

长城保本混合型证券投资基金

[2013] 第四季度报告

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:2014年1月22日

重要提示

本基金的董事会及董事保证本报告不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对内容的真实性、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的规定,于2014年1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。

本基金报告期财务资料未经审计。

本基金报告期自2013年10月01日起至2013年12月31日止。

§ 1 基金产品概况

长城保本混合基金

基金主代码 200016

交易代码 200016

基金运作方式 约定开放式

基金合同生效日 2012年8月2日

报告期末基金份额总额 1,067,817,292.16份

本基金采用固定比例组合保险策略进行资产配置,在确保资产安全的前提下,力争实现基金资产的稳定增值。

本基金采用保本混合型基金,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

3.1 主要财务指标

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)

1.本期已实现收益 5,250,006.01

2.本期利润 -1,091,472.97

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0099

4.期末基金资产净值 1,100,591,111.42

5.期末可供分配基金份额 1,031

注:本基金采用固定比例组合保险策略进行资产配置,在确保资产安全的前提下,力争实现基金资产的稳定增值。

②上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计价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 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -0.10% 0.18% 1.07% 0.01% -1.17% 0.17%

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

注:本基金合同规定本基金投资组合为股票、权证等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%,其余现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%。本基金的建仓期为自本基金合同生效之日起6个月,建仓期间,各项资产配置比例符合基金合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)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经理,长城保本混合型基金基金经理,长城保本混合型基金的基金经理 2012年8月2日 - 4年

于雷 长城优化升级股票型基金基金经理,长城保本混合型基金基金经理 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的任免日期填写。

②本基金从任职日期的计算方法遵从证券业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金报告期内基金经理严格遵守了《证券投资基金法》、《长城保本混合型证券投资基金基金合同》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,在控制和防范风险的基础上为基金份额持有人谋取最大的利益,未出现违反法律法规、基金合同和相关规定的现象,无损公司及基金份额持有人的利益。

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。

本基金报告期财务资料未经审计。

本基金报告期自2013年10月01日起至2013年12月31日止。

§ 5 报告期末按行业分类的股票投资组合

注:本基金未按行业分类的股票投资组合不存在。

5.1 报告期末基金资产组合情况

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)

1.本期已实现收益 5,250,006.01

2.本期利润 -1,091,472.97

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0099

4.期末基金资产净值 1,100,591,111.42

5.期末可供分配基金份额 1,031

注:本基金采用固定比例组合保险策略进行资产配置,在确保资产安全的前提下,力争实现基金资产的稳定增值。

②上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计价费用后实际收益水平要低于所列数据。

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 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -0.10% 0.18% 1.07% 0.01% -1.17% 0.17%

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

注:本基金合同规定本基金投资组合为股票、权证等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%,其余现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%。本基金的建仓期为自本基金合同生效之日起6个月,建仓期间,各项资产配置比例符合基金合同约定。

§ 6 开放式基金份额变动

6.1 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本基金的基金管理人于本报告期未运用固有资金投资于本基金。

6.2 备查文件目录

8.1 本基金投资等价物品种类及名称

8.2 《长城保本混合型证券投资基金基金合同》

8.3 《长城保本混合型证券投资基金基金托管协议》

8.4 法律意见书

8.5 基金管理人业务资格批件、营业执照

8.6 基金托管人业务资格批件、营业执照

8.7 中国证监会规定的其他文件

8.8 其他

8.9 中国证监会规定的其他文件

8.10 中国证监会规定的其他文件

8.11 中国证监会规定的其他文件

8.12 《长城保本混合型证券投资基金基金合同》

8.13 《长城保本混合型证券投资基金基金托管协议》

8.14 法律意见书

8.15 基金管理人业务资格批件、营业执照

8.16 基金托管人业务资格批件、营业执照

8.17 中国证监会规定的其他文件

8.18 中国证监会规定的其他文件

8.19 中国证监会规定的其他文件

8.20 中国证监会规定的其他文件

8.21 中国证监会规定的其他文件

8.22 中国证监会规定的其他文件

8.23 中国证监会规定的其他文件

8.24 中国证监会规定的其他文件

8.25 中国证监会规定的其他文件

8.26 中国证监会规定的其他文件

8.27 中国证监会规定的其他文件

8.28 中国证监会规定的其他文件

8.29 中国证监会规定的其他文件

8.30 中国证监会规定的其他文件

8.31 中国证监会规定的其他文件

8.32 中国证监会规定的其他文件

8.33 中国证监会规定的其他文件

8.34 中国证监会规定的其他文件

8.35 中国证监会规定的其他文件

8.36 中国证监会规定的其他文件

8.37 中国证监会规定的其他文件

8.38 中国证监会规定的其他文件

8.39 中国证监会规定的其他文件

8.40 中国证监会规定的其他文件

8.41 中国证监会规定的其他文件

8.42 中国证监会规定的其他文件

8.43 中国证监会规定的其他文件

8.44 中国证监会规定的其他文件

8.45 中国证监会规定的其他文件

8.46 中国证监会规定的其他文件

8.47 中国证监会规定的其他文件

8.48 中国证监会规定的其他文件

8.49 中国证监会规定的其他文件

8.50 中国证监会规定的其他文件

8.51 中国证监会规定的其他文件

8.52 中国证监会规定的其他文件

8.53 中国证监会规定的其他文件

8.54 中国证监会规定的其他文件

8.55 中国证监会规定的其他文件

8.56 中国证监会规定的其他文件

8.57 中国证监会规定的其他文件

8.58 中国证监会规定的其他文件

8.59 中国证监会规定的其他文件

8.60 中国证监会规定的其他文件

8.61 中国证监会规定的其他文件

8.62 中国证监会规定的其他文件

8.63 中国证监会规定的其他文件

8.64 中国证监会规定的其他文件

8.65 中国证监会规定的其他文件

8.66 中国证监会规定的其他文件

8.67 中国证监会规定的其他文件

8.68 中国证监会规定的其他文件

8.69 中国证监会规定的其他文件

8.70 中国证监会规定的其他文件

8.71 中国证监会规定的其他文件

8.72 中国证监会规定的其他文件

8.73 中国证监会规定的其他文件

8.74 中国证监会规定的其他文件

8.75 中国证监会规定的其他文件

8.76 中国证监会规定的其他文件

8.77 中国证监会规定的其他文件

8.78 中国证监会规定的其他文件

8.79 中国证监会规定的其他文件

8.80 中国证监会规定的其他文件

8.81 中国证监会规定的其他文件

8.82 中国证监会规定的其他文件

8.83 中国证监会规定的其他文件

8.84 中国证监会规定的其他文件

8.85 中国证监会规定的其他文件

8.86 中国证监会规定的其他文件

8.87 中国证监会规定的其他文件

8.88 中国证监会规定的其他文件

8.89 中国证监会规定的其他文件

8.90 中国证监会规定的其他文件

8.91 中国证监会规定的其他文件

8.92 中国证监会规定的其他文件

8.93 中国证监会规定的其他文件

8.94 中国证监会规定的其他文件

8.95 中国证监会规定的其他文件

8.96 中国证监会规定的其他文件

8.97 中国证监会规定的其他文件

8.98 中国证监会规定的其他文件

8.99 中国证监会规定的其他文件

8.10 中国证监会规定的其他文件

8.11 中国证监会规定的其他文件

8.12 中国证监会规定的其他文件

8.13 中国证监会规定的其他文件

8.14