

长安鑫富领先灵活配置混合型证券投资基金2017年半年度报告摘要

2017年06月30日

基金管理人:长安基金管理有限公司

基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期:2017年08月24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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年8月23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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2017年02月22日起至2017年06月30日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	长安鑫富领先灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	长安鑫富领先混合
基金主代码	001657
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年02月22日
基金管理人	长安基金管理有限公司
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	139,574,618.24份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险和保持流动性的前提下，通过灵活的资产配置策略和积极主动的投资管理，追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>本基金将采用“自上而下”的大类资产配置策略和“自下而上”选股策略相结合的方法进行资产配置和组合风险管理。（一）大类资产配置策略 本基金的大类资产配置采用“自上而下”的多因素分析决策支持系统，结合定性分析和定量分析，确定基金资产在股票、债券及货币市场工具等类别资产的配置比例，并随着各类证券风险收益特征的相对变化动态调整配置比例，以平衡投资组合的风险和收益。本基金进行大类资产配置时，重点考察宏观经济状况、政府政策和资本市场等三个方面的因素：1、宏观经济状况：重点关注GDP、工业增加值、CPI、PPI、投资、消费、进出口、流动性状况、利率、汇率等经济指标，以评估未来经济发展所处阶段及宏观经济变化趋势；2、政府政策：重点关注政府货币政策、财政政策和产业政策的变动趋势，评估其对经济发展和各行业及资本市场</p>

的影响； 3、资本市场因素：重点关注资金供求、市场情绪和不同市场的相对估值等指标，以判断未来市场变动趋势。（二）股票投资策略 随着中国经济增长方式的转变和经济机构的调整持续推进，中国的产业结构升级和自主创新速度不断加快，以及互联网对经济和公司运营管理的影响日益广泛和深入的背景下，在某些方面具有领先优势的企业将充分发挥其优势，保持快速成长。本基金将充分发挥基金管理人在个股选择方面的优势，采取“自下而上”为主的投资策略，通过定性与定量分析的有机结合，精选具有持续领先优势和估值合理的上市公司股票进行投资。

1、定性分析 定性分析方面，本基金将通过实地调研和案头工作，精选在以下某方面或几方面具有领先优势的企业：

- （1）行业地位领先：细分行业中的龙头企业，市场占有率高，能够更好把握行业发展的机会；
- （2）资源禀赋领先：企业在自然资源等稀缺资源的开发和销售等方面具有垄断优势；
- （3）运营管理领先：具有运作良好的管理理念、经营机制、制度流程，人才激励有效；
- （4）团队领先：管理层稳定，具有前瞻眼光和进取精神，制定了明确可执行的企业发展战略，具备领先的团队组织建设能力，实现对企业的有效治理；
- （5）技术领先：在技术上具有独特的领先优势，掌握专门技术或专利；
- （6）市场领先：企业提供的产品及服务在市场上处于领先地位，企业形成较高的品牌知名度，客户忠诚度较高；
- （7）商业模式领先：企业在商业模式、流程管理、业务创新等方面保持领先，竞争者难以模仿。

2、定量分析 本基金将通过主营业务收入增长率、净利润增长率、营业利润增长率、EBIT增长率等指标评估公司成长性。同时，通过分析公司的市盈率、市净率、PEG、EV/EBITDA以及行业或同行业同类公司的估值比较，判断公司的估值，选取具有良好成长性且估值合理的公司构建股票投资组合。

（三）债券投资策略 1、普通债券投资策略 本基金在分析宏观经济走势、财政货币政策的前提下，积极主动的进行债券投资，以实现在一定程度上规避

股票市场的系统性风险、提高基金投资组合整体收益的目的。本基金将通过分析利率变动趋势及市场信用环境变化方向,综合考虑不同债券品种的收益率水平、流动性、税赋特点、信用风险等因素,构造债券投资组合。在实际的投资运作中,本基金将采取久期策略、收益率曲线策略、息差策略、骑乘策略、类别选择策略、个券选择策略等多种策略,精选安全边际较高的个券进行投资,以获取债券市场的长期稳健收益。

2、可转债投资策略 本基金在综合分析可转债的股性特征、债性特征、流动性等因素的基础上,采用数量化估值工具评定其投资价值,选择安全边际较高、发行条款相对优惠、流动性良好以及基础股票基本面优良的品种进行投资。本基金还将密切关注转股溢价率、纯债溢价率等指标的变化情况,积极寻找转股溢价率和纯债溢价率呈现“双低”特征的可转债品种,捕捉相关套利机会。

(四)衍生品投资策略 1、股指期货投资策略 本基金将在风险可控的前提下,本着谨慎原则,适度参与股指期货投资。本基金管理人将根据持有的股票投资组合状况,通过对现货和期货市场运行趋势的研究,结合股指期货定价模型对其估值水平合理性的评估,并通过与现货资产进行匹配,选择合适的投资时机,采用多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金还将利用股指期货作为组合流动性管理工具,降低现货市场流动性不足导致的冲击成本过高的风险,提高基金的建仓或变现效率。

2、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综合考虑股票合理价值、标的股票价格,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估计权证合理价值,采用杠杆交易策略、看跌保护组合策略、保护组合成本策略、获利保护策略、买入跨式投资等策略达到改善组合风险收益特征的目的。

(五)资产支持证券投资策略 本基金将通过分析市场利率、发行条款、资产池结构及其资产池所处行业的景气变化和提前偿还率等影响资产支持证券价值的相关要

	素，并综合运用久期管理、收益率曲线变动分析和收益。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*50%+中债综合指数收益率*50%
风险收益特征	本基金为混合型基金，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，属于较高预期风险、较高预期收益的投资品种。

### 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	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李永波
	联系电话	021-20329761
	电子邮箱	service@changanfunds.com
客户服务电话	400-820-9688	95528
传真	021-50598018	021-63602540

### 2.4 信息披露方式

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	上海市浦东芳甸路1088号紫竹大厦16楼

## § 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

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2017年02月22日 - 2017年06月30日）
本期已实现收益	4,785,626.14
本期利润	26,915,477.17
加权平均基金份额本期利润	0.1940

本期加权平均净值利润率	18.17%
本期基金份额净值增长率	19.50%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	报告期末（2017年06月30日）
期末可供分配利润	5145655.31
期末可供分配基金份额利润	0.0369
期末基金资产净值	166,802,877.74
期末基金份额净值	1.195
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	报告期末（2017年06月30日）
基金份额累计净值增长率	19.50%

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

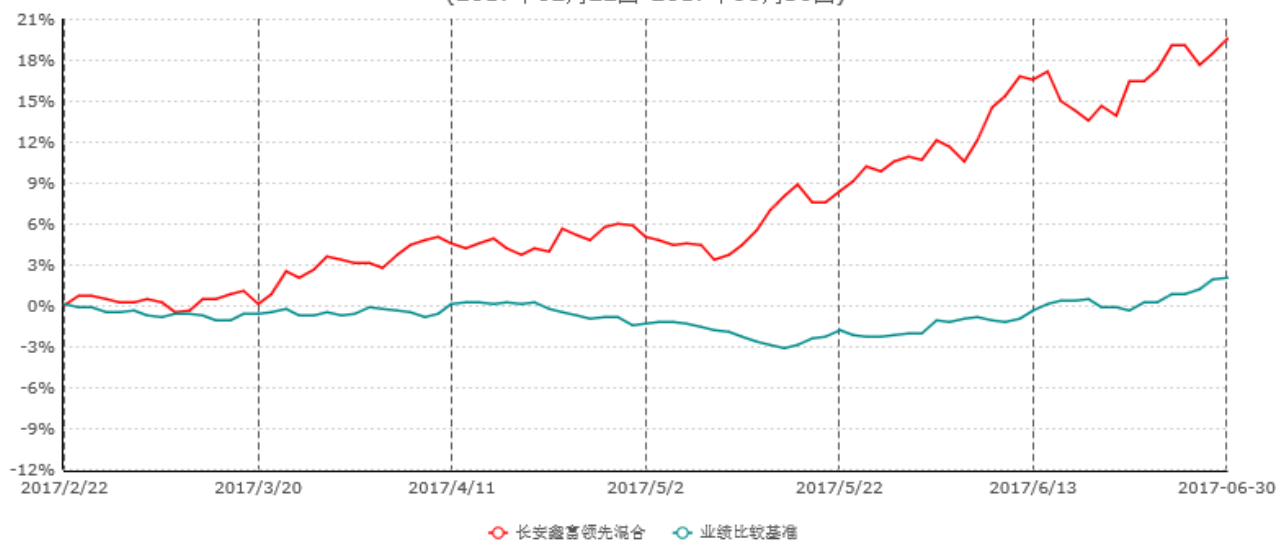
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去一个月	7.95%	1.08%	2.93%	0.34%	5.02%	0.74%
过去三个月	15.24%	0.83%	2.66%	0.37%	12.58%	0.46%
自基金合同生效起至今	19.50%	0.76%	1.97%	0.30%	17.53%	0.46%

本基金整体业绩比较基准构成为：沪深300指数收益率\*50%+中债综合指数收益率\*50%。

#### 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

长安鑫富领先灵活配置混合型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2017年02月22日-2017年06月30日)



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。本基金正处在建仓期。图示日期为2017年02月22日至2017年6月30日。

## § 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7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。

### 3、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。

### 4、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。

### 5、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。

### 6、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。

### 7、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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		

陈立秋	本基金的 基金经理	2017-06- 02	-	11年	工商管理硕士及工学硕士学位，曾任Blue Pool Capital 投资经理，江海证券有限公司研究主管等，人保资产管理有限公司高级投资经理，上海知几资产管理有限公司投资总监，鸿商资本股权投资有限公司董事总经理（期间委派至旗下控股的中法人寿保险有限责任公司担任投资总监）等职。现任长安基金管理有限公司投资总监、长安鑫利优选灵活配置混合型证券投资基金及长安鑫富领先灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
林忠晶	本基金的 基金经理	2017-02- 22	-	7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、长安鑫富领先灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

- 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

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

2016年底以来，管理层对继续去杠杆进程，并且出台多项措施严控金融业系统性风险，长短端利率出现明显上升，但经济表现较好韧性。2017年上半年中国经济增长保持平稳、超出市场预期。从需求端看，基础设施投资增速强劲、房地产投资处于高位、制造业投资温和反弹、出口增速显著复苏；从生产端看，供给侧改革导致供给收缩、叠加低库存周期带动工业品价格上升、从而企业的进入补库存周期。但经济数据稳健增长的背后依然存在一些隐忧，如民间固定资产投资表现依然较为疲软、社会消费品零售总额同比增速出现下跌等。2017年上半年以来，投资者的风险偏好出现明显下降，权益市场表现出现结构性分化，投资者更加关注业绩与估值的匹配性，估值较高板块出现一定压力，受益于消费升级的家电、食品饮料，以及受益于供给侧改革导致盈利持续改善煤炭等行业表现较为较好。盈利前景相对不稳定、以及估值较高的计算机、传媒和国防军工等表现相对较弱。

报告期内，本基金加大受益于消费升级食品饮料、汽车和家电等行业龙头公司的配置比例，并且基于经济增长不可能持续恶化、坏账率持续下降的判断加大银行也配置力度，另外，密切关注国家产业政策的变动趋势，跟踪产业出清紧张，选择研发能力较强并且具有较好商业模式的医药和计算机等行业龙头公司进行投资。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2017年6月30日，本基金份额净值为1.195元。报告期内，本基金份额净值增长率为19.50%，同期业绩基准增长率为1.97%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前经济处于结构调整过程中，随着库存周期接近尾声、而新的产能周期仍未开启，已经房地产调控继续进行、财政与融资规范对基建投资影响的显现，投资和新开工将波动下行，预计2017年下半年经济需求回落的概率仍然较大。若上游原材料供给收缩力度较大，或再度引发工业原材料价格上涨，由于下游消费未出现趋势性的改善，价格由上游向下游传导较为困难，将挤压工业企业盈利，并导致工业生产进一步放缓。因此，对于周期性行业投资保持谨慎。受消费结构升级的影响，具有良好商业模式、较高品质并处于龙头地位的食品饮料、家电等行业龙头公司仍具有投资价值。随着产业政策的稳定，具备技术、市场和资金优势的企业竞争优势将更加明显，市场集中度将进一步提高，具有较强研发实力、完善的产品梯队、市场认可度较高、管理层稳定的细分医药龙头公司将迎来业绩高速增长时期。经过一轮下跌，中小板、创业板中个股估值分化较为严重，部分TMT个股估值与盈利匹配度相对较高，对于符合消费升级并且创新能力较强的公司净利润将保持稳定增长，具有一定投资价值。

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(除固定收益品种外)，采用交易所发布的行情信息来估值。对本基金所持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所和银行间上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)采用第三方估值机构提供的价格进行估值。除了投资总监外，其他基金经理不参与估值政策的决策。但是对于非活跃投资品种，基金经理可以提供估值建议。上述参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金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。

### § 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，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对长安鑫富领先灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，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基金托管人应尽的义务。

#### 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，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对长安鑫富领先灵活配置混合型证券投资基金的投资运作进行了监督，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的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内未进行利润分配。

#### 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

本报告期内，由长安基金管理有限公司编制本托管人复核的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真实、准确、完整。

### § 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：长安鑫富领先灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2017年06月30日

单位：人民币元

资 产	本期末 2017年06月30日
-----	--------------------

<b>资 产:</b>	
银行存款	14,805,673.25
结算备付金	294,514.23
存出保证金	115,508.49
交易性金融资产	151,966,992.91
其中: 股票投资	151,966,992.91
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	-
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	162,586.41
应收利息	10,891.41
应收股利	-
应收申购款	49,888.89
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	167,406,055.59
<b>负债和所有者权益</b>	本期末 2017年06月30日
<b>负 债:</b>	
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	-
应付证券清算款	-
应付赎回款	15,317.16
应付管理人报酬	157,935.77
应付托管费	26,322.61
应付销售服务费	-

应付交易费用	344,427.76
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	59,174.55
负债合计	603,177.85
<b>所有者权益：</b>	
实收基金	139,574,618.24
未分配利润	27,228,259.50
所有者权益合计	166,802,877.74
负债和所有者权益总计	167,406,055.59

1、报告截止日2017年06月30日，基金份额净值1.195元，基金份额总额139,574,618.24份。

2、本基金合同于2017年02月22日生效，本财务报表的实际编制期间为2017年02月22日至2017年06月30日。

## 6.2 利润表

会计主体：长安鑫富领先灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017年02月22日至2017年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期2017年02月22日（基金合同生效日）至2017年06月30日
<b>一、收入</b>	28,215,287.16
1. 利息收入	128,688.55
其中：存款利息收入	128,688.55
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）	4,509,503.08

其中：股票投资收益	2,123,797.48
基金投资收益	-
债券投资收益	-
资产支持证券投资收益	-
贵金属投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	2,385,705.60
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	22,129,851.03
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	1,447,244.50
<b>减：二、费用</b>	<b>1,299,809.99</b>
1. 管理人报酬	617,677.04
2. 托管费	102,946.16
3. 销售服务费	-
4. 交易费用	518,788.28
5. 利息支出	-
其中：卖出回购金融资产支出	-
6. 其他费用	60,398.51
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>26,915,477.17</b>
减：所得税费用	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>26,915,477.17</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长安鑫富领先灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017年02月22日至2017年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2017年02月22日（基金合同生效日）至2017年06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)	201,279,812.54	-	201,279,812.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	26,915,477.17	26,915,477.17
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)	-61,705,194.30	312,782.33	-61,392,411.97
其中：1. 基金申购款	52,738,742.60	1,912,399.52	54,651,142.12
2. 基金赎回款	-114,443,936.90	-1,599,617.19	-116,043,554.09
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)	139,574,618.24	27,228,259.50	166,802,877.74

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：

王健

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

长安鑫富领先灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于准予长安鑫富领先灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2015]1464号文)注册,由长安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《长安鑫富领先灵活配置混合型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于2017年2月22日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定期,首次设立募集规模为201,279,812.54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,基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司(以下简称“浦发银行”)。

本基金于2017年2月13日至2017年2月17日募集,募集期间净认购资金人民币201,278,713.52元,认购资金在募集期间产生的利息人民币1,099.02元,募集的有效认

购份额及利息结转的基金份额合计201,279,812.54份。上述募集资金已由毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）验资，并出具了毕马威华振验字第1700053号验资报告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《长安鑫富领先灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《长安鑫富领先灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、衍生工具（权证、股指期货）、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款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）。本基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为0%-95%；权证投资占基金资产净值的比例为0%-3%；任何交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，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。本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率\*50%+中债综合指数收益率\*50%。

根据《证券投资基金信息披露管理办法》，本基金定期报告在公开披露的第2个工作日，报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

#### 6.4.2 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。

#### 6.4.3 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2017年06月30日的财务状况、自2017年02月22日至2017年06月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历01月01日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为自2017年02月22日至2017年06月30日止。

#### 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，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。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，金融资产和金融负债的后续计量如下：

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。

应收款项以实际利率法按摊余成本计量。

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采用实际利率法按摊余成本进行后续计量。

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。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：所转移金融资产的账面价值；因转移而收到的对价。

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

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

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

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

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

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

本基金的交易费用于进行股票、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四位，发生时直接计入基金损益；如果影响基金份额净值小数点后第四位的，应采用待摊或预提的方法，待摊或预提计入基金损益。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

根据《长安鑫富领先灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定：

1、在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资人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；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即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；

4、每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 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。

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

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金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》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》，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首次投资成本，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。

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》(以下简称“估值处理标准”),在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场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数据进行估值。

#### 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

本基金在本年度未发生过重大会计差错。

#### 6.4.6 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。

2018年1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2018年1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。因此,截至2017年06月30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2017年06月30日,本基金无应交税费。



## 6.4.7 关联方关系

### 6.4.7.1 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。

### 6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	关联方与本基金的关系
长安基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
上海浦东发展银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
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。

## 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.8.1.1 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。

#### 6.4.8.1.2 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。

#### 6.4.8.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 6.4.8.1.4 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。

#### 6.4.8.1.5 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。

#### 6.4.8.2 关联方报酬

##### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年02月22日（基金合同生效日）至2017年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	617,677.04
其中：支付销售机构的客户维护费	6,920.37

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1.2%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×1.2%/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。

##### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年02月22日（基金合同生效日）至2017年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	102,946.16

支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值0.20%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×0.20%/当年天数。

##### 6.4.8.2.3 销售服务费

本基金不收取销售服务费用。

##### 6.4.8.3 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。

##### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

**6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

本基金本报告期内无除基金管理人外的其他关联方投资本基金。

**6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年02月22日（基金合同生效日）至2 017年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
上海浦东发展银行股份有限公司活期存款	14,805,673.25	120,308.73

本基金通过“浦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和存出保证金，于2017年6月30日的相关余额为410,022.72人民币元。

**6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期内未参与关联方承销证券的买卖。

**6.4.8.7 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。

**6.4.9 利润分配情况**

本基金本报告期内未进行利润分配。

**6.4.10 期末（2017年06月30日）本基金持有的流通受限证券****6.4.10.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
代码	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	说明
002879	长缆科技	2017-06-05	2017-07-07	网下新股	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-

				申购						
002882	金龙羽	2017-06-15	2017-07-17	网下新股申购	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-
603933	睿能科技	2017-06-28	2017-07-06	网下新股申购	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-
603305	旭升股份	2017-06-30	2017-07-10	网下新股申购	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-
300670	大烨智能	2017-06-26	2017-07-03	网下新股申购	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	-
300672	国科微	2017-06-30	2017-07-12	网下新股申购	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	-
603331	百达精工	2017-06-27	2017-07-05	网下新股申购	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-
300671	富满电子	2017-06-27	2017-07-05	网下新股申购	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-
603617	君禾股份	2017-06-23	2017-07-03	网下新股申购	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-

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。本基金本报告期末未持有因增发证券而持有流通受限证券。

#### 6.4.10.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金截至2017年6月30日未持有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。

#### 6.4.10.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.10.3.1 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。

## § 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	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	151,966,992.91	90.78
	其中：股票	151,966,992.91	90.78
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	15,100,187.48	9.02
7	其他各项资产	338,875.20	0.20
8	合计	167,406,055.59	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	103,444,450.29	62.02
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	13,190,380.00	7.91
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	410,629.62	0.25
J	金融业	34,921,533.00	20.94
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	151,966,992.91	91.11

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序前十名股票投资明细

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	002241	歌尔股份	825,016	15,906,308.48	9.54
2	600036	招商银行	656,700	15,701,697.00	9.41
3	600519	贵州茅台	31,591	14,906,213.35	8.94
4	600104	上汽集团	471,400	14,636,970.00	8.78
5	002415	海康威视	441,450	14,258,835.00	8.55
6	600566	济川药业	368,667	14,020,406.01	8.41
7	002372	伟星新材	730,121	13,638,660.28	8.18
8	002508	老板电器	307,109	13,353,099.32	8.01
9	601288	农业银行	3,787,800	13,333,056.00	7.99
10	000963	华东医药	265,400	13,190,380.00	7.91

投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于本公司网站的半年度报告正文。

#### 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	601939	建设银行	19,990,348.00	11.98
2	002372	伟星新材	15,012,231.01	9.00
3	002241	歌尔股份	15,000,814.41	8.99
4	600566	济川药业	13,517,110.56	8.10
5	601288	农业银行	13,359,887.00	8.01

6	000001	平安银行	13,305,096.19	7.98
7	002142	宁波银行	13,037,473.40	7.82
8	600519	贵州茅台	13,009,783.56	7.80
9	002508	老板电器	12,949,140.81	7.76
10	600036	招商银行	12,930,020.00	7.75
11	601398	工商银行	12,919,448.00	7.75
12	600104	上汽集团	12,915,988.00	7.74
13	002003	伟星股份	12,679,168.91	7.60
14	000963	华东医药	11,993,733.30	7.19
15	002415	海康威视	11,501,606.75	6.90
16	000338	潍柴动力	10,916,379.00	6.54
17	601088	中国神华	10,038,895.88	6.02
18	601988	中国银行	10,000,104.00	6.00
19	600016	民生银行	9,999,909.00	6.00
20	601328	交通银行	9,988,944.00	5.99
21	000039	中集集团	6,622,009.00	3.97

#### 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	601939	建设银行	14,318,319.64	8.58
2	601398	工商银行	13,911,185.00	8.34
3	000001	平安银行	12,813,051.00	7.68
4	002142	宁波银行	12,787,135.84	7.67
5	601088	中国神华	11,704,207.90	7.02
6	002003	伟星股份	10,916,813.48	6.54
7	601328	交通银行	9,878,556.00	5.92
8	600016	民生银行	9,845,895.00	5.90
9	601988	中国银行	9,758,166.00	5.85
10	000338	潍柴动力	8,999,592.82	5.40



11	000039	中集集团	5,997,563.00	3.60
12	002372	伟星新材	5,076,348.26	3.04
13	002230	科大讯飞	2,500,386.00	1.50
14	002241	歌尔股份	1,771,862.50	1.06
15	600519	贵州茅台	1,742,000.00	1.04
16	002415	海康威视	1,003,595.07	0.60
17	600104	上汽集团	1,001,420.00	0.60
18	601288	农业银行	999,999.00	0.60
19	600036	招商银行	300,200.00	0.18
20	601952	苏垦农发	174,781.24	0.10

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	264,778,968.47
卖出股票的收入（成交）总额	138,582,905.35

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 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。

#### 7.9 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

本基金本报告期末未持有权证。

**7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

本基金本报告期末未进行股指期货交易。

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

本基金本报告期末未进行国债期货交易。

**7.12 投资组合报告附注**

7.12.1 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。

7.12.2 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。

**7.12.3 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	115,508.49
2	应收证券清算款	162,586.41
3	应收股利	-
4	应收利息	10,891.41
5	应收申购款	49,888.89
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	338,875.20

**7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

**7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金报告期末前十名股票中未存在流通受限的股票。

**7.12.6 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。

## § 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 (%)
860	162, 296. 07	136, 220, 160. 70	97. 60	3, 354, 457. 54	2. 40

### 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	321, 462. 61	0. 23

### 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 究部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2017年02月22日)基金份额总额	201, 279, 812. 54
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	52, 738, 742. 60
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	114, 443, 936. 90
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	139, 574, 618. 24

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。

## § 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

2017年7月31日，基金管理人在《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王健代为履行公司总经理职务的公告》，同意黄陈辞去总经理职务，由副总经理王健代行公司总经理职务。

本基金托管人的基金托管部门无重大人事变动情况。

### 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

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)的报酬为人民币伍万元整。

### 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(%)	

			(%)			
中金公司	2	148,690,851.84	36.86	107,251.73	31.14	-
申万宏源证券	2	254,671,021.98	63.14	237,176.03	68.86	-

### 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		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总量的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购交易成交总量的比例 (%)	成交金额	占当期权证交易成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期基金交易成交总额的比例 (%)
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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，均为新增的交易单元，无退租的券商交易单元。

长安基金管理有限公司  
二〇一七年八月二十四日