

<p>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 报告截止日期:2013年3月7日 18时15分</p>	
<p>基金管理人的董事会及董事承诺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法律责任。</p> <p>基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司承诺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法律责任。</p> <p>基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金资产,但不保证基金一定盈利。</p> <p>基金的过往业绩并不代表未来表现,投资有风险,投资者在作出投资决策前应先行阅读本基金的招募说明书。</p> <p>本报告中财务资料未经审计。</p> <p>本报告自投资3月4日至3月6日止。</p>	
<p>2 基金基本情况</p>	
基金简称	长安宏观策略股票
基金代码	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	51,490,519.93份
投资目标	<p>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,力争实现投资资产的长期稳定增值。</p> <p>本基金从全球视野的角度出发,把握全球经济增长-国际产业格局调整与转移以及国内经济工业化、城市化-国内产业结构升级与消费升级所带动带来的投资机会,自上而下地实施战略、战术相结合的大类资产之间的策略配置和各行各业之间的优化配置,并配合自上而下的个股精选策略和债券投资策略,构建投资组合,力争取得超额投资收益。</p>
投资策略	<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、债券等各类资产的相对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、现金之间的资产配置比例。</p>
	<p>2. 行业配置策略</p> <p>本基金在大类资产配置的前提下,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行业的影响,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。</p>
	<p>3. 个股选择策略</p> <p>本基金在行业配置的基础上,将充分发挥基金管理人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式,精选基本面良好、成长性突出的上市公司,构建投资组合。</p>
	<p>4. 债券投资策略</p> <p>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的重要手段,在控制流动性风险的基础上,通过久期管理、信用配置、类属配置和个券选择等方式进行积极主动的组合管理。</p>
	<p>5. 权证投资策略</p> <p>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标的股票的价格和收益的敏感性,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,利用权证行市具有的特性,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。</p>
业绩比较基准	<p>6. 股指期货投资策略</p> <p>本基金将根据《证券投资基金业法规和政策的的规定,在严格控制风险的前提下,本着谨慎原则,以期保值增值为主要目的,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业务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支持系统,授权相关员工负责股指期货的实时风险监控事项。</p>
	<p>7. 其他金融工具的投资策略</p> <p>对于金融结构允许并基金投资的其他金融工具,本基金将在谨慎分析和充分论证的基础上,运用金融工具并主要基于以下目的进行投资:分散风险,以降低组合风险,实现基金资产的保值增值。</p>
	沪深300指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%
	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。
	长安基金管理有限公司
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

长安宏观策略股票

2013

第 三 季 度 报 告

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

主要财务指标	单位：人民币元
1.本期已实现收益	2,903,063.00
2.本期利润	5,291,192.18
3.加权平均基金份额本期利润	0.1433
4.期末基金资产净值	54,922,215.66
5.期末基金份额净值	1.067

报告期(2013年4月1日—2013年6月30日)

阶段	净值增长率①	业绩比较基准收益率②	业绩比较基准收益率-净值率③	①-③	②-④
过去三个月	12.08%	1.78%	-9.49%	1.16%	21.57%

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有人认购或交易基金的各类费用，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 本基金报告期内净值增长率及其与同期业经比较基准收益率的对比

注：本基金整体业绩以基准基金沪深300指数增长率×80%+中证全债指数增长率×20%。

3.2.2 自基金合同生效以来基准基金的累计净值增长率变动及其与同期业经比较基准收益率变动的比较

The chart displays two data series over time from 2013年4月1日到2013年6月30日. The vertical axis represents percentage changes from -10% to 10%. One line shows the cumulative net value growth rate of the benchmark fund, while the other shows the benchmark yield rate. The fund's performance line remains consistently higher than the benchmark yield rate line throughout the period.

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理简介 (基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期间 (任职日期)	证券从业年限 (离任日期)	说明
雷宇	本基金的基金经理	2012年6月28日	- 13年	中国政法大学经济学硕士。曾任中国技术进出口总公司项目经理、研究员、上海中投投资咨询有限公司研究员、基金经理。曾历任光大集团资产管理有限公司投资管理师、投资部副总监、国泰海通基金管理有限公司常务副总经理兼资产管理部总经理等职。2011年8月加入长安基金管理有限责任公司，任基金经理助理。2012年6月28日至今天任长安宏观策略股票基金的基金经理。

注：1、任职日期、其他任职日期、离职日期均与我公司做出聘任决定之日；

2、证券从业年限按从事证券相关业务工作的从业经历累计年限计算；

3、管理人对报告期内基金运作遵规合规情况的说明

本报告期内，本公司严格遵守《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、安全公允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，为基金份额持有人寻求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.2 公平交易执行的专项说明

4.2.1 公平交易执行的情况说明

本基金管理人秉承价值投资理念，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、交易各个环节的有效衔接。同时，建立公平可套用的投资组合决策系统和交易对手选择库，共享研究成果，在确保投资组合组合的信息隔离与保密的前提下，保证建立信息交流、资源共享下的公平投资管理环境。

公司建立了专门公平交易管理制度，并在交易系统内采用公平交易模块，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，并经过严格的调查审核程序，防范交易操作异常情况。

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理人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》。

4.2.2 跨市场交易的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.3 报告期内基金的投资策略和运作分析

2013年一季度股市整体上受到经济增速放缓和改革进程低于预期，以及美国量化宽松政策超预期提前退出等因素负面影响，导致市场信心受到打击，整体呈现震荡下探的走势，尤其是6月份创出四年多来最大跌幅，最

典型证券投资基金

二季度报告

沪深300指数下跌11.8%。从行业上看,二季度板块跌多涨少,分化严重;TMT行业整体涨幅突出明显跑赢大盘,而资源、有色等周期板块跌幅明显。

二季度,我们主要采取了自下而上的选股策略,集中配置了符合国家产业战略规划、未来具有较好成长性的个股。二季度增持了传媒、印制医药、军工、环保等行业公司,取得了较好的收益。同时由于宏观基本面不确定性因素的增多,我们减持了部分金融、地产公司的股票。

4.5 报告期内基金的投资业绩和净值

截至2016年6月30日,本基金份额净值为1.0671元。报告期内,本基金份额净值增长率为12.08%,同期业绩基准增长率为-9.49%。

4.6 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

回顾上半年二季度,在基本面调整期面临落实阶段,短期经济增速下滑的趋势不可避免。另外,央行在货币政策执行过程的释放出偏宽松的基调,短期风险偏好顺势机会以提振。结合基本面和资金面因素考虑,我们对中长期政策走势相对谨慎,大蓝筹蓝筹和中期股没有趋势性机会,市场依然会重点关注成长股。

同时,二季度经济下行概率在急剧扩大,我们将采取稳健的投资策略,围绕国家稳增长、转方式、调结构的方针政策,紧跟新四化趋势,积极寻找政策变化给的市场带来的机会。我们致力于寻找具有长期竞争优势和持续成长潜力的优秀企业,通过分享他们的成长,为投资者创造更高的长期回报。我们珍惜基金份额持有人的一份投资和每一份信任,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。

§ 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	金额单位:人民币元	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	20,887,180.00		37.10
	其中:股票	20,887,180.00		37.10
2	基金投资			
3	固定收益投资			
	其中:债券			
4	资产支持证券			
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			
6	银行存款和结算备付金合计	5,177,952.05		9.20
7	其他各项资产	30,240,133.44		53.71
8	合计	56,305,265.49		100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值	金额单位:人民币元	占基金总资产净值比例 (%)
A	农林、牧、渔业	-		-
B	采矿业	-		-
C	制造业	12,894,030.00		23.48
D	电力、热力、燃气及生产和供应业	1,051,500.00		1.91
E	建筑业	-		-
F	批发和零售业	864,000.00		1.57
G	交通运输、仓储和邮政业	-		-
H	住宿和餐饮业	-		-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	5,324,050.00		9.69
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	753,600.00		1.37
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	20,887,180.00		38.03

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

金额单位：人民币元

					占基金资产净值比例	
					(%)	
序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值		
1	600837	海螺水泥	60,000	1,680,000.00	3.06	
2	002292	奥飞动漫	74,000	1,656,860.00	3.02	
3	300273	上海家化	70,000	1,499,400.00	2.73	
4	600315	上海股份	32,000	1,439,680.00	2.62	
5	002323	瀚特高新	120,000	1,353,600.00	2.46	
6	002230	科大讯飞	23,000	1,062,600.00	1.93	
7	300335	通鼎股份	75,000	1,051,500.00	1.91	
8	002215	博晖光电	160,000	1,049,600.00	1.91	
9	300679	联得讯	50,000	1,048,000.00	1.91	
10	300210	森远股份	50,000	1,000,000.00	1.82	

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名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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 前十大重仓基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未进行股指期货交易。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 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,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

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

5.9.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额	
1	卖出证券资金		
2	应收证券清算款		198,349.33
3	应收利息		
4	应收红利		2,501.87
5	应收申购款		30,309,282.34
6	其他应收款		
7	待摊费用		
8	其他		
合计			30,240,133.44

5.9.4 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。

5.9.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.9.6 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,本报告中文字描述的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 6 开放式基金业绩变动

单位:元

本报告期期初基金份额总额	51,885,033.75
本期新基金份额申购总额	29,791,287.35
减:本期基金份额赎回份额	30,187,180.37
本期基金份额净申购额	
本报告期末基金份额总额	51,490,519.93

§ 7 影响投资者决策的其他重要信息

7.1 本报告期内,公司根据《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》及基金管理人的网站上进行了信息披露。

1. 2013年4月23日披露了《长安宏略股票型证券投资基金2013年第1季度报告》。

2. 2013年5月17日披露了《长安宏略股票型证券投资基金更新招募说明书 2013年第1号》和《长安宏略股票型证券投资基金更新招募说明书 2013年第2号》。

3. 2013年5月17日披露了《长安宏略基金管理人关于开通多交易账户业务公告》。

4. 2013年5月21日披露了《长安基金管理有限责任公司关于增加直销(非)上海基金销售投资顾问有限公司、上海利得基金销售有限公司为旗下基金代销机构的公告》。

§ 8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1. 中国证监会核准基金募集的文件;

2. 长安宏略股票型证券投资基金基金合同;

3. 长安宏略股票型证券投资基金基金托管协议;

4. 长安宏略股票型证券投资基金基金销售招募说明书;

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. 报告期内基金的各项合同;

8. 有权放债人

上海市浦东新区芳甸路188号紫竹国际16层1612。

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。

投资者对资料真实性如有任何疑问,可咨询本管理人。

咨询电话:400-820-0888

公司网址: www.changanfunds.com。

长安基金管理有限责任公司
二〇一三年七月十八日

基金管理人: 长安基金管理有限公司
基金托管人: 广发银行股份有限公司
报告送出日期: 2013 年 5 月 18 日

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。

基金管理人“广发银行股份有限公司”内部控制制度符合中国证监会规定, 于 2013 年 7 月 17 日复核了本报告中的财务指标、净值表现及投资组合合规等内容, 保证报告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运用基金资产, 但不保证基金一定盈利, 也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

基金的过往业绩并不预示其未来业绩, 投资者应查阅有关信息披露文件以了解投资本基金的风险收益特征。

本报告期对财务数据未经审计。

本报告期自 2013 年 4 月 1 日起至 6 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	43,929,724.90 份

投资目标

本基金为股票指数基金, 力求通过沪深 300 非周期行业指数进行复制, 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 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数量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, 其长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
基金托管人

长安基金管理有限公司
 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

主要财务指标	报告期 (2013 年 04 月 01 日 - 2013 年 06 月 30 日)	单位: 人民币元
1. 本期已实现收益	2,102,487.46	
2. 本期利润	-1,903,293.99	
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0342	
4. 期末基金资产净值	42,481,169.15	
5. 期末基金份额净值	0.967	

其中: 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 基准收益 率 ②	业绩比较 基准收益 率 ③	业绩比较 基准收益 率 ④	①-③	②-④
过去三个月	-5.93%	1.21%	-6.63%	1.23%	0.70%	-0.02%

注: 本基金整体业绩比较基准构成: 沪深 300 非周期行业指数收益率 * 95% + 活期存款利率 (税后) * 5%。

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

- 基金净值 - 业绩比较基准

长安沪深300非周期行

基金 基金合同

姓名	职务	任本基金的基金经理期限 任职日期 离任日期	证券从业 年限	说明
王磊	本基金的 基金经理	2012年06月25日 -	6年	吉林大学经济学硕士。曾任中顺创业基金管理有限公司战略发展部副经理、国金通用基金管理有限公司筹备期研究员等职。2011年8月加入长安基金管理有限公司,任基金经理助理。2012年6月25日至今天任长安沪深300非周期行指数基金的基金经理。

注:1、任职日期和离任日期均指公司做出正式聘任或解聘对外公告之日;
2、证券从业的含义遵从行业协会关于从事基金业务人员的相关规定;
3、管理人在报告期内本基金运作期间无异常情况说明;
4、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,在认真风险管理的基础上,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的合法权益为; 4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
公司对于投资各类型资产,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》、《证券投资基金特定资产管理业务试点办法》、《证券投资基金销售管理办法》等法律法规和公司内部制度,制定了《公平交易管理制度》,对于公司管理的各类资产的公平对待做了明确的规定,并规范对投资组合、持仓比例的价格和市场价差较大时,可能存在操纵股价、利益输送等违法违规情况进行控制。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,均采用系统化的公平交易系统进行操作,实现了公平交易;且报告期内无异常交易的情况,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关联交易及交易行为。
4.3.2 异常交易行为的专项说明
本基金及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交易所公开竞价间日反向交易成交的串通交易未超过该证券当日成交量的5%。
4.4 报告期内基金投资运作及分析
截止本报告期末,本基金基金业将坚持既定的指数化投资策略,在指数权重调整和本基金申购变动时,应用股指期货和量化技术对冲冲击成本和跟踪误差。
4.5 报告期内基金的业绩表现
截至2013年6月30日,本基金份额净值为0.967元。报告期内,本基金的份额净值增长率为-5.93%,同期业绩比较基准增长率为-6.63%。
4.6 管理人的投资策略、证券市场行业走势的简要展望
本基金为被动指数型基金,基金管理人将按照基金合同的要求,坚持指数化投资策略,通过运用定量分析的手段,分析并应对导致基金跟踪误差的因素,严格控制基金跟踪误差控制在较低水平。
§ 5. 报告期内基金基金净值情况

			金额单位:人民币元	
序号	项目	金额	占基金总资产比例 (%)	
1	权益投资	39,730,919.73	91.72	
	其中:股票	39,730,919.73	91.72	
2	固定收益投资			
	其中:债券			
	资产支持证券			
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			
7	银行存款和结算备付金合计	3,458,396.19	7.98	
8	其他资产	128,646.63	0.30	
9	合计	42,317,962.55	100.00	

业指数证券投资基金

二 季 度 报 告

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 指数股票投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农林、牧、渔业	586,678.73	1.38
B	采矿业	-	-
C	制造业	27,540,498.98	64.83
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,523,110.62	5.94
E	建筑业	3,428,194.12	8.07
F	批发和零售业	2,147,513.35	5.06
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	2,144,933.27	5.05
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	560,149.83	1.32
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	559,292.91	1.32
O	卫生和社会工作	-	-
P	教育	-	-
Q	文化和体育业	240,547.92	0.57
R	综合	-	-
	合计	39,730,919.73	93.53

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有积极投资股票。

5.2.3 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 期末指数股票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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	8,259	1,588,783.83	3.74
2	000651	格力电器	47,640	1,193,106.60	2.81
3	000887	伊利股份	32,172	1,006,340.16	2.37
4	601668	中国建筑	299,424	979,116.48	2.30
5	600104	上汽集团	66,568	879,363.28	2.07
6	000658	五粮液	37,794	757,391.16	1.78
7	600900	长江电力	98,413	681,017.96	1.60
8	000538	云南白药	6,833	574,040.33	1.35
9	000618	康美药业	29,772	572,155.66	1.35
10	000800	一汽轿车	44,003	541,236.90	1.27

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有积极投资股票。

5.4 报告期末按投资品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未有持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未有持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

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权证投资明细		
本基金本报告期末未持有权证。		
5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明		
5.8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓成本和损益明细		
本基金本报告期末未进行股指期货交易。		
5.9 投资组合报告附注		
5.9.1 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,或在报告编制日前一年内受到过证券监管部门处罚的情况。		
5.9.2 报告期内,本基金投资的前十名股票中,没有投资出基金合同规定的备选股票库之外的股票。		
5.9.3 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	100,126.95
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	27,738.12
4	应收利息	781.56
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	128,646.63
5.9.4 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。		
5.9.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明		
5.9.5.1 期末本报告前十名股票中存在流通受限情况的说明		
本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。		
5.9.5.2 期末积极投资前十名股票中存在流通受限情况的说明		
本基金本报告期末未持有积极投资股票。		
5.9.6 其他各项资产报告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数项可能存在尾差。		
§ 6 开放式基金份额变动		
		单位:份
本报告期初基金份额总额		66,490,190.60
本报告期基金总申购份额		282,163.39
减:本报告期基金总赎回份额		22,821,629.09
本报告期基金净申购份额		-
本报告期末基金份额总额		43,929,724.90
§ 7 影响投资者决策的其他重要信息		
7.1 本报告期内,公司根据《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》基金官方网站进行了如下信息披露:		
1. 2013年4月23日披露了《长安沪深300非周期行业指数证券投资基金2013年第1季度报告》。		
2. 2013年4月17日披露了《长安基金管理有限公司关于开通多交易渠道(手机)的公告》。		
3. 2013年4月17日披露了《长安基金管理有限公司关于增加直销(正行)基金销售投资顾问有限公司、上海利得基金销售有限公司为旗下基金代销机构公告》。		
§ 8 备查文件目录		
8.1 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复、营业执照;		
6. 基金托管人业务资格批复、营业执照;		
7. 报告期内披露的各项公告;		
8. 其他应披露文件。		
以上备查文件存放在路南区1088号紫竹国际大厦1612。		
8.2 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,投资者也可通过其他方式获得备查文件的复制或复印件。		
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.changanfund.com.cn		
长安基金管理有限公司 二〇一三年七月十八		

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:2013年3月18日		
§ 1 重要提示		
基金管理人的董事会及董事承诺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。		
基金管理人广发银行股份有限公司根据基金合同规定,于2013年3月17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,保证基金内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。		
基金管理人或代销机构未对基金业绩进行任何保证,投资者不应仅依据本报告做出投资决策。		
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先仔细阅读本基金的招募说明书。		
本报告中所称资产净值系未经审计。		
本报告日期为2013年3月18日至本月30日止。		
§ 2 基本情况概況		
基金简称	长安货币A	
基金代码	740601	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013/01/25日	
报告期末基金份额总额	218,595,523.92份	
投资目标	在保证资金安全性和流动性的前提下,通过主动式管理,力求获得高于货币基金收益的长期稳定回报。	
投资策略	<p>1.整体资产配置策略</p> <p>通过宏观研判经济运行状况,预测国家货币政策、财政政策等宏观经济政策取向,分析货币市场资金供求状况和利率趋势,形成对中期利率水平变动方向的判断;在此基础上,根据各类别资产的预期收益率、收益性和流动性特征,确定各资产类别的配置比例和期限匹配。</p> <p>2.久期策略</p> <p>组合久期是反映利率风险的重要指标,对于货币市场利率水平变化趋势的判断,制定相应的目标久期。当利率将持稳或下降时,适当增持中长期品种以获取资本利得;当利率上升时,减持中长期品种以锁定资本利得;当利率波动较大时,保持较短久期,并增加浮动利率资产,降低债券投资组合利率上升带来的风险,增强组合的灵活性。</p> <p>3.个券选择策略</p> <p>本基金将优先考虑安全性高的资产,选择高信用等级的债券品种进行投资。在各个选择上,本基金将在确保流动性和久期策略的前提下,对各个个券进行信用资质评估,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。</p> <p>4.套利策略</p> <p>套利策略主要指跨市场、跨币种套利存在一定的前提。即投资主体、交易方式和市场环境具备套利的基础。可寻找套利机会,进行跨币种套利操作。(2)跨币种套利,由于投资者持仓存在一定的差异,跨币种的套利品种和时机可能因持仓不同而改变,因此需对市场的申购赎回情况进行有效的跟踪,本基金将在具备较高流动性的基础上进行跨币种套利操作,以增加超额收益。</p> <p>5.自卖策略</p> <p>自卖策略是指利用市场回购利率低于债券收益率的情形,通过正回购融入资金投资于债券的投资策略。当回购利率低于债券到期收益率时,本基金将适度参与债券回购业务。同时,本基金充分关注债券回购的资金成本与债券收益率之间的差别,选择当日回购利率、逆回购利率和债券收益率,以谋取投资收益最大化。</p> <p>6.现金资产管理策略</p> <p>本基金将根据基金申购资金分配以及申购赎回资金的动态预测,通过回购的方式操作现金头寸管理,借券品种的短期化配置策略,动态调整现金存款比例,在持有充足流动性的基础上争取较高收益。</p>	
业绩比较基准	同期三个月定期存款利率(税后)	
风险收益特征	本基金为货币型基金,属于证券投资基金中的低风险基金,其预期收益和风险均低于股票型基金、混合型基金及债券型基金。	
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	
下属两只基金的基金简称	长安货币A	长安货币B
下属两只基金的代码	740601	740602
报告期及下期报告日的份额总额	37,099,302.00	180,595,721.92
§ 3 主要财务指标和基金净值表现		
单位:人民币		
报告期:2013年04月01日至2013年06月30止		

长安货币市场

2013 第 一 季 度

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变动的比较

注: 1、本基金于1月25日成立,按照本基金基金合同规定,本基金的建仓期为6个月,本基金本报告期末仍处于建仓期。

2、本基金的收益分配是按月结转份额。

注: 1、本基金于1月25日成立,按照本基金基金合同规定,本基金的建仓期为6个月,本基金本报告期末仍处于建仓期。

2、本基金的收益分配是按月结转份额。

4.1 基金经理 或基金管理人简介

§ 4 管理人报告

姓名	职务	任本基金的基金经理期限 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
傅春江	本基金的基金经理	2013年01月25日	-	12年	上海财经大学经济学硕士学位,曾任上海证券(香港)有限公司上海证券研究所研究员,金信证券有限责任公司研究员,国泰证券研究所宏观分析师,国泰君安证券股份有限公司宏观策略分析师,国金通用基金管理有限公司薪酬绩效管理部经理,2011年5月加入长安基金管理有限公司任基金投资助理,2013年1月25日至今任长安货币市场基金基金经理。
乔哲	本基金的基金经理	2013年02月01日	-	17年	山东大学工商管理硕士学位,曾任中国光大发展银行山东省分行信贷计划信贷科科长,中国光大发展银行总行信贷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产高级主管,2012年8月加入长安基金管理有限公司,2013年2月1日至今任长安货币市场基金的基金经理。

注: 1、在任职日期和离任日期均指公司做出决定后并正式对外公告之日。

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议的相关规定。

3、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、安全高效的理财原则和运用基金资产,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。

证券投资基金

二季度报告

的投资机会,根据市场变化趋势灵活调整投资组合,继续保持组合流动性、安全性和收益性的平衡。

§ 1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额	金额单位:人民币元 占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	100,228,900.81	41.09
	其中:债券	100,228,900.81	41.09
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	106,000,421.50	43.45
	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	35,578,401.11	14.58
4	其他资产	2,132,281.88	0.87
	合计	243,940,005.30	100.00

§ 2 报告期末债券回购融资情况

序号	项目	金额	金额单位:人民币元 占基金资产净值比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	-	3.10
	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本基金资产余额占资产余额的比例。

§ 3 报告期内债券融资余额超过基金资产净值的20%的说明

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值比例(%)	原因	调整期
1	2013年06月21日	22.80	净赎回	10个交易日
2	2013年06月22日	22.80	上一交易日本 标,本日为非交易 日	
3	2013年06月23日	22.80	上一交易日本 标,本日为非交易 日	

§ 3 基金投资组合平均剩余期限

§ 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	104
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	125
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	45

注:报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

序号	发生日期	平均剩余期限	原因	调整期
1	2013年06月26日	121.00	净赎回	10个交易日
2	2013年06月27日	125.00	净赎回	10个交易日

注:根据基金合同约定,本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日不得超过120天。本基金由于净赎回的影响,投资组合平均剩余期限在6月26日和6月27日分别超过了120天,在10个交易日内已经调整完毕,达到标准。

				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	9,994,329.16	4.57				
	其中:政策性金融债	9,994,329.16	4.57				
4	企业债券	-	-				
5	企业短期融资券	90,234,571.65	41.28				
6	中期票据	-	-				
7	其他	-	-				
8	合计	100,228,900.81	45.85				
剩余存续期超过397天的浮动利率债券							
注:上表中,债券的成本包括债券价值和折溢价。							
5.5 报告期末按摊余成本法计提减值准备的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	债券余额 (元)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例 (%)		
1	041363001	13政发债(P001)	200,000	20,079,406.32	9.19		
2	041371002	13国开债(P001)	200,000	20,038,784.86	9.17		
3	125220507	12第-农发债(P001)	100,000	10,048,415.86	4.60		
4	041358010	13隆基债(P001)	100,000	10,044,776.83	4.60		
5	041270010	12建元债(P001)	100,000	10,028,756.87	4.59		
6	041270010	13农开债(P001)	100,000	10,003,332.32	4.58		
7	100227	10国债27	70,000	9,994,329.16	4.57		
8	041360034	13银发债(CF01)	100,000	9,991,502.39	4.57		
注:上表中,债券的成本包括债券价值和折溢价。							
5.6 影子定价与摊余成本法确定的基金资产净值的偏离				偏离情况			
项目							
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数				5			
报告期内偏离度的最大值				0.0956%			
报告期内偏离度的最小值				-0.096%			
报告期内偏离度绝对值前5名的债券				0.0822%			
注:上表中“偏离情况”根据报告期内各工作日数据计算。							
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							
5.8 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							
5.9 报告期末公允价值计量							
本基金公允价值计量方法: 加溢价对象以公允价值计提, 按票面价值和票面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。							
5.10 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持有其公允价值100元。							
5.11 本基金本报告期不存在剩余期限小于397天但利息收取期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过其公允价值20%的情况。							
5.12 本基金本报告期不存在投资于报告期末前十大重仓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。							
5.13 本基金本报告期不存在构成重大非活跃证券的其他各项资产构成							
单位:人民币元							
序号	名称	金额					
1	存出保证金	-					
2	应收证券清算款	-					
3	应收利息	1,968,288.00					
4	应收申购款	1,900,281.88					
5	其他应收款	-					
6	其他	-					
7	合计	2,132,288.88					
5.15 投资报告期末报告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 开放式基金业绩变动							
单位:份							
		长安货币A	长安货币B				
基金合同生效日基金份额总额		40,365,815.50	169,001,940.00				
基金合同生效日基金份额总额		100,172,310.05	185,417,763.06				
本报告期末基金份额总额		49,505,144.43	128,281,582.91				
期末,未报告基金份额总额		111,675,641.48	755,044,625.05				
本报告期末基金份额总额		37,999,802.00	180,590,721.92				

2.本期利润	579,363.33	2,138,261.08		
3.期末基金资产净值	37,999,802.00	180,595,721.92		

注：本期实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动损益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益，由于货币基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益即本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.8884%	0.0054%	0.3413%	0.0000%	0.5471%	0.0054%

2. 长交货币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	0.9492%	0.0054%	0.3413%	0.0000%	0.6079%	0.0054%

注：本基金的收益分配按日结转份额。

平行的独立性、保密性,建立安全可靠的投融资信息数据库和交易平台等,并开展研究,在确保投资信息的及时、保密的前提下,搭建信息交流平台,资源丰富的公平投资渠道。

报告期内,基金管理人严格执行《证券投资基金行业基金交易业务自律指引》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,并经过严格的报告审批程序,防范控制异常交易。

报告期内,基金管理人严格执行了《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》和《基金管理有限责任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

2013年二季度,受央行降准和央行外,外汇存款大额减少等多种因素影响,金融市场流动性逐步紧张,货币市场利率大幅上行,债券市场利率下行,权益市场利率则出现了先升后降。二季度末,资金开始趋松,货币基金理财业务已经大幅上后有所下降。

本基金在二季度继续执行流动性管理和风险控制,增加短期投资和短期回购资产比例,积极调整资产,保证了基金资产安全性、流动性、收益性的平衡。

4.5 报告期内基金的投资组合报告

截至本报告期末,本基金A类和B类资产净值0.8884A和0.9429B, 同本基金业绩比较基准上涨0.3413%。

4.6 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金为货币市场基金,主要投资于货币市场工具,自本报告披露之后,以往市场资金宽松的情况将发生改变,银行间市场的流动性将保持紧张状态,短期,受经济复苏仍处于转型阶段,经济增速仍趋放缓,结合以上判断,本基金将继续保持资产短期化,期限与货币资产均衡的配置比例,严密监控流动性,积极把握市场波动带来

		值的比例(%)	值的比例(%)
1	30天以内	64.77	11.44
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	-	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	-	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—180天	9.17	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天(含)	36.68	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	110.62	11.44
5.4	报告期末按债券品种分类的债券投资组合		

1. 2013年4月23日披露:《长安货币市场证券投资基金2013年1季度报告》;
2. 2013年6月21日披露:《长安基金管理有限公司关于开通多交易渠道的公告》;
3. 2013年6月21日披露:《长安基金管理有限公司关于增加浦银正行(上海)基金销售访问有限公司、上海利得基金销售有限公司为旗下基金代销机构的公告》

§ 8 备查文件目录

8.1 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。

8.2 存放地点

上海市浦东新区芳甸路1088号紫竹国际大厦16层。

8.3 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。

投资者如对查阅或复制有困难,可向基金管理人。

咨询电话:400-820-0688

公司网址: www.changanfunds.com。

长安基金管理有限公司
二〇一三年七月十八日