

## 长城久恒平衡型证券投资基金

## 2013第四季度报告

2013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:2014年1月22日
本基金管理人的董事、监事及高级管理人员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2014年01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內容,确认不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
本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。
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**

长城久恒平衡型证券投资基金

基金代码 200001

交易代码 200101

基金运作方式 灵活配置型开放式

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 本基金在资产配置上为防范风险、获得超额收益的手段,通过资产的动态配置,获取资产的风格调整以及顺势选择三个层次进行投资管理。

业绩比较基准 70%×沪深300指数+30%×短期国债指数。

风险特征说明 本基金的风险水平与沪深300指数在市场风险的50%-60%左右。

基金管理人 长城基金管理有限公司

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)

7,752,751.84

本期利润 6,240,748.75

3.96%

本期的平均基金份额利润率 0.0436%

4.期初基金份额 212,842,794.01

5.期末基金份额 211,089,043.15

注:1.本期的收入为基金本期利息收入、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,本期利润为本期实现收入加上本期公允价值变动收益。

2.上述业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值增长率为基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.1 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

序号 股票代码 债券品种名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例 (%)

1 002065 中航软件 269,952 9,124,377.60 4.29

2 000606 东方电机 500,000 8,825,000.00 4.15

3 001126 四川路桥 420,000 8,085,000.00 3.80

4 000651 中国电建 230,000 7,511,800.00 3.53

5 300047 天源迪科 690,000 6,975,900.00 3.28

6 000666 三钢闽光 382,017 6,411,331.07 3.01

7 300145 南都泵业 164,956 6,210,930.40 2.92

8 600518 康美药业 320,000 5,760,000.00 2.71

9 002358 森源电气 260,000 5,590,000.00 2.63

10 600994 盈峰环境 170,000 5,545,400.00 2.61

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 债券品种名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例 (%)

1 002065 中航软件 300,000 29,913,000.00 10.80

2 000606 东方电机 120,000 11,775,600.00 5.53

3 001907 三钢闽光 82,800 8,255,160.00 3.88

4 001007 中国铝业 20,000 1,947,000.00 0.91

5 019302 中国国航 150,000 10,000,300.00 0.47

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号 债券代码 债券名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例 (%)

1 110102 11个月国债 32 300,000 29,913,000.00 14.05

2 020094 13国债06 120,000 11,775,600.00 5.53

3 019107 11国债07 82,800 8,255,160.00 3.88

4 001007 21国债07 20,000 1,947,000.00 0.91

5 019302 15国债02 10,000 1,000,300.00 0.47

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号 债券代码 债券名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例 (%)

1 110102 11个月国债 32 300,000 29,913,000.00 14.05

2 020094 13国债06 120,000 11,775,600.00 5.53

3 019107 11国债07 82,800 8,255,160.00 3.88

4 001007 21国债07 20,000 1,947,000.00 0.91

5 019302 15国债02 10,000 1,000,300.00 0.47

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名货币市场基金投资明细

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总值的25%。

5.4 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 任职日期 证券从业年限 说明

王文祥 长城久恒平衡型证券投资基金基金经理 2011年10月19日 - 6年 中国国籍,清华大学工学硕士,2009年进入长城基金管理有限公司,曾任项目经理、项目研究员,长期从事金融行业研究、基金管理等工作。

吴文庆 长城久恒、长城动力平衡型证券投资基金基金经理 2013年12月26日 - 4年 中国国籍,上海交通大学人文学院生物医学工程专业本科毕业,2010年进入长城基金管理有限公司,曾任项目经理、项目研究员,长期从事金融行业研究、基金管理等工作。

注:1.上任日期为公司做出决定的任职日期。

2.证券从业人员是指本公司正式员工,不包括临时聘用人员。

3.2 基金经理或基金经理助理的过往管理经验的说明

4.2 管理人对报告期内基金运作的总体评价

5.2 基金管理人对报告期内基金投资组合运作的评价

6.4 公平交易专项说明

6.1 公司公平交易制度的执行情况

6.2 管理人对报告期内基金的交易行为的评价

6.3 报告期内基金的异常交易行为的专项说明

6.4 报告期内基金的关联交易的专项说明

6.5 报告期内基金的利润分配情况

6.6 报告期内基金的分红情况

6.7 报告期内基金的费用情况

6.8 报告期内基金的税收情况

6.9 报告期内基金的其他费用情况

6.10 报告期内基金的现金流量表

6.11 报告期内基金的资产支持证券情况

6.12 报告期内基金的融资融券情况

6.13 报告期内基金的衍生品投资情况

6.14 报告期内基金的其他重要事项

6.15 报告期内基金的其他重要事项

6.16 报告期内基金的其他重要事项

6.17 报告期内基金的其他重要事项

6.18 报告期内基金的其他重要事项

6.19 报告期内基金的其他重要事项

6.20 报告期内基金的其他重要事项

6.21 报告期内基金的其他重要事项

6.22 报告期内基金的其他重要事项

6.23 报告期内基金的其他重要事项

6.24 报告期内基金的其他重要事项

6.25 报告期内基金的其他重要事项

6.26 报告期内基金的其他重要事项

6.27 报告期内基金的其他重要事项

6.28 报告期内基金的其他重要事项

6.29 报告期内基金的其他重要事项

6.30 报告期内基金的其他重要事项

6.31 报告期内基金的其他重要事项

6.32 报告期内基金的其他重要事项

6.33 报告期内基金的其他重要事项

6.34 报告期内基金的其他重要事项

6.35 报告期内基金的其他重要事项

6.36 报告期内基金的其他重要事项

6.37 报告期内基金的其他重要事项

6.38 报告期内基金的其他重要事项

6.39 报告期内基金的其他重要事项

6.40 报告期内基金的其他重要事项

6.41 报告期内基金的其他重要事项

6.42 报告期内基金的其他重要事项

6.43 报告期内基金的其他重要事项

6.44 报告期内基金的其他重要事项

6.45 报告期内基金的其他重要事项

6.46 报告期内基金的其他重要事项

6.47 报告期内基金的其他重要事项

6.48 报告期内基金的其他重要事项

6.49 报告期内基金的其他重要事项

6.50 报告期内基金的其他重要事项

6.51 报告期内基金的其他重要事项

6.52 报告期内基金的其他重要事项

6.53 报告期内基金的其他重要事项

6.54 报告期内基金的其他重要事项

6.55 报告期内基金的其他重要事项

6.56 报告期内基金的其他重要事项

6.57 报告期内基金的其他重要事项

6.58 报告期内基金的其他重要事项

6.59 报告期内基金的其他重要事项

6.60 报告期内基金的其他重要事项

6.61 报告期内基金的其他重要事项

6.62 报告期内基金的其他重要事项

6.63 报告期内基金的其他重要事项

6.64 报告期内基金的其他重要事项

6.65 报告期内基金的其他重要事项

6.66 报告期内基金的其他重要事项

6.67 报告期内基金的其他重要事项

6.68 报告期内基金的其他重要事项

6.69 报告期内基金的其他重要事项

6.70 报告期内基金的其他重要事项

6.71 报告期内基金的其他重要事项

6.72 报告期内基金的其他重要事项

6.73 报告期内基金的其他重要事项