

# 信息披露 Disclosure

## 长城品牌优选混合型证券投资基金

[2015] 第四季度报告

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:2016年1月20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2016年1月10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2015年10月01日起至12月31日止。

§ 2 基金产品概况

长城品牌优选混合型证券投资基金				
基金简称				
基金代码				
交易代码				
基金运作方式				
基金合同生效日				
报告期末基金份额总额				
投资目标				
充分分享具有明显优势的上市公司持续成长产生的投资机会，追求基				
金资产的长期增值。				
投资策略				
本基金将采用“积极成长型”的投资策略，运用长线选股与成长价值选股相结合的策略，构建行业优化配置组合，通过行业轮动、个股精选、行业轮动与个股精选相结合的策略，追求超额收益。				
业绩比较基准				
75%×沪深300指数+25%×同业存款利率				
风险收益特征				
本基金为混合型基金，主要投资于具有超额盈利能力的品牌优势上				
市公司，侧重于选择具备稳定性和高市盈率的股票，低于股票型基金，属于				
较高风险的证券投资基金。				
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				
3.1 主要财务指标				
单位:人民币元				
1.本期已实现收益	报告期(2015年10月1日 - 2015年12月31日)			
2.本期利润	792,000,000.75			
3.加权平均基金份额本期利润	0.1968			
4.期末基金资产净值	4,814,974,530.61			
5.期末基金份额净值	1.2167			
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 报告期内基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较				
阶段	净值增长① (%)	净值增长② (%)	业绩比较基准收益率③ (%)	业绩比较基准收益率④ (%)
过去一个月	10.90%	1.72%	11.32%	1.19%
3.2.2 自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:长城品牌优选混合型证券投资基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动情况				
注:本基金合同规定本基金的投资组合为:股票资产60%~95%，权证投资0%~3%，债券0%~35%，本基金保持不低于基金资产净值的5%的现金或者到期日在一年内的政府债券。本基金的建仓期为自基金合同生效日起6个月，建仓期间，各项资产配置比例符合基金合同约定。				
4.1 管理人报告				
4.1.1 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
杨建华	公司副总监、基金经理	2013年6月18日	-	15年 男，中国国籍，北京大学光电子系理学学士，北京大学光电子系硕士学位，工程师，曾就职于华软技术有限公司客户服务部、长城证券有限公司客户服务部、长城证券有限公司、曾就职于华泰联合证券有限公司、长城基金管理有限公司，现任长城基金管理有限公司基金经理、公司总经理助理。
注:①上任日期即日，离任日期即日公司做出决定的任免日期。				
②本基金从业人员的计算口径遵从《证券业协会从业人员资格管理办法》的相关规定。				
③.4.2 管理人对报告期本基金运作合规性的说明				
本报告期内，本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、《长城品牌优选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取最大的利益，未出现投资运作违法违规、损害基金财产和基金份额持有人利益的情况。				
4.1.2 公平交易专项说明				
4.1.2.1 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，不同的投资对象得到了公平对待。				
4.1.2.2 公平交易制度执行情况的每日反向交易、对同向交易价差进行事后分析，定期公开公平交易报告。本报告期内认为，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，整体符合相关法律法规和公司制度的规定。				
4.3 异常交易行为的专项说明				
4.3.1 公平交易制度的执行情况				
报告期内，本基金从业人员没有利用内幕信息进行交易，没有违反基金参与的交易所公开竞价同日反向交易成交金额超过该证券当日成交量的5%的现象。				
4.3.2 异常交易制度的执行情况				
本基金管理人没有发现存在异常交易行为，没有违反基金参与的交易所公开竞价同日反向交易成交金额超过该证券当日成交量的5%的现象。				
4.4 报告期内基金的绩效指标				
本基金的绩效指标:其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金，其长期平均风险和预期收益率高于债券型基金。				
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				
§ 5 投资组合报告				
5.1 报告期末本基金资产组合情况				
序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)	
1	权证投资	4,597,509,889.91	93.04	
其中:股票		4,507,509,889.91	93.04	
2	基金投资	-	-	
3	固定收益投资	300,000,000.00	6.19	
其中:债券		300,000,000.00	6.19	
4	贵金属投资	-	-	
5	黄金期货投资	-	-	
6	银行存款	-	-	
7	买入返售金融资产	26,348,090.00	0.04	
8	其他资产	10,912,833.04	0.02	
9	合计	4,844,860,742.00	100.00	
5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合				
序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)	
1	农林牧渔业	17,136,222.21	0.35%	
2	采矿业	23,790,718.65	0.05%	
3	加权平均基金份额本期利润	0.0268	-	
4	期末基金资产净值	1,164,376,189.89	1.18%	
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。				
5.3 主要财务指标和基金净值表现				
阶段	净值增长率① (%)	净值增长率② (%)	业绩比较基准收益率③ (%)	业绩比较基准收益率④ (%)
过去三个月	2.24%	0.09%	3.10%	0.11%
5.4 报告期内基金份额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:长城品牌优选混合型证券投资基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动情况				
注:本基金合同规定本基金投资组合为:固定收益类资产所占比重不低于基金资产的80%，权益类资产占比不超过基金资产的20%，且基金持有的现金或者到期日在一年内的政府债券不小于基金资产净值的5%。本基金的建仓期为自基金合同生效日起6个月，建仓期间，各项资产配置比例符合基金合同约定。				