

长安沪深300非周期行业指数证券投资基金

2016年第3季度报告

2016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：2016年10月24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2016年10月21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2016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	56,629,218.05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（2016年07月01日-2016年09月30日）
1. 本期已实现收益	946,438.70
2. 本期利润	3,439,971.11
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0613
4. 期末基金资产净值	73,175,413.78
5. 期末基金份额净值	1.292

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	4.87%	0.82%	3.27%	0.83%	1.60%	-0.01%

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2016年9月30日。

## § 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		
林忠晶	本基金的基金经理	2015年01月27日	—	6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，曾任产品开发部产品经理、基金投资部基金经理助理、战略及产品部副总经理等职，现任长安基金管理有限公司量化投资部（筹）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。
--	--	--	--	--	---

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 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、分析，未发现异常情况，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 报告期内基金的投资策略和运作分析

截止本报告期末，本基金将秉承指数化被动投资策略，积极应对在指数成分股调整和基金申赎对跟踪效果的影响，应用量化技术减少跟踪误差。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2016年9月30日，本基金份额净值为1.292元。本报告期内，本基金净值增长率为4.87%，业绩比较基准收益率为3.27%。本基金跟踪误差产生的主要来源是：1) 标的指数成份股中法律法规禁止本基金投资的股票的影响；2) 申购赎回的影响；3) 成份股票的停牌；4) 指数中成份股票的调整等。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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。

#### 4.7 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金为被动式管理的指数型基金，基金管理人在严守基金合同及相关法律法规的前提下，秉承指数化投资策略，并适当使用指数增强策略，积极应对基金申购赎回等因素基金跟踪误差的影响，努力将本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

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	67,612,980.64	90.93
	其中：股票	67,612,980.64	90.93
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	6,723,027.50	9.04

8	其他资产	20,969.66	0.03
9	合计	74,356,977.80	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

5.2.1.1 报告期末（指数投资）按行业分类的股票投资组合

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	104,188.10	0.14
B	采矿业	—	—
C	制造业	39,577,265.19	54.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,419,629.59	7.41
E	建筑业	4,746,897.85	6.49
F	批发和零售业	2,947,361.14	4.03
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,309,612.25	11.36
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	1,626,407.24	2.22
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	1,073,280.80	1.47
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	207,977.04	0.28
R	文化、体育和娱乐业	2,401,736.82	3.28
S	综合	696,688.24	0.95
	合计	67,111,044.26	91.71

5.2.1.2 报告期末（积极投资）按行业分类的股票投资组合

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	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	331,192.86	0.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	15,383.20	0.02
E	建筑业	57,888.15	0.08
F	批发和零售业	5,764.98	0.01
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	80,082.42	0.11
J	金融业	11,624.77	0.02
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	501,936.38	0.69

### 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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	7,868	2,343,955.88	3.20



2	000651	格力电器	73,702	1,637,658.44	2.24
3	600887	伊利股份	97,802	1,575,590.22	2.15
4	601668	中国建筑	234,298	1,445,618.66	1.98
5	600900	长江电力	103,908	1,381,976.40	1.89
6	000333	美的集团	49,267	1,330,701.67	1.82
7	601766	中国中车	144,161	1,291,682.56	1.77
8	600104	上汽集团	57,841	1,263,825.85	1.73
9	000858	五粮液	29,482	983,519.52	1.34
10	600276	恒瑞医药	21,842	962,140.10	1.31

### 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

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	300526	中潜股份	478	43,765.68	0.06
2	300539	横河模具	967	43,292.59	0.06
3	603986	兆易创新	241	42,890.77	0.06
4	603090	宏盛股份	795	35,751.15	0.05
5	603189	网达软件	1,197	32,462.64	0.04

### 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序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序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序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未进行贵金属交易。

## 5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未进行股指期货交易。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未进行国债期货交易。

## 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	6,900.55
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	1,746.33
5	应收申购款	12,322.78
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	20,969.66

### 5.11.4 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。

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 5.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600887	伊利股份	1,575,590.22	2.15	重大事项

#### 5.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300526	中潜股份	43,765.68	0.06	重大事项
2	603986	兆易创新	42,890.77	0.06	重大事项

#### 5.11.6 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

报告期期初基金份额总额	57,513,574.43
报告期期间基金总申购份额	3,347,188.99
减：报告期期间基金总赎回份额	4,231,545.37
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	—
报告期期末基金份额总额	56,629,218.05

### § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

#### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	6,608,724.39
报告期期间买入/申购总份额	—
报告期期间卖出/赎回总份额	—
报告期期末管理人持有的本基金份额	6,608,724.39
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	11.67

#### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人本报告期内未进行本基金的申购或赎回交易。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1. 本报告期内，基金管理人根据《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、2016年7月20日，长安沪深300非周期行业指数证券投资基金2016年第2季度报告。

2、2016年7月27日，关于旗下基金在北京恒天明泽基金销售有限公司开通申购、赎回、基金转换和定投业务并参与费率优惠活动的公告。

3、2016年7月28日，关于开展长安货币市场证券投资基金A类网上直销基金转换费率优惠的公告。

4、2016年7月30日，长安沪深300非周期行业指数证券投资基金招募说明书2016年第1次更新及摘要。

5、2016年8月2日，关于旗下基金在上海万得投资顾问有限公司开通申购、赎回、基金转换和定投业务并参与费率优惠活动的公告。

6、2016年8月25日，长安沪深300非周期行业指数证券投资基金2016年半年度报告及摘要。

7、2016年9月6日，关于长安基金管理有限公司参加中信建投证券费率优惠活动的公告以及长安基金管理有限公司关于提醒投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告。

8、2016年9月20日，关于旗下基金在交通银行股份有限公司开展手机银行申购费率、定期定额投资优惠费率活动的公告。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 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、长安沪深300非周期行业指数证券投资基金招募说明书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内披露的各项公告。

## 9.2 存放地点

上海市浦东新区芳甸路1088号紫竹国际大厦16层。

## 9.3 查阅方式

投资者可到基金管理人、基金托管人的办公场所或基金管理人网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本管理人。

咨询电话：400-820-9688

公司网址：[www.changanfunds.com](http://www.changanfunds.com)。

长安基金管理有限公司  
二〇一六年十月二十四日