长安宏观策略混合型证券投资基金

【2016】第一季度报告

基金管理人:长安基金管理有限公司
基金托管人:中国邮政储蓄银行股份有限公司
报告送出日期:2016年4月22日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。
基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年4月21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2016年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长安宏观策略混合
基金主代码	740001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年3月9日
报告期末基金份额总额	121,969,486.83份
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。
投资策略	本基金从全球视野的角度出发,把握全球经济一体化、国际产业格局调整与转移以及国内经济工业化、城市化、产业结构升级与消费结构升级所带来的投资机遇,自上而下地实施股票、债券、现金等大类资产之间的战略配置和各行业之间的优化配置,并结合自下而上的个股精选策略和债券投资策略,构建投资组合,力争获取超额投资收益。 1.资产配置策略 本基金通过深入分析宏观经济、政策环境、估值水平和市场情绪等因素,综合评判股票、债券等各类资产的风险收益特征的相对变化,根据不同的市场形势,适时动态地调整股票、债券、现金之间的配置比例。 2.行业配置策略 本基金在大类资产配置的框架下,实施积极主动的行业配置策略。本基金将首先确定宏观经济及产业政策等因素对不同行业的潜在影响,通过行业生命周期分析和行业景气度分析,筛选出处于成长期和景气度上升的行业,进行重点配置和动态调整。 3.个股选择策略 本基金在行业配置的基础上,将充分发挥基金管理人在股票研究方面的专业优势,采用定量分析与定性分析相结合的方法,精选基本面良好、成长性突出的上市公司,构建投资组合。 4.债券投资策略 本基金将债券投资作为控制基金整体投资风险和提高非股票资产收益率的重要手段,在控制流动性风险的基础上,通过久期管理、期限结构配置、类属配置和个券选择等层次进行积极主动的组合管理。 5.权证投资策略 本基金对权证的投资以对冲下跌风险,实现保值和锁定收益为主要目的。本基金在权证投资中以对应的标的证券的基本面为基础,结合权证定价模型、市场供求关系、交易制度设计等多种因素对权证进行定价,利用权证衍生工具的特性,通过权证与证券的组合投资,来达到改善组合风险收益特征的目的。 6.股指期货投资策略 本基金将根据有关法律法规和政策的规定,在严格控制风险的前提下,本着谨慎原则,以套期保值为主要目的,参与股指期货的投资,以管理投资组合的系统性风险,改善投资组合的风险收益特征。基金管理人制定了股指期货投资决策流程和风险控制制度并经董事会审议通过。此外,基金管理人建立了股指期货交易决策小组,授权相关管理人员负责股指期货的投资审批事项。 7.其他金融工具的投资策略 对于监管机构允许基金投资的其他金融工具,本基金将在谨慎分析收益率、风险水平、流动性和金融工具自身特征的基础上进行稳健投资,以降低组合风险,实现基金资产的保值增值。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金,其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金,但低于股票型基金,属于证券投资基金中具有较高风险、较高预期收益品种。
基金管理人	长安基金管理有限公司
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司

§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

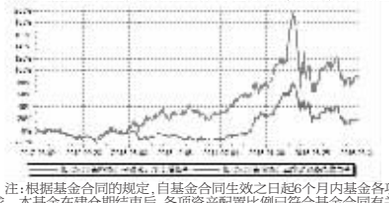
主要财务指标	报告期(2016年1月1日-2016年3月31日)
1.本期已实现收益	-15,919,768.46
2.本期利润	-18,458,953.49
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1515
4.期末基金资产净值	143,370,273.76
5.期末基金份额净值	1.175

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	-11.52%	2.04%	-10.87%	1.94%	-6.50%	0.10%

注:本基金整体业绩比较基准构成为:沪深300指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%。
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



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3月9日至2016年3月31日。

§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		
栾绍菲	本基金的基金经理	2015年5月25日	-	4年	经济学硕士。曾任长安基金管理有限公司研究部研究员、基金经理助理。现任长安基金管理有限公司长安宏观策略混合型证券投资基金、长安产业精选灵活配置混合型发起式证券投资基金的基金经理。

注:1、任职日期、其他任职、离职日期均为我公司做出决定之日;
2、证券从业年限按其从事证券相关行业的从业经历累计年限计算。

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
本基金管理人树立价值投资理念,设置合理的组织架构和科学的投资决策体系,确保投资、研究、交易各个环节的独立性。同时,建立健全公司适用的投资对象备选库和交易对手备选库,共享研究成果,在确保投资组合间的信息隔离与保密的情况下,保证建立信息公开、资源共享的公平投资管理环境。
公司建立了专门的公平交易制度,并在交易系统中采用公平交易模块,保证公平交易的严格执行。对异常交易的监控包括事前、事中和事后三个环节,并经过严格的报告和审批程序,防范和控制异常交易。
报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《长安基金管理有限公司公平交易制度》的规定。
4.3.2 异常交易行为的专项说明
报告期内未发现本基金存在异常交易行为。
报告期内本基金没有公平交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析
2016年1季度A股市场受到边际收紧的货币政策影响,风险偏好从历史高位快速回落,导致股票指数大幅跳水。由于去年4季度上证指数在做多情绪推动下多次冲击3500-4000点的前期成交密集区未果,很多概念股积累的过多的涨幅和过多的获利盘,杀跌动力强大,导致股指下跌的速度超出了大部分投资者的预料。
由于本基金已经提前预判了1季度的回调走势,去年12月底,本基金已经将股票仓位降至最低位,所以在大盘快速下跌的过程中基金的净值回撤较小。1季度本基金依然保持了自身一贯的投资风格,即综合考虑所选标的估值的安全性和业绩的成长性,对投资组合进行动态的优化调整,集中投资于未来的有巨大发展前景以及具备合理估值的股票,在进攻性和防御性之间寻找平衡。

4.5 报告期内基金的业绩表现
截至2016年3月31日,本基金份额净值为1.175元。报告期内,本基金份额净值增长率为-11.52%,同期业绩基准增长率为-10.87%。

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
宏观经济在2016年1季度走出低谷,各项前瞻性指标回暖,这预示着中国经济在未来2季度以及2016年全年都会显现不错的势头。股票市场在经历了1季度的大幅下挫之后,部分优质股票的估值合理性重新显现,因此2季度的股票市场将会迎来温和回升的走势。本基金会在2016年2季度会逢低买入真正的成长股,集中持有,这些真正的成长股将在未来的大浪淘沙中显示出真正的价值。

§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(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	90,770,731.44	61.41
	其中:股票	90,770,731.44	61.41
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	56,834,187.57	38.45
8	其他资产	196,540.12	0.13
9	合计	147,801,459.13	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	68,780,831.44	47.97
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	8,555,600.00	5.97
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	13,434,300.00	9.37
J	金融业	-	-
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	90,770,731.44	63.31

5.3 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	300017	网宿科技	230,000	13,434,300.00	9.37
2	000423	东阿阿胶	249,919	12,133,567.45	8.46
3	600479	千金药业	820,212	11,786,446.44	8.22
4	000513	丽珠集团	219,949	9,886,707.55	6.90
5	300327	中颖电子	232,797	7,542,622.80	5.26
6	002138	顺络电子	500,000	6,940,000.00	4.84
7	600521	华海药业	229,968	5,992,966.08	4.18
8	002727	一心堂	120,000	5,757,600.00	4.02
9	300207	欣旺达	200,000	5,264,000.00	3.67
10	002317	众生药业	296,440	3,308,270.40	2.31

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持有贵金属投资。
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。
5.10.2 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

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	183,587.96
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	11,272.33
5	应收申购款	1,679.83
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	196,540.12

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末无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
5.11.6 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	121,041,772.16
报告期期间基金总申购份额	2,049,188.68
减:报告期期间基金总赎回份额	1,121,474.01
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	121,969,486.83

§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
本基金管理人本报告期未持有本基金。

§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》及管理人网站进行了如下信息披露:
1.2016年1月4日披露了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。
2.2016年1月7日披露了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。
3.2016年1月20日披露了长安宏观策略混合型证券投资基金2015年第4季度报告。
4.2016年1月22日披露了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。
5.2016年2月24日披露了关于旗下基金参与上海利得基金销售有限公司费率优惠活动的公告。
6.2016年3月8日披露了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。
7.2016年3月18日披露了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。
8.2016年3月23日披露了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。
9.2016年3月26日披露了长安宏观策略混合型证券投资基金2015年年度报告及摘要。
10.2016年3月30日披露了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。

§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.长安宏观策略混合型证券投资基金基金合同;
3.长安宏观策略混合型证券投资基金托管协议;
4.长安宏观策略混合型证券投资基金招募说明书;
5.基金管理人业务资格批件、营业执照;
6.基金托管人业务资格批件、营业执照;
7.报告期内披露的各项公告。

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
二〇一六年四月二十二日

长安沪深300非周期行业指数证券投资基金

【2016】第一季度报告

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:2016年04月22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2016年4月21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2016年1月1日起至3月31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	59,892,808.32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

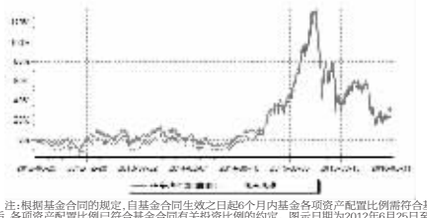
主要财务指标	报告期(2016年01月01日-2016年03月31日)
1.本期已实现收益	-1,605,232.37
2.本期利润	-13,661,184.19
3.加权平均基金份额本期利润	-0.2122
4.期末基金资产净值	73,886,658.22
5.期末基金份额净值	1.234

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	-14.66%	2.52%	-19.77%	2.45%	5.11%	0.07%

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



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3月31日。

§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	-	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商品分析师、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反向交易及交叉交易。
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2016年3月31日,本基金份额净值为1.234元。本报告期内,本基金净值增长率为-14.66%,业绩比较基准收益率为-19.77%。本基金跟踪误差产生的主要来源是:1)标的指数成分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,秉承指数化投资策略,并适当使用指数增强策略,积极应对基金申购赎回等因素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	68,764,894.47	91.16
	其中:股票	68,764,894.47	91.16
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	6,643,854.44	8.81
8	其他资产	28,477.34	0.04
9	合计	75,437,226.25	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合
5.2.1.1 报告期末(指数投资)按行业分类的股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	121,351.41	0.16
B	采矿业	-	-
C	制造业	41,138,074.69	55.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,574,667.34	7.54
E	建筑业	5,160,636.77	6.98
F	批发和零售业	3,087,507.57	4.18
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	7,789,332.25	10.54
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,325,426.72	1.79
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,048,775.75	1.42
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	198,406.16	0.27
R	文化、体育和娱乐业	2,271,901.44	3.07
S	综合	686,213.76	0.93
	合计	68,402,293.86	92.58

5.2.1.2 报告期末(积极投资)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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	326,366.13	0.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	36,234.48	0.05
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	-	-
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	362,600.61	0.49

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

金额单位:人民币元

代码	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	600519	贵州茅台	8,268	2,047,487.52	2.77
2	000651	格力电器	87,302	1,778,341.74	2.41
3	601766	中国中车	151,561	1,551,984.64	2.10
4	600887	伊利股份	99,102	1,443,916.14	1.95
5	601668	中国建筑	248,398	1,415,868.60	1.92
6	600104	上汽集团	61,041	1,224,482.46	1.66
7	601989	中国重工	155,615	1,118,871.85	1.51
8	000333	美的集团	35,545	1,096,563.25	1.48
9	600900	长江电力	81,808	1,004,602.24	1.36
10	000725	京东方A	390,143	994,864.65	1.35

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

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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002791	坚朗五金	3,973	149,345.07	0.20
2	002792	通宇通讯	3,081	135,440.76	0.18
3	300506	名家汇	1,819	36,234.48	0.05
4	603028	N赛福天	3,309	20,284.17	0.03
5	300474	N景嘉微	675	13,257.00	0.02

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	16,776.73
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,848.39
5	应收申购款	9,852.22
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	28,477.34

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	63,008,586.08
报告期期间基金总申购份额	4,974,505.92
减:报告期期间基金总赎回份额	8,090,283.68
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	59,892,808.32

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

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	6,608,724.39
报告期期间买入/申购总份额	-
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(%)	11.03

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
本基金管理人本报告期内未进行本基金的申购或赎回交易。

§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:
1.2016年1月4日披露了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。
2.2016年1月7日披露了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。
3.2016年1月12日披露了关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的提示性公告。
4.2016年1月20日披露了长安沪深300非周期行业指数证券投资基金2015年第4季度报告。
5.2016年1月22日披露了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。
6.2016年1月30日披露了长安沪深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。
7.2016年2月24日披露了关于旗下基金参与上海利得基金销售有限公司费率优惠活动的公告。
8.2016年3月1日披露了关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的提示性公告。
9.2016年3月8日披露了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。
10.2016年3月18日披露了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。
11.2016年3月23日披露了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。
12.2016年3月26日披露了长安沪深300非周期行业指数证券投资基金2015年年度报告及摘要。
13.2016年3月30日披露了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。

§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.长安沪深300非周期行业指数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
二〇一六年四月二十二日

长安货币市场证券投资基金

【2016】第一季度报告

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:2016年04月22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2016年4月21日复核了本报告中的财务指标、净