

# 长城久恒平衡型证券投资基金 更新的招募说明书摘要

2010年第1号

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

二〇一〇年六月

长城久恒平衡型证券投资基金经中国证监会2003年8月25日证监基金字[2003]97号文件“关于同意长城久恒平衡型证券投资基金设立的批复”批准发起设立。基金合同于2003年10月31日正式生效。

## 重要提示

投资有风险，投资人申购基金时应认真阅读本招募说明书；基金的过往业绩并不预示其未来表现，本基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本摘要根据本基金的基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

本招募说明书所载内容截止日为2010年4月30日，有关财务数据和净值表现截止日为2010年3月31日（财务数据未经审计）。

本招募说明书与基金托管人相关更新部分已经本基金托管人中国建设银行股份有限公司复核。

### 一、基金管理人

#### （一）基金管理人概况

- 1、名称：长城基金管理有限公司
- 2、注册地址：深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心41层
- 3、办公地址：深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心41层
- 4、法定代表人：杨光裕
- 5、组织形式：有限责任公司
- 6、设立日期：2001年12月27日
- 7、电话：0755-23982338
- 8、传真：0755-23982328
- 9、联系人：袁柳生
- 10、客户服务电话：400-8868-666

11、注册资本：壹亿伍仟万元人民币

12、股权结构：

持股单位	占总股本比例
长城证券有限责任公司	47.059%
东方证券股份有限公司	17.647%
中原信托有限公司	17.647%
北方国际信托股份有限公司	17.647%
合计	100%

13、管理基金情况：目前管理长城久富核心成长股票型证券投资基金（LOF）、久嘉证券投资基金、长城久恒平衡型证券投资基金、长城久泰中信标普 300 指数证券投资基金、长城货币市场证券投资基金、长城消费增值股票型证券投资基金、长城安心回报混合型证券投资基金、长城品牌优选股票型证券投资基金、长城稳健增利债券型证券投资基金、长城双动力股票型证券投资基金和长城景气行业龙头灵活配置混合型证券投资基金十一只基金。

## （二）主要人员情况

1、董事、监事及高管人员介绍

(1)董事

杨光裕先生，中共党员，硕士研究生毕业。历任江西省审计厅办公室主任，长城证券有限责任公司副总裁，现任长城基金管理有限公司董事长。

叶焯先生，中南财经政法大学经济学硕士。历任君安证券有限责任公司投资银行部高级经理、石家庄营业部总经理、公司副总裁，国泰君安证券股份有限公司北京分公司常务副总经理、武汉分公司总经理、资产委托管理总部总监，长信基金管理有限责任公司总经理。现任长城证券有限责任公司总经理、党委副书记。

张志红女士，中共党员，复旦大学经济学博士。曾任上海金融高等专科学校教师，上海市证管办科员、副主任科员、主任科员，上海证监局机构监管处副处长、处长，上海证监局上市公司监管一处处长，现任长城证券有限责任公司首席合规官。

梁宇峰先生，中共党员，复旦大学经济学博士。历任东方证券股份有限公司研究发展总部经理助理、办公室主任助理、研究所副所长，2006年4月至今任东方证券股份有限公司研究所所长。

姬宏俊先生，中共党员，大学本科学历。历任河南省计划委员会老干部处副处长、投资处副处长，发展计划委员会财政金融处副处长，国家开发银行河南省分行信贷一处副处长。现任中原信托有限公司副总经理。

陆妍女士，天津大学工学硕士。曾任天津国际信托投资公司进出口贸易咨询部部门经理、天津泰达集团证券投资部项目经理、北方国际信托投资股份有限公司证券管理总部总经理，现任北方国际信托投资股份有限公司副总经理。

任俊杰先生，大学本科毕业。历任中国人民银行深圳分行处长、深圳金融机构同业协会首任秘书长、赛格投资有限公司（香港注册）董事总经理、祥安证券有限公司（香港联交所会员）董事、中国投资环境协会副理事长、深圳怀新企业投资顾问有限公司副总经理等职务，现任深圳施得普汇投资顾问有限公司董事长。

万建华先生，中共党员，工商管理博士，高级经济师。历任中国人民银行货币政策司处长、招商银行总行副行长、党委副书记、常务副行长、中国银联筹备组组长、党委书记、副董事长、总裁，现任上海国际集团党委副书记、副董事长、总裁。

谢志华先生，中共党员，经济学博士。历任湖南国营大通湖农场教师、湘西自治州商业学校教师、北京商学院（现北京工商大学）副院长、北京工商大学校长助理。2003年至今任北京工商大学副校长。

刘杉先生，经济学博士。历任中华工商时报社海外部编辑、副主任、中华工商时报财经新闻部主任、中国人民银行深圳分行金融日报社总编辑、中华工商时报社总编辑助理。现任中华工商时报社副总编辑，兼任北京工商大学教授、中国人民大学信托与基金研究所研究员。

关林戈先生，中共党员，经济学硕士。历任中国汽车贸易公司办公室主任，中共天津市委领导同志秘书，南方证券天津分公司副总经理、常务副总经理、代总经理，长城证券有限责任公司总裁助理，长城基金管理有限公司副总经理、常务副总经理，现任长城基金管理有限公司总经理。

## （2）监事

罗世容女士，工商管理硕士，会计师。历任四川省（轻工厅）盐业学校财经教研室副主任，海南机设信托投资公司证券部主办会计，长城证券有限责任公司财务部主管、深圳二部财务部经理，成都营业部副总经理兼财务部经理、深圳一部副总经理兼财务部经理、审计部总经理、风险管理部总经理，现任长城证券有限责任公司财务部副总经理，并担任长城基金管理有限公司监事会主席。

张令先生，中共党员，研究生学历。历任中国纺织机械股份有限公司财务会计、副科长、科长、副总会计师、上海浦发银行信托证券部科长、副总经理、东方证券股份有限公司资金财务管理总部总经理，现任东方证券股份有限公司稽核总部总经理。

孟凡君先生，中共党员，经济学学士，经济师。历任工商银行河南华信资金市场融资二部经理、总经理助理、中原信托投资有限公司开封证券营业部副经理、资产管理部经理，现任中原信托投资有限公司投资管理二部经理。

田德良先生，中共党员，本科学历，经济师。曾任职于中国建设银行天津开发区分行，任经理助理、事后总稽核。现任职于北方国际信托投资股份有限公司，曾任会计部经理助理、会计部副经理、会计部经理、稽核监察部副经理、项目评估部项目经理、业务发展总部客户经理、自营业务总部客户经理，现任资产管理部高级项目经理。

桑煜先生，中共党员，经济学学士。曾任职于中国建设银行山东日照市分行、中国建设银行山东省分行、中国建设银行总行基金托管部。2002年8月进入长城基金管理有限公司，历任市场开发部业务主管、运行保障部副总经理、运行保障部总经理，现任公司总经理助理兼市场开发部总经理。

韩刚先生，中共党员，1999年毕业于中国人民银行研究生部，经济学硕士。曾任国信证券发展研究中心研究员。2001年7月进入长城基金管理有限公司，历任研究员、长城久恒平衡型证券投资基金基金经理、基金管理部副总经理、研究部副总经理、长城久富核心成长股票型证券投资基金基金经理。

### (3) 高级管理人员

杨光裕先生，长城基金管理有限公司董事长，简历同上。

关林戈先生，长城基金管理有限公司董事、总经理。简历同上。

余骏先生，硕士研究生毕业。曾任教于中国地质大学经管学院，历任中国人民银行湖北省分行科室负责人，君安证券有限公司研究部宏观室负责人，长城证券有限责任公司营业部总经理，长城基金管理有限公司督察长兼监察稽核部总经理，现任长城基金管理有限公司副总经理兼运行保障部总经理和综合管理部总经理。

汪钦先生，中共党员，博士研究生毕业。曾就职于中国人民银行河南省分行教育处，海南港澳国际信托投资公司证券部，历任三亚东方实业股份有限公司副总经理，国信证券有限责任公司研究所所长，长城基金管理有限公司总经理助理，并先后兼任研究策划部总经理、市场开发部总经理，现任长城基金管理有限公司副总经理。

韩浩先生，硕士研究生毕业。历任长城证券有限责任公司资产管理部总经理，长城基金管理有限公司投资总监兼投资管理部总经理、“久嘉证券投资基金”基金经理、总经理助理、“长城久恒平衡型证券投资基金”基金经理，现任长城基金管理有限公司副总经理、投资总监兼基金管理部总经理。

彭洪波先生，经济学硕士，MBA。曾就职于长城证券有限责任公司，历任深圳东园路营业部电脑部经理，公司电子商务筹备组项目经理，公司审计部技术主审。2002年3月加盟长城基金管理有限公司，历任监察稽核部业务主管、部门副经理、部门经理，现任长城基金管理有限公司督察长兼监察稽核部总经理。

## 2、本基金基金经理简历

阮涛先生，中国籍。南京航空航天大学工学学士、华中科技大学经济学硕士。曾就职于东风汽车公司、长城证券有限责任公司。2002年进入长城基金管理有限公司，曾任基金久嘉基金助理、“长城久恒平衡型证券投资基金”基金经理、行业研究员。自2010年2月24日起任本基金基金经理，同时兼任长城双动力股票型证券投资基金基金经理。

“长城久恒平衡型证券投资基金”历任基金经理如下：2003年11月1日—2005年3月26日，杨军任基金经理；2005年3月27日—2006年2月25日，韩刚任基金经理；2006年2月26日至2007年4月11日，杨毅平任基金经理；2007年4月12日至2007年11月12日，阮涛任基金经理；2007年11月13日至2010年2月23日，李硕任基金经理。

3、本公司投资决策委员会成员的姓名和职务如下：

关林戈先生，投资决策委员会主席，公司董事、总经理。

韩浩先生，投资决策委员会执行委员，公司副总经理、投资总监兼基金管理部总经理。

杨毅平先生，投资决策委员会委员，公司首席策略分析师。

王定元先生，投资决策委员会委员，公司研究部总经理。

4、上述人员之间不存在近亲属关系。

## 二、基金托管人

### （一）基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：北京市西城区金融大街25号

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

法定代表人：郭树清

成立时间：2004年09月17日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12号

联系人：尹东

联系电话：(010) 6759 5003

中国建设银行股份有限公司拥有悠久的经营历史，其前身“中国人民建设银行”于1954年成立，1996年易名为“中国建设银行”。中国建设银行是中国四大商业银行之一。中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于2004年9月分立而成立，承继了原中国建设银行的商业银行业务及相关的资产和负债。中国建设银行(股票代码：939)于2005年10月27日在香港联合

交易所主板上市，是中国四大商业银行中首家在海外公开上市的银行。2006年9月11日，中国建设银行又作为第一家H股公司晋身恒生指数。2007年9月25日中国建设银行A股在上海证券交易所上市并开始交易。A股发行后中国建设银行的已发行股份总数为：233,689,084,000股(包括224,689,084,000股H股及9,000,000,000股A股)。

截至2009年12月31日，中国建设银行实现净利润1,068.36亿元，较上年增长15.32%，每股盈利为0.46元，较上年增加0.06元，盈利水平好于预期；平均资产回报率为1.24%，较上年降低0.07个百分点，加权平均净资产收益率为20.87%，较上年提高0.19个百分点，整体盈利趋势向好；总资产达到96,233.55亿元，较上年增长27.37%；资产质量在国内大银行中保持领先，不良贷款额和不良贷款率持续双降，信贷资产质量持续改善，不良贷款率为1.50%，较上年末下降0.71个百分点；拨备水平充分，拨备覆盖率为175.77%，较上年末提升44.19个百分点。

中国建设银行在中国内地设有1.3万余个分支机构，并在香港、新加坡、法兰克福、约翰内斯堡、东京、首尔、纽约及胡志明市设有分行，在悉尼设有代表处，拥有建行亚洲、建银国际，建行伦敦、建信基金、建信金融租赁、建信信托等多家子公司。全行已安装运行自动柜员机(ATM)36,021台，拥有员工约30万人，为客户提供全面的金融服务。

中国建设银行得到市场和业界的支持和广泛认可，在2009年共获得50多个国内外奖项。中国建设银行在英国《银行家》杂志公布的“全球金融品牌500强”、“全球银行1000强”中分列第9位和第12位，被《亚洲货币》杂志评为2009年度“中国区最佳银行”，被《欧洲货币》杂志评为2009年度“中国最佳银行”，连续两年被香港《资本》杂志评为“中国杰出零售银行”，荣获《亚洲银行家》杂志颁发的“中国风险管理成就奖”，中国扶贫基金会颁发的“20年特别贡献奖”等奖项，被中国红十字会基金会评为“最具责任感企业”，被《全球托管人》杂志评为“国内最佳托管银行”，连续三年荣获香港《财资》杂志“中国最佳境外客户境内托管银行奖”。

中国建设银行总行设投资托管服务部，下设综合制度处、基金市场处、资产托管处、QFII托管处、基金核算处、基金清算处、监督稽核处和投资托管团队、涉外资产核算团队、养老金托管服务团队、养老金托管市场团队、上海备份中心等12个职能处室，现有员工130余人。2008年，中国建设银行一次性通过了根据美国注册会计师协会(AICPA)颁布的审计准则公告第70号(SAS70)进行的内部控制审计，安永会计师事务所为此提交了“业内最干净的无保留意见的报告”，中国建设银行成为取得国际同业普遍认同并接受的SAS70国际专项认证的托管银行。

## (二) 主要人员情况

罗中涛，投资托管服务部总经理，曾就职于国家统计局、中国建设银行总行评估、信贷、委托代理等业务部门并担任领导工作，对统计、评估、信贷及委托代理业务具有丰富的管理经验。

李春信，投资托管服务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行人事教育部、计划部、筹资储蓄部、国际业务部，对商业银行综合经营计划、零售业务及国际业务具有丰富的客户服务和业务管理经验。

纪伟，投资托管服务部副总经理，曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部，长期从事大客户的客户管理及服务工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

### （三）基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2009年12月31日，中国建设银行已托管143只证券投资基金，其中封闭式基金6只，开放式基金137只。建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。2010年初，中国建设银行被总部设于英国伦敦的《全球托管人》杂志评为2009年度“国内最佳托管银行”（Domestic Top Rated），并连续第三年被香港《财资》杂志评为“中国最佳次托管银行”。

## 三、相关服务机构

### （一）销售机构

#### 1、直销机构

名称：长城基金管理有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心41层

办公地址：深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心41层

法定代表人：杨光裕

电话：0755-23982338

传真：0755-23982328

联系人：黄念英

客户服务电话：400-8868-666

网站：www.ccfund.com.cn

#### 2、代销机构

##### （1）中国建设银行股份有限公司



注册地址：北京市西城区金融大街25号

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

法定代表人：郭树清

客户服务电话：95533

网站：www.ccb.com

(2) 中国农业银行股份有限公司

注册地址：北京市海淀区复兴路甲23号

法定代表人：项俊波

电话：010-85109219

传真：010-85109219

联系人：蒋浩

客户服务电话：95599

网站：www.abchina.com

(3) 中国银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街1号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号中国银行总行办公大楼

法定代表人：肖钢

电话：010-66596688

传真：010-66594946

客户服务电话：95566

网址：www.boc.cn

(4) 招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

法定代表人：秦晓

电话：0755-83198888

传真：0755-83195049

联系人：丰靖

客户服务电话：95555

网站：www.cmbchina.com

(5) 交通银行股份有限公司

注册地址：上海市仙霞路18号

办公地址：上海市银城中路188号

法定代表人：胡怀邦

电话：021-58781234

传真：021-58408842

联系人：曹榕

客户服务电话：95559

网址：www.bankcomm.com

(6) 兴业银行股份有限公司

住所：福州市湖东路154号

法定代表人：高建平

电话：021-62677777

传真：021-62569070

联系人：陈晓瑾

客户服务电话：95561

网站：www.cib.com.cn

(7) 中国光大银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门外大街6号光大大厦

法定代表人：王明权

电话：010-68098778

传真：010-68560661

联系人：李伟

客户服务电话：95595

网站：www.cebbank.com

(8) 华夏银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街22号

办公地址：北京市东城区建国门内大街22号

法定代表人：刘海燕

联系人：陈宇

电话：010-85238423

传真：010-85238680

网址：www.hxb.com.cn

(9) 北京银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街17号北京银行大厦

法定代表人：阎竹冰

联系人：王光伟

电话：010-66223236

客户服务电话：010-96169（北京），022-96269（天津），021-53599688（上海）

网站：[www.bankofbeijing.com.cn](http://www.bankofbeijing.com.cn)

（10）中信银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

法定代表人：孔丹

联系人：王斌

电话：010-65542337

客户服务电话：95558

网站：[www.bank.ecitic.com](http://www.bank.ecitic.com)

（11）中国民生银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街2号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街2号

法定代表人：董文标

电话：010-58351666

传真：010-83914283

联系人：李群

客户服务电话：95568

网址：[www.cmbc.com.cn](http://www.cmbc.com.cn)

（12）深圳发展银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦

办公地址：深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦

法定代表人：法兰克纽曼

联系人：周勤

电话：0755-82088888转8811

客户服务电话：95501

公司网站：[www.sdb.com.cn](http://www.sdb.com.cn)

（13）上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区浦东南路500号

办公地址：上海市中山东一路12号

法定代表人：吉晓辉

电话：021-61618888

传真：021-63602431

联系人：徐伟、汤嘉惠

网址：www.spdb.com.cn

客户服务电话：95528

（14）平安银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南中路1099号平安银行大厦

办公地址：深圳市深南中路1099号平安银行大厦

法定代表人：孙建一

联系人：霍兆龙

电话：0755-25859591

传真：0755-25879453

网址：www.pingan.com

客户服务电话：4006699999

（15）中信建投证券有限责任公司

注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街188号

法定代表人：张佑君

电话：010-85130577

联系人：权唐

客户服务电话：4008888108

网站：www.csc108.com

（16）海通证券股份有限公司

注册地址：上海市淮海中路98号

法定代表人：王开国

电话：021-53594566

联系人：金芸、李笑鸣

客户服务电话：4008888001、021-962503

网站：www.htsec.com

（17）国泰君安证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区商城路618号

办公地址：上海市延平路135号

法定代表人：祝幼一

联系人：芮敏祺

电话：021-62580818-213

传真：021-62569400

客户服务电话：4008888666

网站：www.gtja.com

（18）申银万国证券股份有限公司

注册地址：上海市常熟路171号

办公地址：上海市常熟路171号

法定代表人：丁国荣

电话：021-54033888

传真：021-54035333

客户服务电话：021-962505

网站：www.sw2000.com.cn

（19）兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路99号标力大厦

法定代表人：兰荣

电话：021-68419974

传真：021-68419867

联系人：易勇

网站：www.xyzq.com.cn

（20）长城证券有限责任公司

注册地址：深圳市深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层

法定代表人：黄耀华

联系人：高峰

客户服务电话：0755-82288968

网站：www.cc168.com.cn

（21）中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

法定代表人：顾伟国

联系人：郭京华

客户服务电话：4008-888-8888

网站：www.chinastock.com.cn

(22) 招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38—45层

法定代表人：宫少林

电话：0755-82943511

传真：0755-82943237

联系人：黄健

客户服务电话：4008888111、0755-26951111

网站：www.newone.com.cn

(23) 平安证券有限责任公司

办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼

法定代表人：杨宇翔

联系人：周璐

电话：0755-22626172

传真：0755-82400862

客户服务电话：4008816168

网站：www.pingan.com

(24) 江南证券有限责任公司

注册地址：江西省南昌市抚河北路291号

法定代表人：姚江涛

联系人：方俊才

电话：0791-6772501

传真：0791-6789414

网站：www.scstock.com

(25) 华西证券有限责任公司

注册地址：四川省成都市陕西街239号

办公地址：深圳市深南大道4001号时代金融中心18楼（深圳总部）

法定代表人：张慎修

联系人：杨玲

电话：0755-83025430

传真：0755-83025991

客户服务电话：4008-888-818

网站：www.hx168.com.cn

(26) 东方证券股份有限公司

注册地址：上海市中山南路318号2号楼21层—29层

法定代表人：王益民

联系人：吴宇

电话：021-63325888

传真：021-63327888

客户服务热线：95503

网站：www.dfzq.com.cn

(27) 国盛证券有限责任公司

注册地址：江西省南昌市永叔路15号

办公地址：江西省南昌市永叔路15号信达大厦10-13楼

法定代表人：管荣升

联系电话：0791-6285337

联系人：徐美云

网站：www.gsstock.com

(28) 国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦

法人代表人：何如

联系人：林建闽

电话：0755-82133066

传真：0755-82133302

客户服务电话：800-810-8868

网站：www.guosen.com.cn

(29) 渤海证券股份有限公司

办公地址：天津市河西区宾水道3号

法定代表人：张志军

联系人：徐焕强

联系电话：022-28451883

客户服务电话：022-28455588

网站：www.ewww.com.cn

## (30) 华泰联合证券有限责任公司

注册地址：深圳市罗湖区深南东路5047号深圳发展银行大厦10、25层

法定代表人：马昭明

联系人：盛宗凌

电话：0755-82492000

传真：0755-82492062

客户服务电话：400-8888-555、0755-25125666

网站：www.lhzq.com

## (31) 广州证券有限责任公司

注册地址：广州市先烈中路69号东山广场主楼5楼

法定代表人：吴志明

联系人：樊刚正

电话：020-87323735

传真：020-87325036

客户服务电话：020-961303

网站：www.gzs.com.cn

## (32) 世纪证券有限责任公司

注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦40-42楼

办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦40-42楼

法定代表人：段强

联系人：章磊，刘军辉

电话：0755-83199511

传真：0755-83199545

客户服务电话：0755-83199511

网站：www.cscs.com.cn

## (33) 齐鲁证券有限责任公司

注册地址：山东省济南市经十路128号

办公地址：山东省济南市经十路128号

法定代表人：李炜

电话：0531-81283728

传真：0531-81283735

联系人：傅咏梅



网址: [www.qlzq.com.cn](http://www.qlzq.com.cn)

客服电话: 0531-82084184

(34) 安信证券股份有限公司

住所: 深圳市福田区金田路2222号安联大厦34层、28层A02单元

法定代表人: 牛冠兴

电话: 0755-82825555

传真: 0755-82825560

联系人: 李瑾

客服电话: 020-96210

网址: [www.axzq.com.cn](http://www.axzq.com.cn)

(35) 光大证券股份有限公司

注册地址: 上海市静安区新闻路1508号

办公地址: 上海市静安区新闻路1508号

法定代表人: 王明权

电话: 021-68816000

传真: 021-68815009

联系人: 刘晨

客服电话: 10108998

公司网址: [www.ebscn.com](http://www.ebscn.com)

(36) 东海证券有限责任公司

注册地址: 常州延陵西路59号常信大厦18、19楼

办公地址: 上海市浦东区东方路989号中达广场17楼

法定代表人: 朱科敏

电话: 021-50586660

传真: 021-50586660-8880

联系人: 邵一明

客服电话: 0519-8166222、0379-64912266

网址: [www.longone.com.cn](http://www.longone.com.cn)

(37) 恒泰证券有限责任公司

注册地址: 内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号

办公地址: 内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号

法定代表人: 刘汝军

电话：0471-4913998

传真：0471-4930707

联系人：常向东

客服电话：0471-4961259

网址：www.cnht.com.cn

（38）华泰证券股份有限公司

注册地址：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦

法定代表人：吴万善

电话：025-84457777-950、248

联系人：李金龙、张小波

客户咨询电话：025-84579897

网址：www.htsc.com.cn

（39）中信万通证券有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区香港东路316号

办公地址：青岛市东海西路28号

法定代表人：史洁民

联系电话：0532-85022026

传真：0532-85022026

联系人：丁韶燕

客户服务电话：0532-96577

公司网址：www.zxwt.com.cn

（40）国元证券股份有限公司

注册地址：安徽省合肥市寿春路179号

办公地址：安徽省合肥市寿春路179号

法定代表人：凤良志

电话：0551-2207114

联系人：程维

客户服务电话：全国统一热线4008888777，安徽省内热线96888

网址：www.gyzq.com.cn

（41）中国建银投资证券有限责任公司

注册地址：深圳福田区益田路与福华三路交界处深圳国际商会中心48-50层

法定代表人：杨小阳

电话：0755-82026521

联系人：刘权

客服电话：400-600-8008

网址：www.cjis.cn

（42）西部证券股份有限公司

注册地址：西安市东大街232号陕西信托大厦16-17层

地址：西安市东大街232号陕西信托大厦16-17层

法定代表人：刘建武

电话：029-87406172

传真：029-87406387

客服热线：029-87419999

联系人：黄晓军

网址：www.westsecu.com.cn

（43）长江证券股份有限公司

地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦

法定代表人：胡运钊

联系人：李良

电话：027-65799999

传真：027-85481900

客服热线：4008-888-999或027-85808318

网址：www.cjsc.com

（44）日信证券有限责任公司

注册地址：内蒙古呼和浩特市锡林南路18号

法定代表人：洪明

联系人：张利军

联系电话：0471-6292465，010-88086830-652

传真：010-88086637

网址：www.rxzq.com.cn

（45）华宝证券有限责任公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路166号27层

法定代表人：陈林

联系人：楼斯佳

电话：021-50122222

传真：021-50122200

客户服务电话：4008209898

网址：www.cnhbstock.com

基金管理人可以根据情况变化增加或者减少代销机构，并另行公告。销售机构可以根据情况变化增加或者减少其销售城市、网点，并另行公告。

## **(二) 基金注册登记人**

名称：长城基金管理有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心41层

办公地址：深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心41层

法定代表人：杨光裕

电话：0755-23982338

传真：0755-23982328

联系人：张真珍、徐涛国

客户服务电话：400-8868-666

## **(三) 律师事务所与经办律师**

律师事务所名称：北京市金杜律师事务所

注册地址：北京市朝阳区东三环中路39号建外SOHO A座31层

负责人：王玲

经办律师：靳庆军、宋萍萍

电话：0755-22163333

传真：0755-22163380

联系人：宋萍萍

## **(四) 会计师事务所和经办注册会计师**

会计师事务所名称：安永华明会计师事务所

注册地址：中国北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼(即东三办公楼)16层

法定代表人：葛明

经办注册会计师：李地、樊淑华

联系人：涂珮施

电话：010-58153000

传真：010-85188298

#### 四、基金的名称

本基金名称：长城久恒平衡型证券投资基金

#### 五、基金的类型

本基金类型：契约型开放式

#### 六、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定增长。

#### 七、投资对象

本基金的投资对象为具有良好流动性的金融工具，主要包括国内依法发行、上市的股票、债券以及经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。

#### 八、投资策略

本基金以资产配置作为控制风险、获得超额收益的核心手段，通过资产的动态配置、股票资产的风格调整以及证券选择三个层次进行投资管理。

资产配置策略：根据基金的风险约束条件，运用均值方差理论，得到基金资产的基准配置比例，在此基础上结合当期市场状况采用合适的战术资产调整策略。

风格调整策略：按照中信风格指数的构成方式划分风格资产、确定各风格资产的基础投资比例，并根据风格资产收益率的向量自回归模型进行动态调整。

证券选择策略：在各个风格资产内的适度分散化策略。

选股标准：在各个风格资产内部分别选择同时满足以下条件的上市公司构成风格资产股票库：

- 1、非ST类上市公司；
- 2、经营活动产生的现金流量净额为正的上市公司；
- 3、主营业务利润贡献率排名居前四分之三的上市公司。

对于范围以外的股票，本基金将根据上市公司基本面结合二级市场走势，有选择地纳入研究范围，但该部分投资不会作为基金投资的重点。

#### 九、业绩比较基准

本基金选取的比较基准是70%×中信综指+30%×中信国债指数。

#### 十、基金的风险收益特征

本基金的总体风险水平力求控制在市场风险的50%-60%左右；根据历史数据进行模拟投资结果表

明，盈利概率为95.56%，盈利高于一年定期存款利率的概率为91.46%。

## 十一、投资组合报告

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4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。

本投资组合报告所载数据截至2010年3月31日，本报告中所列财务数据未经审计。

### 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	156,384,476.59	59.70
	其中：股票	156,384,476.59	59.70
2	固定收益投资	76,877,800.00	29.35
	其中：债券	76,877,800.00	29.35
	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	14,691,961.35	5.61
6	其他资产	13,994,566.37	5.34
7	合计	261,948,804.31	100.00

### 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、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	70,093,932.82	27.45
C0	食品、饮料	13,493,824.38	5.29
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	17,649,740.00	6.91
C7	机械、设备、仪表	37,310,222.30	14.61
C8	医药、生物制品	1,640,146.14	0.64
C99	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	17,438,933.37	6.83
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	12,046,472.50	4.72
I	金融、保险业	56,805,137.90	22.25
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	156,384,476.59	61.25

### 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	000581	威孚高科	989,132	18,793,508.00	7.36
2	600875	东方电气	416,574	18,516,714.30	7.25
3	600111	包钢稀土	629,000	17,649,740.00	6.91
4	601318	中国平安	350,000	17,640,000.00	6.91
5	601111	中国国航	1,398,471	17,438,933.37	6.83
6	600000	浦发银行	668,347	15,224,944.66	5.96
7	000858	五粮液	479,014	13,493,824.38	5.29
8	600015	华夏银行	967,192	12,399,401.44	4.86
9	600785	新华百货	408,355	12,046,472.50	4.72
10	601328	交通银行	904,685	7,490,791.80	2.93

### 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	76,877,800.00	30.11
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	76,877,800.00	30.11

### 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	010004	20 国债(4)	410,000	41,114,800.00	16.10
2	010112	21 国债(12)	350,000	35,763,000.00	14.01

#### 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资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

#### 8 投资组合报告附注

8.1 本报告期内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。

8.2 基金投资的前十名股票中，未有投资于超出基金合同规定备选股票库之外股票。

#### 8.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	228,948.61
2	应收证券清算款	12,246,524.16
3	应收股利	-
4	应收利息	1,460,194.04
5	应收申购款	58,090.98
6	其他应收款	808.58
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,994,566.37

#### 8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的股票。

### 十二、基金的业绩

过往一定阶段长城久恒净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较  
(截止2010年3月31日)

时间段	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
2003年度	3.89%	0.48%	4.50%	0.86%	-0.61%	-0.38%
2004年度	-2.69%	0.96%	-12.56%	0.95%	9.87%	0.01%
2005年度	5.03%	0.99%	-4.16%	0.99%	9.19%	0.00%
2006年度	115.54%	1.11%	70.68%	0.99%	44.86%	0.12%



2007年度	76.88%	1.61%	102.06%	1.60%	-25.18%	0.01%
2008年度	-34.96%	1.46%	-47.68%	2.12%	12.72%	-0.66%
2009年度	37.83%	1.15%	68.32%	1.42%	-30.49%	-0.27%
基金合同生效日至 2010年3月31日	238.09%	1.21%	164.59%	1.39%	73.50%	-0.18%

基金的过往业绩并不预示其未来表现，基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

### 十三、基金的费用概览

#### (一) 与基金运作有关的费用

##### 1、基金费用的种类

- (1) 基金管理人的管理费；
- (2) 基金托管人的托管费；
- (3) 证券交易费用；
- (4) 基金法定信息披露费用；
- (5) 基金持有人大会费用；
- (6) 与基金相关的会计师费和律师费；
- (7) 按照国家有关规定可以列入的其它费用。

##### 2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

###### (1) 基金管理人的管理费

基金管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计算。计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应支付的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

###### (2) 基金托管人的托管费

基金托管费按前一日的基金资产净值的2.5%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 2.5\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发

送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

(3) 上述(一)中(3)至(7)项费用由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付，列入当期基金费用。

### 3、不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金资产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。

4、基金管理人和基金托管人可磋商酌情调低基金管理费和基金托管费，此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。

## (二) 与基金销售有关的费用

### 1、申购费

申购费用由基金申购人承担，归基金管理人及代销机构所有，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

#### (1) 前端申购费

申购金额（元）	前端申购费率
$1,000 \leq M < 100$ 万	1.2%
$100$ 万 $\leq M < 500$ 万元	0.9%
$500$ 万 $\leq M < 1000$ 万元	0.3%
$1000$ 万元 $\leq M$	每笔收取固定费用1000元

申购份额的计算方式：

本基金的申购金额包括申购费用和净申购金额。其中，

净申购金额 = 申购金额 / (1 + 申购费率)，对于1000万元（含）以上的申购，净申购金额 = 申购金额 - 固定申购费金额

申购费用 = 申购金额 - 净申购金额

申购份数 = 净申购金额 / T日基金份额净值

例：某投资者投资5,000元申购本基金，对应费率为1.2%，假设申购当日基金份额净值为1.066元，则其可得到的申购份额数为：

净申购金额 =  $5,000 / (1 + 1.2\%) = 4,940.71$

申购费用 =  $5,000 - 4,940.71 = 59.29$

申购份数 =  $4,940.71 / 1.066 = 4,634.81$

即：投资者投资5,000元申购本基金，假设申购当日基金份额净值为1.066元，则可得到4,634.81份基金份额。

例：某投资者投资100万元申购本基金，对应费率为0.9%，假设申购当日基金份额净值仍为1.066元，则其可得到的申购份额为：

$$\text{净申购金额} = 1,000,000 / (1 + 0.9\%) = 991,080.28$$

$$\text{申购费用} = 1,000,000 - 991,080.28 = 8,919.72$$

$$\text{申购份数} = 991,080.28 / 1.066 = 929,718.84$$

即：投资者投资100万元申购本基金，假设申购当日基金份额净值也是1.066元，则可得到929,718.84份基金份额。

## (2) 后端申购费

持有基金时间	后端申购费率
1年以内	1.5%
满1年不满2年	1.2%
满2年不满3年	0.9%
满3年不满4年	0.6%
满4年不满5年	0.3%
满5年后	0

注：以上的持有基金的起始时间为投资者申购确认之日。

后端申购费的计算基数为本次要赎回的基金份额在当初购买时所需的申购金额，计算方法为：当初购买本次赎回份额的申购资金总额－申购资金总额/（1＋后端申购费率）。

举例说明，某投资人提出申购请求，申购金额为10000元，当日基金份额净值为1.100元，3年后申请赎回，基金份额净值为1.800元。则在前端收费和后端收费模式下，计算结果如下（本例中数据皆为假设，并不作为判断基金可能收益的依据）：

	前端收费	后端收费
申购金额 (A)	10000.00	10000.00
申购份额 (B=A/(1+前端申购费率*)/1.1)	8983.11	9090.91
总赎回金额 (C=B×1.8)	16169.60	16363.64
申购费率 (D)	1.2%	0.6%
申购费用 (E=A-A/(1+D))	118.58	59.64
赎回费用 (F=C×0.5%)	80.85	81.82
净赎回金额 (前端: G=C-F, 后端: G=C-E-F)	16088.75	16222.18

注\*：采取后端收费时，前端申购费率为0。

## 2、赎回费

(1) 赎回费率为赎回金额的0.5%，赎回费用由基金赎回人承担。自2004年7月1日起将赎回费用中归入基金资产部分的比例提高到赎回费用总额的25%，其余部分作为注册登记费和其他手续费支出。

(2) 基金赎回支付金额的计算

本基金的赎回支付金额为赎回金额扣减赎回费用。其中：

赎回金额 = 赎回当日基金份额净值 × 赎回份额

赎回费用 = 赎回当日基金份额净值 × 赎回份额 × 赎回费率

赎回支付金额 = 赎回金额 - 赎回费

例：某投资者赎回本基金1万份基金份额，赎回费率为0.5%，假设赎回当日基金份额净值是1.066元，则可得到的赎回支付金额为：

赎回金额 =  $1.066 \times 10,000 = 10,660$

赎回费用 =  $1.066 \times 10,000 \times 0.5\% = 53.30$ 元

赎回支付金额 =  $10660 - 53.30 = 10,606.70$ 元

即：投资者赎回本基金1万份基金份额，假设赎回当日基金份额净值是1.066元，则其可得到的赎回支付金额为10,606.70元。

### 3、转换费用

(1) 基金转换费用由转出基金的赎回费和转出与转入基金的申购费补差二部分构成，具体收取情况视每次转换时两只基金的申购费率差异情况和赎回费率而定。基金转换费用由基金份额持有人承担。

转入份额保留到小数点后两位，剩余部分舍去，舍去部分所代表的资产归转入基金财产所有。

①如转入基金的申购费率 > 转出基金的申购费率

转出金额 = 转出基金份额 × 转出基金当日基金份额净值

转出基金赎回费 = 转出金额 × 转出基金赎回费率

转入总金额 = 转出金额 - 转出基金赎回费

转入基金申购费补差费率 = 转入基金适用申购费率 - 转出基金适用申购费率

转入基金申购费补差 = 转入总金额 - 转入总金额 / (1 + 转入基金申购费补差费率)

转入净金额 = 转入总金额 - 转入基金申购费补差

转入份额 = 转入净金额 / 转入基金当日基金份额净值

基金转换费 = 转出基金赎回费 + 转入基金申购费补差

②如转出基金的申购费率 ≥ 转入基金的申购费率

基金转换费用 = 转出金额 × 转出基金赎回费率

(2)对于实行级差申购费率(不同申购金额对应不同申购费率的基金),以转入总金额对应的转出基金申购费率、转入基金申购费率计算申购补差费用;如转入总金额对应转出基金申购费或转入基金申购费为固定费用时,申购补差费用视为0。

(3)转出基金赎回费的25%计入转出基金资产。

(4)计算基金转换费用所涉及的申购费率和赎回费率均按基金合同、更新的招募说明书规定费率执行,对于通过本公司网上交易、费率优惠活动期间发生的基金转换业务,按照本公司最新公告的相关费率计算基金转换费用。

基金管理人可以根据市场情况在不违背有关法律、法规和基金合同的规定之前提下,调整上述收费方式和费率水平,但最迟应于新收费办法开始实施日前3个工作日在至少一种中国证监会指定媒体上公告。

### (三) 基金税收

本基金运作过程中的各类纳税主体,依照国家法律法规的规定,履行纳税义务。

## 十四、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》等法律法规及《长城久恒平衡型证券投资基金基金合同》的要求,并结合本基金管理人对基金实施的投资管理活动,对2009年12月11日刊登的本基金更新的招募说明书进行了更新,更新的主要内容如下:

- 1、在第三部分“基金管理人”中,更换了基金经理与其相关资料。
- 2、在第四部分“基金托管人”中,更新了基金托管人基本情况和基金托管业务经营情况的内容。
- 3、在第五部分“相关服务机构”中,更新了部分代销机构的全称、联系方式等内容。
- 4、在第八部分“基金的投资管理”中,更新了投资组合报告内容,披露了截至2010年3月31日的的数据。
- 5、在第九部分“基金的业绩”中,披露了截至2010年3月31日本基金的业绩数据。
- 6、在第二十一部分“其他应披露的事项”中,披露了本期已刊登的公告内容。

长城基金管理有限公司

二〇一〇年六月十日