

长安沪深300非周期行业指数证券投资基金

2012年第3季度报告

2012年09月30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

报告送出日期：2012年10月25日

§ 1 重要提示

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。

基金托管人广发银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2012年10月24日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，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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2012年7月1日起至9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	长安沪深300非周期
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
报告期末基金份额总额	163,487,909.61份
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。
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

§ 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（2012年07月01日-2012年09月30日）
1.本期已实现收益	-5,709,850.76
2.本期利润	-6,119,220.81
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0254
4.期末基金资产净值	160,949,138.30
5.期末基金份额净值	0.984

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，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。

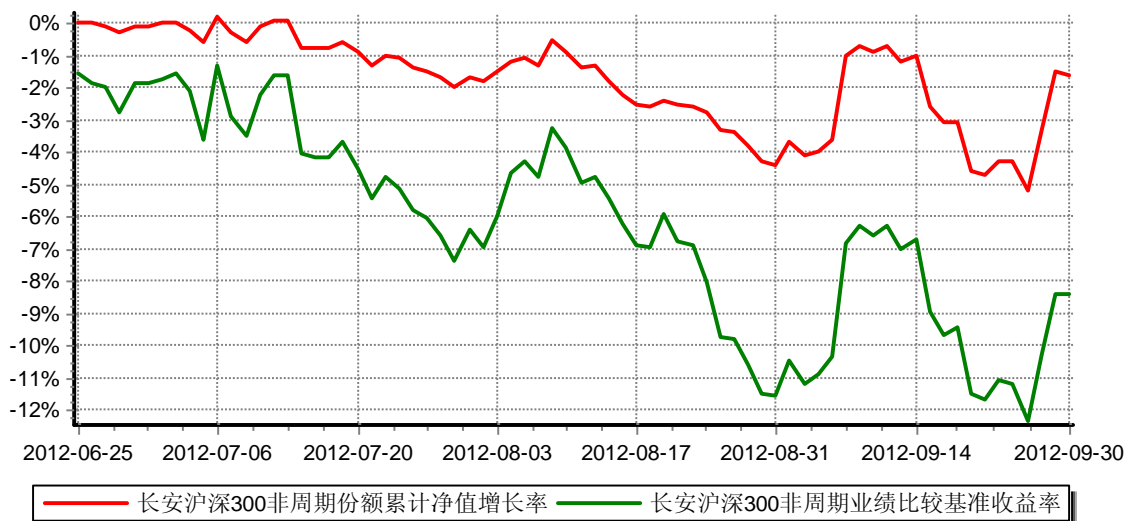
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	-1.50%	0.66%	-6.66%	1.15%	5.16%	-0.49%

注：本基金整体业绩比较基准构成为：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



注：本基金基金合同生效日为2012年6月25日，基金合同生效日至报告期期末，本基金运作时间未滿一年。图示日期为2012年6月25日至2012年9月30日。按基金合同或招募说明书的约定，本基金建仓期为6个月，截止本报告期末本基金仍处于建仓期。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王磊	本基金的基金经理	2012年06月25日	—	5年	吉林大学经济学硕士。曾任中邮创业基金管理有限公司战略发展部副总经理、国金通用基金管理有限公司筹备期研究员等职。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25日至今任长安沪深300非周期行业指数基金的基金经理。

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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了公平对待各类投资人，保护各类投资人利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为，公司根据《证券投资基金法》、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部规章，拟定了《公平交易管理办法》，对公司管理的各类资产的公平对待做了明确具体的规定，并规定对买卖股票、债券时候的价格和市场价格差距较大，可能存在操纵股价、利益输送等违法违规情况进行监控。本报告期，按照时间优先、价格优先的原则，本公司对满足限价条件且对同一证券有相同交易需求的基金等投资组合，均采用了系统中的公平交易模块进行操作，实现了公平交易；未出现清算不到位的情况，且本基金及本基金与本基金管理人管理的其他投资组合之间未发生法律法规禁止的反向交易及交叉交易。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的5%。

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

截止本报告期末，本基金仍处于6个月的建仓期内。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2012年9月30日，本基金份额净值为0.984元。报告期内，本基金份额净值增长率为-1.5%，同期业绩基准增长率为-6.66%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金为被动式指数型基金，在完成建仓期后，基金管理人将按照基金合同的要求，坚持指数化投资策略，通过运用定量分析的手段，分析和应对导致基金跟踪误差的因素，继续努力将基金的跟踪误差控制在较低水平。

§ 5 投资组合报告

5.1 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	133,464,757.87	81.59
	其中：股票	133,464,757.87	81.59
2	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
3	金融衍生品投资	—	—
4	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
5	银行存款和结算备付金合计	29,314,627.00	17.92
6	其他各项资产	804,438.44	0.49
7	合计	163,583,823.31	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末（指数投资）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	2,185,901.92	1.36
B	采掘业	1,564,312.90	0.97
C	制造业	87,953,520.53	54.65
C0	食品、饮料	27,602,550.98	17.15
C1	纺织、服装、皮毛	1,166,962.50	0.73
C2	木材、家具	—	—
C3	造纸、印刷	—	—
C4	石油、化学、塑胶、塑料	6,300,662.26	3.91
C5	电子	5,250,971.67	3.26

C6	金属、非金属	—	—
C7	机械、设备、仪表	31,482,742.50	19.56
C8	医药、生物制品	15,479,325.74	9.62
C99	其他制造业	670,304.88	0.42
D	电力、煤气及水的生产和供应业	10,298,861.14	6.40
E	建筑业	11,252,736.10	6.99
F	交通运输、仓储业	—	—
G	信息技术业	6,727,854.31	4.18
H	批发和零售贸易	6,696,098.57	4.16
I	金融、保险业	—	—
J	房地产业	—	—
K	社会服务业	3,260,712.15	2.03
L	传播与文化产业	1,353,743.01	0.84
M	综合类	2,171,017.24	1.35
	合计	133,464,757.87	82.92

5.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

5.3 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

5.3.1 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	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	36,428	8,954,002.40	5.56
2	600104	上汽集团	353,309	4,783,803.86	2.97
3	002304	洋河股份	37,221	4,652,625.00	2.89
4	000858	五粮液	109,619	3,716,084.10	2.31
5	600900	长江电力	509,406	3,290,762.76	2.04
6	601668	中国建筑	872,653	2,679,044.71	1.66
7	600031	三一重工	263,188	2,526,604.80	1.57
8	601989	中国重工	456,528	2,168,508.00	1.35
9	000651	格力电器	96,992	2,073,688.96	1.29

10	000895	双汇发展	33,405	2,021,002.50	1.26
----	--------	------	--------	--------------	------

5.3.2 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。

5.4 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。

5.5 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。

5.6 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。

5.7 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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.8.2 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。

5.8.3 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	500,000.00
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	8,871.94
5	应收申购款	295,566.50
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—

8	其他	—
9	合计	804,438.44

5.8.4 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无处于转股期的可转换债券。

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.1 期末指数投资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。

5.8.5.2 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。

5.8.6 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。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	277,132,832.76
本报告期基金总申购份额	423,354.16
减：本报告期基金总赎回份额	114,068,277.31
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	163,487,909.61

§ 7 影响投资者决策的其他重要信息

7.1.本报告期内，公司根据《证券投资基金信息披露管理办法》的有关规定，在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和《证券日报》及管理人网站进行了如下信息披露：

- 1、2012年6月26日披露了《长安沪深300非周期行业指数证券投资基金基金合同生效公告》。
- 2、2012年7月2日披露了《长安基金管理有限公司关于旗下基金资产净值、基金份额净值及基金份额累计净值的公告》。
- 3、2012年8月24日披露了《关于长安沪深300非周期行业指数证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告》。

4、2012年8月24日披露了《关于长安沪深300非周期行业指数证券投资基金推出网上直销申购、网上直销定期定额投资业务并实行费率优惠活动的公告》。

5、2012年8月24日披露了《关于长安沪深300非周期行业指数证券投资基金在代销机构推出定期定额投资业务并参加费率优惠活动的公告》。

6、2012年9月14日披露了《关于增加西安银行股份有限公司为长安基金旗下基金代销机构的公告》。

7.2.其他相关信息

无。

长安基金管理有限公司
二〇一二年十月二十五日