

长城安心回报混合型证券投资基金

2012 半年度报告摘要

基金管理人:长城基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
送出日期:2012年8月25日

基金管理人、基金托管人、基金销售机构不存在虚假记载、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。
基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2012年08月20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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。
本报告于2012年07月01日起至6月30日止。

Table with 2 columns: 基金基本情况, 基金管理人. Includes details like 基金名称, 基金代码, 基金管理人名称, 基金托管人名称, etc.

2.2 基金产品说明
以获取高于银行一年期定期存款(税前)利率2倍的回报为目标,通过适当的资产配置平衡当期收益与长期资本增值,力争为投资者实现长期稳定的绝对回报。

投资目标
分析上市公司盈利、固定收益品种当期收益率、上市公司持续成长潜力、动态配置基金资产,采用注重收益、关注流动性、精选个股的投资策略,通过把握上市公司成长超预期、持续成长潜力、选择具有持续分红能力或持续成长潜力的企业作为主要投资对象。

风险收益特征
本基金是绝对回报产品,其预期收益和风险低于股票型基金,高于债券基金与货币市场基金。

2.3 基金管理人、基金托管人
基金管理人:长城基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

信息披露负责人:李秀琴
联系电话:0755-23982338
电子邮箱:chaojun@cfund.com.cn

2.4 信息披露方式
投资者可通过本基金的基金管理人网站、基金销售机构、基金托管人网站、中国证监会基金信息披露网站等途径获取基金定期报告。

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
本期已实现收益 -115,589,105.70

3.1.2 期末数据和指标
期末可供分配基金份额利润 -0.0561
期末基金净值 7,540,849,557.62

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 业绩比较基准收益率② ①-②

3.2.2 自基金合同生效以来基金业绩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:①本基金合同规定本基金投资组合为:股票投资比例为基金净资产的10%-85%;权证投资比例为基金净资产的0%-3%;

4. 基金管理人及基金情况
4.1 基金管理人及其管理基金的经验
长城基金管理有限公司是经中国证监会批准设立的第15家基金管理公司,由长城证券有限责任公司45%、东方证券股份有限公司15%、西北证券有限责任公司45%、北方国际信托投资股份有限公司45%、中原信托投资有限公司45%于2001年12月27日共同出资设立。

4.2 基金管理人报告期内基金运作的合规情况说明
报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《长城安心回报混合型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险和防范风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大的利益。

4.3 管理人报告期内公平交易情况的专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合,制定并完善公平交易制度和流程,通过信息系统和人工稽核等方式对异常交易进行实时监控,严格执行公平交易制度,确保各投资组合的公平交易。

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,没有出现基金参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的现象。

4.4 管理人报告期内基金投资组合和业绩表现的情况
4.4.1 报告期内基金投资组合的情况
截至2012年6月30日,本基金投资组合中股票投资占基金资产净值的比例为66.85%。

4.4.2 报告期内基金业绩表现的情况
报告期内,本基金业绩表现良好,在同类产品中排名靠前。从净值的阶段性表现看,下跌主要集中在一季度,二季度业绩快速回升,基金净值得到较大改善。

4.5 管理人报告期内基金估值程序的情况
从目前的宏观经济形势看,国内外不确定性因素仍然较多,悲观情绪暂时获得了缓解,但由于政治因素,后续政策落地依然充满变数,国内经济企稳回升,传统行业产能过剩,中小企业生存困难,消费低迷,房价有抬头的迹象,虽然CPI下行货币政策调整打开了一定的空间,但上述因素也使得宏观经济政策调整难度加大。

4.6 管理人报告期内基金估值程序的情况
1.参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历
本基金管理人估值委员会由基金管理人估值委员会成员组成,包括基金管理人估值委员会成员、基金托管人估值委员会成员、基金销售机构估值委员会成员、基金注册登记机构估值委员会成员、基金估值服务机构估值委员会成员。

4.7 基金管理人报告期内基金估值程序的情况
1.参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历
本基金管理人估值委员会由基金管理人估值委员会成员组成,包括基金管理人估值委员会成员、基金托管人估值委员会成员、基金销售机构估值委员会成员、基金注册登记机构估值委员会成员、基金估值服务机构估值委员会成员。

4.8 基金管理人报告期内基金估值程序的情况
1.参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历
本基金管理人估值委员会由基金管理人估值委员会成员组成,包括基金管理人估值委员会成员、基金托管人估值委员会成员、基金销售机构估值委员会成员、基金注册登记机构估值委员会成员、基金估值服务机构估值委员会成员。

4.9 基金管理人报告期内基金估值程序的情况
1.参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历
本基金管理人估值委员会由基金管理人估值委员会成员组成,包括基金管理人估值委员会成员、基金托管人估值委员会成员、基金销售机构估值委员会成员、基金注册登记机构估值委员会成员、基金估值服务机构估值委员会成员。

4.10 基金管理人报告期内基金估值程序的情况
1.参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历
本基金管理人估值委员会由基金管理人估值委员会成员组成,包括基金管理人估值委员会成员、基金托管人估值委员会成员、基金销售机构估值委员会成员、基金注册登记机构估值委员会成员、基金估值服务机构估值委员会成员。

4.11 基金管理人报告期内基金估值程序的情况
1.参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历
本基金管理人估值委员会由基金管理人估值委员会成员组成,包括基金管理人估值委员会成员、基金托管人估值委员会成员、基金销售机构估值委员会成员、基金注册登记机构估值委员会成员、基金估值服务机构估值委员会成员。

4.12 基金管理人报告期内基金估值程序的情况
1.参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历
本基金管理人估值委员会由基金管理人估值委员会成员组成,包括基金管理人估值委员会成员、基金托管人估值委员会成员、基金销售机构估值委员会成员、基金注册登记机构估值委员会成员、基金估值服务机构估值委员会成员。

4.13 基金管理人报告期内基金估值程序的情况
1.参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历
本基金管理人估值委员会由基金管理人估值委员会成员组成,包括基金管理人估值委员会成员、基金托管人估值委员会成员、基金销售机构估值委员会成员、基金注册登记机构估值委员会成员、基金估值服务机构估值委员会成员。

4.14 基金管理人报告期内基金估值程序的情况
1.参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历
本基金管理人估值委员会由基金管理人估值委员会成员组成,包括基金管理人估值委员会成员、基金托管人估值委员会成员、基金销售机构估值委员会成员、基金注册登记机构估值委员会成员、基金估值服务机构估值委员会成员。

2. 参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突
估值委员会秉承基金持有人利益至上的宗旨,在估值方法的选择上力求客观、公允,在数据的采集上力求公开、获取方便、操作性强、不易操纵。本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大的利益冲突。

3. 已采纳的估值程序的性质与范围
本基金管理人尚未就没有市价的投资品种的定价服务签署任何协议。
4.7 管理人报告期内基金估值程序的情况
根据《长城安心回报混合型证券投资基金基金合同》关于收益分配原则的规定,本基金收益每年最多分配12次,年度收益分配比例不低于基金可分配收益的60%,基金收益分配后基金份额净值不能低于面值。截止本报告期末,本基金可供分配利润为-648,334,407.48元,不进行收益分配。

5. 托管人报告
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明
本基金托管人中国农业银行股份有限公司在报告期内严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金托管业务管理办法》及相关法律法规的规定,履行了托管人职责,不存在任何违法违规行为,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人报告
5.2.1 托管人报告
5.2.2 托管人报告
5.2.3 托管人报告

5.3 托管人报告
5.3.1 托管人报告
5.3.2 托管人报告
5.3.3 托管人报告

5.4 托管人报告
5.4.1 托管人报告
5.4.2 托管人报告
5.4.3 托管人报告

5.5 托管人报告
5.5.1 托管人报告
5.5.2 托管人报告
5.5.3 托管人报告

5.6 半年度财务会计报告(未经审计)
6.1 资产负债表
单位:人民币元

Balance Sheet Table with columns: 资产, 附注号, 2012年6月30日, 2011年12月31日, 2011年6月30日. Includes items like 银行存款, 结算备付金, 存出保证金, etc.

6.2 利润表
单位:人民币元

Income Statement Table with columns: 项目, 2012年1月1日至2012年6月30日, 2011年1月1日至2011年6月30日. Includes items like 一、收入, 利息收入, 公允价值变动收益, etc.

6.3 所有者权益变动表
单位:人民币元

Equity Statement Table with columns: 项目, 2012年1月1日至2012年6月30日, 2011年1月1日至2011年6月30日. Includes items like 一、期初所有者权益, 本期经营活动产生的基金净值变动, etc.

6.4 基金管理人报告期内基金估值程序的情况
1.参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历
本基金管理人估值委员会由基金管理人估值委员会成员组成,包括基金管理人估值委员会成员、基金托管人估值委员会成员、基金销售机构估值委员会成员、基金注册登记机构估值委员会成员、基金估值服务机构估值委员会成员。

6.5 基金管理人报告期内基金估值程序的情况
1.参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历
本基金管理人估值委员会由基金管理人估值委员会成员组成,包括基金管理人估值委员会成员、基金托管人估值委员会成员、基金销售机构估值委员会成员、基金注册登记机构估值委员会成员、基金估值服务机构估值委员会成员。

6.6 基金管理人报告期内基金估值程序的情况
1.参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历
本基金管理人估值委员会由基金管理人估值委员会成员组成,包括基金管理人估值委员会成员、基金托管人估值委员会成员、基金销售机构估值委员会成员、基金注册登记机构估值委员会成员、基金估值服务机构估值委员会成员。

6.7 基金管理人报告期内基金估值程序的情况
1.参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历
本基金管理人估值委员会由基金管理人估值委员会成员组成,包括基金管理人估值委员会成员、基金托管人估值委员会成员、基金销售机构估值委员会成员、基金注册登记机构估值委员会成员、基金估值服务机构估值委员会成员。

6.8 基金管理人报告期内基金估值程序的情况
1.参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历
本基金管理人估值委员会由基金管理人估值委员会成员组成,包括基金管理人估值委员会成员、基金托管人估值委员会成员、基金销售机构估值委员会成员、基金注册登记机构估值委员会成员、基金估值服务机构估值委员会成员。

6.9 基金管理人报告期内基金估值程序的情况
1.参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历
本基金管理人估值委员会由基金管理人估值委员会成员组成,包括基金管理人估值委员会成员、基金托管人估值委员会成员、基金销售机构估值委员会成员、基金注册登记机构估值委员会成员、基金估值服务机构估值委员会成员。

6.10 基金管理人报告期内基金估值程序的情况
1.参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历
本基金管理人估值委员会由基金管理人估值委员会成员组成,包括基金管理人估值委员会成员、基金托管人估值委员会成员、基金销售机构估值委员会成员、基金注册登记机构估值委员会成员、基金估值服务机构估值委员会成员。

6.11 基金管理人报告期内基金估值程序的情况
1.参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历
本基金管理人估值委员会由基金管理人估值委员会成员组成,包括基金管理人估值委员会成员、基金托管人估值委员会成员、基金销售机构估值委员会成员、基金注册登记机构估值委员会成员、基金估值服务机构估值委员会成员。

注:投资者欲了解本报告期内本基金投资的所有股票明细, 应阅读登载于本基金管理人网站 www.cfund.com.cn 的半年度报告正文。
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动
7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

Table of major stock purchases: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期初基金资产净值比例(%).

7.4.2 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细
金额单位:人民币元

Table of major stock purchases: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计卖出金额, 占期初基金资产净值比例(%).

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额
单位:人民币元

Table of stock purchase costs and income: 买入股票成本(成交总额), 卖出股票收入(成交总额).

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合
金额单位:人民币元

Table of bond portfolio: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值比例(%).

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细
金额单位:人民币元

Table of top 5 bond investments: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值, 占基金资产净值比例(%).

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细
注:本基金本报告期末持有资产支持证券投资。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细
注:本基金本报告期末未持有权证。

7.9 投资组合报告附注
7.9.1 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到过公开谴责、处罚。

7.9.2 基金投资的前十名股票中,未有投资于超出基金合同规定备选股票库之外股票。
7.9.3 期末其他各项资产构成

Table of top 10 securities: 序号, 名称, 金额, 单位:人民币元.

7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.9.5 期末持有的资产支持证券投资明细
注:本基金本报告期末持有资产支持证券投资。

7.9.6 投资组合前五名股票未流通受限的情况
注:本基金本报告期末未持有受限股票。

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构
单位:份

Table of fund shareholders: 持有人户数, 户均持有的基金份额, 机构投资者持有份额, 个人投资者持有份额.

基金管理人所有从业人员持有基金份额情况
注:①本公司高级管理人员、基金投资和研究人员持有本基金基金份额总数的区间为0%。
②本基金基金经理持有本基金基金份额总数的区间为0%。

9. 开放式基金资产变动
单位:份

Table of fund assets: 基金合同生效日(2006年8月22日), 基金份额总额, 1,416,548,067.74.

10.1 基金持有人大会决议
本基金报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的重大人事变动
1.基金管理人重大人事变动
经中国证监会核准,聘任彭洪波先生和梁煜先生为公司副总经理。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼
报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的变动
报告期内投资策略未发生变更。

10.5 为基金持有人提供审计的会计师事务所变更
报告期内基金为基金持有人提供审计的会计师事务所无变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受行政处罚或刑事处罚情况
本基金本报告期基金管理人、基金托管人涉及托管业务机构及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况
10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及基金支付情况
金额单位:人民币元

Table of securities used: 券商名称, 交易单元数量, 成交金额, 占当期股票成交总额的比例, 佣金, 占当期佣金总额的比例, 备注.