

# 长城安心回报混合型证券投资基金 2016 年半年度报告

2016 年 6 月 30 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

送出日期：2016 年 8 月 25 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 08 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

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及其更新。

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 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	13
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	13
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>13</b>
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	17
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>34</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	34
7.2 报告期末按行业分类的境内股票投资组合.....	35
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	37
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	39
7.6 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.....	39
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	39
7.8 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贵金属投资明细.....	39
7.9 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.....	40
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	40
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	40
7.12 投资组合报告附注.....	40

<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>41</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	41
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	41
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	42
<b>§9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>42</b>
<b>§10 重大事件揭示</b> .....	<b>42</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	42
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	42
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	43
10.4 基金投资策略的改变.....	43
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	43
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	43
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	43
10.8 其他重大事件.....	45
<b>§11 备查文件目录</b> .....	<b>51</b>
11.1 备查文件目录.....	51
11.2 存放地点.....	51
11.3 查阅方式.....	51

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	长城安心回报混合型证券投资基金
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
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
报告期末基金份额总额	2,717,474,221.86 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

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型基金，高于债券基金与货币市场基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		长城基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	车君	林葛
	联系电话	0755-23982338	010-66060069
	电子邮箱	chejun@ccfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-8868-666	95599
传真		0755-23982328	010-68121816
注册地址		深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 40、41	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9

	层	
邮政编码	518026	100031
法定代表人	何伟	周慕冰

注：2016 年 7 月 1 日前长城基金管理有限公司的法定代表人为杨光裕，自 2016 年 7 月 1 日起法定代表人变更为何伟。

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报、中国证券报、上海证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.ccfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	长城基金管理有限公司	深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 40、41 层

# § 3 主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	215,097,519.90
本期利润	-336,775,607.17
加权平均基金份额本期利润	-0.1278
本期加权平均净值利润率	-14.06%
本期基金份额净值增长率	-12.24%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	1,338,895,846.19
期末可供分配基金份额利润	0.4927
期末基金资产净值	2,546,002,393.04
期末基金份额净值	0.9369
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	173.86%

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期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 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	份额净值 增长率①	份额净值 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
过去一个月	4.24%	1.05%	0.25%	0.01%	3.99%	1.04%
过去三个月	0.16%	1.27%	0.75%	0.01%	-0.59%	1.26%
过去六个月	-12.24%	1.84%	1.51%	0.01%	-13.75%	1.83%
过去一年	-10.46%	2.28%	3.30%	0.01%	-13.76%	2.27%
过去三年	38.06%	1.64%	15.77%	0.02%	22.29%	1.62%
自基金合同 生效起至今	173.86%	1.55%	74.84%	0.02%	99.02%	1.53%

### 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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

长城基金管理有限公司是经中国证监会批准设立的第 15 家基金管理公司，由长城证券股份有限公司（40%）、东方证券股份有限公司（15%）、西北证券有限责任公司（15%）、北方国际信托股份有限公司（15%）、中原信托有限公司（15%）于 2001 年 12 月 27 日共同出资设立，当时注册资本为壹亿元人民币。2007 年 5 月 21 日，经中国证监会批准，公司完成股权结构调整，现有



股东为长城证券股份有限公司（47.059%）、东方证券股份有限公司（17.647%）、北方国际信托股份有限公司（17.647%）和中原信托有限公司（17.647%）。2007 年 10 月 12 日，经中国证监会批准，将注册资本增加至壹亿伍仟万元人民币。公司经营范围是基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务。截止本报告期末，公司管理的基金有封闭式基金：久嘉证券投资基金；开放式基金：长城久恒灵活配置混合型证券投资基金、长城久泰沪深 300 指数证券投资基金、长城货币市场证券投资基金、长城消费增值混合型证券投资基金、长城安心回报混合型证券投资基金、长城久富核心成长混合型证券投资基金(LOF)、长城品牌优选混合型证券投资基金、长城稳健增利债券型证券投资基金、长城双动力混合型证券投资基金、长城景气行业龙头灵活配置混合型证券投资基金、长城中小盘成长混合型证券投资基金、长城积极增利债券型证券投资基金、长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金、长城优化升级混合型证券投资基金、长城保本混合型证券投资基金、长城岁岁金理财债券型证券投资基金、长城久利保本混合型证券投资基金、长城增强收益定期开放债券型证券投资基金、长城医疗保健混合型证券投资基金、长城淘金一年期理财债券型证券投资基金、长城工资宝货币市场基金、长城久鑫保本混合型证券投资基金、长城久盈纯债分级债券型证券投资基金、长城稳固收益债券型证券投资基金、长城新兴产业灵活配置混合型证券投资基金、长城环保主题灵活配置混合型证券投资基金、长城改革红利灵活配置混合型证券投资基金、长城久惠保本混合型证券投资基金、长城久祥保本混合型证券投资基金、长城新策略灵活配置混合型证券投资基金、长城久安保本混合型证券投资基金、长城新优选混合型证券投资基金、长城久润保本混合型证券投资基金、长城久益保本混合型证券投资基金、长城新视野混合型证券投资基金、长城久源保本混合型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
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	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。

	革红利基金的基金经理				
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、“长城久富核心成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。

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合规守信情况的说明

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年国内经济层面仍然继续寻底，新开工持续下滑，出口和内需仍然萎靡不振。从目前各项经济数据来看，经济还在持续的下滑趋势当中。但经过去年的降准降息之后，目前货币的操作空间有限，国内面临汇率和利率的双重压力。股票市场在开年初给出了当头棒喝，在熔断机制的影响下，连续暴跌应对，使得基金开年走低后，操作空间灵活度下降。二季度市场开始走稳，慢慢的走出了温和上涨的态势。

上半年，本基金一直重仓持有新兴成长行业的上市公司，并辅以稳定的白酒、医药作为底仓配置，在季度中对热点的板块和个股进行了一定程度的波段操作。但由于年初仓位较高，在熔断的影响下，年初下跌较多，使得基金上半年表现一般。下半年，我们将细心甄别风险，选择未来几个季度业绩增长确定，具备长期空间的行业和公司作为本基金投资的重点，争取为持有人做出更好的回报。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金份额净值增长率为-12.24%，本基金比较基准收益率为 1.51%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度来看，英国脱欧之后，除了头两天对全球股市有所冲击之外，市场已经缓和过来，现在全球市场预测脱欧之后，会拖累欧洲经济下行，迫使欧洲继续放水，在此背景下，美国加息的节奏也会放缓，年内加息的预期下降。市场对货币面的宽松的乐观预期开始抬头。国内经济上半年维持平稳，目前国内通胀下行，市场预期下半年货币政策有降准、降息的空间，预计下半年财政和货币政策仍然维持偏宽松的趋势。

目前市场的格局在没有新增资金入市的情况下，指数维持窄幅震荡的板块轮动行情。由于在窄幅震荡的行情中，结构要优于仓位，保持中性仓位的运作，不让过高的仓位暴露风险。

在投资思路方面，我们对于热点板块和个股仍然会考虑去做波段，但主要的个股和持仓仍然会集中在新能源、节能环保、自动化、互联网、配网、高铁、移动支付、医药、食品安全、国企改革、国防安全、信息安全等符合国家政策和持续投入的行业。我们会在这些板块自下而上的仔细甄别个股，选择有核心技术、管理层过硬、产品壁垒高、市场空间大的公司进行集中配置。

## 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

公司成立了受托资产估值委员会，为基金估值业务的最高决策机构，由公司总经理、分管估

值业务副总经理、督察长、投资总监、研究部总经理、运行保障部经理、基金会计、基金经理和行业研究员、金融工程研究员等组成，公司监察稽核人员列席受托资产估值委员会。

受托资产估值委员会负责制定、修订和完善基金估值政策和程序，定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性、适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。基金会计凭借其专业技能和对市场产品长期丰富的估值经验以及对相关法律法规的熟练掌握，对没有市价的投资品种的估值方法在其专业领域提供专业意见。基金经理及研究员凭借其丰富的专业技能和对市场产品的长期深入的跟踪研究，对没有市价的投资品种综合宏观经济、行业发展、及个股状况等各方面因素，从价值投资的角度进行理论分析，并根据分析的结果向受托资产估值委员会建议应采用的估值方法及合理的估值区间。金融工程人员根据受托资产估值委员会提出的多种估值方法预案，利用金融工程研究体系各种经济基础数据和数量化工具，针对不同的估值方法及估值模型进行演算，为估值委员会寻找公允的、操作性较强的估值方法提供数理依据。监察稽核人员对估值委员会做出的决议进行合规性审查，对估值委员提交的基金估值信息披露文件进行合规性审查。

受托资产估值委员会成员均具有五年以上证券、基金行业工作经验，具备专业胜任能力；基金会计具有会计从业资格和基金行业从业资格，精通基金估值政策、流程和标准，具有五年以上基金估值和会计核算工作经验；基金经理和研究员均拥有五年以上基金、证券投资工作经验，精通投资、研究理论知识和工具方法。

## 2、基金经理参与或决定估值的程度

基金经理作为估值委员会成员，凭借其丰富的专业技能和对市场产品的长期深入的跟踪研究，向受托资产估值委员会建议应采用的估值方法及合理的估值区间。基金经理有权出席估值委员会会议，但不得干涉估值委员会作出的决定及估值政策的执行。

## 3、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

估值委员会秉承基金持有人利益至上的宗旨，在估值方法的选择上力求客观、公允，在数据的采集方面力求公开、获取方便、操作性强、不易操纵。本基金管理人旗下管理的基金，其参与估值流程各方之间不存在任何重大的利益冲突。

## 4、已签约的任何定价服务的性质与程度

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署债券估值数据服务协议，由其按约定提供债券品种的估值数据。

## 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金无需要说明的情况。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—长城基金管理有限公司 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为，长城基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

#### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，长城基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

### § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：长城安心回报混合型证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	134,429,942.40	118,652,521.63
结算备付金		1,958,330.69	3,001,775.80
存出保证金		1,004,909.70	1,779,378.51

交易性金融资产	6.4.7.2	2,272,428,720.68	2,283,995,788.17
其中：股票投资		1,997,020,720.68	1,917,967,788.17
基金投资		-	-
债券投资		275,408,000.00	366,028,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	121,824,080.16	300,001,000.00
应收证券清算款		21,777,502.20	32,195,884.42
应收利息	6.4.7.5	1,721,679.82	5,331,443.30
应收股利		-	-
应收申购款		81,030.58	21,166.16
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,555,226,196.23	2,744,978,957.99
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016年6月30日</b>	<b>上年度末 2015年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		1,871,231.87	7,260,038.19
应付管理人报酬		3,043,451.58	3,507,914.03
应付托管费		507,241.92	584,652.36
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	2,535,332.55	1,988,673.59
应交税费		206,630.13	206,630.13
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	1,059,915.14	979,933.68
负债合计		9,223,803.19	14,527,841.98
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	1,207,106,546.85	1,136,097,566.91
未分配利润	6.4.7.10	1,338,895,846.19	1,594,353,549.10
所有者权益合计		2,546,002,393.04	2,730,451,116.01
负债和所有者权益总计		2,555,226,196.23	2,744,978,957.99

注：报告截止日 2016 年 06 月 30 日，基金份额净值人民币 0.9369 元，基金份额总额 2,717,474,221.86 份。

## 6.2 利润表

会计主体：长城安心回报混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		-309,509,525.47	2,260,377,710.81
1.利息收入		6,588,169.86	14,614,267.13
其中：存款利息收入	6.4.7.11	920,019.75	1,235,257.41
债券利息收入		5,388,291.20	12,262,293.47
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		279,858.91	1,116,716.25
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		235,765,124.23	1,970,200,274.01
其中：股票投资收益	6.4.7.12	223,051,330.24	1,943,806,183.00
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-459,850.00	7,042,149.68
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.3	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	13,173,643.99	19,351,941.33
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-551,873,127.07	275,230,475.20
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	10,307.51	332,694.47
<b>减：二、费用</b>		27,266,081.70	63,922,218.58
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	17,865,538.11	41,237,795.36
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,977,589.68	6,872,965.89
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	6,186,771.90	15,109,575.51
5. 利息支出		-	428,603.71
其中：卖出回购金融资产支出		-	428,603.71
6. 其他费用	6.4.7.20	236,182.01	273,278.11
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-336,775,607.17	2,196,455,492.23
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-336,775,607.17	2,196,455,492.23

## 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长城安心回报混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,136,097,566.91	1,594,353,549.10	2,730,451,116.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-336,775,607.17	-336,775,607.17
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	71,008,979.94	81,317,904.26	152,326,884.20
其中：1.基金申购款	101,364,192.05	114,235,304.99	215,599,497.04
2.基金赎回款	-30,355,212.11	-32,917,400.73	-63,272,612.84
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	1,207,106,546.85	1,338,895,846.19	2,546,002,393.04
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	3,363,583,254.91	2,431,442,257.50	5,795,025,512.41
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,196,455,492.23	2,196,455,492.23
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-2,055,604,469.80	-2,854,870,629.38	-4,910,475,099.18
其中：1.基金申购款	29,281,406.46	39,346,672.13	68,628,078.59
2.基金赎回款	-2,084,885,876.26	-2,894,217,301.51	-4,979,103,177.77
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少)	-	-	-



以“-”号填列)			
五、期末所有者权益(基金净值)	1,307,978,785.11	1,773,027,120.35	3,081,005,905.46

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 何伟 _____	_____ 熊科金 _____	_____ 彭洪波 _____
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

长城安心回报混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）系由长城基金管理有限公司发起，经中国证券监督管理委员会（中国证监会）“证监基金字[2006]23 号”《关于同意长城安心回报混合型证券投资基金募集的批复》核准，基金合同于 2006 年 8 月 22 日生效的契约型开放式证券投资基金，存续期限不定，首次设立募集规模为 1,416,548,067.74 份基金份额。基金管理人为长城基金管理有限公司，注册登记机构为长城基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司（以下简称“中国农业银行”）。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行并上市交易的公司股票、债券、权证以及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的业绩比较基准为：银行一年期定期存款（税前）利率的 2 倍。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会、中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2016 年 06 月 30 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 6 月 30 日的经营成果和净值变动情况。

### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金于本期未发生会计差错更正。

### 6.4.6 税项

#### 1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，证券（股票）交易印花税税率为 1%，由出让方缴纳。

股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

#### 2. 营业税、增值税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，免征营业税。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，质押式买入返售金融商品及持有政策性金融债券的利息收入免征增值

税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，买断式买入返售金融商品、同业存单以及持有金融债券的利息收入免征增值税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

### 3. 个人所得税

个人所得税税率为 20%。

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利、债券的利息及储蓄利息时代扣代缴个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号《财政部国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》，自 2008 年 10 月 9 日起暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末
	2016 年 6 月 30 日
活期存款	34,429,942.40
定期存款	100,000,000.00
其中：存款期限 1-3 个月	100,000,000.00
其他存款	-
合计：	134,429,942.40

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2016 年 6 月 30 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	1,940,263,963.79	1,997,020,720.68	56,756,756.89	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	270,681,561.86	275,408,000.00	4,726,438.14
	合计	270,681,561.86	275,408,000.00	4,726,438.14
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	2,210,945,525.65	2,272,428,720.68	61,483,195.03	

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金于本期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末	
	2016 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间	121,824,080.16	121,824,080.16
合计	121,824,080.16	121,824,080.16

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日						
	债券代 码	债券名称	约定 返售日	估值单价	数量（张）	估值 总额	其中：已出售 或再质押总额
1	120217	12 国开 17	2016 年 7 月 4 日	101.20	700,000	70,840,000.00	-
2	160406	16 农发 06	2016 年 7 月 1 日	99.79	500,000	49,895,000.00	-
合计					1,200,000	120,735,000.00	-

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	44,585.70
应收定期存款利息	193,750.00
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	881.30
应收债券利息	1,452,907.53
应收买入返售证券利息	29,103.09
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	452.20
合计	1,721,679.82

注：其他为应收交易所结算保证金利息。

#### 6.4.7.6 其他资产

注：本基金于本期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	2,531,784.87
银行间市场应付交易费用	3,547.68
合计	2,535,332.55

注：交易所市场应付交易费用均为应付佣金。

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2016 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	750,000.00
应付赎回费	1,949.78
预提费用	307,965.36
合计	1,059,915.14

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,557,626,342.96	1,136,097,566.91
本期申购	228,184,447.63	101,364,192.05
本期赎回(以“-”号填列)	-68,336,568.73	-30,355,212.11
本期末	2,717,474,221.86	1,207,106,546.85

注：本期申购包含基金转入份额及金额；本期赎回包含基金转出份额及金额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,482,936,607.49	111,416,941.61	1,594,353,549.10
本期利润	215,097,519.90	-551,873,127.07	-336,775,607.17
本期基金份额交易产生的变动数	91,641,675.83	-10,323,771.57	81,317,904.26
其中：基金申购款	133,127,491.05	-18,892,186.06	114,235,304.99
基金赎回款	-41,485,815.22	8,568,414.49	-32,917,400.73
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,789,675,803.22	-450,779,957.03	1,338,895,846.19

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
	活期存款利息收入
定期存款利息收入	193,750.00
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	26,953.46
其他	12,002.71
合计	920,019.75

注：其他为交易所结算保证金利息收入。

## 6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	1,900,120,900.77
减：卖出股票成本总额	1,677,069,570.53
买卖股票差价收入	223,051,330.24

## 6.4.7.13 债券投资收益

## 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-459,850.00
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	-459,850.00

## 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	283,375,108.57
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	279,476,030.00
减：应收利息总额	4,358,928.57
买卖债券差价收入	-459,850.00

## 6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

注：本基金于本期未发生资产支持证券投资收益/损失。

## 6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期末进行贵金属投资，未产生贵金属投资收益/损失。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金于本期未发生衍生工具收益/损失。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	13,173,643.99
基金投资产生的股利收益	-
合计	13,173,643.99

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
1. 交易性金融资产	-551,873,127.07
——股票投资	-551,160,877.07
——债券投资	-712,250.00
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-551,873,127.07

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	9,967.08
转换基金补偿收入	340.43
合计	10,307.51

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	6,185,412.02



银行间市场交易费用	1,359.88
合计	6,186,771.90

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	49,726.04
信息披露费	149,178.12
银行间债券帐户维护费	18,000.00
银行汇划费用	18,577.85
其他	600.00
银行小额帐户维护费	100.00
合计	236,182.01

注：其他为上海清算所查询服务费 600.00 元。

#### 6.4.7.21 分部报告

截至本期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分部报告。

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准日，本基金无需做披露的资产负债表日后事项。

### 6.4.9 关联方关系

#### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期无对本基金存在控制关系或重大利害关系的关联方发生变化的情况。

#### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
长城基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行	基金托管人、基金代销机构
长城证券股份有限公司（“长城证券”）	基金管理人股东、基金代销机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
长城证券	34,200,131.76	0.81%	695,059,308.07	8.21%
东方证券	-	-	142,748,827.49	1.69%

##### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例	成交金额	占当期债券 成交总额的比例
长城证券	-	-	111,616,364.38	53.24%

##### 6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本期及上年度可比期间未通过关联交易单元进行债券回购交易。

##### 6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本期及上年度可比期间未通过关联交易单元进行权证交易。

##### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量 的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
长城证券	31,850.62	0.81%	31,850.62	1.26%
关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总 量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
长城证券	632,782.47	8.21%	229,937.04	5.43%
东方证券	129,958.18	1.69%	-	-

注：上述佣金按市场佣金率计算，扣除券商需承担的费用(包括但不限于买(卖)经手费、证券结算

风险基金和证券交易所买(卖)证管费等)。

管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月 30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	17,865,538.11	41,237,795.36
其中：支付销售机构的客户维护费	3,685,710.60	8,490,217.70

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.5%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 1.5\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理人的管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前三个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,977,589.68	6,872,965.89

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金托管人于次月前三个工作日内从基金资产中一次性支取。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金于本期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人本期及上年度可比期间未运用固有资金投资于本基金，于本期末及上年度可比期末均未持有本基金份额。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：除基金管理人之外的本基金其他关联方于本期末及上年度可比期末均未持有本基金份额。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	34,429,942.40	687,313.58	196,099,090.93	1,185,187.47

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，并按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金于本期及上年度可比期间未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金于本期未进行利润分配。

6.4.12 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601966	玲珑轮胎	2016年6月24日	2016年7月6日	新股未上市	12.98	12.98	15,341	199,126.18	199,126.18	-
603016	新宏泰	2016年6月23日	2016年7月1日	新股未上市	8.49	8.49	1,602	13,600.98	13,600.98	-
300520	科大国创	2016年6月30日	2016年7月8日	新股未上市	10.05	10.05	926	9,306.30	9,306.30	-
002805	丰元股份	2016年6月29日	2016年7月7日	新股未上市	5.80	5.80	971	5,631.80	5,631.80	-

## 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002574	明牌珠宝	2016年6月27日	重大事项停牌	13.04	-	-	5,000,000	66,321,502.00	65,200,000.00	-
600511	国药股份	2016年2月18日	重大事项停牌	27.44	2016年8月4日	30.16	2,000,000	60,200,275.10	54,880,000.00	-
000639	西王食品	2016年5月27日	重大事项停牌	14.12	-	-	3,388,032	49,081,413.48	47,839,011.84	-
300334	津膜科技	2016年5月20日	重大事项停牌	18.05	-	-	2,000,898	41,583,103.78	36,116,208.90	-
600986	科达股份	2016年6月27日	重大事项停牌	15.98	2016年7月18日	17.58	1,399,968	25,672,673.33	22,371,488.64	-
300292	吴通控股	2016年1月25日	重大事项停牌	33.26	2016年7月20日	36.48	150,000	6,691,356.23	4,989,000.00	-

## 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

## 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截止本报告期末 2016 年 06 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0.00 元，无质押证券。

## 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截止本报告期末 2016 年 06 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0.00 元，无质押证券。

## 6.4.13 金融工具风险及管理

## 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中由金融工具产生的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。

本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由风险控制委员会、投资决策委员会和监察稽核部、相关职能部门构成的三级风险管理架构体系。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券，不得超过该证券市值的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险，是指在履行以交付现金或其他金融资产的方式结算的义务时发生资金短缺的风险。对于本基金而言，体现在所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可通过银行间同业市场交易，期末除 6.4.12 中列示的部分券种流通暂时受限制不能自由转让外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的可回购交易的债券资产的公允价值。本基金所持有的金融负债以及可赎回基金份额净值（所有者权益）的合同约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理人员设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资及买入返售金融资产等。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合同约定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
<b>资产</b>							
银行存款	134,429,942.40	-	-	-	-	-	134,429,942.40
结算备付金	1,958,330.69	-	-	-	-	-	1,958,330.69
存出保证金	1,004,909.70	-	-	-	-	-	1,004,909.70
交易性金融资产	69,888,000.00	49,305,000.00	99,940,000.00	56,275,000.00	-	-1,997,020,720.68	2,272,428,720.68
买入返售金融资产	121,824,080.16	-	-	-	-	-	121,824,080.16
应收证券清算款	-	-	-	-	-	21,777,502.20	21,777,502.20
应收利息	-	-	-	-	-	1,721,679.82	1,721,679.82
应收申购款	-	-	-	-	-	81,030.58	81,030.58
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
<b>资产总计</b>	<b>329,105,262.95</b>	<b>49,305,000.00</b>	<b>99,940,000.00</b>	<b>56,275,000.00</b>	<b>-</b>	<b>-2,020,600,933.28</b>	<b>2,555,226,196.23</b>
<b>负债</b>							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,871,231.87	1,871,231.87
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,043,451.58	3,043,451.58
应付托管费	-	-	-	-	-	507,241.92	507,241.92
应付交易费用	-	-	-	-	-	2,535,332.55	2,535,332.55
应交税费	-	-	-	-	-	206,630.13	206,630.13
其他负债	-	-	-	-	-	1,059,915.14	1,059,915.14
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>9,223,803.19</b>	<b>9,223,803.19</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>329,105,262.95</b>	<b>49,305,000.00</b>	<b>99,940,000.00</b>	<b>56,275,000.00</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
<b>上年度末 2015年12月31日</b>	<b>1个月以内</b>	<b>1-3个月</b>	<b>3个月-1年</b>	<b>1-5年</b>	<b>5年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
<b>资产</b>							
银行存款	118,652,521.63	-	-	-	-	-	118,652,521.63
结算备付金	3,001,775.80	-	-	-	-	-	3,001,775.80
存出保证金	1,779,378.51	-	-	-	-	-	1,779,378.51
交易性金融资产	200,825,000.00	48,965,000.00	59,898,000.00	56,340,000.00	-	-1,917,967,788.17	2,283,995,788.17
买入返售金融资产	300,001,000.00	-	-	-	-	-	300,001,000.00

应收证券清算款	-	-	-	-	32,195,884.42	32,195,884.42
应收利息	-	-	-	-	5,331,443.30	5,331,443.30
应收申购款	-	-	-	-	21,166.16	21,166.16
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	624,259,675.94	48,965,000.00	59,898,000.00	56,340,000.00	-1,955,516,282.05	2,744,978,957.99
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	7,260,038.19	7,260,038.19
应付管理人报酬	-	-	-	-	3,507,914.03	3,507,914.03
应付托管费	-	-	-	-	584,652.36	584,652.36
应付交易费用	-	-	-	-	1,988,673.59	1,988,673.59
应交税费	-	-	-	-	206,630.13	206,630.13
其他负债	-	-	-	-	979,933.68	979,933.68
负债总计	-	-	-	-	14,527,841.98	14,527,841.98
利率敏感度缺口	624,259,675.94	48,965,000.00	59,898,000.00	56,340,000.00	-	-

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2016年6月30日）	上年度末（2015年12月31日）
	利率上升 25 个基点	-1,485,740.10	-2,004,781.11
	利率下降 25 个基点	1,502,436.71	2,030,128.55

注：上表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金资产净值产生的影响。正数表示可能增加基金资产净值，负数表示可能减少基金资产净值。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。

本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大其他价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。



本基金投资组合的资产配置为：股票资产 10%-85%，权证投资 0%-3%，债券 10%-85%，本基金保持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。于本期末，本基金面临的整体其他价格风险列示如下：

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	1,997,020,720.68	78.44	1,917,967,788.17	70.24
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	275,408,000.00	10.82	366,028,000.00	13.41
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	2,272,428,720.68	89.25	2,283,995,788.17	83.65

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2016 年 6 月 30 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%		65,901,683.78
沪深 300 指数下降 5%		-65,901,683.78	-66,169,888.69

注：本基金管理人运用定量分析方法对本基金的其他价格风险进行分析。上表为其他价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。正数表示可能增加基金资产净值，负数表示可能减少基金资产净值。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 1. 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

##### 2. 其他事项

##### (1) 公允价值

管理层已经评估了银行存款、结算备付金、买入返售金融资产、其他应收款项类投资以及其他金融负债因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

#### 各层次金融工具公允价值

于 2016 年 06 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中划分为第一层次的余额为人民币 1,764,622,071.76 元，划分为第二层次的余额为人民币 507,806,648.92 元，无划分为第三层次余额。

#### 公允价值所属层次间重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间及交易不活跃期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

#### 第三层次公允价值期初金额和本期变动金额

本基金于本报告期初未持有公允价值归属于第三层次的金融工具，本基金本报告期末发生第三层次公允价值转入转出情况。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,997,020,720.68	78.15
	其中：股票	1,997,020,720.68	78.15
2	固定收益投资	275,408,000.00	10.78
	其中：债券	275,408,000.00	10.78
	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	121,824,080.16	4.77
	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	136,388,273.09	5.34
7	其他各项资产	24,585,122.30	0.96
8	合计	2,555,226,196.23	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	43,693,995.06	1.72
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,416,085,315.67	55.62
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	29,820,000.00	1.17
E	建筑业	92,136,879.72	3.62
F	批发和零售业	284,427,227.90	11.17
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	51,206,401.20	2.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	37,321,509.42	1.47
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	20,126.10	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	17,369,287.83	0.68
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	24,939,977.78	0.98
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,997,020,720.68	78.44

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	000963	华东医药	2,000,000	134,800,000.00	5.29
2	000513	丽珠集团	2,799,895	129,103,158.45	5.07
3	002638	勤上光电	5,799,735	124,520,310.45	4.89
4	600079	人福医药	6,500,000	109,005,000.00	4.28
5	300147	香雪制药	5,599,804	82,485,112.92	3.24

6	601777	力帆股份	5,899,899	69,441,811.23	2.73
7	000090	天健集团	7,839,786	68,990,116.80	2.71
8	002574	明牌珠宝	5,000,000	65,200,000.00	2.56
9	300199	翰宇药业	3,075,540	62,587,239.00	2.46
10	600271	航天信息	2,499,917	59,498,024.60	2.34
11	002658	雪迪龙	3,315,520	57,656,892.80	2.26
12	600511	国药股份	2,000,000	54,880,000.00	2.16
13	300202	聚龙股份	2,099,851	50,837,392.71	2.00
14	600085	同仁堂	1,699,953	50,641,599.87	1.99
15	600847	万里股份	1,649,862	49,462,862.76	1.94
16	600829	人民同泰	3,300,000	49,104,000.00	1.93
17	000639	西王食品	3,388,032	47,839,011.84	1.88
18	000587	金洲慈航	3,059,946	47,214,966.78	1.85
19	600976	健民集团	1,699,934	45,643,227.90	1.79
20	603008	喜临门	2,500,991	42,992,035.29	1.69
21	002390	信邦制药	4,546,826	42,012,672.24	1.65
22	000541	佛山照明	4,000,000	41,160,000.00	1.62
23	002714	牧原股份	799,802	40,413,995.06	1.59
24	002294	信立泰	1,400,000	38,080,000.00	1.50
25	600597	光明乳业	3,000,000	38,040,000.00	1.49
26	000797	中国武夷	2,498,093	37,321,509.42	1.47
27	600686	金龙汽车	2,499,954	36,824,322.42	1.45
28	300334	津膜科技	2,000,898	36,116,208.90	1.42
29	000523	广州浪奇	3,000,000	32,610,000.00	1.28
30	600969	郴电国际	2,000,000	29,820,000.00	1.17
31	002238	天威视讯	1,999,840	28,937,684.80	1.14
32	600763	通策医疗	799,871	24,939,977.78	0.98
33	002317	众生药业	2,000,000	23,980,000.00	0.94
34	600986	科达股份	1,399,968	22,371,488.64	0.88
35	300059	东方财富	999,920	22,198,224.00	0.87
36	002701	奥瑞金	2,400,000	21,192,000.00	0.83
37	300190	维尔利	999,959	17,369,287.83	0.68
38	300204	舒泰神	799,852	14,749,270.88	0.58
39	600118	中国卫星	300,000	10,080,000.00	0.40
40	600372	中航电子	500,000	9,735,000.00	0.38
41	600150	中国船舶	400,000	8,904,000.00	0.35
42	600685	中船防务	200,000	5,072,000.00	0.20
43	300292	吴通控股	150,000	4,989,000.00	0.20
44	300313	天山生物	200,000	3,280,000.00	0.13

45	600844	丹化科技	500,000	3,230,000.00	0.13
46	601611	中国核建	37,059	775,274.28	0.03
47	601127	小康股份	8,662	206,761.94	0.01
48	601966	玲珑轮胎	15,341	199,126.18	0.01
49	603737	三棵树	1,327	154,038.16	0.01
50	603131	上海沪工	1,263	76,664.10	0.00
51	300515	三德科技	1,355	63,508.85	0.00
52	300518	盛讯达	1,306	61,186.10	0.00
53	002799	环球印务	1,080	47,131.20	0.00
54	603958	哈森股份	2,372	34,394.00	0.00
55	002802	洪汇新材	1,629	24,565.32	0.00
56	603909	合诚股份	1,095	20,126.10	0.00
57	603016	新宏泰	1,602	13,600.98	0.00
58	300520	科大国创	926	9,306.30	0.00
59	002805	丰元股份	971	5,631.80	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002638	勤上光电	123,439,307.14	4.52
2	300307	慈星股份	96,528,618.99	3.54
3	002714	牧原股份	94,053,761.08	3.44
4	300147	香雪制药	93,574,850.40	3.43
5	000090	天健集团	78,557,509.33	2.88
6	002727	一心堂	73,615,926.76	2.70
7	601777	XD 力帆股	70,149,529.08	2.57
8	002574	明牌珠宝	66,321,502.00	2.43
9	002658	雪迪龙	61,840,553.18	2.26
10	600271	航天信息	60,307,390.27	2.21
11	300199	翰宇药业	58,761,613.56	2.15
12	002310	东方园林	58,706,741.49	2.15
13	000587	金洲慈航	52,982,241.82	1.94
14	600847	万里股份	50,648,186.67	1.85
15	000639	西王食品	49,081,413.48	1.80

16	300202	聚龙股份	48,915,205.54	1.79
17	600829	人民同泰	47,800,516.12	1.75
18	600085	同仁堂	47,127,556.07	1.73
19	002390	信邦制药	46,928,509.06	1.72
20	600976	健民集团	46,793,398.49	1.71

注：买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600276	恒瑞医药	127,342,117.43	4.66
2	000661	长春高新	112,430,757.61	4.12
3	002727	一心堂	87,012,327.75	3.19
4	601313	江南嘉捷	73,298,315.57	2.68
5	300307	慈星股份	72,415,198.78	2.65
6	002310	东方园林	68,168,877.36	2.50
7	002714	牧原股份	59,739,074.71	2.19
8	300026	红日药业	55,237,530.50	2.02
9	601886	江河集团	54,791,629.61	2.01
10	300113	顺网科技	53,687,701.87	1.97
11	300017	网宿科技	51,496,928.30	1.89
12	600525	长园集团	49,967,364.80	1.83
13	000728	国元证券	49,784,351.02	1.82
14	002444	巨星科技	47,274,560.10	1.73
15	002294	信立泰	45,675,678.98	1.67
16	300269	联建光电	39,068,977.13	1.43
17	000902	新洋丰	38,413,674.29	1.41
18	000793	华闻传媒	36,748,166.75	1.35
19	600570	恒生电子	34,396,531.41	1.26
20	600557	康缘药业	33,849,917.72	1.24

注：卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,307,283,380.11
卖出股票收入（成交）总额	1,900,120,900.77

注：买入股票成本和卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	99,940,000.00	3.93
2	央行票据	-	-
3	金融债券	119,193,000.00	4.68
	其中：政策性金融债	119,193,000.00	4.68
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	56,275,000.00	2.21
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	275,408,000.00	10.82

### 7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	160011	16 付息国债 11	1,000,000	99,940,000.00	3.93
2	130234	13 国开 34	700,000	69,888,000.00	2.75
3	1382138	13 甘公投 MTN1	500,000	56,275,000.00	2.21
4	110237	11 国开 37	500,000	49,305,000.00	1.94
5	-	-	-	-	-

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

### 7.8 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贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 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。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 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。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金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。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金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。

### 7.11.2 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。

### 7.11.3 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。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

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。

### 7.12.2

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。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,004,909.70
2	应收证券清算款	21,777,502.20
3	应收股利	-



4	应收利息	1,721,679.82
5	应收申购款	81,030.58
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	24,585,122.30

#### 7.12.4 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。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002574	明牌珠宝	65,200,000.00	2.56	重大事项停牌

#### 7.12.6 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。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
172,978	15,709.94	218,576,357.53	8.04%	2,498,897,864.33	91.96%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	3,673.92	0.0001%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

注：同时为基金管理人高级管理人员和基金经理的，分别计算在内。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2006年8月22日）基金份额总额	1,416,548,067.74
本报告期期初基金份额总额	2,557,626,342.96
本报告期基金总申购份额	228,184,447.63
减：本报告期基金总赎回份额	68,336,568.73
本报告期末基金份额总额	2,717,474,221.86

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 1、基金管理人重大人事变动

①自2016年2月1日起，卢盛春先生担任长城基金管理有限公司副总经理。

②由于工作调动，自2016年7月1日起，杨光裕先生不再担任长城基金管理有限公司董事长。

③自2016年7月1日起，何伟先生担任长城基金管理有限公司董事长。

#### 2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

在本报告期内，为本基金提供审计服务的会计师事务所未发生变化。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金本报告期基金管理人、基金托管人涉及托管业务机构及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
西南证券	1	1,432,241,741.81	34.09%	1,333,847.65	34.09%	-
中信建投	1	958,542,635.83	22.82%	892,690.15	22.82%	-
大同证券	1	507,654,152.80	12.08%	472,778.55	12.08%	-
招商证券	2	480,301,927.61	11.43%	447,306.05	11.43%	-
银河证券	2	210,559,615.64	5.01%	196,094.43	5.01%	-
中信证券	2	202,897,060.60	4.83%	188,958.44	4.83%	-
光大证券	1	188,980,336.95	4.50%	175,995.20	4.50%	-
国泰君安	2	171,714,405.26	4.09%	159,917.72	4.09%	-
长城证券	3	34,200,131.76	0.81%	31,850.62	0.81%	-
华西证券	1	14,127,838.10	0.34%	13,156.99	0.34%	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-

中金公司	1	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-
申银万国证券	1	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-

注：1、报告期内租用证券公司席位的变更情况：

本报告期内租用的证券公司交易单元无变化，截止本报告期末共计 32 个交易单元。

2、专用席位的选择标准和程序

本基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，使用其席位作为基金的专用交易席位，选择的标准是：

- (1) 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，能满足基金运作的合法、合规需求；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需，并能为本基金提供全面的信息服；
- (6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告及其他专门报告。

根据上述标准考察确定后，基金管理人和被选中的证券经营机构签订委托协议，并通知托管人。基金管理人应根据有关规定，在基金的中期报告和年度报告中将所选证券经营机构的有关情况、基金通过该证券经营机构买卖证券的成交量、支付的佣金等予以披露。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额	成交金额	占当期权证成交总额的比例

				的比例		
西南证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	10,002,000.00	100.00%	-	-	-	-
大同证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
申银万国证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长城基金管理有限公司关于上海证券交易所、深圳证券交易所、中国金融期货交易所实施熔断对旗下基金相关业务影响的公告	本基金管理人网站	2016年1月4日
2	长城基金管理有限公司关于调整	中国证券报、上海证	2016年1月5日

	旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	
3	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 1 月 6 日
4	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 1 月 8 日
5	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 1 月 12 日
6	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 1 月 13 日
7	长城基金管理有限公司关于旗下基金所持债券估值调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 1 月 13 日
8	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 1 月 14 日
9	长城基金管理有限公司关于变更长城安心回报混合型证券投资基金	中国证券报、上海证券报、证券时报及本	2016 年 1 月 19 日

	金基金经理的公告	基金管理人网站	
10	长城基金管理有限公司关于旗下基金所持债券估值调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 1 月 20 日
11	长城基金管理有限公司关于参加平安证券费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 1 月 20 日
12	长城基金管理有限公司于调整旗下基金天天基金销售平台申购金额下限及最低持有金额下限的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 1 月 20 日
13	长城基金管理有限公司关于旗下基金所持固定收益品种估值调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 1 月 21 日
14	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 1 月 27 日
15	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 1 月 28 日
16	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 1 月 29 日

17	长城基金管理有限公司关于聘任公司副总经理的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 2 月 2 日
18	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 2 月 4 日
19	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 2 月 26 日
20	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 3 月 1 日
21	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 3 月 3 日
22	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 3 月 19 日
23	关于增加陆金所资管为长城旗下开放式基金代销机构并同时实行费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 3 月 21 日
24	长城基金关于增加上海中正达广	中国证券报、上海证	2016 年 3 月 25 日



	投资管理有限公司为旗下开放式基金代销机构并开通定投等业务的公告	券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	
25	长城基金关于增加上海利得基金销售有限公司为旗下开放式基金代销机构并实行费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 3 月 30 日
26	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 4 月 6 日
27	长城基金关于大同证券有限责任公司开通旗下开放式基金定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 4 月 12 日
28	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 4 月 21 日
29	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 5 月 6 日
30	长城基金关于增加富济财富为旗下开放式基金代销机构并开通转换定投等业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 5 月 9 日
31	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法	中国证券报、上海证券报、证券时报、证	2016 年 5 月 10 日

	的公告	券日报及本基金管理人网站	
32	长城基金管理有限公司关于淘宝基金理财平台和支付宝基金支付业务下线的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 5 月 10 日
33	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 5 月 11 日
34	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 6 月 1 日
35	长城基金管理有限公司关于旗下基金参加平安银行股份有限公司费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 6 月 3 日
36	长城基金管理有限公司关于旗下基金参加中国银河证券股份有限公司费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 6 月 6 日
37	长城基金管理有限公司关于旗下基金参加国盛证券有限责任公司费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 6 月 16 日
38	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 6 月 18 日

		理人网站	
39	长城基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与交通银行开展的网上银行、手机银行申购手续费费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 6 月 30 日

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- (一) 本基金设立批准的相关文件
- (二) 《长城安心回报混合型证券投资基金基金合同》
- (三) 《长城安心回报混合型证券投资基金托管协议》
- (四) 《长城安心回报混合型证券投资基金招募说明书》
- (五) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (六) 基金托管人业务资格批件、营业执照
- (七) 中国证监会规定的其他文件

### 11.2 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

### 11.3 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>