

长城中小盘成长股票型证券投资基金

[2012] 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:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2012年7月20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。

本基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2012年07月18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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2012年04月01日起至06月30日止。

\$2 基金产品概况

基金简称 长城中小盘股票

交易代码 200012

基金运作方式 约定开放式

基金合同生效日 2011年1月27日

报告期末基金份额总额 411,872,619.80份

投资目标 本基金主要投资于具有较高成长性的中小盘股票,在控制风险的前提下,采取积极主动的投资策略,力求实现基金资产持续增值。

本基金为股票型证券投资基金,将采用“自上而下”的策略进行基金的大类资产配置。本基金主要通过对宏观经济运行周期、财政及货币政策、利率走势、证券市场估值水平、行业景气度、影响证券市场的主要因素等方面进行分析,判断股票、债券、货币市场、现金等大类资产的预期风险和收益,适时调整基金大类资产的投资比例,以控制系统性风险。

本基金的业绩比较基准为:40%×沪深300指数收益率+40%×天相小盘指数收益率+20%×中信财富指数收益率。

本基金为股票型证券投资基金,预期风险和预期收益率高,风险承受能力高,适合追求个股的成长收益,所以为高风险、高收益产品。

基金管理人 长城基金管理有限公司

基金托管人 中国银行股份有限公司

\$3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2012年4月1日-2012年6月30日)

1.本期已实现收益 -35,924,838.54

2.本期利润 11,111,761.14

3.加权平均基金份额本期利润 0.0264

4.期末基金份额净值 326,908,398.34

5.期末基金份额总额 0.794

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 准确率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 3.39% 1.04% 1.74% 0.93% 1.65% 0.11%

3.2.2 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:股票投资占基金资产的比例范围为60%-95%;债券投资占基金资产的比例范围为0-35%;权证投资占基金资产净值的比例范围为0-3%;现金以及到期日在一年以内(含一年)的政府债券不高于基金资产净值的5%。本基金以不低于80%的股票资产投资于具有较高成长性和基本面良好的中小盘股票。本基金的建仓期为自本基金基金合同生效日起6个月,建仓期满时,各项资产配置比例符合基金合同约定。

54 管理人报告

4.1 基金经理或基金经理助理简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期限 证券从业年限 说明

杨建华 投资总监、基金总经理、本基金的基金经理、长城久富长城基金的基金经理 2011年1月27日 - 12年 男,中国籍,北京大学力学系学士,北京大学光华管理学院经济学硕士,注册会计师,现就职于华泰技术有限公司财务部,长城证券有限责任公司投资银行部,2001年10月进入长城基金管理有限公司,曾任基金经理助理,“长城安心回报混合型证券投资基金基金经理”。

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本基金从任职日期起至离任日期止,未从本基金获得过报酬。

③管理人对报告本期的基本情况进行了遵守信情况的说明。

④本基金的基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、《长城中小盘成长股票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运用基金资产,在控制和防范风险的前提下,为基金份额持有人谋取最大的利益,未出现投资违反法律法规、基金合同的约定和相关规范的情况,因无风险,本基金勤勉尽责或操作不当而导致基金财产损失的情况,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合,制定并严格执行相应的制度和流程,通过信息系统以及人工审核相结合的方式执行公平交易制度,投资对象库对对手库管理制度、投资信息保密制度、各投资组合投资对象库管理制度、投资决策人建立和完善公平的交易分配制度,按照公平、公开、公正的原则,保证各投资组合之间公平对待。

4.3.2 公平交易制度的异常情况

本基金管理人严格按照公司投资部门的共同向反向交易,对向同向交易进行事后分析,定期出具公平交易制度执行情况分析报告。本报告期,基金管理人旗下投资部门的同向交易价差均在合理范围内,通过上述分析我们得出结论:在本报告期,公平交易制度在本基金管理人内部得到了贯彻执行,不存在投资者的利益得到不公平对待。

4.4 公平交易专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为,没有出现基金参与的交易所的股票公开竞价同日反向交易或较少的单边交易量超过该股票当日成交量的5%的现象。

4.4.1 报告期内基金投资组合运作情况

本基金管理人严格按照公司投资部门的共同向反向交易,对向同向交易进行事后分析,定期出具公平交易制度执行情况分析报告。本报告期,基金管理人旗下投资部门的同向交易价差均在合理范围内,通过上述分析我们得出结论:在本报告期,公平交易制度在本基金管理人内部得到了贯彻执行,不存在投资者的利益得到不公平对待。

4.4.2 公平交易行为的专项说明

本基金管理人严格按照公司投资部门的共同向反向交易,对向同向交易进行事后分析,定期出具公平交易制度执行情况分析报告。本报告期,基金管理人旗下投资部门的同向交易价差均在合理范围内,通过上述分析我们得出结论:在本报告期,公平交易制度在本基金管理人内部得到了贯彻执行,不存在投资者的利益得到不公平对待。

4.5 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照公司投资部门的共同向反向交易,对向同向交易进行事后分析,定期出具公平交易制度执行情况分析报告。本报告期,基金管理人旗下投资部门的同向交易价差均在合理范围内,通过上述分析我们得出结论:在本报告期,公平交易制度在本基金管理人内部得到了贯彻执行,不存在投资者的利益得到不公平对待。

4.6 公平交易制度的异常情况

本基金管理人严格按照公司投资部门的共同向反向交易,对向同向交易进行事后分析,定期出具公平交易制度执行情况分析报告。本报告期,基金管理人旗下投资部门的同向交易价差均在合理范围内,通过上述分析我们得出结论:在本报告期,公平交易制度在本基金管理人内部得到了贯彻执行,不存在投资者的利益得到不公平对待。

4.7 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照公司投资部门的共同向反向交易,对向同向交易进行事后分析,定期出具公平交易制度执行情况分析报告。本报告期,基金管理人旗下投资部门的同向交易价差均在合理范围内,通过上述分析我们得出结论:在本报告期,公平交易制度在本基金管理人内部得到了贯彻执行,不存在投资者的利益得到不公平对待。

4.8 公平交易制度的异常情况

本基金管理人严格按照公司投资部门的共同向反向交易,对向同向交易进行事后分析,定期出具公平交易制度执行情况分析报告。本报告期,基金管理人旗下投资部门的同向交易价差均在合理范围内,通过上述分析我们得出结论:在本报告期,公平交易制度在本基金管理人内部得到了贯彻执行,不存在投资者的利益得到不公平对待。

4.9 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照公司投资部门的共同向反向交易,对向同向交易进行事后分析,定期出具公平交易制度执行情况分析报告。本报告期,基金管理人旗下投资部门的同向交易价差均在合理范围内,通过上述分析我们得出结论:在本报告期,公平交易制度在本基金管理人内部得到了贯彻执行,不存在投资者的利益得到不公平对待。

4.10 公平交易制度的异常情况

本基金管理人严格按照公司投资部门的共同向反向交易,对向同向交易进行事后分析,定期出具公平交易制度执行情况分析报告。本报告期,基金管理人旗下投资部门的同向交易价差均在合理范围内,通过上述分析我们得出结论:在本报告期,公平交易制度在本基金管理人内部得到了贯彻执行,不存在投资者的利益得到不公平对待。

4.11 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照公司投资部门的共同向反向交易,对向同向交易进行事后分析,定期出具公平交易制度执行情况分析报告。本报告期,基金管理人旗下投资部门的同向交易价差均在合理范围内,通过上述分析我们得出结论:在本报告期,公平交易制度在本基金管理人内部得到了贯彻执行,不存在投资者的利益得到不公平对待。

4.12 公平交易制度的异常情况

本基金管理人严格按照公司投资部门的共同向反向交易,对向同向交易进行事后分析,定期出具公平交易制度执行情况分析报告。本报告期,基金管理人旗下投资部门的同向交易价差均在合理范围内,通过上述分析我们得出结论:在本报告期,公平交易制度在本基金管理人内部得到了贯彻执行,不存在投资者的利益得到不公平对待。

4.13 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照公司投资部门的共同向反向交易,对向同向交易进行事后分析,定期出具公平交易制度执行情况分析报告。本报告期,基金管理人旗下投资部门的同向交易价差均在合理范围内,通过上述分析我们得出结论:在本报告期,公平交易制度在本基金管理人内部得到了贯彻执行,不存在投资者的利益得到不公平对待。

4.14 公平交易制度的异常情况

本基金管理人严格按照公司投资部门的共同向反向交易,对向同向交易进行事后分析,定期出具公平交易制度执行情况分析报告。本报告期,基金管理人旗下投资部门的同向交易价差均在合理范围内,通过上述分析我们得出结论:在本报告期,公平交易制度在本基金管理人内部得到了贯彻执行,不存在投资者的利益得到不公平对待。

4.15 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照公司投资部门的共同向反向交易,对向同向交易进行事后分析,定期出具公平交易制度执行情况分析报告。本报告期,基金管理人旗下投资部门的同向交易价差均在合理范围内,通过上述分析我们得出结论:在本报告期,公平交易制度在本基金管理人内部得到了贯彻执行,不存在投资者的利益得到不公平对待。

4.16 公平交易制度的异常情况

本基金管理人严格按照公司投资部门的共同向反向交易,对向同向交易进行事后分析,定期出具公平交易制度执行情况分析报告。本报告期,基金管理人旗下投资部门的同向交易价差均在合理范围内,通过上述分析我们得出结论:在本报告期,公平交易制度在本基金管理人内部得到了贯彻执行,不存在投资者的利益得到不公平对待。

4.17 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照公司投资部门的共同向反向交易,对向同向交易进行事后分析,定期出具公平交易制度执行情况分析报告。本报告期,基金管理人旗下投资部门的同向交易价差均在合理范围内,通过上述分析我们得出结论:在本报告期,公平交易制度在本基金管理人内部得到了贯彻执行,不存在投资者的利益得到不公平对待。

4.18 公平交易制度的异常情况

本基金管理人严格按照公司投资部门的共同向反向交易,对向同向交易进行事后分析,定期出具公平交易制度执行情况分析报告。本报告期,基金管理人旗下投资部门的同向交易价差均在合理范围内,通过上述分析我们得出结论:在本报告期,公平交易制度在本基金管理人内部得到了贯彻执行,不存在投资者的利益得到不公平对待。

4.19 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照公司投资部门的共同向反向交易,对向同向交易进行事后分析,定期出具公平交易制度执行情况分析报告。本报告期,基金管理人旗下投资部门的同向交易价差均在合理范围内,通过上述分析我们得出结论:在本报告期,公平交易制度在本基金管理人内部得到了贯彻执行,不存在投资者的利益得到不公平对待。

4.20 公平交易制度的异常情况

本基金管理人严格按照公司投资部门的共同向反向交易,对向同向交易进行事后分析,定期出具公平交易制度执行情况分析报告。本报告期,基金管理人旗下投资部门的同向交易价差均在合理范围内,通过上述分析我们得出结论:在本报告期,公平交易制度在本基金管理人内部得到了贯彻执行,不存在投资者的利益得到不公平对待。

4.21 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照公司投资部门的共同向反向交易,对向同向交易进行事后分析,定期出具公平交易制度执行情况分析报告。本报告期,基金管理人旗下投资部门的同向交易价差均在合理范围内,通过上述分析我们得出结论:在本报告期,公平交易制度在本基金管理人内部得到了贯彻执行,不存在投资者的利益得到不公平对待。

4.22 公平交易制度的异常情况

本基金管理人严格按照公司投资部门的共同向反向交易,对向同向交易进行事后分析,定期出具公平交易制度执行情况分析报告。本报告期,基金管理人旗下投资部门的同向交易价差均在合理范围内,通过上述分析我们得出结论:在本报告期,公平交易制度在本基金管理人内部得到了贯彻执行,不存在投资者的利益得到不公平对待。

4.23 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照公司投资部门的共同向反向交易,对向同向交易进行事后分析,定期出具公平交易制度执行情况分析报告。本报告期,基金管理人旗下投资部门的同向交易价差均在合理范围内,通过上述分析我们得出结论:在本报告期,公平交易制度在本基金管理人内部得到了贯彻执行,不存在投资者的利益得到不公平对待。

4.24 公平交易制度的异常情况

本基金管理人严格按照公司投资部门的共同向反向交易,对向同向交易进行事后分析,定期出具公平交易制度执行情况分析报告。本报告期,基金管理人旗下投资部门的同向交易价差均在合理范围内,通过上述分析我们得出结论:在本报告期,公平交易制度在本基金管理人内部得到了贯彻执行,不存在投资者的利益得到不公平对待。

4.25 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照公司投资部门的共同向反向交易,对向同向交易进行事后分析,定期出具公平交易制度执行情况分析报告。本报告期,基金管理人旗下投资部门的同向交易价差均在合理范围内,通过上述分析我们得出结论:在本报告期,公平交易制度在本基金管理人内部得到了贯彻执行,不存在投资者的利益得到不公平对待。

4.26 公平交易制度的异常情况

本基金管理人严格按照公司投资部门的共同向反向交易,对向同向交易进行事后分析,定期出具公平交易制度执行情况分析报告。本报告期,基金管理人旗下投资部门的同向交易价差均在合理范围内,通过上述分析我们得出结论:在本报告期,公平交易制度在本基金管理人内部得到了贯彻执行,不存在投资者的利益得到不公平对待。

4.27 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照公司投资部门的共同向反向交易,对向同向交易进行事后分析,定期出具公平交易制度执行情况分析报告。本报告期,基金管理人旗下投资部门的同向交易价差均在合理范围内,通过上述分析我们得出结论:在本报告期,公平交易制度在本基金管理人内部得到了贯彻执行,不存在投资者的利益得到不公平对待。

4.28 公平交易制度的异常情况

本基金管理人严格按照公司投资部门的共同向反向交易,对向同向交易进行事后分析,定期出具公平交易制度执行情况分析报告。本报告期,基金管理人旗下投资部门的同向交易价差均在合理范围内,通过上述分析我们得出结论:在本报告期,公平交易制度在本基金管理人内部得到了贯彻执行,不存在投资者的利益得到不公平对待。

4.29 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照公司投资部门的共同向反向交易,对向同向交易进行事后分析,定期出具公平交易制度执行情况分析报告。本报告期,基金管理人旗下投资部门的同向交易价差均在合理范围内,通过上述分析我们得出结论:在本报告期,公平交易制度在本基金管理人内部得到了贯彻执行,不存在投资者的利益得到不公平对待。

4.30 公平交易制度的异常情况

本基金管理人严格按照公司投资部门的共同向反向交易,对向同向交易进行事后分析,定期出具公平交易制度执行情况分析报告。本报告期,基金管理人旗下投资部门的同向交易价差均在合理范围内,通过上述分析我们得出结论:在本报告期,公平交易制度在本基金管理人内部得到了贯彻执行,不存在投资者的利益得到不公平对待。