长城保本混合型证券投资基金

2015 第四季度 报告

2015年12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:2016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。

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01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10月01日起至12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	1,696,390,968.80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1日 - 2015年12月31日)
1.本期已实现收益	4,246,106.75
2.本期利润	18,615,244.66
3.加权平均基金份额本期利润	0.0108
4.期末基金资产净值	1,714,592,100.14
5.期末基金份额净值	1.011

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。

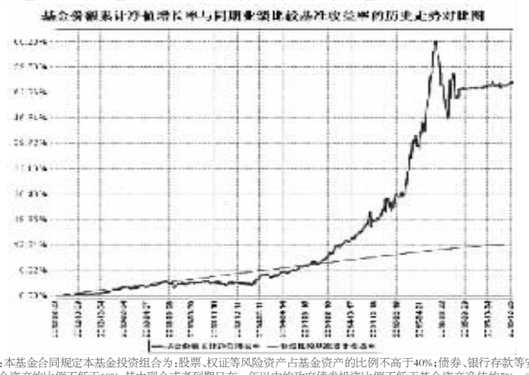
②上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	1.10%	0.17%	0.71%	0.01%	0.39%	0.16%

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、长城积极增利债券、长城保本混合、长城增强收益债券、长城稳固收益债券、长城久祥保本基金的基金经理	2012年8月2日	-	6年	男,中国籍,经济学硕士。具有11年债券投资管理经历。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有限公司,曾任债券研究员。自2010年2月至2011年10月任"长城货币市场证券投资基金"基金经理,自2010年2月至2011年11月任"长城稳健增利债券型证券投资基金"基金经理。
李振兴	长城久利保本基金、长城保本混合基金和长城久鑫保本混合基金的基金经理	2014年4月18日	2015年10月15日	7年	男,中国籍,武汉大学计算机工商管理双学士、金融学硕士。具有7年证券从业经历。曾就职于艾默生网络能源有限公司。2008年进入长城基金管理有限公司,曾任行业研究员、长城基金管理有限公司"长城久利保本混合型证券投资基金"、"长城保本混合型证券投资基金"基金经理助理。
陈良栋	长城保本、长城久祥保本基金的基金经理	2015年11月27日	-	4年	男,中国籍,清华大学微电子学与经济学双学士、清华大学电子科学与技术硕士。2011年进入长城基金管理有限公司,曾任行业研究员、"长城消费增值混合型证券投资基金"基金经理助理。
蔡旻	长城岁岁金理财债券基金、长城鑫金基金、长城稳健增利、长城保本、长城久祥保本基金的基金经理	2015年12月15日	-	5年	男,中国籍,厦门大学金融工程学士、硕士。2010年进入长城基金管理有限公司,曾任债券研究员、"长城货币市场证券投资基金"基金经理助理。

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》、《长城保本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

四季度经济数据继续低迷,债市在4季度继续延续牛市走势,并且收益下行幅度继续超预期。全季度10年期国债收益下行40BP,10年国开收益下行60BP。

本基金在2015年4季度处于第二个保本周期的建仓期,主要以稳步积累安全垫为目标,权益类操作相对谨慎。

安全资产配置在2015年4季度基本完成,并在4季度债市上涨行情中为组合在一定程度上增厚了安全垫。

权益资产方面,我们在4季度本着谨慎的原则,少量仓位参与了权益类投资,但4季度市场关注点在于代表未来的高科技新兴行业和高端服务业等新兴行业中,大部分为中小市值公司,并且经过10月份以来的反弹,大部分中小市值公司股票处于阶段性高位,加上IPO重启、证监会叫停融资类收益互换协议等新因素导致近期市场资金面的供需趋向均衡,权益类市场总体而言缺乏明显的个股选择机会和结构性机会,我们期间权益类资产的操作效果并不明显。

展望2016年一季度,在确保本金安全的前提下,股票投资主要聚焦在新兴产业中,以寻找结构性机会和自下而上寻找个股机会为主,为基金持有人创造稳健回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金份额净值增长率为1.1%,本基金业绩比较基准收益率为0.71%。

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	82,591,856.49	4.03
	其中:股票	82,591,856.49	4.03
2	固定收益投资	1,395,065,500.60	68.09
	其中:债券	1,395,065,500.60	68.09
	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	84,500,000.00	4.12
	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	223,848,316.17	10.93
7	其他资产	262,752,008.63	12.82
8	合计	2,048,757,681.89	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	53,661,510.29	3.13
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	2,221,499.32	0.13
G	交通运输、仓储和邮政业	1,507,500.00	0.09
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,929,350.64	0.29
J	金融业	-	-
K	房地产业	5,899,685.28	0.34
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	4,319,392.21	0.25
N	水利、环境和公共设施管理业	6,798,400.00	0.40
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	3,254,518.75	0.19
S	综合	-	-
	合计	82,591,856.49	4.82

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	002547	春兴精工	750,000	9,960,000.00	0.58
2	300479	神思电子	72,753	7,893,700.50	0.46
3	300190	维尔利	280,000	6,798,400.00	0.40
4	000651	格力电器	300,000	6,705,000.00	0.39
5	002488	金固股份	180,000	5,220,000.00	0.30
6	000926	福星股份	300,000	5,052,000.00	0.29
7	300192	科斯伍德	280,000	4,541,600.00	0.26
8	600460	士兰微	499,918	4,424,274.30	0.26
9	000625	长安汽车	260,000	4,412,200.00	0.26
10	002662	京威股份	200,000	4,400,000.00	0.26

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	101,239,743.00	5.90
2	央行票据	-	-
3	金融债券	315,571,000.00	18.41
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	967,455,757.60	56.42
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	10,147,000.00	0.59
7	可转债	652,000.00	0.04
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,395,065,500.60	81.36

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	1522004	15中外资租债	1,000,000	102,210,000.00	5.96
2	122449	15绿城01	1,000,000	101,530,000.00	5.92
3	122446	15万达01	1,000,000	101,230,000.00	5.90
4	1522007	15兴业租赁债02	1,000,000	100,480,000.00	5.86
5	019506	15国债06	1,000,000	100,240,000.00	5.85

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

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	437,926.40
2	应收证券清算款	239,312,090.61
3	应收股利	-
4	应收利息	21,671,104.86
5	应收申购款	1,330,886.76
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	262,752,008.63

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

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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	1,746,222,870.42
报告期期间基金总申购份额	46,531,226.08
减:报告期期间基金总赎回份额	96,363,127.70
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	1,696,390,968.80

§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:本报告期基金管理人持有本基金的份额情况无变动,于本报告期期初及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:本基金的基金管理人于本报告期未运用固有资金投资于本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1. 本基金设立等相关批准文件
2. 《长城保本混合型证券投资基金基金合同》
3. 《长城保本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

网站:www.ccfund.com.cn

长城安心回报混合型证券投资基金

2015 第四季度 报告

2015年12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:2016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。

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2016年01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10月01日起至12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	2,557,626,342.96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"注重收益、关注成长、精选个股"的投资策略,通过挖掘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10月1日 - 2015年12月31日)
1.本期已实现收益	263,254,690.50
2.本期利润	516,513,989.03
3.加权平均基金份额本期利润	0.1922
4.期末基金资产净值	2,730,451,116.01
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	21.41%	1.47%	0.79%	0.01%	20.62%	1.46%

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、长城医疗保健基金、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3月进入长城基金管理有限公司,曾任基金管理部研究员、"长城久富核心成长混合型证券投资基金"基金经理、"长城量化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。

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 报告期内基金投资策略和运作分析

今年四季度,市场有所反弹,尤其是前期下跌较多的创业板股票。本基金四季度增持了部分中小市值成长股,但仍然因为其估值过高而持仓不够多。基金业绩表现一般。在此,我们向持有人深表歉意。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金四季度净值增长率为21.41%,在同类可比的基金中排名较差。从目前情况看,市场因前期积累的涨幅较大,未来市场震荡将会加大,尤其是题材股。我们将积极调整和优化组合,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	1,917,967,788.17	69.87
	其中:股票	1,917,967,788.17	69.87
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	366,028,000.00	13.33
	其中:债券	366,028,000.00	13.33
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	300,001,000.00	10.93
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	121,654,297.43	4.43
8	其他资产	39,327,872.39	1.43
9	合计	2,744,978,957.99	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	13,528,000.00	0.50
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,286,586,366.06	47.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	6,478,760.00	0.24
F	批发和零售业	231,564,000.00	8.48
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	124,964,000.00	4.58
J	金融业	67,792,567.41	2.48
K	房地产业	25,624,433.90	0.94
L	租赁和商务服务业	10,605,000.00	0.39
M	科学研究和技术服务业	13,300,000.00	0.49
N	水利、环境和公共设施管理业	105,355,326.80	3.86
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	18,591,334.00	0.68
S	综合	13,578,000.00	0.50
	合计	1,917,967,788.17	70.24

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	1,900,000	155,724,000.00	5.70
2	600079	人福医药	6,000,000	133,560,000.00	4.89
3	600276	恒瑞医药	2,700,000	132,624,000.00	4.86
4	000513	丽珠集团	2,000,000	114,860,000.00	4.21
5	000661	长春高新	800,000	96,360,000.00	3.53
6	002294	信立泰	3,000,000	90,360,000.00	3.31
7	600511	国药股份	2,000,000	75,840,000.00	2.78
8	000728	国元证券	3,000,999	67,792,567.41	2.48
9	300026	红日药业	3,000,000	63,300,000.00	2.32
10	603008	喜临门	2,499,991	62,249,775.90	2.28

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	79,676,000.00	2.92
2	央行票据	-	-
3	金融债券	230,012,000.00	8.42
	其中:政策性金融债	230,012,000.00	8.42
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	56,340,000.00	2.06
7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	366,028,000.00	13.41

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	150,810,000.00	5.52
2	1382138	13甘公投MTN1	500,000	56,340,000.00	2.06
3	019501	15国债01	500,000	50,015,000.00	1.83
4	110237	11国开37	500,000	48,965,000.00	1.79
5	110410	11农发10	300,000	30,237,000.00	1.11

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:本基金本报告期末投资股指期货,本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,本期末未持有国债期货。

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

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	1,779,378.51
2	应收证券清算款	32,195,884.42
3	应收股利	-
4	应收利息	5,331,443.30
5	应收申购款	21,166.16
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	39,327,872.39

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

注:本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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	2,771,623,377.65
报告期期间基金总申购份额	7,920,393.76
减:报告期期间基金总赎回份额	221,917,428.45
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	2,557,626,342.96

§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:本报告期基金管理人持有本基金的份额情况无变动,于本报告期期初及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

长城工资宝货币市场基金

2015 第四季度 报告

2015年12月31日

基金管理人:长城基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司
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。

本基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年01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10月01日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长城工资宝货币
基金主代码	000615
交易代码	000615
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年6月25日
报告期末基金份额总额	39,118,811.13份
投资目标	在保证本金安全性和良好流动性的前提下,力争获得超过业绩比较基准的表现。
投资策略	一级资产配置策略:根据宏观经济研究,分析市场趋势和政府政策变化,决定基金投资组合的平均剩余期限。 二级资产配置策略:根据不同类别资产的剩余期限结构、流动性指标、收益率水平、市场偏好等决定不同类别资产的配置比例。 三级资产配置策略:根据明细资产的剩余期限、信用等级、流动性指标,确定构建基金投资组合的投资品种。根据对个券收益率水平、剩余期限、流动性状况的权衡,参照收益目标确定个券投资品种与投资数量。
业绩比较基准	银行活期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为货币市场基金,属于证券投资基金中的低风险品种,其预期风险和收益低于债券型基金、混合型基金和股票型基金。
基金管理人	长城基金管理有限公司
基金托管人	中信银行股份有限公司

§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1日 - 2015年12月31日)
1. 本期已实现收益	268,581.44
2.本期利润	268,581.44
3.期末基金资产净值	39,118,811.13

注: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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

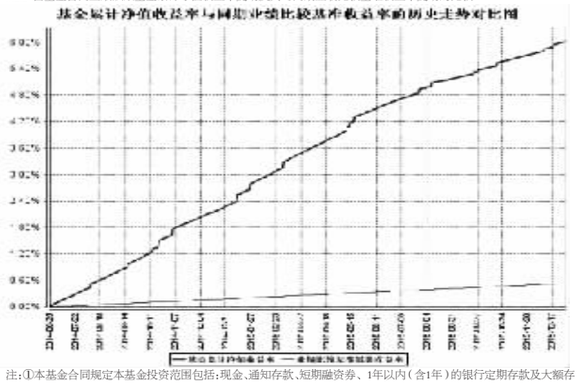
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.6057%	0.0101%	0.0882%	0.0000%	0.5175%	0.0101%

注:本基金收益分配按日结转份额。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:①本基金合同规定本基金投资范围包括:现金、通知存款、短期融资券、1年以内(含1年)的银行定期存款及大额存单、期限在1年以内(含1年)的债券回购、期限在1年以内(含1年)的中央银行票据、剩余期限在397天以内(含397天)的债券、剩余期限在397天以内(含397天)的资产支持证券、剩余期限在397天以内(含397天)的中期票据等具有良好流动性的货币市场工具。

②本基金的建仓期为自基金合同生效之日起3个月内。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		
邹德立	长城工资宝