

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
注册地址:西安210043年03月27日

重要提示及目录

基金管理人、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法律责任。本年度报告已经二分之一以上独立董事签字认可,并承担连带责任。

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2013年3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,基金的实际业绩并不表示其未来表现。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摘要。

本报告自2012年12月31日起生效,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摘要。

本报告自2012年6月25日起生效,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摘要。

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
基金代码	740101
交易代码	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	128,002,700.63
基金资产净值	121,808,580.08

2.2 基金业绩指标	
投资目标	本基金通过投资于沪深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,为投资者提供长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现,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,进行被动跟踪。
业绩比较基准	沪深300非周期行业指数收益率×95%+同期存款利率(税后)×5%

2.3 基金管理人及基金托管人	
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

2.4 基金服务机构	
会计师事务所	毕马威会计师事务所(特殊普通合伙)
注册登记机构	长安基金管理有限公司

3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	
3.1 主要财务指标	单位:人民币元
本期利息收入	7,898,366.40
本期公允价值变动损益	-3,287,320.13
本期投资收益	-0.0167
本期基金份额净值增长率	1.20%
期末基金份额净值	1.012
期末可供分配基金份额利润	-0.0366
期末基金资产净值	129,560,742.05
期末基金份额净值	1.012
3.1.3 累计指标	2012年
基金份额累计净值增长率	1.20%

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	姓名	张洪水	寻卫国
	联系电话		010-65169606

3.3 基金业绩比较基准	
本基金业绩比较基准为:沪深300非周期行业指数收益率×95%+同期存款利率(税后)×5%	
3.3.1 本基金业绩比较基准的构成及权重	
3.3.2 本基金业绩比较基准的构成及权重	

3.4 基金业绩比较基准	
本基金业绩比较基准为:沪深300非周期行业指数收益率×95%+同期存款利率(税后)×5%	
3.4.1 本基金业绩比较基准的构成及权重	
3.4.2 本基金业绩比较基准的构成及权重	

3.5 基金业绩比较基准	
本基金业绩比较基准为:沪深300非周期行业指数收益率×95%+同期存款利率(税后)×5%	
3.5.1 本基金业绩比较基准的构成及权重	
3.5.2 本基金业绩比较基准的构成及权重	

3.6 基金业绩比较基准	
本基金业绩比较基准为:沪深300非周期行业指数收益率×95%+同期存款利率(税后)×5%	
3.6.1 本基金业绩比较基准的构成及权重	
3.6.2 本基金业绩比较基准的构成及权重	

3.7 基金业绩比较基准	
本基金业绩比较基准为:沪深300非周期行业指数收益率×95%+同期存款利率(税后)×5%	
3.7.1 本基金业绩比较基准的构成及权重	
3.7.2 本基金业绩比较基准的构成及权重	

3.8 基金业绩比较基准	
本基金业绩比较基准为:沪深300非周期行业指数收益率×95%+同期存款利率(税后)×5%	
3.8.1 本基金业绩比较基准的构成及权重	
3.8.2 本基金业绩比较基准的构成及权重	

3.9 基金业绩比较基准	
本基金业绩比较基准为:沪深300非周期行业指数收益率×95%+同期存款利率(税后)×5%	
3.9.1 本基金业绩比较基准的构成及权重	
3.9.2 本基金业绩比较基准的构成及权重	

3.10 基金业绩比较基准	
本基金业绩比较基准为:沪深300非周期行业指数收益率×95%+同期存款利率(税后)×5%	
3.10.1 本基金业绩比较基准的构成及权重	
3.10.2 本基金业绩比较基准的构成及权重	

3.11 基金业绩比较基准	
本基金业绩比较基准为:沪深300非周期行业指数收益率×95%+同期存款利率(税后)×5%	
3.11.1 本基金业绩比较基准的构成及权重	
3.11.2 本基金业绩比较基准的构成及权重	

3.12 基金业绩比较基准	
本基金业绩比较基准为:沪深300非周期行业指数收益率×95%+同期存款利率(税后)×5%	
3.12.1 本基金业绩比较基准的构成及权重	
3.12.2 本基金业绩比较基准的构成及权重	

3.13 基金业绩比较基准	
本基金业绩比较基准为:沪深300非周期行业指数收益率×95%+同期存款利率(税后)×5%	
3.13.1 本基金业绩比较基准的构成及权重	
3.13.2 本基金业绩比较基准的构成及权重	

3.14 基金业绩比较基准	
本基金业绩比较基准为:沪深300非周期行业指数收益率×95%+同期存款利率(税后)×5%	
3.14.1 本基金业绩比较基准的构成及权重	
3.14.2 本基金业绩比较基准的构成及权重	

3.15 基金业绩比较基准	
本基金业绩比较基准为:沪深300非周期行业指数收益率×95%+同期存款利率(税后)×5%	
3.15.1 本基金业绩比较基准的构成及权重	
3.15.2 本基金业绩比较基准的构成及权重	

3.16 基金业绩比较基准	
本基金业绩比较基准为:沪深300非周期行业指数收益率×95%+同期存款利率(税后)×5%	
3.16.1 本基金业绩比较基准的构成及权重	
3.16.2 本基金业绩比较基准的构成及权重	

3.17 基金业绩比较基准	
本基金业绩比较基准为:沪深300非周期行业指数收益率×95%+同期存款利率(税后)×5%	
3.17.1 本基金业绩比较基准的构成及权重	
3.17.2 本基金业绩比较基准的构成及权重	

3.18 基金业绩比较基准	
本基金业绩比较基准为:沪深300非周期行业指数收益率×95%+同期存款利率(税后)×5%	
3.18.1 本基金业绩比较基准的构成及权重	
3.18.2 本基金业绩比较基准的构成及权重	

3.19 基金业绩比较基准	
本基金业绩比较基准为:沪深300非周期行业指数收益率×95%+同期存款利率(税后)×5%	
3.19.1 本基金业绩比较基准的构成及权重	
3.19.2 本基金业绩比较基准的构成及权重	

3.20 基金业绩比较基准	
本基金业绩比较基准为:沪深300非周期行业指数收益率×95%+同期存款利率(税后)×5%	
3.20.1 本基金业绩比较基准的构成及权重	
3.20.2 本基金业绩比较基准的构成及权重	

3.21 基金业绩比较基准	
本基金业绩比较基准为:沪深300非周期行业指数收益率×95%+同期存款利率(税后)×5%	
3.21.1 本基金业绩比较基准的构成及权重	
3.21.2 本基金业绩比较基准的构成及权重	

3.22 基金业绩比较基准	
本基金业绩比较基准为:沪深300非周期行业指数收益率×95%+同期存款利率(税后)×5%	
3.22.1 本基金业绩比较基准的构成及权重	
3.22.2 本基金业绩比较基准的构成及权重	

3.23 基金业绩比较基准	
本基金业绩比较基准为:沪深300非周期行业指数收益率×95%+同期存款利率(税后)×5%	
3.23.1 本基金业绩比较基准的构成及权重	
3.23.2 本基金业绩比较基准的构成及权重	

3.24 基金业绩比较基准	
本基金业绩比较基准为:沪深300非周期行业指数收益率×95%+同期存款利率(税后)×5%	
3.24.1 本基金业绩比较基准的构成及权重	
3.24.2 本基金业绩比较基准的构成及权重	

3.25 基金业绩比较基准	
本基金业绩比较基准为:沪深300非周期行业指数收益率×95%+同期存款利率(税后)×5%	
3.25.1 本基金业绩比较基准的构成及权重	
3.25.2 本基金业绩比较基准的构成及权重	

3.26 基金业绩比较基准	
本基金业绩比较基准为:沪深300非周期行业指数收益率×95%+同期存款利率(税后)×5%	
3.26.1 本基金业绩比较基准的构成及权重	
3.26.2 本基金业绩比较基准的构成及权重	

3.27 基金业绩比较基准	
本基金业绩比较基准为:沪深300非周期行业指数收益率×95%+同期存款利率(税后)×5%	
3.27.1 本基金业绩比较基准的构成及权重	
3.27.2 本基金业绩比较基准的构成及权重	

3.28 基金业绩比较基准	
本基金业绩比较基准为:沪深300非周期行业指数收益率×95%+同期存款利率(税后)×5%	
3.28.1 本基金业绩比较基准的构成及权重	
3.28.2 本基金业绩比较基准的构成及权重	

3.29 基金业绩比较基准	
本基金业绩比较基准为:沪深300非周期行业指数收益率×95%+同期存款利率(税后)×5%	
3.29.1 本基金业绩比较基准的构成及权重	
3.29.2 本基金业绩比较基准的构成及权重	

3.30 基金业绩比较基准	
本基金业绩比较基准为:沪深300非周期行业指数收益率×95%+同期存款利率(税后)×5%	
3.30.1 本基金业绩比较基准的构成及权重	
3.30.2 本基金业绩比较基准的构成及权重	

3.31 基金业绩比较基准	
本基金业绩比较基准为:沪深300非周期行业指数收益率×95%+同期存款利率(税后)×5%	
3.31.1 本基金业绩比较基准的构成及权重	
3.31.2 本基金业绩比较基准的构成及权重	

3.32 基金业绩比较基准	
本基金业绩比较基准为:沪深300非周期行业指数收益率×95%+同期存款利率(税后)×5%	
3.32.1 本基金业绩比较基准的构成及权重	
3.32.2 本基金业绩比较基准的构成及权重	

3.33 基金业绩比较基准	
本基金业绩比较基准为:沪深300非周期行业指数收益率×95%+同期存款利率(税后)×5%	
3.33.1 本基金业绩比较基准的构成及权重	
3.33.2 本基金业绩比较基准的构成及权重	

3.34 基金业绩比较基准	
本基金业绩比较基准为:沪深300非周期行业指数收益率×95%+同期存款利率(税后)×5%	
3.34.1 本基金业绩比较基准的构成及权重	
3.34.2 本基金业绩比较基准的构成及权重	

3.35 基金业绩比较基准	
本基金业绩比较基准为:沪深300非周期行业指数收益率×95%+同期存款利率(税后)×5%	
3.35.1 本基金业绩比较基准的构成及权重	
3.35.2 本基金业绩比较基准的构成及权重	

3.36 基金业绩比较基准	
本基金业绩比较基准为:沪深300非周期行业指数收益率×95%+同期存款利率(税后)×5%	
3.36.1 本基金业绩比较基准的构成及权重	
3.36.2 本基金业绩比较基准的构成及权重	

3.37 基金业绩比较基准	
本基金业绩比较基准为:沪深300非周期行业指数收益率×95%+同期存款利率(税后)×5%	
3.37.1 本基金业绩比较基准的构成及权重	
3.37.2 本基金业绩比较基准的构成及权重	

3.38 基金业绩比较基准	
本基金业绩比较基准为:沪深300非周期行业指数收益率×95%+同期存款利率(税后)×5%	
3.38.1 本基金业绩比较基准的构成及权重	
3.38.2 本基金业绩比较基准的构成及权重	

3.39 基金业绩比较基准	
本基金业绩比较基准为:沪深300非周期行业指数收益率×95%+同期存款利率(税后)×5%	
3.39.1 本基金业绩比较基准的构成及权重	
3.39.2 本基金业绩比较基准的构成及权重	

3.40 基金业绩比较基准	
本基金业绩比较基准为:沪深300非周期行业指数收益率×95%+同期存款利率(税后)×5%	
3.40.1 本基金业绩比较基准的构成及权重	
3.40.2 本基金业绩比较基准的构成及权重	

3.41 基金业绩比较基准	
本基金业绩比较基准为:沪深300非周期行业指数收益率×95%+同期存款利率(税后)×5%	
3.41.1 本基金业绩比较基准的构成及权重	
3.41.2 本基金业绩比较基准的构成及权重	

3.42 基金业绩比较基准	
本基金业绩比较基准为:沪深300非周期行业指数收益率×95%+同期存款利率(税后)×5%	
3.42.1 本基金业绩比较基准的构成及权重	
3.42.2 本基金业绩比较基准的构成及权重	

3.43 基金业绩比较基准	
本基金业绩比较基准为:沪深300非周期行业指数收益率×95%+同期存款利率(税后)×5%	
3.43.1 本基金业绩比较基准的构成及权重	
3.43.2 本基金业绩比较基准的构成及权重	

3.44 基金业绩比较基准	
本基金业绩比较基准为:沪深300非周期行业指数收益率×95%+同期存款利率(税后)×5%	
3.44.1 本基金业绩比较基准的构成及权重	
3.44.2 本基金业绩比较基准的构成及权重	

3.45 基金业绩比较基准	
本基金业绩比较基准为:沪深300非周期行业指数收益率×95%+同期存款利率(税后)×5%	
3.45.1 本基金业绩比较基准的构成及权重	
3.45.2 本基金业绩比较基准的构成及权重	

3.46 基金业绩比较基准	
本基金业绩比较基准为:沪深300非周期行业指数收益率×95%+同期存款利率(税后)×5%	
3.46.1 本基金业绩比较基准的构成及权重	
3.46.2 本基金业绩比较基准的构成及权重	

3.47 基金业绩比较基准	
本基金业绩比较基准为:沪深300非周期行业指数收益率×95%+同期存款利率(税后)×5%	
3.47.1 本基金业绩比较基准的构成及权重	
3.47.2 本基金业绩比较基准的构成及权重	

3.48 基金业绩比较基准	
本基金业绩比较基准为:沪深300非周期行业指数收益率×95%+同期存款利率(税后)×5%	
3.48.1 本基金业绩比较基准的构成及权重	
3.48.2 本基金业绩比较基准的构成及权重	

3.49 基金业绩比较基准	
本基金业绩比较基准为:沪深300非周期行业指数收益率×95%+同期存款利率(税后)×5%	
3.49.1 本基金业绩比较基准的构成及权重	
3.49.2 本基金业绩比较基准的构成及权重	

3.50 基金业绩比较基准	
本基金业绩比较基准为:沪深300非周期行业指数收益率×95%+同期存款利率(税后)×5%	
3.50.1 本基金业绩比较基准的构成及权重	
3.50.2 本基金业绩比较基准的构成及权重	

3.51 基金业绩比较基准	
本基金业绩比较基准为:沪深300非周期行业指数收益率×95%+同期存款利率(税后)×5%	
3.51.1 本基金业绩比较基准的构成及权重	
3.51.2 本基金业绩比较基准的构成及权重	

3.52 基金业绩比较基准	
本基金业绩比较基准为:沪深300非周期行业指数收益率×95%+同期存款利率(税后)×5%	
3.52.1 本基金业绩比较基准的构成及权重	
3.52.2 本基金业绩比较基准的构成及权重	

3.53 基金业绩比较基准	
本基金业绩比较基准为:沪深300非周期行业指数收益率×95%+同期存款利率(税后)×5%	
3.53.1 本基金业绩比较基准的构成及权重	
3.53.2 本基金业绩比较基准的构成及权重	

3.54 基金业绩比较基准	
本基金业绩比较基准为:沪深300非周期行业指数收益率×95%+同期存款利率(税后)×5%	
3.54.1 本基金业绩比较基准的构成及权重	
3.54.2 本基金业绩比较基准的构成及权重	

2012年度报告摘要

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:2012年06月25日至2012年12月31日

单位:人民币元		
项 目	附注号	本期 2012年06月25日至2012年12月31日
一、收入		-894,746.52
利息收入		490,590.97