

长安鑫益增强混合型证券投资基金2016年年度报告

2016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

送出日期：2017年03月28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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年03月27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。

本报告中财务资料已经审计。

本报告期自2016年2月22日起至12月31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	7
2.4 信息披露方式	8
2.5 其他相关资料	8
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	9
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
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	14
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明	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	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
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	16
§6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
§7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	21
7.4 报表附注	22
§8 投资组合报告	47
8.1 期末基金资产组合情况	47
8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合	48
8.3 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	48
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	49
8.5 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	52
8.6 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	52
8.7 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	52
8.8 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	52
8.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	52
8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	52
8.11 投资组合报告附注	53
§9 基金份额持有人信息	54
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	54
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	54
§10 开放式基金份额变动	55

§11 重大事件揭示.....	55
11.1 基金份额持有人大会决议.....	55
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.....	55
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	56
11.4 基金投资策略的改变.....	56
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	56
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	56
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	56
11.8 其他重大事件.....	57
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	62
§13 备查文件目录.....	62
13.1 备查文件目录.....	62
13.2 存放地点.....	62
13.3 查阅方式.....	62

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	长安鑫益增强混合型证券投资基金	
基金简称	长安鑫益增强混合	
基金主代码	002146	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年02月22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	
报告期末基金份额总额	286,159,098.71份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	长安鑫益增强混合A	长安鑫益增强混合C
下属分级基金的交易代码	002146	002147
报告期末下属分级基金的份额总额	84,851,295.31份	201,307,803.40份

### 2.2 基金产品说明

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。
投资策略	<p>（一）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>（二）债券投资策略</p> <p>本基金将根据对经济周期和市场环境的把握，基于对财政政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济的持续跟踪，灵活运用期限结构策略、信用策略、互换策略、回购套利策略等多种投资策略，构建债券资产组合，并根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预测，</p>

动态调整债券投资组合。

### （三）股票投资策略

#### 1、新股申购策略

新股投资相对于二级市场股票投资，风险较低，同时预期收益高于固定收益类证券。

本基金管理人将全面深入地把握上市公司基本面，运用基金管理人的研究平台和股票估值体系，深入发掘并评估新股的内在价值，结合同类公司的市场估值水平和二级市场的发展情况，充分考虑中签率、锁定期等因素，有效识别并防范风险，并获取较好收益。

新股上市后，综合考虑其上市后的情况和本基金二级市场股票的投资策略，决定继续持有或卖出。

#### 2、二级市场股票投资策略

本基金二级市场股票投资以定性和定量分析为基础，从基本面分析入手。根据个股的估值水平优选个股，重点配置当前业绩优良、市场认同度较高、在可预见的未来其行业处于景气周期中且估值合理的股票。

### （四）金融衍生品投资策略

#### 1、股指期货投资策略

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，旨在通过股指期货实现基金的套期保值。

#### 2、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。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。

#### 3、权证投资策略

本基金对权证的投资以对冲下跌风险、实现保值和锁定收益为主要目的。本基金在权证投资中综合考虑股票合理价值、标的股票价格，结合权证定价模型、市

	场供求关系、交易制度设计等多种因素估计权证合理价值，采用杠杆交易策略、看跌保护组合策略、保护组合成本策略、获利保护策略、买入跨式投资等策略达到改善组合风险收益特征的目的。	
业绩比较基准	中债综合指数收益率*85%+沪深300指数收益率*15%	
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，属于较高风险、较高收益的投资品种。	
下属分级基金的风险收益特征	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，属于较高风险、较高收益的投资品种。	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，属于较高风险、较高收益的投资品种。

### 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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李永波	林葛
	联系电话	021-20329761	010-66060069
	电子邮箱	liyongbo@changanfunds.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-820-9688	95599
传真		021-20329888	010-68121816
注册地址		上海市虹口区丰镇路806号3幢371室	北京市东城区建国门内大街69号
办公地址		上海市浦东新区芳甸路1088号紫竹国际大厦16层	北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9
邮政编码		201204	100031
法定代表人		万跃楠	周慕冰

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金年度报告正文的 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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市南京西路1266号恒隆广场1期50楼
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、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	2016年	2016年
	长安鑫益增强混合A	长安鑫益增强混合C
本期已实现收益	4,217,348.71	6,494,620.16
本期利润	-4,986,624.75	-14,297,720.24
加权平均基金份额本期利润	-0.0390	-0.0562
本期加权平均净值利润率	-3.88%	-5.63%
本期基金份额净值增长率	-6.70%	-7.30%
3.1.2 期末数据和指标	2016年末	2016年末
期末可供分配利润	-5,699,750.52	-14,657,994.93
期末可供分配基金份额利润	-0.0672	-0.0728
期末基金资产净值	79,151,544.79	186,649,808.47
期末基金份额净值	0.9330	0.9270
3.1.3 累计期末指标	2016年末	2016年末
基金份额累计净值增长率	-6.70%	-7.30%



注：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。

### 3.2 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 (长安鑫益增强混合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	-8.26%	0.62%	-1.70%	0.19%	-6.56%	0.43%
过去六个月	-7.62%	0.47%	-0.45%	0.16%	-7.17%	0.31%
自基金合同生效日起至 至今（2016年02月22 日-2016年12月31日）	-6.70%	0.36%	-0.13%	0.19%	-6.57%	0.17%

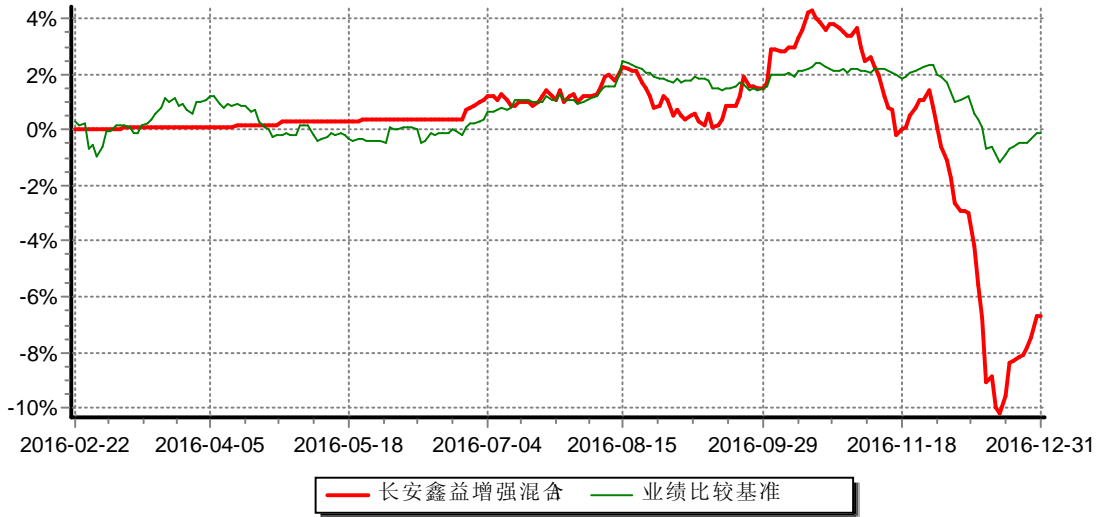
注：本基金整体业绩比较基准构成为：中债综合指数收益率\*85%+沪深300指数收益率\*15%

阶段 (长安鑫益增强混合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	-8.49%	0.62%	-1.70%	0.19%	-6.79%	0.43%
过去六个月	-7.94%	0.47%	-0.45%	0.16%	-7.49%	0.31%
自基金合同生效日起 至今（2016年02月22 日-2016年12月31日）	-7.30%	0.36%	-0.13%	0.19%	-7.17%	0.17%

注：本基金整体业绩比较基准构成为：中债综合指数收益率\*85%+沪深300指数收益率\*15%

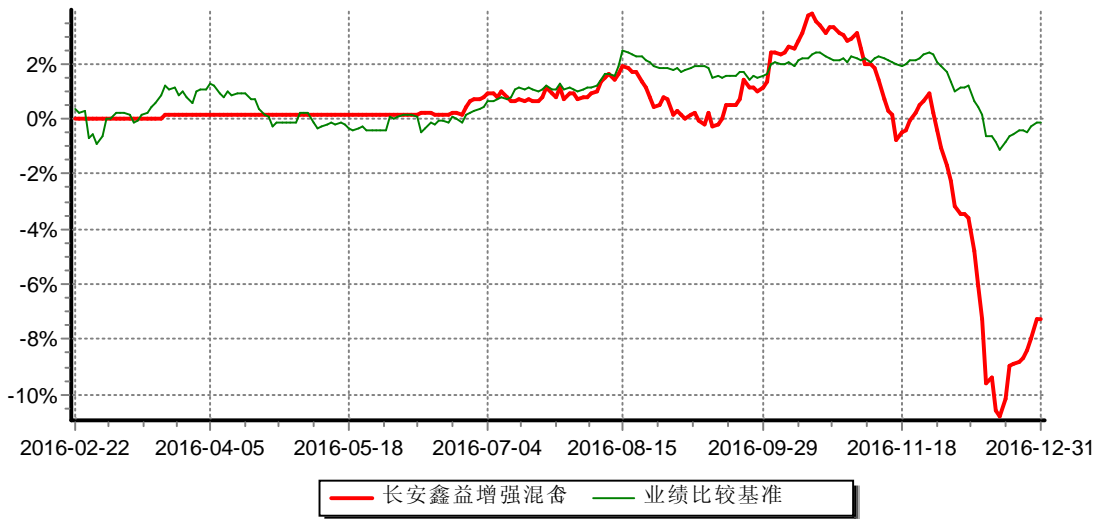
#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

长安鑫益增强混合A份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金基金合同生效日为2016年02月22日，基金合同生效日至报告期期末，本基金运作时间未满一年。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2016年02月22日至2016年12月31日。

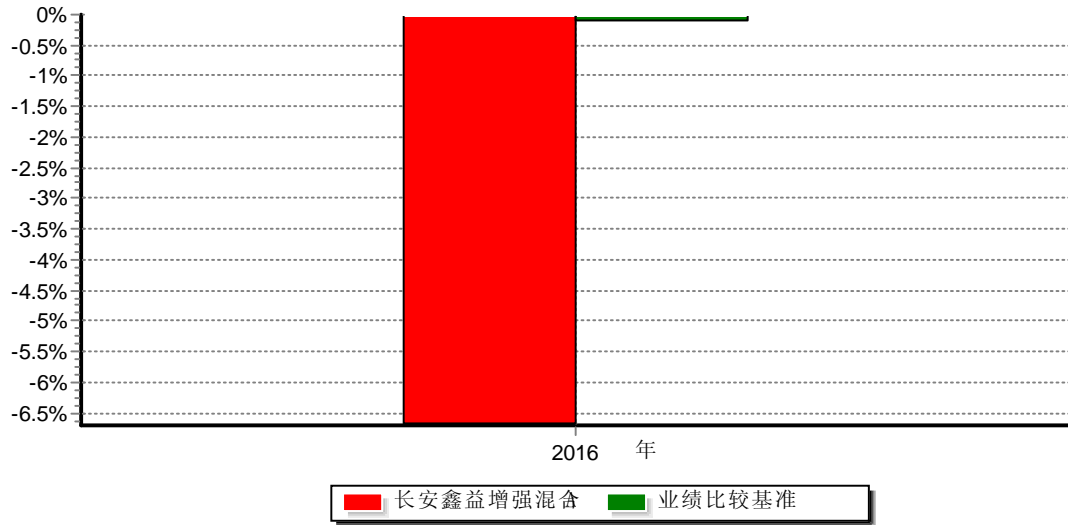
长安鑫益增强混合C份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金基金合同生效日为2016年02月22日，基金合同生效日至报告期期末，本基金运作时间未满一年。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2016年02月22日至2016年12月31日。

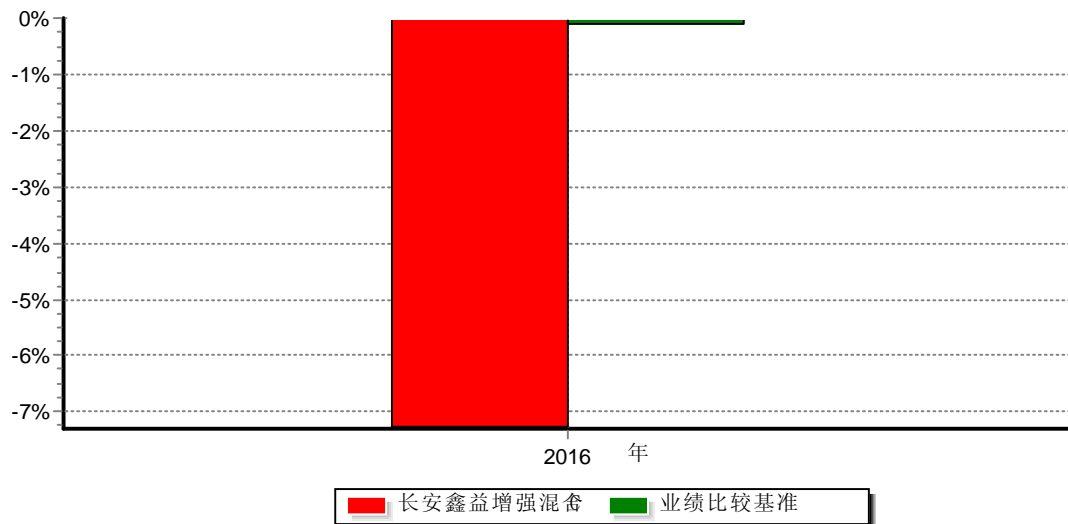
### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

长安鑫益增强混合A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对比图



注：本基金合同生效日为2016年2月22日，合同生效未满一年，当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

长安鑫益增强混合C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对比图



注：本基金合同生效日为2016年2月22日，合同生效未满一年，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

本基金合同生效日为2016年2月22日，本报告期末进行利润分配。

## § 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6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。

##### 5、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。

##### 6、长安泓泽纯债债券型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

成立日期：2016年11月16日

投资目标：在严格控制风险的前提下，通过积极主动的投资管理，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（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
乔哲	本基金的基金经理	2016年02月22日	—	20年	山东大学工商管理硕士学位，曾任中国农业发展银行山东省分行资金计划处资金科科长、中国农业发展银行总行资金计划部债券发行与资金交易负责人、东亚银行（中国）有限公司资金中心高级助理经理、法国巴黎银行（中国）有限公司固定收益部债务资本市场主管等职，2012年8月加入长安基金管理有限公司，现任长安基金管理有限公司联席投资总监，长安货币市场证券投资基金的基金经理、长安鑫益增强混合型证券投资基金及长安泓泽纯债债券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

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

2016年，宏观经济仍有下行压力，但受房地产销售增长和投资拉动，逐步有企稳迹象。各项经济数据有所企稳、回升。但金融市场发生较大的动荡。主要体现在：本币汇率继续贬值，货币市场流动性由宽松逐渐变为紧张，债市发生较大动荡，权益类市场也有震荡。在此期间，宏观管理层实施“中性的货币政策”。央行公开市场操作的方向、期限发生明显变化。同时美联储加息的影响也继续传导至我国市场。在此阶段，权益类资本市场、货币市场、债券市场受诸多因素影响均有一定幅度的波动。信用风险方面，个别信用债出现违约风险。根据宏观经济和货币政策发展趋势，以及金融市场流动性、市场风险、信用风险发生的变化，本基金在审慎控制风险的前提下，积极进行流动性管理和投资类别调整，把风险控制和流动性管理放在首位，及时调整各项资产配置比例。但

受市场系统性风险影响，基金组合受到一定冲击，但基金资产的安全性、流动性较好，收益性仍可期待。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金A类份额和C类份额的单位净值分别为0.933元和0.927元，净值增长率分别为-6.70%和-7.30%，同期本基金的业绩比较基准为-0.13%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2017年，我们将密切观察宏观经济增长力度和货币政策执行情况，继续关注影响金融市场流动性和货币市场、债券市场、权益类市场的关键因素，以及其他市场的变化所带来的影响，积极管理组合中各类大类资产，根据宏观经济和金融市场演变情况，适时调整组合的收益功能和风险管理要求，保障基金良好运营和投资者的利益。

#### 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(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。

#### 4.8 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。

#### 4.9 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

本基金本报告期内未出现基金资产净值低于五千万元和持有人人数不足200人的情形。

### § 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—长安基金管理有限公司从2016年2月22日至2016年12月31日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事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

本托管人认为，长安基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

#### 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

本托管人认为，长安基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、



准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第1700115号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	长安鑫益增强混合型证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的长安鑫益增强混合型证券投资基金(以下简称“长安鑫益增强混合基金”)财务报表,包括2016年12月31日的资产负债表、2016年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是长安鑫益增强混合基金管理人长安基金管理有限公司管理层的责任,这种责任包括:(1)按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“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编制财务报表,并使其实现公允反映;(2)设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注</p>

	<p>册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价长安基金管理有限公司管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p>
审计意见段	<p>我们认为,长安鑫益增强混合基金财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则和在财务报表附注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编制,公允反映了长安鑫益增强混合基金2016年12月31日的财务状况以及2016年度的经营成果及基金净值变动情况。</p>
注册会计师的姓名	黄小熠 张楠
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)
会计师事务所的地址	上海市南京西路1266号恒隆广场1期50楼
审计报告日期	2017-03-27

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体: 长安鑫益增强混合型证券投资基金

报告截止日: 2016年12月31日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2016年12月31日
资产:		
银行存款	7.4.7.1	364,118.56
结算备付金		

存出保证金		22,571.58
交易性金融资产	7.4.7.2	349,197,382.04
其中：股票投资		34,697,382.04
基金投资		—
债券投资		314,500,000.00
资产支持证券投资		—
贵金属投资		—
衍生金融资产	7.4.7.3	—
买入返售金融资产	7.4.7.4	—
应收证券清算款		—
应收利息	7.4.7.5	7,142,613.29
应收股利		—
应收申购款		57,998.50
递延所得税资产		—
其他资产	7.4.7.6	—
资产总计		356,784,683.97
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016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	7.4.7.3	—
卖出回购金融资产款		90,159,744.76
应付证券清算款		—
应付赎回款		201,196.01
应付管理人报酬		274,635.05
应付托管费		57,215.62
应付销售服务费		79,770.14
应付交易费用	7.4.7.7	51,859.66
应交税费		—
应付利息		19,155.32

应付利润		—
递延所得税负债		—
其他负债	7.4.7.8	139,754.15
负债合计		90,983,330.71
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	7.4.7.9	286,159,098.71
未分配利润	7.4.7.10	-20,357,745.45
所有者权益合计		265,801,353.26
负债和所有者权益总计		356,784,683.97

注：1、报告截止日2016年12月31日，本基金A类份额和C类份额的单位净值分别为0.933元和0.927元，基金份额分别为84,851,295.31份和201,307,803.40份。

2、本基金基金合同生效日为2016年02月22日，本财务报表的实际编制期间为2016年02月22日至2016年12月31日。

## 7.2 利润表

会计主体：长安鑫益增强混合型证券投资基金

本报告期：2016年02月22日至2016年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016年02月22日至2016年12月31日
一、收入		-12,349,654.30
1. 利息收入		9,841,775.42
其中：存款利息收入	7.4.7.11	3,560,934.35
债券利息收入		5,257,485.82
资产支持证券利息收入		—
买入返售金融资产收入		1,023,355.25
其他利息收入		—
2. 投资收益（损失以“-”填列）		7,570,164.17
其中：股票投资收益	7.4.7.12	2,338,781.97

基金投资收益		—
债券投资收益	7.4.7.13	5,186,695.00
资产支持证券投资收 益		—
贵金属投资收益	7.4.7.14	—
衍生工具收益	7.4.7.15	—
股利收益	7.4.7.16	44,687.20
3. 公允价值变动收益(损失以 “-”号填列)	7.4.7.17	-29,996,313.86
4. 汇兑收益(损失以“-”号 填列)		—
5. 其他收入(损失以“-”号 填列)	7.4.7.18	234,719.97
<b>减：二、费用</b>		6,934,690.69
1. 管理人报酬		3,905,838.22
2. 托管费		813,716.19
3. 销售服务费		1,079,747.50
4. 交易费用	7.4.7.19	77,694.10
5. 利息支出		884,712.85
其中：卖出回购金融资产支出		884,712.85
6. 其他费用	7.4.7.20	172,981.83
<b>三、利润总额(亏损总额以“-” 号填列)</b>		-19,284,344.99
减：所得税费用		—
<b>四、净利润(净亏损以“-” 号填列)</b>		-19,284,344.99

### 7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：长安鑫益增强混合型证券投资基金

本报告期：2016年02月22日至2016年12月31日

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2016年02月22日至2016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）	591,879,448.03	—	591,879,448.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	-19,284,344.99	-19,284,344.99
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）	-305,720,349.32	-1,073,400.46	-306,793,749.78
其中：1. 基金申购款	1,747,077.48	-46,656.87	1,700,420.61
2. 基金赎回款	-307,467,426.80	-1,026,743.59	-308,494,170.39
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）	286,159,098.71	-20,357,745.45	265,801,353.26

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

-----  
基金管理人负责人

-----  
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

长安鑫益增强混合型证券投资基金经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予长安鑫益增强混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2015]2018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《长安鑫益增强混合型证券投资基金基金合同》发售，基金合同于2016年2月22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591,879,448.03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，基金托管人为中国农业银行股份有限公司（以下简称“中国农业银行”）。

本基金于2016年1月15日至2016年2月17日募集，募集期间净认购资金人民币591,801,388.23元，认购资金在募集期间产生的利息人民币78,059.80元，募集的有效认购份额及利息结转的基金份额合计591,879,448.03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1600096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、《长安鑫益增强混合型证券投资基金基金合同》和《长安鑫益增强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、债券（国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、短期融资券、可转换债券（含分离交易可转债，可交换公司债券）、中期票据）、资产支持证券、债券回购、银行定期存款、股指期货、国债期货、权证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%-30%；权证投资占基金资产净值的比例为0%-3%；每个交易日日终在扣除国债期货和股指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。本基金的业绩比较基准为：中债综合指数收益率\*85%+沪深300指数收益率\*15%。

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。

#### 7.4.2 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》编制财务报表。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2016年12月31日的财务状况、自2016年2月22日（基金合同生效日）至2016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

2016年2月22日(基金合同生效日)至2016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。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。

#### 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。



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。

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。

#### 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。

#### 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、存款本金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。

#### 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《长安鑫益增强混合型证券投资基金基金合同》的规定，由于基金费用的不同，不同类别的基金份额在收益分配数额方面可能有所不同，基金管理人可对各类别基金份额分别制定收益分配方案，同一类别内的每一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两种：现金分红与红利再投资，投资人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；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 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

本基金在本报告期末发生重大会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期末发生重大会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间未发生重大会计差错更正。

#### 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[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[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]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[2015]125号文《关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》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) 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。

证券投资基金(封闭式证券投资基金, 开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券收入免征增值税。

对香港市场投资者(包括单位和个人)通过基金互认买卖内地基金份额免征增值税。

2017年7月1日(含)以后, 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为, 以资管产品管理人为增值税纳税人, 按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在2017年7月1日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, 已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。因此, 截至2016年12月31日, 本基金没有计提有关增值税费用。

(d) 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。

(e) 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。

(f) 关于香港市场投资者通过基金互认买卖内地基金份额的所得税问题:

对香港市场投资者(包括企业和个人)通过基金互认买卖内地基金份额取得的转让差价所得, 暂免征收所得税。

对香港市场投资者(包括企业和个人)通过基金互认从内地基金分配取得的收益, 由内地上市公司向该内地基金分配股息红利时, 对香港市场投资者按照10%的税率代扣所得税; 或发行债券的企业向该内地基金分配利息时, 对香港市场投资者按照7%的税率代扣所得税, 并由内地上市公司或发行债券的企业向其主管税务机关办理扣缴申报。该内地基金向投资者分配收益时, 不再扣缴所得税。

内地基金管理人应当向相关证券登记结算机构提供内地基金的香港市场投资者的相关信息。

(g) 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。

(h) 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2016年12月31日, 本基金无应交税费。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日
活期存款	364,118.56
定期存款	—
其中：存款期限1-3个月	—
其他存款	—
合计	364,118.56

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末2016年12月31日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	35,049,100.90	34,697,382.04	-351,718.86	
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—	
债券	交易所市场	—	—	
	银行间市场	344,144,595.00	314,500,000.00	-29,644,595.00
	合计	344,144,595.00	314,500,000.00	-29,644,595.00
资产支持证券	—	—	—	
基金	—	—	—	
其他	—	—	—	
合计	379,193,695.90	349,197,382.04	-29,996,313.86	

#### 7.4.7.3 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。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.1 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：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。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末2016年12月31日
应收活期存款利息	221.34
应收定期存款利息	—
应收其他存款利息	—
应收结算备付金利息	11.22
应收债券利息	7,142,380.73
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	—
应收黄金合约拆借孳息	—
其他	—
合计	7,142,613.29

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末2016年12月31日
交易所市场应付交易费用	46,314.46
银行间市场应付交易费用	5,545.20
合计	51,859.66

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末2016年12月31日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	754.15
预提费用	139,000.00
合计	139,754.15

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目 (长安鑫益增强混合A)	本期2016年02月22日至2016年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	176,318,212.22	176,318,212.22
本期申购	225,892.77	225,892.77
本期赎回(以“-”号填列)	-91,692,809.68	-91,692,809.68
本期末	84,851,295.31	84,851,295.31
项目 (长安鑫益增强混合C)	基金份额(份)	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	415,561,235.81	415,561,235.81
本期申购	1,521,184.71	1,521,184.71
本期赎回(以“-”号填列)	-215,774,617.12	-215,774,617.12
本期末	201,307,803.40	201,307,803.40

注：本基金于2016年1月15日至2016年2月17日募集，募集期间净认购资金人民币591,801,388.23元，认购资金在募集期间产生的利息人民币78,059.80元，募集的有效认购份额及利息结转的基金份额合计591,879,448.03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1600096号验资报告。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目 (长安鑫益增强混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	—	—	—
本期利润	4,217,348.71	-9,203,973.46	-4,986,624.75
本期基金份额交易产生的变动数	-1,075,705.94	362,580.17	-713,125.77
其中：基金申购款	5,332.67	-8,693.83	-3,361.16
基金赎回款	-1,081,038.61	371,274.00	-709,764.61
本期已分配利润	—	—	—
本期末	3,141,642.77	-8,841,393.29	-5,699,750.52



单位：人民币元

项目 (长安鑫益增强混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	—	—	—
本期利润	6,494,620.16	-20,792,340.40	-14,297,720.24
本期基金份额交易产生的变动数	-292,007.67	-68,267.02	-360,274.69
其中：基金申购款	19,462.93	-62,758.64	-43,295.71
基金赎回款	-311,470.60	-5,508.38	-316,978.98
本期已分配利润	—	—	—
本期末	6,202,612.49	-20,860,607.42	-14,657,994.93

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年02月22日至2016年12月31日
活期存款利息收入	295,797.54
定期存款利息收入	3,264,383.33
其他存款利息收入	—
结算备付金利息收入	753.48
其他	—
合计	3,560,934.35

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2016年02月22日至2016年12月31日
股票投资收益——买卖股票 差价收入	2,338,781.97
股票投资收益——赎回差价	—

收入	
股票投资收益——申购差价收入	—
合计	2,338,781.97

7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期2016年02月22日至2016年12月31日
卖出股票成交总额	15,861,646.80
减：卖出股票成本总额	13,522,864.83
买卖股票差价收入	2,338,781.97

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2016年02月22日至2016年12月31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	5,186,695.00
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	5,186,695.00

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年02月22日至2016年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	597,431,769.71
减：卖出债券（、债转股及债	578,265,755.00

券到期兑付) 成本总额	
减: 应收利息总额	13,979,319.71
买卖债券差价收入	5,186,695.00

**7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入**

本基金本报告期内无债券投资收益-赎回差价收入。

**7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期内无债券投资收益-申购差价收入。

**7.4.7.13.5 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。

**7.4.7.14 贵金属投资收益**

**7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

本基金本报告期内未进行贵金属投资交易。

**7.4.7.15 衍生工具收益**

**7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期内未持有衍生工具。

**7.4.7.16 股利收益**

单位: 人民币元

项目	本期
	2016年02月22日至2016年12月31日
股票投资产生的股利收益	44,687.20
基金投资产生的股利收益	—
合计	44,687.20

**7.4.7.17 公允价值变动收益**

单位: 人民币元

项目名称	本期
	2016年02月22日至2016年12月31日
1. 交易性金融资产	-29,996,313.86
——股票投资	-351,718.86

——债券投资	-29,644,595.00
——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	—
合计	-29,996,313.86

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年02月22日至2016年12月31日
基金赎回费收入	234,719.97
转换费收入	
合计	234,719.97

注：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。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年02月22日至2016年12月31日
交易所市场交易费用	67,794.10
银行间市场交易费用	9,900.00
合计	77,694.10

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年02月22日至2016年12月31日
审计费用	50,000.00

信息披露费	80,000.00
帐户维护费	27,240.00
其他费用	1,000.00
汇划手续费	14,741.83
合计	172,981.83

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 7.4.8.2 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。

#### 7.4.9 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、基金注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司	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
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
长安资产-香洲5号专项资产管理计划	基金管理人子公司管理的专户产品

下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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

本基金自2016年2月22日(基金合同生效日)至2016年12月31日止没有与关联方进行过股票交易。

###### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金自2016年2月22日(基金合同生效日)至2016年12月31日止没有与关联方进行过权证交易。

#### 7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金自2016年2月22日(基金合同生效日)至2016年12月31日止没有通过关联方的交易单元进行过交易。

#### 7.4.10.1.4 债券交易

本基金自2016年2月22日(基金合同生效日)至2016年12月31日止没有与关联方进行过债券交易。

#### 7.4.10.1.5 债券回购交易

本基金自2016年2月22日(基金合同生效日)至2016年12月31日止没有与关联方进行过债券回购交易。

### 7.4.10.2 关联方报酬

#### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年02月22日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	3,905,838.22
其中：支付销售机构的客户维护费	771,388.95

注：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1.2%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×1.2%/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。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2016年02月22日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	813,716.19

注：支付基金托管人中国农业银行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。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

#### 7.4.10.2.3 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 2016年02月22日至2016年12月31日		
	长安鑫益增强混合 A	长安鑫益增强混合 C	合计
农业银行	—	—	—
长安基金	—	1,063,452.86	1,063,452.86
合计	—	1063452.86	1063452.86

注：本基金A类不计算基金销售服务费。本基金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0.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日销售服务费=前一日基金资产净值×0.5% /当年天数；

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金自2016年2月22日(基金合同生效日)至2016年12月31日止没有与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 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。

##### 7.4.10.4.2 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

份额单位：份

关联方名称		本期末 2016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
长安	长安资产-香洲	200,000,000.0	69.89%

鑫益增强混合C	5号专项资产管理计划	0	
---------	------------	---	--

7.4.10.5 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 2016年02月22日至2016年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行活期存款	364,118.56	295,797.54

注：本基金通过“农业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2016年12月31日相关余额为0。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金自2016年2月22日(基金合同生效日)至2016年12月31日止未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本报告期内无其他关联交易事项说明。

7.4.11 利润分配情况

7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金在本报告期末进行过利润分配。

7.4.12 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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(股)	期末成本总额	期末估值总额
601357	中原证券	2016-12-20	2017-01-	首次公开发行	4.00	4.00	26,695	106,780.00	106,780.00



			03						
--	--	--	----	--	--	--	--	--	--

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。本基金截止到2016年12月31日因认购/增发证券而于期末流通受限的证券如图列示。

#### 7.4.12.2 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
603986	兆易创新	2016-09-19	重大资产重组	177.97	2017-03-13	195.77	1,058	24,609.08	188,292.26
002635	安洁科技	2016-11-07	重大资产重组	33.74	2017-02-08	33.50	250,000	9,071,392.28	8,435,000.00

注：本基金截至2016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。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2016年12月31日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额90,159,744.76元，是以如下债券作为质押。

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
160008	16付息国债08	2017-01-13	98.79	920,000	90,886,800.00

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 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。

#### 7.4.13.2 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约责任，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。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行农业银行，因而与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，因此违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2016年12月31日
A-1	—
A-1以下	—
未评级	19,966,000.00
合计	19,966,000.00

注：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。其中，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。截止至2016年12月31日，本基金未持有按短期信用评级列示的债券。

#### 7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2016年12月31日
AAA	—
AAA以下	—
未评级	294,534,000.00
合计	294,534,000.00

注：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。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险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，另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。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人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。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人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，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的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%。

本基金所持有的金融负债的合约约定剩余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。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指由于市场变化或波动所引起的资产损失的可能性，本基金管理人通过监测组合久期、Beta值等指标来衡量市场风险。

#### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率变动引起组合中资产特别是债券投资的市场价格变动，从而影响基金投资收益的风险。

本基金管理人定期对组合中债券投资部分面临的利率风险进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末2016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	364,118.56	—	—	—	364,118.56
存出保证金	22,571.58	—	—	—	22,571.58
交易性金融资产	314,500,00 0.00	—	—	34,697,382 .04	349,197,38 2.04
应收利息	—	—	—	7,142,613. 29	7,142,613. 29
应收申购款	—	—	—	57,998.50	57,998.50
资产总计	314,886,69 0.14	—	—	41,897,993 .83	356,784,68 3.97
负债					
卖出回购金融资产款	90,159,744 .76	—	—	—	90,159,744 .76
应付赎回款	—	—	—	201,196.01	201,196.01
应付管理人报酬	—	—	—	274,635.05	274,635.05
应付托管费	—	—	—	57,215.62	57,215.62
应付销售服务费	—	—	—	79,770.14	79,770.14
应付交易费用	—	—	—	51,859.66	51,859.66

应付利息	—	—	—	19,155.32	19,155.32
其他负债	—	—	—	139,754.15	139,754.15
负债总计	90,159,744.76	—	—	823,585.95	90,983,330.71
利率敏感度缺口	224,726,945.38	—	—	41,074,407.88	265,801,353.26

注：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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	假定所有期限的利率均以相同幅度变动25个基点，其他市场变量均不发生变化。	
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 2016年12月31日
	利率下降25个基点	11,475,961.87
	利率上升25个基点	-10,900,316.14

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要是本基金所面临的市场价格风险。市场价格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。

于2016年12月31日，本基金投资组合中股票投资比例为基金资产净值的13.05%，债券投资比例为118.32%，无衍生金融资产。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2016年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	34,697,382.04	13.05
交易性金融资产-基金投资	—	—
交易性金融资产-债券投资	314,500,000.00	118.32
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	349,197,382.04	131.38

#### 7.4.13.4.3.2 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 2016年12月31日
	业绩比较基准上升5%	2,057,312.58
	业绩比较基准下降5%	-2,057,312.58

注: 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。

#### 7.4.14 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。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2016年12月31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25,967,309.78元,属于第二层级的余额为323,230,072.26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。

## §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	34,697,382.04	9.73
	其中：股票	34,697,382.04	9.73
2	固定收益投资	314,500,000.00	88.15
	其中：债券	314,500,000.00	88.15
	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	364,118.56	0.10
7	其他各项资产	7,223,183.37	2.02
8	合计	356,784,683.97	100.00

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	40,221.20	0.02
C	制造业	17,477,607.59	6.58
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,159,200.00	1.19
E	建筑业	97,714.10	0.04
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	5,691,672.00	2.14
I	信息传输、软件和信息技术服务业	91,341.00	0.03
J	金融业	106,780.00	0.04
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	57,947.40	0.02
M	科学研究和技术服务业	132,580.38	0.05
N	水利、环境和公共设施管理业	7,522,100.00	2.83
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	320,218.37	0.12
S	综合	—	—
	合计	34,697,382.04	13.05

8.3 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	占基金资产净值比例(%)
1	002635	安洁科技	250,000	8,435,000.00	3.17
2	603199	九华旅游	190,000	7,522,100.00	2.83



3	002701	奥瑞金	700,000	6,048,000.00	2.28
4	600754	锦江股份	193,200	5,691,672.00	2.14
5	600323	瀚蓝环境	220,000	3,159,200.00	1.19
6	600572	康恩贝	300,000	2,193,000.00	0.83
7	603986	兆易创新	1,058	188,292.26	0.07
8	601500	通用股份	5,317	127,448.49	0.05
9	600977	中国电影	5,084	117,389.56	0.04
10	601375	中原证券	26,695	106,780.00	0.04
11	601595	上海电影	2,567	101,704.54	0.04
12	601811	新华文轩	4,549	101,124.27	0.04
13	603843	正平股份	4,642	97,714.10	0.04
14	603258	电魂网络	1,530	91,341.00	0.03
15	603658	安图生物	1,430	79,493.70	0.03
16	601163	三角轮胎	2,251	76,421.45	0.03
17	603067	振华股份	2,616	74,215.92	0.03
18	603060	国检集团	2,055	72,685.35	0.03
19	603663	三祥新材	1,826	66,685.52	0.03
20	603203	快克股份	1,048	65,929.68	0.02
21	603090	宏盛股份	1,371	65,355.57	0.02
22	603859	能科股份	1,121	59,895.03	0.02
23	603569	长久物流	1,323	57,947.40	0.02
24	603515	欧普照明	1,500	57,765.00	0.02
25	002828	贝肯能源	1,042	40,221.20	0.02

#### 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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	002701	奥瑞金	9,688,719.27	3.65
2	002635	安洁科技	9,071,392.28	3.41

3	603199	九华旅游	8,835,068.00	3.32
4	600754	锦江股份	8,815,860.70	3.32
5	600572	康恩贝	4,116,000.00	1.55
6	600323	瀚蓝环境	3,621,547.26	1.36
7	300396	迪瑞医疗	3,321,426.00	1.25
8	600909	华安证券	210,427.48	0.08
9	601375	中原证券	106,780.00	0.04
10	601163	三角轮胎	49,679.57	0.02
11	601997	贵阳银行	48,036.42	0.02
12	600977	中国电影	45,349.28	0.02
13	002807	江阴银行	34,280.32	0.01
14	601811	新华文轩	32,388.88	0.01
15	600936	广西广电	31,161.60	0.01
16	603313	梦百合	29,001.62	0.01
17	603816	顾家家居	28,432.98	0.01
18	601128	常熟银行	28,376.40	0.01
19	601500	通用股份	26,159.64	0.01
20	601595	上海电影	26,157.73	0.01

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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	002701	奥瑞金	3,913,512.95	1.47
2	300396	迪瑞医疗	3,694,156.00	1.39
3	600754	锦江股份	2,305,459.00	0.87
4	600572	康恩贝	2,178,000.00	0.82
5	600323	瀚蓝环境	1,001,545.04	0.38
6	603199	九华旅游	827,400.00	0.31

7	600909	华安证券	466,157.60	0.18
8	600936	广西广电	119,842.32	0.05
9	002807	江阴银行	118,429.64	0.04
10	601997	贵阳银行	117,007.44	0.04
11	300556	丝路视觉	87,904.20	0.03
12	603159	上海亚虹	82,167.32	0.03
13	300532	今天国际	79,800.00	0.03
14	300533	冰川网络	79,629.70	0.03
15	300548	博创科技	74,272.00	0.03
16	601128	常熟银行	73,195.20	0.03
17	603777	来伊份	72,489.90	0.03
18	603313	梦百合	69,972.76	0.03
19	601882	海天精工	68,589.20	0.03
20	600908	无锡银行	67,404.00	0.03

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	48,571,965.73
卖出股票收入（成交）总额	15,861,646.80

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。

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	118,548,000.00	44.60
2	央行票据	—	—
3	金融债券	195,952,000.00	73.72
	其中：政策性金融债	195,952,000.00	73.72
4	企业债券	—	—

5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债	—	—
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	314,500,000.00	118.32

8.5 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	160410	16农发10	1,800,000	175,986,000.00	66.21
2	160008	16付息国债08	1,200,000	118,548,000.00	44.60
3	160211	16国开11	200,000	19,966,000.00	7.51

8.6 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

本基金本报告期末持有资产支持证券。

8.7 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

本基金本报告期末持有贵金属。

8.8 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

本基金本报告期末持有权证。

8.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.9.1 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。

8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未进行国债期货交易。

## 8.11 投资组合报告附注

### 8.11.1

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。

### 8.11.2

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。

### 8.11.3 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	22,571.58
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	7,142,613.29
5	应收申购款	57,998.50
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	7,223,183.37

### 8.11.4 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可转换债券。

### 8.11.5 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	002635	安洁科技	8,435,000.00	3.17	重大事项
2	603986	兆易创新	188,292.26	0.07	重大事项
3	601375	中原证券	106,780.00	0.04	首次公开发行

8.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计之间可能存在尾差。

§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
长安鑫 益增强 混合A	1,157	73,337.33	495,175.64	0.58%	84,356,119 .67	99.42%
长安鑫 益增强 混合C	90	2,236,753. 37	200,000,00 0.00	99.35%	1,307,803. 40	0.65%
合计	1,247	229,478.03	200,495,17 5.64	70.06%	85,663,923 .07	29.94%

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	长安鑫益增 强混合A	50,402.26	0.059%
	长安鑫益增 强混合C	192,368.59	0.095%
	合计	242,770.85	0.085%

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	长安鑫益增强混合 A	0~10
	长安鑫益增强混合 C	
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	长安鑫益增强混合 A	0~10
	长安鑫益增强混合 C	
	合计	0~10

### § 10 开放式基金份额变动

单位：份

	长安鑫益增强混合A	长安鑫益增强混合C
基金合同生效日(2016年02月22日) 基金份额总额	176,318,212.22	415,561,235.81
本报告期期初基金份额总额	—	—
本报告期基金总申购份额	225,892.77	1,521,184.71
减：本报告期基金总赎回份额	91,692,809.68	215,774,617.12
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	84,851,295.31	201,307,803.40

### § 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、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，基金托管人的专门基金托管部门发生以下重大人事变动：  
本基金托管人的专门基金托管部门本报告期内未发生重大人事变动。

### 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)的报酬为人民币伍万元整。

### 11.6 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。

### 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	
国泰君安证券	2	63,331,660.31	100.00%	52,422.06	100.00%	

注：1、基金租用席位的选择标准是：

- (1) 资历雄厚，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、上述租用的券商交易单元为本报告期新增。

### 11.8 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	长安鑫益增强混合型证券投资基金基金合同	中国证券报	2016-01-08
2	长安鑫益增强混合型证券投资基金托管协议	中国证券报	2016-01-08
3	长安鑫益增强混合型证券投资基金招募说明书	中国证券报	2016-01-08
4	长安鑫益增强混合型证券投资基金份额发售公告	中国证券报	2016-01-08
5	长安鑫益增强混合型证券投资基金基金合同摘要	中国证券报	2016-01-08
6	关于增加上海浦东发展银行股份有限公司为长安鑫益增强混合型证券投资基金代销机构的公告	中国证券报	2016-01-16
7	关于旗下基金在深圳市新兰德证券投资咨询有限公司开通定投业务费率优惠活动的公告	中国证券报	2016-01-22
8	长安鑫益增强混合型证券投资基金基金合同生效的公告	中国证券报	2016-02-23
9	关于长安基金管理有限公司旗下基金在“金斧子”开通申购和赎回业务并参与费率优惠活动的公告	中国证券报	2016-03-23
10	长安鑫益增强混合型证券投资基金封闭期内每周净值公告 (20160226)	中国证券报	2016-02-26
11	长安鑫益增强混合型证券投资基金封闭期内每周净值公告 (20160304)	中国证券报	2016-03-04
12	长安鑫益增强混合型证券投资基	中国证券报	2016-03-11

	金封闭期内每周净值公告 (20160311)		
13	长安鑫益增强混合型证券投资基金封闭期内每周净值公告 (20160318)	中国证券报	2016-03-18
14	长安鑫益增强混合型证券投资基金封闭期内每周净值公告 (20160325)	中国证券报	2016-03-25
15	长安鑫益增强混合型证券投资基金封闭期内每周净值公告 (20160401)	中国证券报	2016-04-01
16	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	中国证券报	2016-04-02
17	关于旗下基金参加深圳市新兰德证券投资咨询有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报	2016-04-06
18	关于旗下基金在大泰金石投资管理有限公司开通申购和赎回业务并参与费率优惠活动的公告	中国证券报	2016-04-06
19	长安鑫益增强混合型证券投资基金封闭期内每周净值公告 (20160408)	中国证券报	2016-04-08
21	长安鑫益增强混合型证券投资基金封闭期内每周净值公告 (20160415)	中国证券报	2016-04-15
22	长安鑫益增强混合型证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告	中国证券报	2016-04-19
23	长安鑫益增强混合型证券投资基金封闭期内每周净值公告 (20160421)	中国证券报	2016-04-21
24	关于长安鑫益增强混合型证券投资	中国证券报	2016-04-21

	资基金在代销机构推出申购及定期定额投资业务并参加费率优惠活动的公告		
25	关于长安鑫益增强混合型证券投资基金A类实行网上直销申购费率优惠的公告	中国证券报	2016-04-26
26	关于增加杭州数米基金销售有限公司为长安产业精选混合C类、长安鑫利优选混合C类、长安鑫益增强混合A类和C类代销机构并开通申购、赎回和定期定额投资业务并参与费率优惠活动的公告	中国证券报	2016-05-12
27	关于增加珠海盈米财富管理有限公司为长安产业精选混合C类、长安鑫利优选混合C类、长安鑫益增强混合A类和C类代销机构并开通申购、赎回和定期定额投资业务并参与费率优惠活动的公告	中国证券报	2016-05-12
28	关于长安基金管理有限公司旗下基金在北京汇成基金销售有限公司开通申购、赎回和定投业务并参与费率优惠活动的公告	中国证券报	2016-05-18
29	关于旗下基金在上海联泰资产管理有限公司开通申购、赎回、转换和定投业务并参与费率优惠活动的公告	中国证券报	2016-05-31
30	关于长安基金管理有限公司旗下基金在深圳富济财富管理有限公司开通申购、赎回和定投业务并参与费率优惠活动的公告	中国证券报	2016-06-01
31	长安基金管理有限公司督察长李永波任职公告	中国证券报	2016-06-08
32	关于旗下基金在上海凯石财富基金销售有限公司开通申购、赎回、	中国证券报	2016-06-24

	基金转换和定投业务并参与费率优惠活动的公告		
33	长安基金管理有限公司关于旗下基金2016年6月30日基金资产净值、基金份额净值及基金份额累计净值的公告	中国证券报	2016-06-30
34	长安鑫益增强混合型证券投资基金2016年第2季度报告	中国证券报	2016-07-20
35	关于旗下基金在北京恒天明泽基金销售有限公司开通申购、赎回、基金转换和定投业务并参与费率优惠活动的公告	中国证券报	2016-07-27
36	关于开展长安货币市场证券投资基金A类网上直销基金转换费率优惠的公告	中国证券报	2016-07-28
37	关于旗下基金在上海万得投资顾问有限公司开通申购、赎回、基金转换和定投业务并参与费率优惠活动的公告	中国证券报	2016-08-02
38	长安鑫益增强混合型证券投资基金2016年半年度报告及摘要	中国证券报	2016-08-25
39	关于长安基金管理有限公司参加中信建投证券费率优惠活动的公告	中国证券报	2016-09-06
40	长安基金管理有限公司关于提醒投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告	中国证券报	2016-09-06
41	长安鑫益增强混合型证券投资基金招募说明书（2016年第1次更新）及摘要	中国证券报	2016-09-29
42	关于旗下基金在爱建财富开通申购和赎回业务并参与费率优惠活动的公告	中国证券报	2016-10-12

43	长安鑫益增强混合型证券投资基金2016年第3季度报告	中国证券报	2016-10-24
44	关于旗下基金在上海中正达广投资管理有限公司开通申购和赎回业务并参与费率优惠活动的公告	中国证券报	2016-11-11
45	关于长安基金管理有限公司旗下基金参加钱景财富费率优惠活动的公告	中国证券报	2016-11-11
46	关于旗下基金在乾道金融信息服务（北京）有限公司和上海华信证券有限责任公司开通申购和赎回业务并参与费率优惠活动的公告	中国证券报	2016-11-29
47	关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报	2016-12-15
48	关于增加蚂蚁（杭州）基金销售有限公司为长安基金管理有限公司旗下部分基金代销机构并开通申购、赎回和定期定额投资业务并参与费率优惠活动的公告	中国证券报	2016-12-16
49	关于旗下基金参与中国工商银行基金定期定额投资业务申购费率优惠活动的公告	中国证券报	2016-12-30
50	关于旗下基金参与中国农业银行股份有限公司开放式公募基金定期定额投资申购费率优惠的公告	中国证券报	2016-12-30
51	关于开展长安货币市场证券投资基金A类网上直销基金转换费率优惠的公告	中国证券报	2016-12-30
52	长安基金管理有限公司关于旗下基金2016年12月31日基金资产净值、基金份额净值及基金份额累计净值的公告	中国证券报	2016-12-31

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、长安鑫益增强混合型证券投资基金基金合同；
- 3、长安鑫益增强混合型证券投资基金托管协议；
- 4、长安鑫益增强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。

### 13.2 存放地点

上海市浦东新区芳甸路1088号紫竹国际大厦16层。

### 13.3 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](http://www.changanfunds.com)。

长安基金管理有限公司  
二〇一七年三月二十八日