

## 长城久兆中小板300指数分级证券投资基金

### 2013 第一季度报告

2013年3月31日

**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4月22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规定,于2013年04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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。投资者有风险,投资需谨慎。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。本报告财务资料未经审计。

本报告自2013年01月01日起至03月31日止。

基金名称	长城久兆中小板300指数分级
基金代码	162010
基金运作方式	契约开放式
基金合同生效日	2011年4月12日
报告期末基金份额总额	59,499,273.69份
本基金通过境内和境外市场,力争实现中小板300指数(除权)指数的有效跟踪。在正常市场情况下,本基金力争基金净值增长率与业绩比较基准年化率之间的日均跟踪偏离控制在0.35%以内,年化跟踪误差控制在0.7%以内。	
<b>投资策略</b>	本基金采用完全复制策略,按照标的指数的构成及其权重构建股票资产组合,并跟踪标的指数的涨跌幅及其权重的变化进行动态调整。同时根据基金申购赎回情况,对投资组合进行适当的调整,本基金将通过其他方法实现组合,力求实现基金对标的指数的跟踪投资目标。
<b>业绩比较基准</b>	中小板300价格指数收益率+0.95%+活期存款利率(税后)+0.5%
<b>风险收益特征</b>	本基金为长期平均风险和预期收益率高于普通股票型基金,混合型基金,债券型基金,货币市场基金等,为高风险、高收益产品。
<b>基金管理人</b>	长城基金管理有限公司
<b>基金托管人</b>	中国建设银行股份有限公司
<b>下属三级基金名称</b>	长城久兆中小板300指数分级(场内简称:久兆分级)
<b>下属三级基金代码</b>	162010 150057 150058
<b>报告期末下属三级基金份额总额</b>	45,661,110.69份 5,715,265.00份 8,572,898.00份
<b>报告期末下属三级基金份额总额</b>	45,661,110.69份 5,715,265.00份 8,572,898.00份
<b>报告期末下属三级基金的风险收益特征</b>	本基金为长期平均风险和预期收益率高于普通股票型基金,混合型基金,债券型基金,货币市场基金等,为高风险、高收益产品。

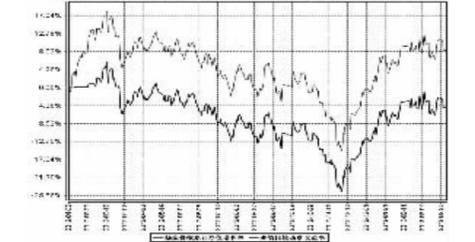
#### 3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期(2013年1月1日-2013年3月31日)	单位:人民币元
1.本期已实现收益	-470,331.44	
2.本期利润	5,155,220.99	
3.加权平均基金份额本期利润	0.0831	
4.期末基金份额净值	55,681,337.97	
5.期末基金资产净值	6,029,273.69	

#### 3.2 基金净值表现

阶段	净值增长率①	净值增长率基准②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-③
过去三个月	8.00%	1.39%	8.81%	1.40%	-0.81%

#### 3.3 主要财务指标和基金净值表现



注:本基金合同约定本基金投资组合中,本基金投资于标的指数的资产占基金资产净值的比例不低于90%,其中投资于中小板300指数的资产占基金资产净值的比例不低于80%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金的建仓期为自本基金基金合同生效日起6个月,建仓期间,各项资产配置比例符合基金合同约定。

#### 4.1 基金经理简介

**4.1 基金经理简介**

姓名:余洪涛 职务:基金经理

余洪涛先生,1970年11月17日出生,毕业于中国政法大学,具有11年证券基金从业经验,曾任富国基金、融通基金、民生证券基金部副经理,2012年12月加入长城基金担任基金经理,2013年1月1日起担任长城久兆中小板300指数分级证券投资基金基金经理。

#### 4.2 基金管理人

**4.2 基金管理人**

名称:长城基金管理有限公司

住所: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

客服电话:400-8868-666

网址:www.ccfund.com.cn

#### 4.3 基金投资组合

项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
报告期末基金份额总额	60,292,950.99	8.48
报告期末基金资产总额	15,219,454.04	25.06
报告期末基金资产净值	18,277,960.17	28.71
报告期末基金资产净值	4,826,262.01	7.43
报告期末基金资产净值	45,661,110.69	71.54

#### 4.4 基金投资组合

项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
报告期末基金资产净值	45,661,110.69	71.54
报告期末基金资产净值	5,715,265.00	9.28
报告期末基金资产净值	8,572,898.00	13.26

#### 4.5 基金投资组合

项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
报告期末基金资产净值	45,661,110.69	71.54
报告期末基金资产净值	5,715,265.00	9.28
报告期末基金资产净值	8,572,898.00	13.26

#### 4.6 基金投资组合

项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
报告期末基金资产净值	45,661,110.69	71.54
报告期末基金资产净值	5,715,265.00	9.28
报告期末基金资产净值	8,572,898.00	13.26

#### 4.7 基金投资组合

项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
报告期末基金资产净值	45,661,110.69	71.54
报告期末基金资产净值	5,715,265.00	9.28
报告期末基金资产净值	8,572,898.00	13.26

#### 4.8 基金投资组合

项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
报告期末基金资产净值	45,661,110.69	71.54
报告期末基金资产净值	5,715,265.00	9.28
报告期末基金资产净值	8,572,898.00	13.26

#### 4.9 基金投资组合

项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
报告期末基金资产净值	45,661,110.69	71.54
报告期末基金资产净值	5,715,265.00	9.28
报告期末基金资产净值	8,572,898.00	13.26

#### 4.10 基金投资组合

项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
报告期末基金资产净值	45,661,110.69	71.54
报告期末基金资产净值	5,715,265.00	9.28
报告期末基金资产净值	8,572,898.00	13.26

#### 4.11 基金投资组合

项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
报告期末基金资产净值	45,661,110.69	71.54
报告期末基金资产净值	5,715,265.00	9.28
报告期末基金资产净值	8,572,898.00	13.26

#### 4.12 基金投资组合

项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
报告期末基金资产净值	45,661,110.69	71.54
报告期末基金资产净值	5,715,265.00	9.28
报告期末基金资产净值	8,572,898.00	13.26

#### 4.13 基金投资组合

项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
报告期末基金资产净值	45,661,110.69	71.54
报告期末基金资产净值	5,715,265.00	9.28
报告期末基金资产净值	8,572,898.00	13.26

#### 4.14 基金投资组合

项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
报告期末基金资产净值	45,661,110.69	71.54
报告期末基金资产净值	5,715,265.00	9.28
报告期末基金资产净值	8,572,898.00	13.26

#### 4.15 基金投资组合

项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
报告期末基金资产净值	45,661,110.69	71.54
报告期末基金资产净值	5,715,265.00	9.28
报告期末基金资产净值	8,572,898.00	13.26

#### 4.16 基金投资组合

项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
报告期末基金资产净值	45,661,110.69	71.54
报告期末基金资产净值	5,715,265.00	9.28
报告期末基金资产净值	8,572,898.00	13.26

#### 4.17 基金投资组合

项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
报告期末基金资产净值	45,661,110.69	71.54
报告期末基金资产净值	5,715,265.00	9.28
报告期末基金资产净值	8,572,898.00	13.26

#### 4.18 基金投资组合

项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
报告期末基金资产净值	45,661,110.69	71.54
报告期末基金资产净值	5,715,265.00	9.28
报告期末基金资产净值	8,572,898.00	13.26

#### 4.19 基金投资组合

项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
报告期末基金资产净值	45,661,110.69	71.54
报告期末基金资产净值	5,715,265.00	9.28
报告期末基金资产净值	8,572,898.00	13.26

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	股票投资	42,346,330.42	75.30
2	其中:买入股票	42,346,330.42	75.30
3	债券投资	-	-
4	其中:买入债券	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	3,860,137.97	6.86
6	其他资产	10,027,706.47	17.83
7	合计	56,234,174.86	100.00

#### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔	1,101,600.47	1.98
B	矿业	744,900.02	1.34
C	制造业	29,992,986.23	53.85
D	电力、热力、燃气及生产和供应业	315,276.54	0.57
E	建筑业	2,819,196.26	5.06
F	批发和零售业	2,101,144.23	3.77
G	交通运输、仓储和邮政业	101,387.37	0.18
H	住宿和餐饮业	183,467.74	0.33
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,986,670.95	3.57
J	金融业	1,091,060.24	1.96
K	房地产业	760,853.00	1.37
L	租赁和商务服务业	797,282.84	1.43
M	科学研究和技术服务业	80,527.84	0.09
N	水利、环境和公共设施服务业	319,170.88	0.57
O	国防军工	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社公事业	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
合计		42,346,330.42	76.05

#### 5.3 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	002024	华信新材	210,653	1,341,899.61	2.41
2	002415	海康威视	22,005	848,072.70	1.52
3	002226	大亚股份	11,266	782,907.00	1.41
4	002204	洋河股份	11,931	744,136.47	1.34
5	002422	科陆电子	10,838	603,395.64	1.25
6	002019	中航光电	10,731	670,269.50	1.20
7	002241	聚龙股份	13,149	662,467.60	1.19
8	002142	宁波韵升	59,643	631,419.37	1.13
9	002553	杰赛科技	7,874	614,565.70	1.10
10	002081	金耀华	16,284	565,054.80	1.01

#### 5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注:本基金本报告期末未持有债券投资。

#### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五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投资。

#### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证投资。

#### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细

注:本基金本报告期末未持有股指期货投资。

#### 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债期货投资明细

注:本基金本报告期末未持有国债期货投资。

#### 5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。

#### 5.10 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名大宗商品投资明细

注:本基金本报告期末未持有大宗商品投资。

#### 5.11 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名衍生品投资明细

注:本基金本报告期末未持有衍生品投资。

#### 5.12 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细

注:本基金本报告期末未持有其他资产投资。

#### 5.13 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细

注:本基金本报告期末未持有其他资产投资。

#### 5.14 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细

注:本基金本报告期末未持有其他资产投资。

#### 5.15 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细

注:本基金本报告期末未持有其他资产投资。

#### 5.16 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细

注:本基金本报告期末未持有其他资产投资。

#### 5.17 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细

注:本基金本报告期末未持有其他资产投资。

#### 5.18 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细

注:本基金本报告期末未持有其他资产投资。

#### 5.19 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细

注:本基金本报告期末未持有其他资产投资。

#### 5.20 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细

注:本基金本报告期末未持有其他资产投资。

#### 5.21 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细

注:本基金本报告期末未持有其他资产投资。

#### 5.22 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细

注:本基金本报告期末未持有其他资产投资。

#### 5.23 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细

注:本基金本报告期末未持有其他资产投资。

#### 5.24 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细

注:本基金本报告期末未持有其他资产投资。

#### 5.25 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细

注:本基金本报告期末未持有其他资产投资。

#### 5.26 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细

注:本基金本报告期末未持有其他资产投资。

#### 5.27 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细

注:本基金本报告期末未持有其他资产投资。

#### 5.28 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细