

长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF)

[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:华夏银行股份有限公司
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承诺本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其中内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

本基金托管人交通银行股份有限公司根据基金合同规定，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，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。

本报告期中财务资料未经审计。

本报告期自2012年07月01日起至09月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称 长城久富股票(LOF) 长城久富(场内简称)

交易代码 162006

基金运作方式 约定开放式

基金合同生效日 2007年12月12日

报告期末基金份额总额 2,040,118,215.31份

投资目标 投资于具有核心竞争力的企业，分享其在中国经济高速增长、平稳增长背景下的持续成长所带来的良好收益，力争为基金份额持有人实现稳定的超额回报。

投资策略 本基金投资的核心策略是“自下而上，精选个股”，同时根据市场偏好适度调整主题类资产以保持组合的均衡性。本基金将根据宏观经济形势、行业景气度、企业评价体系，以“具备核心竞争力，能够在市场竞争中获取超额收益的企业”为主，构建均衡的投资组合。

业绩比较基准 75%×沪深300指数收益率+25%×中信全债指数收益率。

风险收益特征 本基金具有较高预期风险和较高预期风险的产品，其预期收益与风险均高于混合基金、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 交通银行股份有限公司

§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(2012年7月1日-2012年9月30日)

1.本期已实现收益 39,643,327.55

2.本期利润 -6,441,380.69

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0031

4.期末基金份额净值 2,100,050,903.57

5.期末基金份额总额 1,029.4

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，计算费用后实际收益水平要低于所列数据。

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 -0.23% 1.06% -5.07% 0.89% 4.84% 0.17%

3.2.2 自基金转型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:①本基金于2007年2月12日由封闭式基金久富成长转型而来。

②本基金转型时本基金管理人的资产净值为股票资产占基金总资产60%-95%，债券占基金总资产0%-35%，现金或到期日在一年以内的政府债券不高于基金总资产的5%。本基金的建仓期为自本基金基金合同生效日起6个月，建仓期满时，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

杨建华 公司总经理 助理、投资总监、基金投资总监、基金基金经理 2009年9月22日 - 12年 男，中国籍，北京大学力学系理学学士，北京大学光华管理学院经济学硕士，清华大学工程力学系博士，技术有限公司财务部、长城证券有限公司财务部、长城证券有限公司、曾任基金公司责任经理，华泰证券股份有限公司、曾任基金经理，“长城安心回报”、“长城稳健回报”基金经理。

注:①上述任职日期，离任日期根据公司做出的任免日期填写。

②本基金从经理的算符方式从证券业协会“证券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合规性情况的说明

本基金报告期内，基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、《长城久富核心成长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和运用基金资产，在控制和防范风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大的利益，未出现违反法律法规、基金合同约定和相关法规的情况，因无因公司未勤勉尽责或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情况。

4.3 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯执行对旗下管理的所有基金和制，严格执行公平交易制度。在投资决策、交易执行、信息传递以及人工工单保证交易公平的执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金法》、《长城久富核心成长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和运用基金资产，在控制和防范风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大的利益，未出现违反法律法规、基金合同约定和相关法规的情况，因无因公司未勤勉尽责或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情况。

4.4 公平交易行为的专项说明

本基金管理人一贯执行对旗下管理的所有基金和制，严格执行公平交易制度。在投资决策、交易执行、信息传递以及人工工单保证交易公平的执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金法》、《长城久富核心成长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和运用基金资产，在控制和防范风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大的利益，未出现违反法律法规、基金合同约定和相关法规的情况，因无因公司未勤勉尽责或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情况。

4.5 异常交易行为的专项说明

本基金管理人一贯执行对旗下管理的所有基金和制，严格执行公平交易制度。在投资决策、交易执行、信息传递以及人工工单保证交易公平的执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金法》、《长城久富核心成长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和运用基金资产，在控制和防范风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大的利益，未出现违反法律法规、基金合同约定和相关法规的情况，因无因公司未勤勉尽责或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情况。

4.6 报告期内基金的业绩表现

本基金报告期净值增长率为-0.23%，基金业绩比较基准收益率为-5.07%。

§5 投资组合报告

注: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，由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本基金报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

长城货币A

阶段 净值收益率① 净值收益率标准差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 0.7974% 0.0042% 1.008% 0.0000% 0.6966% 0.0042%

长城货币B

阶段 净值收益率① 净值收益率标准差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 0.8585% 0.0042% 1.008% 0.0000% 0.7577% 0.0042%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:①本基金于2007年2月12日由封闭式基金久富成长转型而来。

②本基金从经理的算符方式从证券业协会“证券从业人员资格管理办法”的相关规定。

4.7 报告期内本基金的利润分配情况

本基金报告期中未进行利润分配。

4.8 报告期内基金的现金流量表

本基金报告期中未发生重大现金流入和流出。

4.9 报告期内基金的费用情况

本基金报告期中未发生重大费用。

4.10 报告期内本基金的其他重要信息

本基金报告期中未发生其他重要信息。

4.11 其他需要说明的事项

本基金报告期中未发生其他需要说明的事项。

4.12 其他重要事项

本基金报告期中未发生其他重要事项。

4.13 其他重要事项

本基金报告期中未发生其他重要事项。

4.14 其他重要事项

本基金报告期中未发生其他重要事项。

4.15 其他重要事项

本基金报告期中未发生其他重要事项。

4.16 其他重要事项

本基金报告期中未发生其他重要事项。

4.17 其他重要事项

本基金报告期中未发生其他重要事项。

4.18 其他重要事项

本基金报告期中未发生其他重要事项。

4.19 其他重要事项

本基金报告期中未发生其他重要事项。

4.20 其他重要事项

本基金报告期中未发生其他重要事项。

4.21 其他重要事项

本基金报告期中未发生其他重要事项。

4.22 其他重要事项

本基金报告期中未发生其他重要事项。

4.23 其他重要事项

本基金报告期中未发生其他重要事项。

4.24 其他重要事项

本基金报告期中未发生其他重要事项。

4.25 其他重要事项

本基金报告期中未发生其他重要事项。

4.26 其他重要事项

本基金报告期中未发生其他重要事项。

4.27 其他重要事项

本基金报告期中未发生其他重要事项。

4.28 其他重要事项

本基金报告期中未发生其他重要事项。

4.29 其他重要事项

本基金报告期中未发生其他重要事项。

4.30 其他重要事项

本基金报告期中未发生其他重要事项。

4.31 其他重要事项

本基金报告期中未发生其他重要事项。

4.32 其他重要事项

本基金报告期中未发生其他重要事项。

4.33 其他重要事项

本基金报告期中未发生其他重要事项。

4.34 其他重要事项

本基金报告期中未发生其他重要事项。

4.35 其他重要事项

本基金报告期中未发生其他重要事项。

4.36 其他重要事项

本基金报告期中未发生其他重要事项。

4.37 其他重要事项

本基金报告期中未发生其他重要事项。

4.38 其他重要事项

本基金报告期中未发生其他重要事项。

4.39 其他重要事项

本基金报告期中未发生其他重要事项。

4.40 其他重要事项

本基金报告期中未发生其他重要事项。

4.41 其他重要事项

本基金报告期中未发生其他重要事项。

4.42 其他重要事项

本基金报告期中未发生其他重要事项。

4.43 其他重要事项

本基金报告期中未发生其他重要事项。

4.44 其他重要事项

本基金报告期中未发生其他重要事项。

4.45 其他重要事项