

(上接B050版)

传真:021-62881889
联系人:王国防
经办注册会计师:王国防、黄小熠

四、基金的名称

长安沪深300非周期行业指数证券投资基金。

五、基金类型

股票型证券投资基金。

六、基金的投资目标

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。

七、基金的投资范围

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股成分股(包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市股票)、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和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)。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种(包括期权等金融衍生品),基金管理人将在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为:沪深300非周期行业指数成分股及其备选股成分股的投资比例不低于基金资产的90%,在任何交易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所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不超过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。如法律法规和中国证监会变更投资品种比例限制的,基金管理人可依相关规定履行适当程序后调整本基金的投资比例规定。

八、基金的投资策略

1. 标的指数

本基金股票资产跟踪的标的指数为沪深300非周期行业指数。

沪深300非周期行业指数是中证指数有限公司编制以沪深300指数成分股中的非周期行业股票作为样本,能够较为全面反映沪深两市A股市场非周期行业运行特点。中证系列指数由中证指数有限公司编制和计算。关于指数值和成分股名单的所有版权均属于中证指数有限公司。

如果沪深300非周期行业指数成分股发生调整和发布,而沪深300非周期行业指数由其他指数替代(单换不影响),或由于指数编制方法等重大变更导致沪深300非周期行业指数不能连续作为标的指数,本基金管理人可以依据审慎性原则和维护基金份额持有人合法权益的原则,在履行适当程序后变更本基金的标的指数和跟踪标的,并依据市场代表性、流动性、与原指数的相关性等因素选择确定新的标的指数。本基金由于上述原因变更标的指数,不需召开基金份额持有人大会通过,但应及时通知本基金托管人并报中国证监会备案,并在履行必要手续后,在中国证监会指定的媒体上公告,并在更新的招募说明书中列示。若本基金由于变更投资目标、范围或策略而变更标的指数的,应当召开基金份额持有人大会。

2. 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。在建仓期结束后,本基金力争将年化跟踪误差控制在4%以内,日跟踪偏离度绝对值的平均值控制在0.35%以内。

在基金运作过程中,当发生以下情况时,基金管理人将发挥专业优势,对投资组合进行适当调整,使跟踪误差控制在限定范围之内。

(1) 标的指数编制方法发生变更。基金管理人将评估指数编制方法变更对指数成分股及权重的影响,在适当时机、采用适当方法调整投资组合。

(2) 成分股发生新增、剔除等定期或临时调整。基金管理人将预测成分股调整影响,并判断指数成分股调整对投资组合的影响,在此基础上制定投资组合调整策略。

(3) 沪深300非周期行业指数成分股出现股本变化、增发、配股、派发现股息等情形。基金管理人将分析这些信息对指数的影响,进而进行投资组合调整分析,确定相应的投资组合调整策略。

(4) 基金发生申购赎回、基金分红、参与新股申购等影响跟踪效果的情形。基金管理人将分析这些情形对跟踪误差的影响,并相应调整投资组合。

(5) 指数成分股的股票停牌、股票流动性不足等其他市场因素的影响,或者法律法规限制等合规因素的影响,使得基金管理人无法依据指数构成购买某成分股的情形。基金管理人将根据市场情况,以跟踪误差最小化为原则,采用替代标的替代方式对投资组合进行调整。

为有效控制投资组合对标的指数的跟踪误差,本基金投资股指期货将本着风险管理的原则,以套期保值为目的,选择流动性好、交易活

跃的合约。本基金管理人将根据宏观经济因素和资本市场状况,通过对现货和期货市场运行趋势的分析,结合股指期货定价模型对其估值和公平合理性的评估,并通过与现货资产进行匹配,选择合适的投资时机,采用多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

运用股指期货的情形主要包括:对冲系统性风险;对冲特殊情况下的流动性风险,如大额申购赎回等;对冲因其原因导致无法有效跟踪标的指数的风险;本基金力争利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位频繁调整而导致的交易成本和跟踪误差,从而确保投资组合对标的指数的跟踪效果。

3. 投资决策依据

以国家有关法律、法规、规章和基金合同的有关规定为投资依据,并以维护基金份额持有人利益为最高准则。

4. 投资决策流程

(1) 合法合规原则。公司各类投资、研究业务都应严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则,自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营风格。

(2) 公平交易原则。公司应公平对待不同基金份额持有人、基金份额持有人和其他资产委托人,不得在不同基金财产之间,基金财产和其他委托资产之间直接或通过第三方交易等形式进行利益输送。公司应制定公平交易制度和公平交易规则,明确公平交易的原则和实施细则。

(3) 独立性原则。公司基金投资、其他委托资产和固有资产的投资应当严格分离;投资、研究、决策、交易和评估等部门/岗位应当在物理上制度上隔离,不同的基金要独立运作,分别管理。

(4) 相互制约原则。投资业务部门和岗位的设置必须权责分明,相互牵制,并通过切实可行的相互制衡措施来消除内部控制中的盲点;

(5) 严格授权原则。授权制度是投资业务管理活动的核心,必须贯穿于公司投资管理活动的全过程;

(6) 研究制约原则。任何基金投资决策都必须建立在有研究支持的基础之上。

5. 投资决策流程

本基金实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。投资决策委员会负责制定基金投资的整体投资理念和投资原则;决定有关标的指数重大调整的对标决策、其他重大组合调整决策以及重大的单项投资决策。基金经理根据投资决策委员会的决策,负责投资组合的构建、调整 and 日常管理等工作。

(1) 投资部运用数量化模型以及各种风险监控指标,对指数化投资的偏差风险和流动性风险进行测算,并提供数量化风险分析报告;研究部对标的指数的成分股的基本面和流动性变化出现变化的企业提供及时的风险分析报告,清算登记部每日提供基金申购赎回的数据分析,供基金经理投资决策参考。

(2) 投资决策委员会定期召开会议,依据上述报告对资产配置制定整体投资策略;如遇重大事项,投资决策委员会及召开临时会议做出决策。

(3) 基金经理根据数量风险分析和申购赎回分析报告,在追求跟踪误差最小化的目标下,控制股票组合与指数的偏差风险、流动性风险,降低交易成本。

(4) 中央交易室依据基金经理指令,制定交易策略,通过组合交易系统执行指数投资组合的交易。

(5) 投资部根据市场变化,定期和不定期地对基金投资业绩进行评估,并提供相关绩效评估报告。

(6) 风险管理部根据市场变化对指数化投资组合的资产配置和调整提出风险防范建议。监察稽核部对指数化投资的执行过程进行风险监控。基金经理依据申购赎回和成份股停牌等情况,对投资组合进行监控和调整,控制投资组合的流动性风险。

九、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为95%×沪深300非周期行业指数收益率+5%×活期存款利率(税后)。

本基金追求对标的指数成分股的充分投资,股票资产占基金资产的比例为90%-95%,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%,因此采用该加权复合方法构建以上业绩比较基准。

如果沪深300非周期行业指数被停止编制及发布,被其他指数替代、指数编制方法出现重大变更等原因导致此业绩比较基准不再适用或有更加适合的业绩比较基准,基金管理人可以依据审慎性原则维护基金份额持有人合法权益的原则,对本基金的业绩比较基准进行调整。本基金由于上述原因变更业绩比较基准,不需召开基金份额持有人大会通过,但应及时通知本基金托管人并报中国证监会备案,并在履行必要手续后,在中国证监会指定信息的媒体上公告,并在更新的招募说明书中列示。若本基金由于变更投资目标、范围或策略而变更标的指数的,相应变更业绩比较基准应当召开基金份额持有人大会。

十、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。

十一、基金投资组合报告

基金管理人、基金托管人及基金服务机构均不存在虚假记载、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,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,认为其真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。本报告中财务资料未经审计。本报告日期自2014年4月1日起至2014年9月30日止。

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	占基金资产净值的比例
1	权益投资	22,072,470.53	89.92
2	其中:股票	22,072,470.53	89.92
3	固定收益投资	-	-
4	其中:债券	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	其中:买入返售金融资产	-	-
8	银行存款和结算备付金合计	2,471,038.20	10.07
9	其他各项资产	4,636.80	0.02
9	合计	24,548,145.53	100.00

2 报告期末按行业分类的股票投资组合:

(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	179,820.66	0.77
B	矿业	21,532.31	0.91
C	制造业	15,899,186.40	69.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,707,848.43	7.38
E	建筑业	1,549,339.29	6.60
F	批发和零售业	1,289,537.11	5.59
G	信息和金融业	-	-
I	信息技术、软件和信息服务业	1,776,199.74	7.57
J	房地产业	-	-
K	医药产业	-	-
L	国防和国防服务业	446,216.39	1.90
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	395,240.80	1.68
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	386,953.58	1.65
S	综合	23,076.83	1.01
	合计	22,072,470.53	94.98

(2) 报告期末(积极投资)按行业分类的股票投资组合

(3) 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

金额单位:人民币元			
序号	股票代码	股票名称	数量(股)
1	000519	贵州茅台	3,528
2	000651	格力电器	19,119
3	600887	伊泰集团	19,034
4	600104	上汽集团	26,463
5	601688	中国铁建	117,247
6	601089	中国重工	50,884
7	600900	长江电力	38,361
8	002024	苏宁云商	24,401
9	000858	五粮液	14,686
10	000535	海润光伏	13,515

(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。

3 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

金额单位:人民币元			
序号	股票代码	股票名称	数量(股)
1	000519	贵州茅台	3,528
2	000651	格力电器	19,119
3	600887	伊泰集团	19,034
4	600104	上汽集团	26,463
5	601688	中国铁建	117,247
6	601089	中国重工	50,884
7	600900	长江电力	38,361
8	002024	苏宁云商	24,401
9	000858	五粮液	14,686
10	000535	海润光伏	13,515

(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。

4 报告期末按债券品种和类属的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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。

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。

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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

营业快证登记号:320681000214978

税务登记注册号:320681952400460

基金管理人、基金托管人及基金服务机构均不存在虚假记载、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,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,认为其真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。本报告中财务资料未经审计。本报告日期自2014年4月1日起至2014年9月30日止。

基金管理人、基金托管人及基金服务机构均不存在虚假记载、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,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,认为其真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。本报告中财务资料未经审计。本报告日期自2014年4月1日起至2014年9月30日止。

基金管理人、基金托管人及基金服务机构均不存在虚假记载、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,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,认为其真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。本报告中财务资料未经审计。本报告日期自2014年4月1日起至2014年9月30日止。

基金管理人、基金托管人及基金服务机构均不存在虚假记载、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,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,认为其真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。本报告中财务资料未经审计。本报告日期自2014年4月1日起至2014年9月30日止。

基金管理人、基金托管人及基金服务机构均不存在虚假记载、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,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,认为其真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。本报告中财务资料未经审计。本报告日期自2014年4月1日起至2014年9月30日止。

基金管理人、基金托管人及基金服务机构均不存在虚假记载、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,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,认为其真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。本报告中财务资料未经审计。本报告日期自2014年4月1日起至2014年9月30日止。

基金管理人、基金托管人及基金服务机构均不存在虚假记载、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,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,认为其真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。本报告中财务资料未经审计。本报告日期自2014年4月1日起至2014年9月30日止。

基金管理人、基金托管人及基金服务机构均不存在虚假记载、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,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,认为其真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。本报告中财务资料未经审计。本报告日期自2014年4月1日起至2014年9月30日止。

基金管理人、基金托管人及基金服务机构均不存在虚假记载、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,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,认为其真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。本报告中财务资料未经审计。本报告日期自2014年4月1日起至2014年9月30日止。

基金管理人、基金托管人及基金服务机构均不存在虚假记载、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,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,认为其真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。本报告中财务资料未经审计。本报告日期自2014年4月1日起至2014年9月30日止。

基金管理人、基金托管人及基金服务机构均不存在虚假记载、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,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,认为其真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。本报告中财务资料未经审计。本报告日期自2014年4月1日起至2014年9月30日止。

基金管理人、基金托管人及基金服务机构均不存在虚假记载、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,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,认为其真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。本报告中财务资料未经审计。本报告日期自2014年4月1日起至2014年9月30日止。

基金管理人、基金托管人及基金服务机构均不存在虚假记载、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,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,认为其真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。本报告中财务资料未经审计。本报告日期自2014年4月1日起至2014年9月30日止。

基金管理人、基金托管人及基金服务机构均不存在虚假记载、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,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,认为其真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。本报告中财务资料未经审计。本报告日期自2014年4月1日起至2014年9月30日止。

基金管理人、基金托管人及基金服务机构均不存在虚假记载、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,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,认为其真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。本报告中财务资料未经审计。本报告日期自2014年4月1日起至2014年9月30日止。

基金管理人、基金托管人及基金服务机构均不存在虚假记载、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,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,认为其真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。本报告中财务资料未经审计。本报告日期自2014年4月1日起至2014年9月30日止。

基金管理人、基金托管人及基金服务机构均不存在虚假记载、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,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,认为其真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。本报告中财务资料未经审计。本报告日期自2014年4月1日起至2014年9月30日止。

基金管理人、基金托管人及基金服务机构均不存在虚假记载、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,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,认为其真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。本报告中财务资料未经审计。本报告日期自2014年4月1日起至2014年9月30日止。

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休等,则顺延至下一个工作日支付。

2. 基金托管人的托管费

本基金按前一日基金资产净值的0.15%的年费率计提。托管费

的计算方法如下:

H = E × 0.15% ÷ 当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,则顺延至下一个工作日支付。

3.《基金合同》生效后的标的指数许可使用费

标的指数许可使用费即标的指数许可使用基点费,标的指数许可使用基点费的计算时间从基金合同生效日始计算;标的指数许可使用基点费的收取标准为本基金的资产净值值0.02%/年,标的指数许可使用基点费的收取下限为每季人民币5万元(即不足5万元部分按照5万元收取)。

在通常情况下,标的指数许可使用基点费按照前一日基金资产净值的0.02%的年费率计提。标的指数许可使用基点费每日计算,逐日累

计。计算方法如下:

H = E × 0.02% ÷ 当年天数

H为每日应计提的标的指数许可使用基点费

E为前一日的基金资产净值

标的指数许可使用基点费的支付方式为每季支付一次,自基金合同生效日起,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,经基金托管人复核后,于每年1月、4月、7月、10月的最后一个工作日前从基金财产中一次性支付给基金托管人,自上一季度的标的指数许可使用基点费。基金具体核算方法遵循监管部门有关规定。

如果指数使用许可协议约定的指数许可使用的计算方法、费率

和支付方式等发生变更,本基金将按照调整后的方法或费率计算指

数许可使用费。基金管理人应在招募说明书及其更新中披露基金最新

适用的方法。

上述“一、基金费用的种类中第3-9项费用”,根据有关法规及相

应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基

金财产中支付。

三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

1. 基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;

2. 基金管理人

和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;

3.《基金合同》生效前的相关费用;

4. 其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金

费用的项目。

四、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法

律执行。

十四、对招募说明书更新部分的说

(一)“重要提示”部分

更新了本招募说明书所载内容截止日及与有关财务数据和净值表现

的截止日期信息。

(二)“第三部分 基金管理人”部分

更新了基金管理人主要人员情况。

(三)“第四部分 基金托管人”部分

更新了基金托管人情况。

(四)“第五部分 相关服务机构”部分

更新了代销机构方面信息。