

长安沪深300非周期行业指数证券投资基金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：广发银行股份有限公司

送出日期：2017年3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、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2017年3月27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。

本报告中财务资料经会计师事务所审计。

本报告期自2016年1月1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.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	8
§4 管理人报告.....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
§5 托管人报告.....	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
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.....	13
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.....	13
§6 审计报告.....	14
6.1 审计报告基本信息.....	14
6.2 审计报告的基本内容.....	14
§7 年度财务报表.....	15
7.1 资产负债表.....	15
7.2 利润表.....	17
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
7.4 报表附注.....	20
§8 投资组合报告.....	44
8.1 期末基金资产组合情况.....	44
8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合.....	44
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细.....	46
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	53
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	55
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	55
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	55
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	55
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	55
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	55
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	56
8.12 投资组合报告附注.....	56
§9 基金份额持有人信息.....	57
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	57
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	57

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 .....	57
§10 开放式基金份额变动 .....	57
§11 重大事件揭示 .....	58
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	58
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 .....	58
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	58
11.4 基金投资策略的改变 .....	58
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	58
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 .....	59
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	59
11.8 其他重大事件 .....	60
§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....	64
§13 备查文件目录 .....	64
13.1 备查文件目录 .....	64
13.2 存放地点 .....	65
13.3 查阅方式 .....	65

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	长安沪深300非周期行业指数证券投资基金
基金简称	长安沪深300非周期
基金主代码	740101
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年6月25日
基金管理人	长安基金管理有限公司
基金托管人	广发银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	52,992,737.77

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票型指数基金，力求通过对沪深300非周期行业指数进行完全复制，在严格控制跟踪误差的基础上，为投资者提供一个投资于沪深300非周期行业指数的有效工具。
投资策略	本基金采用完全复制方法跟踪标的指数，即按照沪深300非周期行业指数的成分股组成及权重构建股票投资组合，进行被动指数化投资。
业绩比较基准	沪深300非周期行业指数收益率*95%+活期存款利率（税后）*5%
风险收益特征	本基金为跟踪指数的股票型基金，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，属于证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	长安基金管理有限公司	广发银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李永波
	联系电话	021-20329761
	电子邮箱	liyongbo@changanfunds.com
		李春磊
		010-65169830
		lichunlei@cgbchina.com.cn

客户服务电话	400-820-9688	95508
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	杨明生

## 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》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.changanfunds.com">http://www.changanfunds.com</a>
基金年度报告备置地点	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	2015年	2014年
本期已实现收益	-104,769.73	20,870,064.61	1,709,516.86
本期利润	-6,125,408.44	10,275,969.28	10,843,685.82
加权平均基金份额本期利润	-0.1051	0.1929	0.3642

本期加权平均净值利润率	-8.33%	12.47%	35.39%
本期基金份额净值增长率	-5.67%	18.14%	24.78%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	2016年末	2015年末	2014年末
期末可供分配利润	19,294,838.77	28,082,871.08	2,569,817.22
期末可供分配基金份额利润	0.3641	0.4457	0.0572
期末基金资产净值	72,287,576.54	91,091,457.16	54,982,356.29
期末基金份额净值	1.364	1.446	1.224
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	2016年末	2015年末	2014年末
基金份额累计净值增长率	46.42%	55.22%	31.39%

注：1、本期已实现收益是指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	5.57%	0.76%	2.76%	0.79%	2.81%	-0.03%
过去六个月	10.71%	0.79%	6.12%	0.81%	4.59%	-0.02%
过去一年	-5.67%	1.48%	-12.07%	1.49%	6.40%	-0.01%
过去三年	26.77%	1.86%	35.65%	1.80%	-8.88%	0.06%
自基金合同生效日起至今（2012年06月25日-2016年12月31日）	46.42%	1.67%	34.09%	1.62%	12.33%	0.05%

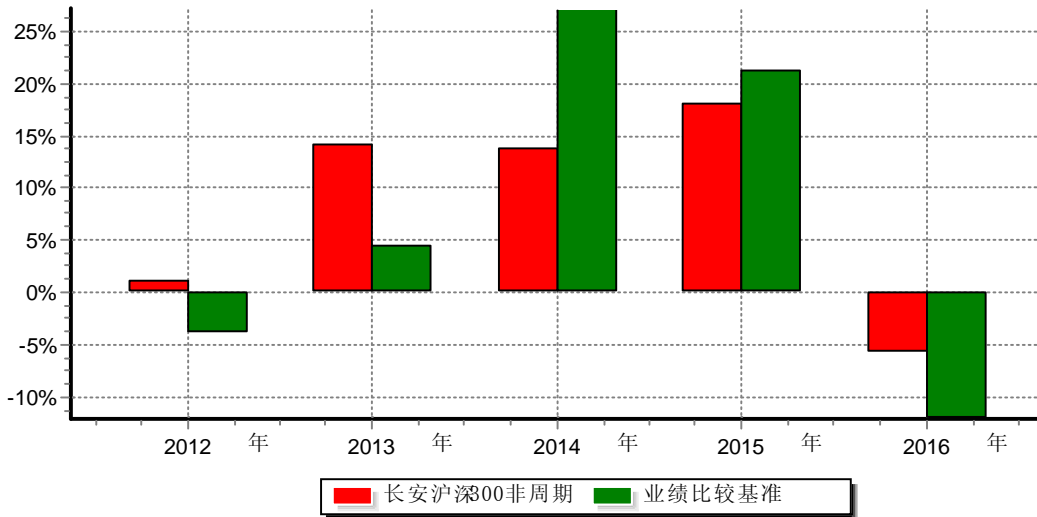
注：本基金的业绩比较基准为：沪深300非周期行业指数收益率\*95%+活期存款利率（税后）\*5%

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



注：根据基金合同的规定，自基金合同生效之日起6个月内基金各项资产配置比例需符合基金合同要求。本基金在建仓期结束后，各项资产配置比例已符合基金合同有关投资比例的约定。图示日期为2012年6月25日至2016年12月31日。

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



注：本基金合同生效日为2012年6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

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注



2014年	0.750	1,396,167.68	154,129.09	1,550,296.77	
合计	0.750	1,396,167.68	154,129.09	1,550,296.77	

注：本基金于本报告年度及2015年均未进行利润分配。

## § 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、长安货币市场证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

成立日期：2013年1月25日

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

##### 3、长安产业精选灵活配置混合型发起式证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

成立日期：2014年5月7日

投资目标：本基金通过把握宏观经济转折点，灵活配置权益类资产和固定收益类资产，并在严格控制下行风险的基础上，力争实现基金资产较高的长期稳健回报。

##### 4、长安鑫利优选灵活配置混合型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

成立日期：2015年5月18日

投资目标：本基金在深入分析宏观经济形势和资本市场变动趋势的基础上，充分挖

掘市场潜在的投资机会，追求基金资产的长期稳定增值。

5、长安鑫益增强混合型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

成立日期：2016年2月22日

投资目标：在严格控制风险和保持流动性的前提下，通过动态配置固定收益类和权益类资产，追求超越业绩比较基准的投资回报和长期稳健增值。

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		
林忠晶	本基金的基金经理	2015年1月27日	—	6年	北京大学国民经济学博士。曾任安信期货有限责任公司高级分析师，中海石油气电集团有限责任公司贸易部研究员等职。2011年6月加入长安基金管理有限公司，曾任产品开发部产品经理、基金投资部基金经理助理、战略及产品部副总经理等职，现任长安基金管理有限公司量化投资部（筹）总经理，长安沪深300非周期行业指数证券投资基金、长安产业精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、长安鑫利优选灵活配置混

					合型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	----------------

注：1、任职日期和离任日期均指公司做出决定后正式对外公告之日；

2、证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作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

在本报告期内，作为被动型指数基金，长安沪深300非周期行业指数基金严格恪守本基金的投资理念和投资目标，努力实现对基准的有效跟踪。本基金的跟踪误差主要来自

源于本基金的限制投资股票的提到选择、申购赎回、样本股调整的冲击以及样本股分红。在基金运作期间，本基金管理人按照基金合同的要求，坚持指数化投资策略，通过运用定量分析的手段，努力降低基金的跟踪误差。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2016年12月31日，本基金份额净值为1.364元，累计单位净值为1.439元。报告期内，本基金份额净值增长率为-5.67%，同期业绩基准增长率为-12.07%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

本基金管理人采取的主要措施包括：

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

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人制订了健全、有效的估值政策和程序，清算登记部按照管理层批准后的估值政策进行估值。对于在交易所上市的证券(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

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

#### 4.9 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”)在对长安沪深300非周期行业指数证券投资基金(以下称“本基金”)的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，完全尽职尽责地履行了应尽的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作方面进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

#### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、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

### 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1700113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	长安沪深300非周期行业指数基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的长安沪深300非周期行业指数证券投资基金(以下简称“长安沪深300非周期基金”)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沪深300非周期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	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。 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册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财

	<p>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，长安沪深300非周期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，公允反映了长安沪深300非周期基金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：长安沪深300非周期行业指数证券投资基金

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	上年度末 2015年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	6,661,402.52	8,603,172.39
结算备付金		11,194.44	84,977.94
存出保证金		4,612.42	36,616.69

交易性金融资产	7.4.7.2	67,530,465.08	83,690,923.36
其中：股票投资		67,530,465.08	83,690,923.36
基金投资			
债券投资		—	—
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
衍生金融资产	7.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	7.4.7.4	—	—
应收证券清算款		1,540,843.46	—
应收利息	7.4.7.5	1,686.22	2,134.48
应收股利		—	—
应收申购款		23,156.24	9,852.22
递延所得税资产		—	—
其他资产	7.4.7.6	—	—
资产总计		75,773,360.38	92,427,677.08
<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>上年度末 2015年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		—	—
交易性金融负债		—	—
衍生金融负债	7.4.7.3	—	—
卖出回购金融资产款		—	—
应付证券清算款		2,285,335.51	—
应付赎回款		2,130.05	23,549.22
应付管理人报酬		62,023.02	77,941.58
应付托管费		9,303.46	11,691.25
应付销售服务费		—	—
应付交易费用	7.4.7.7	18,299.41	24,259.69
应交税费		—	—
应付利息		—	—
应付利润		—	—



递延所得税负债		—	—
其他负债	7.4.7.8	1,108,692.39	1,198,778.18
负债合计		3,485,783.84	1,336,219.92
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	52,992,737.77	63,008,586.08
未分配利润	7.4.7.10	19,294,838.77	28,082,871.08
所有者权益合计		72,287,576.54	91,091,457.16
负债和所有者权益总计		75,773,360.38	92,427,677.08

注：报告截止日2016年12月31日，基金份额净值1.364元，基金份额总额52,992,737.77份。

## 7.2 利润表

会计主体：长安沪深300非周期行业指数证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016年1月1日至 2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015 年12月31日
<b>一、收入</b>		-4,682,116.66	12,012,184.80
1. 利息收入		49,136.83	56,405.98
其中：存款利息收入	7.4.7.11	49,136.83	56,405.98
债券利息收入		—	—
资产支持证券利息收入		—	—
买入返售金融资产收入		—	—
其他利息收入		—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,258,033.28	22,308,927.53
其中：股票投资收益	7.4.7.12	121,190.41	21,324,951.62
基金投资收益	7.4.7.13		
债券投资收益	7.4.7.14	—	—
资产支持证券投资收		—	—

益			
贵金属投资收益	7.4.7.15	—	—
衍生工具收益	7.4.7.16	—	—
股利收益	7.4.7.17	1,136,842.87	983,975.91
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	7.4.7.18	-6,020,638.71	-10,594,095.33
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)			
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	7.4.7.19	31,351.94	240,946.62
<b>减：二、费用</b>		1,443,291.78	1,736,215.52
1. 管理人报酬		735,862.33	813,885.99
2. 托管费		110,379.35	122,082.88
3. 销售服务费		—	—
4. 交易费用	7.4.7.20	77,050.10	280,246.65
5. 利息支出		—	—
其中：卖出回购金融资产支出		—	—
6. 其他费用	7.4.7.21	520,000.00	520,000.00
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		-6,125,408.44	10,275,969.28
减：所得税费用		—	—
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		-6,125,408.44	10,275,969.28

### 7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：长安沪深300非周期行业指数证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2016年1月1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	63,008,586.08	28,082,871.08	91,091,457.16

值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	-6,125,408.44	-6,125,408.44
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)	-10,015,848.31	-2,662,623.87	-12,678,472.18
其中：1. 基金申购款	13,413,759.82	3,631,016.38	17,044,776.20
2. 基金赎回款	-23,429,608.13	-6,293,640.25	-29,723,248.38
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)	52,992,737.77	19,294,838.77	72,287,576.54
项 目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	44,936,569.95	10,045,786.34	54,982,356.29
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	10,275,969.28	10,275,969.28
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)	18,072,016.13	7,761,115.46	25,833,131.59
其中：1. 基金申购款	138,866,616.23	91,987,955.46	230,854,571.69
2. 基金赎回款	-120,794,600.10	-84,226,840.00	-205,021,440.10
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)	—	—	—
五、期末所有者权益(基金净值)	63,008,586.08	28,082,871.08	91,091,457.16

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

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《长安沪深300非周期行业指数基金基金合同》和《长安沪深300非周期行业指数基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括沪深300非周期行业指数的成分股及其备选成分股(包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票)、新股(一级市场初次发行和增发)、债券、回购、货币市场工具、银行存款、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资组合的比例范围为:沪深300非周期行业指数成分股及其备选成分股的投资比例不低于基金资产的90%,在任何交易日日终持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和不超过基金资产净值的100%,每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,权证占基金资产净值的比例为0-3%,其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

本基金的股票投资部分的业绩比较基准为沪深300非周期行业指数,现金或者到期日在一年以内的政府债券投资部分为活期存款利率(税后),复合业绩比较基准为:沪深300非周期行业指数收益率×95%+活期存款利率(税后)×5%。

根据《证券投资基金信息披露管理办法》,本基金定期报告在公开披露的第二个工作日,报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)于2006年2月15日颁布的《企业会计准则-基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)的要求编制,同时亦按照中国证监会公告[2010]5号《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》以及中国证券投资基金业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2016年12月31日的财务状况、自2016年1月1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自2016年1月1日至2016年12月31日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

人民币

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的把金融资产和金融负债分为不同类别:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。

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

类别的金融资产分类为可供出售金融资产。其他金融负债：其他金融负债是指除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于支付价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

初始确认后，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值计量，公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益；应收款项和其他金融负债以实际利率法按摊余成本计量。

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

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

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

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下

列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的；本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

#### 7.4.4.7 实收基金

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

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资收益/（损失）、债券投资收益/（损失）和衍生工具收益/（损失）按相关金融资产于处置日以成交金额与其成本的差额确认。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税（适用于企业债和可转债等）后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息收入。

存款利息收入按存款本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在回购期内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益/（损失）核算基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资

产、衍生金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

本基金的交易费用用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在回购期内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

本基金的其他费用如不影响估值日基金份额净值小数点后第三位，发生时直接计入基金损益；如果影响基金份额净值小数点后第三位的，应采用待摊或预提的方法，待摊或预提计入基金损益。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

根据《长安沪深300非周期行业指数基金基金合同》的规定，本基金同份额类别每份基金份额享有同等分配权。在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为12次，每份基金份额每次分配比例不得低于该次可供分配利润的20%；若基金合同生效不满3个月，可不进行收益分配。基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，基金投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。

#### 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并披露分部信息。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 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，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：



对于特殊事项停牌股票，根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，本基金参考《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》对重大影响基金资产净值的特殊事项停牌股票进行估值。

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

在银行间同业市场交易的债券品种，根据《证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

#### 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

根据估值处理标准，本基金自2015年3月26日起，对本基金所持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外）的估值方法进行调整，采用第三方估值机构提供的价格进行估值。于2015年3月26日，相关调整对前一估值日基金资产净值的影响不超过0.50%。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本年度未发生过重大会计差错。

#### 7.4.6 税项

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：

(1) 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。

(2) 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。

(3) 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。

(4) 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。

(5) 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。

(6) 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。

(7)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。

(8)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。

(9)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	上年度末 2015年12月31日
活期存款	6,661,402.52	8,603,172.39
定期存款	—	—
其中：存款期限1-3个月	—	—
其他存款	—	—
合计	6,661,402.52	8,603,172.39

##### 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	73,541,657.57	67,530,465.08	-6,011,192.49
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—
债券	—	—	—
交易所市场	—	—	—

	银行间市场	—	—	—
	合计	—	—	—
资产支持证券		—	—	—
基金		—	—	—
其他		—	—	—
合计		73,541,657.57	67,530,465.08	-6,011,192.49
项目		上年度末 2015年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		83,681,477.14	83,690,923.36	9,446.22
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—
债券	交易所市场	—	—	—
	银行间市场	—	—	—
	合计	—	—	—
资产支持证券		—	—	—
基金		—	—	—
其他		—	—	—
合计		83,681,477.14	83,690,923.36	9,446.22

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均未通过买断式逆回购交易取得债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------

	2016年12月31日	2015年12月31日
应收活期存款利息	1,303.88	1,709.90
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	5.61	42.02
应收债券利息	—	—
应收买入返售证券利息	—	—
应收申购款利息	374.42	364.41
应收黄金合约拆借孳息	—	—
其他	2.31	18.15
合计	1,686.22	2,134.48

注：其他包括应收结算保证金利息2.31元。

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

#### 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	上年度末 2015年12月31日
交易所市场应付交易费用	18,299.41	24,259.69
银行间市场应付交易费用	—	—
合计	18,299.41	24,259.69

#### 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	上年度末 2015年12月31日
应付券商交易单元保证金	500,000.00	500,000.00
应付赎回费	2.95	88.74
预提费用	500,000.00	640,000.00
其他应付	108,689.44	58,689.44

合计	1,108,692.39	1,198,778.18
----	--------------	--------------

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2016年1月1日至2016年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	63,008,586.08	63,008,586.08
本期申购	13,413,759.82	13,413,759.82
本期赎回（以“-”号填列）	-23,429,608.13	-23,429,608.13
本期末	52,992,737.77	52,992,737.77

注：1、申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

2、本基金自2012年5月14日至2012年6月20日止期间公开发售，共募集有效净认购资金277,072,819.54元，折合277,072,819.54份基金份额；在募集期间认购资金产生的利息为人民币60,013.22元，折合60,013.22元份基金份额；以上实收基金（本息）合计为人民币277,132,832.76元，折合277,132,832.76份基金份额。

7.4.7.10 未分配利润

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	29,146,730.97	-1,063,859.89	28,082,871.08
本期利润	-104,769.73	-6,020,638.71	-6,125,408.44
本期基金份额交易产生的变动数	-4,272,143.98	1,609,520.11	-2,662,623.87
其中：基金申购款	6,032,559.32	-2,401,542.94	3,631,016.38
基金赎回款	-10,304,703.30	4,011,063.05	-6,293,640.25
本期已分配利润	—	—	—
本期末	24,769,817.26	-5,474,978.49	19,294,838.77

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日

活期存款利息收入	48,644.95	53,424.97
定期存款利息收入	—	—
其他存款利息收入	—	—
结算备付金利息收入	268.72	1,262.81
其他	223.16	1,718.20
合计	49,136.83	56,405.98

注：此项包括保证金利息收入213.15元以及申购款利息收入10.01元。

#### 7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12 月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12 月31日
卖出股票成交总额	29,366,924.00	85,055,160.34
减：卖出股票成本总额	29,245,733.59	63,730,208.72
买卖股票差价收入	121,190.41	21,324,951.62

#### 7.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期末及上年度末均未持有基金。

#### 7.4.7.14 债券投资收益

##### 7.4.7.14.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期末及上年度末均未持有债券。

#### 7.4.7.15 贵金属投资收益

##### 7.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期末及上年度末均未进行贵金属投资。

#### 7.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期末及上年度末均未获得衍生工具收益。

#### 7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
股票投资产生的股利收益	1,136,842.87	983,975.91
基金投资产生的股利收益	—	—
合计	1,136,842.87	983,975.91

#### 7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
1. 交易性金融资产	-6,020,638.71	-10,594,095.33
——股票投资	-6,020,638.71	-10,594,095.33
——债券投资	—	—
——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	-6,020,638.71	-10,594,095.33

#### 7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
基金赎回费收入	31,186.68	239,998.91
转换费收入	165.26	947.71
合计	31,351.94	240,946.62



注：本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的25%归入基金资产。

#### 7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12 月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12 月31日
交易所市场交易费用	77,050.10	280,246.65
银行间市场交易费用	—	—
合计	77,050.10	280,246.65

#### 7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12 月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12 月31日
审计费用	60,000.00	60,000.00
信息披露费	260,000.00	260,000.00
指数使用费	200,000.00	200,000.00
合计	520,000.00	520,000.00

#### 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

##### 7.4.9.1 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

本基金本报告期内未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。

##### 7.4.9.2 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
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

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。

#### 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

本基金本报告期内及上年度均未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 7.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度均未通过关联方交易单元进行债券交易。

###### 7.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

###### 7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度均未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度均无应支付给关联方的佣金。

##### 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1月1日至2016年12月 31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月 31日

当期发生的基金应支付的管理费	735,862.33	813,885.99
其中：支付销售机构的客户维护费	249,264.38	299,050.77

注：1、支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值1.0%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×1.0%/当年天数。  
2、客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	110,379.35	122,082.88

注：支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.15%/当年天数。

#### 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

本基金本报告期内及上年度均未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

份额单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
基金合同生效日（2012年6月25日）持有的基金份额	—	—
期初持有的基金份额	6,608,724.39	—
期间申购/买入总份额	—	6,608,724.39

期间因拆分变动份额	—	—
减：期间赎回/卖出总份额	—	—
期末持有的基金份额	6,608,724.39	6,608,724.39
期末持有的基金份额占基金总份额比例	12.47%	10.49%

#### 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		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
长安基金公司 高级管理人员	344,702.73	0.65%	743,889.02	1.18%

#### 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1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015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
广发银行活期 存款	6,661,402.52	48,644.95	8,603,172.39	53,424.97

注：本基金通过“广发银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于2016年12月31日的相关余额为11,194.44人民币元。（2015年12月31日的相关余额为人民币84,977.94元）

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度均未参与关联方承销证券的买卖。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度无其他关联交易事项。

#### 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

本基金本报告期内未进行利润分配。

### 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（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额
601375	中原证券	2016-12-20	2017-01-03	首次公开发行	4.00	4.00	10,297	41,188.00	41,188.00
603035	常熟汽饰	2016-12-27	2017-01-05	首次公开发行	10.44	10.44	761	7,944.84	7,944.84
603877	太平鸟	2016-12-29	2017-01-09	首次公开发行	21.30	21.30	1,081	23,025.30	23,025.30
002838	道恩股份	2016-12-28	2017-01-06	首次公开发行	15.28	15.28	682	10,420.96	10,420.96
002840	华统股份	2016-12-29	2017-01-10	首次公开发行	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70
300586	美联新材	2016-12-26	2017-01-04	首次公开发行	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80
300591	万里马	2016-12-30	2017-01-10	首次公开发行	3.07	3.07	1,909	5,860.63	5,860.63

注：根据《证券发行与承销管理办法(2012年修订)》，证券投资基金参与网下配售，可与发行人、承销商自主约定网下配售股票的持有期限。持有期自公开发行的股票上市之日起计算。在持有期内的股票为流动受限制而不能自由转让的资产。基金通过网上申购获配的新股，从新股获配日至该新股上市日期间，为流通受限制而不能自由转让的资产。此外，基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起12个月内不得转让。

#### 7.4.12.2 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（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额
002129	中环股份	2016-04-25	重大事项	8.27		—	21,996	313,756.33	181,906.92

601727	上海电气	2016-08-31	重大事项	8.42		—	45,297	615,623.00	381,400.74
603986	兆易创新	2016-09-19	重大事项	177.97	2017-03-13	195.77	241	5,605.66	42,890.77
300537	广信材料	2016-10-12	重大事项	48.79	2017-01-13	43.91	539	4,953.41	26,297.81
300104	乐视网	2016-12-07	重大事项	35.80	2017-01-16	36.88	14,400	919,090.94	515,520.00
600875	东方电气	2016-12-09	重大事项	10.79		—	18,368	350,484.52	198,190.72
600485	信威集团	2016-12-26	重大事项	14.60		—	17,400	487,721.51	254,040.00
600406	国电南瑞	2016-12-28	重大事项	16.63		—	21,413	391,271.58	356,098.19

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

本基金本期末及上年度末均未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末及上年度末均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

本基金为被动型股票型指数基金，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。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括沪深300非周期行业指数的成分股及其备选成分股（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、新股（一级市场初次发行和增发）、债券、回购、货币市场工具、银行存款、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。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广发银行，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。

#### 7.4.13.3 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制的投资品种比例等。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。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或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。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等，其余大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

本基金于2016年末未持有债券投资，无重大利率风险，因而未进行敏感性分析。银行存款及结算备付金之浮动利率根据中国人民银行的基准利率和相关机构的相关政策浮动。

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	6,661,402.52	—	—	—	6,661,402.52
结算备付金	11,194.44	—	—	—	11,194.44
存出保证金	4,612.42	—	—	—	4,612.42
交易性金融资产	—	—	—	67,530,465.08	67,530,465.08
应收证券清算款	—	—	—	1,540,843.46	1,540,843.46
应收利息	—	—	—	1,686.22	1,686.22
应收申购款	—	—	—	23,156.24	23,156.24
资产总计	6,677,209.38	—	—	69,096,151.00	75,773,360.38
负债					



应付证券清算款	—	—	—	2,285,335.51	2,285,335.51
应付赎回款	—	—	—	2,130.05	2,130.05
应付管理人报酬	—	—	—	62,023.02	62,023.02
应付托管费	—	—	—	9,303.46	9,303.46
应付交易费用	—	—	—	18,299.41	18,299.41
其他负债	—	—	—	1,108,692.39	1,108,692.39
负债总计	—	—	—	3,485,783.84	3,485,783.84
利率敏感度缺口	6,677,209.38	—	—	65,610,367.16	72,287,576.54
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	8,603,172.39	—	—	—	8,603,172.39
结算备付金	84,977.94	—	—	—	84,977.94
存出保证金	36,616.69	—	—	—	36,616.69
交易性金融资产	—	—	—	83,690,923.36	83,690,923.36
应收利息	—	—	—	2,134.48	2,134.48
应收申购款	—	—	—	9,852.22	9,852.22
资产总计	8,724,767.02	—	—	83,702,910.06	92,427,677.08
负债					
应付赎回款	—	—	—	23,549.22	23,549.22
应付管理人报酬	—	—	—	77,941.58	77,941.58
应付托管费	—	—	—	11,691.25	11,691.25
应付交易费用	—	—	—	24,259.69	24,259.69

其他负债	—	—	—	1,198,778.18	1,198,778.18
负债总计	—	—	—	1,336,219.92	1,336,219.92
利率敏感度缺口	8,724,767.02	—	—	82,366,690.14	91,091,457.16

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

注：截至本报告期末，本基金未持有受重大利率风险影响的投资品种。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

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。本基金主要投资于证券交易所上市的股票，所面临的其他价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日		上年度末 2015年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	67,530,465.08	93.42	83,690,923.36	91.88
交易性金融资产-基金投资	—	—	—	—
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	67,530,465.08	93.42	83,690,923.36	91.88

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深300非周期指数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12月31日	上年度末 2015年12月31日
	沪深300非周期指数上升 5%	3,371,007.55	4,205,379.69
	沪深300非周期指数下降 5%	-3,371,007.55	-4,205,379.69

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65,464,442.70元，第二层级的余额为2,066,022.38，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	67,530,465.08	89.12
	其中：股票	67,530,465.08	89.12
2	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
3	贵金属投资	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	银行存款和结算备付金合计	6,672,596.96	8.81
7	其他各项资产	1,570,298.34	2.07
8	合计	75,773,360.38	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

##### 8.2.1.1 报告期末（指数投资）按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
----	------	------	---------------

A	农、林、牧、渔业	406,470.64	0.56
B	采矿业	—	—
C	制造业	39,795,785.89	55.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,605,955.24	4.99
E	建筑业	6,245,131.75	8.64
F	批发和零售业	2,973,420.83	4.11
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	67,758.00	0.09
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,799,359.22	12.17
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	1,512,601.60	2.09
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	1,068,407.15	1.48
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	177,875.10	0.25
R	文化、体育和娱乐业	1,871,623.57	2.59
S	综合	645,964.08	0.89
	合计	67,170,353.07	92.92

8.2.1.2 报告期末（积极投资）按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	303,331.78	0.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	15,592.23	0.02
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—

H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	—	—
J	金融业	41,188.00	0.06
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	360,112.01	0.50

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 8.3.1 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	600519	贵州茅台	7,068	2,361,772.20	3.27
2	000333	美的集团	71,267	2,007,591.39	2.78
3	601668	中国建筑	214,398	1,899,566.28	2.63
4	000651	格力电器	69,902	1,720,987.24	2.38
5	600887	伊利股份	85,602	1,506,595.20	2.08
6	601766	中国中车	132,561	1,295,120.97	1.79
7	600104	上汽集团	52,041	1,220,361.45	1.69
8	600900	长江电力	93,908	1,188,875.28	1.64
9	000725	京东方A	343,143	981,388.98	1.36
10	000858	五粮液	28,282	975,163.36	1.35
11	601989	中国重工	136,315	966,473.35	1.34
12	601390	中国中铁	106,596	944,440.56	1.31

13	600276	恒瑞医药	20,342	925,561.00	1.28
14	600050	中国联通	125,338	916,220.78	1.27
15	601186	中国铁建	65,849	787,554.04	1.09
16	600518	康美药业	43,908	783,757.80	1.08
17	002450	康得新	36,292	693,540.12	0.96
18	002024	苏宁云商	54,984	629,566.80	0.87
19	002415	海康威视	26,335	627,036.35	0.87
20	002304	洋河股份	8,526	601,935.60	0.83
21	000063	中兴通讯	35,089	559,669.55	0.77
22	300059	东方财富	31,800	538,374.00	0.74
23	600795	国电电力	169,114	536,091.38	0.74
24	000538	云南白药	6,890	524,673.50	0.73
25	300104	乐视网	14,400	515,520.00	0.71
26	002594	比亚迪	9,939	493,769.52	0.68
27	601985	中国核电	69,400	489,964.00	0.68
28	600066	宇通客车	24,554	481,012.86	0.67
29	300070	碧水源	27,001	473,057.52	0.65
30	600637	东方明珠	19,929	464,345.70	0.64
31	600690	青岛海尔	45,726	451,772.88	0.62
32	000503	海虹控股	10,685	449,304.25	0.62
33	300072	三聚环保	9,400	435,126.00	0.60
34	601669	中国电建	59,627	432,892.02	0.60
35	000423	东阿阿胶	7,943	427,889.41	0.59
36	600089	特变电工	46,749	426,818.37	0.59
37	000768	中航飞机	19,865	422,329.90	0.58
38	600703	三安光电	30,490	408,261.10	0.56
39	600535	天士力	9,835	408,054.15	0.56
40	002202	金风科技	23,176	396,541.36	0.55
41	002456	欧菲光	11,459	392,814.52	0.54
42	000839	中信国安	42,650	391,527.00	0.54
43	002739	万达院线	7,100	383,897.00	0.53

44	601727	上海电气	45,297	381,400.74	0.53
45	600893	中航动力	11,613	380,209.62	0.53
46	600804	鹏博士	16,943	371,559.99	0.51
47	002241	歌尔股份	13,905	368,760.60	0.51
48	600068	葛洲坝	39,707	364,907.33	0.50
49	002230	科大讯飞	13,437	364,008.33	0.50
50	300017	网宿科技	6,772	363,046.92	0.50
51	600100	同方股份	25,723	356,263.55	0.49
52	600406	国电南瑞	21,413	356,098.19	0.49
53	000338	潍柴动力	35,582	354,396.72	0.49
54	000100	TCL 集团	106,746	352,261.80	0.49
55	600196	复星医药	15,034	347,886.76	0.48
56	600031	三一重工	56,482	344,540.20	0.48
57	600570	恒生电子	7,305	344,357.70	0.48
58	300024	机器人	16,035	342,828.30	0.47
59	000568	泸州老窖	10,386	342,738.00	0.47
60	000793	华闻传媒	30,251	341,533.79	0.47
61	600309	万华化学	15,848	341,207.44	0.47
62	601618	中国中冶	73,051	340,417.66	0.47
63	002252	上海莱士	14,664	338,591.76	0.47
64	000069	华侨城 A	48,691	338,402.45	0.47
65	601800	中国交建	22,214	337,430.66	0.47
66	600886	国投电力	50,554	337,195.18	0.47
67	601607	上海医药	17,096	334,397.76	0.46
68	000009	中国宝安	32,120	332,763.20	0.46
69	600271	航天信息	16,442	328,017.90	0.45
70	600023	浙能电力	59,975	325,664.25	0.45
71	600739	辽宁成大	18,006	323,387.76	0.45
72	002065	东华软件	13,863	323,007.90	0.45
73	600415	小商品城	37,266	322,350.90	0.45
74	000623	吉林敖东	10,395	322,141.05	0.45



75	601888	中国国旅	7,258	314,997.20	0.44
76	000895	双汇发展	14,977	313,468.61	0.43
77	000413	东旭光电	27,758	312,555.08	0.43
78	600867	通化东宝	14,227	311,998.11	0.43
79	600352	浙江龙盛	33,748	310,819.08	0.43
80	000157	中联重科	67,065	304,475.10	0.42
81	600741	华域汽车	18,835	300,418.25	0.42
82	600820	隧道股份	27,200	299,472.00	0.41
83	002236	大华股份	21,662	296,336.16	0.41
84	600718	东软集团	14,973	294,369.18	0.41
85	002085	万丰奥威	14,873	293,890.48	0.41
86	002465	海格通信	24,860	289,619.00	0.40
87	002008	大族激光	12,742	287,969.20	0.40
88	601933	永辉超市	58,444	286,960.04	0.40
89	300124	汇川技术	14,115	286,957.95	0.40
90	002007	华兰生物	7,994	285,785.50	0.40
91	600959	江苏有线	25,000	282,500.00	0.39
92	600674	川投能源	32,156	279,757.20	0.39
93	600118	中国卫星	8,850	276,474.00	0.38
94	600150	中国船舶	9,871	272,538.31	0.38
95	600153	建发股份	25,392	271,694.40	0.38
96	300315	掌趣科技	29,000	267,960.00	0.37
97	300027	华谊兄弟	24,293	267,223.00	0.37
98	002475	立讯精密	12,652	262,529.00	0.36
99	000826	启迪桑德	7,791	256,947.18	0.36
100	000876	新希望	31,614	254,492.70	0.35
101	600485	信威集团	17,400	254,040.00	0.35
102	600085	同仁堂	7,979	250,381.02	0.35
103	000963	华东医药	3,473	250,299.11	0.35
104	000917	电广传媒	17,326	249,321.14	0.34
105	600170	上海建工	52,001	245,964.73	0.34

106	002310	东方园林	16,800	237,720.00	0.33
107	600839	四川长虹	56,079	234,410.22	0.32
108	300033	同花顺	3,400	233,852.00	0.32
109	002183	怡亚通	21,400	232,404.00	0.32
110	000800	一汽轿车	21,212	230,574.44	0.32
111	002426	胜利精密	27,300	225,771.00	0.31
112	600588	用友网络	10,788	224,606.16	0.31
113	000559	万向钱潮	16,930	224,491.80	0.31
114	002081	金螳螂	22,893	224,122.47	0.31
115	300168	万达信息	11,000	222,420.00	0.31
116	600297	广汇汽车	25,800	220,848.00	0.31
117	000425	徐工机械	64,726	218,773.88	0.30
118	000792	盐湖股份	11,399	217,378.93	0.30
119	002385	大北农	30,442	216,138.20	0.30
120	601718	际华集团	23,400	215,514.00	0.30
121	002074	国轩高科	6,900	213,831.00	0.30
122	600895	张江高科	11,900	210,868.00	0.29
123	600688	上海石化	32,632	210,150.08	0.29
124	600332	白云山	8,755	209,944.90	0.29
125	000415	渤海金控	29,100	208,065.00	0.29
126	600498	烽火通信	8,200	206,722.00	0.29
127	600060	海信电器	11,773	201,553.76	0.28
128	600074	保千里	15,100	199,924.00	0.28
129	600875	东方电气	18,368	198,190.72	0.27
130	000977	浪潮信息	9,300	197,160.00	0.27
131	601633	长城汽车	17,824	197,133.44	0.27
132	600252	中恒集团	42,342	193,926.36	0.27
133	600737	中粮糖业	15,500	193,130.00	0.27
134	600446	金证股份	7,600	190,988.00	0.26
135	002470	金正大	24,024	189,789.60	0.26
136	002049	紫光国芯	5,700	187,758.00	0.26

137	300144	宋城演艺	8,900	186,366.00	0.26
138	600704	物产中大	18,000	185,940.00	0.26
139	601258	庞大集团	67,004	185,601.08	0.26
140	300002	神州泰岳	20,000	184,800.00	0.26
141	600666	奥瑞德	6,800	183,260.00	0.25
142	002129	中环股份	21,996	181,906.92	0.25
143	002292	奥飞娱乐	8,010	181,827.00	0.25
144	300058	蓝色光标	17,851	181,544.67	0.25
145	002131	利欧股份	11,200	178,640.00	0.25
146	600873	梅花生物	27,306	178,035.12	0.25
147	300015	爱尔眼科	5,949	177,875.10	0.25
148	601216	君正集团	38,006	176,727.90	0.24
149	600038	中直股份	3,613	174,941.46	0.24
150	000738	中航动控	7,000	173,180.00	0.24
151	300182	捷成股份	16,600	171,146.00	0.24
152	600373	中文传媒	8,386	169,397.20	0.23
153	600827	百联股份	11,764	168,931.04	0.23
154	600021	上海电力	13,900	168,746.00	0.23
155	600482	中国动力	5,500	167,970.00	0.23
156	600037	歌华有线	10,900	166,988.00	0.23
157	002152	广电运通	12,100	160,688.00	0.22
158	002195	二三四五	14,100	159,612.00	0.22
159	600008	首创股份	37,838	155,514.18	0.22
160	603000	人民网	8,520	150,463.20	0.21
161	600372	中航电子	8,059	149,575.04	0.21
162	002299	圣农发展	7,000	148,540.00	0.21
163	000156	华数传媒	8,289	148,455.99	0.21
164	600685	中船防务	4,900	145,530.00	0.20
165	002714	牧原股份	5,800	135,024.00	0.19
166	000938	紫光股份	2,300	131,997.00	0.18
167	300146	汤臣倍健	11,000	131,340.00	0.18

168	002027	分众传媒	9,200	131,284.00	0.18
169	601611	中国核建	7,600	130,644.00	0.18
170	002174	游族网络	4,900	129,605.00	0.18
171	300251	光线传媒	13,126	128,109.76	0.18
172	300133	华策影视	11,040	125,304.00	0.17
173	000027	深圳能源	18,071	124,147.77	0.17
174	002153	石基信息	5,094	124,140.78	0.17
175	601877	正泰电器	6,200	124,000.00	0.17
176	000008	神州高铁	13,200	123,024.00	0.17
177	601118	海南橡胶	17,659	122,906.64	0.17
178	000061	农产品	9,859	121,955.83	0.17
179	601928	凤凰传媒	11,589	121,336.83	0.17
180	002424	贵州百灵	6,300	119,322.00	0.17
181	600582	天地科技	23,600	117,292.00	0.16
182	600648	外高桥	5,866	115,794.84	0.16
183	601608	中信重工	19,500	109,395.00	0.15
184	600783	鲁信创投	4,524	102,332.88	0.14
185	300085	银之杰	4,200	87,780.00	0.12
186	000555	神州信息	3,900	82,797.00	0.11
187	600754	锦江股份	2,300	67,758.00	0.09
188	601127	小康股份	2,500	66,850.00	0.09
189	002568	百润股份	2,700	54,648.00	0.08
190	603416	信捷电气	1,076	53,886.08	0.07
191	603986	兆易创新	241	42,890.77	0.06
192	601375	中原证券	10,297	41,188.00	0.06
193	603218	日月股份	883	36,776.95	0.05
194	300582	英飞特	1,359	35,157.33	0.05
195	300537	广信材料	539	26,297.81	0.04
196	002835	同为股份	1,126	24,220.26	0.03
197	603877	太平鸟	1,081	23,025.30	0.03
198	603929	亚翔集成	2,193	15,592.23	0.02

199	002840	华统股份	1,814	11,881.70	0.02
200	002838	道恩股份	682	10,420.96	0.01
201	300586	美联新材	1,006	9,355.80	0.01
202	603886	元祖股份	461	8,159.70	0.01
203	603035	常熟汽饰	761	7,944.84	0.01
204	603239	浙江仙通	237	7,453.65	0.01
205	300591	万里马	1,909	5,860.63	0.01

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	603416	信捷电气	1,076	53,886.08	0.07
2	603986	兆易创新	241	42,890.77	0.06
3	601375	中原证券	10,297	41,188.00	0.06
4	603218	日月股份	883	36,776.95	0.05
5	300582	英飞特	1,359	35,157.33	0.05

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000333	美的集团	795,577.00	0.87
2	300072	三聚环保	432,192.00	0.47
3	600900	长江电力	413,347.00	0.45
4	002739	万达院线	390,884.00	0.43
5	600519	贵州茅台	352,497.00	0.39
6	000839	中信国安	339,353.00	0.37
7	601390	中国中铁	335,519.00	0.37
8	002183	怡亚通	290,623.00	0.32

9	002085	万丰奥威	284,514.11	0.31
10	300168	万达信息	278,300.00	0.31
11	601186	中国铁建	270,712.00	0.30
12	600446	金证股份	266,912.00	0.29
13	600074	保千里	240,555.00	0.26
14	002310	东方园林	237,479.25	0.26
15	300033	同花顺	233,540.00	0.26
16	600887	伊利股份	232,958.00	0.26
17	002426	胜利精密	223,783.00	0.25
18	600297	广汇汽车	219,272.00	0.24
19	002074	国轩高科	215,526.98	0.24
20	000977	浪潮信息	210,641.99	0.23

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	811,904.94	0.89
2	600011	华能国际	550,889.68	0.60
3	601668	中国建筑	512,939.00	0.56
4	600887	伊利股份	487,670.00	0.54
5	600104	上汽集团	465,888.00	0.51
6	601766	中国中车	411,754.00	0.45
7	000651	格力电器	409,588.00	0.45
8	600166	福田汽车	345,244.84	0.38
9	600637	东方明珠	341,576.70	0.37
10	002024	苏宁云商	329,382.00	0.36
11	000858	五粮液	318,961.00	0.35
12	601989	中国重工	314,358.00	0.35
13	300003	乐普医疗	310,477.00	0.34

14	600900	长江电力	299,858.00	0.33
15	000725	京东方 A	299,452.00	0.33
16	002821	凯莱英	299,007.20	0.33
17	600276	恒瑞医药	287,225.00	0.32
18	000839	中信国安	278,301.47	0.31
19	000333	美的集团	272,881.00	0.30
20	002594	比亚迪	270,987.00	0.30

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

买入股票的成本（成交）总额	19,105,914.02
卖出股票的收入（成交）总额	29,366,924.00

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期及上年度均未持有债券。

#### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期及上年度均未持有债券。

#### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期及上年度均未持有资产支持证券。

#### 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期及上年度均未进行贵金属投资。

#### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期及上年度均未持有权证。

#### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期及上年度均未进行股指期货交易。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.11.1 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期及上年度均未进行国债期货交易。

### 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

#### 8.12.3 期末其他各项资产构成

金额单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	4,612.42
2	应收证券清算款	1,540,843.46
3	应收股利	—
4	应收利息	1,686.22
5	应收申购款	23,156.24
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	1,570,298.34

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期及上年度均未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.12.5 期末股票中存在流通受限情况的说明

##### 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

##### 8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元



序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	601375	中原股份	41,188.00	0.06	网下新股发行
2	603986	兆易创新	42,890.77	0.06	重大事项

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，本报告中涉及比例计算的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有 份额	占总份 额比例	持有 份额	占总份 额比例
1,583	33,476.15	6,915,097.30	13.05%	46,077,640.47	86.95%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	682,684.22	1.290%

### 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	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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2012年6月25日)基金份额总额	277,132,832.76
本报告期期初基金份额总额	63,008,586.08
本报告期基金总申购份额	13,413,759.82
减：本报告期基金总赎回份额	23,429,608.13
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	52,992,737.77

注：总申购份额包含红利再投、转换入份额，总赎回份额包含转换出份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

一、报告期内基金管理人发生以下重大人事变动：

1、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。

### 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，为2016年年度审计费用。

### 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	
东兴证券	1	6,271,528.37	13.42%	5,840.86	13.42%	
海通证券	1	14,119,205.75	30.20%	13,149.44	30.20%	
民生证券	1	3,818,172.34	8.17%	3,555.85	8.17%	
兴业证券	1	4,741,257.52	10.14%	4,415.57	10.14%	
招商证券	1	13,828,340.01	29.58%	12,878.24	29.58%	
中信证券	1	3,968,710.24	8.49%	3,696.08	8.49%	

注：1、基金租用席位的选择标准是：

- (1) 资质雄厚，信誉良好；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，在最近一年内无重大违规经营行为；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 公司具有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供具有相当质量的关于宏观经济面分析、行业发展趋势及证券市场走向、个股分析的研究报告以及丰富全面的信息服务；能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

选择程序是：根据对各券商提供的各项投资、研究服务情况的考评结果，符合席位券商标准的，由公司研究部提出席位券商的调整意见（调整名单及调整原因），并经公司批准。

2、在上述租用的券商交易单元中，本基金本期无新增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	
	成交金额	占债券成交总额比例	成交金额	占债券回购成交总额比例	成交金额	占权证成交总额比例
东兴证券	—	—	—	—	—	—
海通证券	—	—	—	—	—	—
民生证券	—	—	—	—	—	—
兴业证券	—	—	—	—	—	—
招商证券	—	—	—	—	—	—
中信证券	—	—	—	—	—	—

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、上海证券报、证券时报、证券日报	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、上海证券报、证券时报、证券日报	2016-01-07
3	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、上海证券报、证券时报、证券日报	2016-01-12
4	长安沪深300非周期行业指数证券投资基金2015年第4季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2016-01-20
5	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、上海证券报、证券时报、证券日报	2016-01-22
6	长安沪深300非周期行业指数证券投资基金招募说明书2015年第2次更新及摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2016-01-30
7	关于长安基金管理有限公司旗下	中国证券报、上海证券报、	2016-02-24

	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	证券时报、证券日报	
8	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、上海证券报、证券时报、证券日报	2016-03-01
9	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、上海证券报、证券时报、证券日报	2016-03-08
10	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、上海证券报、证券时报、证券日报	2016-03-18
11	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、上海证券报、证券时报、证券日报	2016-03-23
12	长安沪深300非周期行业指数证券投资基金2015年年度报告及摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2016-03-26
13	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、上海证券报、证券时报、证券日报	2016-03-30
14	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、上海证券报、证券时报、证券日报	2016-04-02
15	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、上海证券报、证券时报、证券日报	2016-04-06
16	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、上海证券报、证券时报、证券日报	2016-04-06
17	长安沪深300非周期行业指数证券投资基金2016年第1季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2016-04-22
18	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	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2016-05-18

	司开通申购、赎回和定投业务并参与费率优惠活动的公告		
19	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、上海证券报、证券时报、证券日报	2016-05-27
20	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、上海证券报、证券时报、证券日报	2016-05-31
21	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、上海证券报、证券时报、证券日报	2016-06-01
22	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、上海证券报、证券时报、证券日报	2016-06-08
23	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、上海证券报、证券时报、证券日报	2016-06-24
24	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、上海证券报、证券时报、证券日报	2016-06-24
25	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、上海证券报、证券时报、证券日报	2016-06-30
26	长安沪深300非周期行业指数证券投资基金2016年第2季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2016-07-20
27	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、上海证券报、证券时报、证券日报	2016-07-27
28	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	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2016-07-28

	优惠的公告		
29	长安沪深300非周期行业指数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、上海证券报、证券时报、证券日报	2016-07-30
30	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、上海证券报、证券时报、证券日报	2016-08-02
31	长安沪深300非周期行业指数证券投资基金2016年半年度报告及摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2016-08-25
32	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、上海证券报、证券时报、证券日报	2016-09-06
33	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、上海证券报、证券时报、证券日报	2016-09-06
34	关于旗下基金在交通银行股份有限公司开展手机银行申购费率、定期定额投资优惠费率活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2016-09-20
35	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、上海证券报、证券时报、证券日报	2016-10-12
36	长安沪深300非周期行业指数证券投资基金2016年第3季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2016-10-24
37	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、上海证券报、证券时报、证券日报	2016-11-11
38	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、上海证券报、证券时报、证券日报	2016-11-11
39	关于旗下基金在交通银行股份有	中国证券报、上海证券报、	2016-11-29

	限公司手机银行开展申购费率、定期定额投资优惠费率活动的公告	证券时报、证券日报	
40	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、上海证券报、证券时报、证券日报	2016-11-29
41	关于旗下基金在交通银行股份有限公司开展手机银行申购费率及定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2016-12-22
42	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、上海证券报、证券时报、证券日报	2016-12-30
43	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、上海证券报、证券时报、证券日报	2016-12-30
44	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、上海证券报、证券时报、证券日报	2016-12-30
45	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、上海证券报、证券时报、证券日报	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、中国证监会批准设立长安沪深300非周期行业指数证券投资基金的文件。



- 2、长安沪深300非周期行业指数证券投资基金基金合同。
- 3、长安沪深300非周期行业指数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。

### 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

[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