

长城医疗保健股票型证券投资基金

[2015] 第二季度报告

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:2015年7月21日

§ 1 重要提示

本基金管理人的董事、监事、高级管理人员在报告期间内没有发生虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其实质内容的真实性、准确性、完整性承担责任。

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规定，于2015年07月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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信为原则，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。

§ 2 基金产品概况

§ 3 主要财务指标

报告期(2015年4月1日—2015年6月30日) 单位:人民币元

1.本期已实现收益 60,913,364.18

2.本期利润 116,572,472.08

3.期末基金余额 906,246,734.05

4.期末基金份额净值 1.4095

注:①本基金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 本报告期内基金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(%) 累计净值基准收益率 累计净值基准收益率差 (%) ①-③ ②-④

过去三个月 14.04% 2.24% 17.94% -2.54% -3.90% 0.10%

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

图:长城医疗保健股票型证券投资基金净值增长率与业绩比较基准收益率走势图

注:①本基金合同规定本基金的投资组合比例为:股票投资比例为基金资产的60%—95%，其中投资于医疗保健行业上市公司股票的比例不低于本基金资产的80%;其余资产投资于债券、权证、货币市场工具及法律法规或中国证监会允许的其他金融工具。本基金现金或者到期日在一年以内可以支取的现金比例合计不超过基金资产净值的5%。

②本基金的建仓期为本基金合同生效之日起6个月内，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、长城医疗保健、长城新兴产业基金基金经理 2014年2月28日 13年

注:①上任日期、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《证券业协会证券从业人员资格管理规定》的相关规定。

4.2 管理人对本基金运作合规性情况的说明

本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《长城医疗保健股票型证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规的规定，履行诚实守信、勤勉尽责的职责，不存在损害基金持有人利益的情况。

4.3 公平交易制度的执行情况

报告期内未发现本基金存在不公平交易行为，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且双边买卖量超过该证券当年总成交量5%的现象。

4.4 报告期内本基金的偏离度情况

报告期内，本基金的偏离度始终在±0.5%的范围内，未超过偏离度的绝对值0.5%的界限。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金合同生效以来至本报告期，期间总回报率为14.04%，在同类型基金中排名居前。目前行业增长压力较大，但具有研究能力和行业模式的公司获得长期竞争优势。通过本次调仓后，市场将逐步恢复理性，我们将逐步调整行业组合，继续在控制风险的前提下，努力提高基金的投资绩效。

4.6 报告期内基金管理人人数和基金资产净值的变动说明

本基金报告期内，基金管理人人数无需要说明的情况。

§ 5 投资组合报告

5.1 期末基金资产组合情况

报告期(2015年4月1日—2015年6月30日) 单位:人民币元

1 权益投资 723,840,162.94 87.20

2 固定收益投资 723,840,162.94 87.20

3 国际投资 53,450,000 0.01

4 货币市场工具 - -

5 其他资产 - -

6 银行存款和结算备付金合计 108,273,610.61 12.68

7 其他资产 887,279.80 0.11

8 合计 830,654,503.35 100.00

注:本基金合同规定本基金投资组合为:股票投资占基金资产的比例范围为60%—95%;债券投资占基金资产的比例范围为30%—35%;权证投资占基金资产净值的比例范围20%-30%;现金以及到期日在一年以内可以支取的现金比例合计不超过基金资产净值的5%。本基金的建仓期为自基金合同生效之日起6个月内，建仓期间，各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.2.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期内基金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(%) 累计净值基准收益率 累计净值基准收益率差 (%) ①-③ ②-④

过去三个月 -6.59% 2.24% 17.98% -2.19% -2.36% 0.06%

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:长城医疗保健股票型证券投资基金净值增长率与业绩比较基准收益率走势图

注:本基金合同规定本基金的投资组合为:股票投资比例为基金资产的60%—95%;债券投资占基金资产的比例范围为30%—35%;权证投资占基金资产净值的比例范围20%-30%;现金以及到期日在一年以内可以支取的现金比例合计不超过基金资产净值的5%。本基金的建仓期为自基金合同生效之日起6个月内，建仓期间，各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.3 主要财务指标

报告期(2015年4月1日起至2015年6月30日止) 单位:人民币元

1.本期已实现收益 30,238,991.64

2.本期利润 -2,472,198.06

3.期末平均基金份额利润 -0.0267

4.期末基金份额净值 93,311,636.87

5.期末基金份额净值 1.276

注:①本基金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。

3.2.3 基金净值表现

3.2.1 本报告期内基金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(%) 累计净值基准收益率 累计净值基准收益率差 (%) ①-③ ②-④

过去三个月 -6.59% 2.24% 17.98% -2.19% -2.36% 0.06%

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:长城医疗保健股票型证券投资基金净值增长率与业绩比较基准收益率走势图

注:本基金合同规定本基金的投资组合为:股票投资占基金资产的比例范围为60%—95%;债券投资占基金资产的比例范围为30%—35%;权证投资占基金资产净值的比例范围20%-30%;现金以及到期日在一年以内可以支取的现金比例合计不超过基金资产净值的5%。本基金的建仓期为自基金合同生效之日起6个月内，建仓期间，各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.3 主要财务指标

报告期(2015年4月1日起至2015年6月30日止) 单位:人民币元

1.本期已实现收益 30,238,991.64

2.本期利润 -2,472,198.06

3.期末平均基金份额利润 -0.0267

4.期末基金份额净值 93,311,636.87

5.期末基金份额净值 1.276

注:①本基金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。

3.4 公平交易制度的执行情况

报告期内未发现本基金存在不公平交易行为，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且双边买卖量超过该证券当年总成交量5%的现象。

4.4 报告期内本基金的偏离度情况

报告期内，本基金的偏离度始终在±0.5%的范围内，未超过偏离度的绝对值0.5%的界限。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金合同生效以来至本报告期，期间总回报率为14.04%，在同类型基金中排名居前。目前行业增长压力较大，但具有研究能力和行业模式的公司获得长期竞争优势。通过本次调仓后，市场将逐步恢复理性，我们将逐步调整行业组合，继续在控制风险的前提下，努力提高基金的投资绩效。

4.6 报告期内基金管理人人数和基金资产净值的变动说明

本基金报告期内，基金管理人人数无需要说明的情况。

§ 5.1 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 2,167,000.00 0.27

B 矿采业 - -

C 制造业 526,291,767.06 65.36

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 - -

E 建筑业 3,896,301.80 0.48

F 批发和零售业 191,471,017.61 23.78

G 交通运输、仓储和邮政业 - -

H 宿含餐饮业 - -

I 信息传输、软件和信息技术服务业 9,431.04 0.00

J 金融业 - -

K 房地产业 - -

L 租赁和商务服务业 - -

M 科学、技术服务业 - -

N 水利、环境和公共设施管理业 - -

O 国际服务、修理和其他服务业 - -

P 教育 - -

Q 卫生和社会工作 4,046.44 0.00

R 文化、体育和娱乐业 - -

S 综合 - -

合计 723,840,162.94 100.00

注:本基金占资产净值比例重大的股票名称、在报告期内的持股比例、占基金资产净值的比例

本基金的前十名股票、债券、基金名称、在报告期内的持股比例、占基金资产净值的比例

本基金的前十名股票、债券、基金名称、在