

## 长城久恒平衡型证券投资基金

## [2013] 第四季度报告

基金管理人:长城基金管理有限公司

基金托管人:中国建设银行股份有限公司

报告送出日期:2014年1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约定，于2014年1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。

本基金报告期财务数据未经审计。

本报告期自2013年10月01日起至12月31日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称 长城久恒平衡混合

基金主代码 200001

前端交易代码 200001

后端交易代码 201001

基金运作方式 约定型开放式

基金合同生效日 2003年10月31日

报告期末基金份额总额 148,723,697.63份

投资目标 本着安全性、流动性原则，控制投资风险，谋求基金资产长期稳健增长。

投资策略 本基金以资产配置为基本控制机制，获得超预期收益的核心手段，通过资产的动态配置、股票资产的风险调整以及选择一个层次进行投资管理。

业绩比较基准 70%×中证指数30%×中证国债指数。

风险收益特征 本基金的风险水平介于市场风险的50%-60%左右。

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

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2013年10月1日 - 2013年12月31日)

1.本期已实现收益 7,752,715.84

2.本期利润 6,240,748.75

3.加权平均基金份额本期利润 0.0436

4.期末基金资产净值 212,842,794.01

5.期末基金份额净值 1.0000

注:本基金已实现收益、本期利润和加权平均基金份额本期利润均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 2.95% 0.96% -1.70% 0.83% 4.65% 0.13%

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

注:(1)本基金合同约定:本基金投资于股票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25%。

## 5.4 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

王文祥 长城双动力、长城久恒的基金经理 2011年10月19日 - 6年 男,中国籍,清华大学工学硕士。2007年进入长城基金管理有限公司,曾任研究部研究员、行业研究员、长城久恒成长股票型证券投资基金基金经理助理。

吴文庆 长城久恒、长城双动力的基金经理 2011年12月26日 - 4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,曾任行业研究员、长城久恒成长股票型证券投资基金基金经理助理。

注:本基金从任职之日起,连续计算五年方遵从《证券投资基金从业人员职业道德规范》的相关规定。

2.2 个人简介 从任职之日起,连续计算五年方遵从《证券投资基金从业人员职业道德规范》的相关规定。

本基金报告期内,本基金基金经理严格执行了《证券投资基金管理法》、《长城久恒平衡型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,以诚信守信、勤勉尽责的原则管理好本基金,在控制风险和防范风险的前提下,为基金份额持有人谋取最大利益,未出现投资违法乱纪、基金合同约定的特别约定的情况,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情形。

4.3 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金基金经理严格执行了《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,不同投资组合的利益得到了公平对待。

本基金基金经理严格执行不同投资组合之间的同向反向交易,对向同交易的价差进行事后分析,定期出具公平交易稽核报告。本报告期报告期未发生,本期基金经理旗下投资组合的同向交易价差均在合理范围内,未发现不公平交易行为。

4.4 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。

4.5 其他资产构成

注:本基金报告期内未投资国债期货。

5.1 报告期本基金资产组合情况

序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

1 权益投资 135,790,016.92 63.53

其中:股票 135,790,016.92 63.53

2 固定收益投资 52,891,060.00 24.75

其中:债券 52,891,060.00 24.75

货币支持证券 - -

3 金融衍生品投资 - -

4 买入返售金融资产 - -

其中:买断式回购的买入返售金融资产 - -

5 银行存款和结算备付金合计 23,784,506.14 11.13

6 其他资产 1,278,104.57 0.60

7 合计 213,743,687.63 100.00

注:本基金合同规定本基金投资组合的资产配置为:本基金投资于股票的比例为基金净资产的90%~95%,现金或者到期日在一年内的政府债券不高于基金净资产的5%。

5.2 备查文件目录

注:本报告期本基金管理人员未运用固有资金投资本基金。

5.3 报告期内基金组合情况

序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

1 权益投资 15,015,218.08 1.02

其中:股票 15,015,218.08 1.02

2 固定收益投资 - -

其中:债券 - -

3 金融衍生品投资 - -

4 买入返售金融资产 - -

其中:买断式回购的买入返售金融资产 - -

5 银行存款和结算备付金合计 87,274,866.54 5.65

6 其他资产 31,505,395.35 2.04

7 合计 1,543,513,808.69 100.00

注:本报告期本基金管理人员未持有股票。

5.4 报告期内基金产品概况

序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

1 本期已实现收益 -67,872,250.71

2.本期利润 -57,194,492.71

3.加权平均基金份额利润 -0.0278

4.期末基金资产净值 1,539,105,678.79

5.期末基金份额净值 0.9833

注:本基金已实现收益指本基金本期收入、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)上述基金业指标不包含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 基金份额表现

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

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2013年10月1日 - 2013年12月31日)

1.本期已实现收益 -67,872,250.71

2.本期利润 -57,194,492.71

3.加权平均基金份额利润 -0.0278

4.期末基金资产净值 1,539,105,678.79

5.期末基金份额净值 0.9833

注:本基金已实现收益指本基金本期收入、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)上述基金业指标不包含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。

3.2.2 本报告期基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

3.2.3 本报告期基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

3.2.4 本报告期基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

3.2.5 本报告期基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

3.2.6 本报告期基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

3.2.7 本报告期基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

3.2.8 本报告期基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

3.2.9 本报告期基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

3.2.10 本报告期基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

3.2.11 本报告期基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

3.2.12 本报告期基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

3.2.13 本报告期基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

3.2.14 本报告期基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

3.2.15 本报告期基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

3.2.16 本报告期基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

3.2.17 本报告期基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

3.2.18 本报告期基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

3.2.19 本报告期基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

3.2.20 本报告期基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

3.2.21 本报告期基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

3.2.22 本报告期基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

3.2.23 本报告期基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

3.2.24 本报告期基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

3.2.25 本报告期基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

3.2.26 本报告期基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

3.2.27 本报告期基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

3.2.28 本报告期基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

3.2.29 本报告期基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

3.2.30 本报告期基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

3.2.31 本报告期基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

3.2.32 本报告期基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

3.2.33 本报告期基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

3.2.34 本报告期基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

3.2.35 本报告期基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

3.2.36 本报告期基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

3.2.37 本报告期基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

3.2.38 本报告期基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

3.2.39 本报告期基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

3.2.40 本报告期基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

3.2.41 本报告期基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

3.2.42 本报告期基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

3.2.43 本报告期基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

3.2.44 本报告期基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

3.2.45 本报告期基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

3.2.46 本报告期基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

3.2.47 本报告期基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

3.2.48 本报告期基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

3.2.49 本报告期基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

3.2.50 本报告期基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

3.2.51 本报告期基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

3.2.52 本报告期基金管理人运用固有资金投资本基金的情况