长安宏观策略股票型证券投资基金

【2012】第三季度报告

基金管理人:长安基金管理有限公司
基金托管人:中国邮政储蓄银行股份有限公司
报告送出日期:2012年10月25日

§1 重要提示

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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2012年10月24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2012年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长安宏观策略股票
基金主代码	740001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年3月9日
报告期末基金份额总额	74,942,441.78份
投资目标	本基金在宏观策略研判的基础上,通过强化配置景气行业及精选基本面良好、成长性突出的上市公司,在有效控制风险的前提下,力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金从全球视野的角度出发,把握全球经济一体化、国际产业格局调整与转移以及国内经济工业化、城市化、产业结构升级与消费结构升级所带来的投资机遇,自上而下地实施股票、债券、现金等大类资产之间的战略配置和各行业之间的优化配置,并结合自下而上的个股精选策略和债券投资策略,构建投资组合,力争获取超额投资收益。 1.资产配置策略 本基金通过深入分析宏观经济、政策环境、估值水平和市场情绪等因素,综合评判股票、债券等各类资产的风险收益特征的相对变化,根据不同的市场形势,适时动态地调整股票、债券、现金之间的配置比例。 2.行业配置策略 本基金在大类资产配置的框架下,实施积极主动的行业配置策略。本基金将首先确定宏观经济及产业政策等因素对不同行业的潜在影响,通过行业生命周期分析和行业景气度分析,筛选出处于成长期和景气度上升的行业,进行重点配置和动态调整。 3.个股选择策略 本基金在行业配置的基础上,将充分发挥基金管理人在股票研究方面的专业优势,采用定量分析与定性分析相结合的方法,精选基本面良好、成长性突出的上市公司,构建投资组合。 4.债券投资策略 本基金将债券投资作为控制基金整体投资风险和提高非股票资产收益率的重要手段,在控制流动性风险的基础上,通过久期管理、期限结构配置、类属配置和个券选择等层次进行积极主动的组合管理。 5.权证投资策略 本基金对权证的投资以对冲下跌风险、实现保值和锁定收益为主要目的。本基金在权证投资中以对应的标的证券的基本面为基础,结合权证定价模型、市场供求关系、交易制度设计等多种因素对权证进行定价,利用权证衍生工具的特性,通过权证与证券的组合投资,来达到改善组合风险收益特征的目的。 6.股指期货投资策略 本基金将根据有关法律法规和政策的规定,在严格控制风险的前提下,本着谨慎原则,以套期保值为主要目的,参与股指期货的投资,以管理投资组合的系统性风险,改善投资组合的风险收益特征。基金管理人制定了股指期货投资决策流程和风险控制制度并经董事会审议通过。此外,基金管理人建立了股指期货交易决策小组,授权相关管理人员负责股指期货的投资审批事项。 7.其他金融工具的投资策略 对于监管机构允许基金投资的其他金融工具,本基金将在谨慎分析收益率、风险水平、流动性和金融工具自身特征的基础上进行稳健投资,以降低组合风险,实现基金资产的保值增值。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为股票型证券投资基金,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、较高预期收益品种。
基金管理人	长安基金管理有限公司
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司

§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	-6,803,813.20
2.本期利润	-5,924,877.94
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0750
4.期末基金资产净值	66,683,319.92
5.期末基金份额净值	0.890

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。

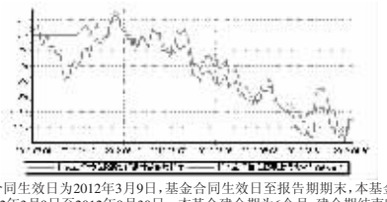
3.2 基金净值表现

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	-7.68%	0.89%	-5.67%	0.95%	-2.01%	-0.06%

注:本基金整体业绩比较基准构成为:沪深300指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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:本基金基金合同生效日为2012年3月9日,基金合同生效日至报告期期末,本基金运作时间未满一年。图示日期为2012年3月9日至2012年9月30日。本基金建仓期为6个月,建仓期结束时本基金各项资产配置比例已符合基金合同约定。

§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
		任职日期	离任日期		
雷宇	本基金的基金经理	2012年6月28日	-	12年	中国人民大学经济学硕士。曾任中国技术进出口总公司项目经理、研究员、上海中技投资顾问有限公司研究员、投资经理,通用技术集团投资管理有限公司投资经理、投资部副总监、国金通用基金管理有限公司筹备期基金经理助理、风险管理部负责人等职。2011年8月加入长安基金管理有限公司,任基金经理助理,2012年6月28日至今任长安宏观策略股票基金的基金经理。
吴富佳	本基金的基金经理、公司研究总监	2012年3月9日	2012年8月27日	9年	复旦大学经济学博士。曾任泰康人寿保险股份有限公司研究发展部负责人、金元证券有限责任公司研究所总经理、中邮创业基金管理有限公司投资研究部总经理、研究总监、国金通用基金管理有限公司首席经济学家、投研总监等职,2011年6月加入长安基金管理有限公司。

注:1、上表中吴富佳同志的任职日期为该基金基金合同成立日、其他任职、离职日期均为我公司做出决定并公告之日;

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》、《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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金的投资策略和运作分析

国内宏观经济持续第10个季度下滑,GDP增速已经接近7.5%的"警戒线",期间"稳增长"政策屡低于预期,导致市场信心受到打击。在此背景下,沪深股市持续走低,持续不断的扩容进一步打击了市场人气。期间市场出现普跌局面,前期强势的非周期类行业出现补跌,而二季度超跌的周期类板块在本季度表现相对抗跌。

报告期内,本基金保持相对平衡的股票仓位,对组合品种进行了大幅的结构性调整,由于对宏观经济走势和政策方面的把握难度加大,我们加大了中长期稳定成长行业的组合配置,倾向于弱周期业绩增长确定的个股。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2012年9月30日,本基金份额净值为0.890元。报告期内,本基金份额净值增长率为-7.68%,同期业绩比较基准增长率为-5.67%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来,国内经济的调整无论从时间上还是幅度上,都已经达到正常经济调整的极限水平,同时市场大部分行业公司估值亦达到历史最低水平,在此情况下,我们对四季度的市场持谨慎乐观态度,股市进一步下跌的空间有限。我们认为,中国经济内在的增长动力依然充足,外围疲弱有利于国内经济软着陆。在近半年来货币政策稳健放松,财政政策逐步加力的情况下,国内经济将扭转单边下跌的趋势,股票市场也将迎来稳步回升的机会。因此,我们认为期间任何一次非理性的下跌都是长期投资者买入优质个股的绝佳时机,我们将致力于寻找具有长期竞争优势和持续成长潜力的优秀企业,通过分享他们的成长,为投资者创造更高的长期回报。

本基金将以经济结构调整为主线,坚持挖掘具有中长期成长潜力的投资品种,优化组合,着眼未来进行长线布局。我们珍惜基金份额持有人的每一分投资和每一份信任,我们将继续规范运作,审慎投资,勤勉尽责地为基金份额持有人谋求长期、稳定的回报。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	53,443,365.97	76.39
	其中:股票	53,443,365.97	76.39
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	15,760,610.45	22.53
6	其他各项资产	760,175.98	1.09
7	合计	69,964,152.40	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	793,535.40	1.19
C	制造业	25,825,336.37	38.73
C0	食品、饮料	5,074,472.69	7.61
C1	纺织、服装、皮毛	324,754.32	0.49
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	8,257,996.96	12.38
C5	电子	4,808,048.90	7.21
C6	金属、非金属	1,766,608.34	2.65
C7	机械、设备、仪表	3,446,826.12	5.17
C8	医药、生物制品	2,146,629.04	3.22
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	5,100,994.16	7.65
G	信息技术业	6,842,002.94	10.26
H	批发和零售贸易	4,077,491.64	6.11
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	8,027,755.06	12.04
L	传播与文化产业	2,776,250.40	4.16
M	综合类	-	-
	合计	53,443,365.97	80.15

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

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	000415	渤海租赁	1,060,014	6,190,481.76	9.28
2	300251	光线传媒	120,184	2,776,250.40	4.16
3	000861	海印股份	185,374	2,654,555.68	3.98
4	002215	诺普信	350,273	2,634,052.96	3.95
5	300132	青松股份	191,700	2,591,784.00	3.89
6	002429	兆驰股份	195,790	2,527,648.90	3.79
7	002368	太极股份	130,000	2,148,900.00	3.22
8	000423	东阿阿胶	54,657	2,116,319.04	3.17
9	300146	汤臣倍健	38,205	2,025,247.05	3.04
10	002415	海康威视	70,000	1,940,400.00	2.91

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名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名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名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 报告期内本基金投资的前十名证券中兆驰股份(证券代码:002429)于2011年11月3日受到深圳证券交易所通报批评处分。本基金对该股票的投资符合法律法规和公司制度。除此之外,本基金投资的前十名证券中其他证券的发行主体报告期内没有被监管部门立案调查,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.8.2 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。

5.8.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	750,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,444.84
5	应收申购款	5,731.14
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	760,175.98

5.8.4 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无处于转股期的可转换债券。

5.8.5 报告期末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情况。

5.8.6 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

本报告期期初基金份额总额	82,794,366.49
本报告期基金总申购份额	651,676.80
减:本报告期基金总赎回份额	8,503,601.51
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	74,942,441.78

§7 影响投资者决策的其他重要信息

7.1.本报告期内,公司根据《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》及管理人网站进行了如下信息披露:

1、2012年7月2日披露了《长安基金管理有限公司关于旗下基金资产净值、基金份额净值及基金份额累计净值的公告》。

2、2012年7月13日披露了《关于增加杭州数米基金销售有限公司为长安宏观策略股票型证券投资基金代销机构并参加申购费率优惠的公告》。

3、2012年7月20日披露了《长安宏观策略股票型证券投资基金2012年第2季度报告》。

4、2012年8月25日披露了《长安宏观策略股票型证券投资基金2012年半年度报告》。

5、2012年8月25日披露了《长安宏观策略股票型证券投资基金2012年半年度报告摘要》。

6、2012年8月28日披露了《长安宏观策略股票型证券投资基金基金经理变更公告》。

7、2012年9月14日披露了《关于增加西安银行股份有限公司为长安基金旗下基金代销机构的公告》。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会核准基金募集的文件;

2、长安宏观策略股票型证券投资基金基金合同;

3、长安宏观策略股票型证券投资基金托管协议;

4、长安宏观策略股票型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。

8.2 存放地点

上海市浦东新区芳甸路1088号紫竹国际大厦16层。

8.3 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
二〇一二年十月二十五日

长安沪深300非周期行业指数证券投资基金

【2012】第三季度报告

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:2012年10月25日

§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2012年10月24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2012年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长安沪深300非周期
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	163,487,909.61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(2012年07月01日-2012年09月30日)
1.本期已实现收益	-5,709,850.76
2.本期利润	-6,119,220.81
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0254
4.期末基金资产净值	160,949,138.30
5.期末基金份额净值	0.984

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。

3.2 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	-1.50%	0.66%	-6.66%	1.15%	5.16%	-0.49%

注: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份额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:本基金基金合同生效日为2012年6月25日,基金合同生效日至报告期期末,本基金运作时间未满一年。图示日期为2012年6月25日至2012年9月30日。按基金合同或招募说明书的约定,本基金建仓期为6个月,截止本报告期末本基金仍处于建仓期。

§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		
王磊	本基金的基金经理	2012年06月25日	-	5年	吉林大学经济学硕士。曾任中邮创业基金管理有限公司战略发展部副总经理、国金通用基金管理有限公司筹备期研究员等职。2011年8月加入长安基金管理有限公司,任基金经理助理,2012年6月25日至今任长安沪深300非周期行业指数基金的基金经理。

注: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》、《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

为了公平对待各类投资人,保护各类投资人利益,避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为,公司根据《证券投资基金法》、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部规章,拟定了《公平交易管理办法》,对公司管理的各类资产的公平对待做了明确具体的规定,并规定对买卖股票、债券时候的价格和市场价格差距较大,可能存在操纵股价、利益输送等违法违规情况进行监控。本报告期,按照时间优先、价格优先的原则,本公司对满足限价条件且对同一证券有相同交易需求的基金等投资组合,均采用了系统中的公平交易模块进行操作,实现了公平交易:未出现清算不到位的情况,且本基金及本基金与本基金管理人管理的其他投资组合之间未发生法律法规禁止的反向交易及交叉交易。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期内,本公司所有投资组合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未超过该证券当日成交量的5%。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金的投资策略和运作分析

截止本报告期末,本基金仍处于6个月的建仓期内。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2012年9月30日,本基金份额净值为0.984元。报告期内,本基金份额净值增长率为-1.5%,同期业绩基准增长率为-6.66%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金为被动式指数型基金,在完成建仓期后,基金管理人将按照基金合同的要求,坚持指数化投资策略,通过运用定量分析的手段,分析和应对导致基金跟踪误差的因素,继续努力将基金的跟踪误差控制在较低水平。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	133,464,757.87	81.59
	其中:股票	133,464,757.87	81.59
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	29,314,627.00	17.92
6	其他各项资产	804,438.44	0.49
7	合计	163,583,823.31	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)按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	2,185,901.92	1.36
B	采掘业	1,564,312.90	0.97
C	制造业	87,953,520.53	54.65
C0	食品、饮料	27,602,550.98	17.15
C1	纺织、服装、皮毛	1,166,962.50	0.73
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	6,300,662.26	3.91
C5	电子	5,250,971.67	3.26
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	31,482,742.50	19.56
C8	医药、生物制品	15,479,325.74	9.62
C99	其他制造业	670,304.88	0.42
D	电力、煤气及水的生产和供应业	10,298,861.14	6.40
E	建筑业	11,252,736.10	6.99
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	6,727,854.31	4.18
H	批发和零售贸易	6,696,098.57	4.16
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	3,260,712.15	2.03
L	传播与文化产业	1,353,743.01	0.84
M	综合类	2,171,017.24	1.35
	合计	133,464,757.87	82.92

5.2.2 报告期末(积极投资)按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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 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

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	36,428	8,954,002.40	5.56
2	600104	上汽集团	353,309	4,783,803.86	2.97
3	002304	洋河股份	37,221	4,652,625.00	2.89
4	000858	五粮液	109,619	3,716,084.10	2.31
5	600900	长江电力	509,406	3,290,762.76	2.04
6	601668	中国建筑	872,653	2,679,044.71	1.66
7	600031	三一重工	263,188	2,526,604.80	1.57
8	601989	中国重工	456,528	2,168,508.00	1.35
9	000651	格力电器	96,992	2,073,688.96	1.29
10	000895	双汇发展	33,405	2,021,002.50	1.26

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名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名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名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 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。

5.8.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	500,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	8,871.94
5	应收申购款	295,566.50
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	804,438.44

5.8.4 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无处于转股期的可转换债券。

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.1 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情况。

5.8.5.2 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。

5.8.6 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

本报告期期初基金份额总额	277,132,832.76
本报告期基金总申购份额	423,354.16
减:本报告期基金总赎回份额	114,068,277.31
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	163,487,909.61

§7 影响投资者决策的其他重要信息

7.1.本报告期内,公司根据《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》和《证券日报》及管理人网站进行了如下信息披露:

1、2012年6月26日披露了《长安沪深300非周期行业指数证券投资基金基金合同生效公告》。

2、2012年7月2日披露了《长安基金管理有限公司关于旗下基金资产净值、基金份额净值及基金份额累计净值的公告》。

3、2012年8月24日披露了《关于长安沪深300非周期行业指数证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告》。

4、2012年8月24日披露了《关于长安沪深300非周期行业指数证券投资基金推出网上直销申购、网上直销定期定额投资业务并实行费率优惠活动的公告》。

5、2012年8月24日披露了《关于长安沪深300非周期行业指数证券投资基金在代销机构推出定期定额投资业务并参加费率优惠活动的公告》。

6、2012年9月14日披露了《关于增加西安银行股份有限公司为长安基金旗下基金代销机构的公告》。

7.2.其他相关信息

无。

长安基金管理有限公司
二〇一二年十月二十五日

国投瑞银全球新兴市场精选股票型证券投资基金(LOF)

【2012】第三季度报告

基金管理人:国投瑞银基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2012年10月25日

§1 重要提示

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2012年10月23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2012年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国投瑞银新兴市场股票(QDII-LOF)(场内简称:国投新兴)
基金主代码	161210
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2010年6月10日
报告期末基金份额总额	66,439,823.43份
投资目标	本基金主要投资于全球新兴市场国家或者地区,通过对投资对象的精选和组合投资,分散投资风险,力求实现基金资产的中长期稳定增值。
投资策略	本基金将采取积极的股票投资管理策略,充分借鉴UBS Global AM的全球投资管理经验,在辅助性地考虑类别资产配置、国别或区域配置等因素的基础上,主要通过精选具有国际竞争力或高成长性的全球新兴市场优质企业和严谨的风险控制管理下的组合构建及调整,力求实现基金资产的中长期稳定增长。
业绩比较基准	摩根士丹利资本国际新兴市场指数(MSCI Emerging Markets Index(Net Total Return))
风险收益特征	本基金为全球投资股票型证券投资基金,属于较高预期风险和预期收益的证券投资基金品种,其预期风险与收益水平高于债券型基金和混合型基金。由于投资国家与地区市场的分散,风险低于投资单一市场的股票型基金。但是,本基金主要投资于全球新兴市场的证券,因此具有较大的新兴市场投资所面临的特定风险。
基金管理人	国投瑞银基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
境外投资顾问	英文名称:UBS Global Asset Management(Singapore)Ltd 中文名称:瑞银环球资产管理(新加坡)有限公司
境外资产托管人	英文名称:Standard Chartered Bank(Hong Kong)Limited 中文名称:渣打银行(香港)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

金额单位: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	-2,399,096.47
2.本期利润	5,656,886.32
3.加权平均基金份额本期利润	0.0769
4.期末基金资产净值	65,526,453.90
5.期末基金份额净值	0.986

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、以上所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(例如基金申购赎回费、基金转换费等),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 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	8.95%	1.05%	7.24%	0.93%	1.71%	0.12%

注:1、MSCI Emerging Markets Index(Net Total Return),即摩根士丹利资本国际新兴市场指数,是按照自由流通市值调整方法并考虑净红利再投资的全回报(Total return)因素编制的跟踪全球新兴市场的全球性投资指数,是适合作为全球新兴市场投资业绩比较基准的指数。

2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

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