

久嘉证券投资基

[2013] 第一季度报告

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:2013年4月22日

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，并对其中的真实性、准确性、完整性和及时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2013年04月17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。

本报告期中财务资料未经审计。

本报告期自2013年01月01日起至03月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 长城久嘉基金

基金主代码 184722

交易代码 184722

基金运作方式 约定期闭式

基金合同生效日 2002年7月5日

报告期末基金份额总额 2,000,000,000.00份

投资目标 为投资者减少和分散投资风险,确保基金资产的安全并谋求长期稳定的收益。

根据中国证券市场的特点,本基金将密切关注对市场整体趋势的把握,重视对投资的市场时机选择。本基金将注重把握不同类型投资市场的整体风险与收益,在不同阶段合理配置基金资产在股票、债券、现金的分配比例。

本基金将密切关注国家宏观经济政策、行业发展方向及动态,在价值深入研究的基础上,根据不同上市公司股票的流动性、市场权重及收益预期构建动态投资组合。

我们将根据对市场发展的不同阶段的判断与把握,上市公司本身的发展态势及二级市场股价走势适时调整个股及股票组合在整体基金资产的份额以获取收益及控制风险。

业绩比较基准 选取上证A股指数为业绩比较基准

风险收益特征 中性的风险偏好,力争实现年度内基金单位资产净值在市场下限不高于比较基准跌幅的60%,在市场上涨时增幅不低于比较基准的70%。

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

报告期(2013年1月1日-2013年3月31日)

1.本期已实现收益 -2,373,741.75

2.本期利润 -4,707,516.96

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0024

4.期末基金资产净值 1,719,010,755.72

5.期末基金份额净值 0.8595

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 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(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -0.28% 2.18% -1.48% 2.88% 1.20% -0.70%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:本基金合同约定:本基金投资于股票、债券的比例不低于本基金资产总值的80%,本基金投资于国家债券的比例不低于本基金资产净值的20%。

§ 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

蒋劲刚 基金久嘉、长城景气行业、龙头灵活配置混合型证券投资基金的基金经理 2012年3月7日 - 15年 男,中国籍,天津大学材料工程学士,天津大学管理学院工学硕士,曾就职于深圳市华华技术有限公司,海南嘉富资产管理有限公司,海

南嘉富资产管理有限公司,历任项目管理经理、项目管理部项目经理、项目研究员、机构投资部投资经理、长城消费增值股票基金的基金经理。

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证券从业人员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 管理人对报告期内基金运作合规性的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《私募投资基金合同》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,未出现投资反洗钱法规、基金合同约定的相关规定的情况,无因公司勤勉尽责或操作不当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 公平交易执行情况

本基金管理人公平对待旗下管理的所有基金和组合,制定并严格遵守相应的制度和流程,通过信息披露制度、公平交易制度的执行,报告期内,本公司严格执行了证券投资基金组合在投资决策、交易执行、风险管理等环节对投资者的公平对待。

4.3.2 公平交易执行的执行情况

本基金管理人公平对待旗下管理的所有基金和组合,制定并严格遵守相应的制度和流程,通过信息披露制度、公平交易制度的执行,报告期内,本公司严格执行了证券投资基金组合在投资决策、交易执行、风险管理等环节对投资者的公平对待。

4.3.3 公平交易执行的执行情况

本基金管理人公平对待旗下管理的所有基金和组合,制定并严格遵守相应的制度和流程,通过信息披露制度、公平交易制度的执行,报告期内,本公司严格执行了证券投资基金组合在投资决策、交易执行、风险管理等环节对投资者的公平对待。

4.3.4 公平交易执行的执行情况

本基金管理人公平对待旗下管理的所有基金和组合,制定并严格遵守相应的制度和流程,通过信息披露制度、公平交易制度的执行,报告期内,本公司严格执行了证券投资基金组合在投资决策、交易执行、风险管理等环节对投资者的公平对待。

4.3.5 公平交易执行的执行情况

本基金管理人公平对待旗下管理的所有基金和组合,制定并严格遵守相应的制度和流程,通过信息披露制度、公平交易制度的执行,报告期内,本公司严格执行了证券投资基金组合在投资决策、交易执行、风险管理等环节对投资者的公平对待。

4.3.6 公平交易执行的执行情况

本基金管理人公平对待旗下管理的所有基金和组合,制定并严格遵守相应的制度和流程,通过信息披露制度、公平交易制度的执行,报告期内,本公司严格执行了证券投资基金组合在投资决策、交易执行、风险管理等环节对投资者的公平对待。

4.3.7 公平交易执行的执行情况

本基金管理人公平对待旗下管理的所有基金和组合,制定并严格遵守相应的制度和流程,通过信息披露制度、公平交易制度的执行,报告期内,本公司严格执行了证券投资基金组合在投资决策、交易执行、风险管理等环节对投资者的公平对待。

4.3.8 公平交易执行的执行情况

本基金管理人公平对待旗下管理的所有基金和组合,制定并严格遵守相应的制度和流程,通过信息披露制度、公平交易制度的执行,报告期内,本公司严格执行了证券投资基金组合在投资决策、交易执行、风险管理等环节对投资者的公平对待。

4.3.9 公平交易执行的执行情况

本基金管理人公平对待旗下管理的所有基金和组合,制定并严格遵守相应的制度和流程,通过信息披露制度、公平交易制度的执行,报告期内,本公司严格执行了证券投资基金组合在投资决策、交易执行、风险管理等环节对投资者的公平对待。

4.3.10 公平交易执行的执行情况

本基金管理人公平对待旗下管理的所有基金和组合,制定并严格遵守相应的制度和流程,通过信息披露制度、公平交易制度的执行,报告期内,本公司严格执行了证券投资基金组合在投资决策、交易执行、风险管理等环节对投资者的公平对待。

4.3.11 公平交易执行的执行情况

本基金管理人公平对待旗下管理的所有基金和组合,制定并严格遵守相应的制度和流程,通过信息披露制度、公平交易制度的执行,报告期内,本公司严格执行了证券投资基金组合在投资决策、交易执行、风险管理等环节对投资者的公平对待。

4.3.12 公平交易执行的执行情况

本基金管理人公平对待旗下管理的所有基金和组合,制定并严格遵守相应的制度和流程,通过信息披露制度、公平交易制度的执行,报告期内,本公司严格执行了证券投资基金组合在投资决策、交易执行、风险管理等环节对投资者的公平对待。

4.3.13 公平交易执行的执行情况

本基金管理人公平对待旗下管理的所有基金和组合,制定并严格遵守相应的制度和流程,通过信息披露制度、公平交易制度的执行,报告期内,本公司严格执行了证券投资基金组合在投资决策、交易执行、风险管理等环节对投资者的公平对待。

4.3.14 公平交易执行的执行情况

本基金管理人公平对待旗下管理的所有基金和组合,制定并严格遵守相应的制度和流程,通过信息披露制度、公平交易制度的执行,报告期内,本公司严格执行了证券投资基金组合在投资决策、交易执行、风险管理等环节对投资者的公平对待。

4.3.15 公平交易执行的执行情况

本基金管理人公平对待旗下管理的所有基金和组合,制定并严格遵守相应的制度和流程,通过信息披露制度、公平交易制度的执行,报告期内,本公司严格执行了证券投资基金组合在投资决策、交易执行、风险管理等环节对投资者的公平对待。

4.3.16 公平交易执行的执行情况

本基金管理人公平对待旗下管理的所有基金和组合,制定并严格遵守相应的制度和流程,通过信息披露制度、公平交易制度的执行,报告期内,本公司严格执行了证券投资基金组合在投资决策、交易执行、风险管理等环节对投资者的公平对待。

4.3.17 公平交易执行的执行情况

本基金管理人公平对待旗下管理的所有基金和组合,制定并严格遵守相应的制度和流程,通过信息披露制度、公平交易制度的执行,报告期内,本公司严格执行了证券投资基金组合在投资决策、交易执行、风险管理等环节对投资者的公平对待。

4.3.18 公平交易执行的执行情况

本基金管理人公平对待旗下管理的所有基金和组合,制定并严格遵守相应的制度和流程,通过信息披露制度、公平交易制度的执行,报告期内,本公司严格执行了证券投资基金组合在投资决策、交易执行、风险管理等环节对投资者的公平对待。

4.3.19 公平交易执行的执行情况

本基金管理人公平对待旗下管理的所有基金和组合,制定并严格遵守相应的制度和流程,通过信息披露制度、公平交易制度的执行,报告期内,本公司严格执行了证券投资基金组合在投资决策、交易执行、风险管理等环节对投资者的公平对待。

4.3.20 公平交易执行的执行情况

本基金管理人公平对待旗下管理的所有基金和组合,制定并严格遵守相应的制度和流程,通过信息披露制度、公平交易制度的执行,报告期内,本公司严格执行了证券投资基金组合在投资决策、交易执行、风险管理等环节对投资者的公平对待。

4.3.21 公平交易执行的执行情况

本基金管理人公平对待旗下管理的所有基金和组合,制定并严格遵守相应的制度和流程,通过信息披露制度、公平交易制度的执行,报告期内,本公司严格执行了证券投资基金组合在投资决策、交易执行、风险管理等环节对投资者的公平对待。

4.3.22 公平交易执行的执行情况

本基金管理人公平对待旗下管理的所有基金和组合,制定并严格遵守相应的制度和流程,通过信息披露制度、公平交易制度的执行,报告期内,本公司严格执行了证券投资基金组合在投资决策、交易执行、风险管理等环节对投资者的公平对待。

4.3.23 公平交易执行的执行情况

本基金管理人公平对待旗下管理的所有基金和组合,制定并严格遵守相应的制度和流程,通过信息披露制度、公平交易制度的执行,报告期内,本公司严格执行了证券投资基金组合在投资决策、交易执行、风险管理等环节对投资者的公平对待。

4.3.24 公平交易执行的执行情况

本基金管理人公平对待旗下管理的所有基金和组合,制定并严格遵守相应的制度和流程,通过信息披露制度、公平交易制度的执行,报告期内,本公司严格执行了证券投资基金组合在投资决策、交易执行、风险管理等环节对投资者的公平对待。

4.3.25 公平交易执行的执行情况

本基金管理人公平对待旗下管理的所有基金和组合,制定并严格遵守相应的制度和流程,通过信息披露制度、公平交易制度的执行,报告期内,本公司严格执行了证券投资基金组合在投资决策、交易执行、风险管理等环节对投资者的公平对待。

4.3.26 公平交易执行的执行情况

本基金管理人公平对待旗下管理的所有基金和组合,制定并严格遵守相应的制度和流程,通过信息披露制度、公平交易制度的执行,报告期内,本公司严格执行了证券投资基金组合在投资决策、交易执行、风险管理等环节对投资者的公平对待。

4.3.27 公平交易执行的执行情况

本基金管理人公平对待旗下管理的所有基金和组合,制定并严格遵守相应的制度和流程,通过信息披露制度、公平交易制度的执行,报告期内,本公司严格执行了证券投资基金组合在投资决策、交易执行、风险管理等环节对投资者的公平对待。

4.3.28 公平交易执行的执行情况

本基金管理人公平对待旗下管理的所有基金和组合,制定并严格遵守相应的制度和流程,通过信息披露制度、公平交易制度的执行,报告期内,本公司严格执行了证券投资基金组合在投资决策、交易执行、风险管理等环节对投资者的公平对待。

4.3.29 公平交易执行的执行情况

本基金管理人公平对待旗下管理的所有基金和组合,制定并严格遵守相应的制度和流程,通过信息披露制度、公平交易制度的执行,报告期内,本公司严格执行了证券投资基金组合在投资决策、交易执行、风险管理等环节对投资者的公平对待。

4.3.30 公平交易执行的执行情况

本基金管理人公平对待旗下管理的所有基金和组合,制定并严格遵守相应的制度和流程,通过信息披露制度、公平交易制度的执行,报告期内,本公司严格执行了证券投资基金组合在投资决策、交易执行、风险管理等环节对投资者的公平对待。

4.3.31 公平交易执行的执行情况

本基金管理人公平对待旗下管理的所有基金和组合,制定并严格遵守相应的制度和流程,通过信息披露制度、公平交易制度的执行,报告期内,本公司严格执行了证券投资基金组合在投资决策、交易执行、风险管理等环节对投资者的公平对待。

4.3.32 公平交易执行的执行情况

本基金管理人公平对待旗下管理的所有基金和组合,制定并严格遵守相应的制度和流程,通过信息披露制度、公平交易制度的执行,报告期内,本公司严格执行了证券投资基金组合在投资决策、交易执行、风险管理等环节对投资者的公平对待。

4.3.33 公平交易执行的执行情况

本基金管理人公平对待旗下管理的所有基金和组合,制定并严格遵守相应的制度和流程,通过信息披露制度、公平交易制度的执行,报告期内,本公司严格执行了证券投资基金组合在投资决策、交易执行、风险管理等环节对投资者的公平对待。

4.3.34 公平交易执行的执行情况

本基金管理人公平对待旗下管理的所有基金和组合,制定并严格遵守相应的制度和流程,通过信息披露制度、公平交易制度的执行,报告期内,本公司严格执行了证券投资基金组合在投资决策、交易执行、风险管理等环节对投资者的公平对待。

4.3.35 公平交易执行的执行情况

本基金管理人公平对待旗下管理的所有基金和组合,制定并严格遵守相应的制度和流程,通过信息披露制度、公平交易制度的执行,报告期内,本公司严格执行了证券投资基金组合在投资决策、交易执行、风险管理等环节对投资者的公平对待。

4.3.36 公平交易执行的执行情况

本基金管理人公平对待旗下管理的所有基金和组合,制定并严格遵守相应的制度和流程,通过信息披露制度、公平交易制度的执行,报告期内,本公司严格执行了证券投资基金组合在投资决策、交易执行、风险管理等环节对投资者的公平对待。

4.3.37 公平交易执行的执行情况

本基金管理人公平对待旗下管理的所有基金和组合,制定并严格遵守相应的制度和流程,通过信息披露制度、公平交易制度的执行,报告期内,本公司严格执行了证券投资基金组合在投资决策、交易执行、风险管理等环节对投资者的公平对待。

4.3.38 公平交易执行的执行情况

本基金管理人公平对待旗下管理的所有基金和组合,制定并严格遵守相应的制度和流程,通过信息披露制度、公平交易制度的执行,报告期内,本公司严格执行了证券投资基金组合在投资决策、交易执行、风险管理等环节对投资者的公平对待。

4.3.39 公平交易执行的执行情况

本基金管理人公平对待旗下管理的所有基金和组合,制定并严格遵守相应的制度和流程,通过信息披露制度、公平交易制度的执行,报告期内,本公司严格执行了证券投资基金组合在投资决策、交易执行、风险管理等环节对投资者的公平对待。

4.3.40 公平交易执行的执行情况

本基金管理人公平对待旗下管理的所有基金和组合,制定并严格遵守相应的制度和流程,通过信息披露制度、公平交易制度的执行,报告期内,本公司严格执行了证券投资基金组合在投资决策、交易执行、风险管理等环节对投资者的公平对待。

4.3.41 公平交易执行的执行情况