长安宏观策略股票型证券投资基金

2013 年度报告摘要

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3月29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(以下简称:中国邮政储蓄银行)根据本基金合同规定,于2014年3月28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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2013年1月1日起至12月31日止。

§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	48,934,562.99

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	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。 1、资产配置策略 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。 2、行业配置策略 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	李永波	胡涛
	联系电话	021-20329761	010-68858112
	电子邮箱	liyongbo@changanfunds.com	hutao@psbcoa.com.cn
客户服务电话		400-820-9688	95580
传真		021-50598018	010-68858120

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.changanfunds.com
基金年度报告备置地点	上海市浦东新区芳甸路1088号紫竹国际大厦16层

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2013年	2012年3月9日-2012年12月31日
本期已实现收益	14,033,696.42	-8,965,687.24
本期利润	16,851,583.55	-5,947,983.91
加权平均基金份额本期利润	0.3621	-0.0532
本期加权平均净值利润率	32.43%	-5.54%
本期基金份额净值增长率	37.07%	-7.20%
3.1.2 期末数据和指标	2013年末	2012年末
期末可供分配利润	9,933,527.33	-7,100,741.43
期末可供分配基金份额利润	0.2030	-0.1199
期末基金资产净值	62,250,632.47	54,975,946.56
期末基金份额净值	1.272	0.928
3.1.3 累计期末指标	2013年末	2012年末
基金份额累计净值增长率	27.20%	-7.20%

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

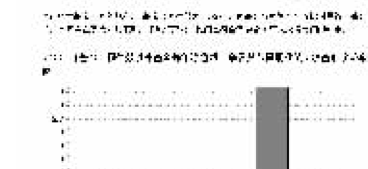
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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④	①-③	②-④
过去三个月	-2.38%	1.79%	-3.26%	0.90%	0.88%	0.89%
过去六个月	19.21%	1.82%	3.64%	1.03%	15.57%	0.79%
过去一年	37.07%	1.73%	-6.85%	1.12%	43.92%	0.61%
自基金合同生效日起至今(2012年03月09日-2013年12月31日)	27.20%	1.42%	-9.89%	1.05%	37.09%	0.37%

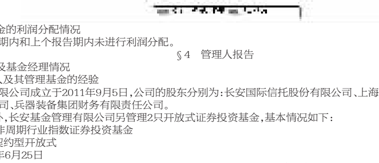
注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%

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

长安宏观策略股票型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2012年3月9日-2013年12月31日)



[illegible]



3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金在本报告期内和上个报告期内未进行利润分配。

§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、上海美特斯邦威服饰股份有限公司、上海磐石投资有限公司、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2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。

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(助理)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	-	12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,任基金经理助理,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遵规守信情况的说明

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 公平交易制度和控制方法

在本报告期内,本基金严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,投资管理和交易执行相隔离,实行集中交易制度,公平对待所管理的所有基金和投资组合,未出现违反公平交易制度的情况,亦未受到监管机构的相关调查。

4.3.2 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。

4.3.3 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

2013年中国在转变经济增长方式的大背景下,宏观经济在持续下滑三年后,GDP增速在7.5%附近弱势震荡。期间A股市场亦呈现窄幅震荡走势,行业板块出现两极分化走势,强周期的采掘、有色金属、金融、房地产等板块明显跑输市场指数,而以信息服务、信息设备、医疗生物为代表的战略新兴产业板块涨幅巨大。

报告期内,本基金主要采取了自下而上选股策略,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,主要超配了传媒娱乐、医疗服务、节能环保、高端装备等行业公司,大幅跑赢基准指数,取得了较好的投资回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2013年12月31日,本基金份额净值为1.272元。报告期内,本基金份额净值增长率为37.07%,同期业绩基准增长率为-6.85%。

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,我国已进入改革深水期,伴随改革的不断推进,经济不确定因素增加,从宏观层面看,改革和增长相互博弈,改革虽然会对经济增长带来短期阵痛,但我们认为从长期看,中国改革势在必行,依靠传统经济增长模式已明显不符合我国现有国情。对于A股市场,我们认为14年将充分受益于改革,我们始终相信从中长期来看,随着改革的逐步深化落实,改革红利逐步释放,我国经济必将回到稳定增长的轨道上来。我们认为在地方债、影子银行、房价调控等不利因素逐步消化后,把握改革趋势、平衡配置新兴成长行业、精选成长个股依旧能为投资者带来较好回报。

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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内,为了保证公司合规运作、加强内部控制、防范经营风险、保障基金份额持有人的利益,监察稽核人员按照独立、客观、公正的原则,依据国家相关法律法规、基金合同和管理制度,采用例行检查与专项检查、定期检查和不定期检查有机结合的方式,对公司内控制度的合法性和合规性、执行的有效性和完整性、风险的防范和控制等进行了持续的监察稽核,对发现的问题进行提示和追踪落实,定期制作监察稽核报告,及时呈报公司领导层和上级监管部门。

本基金管理人采取的主要措施包括:

(1)积极响应中国证监会关于加强市场监管的号召,采取外部法律顾问授课和内部监察部门培训相结合的方式,多次组织全体员工开展《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》及其配套法规、公司内控制度等的学习。通过上述学习宣传活动,使员工加深了对法律法规的认识,并进一步将法律法规与内控制度落实到日常工作中,确保其行为守法合规,严格自律,恪守诚实信用原则,以充分维护基金持有人的利益。

(2)继续完善公司治理结构,严格按照现代企业制度的要求,以规范经营运作、保护基金份额持有人利益为目标,建立、健全了组织结构和运行机制,明确界定董事会、监事会职责范围,认真贯彻了独立董事制度,重大经营决策的制定都征得了所有独立董事的同意,保证了独立董事在公司法人治理结构中作用的切实发挥,保证了各项重大决策的客观公正。

(3)不断完善规章制度体系,根据国家的有关法律法规和基金管理公司实际运作的要求,对现有的规章制度体系不断进行完善,对经营管理活动的决策、执行和监督程序进行规范,明确不同决策层和执行层的权利与责任,细化研究、投资、交易等各项工作流程,为杜绝人为偏差、合法合规运作、强化风险控制提供了制度保证。

4.7 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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金于2012年3月9日成立,根据《基金合同》有关规定"本基金收益每年最多分配12次,每次基金收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的25%"。截至2013年底,本基金尚未进行利润分配。

§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 审计报告

本报告期内本基金由毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)出具无保留意见审计报告,投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 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:2013年12月31日

单位:人民币元

资 产	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
资 产:		
银行存款	3,681,390.13	3,187,232.97
结算备付金	719,751.21	305,038.56
存出保证金	191,227.73	750,000.00
交易性金融资产	58,966,433.89	49,298,593.66
其中:股票投资	58,966,433.89	49,298,593.66
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	-	306,501.66
应收利息	3,115.24	1,851.57
应收股利	-	-
应收申购款	88,424.15	4,458,607.51
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	63,650,342.35	58,307,825.93
负债和所有者权益	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
负 债:		
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	-	1,708,345.63
应付赎回款	431,113.11	105,500.63
应付管理人报酬	77,713.15	61,671.79
应付托管费	12,952.22	10,278.64
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	226,454.92	256,185.11
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	651,476.48	1,189,897.57
负债合计	1,399,709.88	3,331,879.37
所有者权益:		
实收基金	48,934,562.99	59,233,770.12
未分配利润	13,316,069.48	-4,257,823.56
所有者权益合计	62,250,632.47	54,975,946.56
负债和所有者权益总计	63,650,342.35	58,307,825.93

注:1、报告截止日2013年12月31日,基金份额净值1.272元,基金份额48,934,562.99份。

7.2 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:2013年1月1日-2013年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2013年1月1日-2013年12月31日	上年度可比期间 2012年3月9日-2012年12月31日
一、收入	19,465,798.71	-1,862,814.59
1.利息收入	44,728.03	891,979.57
其中:存款利息收入	44,728.03	231,250.36
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	-	660,729.21
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	16,535,661.20	-6,183,756.01
其中:股票投资收益	16,391,282.64	-6,983,307.49
基金投资收益		
债券投资收益	-	-
7.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	144,378.56	799,551.48
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	2,817,887.13	3,017,703.33
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		
5.其他收入(损失以"-"号填列)	67,522.35	411,258.52
减:二、费用	2,614,215.16	4,085,169.32
1.管理人报酬	778,608.35	1,326,567.21
2.托管费	129,768.07	221,094.58
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	1,312,438.74	2,095,607.53
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	393,400.00	441,900.00
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	16,851,583.55	-5,947,983.91
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	16,851,583.55	-5,947,983.91

7.3 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:2013年1月1日-2013年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2013年1月1日-2013年12月31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)	-	16,851,583.55	16,851,583.55
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)	-10,299,207.13	722,309.49	-9,576,897.64
其中:1.基金申购款	52,846,161.09	7,979,570.97	60,825,732.06
2.基金赎回款	-63,145,368.22	-7,257,261.48	-70,402,629.70
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)	48,934,562.99	13,316,069.48	62,250,632.47
项 目	上年度可比期间 2012年3月9日-2012年12月31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)	383,988,929.19	-	383,988,929.19
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-5,947,983.91	-5,947,983.91
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)	-324,755,159.07	1,690,160.35	-323,064,998.72
其中:1.基金申购款	6,441,348.00	-507,714.60	5,933,633.40
2.基金赎回款	-331,196,507.07	2,197,874.95	-328,998,632.12
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)	59,233,770.12	-4,257,823.56	54,975,946.56

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

黄陈	李卫	欧鹏
基金管理公司负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 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(以下简称"中国证监会")《关于核准长安宏观策略股票型证券投资基金募集的批复》(证监许可[2011]1950号文)批准,由长安基金管理有限公司(以下简称"长安基金公司")依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《长安宏观策略股票型证券投资基金基金合同》于2012年2月2日至2012年3月7日公开发售,募集资金总额人民币383,988,929.19元,其中扣除认购费后的有效认购资金人民币383,969,236.76元,有效认购资金在募集期间产生利息人民币19,692.43元,共折合383,988,929.19份基金份额。上述募集资金已经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了KPMG-B(2012)CRNo.0011号验资报告。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,基金合同已于2012年3月9日生效。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(以下简称"邮储银行")。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《长安宏观策略股票型证券投资基金基金合同》和《长安宏观策略股票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、货币市场工具、银行存款、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资组合的比例范围为:股票资产占基金资产的比例为60%-95%,债券、货币市场工具、银行存款、权证、资产支持证券以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为0-40%,其中权证占基金资产净值的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现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。

本基金的股票投资部分的业绩比较基准为沪深300指数,债券投资部分为中证全债指数收益率,复合业绩比较基准为:沪深300指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%。

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二个工作日,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。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金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。

本基金的收益分配原则遵循了《长安宏观策略股票型证券投资基金基金合同》的有关规定。

7.4.3 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2013年12月31日的财务状况、自2013年1月1日至2013年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为自2013年1月1日至2013年12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

人民币

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本年度未发生重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本年度未发生重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本年度未发生过重大会计差错。

7.4.6 税项

根据财税字[1998]55号文、财税字[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[2005]102号文《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、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》、财税[2005]107号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、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》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:

(a)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。

(b)基金买卖股票、债券的投资收益暂免征收营业税和企业所得税。

(c)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%。

(d)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。

7.4.7 关联方关系

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
上海美特斯邦威服饰股份有限公司	基金管理人的股东
上海磐石投资有限公司	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

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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 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。

7.4.8.1.2 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。

7.4.8.1.3 债券回购交易

注: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。

7.4.8.1.4 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。

7.4.8.1.5 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。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日-2013年12月31日	上年度可比期间 2012年3月9日-2012年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	778,608.35	1,326,567.21
其中:支付销售机构的客户维护费	173,474.71	289,807.38

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。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日-2013年12月31日	上年度可比期间 2012年3月9日-2012年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	129,768.07	221,094.58

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。

7.4.8.3 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。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日-2013年12月31日	上年度可比期间 2012年3月9日-2012年12月31日
基金合同生效日(2012年3月9日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	4,864,023.52	-
期间申购/买入总份额	-	4,864,023.52
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	4,864,023.52	-
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	-	8.21%

注:基金管理人于本报告期内通过恒泰证券赎回本基金的全部持有份额,赎回费为28,770.70元。

7.4.8.4.2 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

份额单位:份

关联方名称	本期末 2013年12月31日		上年度末 2012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
长安基金公司高级管理人员	158,883.32	0.32%	790,663.84	1.33%
长安国际信托股份有限公司	27,932,029.80	57.08%	-	-
兵器装备集团财务有限责任公司	-	-	10,000,138.90	16.88%

7.4.8.5 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 2013年1月1日-2013年12月31日		上年度可比期间 2012年3月9日-2012年12月31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	3,681,390.13	33,205.88	3,187,232.97	215,636.69

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。

本基金通过"邮储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,于2013年12月31日的相关余额为人民币719,751.21元。(2012年12月31日:人民币305,038.56元)。

7.4.8.6 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在承销期内购入关联方承销证券。

7.4.8.7 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。

7.4.9 利润分配情况

7.4.9.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金本报告期内未实施利润分配。

7.4.10期末(2013年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.10.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注:本基金本报告期末未持有承销期内直接购入关联方承销的证券。

7.4.10.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金截至2013年12月31日止持有以上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,该类股票将在所公布事项的重大影响消除后,经交易所批准复牌。

7.4.10.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.10.3.1 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。

7.4.10.3.2 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。

§8 投资组合报告

8.1 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	58,966,433.89	92.64
	其中:股票	58,966,433.89	92.64
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	4,401,141.34	6.91
7	其他各项资产	282,767.12	0.44
8	合计	63,650,342.35	100.00

8.2 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	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	45,938,740.09	73.80
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,019,200.00	4.85
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,211,793.80	1.95
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	8,796,700.00	14.13
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	58,966,433.89	94.72

8.3 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

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	002292	奥飞动漫	135,050	4,410,733.00	7.09
2	002023	海特高新	250,000	4,285,000.00	6.88
3	600315	上海家化	90,000	3,800,700.00	6.11
4	002312	三泰电子	200,000	3,714,000.00	5.97
5	300273	和佳股份	140,000	3,627,400.00	5.83
6	002465	海格通信	170,000	3,532,600.00	5.67
7	002230	科大讯飞	70,000	3,349,500.00	5.38
8	300335	迪森股份	170,000	3,019,200.00	4.85
9	600536	中国软件	80,000	3,013,600.00	4.84
10	002215	诺 普 信	300,000	2,883,000.00	4.63

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1累计买入金额超出期末基金资产净值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	600536	中国软件	16,847,551.47	30.65
2	600315	上海家化	12,504,316.58	22.75
3	002023	海特高新	11,015,538.44	20.04
4	600637	百视通	10,396,909.00	18.91
5	600316	洪都航空	9,665,974.32	17.58
6	002230	科大讯飞	9,556,180.71	17.38
7	300273	和佳股份	8,748,740.39	15.91
8	601318	中国平安	6,905,514.58	12.56
9	002292	奥飞动漫	6,893,077.43	12.54
10	000024	招商地产	6,703,067.04	12.19
11	300034	钢研高纳	6,390,462.07	11.62
12	300251	光线传媒	6,013,059.43	10.94
13	600048	保利地产	5,893,211.52	10.72
14	300079	数码视讯	5,848,327.66	10.64
15	002049	同方国芯	5,824,926.31	10.60
16	601628	中国人寿	5,415,111.41	9.85
17	600406	国电南瑞	5,407,473.30	9.84
18	300074	华平股份	5,330,075.58	9.70
19	002253	川大智胜	5,255,413.66	9.56
20	600000	浦发银行	5,221,861.33	9.50
21	601166	兴业银行	4,973,386.72	9.05
22	002312	三泰电子	4,641,652.14	8.44
23	300090	盛运股份	4,564,520.68	8.30
24	601601	中国太保	4,477,211.32	8.14
25	000001	平安银行	4,439,633.78	8.08
26	600535	天士力	4,339,212.16	7.89
27	600893	航空动力	4,335,635.94	7.89
28	600383	金地集团	4,182,029.60	7.61
29	600030	中信证券	4,096,569.24	7.45
30	000002	万 科A	3,888,907.15	7.07
31	600855	航天长峰	3,855,673.84	7.01
32	000816	江淮动力	3,799,926.49	6.91
33	300335	迪森股份	3,645,239.17	6.63
34	000423	东阿阿胶	3,617,973.18	6.58
35	002465	海格通信	3,586,088.58	6.52
36	300124	汇川技术	3,499,560.99	6.37
37	600976	武汉健民	3,353,729.12	6.10
38	600885	宏发股份	3,351,751.46	6.10
39	600837	海通证券	3,325,340.00	6.05
40	002215	诺 普 信	3,282,391.36	5.97
41	600456	宝钛股份	3,274,293.93	5.96
42	000738	中航动控	3,193,955.12	5.81
43	000415	渤海租赁	3,176,513.86	5.78
44	300210	森远股份	3,134,849.89	5.70
45	000063	中兴通讯	3,044,004.97	5.54
46	300070	碧水源	2,979,231.21	5.42
47	601808	中海油服	2,960,505.01	5.39
48	002570	贝因美	2,874,806.52	5.23
49	600372	中航电子	2,851,877.14	5.19
50	600867	通化东宝	2,696,008.38	4.90
51	600171	上海贝岭	2,625,738.50	4.78
52	300206	理邦仪器	2,623,345.94	4.77
53	300037	新宙邦	2,619,868.00	4.77
54	600038	哈飞股份	2,604,384.55	4.74
55	002594	比亚迪	2,508,193.07	4.56
56	600403	大有能源	2,479,528.00	4.51
57	000800	一汽轿车	2,297,750.84	4.18
58	603000	人民网	2,289,000.00	4.16
59	002055	得润电子	2,214,073.42	4.03
60	300024	机器人	2,185,121.00	3.97
61	600108	亚盛集团	2,177,111.16	3.96
62	600835	上海机电	2,159,551.83	3.93
63	600104	上汽集团	2,086,474.65	3.80
64	002029	七 匹 狼	2,082,766.00	3.79
65	002073	软控股份	2,043,834.51	3.72
66	600970	中材国际	1,997,647.89	3.63
67	600703	三安光电	1,976,798.16	3.60
68	000661	长春高新	1,970,311.22	3.58
69	300168	万达信息	1,941,874.46	3.53
70	600597	光明乳业	1,931,926.84	3.51
71	300289	利德曼	1,882,809.97	3.42
72	600376	首开股份	1,869,505.69	3.40
73	300177	中海达	1,843,399.33	3.35
74	002681	奋达科技	1,826,796.05	3.32
75	002605	姚记扑克	1,817,098.90	3.31
76	600519	贵州茅台	1,763,602.80	3.21
77	600585	海螺水泥	1,757,967.00	3.20
78	002148	北纬通信	1,737,110.00	3.16
79	300007	汉威电子	1,730,545.00	3.15
80	601668	中国建筑	1,728,000.00	3.14
81	002477	雏鹰农牧	1,714,521.78	3.12
82	600056	中国医药	1,699,475.00	3.09
83	300159	新研股份	1,690,038.71	3.07
84	300059	东方财富	1,685,143.00	3.07
85	002229	鸿博股份	1,679,079.85	3.05
86	601888	中国国旅	1,670,029.00	3.04
87	002273	水晶光电	1,665,329.20	3.03
88	000926	福星股份	1,658,258.55	3.02
89	000869	张 裕A	1,652,156.57	3.01
90	300353	东土科技	1,644,161.80	2.99
91	000829	天音控股	1,632,837.58	2.97
92	300217	东方电热	1,590,144.36	2.89
93	300133	华策影视	1,574,010.71	2.86
94	600562	国睿科技	1,517,461.50	2.76
95	600298	安琪酵母	1,479,731.50	2.69
96	600199	金种子酒	1,476,051.19	2.68
97	000848	承德露露	1,419,444.88	2.58
98	601699	潞安环能	1,370,394.23	2.49
99	300307	慈星股份	1,361,924.00	2.48
100	002111	威海广泰	1,352,025.12	2.46
101	002603	以岭药业	1,298,802.00	2.36
102	300145	南方泵业	1,298,247.50	2.36
103	600875	东方电气	1,287,941.00	2.34
104	600141	兴发集团	1,274,888.00	2.32
105	300299	富春通信	1,270,770.00	2.31
106	000157	中联重科	1,265,800.00	2.30
107	002158	汉钟精机	1,256,729.79	2.29
108	000088	盐 田 港	1,211,490.00	2.20
109	601616	广电电气	1,210,000.00	2.20
110	300077	国民技术	1,180,087.16	2.15
111	600993	马应龙	1,178,313.40	2.14
112	002349	精华制药	1,161,234.30	2.11
113	601992	金隅股份	1,158,728.77	2.11
114	300253	卫宁软件	1,157,528.29	2.11
115	600718	东软集团	1,155,360.00	2.10
116	300078	中瑞思创	1,130,187.00	2.06
117	002153	石基信息	1,103,798.91	2.01

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。

8.4.2累计卖出金额超出期末基金资产净值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	600536	中国软件	14,774,079.34	26.87
2	600637	百视通	12,689,300.50	23.08
3	002049	同方国芯	11,118,706.91	20.22
4	002023	海特高新	8,992,010.56	16.36
5	600315	上海家化	8,927,495.84	16.24
6	600316	洪都航空	8,819,936.28	16.04
7	601318	中国平安	8,153,691.56	14.83
8	300079	数码视讯	6,801,582.82	12.37
9	000024	招商地产	6,774,360.37	12.32
10	600048	保利地产	6,644,286.20	12.09
11	000415	渤海租赁	6,530,661.52	11.88
12	300273	和佳股份	6,489,187.02	11.80
13	002230	科大讯飞	6,220,386.78	11.31
14	600000	浦发银行	6,093,645.42	11.08
15	600030	中信证券	6,069,078.00	11.04
16	000423	东阿阿胶	5,816,754.42	10.58
17	000001	平安银行	5,744,507.67	10.45
18	601166	兴业银行	5,719,822.83	10.40
19	300074	华平股份	5,487,821.52	9.98
20	300251	光线传媒	5,461,036.19	9.93
21	002292	奥飞动漫	5,397,740.43	9.82
22	600406	国电南瑞	5,210,966.92	9.48
23	601628	中国人寿	4,867,313.03	8.85
24	601601	中国太保	4,717,679.63	8.58
25	000002	万 科A	4,553,813.56	8.28
26	600383	金地集团	4,442,727.20	8.08
27	600456	宝钛股份	4,431,641.04	8.06
28	300090	盛运股份	4,377,346.81	7.96
29	300034	钢研高纳	4,295,454.60	7.81
30	600893	航空动力	4,254,827.93	7.74
31	300124	汇川技术	4,020,885.11	7.31
32	300070	碧水源	3,957,211.58	7.20
33	000816	江淮动力	3,800,983.67	6.91
34	600535	天士力	3,560,356.98	6.48
35	002253	川大智胜	3,479,960.95	6.33
36	002312	三泰电子	3,479,098.38	6.33
37	300210	森远股份	3,310,585.88	6.02
38	600976	武汉健民	3,201,387.32	5.82
39	600837	海通证券	3,187,480.01	5.80
40	000063	中兴通讯	3,038,248.84	5.53
41	002570	贝因美	3,006,070.50	5.47
42	002073	软控股份	2,979,381.00	5.42
43	601808	中海油服	2,949,102.06	5.36
44	002215	诺 普 信	2,942,977.47	5.35
45	002594	比亚迪	2,821,356.39	5.13
46	002273	水晶光电	2,690,566.64	4.89
47	600372	中航电子	2,680,887.93	4.88
48	300037	新宙邦	2,623,368.11	4.77
49	600867	通化东宝	2,585,794.58	4.70
50	000012	南 玻A	2,508,463.57	4.56
51	600108	亚盛集团	2,469,500.00	4.49
52	300168	万达信息	2,384,223.21	4.34
53	002055	得润电子	2,369,793.01	4.31
54	300206	理邦仪器	2,339,180.73	4.25
55	600036	招商银行	2,316,375.00	4.21
56	600403	大有能源	2,297,132.00	4.18
57	600597	光明乳业	2,210,558.76	4.02
58	601233	桐昆股份	2,206,225.04	4.01
59	603000	人民网	2,192,010.00	3.99
60	600376	首开股份	2,185,125.34	3.97
61	000800	一汽轿车	2,151,351.78	3.91
62	600104	上汽集团	2,026,419.92	3.69
63	600835	上海机电	2,011,941.79	3.66
64	300289	利德曼	1,975,309.30	3.59
65	000401	冀东水泥	1,964,355.60	3.57
66	300024	机器人	1,903,374.40	3.46
67	002029	七 匹 狼	1,892,023.96	3.44
68	000876	新 希 望	1,874,037.29	3.41
69	600056	中国医药	1,856,192.18	3.38
70	600970	中材国际	1,835,601.74	3.34
71	600703	三安光电	1,818,731.00	3.31
72	600855	航天长峰	1,812,135.00	3.30
73	000661	长春高新	1,801,363.42	3.28
74	002605	姚记扑克	1,795,192.70	3.27
75	000528	柳 工	1,779,095.98	3.24
76	002681	奋达科技	1,767,953.38	3.22
77	601888	中国国旅	1,745,297.95	3.17
78	000937	冀中能源	1,740,129.75	3.17
79	300177	中海达	1,739,803.94	3.16
80	600519	贵州茅台	1,736,915.43	3.16
81	601668	中国建筑	1,732,100.00	3.15
82	300058	蓝色光标	1,727,321.23	3.14
83	300217	东方电热	1,724,946.27	3.14
84	600585	海螺水泥	1,719,126.00	3.13
85	002477	雏鹰农牧	1,700,079.96	3.09
86	600199	金种子酒	1,670,397.90	3.04
87	300159	新研股份	1,659,395.65	3.02
88	300059	东方财富	1,650,519.34	3.00
89	000861	海印股份	1,627,930.00	2.96
90	300353	东土科技	1,602,564.05	2.92
91	300299	富春通信	1,585,685.14	2.88
92	300335	迪森股份	1,569,340.03	2.85
93	002148	北纬通信	1,565,402.00	2.85
94	000829	天音控股	1,545,683.90	2.81
95	300133	华策影视	1,512,170.43	2.75
96	600885	宏发股份	1,509,495.00	2.75
97	300145	南方泵业	1,502,987.05	2.73
98	300113	顺网科技	1,502,658.96	2.73
99	000926	福星股份	1,500,968.68	2.73
100	002229	鸿博股份	1,494,064.32	2.72
101	000049	德赛电池	1,489,073.37	2.71
102	600166	福田汽车	1,450,787.50	2.64
103	000869	张 裕A	1,448,385.09	2.63
104	600298	安琪酵母	1,440,797.84	2.62
105	000738	中航动控	1,427,425.60	2.60
106	002111	威海广泰	1,423,328.66	2.59
107	000848	承德露露	1,384,275.70	2.52
108	601699	潞安环能	1,345,942.24	2.45
109	300307	慈星股份	1,336,357.00	2.43
110	600875	东方电气	1,322,239.02	2.41
111	000088	盐 田 港	1,310,528.91	2.38
112	600765	中航重机	1,291,323.05	2.35
113	600141	兴发集团	1,252,086.50	2.28
114	002158	汉钟精机	1,237,685.82	2.25
115	000157	中联重科	1,198,300.00	2.18
116	300077	国民技术	1,188,501.82	2.16
117	601616	广电电气	1,182,562.00	2.15
118	300253	卫宁软件	1,178,250.82	2.14
119	600718	东软集团	1,173,854.32	2.14
120	300078	中瑞思创	1,168,086.38	2.12
121	600418	江淮汽车	1,162,249.20	2.11
122	002368	太极股份	1,157,336.34	2.11
123	002092	中泰化学	1,157,174.57	2.10
124	601992	金隅股份	1,141,496.13	2.08
125	000858	五 粮 液	1,130,315.00	2.06
126	600660	福耀玻璃	1,116,648.67	2.03
127	002349	精华制药	1,110,113.94	2.02
128	300132	青松股份	1,101,705.60	2.00

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。

8.4.3 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	425,639,229.42
卖出股票的收入(成交)总额	435,180,558.96

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。

8.5 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。

8.6 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。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

8.8 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投资。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末进行股指期货交易。

8.10.2 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.10.3 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末进行国债期货交易。

8.11投资组合报告附注

8.12.1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。

8.112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。

8.11.3 期末其他各项资产构成

金额单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	191,227.73
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,115.24
5	应收申购款	88,424.15
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	282,767.12

8.11.4 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。

8.11.5 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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
2,253	21,719.74	27,932,029.80	57.08%	21,002,533.19	42.92%

9.2 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	425,867.64	0.87%

§10 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	59,233,770.12
本报告期基金总申购份额	52,846,161.09
减:本报告期基金总赎回份额	63,145,368.22
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	48,934,562.99

注: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。

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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、2013年8月31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变更公告》,同意盛军辞去副总经理职务,聘任张淦泉公司副总经理职务。

2、2013年12月10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关于由黄陈先生代为履行督察长职务的公告》,同意张洪水辞去公司督察长职务,由总经理黄陈代行公司督察长职务。

二、报告期内基金托管人发生如下重大变动:

本报告期内,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,并已完成监管报备程序。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 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)的报酬为人民币柒万伍千元整。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况

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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	占股票成交总额比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
恒泰证券	1	244,236,020.32	28.37%	219,463.13	28.12%	
广发证券	1	227,290,580.24	26.40%	206,925.87	26.51%	
海通证券	1	199,003,382.37	23.12%	181,173.23	23.21%	
国金证券	1	103,326,175.70	12.00%	94,068.25	12.05%	
光大证券	1	54,240,648.85	6.30%	49,380.79	6.33%	
宏源证券	1	18,821,379.18	2.19%	17,134.85	2.20%	
天风证券	1	13,901,601.72	1.61%	12,301.72	1.58%	
东方证券	1		-	-	-	
金元证券	1		-	-	-	
日信证券	1		-	-	-	

注:基金租用席位的选择标准是:(1)资力雄厚,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。

11.7.2 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	占债券成交总额比例	成交金额	占债券回购成交总额比例	成交金额	占权证成交总额比例
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
广发证券		-		-		-
海通证券		-	-	-		-
国金证券		-		-		-
光大证券		-	-	-		-
宏源证券		-		-		-
天风证券		-		-		-
东方证券		-		-		-
金元证券		-		-		-
日信证券		-		-		-

长安基金管理有限公司
二〇一四年三月二十九日