

长城安心回报混合型证券投资基金

[2012] 第三季度报告

基金管理人:长城基金管理有限公司

基金托管人:中国建设银行股份有限公司

报告送出日期:2012年10月25日

§ 1 重要提示

本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。

本基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同的规定，于2012年10月22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。

本基金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。

本报告书部分财务数据未经审计。

本报告书自2012年07月01日起至09月30日止。

§ 2 基金产品概况

长城安心回报混合型证券投资基金

基金简称 2000007

交易代码 约定型开放式

基金合同生效日 2006年4月16日

报告期末基金份额总额 4,751,726,948.65份

投资目标 重点投资于消费品及消费服务相关行业中的优势企业，同时适度配置成长类股票，以获得高于平均水平的资本增值。

投资策略 本基金主要通过股票投资来实现收益，股票投资比例为基金净资产的60%~95%，债券及短期金融工具的投资比例为基金净资产的5%~40%。现金或者到期日在一年以内（含一年）的货币市场工具的比例不超过基金总资产的5%以下。本基金的建仓期为自本基金基金合同生效日起6个月，建仓期间，各项资产配置比例符合基金合同约定。

业绩比较基准 中证中信标普300指数收益率+15%×中债国债指数收益率+5%×同业存款利率

风险收益特征 风险收益特征：本基金是混合型基金，属于证券投资基金中的中等风险品种，预期收益与风险水平低于股票基金，高于货币市场基金。

基金管理人 长城基金管理有限公司

基金托管人 中国建设银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

主要财务指标 报告期(2012年7月1日 - 2012年9月30日)

1.本期已实现收益 89,063,553.62

2.本期利润 84,188,151.96

3.加权平均基金份额本期利润 0.0073

4.期末基金份额净值 7,609,417,166.22

5.期末基金总资产 6,059,712,650.69

注：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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 报告期内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 1.12% 0.77% 1.52% 0.01% -0.40% 0.76%

3.2.2 日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

基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率走势图

注：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%，债券投资比例为基金净资产的10%-85%；现金或者到期日在一年以内的货币市场基金为5%以下。本基金的建仓期为自本基金基金合同生效日起6个月，建仓期间，各项资产配置比例符合基金合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理或基金经理助理简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期限 任职日期 离任日期 说明

徐九龙 本基金基金经理 2009年1月6日 - 10年

注：①上任职日期、离任日期根据公司做出决定的任免日期填写。

②证券从业年限的计算方式遵从《证券业协会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守廉洁情况的说明

本基金管理人严格遵守了《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本基金，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利益，未出现投资运作、法律法规、基金合同约定和相关规定的违规行为。本公司勤勉尽责的操作不当而导致基金财产损失的情况，不存在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

本基金管理人严格按照不同投资组合之间的公平原则，对向同向交易进行事后分析，定期出具公平交易报告并对外披露。本报告期，本公司严格执行了《证券投资基金法》、《证券投资基金托管协议》、《公司公平交易制度指导意见》和《长城基金管理有限公司公平交易制度》，在投资决策、风险管理、防范风险等方面严格执行了公平交易制度，不存在不公平交易行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金管理人未发现存在异常交易行为，没有出现基金参与的交易所公开竞价同日反向交易成

交较高的单边交易量，且至少未跌破2000点指数关口才出现反弹。期间，周期性行业调整幅度较大，而下游消费类板块涨幅相对较小，且个股分化加剧。

本基金一直坚持年初以来的判断，基本面对消费类资产，虽然白酒板块三季度回落较大，但医药板块季度表现较好。本基金仓位有所下降，主要是因为前期涨幅较大的个股进行了减持，但持仓结构整

体较为分散，整体表现较好。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金的过往业绩并不代表其未来表现。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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2012年07月01日起至09月30日止。

§ 5 基金产品概况

长城消费增值股票型证券投资基金

基金简称 2000006

交易代码 约定型开放式

基金合同生效日 2006年4月16日

报告期末基金份额总额 4,751,726,948.65份

投资目标 重点投资于消费品及消费服务相关行业中优势企业的股票，同时适当配置成长类股票，以获得高于平均水平的资本增值。

投资策略 本基金合同规定本基金投资组合中，股票投资比例为基金净资产的60%~95%，债券及短期金融工

具的投资比例为基金净资产的5%~40%。现金或者到期日在一年以内（含一年）的货币市场工具的比例不超过基金总资产的5%以下。本基金的建仓期为自本基金基金合同生效日起6个月，建仓期间，各项资产配置比例符合基金合同约定。

业绩比较基准 中证中信标普300指数收益率+15%×中债国债指数收益率+5%×同业存款利率

风险收益特征 风险收益特征：本基金是股票型基金，属于证券投资基金中的较高风险品种，预期收益与风险水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。

基金管理人 长城基金管理有限公司

基金托管人 中国建设银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

主要财务指标 报告期(2012年7月1日 - 2012年9月30日)

1.本期已实现收益 -1,816,074.92

2.本期利润 13,282,722.93

3.加权平均基金份额本期利润 0.0028

4.期末基金份额净值 3,829,228,188.80

5.期末基金份额净值 0.8059

注：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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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 0.34% 0.92% -5.18% 0.93% 5.52% -0.01%

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

注：本基金的过往业绩并不代表其未来表现。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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2012年07月01日起至09月30日止。

§ 6 开放式基金份额变动

报告期期初基金份额总额 11,559,313,261.51

报告期期间基金申购总量 169,630,785.94

报告期期间基金赎回总量 193,494,697.27

报告期期末基金份额总额 -

报告期期末基金份额净值 11,535,449,350.18

注：①上任职日期、离任日期根据公司做出决定的任免日期填写。

②证券从业年限的计算方式遵从《证券业协会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守廉洁情况的说明

本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、《长城消费增值股票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本基金，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利益，未出现投资运作、法律法规、基金合同约定和相关规定的违规行为。本公司勤勉尽责的操作不当而导致基金财产损失的情况，不存在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

本基金管理人严格按照不同投资组合之间的公平原则，对向同向交易进行事后分析，定期出具公平交易报告并对外披露。本报告期，本公司严格执行了《证券投资基金法》、《证券投资基金托管协议》、《公司公平交易制度指导意见》和《长城基金管理有限公司公平交易制度》，在投资决策、风险管理、防范风

险等方面严格执行了公平交易制度，不存在不公平交易行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金管理人未发现存在异常交易行为，没有出现基金参与的交易所公开竞价同日反向交易成

交较高的单边交易量，且至少未跌破2000点指数关口才出现反弹。期间，周期性行业调整幅度较大，而下游消费类板块涨幅相对较小，且个股分化加剧。

本基金一直坚持年初以来的判断，基本面对消费类资产，虽然白酒板块三季度回落较大，但医药

板块季度表现较好。本基金仓位有所下降，主要是因为前期涨幅较大的个股进行了减持，但持仓结

构整体较为分散，整体表现较好。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金的过往业绩并不代表其未来表现。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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2012年07月01日起至09月30日止。

§ 7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

7.2 备查文件

7.3 备查文件

7.4 备查文件

7.5 备查文件

7.6 备查文件

7.7 备查文件

7.8 备查文件

7.9 备查文件

7.10 备查文件

7.11 备查文件

7.12 备查文件

7.13 备查文件

7.14 备查文件

7.15 备查文件

7.16 备查文件

7.17 备查文件

7.18 备查文件

7.19 备查文件

7.20 备查文件

7.21 备查文件

7.22 备查文件

7.23 备查文件