（上接B26版）

2）风险乘数M值的调整方式和投资决策流程

根据CPPI投资策略，在风险乘数M值保持固定时，根据投资组合资产净值的变化，本基金需要动态调整安全资产、风险资产的比例。当市场波动较大时，为维持固定风险乘数M值，频繁的资产调整将给基金带来较高的交易成本；另一方面，预期未来市场环境将发生较大变化时，固定风险乘数M值可能会限制资产的灵活调整。

因此，本基金对于风险乘数M值采用定期调整与特殊情形下灵活调整相结合的方式。一般地，本基金根据研究部每月提交的投资策略报告，拟定下月风险乘数M值范围报投资决策委员会审批，之后根据投资决策委员会的决议，在风险乘数M值范围内进行灵活调整。另一方面，若已发生或预期将发生引起市场波动率急剧加大的事件，本基金亦将对风险乘数M值进行及时的调整。

风险乘数M值的投资决策流程分为以下三步：

第一步，研究部金融工程小组、宏观策略小组对宏观经济、证券市场从定量、定性两个方面进行分析，其中，定量分析是预测分析市场波动率等参数；定性分析包括宏观经济运行周期、财政及货币政策、利率走势、资金供需情况等分析。研究部为本基金提出投资策略报告，基金经理以此作为风险乘数M值的投资决策依据；对于可能对证券市场造成重大影响的突发事件，研究部及时提出投资建议。

第二步，基金经理参考研究部提交的投资策略报告，拟定基金风险乘数M值范围报投资决策委员会审批。

第三步，投资决策委员会对基金经理上报的风险乘数M值范围配置提案召开投资决策会议，投资决策委员会通过会议决议后，以书面形式下达给基金经理，由基金经理具体实施。

为控制风险，在投资管理过程中，本基金规定风险乘数M值不超过3。

②）TIPP投资策略

当保本期间基金资产上涨时，投资者的需求不仅是保证本金的安全，而且还要求将基金的收益能得到一定程度的锁定，使期末得到的回报回避其后市场下跌的风险。因此，在CPPI策略的基础上引入TIPP策略。

TIPP的投资策略是改进CPPI中安全底线的调整方式，当投资组合的价值上升时，安全底线随着收益水平进行调整，即每当收益率达到一定的比率，则将安全底线相应提高一定的比例。这样无论以后市场如何变化，当前投资者所获的部分收益在期末都能得到保证。

TIPP在操作上大致与CPPI相同，唯一不同的是动态调整安全底线，并且这种调整一般只在投资组合盈利的情况下使用。TIPP策略相比CPPI策略可投资于风险资产的额度相应减少，因此多头行情期间获取潜在收益的能力会有所降低。总体来说，TIPP策略是一种较CPPI更为保守的策略。

2.安全资产投资策略

①）债券投资策略

本基金债券的收益主要来源于久期管理策略、收益率曲线策略、个券选择、跨市场套利以及把握市场低效或失效情况下的交易机会，主要包括以下几个方面：

1）久期管理策略

本基金建立了债券分析框架和量化模型，通过预测利率变化趋势，确定投资组合的目标平均久期，实现久期管理。

本基金将债券市场视为金融市场整体的一个有机部分，通过“自上而下”对宏观经济形势、财政与货币政策，以及债券市场资金供求等因素的分析，主动判断利率和收益率曲线可能移动的方向和方式，并据此确定资产组合的平均久期。

2）收益率曲线策略

本基金将在确定资产组合平均久期的基础上，根据利率期限结构的特点，以及收益率曲线斜率和曲度的预期变化，遵循风险调整后收益率最大化配比原则，建立最优化的债券投资组合，例如子弹组合、哑铃组合或阶梯组合等。

3）个券选择策略

本基金将通过对个券基本面和估值的研究，选择经信用风险或预期信用风险调整后收益率较高的个券，收益率相同情况下流动性较高的个券以及具有税收优势的个券。

在个券基本面分析方面，本基金重点关注：信用评级良好的个券，预期信用评级上升的个券和具有某些特殊优势条款的个券。在个券估值方面，本投资组合将重点关注估值合理的个券，信用利差充分反映债券发行主体的风险溢价要求的个券，经风险调整后的收益率与市场收益率曲线比较具有相对优势的个券。

4）跨市场套利

跨市场套利是指基金管理人从债券各子市场所具有的不同运行规律、不同参与主体和不同风险收益特征的差异中发掘套利机会，从而进一步增强债券组合的投资回报。本基金将在确定套利机会可行性的基础上，寻找合适的介入时机，进行一定的跨市场套利。

5）把握市场低效或失效状况下的交易机会

在市场低效或失效状况下，该基金将根据市场实际情况，积极运用各类套利以及优化策略对资产投资组合进行管理与调整，捕捉交易机会，以获取超额收益。

A.新券发行溢价策略

在特殊市场环境下，新券发行利率可能远高于市场合理收益率，在发行时认购新券可能获得超额收益。

B.信用利差策略

不同信用等级的债券存在合理的信用利差，由于短期市场因素信用利差可能暂时偏离均衡范围，从而出现短期交易机会。通过把握这样的交易机会可能获得超额收益。

C.可转换债券投资策略

当正股价格处于转定区间内时，可转换债券将表现出股性、债性或者股债混合的特性。本基金将对可转换债券对应的正股进行分析，从行业背景、公司基本面、市场情绪、期权价值等因素综合考虑可转换债券的投资机会，在价值权衡和风险评估的基础上审慎进行可转换债券的投资，创造超额收益。

D.中小企业私募债券投资策略

1）根据宏观经济环境及各行业的发展状况，优先投资于选择盈利能力稳定、经济周期波动性较弱行业中的企业，并根据行业特征、所处阶段等因素对于不同行业进行排序；

2）研究债券发行人的产业状况、市场竞争格局、行业政策、盈利能力、治理结构、特殊事件风险等基本面信息，综合评价公司的长期竞争能力和运作风险；

3）运用财务评价体系对债券发行人的资产流动性、盈利能力、偿债能力、现金流状况等方面进行综合评价，合理评估发行人财务风险；

4）利用债券和可获取的信贷历史数据、市场价格以及资产质量等信息，估算私募债券发行人的违约率，根据债券相关条款和可类比实际投资的回收情况，估算该债券的违约损失率；

5）债券评级的具体要求债券主体评级BBB+以上（含），债项评级A+以上（含），同时考察债券发行人的增信措施，如担保、抵押、质押、银行授信、偿债基金、有序偿债安排等；

6）综合发行人各方面分析结果，确定合理的信用利差水平，利用市场的相对失衡，选择溢价偏高、性价比较优的私募债品种进行投资。

基金投资中小企业私募债券，基金管理人将根据审慎原则，制定严格的投资决策流程、风险控制制度和信用风险、流动性风险处置预案，并经董事会批准，以防范信用风险、流动性风险等各种风险。

②）债券回购杠杆策略

本基金将在市场资金面和债券市场基本面分析的基础上结合个券分析和组合风险管理结果，积极参与债券回购交易，放大固定收益类资产投资比例，追求债券资产的超额收益。

3.风险资产投资策略

①）股票投资策略

本基金股票重点投资于具备内生性增长基础或具备外延式扩张能力的价值创造型企业。根据CPPI和TIPP策略，在股票投资限额之下，发挥基金管理人主动选股能力，控制股票资产下行风险，分享股票市场成长收益。

股票选择方面，本基金将充分发挥“自上而下”的主动选股能力，结合对宏观经济状况、行业成长空间、行业集中度、公司内生性增长动力的判断，选择具备外延式扩张能力的优势上市公司，结合财务与估值分析，深入挖掘盈利预期稳步上升、成长性发生根本变化且价值低估的上市公司，构建股票投资组合，同时通过选择流动性高、风险低、具备中期上涨潜力的股票进行分散化组合投资，动态优化股票投资组合，控制流动性风险和集中性风险，保证股票组合的稳定性和收益性。

②）新股申购策略

本基金将根据市场情况，适度参与新股申购（含增发新股），以增加收益。本基金组合的新股申购（含增发新股）策略主要是从上市公司基本面、估值水平、市场环境三方面选择新股申购的参与标的、参与规模和新股的卖出时机。通过深入分析新股上市公司的基本情况，结合新股发行当时的市场环境，根据可比公司股票的基本面因素和价格水平，预测新股在二级市场的合理定价及其发行价格，指导新股询价，在有效识别和防范风险的前提下，获取较高的低风险收益。

③）权证投资策略

本基金在进行权证投资时将在严格控制风险的前提下谋取最大的收益，以不改变投资组合的风险收益特征为首要条件，运用有关数量模型进行估值和风险评估，谨慎投资。

此外，该基金还将根据市场情况，适度参与新股申购（含增发新股），以增加收益。该基金组合的新股申购（含增发新股）策略主要体现在从上市公司基本面、估值水平、市场环境三方面选择新股申购的参与标的、参与规模和新股的卖出时机。通过深入分析新股上市公司的基本情况，结合新股发行当时的市场环境，根据可比公司股票的基本面因素和价格水平预测新股在二级市场的合理定价及其发行价格，指导新股询价，在有效识别和防范风险的前提下，获取较高的低风险收益。

如法律法规或监管机构今后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

十二、基金的业绩比较基准

（一）本基金在当期保本周期内或保本周期到期自动转为下一个保本周期，基金的业绩比较基准为：3年期银行定期存款税后收益率。

本基金是保本混合型基金，保本周期是3年，以三年期银行定期存款税后收益率作为本基金的业绩比较基准，基金管理人认为选择该业绩比较基准体现了本基金的风险收益特征，能够使投资者理性判断本基金产品的风险收益特征，合理衡量比较本基金保本保证的有效性。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，经与基金托管人协商一致，本基金可在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告，不需要召开基金份额持有人大会。

（二）若本基金保本周期到期后变更为“长城核心优选灵活配置混合型证券投资基金”，则基金的业绩比较基准为：55%×沪深300指数收益率+45%×中债总财富指数收益率。

沪深300指数选取了A股市场上规模最大、流动性最好的300只股票作为其成份股，较好地反映了A股市场的总体趋势，是目前市场上较有影响力的股票投资业绩比较基准。中债总财富指数的编制采用了银行间债券市场结算数据、交易所债券的成交数据、债券柜台的双边报价、银行间债券市场的双边报价以及市场成员收益率的估值数据，并参考了中国债券市场中部分核心成员的收益率估值数据，以更好地反映债券价格信息。中债总财富指数是目前市场上较有影响力的债券投资业绩比较基准。

该基金是混合型证券投资基金，对沪深300指数和中债总财富指数分别赋予55%和45%的权重符合该基金的投资特性。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，经与基金托管人协商一致，该基金可在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

十三、基金的风险收益特征

（一）本基金在当期保本周期内或保本周期到期自动转为下一个保本周期，基金的风险收益特征为：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。

（二）若本基金保本周期到期后变更为“长城核心优选灵活配置混合型证券投资基金”，则基金的风险收益特征为：该基金是混合型证券投资基金，其长期平均风险和预期收益率高于债券型基金、货币市场基金，低于股票型基金，为中高风险、中高收益的基金产品。

十四、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2013年11月6日复核了本投资组合报告，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本报告期自2013年4月18日起至6月30日止。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	14,317,804.68	1.53
	其中：股票	14,317,804.68	1.53
2	固定收益投资	685,975,198.14	73.47
	其中：债券	685,975,198.14	73.47
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	199,160,778.74	21.33
	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	17,509,914.90	1.88
6	其他资产	16,744,672.27	1.79
7	合计	933,708,368.73	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	采矿业	-	-
C	制造业	14,317,804.68	1.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
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	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	14,317,804.68	1.57

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	600261	阳光照明	159,904	2,027,582.72	0.22
2	300115	长盈精密	59,902	1,925,250.28	0.21
3	600498	烽火通信	100,000	1,648,000.00	0.18
4	002491	通鼎光电	129,945	1,561,938.90	0.17
5	002241	歌尔声学	40,000	1,451,600.00	0.16
6	600522	中天科技	150,000	1,266,000.00	0.14
7	002313	日海通讯	75,042	1,237,442.58	0.14
8	002415	海康威视	30,000	1,060,200.00	0.12
9	300207	欣旺达	45,926	812,890.20	0.09
10	300322	硕贝德	44,000	794,200.00	0.09

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	53,108,000.00	5.84
2	央行票据	-	-
3	金融债券	128,449,000.00	14.13
	其中：政策性金融债	128,449,000.00	14.13
4	企业债券	285,761,719.15	31.43
5	企业短期融资券	79,694,000.00	8.76
6	中期票据	49,786,000.00	5.48
7	可转债	89,176,478.99	9.81
8	其他	-	-
9	合计	685,975,198.14	75.44

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	100401	10农发01	500,000	49,675,000.00	5.46
2	130223	13国开23	500,000	49,260,000.00	5.42
3	019302	13国债02	480,000	47,856,000.00	5.26
4	122994	08云投债	313,840	31,475,013.60	3.46
5	0980123	09晋交投债	300,000	30,291,000.00	3.33

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.报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末进行股指期货投资，期末未持有股指期货。

8.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金尚未在基金合同中明确股指期货的投资策略、比例限制、信息披露方式等，暂不参与股指期货交易。

9.投资组合报告附注

9.1 本报告期内本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。

9.2 本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。

9.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	58,765.06
2	应收证券清算款	5,428,388.49
3	应收股利	-
4	应收利息	11,251,392.26
5	应收申购款	6,126.46
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,744,672.27

9.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	127001	海直转债	21,549,700.09	2.37
2	110003	新钢转债	15,622,500.00	1.72
3	113002	工行转债	15,495,864.60	1.70
4	110015	石化转债	13,701,293.20	1.51
5	110018	国电转债	10,210,600.00	1.12
6	110013	国投转债	7,138,671.10	0.79
7	113001	中行转债	3,503,850.00	0.39
8	110011	歌华转债	1,954,000.00	0.21

9.5 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未存在流通受限的情况。

9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

十五、基金的业绩

过往一定阶段本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

截至2013年6月30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
基金合同生效日至2013年6月30日	-0.60%	0.15%	0.86%	0.01%	-1.46%	0.14%

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。

十六、基金费用概览

（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）基金财产拨划支付的银行费用；

④）基金合同生效后的基金信息披露费用；

⑤）基金份额持有人大会费用；

⑥）基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；

⑦）基金的证券交易费用；

⑧）基金的开户费用、账户维护费用

⑨）法律法规及中国证监会规定的其他费用。

2.上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

3.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

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的1.2%年费率计提。计算方法如下：

H=E×年管理费率÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

若保本周期到期后，本基金不符合保本基金存续条件，转型为“长城核心优选灵活配置混合型证券投资基金”，则管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。

基金托管费每日计提，按月支付。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初五个工作日内、按照指定的帐户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

在保本周期到期操作期间和过渡期间，基金管理人和基金托管人免收本基金的管理费和托管费。

②）称管理费和托管费之外的基金费用，由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

（二）与基金销售有关的费用

1.申购费用

本基金的申购费率随申购金额的增加而递减，投资人在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。申购费率如下表所示：

申购金额（含申购费）	申购费率
50万元以下	1.2%
50万元（含）-200万元	0.8%
200万元（含）-500万元	0.4%
500万元以上（含）	每笔1000元

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500万元（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：投资者申购本基金10,000.00元，T日基金份额净值为1.100元，其获得的基金份额计算如下：

净申购金额=10,000.00/（1+1.2%）=9,881.42元

申购费用=10,000.00-9,881.42=118.58元

申购份额=9,881.42/1.100=8,983.11份

即投资者缴纳申购款10,000.00元，获得8,983.11份本基金的基金份额。

2.赎回费用

本基金的赎回费用按持有时间的增加而递减，费率如下：

持有期	赎回费率
1年以内	2.0%
1年（含）-2年	1.5%
2年（含）-3年	1.0%
3年（含）以上	0

本基金的赎回金额为赎回总额扣减赎回费用。其中，

赎回总额=赎回份数×T日基金份额净值

赎回费用=赎回总额×赎回费率

赎回金额=赎回总额-赎回费用

例：假定T日本基金的基金份额净值为1.150元，投资者赎回其持有的10,000份基金份额，持有满1年，则：

赎回总额=10,000×1.150=11,500.00元

赎回费用=11,500.00×1.5%=172.50元

赎回金额=11,500.00-172.50=11,327.50元

即投资者赎回其持有的10,000份本基金的基金份额，获得赎回金额11,327.50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

例：某投资者持有长城货币市场证券投资基金10万份基金份额，持有期为100天，决定转换为本基金，假设转换当日转入基金（本基金）份额净值是1.050元，转出基金（长城货币市场证券投资基金）对应赎回费率为0，申购补差费率为1.2%，则可得到的转换份额及基金转换费为：

转出金额=100,000×1=100,000元

转出基金赎回费=0

转入总金额=100,000-0=100,000元

转入基金申购费补差=100,000-100,000/（1+1.2%）=1,185.77元

转入净金额=100,000-1,185.77=98,814.23元

转入份额=98,814.23/1.050=94,108.79份

基金转换费=0+1,185.77=1,185.77元

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

例：某投资者持有长城货币市场证券投资基金，持有满2年，决定转换为长城货币市场证券投资基金，假设转换当日转出基金（本基金）份额净值是1.150元，转出基金对应赎回费率为1.0%，申购补差费率为0，则可得到的转换份额及基金转换费为：

转出金额=100,000×1.150=115,000元

转出基金赎回费=115,000×1.0%=1.150元

转入总金额=115,000-1,150=113,850元

转入基金申购费补差=0

转入净金额=113,850-0=113,850元

转入份额=113,850/1=113,850份

基金转换费=115,000×1.0%=1.150元

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率；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）赎出基金赎回费的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。

基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对以特定交易方式（如网上交易、电话交易等）等进行基金交易的投资人定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

4.本基金的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。赎回费用由基金赎回人承担，赎回费将按照赎回当时适用的费率收取，所收取赎回费的25%归入基金资产，其余部分作为注册登记费和其他手续费支出。

（三）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财产的损失，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。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

（四）基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施日2日前在指定媒体上刊登公告。

（五）基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

十七、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《长城久利保本混合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2013年3月13日刊登的本基金招募说明书进行了更新，更新的主要内容如下：

1、在“重要提示”中，调整了风险提示的相关内容；更新了招募说明书所载内容截止日期与有关财务数据、净值表现截止日期。

2、在第三部分“基金管理人”中，更新了基金管理人情况及主要人员情况。

3、在第四部分“基金托管人”中，更新了基金托管人的信息。

4、在第五部分“相关服务机构”中，更新了代销机构信息以及会计师事务所信息。

5、将原六、七部分合并为现在的第六部分“基金的募集与基金合同的生效”，并删除了基金合同生效前适用的内容。

6、在第七部分“基金份额的申购与赎回”中，更新了基金转换和定期定额投资的内容。

7、在第十一部分“基金的投资管理”中，增加了投资组合报告内容，按露截至2013年6月30日的数据。

8、增加了第十二部分“基金的业绩”数据，按露了截至2013年6月30日本基金的业绩数据。

9、在第十六部分“基金的费用与税收”中，增加了与基金销售有关的费用的内容。

10、在第二十四部分“其他应披露的事项”中，披露了本期已刊登的公告事项。

长城基金管理有限公司
二〇一三年十一月三十日

股票代码：002202　股票简称：金风科技　公告编号：2013-055
债券代码：112060　债券简称：12金风01

新疆金风科技股份有限公司关于召开２０１３年第二次临时股东大会的提示性公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

公司董事会于2013年11月2日在《证券时报》、巨潮资讯网（www.cninfo.com.cn）、香港联合交易所有限公司网站（www.hkexnews.hk）及本公司网站（www.goldwind.com.cn）上刊登了《关于召开公司2013年第二次临时股东大会的通知》，现发布本次股东大会的提示性公告，具体内容如下：

一、会议基本情况

1、会议时间：2013年12月17日（星期二）上午10:30

2、会议召集人：公司董事会

3、会议地点：新疆乌鲁木齐市经济技术开发区上海路107号公司本部会议室

4、会议召开方式：现场召开

5、股权登记日

①）A股股权登记日为2013年12月10日（星期二）；

②）H股股权登记日为2013年11月15日（星期五）；2013年11月18日至2013年12月17日（包括首尾两天）暂停办理H股股份过户登记手续。

二、会议审议议题

1、审议《关于公司董事薪酬的议案》：

①）董事长薪酬包括固定薪酬及年度绩效奖励，固定薪酬为90万元/年（含税），年度绩效奖励根据公司业绩及薪酬管理制度授权公司董事会薪酬与考核委员会决定；

②）在公司担任高级管理人员的董事薪酬根据其在公司所担任的职务及公司薪酬管理制度确定；

③）不在公司担任职务的外部董事不在公司领薪。

2、审议《关于金风科技2014年度日常关联交易（A股）预计额度的议案》：

①）与新疆风能有限责任公司之间的关联交易；

②）与中国三峡新能源公司之间的关联交易；

③）与新疆新能源（集团）有限责任公司之间的关联交易。

上述第1项议案为第五届董事会第一次会议审议通过，第2项议案为第五届董事会第三次会议审议通过。具体内容详见2013年6月27日及2013年10月26日刊登于《证券时报》及巨潮资讯网（http://www.cninfo.com.cn）上的相关公告及附件。

三、参会人员

1、全体股东有权出席股东大会，并可以委托代理人出席会议和参加表决，该股东代理人不必是公司的股东。凡持有本公司A股，并于2013年12月10日（星期二）下午收市时在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司登记在册的本公司股东，可出席本公司2013年第二次临时股东大会；凡持有本公司H股，并于2013年11月15日（星期五）营业日结束登记在册的本公司H股股东，可出席本公司2013年第二次临时股东大会。

2、公司董事、监事和高级管理人员。

3、公司聘请的律师等其他人员。

四、会议登记

1、符合出席会议条件的A股股东可携带相关文件于现场登记时间至乌鲁木齐市经济技术开发区上海路107号公司本部会议室登记；

现场登记时间：2013年12月17日早9:30-10:30；

登记办法：

①）自然人股东持本人身份证、股东账户卡、持股凭证办理登记手续；

②）法人股东凭营业执照复印件（加盖公章）、单位持股凭证、法人委托授权书和出席人身份证原件办理登记手续；

③）委托代理人凭本人身份证原件、授权委托书、委托人证券账户卡及持股凭证等办理登记手续。

2、公司H股股东须于2013年11月27日（星期三）下午5:00点前将H股股东的参会回条以专人送达、邮寄或传真方式，送交至公司董事会秘书办公室，地址为乌鲁木齐市经济技术开发区上海路107号。

五、其他事项

1、会期半天，参加会议的股东食宿、交通等费用自理。

2、联系人：周晶

3、邮话：0991-3767495　传真：0991-3767411

4、邮政编码：830026

新疆金风科技股份有限公司
董事会
２０１３年１１月２９日

附件：

授权委托书（格式一）

兹委托　　代表本人出席新疆金风科技股份有限公司2013年第二次临时股东大会，该受托股东享有发言权、表决权，对于列入股东大会的议案，均需按照以下明确指示进行表决：

序号	议案内容		表决意见		
			同意	反对	弃权
1	审议《关于公司董事薪酬的议案》	董事长薪酬包括固定薪酬及年度绩效奖励，固定薪酬为90万元/年（含税），年度绩效奖励根据公司业绩及薪酬管理制度授权公司董事会薪酬与考核委员会决定			
		在公司担任高级管理人员的董事薪酬根据其在公司所担任的职务及公司薪酬管理制度确定			
		不在公司担任职务的外部董事不在公司领薪			
2	《关于金风科技2014年度日常关联交易（A股）预计额度的议案》	与新疆风能有限责任公司之间的关联交易			
		与中国三峡新能源公司之间的关联交易			
		与新疆新能源（集团）有限责任公司之间的关联交易			

本次委托授权的有效期限：自本授权委托书签发之日起至该次股东会结束时止。

委托人签名（或签章）：　　身份证号码：

持股数量：　　股东账号：

受托人签名：　　身份证号码：

受托日期

授权委托书（格式二）

兹全权委托　　代表本人出席新疆金风科技股份有限公司2013年第二次临时股东大会，并代为行使表决权。

1、该受托股东享有发言权、表决权，可以按股东大会要求的表决方式表决；

2、本次委托授权的有效期限：自本授权委托书签发之日起至该次股东会结束时止。

委托人签名（或签章）：　　身份证号码：

持股数量：　　股东账号：

受托人签名：　　身份证号码：

受托日期

证券代码：002599　证券简称：盛通股份　公告编号：2013048

北京盛通印刷股份有限公司关于部分募投项目进展的公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露内容的真实、准确和完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

一、项目基本情况概述

北京盛通印刷股份有限公司（以下简称“公司”）于2013年3月7日召开的第二届董事会2013年第一次会议审议通过了《关于公司变更募集资金投资项目实施方式和部分实施地点的议案》，并于2013年4月1日召开的2012年度股东大会审议通过了该议案。具体情况如下：

公司“印刷生产线产能扩建项目”位于北京经济技术开发区东区印刷服务基地，原建设期为18个月，总投资额为24,612.00万元，其中建设投资为23,643.00万元，铺底流动资金969.00万元。公司对该项目的实施方式及部分实施地点进行了调整，总投资额度不变，具体变更如下：

将原计划北京经济技术开发区东区印刷服务基地的部分投资变更至公司全资子公司上海盛通时代印刷有限公司（以下简称：盛通时代），由其在上海金山工业区实施，相关内容变更前后对比如下：

	项目名称	投资总额（万元）	募集资金使用金额（万元）	实施主体	实施地点	项目建设完成日期
变更前	印刷生产线产能扩建项目	24,612.00	24,612.00	北京盛通印刷股份有限公司	北京经济技术开发区	2011年12月
变更后	印刷生产线产能扩建项目	19,012.00	19,012.00	北京盛通印刷股份有限公司	北京经济技术开发区	2013年12月
	上海盛通时代印刷有限公司生产线建设项目	5,600.00	5,600.00	上海盛通时代印刷有限公司	上海金山绿色印刷示范园区	2013年8月

二、项目进展情况

上海盛通时代印刷有限公司生产线建设项目由于项目从立项到开工进行实体建设前要经过行政审批、方案报批及相关评审报告等工作繁多、相关手续的审批程序和审核周期较长等多方面客观因素影响，整体计划受客观条件限制，导致前期工作流程时间延长，相应影响了建设进度。

2013年7月8日上海盛通时代公司取得了上海市金山区经济委员会批复的“企业投资项目备案意见表”；2013年10月16日，取得了上海市金山区环境保护局批复的关于“书刊彩印”生产项目”环境影响报告表的审批意见。因该项目审批周期、设备采购进口等时间较长，项目整体计划受客观条件限制，同时公司根据市场订单情况适当调整投资进度，截止2013年10月31日，该项目已投资2950万元，已完成投资进度的52.68%。

上海市金山区经济委员会批复的企业投资项目备案意见表中项目建设名称为：“书刊彩印建设项目”，项目投资总额、建设地址等均与董事会批准的可研情况一致。

为使项目名称一致，公司董事会决定按照上海市金山区经济委员会的批复调整该募投项目名称，项目名称由“上海盛通时代印刷生产线建设项目”调整为“书刊彩印建设项目”。

三、风险提示

由于项目建设进度相应延后，建设周期延长，可能面临较多的不确定性因素。包括受市场情况影响订单及价格、设备采购成本及进度、人员成本上升等不确定性因素，可能导致项目建设进度、投资总额、盈利水平与预测的建设进度、投资总额、盈利水平出现差异，达不到预期目标。如果我国宏观经济形势和印刷行业市场状况出现重大变化，可能存在由于市场需求变化而导致收入增长不能达到预期的风险。

敬请投资者注意投资风险。

特此公告

北京盛通印刷股份有限公司
２０１３年１１月２９日

证券代码：600064　股票简称：南京高科　编