

长安沪深300非周期行业指数证券投资基金2014年半年度报告

2014年06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

送出日期：2014年08月28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2014年8月26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。

本报告中财务资料未经会计师事务所审计。

本报告期自2014年1月1日起至6月30日止。

1.2 目录

1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介.....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告.....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
§5 托管人报告.....	11
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	11
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.....	11
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.....	11
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告.....	37
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	37
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.....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	47
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.....	47
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	47
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.....	47
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.....	47
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	47
7.12 投资组合报告附注.....	47
§8 基金份额持有人信息.....	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	48
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.....	49
§9 开放式基金份额变动.....	49
§10 重大事件揭示.....	49
10.1 基金份额持有人大会决议.....	49
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.....	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	50

10.4	基金投资策略的改变.....	50
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	50
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况.....	50
10.7	本期基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	50
10.8	其他重大事件.....	51
§11	影响投资者决策的其他重要信息.....	52
§12	备查文件目录.....	52
12.1	备查文件目录.....	52
12.2	存放地点.....	53
12.3	查阅方式.....	53

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长安沪深300非周期行业指数证券投资基金
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
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	24,352,216.27

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	袁明
	联系电话	021-20329995
	电子邮箱	yuanming@changanfunds.com
		李春磊
		010-65169830
		lichunlei@cgbchina.com.cn

客户服务电话	400-820-9688	400-830-8003
传真	021-50598018	010-65169555
注册地址	上海市虹口区丰镇路806号3幢371室	广东省广州市越秀区东风东路713号
办公地址	上海市浦东新区芳甸路1088号紫竹国际大厦16层	北京市东城区东长安街甲2号 广发银行大厦四层
邮政编码	201204	100005
法定代表人	万跃楠	董建岳

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
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	上海市浦东新区芳甸路1088号紫竹国际大厦16层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市南京西路1266号恒隆广场1期50楼
注册登记机构	长安基金管理有限公司	上海市浦东新区芳甸路1088号紫竹国际大厦16层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2014年01月01日-2014年06月30日）
本期已实现收益	-628,194.03
本期利润	-2,551,353.18
加权平均基金份额本期利润	-0.0953

本期加权平均净值利润率	-9.69%
本期基金份额净值增长率	-8.83%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2014年06月30日）
期末可供分配利润	-977,915.84
期末可供分配基金份额利润	-0.0402
期末基金资产净值	23,374,300.43
期末基金份额净值	0.9600
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2014年06月30日）
基金份额累计净值增长率	-4.00%

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。

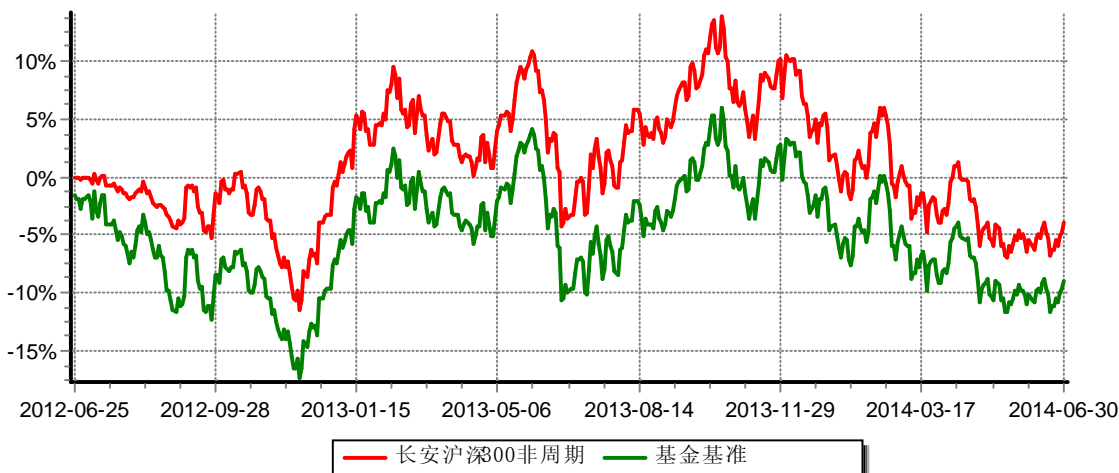
3.2 基金净值表现

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
过去一个月	1.05%	0.74%	0.85%	0.77%	0.20%	-0.03%
过去三个月	—	0.84%	0.24%	0.86%	-0.24%	-0.02%
过去六个月	-8.83%	1.05%	-7.87%	1.07%	-0.96%	-0.02%
过去一年	-0.72%	1.13%	0.80%	1.14%	-1.52%	-0.01%
自基金合同生效日起至今（2012年06月25日-2014年06月30日）	-4.00%	1.08%	-8.93%	1.15%	4.93%	-0.07%

注：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



§ 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。

目前，除本基金外，长安基金管理有限公司另管理3只开放式证券投资基金，基本情况如下：

1、长安宏观策略股票型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

成立日期：2012年3月9日

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。

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。

3、长安产业精选灵活配置混合型发起式证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

成立日期：2014年5月7日

投资目标：本基金通过把握宏观经济转折点，灵活配置权益类资产和固定收益类资产，并在严格控制下行风险的基础上，力争实现基金资产较高的长期稳健回报。

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	2014年8月22日	7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，现任基金经理、研究部副总经理，2012年6月25日至2014年8月22日任长安沪深300非周期行业指数基金的基金经理。
雷宇	本基金的基金经理	2014年8月22日		14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，2014年8月22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合规守信情况的说明

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

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

在本报告期内，作为被动型指数基金，长安沪深300非周期行业指数基金严格恪守本基金的投资理念和投资目标，努力实现对基准的有效跟踪。在基金运作期间，本基金管理人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，努力将基金的跟踪误差控制在较低水平。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2014年06月30日，本基金份额净值为0.960元。报告期内，本基金份额净值增长率为-8.83%，同期业绩基准增长率为-7.87%。

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，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。

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，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。

4.7 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6月25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20%”。截至2014年6月30日，本基金未进行利润分配。

§ 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，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：2014年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2014年06月30日	上年度末 2013年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.6.1	2,074,417.85	2,924,496.43
结算备付金		—	18,538.30
存出保证金		5,985.85	13,482.25
交易性金融资产	6.4.6.2	21,977,504.98	29,653,786.81
其中：股票投资		21,977,504.98	29,653,786.81
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	6.4.6.3	—	—
买入返售金融资产	6.4.6.4	—	—
应收证券清算款		163,939.99	—
应收利息	6.4.6.5	463.81	649.65
应收股利		—	—
应收申购款		—	789.05
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.6.6	—	—
资产总计		24,222,312.48	32,611,742.49
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014年06月30日	上年度末 2013年12月31日

负 债：			
短期借款		—	—
交易性金融负债		—	—
衍生金融负债	6.4.6.3	—	—
卖出回购金融资产款		—	—
应付证券清算款		20,698.75	—
应付赎回款		47,094.51	66,978.91
应付管理人报酬		19,164.92	27,703.20
应付托管费		2,874.76	4,155.47
应付销售服务费		—	—
应付交易费用	6.4.6.7	5,300.64	13,774.88
应交税费		—	—
应付利息		—	—
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	6.4.6.8	752,878.47	1,098,840.60
负债合计		848,012.05	1,211,453.06
所有者权益：			
实收基金	6.4.6.9	24,352,216.27	29,827,760.86
未分配利润	6.4.6.10	-977,915.84	1,572,528.57
所有者权益合计		23,374,300.43	31,400,289.43
负债和所有者权益总计		24,222,312.48	32,611,742.49

注：1、报告截止日2014年06月30日，基金份额净值0.960元，基金份额总额24,352,216.27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：2014年01月01日-2014年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期2014年01月01 日-2014年06月30 日	上年度可比期间 2013年01月01日-2013 年06月30日

一、收入		-2,085,264.76	1,947,686.42
1. 利息收入		9,585.19	23,019.12
其中：存款利息收入	6.4.6.11	9,585.19	23,019.12
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）		-175,992.08	7,103,935.31
其中：股票投资收益	6.4.6.12	-417,877.89	6,671,880.12
基金投资收益		—	—
债券投资收益	6.4.6.13	—	—
资产支持证券投资收益		—	—
贵金属投资收益	6.4.6.14	—	—
衍生工具收益	6.4.6.15	—	—
股利收益	6.4.6.16	241,885.81	432,055.19
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.6.17	-1,923,159.15	-5,292,366.48
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.6.18	4,301.28	113,098.47
减：二、费用		466,088.42	951,048.39
1. 管理人报酬		130,960.70	365,661.47
2. 托管费		19,644.06	54,849.19
3. 销售服务费		—	—
4. 交易费用	6.4.6.19	21,294.63	210,217.61
5. 利息支出		—	—

其中：卖出回购金融资产支出		—	—
6. 其他费用	6.4.6.20	294,189.03	320,320.12
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-2,551,353.18	996,638.03
减：所得税费用		—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-2,551,353.18	996,638.03

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：2014年01月01日-2014年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2014年01月01日-2014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)	29,827,760.86	1,572,528.57	31,400,289.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	-2,551,353.18	-2,551,353.18
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)	-5,475,544.59	908.77	-5,474,635.82
其中：1. 基金申购款	499,231.09	2,700.79	501,931.88
2. 基金赎回款（以“-”号填列）	-5,974,775.68	-1,792.02	-5,976,567.70
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）	24,352,216.27	-977,915.84	23,374,300.43
项目	上年度可比期间 2013年01月01日-2013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)	128,002,700.63	1,558,041.42	129,560,742.05
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	996,638.03	996,638.03
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)	-84,072,975.73	-4,003,235.20	-88,076,210.93
其中：1. 基金申购款	2,425,479.13	136,723.00	2,562,202.13
2. 基金赎回款(以“-”号填列)	-86,498,454.86	-4,139,958.20	-90,638,413.06
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)	43,929,724.90	-1,448,555.75	42,481,169.15

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

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

主管会计工作负责人

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%，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。

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<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。

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2014年06月30日的财务状况、自2014年1月1日至2014年06月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.3.1 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2014年1月1日至2014年06月30日止。

6.4.3.2 记账本位币

人民币

6.4.3.3 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。

6.4.3.4 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。

6.4.3.5 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的事件的，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的事件，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。

6.4.3.6 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。

6.4.3.7 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。

6.4.3.8 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)”。

6.4.3.9 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。

6.4.3.10 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。

6.4.3.11 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。

6.4.3.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于特殊事项停牌股票，根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，本基金参考《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》对重大影响基金资产净值的特殊事项停牌股票进行估值。

对于在锁定期内的非公开发行股票，中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》（以下简称“《证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价的通知》”），若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易所交易天数占锁定期内总交易所交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

在银行间同业市场交易的债券品种，根据《证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

6.4.4 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.4.1 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。

6.4.4.2 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。

6.4.4.3 差错更正的说明

本基金在本年度未发生过重大会计差错。

6.4.5 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。

6.4.6 重要财务报表项目的说明

6.4.6.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2014年06月30日
活期存款	2,074,417.85
合计	2,074,417.85

6.4.6.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2014年06月30日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		22,431,291.54	21,977,504.98	-453,786.56
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—
债券	交易所市场	—	—	—
	银行间市场	—	—	—
	合计	—	—	—
资产支持证券		—	—	—
其他		—	—	—
合计		22,431,291.54	21,977,504.98	-453,786.56

6.4.6.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.6.4 买入返售金融资产

6.4.6.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.6.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未通过买断式逆回购交易取得债券。

6.4.6.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2014年06月30日
应收活期存款利息	460.25
应收结算备付金利息	—
应收债券利息	—
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	0.86

应收黄金合约拆借孳息	—
其他	2.70
合计	463.81

注：其他为结算保证金利息收入。

6.4.6.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.6.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2014年06月30日
交易所市场应付交易费用	5,300.64
银行间市场应付交易费用	—
合计	5,300.64

6.4.6.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2014年06月30日
应付券商交易单元保证金	500,000.00
应付赎回费	—
应付指数使用费	1,203.77
应付其他	8,689.44
预提审计费用	29,752.78
指数化信息披露费	213,232.48
合计	752,878.47

6.4.6.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2014年01月01日-2014年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	29,827,760.86	29,827,760.86
本期申购	499,231.09	499,231.09
本期赎回（以“-”号填列）	-5,974,775.68	-5,974,775.68
本期末	24,352,216.27	24,352,216.27

注：1、申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

2、本基金自2012年5月14日至2012年6月20日止期间公开发售，共募集有效净认购资金277,072,819.54元，折合277,072,819.54份基金份额；在募集期间认购资金产生的利息为人民币60,013.22元，折合60,013.22元份基金份额；以上实收基金（本息）合计为人民币277,132,832.76元，折合277,132,832.76份基金份额。

6.4.6.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,987,729.06	-1,415,200.49	1,572,528.57
本期利润	-628,194.03	-1,923,159.15	-2,551,353.18
本期基金份额交易产生的变动数	-504,865.74	505,774.51	908.77
其中：基金申购款	46,908.35	-44,207.56	2,700.79
基金赎回款（以“-”号填列）	-551,774.09	549,982.07	-1,792.02
本期已分配利润	—	—	—
本期末	1,854,669.29	-2,832,585.13	-977,915.84

6.4.6.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2014年01月01日-2014年06月30日
活期存款利息收入	9,463.94
结算备付金利息收入	42.37
其他	78.88
合计	9,585.19

6.4.6.12 股票投资收益

6.4.6.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2014年01月01日-2014年06月30日
卖出股票成交总额	8,747,836.53
减：卖出股票成本总额	9,165,714.42
买卖股票差价收入	-417,877.89

6.4.6.13 债券投资收益

本基金本报告期内未获得债券投资收益。

6.4.6.14 贵金属投资收益

6.4.6.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内未进行贵金属投资。

6.4.6.15 衍生工具收益

6.4.6.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内未获得衍生工具收益。

6.4.6.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2014年01月01日-2014年06月30日
股票投资产生的股利收益	241,885.81
基金投资产生的股利收益	—
合计	241,885.81

6.4.6.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期
	2014年01月01日-2014年06月30日
1. 交易性金融资产	-1,923,159.15
——股票投资	-1,923,159.15
——债券投资	—

—资产支持证券投资	—
—基金投资	—
—贵金属投资	—
—其他	—
2. 衍生工具	—
—权证投资	—
3. 其他	—
合计	-1,923,159.15

6.4.6.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年01月01日-2014年06月30日
基金赎回费收入	4,301.28
合计	4,301.28

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的25%归入基金资产。

6.4.6.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2014年01月01日-2014年06月30日
交易所市场交易费用	21,294.63
银行间市场交易费用	—
合计	21,294.63

6.4.6.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2014年01月01日-2014年06月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	213,232.48

银行手续费	—
指数使用费	51,203.77
银行间帐户维护费	—
其他费用	—
合计	294,189.03

6.4.7 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.7.1 或有事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

6.4.7.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

6.4.8 关联方关系

6.4.8.1 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

本报告期内不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。

6.4.8.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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。

6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.9.1.1 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。

6.4.9.1.2 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。

6.4.9.1.3 债券回购交易

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。

6.4.9.1.4 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。

6.4.9.1.5 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。

6.4.9.2 关联方报酬

6.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2014年01月01日-2014年 06月30日	上年度可比期间 2013年01月01日-2013年06月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	130,960.70	365,661.47
其中：支付销售机构的客户维护费	38,972.55	108,143.64

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1.0%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。

6.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2014年01月01日-2014年 06月30日	上年度可比期间 2013年01月01日-2013年06月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	19,644.06	54,849.19

注：支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值0.15%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。

6.4.9.3 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。

6.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.9.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内基金管理人没有投资本基金的情况。

6.4.9.4.2 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

本基金本报告期内其他关联方没有投资本基金的情况。

6.4.9.5 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 2014年01月01日-2014年06月30 日		上年度可比期间 2013年01月01日-2013年06月30 日	
	期末 余额	当期 存款利息收入	期末 余额	当期 存款利息收入
广发银行股份 有限公司	2,074,417.85	9,463.94	3,458,396.19	21,226.98

注：本基金的银行存款由基金托管人广发银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.9.6 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参与关联方承销证券的买卖。

6.4.9.7 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。

6.4.10 利润分配情况

6.4.10.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金本年未进行利润分配。

6.4.11 期末（2014年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.11.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

根据《证券发行与承销管理办法(2012年修订)》，证券投资基金参与网下配售，可与发行人、承销商自主约定网下配售股票的持有期限。持有期自公开发行的股票上市之日起计算。在持有期内的股票为流动受限制而不能自由转让的资产。基金通过网上申购获配的新股，从新股获配日至该新股上市日期间，为流通受限制而不能自由转让的资产。此外，基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起12个月内不得转让。

于2014年06月30日，本基金未因认购新发或增发证券而持有流通受限证券。

6.4.11.2 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	期末 成本总额	期末 估值总额
600498	烽火通信	2014-06-27	筹划股权激励	11.91		—	5,570	66,355.28	66,338.70
600582	天地科技	2014-06-25	重大事项	7.97		—	3,920	43,979.19	31,242.40
600637	百视通	2014-05-28	重大事项	32.03		—	6,069	140,509.47	194,390.07
600832	东方明珠	2014-05-28	资产整合	10.98		—	12,889	78,608.73	141,521.22
601669	中国电建	2014-05-12	重大事项	2.79		—	37,294	126,578.83	104,050.26
000009	中国宝安	2014-05-27	重大事项	10.21		—	11,256	108,449.11	114,923.76
000536	华映科技	2014-05-22	重大事项	23.10		—	1,685	40,284.50	38,923.50
002570	贝因美	2014-06-18	重大事项	14.36		—	5,707	59,829.38	81,952.52

注：本基金截至2014年06月30日止持有以上因公布的重大事项等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。

6.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.11.3.1 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。

6.4.11.3.2 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。

6.4.12 金融工具风险及管理

6.4.12.1 风险管理政策和组织架构

本基金为被动型股票型指数基金，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。

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（但须符合中国证监会相关规定）。

本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人按照“健全、合理、制衡、独立”的原则，建立了合规与风险管理委员会（董事会层面）、督察长、监察稽核部和相关部门构成的全方位、多层级的合规风险管理架构。本基金管理人秉承全面风险管理的理念，将风险管理贯穿日常经营活动的整个过程，渗透到各个业务环节，覆盖所有部门和岗位，建立了集风险识别、风险测量、风险控制、风险评价、风险报告为一体的风险管理机制，全面、及时识别、分析和评估各类风险，有效防范日常经营和基金运作过程中可能面临的各种风险，最大限度地保护基金份额持有人的合法权益。

6.4.12.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行广发银行，因而与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，因此违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

6.4.12.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的

10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的10%。

本基金所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.12.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.12.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等，其余大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

本基金于2014年末未持有债券投资，无重大利率风险，因而未进行敏感性分析。银行存款及结算备付金之浮动利率根据中国人民银行的基准利率和相关机构的相关政策浮动。

6.4.12.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末2014年 06月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,074,417.85	—	—	—	2,074,417.85
存出保证金	5,985.85	—	—	—	5,985.85
交易性金融资产	—	—	—	21,977,504.98	21,977,504.98
应收证券清算	—	—	—	163,939.99	163,939.99

款					
应收利息	—	—	—	463.81	463.81
资产总计	2,080,403.70	—	—	22,141,908.78	24,222,312.48
负债					
应付证券清算款	—	—	—	20,698.75	20,698.75
应付赎回款	—	—	—	47,094.51	47,094.51
应付管理人报酬	—	—	—	19,164.92	19,164.92
应付托管费	—	—	—	2,874.76	2,874.76
应付交易费用	—	—	—	5,300.64	5,300.64
其他负债	—	—	—	752,878.47	752,878.47
负债总计	—	—	—	848,012.05	848,012.05
利率敏感度缺口	2,080,403.70	—	—	21,293,896.73	23,374,300.43
上年度末2013年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,924,496.43	—	—	—	2,924,496.43
结算备付金	18,538.30	—	—	—	18,538.30
存出保证金	13,482.25	—	—	—	13,482.25
交易性金融资产	—	—	—	29,653,786.81	29,653,786.81
应收利息	—	—	—	649.65	649.65
应收申购款	—	—	—	789.05	789.05
资产总计	2,956,516.98	—	—	29,655,225.51	32,611,742.49
负债					
应付赎回款	—	—	—	66,978.91	66,978.91
应付管理人报	—	—	—	27,703.20	27,703.20

酬					
应付托管费	—	—	—	4,155.47	4,155.47
应付交易费用	—	—	—	13,774.88	13,774.88
其他负债	—	—	—	1,098,840.60	1,098,840.60
负债总计	—	—	—	1,211,453.06	1,211,453.06
利率敏感度缺口	2,956,516.98	—	—	28,443,772.45	31,400,289.43

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.12.4.1.2 利率风险的敏感性分析

截至本报告期末，本基金未持有受重大利率风险影响的投资品种。

6.4.12.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.12.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票，所面临的其他价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.4.12.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末		上年度末	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	21,977,504.98	94.02	29,653,786.81	94.44
交易性金融资产-债券投资	—	—	—	—

交易性金融资产-贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产-权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	21,977,504.98	94.02	29,653,786.81	94.44

6.4.12.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深300非周期指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末	上年度末
	沪深300非周期指数上升5%	1,076,354.73	1,190,459.60
	沪深300非周期指数下降5%	-1,076,354.73	-1,190,459.60

6.4.13 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2014年06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21,204,162.55元，属于第二层级的余额为773,342.43，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（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	21,977,504.98	90.73
	其中：股票	21,977,504.98	90.73
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	2,074,417.85	8.56
7	其他各项资产	170,389.65	0.70
8	合计	24,222,312.48	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	148,508.92	0.64
B	采矿业	—	—
C	制造业	14,167,509.12	60.61
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,633,841.09	6.99
E	建筑业	1,445,460.83	6.18
F	批发和零售业	1,195,935.90	5.12
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	1,757,677.25	7.52
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	422,011.18	1.81
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	425,719.75	1.82
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	385,961.76	1.65
S	综合	394,879.18	1.69
	合计	21,977,504.98	94.02

7.2.2 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。

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所有股票投资明细

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	000651	格力电器	20,999	618,420.55	2.65
2	600519	贵州茅台	4,021	570,901.58	2.44

3	600887	伊利股份	14,261	472,324.32	2.02
4	600104	上汽集团	28,867	441,665.10	1.89
5	601668	中国建筑	136,150	383,943.00	1.64
6	000858	五粮液	16,713	299,664.09	1.28
7	600900	长江电力	45,004	279,924.88	1.20
8	601989	XD中国重	57,559	277,434.38	1.19
9	000333	美的集团	14,287	276,024.84	1.18
10	000800	一汽轿车	28,282	271,507.20	1.16
11	002024	苏宁云商	40,484	265,575.04	1.14
12	600050	中国联通	75,837	244,953.51	1.05
13	600089	特变电工	28,423	241,311.27	1.03
14	000538	云南白药	4,598	240,015.60	1.03
15	000063	中兴通讯	17,581	230,662.72	0.99
16	600276	恒瑞医药	6,790	225,156.40	0.96
17	600535	天士力	5,771	223,741.67	0.96
18	600011	华能国际	38,611	218,538.26	0.93
19	600690	青岛海尔	14,596	215,436.96	0.92
20	000895	双汇发展	5,968	213,594.72	0.91
21	002594	比亚迪	4,407	209,288.43	0.90
22	600196	复星医药	10,292	207,795.48	0.89
23	600518	康美药业	13,894	207,715.30	0.89
24	600256	广汇能源	28,024	196,728.48	0.84
25	600637	百视通	6,069	194,390.07	0.83
26	601766	中国南车	42,051	189,229.50	0.81
27	000725	京东方A	85,128	184,727.76	0.79
28	600739	辽宁成大	12,048	183,491.04	0.79
29	002415	海康威视	10,607	179,682.58	0.77
30	002241	歌尔声学	6,688	178,302.08	0.76
31	000157	中联重科	39,659	175,689.37	0.75
32	000338	潍柴动力	9,844	175,124.76	0.75
33	600406	国电南瑞	13,016	173,503.28	0.74

34	600352	浙江龙盛	10,568	170,673.20	0.73
35	000069	华侨城 A	36,212	169,834.28	0.73
36	600703	三安光电	7,246	169,773.78	0.73
37	600795	国电电力	78,103	169,483.51	0.73
38	601299	中国北车	36,429	165,387.66	0.71
39	600886	国投电力	31,161	158,921.10	0.68
40	601390	中国中铁	61,572	158,855.76	0.68
41	600315	上海家化	4,268	156,422.20	0.67
42	000423	东阿阿胶	4,672	155,671.04	0.67
43	000100	TCL 集团	68,249	155,607.72	0.67
44	600804	鹏博士	10,519	151,894.36	0.65
45	000581	威孚高科	5,608	151,247.76	0.65
46	600309	万华化学	9,836	149,113.76	0.64
47	002450	康得新	6,460	146,965.00	0.63
48	002304	洋河股份	2,833	143,774.75	0.62
49	002236	大华股份	5,296	142,727.20	0.61
50	600832	东方明珠	12,889	141,521.22	0.61
51	002353	杰瑞股份	3,484	140,231.00	0.60
52	002065	东华软件	6,936	139,552.32	0.60
53	600031	三一重工	27,303	137,607.12	0.59
54	002230	科大讯飞	5,008	133,212.80	0.57
55	002202	金风科技	13,823	131,180.27	0.56
56	601186	中国铁建	28,048	129,301.28	0.55
57	600066	宇通客车	7,973	128,684.22	0.55
58	600600	青岛啤酒	3,170	126,990.20	0.54
59	002456	欧菲光	5,872	125,836.96	0.54
60	002008	大族激光	7,200	124,848.00	0.53
61	000503	海虹控股	6,400	124,800.00	0.53
62	600100	同方股份	13,900	123,849.00	0.53
63	600332	白云山	4,926	122,608.14	0.52
64	600079	人福医药	4,101	122,414.85	0.52

65	000768	中航飞机	11,603	122,179.59	0.52
66	600893	航空动力	4,606	118,696.62	0.51
67	600150	中国船舶	5,567	117,241.02	0.50
68	000061	农产品	12,500	115,375.00	0.49
69	600177	雅戈尔	16,408	115,348.24	0.49
70	000009	中国宝安	11,256	114,923.76	0.49
71	000826	桑德环境	5,005	114,364.25	0.49
72	002038	双鹭药业	2,557	113,965.49	0.49
73	601991	大唐发电	31,426	111,876.56	0.48
74	000793	华闻传媒	9,220	108,335.00	0.46
75	000400	许继电气	5,367	107,608.35	0.46
76	601607	上海医药	8,616	107,096.88	0.46
77	600674	川投能源	9,122	107,092.28	0.46
78	601669	中国电建	37,294	104,050.26	0.45
79	002081	金螳螂	7,321	103,665.36	0.44
80	600839	四川长虹	33,549	103,330.92	0.44
81	000568	泸州老窖	6,295	103,112.10	0.44
82	600718	东软集团	7,599	102,510.51	0.44
83	601633	长城汽车	4,004	101,301.20	0.43
84	002400	省广股份	4,100	100,778.00	0.43
85	600085	同仁堂	5,779	100,727.97	0.43
86	600271	航天信息	4,789	99,946.43	0.43
87	000623	吉林敖东	6,429	99,778.08	0.43
88	000963	华东医药	1,823	98,442.00	0.42
89	002465	海格通信	6,100	97,173.00	0.42
90	600642	申能股份	22,435	96,919.20	0.41
91	000917	电广传媒	6,300	95,949.00	0.41
92	000970	中科三环	8,066	95,824.08	0.41
93	002422	科伦药业	2,378	94,763.30	0.41
94	603000	人民网	2,400	94,056.00	0.40
95	601098	中南传媒	6,482	93,600.08	0.40

96	600118	中国卫星	5,048	93,287.04	0.40
97	600597	光明乳业	5,811	93,208.44	0.40
98	601117	中国化学	17,746	92,456.66	0.40
99	600252	中恒集团	7,826	91,798.98	0.39
100	601929	吉视传媒	7,900	90,376.00	0.39
101	600741	华域汽车	9,064	88,645.92	0.38
102	002475	立讯精密	2,700	88,506.00	0.38
103	600372	中航电子	3,868	87,687.56	0.38
104	600068	葛洲坝	23,413	86,862.23	0.37
105	002410	广联达	3,284	86,828.96	0.37
106	601933	永辉超市	13,603	85,970.96	0.37
107	601888	中国国旅	2,591	85,606.64	0.37
108	002385	大北农	7,418	84,268.48	0.36
109	600166	福田汽车	16,455	83,920.50	0.36
110	600867	通化东宝	6,400	83,392.00	0.36
111	000425	徐工机械	12,166	83,337.10	0.36
112	000792	盐湖股份	5,511	83,050.77	0.36
113	000729	燕京啤酒	12,748	82,862.00	0.35
114	002570	贝因美	5,707	81,952.52	0.35
115	601618	中国中冶	47,534	81,283.14	0.35
116	600875	东方电气	6,736	79,956.32	0.34
117	601800	中国交建	21,010	78,997.60	0.34
118	600027	华电国际	25,309	77,698.63	0.33
119	600108	亚盛集团	14,000	77,420.00	0.33
120	600060	海信电器	8,022	77,412.30	0.33
121	000598	兴蓉投资	16,130	76,940.10	0.33
122	600863	内蒙华电	19,799	74,642.23	0.32
123	600153	建发股份	13,590	74,065.50	0.32
124	002007	华兰生物	2,837	74,045.70	0.32
125	000876	新希望	6,425	72,538.25	0.31
126	600588	用友软件	5,132	72,207.24	0.31

127	601118	海南橡胶	11,578	71,088.92	0.30
128	600827	友谊股份	6,472	71,062.56	0.30
129	600873	梅花生物	13,852	71,060.76	0.30
130	600008	首创股份	11,172	69,042.96	0.30
131	600880	博瑞传播	5,800	68,672.00	0.29
132	600655	豫园商城	9,144	67,299.84	0.29
133	601179	中国西电	18,600	66,402.00	0.28
134	600267	海正药业	4,474	66,349.42	0.28
135	600498	烽火通信	5,570	66,338.70	0.28
136	601928	凤凰传媒	7,006	65,015.68	0.28
137	000999	华润三九	3,503	64,420.17	0.28
138	600664	哈药股份	10,303	64,084.66	0.27
139	002129	中环股份	3,353	63,941.71	0.27
140	002310	东方园林	3,861	63,745.11	0.27
141	600316	洪都航空	3,700	63,233.00	0.27
142	600688	上海石化	19,150	63,003.50	0.27
143	002292	奥飞动漫	1,700	62,390.00	0.27
144	600062	华润双鹤	3,610	62,055.90	0.27
145	002001	新 和 成	4,953	61,367.67	0.26
146	600415	小商品城	12,193	61,330.79	0.26
147	600143	金发科技	13,684	60,346.44	0.26
148	600648	外高桥	2,238	59,620.32	0.26
149	002344	海宁皮城	4,725	58,920.75	0.25
150	601238	广汽集团	7,643	57,551.79	0.25
151	002375	亚厦股份	2,465	55,610.40	0.24
152	601231	环旭电子	1,800	55,512.00	0.24
153	600436	片仔癀	703	54,503.59	0.23
154	000839	中信国安	7,032	53,443.20	0.23
155	600216	浙江医药	5,766	52,758.90	0.23
156	002294	信立泰	1,748	52,474.96	0.22
157	000883	湖北能源	9,700	51,119.00	0.22

158	002106	莱宝高科	4,474	50,556.20	0.22
159	000413	东旭光电	6,500	48,750.00	0.21
160	601158	重庆水务	9,503	46,944.82	0.20
161	600170	上海建工	10,660	45,731.40	0.20
162	600895	张江高科	6,767	44,120.84	0.19
163	002399	海普瑞	2,348	43,860.64	0.19
164	002429	兆驰股份	5,500	42,570.00	0.18
165	600058	五矿发展	3,881	40,944.55	0.18
166	002051	中工国际	2,525	40,905.00	0.17
167	601258	庞大集团	9,265	40,673.35	0.17
168	002653	海思科	2,101	40,339.20	0.17
169	600783	鲁信创投	2,435	39,106.10	0.17
170	000536	华映科技	1,685	38,923.50	0.17
171	000027	深圳能源	6,900	38,778.00	0.17
172	600998	九州通	2,800	37,492.00	0.16
173	600546	山煤国际	10,467	37,471.86	0.16
174	601216	内蒙君正	3,400	35,802.00	0.15
175	002603	以岭药业	1,193	35,098.06	0.15
176	002470	金正大	1,800	34,542.00	0.15
177	000869	张裕A	1,423	34,308.53	0.15
178	600023	浙能电力	7,100	32,092.00	0.14
179	600582	天地科技	3,920	31,242.40	0.13
180	600809	山西汾酒	2,290	30,411.20	0.13
181	600096	云天化	4,282	30,102.46	0.13
182	600633	浙报传媒	2,100	27,867.00	0.12
183	002416	爱施德	1,800	26,730.00	0.11
184	603699	纽威股份	1,300	25,311.00	0.11
185	601139	深圳燃气	3,567	23,827.56	0.10
186	000156	华数传媒	800	22,472.00	0.10
187	000961	中南建设	3,071	20,053.63	0.09

7.3.2 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。

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	002065	东华软件	166,047.00	0.53
2	600519	贵州茅台	136,080.12	0.43
3	000503	海虹控股	124,608.00	0.40
4	002008	大族激光	122,898.19	0.39
5	002400	省广股份	100,204.00	0.32
6	603000	人民网	96,057.76	0.31
7	000917	电广传媒	92,232.00	0.29
8	002465	海格通信	91,317.00	0.29
9	601929	吉视传媒	90,432.00	0.29
10	002475	立讯精密	83,700.00	0.27
11	002410	广联达	82,626.44	0.26
12	600867	通化东宝	81,856.00	0.26
13	002415	海康威视	78,662.00	0.25
14	600688	上海石化	74,844.00	0.24
15	002594	比亚迪	74,595.00	0.24
16	600089	特变电工	73,544.00	0.23
17	600887	伊利股份	72,695.00	0.23
18	002241	歌尔声学	69,959.00	0.22
19	002129	中环股份	68,280.00	0.22
20	600880	博瑞传播	67,463.00	0.21

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。

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	344,387.52	1.10
2	000651	格力电器	224,573.41	0.72
3	600887	伊利股份	176,188.40	0.56
4	002024	苏宁云商	165,020.86	0.53
5	000538	云南白药	154,977.99	0.49
6	002594	比亚迪	140,026.80	0.45
7	600104	上汽集团	137,638.76	0.44
8	601668	中国建筑	124,791.66	0.40
9	000333	美的集团	117,520.50	0.37
10	000100	TCL 集团	117,004.51	0.37
11	002304	洋河股份	110,592.86	0.35
12	600196	复星医药	110,161.79	0.35
13	601989	中国重工	110,073.22	0.35
14	600535	天士力	108,441.34	0.35
15	600900	长江电力	107,784.87	0.34
16	600406	国电南瑞	105,746.87	0.34
17	600718	东软集团	104,046.23	0.33
18	000858	五粮液	99,985.64	0.32
19	600315	上海家化	99,902.53	0.32
20	600089	特变电工	99,170.27	0.32

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。

7.4.3 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	3,412,566.06
卖出股票的收入（成交）总额	8,747,836.53

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。

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。

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

本基金本报告期末进行贵金属投资。

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

本基金本报告期末进行股指期货交易。

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 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。

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 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。

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	5,985.85
2	应收证券清算款	163,939.99
3	应收股利	—

4	应收利息	463.81
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	其他	—
8	合计	170,389.65

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。

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。

7.12.6 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		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
727	33,496.86	1,665,318.56	6.84%	22,686,897.71	93.16%

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	174,527.49	0.72%

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

§ 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	29,827,760.86
本报告期基金总申购份额	499,231.09
减：本报告期基金总赎回份额	5,974,775.68
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	24,352,216.27

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。

§ 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

一、报告期内基金管理人发生以下重大人事变动：

1、2014年4月3日，在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》上刊登了《长安基金管理有限公司副总经理王健任职公告》，同意王健担任公司副总经理职务。

2、2014年4月9日，在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》上刊登了《长安基金管理有限公司督察长袁明任职公告》，同意袁明担任公司督察长职务，总经理黄陈不再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：

1、本基金基金托管人2014年5月5日发布公告，禄金山先生不再担任广发银行股份有限公司资产托管部总经理，任命寻卫国先生担任资产托管部总经理。

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)(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)的报酬为人民币捌万元整,为2013年年度审计费用。

10.6 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。

10.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		债券交易		债券回购交易		权证交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占股票成交总额比例	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	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券	1	5,574,729.72	45.84%		—		—		—	5,075.28	45.84%	
中信建投	1	6,585,672.87	54.16%		—		—		—	5,995.55	54.16%	
招商证券	1	0.16	—		—		—		—	—	—	

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。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	信息披露方式	披露日期
1	长安沪深300非周期行业指数证券投资基金2013年第4季度报告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、证券日报	2014-01-22
2	长安沪深300非周期行业指数证券投资基金招募说明书2013年第二次更新	中国证券报、上海证券报、 证券时报、证券日报	2014-01-24
3	长安沪深300非周期行业指数证券投资基金招募说明书2013年第二次更新摘要	中国证券报、上海证券报、 证券时报、证券日报	2014-01-24
4	关于增加华泰证券股份有限公司有为长安基金旗下基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、证券日报	2014-03-12
5	长安沪深300非周期行业指数证券投资基金2013年年度报告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、证券日报	2014-03-29
6	长安沪深300非周期行业指数证券投资基金2013年年度报告摘要	中国证券报、上海证券报、 证券时报、证券日报	2014-03-29
7	长安基金管理有限公司关于旗下基金在上海好买基金销售有限公司开通定期定额投资业务并参加费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、证券日报	2014-03-29
8	关于增加浙江同花顺基金销售有限公司和安信证券股份有限公司为长安基金旗下基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、证券日报	2014-04-02
9	长安基金管理有限公司副总经理王健任职公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、证券日报	2014-04-03
10	关于增加齐鲁证券有限公司、和讯信息科技有限公司、中期时代	中国证券报、上海证券报、 证券时报、证券日报	2014-04-08

	基金销售（北京）有限公司和北京钱景财富投资管理有限公司为长安基金旗下基金代销机构的公告		
11	长安基金管理有限公司督察长袁明任职公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2014-04-09
12	长安沪深300非周期行业指数证券投资基金2014年第1季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2014-04-21
13	关于增加西南证券股份有限公司为长安基金旗下基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2014-04-24
14	长安基金管理有限公司关于从业人员在子公司兼任职务及领薪情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2014-06-17
15	长安基金管理有限公司关于旗下基金在浙江同花顺基金销售有限公司开通定期定额投资业务并参加费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2014-06-26
16	长安基金管理有限公司关于旗下基金2014年6月30日基金资产净值、基金份额净值及基金份额累计净值的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2014-06-30

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立长安沪深300非周期行业指数证券投资基金的文件。
- 2、长安沪深300非周期行业指数证券投资基金基金合同。

- 3、长安沪深300非周期行业指数证券投资基金托管协议。
- 4、中国证监会批准设立长安基金管理有限公司的文件。
- 5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告。

12.2 存放地点

上海市浦东新区芳甸路1088号紫竹国际大厦16层

12.3 查阅方式

www.changanfunds.com

长安基金管理有限公司
二〇一四年八月二十八日