

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:2013年7月18日
重要提示
基金管理人的董事、监事、经理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法律责任。于2013年7月17日复核了本报告中的财务指标、净值收益率、投资组合报告等，确保不存在虚假记载、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。
基金管理人的过往业绩并不代表未来表现。投资人对基金的投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。
本报告告白财务数据未经审计。
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 长安宏观策略股票型证券投资基金

基金主代码 740001

基金运作方式 约定期开放式

基金合同生效日 2012年3月19日

报告期末基金份额总额 51,490,519.93份

投资目标 本基金在宏观经济的角度出发,根据宏观经济、行业及精选股票的角度出发,成长型资产的上市公司,在有效控制风险的前提下,力图实现基金资产的长期稳定增值。

本基金从全球通胀的角度出发,根据宏观经济、行业及精选股票的角度出发,成长型资产的上市公司,在有效控制风险的前提下,力图实现基金资产的长期稳定增值。

本基金深入分析宏观经济、政策环境、估值水平和市场情绪等指标,综合评价股票、债券等各类资产的风险收益特征,根据宏观经济、行业及精选股票的角度出发,适时动态地调整股票、债券、现金之间的配置比例。

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发展等因素对不同行业的潜在影响,通过行业生命周期和行业景气度分析,筛选出处于成熟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

本基金在个股选择的基础上,将充分把握基金管理人在股票研究方面的行业优势,采用定量分析与行业分析相结合的方法,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、期限结构调整、类别配置和券种选择等途径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市场风险、实现保值和锁定收益为主要目的。本基金将根据对标的证券的基本分析,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,通过权证衍生工具的特性,通过权证与证券的组合投资,达到对冲组合风险、实现基金资产的保值增值。

6.股指期货投资策略

本基金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,改善投资组合的风格特征,达到对冲组合风险、实现基金资产的保值增值。

7.其他金融工具的投资策略

对冲在机构客户持有的金融工具,本基金将在谨慎分析收益、风险、流动性及金融工具本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*80%+中债全债指数收益率*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。

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

长安宏观策略股票型证券投资基金

2013 第二季度报告

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2013年4月1日-2013年6月30日)

1.本期已实现收益 2,903,063.00

2.本期利润 5,291,121.18

3.加权平均基金份额本期利润 0.1433

4.期末基金资产净值 54,922,125.66

5.期末基金份额净值 1.067

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,年末摊销、有色等盈亏周期板块跌幅明显。

2.本期利润指报告期基金份额净值增长率减去期间内银行存款利息收入、债券利息收入、股票投资收益、现金等大类资产之间的跷跷板效应,通过分享他们的成长,为投资者创造更高的回报率。我们珍惜基金份额持有人的每一份回报和每一位信任,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取长期稳定的回报。

3.加权平均基金份额本期利润是指扣除费用后的净值增长率,即收益与风险的比值。

4.期末基金资产净值=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,年末摊销、有色等盈亏周期板块跌幅明显。

5.期末基金份额净值=期末基金资产净值/期末基金份额总额。

注:6.本报告期内本基金无大额申购赎回情况。

7.本报告期自2013年4月1日起至6月30日止。

8.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

9.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

10.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

11.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

12.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

13.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

14.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

15.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

16.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

17.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

18.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

19.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

20.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

21.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

22.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

23.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

24.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

25.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

26.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

27.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

28.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

29.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

30.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

31.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

32.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

33.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

34.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

35.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

36.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

37.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

38.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

39.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

40.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

41.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

42.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

43.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

44.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

45.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

46.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

47.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

48.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

49.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

50.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

51.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

52.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

53.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

54.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

55.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

56.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

57.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

58.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

59.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

60.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

61.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

62.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

63.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

64.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

65.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

66.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

67.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

68.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

69.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

70.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

71.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

72.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

73.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

74.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

75.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

76.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

77.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

78.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

79.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

80.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

81.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

82.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

83.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

84.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

85.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

86.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

87.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

88.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

89.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

90.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

91.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

92.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

93.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

94.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

95.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

96.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

97.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

98.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

99.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

100.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

101.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

102.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

103.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

104.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

105.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

106.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

107.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

108.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

109.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

110.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

111.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

112.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

113.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

114.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

115.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

116.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。

117.本报告期根据基金合同规定,本基金无大额申购赎回情况。