长安宏观策略混合型证券投资基金招募说明书2015年第2次更新摘要

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

重要提示

本基金的募集申请经中国证监会2011年12月9日证监许可 [2011]1950号文核准。本基金基金合同于2012年3月9日正式生效。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本基金由基金管理人依照《基金法》、本基金合同和其他有关法律法规规定募集，并经中国证监会核准。中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

证券投资基金（以下简称“基金”）是一种长期投资工具，其主要功能是分散投资，降低投资单一证券所带来的个别风险。基金不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具，投资者购买基金，既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益，也可能承担基金投资所带来的损失。

基金投资者应当充分了解基金定期定额投资和零存整取等储蓄方式的区别。定期定额投资是引导投资者进行长期投资、平均投资成本的一种简单易行的投资方式，但并不能规避基金投资所固有的风险，不能保证投资者获得收益，也不是替代储蓄的等效理财方式。

基金在投资运作过程中可能面临各种风险，既包括市场风险，也包括基金自身的管理风险、技术风险、合规风险等。巨额赎回风险是开放式基金所特有的一种风险，即当单个开放日基金的净赎回申请超过上一日基金总份额的10%时，投资者将可能无法及时赎回持有的全部基金份额。

基金分为混合型基金、混合型基金、债券型基金、货币市场基金等不同类型，投资者投资不同类型的基金将获得不同的收益预期，也将承担不同程度的风险。一般来说，基金的收益预期越高，投资者所承担的风险也越大。

因分红、拆分等行为导致基金份额净值变化，不会改变基金的风险收益特征，不会降低基金投资风险或提高基金投资收益。

本基金是混合型基金，其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于证券投资基金中具有较高风险、较高预期收益品种。本基金投资于证券市场，基金份额净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，应仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认购/申购基金份额的意愿、时机、数量等投资行为做出独立、谨慎的决策，获得基金投资收益，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、由于基金投资者连续大量赎回基金产生的流动性风险、基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险、本基金的特定风险等。

本基金按照基金份额初始面值1.00元发售，在市场波动等因素的影响下，基金份额净值可能低于基金份额初始面值，投资者存在遭受损失的风险。

投资者应当认真阅读基金合同、招募说明书等基金法律文件，了解本基金的风险收益特征，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资者的风险承受能力相适应。投资者应当通过基金管理人或代销机构购买本基金，基金代销机构名单详见本基金份额发售公告。

基金管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。本基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来表现，基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。

本招募说明书所载内容截止日为2015年9月9日，有关财务数据和净值表现截止日为2015年6月30日。

一、基金管理人

(一)基金管理人情况

基金管理人：长安基金管理有限公司
住所：上海市虹口区丰镇路806号3幢371室
办公地址：上海市浦东新区芳甸路1088号紫竹国际大厦16层
法定代表人：万跃楠
成立日期：2011年9月5日
批准设立机关：中国证券监督管理委员会
及批准设立文号：中国证监会证监许可【2011】1351号
组织形式：有限责任公司
注册资本：2.7亿元人民币
存续期间：持续经营
联系人： 吴昱
电话：021－20329896
股权结构：

股东名称	出资比例
长安国际信托股份有限公司	29.63%
上海景林投资发展有限公司	25.93%
上海恒嘉美联发展有限公司	24.44%
五星控股集团有限公司	13.33%
兵器装备集团财务有限责任公司	6.67%
合计	100%

(二) 主要人员情况

1、董事会成员

万跃楠先生，董事，经济学博士。曾任南昌保险学校教师、中国证监会处长、长沙通程实业集团有限公司总裁、特华投资控股有限公司执行总裁、兵器装备集团财务有限责任公司副总经理和安信期货有限责任公司董事长等职，现任长安基金管理有限公司董事长、长安财富资产管理有限公司董事。

崔进才先生，董事，经济学硕士。曾任中信银行（原中信实业银行）总行部门副总经理、部门总经理等职，中信资产管理有限公司公司董事、副总经理，现任长安国际信托股份有限公司公司总经理，西安国家航空产业基金投资管理有限公司董事。

陈媛玲女士，董事，硕士。曾任中国爱地集团会计、财务经理，深圳中华会计师事务所项目经理，上海淳大集团审计经理，利安达信隆会计师事务所部门负责人，上海淳大源地实业有限公司财务总监、运营总监、总经理，现任上海景林投资发展有限公司副总经理。

陈东升先生，董事，硕士。曾任中国航空工业集团深圳公司部门经理，深圳市拍卖行部门经理、拍卖师，深圳市艺术品拍卖公司首席拍卖师、总经理，国信证券有限公司总裁室主管、北京三里河营业部副总经理，融通基金管理有限公司市场部总监、北京中心主任，上海金信投资控股公司业务拓展中心总经理，友邦华泰基金管理公司市场总监、总经理助理、拟任副总经理，财通基金管理有限公司总经理，现任上海同安投资管理有限公司总经理。

李莉女士，董事，经济学硕士、工商管理硕士。曾任中国招商银行总行离岸业务部经理、同业机构部高级经理，美国PIMCO总部香港公司副总裁，现任上海国和现代服务业股权投资管理有限公司董事总经理，上海正阳国际经贸有限公司董事长、法人代表，兴业银行股份有限公司监事，通联网络支付股份有限公司监事。

黄陈先生，董事，金融学博士。曾任中国工商银行总行政策室、发展规划部、投资银行部等部门主任科员、副处长，工银瑞信基金管理有限公司战略发展部总监，汤森路透中国区投资及咨询业务董事总经理、中国区机构投资者业务负责人等职，现任长安基金管理有限公司总经理，长安财富资产管理有限公司董事长。

张俊瑞先生，独立董事，经济学博士。曾任陕西财经学院会计系/财会学院、西安交通大学会计学院教授、副院长等职，现任西安交通大学管理学院教授、博士生导师。

田轩先生，独立董事，金融学博士。曾任印第安纳大学凯利商学院助理教授、副教授，现任清华大学五道口金融学院教授、保利能源控股有限公司独立董事。

傅蔚冈先生，独立董事，法学博士。曾任上海金融与法律研究院院长助理，现任上海金融与法律研究院执行院长，北京刘鸿儒金融教育基金会副秘书长。

2、监事会成员

孙广民先生，监事，涉外经济管理本科。曾任中国船舶工业总公司财务局副处长、江南船舶（集团）有限责任公司财务总监、中国船舶工业集团公司财务部副主任、兵器装备集团财务有限责任公司稽核审计部总经理等职，现任兵器装备集团财务有限责任公司投资业务部专务。

吴缨女士，职工监事，上海财经大学金融学研究生，理学学士。曾任江西电力职大助教，亚龙湾开发股份有限公司董事会秘书兼资金证券部经理，海南欣龙无纺股份有限公司董事会秘书，上海君创财经顾问有限公司副总经理，上海鼎立实业投资有限公司副总经理等职。现任长安基金管理有限公司综合管理部总经理。

3、公司高级管理人员

万跃楠先生，董事长，简历同上。

黄陈先生，总经理，简历同上。

刘玉生先生，督察长，经济学博士，十九年金融行业从业经验，曾任建设银行总行清算中心副主任科员、主任科员、副处，中国证券登记结算有限责任公司总部业务发展部副总监、基金业务部总监等职。

王健先生，副总经理。工商管理博士，十二年基金行业从业经历。曾任长信基金管理有限责任公司市场开发部总监，金元比联基金管理有限公司渠道销售部总监，长安基金管理有限公司市场总监等职。

4、本基金基金经理

栾绍菲先生，澳大利亚悉尼大学毕业，获金融与经济学硕士学位，四年以上金融行业从业经历。曾任长安基金管理有限公司研究部研究员、基金经理助理等职，现任长安基金管理有限公司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的基金经理。

5、投资决策委员会成员

黄陈先生，简历同上。

乔哲先生，获工商管理硕士学位，十九年债券及相关金融工作经验。曾任中国农业发展银行山东省分行资金计划处资金科科长，中国农业发展银行总行资金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务资本市场主管等职，现任长安基金管理有限公司联席投资总监、长安货币市场证券投资基金的基金经理。

林忠晶先生，经济学博士，五年以上金融行业从业经历。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，长安基金管理有限公司产品经理等职，现任长安基金管理有限公司战略及产品部副总经理，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的基金经理。

栾绍菲先生，简历同上。

上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

(一) 基金托管人情况

1、基本情况

名称：中国邮政储蓄银行股份有限公司(简称：中国邮政储蓄银行)
住所：北京市西城区金融大街3号
办公地址：北京市西城区金融大街3号A座
法定代表人：李国华
成立时间：2007年3月6日
组织形式：股份有限公司
注册资本：570亿元人民币
存续期间：持续经营
基金托管资格批文及文号：证监许可【2009】673号
联系人：王瑛
联系电话：010－68858126

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑和贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱服务；经中国银行业监督管理机构等监管部门批准的其他业务。

经国务院同意并经中国银行业监督管理委员会批准，中国邮政储蓄银行有限责任公司（成立于2007年3月6日）于2012年1月21日依法整体变更为中国邮政储蓄银行股份有限公司。中国邮政储蓄银行股份有限公司依法承继原中国邮政储蓄银行有限责任公司全部资产、负债、机构、业务和人员，依法承担和履行原中国邮政储蓄银行有限责任公司在有关具有法律效力的合同或协议中的权利、义务，以及相应的债权债务关系和法律责任。中国邮政储蓄银行股份有限公司坚持服务“三农”、服务中小企业、服务城乡居民的大型零售商业银行定位，发挥邮政网络优势，强化内部控制，合规稳健经营，为广大城乡居民及企业提供优质金融服务，实现股东价值最大化，支持国民经济发展和社会进步。

2、主要人员情况

中国邮政储蓄银行股份有限公司总行设托管业务部，下设资产托管处、风险管理处、运营管理处等处室。现有员工20人，全部员工拥有大学本科以上学历及基金从业资格，80%员工具有三年以上基金从业经历，具备丰富的托管服务经验。

3、托管业务经营情况

2009年7月23日，中国邮政储蓄银行经中国证券监督管理委员会和中国银行业监督管理委员会联合批准，获得证券投资基金托管资格，是我国第16家托管银行。2012年7月19日，中国邮政储蓄银行经中国保险业监督管理委员会批准，获得保险资金托管资格。中国邮政储蓄银行坚持以客户为中心、以服务为基础的经营理念，依托专业的托管团队、灵活的托管业务系统、规范的托管管理制度、健全的内控体系、运作高效的业务处理模式，为广大基金份额持有人和众多资产管理机构提供安全、高效、专业、全面的托管服务，并获得了合作伙伴一致好评。

截至2015年6月30日，中国邮政储蓄银行托管的证券投资基金共42只，包括中欧行业成长混合型证券投资基金(LOF)（原中欧中小盘股票型证券投资基金（LOF））(166006)、长信纯债壹号债券型证券投资基金（原长信中短债证券投资基金）(519985)、东方保本混合型开放式证券投资基金（400013）、万家添利债券型证券投资基金（LOF）（161908）、长信利鑫分级债券型证券投资基金（163003）、天弘丰利债券型证券投资基金（LOF）（164208）、鹏华丰泽债券型证券投资基金（LOF）（160618）、东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金（400015）、长安宏观策略混合型证券投资基金（740001）、金鹰持久增利债券型证券投资基金（LOF）（162105）、中欧信用增利债券型证券投资基金（LOF）（166012）、农银汇理消费主题股票型证券投资基金（660012）、浦银安盛中证锐联基本面400指数证券投资基金（519117）、天弘现金管家货币市场基金（420006）、汇丰晋信恒生A股行业龙头指数证券投资基金（540012）、华安安心收益债券型证券投资基金（040036）、东方强化收益债券型证券投资基金（400016）、中欧纯债分级债券型证券投资基金（166016）、东方安心收益保本混合型证券投资基金（400020）、银河岁岁回报定期开放债券型证券投资基金（519662）、中欧纯债添利分级债券型证券投资基金（166021）、银河灵活配置混合型证券投资基金（519656）、天弘通利混合型证券投资基金（000573）、中加纯债一年定期开放债券型证券投资基金（000552）、南方通利债券型证券投资基金（000563）、中邮货币市场基金（000576）、易方达财富快线货币市场基金（000647）、天弘瑞利分级债券型证券投资基金（000774）、中邮核心科技创新灵活配置混合证券投资基金（000966）、中信建投凤凰货币市场基金（001006）、景顺长城稳健回报灵活配置混合型证券投资基金（001194）、南方利淘灵活配置混合型证券投资基金（001183）、易方达新收益灵活配置混合型证券投资基金（001216）、易方达改革红利混合型证券投资基金（001076）、天弘新活力灵活配置混合型发起式证券投资基金（001250）、易方达新利灵活配置混合型证券投资基金（001249）、易方达新鑫灵活配置混合型证券投资基金（001285）、天弘互联网灵活配置混合型证券投资基金（001210）、天弘惠利灵活配置混合型证券投资基金（001447）、易方达新益灵活配置混合型证券投资基金（001314）、方正富邦优选灵活配置混合型证券投资基金（001431）、易方达瑞景灵活配置混合型证券投资基金（001433）。至今，中国邮政储蓄银行已形成涵盖证券投资基金、基金公司特定客户资产管理计划、信托计划、银行理财产品（本外币）、私募基金、证券公司资产管理计划、保险资金、保险资产管理计划等多种资产类型的托管产品体系，托管规模达12,919.41亿元。

三、相关服务机构

(一) 基金份额发售机构

1、直销机构

长安基金管理有限公司及本公司的网上交易平台
注册地址：上海市虹口区丰镇路806号3幢371室
办公地址：上海市浦东新区芳甸路1088号紫竹国际大厦16楼
法定代表人：万跃楠
联系电话：021－20329866
传真：021－20329899
联系人：吴昱

投资者可以通过本公司网上交易系统办理本基金的开户、认购、申购及赎回等业务，具体交易细则请参阅本公司网站公告。

网上交易网址：www.changanfunds.com

2、代销机构

（1）中国邮政储蓄银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区金融大街3号
办公地址：北京市西城区金融大街3号A座
法定代表人：李国华
客服电话：95580
公司网站：www.psbc.com

（2）中国工商银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号
法定代表人：姜建清
客服电话：95588
网址：www.icbc.com.cn

（3）中国农业银行股份有限公司
注册地址:北京市东城区建国门内大街69号
办公地址:北京市东城区建国门内大街69号
法定代表人: 刘士余
客服电话:95599
公司网址:www.abchina.com

（4）交通银行股份有限公司
注册地址：上海市银城中路188号
办公地址：上海市银城中路188号
法定代表人：牛锡明
客服电话：95559
公司网址：www.bankcomm.com

（4）上海浦东发展银行股份有限公司
注册地址：上海市浦东新区浦东南路 500 号
法定代表人：吉晓辉
客服电话：95528
网站：www.spdb.com.cn

（5）西安银行股份有限公司
注册地址：陕西省西安市高新区高新路60号
办公地址：陕西省西安市高新区高新路60号
法定代表人:王西省
客服电话：400－869－6779
公司网址： www.96779.com.cn

（6）中国银河证券股份有限公司
注册地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
办公地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
法定代表人：陈有安
客服电话：400－888－8888
公司网址：www.chinastock.com.cn

（7）国泰君安证券股份有限公司
注册地址：上海市浦东新区商城路618号
办公地址：上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼
法定代表人：万建华
客服电话：400－888－8666
公司网址：www.gtja.com

（8）海通证券股份有限公司
注册地址：上海市淮海中路98号
办公地址：上海市广东路689号
法定代表人：王开国
客服电话：95553
公司网址：www.htsec.com

（9）中信证券股份有限公司
注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦A层
办公地址：北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦
法定代表人：王东明
客服电话：95558
公司网址：www.cs.ecitic.com

（10）广发证券股份有限公司
注册地址：广州天河区天河北路183－187号大都会广场43楼（4301－4316房）
办公地址：广东省广州天河北路大都会广场5、18、19、36、38、39、41、42、43、44楼
法定代表人：孙树明
客服电话：95575
公司网址：www.gf.com.cn

（11）中信建投证券股份有限责任公司
注册地址:北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼
办公地址:北京市朝阳门内大街 188 号
法定代表人:王常青
客服电话:400－888－8108
公司网址： www.csc108.com

（12）光大证券股份有限公司
注册地址:上海市静安区新闸路1508号
办公地址:上海市静安区新闸路1508号
法定代表人:薛峰
客服电话：95525
公司网址:www.ebscn.com

（13）兴业证券股份有限公司
注册地址：福州市湖东路99号标力大厦
办公地址：浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼21层
法定代表人:兰荣
客服电话:400－888－8123
公司网址:www.xyzq.com.cn

(14)国信证券股份有限公司
注册地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
办公地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
法定代表人：何如
客服电话：95536
公司网址： www.guosen.com.cn

（15）招商证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区益田路江苏大厦38－45层
办公地址:深圳市福田区益田路江苏大厦38－45层
法定代表人：宫少林
客服务电话:95565
公司网址:www.newone.com.cn

（16）安信证券股份有限公司
注册地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦34层、28层A02单元
办公地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层
法定代表人：牛冠兴
客服电话：400－800－1001
公司网址：www.essence.com.cn

（17）恒泰证券股份有限公司
注册地址：内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号
办公地址：内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号
法定代表人：庞介民
客服电话：400－660－9926
公司网址：www.cnht.com.cn

（18）信达证券股份有限公司
住所：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼
办公地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼
法定代表人：高冠江
客服电话：400－800－8899
公司网址：www.cindasc.com

（19）中信证券（山东）有限责任公司
注册地址：青岛市崂山区苗岭路29号澳柯玛大厦15层(1507－1510室)
办公地址：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场20层
法定代表人：张智河
客服电话：0532－96577
公司网址：www.zxwt.com.cn

（20）华安证券股份有限公司
注册地址:安徽省合肥市长江中路 357 号
办公地址:安徽省合肥市阜南路 166 号润安大厦 A 座
法定代表人：李工
客服电话：400－809－6518
公司网址：www.hazq.com

（21）中信证券(浙江)有限责任公司
注册地址：浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层
办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层
法定代表人：沈强
客服电话：0571－96598
公司网址：www.bigsun.com.cn

（22）申万宏源证券有限公司
注册地址：上海市徐汇区长乐路989号45层
办公地址：上海市徐汇区长乐路989号45层
法定代表人：李梅
客服电话：95523或4008895523
电话委托：021－962505
公司网址： www.swhysc.com

（23）申万宏源西部证券有限公司
注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区北京南路358号大成国际大厦20楼2005室
办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区北京南路358号大成国际大厦20楼2005室
法定代表人：许建平
客服电话：400－800－0562
公司网址：www.hysec.com

（24）齐鲁证券有限公司
注册地址：济南市经七路86号
办公地址：济南市经七路86号23层
法定代表人：李玮
客户电话：95538
公司网址：www.qlzq.com.cn

（25）日信证券有限责任公司
注册地址:内蒙古呼和浩特市锡林南路18号
办公地址:内蒙古呼和浩特市锡林南路18号
法定代表人:孔佑杰
客服电话： 400－660－9839
公司网址:www.rxzq.com.cn

（26）华泰证券股份有限公司
注册地址：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
办公地址：深圳市深南大道4011号港中旅大厦24楼
法定代表人：吴万善
客服电话：95597
公司网址：www.htsc.com.cn

（27）西南证券股份有限公司
注册地址：重庆市江北区桥北苑8号
办公地址：重庆市江北区桥北苑8号西南证券大厦
法定代表人：余维佳
客服电话：400－809－6096
公司网址：www.swsc.com.cn

（28）天风证券股份有限公司
注册地址：湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦四楼
办公地址：中国武汉市武昌区中南路99号保利广场A座37楼
法定代表人：余磊
客服电话：400－800－5000
公司网站：www.tfzq.com

(29) 国金证券股份有限公司
注册地址：成都市青羊区东城根上街95号
办公地址：成都市青羊区东城根上街95号
法定代表人：冉云
客服电话：400－160－0109
公司网址：www.gjzq.com.cn

（30）湘财证券股份有限公司
注册地址：湖南省长沙市黄兴中路 63 号中山国际大厦 12 楼
法定代表人：林俊波
客服电话：400－888－1551
公司网站：www.xcsc.com

（31）万联证券有限责任公司
注册地址：广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F栋18、19层
办公地址：广州市天河区珠江东路11号高德置地广场 F 栋18、19层
法定代表人：张建军
客服电话：400－888－8133
公司网址：www.wlzq.com.cn

（32）华鑫证券有限责任公司
注册地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01（b）单元
法定代表人：俞洋
客服电话：400－109－9918
网站：www.cfsc.com.cn

（33）国海证券股份有限公司
注册地址：广西桂林市辅星路13号
办公地址：广西壮族自治区南宁市滨湖路46号
法定代表人：张雅锋
客服电话：95563
公司网址：www.ghzq.com.cn

（34）大同证券有限责任公司
注册地址：大同市城区迎宾街15 号桐城中央21 层
法定代表人：董祥
客服电话：95563
公司网址：www.ghzq.com.cn

(35) 深圳众禄基金销售有限公司
注册地址：深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、J单元
办公地址：深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、J单元
法定代表人：薛峰
客服电话：400－6788－887
公司网址：www.zlfund.cn及www.jjmmw.com

(36) 杭州数米基金销售有限公司
注册地址：杭州市余杭区仓前街道海曙路东2号
办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼
法定代表人：陈柏青
客服电话：400－076－6123
公司网址：www.fund123.cn

(37) 上海好买基金销售有限公司
注册地址：上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室
办公地址：上海市浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦9楼
法定代表人：杨文斌
客服电话：400－700－9665
公司网址：www.ehowbuy.com

（38）上海天天基金销售有限公司
办公地址：上海市徐汇区龙田路195号3C座9楼
法定代表人：其实
客服电话：400－181－8188
公司网址：www.1234567.com.cn

（39）上海长量基金销售投资顾问有限公司
注册地址：上海市浦东新区高翔路526号2幢220室
办公地址：上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层
法定代表人：张跃伟
公司网址：www.erichfund.com

（40）诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司
注册地址：上海市金山区廊下镇漕廊公路7650号205室
办公地址：中国上海杨浦区秦皇岛路32号C栋
法定代表人：汪静波
客服电话：400－821－5399
公司网址：www.noah－fund.com

（41）上海利得基金销售有限公司
注册地址：上海市宝山区蕴川路5475号1033室
办公地址：上海市浦东新区东方路989号中达广场201室
法定代表人：盛大
客服电话：400－005－6355
公司网址：leadfund.com.cn

（42）万银财富（北京）基金销售有限公司
注册地址：中国北京朝阳区北四环中路27号盘古大观3201
办公地址：中国北京朝阳区北四环中路27号盘古大观3201
法定代表人：李招弟
客服电话：400－808－0069
公司网址： www.wy－fund.com

（43）和讯信息科技有限公司
住所：北京市朝外大街22号泛利大厦10层
办公地址：北京市朝外大街22号泛利大厦10层
法定代表人：王莉
客户服务电话：400－920－0022
公司网址：licaike.hexun.com

（44）中期时代基金销售（北京）有限公司
注册地址：北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢11层1103号
办公地址：北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢2层
法定代表人：路瑶
客服热线：95162、4008888160
公司网址：www.CIFCOFUND.com

（45） 北京钱景财富投资管理有限公司
注册地址:北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008－1012
办公地址:北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008－1012
法定代表人:赵荣春
客服热线：400－678－5095
公司网址：www.niuji.net

（46）浙江同花顺基金销售有限公司
注册地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903室
办公地址：浙江省杭州市翠柏路7号杭州电子商务产业园2号楼2楼
法定代表人：凌顺平
客服电话：4008－773－772
公司网址：www.5ifund.com

（47）中国国际期货有限公司
注册地址：北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢1层、2层、9层、11层、12层
办公地址：北京市朝阳区麦子店西路3号新恒基国际大厦15层
法定代表人：王兵
客服电话：95162、400－8888－160
公司网址：www.cifco.net

（48）上海基煜基金销售有限公司
注册地址：上海市崇明县长兴镇路潘园公路1800号2号楼6153室
法定代表人：王翔
客服电话：021－65370077
网站：www.jiyufund.com.cn

（49）北京展恒基金销售有限公司
注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街6号
办公地址：北京市朝阳区德胜门外华严北里2号民建大厦6层
法定代表人：闫振杰
客服电话：400－888－6661
公司网址：www.myfund.com

（50）上海钜派钰茂基金销售有限公司
注册地址：上海市浦东新区泥城镇新城路2号24幢N3187
办公地址：上海市浦东南路379号金穗大厦14楼C座
法定代表人：胡天翔
客服电话：400－096－3866
公司网站： www.jp－fund.com

（51）上海陆金所资产管理有限公司
注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元
办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼
法定代表人：郭坚
客户服务电话：400－821－9031
公司网站： www.lufunds.com

基金管理人可根据有关法律法规的要求选择其他机构代理销售基金，并及时公告。

(二) 注册登记机构

长安基金管理有限公司及本公司的网上交易平台
注册地址：上海市虹口区丰镇路806号3幢371室
办公地址：上海市浦东新区芳甸路1088号紫竹国际大厦16楼
法定代表人：万跃楠
联系电话：021－20329771
传真：021－50598018
联系人：欧鹏

(三) 出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所
注册地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼
办公地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼
负责人：韩炯
联系电话：（021）31358666
传真：（021）31358600
联系人：安冬
经办律师：吕红、安冬

(四) 审计基金财产的会计师事务所

名称：毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）
注册地址：北京东长安街1号东方广场东2座8层
办公地址：上海市南京西路1266号恒隆广场1期50楼
法定代表人：邹俊
电话：021－22122888
传真：021－62881889
联系人：王国蓓
经办注册会计师：王国蓓、黄小熠

四、基金名称

长安宏观策略混合型证券投资基金

五、基金类型

混合型证券投资基金

六、基金投资目标

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。

七、基金投资范围

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，但需符合中国证监会的相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金为混合型基金，基金的投资组合比例为：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%，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。如法律法规或中国证监会变更投资品种的比例限制的，基金管理人可依据相关规定履行适当程序后调整本基金的投资比例规定。

八、基金投资策略

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。

（1）宏观经济分析

本基金对宏观经济的分析主要基于经济周期运行规律和宏观经济指标两方面。实践经验表明，经济运行存在着周期波动，并表现为繁荣、衰退、萧条、复苏等阶段，各类资产在不同的经济周期阶段会呈现出不同的收益特征。本基金采用定量和定性相结合的方法预测经济周期的未来走向，从而指导大类资产配置。具体研判的宏观经济指标主要包括国内生产总值、工业增加值、固定资产投资、消费者价格指数、生产者价格指数、社会消费品零售总额以及其他一些宏观经济领先指标和同步指标。

（2）政策环境分析

本基金将重点分析国内外的财政政策、货币政策和资本市场政策，比如国家产业政策、信贷政策、利率政策、汇率政策以及与资本市场相关的股权制度、发行制度等相关政策；

（3）估值水平分析

估值水平决定了各类资产的相对投资价值和预期风险状况。本基金将主要考察市场整体的估值水平与长期均值的偏离程度、债券收益率曲线变化、长期国债收益率与市场整体市盈率倒数的比较以及股票市场波动率等估值参考指标。

（4）市场情绪分析

分析市场情绪有助于判断市场短期波动，辅助大类资产配置比例的调整。本基金将主要通过相关舆情指标、市场交易特征、资金供求分析等方面来判断。

上述四个方面是影响本基金大类资产配置决策的四大基本因素。本基金将对上述四个因素的状态及未来的趋势进行仔细分析和预测，并重点考察该四个因素形成的综合效应及对资本市场的走势影响，在此判断的基础上形成对大类资产的风险收益预期。随着上述四大因素的不断变化，本基金将根据现实的状况与之前预期的差异进行动态调整。

本基金在综合以上分析结果后，得出对股票、债券等各类资产未来走势的理性预期，并在此基础上合理分配基金资产在股票、债券、现金上的配置比例。在宏观经济向好且股票市场预期上涨的情况下，本基金将加大股票资产的配置比例以分享市场上涨的收益；而在宏观经济走弱且股票市场预期下跌的情况下，本基金将相应降低股票资产的配置比例以回避市场系统性风险。在基金合同约定的投资比例范围之内，通过对市场上涨的充分暴露以及市场下跌的风险回避，本基金将力争在大类资产配置层面获取超越市场平均的收益水平。

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。具体的行业配置策略主要包括以下几方面：

（1）从全球视野的角度出发，遵循从国际到国内、从宏观到行业的分析思路，通过对经济周期、产业环境、产业政策和行业竞争格局的分析和预测，密切跟踪受益于国际经济一体化、国际产业变迁趋势的产业和行业，寻找和挖掘符合国际产业演变趋势、切合国内经济未来发展规划的产业和行业。

（2）结合国内经济的结构性变革趋势和产业政策导向，在深刻理解经济转型主要驱动力的基础上，通过对经济结构调整和产业升级方向的前瞻性分析，把握新兴产业的崛起以及传统产业的升级换代所带来的中长期投资机会。

（3）行业生命周期分析。从行业发展历史经验来看，每个行业都将经历从成长到衰退的发展演变过程。一般来说分为四个阶段，即初创期、成长期、成熟期和衰退期。其中成长期行业的利润增长率将超过市场平均水平，投资于该阶段行业获得超额收益的可能性将大大提高。本基金将根据行业整体增长率、销售额、利润率、竞争状况、定价方式、进入壁垒等方面进行综合分析，判断行业所处的生命周期，确定行业中长期发展前景和投资价值，重点关注处于成长期的行业。

（4）行业景气度分析。在经济周期的不同阶段，各个行业的发展速度、盈利水平等存在差异，从而呈现出不同的行业景气程度。行业景气度上升预示着该行业的发展趋势向好，盈利能力将提高。本基金将结合行业主营业务收入增长率、主营业务利润增长率、毛利率、净利润增长率以及其他行业领先指标和同步指标来判断行业的景气度，重点投资景气度上升的行业。

（5）本基金还将紧密跟踪国家政府在某一时期针对部分行业出台的产业提振政策，以及在某些市场阶段下涌现出的特定投资主题，及时把握受益于此的中短期行业投资机会。

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。

（1）定量分析

本基金管理人将重点考察以下定量指标对个股进行分析：

成长指标：本基金通过考察过去三年平均主营业务收入增长率、主营业务利润增长率、未来一年预测每股收益增长率等指标来衡量上市公司的成长性。

盈利指标：除了成长性之外，本基金还将通过考察过去三年平均总资产报酬率和净资产收益率等指标来衡量上市公司的盈利质量。

估值指标：个股的估值水平在一定程度上反映了未来获利空间和投资安全边际。本基金将针对不同行业特点，采用市盈率（P/E）、市净率（P/B）、市盈增长比率（PEG）等估值指标，并参考国际估值分析方法，将公司估值水平与行业估值水平以及市场整体估值水平进行比较，选择具有动态估值优势的公司。

（2）定性分析

在定量分析的基础上，本基金还将通过实地调研和利用卖方研究报告等方式，从定性的角度对上市公司进行深入分析。定性分析主要包括以下几个方面：

突出的行业地位或具备核心竞争优势：公司在所属行业或细分行业中处于领先地位或者具备独特的核心竞争优势，比如具有垄断的资源优势、先进的经营模式、稳定良好的销售网络、著名的市场品牌、优秀的创新能力等。

公司经营及业绩增长可持续：公司外部经营环境、内部核心竞争力以及业绩增长的驱动因素在短期内不会发生重大改变，具有可持续性。

稳健的公司运营状况：股东和管理层结构稳定，公司营运能力和经营效率良好，各项财务指标健康，公司具有清晰的发展战略。

良好的公司治理结构：公司治理结构完善、管理规范，已建立市场化经营机制、决策效率高、对市场变化反应灵敏并内控有力。

本基金所认为的基本面良好、成长性突出的上市公司应同时具备企业盈利质量状况良好、成长潜力高于平均水平并具有可持续性、企业经营稳健、公司治理完善等条件。

因此，对于上述定量分析，本基金将在计算各个具体定量指标的基础上，对各项指标进行排序并评分，将处于全市场平均水平之上的个股纳入重点研究范围。对于重点研究个股，本基金还将从上述定性方面进行进一步的基本面分析，从而筛选出符合本基金衡量标准的基本面良好、成长性突出的个股进行投资。

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。

（1）久期管理

久期管理是债券组合管理的核心环节，是提高收益、控制风险的有效手段。本基金通过全面分析宏观经济、货币政策与财政政策、物价水平变化等因素，对未来市场利率走势形成合理预期。当预期利率下降时，本基金将适度提高组合久期，以较多地获得债券价格上升带来的收益；当预期利率上升时，本基金将适度降低组合久期，以规避债券价格下降的风险。

（2）期限结构配置

由于期限不同，债券价格变化对市场利率的敏感程度也不同，本基金将在确定组合久期后，结合收益率曲线变化的预测，进行期限结构的配置。主要的配置方式有：梯形组合、哑铃组合、子弹组合等。

（3）类属配置

类属配置主要体现在对不同类型债券的选择，实现债券组合收益的优化。主要包括银行间市场和交易所市场之间，以及各个市场内不同债券类型之间的选择。本基金将在充分考虑不同类型债券的流动性、赋税特点以及信用风险等因素的基础上，进行类属配置，优化组合收益。

（4）个券选择

本基金在综合考虑上述配置原则的基础上，通过对个券的价值分析，重点考察各券种的收益率、流动性、信用等级等，选择流动性较好、风险水平合理、到期收益率与信用质量相对较高的债券品种。本基金还将采取积极主动的策略，针对市场定价错误和回购套利机会等，在确定存在超额收益的情况下，积极把握市场机会。

未来随着国内债券市场的不断发展，本基金将根据实际情况不断研究使用更多的债券投资盈利模式，在控制风险的前提下谋求高于市场平均水平的投资回报。

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，包括但不限于杠杆交易策略、看跌保护组合策略、保护组合成本策略、获利保护策略、买入跨式投资策略等。

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。此外，本基金还将运用股指期货来对冲诸如预期大额申购赎回、大量分红等特殊情况下的流动性风险，以进行有效的现金管理。为此，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。

如未来法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

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。

九、业绩比较基准

本基金整体业绩比较基准构成为：沪深300指数收益率×80%＋中证全债指数收益率×20%

沪深300指数是由中证指数公司开发的中国A股市场统一指数，该指数的样本选自沪深两个证券市场，具有市场代表性强、流动性好，市场影响力高等特点，能够反映中国A股市场总体发展趋势，适合作为本基金股票投资业绩比较基准。

中证全债指数是由中证指数公司开发的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数，也是中证指数公司编制并发布的首只债券类指数。该指数的样本由银行间市场和沪深交易所市场的国债、金融债及企业债组成，为债券投资者提供投资分析工具和业绩评价基准。

基于本基金的投资范围和投资比例，选用上述业绩比较基准能够真实、客观地反映本基金的风险收益特征。

随着市场环境的变化，如果上述业绩比较基准不适用本基金或市场推出代表性更强、投资者认同度更高且更能够表征本基金风险收益特征的指数时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整。调整业绩比较基准应经基金托管人同意，报中国证监会备案，基金管理人应在调整前3个工作日在中国证监会指定的信息披露媒体上刊登公告。

十、风险收益特征

本基金为混合型证券投资基金，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。

十一、基金投资组合报告

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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，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，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。

本报告期自2015年1月1日起至6月30日止。

1、报告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	183,880,748.12	89.28
	其中：股票	183,880,748.12	89.28
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	19,591,007.84	9.51
7	其他各项资产	2,482,197.28	1.21
8	合计	205,953,953.24	100.00

2、报告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（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	－	－
B	采矿业	－	－
C	制造业	116,465,011.52	57.81
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	12,773,681.20	6.34
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	54,642,055.40	27.12
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	183,880,748.12	91.28

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

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	300329	海伦钢琴	520,000	18,200,000.00	9.03
2	300285	国瓷材料	500,000	17,850,000.00	8.86
3	002484	江海股份	599,974	14,219,383.80	7.06
4	002230	科大讯飞	360,000	12,578,400.00	6.24
5	300017	网宿科技	260,000	12,069,200.00	5.99
6	600703	三安光电	350,000	10,955,000.00	5.44
7	300207	欣旺达	450,000	10,899,000.00	5.41
8	002467	二六三	539,972	10,502,455.40	5.21
9	002605	姚记扑克	469,896	9,989,988.96	4.96
10	002249	大洋电机	699,911	8,972,859.02	4.45

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名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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。

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。

8、投资组合报告附注

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。

8.2. 报告期内，本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

8.3. 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	789,332.20
2	应收证券清算款	1,139,514.09
3	应收股利	－
4	应收利息	489,117.11
5	应收申购款	64,233.88
6	其他应收款	－
7	待摊费用	－
8	其他	－
9	合计	2,482,197.28

8.4. 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	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002605	姚记扑克	9,989,988.96	4.96	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，本报告中涉及比例计算的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

十二、基金的业绩

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，也不保证最低收益。

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。

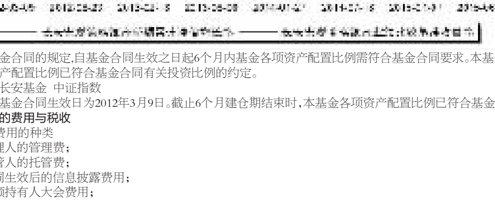
本基金合同生效日为2012年3月9日，基金业绩截止日为2015年6月30日。

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	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	－16.27%	3.58%	－5.93%	2.80%	－10.34%	0.78%
过去三个月	9.78%	2.75%	8.85%	2.09%	0.93%	0.66%
过去六个月	36.87%	2.21%	21.57%	1.81%	15.30%	0.40%
过去一年	78.28%	1.86%	81.16%	1.47%	－2.88%	0.39%
过去三年	140.23%	1.64%	63.09%	1.20%	77.14%	0.44%
自基金合同生效日起至今（2012年03月09日－2015年06月30日）	131.59%	1.58%	54.98%	1.17%	76.61%	0.41%

数据来源：长安基金 中证指数

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



注：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时，各项资产配置比例已符合基金合同有关投资比例的约定。

数据来源：长安基金 中证指数

注：本基金基金合同生效日为2012年3月9日。截止6个月建仓期结束时，本基金各项资产配置比例已符合基金合同约定。

十三、基金的费用与税收

(一) 基金费用的种类

1、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、基金份额持有人大会费用；
5、基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
6、基金的证券交易费用；
7、基金财产拨划支付的银行费用；
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) 上述基金费用由基金管理人在法律法规规定的范围内按照公允的市场价格确定，法律法规和基金合同另有规定时从其规定。

(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、休息日结束之日起3个工作日内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托管人。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、休息日结束之日起3个工作日内或不可抗力情形消除之日起3个工作日内支付。

3、上述(一)中3到7项费用由基金托管人根据其他有关法律法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

(四) 不列入基金费用的项目

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的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效之前的律师费、会计师费和信息披露费用等不得从基金财产中列支，基金收取认购费的，可以从认购费中列支。

(五) 基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。降低基金管理费率和基金托管费率，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率实施日前在指定媒体和基金管理人网站上刊登公告。

(六) 基金税收

基金运作过程中涉及的各纳税主体根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

十四、对招募说明书更新部分的说明

（一）“重要提示”部分

更新了本招募说明书所载内容截止日、该基金类型及有关财务数据和净值表现的截止日期信息。

（二）“第三部分 基金管理人”部分

更新了基金管理人联系人及主要人员情况。

(三)“第四部分 基金托管人”部分

更新了基金托管人情况。

（四）“第五部分 相关服务机构”部分

更新了代销机构方面信息。

（五）“第九部分 基金的投资”部分

更新了基金投资组合报告，报告期自2015年1月1日起至2015年6月30日止。

（六）基金的投资

更新了基金风险收益特征。

（七）“第十部分 基金的业绩”部分

更新了基金的业绩，报告期截止2015年6月30日止。

（八）“第二十二部分 其他应披露事项”部分

更新了2015年3月10日至2015年9月9日期间涉及本基金的相关公告。

长安基金管理有限公司
2015年10月28日