长城久兆中小板300指数分级证券投资基金

【2015】半年度报告摘要

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
送出日期:2015年8月27日

§1 重要提示

1.1 重要提示
基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。
基金托管人中国建设银行股份有限公司根复本基金合同规定,于2015年08月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。
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。
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及其更新。
本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。
本报告中财务资料未经审计。
本报告期自2015年01月01日起至06月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

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1月30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		
报告期末基金份额总额	107,408,049.48份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2012-02-21		
下属分级基金的基金简称	长城久兆中小板300指数分级	长城久兆稳健指数	长城久兆积极指数
下属分级基金场内简称:	长城久兆	中小300A	中小300B
下属分级基金的交易代码	162010	150057	150058
报告期末下属分级基金份额总额	33,811,016.48份	29,438,813.00份	44,158,220.00份

注:自2015年6月01日起长城久兆中小板300指数分级证券投资基金之稳健份额的场内简称由"久兆稳健"(代码:150057)变更为"中小300A",长城久兆中小板300指数分级证券投资基金之积极份额的场内简称由"久兆积极"(代码:150058)变更为"中小300B"。基金代码和其他信息均保持不变,详见本管理人2015年6月4日公告。

2.2 基金产品说明

投资目标	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)指数的有效跟踪。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变化率之间的日平均跟踪误差控制在0.35%以内,年跟踪误差控制在4%以内。		
投资策略	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资产组合,并根据标的指数成份股及其权重的变化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建立实际组合,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)指数收益率×95%+活期存款利率(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、货币市场基金等,为高风险、高收益产品。		
下属分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、货币市场基金等,为高风险、高收益产品。	长城久兆稳健具有低风险、收益相对稳定的特征。	长城久兆积极具有高风险、高预期收益的特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		长城基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	车君	田青
	联系电话	0755-23982338	010-67595096
	电子邮箱	chejun@ccfund.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-8868-666	010-67595096
传真		0755-23982328	010-66275865

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.ccfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心41层

3.1 主要会计数据和财务指标

§3 主要财务指标和基金净值表现

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2015年1月1日-2015年6月30日)
本期已实现收益	18,303,340.16
本期利润	7,467,497.09
加权平均基金份额本期利润	0.1625
本期基金份额净值增长率	62.32%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.4232
期末基金资产净值	94,077,754.07
期末基金份额净值	0.876

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字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准的收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	-14.62%	3.92%	-13.86%	3.56%	-0.76%	0.36%
过去三个月	14.24%	2.91%	19.91%	2.84%	-5.67%	0.07%
过去六个月	62.32%	2.31%	71.41%	2.24%	-9.09%	0.07%
过去一年	85.30%	1.80%	97.24%	1.77%	-11.94%	0.03%
过去三年	104.77%	1.54%	127.32%	1.53%	-22.55%	0.01%
自基金合同生效起至今	93.50%	1.49%	141.11%	1.49%	-47.61%	0.00%

注:以1到180日时间长度滚动测算长城久兆中小板300指数分级证券投资基金之稳健份额的场内简称由"久兆稳健"(代码:150057)变更为"中小300A",长城久兆中小板300指数分级证券投资基金之积极份额的场内简称由"久兆积极"(代码:150058)变更为"中小300B"。基金代码和其他信息均保持不变,详见本管理人2015年6月4日公告。

2.2 基金产品说明

投资目标	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)指数的有效跟踪。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变化率之间的日平均跟踪误差控制在0.35%以内,年跟踪误差控制在4%以内。		
投资策略	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资产组合,并根据标的指数成份股及其权重的变化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建立实际组合,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)指数收益率×95%+活期存款利率(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、货币市场基金等,为高风险、高收益产品。		
下属分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、货币市场基金等,为高风险、高收益产品。	长城久兆稳健具有低风险、收益相对稳定的特征。	长城久兆积极具有高风险、高预期收益的特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		长城基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	车君	田青
	联系电话	0755-23982338	010-67595096
	电子邮箱	chejun@ccfund.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-8868-666	010-67595096
传真		0755-23982328	010-66275865

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.ccfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心41层

3.1 主要会计数据和财务指标

§3 主要财务指标和基金净值表现

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2015年1月1日-2015年6月30日)
本期已实现收益	18,303,340.16
本期利润	7,467,497.09
加权平均基金份额本期利润	0.1625
本期基金份额净值增长率	62.32%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.4232
期末基金资产净值	94,077,754.07
期末基金份额净值	0.876

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字。

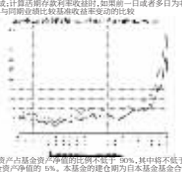
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准的收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	-14.62%	3.92%	-13.86%	3.56%	-0.76%	0.36%
过去三个月	14.24%	2.91%	19.91%	2.84%	-5.67%	0.07%
过去六个月	62.32%	2.31%	71.41%	2.24%	-9.09%	0.07%
过去一年	85.30%	1.80%	97.24%	1.77%	-11.94%	0.03%
过去三年	104.77%	1.54%	127.32%	1.53%	-22.55%	0.01%
自基金合同生效起至今	93.50%	1.49%	141.11%	1.49%	-47.61%	0.00%

注:以1到180日时间长度滚动测算长城久兆中小板300指数分级证券投资基金之稳健份额的场内简称由"久兆稳健"(代码:150057)变更为"中小300A",长城久兆中小板300指数分级证券投资基金之积极份额的场内简称由"久兆积极"(代码:150058)变更为"中小300B"。基金代码和其他信息均保持不变,详见本管理人2015年6月4日公告。

3.2.2 自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:本基金投资于股票的资产占基金资产净值的比例不低于60%,其中投不低于90%的股票资产投资于中小板300(价格)指数的成份股及其备选成份股,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规定。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况
4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验
长城基金管理有限公司是经中国证监会批准设立的第16家基金管理公司,由长城证券股份有限公司(40%)、东方证券股份有限公司(15%)、西北证券有限责任公司(15%)、老万国际信托投资股份有限公司(15%)、中原信托投资有限公司(15%)于2001年12月27日共同出资设立,当时注册资本为壹亿元人民币。2007年8月21日,经中国证监会批准,公司完成股权结构调整,现有股东为长城证券股份有限公司(47.05%)、东方证券股份有限公司(17.647%)、北方国际信托股份有限公司(17.647%)和中原信托有限公司(17.647%),2007年10月12日,经中国证监会批准,将注册资本增加至壹亿伍仟万元人民币。公司经营范围是基金募集、基金管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务。截止本报告期末,公司管理的基金有封闭式基金:久盛证券投资基金;开放式基金:长城久恒平衡型证券投资基金、长城久泰沪深300指数证券投资基金、长城货币市场证券投资基金、长城消费增值股票型证券投资基金、长城安心回报证券投资基金、长城久利债券证券投资基金、长城久富核心债券证券投资基金(QDII)、长城品牌优选股票型证券投资基金、长城稳健增利债券型证券投资基金、长城久乐债券证券投资基金、长城久兴保本证券投资基金、长城久惠债券证券投资基金、长城久丰债券证券投资基金、长城久盈保本证券投资基金、长城久益保本证券投资基金、长城久安保证券投资基金、长城久利保本证券投资基金、长城久利保本证券投资基金、长城久益增值证券投资基金、长城稳健证券投资基金、长城久惠保本证券投资基金、长城久泰保本证券投资基金、长城久益保本证券投资基金、长城久益纯债证券投资基金、长城久利保本证券投资基金、长城久利保本证券投资基金、长城久利保本