

长安货币市场证券投资基金2016年半年度报告

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 重要提示及目录

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。

本报告中财务资料未经会计师事务所审计。

本报告期自2016年01月01日起至06月30日止。

1.2 目录

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	7
2.5	其他相关资料	7
§3	主要财务指标和基金净值表现	8
3.1	主要会计数据和财务指标	8
3.2	基金净值表现	8
§4	管理人报告	10
4.1	基金管理人及基金经理情况	10
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
§5	托管人报告	14
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
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	14
§6	半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1	资产负债表	14
6.2	利润表	16
6.3	所有者权益（基金净值）变动表	18
6.4	报表附注	19
§7	投资组合报告	44
7.1	期末基金资产组合情况	44
7.2	债券回购融资情况	44
7.3	基金投资组合平均剩余期限	44
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	46
7.6	期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细	46
7.7	“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离	47
7.8	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	47
7.9	投资组合报告附注	47
§8	基金份额持有人信息	48
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	48
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	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	49
§9	开放式基金份额变动	49
§10	重大事件揭示	49
10.1	基金份额持有人大会决议	49
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	49
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	50
10.4	基金投资策略的改变	50
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	50
10.6	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	50
10.7	本期基金租用证券公司交易单元的有关情况	50

10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况	51
10.9 其他重大事件	51
§11 影响投资者决策的其他重要信息	54
§12 备查文件目录	54
12.1 备查文件目录	54
12.2 存放地点	54
12.3 查阅方式	54

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长安货币市场证券投资基金	
基金简称	长安货币	
基金主代码	740601	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年1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	1,837,611,762.84份	
基金合同存续期	不定期	
下属两级基金的基金简称	长安货币A	长安货币B
下属两级基金的交易代码	740601	740602
报告期末下属两级基金的份额总额	81,910,093.81份	1,755,701,669.03份

2.2 基金产品说明

投资目标	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。
投资策略	<p>1、整体配置策略</p> <p>通过全面研究经济运行状况，预测货币政策、财政政策等政府宏观经济政策取向，分析资本市场资金供给状况的变动趋势，形成对市场利率水平变动趋势的判断。在此基础上，根据各类别资产的流动性、收益性和信用水平，决定各类资产的配置比例和期限匹配量。</p> <p>2、久期策略</p> <p>组合久期是反映利率风险的重要指标，在对市场利率水平变化趋势预测的前提下，制定组合的目标久期。预测利率将进入下降通道时，基金管理人将通过提高组合的久期，以最大程度获取债券价格上升带来的资本利得；预测市场利率将进入上升通道时，本基金将</p>

	<p>缩短组合久期，降低债券收益率上升带来的风险，并增加再投资收益。</p> <p>3、个券选择策略</p> <p>本基金将优先考虑安全性因素，选择高信用等级的债券品种进行投资。在个券选择上，本基金将在整体配置策略和久期策略的基础上，对影响个别债券定价的主要因素，包括信用等级、流动性、市场供求、票息及付息频率、税赋等因素进行分析，选择具有良好投资价值的债券品种进行投资。</p> <p>4、套利策略</p> <p>套利策略主要包括两方面：（1）跨市场套利。由于其中的投资群体、交易方式等市场要素不同，使得交易所市场和银行间市场的资金面、短期利率期限结构、流动性都存在着一定的差别。本基金将在充分论证套利机会可行性的基础上，寻找合理的介入时机，进行跨市场套利操作。（2）跨品种套利。由于投资群体存在一定的差异性，对期限相近的交易品种同样可能因为存在流动性、税收等市场因素的影响出现内在价值明显偏离的情况。本基金将在保证高流动性的基础上进行跨品种套利操作，以增加超额收益。</p> <p>5、息差策略</p> <p>息差策略是指利用市场回购利率低于债券收益率的情形，通过正回购将所获得资金投资于债券的策略。市场回购利率往往低于相对较长期限债券的收益率，为息差交易提供了机会。本基金充分考虑市场回购资金利率与债券收益率之间的关系，选择适当的杠杆比率，谨慎实施息差策略，以提高投资组合收益水平。</p> <p>6、现金流管理策略</p> <p>本基金将根据对市场资金面分析以及对申购赎回变化的动态预测，通过回购的滚动操作和银行存款、债券品种的期限结构搭配，动态调整基金的现金流，在保持充分流动性的基础上争取较高收益。</p>
业绩比较基准	7天通知存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为货币市场基金，属于证券投资基金中的低风

	险品种，其预期收益和风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。
--	-----------------------------------

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	010-65169830
传真		021-50598018	010-65169555
注册地址		上海市虹口区丰镇路806号3幢371室	广东省广州市越秀区东风东路713号
办公地址		上海市浦东新区芳甸路1088号紫竹国际大厦16层	北京市东城区东长安街甲2号
邮政编码		201204	510080
法定代表人		万跃楠	董建岳

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》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.changanfunds.com
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

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-2016年6月30日）	
	长安货币A	长安货币B
本期已实现收益	1,296,528.67	35,684,816.73
本期利润	1,296,528.67	35,684,816.73
本期净值收益率	1.26%	1.38%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016年6月30日)	
期末基金资产净值	81,910,093.81	1,755,701,669.03
期末基金份额净值	1.000	1.000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016年6月30日)	
累计净值收益率	14.33%	15.27%

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，由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2、基金收益分配按月结转份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

(1) 长安货币A基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段(A级)	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 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	0.2048%	0.0045%	0.1125%	0.0000%	0.0923%	0.0045%
过去三个月	0.5580%	0.0033%	0.3412%	0.0000%	0.2168%	0.0033%
过去六个月	1.2582%	0.0055%	0.6825%	0.0000%	0.5757%	0.0055%
过去一年	2.7310%	0.0049%	1.3725%	0.0000%	1.3585%	0.0049%
过去三年	12.7192%	0.0064%	4.1100%	0.0000%	8.6092%	0.0064%

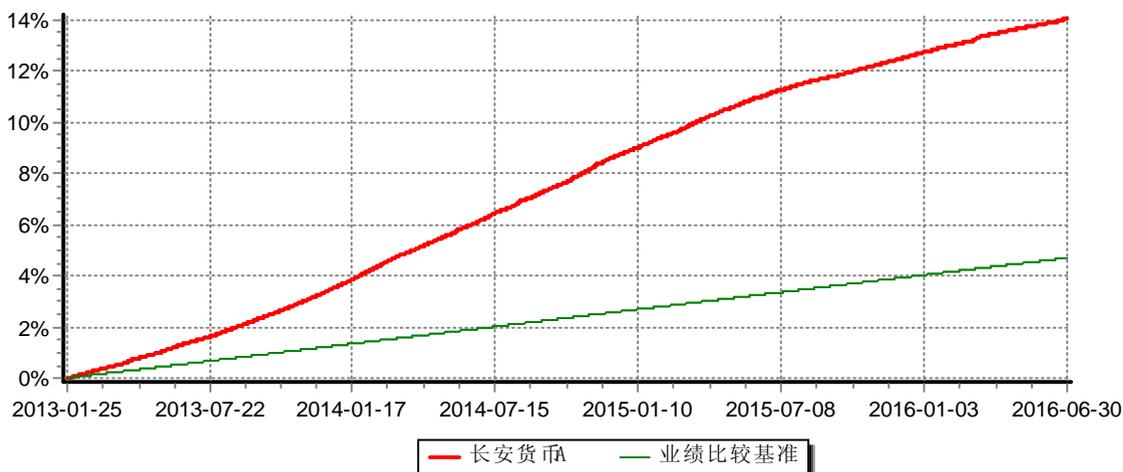
自基金合同生效日起至今 (2013年01月25日-2016年06月30日)	14.3250%	0.0062%	4.6988%	0.0000%	9.6262%	0.0062%
--	----------	---------	---------	---------	---------	---------

(2) 长安货币B基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段(B级)	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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	0.2246%	0.0045%	0.1125%	0.0000%	0.1121%	0.0045%
过去三个月	0.6183%	0.0033%	0.3412%	0.0000%	0.2771%	0.0033%
过去六个月	1.3791%	0.0055%	0.6825%	0.0000%	0.6966%	0.0055%
过去一年	2.9782%	0.0049%	1.3725%	0.0000%	1.6057%	0.0049%
过去三年	13.5315%	0.0064%	4.1100%	0.0000%	9.4215%	0.0064%
自基金合同生效日起至今 (2013年01月25日-2016年06月30日)	15.2685%	0.0062%	4.6988%	0.0000%	10.5697%	0.0062%

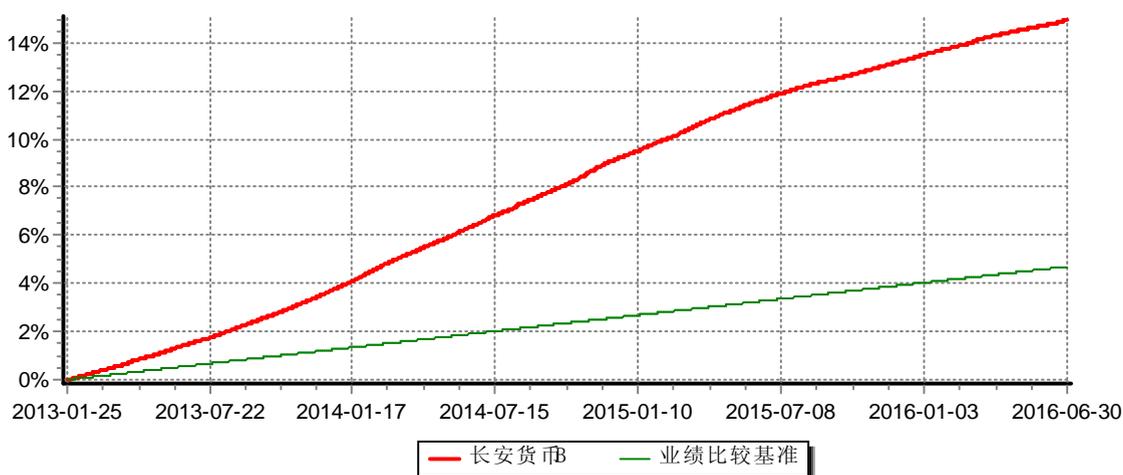
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

长安货币市场证券投资基金
 份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 (2013年1月25日-2016年6月30日)



注：1、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时，各项资产配置比例已符合基金合同有关投资比例的约定。

2、本基金的收益分配是按月结转份额。



注：1、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时，各项资产配置比例已符合基金合同有关投资比例的约定。

2、本基金的收益分配是按月结转份额。

§ 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		
乔哲	本基金	2013年2月1	—	20年	山东大学工商管理硕士学

	的基金 经理	日		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、长安鑫益增强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

2016年上半年，宏观经济仍有下行压力，但逐步有企稳迹象。上半年前半段固定资产投资、物价指数等指标有所回升，人民币汇率阶段性稳定。但下半段投资、物价指数有所回落，本币有所贬值。在此期间，宏观管理层继续实施“稳健合理的货币政策和积极的财政政策”。从央行公开市场操作和金融市场流动性情况来看，金融市场流动性总体宽松，但春节、一季末、半年末等时点比较紧张。受上述因素影响，权益类资本市场经历了震荡回升，货币市场、债券市场也有较大幅度的波动，信用风险暴露频繁。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，充分发挥了货币基金的避险和现金管理功能，较好地实现了基金资产安全性、流动性、收益性的平衡，保证了基金持有人的利益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2016年06月30日，本基金A类和B类分别上涨1.2582%和1.3791%，同期本基金的业绩比较基准上涨0.6825%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，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、债券市场的关键因素，以及其他资本市场的变化所带来的影响，审慎、积极地管理组合流动性和市场风险、信用风险，继续保持基金资产安全性、流动性、收益性的平衡，保障基金良好运营和投资者的利益。

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

本基金在本报告期进行了6次基金收益集中支付并结转为基金份额,分别为2016年1月25日,2016年2月25日,2016年3月25日,2016年4月25日,2016年5月25日,2016年6月27日。累计分配收益35,221,849.66元,利润分配金额、方式等符合相关法规和本基金基金合同的规定。

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

本报告期内无需要说明的相关情形。

§ 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”)在对长安货币市场证券投资基金(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：长安货币市场证券投资基金

报告截止日：2016年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	551,914,476.05	1,430,872,656.93
结算备付金			—
存出保证金		—	—
交易性金融资产	6.4.7.2	649,833,338.81	1,665,417,121.35
其中：股票投资		—	—
基金投资		—	—
债券投资		649,833,338.81	1,665,417,121.35
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
衍生金融资产	6.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	427,911,881.87	600,301,420.45
应收证券清算款		—	—
应收利息	6.4.7.5	14,199,650.46	52,001,649.34
应收股利		—	—
应收申购款		200,115,750.00	308,208,594.00
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.6	—	—
资产总计		1,843,975,097.19	4,056,801,442.07
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
负债：			
短期借款		—	—
交易性金融负债		—	—
衍生金融负债	6.4.7.3	—	—
卖出回购金融资产款		—	—

应付证券清算款		—	—
应付赎回款		—	—
应付管理人报酬		467,393.45	1,214,199.08
应付托管费		141,634.38	367,939.13
应付销售服务费		31,323.67	56,813.60
应付交易费用	6.4.7.7	12,022.65	26,215.00
应交税费		5,170,450.82	938,600.00
应付利息		—	—
应付利润		456,920.32	2,494,379.27
递延所得税负债		—	—
其他负债	6.4.7.8	83,589.06	159,000.00
负债合计		6,363,334.35	5,257,146.08
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	1,837,611,762.84	4,051,544,295.99
未分配利润	6.4.7.10	—	—
所有者权益合计		1,837,611,762.84	4,051,544,295.99
负债和所有者权益总计		1,843,975,097.19	4,056,801,442.07

注：报告截止日2016年06月30日，基金份额总额1,837,611,762.84份。其中A类基金份额为81,910,093.81份，B类基金份额为1,755,701,669.03份。

6.2 利润表

会计主体：长安货币市场证券投资基金

本报告期：2016年1月1日-2016年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2016年1月1日 -2016年6月30日	上年度可比期间2015 年01月01日-2015年06 月30日
一、收入		43,907,730.26	43,520,750.90
1. 利息收入		36,308,437.51	34,512,874.88
其中：存款利息收入	6.4.7.11	19,980,941.13	13,506,232.40
债券利息收入		14,074,838.43	16,704,045.30
资产支持证券利息收		—	—

入			
买入返售金融资产收入		2,252,657.95	4,302,597.18
其他利息收入		—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）		7,599,292.75	9,007,876.02
其中：股票投资收益		—	—
基金投资收益		—	—
债券投资收益	6.4.7.12	7,599,292.75	9,007,876.02
资产支持证券投资收益		—	—
贵金属投资收益		—	—
衍生工具收益	6.4.7.13	—	—
股利收益		—	—
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		—	—
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		—	—
减：二、费用		6,926,384.86	4,767,458.12
1. 管理人报酬		4,441,347.94	2,860,900.07
2. 托管费		1,345,862.97	866,939.33
3. 销售服务费		261,345.06	422,696.83
4. 交易费用		—	45.00
5. 利息支出		784,939.83	524,293.13
其中：卖出回购金融资产支出		784,939.83	524,293.13
6. 其他费用	6.4.7.14	92,889.06	92,583.76
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		36,981,345.40	38,753,292.78
减：所得税费用		—	—

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		36,981,345.40	38,753,292.78
-------------------	--	---------------	---------------

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长安货币市场证券投资基金

本报告期：2016年1月1日-2016年6月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2016年1月1日-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)	4,051,544,295.99	—	4,051,544,295.99
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	36,981,345.40	36,981,345.40
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)	-2,213,932,533.15	—	-2,213,932,533.15
其中：1. 基金申购款	5,757,888,203.59	—	5,757,888,203.59
2. 基金赎回款	-7,971,820,736.74	—	-7,971,820,736.74
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)	—	-36,981,345.40	-36,981,345.40
五、期末所有者权益(基金净值)	1,837,611,762.84	—	1,837,611,762.84
项 目	上年度可比期间 2015年01月01日-2015年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	2,064,031,972.33	—	2,064,031,972.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	38,753,292.78	38,753,292.78

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)	180,213,774.41	—	180,213,774.41
其中：1. 基金申购款	6,133,306,663.51	—	6,133,306,663.51
2. 基金赎回款	-5,953,092,889.10	—	-5,953,092,889.10
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)	—	-38,753,292.78	-38,753,292.78
五、期末所有者权益(基金净值)	2,244,245,746.74	—	2,244,245,746.74

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

长安货币市场证券投资基金（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”）《关于核准长安货币市场证券投资基金募集的批复》（证监许可[2012]1589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《长安货币市场证券投资基金基金合同》发售，基金合同于2013年1月25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573,358,755.50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2013年1月4日至2013年1月23日募集，募集期间净认购资金人民币573,332,659.12元，认购资金在募集期间产生的利息人民币26,096.38元，募集的有效认购份额及利息结转的基金份额合计573,358,755.50份。上述募集资金已由毕马威华振会计师事务所验证，并出具了毕马威华振验字第1300006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、《长安货币市场券投资基金基金合同》和《长安货币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：现金、通知存款、短期融资券（包括超级短期融资券）、1年以内（含1年）的银行定期存款、大额存单、期限在1年以内（含1年）的债券回购、剩余期限在397天以内（含397天）的债券、剩余期限在397天以内（含397天）的资产支持证券、剩余期限在397天以内（含397天）的中期票据、期限在1年以内（含1年）的中央银行票据（以下简称“央行票据”）和中国证监会认可的其它具有良好流动性的货币市场工具。本基金业绩比较基准为：同期七天通知存款利率（税后）。

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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2016年06月30日的财务状况、2016年上半年的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历1月1日起至12月31日止。

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。本基金现无金融资产分类为持有至到期投资和可供出售金融资产。本基金现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

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

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表

内确认。

取得债券投资支付的价款中包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，应当单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。债券投资采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，即债券投资按票面利率或商定利率每日计提应收利息，按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价；同时于每一估值日计算影子价格，以避免债券投资的摊余成本与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以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。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

为了避免采用摊余成本法计算的基金资产净值与按其他可参考公允价值指标计算的基金资产净值发生重大偏离，从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果，基金管理人于每一估值日，采用金融工具的公允价值确定影子价格。当基金资产净值与影子价格的偏离度的绝对值达到或超过 0.25% 时，基金管理人应根据风险控制的需要调整组合，使基金资产净值更能公允地反映基金资产净值。

计算影子价格时按如下原则确定金融工具的公允价值：

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，且该种法定权利是当前可执行的；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少，以及因类别调整而引起的A、B级基金份额之间的转换所产生的实收基金变动。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

债券投资收益于卖出交易日按卖出债券成交金额与其成本和应收利息的差额确认。

债券利息收入按债券投资的摊余成本与实际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。

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。

6.4.4.10 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。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

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。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别内的每份基金份额享有同等分配权。本基金收益分配方式为红利再投资，免收再投资的费用。“每日分配、按月支付”。本基金根据每日基金收益情况，以每万份基金已实现收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，每月集中支付。投资人当日收益分配的计算保留到小数点后2位，小数点后第3位按去尾原则处理，因去尾形成的余额进行再次分配，直到分完为止。本基金根据每日收益情况，将当日收益全部分配，若当日已实现收益大于零时，为投资人记正收益；若当日已实现收益小于零时，为投资人记负收益；若当日已实现收益等于零时，当日投资人不记收益。本基金每日进行收益计算并分配时，每月累计收益支付方式只采用红利再投资(即红利转基金份额)方式，投资人可通过赎回基金份额获得现金收益；若投资人在每月累计收益支付时，其累计收益为正值，则为投资人增加相应的基金份额，其累计收益为负值，则缩减投资人基金份额。若投资人赎回基金份额时，其对应收益将立即结清；若收益为负值，则从投资人赎回基金款中扣除。当日申购的基金份额自下一个工作日起，享有基金的收益分配权益；当日赎回的基金份额自下一个工作日起，不享有基金的收益分配权益。法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

6.4.4.12 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：

在银行间同业市场交易的债券品种，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》及《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》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

本基金在本年度未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本年度未发生过重大会计差错。

6.4.6 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[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债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。

(c) 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。]

(d) 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试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（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债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；质押式买入返售金融商品及持有政策性金融债券的利息收入免征增值税。

(e) 证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(2) 应交税费	债券利息收入所得税
2016年06月30日	5,170,450.82

该项系基金收到的债券发行人在支付债券利息时未代扣代缴的利息税部分。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
活期存款	1,914,476.05
定期存款	550,000,000.00
合计	551,914,476.05

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2016年6月30日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度
债券	交易所市场	—	—	—	—
	银行间市场	649,833,338.81	651,775,000.00	1,941,661.19	0.1057%
	合计	649,833,338.81	651,775,000.00	1,941,661.19	0.1057%

注：截止至本期末，本基金的交易性金融资产均为采用摊余成本法摊余的债券投资成本。本基金管理人认为本基金债券投资的公允价值与摊余成本间的差异在合理范围内。

1. 偏离金额=影子定价-摊余成本；
2. 偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末2016年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
银行间市场	427,911,881.87	—
合计	427,911,881.87	—

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未通过买断式逆回购交易取得债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	1,126.53
应收定期存款利息	469,325.66
应收其他存款利息	773,568.00
应收结算备付金利息	—
应收债券利息	12,440,042.84
应收买入返售证券利息	515,587.43
应收申购款利息	—
应收黄金合约拆借孳息	—
其他	—
合计	14,199,650.46

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	—
银行间市场应付交易费用	12,022.65
合计	12,022.65

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	—
预提审计费	29,835.26
预提信息披露费	44,753.80

中债账户维护费	4,500.00
上清所账户维护费	4,500.00
合计	83,589.06

6.4.7.9 实收基金

6.4.7.9.1 长安货币A

金额单位：人民币元

项目(A级)	本期2016年1月1日-2016年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	96,163,836.92	96,163,836.92
本期申购	337,369,600.33	337,369,600.33
本期赎回(以“-”号填列)	-351,623,343.44	-351,623,343.44
本期末	81,910,093.81	81,910,093.81

6.4.7.9.2 长安货币B

金额单位：人民币元

项目(B级)	本期2016年1月1日-2016年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	3,955,380,459.07	3,955,380,459.07
本期申购	5,420,518,603.26	5,420,518,603.26
本期赎回(以“-”号填列)	-7,620,197,393.30	-7,620,197,393.30
本期末	1,755,701,669.03	1,755,701,669.03

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

6.4.7.10.1 长安货币A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	—	—	—
本期利润	—	—	—
本期基金份额交易产生的变动数	—	—	—

其中：基金申购款	—	—	—
基金赎回款	—	—	—
本期已分配利润	-1,296,528.67	—	-1,296,528.67
本期末	—	—	—

6.4.7.10.2 长安货币B

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	—	—	—
本期利润	—	—	—
本期基金份额交易产生的变动数	—	—	—
其中：基金申购款	—	—	—
基金赎回款	—	—	—
本期已分配利润	-35,684,816.73	—	-35,684,816.73
本期末	—	—	—

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2016年1月1日-2016年6月30日
活期存款利息收入	120,021.64
定期存款利息收入	19,444,980.92
其他存款利息收入	—
结算备付金利息收入	—
其他	415,938.57
合计	19,980,941.13

注：其他为直销申购款利息收入。

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2016年1月1日-2016年6月30日
债券投资收益——买卖债券 (、债转股及债券到期兑付) 差价收入	7,599,292.75
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	7,599,292.75

6.4.7.12.2 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1月1日-2016年6月30日
卖出债券(、债转股及债券到 期兑付)成交总额	2,043,150,082.08
减：卖出债券(、债转股及债 券到期兑付)成本总额	1,973,589,611.71
减：应收利息总额	61,961,177.62
买卖债券差价收入	7,599,292.75

6.4.7.13 衍生工具收益

本基金本报告期内未进行买卖权证的交易。

6.4.7.14 其他费用

单位：人民币元

项目	本期2016年1月1日-2016年6月30日
审计费用	44753.80—
信息披露费	29835.26—
中债账户维护费	9000.00
上清账户维护费	9100.00
其他	200.00
合计	92,889.06

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无需要说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期内不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
长安基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
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
长安创新2号分级资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
长安德利1期资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
长安丰利20号分级资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
长安丰利23号分级资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
长安丰利24号分级资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
长安丰利29号分级资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
长安丰利31号分级资产管理计划	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
长安骅钰鼎立增长混合1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9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
长安基金-浦发-长安证大28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-长安证大29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-长安证大30号资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
长安基金浦发银行长安白鹭3号分级资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
长安基金浦发银行长安贝溢精选2号分级资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
长安基金浦发银行长安汇海成1号分级资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
长安基金浦发银行长安汇石聚金3号分级资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
长安基金浦发银行长安铭深1号分级资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
长安基金浦发银行长安前程进取1号分级资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
长安基金浦发银行长安前程进取2号分级资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
长安基金浦发银行长安添然1号分级资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
长安基金浦发银行长安沃善3号分级资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
长安基金浦发银行长安兴源定增1号分级资产管理计划	基金管理人管理的专户产品

长安景林定增1号资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
长安理想红利1号分级资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
长安乾祥多策略优选1号分级资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
长安瑞富1号分级资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
长安新沪商白鹭18号分级资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
长安耀之1号资产管理计划二期	基金管理人管理的专户产品
长安友连瀛1期资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
长安资产·长春城开两横两纵项目六号专项资产管理计划	基金管理人子公司的专户产品
长安资产·长春城开两横两纵项目五号专项资产管理计划	基金管理人子公司的专户产品
长安资产·杭州银行年利丰1号专项资产管理计划	基金管理人子公司的专户产品
长安资产·华泰3号专项资产管理计划	基金管理人子公司的专户产品
长安资产·年利丰12号专项资产管理计划	基金管理人子公司的专户产品
长安资产·年利丰13号专项资产管理计划	基金管理人子公司的专户产品
长安资产·年利丰2号专项资产管理计划	基金管理人子公司的专户产品
长安资产·年利丰3号专项资产管理计划	基金管理人子公司的专户产品
长安资产·年利丰6号专项资产管理计划	基金管理人子公司的专户产品
长安资产·年利丰7号专项资产管理计划	基金管理人子公司的专户产品
长安资产·年利丰8号专项资产管理计划	基金管理人子公司的专户产品
长安资产-富利13号专项资产管理计划	基金管理人子公司的专户产品
长安资产申万泓鼎新三板投资专项资产管理计划	基金管理人子公司的专户产品
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
长安汇旌9号分级资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
长安浙银悦享定增21号分级资产管理计划	基金管理人管理的专户产品

长安浙银悦享定增22号分级资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
中国银行特定客户资产托管专户（长安映雪霜雪分级1号）	基金管理人管理的专户产品

注：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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内无应支付给关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期2016年1月1日-2016年6月30日	上年度可比期间2015年01月01日-2015年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	4,441,347.94	2,860,900.07
其中：应支付销售机构的客户维护费	122,338.35	394,213.31

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0.33%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×0.33%/当年天数。

2、客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期2016年1月1日-2016年6月30日	上年度可比期间2015年01月01日-2015年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,345,862.97	866,939.33

注：支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值0.10%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×0.10% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2016年1月1日-2016年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长安货币A	长安货币B	合计
广发银行股份有限公司	2,582.00	195.19	2,777.19
长安基金管理有限公司	56,378.14	317,557.72	373,935.86
合计	58,960.14	317,752.91	376,713.05

注：长安货币A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0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金销售服务费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数；

长安货币B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0.01%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金销售服务费=前一日基金资产净值×0.01%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期2016年1月1日-2016年6月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
广发银行股份有限公司	—	—	—	—	289,400,000.00	29,562.24

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期2016年1月1日-2016年6月30日		上年度可比期间2015年01月01日-2015年06月30日	
	长安货币A	长安货币B	长安货币A	长安货币B
基金合同生效日持有的基金份额	—	—	—	—
期初持有的基金份额	—	183,676,184.85	—	42,374,075.88
期间申购/买入总份额	—	75,006,459.98	—	161,873,969.53
期间因拆分变动份额	—	—	—	—
减：期间赎回/卖出总份额	—	-123,003,642.00	—	-79,028,500.00
期末持有的基金份额	—	135,679,002.83	—	125,219,545.41
期末持有的基金份额占基金总份额比例	—	4.53%	—	5.99%

注：基金管理人于本报告期内通过直销柜台申购本基金，根据基金合同规定，申购费为0元。以上申购份额包含红利再投金额。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称		本期末 2016年6月30日		上年度末 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
A类	长安资产申万泓鼎新三板投资专项资产管理计划	906316.15	0.053%	0	—
A	长安资产鼎锋新	831863.35	0.0487%	821215.61	0.02%

类	三板专项资产管理计划				
A类	长安资产盛通精选2号A类3期专项资产管理计划	275677.3	0.0161%	272148.67	0.01%
B类	长安丰利29号分级资产管理计划	200000000	11.7019%	72222239.89	1.78%
B类	长安财富资产管理有限公司	197832611.53	11.5751%	120674155.11	2.98%
B类	长安基金浦发银行长安兴源定增1号分级资产管理计划	182181782.35	10.6594%	0	—
B类	长安丰利24号分级资产管理计划	155629899.67	9.1058%	212015375.35	5.23%
B类	长安丰利31号分级资产管理计划	100663980.82	5.8898%	185676175.78	4.58%
B类	长安基金-浦发-长安深蓝启明灵活对冲9号分级资产管理计划	83682896.44	4.8963%	43761172.52	1.08%
B类	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	72116676.08	4.2195%	37149739.36	0.92%
B类	长安国际信托股份有限公司	60140441.23	3.5188%	0	—
B类	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	50789445.54	2.9717%	28106497.2	0.69%
B类	长安弘哲亿信深蓝启明灵活对冲	46100326.19	2.6973%	23083045.95	0.57%

	6号分级资产管理计划				
B类	长安基金-浦发-长安证大29号资产管理计划	42515125.96	2.4875%	0	—
B类	长安基金浦发银行长安沃善3号分级资产管理计划	35255506.6	2.0628%	0	—
B类	长安资产·华泰1号专项资产管理计划	34925567.44	2.0435%	34436739.56	0.85%
B类	长安基金浦发银行长安添然1号分级资产管理计划	25218888.37	1.4755%	0	—
B类	长安基金浦发银行长安汇海成1号分级资产管理计划	22761491.98	1.3318%	20000000	0.49%
B类	长安资产滨海投资2号专项资产管理计划	15071962.96	0.8819%	0	—
B类	长安资产滨海投资1号专项资产管理计划	9508542.82	0.5563%	0	—
B类	长安资产民生非凡4号专项资产管理计划	8667606.41	0.5071%	8546292.18	0.21%
B类	长安资产·年利丰3号专项资产管理计划	5061835.38	0.2962%	0	—
B	长安资产·年利	5061835.33	0.2962%	0	—

类	丰7号专项资产管理计划				
---	-------------	--	--	--	--

注：以上关联方于本报告期内通过长安基金直销柜台申购本基金，申购手续费按照基金合同为0元。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期2016年1月1日-2016年6月30日		上年度可比期间2015年01月01日-2015年06月30日	
	期末余额	当期存款利息收入	期末余额	当期存款利息收入
广发银行股份有限公司	301,914,476.05	2,720,793.87	493,659,268.90	3,904,128.65

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保证金，于2016年06月30日的相关余额为人民币元0.00元。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内购入关联方承销证券。

6.4.10.7 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。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

已按再投资形式转实收基金(A级)	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	本期利润分配合计	备注
3,705,187.85	191,691.65	-2,600,350.83	1,296,528.67	
已按再投资形式转实收基金(B级)	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	本期利润分配合计	备注
34,012,687.19	3,605,263.04	-1,933,133.50	35,684,816.73	

6.4.12 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

根据《证券发行与承销管理办法》，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或认购的新发或增发债券，从新股获配日或债券成功认购日至该证券上市日期间，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。

至本期末，本基金未持有因认购新发或增发证券而受上述规定约束的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

至本期末，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

至本期末，本基金未持有正回购交易。

6.4.12.3.2 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括：

- 信用风险
- 流动性风险
- 市场风险

本基金管理人按照“健全、合理、制衡、独立”的原则，建立了合规与风险管理委员会（董事会层面）、督察长、监察稽核部和相关部门构成的全方位、多层级的合规风险管理架构。本基金管理人秉承全面风险管理的理念，将风险管理贯穿日常经营活动的整个过程，渗透到各个业务环节，覆盖所有部门和岗位，建立了集风险识别、风险测量、风险控制、风险评价、风险报告为一体的风险管理机制，全面、及时识别、分析和评估各类风险，有效防范日常经营和基金运作过程中可能面临的各种风险，最大限度地保护基金份额持有人的合法权益。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，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。本基金的银行存款存放在本基金的托管行广发银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投

资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
A-1	350,088,498.07	1,124,631,624.49
A-1以下	—	—
未评级	—	130,296,193.34
合计	350,088,498.07	1,254,927,817.83

注：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。

6.4.13.2.2 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6月30日	上年度末 2015年12月31日
AAA	—	—
AAA以下	—	—
未评级	299,744,840.74	410,489,303.52
合计	299,744,840.74	410,489,303.52

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。

6.4.13.3 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主要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和基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额。

本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此均能及时变现。此外，

本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合约约定剩余到期日均为一年以内，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日。

此外，针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人在基金合同中约定了巨额赎回条款，制定了发生巨额赎回时资金的处理模式，控制因开放模式而产生的流动性风险。本基金的基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人日常通过对持仓品种组合的久期分析等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2016年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	551,914,476.05	—	—	—	551,914,476.05
交易性金融资产	649,833,338.81	—	—	—	649,833,338.81
买入返售金融资产	427,911,881.87	—	—	—	427,911,881.87
应收利息	—	—	—	14,199,650.46	14,199,650.46
应收申购款	—	—	—	200,115,750.00	200,115,750.00

资产总计	1,629,659,696.73	—	—	214,315,400.46	1,843,975,097.19
负债					
应付管理人报酬	—	—	—	467,393.45	467,393.45
应付托管费	—	—	—	141,634.38	141,634.38
应付销售服务费	—	—	—	31,323.67	31,323.67
应付交易费用	—	—	—	12,022.65	12,022.65
应交税费	—	—	—	5,170,450.82	5,170,450.82
应付利润	—	—	—	456,920.32	456,920.32
其他负债	—	—	—	83,589.06	83,589.06
负债总计	—	—	—	6,363,334.35	6,363,334.35
利率敏感度缺口	1,629,659,696.73	—	—	207,952,066.11	1,837,611,762.84
上年度末2015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	1,430,872,656.93	—	—	—	1,430,872,656.93
交易性金融资产	1,665,417,121.35	—	—	—	1,665,417,121.35
买入返售金融资产	600,301,420.45	—	—	—	600,301,420.45
应收利息	—	—	—	52,001,649.34	52,001,649.34
应收申购款	—	—	—	308,208,594.00	308,208,594.00
资产总计	3,696,591,198.73	—	—	360,210,243.34	4,056,801,442.07

负债					
应付管理人报酬	—	—	—	1,214,199.08	1,214,199.08
应付托管费	—	—	—	367,939.13	367,939.13
应付销售服务费	—	—	—	56,813.60	56,813.60
应付交易费用	—	—	—	26,215.00	26,215.00
应交税费	—	—	—	938,600.00	938,600.00
应付利润	—	—	—	2,494,379.27	2,494,379.27
其他负债	—	—	—	159,000.00	159,000.00
负债总计	—	—	—	5,257,146.08	5,257,146.08
利率敏感度缺口	3,696,591,198.73	—	—	354,953,097.26	4,051,544,295.99

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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
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6月30日	上年度末 2015年12月31日
	市场利率下降25个基点	650,262.97	1,901,507.01
	市场利率上升25个基点	-650,262.97	-1,901,507.01

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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。本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，且以摊余成本进行后续计量，因此无重大其他价格风险。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金在本期间未发生有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	固定收益投资	649,833,338.81	35.24
	其中：债券	649,833,338.81	35.24
	资产支持证券	—	—
2	买入返售金融资产	427,911,881.87	23.21
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
3	银行存款和结算备付金合计	551,914,476.05	29.93
4	其他各项资产	214,315,400.46	11.62
5	合计	1,843,975,097.19	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	2.38	
	其中：买断式回购融资	—	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	—	—
	其中：买断式回购融资	—	—

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	71
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	105
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	57

注：根据基金合同约定，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日不得超过120天。本报告期内未发生平均剩余期限超过120天的情况。

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

序号	发生日期	平均剩余期限（天数）	原因	调整期
1	无	0	-	-

7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例（%）	各期限负债占基金资产净值的比例（%）
1	30天以内	38.09	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
2	30天(含)—60天	25.58	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
3	60天(含)—90天	—	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
4	90天(含)—120天	8.17	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
5	120天(含)—397天（含）	16.85	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
	合计	88.68	—

7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

序号	发生日期	平均剩余存续期	原因	调整期
1	无	0	-	-

7.5 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	摊余成本	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	299,744,840.74	16.31
	其中：政策性金融债	299,744,840.74	16.31
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	350,088,498.07	19.05
6	中期票据	—	—
7	其他	—	—
8	合计	649,833,338.81	35.36
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	—	—

7.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量 (张)	摊余成本	占基金资产净值比例（%）
1	160209	16国开09	2,500,000	249,759,149.05	13.59
2	041564052	15渝轻纺 CP001	1,100,000	110,058,349.03	5.99
3	041667002	16西安民生 CP001	600,000	59,968,738.71	3.26
4	041560087	15润华 CP002	500,000	50,047,518.69	2.72
5	041566019	15三星 CP002	500,000	50,011,018.87	2.72
6	041567003	15润华	500,000	49,995,401.22	2.72

		CP001			
7	150222	15国开22	500,000	49,985,691.69	2.72
8	041560066	15九华山 CP002	300,000	30,007,471.55	1.63

7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	8
报告期内偏离度的最高值	0.2694%
报告期内偏离度的最低值	-0.2002%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1362%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

序号	发生日期	偏离度	原因	调整期
1	无	0	-	-

报告期内负偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

序号	发生日期	偏离度	原因	调整期
1	无	0	-	-

7.8 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。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 基金计价方法说明。

本基金计价采用摊余成本法，即计价对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内按照实际利率法每日计提收益。

本基金通过每日计算基金收益并分配的方式，使基金份额资产净值保持在人民币1.00元。

7.9.2 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现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。

7.9.3 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	—
2	应收证券清算款	—
3	应收利息	14,199,650.46
4	应收申购款	200,115,750.00
5	其他应收款	—
6	待摊费用	—
7	其他	—
8	合计	214,315,400.46

7.9.4 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有 份额	占总份 额 比例	持有 份额	占总份 额 比例
长安货 币A	2,668	30,700.93	14,142,876 .02	0.7696%	67,767,217 .79	82.7337 %
长安货 币B	33	53,203,080 .88	1,694,978, 577.54	92.2381 %	60,723,091 .49	3.4586%
合计	2,701	680,344.97	1,709,121, 453.56	93.0078 %	128,490,30 9.28	6.9922%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本基金	长安货币A	3,391,944.43	4.14%
	长安货币B	—	—
	合计	3,391,944.43	0.18%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本 开放式基金	长安货币A	>100
	长安货币B	
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放 式基金	长安货币A	
	长安货币B	
	合计	

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	长安货币A	长安货币B
基金合同生效日(2013年1月25日)基金 份额总额	404,356,815.50	169,001,940.00
本报告期期初基金份额总额	96,163,836.92	3,955,380,459.07
本报告期基金总申购份额	337,369,600.33	5,420,518,603.26
减：本报告期基金总赎回份额	351,623,343.44	7,620,197,393.30
本报告期期末基金份额总额	81,910,093.81	1,755,701,669.03

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：

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监管部门稽查或处罚的情况

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 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	债券成交金额	债券交易占当期成交总额的比例	债券回购成交金额	债券回购交易占当期成交总额的比例	权证交易成交金额	权证交易占当期成交总额	应支付券商的佣金	应支付券商的佣金占当期佣金总量的比例	备注

							额的比例			
海通证券	1	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-	-	-	-	-

注：基金租用席位的选择标准是：

- (1) 资力雄厚，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。

10.8 偏离度绝对值超过0.5%的情况

本基金本报告期内偏离度绝对值不存在超过0.5%的情况。

10.9 其他重大事件

序号	公告事项	信息披露方式	披露日期
1	长安基金管理有限公司关于调整我公司受指数熔断影响的相关基金2016年1月4日开放时间的公告	《中国证券报》	2016-01-04
2	长安基金管理有限公司关于2016年1月7日指数熔断期间调整旗下部分基金开放时间的公告	《中国证券报》	2016-01-07
3	长安货币市场证券投资基金2015	《中国证券报》	2016-01-20

	年第4季度报告		
4	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
5	关于长安货币市场证券投资基金春节前二个工作日暂停申购(含转换转入及定期定额投资)业务公告	《中国证券报》	2016-02-02
6	关于旗下基金参与上海利得基金销售有限公司费率优惠活动的公告	《中国证券报》	2016-02-24
7	长安货币市场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》	2016-03-05
8	关于长安基金管理有限公司旗下基金在大同证券有限责任公司开通定期定额投资业务的公告	《中国证券报》	2016-03-08
9	关于长安基金管理有限公司旗下基金参与平安证券费率优惠活动的公告	《中国证券报》	2016-03-18
10	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
11	长安货币市场证券投资基金2015年年度报告及摘要	《中国证券报》	2016-03-26
12	关于旗下基金参与中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》	2016-03-30
13	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
14	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	《中国证券报》	2016-04-06

	并参与费率优惠活动的公告		
15	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
16	长安货币市场证券投资基金2016年第1季度报告	《中国证券报》	2016-04-22
17	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
18	关于旗下部分开放式基金参加盈米财富转换费率优惠活动的公告	《中国证券报》	2016-05-27
19	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
20	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
21	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
22	关于旗下基金参与交通银行股份有限公司网上银行、手机银行基金申购手续费费率优惠的公告	《中国证券报》	2016-06-24
23	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、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》	2016-06-24
24	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

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立长安货币市场证券投资基金的文件。
- 2、长安货币市场证券投资基金合同。
- 3、长安货币市场证券投资基金托管协议。
- 4、中国证监会批准设立长安基金管理有限公司的文件。
- 5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告。

12.2 存放地点

上海市浦东新区芳甸路1088号紫竹国际大厦16层

12.3 查阅方式

www.changanfunds.com

长安基金管理有限公司

二〇一六年八月二十五日