

信息披露 Disclosure

长城双动力股票型证券投资基金

【2013】第四季度报告

—3%、债券占基金资产0%—35%。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。本基金的建仓期为自本基金基金合同生效日起6个月,建仓期间,各项资产配置比例符合基金合同约定。

§4 基金经理人

姓名	职务	任本基金的基金经理期限	证券从业年限	说明
姓名	职务	任职日期	离任日期	
吴文庆	长城双动力、长城双动力基金的基金经理	2013年12月26日	-	4年
王文明	长城双动力基金基金经理	2011年10月19日	-	6年

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《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。
③基金经理人对报告期内本基金运作遵规守法情况的说明
报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、《长城双动力股票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,在控制风险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受损的情况,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《证券投资基金管理人公平交易制度指导意见》和《长城基金管理有限责任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。
本基金管理人严格执行了《证券投资基金法》、《长城双动力股票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,在控制风险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受损的情况,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

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
四季度市场整体依然是分化严重,具体表现为:在十八届三中全会《决定》的影响下,国防军工表现出色,受到市场追捧;大宗商品价格继续回落,钢铁行业及估值修复的上游;前期在机器人自动化、先进制造业和转型的推动下,市场大幅回升;四季度以来,医药、汽车没有估值切换行情表现疲软,维持不能不跌的局面。四季度以传媒为龙头的TMT板块,受制于估值过高、业绩不达预期和市场情绪转向的制约,下跌幅度较大。

从十八届三中全会和中央经济工作会议以来,大方向应该是维持社会稳定的前提下,去产能、搞转型、稳增长。十八届三中全会《决定》,诸如环境治理、二胎放、土地改革、国企改革、财政改革、金融改革、地方债务、城镇化建设、信息安全、食品药品安全等都会在接下来的五到十年看到一定的效果,投资于实体经济依然是重点。
本基金在四季度继续持有软件、电力设备、自动化设备、智能设备的公司,并保持较多仓位的高低估值和确定性成长的公司,并辅以长期空间明确的医药、医药等作为核心持仓。我们预计14Q1季度市场仍将保持谨慎格局,结构性的机会仍然存在,我们将把握市场企稳回升带来的几个季度温和增长行情,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。

4.5 报告期内基金的业绩表现
本报告期内,本基金跑赢比较基准,在可比同类基金中排名靠上。

§5 投资组合报告

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	143,745,458.81	71.69
	其中:股票	143,745,458.81	71.69
2	固定收益投资	1,866,000.00	0.93
	其中:债券	1,866,000.00	0.93
	资产支持证券	-	-
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	54,549,165.91	27.21
6	其他资产	350,249.27	0.17
7	合计	200,510,873.99	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	143,745,458.81	71.69
	其中:股票	143,745,458.81	71.69
2	固定收益投资	1,866,000.00	0.93
	其中:债券	1,866,000.00	0.93
	资产支持证券	-	-
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	54,549,165.91	27.21
6	其他资产	350,249.27	0.17
7	合计	200,510,873.99	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	143,745,458.81	71.69
	其中:股票	143,745,458.81	71.69
2	固定收益投资	1,866,000.00	0.93
	其中:债券	1,866,000.00	0.93
	资产支持证券	-	-
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	54,549,165.91	27.21
6	其他资产	350,249.27	0.17
7	合计	200,510,873.99	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	143,745,458.81	71.69
	其中:股票	143,745,458.81	71.69
2	固定收益投资	1,866,000.00	0.93
	其中:债券	1,866,000.00	0.93
	资产支持证券	-	-
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	54,549,165.91	27.21
6	其他资产	350,249.27	0.17
7	合计	200,510,873.99	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	143,745,458.81	71.69
	其中:股票	143,745,458.81	71.69
2	固定收益投资	1,866,000.00	0.93
	其中:债券	1,866,000.00	0.93
	资产支持证券	-	-
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	54,549,165.91	27.21
6	其他资产	350,249.27	0.17
7	合计	200,510,873.99	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	143,745,458.81	71.69
	其中:股票	143,745,458.81	71.69
2	固定收益投资	1,866,000.00	0.93
	其中:债券	1,866,000.00	0.93
	资产支持证券	-	-
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	54,549,165.91	27.21
6	其他资产	350,249.27	0.17
7	合计	200,510,873.99	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	143,745,458.81	71.69
	其中:股票	143,745,458.81	71.69
2	固定收益投资	1,866,000.00	0.93
	其中:债券	1,866,000.00	0.93
	资产支持证券	-	-
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	54,549,165.91	27.21
6	其他资产	350,249.27	0.17
7	合计	200,510,873.99	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	143,745,458.81	71.69
	其中:股票	143,745,458.81	71.69
2	固定收益投资	1,866,000.00	0.93
	其中:债券	1,866,000.00	0.93
	资产支持证券	-	-
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	54,549,165.91	27.21
6	其他资产	350,249.27	0.17
7	合计	200,510,873.99	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	143,745,458.81	71.69
	其中:股票	143,745,458.81	71.69
2	固定收益投资	1,866,000.00	0.93
	其中:债券	1,866,000.00	0.93
	资产支持证券	-	-
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	54,549,165.91	27.21
6	其他资产	350,249.27	0.17
7	合计	200,510,873.99	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	143,745,458.81	71.69
	其中:股票	143,745,458.81	71.69
2	固定收益投资	1,866,000.00	0.93
	其中:债券	1,866,000.00	0.93
	资产支持证券	-	-
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	54,549,165.91	27.21
6	其他资产	350,249.27	0.17
7	合计	200,510,873.99	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	143,745,458.81	71.69
	其中:股票	143,745,458.81	71.69
2	固定收益投资	1,866,000.00	0.93
	其中:债券	1,866,000.00	0.93
	资产支持证券	-	-
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	54,549,165.91	27.21
6	其他资产	350,249.27	0.17
7	合计	200,510,873.99	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	143,745,458.81	71.69
	其中:股票	143,745,458.81	71.69
2	固定收益投资	1,866,000.00	0.93
	其中:债券	1,866,000.00	0.93
	资产支持证券	-	-
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	54,549,165.91	27.21
6	其他资产	350,249.27	0.17
7	合计	200,510,873.99	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	143,745,458.81	71.69
	其中:股票	143,745,458.81	71.69
2	固定收益投资	1,866,000.00	0.93
	其中:债券	1,866,000.00	0.93
	资产支持证券	-	-
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	54,549,165.91	27.21
6	其他资产	350,249.27	0.17
7	合计	200,510,873.99	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	143,745,458.81	71.69
	其中:股票	143,745,458.81	71.69
2	固定收益投资	1,866,000.00	0.93
	其中:债券	1,866,000.00	0.93
	资产支持证券	-	-
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	54,549,165.91	27.21
6	其他资产	350,249.27	0.17
7	合计	200,510,873.99	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	143,745,458.81	71.69
	其中:股票	143,745,458.81	71.69
2	固定收益投资	1,866,000.00	0.93
	其中:债券	1,866,000.00	0.93
	资产支持证券	-	-
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	54,549,165.91	27.21
6	其他资产	350,249.27	0.17
7	合计	200,510,873.99	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	143,745,458.81	71.69
	其中:股票	143,745,458.81	71.69
2	固定收益投资	1,866,000.00	0.93
	其中:债券	1,866,000.00	0.93
	资产支持证券	-	-
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	54,549,165.91	27.21
6	其他资产	350,249.27	0.17
7	合计	200,510,873.99	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	143,745,458.81	71.69
	其中:股票	143,745,458.81	71.69
2	固定收益投资	1,866,000.00	0.93
	其中:债券	1,866,000.00	0.93
	资产支持证券	-	-
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	54,549,165.91	27.21
6	其他资产	350,249.27	0.17
7	合计	200,510,873.99	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	143,745,458.81	71.69
	其中:股票	143,745,458.81	71.69
2	固定收益投资	1,866,000.00	0.93
	其中:债券	1,866,000.00	0.93
	资产支持证券	-	-
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	54,549,165.91	27.21
6	其他资产	350,249.27	0.17
7	合计	200,510,873.99	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	143,745,458.81	71.69
	其中:股票	143,745,458.81	71.69
2	固定收益投资	1,866,000.00	0.93
	其中:债券	1,866,000.00	0.93
	资产支持证券	-	-
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	54,549,165.91	27.21
6	其他资产	350,249.27	0.17
7	合计	200,510,873.99	100.00

5.2 报告期末按行业