

长城久兆中小板300指数分级证券投资基金

[2013] 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:中国建设银行股份有限公司

报告送出日期:2013年7月18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07月15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2013年04月01日起至6月30日止。

\$ 2 基金产品概况

基金简称:长城久兆中小板300指数分级

基金主代码:162010

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2012年3月30日

报告期末基金份额总额:62,515,156.72份

本基金通过投资约束和数量化监控，力求实现对中小板300(价格)指数的跟踪。在正常市场情况下，本基金力争将基金净值增长率与业绩比较基准收益率之间的日平均跟踪误差控制在3%以内，年跟踪误差控制在5%以内。

本基金采用完全复制策略，按照标的指数成份股构成及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票组合进行动态调整。但因特殊情况导致基金无法有效跟踪标的指数时，本基金将运用其他方法对实际组合，力求实现基金相对业绩比较基准的跟踪误差最小化。

业绩比较基准:中小板300(价格)指数×95%+存款利率(税后)×5%。

风险收益特征:本基金的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，低于市场基金等，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:中国建设银行股份有限公司

长城久兆中小板300指
数分级(场内简称:长城
久兆,场外简称:久兆积
极)

下属三级基金简称:长城久兆稳健指数(场
内简称:久兆稳
定)

下属三级基金交易代码:162010

下属三级基金报告期末基
金份额总额:51,025,983.72份

下属三级基金的风险收
益特征:本基金的长期平均风
险和预期收益率高于普通股
票型基金、混合型基金、债券型
基金等，为高风险、高收益产
品。

下属三级基金的风
险收益特征:长城久兆稳健具有低风
险，收益相对稳定的特
征。

下属三级基金的风
险收益特征:长城久兆积极具有高
风险，高预期收益的特征。

下属三级基金的风
险收益特征:长城久兆稳健具有高
风险，高预期收益的特征。

下属三级基金的风
险收益特征:长城久兆积极具有高
风险，高预期收益的特征。