长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF)

2015 第一季度 报告

2015年3月31日

基金管理人:长城基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
报告送出日期:2015年4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。

本基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年04月16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01月01日起至03月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长城久富(股票 LOF)
场内简称	长城久富
基金主代码	162006
交易代码	162006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年2月12日
报告期末基金份额总额	1,343,774,160.65份
投资目标	投资于具有核心竞争力的企业,分享其在中国经济高速、平稳增长背景下的持续成长所带来的良好收益,力争为基金持有人实现稳定的超额回报。
投资策略	本基金投资的核心策略是"自下而上、精选个股",即时根据市场偏好适度配置主题类资产以保持组合的均衡性,精选原则将继承基金久富以注富有成效的核心企业评价体系,以"具备核心竞争力,能够在市场中获取超额收益的企业"为主,构建均衡的投资组合。
业绩比较基准	75%×沪深300指数收益率+25%×中信全债指数收益率
风险收益特征	本基金是较高预期收益较高预期风险的产品,其预期收益与风险高于混合基金、债券基金与货币市场基金。
基金管理人	长城基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司

§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1月1日 - 2015年3月31日)
1.本期已实现收益	370,161,813.89
2.本期利润	412,677,831.49
3.加权平均基金份额本期利润	0.2886
4.期末基金资产净值	1,904,936,404.53
5.期末基金份额净值	1.4176

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。

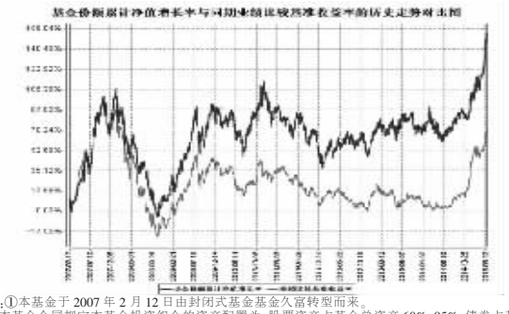
②上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	25.82%	1.31%	11.15%	1.39%	14.67%	-0.08%

3.2.2 自基金转型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本基金于2007年2月12日由封闭式基金基金久富转型而来。

②本基金合同规定本基金投资组合的资产配置为:股票资产占基金总资产60%-95%,债券占基金总资产0%-35%,权证投资占基金资产净值0%-3%,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金的建仓期为自本基金基金合同生效日起6个月,建仓期满时,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	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨建华	公司副总经理、投资总监、基金管理部总经理、长城久泰、长城久富和长城品牌的基金经理	2009年9月22日	-	15年	男,中国籍,北京大学力学系理学学士,北京大学光华管理学院经济学硕士,注册会计师,曾就职于华为技术有限公司财务部,长城证券有限责任公司投资银行部,2001年10月进入长城基金管理公司,曾任基金经理助理、"长城安心回报混合型证券投资基金"和"长城中小盘成长股票型证券投资基金"的基金经理,公司总经理助理。

注:①上述任职日期、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情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、《长城久富核心成长股票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,未出现投资违反法律法规、基金合同约定和相关规定的情况,无因公司未勤勉尽责或操作不当而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,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,不同投资者的利益得到了公平对待。

本基金管理人严格控制不同投资组合之间的同日反向交易,对同向交易的价差进行事后分析,定期出具公平交易稽核报告。本报告期报告认为,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,结果符合相关政策法规和公司制度的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未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量超过该证券当日成交量的5%的现象。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

一季度,美国经济相对于其他主要经济体一枝独秀,美元维持强势,石油等大宗商品价格维持在低位,人民币相对美元有所贬值,对其他货币仍然强势。国内宏观经济仍然呈现弱势格局,增速继续放缓,下行压力依然较大。货币政策继续延续适度宽松态势,相继降准降息,并在季度末推出存款保险制度,利率市场化稳步推进。财政政策继续托底,同时继续深化改革、推动经济结构转型。证券市场方面,年初对杠杆资金进入市场的限制延续了增量资金进场的节奏,市场重回存量资金博弈态势,围绕互联网的转型主题持续盛行,TMT领涨市场,军民融合、环保、国企改革、一带一路、京津冀一体化等主题都借助政策或者事件驱动有所表现。3月份后,增量基金入市节奏加快,大盘蓝筹股有所表现,但整体仍远远落后于互联网相关板块,尤其是两会后,"互联网+"大行其道,部分相关个股短期表现、估值水平、市值规模都达到超乎想象的地步。本基金报告期加大了对战略新兴产业及传统产业涉足互联网个股的关注,适度加大了配置比例。综合下来本基金报告期业绩好于比较基准,但是远远落后于创业板,相对比较平淡。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金净值增长率为25.82%,本基金业绩比较基准收益率为11.15%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内,本基金无需要说明的情况。

§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	权益投资	1,703,891,117.95	88.33
	其中:股票	1,703,891,117.95	88.33
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	173,313,828.18	8.98
7	其他资产	51,761,081.82	2.68
8	合计	1,928,966,027.95	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,208,275,887.19	63.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	47,342,675.00	2.49
E	建筑业	18,590,000.00	0.98
F	批发和零售业	89,513,582.60	4.70
G	交通运输、仓储和邮政业	7,407,000.00	0.39
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	16,870,000.00	0.89
J	金融业	197,262,000.00	10.36
K	房地产业	59,617,000.00	3.13
L	租赁和商务服务业	38,141,973.16	2.00
M	科学研究和技术服务业	7,200,000.00	0.38
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	13,671,000.00	0.72
S	综合	-	-
	合计	1,703,891,117.95	89.45

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000568	泸州老窖	4,716,231	115,736,308.74	6.08
2	600625	长安汽车	4,538,145	104,785,768.05	5.50
3	000513	丽珠集团	1,383,319	82,584,144.30	4.34
4	000651	格力电器	1,544,000	67,596,320.00	3.55
5	000963	华东医药	1,070,106	66,453,582.60	3.49
6	000895	双汇发展	1,676,560	61,865,064.00	3.25
7	601166	兴业银行	3,000,000	55,080,000.00	2.89
8	001696	宗申动力	3,599,906	54,682,572.14	2.87
9	600369	西南证券	2,400,000	52,008,000.00	2.73
10	600352	浙江龙盛	1,600,000	46,896,000.00	2.46

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注:本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末进行股指期货投资,本期未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

注: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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

注: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。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末进行国债期货投资,期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

注:本基金本报告期内未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到过公开谴责、处罚。

5.11.2

本基金投资的前十名股票中,未有投资于超出基金合同规定备选股票库之外股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	771,619.50
2	应收证券清算款	50,682,208.95
3	应收股利	-
4	应收利息	103,219.79
5	应收申购款	204,033.58
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	51,761,081.82

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000625	长安汽车	104,785,768.05	5.50	重大事项

注:根据相关法规的规定,经与托管行协商一致,自2015年3月16日起,本管理人对旗下基金所持股票长安汽车(000625)按指数收益法进行估值,详见本管理人2015年3月17日公告。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

1.根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》,经与托管银行、会计师事务所协商一致,自2015年3月25日起本基金对持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值,详见本管理人2015年3月26日公告。

2.由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	1,479,389,453.11
报告期期间基金总申购份额	35,712,493.59
减:报告期期间基金总赎回份额	171,327,786.05
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	1,343,774,160.65

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	5,702,120.00
报告期期间买入申购总份额	-
报告期期间卖出赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	5,702,120.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.42

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本报告期本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1. 久富证券投资基金基金份额持有人大会决议公告
2. 中国证监会核准久富证券投资基金基金份额持有人大会决议的文件
3.《长城久富核心成长股票型证券投资基金基金合同》
4.《长城久富核心成长股票型证券投资基金托管协议》
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照
6. 基金托管人业务资格批件、营业执照
7. 中国证监会规定的其他文件

8.2 存放地点

广东省深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心41层

8.3 查阅方式

投资者可在办公时间亲临上述存放地点免费查阅,如有疑问,可向本基金管理人长城基金管理有限公司咨询。

咨询电话:0755-23982338

客户服务电话:400-8868-666

网站:www.ccfund.com.cn

长城安心回报混合型证券投资基金

2015 第一季度 报告

2015年3月31日

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:2015年4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。

本基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年04月16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01月01日起至03月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长城安心回报混合
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	2006年8月22日
报告期末基金份额总额	6,844,706,261.68份
投资目标	以获取高于银行一年期定期存款(税前)利率2倍的回报为目标,通过动态的资产配置平衡当期收益与长期资本增值,争取为投资人实现长期稳定的绝对回报。
投资策略	分析上市公司股息率、固定收益品种当期收益率、上市公司持续成长潜力、动态配置基金资产,采用"自底收益,关注成长,精选个股"的投资策略,通过把握上市公司股息率预期、持续成长潜力,选择具有持续分红能力或持续成长潜力的企业作为主要投资对象。
业绩比较基准	银行一年期定期存款(税前)利率的2倍
风险收益特征	本基金是绝对回报产品,其预期收益与风险低于股票基金,高于债券基金与货币市场基金。
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

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1月1日 - 2015年3月31日)
1.本期已实现收益	379,560,253.41
2.本期利润	1,195,796,311.63
3.加权平均基金份额本期利润	0.1645
4.期末基金资产净值	6,375,564,571.29
5.期末基金份额净值	0.9315

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。

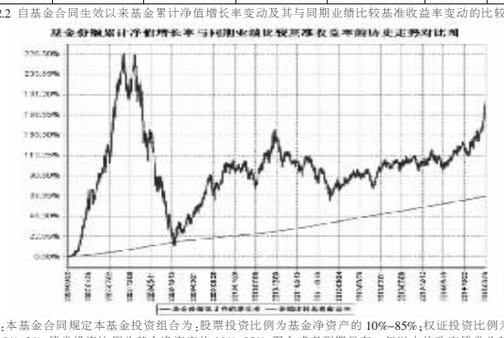
②上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	21.72%	1.02%	1.26%	0.02%	20.46%	1.00%

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: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%-85%;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%-85%;现金或者到期日在一年以内的政府债券为基金净资产的5%以上。本基金的建仓期为自本基金基金合同生效日起6个月,建仓期满时,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	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
徐九龙	长城安心回报混合基金、长城新兴产业基金的基金经理	2009年1月6日	-	13年	男,中国籍,兰州大学理学学士,中山大学理学硕士,曾就职深圳市沙头角保税区管理局,深圳市经济贸易局。2002年1月进入长城基金管理有限公司,曾任基金管理部研究员、"长城久富核心成长股票型证券投资基金"基金经理、"长城银元行业龙头灵活配置混合型证券投资基金"基金经理。

注:①上述任职日期、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情况的说明

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,未出现投资违反法律法规、基金合同约定和相关规定的情况,无因公司未勤勉尽责或操作不当而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,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,不同投资者的利益得到了公平对待。

本基金管理人严格控制不同投资组合之间的同日反向交易,对同向交易的价差进行事后分析,定期出具公平交易稽核报告。本报告期报告认为,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,结果符合相关政策法规和公司制度的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未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量超过该证券当日成交量的5%的现象。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

今年一季度,上证指数震荡上扬,创出09年来的新高,市场非常活跃。本基金投资交易相对较多,减持了部分前期涨幅较大的股票,同时增持了部分互联网类股票,由于创业板调整时间和幅度都很有限,本基金未能把组合调整到位。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金一季度净值增长率为21.72%,在同类可比的基金中排名比较靠后。从目前的情况看,我国经济下行压力仍然较大,政府出台了一系列稳增长的措施,尤其是货币政策持续宽松为市场稳步上行创造了良好的市场环境。但随着年报以及一季报的陆续披露,震荡可能加大。我们将逐步调整和优化组合,争取在控制风险的前提下竭力改善基金的投资绩效。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内,本基金无需要说明的情况。

§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	权益投资	5,388,694,256.63	81.56
	其中:股票	5,388,694,256.63	81.56
2	固定收益投资	674,016,305.00	10.20
	其中:债券	674,016,305.00	10.20
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	246,324,363.16	3.73
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	187,960,903.37	2.84
7	其他资产	110,161,106.78	1.67
8	合计	6,607,156,934.94	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	3,764,666,524.76	59.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	634,576,808.93	9.95
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	532,303,613.10	8.35
J	金融业	261,791,854.68	4.11
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	13,744,743.16	0.22
M	科学研究和技术服务业	7,775,712.00	0.12
N	水利、环境和公共设施管理业	151,050,000.00	2.37
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	22,785,000.00	0.36
S	综合	-	-
	合计	5,388,694,256.63	84.52

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000963	华东医药	6,500,000	403,650,000.00	6.33
2	000513	丽珠集团	5,000,000	298,500,000.00	4.68
3	600887	伊利股份	9,000,000	277,650,000.00	4.35
4	000625	长安汽车	11,000,000	253,990,000.00	3.98
5	600535	天士力	5,000,000	241,100,000.00	3.78
6	600406	国电南瑞	11,000,000	228,140,000.00	3.58
7	000651	格力电器	5,009,755	219,327,073.90	3.44
8	600079	人福医药	6,000,000	215,220,000.00	3.38
9	000895	双汇发展	5,800,000	214,020,000.00	3.36
10	300026	红日药业	6,000,000	196,800,000.00	3.09

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	149,942,105.00	2.35
2	央行票据	-	-
3	金融债券	433,669,200.00	6.80
	其中:政策性金融债	433,669,200.00	6.80
4	企业债券	30,915,000.00	0.48
5	企业短期融资券	29,991,000.00	0.47
6	中期票据	29,499,000.00	0.46
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	674,016,305.00	10.57

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	130234	13国开34	1,500,000	149,235,000.00	2.34
2	140437	14农发37	600,000	60,000,000.00	0.94
3	019428	14国债28	500,000	50,075,000.00	0.79
4	019501	15国债01	500,000	49,975,000.00	0.78
5	110237	11国开37	500,000	47,755,000.00	0.75

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末进行股指期货投资,期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

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。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末进行国债期货投资,本期未未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到过公开谴责、处罚。

5.11.2

本基金投资的前十名股票中,未有投资于超出基金合同规定备选股票库之外股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	830,830.96
2	应收证券清算款	100,000,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	8,813,799.29
5	应收申购款	516,476.53
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	110,161,106.78

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000625	长安汽车	253,990,000.00	3.98	重大事项停牌

注:根据相关法规的规定,经与托管行协商一致,自2015年3月16日起,本管理人对旗下基金所持长安汽车(000625)按指数收益法进行估值,详见本管理人2015年3月17日公告。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

(1)根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》,经与托管银行、会计师事务所协商一致,自2015年3月25日起本基金对持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值,详见本管理人2015年3月26日公告。

(2)由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	7,572,225,068.48
报告期期间基金总申购份额	14,974,912.10
减:报告期期间基金总赎回份额	742,493,718.90
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	6,844,706,261.68

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注:本基金的基金管理人于本报告期期初及本报告期期末均未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本报告期本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1. 本基金设立批准的相关文件
2.《长城安心回报混合型证券投资基金基金合同》
3.《长城安心回报混合型证券投资基金托管协议》
4. 法律意见书
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照
6. 基金托管人业务资格批件、营业执照
7. 中国证监会规定的其他文件

8.2 存放地点

广东省深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心41层

8.3 查阅方式

投资者可在办公时间亲临上述存放地点免费查阅,如有疑问,可向本基金管理人长城基金管理有限公司咨询。

咨询电话:0755-23982338

客户服务电话:400-8868-666

公司网址:http://www.ccfund.com.cn

长城保本混合型证券投资基金

2015 第一季度 报告

2015年3月31日

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:2015年4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2015年04月16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01月01日起至03月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长城保本混合
基金主代码	200016
交易代码	200016
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年8月2日
报告期末基金份额总额	587,760,054.20份
投资目标	本基金采用固定比例组合保险策略进行资产配置,在确保本周期到期时本金安全的基础上,力争实现基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金投资策略分为两个层次:一层为基金在安全资产和风险资产之间的大类资产配置策略;另一层为安全资产的投资策略和风险资产的投资策略。
业绩比较基准	3年期银行定期存款税后收益率
风险收益特征	本基金为保本混合型基金,属于证券投资基金中的低风险品种。
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
基金保证人	中国投融资担保有限公司

§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1月1日 - 2015年3月31日)
1.本期已实现收益	22,425,972.66
2.本期利润	105,615,313.07
3.加权平均基金份额本期利润	0.1689
4.期末基金资产净值	805,361,111.81
5.期末基金份额净值	1.370

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。

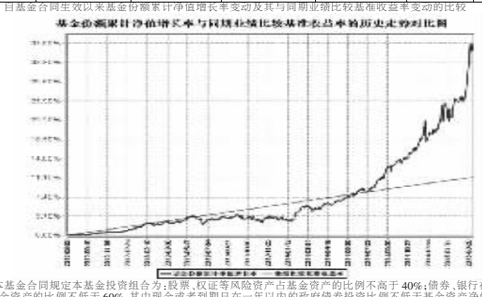
②上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	14.26%	0.76%	0.96%	0.01%	13.30%	0.75%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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、权证等风险资产占基金资产的比例不高于40%;债券、银行存款等安全资产占基金资产的比例不低于60%,其中现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%。本基金的建仓期为自本基金基金合同生效日起6个月,建仓期满时,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	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
钟光正	公司固定收益部总经理、长城保本混合、长城增强收益债券、长城稳固收益债券基金的基金经理	2012年8月2日	-	6年	男,中国籍,经济学硕士,具有10年债券投资管理经验,曾就职于安徽安凯汽车股份有限公司,广发银行总行资金部,招商银行总行资金交易部,2009年11月进入长城基金管理