

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:2013年8月29日

\$ 1 重要提示

基金管理人的董事及监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约定，于2013年8月28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财产，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2013年1月1日起至2013年6月30日止。

\$ 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
报告期基金份额总额	43,929,724.90

2.2 基金产品说明

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。

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构成比例构建股票投资组合，进行被动指数化投资。

沪深300周期行业指数收益率×95%+活期存款利率(税后)*5%

本基金为指数型的股票型基金，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

信息披露义务人姓名

张洪冰 寻卫国

联系电话 021-20329905

电子邮箱 zhanglehongshu@changanfunds.com

客户服务电话 400-820-9688

传真 021-20329888

010-65169555

2.4 信息披露方式

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

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(2013年01月01日-2013年06月30日)

本期已实现收益 6,289,004.51

本期利润 996,638.03

加权平均基金份额本期利润 0.0142

本期平均净值增长率 1.37%

本期基金份额净值增长率 -4.45%

报告期(2013年06月30日)

期末可供分配利润 -1,448,555.75

期末基金份额余额 0.0330

期末基金资产净值 42,481,169.15

期末基金份额净值 0.9670

3.1.3 期末可供分配利润

报告期(2013年06月30日)

未分配利润 -1,448,555.75

所有者权益合计 42,481,169.15

负债和所有者权益总计 43,929,724.90

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将低于所列数字。

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同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 份额净值增长率为① 份额净值增长率为② 业绩比较基准收益率为③

过去一个月 -11.45% 1.54% -11.80% 1.57% 0.35% -0.03%

过去三个月 -5.93% 1.21% -6.63% 1.23% 0.70% -0.02%

过去六个月 -4.45% 1.20% -4.47% 1.21% 0.02% -0.01%

过去一年 -3.20% 1.04% -7.94% 1.16% 4.74% -0.12%

自基金合同生效日起至 2012年06月25日 -3.30% 1.03% -9.65% 1.15% 6.35% -0.12%

(2012年06月25日至2013年6月30日)

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:本基金合同生效之日起6个月为建仓期,建仓期结束时投资组合比例符合基金合同约定。

§ 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:长安国际信托有限公司、上海美特斯邦威服饰有限公司、上海磐石投资有限公司、兵器装备集团财务有限责任公司。

目前,除本基金外,长航基金管理有限公司另管理2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

基金经理:张洪冰

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,通过强化配置行业精选基本面良好、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

基金经理:张洪冰

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。

4.1.2 基金经理(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

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的相关规定。

4.2 管理人对报告期内基金运作指标的说明

本基金报告期内未出现异常情况的说明。

4.3 公平交易制度的执行情况

为了公平对各类投资人,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、公平交易的原则,对买卖股票、债券等有价证券的关联交易进行严格监控。

本基金报告期内未出现违法违规情况且未被处罚。

4.4 管理人对报告期内基金业绩表现的说明

本基金为被动指数型基金,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,分析对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。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金将被动指数型基金,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,分析对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的投资策略分析

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人批准后的估值政策进行估值。对于在交易所上市的证券,采用交易所公布的收盘价作为基金资产的公允价值。

对于在银行间市场交易的债券,采用估值技术确定公允价值。

对于在银行间市场交易的资产支持证券,采用估值技术确定公允价值。

对于在银行间市场交易的黄金,采用估值技术确定公允价值。

对于在银行间市场交易的资产支持票据,采用估值技术确定公允价值。

对于在银行间市场交易的资产支持证券,采用估值技术确定公允价值。

对于在银行间市场交易的资产支持票据,采用估值技术确定公允价值。

对于在银行间市场交易的资产支持票据,采用估值技术确定公允价值。