

# 长安沪深 300 非周期行业指数证券投资基金

2017 年第 4 季度报告

2017 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:2018 年 01 月 20 日

## 目录

|   |    |
|---|----|
| §1 重要提示 .....                                       | 2  |
| §2 基金产品概况 .....                                     | 2  |
| 2.1 基金基本情况 .....                                    | 2  |
| §3 主要财务指标和基金净值表现 .....                              | 3  |
| 3.2 基金净值表现 .....                                    | 3  |
| 3.2.1 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 .....          | 3  |
| 3.2.2 自基金合同生效以来基金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 ..... | 3  |
| §4 管理人报告 .....                                      | 4  |
| 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介 .....                           | 4  |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况说明 .....                     | 5  |
| 4.3 公平交易专项说明 .....                                  | 5  |
| 4.3.1 公平交易制度的执行情况 .....                             | 6  |
| 4.3.2 异常交易行为的专项说明 .....                             | 6  |
| 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析 .....                          | 6  |
| 4.5 报告期内基金的业绩表现 .....                               | 6  |
| 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明 .....                     | 6  |
| §5 投资组合报告 .....                                     | 6  |
| 5.1 报告期末基金资产组合情况 .....                              | 6  |
| 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....                          | 7  |
| 5.3 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股票投资明细 .....          | 8  |
| 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合 .....                        | 8  |
| 5.5 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 .....          | 9  |
| 5.6 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 .....      | 9  |
| 5.7 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贵金属投资明细 .....         | 9  |
| 5.8 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 .....          | 9  |
| 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....                      | 9  |
| 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....                     | 9  |
| 5.11 投资组合报告附注 .....                                 | 9  |
| 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明 .....                  | 10 |
| §6 开放式基金份额变动 .....                                  | 10 |
| §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况 .....                         | 10 |
| §8 影响投资者决策的其他重要信息 .....                             | 11 |
| 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....             | 11 |
| 8.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                            | 11 |
| §9 备查文件目录 .....                                     | 12 |
| 9.1 备查文件目录 .....                                    | 12 |
| 9.2 存放地点 .....                                      | 12 |
| 9.3 查阅方式 .....                                      | 12 |

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及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2018年1月19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，投资者在做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2017年10月01日起至2017年12月31日止。

## § 2 基金产品概况

### 2.1 基金基本情况

|            |   |
|------------|---|
| 基金简称       | 长安沪深300非周期  |
| 场内简称       | -   |
| 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06月25日   |
| 报告期末基金份额总额 | 68,934,285.23份  |
| 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。            |

|       |            |
|-------|------------|
| 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 |

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标          | 报告期（2017年10月01日 - 2017年12月31日） |
|-----------------|--------------------------------|
| 1. 本期已实现收益      | 2,419,562.96                   |
| 2. 本期利润         | 4,271,477.70                   |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0562                         |
| 4. 期末基金资产净值     | 78,821,881.15                  |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.143                          |

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 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 | 4.19%  | 0.93%     | 6.10%      | 0.94%         | -1.91% | -0.01% |

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

长安沪深300非周期行业指数证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2012年06月25日-2017年12月31日)



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。基金合同生效日至报告期期末,本基金运作时间超过一年,图示日期为2012年6月25日至2017年12月31日。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）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 |        |   |
| 林忠晶 | 本基金的基金经理 | 2015-01-27  | -    | 7年     | 北京大学国民经济学博士。曾任安信期货有限责任公司高级分析师,中海石油气电集团有限责任公司贸易部研究员等职。2011年6月加入长安基金管理有限公司,曾任产品经理、战略及产品部副总经理、量化投资部(筹)总经理等职,现任基金投资部副总经理,长安 |

|    |          |            |   |    |   |
|----|----------|------------|---|----|---|
|    |          |            |   |    | 沪深300非周期行业指数证券投资基金、长安宏观策略混合型证券投资基金、长安产业精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、长安鑫利优选灵活配置混合型证券投资基金、长安鑫富领先灵活配置混合型证券投资基金、长安鑫恒回报混合型证券投资基金、长安鑫珪主题轮动混合型证券投资基金、长安鑫旺价值灵活配置混合型证券投资基金、长安鑫兴灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。                       |
| 王伟 | 本基金的基金经理 | 2017-12-13 | - | 5年 | 五年金融行业从业经历。曾任中国科学院德国马普学会计算生物学伙伴研究所助理研究员、博士后，华宸未来基金管理有限公司金融工程部研究员、风险管理部研究员，东北证券股份有限公司上海证券研究咨询分公司量化投资研究员，长安基金管理有限公司战略及产品部高级产品经理、量化投资部（筹）高级研究员、组合管理中心拟任FOF基金经理等职务，现任长安基金管理有限公司长安沪深300非周期行业指数证券投资基金的基金经理。 |

- 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办法的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《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、安全高效的原则管理和

运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

### 4.3 公平交易专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人树立价值投资理念，设置合理的组织架构和科学的投资决策体系，确保投资、研究、交易各个环节的独立性。同时，建立健全公司适用的投资对象备选库和交易对手备选库，共享研究成果，在确保投资组合间的信息隔离与保密的情况下，保证建立信息公开、资源共享的公平投资管理环境。

公司建立了专门的公平交易制度，并在交易系统中采用公平交易模块，保证公平交易的严格执行。对异常交易的监控包括事前、事中和事后三个环节，并经过严格的报告和审批程序，防范和控制异常交易。

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《长安基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内，作为被动型指数基金，本基金在运作过程中严格遵守基金合同，坚持既定的指数化投资策略，对指数基金操作采取被动复制、抽样复制与组合优化相结合的方式，努力实现对业绩比较基准的有效跟踪。当由于申购赎回变动、指数成分股权重调整等原因引发组合调整时，在操作过程中坚守合规第一、风控第一的前提下，结合市场趋势预判与量化分析，应用指数复制和其他合理方法优化组合结构，最大限度降低冲击成本和减少跟踪误差，力争投资回报与所跟踪指数保持一致，努力为投资者提供一个良好的指数投资工具。

### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末长安沪深300非周期指数基金份额净值为1.143元；本报告期内，基金份额净值增长率为4.19%，同期业绩比较基准收益率为6.1%。

### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金无连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情形。

## § 5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额(元)         | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|---------------|---------------|
| 1  | 权益投资              | 74,056,672.24 | 91.69         |
|    | 其中：股票             | 74,056,672.24 | 91.69         |
| 2  | 基金投资              | -             | -             |
| 3  | 固定收益投资            | -             | -             |
|    | 其中：债券             | -             | -             |
|    | 资产支持证券            | -             | -             |
| 4  | 贵金属投资             | -             | -             |
| 5  | 金融衍生品投资           | -             | -             |
| 6  | 买入返售金融资产          | -             | -             |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -             | -             |
| 7  | 银行存款和结算备付金合计      | 5,918,317.80  | 7.33          |
| 8  | 其他资产              | 793,404.17    | 0.98          |
| 9  | 合计                | 80,768,394.21 | 100.00        |

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值(元)       | 占基金资产净值的比例 (%) |
|----|------------------|---------------|----------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | 382,023.45    | 0.48           |
| B  | 采矿业              | -             | -              |
| C  | 制造业              | 51,093,634.71 | 64.82          |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 3,456,772.98  | 4.39           |
| E  | 建筑业              | 5,701,473.69  | 7.23           |
| F  | 批发和零售业           | 3,121,363.98  | 3.96           |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 219,744.00    | 0.28           |
| H  | 住宿和餐饮业           | -             | -              |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 5,743,575.46  | 7.29           |

|   |                   |               |       |
|---|-------------------|---------------|-------|
| J | 金融业               | -             | -     |
| K | 房地产业              | -             | -     |
| L | 租赁和商务服务业          | 1,758,378.16  | 2.23  |
| M | 科学研究和技术服务业        | -             | -     |
| N | 水利、环境和公共设施<br>管理业 | 993,951.89    | 1.26  |
| O | 居民服务、修理和其他<br>服务业 | -             | -     |
| P | 教育                | -             | -     |
| Q | 卫生和社会工作           | 286,497.00    | 0.36  |
| R | 文化、体育和娱乐业         | 1,154,826.92  | 1.47  |
| S | 综合                | 144,430.00    | 0.18  |
|   | 合计                | 74,056,672.24 | 93.95 |

### 5.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

### 5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

## 5.3 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股票投资明细

### 5.3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资 明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称  | 数量(股)   | 公允价值(元)      | 占基金资产净<br>值比例(%) |
|----|--------|-------|---------|--------------|------------------|
| 1  | 600519 | 贵州茅台  | 6,196   | 4,321,648.04 | 5.48             |
| 2  | 000333 | 美的集团  | 52,312  | 2,899,654.16 | 3.68             |
| 3  | 600887 | 伊利股份  | 76,430  | 2,460,281.70 | 3.12             |
| 4  | 000651 | 格力电器  | 55,833  | 2,439,902.10 | 3.10             |
| 5  | 000858 | 五粮液   | 24,505  | 1,957,459.40 | 2.48             |
| 6  | 002415 | 海康威视  | 47,532  | 1,853,748.00 | 2.35             |
| 7  | 000725 | 京东方 A | 319,543 | 1,850,153.97 | 2.35             |
| 8  | 601668 | 中国建筑  | 192,560 | 1,736,891.20 | 2.20             |
| 9  | 600104 | 上汽集团  | 48,547  | 1,555,445.88 | 1.97             |
| 10 | 600276 | 恒瑞医药  | 21,654  | 1,493,692.92 | 1.90             |

### 5.3.2 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的股票。

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

### 5.5 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。

### 5.6 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。

### 5.7 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未进行贵金属交易。

### 5.8 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。

### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未进行股指期货交易。

### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未进行国债期货交易。

#### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未进行国债期货交易。

#### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未进行国债期货交易。

### 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2 报告期内，本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额(元)      |
|----|---------|------------|
| 1  | 存出保证金   | 61,536.02  |
| 2  | 应收证券清算款 | -          |
| 3  | 应收股利    | -          |
| 4  | 应收利息    | 712,427.63 |
| 5  | 应收申购款   | 19,440.52  |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 其他      | -          |
| 8  | 合计      | 793,404.17 |

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 5.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 5.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

### 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，本报告中涉及比例计算的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

|                           |               |
|---------------------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 90,555,627.83 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 4,119,767.22  |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 25,741,109.82 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | -             |
| 报告期期末基金份额总额               | 68,934,285.23 |

总申购份额包含红利再投、转换入份额，总赎回份额包含转换出份额。

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

|                           |              |
|---------------------------|--------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额          | 6,608,724.39 |
| 报告期期间买入/申购总份额             | -            |
| 报告期期间卖出/赎回总份额             | -            |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额          | 6,608,724.39 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%) | 9.59         |

本报告期内，本基金管理人未运用固有资金申购或赎回本基金。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人本报告期内未进行本基金的申购或赎回交易。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期内没有发生单一投资者持有基金份额达到或超过20%的情形。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，基金管理人根据《证券投资基金信息披露管理办法》的有关规定，在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及管理人网站进行了如下信息披露：

- 1、2017年10月27日，长安沪深300非周期行业指数证券投资基金2017年第三季度报告。
- 2、2017年10月31日，长安基金管理有限公司关于乐视网股票进一步调整估值的公告。
- 3、2017年11月8日，关于旗下基金在上海证券有限责任公司开通认购、申购和赎回并参与费率优惠活动的公告。
- 4、2017年11月10日，关于旗下基金在北京蛋卷基金销售有限公司开通认购、申购、赎回、基金转换和定投业务并参与费率优惠活动的公告。
- 5、2017年11月11日，关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的提示性公告。
- 6、2017年11月17日，长安基金管理有限公司关于对乐视网股票进一步调整估值的公告。

7、2017年12月7日，关于旗下基金在上海基煜基金销售有限公司开通认购、申购、赎回、基金转换和定投业务并参与费率优惠活动的公告。

8、2017年12月13日，关于长安沪深300非周期行业指数证券投资基金增聘基金经理的公告。

9、2017年12月28日，关于开展长安货币市场证券投资基金网上直销基金转换费率优惠的公告、长安基金管理有限公司总经理袁丹旭任职公告。

10、2017年12月29日，关于旗下证券投资基金调整所投资流通受限股票估值方法的公告。

11、2017年12月31日，长安基金管理有限公司关于旗下基金2017年12月31日基金资产净值、基金份额净值及基金份额累计净值的公告。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、长安沪深300非周期行业指数证券投资基金基金合同；
- 3、长安沪深300非周期行业指数证券投资基金托管协议；
- 4、长安沪深300非周期行业指数证券投资基金招募说明书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内披露的各项公告。

### 9.2 存放地点

上海市浦东新区芳甸路1088号紫竹国际大厦16层。

### 9.3 查阅方式

投资者可到基金管理人、基金托管人的办公场所或基金管理人网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本管理人。

咨询电话：400-820-9688

公司网址：www.changanfunds.com。

长安基金管理有限公司  
二〇一八年一月二十日