

长安宏观策略股票型证券投资基金2014年半年度报告

2014年6月30日

基金管理人：长安基金管理有限公司

基金托管人：中国邮政储蓄银行股份有限公司

送出日期：2014年8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。本半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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2014年8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，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年1月1日起至6月30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	7
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
§7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
7.3 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	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	40
7.6 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	49
7.7 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	49
7.8 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	50
7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	50
7.10 投资组合报告附注	50
§8 基金份额持有人信息	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	51
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	51
§9 开放式基金份额变动	51
§10 重大事件揭示	52
10.1 基金份额持有人大会决议	52
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	52
10.4 基金投资策略的改变	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	52

---

10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	52
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	53
10.8	其他重大事件	54
§11	影响投资者决策的其他重要信息	55
§12	备查文件目录	55
12.1	备查文件目录	55
12.2	存放地点	55
12.3	查阅方式	56

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	长安宏观策略股票型证券投资基金
基金简称	长安宏观策略股票
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
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
报告期末基金份额总额	42,120,402.72份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

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	<p>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。</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>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。</p> <p>2、行业配置策略</p> <p>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</p>

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	本基金为股票型证券投资基金，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、较高预期收益品种。

### 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	中国邮政储蓄银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	袁明	胡涛
	联系电话	021-20329995	010-68858112
	电子邮箱	yuanming@changanfunds.com	hutao@psbcoa.com.cn
客户服务电话		400-820-9688	95580
传真		021-20329888	010-68858120
注册地址		上海市虹口区丰镇路806号3幢371室	北京市西城区金融大街3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	北京市西城区金融大街3号A座
邮政编码		201204	100808
法定代表人		万跃楠	李国华

### 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》
登载基金半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>
基金半年度报告备置地点	上海市浦东新区芳甸路1088号紫竹国际大厦16层

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
----	----	------

会计师事务所	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)	上海南京西路1266号恒隆广场1期50楼
注册登记机构	长安基金管理有限公司	上海市浦东新区芳甸路1088号紫竹国际大厦16层

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

<b>3.1.1 期间数据和指标</b>	报告期（2014年1月1日至2014年6月30日）
本期已实现收益	5,615,269.37
本期利润	1,920,303.58
加权平均基金份额本期利润	0.0439
本期加权平均净值利润率	3.41%
本期基金份额净值增长率	2.12%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	报告期末(2014年6月30日)
期末可供分配利润	12,577,150.72
期末可供分配基金份额利润	0.2986
期末基金资产净值	54,697,553.44
期末基金份额净值	1.299
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	报告期末(2014年6月30日)
基金份额累计净值增长率	29.90%

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	①-③	②-④

				④		
过去一个月	3.10%	1.07%	0.41%	0.62%	2.69%	0.45%
过去三个月	4.67%	1.28%	1.06%	0.70%	3.61%	0.58%
过去六个月	2.12%	1.48%	-5.06%	0.83%	7.18%	0.65%
过去一年	21.74%	1.66%	-1.60%	0.94%	23.34%	0.72%
自基金合同生效日起 至今（2012年03月09 日-2014年06月30日）	29.90%	1.43%	-14.45%	1.01%	44.35%	0.42%

注：本基金的业绩比较基准为：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



## § 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3只开放式证券投资基金，基本情况如下：

1、长安沪深300非周期行业指数证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

成立日期：2012年6月25日

投资目标：本基金为股票型指数基金，力求通过对沪深300非周期行业指数进行完全复制，在严格控制跟踪误差的基础上，为投资者提供一个投资于沪深300非周期行业指数的有效工具。

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。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
雷宇	本基金的基金经理	2012年6月28日	—	14年	中国人民大学经济学硕士。曾任中国技术进出口总公司项目经理、研究员，上海中技投资顾问有限公司研究员、投资经理，通用技术集团投资管理有限公司投资经理、投资部副总监，国金通用基金管理有限公司筹备期基金经理助理、风险管理部负责人等职。2011年8月加入长安基金管理有限公司，现任基金经理、基金投资部副总经理，2012年6月28日至

					今任长安宏观策略股票基金的基金经理。
--	--	--	--	--	--------------------

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 公平交易制度的执行情况

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

公司建立了专门的公平交易制度，并在交易系统中采用公平交易模块，保证公平交易的严格执行。对异常交易的监控包括事前、事中和事后三个环节，并经过严格的报告和审批程序，防范和控制异常交易。

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《长安基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2014年上半年A股市场整体呈现窄幅震荡的走势，期间微刺激政策的加速落实，遏制了经济下滑的趋势，国内经济短期回升的预期逐步增强，但受IPO重启和流动性约束等因素影响，各大指数均没有突出表现。期间市场依然是结构性分化行情，采掘、农林牧渔、食品饮料等行业个股出现下跌走势，而以TMT、国防军工、轻工制造为代表的中小盘个股出现明显上涨走势。

报告期内，本基金采取了相对稳健的投资策略，在年初既定策略下保持了中性仓位，

在市场调整中坚持了新兴产业的持仓结构，由于对宏观经济走势和政策方面的把握难度加大，我们加大了中长期稳定成长行业的组合配置，减持了基本面前景不明的行业个股。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2014年6月30日，本基金份额净值为1.299元。报告期内，本基金份额净值增长率为2.12%，同期业绩基准增长率为-5.06%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2014年下半年，我们对市场持谨慎乐观态度，首先对于主板来说，在宏观面、政策面和流动性不存在向好共振的情况下，仅存在风险偏好博弈的机会；其次对于创业板来说，根据上半年盈利水平判断，全年超预期的可能性在逐步降低，因此整体估值水平还处于消化之中，期间部分优质成长股的回调将给我们提供较好的建仓机会。我们坚持认为，未来随着经济转型的深入，改革红利的逐步释放，代表新经济生命力的新兴产业成长股依然会创出新高。我们珍惜基金份额持有人的每一分投资和每一份信任，我们将继续规范运作，审慎投资，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求长期、稳定的回报。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人制订了健全、有效的估值政策和程序，清算登记部按照管理层批准后的估值政策进行估值。对于在交易所上市的证券，采用交易所发布的行情信息来估值。对于固定收益品种，采用证券投资基金估值工作小组免费提供的固定收益品种的估值处理标准。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

本基金本报告期内未进行利润分配。

### § 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，中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对长安宏观策略股票型证券投资基金（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，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

#### 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。

本报告期内，本基金未进行利润分配。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：长安宏观策略股票型证券投资基金

报告截止日：2014年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	13,330,003.59	3,681,390.13
结算备付金		629,732.48	719,751.21
存出保证金		341,207.51	191,227.73
交易性金融资产	6.4.7.2	44,190,265.90	58,966,433.89
其中：股票投资		44,190,265.90	58,966,433.89
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	6.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	—	—
应收证券清算款		164,422.20	—

应收利息	6.4.7.5	4,815.39	3,115.24
应收股利		—	—
应收申购款		8,723.87	88,424.15
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.6	—	—
资产总计		58,669,170.94	63,650,342.35
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2014年6月30日</b>	<b>上年度末 2013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	6.4.7.3	—	—
卖出回购金融资产款		—	—
应付证券清算款		2,844,571.43	—
应付赎回款		501,095.05	431,113.11
应付管理人报酬		68,304.59	77,713.15
应付托管费		11,384.10	12,952.22
应付销售服务费		—	—
应付交易费用	6.4.7.7	341,940.56	226,454.92
应交税费		—	—
应付利息		—	—
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	6.4.7.8	204,321.77	651,476.48
负债合计		3,971,617.50	1,399,709.88
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	42,120,402.72	48,934,562.99
未分配利润	6.4.7.10	12,577,150.72	13,316,069.48
所有者权益合计		54,697,553.44	62,250,632.47
负债和所有者权益总计		58,669,170.94	63,650,342.35

注：1、报告截止日2014年6月30日，基金份额净值1.299元，基金份额总额42,120,402.72份。

2、本基金合同于2012年3月9日生效，本财务报表的实际编制期间为2014年1月1日至2014年6月30日。

## 6.2 利润表

会计主体：长安宏观策略股票型证券投资基金

本报告期：2014年1月1日至2014年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日-2013年 6月30日
一、收入		3,951,612.45	8,109,843.43
1. 利息收入		48,738.12	23,173.27
其中：存款利息收入	6.4.7.11	48,738.12	23,173.27
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）		7,571,332.70	8,386,708.56
其中：股票投资收益	6.4.7.12	7,321,698.05	8,251,691.07
基金投资收益		—	—
债券投资收益	6.4.7.13	—	—
资产支持证券投资收益		—	—
贵金属投资收益	6.4.7.14	—	—
衍生工具收益	6.4.7.15	—	—
股利收益	6.4.7.16	249,634.65	135,017.49
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-3,694,965.79	-333,195.15
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		—	—

5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	26,507.42	33,156.75
<b>减：二、费用</b>		2,031,308.87	1,199,650.14
1. 管理人报酬		419,665.83	342,685.51
2. 托管费		69,944.32	57,114.23
3. 销售服务费		—	—
4. 交易费用	6.4.7.19	1,363,695.41	609,156.88
5. 利息支出		—	—
其中：卖出回购金融资产支出		—	—
6. 其他费用	6.4.7.20	178,003.31	190,693.52
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		1,920,303.58	6,910,193.29
减：所得税费用		—	—
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		1,920,303.58	6,910,193.29

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长安宏观策略股票型证券投资基金

本报告期：2014年1月1日至2014年6月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	48,934,562.99	13,316,069.48	62,250,632.47
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	1,920,303.58	1,920,303.58
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)	-6,814,160.27	-2,659,222.34	-9,473,382.61
其中：1. 基金申购款	11,127,690.62	3,028,273.44	14,155,964.06
2. 基金赎回款（以“-”	-17,941,850.89	-5,687,495.78	-23,629,346.67

号填列)			
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)	42,120,402.72	12,577,150.72	54,697,553.44
项 目	上年度可比期间 2013年1月1日-2013年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	59,233,770.12	-4,257,823.56	54,975,946.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	6,910,193.29	6,910,193.29
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)	-7,743,250.19	779,326.00	-6,963,924.19
其中：1. 基金申购款	30,350,879.24	2,205,930.36	32,556,809.60
2. 基金赎回款(以“-”号填列)	-38,094,129.43	-1,426,604.36	-39,520,733.79
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)	51,490,519.93	3,431,695.73	54,922,215.66

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

黄陈

李卫

欧鹏

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

长安宏观策略股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会

会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2011]第1950号《关于核准长安宏观策略股票型证券投资基金募集的批复》核准,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》和《长安宏观策略股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。

本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息的净认购资金为383,969,236.76元,业经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)KPMG-B(2012)CRNo.0011号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《长安宏观策略股票型证券投资基金基金合同》于2012年3月9日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为383,988,929.19份基金份额,其中认购资金利息折合19,692.43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,基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长安宏观策略股票型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金投资对象是具有良好流动性的金融工具,包括股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、权证及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。股票投资占基金资产的比例为60%-95%,债券投资、现金以及国家证券监管机构允许基金投资的其它金融工具及其他资产占基金资产的比例为0%-40%,权证投资占基金资产净值的比例为0%-3%,其中现金及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资于其它的产品,基金管理人在履行适当的程序后,可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准:沪深300指数收益率 $\times$ 80%+中证全债指数收益率 $\times$ 20%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于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”)、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>》、中国证券业协会于2007年5月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《长安宏观策略股票型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如报表附注6.4.4所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2014年半年度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2014年6月30日的财务状况以及2014年1月1日至2014年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本财务报表的实际编制期间为2014年1月1日至2014年6月30日。

##### 6.4.4.2 记账本位币

人民币

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

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。

##### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于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。

#### 6.4.4.5 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。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的；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。

#### 6.4.4.7 实收基金

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

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等

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

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

根据《长安宏观策略股票型证券投资基金基金合同》的规定，基金管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%的年费率逐日计提。

根据《长安宏观策略股票型证券投资基金基金合同》的规定，基金托管费按前一日基金资产净值0.25%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。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

根据《长安宏观策略股票型证券投资基金基金合同》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收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的25%；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。经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从持有人权益转出。

#### 6.4.4.12 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。

经营分部，是指本基金同时满足下列条件的组成部分：(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本基金的管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

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。

#### 6.4.4.13 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。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

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《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号《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[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,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)基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴20%的个人所得税,暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入,暂按25%计入应纳税所得额,适用20%的税率计征个人所得税,实际税负为5%,由上市公司在向基金派发股息、红利时代扣代缴个人所得税,暂不征收企业所得税。基金在股权登记日后转让股票时,中登上海分公司根据其持股期限计算实际应纳税额,超过已扣缴税款的部分,由证券公司等股份托管机构从个人资金账户中扣收并划付中登上海分公司。具体实际税负为:股东的持股期限在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,实际税负为 20%;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,实际税负为 10%;持股期限超过 1 年的,暂减按 25%计入应纳税所得额,实际税负为 5%。

(4)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。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
活期存款	13,330,003.59
定期存款	—
其中:存款期限1-3个月	—
其他存款	—
合计	13,330,003.59

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目	本期末 2014年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	42,049,641.23	44,190,265.90	2,140,624.67
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	—	—	—
其他	—	—	—
合计	42,049,641.23	44,190,265.90	2,140,624.67

##### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未通过买断式逆回购交易取得债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
应收活期存款利息	2,558.07
应收定期存款利息	—
应收其他存款利息	153.60
应收结算备付金利息	283.80
应收债券利息	—
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	1,819.92
应收黄金合约拆借孳息	—
其他	—
合计	4,815.39

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
交易所市场应付交易费用	341,940.56
银行间市场应付交易费用	—
合计	341,940.56

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	1,840.26
其它应付款	20,378.20
预提信息披露费	138,850.53
预提审计费用	29,752.78
预提账户维护费	13,500.00
合计	204,321.77

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2014年1月1日至2014年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	48,934,562.99	48,934,562.99
本期申购	11,127,690.62	11,127,690.62
本期赎回（以“-”号填列）	-17,941,850.89	-17,941,850.89
本期末	42,120,402.72	42,120,402.72

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2月2日至2012年3月7日止期间公开发售，共募集有效净认购资金383,969,236.76元，折合383,969,236.76份基金份额；在募集期间认购资金产生的利息为人民币19,692.43元，折合19,692.43元份基金份额；以上实收基金（本息）合计为人民币383,988,929.19元，折合383,988,929.19份基金份额。

#### 6.4.7.10 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	9,933,527.33	3,382,542.15	13,316,069.48
本期利润	5,615,269.37	-3,694,965.79	1,920,303.58
本期基金份额交易产生的变动数	-1,869,686.12	-789,536.22	-2,659,222.34

其中：基金申购款	3,368,915.75	-340,642.31	3,028,273.44
基金赎回款	-5,238,601.87	-448,893.91	-5,687,495.78
本期已分配利润	—	—	—
本期末	13,679,110.58	-1,101,959.86	12,577,150.72

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2014年1月1日至2014年6月30日
活期存款利息收入	41,178.29
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	5,231.65
其他	2,328.18
合计	48,738.12

注：其他指直销申购款利息收入0.98元，结算保证金利息收入2327.20元。

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
卖出股票成交总额	453,322,352.66
减：卖出股票成本总额	446,000,654.61
买卖股票差价收入	7,321,698.05

#### 6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期内未获得债券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

##### 6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内未获得贵金属投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

#### 6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内未获得衍生工具收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
股票投资产生的股利收益	249,634.65
基金投资产生的股利收益	—
合计	249,634.65

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
1. 交易性金融资产	-3,694,965.79
——股票投资	-3,694,965.79
——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	-3,694,965.79

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
基金赎回费收入	26,507.42

合计	26,507.42
----	-----------

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。

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
交易所市场交易费用	1,363,695.41
银行间市场交易费用	—
合计	1,363,695.41

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	138,850.53
交易费用_回购	—
交易费用_权证	—
上市年费	—
账户维护费-中债登	9,000.00
账户维护费-上清所	—
银行汇划手续费	—
注册登记费	—
分红手续费	—
其他费用	400.00
合计	178,003.31

注：其他费用为银行间交易清算电子证书费用。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期内不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
长安基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国邮政储蓄银行股份有限公司	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

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。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内无应支付给关联方的佣金。

###### 6.4.10.1.4 债券交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行债券交易。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6 月30日	上年度可比期间 2013年1月1日-2013年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	419,665.83	342,685.51
其中：支付销售机构的客户维护费	68,093.95	101,855.51

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1.5%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×1.5%/当年天数。  
2、客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6 月30日	上年度可比期间 2013年1月1日-2013年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	69,944.32	57,114.23

注：支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值0.25%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×0.25%/当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2014年1月1日至2014年6 月30日	上年度可比期间 2013年1月1日-2013年6月 30日
期初持有的基金份额	—	4,864,023.52
期间申购/买入总份额	—	—

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	—	4,864,023.52
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	—	9.45%

注：本报告期内基金管理人未运用自有资金投资本基金。

#### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2014年6月30日		上年度末 2013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	27,932,029.80	66.31%	27,932,029.80	57.08%

注：长安国际信托股份有限公司于本报告期内通过直销柜台申购本基金，申购手续费1,000元。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年1月1日-2013年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国邮政储蓄 银行股份有限 公司	13,330,003.59	41,178.29	5,056,716.31	16,097.45

注：本基金的银行存款由基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内购入关联方承销证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配。

#### 6.4.12 期末（2014年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：									
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	期末成本总额	期末估值总额
002726	龙大肉食	2014-06-20	2014-07-07	公开发行	9.79	17.06	500	4,895.00	8,530.00
002727	一心堂	2014-06-25	2014-07-07	公开发行	12.20	12.20	500	6,100.00	6,100.00
300385	雪浪环境	2014-06-20	2014-07-07	公开发行	14.73	25.66	500	7,365.00	12,830.00

##### 6.4.12.2 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	期末成本总额	期末估值总额
300253	卫宁软件	2014-05-28	重大事项	40.53		-	60,000	2,455,739.63	2,431,800.00

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只进行主动投资的股票型证券投资基金，属于中高风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。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。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任,或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况,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中国邮政储蓄银行股份有限公司,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。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险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。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指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。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末 2014年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	13,330,003.59	—	—	—	13,330,003.59
结算备付金	629,732.48	—	—	—	629,732.48
存出保证金	341,207.51	—	—	—	341,207.51
交易性金融资产	—	—	—	44,190,265.90	44,190,265.90
应收证券清算款	—	—	—	164,422.20	164,422.20
应收利息	—	—	—	4,815.39	4,815.39
应收申购款	—	—	—	8,723.87	8,723.87
资产总计	14,300,943.58	—	—	44,368,227.36	58,669,170.94
负债					
应付证券清算款	—	—	—	2,844,571.43	2,844,571.43
应付赎回款	—	—	—	501,095.05	501,095.05
应付管理人报酬	—	—	—	68,304.59	68,304.59
应付托管费	—	—	—	11,384.10	11,384.10
应付交易费用	—	—	—	341,940.56	341,940.56
其他负债	—	—	—	204,321.77	204,321.77

负债总计	—	—	—	3,971,617.50	3,971,617.50
利率敏感度缺口	14,300,943.58	—	—	40,396,609.86	54,697,553.44
上年度末 2013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	3,681,390.13	—	—	—	3,681,390.13
结算备付金	719,751.21	—	—	—	719,751.21
存出保证金	191,227.73	—	—	—	191,227.73
交易性金融资产	—	—	—	58,966,433.89	58,966,433.89
应收利息	—	—	—	3,115.24	3,115.24
应收申购款	—	—	—	88,424.15	88,424.15
资产总计	4,592,369.07	—	—	59,057,973.28	63,650,342.35
负债					
应付赎回款	—	—	—	431,113.11	431,113.11
应付管理人报酬	—	—	—	77,713.15	77,713.15
应付托管费	—	—	—	12,952.22	12,952.22
应付交易费用	—	—	—	226,454.92	226,454.92
其他负债	—	—	—	651,476.48	651,476.48
负债总计	—	—	—	1,399,709.88	1,399,709.88
利率敏感度缺口	4,592,369.07	—	—	57,658,263.40	62,250,632.47

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素发生变动时产生的价格波动风险。本基金的其他价格风险主要为市场价格变化或波动所引起的股票资产损失的可能性。

本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日		上年度末 2013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	44,190,265.90	80.79	58,966,433.89	94.72
衍生金融资产-权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	44,190,265.90	80.79	58,966,433.89	94.72

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1、测算组合市场价格风险的数据为沪深300指数变动时，股票资产相应的理论变动值。
假设	2、假定沪深300指数变化5%，其他市场变量均不发生变化。
假设	3、Beta系数是根据报表日持仓资产在过去100个交易日收益率与其对应指数收益率回归加权得出，对于交易少于100个交易日的资产，默认其波动与市场同步。

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 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
	沪深300指数下降5%	2, 294, 901. 38	2, 234, 127. 86
	沪深300指数上升5%	-2, 294, 901. 83	-2, 234, 127. 86

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至本报告期末，本基金无需要说明的其他重要事项。

### §7 投资组合报告

#### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	44,190,265.90	75.32
	其中：股票	44,190,265.90	75.32
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	13,959,736.07	23.79
7	其他资产	519,168.97	0.88
8	合计	58,669,170.94	100.00

#### 7.2 报告期末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（元）	占基金资产净值比
----	------	---------	----------

			例 (%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	31,124,665.90	56.90
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	6,100.00	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	1,812,000.00	3.31
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,247,500.00	20.56
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	44,190,265.90	80.79

### 7.3 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(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	002023	海特高新	270,000	5,157,000.00	9.43
2	002312	三泰电子	250,000	5,092,500.00	9.31
3	002292	奥飞动漫	80,477	2,953,505.90	5.40
4	300206	理邦仪器	120,000	2,547,600.00	4.66
5	002253	川大智胜	100,000	2,495,000.00	4.56

6	300273	和佳股份	80,000	2,456,000.00	4.49
7	300253	卫宁软件	60,000	2,431,800.00	4.45
8	600372	中航电子	100,000	2,267,000.00	4.14
9	600352	浙江龙盛	120,000	1,938,000.00	3.54
10	300326	凯利泰	50,000	1,874,000.00	3.43
11	600270	外运发展	150,000	1,812,000.00	3.31
12	002294	信立泰	60,000	1,801,200.00	3.29
13	600137	浪莎股份	135,000	1,741,500.00	3.18
14	600316	洪都航空	100,000	1,709,000.00	3.12
15	300113	顺网科技	70,000	1,694,000.00	3.10
16	600718	东软集团	120,000	1,618,800.00	2.96
17	000538	云南白药	30,000	1,566,000.00	2.86
18	300059	东方财富	130,000	1,563,900.00	2.86
19	600804	鹏博士	100,000	1,444,000.00	2.64
20	300385	雪浪环境	500	12,830.00	0.02
21	002726	龙大肉食	500	8,530.00	0.02
22	002727	一心堂	500	6,100.00	0.01

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 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	002292	奥飞动漫	19,134,274.15	30.74
2	300017	网宿科技	10,704,552.25	17.20
3	002312	三泰电子	9,457,214.23	15.19
4	600270	外运发展	8,546,247.21	13.73
5	002450	康得新	8,187,987.32	13.15
6	300002	神州泰岳	8,038,529.31	12.91
7	600316	洪都航空	7,949,419.17	12.77
8	600887	伊利股份	7,836,206.56	12.59

9	300104	乐视网	7,774,195.20	12.49
10	002294	信立泰	7,104,766.43	11.41
11	601998	中信银行	7,036,400.00	11.30
12	300005	探路者	6,937,958.46	11.15
13	002023	海特高新	6,585,593.45	10.58
14	600372	中航电子	6,374,606.02	10.24
15	300059	东方财富	6,298,062.96	10.12
16	002439	启明星辰	6,291,598.40	10.11
17	002215	诺普信	6,261,839.23	10.06
18	300206	理邦仪器	6,199,083.94	9.96
19	600703	三安光电	5,128,513.99	8.24
20	600794	保税科技	5,037,844.39	8.09
21	601318	中国平安	4,860,723.27	7.81
22	300183	东软载波	4,812,079.08	7.73
23	603000	人民网	4,660,499.94	7.49
24	300273	和佳股份	4,555,306.25	7.32
25	600315	上海家化	4,270,596.69	6.86
26	600406	国电南瑞	4,106,789.00	6.60
27	300078	中瑞思创	4,071,793.92	6.54
28	600655	豫园商城	3,913,617.95	6.29
29	002396	星网锐捷	3,821,784.82	6.14
30	601117	中国化学	3,777,280.00	6.07
31	300326	凯利泰	3,685,866.05	5.92
32	600998	九州通	3,570,130.16	5.74
33	600289	亿阳信通	3,563,502.14	5.72
34	600804	鹏博士	3,551,103.50	5.70
35	600563	法拉电子	3,550,695.35	5.70
36	300331	苏大维格	3,542,062.50	5.69
37	601098	中南传媒	3,470,433.21	5.57
38	002416	爱施德	3,448,406.53	5.54
39	300058	蓝色光标	3,424,064.50	5.50

40	600536	中国软件	3,415,073.96	5.49
41	000529	广弘控股	3,272,518.04	5.26
42	300285	国瓷材料	3,258,277.40	5.23
43	000793	华闻传媒	3,244,405.60	5.21
44	002117	东港股份	3,229,579.20	5.19
45	600330	天通股份	3,175,050.98	5.10
46	000423	东阿阿胶	3,081,223.71	4.95
47	002527	新时达	2,946,404.45	4.73
48	300027	华谊兄弟	2,789,294.20	4.48
49	002260	伊立浦	2,732,340.53	4.39
50	002701	奥瑞金	2,711,764.99	4.36
51	002148	北纬通信	2,710,491.20	4.35
52	002253	川大智胜	2,709,988.20	4.35
53	300074	华平股份	2,692,035.46	4.32
54	300253	卫宁软件	2,660,384.60	4.27
55	002393	力生制药	2,640,949.99	4.24
56	600835	上海机电	2,638,224.94	4.24
57	600587	新华医疗	2,595,526.94	4.17
58	601601	中国太保	2,584,235.59	4.15
59	000895	双汇发展	2,581,988.00	4.15
60	002060	粤水电	2,566,684.65	4.12
61	000538	云南白药	2,552,700.00	4.10
62	002073	软控股份	2,529,192.50	4.06
63	600137	浪莎股份	2,488,797.40	4.00
64	600521	华海药业	2,423,197.34	3.89
65	002230	科大讯飞	2,357,059.50	3.79
66	600030	XD中信证	2,329,503.00	3.74
67	000001	平安银行	2,279,388.72	3.66
68	002554	惠博普	2,252,895.00	3.62
69	600839	四川长虹	2,176,984.27	3.50
70	600125	铁龙物流	2,156,710.00	3.46

71	002570	贝因美	2,150,509.14	3.45
72	300113	顺网科技	2,133,858.80	3.43
73	600028	中国石化	2,112,000.00	3.39
74	002024	苏宁云商	2,081,282.00	3.34
75	000415	渤海租赁	2,077,380.00	3.34
76	600312	平高电气	2,062,418.75	3.31
77	002368	太极股份	2,058,000.00	3.31
78	300157	恒泰艾普	2,053,999.57	3.30
79	600690	青岛海尔	2,050,821.28	3.29
80	000997	新大陆	2,040,749.89	3.28
81	002304	洋河股份	2,040,133.01	3.28
82	300205	天喻信息	2,029,432.00	3.26
83	600832	东方明珠	2,009,784.50	3.23
84	600867	通化东宝	1,974,422.00	3.17
85	002465	海格通信	1,934,467.40	3.11
86	300079	数码视讯	1,922,870.24	3.09
87	600111	包钢稀土	1,905,457.44	3.06
88	002429	兆驰股份	1,904,109.86	3.06
89	600809	山西汾酒	1,899,456.47	3.05
90	002402	和而泰	1,878,630.00	3.02
91	600637	百视通	1,871,534.04	3.01
92	000639	西王食品	1,864,039.15	2.99
93	600855	航天长峰	1,842,877.64	2.96
94	600642	申能股份	1,828,116.58	2.94
95	002467	二六三	1,791,440.41	2.88
96	002185	华天科技	1,787,664.00	2.87
97	600478	科力远	1,776,940.00	2.85
98	300188	美亚柏科	1,768,569.19	2.84
99	600161	天坛生物	1,768,395.00	2.84
100	000413	东旭光电	1,761,395.41	2.83
101	300363	博腾股份	1,754,600.00	2.82

102	600562	国睿科技	1,754,147.00	2.82
103	000024	招商地产	1,747,000.00	2.81
104	600352	浙江龙盛	1,730,400.00	2.78
105	002049	同方国芯	1,703,321.41	2.74
106	600824	益民集团	1,697,500.00	2.73
107	600547	山东黄金	1,687,500.00	2.71
108	002699	美盛文化	1,666,516.24	2.68
109	300124	汇川技术	1,655,732.17	2.66
110	002595	豪迈科技	1,654,957.12	2.66
111	600276	恒瑞医药	1,645,386.87	2.64
112	002229	鸿博股份	1,643,807.48	2.64
113	600718	东软集团	1,620,980.92	2.60
114	601992	金隅股份	1,610,264.00	2.59
115	300178	腾邦国际	1,582,197.25	2.54
116	600872	中炬高新	1,576,324.00	2.53
117	300307	慈星股份	1,570,548.88	2.52
118	600754	锦江股份	1,534,698.15	2.47
119	002231	奥维通信	1,533,641.00	2.46
120	002594	比亚迪	1,529,737.18	2.46
121	300223	北京君正	1,500,988.00	2.41
122	300359	全通教育	1,495,745.42	2.40
123	300296	利亚德	1,492,601.00	2.40
124	600630	龙头股份	1,454,274.41	2.34
125	600109	国金证券	1,428,683.97	2.30
126	600123	兰花科创	1,428,503.52	2.29
127	002197	证通电子	1,418,915.00	2.28
128	000726	鲁泰A	1,394,367.00	2.24
129	002249	大洋电机	1,335,834.44	2.15
130	002250	联化科技	1,315,989.00	2.11
131	300167	迪威视讯	1,260,128.00	2.02

注：买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

## 7.4.2 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	002292	奥飞动漫	22,103,630.14	35.51
2	300017	网宿科技	11,014,981.09	17.69
3	600316	洪都航空	9,014,122.18	14.48
4	002215	诺普信	8,586,764.75	13.79
5	002450	康得新	8,573,155.97	13.77
6	002312	三泰电子	8,235,919.28	13.23
7	600315	上海家化	7,978,216.24	12.82
8	300104	乐视网	7,842,648.22	12.60
9	300002	神州泰岳	7,806,866.02	12.54
10	600887	伊利股份	7,690,940.38	12.35
11	300005	探路者	7,175,426.90	11.53
12	300273	和佳股份	7,149,906.47	11.49
13	601998	中信银行	7,084,000.00	11.38
14	600270	外运发展	6,803,948.70	10.93
15	600536	中国软件	6,627,147.76	10.65
16	002023	海特高新	6,618,687.00	10.63
17	002439	启明星辰	6,337,835.55	10.18
18	002230	科大讯飞	5,670,803.75	9.11
19	002465	海格通信	5,515,511.29	8.86
20	002294	信立泰	4,994,089.13	8.02
21	603000	人民网	4,912,508.62	7.89
22	601318	中国平安	4,856,078.21	7.80
23	300059	东方财富	4,854,063.91	7.80
24	600794	保税科技	4,799,474.20	7.71
25	300183	东软载波	4,788,107.42	7.69
26	600703	三安光电	4,706,276.02	7.56

27	600372	中航电子	4,468,832.10	7.18
28	300206	理邦仪器	4,255,263.78	6.84
29	600406	国电南瑞	4,219,935.80	6.78
30	300078	中瑞思创	3,893,459.70	6.25
31	600655	豫园商城	3,881,909.17	6.24
32	600563	法拉电子	3,818,840.16	6.13
33	601117	中国化学	3,723,000.00	5.98
34	002396	星网锐捷	3,711,505.85	5.96
35	300285	国瓷材料	3,695,929.63	5.94
36	600289	亿阳信通	3,609,911.07	5.80
37	600855	航天长峰	3,571,857.07	5.74
38	300058	蓝色光标	3,521,303.37	5.66
39	601098	中南传媒	3,413,862.60	5.48
40	002416	爱施德	3,411,500.38	5.48
41	300331	苏大维格	3,387,659.07	5.44
42	600998	九州通	3,329,232.29	5.35
43	002117	东港股份	3,256,466.07	5.23
44	600330	天通股份	3,230,738.21	5.19
45	300335	迪森股份	3,154,304.01	5.07
46	000793	华闻传媒	3,132,489.04	5.03
47	000529	广弘控股	3,100,445.66	4.98
48	000423	东阿阿胶	2,944,876.76	4.73
49	002527	新时达	2,830,748.98	4.55
50	600587	新华医疗	2,801,242.78	4.50
51	600562	国睿科技	2,793,965.01	4.49
52	600885	宏发股份	2,775,002.26	4.46
53	002253	川大智胜	2,753,562.19	4.42
54	300074	华平股份	2,730,451.00	4.39
55	300027	华谊兄弟	2,709,792.60	4.35
56	600835	上海机电	2,707,529.29	4.35
57	002060	粤水电	2,634,274.53	4.23

58	002148	北纬通信	2,611,039.00	4.19
59	002393	力生制药	2,609,004.09	4.19
60	601601	中国太保	2,581,452.00	4.15
61	000895	双汇发展	2,556,478.00	4.11
62	002260	伊立浦	2,526,340.39	4.06
63	600521	华海药业	2,504,352.00	4.02
64	002073	软控股份	2,484,427.09	3.99
65	002701	奥瑞金	2,465,119.16	3.96
66	600171	上海贝岭	2,414,234.00	3.88
67	600030	XD中信证	2,396,000.00	3.85
68	300034	钢研高纳	2,300,286.47	3.70
69	002554	惠博普	2,232,015.74	3.59
70	000001	平安银行	2,232,000.00	3.59
71	600028	中国石化	2,144,000.00	3.44
72	600535	天士力	2,141,320.90	3.44
73	600125	铁龙物流	2,121,190.11	3.41
74	600804	鹏博士	2,079,504.00	3.34
75	002368	太极股份	2,075,891.20	3.33
76	600690	青岛海尔	2,063,520.02	3.31
77	002024	苏宁云商	2,062,186.00	3.31
78	600839	四川长虹	2,057,681.01	3.31
79	002304	洋河股份	2,042,280.72	3.28
80	300157	恒泰艾普	2,021,935.00	3.25
81	000997	新大陆	2,009,700.00	3.23
82	000415	渤海租赁	1,998,933.94	3.21
83	002570	贝因美	1,995,695.30	3.21
84	300205	天喻信息	1,989,043.71	3.20
85	600867	通化东宝	1,988,596.00	3.19
86	300326	凯利泰	1,987,962.10	3.19
87	002402	和而泰	1,986,667.33	3.19
88	600637	百视通	1,965,688.00	3.16

89	600832	东方明珠	1,951,847.00	3.14
90	600312	平高电气	1,929,165.70	3.10
91	002429	兆驰股份	1,913,977.45	3.07
92	300079	数码视讯	1,908,636.24	3.07
93	600111	包钢稀土	1,862,766.30	2.99
94	000639	西王食品	1,859,616.46	2.99
95	000413	东旭光电	1,844,792.15	2.96
96	000024	招商地产	1,844,067.98	2.96
97	300363	博腾股份	1,830,014.00	2.94
98	600809	山西汾酒	1,819,545.92	2.92
99	600038	XD哈飞股	1,791,769.97	2.88
100	600161	天坛生物	1,780,098.99	2.86
101	002185	华天科技	1,767,093.92	2.84
102	600478	科力远	1,766,422.05	2.84
103	002467	二六三	1,762,839.00	2.83
104	600642	申能股份	1,740,000.00	2.80
105	300188	美亚柏科	1,702,988.93	2.74
106	600276	恒瑞医药	1,698,340.63	2.73
107	002231	奥维通信	1,690,150.00	2.72
108	002699	美盛文化	1,684,462.90	2.71
109	002595	豪迈科技	1,670,393.66	2.68
110	002229	鸿博股份	1,670,205.28	2.68
111	300124	汇川技术	1,641,861.75	2.64
112	002049	同方国芯	1,629,153.50	2.62
113	600547	山东黄金	1,610,730.00	2.59
114	300296	利亚德	1,610,253.30	2.59
115	601992	金隅股份	1,589,213.46	2.55
116	600824	益民集团	1,582,787.00	2.54
117	600872	中炬高新	1,579,620.57	2.54
118	002197	证通电子	1,544,719.78	2.48
119	300167	迪威视讯	1,540,949.96	2.48

120	300007	汉威电子	1,532,033.00	2.46
121	000738	中航动控	1,500,201.85	2.41
122	600754	锦江股份	1,494,790.96	2.40
123	002594	比亚迪	1,493,886.64	2.40
124	300178	腾邦国际	1,484,297.80	2.38
125	600630	龙头股份	1,483,016.08	2.38
126	600123	兰花科创	1,439,731.21	2.31
127	300307	慈星股份	1,431,724.00	2.30
128	300223	北京君正	1,426,210.72	2.29
129	600109	国金证券	1,422,476.00	2.29
130	000726	鲁泰A	1,405,001.88	2.26
131	002603	以岭药业	1,390,594.00	2.23
132	300359	全通教育	1,323,948.51	2.13
133	002249	大洋电机	1,308,104.00	2.10
134	002250	联化科技	1,294,835.00	2.08
135	002104	恒宝股份	1,290,809.30	2.07

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 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	434,919,452.41
卖出股票的收入（成交）总额	453,322,352.66

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。

#### 7.5 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。

#### 7.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.7 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 7.8 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。

### 7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 7.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未投资股指期货。

### 7.10 投资组合报告附注

7.10.1 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.10.2 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。

#### 7.10.3 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	341,207.51
2	应收证券清算款	164,422.20
3	应收股利	—
4	应收利息	4,815.39
5	应收申购款	8,723.87
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	519,168.97

#### 7.10.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.10.5 期末前十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	300253	卫宁软件	2,431,800.00	4.45	重大事项

### 7.10.6 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，分项之和与合计之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
1,880	22,404.47	27,932,029.80	66.31%	14,188,372.92	33.69%

### 8.2 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	403,672.85	0.96%

注：本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为10万份以上。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研发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

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2012年3月9日)基金份额总额	383,988,929.19
本报告期期初基金份额总额	48,934,562.99
本报告期基金总申购份额	11,127,690.62
减：本报告期基金总赎回份额	17,941,850.89
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	42,120,402.72

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

一、报告期内基金管理人发生以下重大人事变动：

1、2014年4月3日，在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上刊登了《长安基金管理有限公司副总经理王健任职公告》，同意王健担任公司副总经理职务。

2、2014年4月9日，在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上刊登了《长安基金管理有限公司督察长袁明任职公告》，同意袁明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、基金托管人中国邮政储蓄银行托管业务部总经理变更为胡涛先生，向监管部门的相关报备手续正在办理中。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内没有改聘会计师事务所，目前事务所已提供审计服务的连续年限为三年。

### 10.6 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。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 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比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
海通证券	1	258,115,791.13	29.06%	234,988.31	29.06%	
招商证券	1	245,707,481.08	27.66%	223,692.27	27.66%	
广发证券	1	169,766,029.69	19.11%	154,555.08	19.11%	
天风证券	1	133,291,990.05	15.01%	121,349.72	15.01%	
宏源证券	1	81,342,153.12	9.16%	74,053.77	9.16%	

注：1、基金租用席位的选择标准是：

- (1) 财力雄厚，信誉良好，财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (2) 经营行为规范，在最近一年内无重大违规经营行为；
- (3) 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；
- (4) 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，本基金本期无新增的交易单元，无剔除的交易单元。

#### 10.7.2 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	占当期债券成交总额比例	成交金额	占当期债券回购成交总额比例	成交金额	占当期权证成交总额比例

				例		
海通证券	—	—	—	—	—	—
招商证券		—		—		—
广发证券		—		—		—
天风证券		—		—		—
宏源证券		—		—		—

### 10.8 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	长安宏观策略股票型证券投资基金2013年第4季度报告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2014-01-22
2	关于增加华泰证券股份有限公司 有为长安基金旗下基金代销机构 的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2014-03-12
3	长安宏观策略股票型证券投资基金 2013年年度报告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2014-03-29
4	长安宏观策略股票型证券投资基金 2013年年度报告摘要	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2014-03-29
5	关于增加浙江同花顺基金销售有 限公司和安信证券股份有限公司 为长安基金旗下基金代销机构的 公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2014-04-02
6	长安基金管理有限公司副总经理 王健任职公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2014-04-03
7	关于增加齐鲁证券有限公司、和 讯信息科技有限公司、中期时代 基金销售（北京）有限公司和北 京钱景财富投资管理有限公司为 长安基金旗下基金代销机构的公 告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2014-04-08
8	长安基金管理有限公司督察长袁 明任职公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2014-04-09
9	长安宏观策略股票型证券投资基	中国证券报、上海证券报、	2014-04-21

	金招募说明书2014年第1次更新	证券时报	
10	长安宏观策略股票型证券投资基金招募说明书2014年第1次更新摘要	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2014-04-21
11	长安宏观策略股票型证券投资基金2014年第1季度报告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2014-04-21
12	关于增加西南证券股份有限公司为长安基金旗下基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2014-04-24
13	长安基金管理有限公司关于从业人员在子公司兼任职务及领薪情况的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2014-06-17
14	长安基金管理有限公司关于旗下基金在浙江同花顺基金销售有限公司开通定期定额投资业务并参加费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2014-06-26
15	长安基金管理有限公司关于旗下基金2014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	2014-06-30

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、《长安宏观策略股票型证券投资基金基金合同》；
- 2、《长安宏观策略股票型证券投资基金托管协议》；
- 3、《长安宏观策略股票型证券投资基金招募说明书》；
- 4、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 5、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

### 12.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人的办公场所-上海浦东新区芳甸路1088号紫竹国际大厦16层

### 12.3 查阅方式

投资者可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相关公开披露的法律文件，投资者还可在本基金管理人网站（[www.changanfunds.com](http://www.changanfunds.com)）查阅。

长安基金管理有限公司

二〇一四年八月二十八日