

长城景气行业龙头灵活配置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
报告期截止日期:2016年1月20日

§ 1 重要提示
本基金基金管理人的董事及基金经理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的内容，确认不存在虚假记载、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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2015年10月01日起至2015年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

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	契约型开放式
基金合同生效日	2009年06月01日
报告期末基金份额总额	63,808,691.00份

投资目标 在合理的风险和收益的头上平衡，实现基金资产的稳定增值。

投资策略 本基金采用“自下而上”和“自上而下”相结合的方式进行类别资产配置。由不同行业不同的投资风格中表现出不同的运行特征，结合对宏观经济运行的分析和对各行业的深入研究，选择相对较好的行业作为资产配置的重点。

业绩比较基准 65%×沪深300指数收益率+45%×中债总财富(债券)指数收益率

风险收益特征 本基金为混合型基金，长期平均风险和预期收益高于债券型基金，低于股票型基金，为中级风险、中庸收益产品。

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(2015年10月01日 - 2015年12月31日)
1.本期已实现收益	14,283,362.03
2.本期利润	20,466,661.39
3.加权平均基金份额本期利润	0.3146
4.期末基金份额净值	104,861,377.62
5.期末基金份额总额	1,6443

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)上述基金绩效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	净值增长率差额	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率差额
过去三个月	23.07%	2.17%	10.60%	0.91%

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

注:①上述任职期间,任刚先生因根据公司做出决定的任免日期填写。
②该从业从行业的分类方式根据《证券业协会从业人员执业资格管理办法》的相关规定。

4.1 基金经理(或基金经理助理)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期间	证券从业年限	说明
赵波	长城景气行业龙头混合基金经理	2014年9月4日	7年	男,中国籍,伦敦大学皇家霍洛威学院学士,伦敦城市大学金融学硕士,拥有7年证券从业经历,曾任职于中银国际证券有限公司担任研究员,后加入长城基金管理有限公司,曾任行业研究员、基金经理。

注:①上述任职期间,任刚先生因根据公司做出决定的任免日期填写。
②该从业从行业的分类方式根据《证券业协会从业人员执业资格管理办法》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

报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《长城景气行业龙头灵活配置混合型证券投资基金合同》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利益,未出现违反法律法规、基金合同约定和相关规定的风险,无因公司内部决策导致损益或操作不当而导致基金财产损失的情况。

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,不同投资组合的利益得到公平对待。

本基金管理人严格按照《证券投资基金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制度》的规定,不同投资组合之间公平交易。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照《证券投资基金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制度》的规定,不同投资组合之间公平交易。

4.3.3 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照《证券投资基金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制度》的规定,不同投资组合之间公平交易。

4.3.4 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照《证券投资基金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制度》的规定,不同投资组合之间公平交易。

4.3.5 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照《证券投资基金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制度》的规定,不同投资组合之间公平交易。

4.3.6 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照《证券投资基金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制度》的规定,不同投资组合之间公平交易。

4.3.7 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照《证券投资基金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制度》的规定,不同投资组合之间公平交易。

4.3.8 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照《证券投资基金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制度》的规定,不同投资组合之间公平交易。

4.3.9 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照《证券投资基金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制度》的规定,不同投资组合之间公平交易。

4.3.10 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照《证券投资基金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制度》的规定,不同投资组合之间公平交易。

4.3.11 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照《证券投资基金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制度》的规定,不同投资组合之间公平交易。

4.3.12 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照《证券投资基金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制度》的规定,不同投资组合之间公平交易。

4.3.13 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照《证券投资基金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制度》的规定,不同投资组合之间公平交易。

4.3.14 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照《证券投资基金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制度》的规定,不同投资组合之间公平交易。

4.3.15 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照《证券投资基金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制度》的规定,不同投资组合之间公平交易。

4.3.16 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照《证券投资基金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制度》的规定,不同投资组合之间公平交易。

4.3.17 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照《证券投资基金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制度》的规定,不同投资组合之间公平交易。

4.3.18 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照《证券投资基金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制度》的规定,不同投资组合之间公平交易。

4.3.19 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照《证券投资基金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制度》的规定,不同投资组合之间公平交易。

4.3.20 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照《证券投资基金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制度》的规定,不同投资组合之间公平交易。

4.3.21 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照《证券投资基金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制度》的规定,不同投资组合之间公平交易。

4.3.22 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照《证券投资基金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制度》的规定,不同投资组合之间公平交易。

4.3.23 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照《证券投资基金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制度》的规定,不同投资组合之间公平交易。

4.3.24 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照《证券投资基金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制度》的规定,不同投资组合之间公平交易。

4.3.25 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照《证券投资基金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制度》的规定,不同投资组合之间公平交易。

4.3.26 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照《证券投资基金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制度》的规定,不同投资组合之间公平交易。

4.3.27 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照《证券投资基金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制度》的规定,不同投资组合之间公平交易。

4.3.28 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照《证券投资基金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制度》的规定,不同投资组合之间公平交易。

4.3.29 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照《证券投资基金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制度》的规定,不同投资组合之间公平交易。

4.3.30 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照《证券投资基金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制度》的规定,不同投资组合之间公平交易。

4.3.31 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照《证券投资基金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制度》的规定,不同投资组合之间公平交易。

4.3.32 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照《证券投资基金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制度》的规定,不同投资组合之间公平交易。

4.3.33 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照《证券投资基金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制度》的规定,不同投资组合之间公平交易。

4.3.34 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照《证券投资基金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制度》的规定,不同投资组合之间公平交易。

4.3.35 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照《证券投资基金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制度》的规定,不同投资组合之间公平交易。

4.3.36 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照《证券投资基金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制度》的规定,不同投资组合之间公平交易。

4.3.37 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照《证券投资基金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制度》的规定,不同投资组合之间公平交易。

4.3.38 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照《证券投资基金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制度》的规定,不同投资组合之间公平交易。

4.3.39 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照《证券投资基金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制度》的规定,不同投资组合之间公平交易。

4.3.40 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照《证券投资基金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制度》的规定,不同投资组合之间公平交易。

4.3.41 公平交易制度的执行情况