

长安货币市场证券投资基金 2018 年年度报告摘要

2018 年 12 月 31 日

基金管理人:长安基金管理有限公司

基金托管人:广发银行股份有限公司

送出日期:2019 年 03 月 29 日

§ 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。本年度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 2019 年 3 月 28 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，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料已经会计师事务所审计。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2018 年 01 月 01 日起至 2018 年 12 月 31 日止。

§ 2基金简介

2.1基金基本情况

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01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	6,542,720,626.79份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	长安货币A	长安货币B
下属分级基金的交易代码	740601	740602
报告期末下属分级基金的份额总额	112,231,576.38份	6,430,489,050.41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	戴辉
	联系电话	021-20329700	010-65169958
	电子邮箱	service@changanfunds.com	daihui@cgbchina.com.cn
客户服务电话		400-820-9688	95508
传真		021-50598018	010-65169555

2.4 信息披露方式

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	上海市浦东芳甸路1088号紫竹大厦16楼

§ 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	2018年		2017年		2016年	
	长安货币 A	长安货币B	长安货币 A	长安货币B	长安货 币A	长安货币B
本期已实现 收益	3,219,12 5.13	110,329,6 15.47	2,581,92 1.44	53,670,66 9.10	2,198,6 51.34	64,644,33 2.53
本期利润	3,219,12 5.13	110,329,6 15.47	2,581,92 1.44	53,670,66 9.10	2,198,6 51.34	64,644,33 2.53
本期净值收 益率	3.4704%	3.7194%	3.6840%	3.9317%	2.5177%	2.7641%
3.1.2 期末 数据和指标	2018年末		2017年末		2016年末	

期末基金资产净值	112,231,576.38	6,430,489,050.41	361,726,151.98	2,586,743,770.20	50,287,045.81	1,393,871,049.05
期末基金份额净值	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000

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

长安货币A

阶段	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
过去三个月	0.6863%	0.0021%	0.3450%	0.0000%	0.3413%	0.0021%
过去六个月	1.4550%	0.0023%	0.6900%	0.0000%	0.7650%	0.0023%
过去一年	3.4704%	0.0024%	1.3688%	0.0000%	2.1016%	0.0024%
过去三年	9.9726%	0.0034%	4.1100%	0.0000%	5.8626%	0.0034%
过去五年	19.8396%	0.0053%	6.8475%	0.0000%	12.9921%	0.0053%
自基金合同生效起至今	24.1639%	0.0051%	8.1263%	0.0000%	16.0376%	0.0051%

本基金的业绩比较基准为：同期七天通知存款利率（税后）。

长安货币B

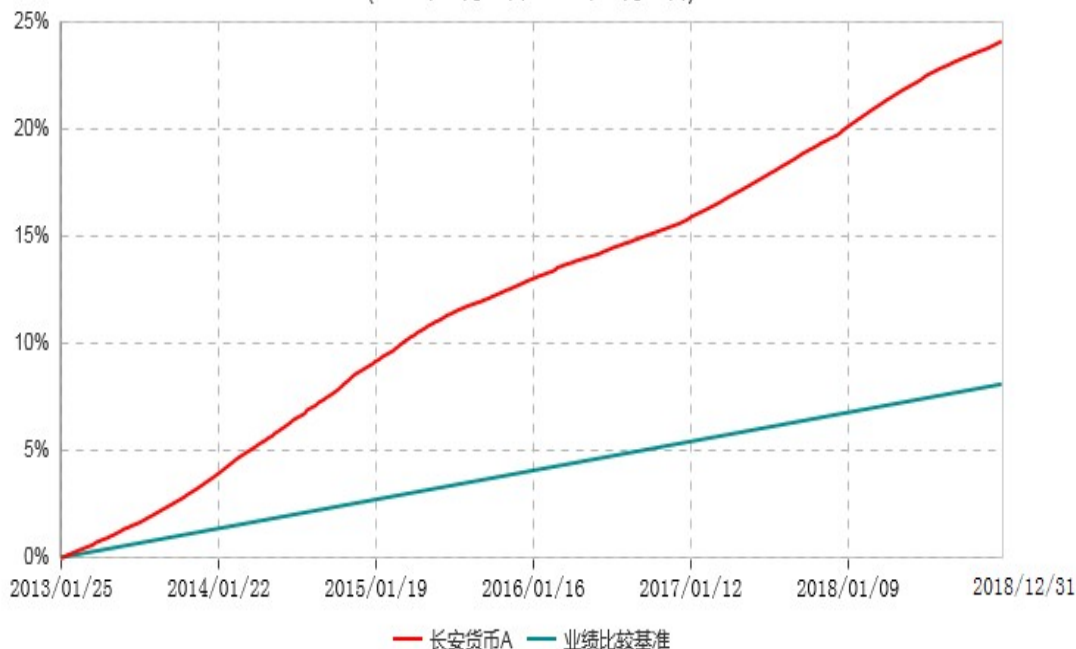
阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三 个月	0.7469%	0.0021%	0.3450%	0.0000%	0.4019%	0.0021%
过去六 个月	1.5774%	0.0023%	0.6900%	0.0000%	0.8874%	0.0023%
过去一 年	3.7194%	0.0024%	1.3688%	0.0000%	2.3506%	0.0024%
过去三 年	10.8517%	0.0034%	4.1100%	0.0000%	6.7417%	0.0034%
过去五 年	21.2938%	0.0053%	6.8475%	0.0000%	14.4463%	0.0053%
自基金 合同生 效起至 今	25.9535%	0.0051%	8.1263%	0.0000%	17.8272%	0.0051%

本基金的业绩比较基准为：同期七天通知存款利率（税后）。

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A累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

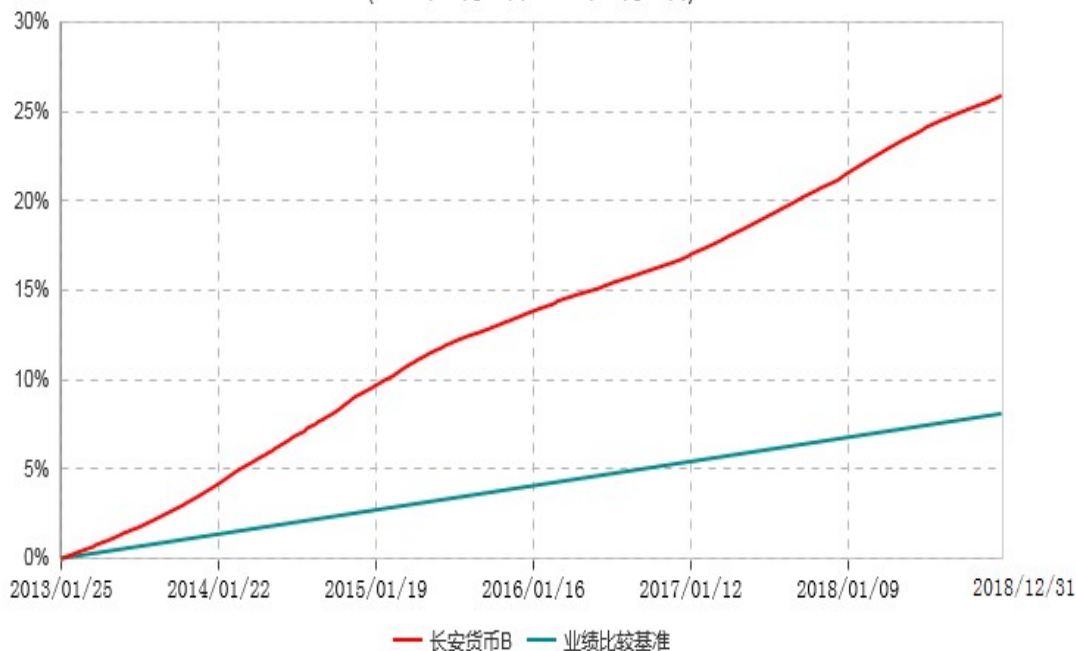
(2013年01月25日-2018年12月31日)



- 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。图示日期为2013年1月25日至2018年12月31日。
- 2、本基金的收益分配是按月结转份额。

长安货币B累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

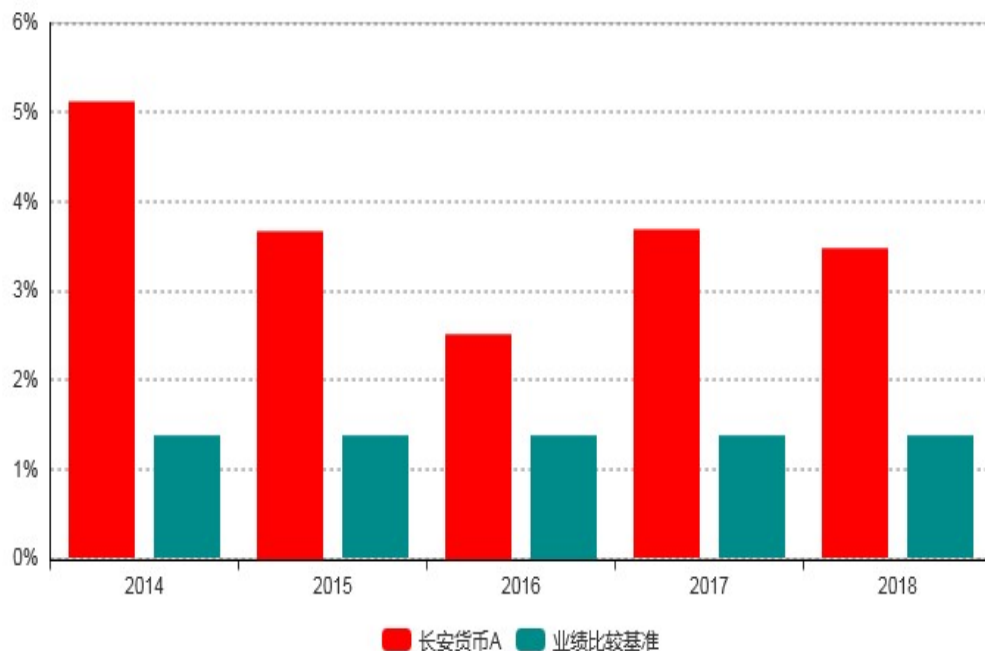
(2013年01月25日-2018年12月31日)



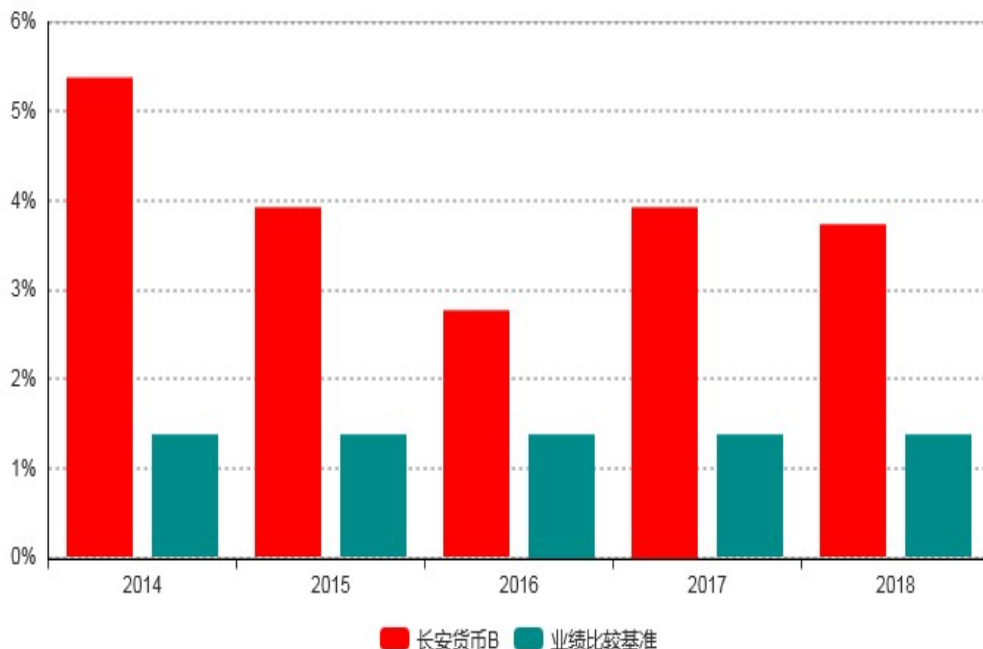
1、根据基金合同的规定,自基金合同生效之日起 6 个月内基金各项资产配置比例需符合基金合同要求。本基金在建仓期结束时,各项资产配置比例已符合基金合同有关投资比例的约定。图示日期为 2013 年 1 月 25 日至 2018 年 12 月 31 日。

2、本基金的收益分配是按月结转份额。

3. 2. 3过去五年基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



本基金合同生效日为 2013 年 1 月 25 日,合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。



本基金合同生效日为 2013 年 1 月 25 日，合同生效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

长安货币A

单位：人民币元

年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2018年	3,787,222.88	650,120.08	-1,218,217.83	3,219,125.13	-
2017年	2,376,217.83	402,998.92	-197,295.31	2,581,921.44	-
2016年	2,689,947.83	251,884.70	-743,181.19	2,198,651.34	-
合计	8,853,388.54	1,305,003.70	-2,158,694.33	7,999,697.91	-

长安货币B

单位：人民币元

年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
----	--------------	---------------	----------	----------	----

2018年	98,289,058.49	8,667,989.85	3,372,567.13	110,329,615.47	-
2017年	47,381,560.94	4,119,144.83	2,169,963.33	53,670,669.10	-
2016年	57,214,372.94	8,536,011.14	-1,106,051.55	64,644,332.53	-
合计	202,884,992.37	21,323,145.82	4,436,478.91	228,644,617.10	-

§ 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、杭州景林投资管理合伙企业（有限合伙）、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。截至 2018 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理长安宏观策略混合型证券投资基金、长安沪深 300 非周期行业指数证券投资基金、长安货币市场证券投资基金、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、长安鑫益增强混合型证券投资基金、长安泓泽纯债债券型证券投资基金、长安鑫富领先灵活配置混合型证券投资基金、长安鑫恒回报混合型证券投资基金、长安鑫垚主题轮动混合型证券投资基金、长安鑫旺价值灵活配置混合型证券投资基金、长安鑫兴灵活配置混合型证券投资基金、长安裕盛灵活配置混合型证券投资基金、长安裕泰灵活配置混合型证券投资基金、长安鑫禧灵活配置混合型证券投资基金、长安裕腾灵活配置混合型证券投资基金、长安泓润纯债债券型证券投资基金、长安裕隆灵活配置混合型证券投资基金等 18 只证券投资基金。

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		
方红涛	本基金的基金经理	2017-12-11	-	6年	曾任国联证券股份有限公司场外市场部项目负责人、投资经理，资产管理

					部固定收益部投资经理、投资主办，现任长安基金管理有限公司基金投资部基金经理。
--	--	--	--	--	--

- 1、任职日期和离任日期均指公司做出决定后正式对外公告之日；
- 2、证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

在本报告期内，本基金严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，投资管理和交易执行相隔离，实行集中交易制度，公平对待所管理的所有基金和投资组合，未出现违反公平交易制度的情况，亦未受到监管机构的相关调查。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人树立价值投资理念，设置合理的组织架构和科学的投资决策体系，确保投资、研究、交易各个环节的独立性。同时，建立健全公司适用的投资对象备选库和交易对手备选库，共享研究成果，在确保投资组合间的信息隔离与保密的情况下，保证建立信息公开、资源共享的公平投资管理环境。

公司建立了专门的公平交易制度，并在交易系统中采用公平交易模块，保证公平交易的严格执行。对异常交易的监控包括事前、事中和事后三个环节，并经过严格的报告和审批程序，防范和控制异常交易。报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《长安基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

纵观 2018 年全年，国内宏观经济呈现下行，受到全球贸易争端影响，工业企业利润增速下滑，房地产调控全年未有放松，地产投融资受到抑制，遏制了房价的过快增长。2018 年央行通过降准、MLF续作、OMO等货币政策工具调节市场货币供应局面，全年货币

政策稳健偏松。2018 年下半年地方债发行提速，以着力发展基建稳增长。2018 年全年风险偏好处于低位，利率债和高等级信用债收益率快速下行，债券资产表现明显优于权益性资产。对于货币基金的资产端方面，货币政策宽松的情形下，资产收益率快速下行。

报告期内，同业存单、同业存款收益率不断下行，本基金主要配置主要为高评级、流动性好、短久期资产，杠杆方面配合资金面宽松，并适度增加杠杆，争取在保持高流动性的情形下增加收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末长安货币A基金份额净值为 1.000 元，本报告期内，该类基金份额净值收益率为 3.4704%，同期业绩比较基准收益率为 1.3688%；截至报告期末长安货币B基金份额净值为 1.000 元，本报告期内，该类基金份额净值收益率为 3.7194%，同期业绩比较基准收益率为 1.3688%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2019 年上半年，我们认为宏观经济仍然有较大的下行压力，但经济数据在 2 季度末或提前企稳，全年的货币政策较 2018 年变化不大，宽松的货币政策下，货币基金的配置策略与 2018 年基本保持一致。

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(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。

4.7 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 12 次基金收益集中支付并结转为基金份额，分别为 2018 年 1 月 25 日，2018 年 2 月 26 日，2018 年 3 月 26 日，2018 年 4 月 25 日，2018 年 5 月 25 日，2018 年 6 月 25 日，2018 年 7 月 25 日，2018 年 8 月 27 日，2018 年 9 月 25 日，2018 年 10 月 25 日，2018 年 11 月 26 日，2018 年 12 月 25 日。累计分配收益 102,076,281.37 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 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

本基金本报告期审计报告为标准无保留意见审计报告。

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连续出现 20 个工作日(含)以上基金资产净值低于五千万元的情形或连续出现 20 个工作日(含)以上持有人人数不足 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

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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

本报告期基金年度财务会计报告经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)审计，注册会计师签字出具了标准无保留意见的审计报告。投资者可通过登载于本管理人网站的年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 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：2018年12月31日

单位：人民币元

资产	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
资产：		
银行存款	936,295,381.13	703,446,600.67
结算备付金	-	-
存出保证金	-	-

交易性金融资产	3,489,051,821.42	1,481,262,039.99
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	3,489,051,821.42	1,481,262,039.99
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	2,430,550,725.84	734,671,582.00
应收证券清算款	-	40,483,706.30
应收利息	23,526,157.58	10,433,674.87
应收股利	-	-
应收申购款	12,324,145.44	52,314,765.84
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	6,891,748,231.41	3,022,612,369.67
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2018年12月31日	2017年12月31日
负债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	336,939,294.59	65,339,661.99
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	16,000.00
应付管理人报酬	1,132,376.96	384,477.41
应付托管费	343,144.53	116,508.34
应付销售服务费	51,257.27	42,149.61
应付交易费用	82,663.05	32,400.85
应交税费	5,418,064.01	5,397,850.82
应付利息	129,640.36	36,583.92
应付利润	4,772,163.85	2,617,814.55

递延所得税负债	-	-
其他负债	159,000.00	159,000.00
负债合计	349,027,604.62	74,142,447.49
所有者权益：		
实收基金	6,542,720,626.79	2,948,469,922.18
未分配利润	-	-
所有者权益合计	6,542,720,626.79	2,948,469,922.18
负债和所有者权益总计	6,891,748,231.41	3,022,612,369.67

报告截止日2018年12月31日，基金份额总额6,542,720,626.79份。其中A类基金份额为112,231,576.38份，B类基金份额为6,430,489,050.41份。

7.2 利润表

会计主体：长安货币市场证券投资基金

本报告期：2018年01月01日至2018年12月31日

单位：人民币元

项目	本期2018年01月01日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12月31日
一、收入	132,967,047.84	63,829,781.90
1. 利息收入	128,826,220.78	63,166,447.44
其中：存款利息收入	27,645,528.34	34,943,010.37
债券利息收入	69,817,937.20	11,024,884.15
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	31,362,755.24	17,198,552.92
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	4,140,827.06	663,334.46
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	4,140,827.06	663,334.46

资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3. 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	19,418,307.24	7,577,191.36
1. 管理人报酬	10,548,422.72	4,782,136.66
2. 托管费	3,196,491.76	1,449,132.40
3. 销售服务费	541,976.75	304,868.47
4. 交易费用	-	-
5. 利息支出	4,931,837.11	853,853.83
其中：卖出回购金融资产支出	4,931,837.11	853,853.83
6. 税金及附加	12,108.22	-
7. 其他费用	187,470.68	187,200.00
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	113,548,740.60	56,252,590.54
减：所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	113,548,740.60	56,252,590.54

7.3 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：2018年01月01日至2018年12月31日

单位：人民币元

项目	本期
	2018年01月01日至2018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)	2,948,469,92 2.18	-	2,948,469,922.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	113,548,740.6 0	113,548,740.60
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)	3,594,250,70 4.61	-	3,594,250,704.61
其中：1. 基金申购款	15,404,964,38 0.92	-	15,404,964,380.9 2
2. 基金赎回款	-11,810,713,6 76.31	-	-11,810,713,676. 31
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)	-	-113,548,740. 60	-113,548,740.60
五、期末所有者权益(基金净值)	6,542,720,62 6.79	-	6,542,720,626.79
项目	上年度可比期间		
	2017年01月01日至2017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)	1,444,158,09 4.86	-	1,444,158,094.86
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	56,252,590.54	56,252,590.54
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	1,504,311,82 7.32	-	1,504,311,827.32
其中：1. 基金申购款	8,307,548,83 2.00	-	8,307,548,832.00
2. 基金赎回款	-6,803,237,00 4.68	-	-6,803,237,004.6 8
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-56,252,590.5 4	-56,252,590.54

(净值减少以“-”号填列)			
五、期末所有者权益(基金净值)	2,948,469,922.18	-	2,948,469,922.18

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：

袁丹旭

吴纓

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”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《长安货币市场证券投资基金基金合同》和《长安货币市场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:现金,期限在1年以内(含1年)的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单,剩余期限在397天以内(含397天)的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券和中国证监会、中国人民银行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2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及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要求,真实、完整地反映了本基金2018年12月31日的财务状况、2018年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 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

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。

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。

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。

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；
- 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金估计公允价值时，考虑市场参与者在计量日对相关资产或负债进行定价时考虑的特征(包括资产状况及所在位置、对资产出售或者使用的限制等)，并采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

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。

当影子定价确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的负偏离度绝对值达到 0.25%时，基金管理人应当在 5 个交易日内将负偏离度绝对值调整到 0.25%以内。当正偏离度绝对值达到 0.5%时，基金管理人应当暂停接受申购并在 5 个交易日内将正偏离度绝对值调整到 0.5%以内。当负偏离度绝对值达到 0.5%时，基金管理人应当使用风险准备金或者固有资金弥补潜在资产损失，将负偏离度绝对值控制在 0.5%以内。当负偏离度绝对值连续两个交易日超过 0.5%时，基金管理人应当采用公允价值估值方法对持有投资组合的账面价值进行调整，或者采取暂停接受所有赎回申请并终止基金合同进行财产清算等措施。

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。

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。每份基金份额面值为 1.000 元。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。

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，并于会计期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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(如适用)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。

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

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。

7.4.4.12分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13其他重要的会计政策和会计估计

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。

7.4.5会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1会计政策变更的说明

本基金在本年度未发生重大会计政策变更。

7.4.5.2会计估计变更的说明

本基金在本年度未发生重大会计估计变更。

7.4.5.3差错更正的说明

本基金在本年度未发生重大会计差错更正。

7.4.6税项

(1)主要税项说明

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《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》、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]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关

于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、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[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》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) 证券投资基金管理人运用基金买卖债券的差价收入暂不征收企业所得税。

(b) 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。

2018 年 1 月 1 日(含)以后，资管产品管理人(以下称管理人)运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日以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，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(c) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(d) 对基金在 2018 年 1 月 1 日(含)以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

(2) 应交税费债券利息收入所得税

2018 年 12 月 31 日 5,418,064.01 元

2017 年 12 月 31 日 5,397,850.82 元

2016 年 12 月 31 日 5,397,850.82 元

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。

7.4.7 关联方关系

本基金本报告期内经长安基金管理有限公司（以下简称“本公司”）股东会审议通过，并经中国证券监督管理委员会证监许可[2017]2440号文批复同意，本公司原股东上海景林投资发展有限公司将其持有的本公司 25.93%股权转让给杭州景林投资管理合伙企业（有限合伙）。

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
广发银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
长安国际信托股份有限公司	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
杭州景林投资管理合伙企业（有限合伙）	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
长安春华秋实11号投资组合资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
长安纯熙精选1期资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
长安纯熙聚盈1号资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
长安丰大1号资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
长安弘硕2号资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
长安基金-长安基金安鑫1号资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
长安基金-长安久铭浦睿1号资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
长安基金长安久期债券2号资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
长安基金长安睿享2号分级资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
长安基金长安源乐晟3号资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
长安基金公司-工行-长安东成1号资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
长安基金-浦发银行-长安信托6号投资组合	基金管理人管理的专户产品
长安基金浦发银行长安西元2号投资组合	基金管理人管理的专户产品
长安基金拾贝投资信元2号资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
长安基金拾贝投资信元3号资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
长安基金拾贝投资信元4号资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
长安基金拾贝投资信元8号资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
长安基金-世真信宏1号资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
长安基金-世真信宏2号资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
长安基金私募证券基金2号（和聚）明珠资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
长安基金源乐晟信晟10号资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
长安基金源乐晟信晟1号资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
长安基金源乐晟信晟2号资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
长安基金源乐晟信晟3号资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
长安基金源乐晟信晟4号资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
长安基金源乐晟信晟5号资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
长安基金源乐晟信晟6号资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
长安基金源乐晟信晟7号资产管理计划	基金管理人管理的专户产品

长安基金源乐晟信晟8号资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
长安基金源乐晟信晟9号资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
长安基金证大信荣稳健增长1号资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
长安平安富贵千金净雅资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
长安润银5号资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
长安祥瑞1号分级资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
长安西元6号单一资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
长安源乐晟1号资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
长安源乐晟2号资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
长安-中信银行权益策略1期4号资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
长安-中信银行睿赢精选A类1期资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
长安-中信银行睿赢精选A类5期资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
长安-中信银行睿赢精选A类6期资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
长安-中信银行睿赢精选C类4期资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
长安资产-长安开元1号专项资产管理计划	基金管理人子公司管理的专户产品
长安资产传化物流股权投资专项资产管理计划	基金管理人子公司管理的专户产品
长安资产侗乡投资1号专项资产管理计划	基金管理人子公司管理的专户产品
长安资产侗乡投资2号专项资产管理计划	基金管理人子公司管理的专户产品
长安资产侗乡投资3号专项资产管理计划	基金管理人子公司管理的专户产品
长安资产侗乡投资4号专项资产管理计划	基金管理人子公司管理的专户产品
长安资产贵安1号专项资产管理计划	基金管理人子公司管理的专户产品
长安资产贵安3号专项资产管理计划	基金管理人子公司管理的专户产品
长安资产贵安4号专项资产管理计划	基金管理人子公司管理的专户产品

长安资产-汉中1号专项资产管理计划	基金管理人子公司管理的专户产品
长安资产-汉中2号专项资产管理计划	基金管理人子公司管理的专户产品
长安资产-华泰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
长安资产景林新三板2期专项资产管理计划	基金管理人子公司管理的专户产品
长安资产景林新三板专项资产管理计划	基金管理人子公司管理的专户产品
长安资产-凯里交建1号专项资产管理计划	基金管理人子公司管理的专户产品
长安资产-盘州红腾2号专项资产管理计划	基金管理人子公司管理的专户产品
长安资产-盘州红腾3号专项资产管理计划	基金管理人子公司管理的专户产品
长安资产天津物产浩英1号专项资产管理计划	基金管理人子公司管理的专户产品
广发银行托管专户-长安善渊1号资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
广发银行托管专户-长安顺时长青19号资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
广发银行托管专户-长安裕丰精选2号投资组合	基金管理人管理的专户产品
广发银行托管专户-长安裕丰精选3号投资组合	基金管理人管理的专户产品
广发银行托管专户-长安裕丰精选4号投资组合	基金管理人管理的专户产品
广发银行托管专户-长安悦享定增61号投资组合	基金管理人管理的专户产品
兴业银行资产托管专户长安酉元7号单一资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
中国工商银行上海市分行托管专户-长安春华秋实3号资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
中国工商银行股份有限公司深圳市分行资产托管专户-长安誉享9号资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
中国工商银行上海市分行托管专户-长安基金罗牛山投资组合	基金管理人管理的专户产品

中国工商银行股份有限公司深圳市分行资产托管专户-长安舜耕悦享定增56号投资组合	基金管理人管理的专户产品
中国工商银行股份有限公司浙江省分行托管专户-长安青松1号投资组合	基金管理人管理的专户产品
中国工商银行股份有限公司浙江省分行托管专户-长安青松2号投资组合	基金管理人管理的专户产品
中国工商银行股份有限公司浙江省分行托管专户-长安青松3号投资组合	基金管理人管理的专户产品
中国工商银行股份有限公司浙江省分行托管专户-长安弘硕1号资产管理计划	基金管理人管理的专户产品

上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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内均未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.3 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内均未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.8.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间内均无应支付给关联方的佣金。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2018年01月01日至2018年12月31日	2017年01月01日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	10,548,422.72	4,782,136.66
其中：支付销售机构的客户维护费	165,201.92	261,928.31

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。

7.4.8.2.2基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	3,196,491.76	1,449,132.40

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。

7.4.8.2.3销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2018年01月01日至2018年12月31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	3,670.78	0.00	3,670.78
长安基金管理有限公司	107,432.55	299,285.81	406,718.36
合计	111,103.33	299,285.81	410,389.14
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12月31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	5,566.06	0.00	5,566.06
长安基金管理有限公司	42,554.91	121,708.39	164,263.30
合计	48,120.97	121,708.39	169,829.36

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；

7.4.8.3与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2018年01月01日至2018年12月31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	198,216,000.00	49,675,781.87	-	-	644,030,000.00	75,263.71
上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12月31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	-	-	-	-	198,000,000.00	15,189.04

7.4.8.4各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

长安货币A

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期
----	----	--------

	2018年01月01 日至2018年12 月31日	间 2017年01月01 日至2017年12 月31日
基金合同生效日（2013年01月25日）持有的基金份额	0.00	0.00
报告期初持有的基金份额	0.00	0.00
报告期间申购/买入总份额	44,617,002.01	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	44,617,002.01	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	0.00%

长安货币B

份额单位：份

项目	本期 2018年01月01 日至2018年12 月31日	上年度可比期 间 2017年01月01 日至2017年12 月31日
基金合同生效日（2013年01月25日）持有的基金份额	0.00	0.00
报告期初持有的基金份额	101,075,402.1 5	174,821,083.6 7
报告期间申购/买入总份额	174,335,976.0 4	189,339,080.1 1
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	66,552,106.00	263,084,761.6 3
报告期末持有的基金份额	208,859,272.1 9	101,075,402.1 5
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	3.19%	3.43%

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。

7.4.8.4.2报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

长安货币A

关联方名称	本期末 2018年12月31日		上年度末 2017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 长安睿享 2号分级 资产管理 计划	270,251.72	0.0000%	605,240.47	0.0200%
长安资产 申万泓鼎 新三板投 资专项资 产管理计 划	193,261.60	0.0000%	186,732.51	0.0100%
长安祥瑞 2号分级 资产管理 计划	644,118.90	0.0100%	622,358.43	0.0200%
长安平安 富贵恒康 医疗资产 管理计划	1,043,613.59	0.0200%	1,008,357.08	0.0300%
长安-中 信银行睿 赢精选C 类4期资	2,400,000.00	0.0400%	0.00	0.0000%

产管理计划				
长安资产·华泰1号专项资产管理计划	2,044,248.08	0.0300%	1,975,187.05	0.0700%
长安资产-长安开元1号专项资产管理计划	2,779,369.77	0.0400%	0.00	0.0000%
长安资产-凯里交建1号专项资产管理计划	713,788.53	0.0100%	0.00	0.0000%
长安资产-汉中2号专项资产管理计划	254,203.82	0.0000%	0.00	0.0000%
长安资产-汉中1号专项资产管理计划	457,566.90	0.0100%	0.00	0.0000%
长安资产-盘州红腾2号专项资产管理计划	935,845.94	0.0100%	0.00	0.0000%
长安资产-盘州红腾3号专项资产管理计划	915,078.21	0.0100%	0.00	0.0000%

理计划				
长安资产 贵安1号 专项资产 管理计划	632,121.41	0.0100%	0.00	0.0000%
长安资产 贵安3号 专项资产 管理计划	233,375.21	0.0000%	0.00	0.0000%
长安资产 贵安4号 专项资产 管理计划	667,360.15	0.0100%	0.00	0.0000%
长安资产 鼎锋新三 板专项资 产管理计 划	903,070.13	0.0100%	872,561.53	0.0300%
长安资产 -华泰5号 专项资产 管理计划	1,323,364.63	0.0200%	1,671,366.03	0.0600%
长安基金 拾贝投资 信元3号 资产管理 计划	3,900,000.00	0.0600%	0.00	0.0000%
长安基金 拾贝投资 信元2号 资产管理 计划	3,500,000.00	0.0500%	0.00	0.0000%
长安祥瑞 1号分级	0.00	0.0000%	606,073.18	0.0200%

资产管理计划				
长安资产 桐乡投资 1号专项 资产管理 计划	0.00	0.0000%	1,267,100.88	0.0400%
长安资产 桐乡投资 2号专项 资产管理 计划	0.00	0.0000%	940,816.94	0.0300%
中国工商 银行上海 市分行托 管专户- 长安春华 秋实3号 资产管理 计划	0.00	0.0000%	1,482,418.89	0.0500%
中国工商 银行股份 有限公司 浙江省分 行托管专 户-长安 青松1号 投资组合	1,300,000.00	0.0200%	0.00	0.0000%
中国工商 银行股份 有限公司 浙江省分 行托管专 户-长安	1,120,000.00	0.0200%	0.00	0.0000%

青松2号 投资组合				
中国工商 银行股份 有限公司 浙江省分 行托管专 户-长安 青松3号 投资组合	1,300,000.00	0.0200%	0.00	0.0000%

长安货币B

关联方名 称	本期末 2018年12月31日		上年度末 2017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
长安国际 信托股份 有限公司	100,349,179.43	1.5300%	101,433,789.00	3.4400%
长安财富 资产管理 有限公司	220,076,674.52	3.3600%	111,860,783.70	3.7900%
长安国金 1号资产 管理计划	5,190,470.17	0.0800%	5,003,071.56	0.1700%
长安基金 证大信荣 稳健增长 1号资产 管理计划	20,137,746.30	0.3100%	0.00	0.0000%
广发银行 托管专户 -长安悦	11,039,746.98	0.1700%	0.00	0.0000%

享定增61号投资组合				
长安基金-浦发银行-长安信托6号投资组合	102,482,970.22	1.5700%	0.00	0.0000%
长安酉元6号单一资产管理计划	45,022,776.95	0.6900%	0.00	0.0000%
长安-中信银行睿赢精选A类1期资产管理计划	20,000,000.00	0.3100%	0.00	0.0000%
长安弘硕2号资产管理计划	26,500,000.00	0.4100%	26,119,841.10	0.8900%
长安-中信银行权益策略1期4号资产管理计划	50,000,000.00	0.7600%	0.00	0.0000%
长安资产景林新三板2期专项资产管理计划	26,170,947.48	0.4000%	0.00	0.0000%
长安纯熙精选1期	6,000,000.00	0.0900%	0.00	0.0000%

资产管理计划				
长安资产 景林新三板专项资产管理计划	15,064,105.33	0.2300%	0.00	0.0000%
兴业银行 资产托管 专户长安 酉元7号 单一资产管理计划	1,000,000,000.00	15.2800%	0.00	0.0000%
长安基金 公司-工 行-长安 东成1号 资产管理 计划	14,000,000.00	0.2100%	0.00	0.0000%
长安纯熙 聚盈1号 资产管理 计划	8,000,000.00	0.1200%	0.00	0.0000%
长安基金 -世真信 宏1号资 产管理计 划	30,000,000.00	0.4600%	30,000,000.00	1.0200%
长安基金 -世真信 宏2号资 产管理计 划	41,500,000.00	0.6300%	0.00	0.0000%
长安基金	7,000,000.00	0.1100%	0.00	0.0000%

拾贝投资 信元4号 资产管理 计划				
长安-中 信银行睿 赢精选A 类5期资 产管理计 划	60,000,000.00	0.9200%	0.00	0.0000%
长安基金 私募证券 基金2号 (和聚) 明珠资产 管理计划	9,000,000.00	0.1400%	0.00	0.0000%
长安基金 拾贝投资 信元8号 资产管理 计划	5,000,000.00	0.0800%	0.00	0.0000%
长安资产 传化物流 股权投资 专项资产 管理计划	28,000,000.00	0.4300%	34,814,981.42	1.1800%
兵器装备 集团财务 有限责任 公司	0.00	0.0000%	30,000,000.00	1.0200%
长安平安 富贵千金 净雅资产 管理计划	0.00	0.0000%	6,608,477.06	0.2200%

长安润银 5号资产 管理计划	0.00	0.0000%	18,000,000.00	0.6100%
广发银行 托管专户 -长安裕 丰精选2 号投资组 合	0.00	0.0000%	13,276,111.40	0.4500%
广发银行 托管专户 -长安裕 丰精选3 号投资组 合	0.00	0.0000%	13,276,111.39	0.4500%
广发银行 托管专户 -长安裕 丰精选4 号投资组 合	0.00	0.0000%	13,761,370.47	0.4700%
中国工商 银行股份 有限公司 浙江省分 行托管专 户-长安 弘硕1号 资产管理 计划	8,500,000.00	0.1300%	0.00	0.0000%

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约定为0元。

7.4.8.5由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年01月01日至2018年12 月31日		上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12 月31日	
	期末余额	当期利息收 入	期末余额	当期利息收 入
广发银行股份有限公司	196,695,38 1.13	1,358,326. 72	3,446,600.6 7	5,200,944.8 9

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2018年12月31日的相关余额为人民币元0.00元。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

7.4.8.7.1 其他关联交易事项的说明

本基金本年度报告期及上年度无其他关联交易事项。

7.4.9 期末（2018年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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并公开披露。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。

于2018年12月31日，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。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

于2018年12月31日，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2018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336,939,294.59元，是以以下债券作为质押。

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
111807085	18招商银行 CD085	2019-01-04	99.18	3,000,000	297,540,00 0.00
111884219	18哈尔滨银 行CD146	2019-01-04	99.46	530,000	52,713,80 0.00
合计				3,530,000	350,253,80 0.00

7.4.9.3.2交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 12 月 31 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券余额为 0 元，因此没有作为抵押的债券。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

7.4.10有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值计量

(a) 公允价值计量的层次

下表列示了本基金在每个资产负债表日持续和非持续以公允价值计量的资产和负债于本报告期末的公允价值信息及其公允价值计量的层次。公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

于 2018 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二层级的余额为 3,489,051,821.42 元，无属于第一层级和第三层级的余额。

于 2017 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二层级的余额为 1,481,262,039.99 元，无属于第一层级和第三层级的余额。

2018 年，本基金上述持续以公允价值计量的资产和负债金融工具的第一层次与第二层次之间没有发生重大转换。本基金是在发生转换当年的报告期末确认各层次之间的转换。

(b) 第二层次的公允价值计量

对于本基金投资的证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于限售期间等情况时，本基金将相应进行估值方法的变更。根据估值方法的变更，本基金综合考虑估值调整中采用的可观察与不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值的层次。

2018 年, 本基金上述持续和非持续第二层次公允价值计量所使用的估值技术并未发生过变更。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2018 年 12 月 31 日和 2017 年 12 月 31 日, 本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具。

(2) 其他金融工具的公允价值(年末非以公允价值计量的项目)

其他金融工具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之间无重大差异。

§ 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	固定收益投资	3,489,051,821.42	50.63
	其中: 债券	3,489,051,821.42	50.63
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	2,430,550,725.84	35.27
	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	936,295,381.13	13.58
4	其他各项资产	35,850,303.02	0.52
5	合计	6,891,748,231.41	100.00

8.2 债券回购融资情况

金额单位: 人民币元

序号	项目	占基金资产净值比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	6.51	
	其中: 买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	336,939,294.59	5.15
	其中: 买断式回购融资	-	-

报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

在本报告期内未发生债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20%的情况。

8.3基金投资组合平均剩余期限

8.3.1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	54
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	65
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	31

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本报告期内未发生投资组合平均剩余期限超过 120 天的情况。

8.3.2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	39.24	5.15
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	17.98	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	33.62	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	8.36	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天(含)	5.58	-
	其中：剩余存续期超过397天	-	-

	的浮动利率债		
	合计	104.79	5.15

8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本报告期内未发生投资组合平均剩余存续期超过 240 天的情况。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	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	590,604,296.09	9.03
	其中：政策性金融债	590,604,296.09	9.03
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	130,015,694.25	1.99
6	中期票据	-	-
7	同业存单	2,768,431,831.08	42.31
8	其他	-	-
9	合计	3,489,051,821.42	53.33
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

8.6 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	111807085	18招商银行C D085	3,000,000	297,111,960.36	4.54
2	160415	16农发15	2,200,000	220,038,570.91	3.36
3	111809420	18浦发银行C D420	2,000,000	198,443,699.21	3.03

4	111820240	18广发银行C D240	2,000,000	198,294,94 9.92	3.03
5	111815656	18民生银行C D656	2,000,000	198,294,94 9.92	3.03
6	111810421	18兴业银行C D421	2,000,000	197,463,83 8.01	3.02
7	111883377	18成都银行C D212	1,500,000	149,345,53 9.49	2.28
8	111815437	18民生银行C D437	1,200,000	118,467,14 9.73	1.81
9	140408	14农发08	1,000,000	100,369,46 4.95	1.53
10	160208	16国开08	1,000,000	100,045,23 6.38	1.53

8.7 “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	-
报告期内偏离度的最高值	0.1257%
报告期内偏离度的最低值	-0.0470%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0415%

上表中“偏离情况”根据报告期内各工作日数据计算。

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本报告期内未发生负偏离度的绝对值达到0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

本报告期内未发生正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 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。

8.9.2 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。

8.9.3 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	23,526,157.58
4	应收申购款	12,324,145.44
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	35,850,303.02

8.9.4 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。

§ 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	1,950	57,554.65	46,66	41.5	65,56	58.42%

货币A			3,93 8.63	8%	7,63 7.75	
长安 货币B	88	73,073,739.21	6,37 0,79 5,45 2.32	99.0 7%	59,69 3,59 8.09	0.93%
合计	2,038	3,210,363.41	6,41 7,45 9,39 0.95	98.0 9%	125,2 61,23 5.84	1.91%

9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额(份)	占总份额比例
1	基金类机构	1,000,000,000.00	15.28%
2	保险类机构	418,788,260.99	6.40%
3	基金类机构	350,091,203.61	5.35%
4	银行类机构	300,373,295.57	4.59%
5	保险类机构	300,101,337.35	4.59%
6	基金类机构	290,000,000.00	4.43%
7	保险类机构	223,261,622.91	3.41%
8	基金类机构	220,076,674.52	3.36%
9	基金类机构	208,859,272.19	3.19%
10	保险类机构	205,047,830.56	3.13%

9.3 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	长安货币A	560,977.63	0.49%
	长安货币B	0.00	0.00%
	合计	560,977.63	0.01%

9.4 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	0~10
	长安货币B	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	长安货币A	0~10
	长安货币B	0~10
	合计	0~10

§ 10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01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	361,726,151.98	2,586,743,770.20
本报告期基金总申购份额	278,210,035.74	15,126,754,345.18
减：本报告期基金总赎回份额	527,704,611.34	11,283,009,064.97
本报告期期末基金份额总额	112,231,576.38	6,430,489,050.41

总申购份额包含红利再投资、转换入份额，总赎回份额包含转换出份额。

§ 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

本报告期，基金管理人无重大人事变动。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

(1) 托管部负责人蒋柯先生，2018年7月，经中国证监会核准资格，任广发银行资产托管部总经理；

(2) 托管部负责人梁冰女士，2018年6月，经中国证监会核准资格，任广发银行资产托管部副总经理。

11.3涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)(原“毕马威华振会计师事务所”自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务,本基金报告年度应支付给毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)的报酬为人民币陆万元整。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内,基金管理人收到中国证券监督管理委员会上海证监局《关于对长安基金基金管理有限公司采取责令改正措施的决定》,责令公司进行整改,并对公司相关责任人员采取监管谈话措施。公司高度重视,对内部控制和风险管理工作进行全面梳理,制定了整改措施。公司已根据相关法律、行政法规和中国证监会的要求于 2018 年度落实整改,并通过了上海证监局的验收。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。

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	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
海通证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-

1、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。

2、在上述租用的券商交易单元中，本基金本期无新增和退租的券商交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
海通证券	-	-	146,000,000.00	100.00%	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-

11.8 偏离度绝对值超过0.5%的情况

本报告期内未发生偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况
-----	----------------	------------

类别	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20180101-20180104	600,000.00	0.00	600,000.00	0.00	0.00%
	2	20180328-20180808	500,323,768.18	18,464,492.81	100,000.00	418,788,260.99	6.40%
	3	20180620-20180624	240,377,157.26	214,951,396.03	325,000.00	130,328,553.29	1.99%

产品特有风险

本基金由于存在上述单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况，存在以下特有风险：

（1）当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对重大事项进行投票表决时可能拥有较大话语权；

（2）在极端情况下，当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于5000万元，进而可能导致本基金终止或与其他基金合并或转型为另外的基金，其他基金份额持有人丧失继续投资本基金的机会；

（3）当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，更容易触发巨额赎回条款，基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额；

（4）当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，基金为支付赎回款项而卖出所持有的证券，可能造成证券价格波动，导致本基金的收益水平发生波动。同时，巨额赎回、份额净值小数保留位数是采用四舍五入、管理费及托管费等费用是按前一日资产计提，会导致基金份额净值出现大幅波动；

（5）当某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金规模的50%时，本基金管理人将不再接受该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。在其他基金份额持有人赎回基金份额导致某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金规模50%的情况下，该基金份额持有人将面临所提出的对本基金基金份额的申购及转换转入申请被拒绝的风险。如果投资人某笔申购或转换转入申请导致其持有本基金基金份额达到或超过本基金规模的50%，该笔申购或转换转入申请可能被确认失败。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

经长安基金管理有限公司（以下简称“本公司”）股东会审议通过，并经中国证券监督管理委员会证监许可[2017]2440 号文批复同意，本公司原股东上海景林投资发展有限公司将其持有的本公司 25.93%股权转让给杭州景林投资管理合伙企业（有限合伙）。

本次股权转让后，本公司的股东及股权比例为：长安国际信托股份有限公司持有本公司全部股权的 29.63%，杭州景林投资管理合伙企业（有限合伙）持有本公司全部股权的 25.93%，上海恒嘉美联发展有限公司持有本公司全部股权的 24.44%，五星控股集团有限公司持有本公司全部股权的 13.33%，兵器装备集团财务有限责任公司持有本公司全部股权的 6.67%。

本公司章程已随公司股权变更进行了相应的修改。目前，本次股权转让的相关工商变更登记手续已办理完毕。

长安基金管理有限公司
二〇一九年三月二十九日