长城安心回报混合型证券投资基金

2016 第一季度 报告

2016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: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。

本基金托管人中国农业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	2,534,896,616.73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(2016年1月1日 - 2016年3月31日)
1.本期已实现收益	6,518,041.00
2.本期利润	-337,845,184.06
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1328
4.期末基金资产净值	2,371,047,011.69
5.期末基金份额净值	0.9354

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。

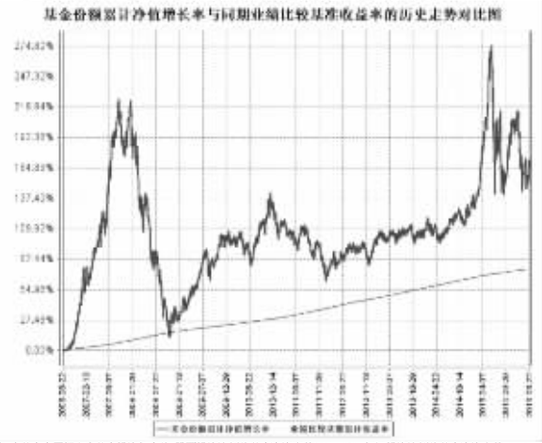
②上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-12.38%	2.30%	0.75%	0.01%	-13.13%	2.29%

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	2016年1月18日	14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、"长城久富核心或长混合型证券投资基金"基金经理、"长城景气行业龙头灵活配置混合型证券投资基金"基金经理。
吴文庆	公司研究部总经理、长城久恒、长城双动力、长城安心回报、长城新兴产业、长城环保、长城改革红利基金的基金经理	2016年1月18日	-	7年	男,中国籍,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,曾任研究部行业研究员、"长城品牌优选混合型证券投资基金"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

16年一季度资本市场开端颇不平静,一方面供给侧改革带来的经济增长动力短期难以释放,另一方面保底线思维下政府稳增长力度加大。经济方面,年初以来补库存行情叠加开工旺季带来经济回暖预期,1、2月份金融数据放量、地产销量和投资改善、工业利润增速转正以及PMI数据回暖逐步强化这一预期。通胀方面,蔬菜和猪肉价格的上涨带动CPI上行。货币政策方面,海外市场不断宽松以及美联储加息节奏放缓阶段性减轻人民币贬值压力,货币政策在利率走廊和MPA两条主线下继续适度宽松。一季度多空分歧下的债券市场收益率呈现窄幅震荡,一方面利率债在短期无法证伪的基本面预期下中枢波动上行,另一方面信用利差在刚性配置需求下不断走低。

二季度伊始,短期经济与物价双升的局面难以证伪,但更长期来看,基建和房地产产业链复苏的持续性存疑,过剩产能去化的实质性进展有待观察,稳增长面临众多约束,债券市场周期拉长,收益率中枢下移是大概率事件。国债、政策性金融债、地方债供给量增幅较大,企业债、公司债等信用债发行审批加速,而银行理财、券商资管、基金专户规模持续增长,对债券的需求旺盛,债券市场供需两旺的格局将会持续。对于信用债,信用违约会成为常态,而当前信用利差的保护空间非常有限,信用债投资需要甄别风险。

一季度,我们完成了组合的建仓,保持债券仓位80%左右,适当参与利率债波段操作,积极参与转债和新股一级申购,对于部分息差过窄、边际贡献较小的债券进行存量置换,优化组合结构;权益方面,保持较低仓位,组合回撤控制在合理范围内,在反弹过程中通过优化持仓结构,适当提高仓位,获得一定超额收益。二季度,我们将保持组合久期匹配,积极参与低风险类固定收益机会,提高组合静态收益;根据安全垫构建情况灵活调整组合权益类资产仓位,以基本面确定性较强、估值相对合理、符合经济结构调整方向的个股作为主要投资标的,以期获取更好的风险调整后收益。

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0.80%,本基金业绩比较基准收益率为0.60%。

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	55,672,203.79	1.59
	其中:股票	55,672,203.79	1.59
2	固定收益投资	1,940,028,471.00	55.46
	其中:债券	1,940,028,471.00	55.46
	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	1,129,892,214.83	32.30
	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	34,954,257.69	1.00
7	其他资产	337,398,885.27	9.65
8	合计	3,497,946,032.58	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	1,214,085,255.25	51.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	63,660,867.31	2.68
F	批发和零售业	280,397,221.30	11.83
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	35,046,000.00	1.48
J	金融业	-	-
K	房地产业	30,790,921.33	1.30
L	租赁和商务服务业	28,824,556.86	1.22
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	82,755,128.19	3.49
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	46,429,724.20	1.96
S	综合	-	-
	合计	1,781,989,674.44	75.16

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	2,000,000	139,900,000.00	5.90
2	600276	恒瑞医药	2,700,000	127,521,000.00	5.38
3	000513	丽珠集团	2,799,895	125,855,280.25	5.31
4	600079	人福医药	6,000,000	111,600,000.00	4.71
5	000661	长春高新	1,049,902	106,985,013.80	4.51
6	002294	信立泰	3,000,000	84,870,000.00	3.58
7	002310	东方园林	2,996,921	63,624,632.83	2.68
8	601313	江南嘉捷	4,999,884	63,148,534.92	2.66
9	600511	国药股份	2,000,000	56,300,000.00	2.37
10	603008	喜临门	3,000,991	54,467,986.65	2.30

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	109,255,000.00	4.61
2	央行票据	-	-
3	金融债券	229,157,000.00	9.66
	其中:政策性金融债	229,157,000.00	9.66
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	56,695,000.00	2.39
7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	395,107,000.00	16.66

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	149,970,000.00	6.33
2	169913	16贴现国债13	800,000	79,600,000.00	3.36
3	1382138	13甘公投MTN1	500,000	56,695,000.00	2.39
4	110237	11国开37	500,000	49,085,000.00	2.07
5	110410	11农发10	300,000	30,102,000.00	1.27

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:本基金本报告期末未持有股指期货投资。

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	364,582.71
2	应收证券清算款	1,000,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	30,697,590.70
5	应收申购款	420,164.15
6	其他应收款	150.00
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	32,482,487.56

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	1,696,390,968.80
报告期间基金总申购份额	56,037,350.98
减:报告期期间基金总赎回份额	66,200,173.95
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	1,686,228,145.83

§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. 本基金设立批准的文件
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

2016 第一季度 报告

2016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: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	1,686,228,145.83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(2016年1月1日 - 2016年3月31日)
1.本期已实现收益	-2,080,698.50
2.本期利润	6,235,628.76
3.加权平均基金份额本期利润	0.0037
4.期末基金资产净值	1,710,631,591.29
5.期末基金份额净值	1.014

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。

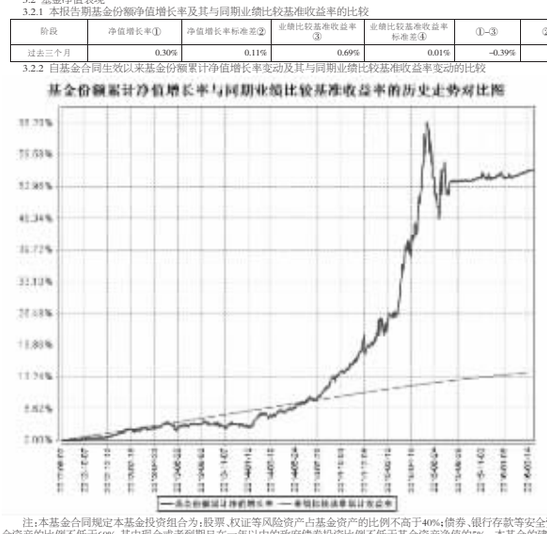
②上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	0.30%	0.11%	0.69%	0.01%	-0.39%	0.10%

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、长城久稳固收益债券、长城久祥保本基金的基金经理	2012年8月2日	-	7年	男,中国籍,经济学硕士。具有12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。
蔡旻	长城岁岁金理财债券基金、长城商金基金、长城稳健增利、长城保本、长城久祥保本、长城新优选混合基金的基金经理	2015年12月15日	-	6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。
陈良栋	长城保本、长城久祥保本、长城久安保本基金的基金经理	2015年11月27日	-	5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,曾任研究员,"长城消费增值混合型证券投资基金"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

2016年1季度,国内经济出现曙光。具体来看,尽管钢铁有色等主要高耗能行业和传统行业产量大幅下滑,出口超预期下跌等因素共同导致了今年工业的开局低迷。但在房地产政策的刺激下,1-2月份房地产投资同比增长3%,增速比去年全年提高2%,受此影响,1-2月固定资产投资增速结束连续20个月下滑,较去年全年增速提高了0.2%。1-2月制造业和基建投资增速分别为7.5%和15.7%,二者均远好于去年12月,也对固定资产投资增速的回升有贡献。1-2月消费同比增长10.2%,依然保持了平稳较快的增长。受需求温和上升以及食品价格上涨的影响,CPI增速温和反弹,PPI通缩幅度缩小。

2016年1季度货币环境整体宽松,短端利率中枢稳步下移,以1年期国债为例,已突破了15年8月份以来的低点。与此同时,由于一季度金融和经济数据出现了部分改善,大宗商品价格也从低点明显反弹,投资者对于未来经济增长以及通货膨胀的看法分歧加大,长端利率中枢震荡中小幅上行。

2016年1季度,本基金处于降本周期的第一阶段,主要以稳步积累安全垫为目标。本基金安全资产在2016年1季度已经配置完成,并在1季度信用债上涨行情中为组合增厚了安全垫。

风险资产方面,在人民币贬值、大小非减持、IPO重启等风险因素影响下,2016年前两个月上证综指下跌24%,创业板下跌31%,成交量低迷,市场风险偏好下降,市场风险短期得到较大释放。3月份中国经济企稳回升、美元加息预期延后,市场迎来反弹,上证综指上涨11.8%,创业板指上涨19.1%。我们在2015年底和2016年初大幅度降低股票仓位,3月份反弹中适当参与,但中长期相对谨慎,没有大幅度加仓。

展望后市,中长期看,美国加息、人民币贬值、政府货币宽松力度不如以前、大小非减持等风险因素仍旧存在,微观层面看,中小市值公司的估值还比较贵,压制市场反弹高度,预计市场处于存量资金博弈格局中,整体趋势性机会不大,一些基本面优良个股能走出独立行情。股票市场存在较大不确定性和风险,我们本着先防范风险再考虑追求收益的原则,自下而上寻找确定性机会。

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0.30%,本基金业绩比较基准收益率为0.69%。

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	37,580,304.96	2.18
	其中:股票	37,580,304.96	2.18
2	固定收益投资	1,404,375,016.30	81.63
	其中:债券	1,404,375,016.30	81.63
	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	238,000,000.00	13.83
	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	7,890,043.80	0.46
7	其他资产	32,482,487.56	1.89
8	合计	1,720,327,852.62	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	16,848,218.75	0.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	2,571,265.01	0.15
F	批发和零售业	-	-
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	9,989,121.20	0.58
J	金融业	4,048,700.00	0.24
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	4,123,000.00	0.24
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	37,580,304.96	2.20

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	600588	用友网络	340,000	7,095,800.00	0.41
2	002236	大华股份	130,100	4,688,804.00	0.27
3	600079	人福医药	250,000	4,650,000.00	0.27
4	002183	怡亚通	140,000	4,123,000.00	0.24
5	600563	法拉电子	110,000	3,818,100.00	0.22
6	300269	联建光电	140,056	3,217,086.32	0.19
7	300379	东方通	39,963	2,893,321.20	0.17
8	000090	天健集团	179,917	2,535,030.53	0.15
9	601336	新华保险	50,000	2,028,500.00	0.12
10	600109	国金证券	140,000	2,020,200.00	0.12

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	100,040,894.00	5.85
2	央行票据	-	-
3	金融债券	315,330,000.00	18.43
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	978,874,122.30	57.22
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	10,130,000.00	0.59
7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,404,375,016.30	82.10

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	122449	15绿城01	1,000,000	102,210,000.00	5.97
2	1522004	15中外贸租赁债	1,000,000	102,110,000.00	5.97
3	122446	15万达01	1,000,000	101,690,000.00	5.94
4	122467	15万达02	1,000,000	101,350,000.00	5.92
5	1522007	15兴业租赁债02	1,000,000	100,490,000.00	5.87

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	275,855.37
2	应收证券清算款	324,261,151.66
3	应收股利	-
4	应收利息	12,831,105.30
5	应收申购款	29,422.33
6	其他应收款	1,350.61
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	337,398,885.27

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	000651	格力电器	7,136,500.00	0.24	重大事项
2	002470	金正大	5,144,700.00	0.17	重大事项

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

基金合同生效日(2016年1月12日)基金份额总额	2,977,984,216.26
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	4,873,838.89
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	25,425,510.36
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	2,957,432,544.79

§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.中国证监会许可长城久安保本混合型证券投资基金注册的文件
2.《长城久安保本混合型证券投资基金基金合同》
3.《长城久安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

长城久安保本混合型证券投资基金

2016 第一季度 报告

2016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: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12日(基金合同生效日)起至03月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长城久安保本
基金主代码	002296
交易代码	002296
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年1月12日
报告期末基金份额总额	2,957,432,544.79份
投资目标	本基金通过固定收益类资产与权益类资产的动态配置和有效的组合管理,在确保保本周期