

中证财通中国可持续发展100(ECPI ESG)指数增强型证券投资基金

【2015】第三季度报告

基金管理人:财通基金管理有限公司
基金托管人:上海银行股份有限公司
报告送出日期:2015年10月30日

基金管理人及基金托管人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。
基金管理人:财通基金管理有限公司
基金托管人:上海银行股份有限公司
报告送出日期:2015年10月30日

基金管理人及基金托管人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。
基金管理人:财通基金管理有限公司
基金托管人:上海银行股份有限公司
报告送出日期:2015年10月30日

基金管理人:财通基金管理有限公司
基金托管人:上海银行股份有限公司
报告送出日期:2015年10月30日

基金管理人:财通基金管理有限公司
基金托管人:上海银行股份有限公司
报告送出日期:2015年10月30日

基金管理人:财通基金管理有限公司
基金托管人:上海银行股份有限公司
报告送出日期:2015年10月30日

基金管理人:财通基金管理有限公司
基金托管人:上海银行股份有限公司
报告送出日期:2015年10月30日

基金管理人:财通基金管理有限公司
基金托管人:上海银行股份有限公司
报告送出日期:2015年10月30日

基金管理人:财通基金管理有限公司
基金托管人:上海银行股份有限公司
报告送出日期:2015年10月30日

基金管理人:财通基金管理有限公司
基金托管人:上海银行股份有限公司
报告送出日期:2015年10月30日

基金管理人:财通基金管理有限公司
基金托管人:上海银行股份有限公司
报告送出日期:2015年10月30日

基金管理人:财通基金管理有限公司
基金托管人:上海银行股份有限公司
报告送出日期:2015年10月30日

基金管理人:财通基金管理有限公司
基金托管人:上海银行股份有限公司
报告送出日期:2015年10月30日

基金管理人:财通基金管理有限公司
基金托管人:上海银行股份有限公司
报告送出日期:2015年10月30日

基金管理人:财通基金管理有限公司
基金托管人:上海银行股份有限公司
报告送出日期:2015年10月30日

基金管理人:财通基金管理有限公司
基金托管人:上海银行股份有限公司
报告送出日期:2015年10月30日

基金管理人:财通基金管理有限公司
基金托管人:上海银行股份有限公司
报告送出日期:2015年10月30日

基金管理人:财通基金管理有限公司
基金托管人:上海银行股份有限公司
报告送出日期:2015年10月30日

代码	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	-	-
C	制造业	119,563,603	0.67
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	1,064,000.00	4.16
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社公工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
合计		1,172,563,603	4.64

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000003	五粮液	50,000	622,000.00	2.06
2	000108	中信银行	48,769	379,872.14	1.28
3	000004	中航地产	13,104	373,252.86	1.47
4	001019	中信证券	31,500	368,285.00	1.46
5	001985	中国国旅	40,300	351,110.00	1.39
6	001918	山东黄金	41,423	328,060.00	1.35
7	000076	康美药业	17,319	320,368.02	1.30
8	300068	蓝色光标	22,728	325,016.80	1.28
9	000003	中信证券	7,117	280,806.02	1.15
10	000056	中航	10,480	267,823.57	1.08

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	001985	中国国旅	20,000	1,064,000.00	4.16
2	000007	华能国际	8,185	119,563,603	0.67

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	001985	中国国旅	20,000	1,064,000.00	4.16
2	000007	华能国际	8,185	119,563,603	0.67

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	001985	中国国旅	20,000	1,064,000.00	4.16
2	000007	华能国际	8,185	119,563,603	0.67

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	001985	中国国旅	20,000	1,064,000.00	4.16
2	000007	华能国际	8,185	119,563,603	0.67

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	001985	中国国旅	20,000	1,064,000.00	4.16
2	000007	华能国际	8,185	119,563,603	0.67

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	001985	中国国旅	20,000	1,064,000.00	4.16
2	000007	华能国际	8,185	119,563,603	0.67

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	001985	中国国旅	20,000	1,064,000.00	4.16
2	000007	华能国际	8,185	119,563,603	0.67

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	001985	中国国旅	20,000	1,064,000.00	4.16
2	000007	华能国际	8,185	119,563,603	0.67

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	001985	中国国旅	20,000	1,064,000.00	4.16
2	000007	华能国际	8,185	119,563,603	0.67

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	001985	中国国旅	20,000	1,064,000.00	4.16
2	000007	华能国际	8,185	119,563,603	0.67

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	001985	中国国旅	20,000	1,064,000.00	4.16
2	000007	华能国际	8,185	119,563,603	0.67

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	001985	中国国旅	20,000	1,064,000.00	4.16
2	000007	华能国际	8,185	119,563,603	0.67

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	001985	中国国旅	20,000	1,064,000.00	4.16
2	000007	华能国际	8,185	119,563,603	0.67

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	001985	中国国旅	20,000	1,064,000.00	4.16
2	000007	华能国际	8,185	119,563,603	0.67

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	001985	中国国旅	20,000	1,064,000.00	4.16
2	000007	华能国际	8,185	119,563,603	0.67

长城安心回报混合型证券投资基金

【2015】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:2015年10月26日

基金管理人及基金托管人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:2015年10月26日

基金管理人及基金托管人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:2015年10月26日

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:2015年10月26日

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:2015年10月26日

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:2015年10月26日

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:2015年10月26日

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:2015年10月26日

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:2015年10月26日

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:2015年10月26日

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:2015年10月26日

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:2015年10月26日

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:2015年10月26日

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:2015年10月26日

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:2015年10月26日

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:2015年10月26日

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:2015年10月26日

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:2015年10月26日

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	--	--
C	制造业	1,261,586,183.31	61.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	--	--
E	建筑业	--	--
F	批发和零售业	271,121,000.00	13.13
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	268,022,020.85	12.85
J	金融业	--	--
K	房地产业	41,088,020.00	1.99
L	租赁和商务服务业	--	--
M	科学研究和技术服务业	--	--
N	水利、环境和公共设施管理业	79,229,471.10	3.86
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	5,625,790.00	0.27
		2,087,032,266.00	100.00

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000003	五粮液	2,600,000	181,410,000.00	7.46
2	000076	康美药业	3,400,000	157,460,000.00	6.44
3	200017	招商证券	2,000,927	106,468,862.17	4.33
4	000513	顺络电子	2,600,000	103,374,000.00	4.27
5	000001	平安银行	1,000,000	97,166,240.00	3.99
6	000079	人福医药	6,000,000	95,540,000.00	3.72
7	002294	亿纬锂能	3,500,000	86,410,000.00	3.63
8	000511	国药股份	2,700,000	79,191,000.00	3.26
9	000087	伊利股份	5,000,000	76,300,000.00	3.16
10	000086	顺电网络	5,000,000	70,560,000.00	2.91

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000003	五粮液	2,600,000	181,410,000.00	7.46
2	000076	康美药业	3,400,000	157,460,000.00	6.44
3	200017	招商证券	2,000,927	106,468,862.17	4.33
4	000513	顺络电子	2,600,000	103,374,000.00	4.27
5	000001	平安银行	1,000,000	97,166,240.00	3.99
6	000079	人福医药	6,000,000	95,540,000.00	3.72
7	002294	亿纬锂能	3,500,000	86,410,000.00	3.63
8	000511	国药股份	2,700,000	79,191,000.00	3.26
9	000087	伊利股份	5,000,000	76,300,000.00	3.16
10	000086	顺电网络	5,000,000	70,560,000.00	2.91

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000003	五粮液	2,600,000	181,410,000.00	7.46
2	000076	康美药业	3,400,000	157,460,000.00	6.44
3	200017	招商证券	2,000,927	106,468,862.17	4.33
4	000513	顺络电子	2,600,000	103,374,000.00	4.27
5	000001	平安银行	1,000,000	97,166,240.00	3.99
6	000079	人福医药	6,000,000	95,540,000.00	3.72
7	002294	亿纬锂能	3,500,000	86,410,000.00	3.63
8	000511	国药股份	2,700,000	79,191,000.00	3.26
9	000087	伊利股份	5,000,000	76,300,000.00	3.16
10	000086	顺电网络	5,000,000	70,560,000.00	2.91

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000003	五粮液	2,600,000	181,410,000.00	7.46
2	000076	康美药业	3,400,000	157,460,000.00	6.44
3	200017	招商证券	2,000,927	106,468,862.17	4.33
4	000513	顺络电子	2,600,000	103,374,000.00	4.27
5	000001	平安银行	1,000,000	97,166,240.00	3.99
6	000079	人福医药	6,000,000	95,540,000.00	3.72
7	002294	亿纬锂能	3,500,000	86,410,000.00	3.63
8	000511	国药股份	2,700,000	79,191,000.00	3.26
9	000087	伊利股份	5,000,000	76,300,000.00	3.16
10	000086	顺电网络	5,000,000	70,560,000.00	2.91

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000003	五粮液	2,600,000	181,410,000.00	7.46
2	000076	康美药业	3,400,000	157,460,000.00	6.44
3	200017	招商证券	2,000,927	106,468,862.17	4.33
4	000513	顺络电子	2,600,000	103,374,000.00	4.27
5	000001	平安银行	1,000,000	97,166,240.00	3.99
6	000079	人福医药	6,000,000	95,540,000.00	3.72
7	002294	亿纬锂能	3,500,000	86,410,000.00	3.63
8	000511	国药股份	2,700,000	79,191,000.00	3.26
9	000087	伊利股份	5,000,000	76,300,000.00	3.16
10	000086	顺电网络	5,000,000	70,560,000.00	2.91

5.11.2

基金投资的前十名股票中,未有投资于超出基金合同规定备选股票库之外股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	银行理财产品	1,715,690.64
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,366,835.50
5	应收申购款	20,807.77
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-