

长城久泰中信标普 300 指数证券投资基金

2009年第一季度报告

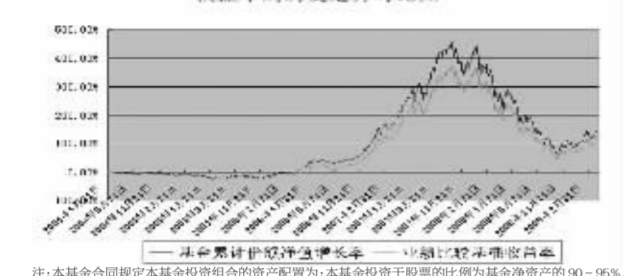
2009年03月31日
基金管理人:长城基金管理有限公司 基金托管人:招商银行股份有限公司
报告送出日期:2009年04月20日

现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产的5%。

基金名称	长城久泰中信标普 300 指数
交易所代码	200022 (前编) / 202002 (后编)
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004年05月21日
报告期末基金份额总额	1,869,204,810.64 份
投资目标	以跟踪指数化投资方法为投资目标,分享中国经济的长期增长,在严格控制与跟踪误差风险的前提下,力争取得超越目标指数的投资收益,谋求基金资产的长期增值。
投资策略	资产配置策略:本基金为股票型指数基金,以中证 300 指数作为目标指数。除因分红或基金持有人赎回申请等原因,本基金保持相对稳定的股票投资比例,通过跟踪误差的最小成本对目标指数进行被动投资,力争取得超越目标指数的投资收益。在正常市场下,本基金投资于标的指数的资产占基金资产的 90%-95%,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产的 5%。(2) 股票投资策略:本基金采用指数化投资策略,跟踪中证 300 指数的表现,并按照中证 300 指数的行业权重进行资产配置。投资组合中股票资产占基金资产的比例不低于 90%。本基金采用被动投资策略,跟踪中证 300 指数的表现,力争取得超越目标指数的投资收益。在正常市场下,本基金投资于标的指数的资产占基金资产的 90%-95%,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产的 5%。本基金的投资目标是:跟踪中证 300 指数的表现,力争取得超越目标指数的投资收益,谋求基金资产的长期增值。
业绩比较基准	95% × 中证 300 指数收益率 + 5% × 银行同业存款利率。
风险收益特征	本基金为股票型基金,预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。
基金管理人	长城基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司

§3 主要财务数据和基金净值表现	
单位:人民币元	
本报告期 2009 年 01 月 01 日 - 2009 年 03 月 31 日	
1. 本期基金份额净值增长率	-3.96% 173.2725%
2. 本期基金份额持有人申购/赎回净收益	400,489,529.24
3. 本期基金份额持有人申购/赎回净收益占基金资产净值的比例	0.2474%
4. 本期基金份额持有人申购/赎回净收益占基金资产净值的比例	1,818,479,663.72
5. 本期基金份额持有人申购/赎回净收益占基金资产净值的比例	0.9729%

注:1. 本基金合同约定本基金投资组合资产配置为:股票资产占基金资产的 90%-95%。2. 本基金合同约定本基金投资组合资产配置为:股票资产占基金资产的 90%-95%。



基金累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

姓名	职务	任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
杨建中	基金经理	2004 年 05 月 21 日	-	10 年	北京大学力学系物理学学士, 北京大学光华管理学院工商管理硕士, 注册会计师, 曾担任中化集团财务部经理, 2001 年 10 月调入长城基金管理有限公司, 曾任基金经理。2004 年 5 月 21 日起任本基金基金经理。现任本基金基金经理。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明
本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《长城久泰中信标普 300 指数证券投资基金合同》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,未出现违法违规及违反法律法规的情况。本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《长城久泰中信标普 300 指数证券投资基金合同》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,未出现违法违规及违反法律法规的情况。本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《长城久泰中信标普 300 指数证券投资基金合同》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,未出现违法违规及违反法律法规的情况。

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,656,569,500.26	88.95
2	固定收益投资	1,656,569,500.26	88.95
3	金融资产投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	89,820,925.26	4.71
6	其他资产	129,799,012.36	6.34
7	合计	1,906,629,800.17	100.00

注:本基金合同约定本基金投资组合资产配置为:股票资产占基金资产的 90%-95%。

长城品牌优选股票型证券投资基金

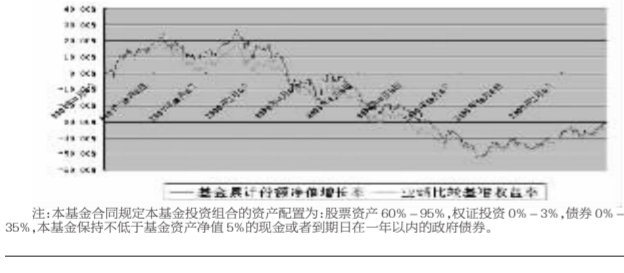
2009年第一季度报告

2009年04月20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:2009年04月20日

本基金的投资组合中股票资产占基金资产的 60%-95%。

基金名称	长城品牌优选股票
交易所代码	200008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年08月06日
报告期末基金份额总额	18,140,489,192.93 份
投资目标	本基金投资于具有良好成长性的上市公司,分享中国经济的长期增长,在严格控制与跟踪误差风险的前提下,力争取得超越目标指数的投资收益,谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金为股票型指数基金,以中证 300 指数作为目标指数。除因分红或基金持有人赎回申请等原因,本基金保持相对稳定的股票投资比例,通过跟踪误差的最小成本对目标指数进行被动投资,力争取得超越目标指数的投资收益。在正常市场下,本基金投资于标的指数的资产占基金资产的 90%-95%,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产的 5%。(2) 股票投资策略:本基金采用指数化投资策略,跟踪中证 300 指数的表现,并按照中证 300 指数的行业权重进行资产配置。投资组合中股票资产占基金资产的比例不低于 90%。本基金采用被动投资策略,跟踪中证 300 指数的表现,力争取得超越目标指数的投资收益。在正常市场下,本基金投资于标的指数的资产占基金资产的 90%-95%,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产的 5%。本基金的投资目标是:跟踪中证 300 指数的表现,力争取得超越目标指数的投资收益,谋求基金资产的长期增值。
业绩比较基准	95% × 中证 300 指数收益率 + 5% × 银行同业存款利率。
风险收益特征	本基金为股票型基金,预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。
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 主要财务数据和基金净值表现	
单位:人民币元	
本报告期 2009 年 01 月 01 日 - 2009 年 03 月 31 日	
1. 本期基金份额净值增长率	-5.94% 705.0000%
2. 本期基金份额持有人申购/赎回净收益	2,814,476,893.12
3. 本期基金份额持有人申购/赎回净收益占基金资产净值的比例	0.1541%
4. 本期基金份额持有人申购/赎回净收益占基金资产净值的比例	12,469,487,794.97
5. 本期基金份额持有人申购/赎回净收益占基金资产净值的比例	0.6893%



基金累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

姓名	职务	任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
杨建中	基金经理	2007 年 08 月 06 日	-	16 年	中国人民大学经济学院经济学学士, 经济学硕士, 曾任中化集团财务部经理, 2001 年 10 月调入长城基金管理有限公司, 曾任基金经理。2007 年 8 月 6 日起任本基金基金经理。现任本基金基金经理。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明
本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《长城品牌优选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,未出现违法违规及违反法律法规的情况。本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《长城品牌优选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,未出现违法违规及违反法律法规的情况。本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《长城品牌优选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,未出现违法违规及违反法律法规的情况。

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	10,255,549,549.01	82.04
2	固定收益投资	10,255,549,549.01	82.04
3	金融资产投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	2,226,226,261.03	17.81
6	其他资产	16,255,491.78	0.13
7	合计	12,488,080,310.82	100.00

注:本基金合同约定本基金投资组合资产配置为:股票资产占基金资产的 60%-95%。

长城稳健增利债券型证券投资基金

2009年第一季度报告

2009年03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:2009年04月20日

本基金的投资组合中债券资产占基金资产的 80%-100%。

基金名称	长城稳健增利债券
交易所代码	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	300,303,175.36 份
投资目标	本基金投资于具有良好信用等级和较高流动性的固定收益类金融工具,部分基金资产可以投资于一级市场非公开发行的固定收益类金融工具,在严格控制与跟踪误差风险的前提下,力争取得超越目标指数的投资收益,谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金为债券型指数基金,以中证 300 指数作为目标指数。除因分红或基金持有人赎回申请等原因,本基金保持相对稳定的股票投资比例,通过跟踪误差的最小成本对目标指数进行被动投资,力争取得超越目标指数的投资收益。在正常市场下,本基金投资于标的指数的资产占基金资产的 90%-95%,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产的 5%。(2) 股票投资策略:本基金采用指数化投资策略,跟踪中证 300 指数的表现,并按照中证 300 指数的行业权重进行资产配置。投资组合中股票资产占基金资产的比例不低于 90%。本基金采用被动投资策略,跟踪中证 300 指数的表现,力争取得超越目标指数的投资收益。在正常市场下,本基金投资于标的指数的资产占基金资产的 90%-95%,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产的 5%。本基金的投资目标是:跟踪中证 300 指数的表现,力争取得超越目标指数的投资收益,谋求基金资产的长期增值。
业绩比较基准	95% × 中证 300 指数收益率 + 5% × 银行同业存款利率。
风险收益特征	本基金为股票型基金,预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。
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 主要财务数据和基金净值表现	
单位:人民币元	
本报告期 2009 年 01 月 01 日 - 2009 年 03 月 31 日	
1. 本期基金份额净值增长率	-18.22% 983.67%
2. 本期基金份额持有人申购/赎回净收益	-2,803,416.56
3. 本期基金份额持有人申购/赎回净收益占基金资产净值的比例	-0.008%
4. 本期基金份额持有人申购/赎回净收益占基金资产净值的比例	325,982,128.47
5. 本期基金份额持有人申购/赎回净收益占基金资产净值的比例	1.08%



基金累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

姓名	职务	任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
陶海	基金经理	2008 年 08 月 27 日	-	4 年	CFA, 1989 年毕业于清华大学, 曾任中化集团财务部经理, 2001 年 10 月调入长城基金管理有限公司, 曾任基金经理。2008 年 8 月 27 日起任本基金基金经理。现任本基金基金经理。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明
本报告期内,本基金管理人严格遵守《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,未出现违法违规及违反法律法规的情况。本基金管理人严格遵守《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,未出现违法违规及违反法律法规的情况。本基金管理人严格遵守《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,未出现违法违规及违反法律法规的情况。

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	22,626,790.00	7.37
2	固定收益投资	23,626,790.00	7.37
3	金融资产投资	297,435,079.80	87.26
4	买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	11,772,267.62	3.57
6	其他资产	6,601,282.26	2.00
7	合计	329,432,939.67	100.00

注:本基金合同约定本基金投资组合资产配置为:股票资产占基金资产的 60%-95%。

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔业	8,149,173.32	0.46
B	采矿业	149,964,541.68	6.20
C	制造业	546,436,313.94	22.85
D	电力、热力、燃气及水的生产和供应业	62,304,142.00	2.61
E	建筑业	17,123,344.10	0.74
F	批发和零售业	8,595,971.10	0.45
G	交通运输、仓储和邮政业	5,987,588.47	0.25
H	住宿和餐饮业	46,340,366.47	1.94
I	金融业	11,139,729.80	0.61
J	房地产业	161,127,128.11	6.88
K	其他行业	141,125,076.89	5.95
L	其他行业	56,436,136.38	2.40
M	其他行业	6,019,313.62	0.26
N	其他行业	76,377,561.94	3.23
O	其他行业	43,269,814.71	1.83
P	其他行业	102,615,476.87	4.34
Q	其他行业	67,948,022.22	2.91
R	其他行业	60,923,893.46	2.58
S	其他行业	497,459,813.34	20.36
T	其他行业	102,229,773.22	4.33
U	其他行业	27,489,775.80	1.15
V	其他行业	5,647,640.83	0.24
W	其他行业	46,276,562.81	1.94
X	其他行业	1,666,399,326.83	70.28

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	金融业	-	-
J	房地产业	-	-
K	其他行业	-	-
L	其他行业	-	-
M	其他行业	-	-
N	其他行业	-	-
O	其他行业	-	-
P	其他行业	-	-
Q	其他行业	-	-
R	其他行业	-	-
S	其他行业	-	-
T	其他行业	-	-
U	其他行业	-	-
V	其他行业	-	-
W	其他行业	-	-
X	其他行业	-	-
Y	其他行业	-	-
Z	其他行业	-	-

注:本基金合同约定本基金投资组合资产配置为:股票资产占基金资产的 60%-95%。

注:本基金本报告期末未有积极类股票。

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五名股票投资明细

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	601318	中国平安	1,964,708	36,843,280.70	4.23
2	600000	浦发银行	2,818,310	61,777,266.20	7.24
3	601228	交通银行	8,808,267	57,056,816.81	6.71
4	600030	中信证券	2,158,477	55,011,979.19	6.52
5	601106	兴业银行	1,971,597	45,307,289.06	5.40

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	存出保证金	-	760,000.00	-
2	应收证券清算款	-	-	-
3	应收股利	-	-	-
4	应收利息	-	-	-
5	持有至到期投资	-	-	-
6	其他债权投资	-	-	-
7	其他	-	-	-
8	合计	-	760,000.00	-

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权证投资明细

序号	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	存出保证金	-	1,762,912.99303	-
2	应收证券清算款	-	-	-
3	应收股利	-	-	-
4	应收利息	-	-	-
5	持有至到期投资	-	-	-
6	其他债权投资	-	-	-
7	其他	-	-	-
8	合计	-	1,762,912.99303	-

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五名权证投资明细

序号	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	存出保证金	-	1,100,476.67371	-
2	应收证券清算款	-	-	-
3	应收股利	-	-	-
4	应收利息	-	-	-
5	持有至到期投资	-	-	-
6	其他债权投资	-	-	-
7	其他	-	-	-
8	合计	-	1,100,476.67371	-

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	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	存出保证金	-	994,182.87700	-
2	应收证券清算款	-	-	-
3	应收股利	-	-	-
4	应收利息	-	-	-
5	持有至到期投资	-	-	-
6	其他债权投资	-	-	-
7	其他	-	-	-
8	合计	-	994,182.87700	-

5.8 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	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	存出保证金	-	1,869,204,810.64	-
2	应收证券清算款	-	-	-
3	应收股利	-	-	-
4	应收利息	-	-	-
5	持有至到期投资	-	-	-
6	其他债权投资	-	-	-
7	其他	-	-	-
8	合计	-	1,869,204,810.64	-

5.9 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	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	存出保证金	-	1,762,912.99303	-
2	应收证券清算款	-	-	-
3	应收股利	-	-	-
4	应收利息	-	-	-
5	持有至到期投资	-	-	-
6	其他债权投资	-	-	-
7	其他	-	-	-
8	合计	-	1,762,912.99303	-

5.10 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	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	存出保证金	-	1,100,476.67371	-
2	应收证券清算款	-	-	-
3	应收股利	-	-	-
4	应收利息	-	-	-
5	持有至到期投资	-	-	-
6	其他债权投资	-	-	-
7	其他	-	-	-
8	合计	-	1,100,476.67371	-

5.11 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	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	存出保证金	-	994,182.87700	-
2	应收证券清算款	-	-	-
3	应收股利	-	-	-
4	应收利息	-	-	-
5	持有至到期投资	-	-	-