长安沪深300非周期行业指数证券投资基金

【2014】年度报告摘要

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:2015年3月27日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

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2015年3月25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及其更新。

本报告中财务资料经会计师事务所审计。

本报告期自2014年1月1日起至12月31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6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	44,936,569.95

2.2 基金产品说明

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。

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
信息披露负责人	姓名	李永波	李春磊
	联系电话	021-20329761	010-65169830
	电子邮箱	liyongbo@changanfunds.com	lichunlei@cgbchina.com.cn
客户服务电话		400-820-9688	400-830-8003
传真		021-50598018	010-65169555

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.changanfunds.com
基金年度报告备置地点	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、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2014年	2013年	2012年6月25日-2012年12月31日
本期已实现收益	1,709,516.86	8,194,448.63	-7,898,364.40
本期利润	10,843,685.82	5,052,776.95	-3,287,320.13
加权平均基金份额本期利润	0.3642	0.0951	-0.0167
本期加权平均净值利润率	35.39%	9.09%	-1.71%
本期基金份额净值增长率	24.78%	4.05%	1.20%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末	2013年末	2012年末
期末可供分配利润	2,569,817.22	1,572,528.57	-4,687,939.25
期末可供分配基金份额利润	0.0572	0.0527	-0.0366
期末基金资产净值	54,982,356.29	31,400,289.43	129,560,742.05
期末基金份额净值	1.224	1.053	1.012
3.1.3 累计期末指标	2014年末	2013年末	2012年末
基金份额累计净值增长率	31.39%	5.30%	1.20%

注:1、本期已实现收益是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、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与同期业绩比较基准收益率的比较

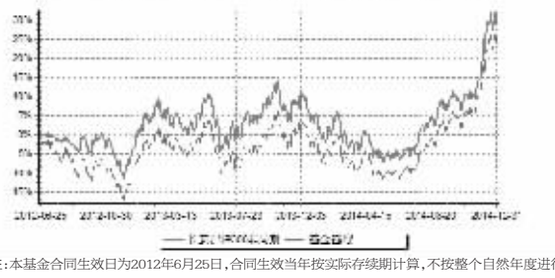
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	19.66%	1.25%	20.39%	1.27%	-0.73%	-0.02%
过去六个月	36.87%	1.04%	38.09%	1.05%	-1.22%	-0.01%
过去一年	24.78%	1.05%	27.22%	1.07%	-2.44%	-0.02%
自基金合同生效日起至今(2012年06月25日-2014年12月31日)	31.39%	1.08%	25.76%	1.13%	5.63%	-0.05%

注:本基金的业绩比较基准为: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: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。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:本基金合同生效日为2012年6月25日,合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2014年	0.750	1,396,167.68	154,129.09	1,550,296.77	
合计	0.750	1,396,167.68	154,129.09	1,550,296.77	

注:本基金前两个报告期内未进行利润分配,本报告期内进行过1次利润分配。

§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:长安国际信托股份有限公司、上海恒嘉美联发展有限公司、五星控股集团有限公司、兵器装备集团财务有限责任公司。

目前,除本基金外,长安基金管理有限公司另管理3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,通过强化配置景气行业及精选基本面良好、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。

3、长安产业精选灵活配置混合型发起式证券投资基金

基金动作方式:契约型开放式

成立日期:2014年5月7日

投资目标:本基金通过把握宏观经济转折点,灵活配置权益类资产和固定收益类资产,并在严格控制下行风险的基础上,力争实现基金资产较高的长期稳健回报。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王磊	本基金的基金经理	2012年6月25日	2014年8月22日	7年	吉林大学经济学硕士。曾任中国技术进出口总公司项目经理、研究员,上海中投投资顾问有限公司研究员、投资经理,通用技术集团投资管理有限公司投资经理、投资部副总监,国金通用基金管理有限公司筹备期基金经理助理、风险管理部负责人等职。2011年8月加入长安基金管理有限公司,曾任基金经理助理、基金投资部副总经理,现任长安基金联席投资总监、长安宏观策略股票型证券投资基金、长安产业精选灵活配置混合型发起式基金及长安沪深300非周期行业指数证券投资基金基金经理。
雷宇	本基金的基金经理	2014年8月22日	-	14年	中国人民大学经济学硕士,曾任中国铁道建筑总公司财务部、证券事务代表、董秘办主任、证券投资部经理、证券事务代表、董秘办主任、证券投资部经理、证券事务代表、董秘办主任、证券投资部经理