

长城安心回报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:中国农业银行股份有限公司

报告送出日期:2016年1月20日

§ 1 重要提示

本基金托管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的规定,于2016年1月18日复核了本报告中的财务数据,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。投资人应当在作出投资决策前仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告书内容节选自基金定期报告。

本报告期自2015年10月01日起至2015年12月31止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	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10月21日
报告期末基金份额总额	2,567,626,342.96份
投资目标	以获取稳定的、一年期定期存款(到期)利差2%的回报为目标,通过动态的资产配置策略与长期资产增值,获取投资人身长期锁定的绝对回报。

分析公司基本情况,确定投资策略与投资比例,上市公司持续经营能力,宏观经济运行情况,股票市场走势,通过把握上市公司股息率、持续成长能力,选择具有稳定分红能力和成长潜力的企业作为主要投资对象。

本基金绝对收益目标,风险较低,适合追求稳健收益的投资者。

本基金基金经理代表其未来表现。投资人应当在作出投资决策前仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告书内容节选自基金定期报告。

本报告期自2015年10月01日起至2015年12月31止。

§ 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

报告期(2015年10月01日 - 2015年12月31日)	263,264,600.50
本期已实现收益	616,513,988.03
3.加权平均基金份额本期利润	0.0122
4.期末基金资产净值	2,730,461,116.01
5.期末基金份额净值	1.0676

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上述基金业绩报酬不包括持有交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平将低于所列示数字。

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 净值增长率为% 业绩比较基准收益率为% 基准收益率差为% 标准差为% ①-③ ②-④

过去三个月 21.41% 0.79% 0.01% 20.62% 1.46%

3.2.2 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: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%-80%;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%-80%;现金或者到期日在一年以内

的债券为基金净资产的5%以下。本基金的建仓期为自本基金基金合同生效之日起6个月内,建仓期间,各项资产配比均符合合同约定。

4 管理人报告

4.1 基金经理(基金经理小组)简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期限 任职日期 离任日期 说明

徐九龙	安心回报混合基金经理 长盛行业精选基金经理 长盛新兴产业基金经理 长城保本基金经理	2009年1月6日	-	13年
-----	--	-----------	---	-----

注:①上述任本基金日期,离任日期根据公司做出决定的任免日期填写。

②本基金由徐九龙担任的管理人处对正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的情况说明

本基金报告期内,基金管理人严格按照《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,未出现损害基金份额持有人利益的情况。

本基金托管人未勤勉尽责或操作不当导致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,基金管理人严格执行了《证券投资基金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。

本基金托管人未勤勉尽责或操作不当导致损害基金份额持有人利益的情况。

本基金托管人未勤勉尽责或操作不当导致损害基金份额持有人利益的情况。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格执行了《证券投资基金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。

本基金托管人未勤勉尽责或操作不当导致损害基金份额持有人利益的情况。

4.3.3 公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格执行了《证券投资基金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。

本基金托管人未勤勉尽责或操作不当导致损害基金份额持有人利益的情况。

4.3.4 公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格执行了《证券投资基金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。

本基金托管人未勤勉尽责或操作不当导致损害基金份额持有人利益的情况。

4.3.5 公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格执行了《证券投资基金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。

本基金托管人未勤勉尽责或操作不当导致损害基金份额持有人利益的情况。

4.3.6 公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格执行了《证券投资基金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。

本基金托管人未勤勉尽责或操作不当导致损害基金份额持有人利益的情况。

4.3.7 公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格执行了《证券投资基金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。

本基金托管人未勤勉尽责或操作不当导致损害基金份额持有人利益的情况。

4.3.8 公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格执行了《证券投资基金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。

本基金托管人未勤勉尽责或操作不当导致损害基金份额持有人利益的情况。

4.3.9 公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格执行了《证券投资基金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。

本基金托管人未勤勉尽责或操作不当导致损害基金份额持有人利益的情况。

4.3.10 公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格执行了《证券投资基金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。

本基金托管人未勤勉尽责或操作不当导致损害基金份额持有人利益的情况。

4.3.11 公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格执行了《证券投资基金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。

本基金托管人未勤勉尽责或操作不当导致损害基金份额持有人利益的情况。

4.3.12 公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格执行了《证券投资基金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。

本基金托管人未勤勉尽责或操作不当导致损害基金份额持有人利益的情况。

4.3.13 公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格执行了《证券投资基金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。

本基金托管人未勤勉尽责或操作不当导致损害基金份额持有人利益的情况。

4.3.14 公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格执行了《证券投资基金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。

本基金托管人未勤勉尽责或操作不当导致损害基金份额持有人利益的情况。

4.3.15 公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格执行了《证券投资基金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。

本基金托管人未勤勉尽责或操作不当导致损害基金份额持有人利益的情况。

4.3.16 公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格执行了《证券投资基金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。

本基金托管人未勤勉尽责或操作不当导致损害基金份额持有人利益的情况。

4.3.17 公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格执行了《证券投资基金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。

本基金托管人未勤勉尽责或操作不当导致损害基金份额持有人利益的情况。

4.3.18 公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格执行了《证券投资基金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。

本基金托管人未勤勉尽责或操作不当导致损害基金份额持有人利益的情况。

4.3.19 公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格执行了《证券投资基金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。

本基金托管人未勤勉尽责或操作不当导致损害基金份额持有人利益的情况。

4.3.20 公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格执行了《证券投资基金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。

本基金托管人未勤勉尽责或操作不当导致损害基金份额持有人利益的情况。

4.3.21 公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格执行了《证券投资基金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。

本基金托管人未勤勉尽责或操作不当导致损害基金份额持有人利益的情况。

4.3.22 公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格执行了《证券投资基金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。

本基金托管人未勤勉尽责或操作不当导致损害基金份额持有人利益的情况。

4.3.23 公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格执行了《证券投资基金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。

本基金托管人未勤勉尽责或操作不当导致损害基金份额持有人利益的情况。

4.3.24 公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格执行了《证券投资基金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。

本基金托管人未勤勉尽责或操作不当导致损害基金份额持有人利益的情况。

4.3.25 公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格执行了《证券投资基金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。

本基金托管人未勤勉尽责或操作不当导致损害基金份额持有人利益的情况。

4.3.26 公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格执行了《证券投资基金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。

本基金托管人未勤勉尽责或操作不当导致损害基金份额持有人利益的情况。

4.3.27 公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格执行了《证券投资基金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。

本基金托管人未勤勉尽责或操作不当导致损害基金份额持有人利益的情况。

4.3.28 公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格执行了《证券投资基金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。

本基金托管人未勤勉尽责或操作不当导致损害基金份额持有人利益的情况。

4.3.29 公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格执行了《证券投资基金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。

本基金托管人未勤勉尽责或操作不当导致损害基金份额持有人利益的情况。

4.3.30 公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格执行了《证券投资基金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。

本基金托管人未勤勉尽责或操作不当导致损害基金份额持有人利益的情况。

4.3.31 公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格执行了《证券投资基金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。