

# 长城久利保本混合型证券投资基金

## 2013年第二季度报告

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:2013年7月18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约定，于2013年07月15日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配政策等信息，保证复核结果与本基金的实际情况相符，并无重大遗漏。

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。

本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。

本报告期基金费用已经审计。

本基金报告期2013年04月18日起至2013年6月30日止。

### § 2 基金产品概况

基金简称 长城久利保本

基金主代码 000030

交易代码 000030

基金运作方式 约定型开放式

基金合同生效日 2013年4月18日

报告期末基金份额总额 914,892,252.42份

投资目标 本基金严格控制风险，在确保本基金周期到期时本金安全的基础上，力争实现基金资产的稳定增值。

投资策略 固定比例组合保险策略(CPP)·时间不变性投资组合保险策略(TIPP)

业绩比较基准 3个月期银行定期存款税后收益率

风险收益特征 本基金为保本混合型基金，属于证券投资基金中的低风险品种

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

基金保证人 中国投资担保有限公司

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

报告期(2013年4月18日-2013年6月30日)

1.本期已实现收益 3,997,370.76

2.本期利润 -5,687,984.05

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0661

4.期末基金资产净值 909,246,122.05

5.期末基金份额净值 0.994

注:①本期已实现收益指本基金本期利息收入、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，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

②上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的费用，计算费用后实际收益水平将低于所列数字。

③2.期末基金资产净值以2013年4月18日生效，截至报告期末，基金合同尚未满一个季度。

④2.期末基金资产净值以2013年4月18日生效，截至报告期末，基金合同尚未满一个季度。

⑤.2.1 本基金报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 业绩比较基准收益率② 收益率差③ 收益率差标准差④ ①-③ ②-④

2013年4月18日至6月30日 -0.60% 0.15% 0.86% 0.01% -1.46% 0.14%

3.2.2 基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金简称 长城久利保本混合型证券投资基金

报告期(2013年4月18日至2013年6月30日)

净值增长率 14,317,804.68

业绩比较基准收益率 14,317,804.68

净值增长率与业绩比较基准收益率的差值 14,317,804.68

净值增长率与业绩比较基准收益率的差值标准差 1.53

净值增长率与业绩比较基准收益率的差值与差值标准差的比值 1.5