

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10月23日

## § 1 重要提示

本基金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，并对其中内容的真实性、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2013年10月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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。

本报告期中财务资料未经审计。

本报告期自2013年07月01日起至09月30日止。

## § 2 基金产品概况

报告期(2013年7月1日-2013年9月30日)

## § 3 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2013年7月1日-2013年9月30日)

1.本期已实现收益 16,199,760.78

2.本期利润 9,046,001.63

3.加权平均基金份额本期利润 0.0966

4.期末基金份额净值 1,307,586.9411

5.期末基金份额净值 1.032

注:1)本期已实现收益指基金本期利息收入、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各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数据。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 0.58% 0.12% 1.07% 0.01% -0.49% 0.11%

3.2.2 自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

注:本基金合同规定本基金投资组合为:股票、债券及风险资产占基金资产的比例不高于40%;债券、银行存款等安全资产占基金资产的比例不低于60%,其中现金或到期日在一年以内的政府债券资产比例不超过5%。本基金的建仓期为自基金合同生效之日起6个月内,建仓期间,各项资产配置比例均符合基金合同约定。

## § 4 管理人报告

基金管理人:长城基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

报告送出日期:2013年10月23日

## § 1 重要提示

本基金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，并对其中内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

本基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2013年10月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年07月01日起至09月30日止。

## § 2 基金产品概况

报告期(2013年7月1日-2013年9月30日)

## § 3 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2013年7月1日-2013年9月30日)

1.本期已实现收益 5,944,466.74

2.本期利润 5,944,466.74

3.加权平均基金份额本期利润 0.0104

4.期末基金份额净值 579,045.9170

5.期末基金份额净值 1.015

注:1)本期已实现收益指基金本期利息收入、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各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数据。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 1.00% 0.04% 0.83% 0.01% 0.17% 0.03%

基金管理人:长城基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

报告送出日期:2013年10月23日

## § 1 重要提示

本基金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，并对其中内容的真实性、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2013年10月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年07月01日起至09月30日止。

## § 2 基金产品概况

报告期(2013年7月1日-2013年9月30日)

## § 3 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2013年7月1日-2013年9月30日)

1.本期已实现收益 4,449,223.63

2.本期利润 4,853,011.22

3.加权平均基金份额本期利润 0.0949

4.期末基金份额净值 57,443,457.89

5.期末基金份额净值 1.095

注:1)本期已实现收益指基金本期利息收入、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各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数据。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 7.04% 1.70% 7.40% 1.15% -0.36% 0.55%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

注:本基金合同规定本基金投资组合为:股票、债券及风险资产占基金资产的比例不高于40%;债券、银行存款等安全资产占基金资产的比例不低于60%,其中现金或到期日在一年以内的政府债券资产比例不超过5%。本基金的建仓期为自基金合同生效之日起6个月内,建仓期间,各项资产配置比例均符合基金合同约定。

## 长城保本混合型证券投资基金

## 2013年第3季度报告

2013年07月01日起至09月30日止

## § 1 基金经理(或基金经理)简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期限 证券从业年限 说明

钟光正 公司固定收益部副总监、长城保本混合型基金和长城保本混合型债券基金的基金经理 2012年8月2日 4年

于雷 长城量化升级股票基金经理 2013年3月29日 5年

注:1)上述任职日期、离任日期根据公司做出决定的任免日期填写。  
2)上述从不同机构转任董事、监事或高级管理人员的日期遵从证券业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

3.2.1 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 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 0.58% 0.12% 1.07% 0.01% -0.49% 0.11%

3.2.2 自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

注:本基金合同规定本基金投资组合为:股票、债券及风险资产占基金资产的比例不高于40%;债券、银行存款等安全资产占基金资产的比例不低于60%,其中现金或到期日在一年以内的政府债券资产比例不超过5%。本基金的建仓期为自基金合同生效之日起6个月内,建仓期间,各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3.3 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2013年7月1日-2013年9月30日)

1.本期已实现收益 16,199,760.78

2.本期利润 9,046,001.63

3.加权平均基金份额本期利润 0.0966

4.期末基金份额净值 1,307,586.9411

5.期末基金份额净值 1.032

注:1)本期已实现收益指基金本期利息收入、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各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数据。

3.2.3 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 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 0.58% 0.12% 1.07% 0.01% -0.49% 0.11%

3.2.4 自基金合同生效以来基金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

注:本基金合同规定本基金投资组合为:股票、债券及风险资产占基金资产的比例不高于40%;债券、银行存款等安全资产占基金资产的比例不低于60%,其中现金或到期日在一年以内的政府债券资产比例不超过5%。本基金的建仓期为自基金合同生效之日起6个月内,建仓期间,各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3.3 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2013年7月1日-2013年9月30日)

1.本期已实现收益 16,199,760.78

2.本期利润 9,046,001.63

3.加权平均基金份额本期利润 0.0966

4.期末基金份额净值 1,307,586.9411

5.期末基金份额净值 1.032

注:1)本期已实现收益指基金本期利息收入、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各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数据。

3.2.5 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 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 0.58% 0.12% 1.07% 0.01% -0.49% 0.11%

3.2.6 自基金合同生效以来基金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

注:本基金合同规定本基金投资组合为:股票、债券及风险资产占基金资产的比例不高于40%;债券、银行存款等安全资产占基金资产的比例不低于60%,其中现金或到期日在一年以内的政府债券资产比例不超过5%。本基金的建仓期为自基金合同生效之日起6个月内,建仓期间,各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3.3 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2013年7月1日-2013年9月30日)

1.本期已实现收益 16,199,760.78

2.本期利润 9,046,001.63

3.加权平均基金份额本期利润 0.0966

4.期末基金份额净值 1,307,586.9411

5.期末基金份额净值 1.032

注:1)本期已实现收益指基金本期利息收入、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各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数据。

3.2.7 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