

长安沪深300非周期行业指数证券投资基金

2013第四季度报告

2013年12月31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:2014年1月22日

5.1 重要提示
基金管理人的董事会及高级管理人员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，并对本报告的内容的真实性、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2014年1月21日复核了本报告中的财务数据、净值表现和投资组合报告等內容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
基金管理人和基金托管人承诺以诚实信用、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。投资人应当在做出投资决策前仔细阅读本基金的招募说明书。
本报告期中财务资料未经审计。
本报告期自2013年10月1日起至12月31日止。

5.2 基本产品概况

基金名称	长安沪深300非周期
基金代码	740101
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年5月25日
报告期末基金份额总额	29,827,760.86份

本基金为股票型指数基金，力求通过沪深300非周期行业指数进行完全复制，以达到与沪深300非周期行业指数的走势相一致。
本基金采用完全复制法跟踪标的指数，即按照沪深300非周期行业指数的成分股组成及其权重比例进行被动指数化投资。
投资策略
本基金在投资策略上主要通过股票投资组合的构建和调整，以期获得与沪深300非周期行业指数相似的收益。
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
本基金为股票型基金，其风险和预期收益高于混合型基金、债券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

5.3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	报告期(2013年10月1日-2013年12月31日)	单位:人民币元
1.本期已实现收益	50,956.50	
2.本期利润	-58,732.45	
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0299	
4.期末基金份额净值	31,400.2093	
5.期末基金份额净值	31,400.2093	1.053

注:1.本报告期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利润。

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，计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.基金的净值表现

3.2 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	-3.1%	1.2%	-1.9%	1.2%	-1.15%	0.00%

3.3 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	-3.1%	1.2%	-1.9%	1.2%	-1.15%	0.00%

3.4 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	-3.1%	1.2%	-1.9%	1.2%	-1.15%	0.00%

3.5 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	-3.1%	1.2%	-1.9%	1.2%	-1.15%	0.00%

3.6 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	-3.1%	1.2%	-1.9%	1.2%	-1.15%	0.00%

3.7 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	-3.1%	1.2%	-1.9%	1.2%	-1.15%	0.00%

3.8 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	-3.1%	1.2%	-1.9%	1.2%	-1.15%	0.00%

3.9 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	-3.1%	1.2%	-1.9%	1.2%	-1.15%	0.00%

3.10 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	-3.1%	1.2%	-1.9%	1.2%	-1.15%	0.00%

3.11 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	-3.1%	1.2%	-1.9%	1.2%	-1.15%	0.00%

3.12 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	-3.1%	1.2%	-1.9%	1.2%	-1.15%	0.00%

3.13 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	-3.1%	1.2%	-1.9%	1.2%	-1.15%	0.00%

3.14 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	-3.1%	1.2%	-1.9%	1.2%	-1.15%	0.00%

3.15 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	-3.1%	1.2%	-1.9%	1.2%	-1.15%	0.00%

3.16 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	-3.1%	1.2%	-1.9%	1.2%	-1.15%	0.00%

3.17 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	-3.1%	1.2%	-1.9%	1.2%	-1.15%	0.00%

3.18 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	-3.1%	1.2%	-1.9%	1.2%	-1.15%	0.00%

3.19 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	-3.1%	1.2%	-1.9%	1.2%	-1.15%	0.00%

3.20 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	-3.1%	1.2%	-1.9%	1.2%	-1.15%	0.00%

3.21 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	-3.1%	1.2%	-1.9%	1.2%	-1.15%	0.00%

3.22 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	-3.1%	1.2%	-1.9%	1.2%	-1.15%	0.00%

3.23 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	-3.1%	1.2%	-1.9%	1.2%	-1.15%	0.00%

3.24 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	-3.1%	1.2%	-1.9%	1.2%	-1.15%	0.00%

3.25 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	-3.1%	1.2%	-1.9%	1.2%	-1.15%	0.00%

3.26 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	-3.1%	1.2%	-1.9%	1.2%	-1.15%	0.00%

3.27 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	-3.1%	1.2%	-1.9%	1.2%	-1.15%	0.00%

3.28 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	-3.1%	1.2%	-1.9%	1.2%	-1.15%	0.00%

3.29 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	-3.1%	1.2%	-1.9%	1.2%	-1.15%	0.00%

3.30 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	-3.1%	1.2%	-1.9%	1.2%	-1.15%	0.00%

3.31 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	-3.1%	1.2%	-1.9%	1.2%	-1.15%	0.00%

3.32 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	-3.1%	1.2%	-1.9%	1.2%	-1.15%	0.00%

3.33 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	-3.1%	1.2%	-1.9%	1.2%	-1.15%	0.00%

3.34 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</td
