

长安宏观策略混合型证券投资基金招募说明书(2018年第2次更新摘要)

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	2,134,060.00	3.01
B	采矿业	1,972,800.00	2.78
C	制造业	31,762,447.73	44.81
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	3,624,662.50	4.97
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,723,717.73	6.67
J	金融业	4,469,690.00	6.21
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	48,576,367.96	68.56

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

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	000661	格力电器	76,000	3,536,250.00	4.59
2	000663	华东医药	73,060	3,524,662.50	4.57
3	300097	碧云股份	159,900	2,833,428.00	3.70
4	601318	中国平安	41,800	2,434,040.00	3.16
5	002714	牧原股份	48,000	2,148,680.00	2.81
6	002415	海康威视	55,000	2,042,150.00	2.68
7	600872	中航高新	72,800	2,038,400.00	2.68
8	600036	招商银行	76,400	2,020,016.00	2.65
9	601225	陕西医药	240,000	1,972,800.00	2.58
10	600745	国泰君安	77,000	1,968,120.00	2.58

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、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资

本基金本报告期末未持有债券。

6、本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有权证。

8、投资情况报告附注

8.1. 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。

8.2. 报告期内,本基金投资的前十名证券中,没有包含国家间约定的备选股票之外的股票。

8.3. 期末其他各项资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	137,688.26
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,263.81
5	应收申购款	40,204.09
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	182,246.16

8.4. 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.5. 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况
1	600745	国泰君安	1,968,120.00	2.58	重大事项

8.6. 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,本报告所涉及比例的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

十二、基金的投资

本基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,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表现。投资者应了解,投资者在做出基金决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

基金合同生效日为2013年9月10日,基金业绩截止日为2018年6月30日

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	基金份额净值增长率①	业绩比较基准收益率②	超额收益③	①-③	②-④
过去三个月	-6.00%	1.20%	-7.77%	0.91%	1.17%
过去六个月	-12.38%	1.24%	-9.94%	0.28%	-2.44%
过去一年	-6.74%	1.06%	-3.25%	0.76%	-3.40%
自基金合同生效以来	101.47%	1.61%	27.38%	1.18%	74.09%

注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%

2. 本基金合同生效以来基金资产净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:根据基金合同的规定,自基金合同生效后6个月内基金各项资产配置比例符合基金合同要求。本基金在合同生效后,各项资产配置比例符合基金合同有关资产配置比例的规定。图示日期为2013年9月10日至2018年6月30日。

十三、基金的费用与税收

(一) 基金管理人的管理费

2. 基金托管人的托管费

3. 基金合同生效后的信息披露费用

4. 基金合同生效后的审计费用

5. 基金销售服务费

6. 基金的证券交易费用

7. 基金财产划转支付的相关费用

8. 按照国家有关规定可以在基金财产中列支的其他费用

(二) 基金管理人运用基金财产在承销期间发生的按照合同支付的市场价格溢价、法律法规和基金合同另有规定时其规定。

(三) 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1. 基金管理人的管理费

在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下:

H = E × 年管理费率 ÷ 当年天数,本基金年管理费率为1.50%

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至法定节假日、休息日结束后的第一个工作日或不可抗力情形消除之日起3个工作日内支付。

2. 基金托管人的托管费

在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下:

H = E × 年托管费率 ÷ 当年天数,本基金年托管费率为0.25%

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至法定节假日、休息日结束后的第一个工作日或不可抗力情形消除之日起3个工作日内支付。

3. 上述①-③项费用均由基金托管人根据相关法律法规及本协议的规定,按照费用支出金额支付,列入或摊入当期基金费用。

(四) 不列入基金费用的项目

1. 基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产损失,以及处理与基金财产无关的事项发生的费用

2. 基金合同生效前的相关费用,包括但不限于律师费、会计师费、审计费、基金销售费、基金注册登记费、基金托管费、基金销售服务费、基金销售佣金等

3. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

4. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

5. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

6. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

7. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

8. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

9. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

10. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

11. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

12. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

13. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

14. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

15. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

16. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

17. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

18. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

19. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

20. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

21. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

22. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

23. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

24. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

25. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

26. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

27. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

28. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

29. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

30. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

31. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

32. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

33. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

34. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

35. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

36. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

37. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

38. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

39. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

40. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

41. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

42. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

43. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

44. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

45. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

46. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

47. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

48. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

49. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

50. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

51. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

52. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

53. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

54. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

55. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

56. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

57. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

58. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

59. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

60. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

61. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

62. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

63. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

64. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

65. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

66. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

67. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

68. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

69. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

70. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

71. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

72. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

73. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

74. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

75. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

76. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

77. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

78. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

79. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

80. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

81. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

82. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

83. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

84. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

85. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

86. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

87. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

88. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

89. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

90. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

91. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

92. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

93. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

94. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

95. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

96. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

97. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

98. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

99. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

100. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

101. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

102. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

103. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

104. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

105. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

106. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

107. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

108. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

109. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用

110. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构因基金销售活动而发生的费用