

# 长城安心回报混合型证券投资基金 [2014] 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:中国农业银行股份有限公司  
报告送出日期:2014年10月27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。

本基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2014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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2014年07月01日起至09月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	长城安心回报混合
基金代码	200008
交易代码	200008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年8月22日
报告期末基金份额总额	8,664,179,741.51份

投资目标

追求较高收益，同时兼顾风险控制，力争实现基金资产的长期稳定增值。

分析公司股价水平，固定收益类品种当前收益率，上市公司经营成

长趋势，动态配置基金资产，采用“进益收益，关注成长，精选个股”的

投资策略，通过上市公司的股息率、持仓成本、盈利能力，选择具

有持续增长潜力的股票进行投资，同时适当配置债券类资产。

本基金是绝对收益型基金，其预期收益与风险低于股票基金，高于债

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:中国农业银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2014年7月1日 - 2014年9月30日)

1.本期已实现收益 48,360,056.92

2.本期利润 487,582,234.51

3.期初平均基金份额净值 0.9501

4.期末基金净值 6,630,448,176.05

5.期末基金份额净值 0.7653

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，计价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① % 业绩比较基准收 益② % 业绩比较基准收益 率差额③ % 单位净值④ ①-③ ②-④

过去三个月 7.02% 0.69% 1.32% 0.01% 5.50% 0.68%

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

图示了基金成立以来的净值增长情况，显示基金净值从2006年8月22日的1.00元增长至2014年9月30日的0.7653元，期间波动较大，但整体呈上升趋势。

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政府

债券投资为基金净资产的5%以上。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
徐九龙	长城安心回报混合型基金基金经理	2009年1月6日	-	12年

注:①上述任职日期、离任日期根据公司做出决定的任命日期填写。

②证券从业人员的计算方式遵从证券业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内基金运作遵守行业规范的情况的说明

本报告期内，本基金管理人遵守了《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取最大的利益，未出现违反法律法规、基金合同约定和相关规定的现象，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行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 平等交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金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管理制度》的规定，不存在利用不同的投资组合之间的交易时机、交易方

式、交易价格等方面获取异常利益的情况。

4.3.2 不同投资组合之间公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《长城品牌优选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取最大的利益，未出现违反法律法规、基金合同约定和相关规定的

情况，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行

为。

4.4 公平交易行为的专项说明

报告期内本基金在日常交易行为中，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。

4.4.1 报告期内基金的资产配置比例说明

本报告期内，本基金管理人未进行国债期货投资，本期未持有国债期货。

4.4.2 报告期内基金的资产配置比例说明

本基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《长城品牌优选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取最大的利益，未出现违反法律法规、基金合同约定和相关规定的

情况，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行

为。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内本基金的业绩表现率为7.02%，本基金业绩比较基准收益率为1.52%。

§ 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 5,125,005,538.07 76.91

其中:股票 5,125,005,538.07 76.91

2 固定收益投资 698,215,590.60 10.48

其中:债券 698,215,590.60 10.48

3 货币市场工具 - -

4 金融衍生品投资 - -

5 其他资产 500,200,452.60 7.64

其中:应收申购款 - -

6 银行存款和结算备付金合计 320,529,437.25 4.81

7 其他资产 10,378,992.78 0.16

8 合计 6,663,330,011.30 100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

A 农、林、牧、渔业 - -

B 采矿业 117,815,956.64 1.78

C 制造业 3,981,452,551.43 60.05

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 - -

E 建筑业 - -

F 批发零售业 478,550,000.00 7.22

G 交通运输、仓储和邮政业 - -

H 住宿和餐饮业 - -

I 信息传输、软件和信息技术服务业 456,405,000.00 6.88

J 金融业 - -

K 房地产业 - -

L 预测商务服务业 - -

M 科学研究、技术服务业 2,030,000.00 0.00

N 水利、环境和公共设施管理业 90,780,000.00 1.37

O 居民服务、修理和其他服务业 - -

P 教育 - -

Q 卫生和社会工作 - -

R 文化、体育和娱乐业 - -

S 综合 - -

合计 5,125,005,538.07 77.30

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

序号 股票代码 股票名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 600519 贵州茅台 2,500,000.00 6.41

2 000933 华东医药 6,100,000.00 5.51

3 600594 盘锦石化的 9,498,907 356,209,12.50 5.37

4 000568 沪商集团 18,000,000 320,230,444.75 4.83

5 600535 天士力 7,700,840 320,269,272.01 4.83

6 600887 伊利股份 12,000,000 310,807,070.00 4.69

7 000513 丽珠集团 5,362,584 283,077,83.52 4.27

8 600557 海正药业 7,102,177 194,670,671.57 2.94

9 000895 双汇国际 5,800,000 194,648,000.00 2.94

10 600406 国电南瑞 11,000,000 188,430,000.00 2.84

5.4 报告期内涉及诉讼的公告索引

本报告期内，本基金未涉及诉讼。

§ 3 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2014年7月1日 - 2014年9月30日)

1.本期已实现收益 48,360,056.92

2.本期利润 487,582,234.51

3.期初平均基金份额净值 1.0501

4.期末基金净值 6,630,448,176.05

5.期末基金份额净值 0.7653

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