

长城双动力混合型证券投资基金

[2016] 第一季度报告

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4月22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04月20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2016年01月01日起至03月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	长城双动力混合
基金代码	200010
交易代码	200010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年1月16日
报告期末基金份额总额	690,763,467.49份
投资目标	充分配置于上市公司从内生性增长到外延式扩张过程中产生的投资机会,通过基金资产的配置,实现基金资产的保值增值。
投资策略	本基金将通过行业配置分析上市公司从内生性增长到外延式扩张过程中产生的投资机会,通过基金资产的配置,实现基金资产的保值增值。本基金将主要投资于具有良好成长潜力的行业,并根据市场情况,适时调整行业配置比例。
业绩比较基准	60%×沪深300指数+40%债券指数
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金,主要投资于具有内生性增长潜力的行业,并根据市场情况,适时调整行业配置比例,本基金风险收益特征介于股票型基金和债券型基金之间,低于股票型基金,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

§ 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(2016年1月1日 - 2016年3月31日)

1.本期已实现收益 -190,364,676.46

2.本期利润 -264,765,696.94

3.加权平均基金份额本期利润 -0.3690

4.期末基金资产净值 1,392,617,953.96

5.期末基金份额净值 2016.1

注:①本期已实现收益指本期利息收入、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本基金的各项费用,计价费用后实际收益水平要低于所列数据。

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

过去三个月 17.29% 3.46% 10.04% 1.26% 7.20% 1.70%

3.2.2 自基金合同生效以来基金净值增长率波动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

图:长城双动力混合型证券投资基金净值增长率与同期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比例为:股票资产占基金资产60%~95%,权证投资占基金资产0%~3%,债券(含货币市场基金)占基金资产0%~35%,本基金将不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,本基金的建仓期为自本基金合同生效日起6个月,建仓期间,各项资产配置比例符合基金合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	性别	任本基金的基金经理期限	任本基金的基金经理	说明
吴文庆	男	2013年12月26日	7年	中国国籍,上海交通大学生物医学工程博士,2010年进入长城基金管理有限公司,历任基金研究员、基金经理、基金经理助理、基金经理。
郑海强	男	2015年1月27日	2016年3月1日	中国国籍,华中科技大学工科硕士,华中科技大学金融学硕士,2006年进入长城基金管理有限公司,历任基金研究员、基金经理助理、基金经理。

注:①任职日期:离任日期根据公司做出决定的任免日期填写。

②证券从业年限的计算方式遵从证券业协会《证券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的说明

本基金报告期内,基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、《长城双动力混合型证券投资基金基金合同》以及其他法律法规的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险、防范风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大的利益,未出现违反法律法规、基金合同约定和相关规定的前提下,因无因公司未勤勉尽责或操作不当而导致基金资产损失的情况,不存在损害基金份额持有人利益的情况。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易执行的情况

报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金法》、《长城双动力混合型证券投资基金基金合同》以及相关法律法规的规定,不同投资人的利益得到公平对待。

4.3.2 公平交易执行的专项说明

报告期内发现本基金存在异常交易行为,没有出现基金参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易

交较少的股票,且连续十个交易日涨跌幅偏离度的绝对值在3%以上的股票。

4.4 报告期内基金管理人公平交易制度的执行情况

在报告期内,基金管理人严格执行了《证券投资基金法》、《长城双动力混合型证券投资基金基金合同》以及相关法律法规的规定,不存在不公平交易行为。

4.5 报告期内基金管理人公平交易制度的执行情况

本基金报告期内不存在不公平交易行为。

4.6 报告期内基金管理人公平交易制度的预警说明

本基金报告期内,本基金不需要说明的情况。

§ 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	权证投资	1,233,747,113.61	96.06
2	基金投资	1,233,747,113.61	96.06
3	国债投资	89,560,000.00	6.25
4	其他投资	89,560,000.00	6.25
5	买入返售金融资产	0.00	0.00
6	银行存款	100,904,363.68	7.04
7	其他资产	9,341,092.64	0.68
8	合计	1,432,542,569.43	100.00

注:本基金合同规定本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的60%~95%;债券及短期金融工具的投资比例占基金资产的0%~3%;现金或到期日在一年以内的政府债券为基金净资产的5%以内。本基金的建仓期为自本基金合同生效日起6个月,建仓期间,各项资产配置比例符合基金合同约定。

§ 6 管理人报告

6.1 基金经理(或基金经理小组)简介

单位:人民币元

主要财务指标

报告期(2016年1月1日 - 2016年3月31日)

1.本期已实现收益 -270,299,964.50

2.本期利润 -326,919,952.67

3.加权平均基金份额本期利润 -0.1690

4.期末基金资产净值 1,283,571,344.64

5.期末基金份额净值 0.8783

注:①本期已实现收益指本期利息收入、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本基金的各项费用,计价费用后实际收益水平要低于所列数据。

3.2 基金合同生效以来基金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:长城双动力混合型证券投资基金净值增长率与同期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比例为:股票资产占基金资产的60%~95%;债券及短期金融工具的投资比例占基金资产的0%~3%;现金或到期日在一年以内的政府债券为基金净资产的5%以内。本基金的建仓期为自本基金合同生效日起6个月,建仓期间,各项资产配置比例符合基金合同约定。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金报告期内,基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金报告期内,基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.3 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金报告期内,基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金报告期内,基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.5 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金报告期内,基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.6 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金报告期内,基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.7 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金报告期内,基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.8 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金报告期内,基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.9 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金报告期内,基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.10 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金报告期内,基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.11 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金报告期内,基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.12 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金报告期内,基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.13 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金报告期内,基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.14 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金报告期内,基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.15 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金报告期内,基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.16 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金报告期内,基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.17 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金报告期内,基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.18 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金报告期内,基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.19 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金报告期内,基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.20 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金报告期内,基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.21 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金报告期内,基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.22 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金报告期内,基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.23 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金报告期内,基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.24 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金报告期内,基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.25 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金报告期内,基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.26 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金报告期内,基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.27 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金报告期内,基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.28 报告期内基金管理人运用固