

## 长城景气行业龙头灵活配置混合型证券投资基金

## 2015 第三季度 报告

2015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:中国建设银行股份有限公司  
报告送出日期:2015年10月26日

## § 1 重要提示

本基金的管理人、董事会及监事会在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2015年10月26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,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本基金基金管理人承诺在编制报告期间未从事损害基金份额持有人利益的买卖基金等行为,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表未来表现,投资人在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告告财务数据未经审计。

本基金自2015年6月1日起至2015年9月30日止。

§ 2 基本产品概况

基金简称 长城景气行业龙头混合

基金代码 200011

交易代码 200011

基金运作方式 灵活配置型开放式

基金合同生效日 2009年6月10日

报告期末基金份额总额 67,144,228.48份

投资目标 在合理的资产配置基础上,通过投资于景气行业龙头预期景气度向好的行业中

的股票,获取超越基准的收益。

投资策略 本基金将运用“行业龙头”下的行业相结合的分类资产配置,通过不同行业在不同的周期中表现出不同的运行轨迹,本基金将结合宏观经济分析、行业分析,运用景气基金评价体系对行业、经济指标进行定性和定量的分析,从而选择景气度向好的行业,并根据景气度向好的行业配置资产。

业绩比较基准 55%沪深300指数收益率+45%中债企业债指数收益率

风险收益特征 本基金为混合型基金,长周期看预期风险和预期收益高于债券型基金,货币市场基金,低风险股票型基金,为中高风险,高收益产品。

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

单位:人民币元

报告期(2015年7月1日 - 2015年9月30日)

1.本期已实现收益 -37,463,327.55

2.本期利润 -45,529,084.86

3.期初至报告期末基金本期利润 89,603,908.90

4.期末基金资产净值 1,355

5.期末基金份额净值 1.000

注:本基金期末资产收益指基金本期收入,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上述基金收益不包括任何交易费用,计价费用和利息收入等予以列示。

3.2 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的差额

阶段 净值增长(%) 净值增长标准差 业绩比较基准收益率 标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -31.43% 3.96% -15.21% 1.84% -16.22% 2.96%

3.2.2 日基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的差额

阶段 净值增长(%) 净值增长标准差 业绩比较基准收益率 标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -31.43% 3.96% -15.21% 1.84% -16.22% 2.96%

3.3 主要财务指标

单位:人民币元

报告期(2015年7月1日 - 2015年9月30日)

1.本期已实现收益 -37,463,327.55

2.本期利润 -45,529,084.86

3.期初至报告期末基金本期利润 89,603,908.90

4.期末基金资产净值 1,355

5.期末基金份额净值 1.000

注:本基金期末资产收益指基金本期收入,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上述基金收益不包括任何交易费用,计价费用和利息收入等予以列示。

3.2.3 本基金报告期份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的差额

阶段 净值增长(%) 净值增长标准差 业绩比较基准收益率 标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -31.43% 3.96% -15.21% 1.84% -16.22% 2.96%

3.2.4 日基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的差额

阶段 净值增长(%) 净值增长标准差 业绩比较基准收益率 标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -31.43% 3.96% -15.21% 1.84% -16.22% 2.96%

3.3.1 主要财务指标

单位:人民币元

报告期(2015年7月1日 - 2015年9月30日)

1.本期已实现收益 -37,463,327.55

2.本期利润 -45,529,084.86

3.期初至报告期末基金本期利润 89,603,908.90

4.期末基金资产净值 1,355

5.期末基金份额净值 1.000

注:本基金期末资产收益指基金本期收入,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上述基金收益不包括任何交易费用,计价费用和利息收入等予以列示。

3.2.5 本基金报告期份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的差额

阶段 净值增长(%) 净值增长标准差 业绩比较基准收益率 标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -31.43% 3.96% -15.21% 1.84% -16.22% 2.96%

3.2.6 日基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的差额

阶段 净值增长(%) 净值增长标准差 业绩比较基准收益率 标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -31.43% 3.96% -15.21% 1.84% -16.22% 2.96%

3.3.2 主要财务指标

单位:人民币元

报告期(2015年7月1日 - 2015年9月30日)

1.本期已实现收益 -37,463,327.55

2.本期利润 -45,529,084.86

3.期初至报告期末基金本期利润 89,603,908.90

4.期末基金资产净值 1,355

5.期末基金份额净值 1.000

注:本基金期末资产收益指基金本期收入,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上述基金收益不包括任何交易费用,计价费用和利息收入等予以列示。

3.2.7 本基金报告期份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的差额

阶段 净值增长(%) 净值增长标准差 业绩比较基准收益率 标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -31.43% 3.96% -15.21% 1.84% -16.22% 2.96%

3.2.8 日基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的差额

阶段 净值增长(%) 净值增长标准差 业绩比较基准收益率 标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -31.43% 3.96% -15.21% 1.84% -16.22% 2.96%

3.3.3 主要财务指标

单位:人民币元

报告期(2015年7月1日 - 2015年9月30日)

1.本期已实现收益 -37,463,327.55

2.本期利润 -45,529,084.86

3.期初至报告期末基金本期利润 89,603,908.90

4.期末基金资产净值 1,355

5.期末基金份额净值 1.000

注:本基金期末资产收益指基金本期收入,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上述基金收益不包括任何交易费用,计价费用和利息收入等予以列示。

3.2.9 本基金报告期份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的差额

阶段 净值增长(%) 净值增长标准差 业绩比较基准收益率 标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -31.43% 3.96% -15.21% 1.84% -16.22% 2.96%

3.2.10 日基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的差额

阶段 净值增长(%) 净值增长标准差 业绩比较基准收益率 标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -31.43% 3.96% -15.21% 1.84% -16.22% 2.96%

3.3.4 主要财务指标

单位:人民币元

报告期(2015年7月1日 - 2015年9月30日)

1.本期已实现收益 -37,463,327.55

2.本期利润 -45,529,084.86

3.期初至报告期末基金本期利润 89,603,908.90

4.期末基金资产净值 1,355

5.期末基金份额净值 1.000

注:本基金期末资产收益指基金本期收入,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上述基金收益不包括任何交易费用,计价费用和利息收入等予以列示。

3.3.5 本基金报告期份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的差额

阶段 净值增长(%) 净值增长标准差 业绩比较基准收益率 标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -31.43% 3.96% -15.21% 1.84% -16.22% 2.96%

3.3.6 日基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的差额

阶段 净值增长(%) 净值增长标准差 业绩比较基准收益率 标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -31.43% 3.96% -15.21% 1.84% -16.22% 2.96%

3.3.7 主要财务指标

单位:人民币元

报告期(2015年7月1日 - 2015年9月30日)

1.本期已实现收益 -37,463,327.55

2.本期利润 -45,529,084.86

3.期初至报告期末基金本期利润 89,603,908.90

4.期末基金资产净值 1,355

5.期末基金份额净值 1.000

注:本基金期末资产收益指基金本期收入,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上述基金收益不包括任何交易费用,计价费用和利息收入等予以列示。

3.3.8 本基金报告期份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的差额

阶段 净值增长(%) 净值增长标准差 业绩比较基准收益率 标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -31