

长城安心回报混合型证券投资基金

[2016] 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:2017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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年1月10日对本基金报告中的财务指标、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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2016年10月01日起至2016年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	长城安心回报混合型证券投资基金
基金主代码	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	2009年8月22日
报告期末基金总资产	2,443,069,070.38元
投资目标	本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，通过积极主动的资产配置，在控制和防范风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	分析上市公司的股票、债券品种，采用“进退结合”的投资策略，通过积极主动的资产配置，在控制和防范风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。
业债比较基准	银行一年期定期存款(税前)的平均收益率
风险收益特征	本基金为债券型理财产品，风险收益特征介于股票基金、货币市场基金与债券基金之间。
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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

报告期:2016年10月1日 - 2016年12月31日)

1.本期已实现收益 106,069,914.09

2.本期利润 -20,501,081.91

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0083

4.期末基金资产净值 2,369,413,598.19

5.期末基金份额净值 0.9692

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)扣除相关税费后的余额，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，计价费用影响实际收益水平将低于所列数字。

3.2.1 本基金报告期内基金份额净值增长率及其与同行业业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长(%) 业绩比较基准 收益率差(%)

过去三个月 -0.91% 0.60% -0.76% 0.01% -1.61% -0.03%

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行业业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 净值增长(%) 业绩比较基准 收益率差(%)

过去三年 -0.91% 0.60% -0.76% 0.01% -1.61% -0.03%

3.3 报告期内基金的业绩表现

本基金报告期内未出现基金净值增长率连续二十个交易日偏离度绝对值超过1%的情形。

3.4 管理人报告

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限 证券从业年限 说明

吴文庆 公司总经理、长城久恒、长城双债、长城安心回报混合型证券投资基金基金经理 2016年1月18日 - 7年 男,中国国籍,上海交通大学生物医学工程学士,博士,2002年7月进入长城基金管理有限公司,曾任研究部履行研究员职责,2006年1月起担任公司基金经理,现任公司总经理兼基金经理。“长城安心回报混合型证券投资基金”、“长城安心回报混合型证券投资基金”基金经理。

①上述日期即日起,任职日期根据公司做出决定的任免日填写。

②基金管理人对本基金运作遵循“诚实信用、勤勉尽责”的原则和运用基金资产,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具体情况,无因公司未勤勉尽责或违规操作不当导致本基金财产损失的情况,不存在损害基金份额持有人利益的具体情况。

③本基金对宏观经济政策的执行情况

④本基金对宏观经济政策的执行情况

⑤本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露方式等,暂不参与国债期货交易。

⑥本基金报告期内未进行国债期货交易情况说明

⑦本基金尚未在基金合同中明确股指期货的投资策略、比例限制、信息披露方式等,暂不参与股指期货交易。

⑧本基金尚未在基金合同中明确商品期货的投资策略、比例限制、信息披露方式等,暂不参与商品期货交易。

⑨本基金尚未在基金合同中明确商品期货的投资策略、比例限制、信息披露方式等,暂不参与商品期货交易。

⑩本基金尚未在基金合同中明确商品期货的投资策略、比例限制、信息披露方式等,暂不参与商品期货交易。

⑪本基金尚未在基金合同中明确商品期货的投资策略、比例限制、信息披露方式等,暂不参与商品期货交易。

⑫本基金尚未在基金合同中明确商品期货的投资策略、比例限制、信息披露方式等,暂不参与商品期货交易。

⑬本基金尚未在基金合同中明确商品期货的投资策略、比例限制、信息披露方式等,暂不参与商品期货交易。

⑭本基金尚未在基金合同中明确商品期货的投资策略、比例限制、信息披露方式等,暂不参与商品期货交易。

⑮本基金尚未在基金合同中明确商品期货的投资策略、比例限制、信息披露方式等,暂不参与商品期货交易。

⑯本基金尚未在基金合同中明确商品期货的投资策略、比例限制、信息披露方式等,暂不参与商品期货交易。

⑰本基金尚未在基金合同中明确商品期货的投资策略、比例限制、信息披露方式等,暂不参与商品期货交易。

⑱本基金尚未在基金合同中明确商品期货的投资策略、比例限制、信息披露方式等,暂不参与商品期货交易。

⑲本基金尚未在基金合同中明确商品期货的投资策略、比例限制、信息披露方式等,暂不参与商品期货交易。

⑳本基金尚未在基金合同中明确商品期货的投资策略、比例限制、信息披露方式等,暂不参与商品期货交易。

㉑本基金尚未在基金合同中明确商品期货的投资策略、比例限制、信息披露方式等,暂不参与商品期货交易。

㉒本基金尚未在基金合同中明确商品期货的投资策略、比例限制、信息披露方式等,暂不参与商品期货交易。

㉓本基金尚未在基金合同中明确商品期货的投资策略、比例限制、信息披露方式等,暂不参与商品期货交易。

㉔本基金尚未在基金合同中明确商品期货的投资策略、比例限制、信息披露方式等,暂不参与商品期货交易。

㉕本基金尚未在基金合同中明确商品期货的投资策略、比例限制、信息披露方式等,暂不参与商品期货交易。

㉖本基金尚未在基金合同中明确商品期货的投资策略、比例限制、信息披露方式等,暂不参与商品期货交易。

㉗本基金尚未在基金合同中明确商品期货的投资策略、比例限制、信息披露方式等,暂不参与商品期货交易。

㉘本基金尚未在基金合同中明确商品期货的投资策略、比例限制、信息披露方式等,暂不参与商品期货交易。

㉙本基金尚未在基金合同中明确商品期货的投资策略、比例限制、信息披露方式等,暂不参与商品期货交易。

㉚本基金尚未在基金合同中明确商品期货的投资策略、比例限制、信息披露方式等,暂不参与商品期货交易。

㉛本基金尚未在基金合同中明确商品期货的投资策略、比例限制、信息披露方式等,暂不参与商品期货交易。

㉜本基金尚未在基金合同中明确商品期货的投资策略、比例限制、信息披露方式等,暂不参与商品期货交易。

㉝本基金尚未在基金合同中明确商品期货的投资策略、比例限制、信息披露方式等,暂不参与商品期货交易。

㉞本基金尚未在基金合同中明确商品期货的投资策略、比例限制、信息披露方式等,暂不参与商品期货交易。

㉟本基金尚未在基金合同中明确商品期货的投资策略、比例限制、信息披露方式等,暂不参与商品期货交易。

㉟本基金尚未在基金合同中明确商品期货的投资策略、比例限制、信息披露方式等,暂不参与商品期货交易。