长安沪深300非周期行业指数证券投资基金 2018年半年度报告摘要

基金管理人:长安基金管理有限公司
基金托管人:广发银行股份有限公司
送出日期:2018年08月29日

§1重要提示

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。本半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。

基金托管人广发银行股份有限公司(以下简称:广发银行)根据本基金合同规定,于2018年8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,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经会计师事务所审计。

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。

本报告期自2018年01月01日起至2018年06月30日止。

§2基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	长安沪深300非周期指数
场内简称	–
基金主代码	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
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
报告期末基金份额总额	54,862,294.12份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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。
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组成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	广发银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李永波	戴辉
	联系电话	021-20329700	010-65169958
	电子邮箱	service@changanfunds.com	daihui@cgbchina.com.cn
客户服务电话		400-820-9688	400-830-8003
传真		021-50598018	010-65169555

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	http://www.changanfunds.com
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(2018年01月01日-2018年06月30日)
本期已实现收益	-494,016.86
本期利润	-5,031,108.91
本期基金份额净值增长率	-9.01%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年06月30日)
期末基金资产净值	57,050,455.66
期末基金份额净值	1.040

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。

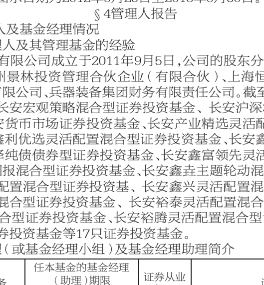
3.2 基金净值表现

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	-6.39%	1.43%	-7.57%	1.45%	1.18%	-0.02%
过去三个月	-6.89%	1.17%	-7.07%	1.19%	0.18%	-0.02%
过去六个月	-9.01%	1.17%	-8.83%	1.19%	-0.18%	-0.02%
过去一年	-1.89%	0.98%	-0.41%	1.00%	-1.48%	-0.02%
过去三年	-15.48%	1.59%	-17.86%	1.57%	2.38%	0.02%
自基金合同生效起至今	59.68%	1.51%	50.18%	1.47%	9.50%	0.04%

本基金的业绩比较基准为: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率变动的比较



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。本基金在建仓期结束后,各项资产配置比例已符合基金合同有关投资比例的约定。图示日期为2012年6月25日至2018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、杭州景林投资管理合伙企业(有限合伙)、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。截至2018年6月30日,本基金管理人共管理长安宏观策略混合型证券投资基金、长安沪深300非周期行业指数证券投资基金、长安货币市场证券投资基金、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、长安鑫益增强混合型证券投资基金、长安泓泽纯债债券型证券投资基金、长安鑫富领先灵活配置混合型证券投资基金、长安鑫恒回报混合型证券投资基金、长安鑫垚主题轮动混合型证券投资基金、长安鑫旺价值灵活配置混合型证券投资基金、长安鑫兴灵活配置混合型证券投资基金、长安裕盛灵活配置混合型证券投资基金、长安裕泰灵活配置混合型证券投资基金、长安鑫禧灵活配置混合型证券投资基金、长安裕腾灵活配置混合型证券投资基金、长安泓润纯债债券型证券投资基金等17只证券投资基金。

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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
林忠晶	本基金的基金经理	2015-01-27	–	8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,曾任产品经理,战略及产品部副总经理、量化投资部(筹)总经理等职,现任基金投资部副总经理,长安沪深300非周期行业指数证券投资基金、长安宏观策略混合型证券投资基金、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、长安鑫恒回报混合型证券投资基金、长安鑫垚主题轮动混合型证券投资基金、长安鑫旺价值灵活配置混合型证券投资基金、长安鑫兴灵活配置混合型证券投资基金、长安鑫禧灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
王伟	本基金的基金经理	2017-12-13	–	5年	曾任中国科学院德国马普学会计算生物学伙伴研究所助理研究员、博士后,华宸未来基金管理有限公司金融工程部研究员、风险管理部研究员,东北证券股份有限公司上海证券研究咨询分公司量化投资研究员,长安基金管理有限公司战略及产品部高级产品经理、量化投资部(筹)高级研究员、组合管理中心拟任FOF基金经理等职务,现任长安基金管理有限公司长安沪深300非周期行业指数证券投资基金的基金经理。

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

本基金在运作过程中严格遵守基金合同,坚持既定的指数化投资策略,对指数基金操作采取抽样复制、被动复制与组合优化、调整成本优化相结合的方式,努力实现对业绩比较基准的有效跟踪。当由于申购赎回变动、指数成分股权重调整等原因引发组合调整时,在操作过程中坚守合规第一、风控第一的前提下,结合市场趋势预判与量化分析,应用指数复制和其他合理方法优化组合结构,最大限度降低冲击成本和减少跟踪误差,力争投资回报与所跟踪指数保持一致,努力为投资者提供一个良好的指数投资工具。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末长安沪深300非周期指数基金份额净值为1.040元, 本报告期内,基金份额净值增长率为-9.01%,同期业绩比较基准收益率为-8.83%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金坚持既定的指数化投资策略,以严格控制基金相对目标指数的跟踪偏离为主要投资目标,期望为投资者提供一种分享中国经济未来成长的良好的投资机会。

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,广发银行股份有限公司(以下称"本托管人")在对长安沪深300非周期行业指数证券投资基金(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,完全尽职尽责地履行了应尽的义务,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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方面进行了必要的监督,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。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§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:长安沪深300非周期行业指数证券投资基金

报告截止日:2018年06月30日

单位:人民币元

资 产	本期末 2018年06月30日	上年度末 2017年12月31日
资 产:		
银行存款	4,015,560.65	5,918,317.80
结算备付金	5,297.23	–
存出保证金	26,473.94	61,536.02
交易性金融资产	53,595,065.18	74,056,672.24
其中:股票投资	53,595,065.18	74,056,672.24
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	–	–
应收利息	711,898.66	712,427.63
应收股利	–	–
应收申购款	69,808.62	19,440.52
递延所得税资产	–	–
其他资产	–	–
资产总计	58,424,104.28	80,768,394.21
负债和所有者权益	本期末 2018年06月30日	上年度末 2017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	83,846.88	–
应付赎回款	6,392.06	553,390.64
应付管理人报酬	48,813.64	67,290.07
应付托管费	7,322.03	10,093.54
应付销售服务费	–	–
应付交易费用	29,891.33	26,643.44
应交税费	–	–
应付利息	–	–
应付利润	–	–
递延所得税负债	–	–
其他负债	1,197,382.68	1,289,095.37
负债合计	1,373,648.62	1,946,513.06
所有者权益:		
实收基金	54,862,294.12	68,934,285.23
未分配利润	2,188,161.54	9,887,595.92
所有者权益合计	57,050,455.66	78,821,881.15
负债和所有者权益总计	58,424,104.28	80,768,394.21

报告截止日2018年6月30日,基金份额净值1.040元,基金份额总额54,862,294.12份。

6.2 利润表

会计主体:长安沪深300非周期行业指数证券投资基金

本报告期:2018年01月01日至2018年06月30日

单位:人民币元

项 目	本期2018年01月01日至2018年06月30日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日
一、收入	-4,328,871.01	28,008,420.27
1.利息收入	18,168.51	1,727,885.30
其中:存款利息收入	18,168.51	1,727,885.30
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)	163,979.83	6,981,391.77
其中:股票投资收益	-283,662.77	6,366,755.68
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	447,642.60	614,636.09
3. 公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-4,537,092.05	10,149,984.35
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	–	–
5.其他收入(损失以"-"号填列)	26,072.70	9,149,158.85
减:二、费用	702,237.90	4,489,121.43
1. 管理人报酬	327,961.16	1,869,521.89
2. 托管费	49,194.16	280,428.30
3. 销售服务费	–	–
4. 交易费用	66,399.88	2,123,792.01
5. 利息支出	–	–
其中:卖出回购金融资产支出	–	–
6. 税金及附加	–	–
7. 其他费用	258,682.70	215,379.23
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-5,031,108.91	23,519,298.84
减:所得税费用	–	–
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-5,031,108.91	23,519,298.84

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:长安沪深300非周期行业指数证券投资基金

本报告期:2018年01月01日至2018年06月30日

单位:人民币元

项 目	本期 2018年01月01日至2018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)	68,934,285.23	9,887,595.92	78,821,881.15
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	-5,031,108.91	-5,031,108.91
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)	-14,071,991.11	-2,668,325.47	-16,740,316.58
其中:1.基金申购款	8,205,255.27	901,170.86	9,106,426.13
2.基金赎回款	-22,277,246.38	-3,569,496.33	-25,846,742.71
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)	54,862,294.12	2,188,161.54	57,050,455.66

项 目	上年度可比期间 2017年01月01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)	52,992,737.77	19,294,838.77	72,287,576.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	23,519,298.84	23,519,298.84
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)	39,228,431.20	3,122,811,783.11	3,162,040,214.31
其中:1.基金申购款	7,367,790,420.51	3,117,180,590.01	10,484,971,010.52
2.基金赎回款	-7,328,561,989.31	5,631,193.10	-7,322,930,796.21
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)	–	-3,160,092,388.12	-3,160,092,388.12
五、期末所有者权益(基金净值)	92,221,168.97	5,533,532.60	97,754,701.57

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:

袁丹旭	李永波	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

长安沪深300非周期行业指数基金(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")《关于核准长安沪深300非周期行业指数基金募集的批复》(证监许可[2012]130号文)批准,由长安基金管理有限公司(以下称"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《长安沪深300非周期行业指数基金基金合同》于2012年5月14日至2012年6月20日公开发售,募集资金总额人民币277,132,832.76元,其中扣除认购费后的有效认购资金人民币277,072,819.54元,有效认购资金在募集期间产生利息人民币60,013.22元,共折合277,132,832.76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.0049号验资报告。基金为契约型开放式基金,存续期限不定,基金合同于2012年6月25日生效。本基金的基金管理人为长安基金公司,基金托管人为广发银行股份有限公司(以下称"广发银行")。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《长安沪深300非周期行业指数基金基金合同》和《长安沪深300非周期行业指数基金招募说明书》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,包括沪深300非周期行业指数的成分股及其备选成分股(包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票)、新股(一级市场初次发行和增发)、债券、回购、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或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:沪深300非周期行业指数成分股及其备选成分股的投资比例不低于基金资产的90%,在任何交易日日终持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和不超过基金资产净值的100%,每个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到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等,权证占基金资产净值的比例为0-3%,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。

本基金的股票投资部分的业绩比较基准为沪深300非周期行业指数,现金或者到期日在一年以内的政府债券投资部分为活期存款利率(税后),复合业绩比较基准为:沪深300非周期行业指数收益率×95%+活期存款利率(税后)×5%。

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。

根据《关于长安沪深300非周期行业指数证券投资基金根据〈公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定〉修改基金合同、托管协议及招募说明书的公告》,本基金根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修改了申购赎回、基金的投资和基金的信息披露等相关条款,修订后的基金合同自2018年3月30日起生效。

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》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2018年6月30日的财务状况、自2018年1月1日至2018年6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2018年1月1日至2018年6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,于交易日按公允价值在资产负债表内确认。

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;对于支付价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认为应收项目。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,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;应收款项和其他金融负债以实际利率法按摊余成本计量。

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。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

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

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

根据《长安沪深300非周期行业指数基金基金合同》的规定,基金管理人报酬按前一日基金资产净值1.00%的年费率逐日计提。

根据《长安沪深300非周期行业指数基金基金合同》的规定,基金托管费按前一日基金资产净值0.15%的年费率逐日计提。

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三位,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三位的,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《长安沪深300非周期行业指数基金基金合同》的规定,本基金同份额类别每份基金份额享有同等分配权。在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为12次, 每份基金份额每次分配比例不得低于该次可供分配利润的20%;若基金合同生效不满3个月,可不进行收益分配。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。本基金收益分配方式分为两种:现金分红与红利再投资,基金投资者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;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红。

6.4.4.12 外币交易

本基金本报告期内未进行外币交易。

6.4.4.13 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。

6.4.4.14 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[2017]13号《中国证券监督管理委员会关于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。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票,包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等,不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票,根据中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》,在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

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

本基金在本报告期未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 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。

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 [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》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》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) 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。

(b) 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。

2018年1月1日(含)以后,资管产品管理人(以下称管理人)运营基金过程中发生的增值税应税行为,以管理人为增值税纳税人,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。对基金在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;已缴纳增值税的,已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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。

(c) 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。

(d) 对基金取得的股票的股息、红利收入,由上市公司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。

(e) 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。

(f) 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。

(g) 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,暂不征收企业所得税。

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

本基金本报告期内经长安基金管理有限公司(以下简称"本公司")股东会审议通过,并经中国证券监督管理委员会证监许可[2017]2440号文批复同意,本公司原股东上海景林投资发展有限公司将其持有的本公司25.93%股权转让给杭州景林投资管理合伙企业(有限合伙)。

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	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
广发银行股份有限公司	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
杭州景林投资管理合伙企业(有限合伙)	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

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

本基金本报告期内及上年度可比期间内均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.3 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.8.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间内均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 2018年01月01日至2018年06月30日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	327,961.16	1,869,521.89
其中:支付销售机构的客户维护费	104,724.63	158,958.43

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1.0%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×1.0% /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 2018年01月01日至2018年06月30日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	49,194.16	280,428.30

支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值0.15%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×0.15%/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。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间内均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

份额单位:份

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日
基金合同生效日(2012年06月25日)持有的基金份额	–	–
报告期初持有的基金份额	6,608,724.39	6,608,724.39
报告期间申购/买入总份额	–	–
报告期间因拆分变动份额	–	–
减:报告期间赎回/卖出总份额	–	–
报告期末持有的基金份额	6,608,724.39	6,608,724.39
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	12.05%	7.17%

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之外的其他关联方投资本基金的情况。

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 2018年01月01日至2018年06月30日 期末余额	当期利息收入	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日 期末余额	当期利息收入
广发银行股份有限公司	4,015,560.65	17,691.22	6,910,731.89	1,006,964.77

本基金通过"广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2018年6月30日的相关余额为31,771.17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

本基金本报告期及上年度可比期间内均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

6.4.8.7.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间内无其他关联交易事项。

6.4.9 期末(2018年06月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发而流通受限的证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002739	万达电影	2017-07-04	重大事项	52.04	–	–	7,776	460,159.08	404,663.04	–
601390	中国中铁	2018-05-07	重大事项	7.47	2018-08-20	7.25	52,311	463,734.20	390,763.17	–
002450	康得新	2018-06-04	重大事项	17.08	–	–	19,689	388,937.69	336,288.12	–
002252	上海莱士	2018-02-23	重大事项	19.52	–	–	16,624	321,971.75	324,500.48	–
600485	信威集团	2016-12-26	重大事项	14.59	–	–	17,400	487,721.51	253,866.00	–
002310	东方园林	2018-05-25	重大事项	15.03	2018-08-27	13.47	13,200	223,191.68	198,396.00	–
601727	上海电气	2018-06-06	重大事项	6.34	2018-08-07	5.71	30,697	365,765.44	194,618.98	–
300072	三聚环保	2018-06-19	重大事项	23.28	2018-07-10	18.38	7,700	273,970.51	179,256.00	–
002602	世纪华通	2018-06-12	重大事项	32.50	–	–	3,900	140,232.43	126,750.00	–
000415	渤海金控	2018-01-17	重大事项	5.84	2018-07-17	5.19	20,900	147,942.12	122,056.00	–
601118	海南橡胶	2018-05-24	重大事项	6.62	–	–	10,659	71,615.32	70,562.58	–
002411	必康股份	2018-06-19	重大事项	28.34	–	–	1,000	27,721.71	28,340.00	–
000008	神州高铁	2018-06-06	重大事项	4.96	2018-08-07	4.46	3,900	29,618.01	19,344.00	–
000723	美锦能源	2018-03-27	重大事项	5.43	2018-07-31	4.89	3,400	23,256.00	18,462.00	–

本基金截至2018年06月30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。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末及上年度可比期间内均未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末及上年度可比期间内均未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值,公允价值层级可分为:第一层级:相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。 第二层级:直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。 第三层级:以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

(ii) 各层次金融工具公允价值

于2018年6月30日,本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为50,927,198.81元,第二层级的余额为2,667,866.37元,无属于第三层级的余额。 (iii) 公允价值所属层次间的重大变动 本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层级未发生重大变动。

(iv) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(2) 除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§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	53,595,065.18	91.73
	其中:股票	53,595,065.18	91.73
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	–	–
	其中:债券	–	–
	资产支持证券	–	–
4	贵金属投资	–	–
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	–	–
7	银行存款和结算备付金合计	4,020,857.88	6.88
8	其他各项资产	808,181.22	1.38
9	合计	58,424,104.28	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(指数投资)按行业分类的境内股票投资组合

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	230,618.58	0.40
B	采矿业	–	–
C	制造业	38,263,047.74	67.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,664,802.15	4.67
E	建筑业	3,258,578.60	5.71
F	批发和零售业	1,963,312.35	3.44
G	交通运输、仓储和邮政业	184,895.00	0.32
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,590,805.53	6.29
J	金融业	–	–
K	房地产业	–	–
L	租赁和商务服务业	1,575,893.26	2.76
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	316,374.28	0.55
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	598,004.21	1.05
R	文化、体育和娱乐业	948,733.48	1.66
S	综合	–	–
	合计	53,595,065.18	93.94

7.2.2 报告期末(积极投资)按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

7.2.3 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的股票投资明细

7.3.1 期末指数投资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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	4,996	3,654,374.16	6.41
2	000333	美的集团	45,012	2,350,526.64	4.12
3	000651	格力电器	46,933	2,212,890.95	3.88
4	600887	伊利股份	60,430	1,685,997.00	2.96
5	600276	恒瑞医药	20,830	1,578,080.80	2.77
6	000858	五 粮 液	19,205	1,459,580.00	2.56
7	002415	海康威视	36,032	1,337,868.16	2.35
8	600104	上汽集团	36,247	1,268,282.53	2.22
9	600900	长江电力	67,207	1,084,720.98	1.90
10	601668	中国建筑	192,864	1,053,037.44	1.85

注: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http://www.changanfunds.com 网站的半年度报告正文。

7.3.2 期末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持有积极投资股票。

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	603288	海天味业	469,500.00	0.60
2	300003	乐普医疗	390,959.00	0.50
3	000651	格力电器	378,948.00	0.48
4	000333	美的集团	356,538.00	0.45
5	002572	索菲亚	326,201.00	0.41
6	600867	通化东宝	301,411.00	0.38
7	600487	亨通光电	299,544.00	0.38
8	600011	华能国际	272,464.00	0.35
9	300015	爱尔眼科	269,572.00	0.34
10	300408	三环集团	259,988.00	0.33
11	002027	分众传媒	229,073.00	0.29
12	300433	蓝思科技	212,590.00	0.27
13	002601	龙蟒佰利	209,782.00	0.27
14	600398	海澜之家	196,873.00	0.25
15	002624	完美世界	171,111.00	0.22
16	002558	巨人网络	167,839.00	0.21
17	600482	XD中国动	161,762.00	0.21
18	002493	荣盛石化	157,971.00	0.20
19	600276	恒瑞医药	156,514.00	0.20
20	002050	三花智控	155,639.00	0.20

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	600519	贵州茅台	873,288.00	1.11
2	000651	格力电器	872,894.00	1.11
3	000333	美的集团	826,911.00	1.05
4	300104	乐视网	706,640.92	0.90
5	000725	京东方A	692,617.00	0.88
6	002415	海康威视	643,963.00	0.82
7	600887	伊利股份	631,303.00	0.80
8	600276	恒瑞医药	625,750.00	0.79
9	601668	中国建筑	589,528.00	0.75
10	600104	上汽集团	568,980.00	0.72
11	000858	五 粮 液	541,945.78	0.69
12	000069	华侨城A	427,904.98	0.54
13	000063	中兴通讯	390,588.00	0.50
14	601766	中国中车	366,179.00	0.46
15	600900	长江电力	340,079.00	0.43
16	002027	分众传媒	312,072.00	0.40
17	002304	洋河股份	293,461.00	0.37
18	600666	奥瑞德	282,540.80	0.36
19	600518	康美药业	273,012.00	0.35
20	002450	康得新	271,061.00	0.34

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

买入股票成本(成交)总额	13,044,664.00
卖出股票收入(成交)总额	28,685,516.24

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

本基金本报告期末及上年度可比期间内均未持有债券。

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

本基金本报告期末及上年度可比期间内均未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期内及上年度可比期间内均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

本基金本报告期内及上年度可比期间内均未进行贵金属投资。

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

本基金本报告期末及上年度可比期间内均未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期内及上年度可比期间内均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

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内及上年度可比期间内均未进行国债期货交易。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内及上年度可比期间内均未进行国债期货交易。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未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。

7.12.2 报告期内本基金投资的前十名股票未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	26,473.94
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	711,898.66
5	应收申购款	69,808.62
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	808,181.22

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末及上年度可比期间内均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

7.12.5.1 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。

7.12.5.2 期末积极投资前五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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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 持有份额	占总份额比例	个人投资者 持有份额	占总份额比例
1,928	28,455.55	6,875,562.81	13.00%	47,986,731.31	87.47%

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	177,363.39	0.32%

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(2012年06月25日)基金份额总额	277,132,832.76
本报告期期初基金份额总额	68,934,285.23
本报告期基金总申购份额	8,205,255.27
减:本报告期基金总赎回份额	22,277,246.38
本报告期基金拆分变动份额	–
本报告期期末基金份额总额	54,862,294.12

总申购份额包含红利再投资、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

本报告期,基金管理人无重大人事变动。

本基金托管人于2018年6月经证监会核准,由梁冰女士担任广发银行股份有限公司资产托管部副总经理。

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)自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务。

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

本报告期内,基金管理人收到中国证券监督管理委员会上海证监局《关于对长安基金基金管理有限公司采取责令改正措施的决定》,责令公司进行整改,并对公司相关责任人员采取监管谈话措施。公司高度重视,对公司内部控制和风险管理工作进行全面梳理,制定相关整改措施,并持续进行全面整改。除上述情况外,本报告期内,基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽核或处罚。

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 成交金额	占当期股票成交总额的比例	应支付该券商的佣金 佣金	占当期佣金总量的比例	备注
国信证券	1	–	–	–	–	–
民生证券	1	–	–	–	–	–
中信证券	1	–	–	–	–	–
兴业证券	1	–	–	–	–	–
中信建投	1	2,863,627.00	6.87%	2,666.87	7.84%	–
招商证券	1	10,391,632.17	24.93%	9,677.76	28.45%	–
东兴证券	2	4,427,768.00	10.62%	4,123.88	12.12%	–
浙商证券	2	4,080,206.12	9.79%	2,979.79	8.76%	–
上海证券	2	18,113,833.95	43.45%	13,245.01	38.94%	–
安信证券	2	–	–	–	–	–
华金证券	2	1,807,583.00	4.34%	1,321.90	3.89%	–
海通证券	3	–	–	–	–	–

1、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。

2、在上述租用的券商交易单元中,本基金本期新增浙商证券的交易单元,无退租的券商交易单元。

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 成交金额	占当期债券成交总额的比例	债券回购交易 成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	权证交易 成交金额	占当期权证成交总额的比例	基金交易 成交金额	占当期基金成交总额的比例
国信证券	–	–	–	–	–	–	–	–
民生证券	–	–	–	–	–	–	–	–
中信证券	–	–	–	–	–	–	–	–
兴业证券	–	–	–	–	–	–	–	–
中信建投	–	–	–	–	–	–	–	–
招商证券	–	–	–	–	–	–	–	–
东兴证券	–	–	–	–	–	–	–	–
浙商证券	–	–	–	–	–	–	–	–
上海证券	–	–	–	–	–	–	–	–
安信证券	–	–	–	–	–	–	–	–
华金证券	–	–	–	–	–	–	–	–
海通证券	–	–	–	–	–	–	–	–

§11影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额达到或超过20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

经长安基金管理有限公司(以下简称"本公司")股东会审议通过,并经中国证券监督管理委员会证监许可[2017]2440号文批复同意,本公司原股东上海景林投资发展有限公司将其持有的本公司25.93%股权转让给杭州景林投资管理合伙企业(有限合伙)。

本次股权转让后,本公司的股东及股权比例为:长安国际信托股份有限公司持有本公司全部股权的29.63%,杭州景林投资管理合伙企业(有限合伙)持有本公司全部股权的25.93%,上海恒嘉美联发展有限公司持有本公司全部股权的24.44%,五星控股集团有限公司持有本公司全部股权的13.33%,兵器装备集团财务有限责任公司持有本公司全部股权的6.67%。

本公司章程已随公司股权变更进行了相应的修改。目前,本次股权转让的相关工商变更登记手续已办理完毕。

长安基金管理有限公司

二〇一八年八月二十九日