长安沪深300非周期行业指数证券投资基金

2026年第3季度报告

2026年09月30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:2026年10月27日

目录

§1 重要提示 3
§2 基金产品概况 3
§3 主要财务指标和基金净值表现 4
3.1 主要财务指标 4
3.2 基金净值表现 4
§4 管理人报告 6
4.1 基金经理（或基金经理小组）简介 6
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 7
4.3 公平交易专项说明 7
4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析 8
4.5 报告期内基金的业绩表现 8
4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明 8
§5 投资组合报告 8
5.1 报告期末基金资产组合情况 8
5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 9
5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细 9
5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合 10
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 10
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 10
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 10
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 10
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 10
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 11
5.11 投资组合报告附注 11
§6 开放式基金份额变动 12
§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况 12
7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况 12
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细 12
§8 影响投资者决策的其他重要信息 12
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 12
8.2 影响投资者决策的其他重要信息 13
§9 备查文件目录 13
9.1 备查文件目录 13
9.2 存放地点 13
9.3 查阅方式 13

§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2026年10月26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2026年7月1日起至2026年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长安沪深300非周期指数
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	10,781,511.38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。 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。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研究，结合股指期货定价模型对其估值水平合理性的评估，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。	
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	
下属分级基金的基金简称	长安沪深300非周期指数A	长安沪深300非周期指数C
下属分级基金的交易代码	740101	017040
报告期末下属分级基金的份额总额	10,615,713.23份	165,798.15份

§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(2026年07月01日 - 2026年09月30日)	
	长安沪深300非周期指数A	长安沪深300非周期指数C
1.本期已实现收益	233,455.75	3,472.15
2.本期利润	-2,946,566.51	-44,615.13
3.加权平均基金份额本期利润	-0.2754	-0.2668
4.期末基金资产净值	14,242,179.18	221,238.33
5.期末基金份额净值	1.342	1.334

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

长安沪深300非周期指数A净值表现

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	-16.96%	1.60%	-18.06%	1.66%	1.10%	-0.06%
过去六个月	-2.75%	1.49%	-0.64%	1.59%	-2.11%	-0.10%
过去一年	-8.96%	1.27%	-6.61%	1.36%	-2.35%	-0.09%
过去三年	11.83%	1.22%	16.35%	1.28%	-4.52%	-0.06%
过去五年	-16.85%	1.18%	-14.60%	1.22%	-2.25%	-0.04%
过去七年	24.03%	1.23%	21.94%	1.27%	2.09%	-0.04%
过去十年	48.56%	1.20%	46.29%	1.23%	2.27%	-0.03%
自基金合同生效起至今	106.04%	1.35%	90.89%	1.37%	15.15%	-0.02%

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%

长安沪深300非周期指数C净值表现

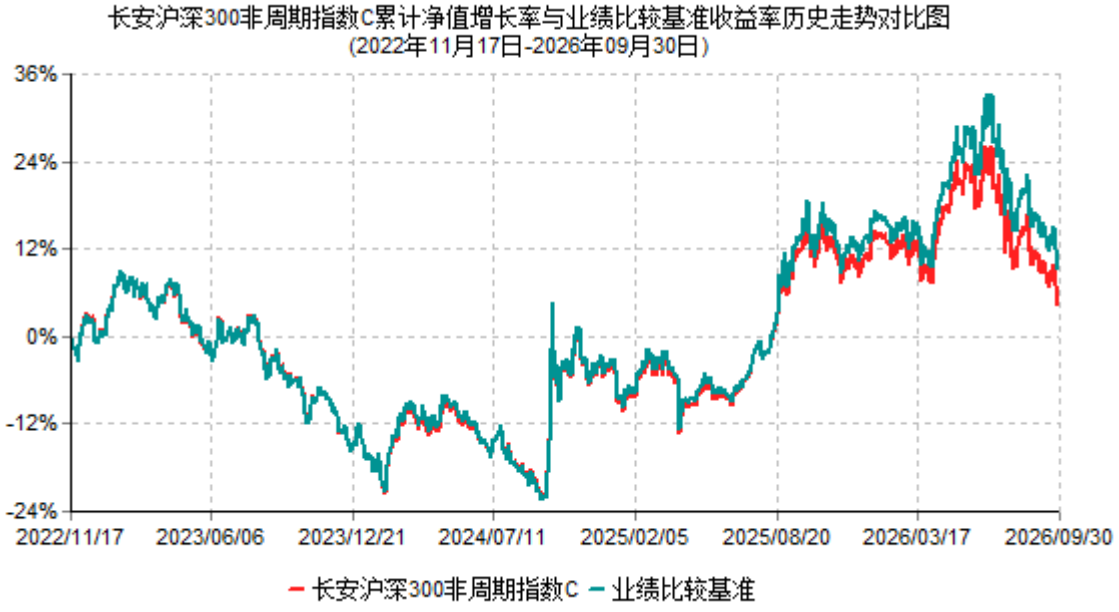
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-17.04%	1.61%	-18.06%	1.66%	1.02%	-0.05%
过去六个月	-2.91%	1.50%	-0.64%	1.59%	-2.27%	-0.09%
过去一年	-9.19%	1.28%	-6.61%	1.36%	-2.58%	-0.08%
过去三年	11.17%	1.23%	16.35%	1.28%	-5.18%	-0.05%
自基金合同生效起至今	4.55%	1.15%	9.22%	1.19%	-4.67%	-0.04%

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



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 2026 年 9 月 30 日。



长安沪深 300 非周期行业指数 C 于 2022 年 11 月 14 日公告新增，实际首笔 C 类份额申购申请于 2022 年 11 月 17 日确认,图示日期为 2022 年 11 月 17 日至 2026 年 9 月 30 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	说明

		任职日期	离任日期	年限	
肖洁	本基金的基金经理	2022-02-08	-	15年	中国国籍。工商管理硕士。曾任德摩资本有限公司交易经理、长安基金管理有限公司研究部研究员、权益投资部基金经理助理等职。现任长安基金管理有限公司权益投资部基金经理。

1、上述任职日期为根据公司决定确定的聘任日期，离任日期为根据公司决定确定的解聘日期；首任基金经理任职日期为基金合同生效日。

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。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本基金的基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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》、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、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作合法合规，无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管理办法》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，本基金坚持指数化投资策略，采取被动复制和优化相结合的方式，尽可能地减少对本基金业绩比较基准的跟踪误差。采用多种优化方法应对申购赎回、指数成分股或成分股权重调整等引发被动调整所带来的跟踪误差和冲击成本，力争投资回报与本基金所跟踪指数保持一致，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A基金份额净值为1.342元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-16.96%，同期业绩比较基准收益率为-18.06%；截至报告期末长安沪深300非周期指数C基金份额净值为1.334元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-17.04%，同期业绩比较基准收益率为-18.06%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金从2026年7月1日至2026年9月30日连续65个工作日出现资产净值低于五千万情形，未出现连续20个工作日（含）以上基金份额持有人数量不满二百人的情形。基金管理人已持续关注并将采取适当措施。

§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	13,500,166.94	90.87
	其中：股票	13,500,166.94	90.87
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	1,353,986.96	9.11
8	其他资产	2,802.46	0.02
9	合计	14,856,956.36	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)	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	167,967.30	1.16
B	采矿业	-	-
C	制造业	10,854,721.70	75.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	616,007.26	4.26
E	建筑业	272,462.68	1.88
F	批发和零售业	38,233.55	0.26
G	交通运输、仓储和邮政业	84,467.00	0.58
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	950,888.55	6.57
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	108,671.60	0.75
M	科学研究和技术服务业	360,115.68	2.49
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	31,273.62	0.22
R	文化、体育和娱乐业	15,358.00	0.11
S	综合	-	-
	合计	13,500,166.94	93.34

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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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)	占基金资产净值比例（%）
1	300308	中际旭创	880	711,427.20	4.92
2	600519	贵州茅台	496	624,275.52	4.32
3	300750	宁德时代	2,140	622,975.40	4.31
4	300502	新易盛	1,120	435,680.00	3.01
5	603259	药明康德	2,152	360,115.68	2.49
6	000333	美的集团	4,012	321,361.20	2.22
7	600900	长江电力	10,007	285,599.78	1.97
8	002475	立讯精密	4,313	213,191.59	1.47
9	002371	北方华创	340	209,429.80	1.45
10	688981	中芯国际	1,824	204,269.76	1.41

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持有贵金属。

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

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期未进行股指期货交易。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期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

本基金本报告期未进行国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

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 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

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	1,972.38
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	830.08
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	2,802.46

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

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的股票。

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

	长安沪深300非周期指数A	长安沪深300非周期指数C
报告期期初基金份额总额	10,796,616.09	165,680.50
报告期期间基金总申购份额	110,511.91	46,637.66
减：报告期期间基金总赎回份额	291,414.77	46,520.01
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	10,615,713.23	165,798.15

总申购份额包含红利再投资、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

本报告期内，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§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

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额达到或超过20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

2026年8月13日，崔晓健离任长安基金管理有限公司董事长职务；2026年8月14日，陈卓权担任长安基金管理有限公司董事长职务。

2026年8月24日，李晔担任长安基金管理有限公司总经理职务，同日孙晔伟离任长安基金管理有限公司总经理职务。

2026年8月31日，李晔担任长安基金管理有限公司财务总监职务，同日王娟离任长安基金管理有限公司财务负责人职务。

§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.cafund.com。

长安基金管理有限公司

2026年10月27日