长安货币市场证券投资基金

【2015】第三季度报告

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
报告送出日期:2015年10月27日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。
基金托管人广发银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年10月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。
基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。
本报告中财务资料未经审计。
本报告期自2015年07月01日起至09月30日止。

§2 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	6,383,928,749.49份
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	1、整体配置策略 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。 2、久期策略 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。 3、个券选择策略 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。 4、套利策略 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。 5、息差策略 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。 6、现金流管理策略 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。
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。
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

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	116,696,062.68份	6,267,232,686.81份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年07月01日-2015年09月30日)	
	长安货币A	长安货币B
1.本期已实现收益	1,016,400.32	42,363,133.53
2.本期利润	1,016,400.32	42,363,133.53
3.期末基金资产净值	116,696,062.68	6,267,232,686.81

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

阶段	净值收益率①	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	0.7054%	0.0041%	0.3450%	0.0000%	0.3604%	0.0000%

注:本基金的业绩比较基准为:同期七天通知存款利率(税后)

2、长安货币B

阶段	净值收益率①	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	0.7664%	0.0041%	0.3450%	0.0000%	0.4214%	0.0000%

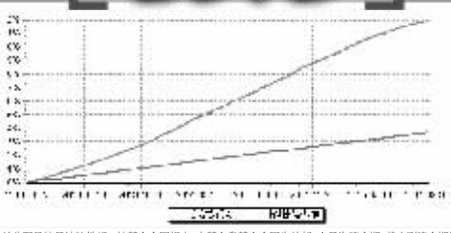
注:本基金的业绩比较基准为:同期七天通知存款利率(税后)

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

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01月25日-2015年09月30日)

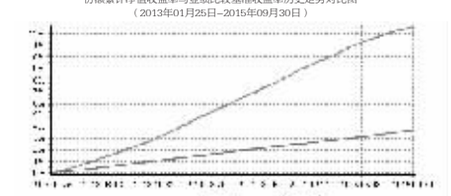


注:本基金的收益分配是按月结转份额。按基金合同规定,本基金自基金合同生效起6个月为建仓期,截止到建仓期结束时,本基金的各项投资组合比例已符合基金合同的相关规定。

长安货币B

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01月25日-2015年09月30日)



注:本基金的收益分配是按月结转份额。按基金合同规定,本基金自基金合同生效起6个月为建仓期,截止到建仓期结束时,本基金的各项投资组合比例已符合基金合同的相关规定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)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	本基金的基金经理	2013年02月01日	-	19年	山东大学工商管理硕士学位,曾任中国农业发展银行山东省分行资金计划处资金科科长、中国农业发展银行总行资金计划部债券发行与资金交易负责人、东亚银行(中国)有限公司资金中心高级助理经理、法国巴黎银行(中国)有限公司固定收益部债券资本市场主管等职,2012年8月加入长安基金管理有限公司,现任长安基金管理有限公司联席投资总监,长安货币市场证券投资基金的基金经理。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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 公平交易专项说明

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于备选库,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

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2015年三季度,宏观经济增长速率乏力,GDP增长率、物价指数等指标处于相对低位,金融市场出现剧烈动荡。已经公布的各月度经济金融数据显示,国内经济仍面临下行压力。管理层继续实施"稳健的货币政策和积极的财政政策",货币政策仍处于降准降息通道中。权益类资本市场大幅调整震荡,外汇市场也出现一定程度的不稳定性。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仍呈宽松。受权益类资本市场、外汇市场等因素的影响,各期限货币市场工具的收益率也有较大幅度的波动,从整体看呈下行趋势。本基金准确判断了宏观经济和货币政策发展趋势,以及金融市场流动性发生的变化,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。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,本基金A类和B类分别上涨0.7054%和0.7664%,同期本基金的业绩比较基准上涨0.345%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金无连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情形。

4.7 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望四季度,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。

§5 投资组合报告

5.1 报告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	1,616,812,441.92	25.30
	其中:债券	1,616,812,441.92	25.30
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	760,001,940.00	11.89
	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	3,964,613,061.24	62.04
4	其他资产	48,996,767.42	0.77
5	合计	6,390,424,210.58	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

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	0.63
	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	- / -
	其中:买断式回购融资	- / -

注: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

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 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	99
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	119
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	69

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过120天。

5.3.2 报告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	41.74	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	6.91	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	3.77	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	30.75	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	16.16	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	99.33	-

5.4 报告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	610,751,100.05	9.57
	其中:政策性金融债	610,751,100.05	9.57
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	1,006,061,341.87	15.76
6	中期票据	-	-
7	同业存单	-	-
8	其他	-	-
9	合计	1,616,812,441.92	25.33
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.5 报告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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	150211	15国开11	3,100,000	310,874,282.94	4.87
2	150215	15国开15	3,000,000	299,876,817.11	4.70
3	041564028	15博源CP002	1,400,000	141,085,090.27	2.21
4	041564052	15渝轻纺CP001	1,100,000	109,938,875.29	1.72
5	041477002	14亿阳CP001	800,000	80,557,767.55	1.26
6	011599145	15深能源SCP001	700,000	70,356,835.72	1.10
7	041459071	14三江化工CP001	500,000	50,448,265.53	0.79
8	041554011	15雨润CP001	500,000	50,346,483.05	0.79
9	011599154	15中航技SCP002	500,000	50,271,612.87	0.79
10	041567003	15润华CP001	500,000	49,966,619.00	0.78

5.6 "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	0
报告期内偏离度的最高值	0.1626%
报告期内偏离度的最低值	0.0196%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0647%

5.7 报告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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 本基金本报告期内不存在剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。

5.8.3 本基金本报告期内不存在投资的前十名证券的发行主体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。

5.8.4 其他资产构成

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	48,996,767.42
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	48,996,767.42

§6 开放式基金份额变动

单位:份

	长安货币A	长安货币B
报告期期初基金份额总额	154,111,411.01	2,090,134,335.73
报告期基金总申购份额	242,681,166.16	9,175,457,709.53
减:报告期基金总赎回份额	280,096,514.49	4,998,359,358.45
报告期期末基金份额总额	116,696,062.68	6,267,232,686.81

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	申购	2015年07月14日	25,000,000.00	25,000,000.00	-
2	申购	2015年08月28日	10,000,000.00	10,000,000.00	-
3	申购	2015年09月02日	88,000,000.00	88,000,000.00	-
4	申购	2015年09月24日	6,000,000.00	6,000,000.00	-

§8 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内,基金管理人根据《证券投资基金信息披露管理办法》的有关规定,在《中国证券报》及管理人网站进行了如下信息披露:

1、2015年7月1日披露了长安基金管理有限公司关于旗下基金2015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。

2、2015年7月7日披露了长安基金管理有限公司关于公司及基金经理投资旗下基金等相关事宜的公告。

2、2015年7月8日披露了长安基金管理有限公司关于增加大同证券有限责任公司为代销机构并开通申购和定期定额投资业务并参与费率优惠活动的公告。

3、2015年7月8日披露了长安基金管理有限公司关于增加长江证券有限责任公司为代销机构并开通申购业务的公告。

4、2015年7月9日披露了长安基金关于参加数米基金网费率优惠活动的公告。

5、2015年7月20日披露了长安货币市场证券投资基金2015年第2季度报告。

6、2015年7月29日披露了关于长安基金管理有限公司旗下基金在上海浦东发展银行股份有限公司网上银行、手机银行开通申购费率优惠的公告。

7、2015年8月12日披露了长安基金管理有限公司关于开通长安基金微信服务平台的公告。

8、2015年8月26日披露了长安基金管理有限公司关于参加天天基金网费率优惠活动的公告。

9、2015年8月27日披露了长安货币市场证券投资基金2015年半年度报告及摘要。

10、2015年8月29日披露了关于长安基金管理有限公司在北京钱景财富投资管理有限公司开通申购和定期定额投资业务并参与费率优惠活动的公告。

11、2015年9月1日披露了关于长安基金管理有限公司旗下基金在上海陆金所资产管理有限公司开通申购和定期定额投资业务并参与费率优惠活动的公告。

12、2015年9月22日披露了长安基金管理有限公司关于长安货币市场证券投资基金国庆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。

13、2015年9月25日披露了关于长安基金管理有限公司旗下基金在上海汇付金融服务有限公司开通申购、赎回和定投业务并参与费率优惠活动的公告。

14、2015年9月25日披露了关于长安基金管理有限公司旗下基金在北京乐融多源投资咨询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。

15、2015年9月29日披露了长安基金管理有限公司关于参加积木基金网费率优惠活动的公告。

16、2015年9月30日披露了长安基金管理有限公司关于调整旗下基金对账单服务形式的公告。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会核准基金募集的文件;
2、长安货币市场证券投资基金基金合同;
3、长安货币市场证券投资基金托管协议;
4、长安货币市场证券投资基金招募说明书;
5、基金管理人业务资格批件、营业执照;
6、基金托管人业务资格批件、营业执照;
7、报告期内披露的各项公告。

9.2 存放地点

上海市浦东新区芳甸路1088号紫竹国际大厦16层。

9.3 查阅方式

投资者可到基金管理人、基金托管人的办公场所或基金管理人网站免费查阅备查文件。在支付工本费后,投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告如有疑问,可咨询本管理人。
咨询电话:400-820-9688
公司网址:www.changanfunds.com。

长安基金管理有限公司
二〇一五年十月二十七日

长安沪深300非周期行业指数证券投资基金

【2015】第三季度报告

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
报告送出日期:2015年10月27日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。
基金托管人广发银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年10月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。
基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。
本报告中财务资料未经审计。
本报告期自2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

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06月25日
报告期末基金份额总额	54,400,607.85份
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。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年07月01日-2015年09月30日)
1.本期已实现收益	-355,288.49
2.本期利润	-26,916,556.40
3.加权平均基金份额本期利润	-0.4896
4.期末基金资产净值	68,984,917.11
5.期末基金份额净值	1.268

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

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

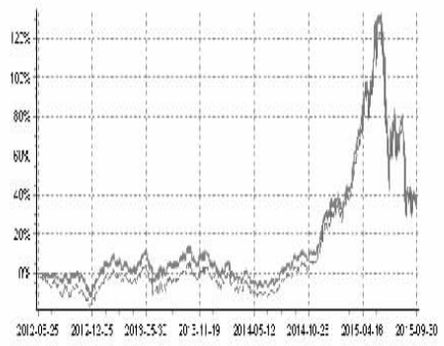
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	-27.95%	3.70%	-26.53%	3.57%	-1.42%	0.13%

注:本基金整体业绩比较基准构成为: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



§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
林忠晶	本基金的基金经理	2015年01月27日	-	5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等职,现任长安基金管理有限公司战略及产品部副总经理、长安沪深300非周期行业指数证券投资基金、长安产业精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、长安鑫利优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

注:1、任职日期和离任日期均指公司做出决定后正式对外公告之日;

2、证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了公平对待各类投资人,保护各类投资人利益,避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为,公司根据《证券投资基金法》、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部规章,拟定了《公平交易管理办法》,对公司管理的各类资产的公平对待做了明确具体的规定,并规定对买卖股票、债券时候的价格和市场价格差距较大,可能存在操纵股价、利益输送等违法违规情况进行监控。本报告期,按照时间优先、价格优先的原则,本公司对满足限价条件且对同一证券有相同交易需求的基金等投资组合,均采用了系统中的公平交易模块进行操作、分析,未发现有异常情况,且本基金及本基金与本基金管理人管理的其他投资组合之间未发生法律法规禁止的双向交易及交叉交易。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期内,本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的5%。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

截止本报告期末,本基金将秉承指数化被动投资策略,积极应对在指数成分股调整和基金申赎对跟踪效果的影响,应用数量化技术减少跟踪误差。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2015年9月30日,本基金份额净值为1.268元。本报告期内,本基金净值增长率为-27.95%,业绩比较基准收益率为-26.53%。本基金跟踪误差产生的主要来源是:1)标的指数成份股中法律法规禁止本基金投资的股票的影响;2)申购赎回的影响;3)成份股票的停牌;4)指数中成份股票的调整等。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金无连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情形。

4.7 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金为被动式管理的指数型基金,基金管理人在严守基金合同及相关法律法规的前提下,坚持指数化投资策略,通过运用定量分析的手段,积极应对基金申购赎回,成分股调整等对基金跟踪误差的影响,努力将基金的跟踪误差控制在较低水平。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	63,228,469.39	89.97
	其中:股票	63,228,469.39	89.97
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	6,944,813.82	9.88
8	其他资产	103,239.71	0.15
9	合计	70,276,522.92	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末(指数投资)按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	335,703.17	0.49
B	采矿业	-	-
C	制造业	37,495,741.80	54.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,970,394.15	7.21
E	建筑业	5,652,034.43	8.19
F	批发和零售业	3,068,740.14	4.45
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,048,313.23	10.22
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,282,249.79	1.86
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,057,624.20	1.53
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	175,486.36	0.25
R	文化、体育和娱乐业	1,809,217.80	2.62
S	综合	332,964.32	0.48
	合计	63,228,469.39	91.66

5.2.2 报告期末(积极投资)按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

5.3 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

5.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601766	中国中车	135,861	1,762,117.17	2.55
2	600519	贵州茅台	7,768	1,478,328.08	2.14
3	600887	伊利股份	94,502	1,453,440.76	2.11
4	601989	中国重工	136,715	1,368,517.15	1.98
5	601668	中国建筑	231,198	1,336,324.44	1.94
6	000651	格力电器	78,102	1,263,690.36	1.83
7	600104	上汽集团	56,041	941,488.80	1.36
8	601390	中国中铁	85,196	932,044.24	1.35
9	600276	恒瑞医药	19,018	878,441.42	1.27
10	002024	苏宁云商	71,684	868,810.08	1.26

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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未进行贵金属交易。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末进行股指期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末进行国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2 报告期内,本基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	89,887.86
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,420.97
5	应收申购款	11,930.88
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	103,239.71

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 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不存在流通受限情况。

5.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	50,699,218.85
报告期期间基金总申购份额	21,907,646.12
减:报告期期间基金总赎回份额	18,206,257.12
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	54,400,607.85

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	-
报告期期间买入/申购总份额	6,608,724.39
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	6,608,724.39
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	12.15

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	申购	2015年07月06日	6,608,724.39	10,000,000.00	-

基金管理人通过直销机构申购本基金,适用费率按照基金合同,申购金额超过500万元时申购费为1000元/笔。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1.本报告期内,基金管理人根据《证券投资基金信息披露管理办法》的有关规定,在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和《证券日报》及管理人网站进行了如下信息披露:

1、2015年7月1日披露了长安基金管理有限公司关于旗下基金2015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。

2、2015年7月7日披露了长安基金管理有限公司关于公司及基金经理投资旗下基金等相关事宜的公告。

3、2015年7月8日披露了长安基金管理有限公司关于增加大同证券有限责任公司为代销机构并开通申购和定期定额投资业务并参与费率优惠活动的公告。

4、2015年7月9日披露了长安基金关于参加数米基金网费率优惠活动的公告。

5、2015年7月20日披露了长安货币市场证券投资基金2015年第2季度报告。

6、2015年7月29日披露了关于长安基金管理有限公司旗下基金在上海浦东发展银行股份有限公司网上银行、手机银行开通申购费率优惠的公告。

7、2015年8月12日披露了长安基金管理有限公司关于开通长安基金微信服务平台的公告。

8、2015年8月26日披露了长安基金管理有限公司关于参加天天基金网费率优惠活动的公告。

9、2015年8月27日披露了长安货币市场证券投资基金2015年半年度报告及摘要。

10、2015年8月29日披露了关于长安基金管理有限公司在北京钱景财富投资管理有限公司开通申购和定期定额投资业务并参与费率优惠活动的公告。

11、2015年9月1日披露了关于长安基金管理有限公司