.17%	0.01%
过去六个月	-14.80%	1.95%	-17.14%	1.96%	2.34%	-0.01%
过去一年	-30.00%	2.48%	-30.89%	2.43%	0.89%	0.05%
过去三年	36.76%	1.93%	39.83%	1.84%	-3.07%	0.09%
自基金合同生效日起至今（2012年06月25日-2016年06月30日）	32.25%	1.75%	26.33%	1.69%	5.92%	0.06%

注：本基金的业绩比较基准为：沪深300非周期行业指数收益率\*95%+活期存款利率（税后）\*5%

### 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：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。图示日期为2012年6月25日至2016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、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5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。

#### 3、长安产业精选灵活配置混合型发起式证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

成立日期：2014年5月7日

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。

#### 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。

#### 5、长安鑫益增强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：2016年2月22日

投资目标：在严格控制风险和保持流动性的前提下，通过动态配置固定收益类和权

益类资产，追求超越业绩比较基准的投资回报和长期稳健增值。

#### 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	2015年1月27日	—	6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遵规守信情况的说明

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

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的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

在本报告期内，作为被动型指数基金，长安沪深300非周期行业指数基金严格恪守本基金的投资理念和投资目标，努力实现对基准的有效跟踪。影响本基金的跟踪效果的因素主要来源于基金份额的申购赎回、样本股调整的冲击以及样本股分红等。本基金在运作期间，基金管理人按照基金合同的要求，遵循指数化投资策略，并适当采用指数增强策略，努力降低基金的跟踪误差。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2016年6月30日，本基金份额净值为1.232元，累计单位净值为1.307元。报告期内，本基金份额净值增长率为-14.80%，同期业绩基准增长率为-17.14%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金为被动式指数型基金，基金管理人将按照基金合同的要求，坚持指数化投资策略，通过运用定量分析的方法，分析和应对影响本基金跟踪误差的因素，努力将基金的跟踪误差控制在较低水平。

## 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，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。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金于2012年6月25日成立,根据《基金合同》有关规定“本基金收益每年最多分配12次,每次基金收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的20%”。本报告期内未进行收益分配。

#### 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

本基金未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”)在对长安沪深300非周期行业指数证券投资基金(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 托管人对本半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 半年度财务会计报告(未经审计)

#### 6.1 资产负债表

会计主体：长安沪深300非周期行业指数证券投资基金

报告截止日：2016年6月30日

单位：人民币元

资 产	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
<b>资 产：</b>		
银行存款	6,496,681.89	8,603,172.39
结算备付金	—	84,977.94
存出保证金	12,954.67	36,616.69
交易性金融资产	65,707,101.51	83,690,923.36
其中：股票投资	65,707,101.51	83,690,923.36
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	—	—
应收证券清算款	—	—
应收利息	1,683.99	2,134.48
应收股利	—	—
应收申购款	—	9,852.22
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	72,218,422.06	92,427,677.08
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2016年6月30日</b>	<b>上年度末 2015年12月31日</b>
<b>负 债：</b>		
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	—	—
应付赎回款	157,454.60	23,549.22
应付管理人报酬	57,676.83	77,941.58
应付托管费	8,651.53	11,691.25
应付销售服务费	—	—
应付交易费用	34,487.44	24,259.69
应交税费	—	—
应付利息	—	—
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	1,111,912.20	1,198,778.18
负债合计	1,370,182.60	1,336,219.92
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	57,513,574.43	63,008,586.08
未分配利润	13,334,665.03	28,082,871.08
所有者权益合计	70,848,239.46	91,091,457.16
负债和所有者权益总计	72,218,422.06	92,427,677.08

注：报告截止日2016年6月30日，基金份额净值1.232元，基金份额总额57,513,574.43份。

## 6.2 利润表

会计主体：长安沪深300非周期行业指数证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年6月30日

单位：人民币元

项目	本期2016年1月1日至2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日
一、收入	-13,075,515.80	28,327,612.32
1. 利息收入	26,546.91	25,257.82
其中：存款利息收入	26,546.91	25,257.82
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	—	—
其他利息收入	—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-1,153,734.31	22,424,271.18
其中：股票投资收益	-1,665,233.79	21,893,724.71
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	511,499.48	530,546.47
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-11,965,262.28	5,681,026.44
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	16,933.88	197,056.88
<b>减：二、费用</b>	<b>665,452.18</b>	<b>846,968.04</b>
1. 管理人报酬	366,956.03	400,052.01
2. 托管费	55,043.38	60,007.74
3. 销售服务费	—	—
4. 交易费用	30,810.64	220,224.48
5. 利息支出	—	—
其中：卖出回购金融资产支出	—	—
6. 其他费用	212,642.13	166,683.81
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>-13,740,967.98</b>	<b>27,480,644.28</b>
减：所得税费用	—	—

四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-13,740,967.98	27,480,644.28
-------------------	----------------	---------------

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长安沪深300非周期行业指数证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6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)	63,008,586.08	28,082,871.08	91,091,457.16
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	-13,740,967.98	-13,740,967.98
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)	-5,495,011.65	-1,007,238.07	-6,502,249.72
其中：1. 基金申购款	6,671,604.50	1,377,570.65	8,049,175.15
2. 基金赎回款	-12,166,616.15	-2,384,808.72	-14,551,424.87
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)	—	—	—
五、期末所有者权益(基金净值)	57,513,574.43	13,334,665.03	70,848,239.46
项目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6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)	44,936,569.95	10,045,786.34	54,982,356.29
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	27,480,644.28	27,480,644.28
三、本期基金份额交易产生的	5,762,648.90	996,933.13	6,759,582.03

基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	100,666,035.55	72,633,458.94	173,299,494.49
2. 基金赎回款	-94,903,386.65	-71,636,525.81	-166,539,912.46
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)	50,699,218.85	38,523,363.75	89,222,582.60

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：

黄陈

李卫

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

长安沪深300非周期行业指数基金(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”)《关于核准长安沪深300非周期行业指数基金募集的批复》(证监许可[2012]130号文)批准,由长安基金管理有限公司(以下称“长安基金公司”)依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《长安沪深300非周期行业指数基金基金合同》于2012年5月14日至2012年6月20日公开发售,募集资金总额人民币277,132,832.76元,其中扣除认购费后的有效认购资金人民币277,072,819.54元,有效认购资金在募集期间产生利息人民币60,013.22元,共折合277,132,832.76份基金份额。上述募集资金已经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了KPMG-B(2012)CRNo.0049号验资报告。基金为契约型开放式基金,存续期限不定,基金合同于2012年6月25日生效。本基金的基金管理人为长安基金公司,基金托管人为广发银行股份有限公司(以下称“广发银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《长安沪深300非周期行业指数基金基金合同》和《长安沪深300非周期行业指数基金招募说明书》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,包括沪深300非周期行业指数的成分股及其备选成分股(包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票)、新股(一级市场初次发行和增发)、债券、回购、货币市场工具、银行存款、权证、资产支持证券、股指期货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。本基金投资组

合的比例范围为：沪深300非周期行业指数成分股及其备选成分股的投资比例不低于基金资产的90%，在任何交易日日终持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和不超过基金资产净值的100%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，权证占基金资产净值的比例为0-3%，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非周期行业指数，现金或者到期日在一年以内的政府债券投资部分为活期存款利率(税后)，复合业绩比较基准为：沪深300非周期行业指数收益率×95%+活期存款利率(税后)×5%。

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。

#### 6.4.2 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。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2016年6月30日的财务状况、自2016年1月1日至2016年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

##### 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2016年1月1日至2016年6月30日止。

##### 6.4.4.2 记账本位币

人民币

##### 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。

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。

#### 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。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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。

#### 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。

#### 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，并于年末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

#### 6.4.4.9 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。

存款利息收入按存款本金与适用利率逐日计提。

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。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

根据《长安沪深300非周期行业指数基金基金合同》的规定,基金管理人报酬按前一日基金资产净值1.00%的年费率逐日计提。

根据《长安沪深300非周期行业指数基金基金合同》的规定,基金托管费按前一日基金资产净值0.15%的年费率逐日计提。

本基金的交易费用用于进行股票、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三位,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三位的,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《长安沪深300非周期行业指数基金基金合同》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12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20%;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。

#### 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并披露分部信息。

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

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于特殊事项停牌股票，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》，本基金参考《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》对重大影响基金资产净值的特殊事项停牌股票进行估值。

对于在锁定期内的非公开发行股票，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。

在银行间同业市场交易的债券品种，根据《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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

#### 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

根据估值处理标准，本基金自2015年3月26日起，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。于2015年3月26日，相关调整对前一估值日基金资产净值的影响不超过0.50%。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本年度未发生过重大会计差错。

### 6.4.6.1 关联方报酬

#### 6.4.6.1.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6 月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6 月30日
当期发生的基金应支付的管 理费	366,956.03	400,052.01
其中：支付销售机构的客户维 护费	122,893.82	90,347.45

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1.0%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×1.0%/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。

#### 6.4.6.1.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6 月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6 月30日
当期发生的基金应支付的托 管费	55,043.38	60,007.74

注：支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值0.15%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×0.15%/当年天数。

### 6.4.6.2 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

### 6.4.6.3 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.6.3.1 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：份

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年1月1日至2015年6月30日
期初持有的基金份额	6,608,724.39	—
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	6,608,724.39	—
期末持有的基金份额占基金总份额比例	11.49%	—

#### 6.4.6.3.2 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：份

关联方名称	本期末		上年度末	
	2016年6月30日		2015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
长安基金公司高级管理人员	524,841.70	0.74%	743,889.02	1.18%

#### 6.4.6.4 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		上年度可比期间	
	2016年1月1日至2016年6月30日		2015年1月1日至2015年6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	6,496,681.89	26,198.36	6,126,862.83	24,053.02

注：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和存出保证金，于2016年6月30日的相关余额为人民币12954.67元。

#### 6.4.6.5 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未参与关联方承销证券的买卖。

#### 6.4.6.6 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。

#### 6.4.7 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.8 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.8.1 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

6.4.8.1.1 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	期末成本总额	期末估值总额
002805	丰元股份	2016-06-29		非公开发行	5.8	5.8	817	4,738.6	4,738.6
300520	科大国创	2016-06-30		非公开发行	10.05	10.05	476	4,783.8	4,783.8
603016	宏泰申购	2016-06-23		非公开发行	8.49	8.49	610	5,178.9	5,178.9

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，为流动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。

##### 6.4.8.2 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	期末成本总额	期末估值总额
601611	中国核建	2016-06-30	股票价格异常波动	20.92	2016-06-30	23.01	2,016	6,995.52	42,174.72
000415	渤海金控	2016-02-01	公司重大事项	6.82	2016-08-11	7.50	34,000	293,568.00	231,880.00
000651	格力电器	2016-02-22	公司重大事项	22.04		—	87,302	1,731,559.05	1,924,136.08
002065	东华软件	2015-12-21	公司重大事项	25.10	2016-07-04	22.59	13,663	350,574.62	342,941.30
002129	中环股份	2016-04-25	公司重大事项	8.29		—	21,996	313,756.33	182,346.84
002465	海格通信	2016-06-13	公司重大事项	12.44		—	28,160	375,360.08	350,310.40

注：本基金截至2016年6月30日止持有以上因公布的重大事项等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。

### 6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.8.3.2 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。

## §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（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	65,707,101.51	90.98
	其中：股票	65,707,101.51	90.98
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	—	—
	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	6,496,681.89	9.00
7	其他资产	14,638.66	0.02
8	合计	72,218,422.06	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末指数投资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	113,247.81	0.16
B	采矿业	—	—
C	制造业	39,549,543.24	55.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,102,995.03	7.20
E	建筑业	4,435,731.42	6.26
F	批发和零售业	2,817,190.79	3.98
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	7,906,774.26	11.16
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	1,623,282.37	2.29
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	954,813.33	1.35
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	217,316.97	0.31
R	文化、体育和娱乐业	2,004,644.37	2.83
S	综合	622,761.44	0.88
	合计	65,348,301.03	92.24

### 7.2.2 报告期末积极投资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	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	288,839.50	0.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—



E	建筑业	42,174.72	0.06
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	18,651.40	0.03
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	9,134.86	0.01
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	358,800.48	0.51

注：本基金本报告期末未持有积极投资股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

#### 7.3.1 期末指数投资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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	7,968	2,326,018.56	3.28
2	000651	格力电器	87,302	1,924,136.08	2.72
3	600887	伊利股份	97,802	1,630,359.34	2.30
4	601766	中国中车	148,061	1,357,719.37	1.92
5	600900	长江电力	104,508	1,305,304.92	1.84
6	601668	中国建筑	241,098	1,282,641.36	1.81
7	600104	上汽集团	59,941	1,216,202.89	1.72
8	000333	美的集团	49,867	1,182,845.24	1.67

9	000858	五 粮 液	30,082	978,567.46	1.38
10	601989	中国重工	148,115	937,567.95	1.32

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票信息，应阅读登载于<http://www.changanfunds.com>网站的半年度报告正文。

### 7.3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	002798	帝王洁具	536	46,471.20	0.07
2	603737	三棵树	389	45,155.12	0.06
3	300516	久之洋	253	44,318.01	0.06
4	601611	中国核建	2,016	42,174.72	0.06
5	603131	上海沪工	581	35,266.70	0.05

### 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	600900	长江电力	380,127.00	0.42
2	000839	中信国安	325,586.00	0.36
3	002183	怡 亚 通	267,691.00	0.29
4	600074	保千里	216,216.00	0.24
5	000977	浪潮信息	210,641.99	0.23
6	002152	广电运通	208,136.96	0.23
7	600166	福田汽车	192,562.00	0.21
8	600737	中粮屯河	180,964.00	0.20
9	600519	贵州茅台	170,543.00	0.19
10	600704	物产中大	165,600.00	0.18
11	600887	伊利股份	162,078.00	0.18
12	600037	歌华有线	161,282.00	0.18

13	000651	格力电器	157,029.00	0.17
14	002027	分众传媒	138,506.00	0.15
15	601766	中国中车	135,360.00	0.15
16	600666	奥瑞德	123,696.00	0.14
17	600104	上汽集团	113,535.00	0.12
18	601668	中国建筑	105,288.00	0.12
19	601989	中国重工	101,747.00	0.11
20	000333	美的集团	95,137.00	0.10

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。

#### 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	600166	福田汽车	345,244.84	0.38
2	600519	贵州茅台	327,956.94	0.36
3	600637	东方明珠	321,886.70	0.35
4	600315	上海家化	261,856.60	0.29
5	000839	中信国安	256,033.47	0.28
6	002024	苏宁云商	247,957.00	0.27
7	002792	通宇通讯	246,510.81	0.27
8	601766	中国中车	226,725.00	0.25
9	601238	广汽集团	219,826.00	0.24
10	002791	坚朗五金	211,363.60	0.23
11	002038	双鹭药业	208,236.12	0.23
12	600104	上汽集团	198,714.00	0.22
13	600887	伊利股份	194,867.00	0.21
14	601668	中国建筑	193,581.00	0.21
15	000333	美的集团	177,338.00	0.19
16	000598	兴蓉环境	170,969.58	0.19
17	000581	威孚高科	170,541.64	0.19

18	000400	许继电气	168,757.50	0.19
19	002353	杰瑞股份	165,028.42	0.18
20	600633	浙报传媒	158,657.70	0.17

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。

#### 7.4.3 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

买入股票的成本（成交）总额	7,374,190.58
卖出股票的收入（成交）总额	11,727,962.76

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。

#### 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 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。

## 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

### 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	12,954.67
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	1,683.99
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	14,638.66

### 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

#### 7.12.5.1 期末指数投资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	000651	格力电器	1,924,136.08	2.72	公司重大事项

#### 7.12.5.2 期末积极投资前五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	601611	中国核建	42,174.72	—	股票价格异常波动

### 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

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
1,638	35,112.07	6,915,097.30	12.02%	50,598,477.13	87.98%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	852,484.90	1.48%

### 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	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	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2012年6月25日)基金份额总额	277,132,832.76
本报告期期初基金份额总额	63,008,586.08
本报告期基金总申购份额	6,671,604.50
减：本报告期基金总赎回份额	12,166,616.15
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	57,513,574.43

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。

## § 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

一、报告期内基金管理人发生以下重大人事变动：

1、2016年4月2日，在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》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》，同意刘玉生辞去督察长职务，由总经理黄陈代行公司督察长职务。

2、2016年6月8日，在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》上刊登了《长安基金管理有限公司督察长李永波任职公告》，同意李永波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以下重大人事变动：

1、本报告期内，寻卫国先生不再担任基金托管人资产托管部总经理职务，蒋柯先生临时主持部门工作。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报告。

### 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,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。

## 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

2015年5月至7月,中国证监会上海证监局对公司进行了现场检查。针对现场检查中发现问题,上海证监局于2015年10月19日出具了《关于对长安基金管理有限公司采取责令改正措施的决定》,并对公司相关负责人出具警示函。公司非常重视监管部门的决定,成立了公司专项整改工作领导小组和工作小组,已根据相关法律、行政法规和中国证监会的要求于2015年度落实整改。除上述情况外,本报告期内,基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

## 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比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东兴证券	1	6,227,562.48	33.29%	5,799.91	2.01%	—
民生证券	1	3,818,172.34	20.41%	3,555.85	1.23%	—
兴业证券	1	4,693,585.68	25.09%	4,371.18	1.52%	—
中信证券	1	3,968,710.24	21.21%	3,696.08	1.28%	—

注:1、基金租用席位的选择标准是:

- (1) 资质雄厚,信誉良好;
- (2) 财务状况良好,各项财务指标显示公司经营状况稳定;
- (3) 经营行为规范,在最近一年内无重大违规经营行为;
- (4) 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;
- (5) 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，本基金本期无新增的交易单元，无剔除的交易单元。

长安基金管理有限公司

二〇一六年八月二十五日