

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:2013年10月23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。

本基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年10月18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。

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,基金的风险与收益并不必然成正比,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2013年07月01日起至09月30日止。

§2 基金产品概况

基金名称	长城安心回报混合
基金代码	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	11,151,286,257.58份

投资目标: 选取高成长性个股并定期调整持仓(权重)为管理目标,通过动态资产配置平衡当期收益与投资长期回报,争取为投资者实现长期稳定的增值。

投资策略: 本基金重点投资于具有核心能力或持续增长潜力的优势企业,采取适度灵活而前瞻的资产配置策略,在获取高于国内一年期定期存款或同期2年期定期存款收益的基础上,力争实现基金资产的增值。本基金采取自上而下资产配置策略,在充分研究宏观经济形势、上市公司估值水平、行业景气度、市场流动性、利率水平、估值水平的基础上,自上而下选择行业,并在此基础上进行个股选择。本基金采取自上而下资产配置策略,在充分研究宏观经济形势、上市公司估值水平、行业景气度、市场流动性、利率水平、估值水平的基础上,自上而下选择行业,并在此基础上进行个股选择。

业绩比较基准: 沪深300指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%

风险收益特征: 本基金属混合型证券投资基金,其预期收益与风险高于债券基金,低于股票基金和货币市场基金。

基金管理人: 长城基金管理有限公司
基金托管人: 中国建设银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2013年7月1日-2013年9月30日)
1.本期已实现收益	84,016,466.79
2.本期利润	407,298,301.21
3.加权平均基金份额本期利润	0.0412
4.期末基金份额净值	8.031,094,965.82
5.期末基金资产净值	90,342,972,972.97

§4 基金净值表现

本基金自成立以来的基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图

§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	5,493,234,972.79	6.081
2	固定收益投资	5,493,234,972.79	6.081
3	银行存款	1,173,498,709.00	14.53
4	买入返售金融资产	421,705,192.56	5.22
5	其他金融资产	971,698,540.63	12.08
6	其他资产	17,418,660.61	0.22
7	合计	8,077,646,095.59	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金总资产比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	69,863,452.65	0.871
C	制造业	4,249,327,210.86	52.97
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,969,000,000.00	24.43
E	建筑业	111,583,716.38	1.39
F	批发和零售业	413,362,161.04	5.15
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术业	241,028,963.11	3.00
J	金融业	156,289,125.89	1.95
K	房地产业	251,788,616.60	3.13
L	综合类	-	-
M	科学研究和技术服务业	2,310,000.00	0.03
N	水利、环境和公共设施管理业	7,445,000.00	0.09
O	教育	-	-
P	卫生健康业	-	-
Q	软件和信息技术服务业	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	其他	-	-
合计		5,493,234,972.79	68.39

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	000561	格力电器	13,000,584	345,295,511.04	4.30
2	200568	泸州老窖	16,000,121	337,602,553.10	4.20
3	600594	广汇股份	8,200,444	275,548,558.40	3.43
4	600062	华鲁恒升	13,000,729	271,585,228.81	3.38
5	600079	华明医药	8,000,000	229,520,000.00	2.83
6	600131	顺络电子	5,000,000	217,215,000.00	2.71
7	600919	华谊集团	1,600,570	124,378,465.80	1.59
8	600897	厦门国贸	4,800,678	222,991,403.10	2.78
9	600252	中汇集团	12,000,918	179,548,274.10	2.24
10	000848	承德露露	6,000,000	174,060,000.00	2.17

5.4 报告期末按品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金总资产比例(%)
1	国债券	257,036,709.00	3.20
2	央行票据	-	-
3	金融债券	706,416,000.00	8.80
4	其他金融债券	706,416,000.00	8.80
5	企业债券	-	-
6	可转债	210,046,000.00	2.62
7	其他	-	-
8	其他	-	-
9	其他	-	-
10	其他	-	-
合计		1,733,498,709.00	21.41

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	债券品种	公允价值(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	2,027,181,098.20	92.48
2	其他债券	2,027,181,098.20	92.48
3	其他	-	-
4	其他	-	-
5	其他	-	-
6	其他	-	-
7	其他	-	-
8	其他	-	-
9	其他	-	-
10	其他	-	-
合计		2,027,181,098.20	92.48

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五名债券投资明细

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	2,027,181,098.20	92.48
2	其他债券	2,027,181,098.20	92.48
3	其他	-	-
4	其他	-	-
5	其他	-	-
6	其他	-	-
7	其他	-	-
8	其他	-	-
9	其他	-	-
10	其他	-	-
合计		2,027,181,098.20	92.48

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债券投资明细

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	2,027,181,098.20	92.48
2	其他债券	2,027,181,098.20	92.48
3	其他	-	-
4	其他	-	-
5	其他	-	-
6	其他	-	-
7	其他	-	-
8	其他	-	-
9	其他	-	-
10	其他	-	-
合计		2,027,181,098.20	92.48

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债券投资明细

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	2,027,181,098.20	92.48
2	其他债券	2,027,181,098.20	92.48
3	其他	-	-
4	其他	-	-
5	其他	-	-
6	其他	-	-
7	其他	-	-
8	其他	-	-
9	其他	-	-
10	其他	-	-
合计		2,027,181,098.20	92.48

5.9 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	债券品种	公允价值(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	2,027,181,098.20	92.48
2	其他债券	2,027,181,098.20	92.48
3	其他	-	-
4	其他	-	-
5	其他	-	-
6	其他	-	-
7	其他	-	-
8	其他	-	-
9	其他	-	-
10	其他	-	-
合计		2,027,181,098.20	92.48

5.10 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	债券品种	公允价值(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	2,027,181,098.20	92.48
2	其他债券	2,027,181,098.20	92.48
3	其他	-	-
4	其他	-	-
5	其他	-	-
6	其他	-	-
7	其他	-	-
8	其他	-	-
9	其他	-	-
10	其他	-	-
合计		2,027,181,098.20	92.48

5.11 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	债券品种	公允价值(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	2,027,181,098.20	92.48
2	其他债券	2,027,181,098.20	92.48
3	其他	-	-
4	其他	-	-
5	其他	-	-
6	其他	-	-
7	其他	-	-
8	其他	-	-
9	其他	-	-
10	其他	-	-
合计		2,027,181,098.20	92.48

5.12 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	债券品种	公允价值(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	2,027,181,098.20	92.48
2	其他债券	2,027,181,098.20	92.48
3	其他	-	-
4	其他	-	-
5	其他	-	-
6	其他	-	-
7	其他	-	-
8	其他	-	-
9	其他	-	-
10	其他	-	-
合计		2,027,181,098.20	92.48

5.13 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	债券品种	公允价值(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	2,027,181,098.20	92.48
2	其他债券	2,027,181,098.20	92.48
3	其他	-	-
4	其他	-	-
5	其他	-	-
6	其他	-	-
7	其他	-	-
8	其他	-	-
9	其他	-	-
10	其他	-	-
合计		2,027,181,098.20	92.48

5.14 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	债券品种	公允价值(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	2,027,181,098.20	92.48
2	其他债券	2,027,181,098.20	92.48
3	其他	-	-
4	其他	-	-
5	其他	-	-
6	其他	-	-
7	其他	-	-
8	其他	-	-
9	其他	-	-
10	其他	-	-
合计		2,027,181,098.20	92.48

5.15 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	债券品种	公允价值(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	2,027,181,098.20	92.48
2	其他债券	2,027,181,098.20	92.48
3	其他	-	-
4	其他	-	-
5	其他	-	-
6	其他	-	-
7	其他	-	-
8	其他	-	-
9	其他	-	-
10	其他	-	-
合计		2,027,181,098.20	92.48

5.16 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	债券品种	公允价值(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	2,027,181,098.20	92.48
2	其他债券	2,027,181,098.20	92.48
3	其他	-	-
4	其他	-	-
5	其他	-	-
6	其他	-	-
7	其他	-	-
8	其他	-	-
9	其他	-	-
10	其他	-	-
合计		2,027,181,098.20	92.48

5.17 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	债券品种	公允价值(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	2,027,181,098.20	92.48
2	其他债券	2,027,181,098.20	92.48
3	其他	-	-
4	其他	-	-
5	其他	-	-
6	其他	-	-
7	其他	-	-
8	其他	-	-
9	其他	-	-
10	其他	-	-
合计		2,027,181,098.20	92.48

5.18 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	债券品种	公允价值(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	2,027,181,098.20	92.48
2	其他债券	2,027,181,098.20	92.48
3	其他	-	-
4	其他	-	-
5	其他	-	-
6	其他	-	-
7	其他	-	-
8	其他	-	-
9	其他	-	-
10	其他	-	-
合计		2,027,181,098.20	92.48

5.19 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	债券品种	公允价值(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	2,027,181,098.20	92.48
2	其他债券	2,027,181,098.20	92.48
3	其他	-	-
4	其他	-	-
5	其他	-	-
6	其他	-	-
7	其他	-	-
8	其他	-	-
9	其他	-	-
10	其他	-	-
合计		2,027,181,098.20	92.48

5.20 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	债券品种	公允价值(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	2,027,181,098.20	92.48
2	其他债券	2,027,181,098.20	92.48
3	其他	-	-
4	其他	-	-
5	其他	-	-
6	其他	-	-
7	其他	-	-
8	其他	-	-
9	其他	-	-
10	其他	-	-
合计		2,027,181,098.20	92.48

5.21 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	债券品种	公允价值(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	2,027,181,098.20	92.48
2	其他债券	2,027,181,098.20	92.48
3	其他	-	-
4	其他	-	-
5	其他	-	-
6	其他	-	-
7	其他	-	-
8	其他	-	-
9	其他	-	-
10	其他	-	-
合计		2,027,181,098.20	92.48

5.22 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	债券品种	公允价值(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	2,027,181,098.20	92.48
2	其他债券	2,027,181,098.20	92.48
3	其他	-	-
4	其他	-	-
5	其他	-	-
6	其他	-	-
7	其他	-	-
8</			