

长城稳健增利债券型证券投资基金

2009 第四季度报告

2009年12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:2010年01月20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2010年1月15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。
 本报告中财务资料未经审计。
 本报告自2009年10月01日起至12月31日止。

2 基金产品概况

基金简称	长城稳健增利债券
交易代码	200009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年08月27日
报告期末基金份额总额	80,358,252.30份

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 2009年10月01日-2009年12月31日
1.本期已实现收益	1,437,797.36
2.本期利润	161,494.61
3.加权平均基金份额本期利润	0.0015
4.期末基金资产净值	89,869,940.28
5.期末基金份额净值	1.118

注:①本基金合同规定本基金投资组合中:固定收益类资产所占比例为80%-100%,权益类资产所占比例为0-20%,且本基金现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。②本基金的投资组合为自本基金合同生效日起6个月内,自2008年8月27日至2009年2月28日止,建仓期。
 ③本基金的投资组合符合法律法规及基金合同的相关规定。

4.1 基金经理 钱基敏先生简介

姓名	职务	在本基金的基金经理任期	证券从业年限	说明
钱基敏	基金经理	2009年09月22日	17年	中国籍,东北大学数学系系统科学学士,中国科学院大学计算机系系统科学硕士,中南财经政法大学金融学院金融学硕士,具有17年证券从业经验。曾就职于中国证监会、北京市西城区政府经济事务局、北京远望谷股份有限公司,从事基金、证券、信托、资产管理、基金销售等工作。2005年5月加入长城基金管理有限公司,曾任长城基金基金经理,现担任长城稳健增利债券型证券投资基金基金经理。

4.2 管理人对于报告期内本基金运作遵守信情况的说明
 本报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、《长城稳健增利债券型证券投资基金合同》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和运用基金资产,在控制投资风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大的利益,未出现违反法律法规、基金合同和相关规定的情形,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。本报告期内运作过程中未出现投资组合比例超标或基金合同约定的情况,本基金管理人已在规定的合理期限内进行了调整,有效地保护了基金份额持有人的利益。

4.3 公平交易专项说明
 4.3.1 公平交易制度的执行情况
 4.3.2 本基金投资与其他投资组合的公平交易专项说明
 4.3.3 异常交易行为的专项说明

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析
 4.4.2 报告期内基金业绩表现说明
 4.4.3 报告期内基金净值表现说明
 4.4.4 报告期内基金持有人损益情况

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	6,238,064,577.33	84.98
2	其中:股票	6,238,064,577.33	84.98
3	固定收益投资	3,381,904.54	0.05
4	其中:债券	3,381,904.54	0.05
5	资产支持证券	-	-

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、业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	21,050.00	0.02
CD	食品、饮料	10,050.00	0.01
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	11,000.00	0.01
C7	机械、设备、仪表	-	-
C8	医药、生物制品	-	-
C9	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售业	-	-
I	房地产业	-	-
J	社会服务业	-	-
K	传播与文化业	-	-
L	综合类	-	-
M	合计	21,050.00	0.02

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	002333	罗普斯金	500	11,000.00	0.01
2	002229	鹏辉乳业	500	10,050.00	0.01

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
4	其中:政策性金融债	-	-
5	企业短期融资券	3,381,904.54	0.05
6	可转换债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	3,381,904.54	0.05

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	债券品种	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	126011	08央行票	32,570	2,771,707.00	0.04
2	112005	08国债01	3,337	346,180.38	0.00
3	112006	08国债02	2,508	264,017.16	0.00

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

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债逆回购	4,455,360.00	4.98
2	央行票据	30,840,000.00	34.32
3	金融债券	30,103,000.00	33.50
4	其中:政策性金融债	30,103,000.00	33.50
5	企业短期融资券	6,580,227.00	7.32
6	可转换债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	71,978,587.00	80.09

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权证投资明细

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)		
1	080103	08央行票据	300,000	30,840,000.00	34.32
2	090220	09国债02	200,000	20,114,000.00	22.38
3	090205	09国债05	100,000	9,989,000.00	11.11
4	122926	09国债06	50,000	5,000,000.00	5.56
5	010004	20国债04	44,200	4,455,360.00	4.96

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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公开谴责、处罚。
 5.8.2 本基金投资的前十名股票中,未有投资超出基金合同规定备选股票库之外股票。
 5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	13,419.68
2	应收证券清算款	10,626,776.85
3	应收股利	-
4	应收利息	1,291,269.60
5	应收申购款	420,987.92
6	其他应收款	3.00
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,352,457.05

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 报告期内本基金持有的处于转股期的可转换债券明细
 5.9.2 报告期内本基金持有的处于转股期的可转换债券
 5.9.3 报告期内本基金持有的处于转股期的可转换债券
 5.9.4 报告期内本基金持有的处于转股期的可转换债券
 5.9.5 报告期内本基金持有的处于转股期的可转换债券

6 开放式基金份额变动

单位:份	
报告期初基金份额总额	130,697,453.32
报告期内基金总申购份额	20,541,620.38
报告期内基金总赎回份额	-70,880,521.40
报告期内基金净申购份额(份额减少以“-”填列)	59,816,948.98
报告期末基金份额总额	80,358,532.30

7 备查文件目录

7.1 中国证监会批准设立本基金的文件
 7.2 长城稳健增利债券型证券投资基金合同
 7.3 长城稳健增利债券型证券投资基金托管协议
 7.4 法律意见书
 7.5 基金管理人业务资格批件、营业执照
 7.6 基金托管人业务资格批件、营业执照
 7.7 中国证监会规定的其他文件
 7.8 存放地点
 7.9 查询方式
 7.10 投资者可在办公时间亲自来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:400-8868-666
 7.11 网址:www.ccwm.com.cn

长城消费增值股票型证券投资基金

2009 第四季度报告

2009年12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:2010年01月20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2010年1月15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。
 本报告中财务资料未经审计。
 本报告自2009年10月01日起至12月31日止。

2 基金产品概况

基金简称	长城消费增值股票
交易代码	200006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年04月06日
报告期末基金份额总额	7,304,522,111.92份

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 2009年10月01日-2009年12月31日
1.本期已实现收益	296,100,136.05
2.本期利润	1,027,325,655.36
3.加权平均基金份额本期利润	0.1318
4.期末基金资产净值	7,219,539,848.96
5.期末基金份额净值	0.9884

注:①本基金合同规定本基金投资组合中:股票投资比例为基金资产净值的60%-95%,债券及短期金融工具的投资比例为基金资产净值的5%-40%。现金或到期日在一年以内的政府债券为基金资产净值的5%以上。②本基金的投资组合为自本基金合同生效日起6个月内,自2006年4月6日至2006年10月5日止,建仓期。
 ③本基金的投资组合符合法律法规及基金合同的相关规定。

4.1 基金经理 钱基敏先生简介

姓名	职务	在本基金的基金经理任期	证券从业年限	说明
钱基敏	基金经理	2006年04月06日	12年	中国籍,北京大学经济学院系统科学学士,北京交通大学经济学院系统科学硕士,曾就职于深圳平安证券有限公司、深圳平安证券资产管理部,从事基金、证券、信托、资产管理、基金销售等工作。2003年3月加入长城基金管理有限公司,曾任长城基金基金经理,现担任长城消费增值股票型证券投资基金基金经理。

4.2 管理人对于报告期内本基金运作遵守信情况的说明
 本报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、《长城消费增值股票型证券投资基金合同》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和运用基金资产,在控制投资风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大的利益,未出现违反法律法规、基金合同和相关规定的情形,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。本报告期内运作过程中未出现投资组合比例超标或基金合同约定的情况,本基金管理人已在规定的合理期限内进行了调整,有效地保护了基金份额持有人的利益。

4.3 公平交易专项说明
 4.3.1 公平交易制度的执行情况
 4.3.2 本基金投资与其他投资组合的公平交易专项说明
 4.3.3 异常交易行为的专项说明

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	6,238,064,577.33	84.98
2	其中:股票	6,238,064,577.33	84.98
3	固定收益投资	3,381,904.54	0.05
4	其中:债券	3,381,904.54	0.05
5	资产支持证券	-	-

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、业	-	-
B	采掘业	611,405,897.25	8.47
C	制造业	1,684,685,081.20	23.34
CD	食品、饮料	842,847,275.64	11.67
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	68,573,571.63	0.95
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	361,664,597.12	5.01
C7	机械、设备、仪表	154,928,154.06	2.15
C8	医药、生物制品	256,671,482.75	3.56
C9	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	4,088,700.00	0.06
F	交通运输、仓储业	112,838,332.62	1.56
G	信息技术业	15,915.00	0.00
H	批发和零售业	191,881,441.70	2.66
I	房地产业	3,598,664,256.93	49.83
J	社会服务业	22,040,303.61	0.31
K	传播与文化业	-	-
L	综合类	144,837.33	0.00
M	合计	12,299,810,677.33	0.17

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	601166	兴业银行	16,120,918	649,834,204.58	9.00
2	600010	浦发银行	24,102,644	522,786,348.36	7.24
3	600519	贵州茅台	3,050,898	518,103,498.36	7.18
4	600036	招商银行	28,123,728	507,633,290.40	7.03
5	600016	民生银行	51,297,009	405,759,341.19	5.62
6	000568	泸州老窖	8,318,232	324,743,777.28	4.50
7	600015	华夏银行	15,991,597	198,615,634.74	2.75
8	600005	中国联通	22,840,520	189,119,505.60	2.62
9	601628	中国人寿	5,923,337	187,710,549.83	2.60
10	000001	深发展A	7,635,010	186,065,193.70	2.58

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
4	其中:政策性金融债	-	-
5	企业短期融资券	3,381,904.54	0.05
6	可转换债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	3,381,904.54	0.05

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	债券品种	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	126011	08央行票	32,570	2,771,707.00	0.04
2	112005	08国债01	3,337	346,180.38	0.00
3	112006	08国债02	2,508	264,017.16	0.00

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

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债逆回购	4,455,360.00	4.98
2	央行票据	30,840,000.00	34.32
3	金融债券	30,103,000.00	33.50
4	其中:政策性金融债	30,103,000.00	33.50
5	企业短期融资券	6,580,227.00	7.32
6	可转换债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	71,978,587.00	80.09

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权证投资明细

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)		
1	080103	08央行票据	300,000	30,840,000.00	34.32
2	090220	09国债02	200,000	20,114,000.00	22.38
3	090205	09国债05	100,000	9,989,000.00	11.11
4	122926	09国债06	50,000	5,000,000.00	5.56
5	010004	20国债04	44,200	4,455,360.00	4.96

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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公开谴责、处罚。
 5.8.2 本基金投资的前十名股票中,未有投资超出基金合同规定备选股票库之外股票。
 5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	236,580.32
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	242,274.27
5	应收申购款	105,549,210.77
6	其他应收款	18,543.84
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	106,043,099.20

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 报告期内本基金持有的处于转股期的可转换债券明细
 5.9.2 报告期内本基金持有的处于转股期的可转换债券
 5.9.3 报告期内本基金持有的处于转股期的可转换债券
 5.9.4 报告期内本基金持有的处于转股期的可转换债券
 5.9.5 报告期内本基金持有的处于转股期的可转换债券

6 开放式基金份额变动

单位:份	
报告期初基金份额总额	8,567,727,127.38
报告期内基金总申购份额	1,089,171,202.91
报告期内基金总赎回份额	-2,352,736,218.37
报告期内基金净申购份额(份额减少以“-”填列)	7,304,052,111.92

7 备查文件目录

7.1 中国证监会批准设立本基金的文件
 7.2 长城消费增值股票型证券投资基金合同
 7.3 长城消费增值股票型证券投资基金托管协议
 7.4 法律意见书
 7.5 基金管理人业务资格批件、营业执照
 7.6 基金托管人业务资格批件、营业执照
 7.7 中国证监会规定的其他文件
 7.8 存放地点
 7.9 查询方式
 7.10 投资者可在办公时间亲自来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:400-8868-666
 7.11 网址:www.ccwm.com.cn

久嘉证券投资基金

2009 第四季度报告

2009年12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:2010年01月20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2010年1月15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。
 本报告中