

# 长城安心回报混合型证券投资基金 2016 年第 3 季度报告

2016 年 9 月 30 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：2016 年 10 月 24 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 2016 年 10 月 20 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 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
基金主代码	200007
交易代码	200007
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	2,494,403,469.34 份
投资目标	以获取高于银行一年期定期存款（税前）利率 2 倍的回报为目标，通过动态的资产配置平衡当期收益与长期资本增值，争取为投资人实现长期稳定的绝对回报。
投资策略	分析上市公司股息率、固定收益品种当期收益率、上市公司持续成长潜力，动态配置基金资产。采用“注重收益、关注成长、精选个股”的投资策略，通过把握上市公司股息率预期、持续成长潜力，选择具有持续分红能力或持续成长潜力的企业作为主要投资对象。
业绩比较基准	银行一年期定期存款（税前）利率的 2 倍
风险收益特征	本基金是绝对回报产品，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（2016年7月1日—2016年9月30日）
1. 本期已实现收益	87,077,216.36
2. 本期利润	110,480,557.80
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0418
4. 期末基金资产净值	2,437,215,625.92
5. 期末基金份额净值	0.9771

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	4.29%	0.65%	0.76%	0.01%	3.53%	0.64%

### 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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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
		任职日期	离任日期		
吴文庆	公司研究部总经理、长城久恒、长城双动力、长城安心回报、长城新兴	2016 年 1 月 18 日	-	7 年	男，中国籍，上海交通大学生物医学工程博士。2010 年进入长城基金管理有限公司，曾任研究部行业研究员，“长城品牌优选混合型证券投资基金”

	产业、长城改革红利基金的基金经理				基金经理助理，“长城消费增值混合型证券投资基金”基金经理，“长城环保主题灵活配置混合型证券投资基金”基金经理。
--	------------------	--	--	--	---

注：①上述任职日期、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《证券业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求最大的利益，未出现投资违反法律法规、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。

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理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，不同投资者的利益得到了公平对待。

本基金管理人严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，对同向交易的价差进行事后分析，定期出具公平交易稽核报告。本报告期报告认为，本基金管理人旗下投资组合的同向交易价差均在合理范围内，结果符合相关政策法规和公司制度的规定。

##### 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，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 报告期内基金投资策略和运作分析

第三季度的市场震荡上行，表现较好的板块为建筑、装饰类板块，这些板块得益于 PPP 政策的拉动；在举牌等概念的影响下，房地产板块也表现较好。三季度市场的主旋律主要是中盘蓝筹加短期概念炒作。表现较差的行业主要是估值较高的计算机、传媒、电子和军工等板块，这些板块的表现处于各行业的最后面。

展望四季度来看，市场会比较敏感，一是上市公司三季报验证期，同时市场对公司全年预期

的预期也基本确定，常常是个股分化比较明显的一个季度；二是在二级市场处于个股估值切换和业绩排名的关键季度，这个时候个股的表现常常会超过市场的预期，热点也会精彩纷呈。

这个四季度也是外部环境较为敏感的时点：美国大选、联储加息、德意志银行是否会引发危机、意大利修宪公投等。这些事件有可能带来全球金融市场的震荡，怎样配置好组合和调节好仓位是四季度投资的挑战。

三季度，本基金一直将机械、医药、汽车、公用事业作为核心配置品种，并辅以新兴成长行业作为进攻配置，在季度中对热点的版块和个股进行了一定程度的波段操作。我们将继续细心甄别风险，选择未来几个季度业绩增长确定，具备长期空间的行业和公司作为本基金投资的重点，争取为持有人做出更好的回报。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内基金业绩在同类可比的基金中排名位于偏上水平。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金无需要说明的情况。

### §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	1,664,055,883.22	68.04
	其中：股票	1,664,055,883.22	68.04
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	277,141,000.00	11.33
	其中：债券	277,141,000.00	11.33
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	50,000,195.00	2.04
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	450,734,395.44	18.43
8	其他资产	3,811,453.71	0.16
9	合计	2,445,742,927.37	100.00

#### 5.2 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	36,645,000.00	1.50
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,068,631,620.88	43.85
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	96,123,479.20	3.94
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	261,982,982.93	10.75
G	交通运输、仓储和邮政业	27,724,386.40	1.14
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	155,501,898.70	6.38
J	金融业	177,223.18	0.01
K	房地产业	-	-
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	17,269,291.93	0.71
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	1,664,055,883.22	68.28

### 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	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000963	华东医药	2,299,919	158,004,435.30	6.48
2	000513	丽珠集团	2,199,940	119,478,741.40	4.90
3	002509	天广中茂	7,999,895	101,438,668.60	4.16
4	300147	香雪制药	5,599,804	77,333,293.24	3.17
5	002574	明牌珠宝	5,000,000	69,750,000.00	2.86
6	600525	长园集团	4,999,920	69,498,888.00	2.85
7	002303	美盈森	5,000,085	66,351,127.95	2.72
8	600146	商赢环球	2,000,000	66,160,000.00	2.71
9	601777	力帆股份	5,899,899	56,226,037.47	2.31
10	002368	太极股份	1,749,918	56,207,366.16	2.31

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	100,110,000.00	4.11
2	央行票据	-	-
3	金融债券	119,681,000.00	4.91
	其中：政策性金融债	119,681,000.00	4.91
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	57,350,000.00	2.35
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	277,141,000.00	11.37

#### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	019539	16 国债 11	1,000,000	100,110,000.00	4.11
2	130234	13 国开 34	700,000	70,161,000.00	2.88
3	1382138	13 甘公投 MTN1	500,000	57,350,000.00	2.35
4	110237	11 国开 37	500,000	49,520,000.00	2.03
5	-	-	-	-	-

#### 5.6 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资产支持证券投资明细

注：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序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未投资股指期货，本期末未持有股指期货。



## 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金尚未在基金合同中明确股指期货的投资策略、比例限制、信息披露方式等，暂不参与股指期货交易。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露方式等，暂不参与国债期货交易。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未进行国债期货投资，本期末未持有国债期货。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1

本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到过公开谴责、处罚。

### 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	存出保证金	893,723.48
2	应收证券清算款	61,748.60
3	应收股利	-
4	应收利息	2,854,405.28
5	应收申购款	1,576.35
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,811,453.71

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

**5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002509	天广中茂	101,438,668.60	4.16	重大事项停牌
2	002574	明牌珠宝	69,750,000.00	2.86	重大事项停牌
3	600525	长园集团	69,498,888.00	2.85	重大事项停牌
4	002303	美盈森	66,351,127.95	2.72	重大事项停牌

**5.11.6 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，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

报告期期初基金份额总额	2,717,474,221.86
报告期期间基金总申购份额	56,932,909.61
减：报告期期间基金总赎回份额	280,003,662.13
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	2,494,403,469.34

**§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况****7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况**

注：本报告期基金管理人持有本基金的份额情况无变动，于本报告期期初及期末均未持有本基金份额。

**7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细**

注：本报告期本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## §8 备查文件目录

### 8.1 备查文件目录

1. 本基金设立批准的相关文件
2. 《长城安心回报混合型证券投资基金基金合同》
3. 《长城安心回报混合型证券投资基金托管协议》
4. 法律意见书
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. 中国证监会规定的其他文件

### 8.2 存放地点

广东省深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层

### 8.3 查阅方式

投资者可在办公时间亲临上述存放地点免费查阅，如有疑问，可向本基金管理人长城基金管理有限公司咨询。

咨询电话：0755-23982338

客户服务电话：400-8868-666

公司网址：<http://www.ccfund.com.cn>