

中邮核心成长股票型证券投资基金

[2012] 第二季度报告

基金管理人:中邮创业基金管理有限公司
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19日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会对本基金报告期内投资运作的合规性不存在虚假记载、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。

基金托管人对本基金报告期内投资运作的合规性不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

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，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本季度报告的财务资料未经审计。

本报告期自2012年4月01日起至2012年6月30日止。

§ 2 基金产品概况

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

报告期(2012年4月1日-2012年6月30日)

本期已实现收益 -463,431,424.18

本期利润 -33,870,476.00

加权平均基金份额本期利润 -0.0012

期末基金份额净值 13,579,411,676.00

净值收益率 0.4705%

净值收益率标准差 1.13%

3.2 本期报告期基金资产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 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

过去三个月 -0.30% 0.66% -0.89% -0.96% 0.25%

3.2.2 自基金合同生效以来基金资产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

报告期(2012年4月1日-2012年6月30日)

本期已实现收益 -463,431,424.18

本期利润 -33,870,476.00

加权平均基金份额本期利润 -0.0012

期末基金份额净值 13,579,411,676.00

净值收益率 0.4705%

净值收益率标准差 1.13%

3.3 主要财务指标和基金净值表现

3.3.1 本期报告期基金资产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 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

过去三个月 -0.30% 0.66% -0.89% -0.96% 0.25%

3.3.2 自基金合同生效以来基金资产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

报告期(2012年4月1日-2012年6月30日)

本期已实现收益 -463,431,424.18

本期利润 -33,870,476.00

加权平均基金份额本期利润 -0.0012

期末基金份额净值 13,579,411,676.00

净值收益率 0.4705%

净值收益率标准差 1.13%

3.4 管理人报告

4.1 基金经理(基金经理小组)简介

姓名 职务 任职日期 离任日期 说明

祁立新 基金经理 2011年3月21日 - 23年

祁立新,男,23年金融从业经验,历任中邮基金管理有限公司投资经理、基金经理助理、投资总监、基金经理,现任中邮基金管理有限公司基金经理。

任泽深 基金经理助理 2012年1月4日 - 3年

任泽深,男,3年金融从业经验,历任中邮基金管理有限公司研究员、基金经理助理、基金经理,现任中邮基金管理有限公司基金经理助理。

白晋 基金经理助理 2012年1月4日 - 2年

白晋,男,2年金融从业经验,历任中邮基金管理有限公司研究员、基金经理助理,现任中邮基金管理有限公司基金经理助理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规性情况的说明

本报告期内,基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定,基金在研究、投资、交易等方面受到公平对待,不存在利用基金不公平交易行为。

报告期内,本基金的投资者买卖、投资交易程序、授权限制等方面均符合规定的程序,交易行为合法合规,未出现异常交易、操纵市场的情形,未发生内幕交易、关联交易等情况,相关信息披露真实、完整、准确,及时;基金各种账户类申购赎回及其交易类业务,注册登记业务均按规定的程序、规则进行,未出现过大额申购或赎回及违反基金合同的行为。

4.3 管理人对基金业绩表现的说明

4.3.1 公平交易执行的情况说明

在证监局会“证券投资基金公司公平交易制度指引意见”后,由金融工程部组织,对交易部和投资部相关人员进行了培训,相关人员严格遵守该制度。为确保该制度的严格执行,公司与泰禾资本共同开发了公平交易系统,并按月度、季度、年度生成各只基金的公平交易报告,并定期向相关部门和人员,对报告中产生的异常情况,进行分析得出结论后发送给相关部门和人员,完善公平、公正的公平交易制度。

4.3.2 公平交易价差的说明

取时间窗为5日,分别计算与其它各基金之间的交易价差,其中成长与优秀、成长与主题的5日交易价差的均值价差为-0.42%,未通过TPE模型进一步分析后发现,基金经理在个股买卖、买入、卖出、深康佳A的交易量是导致价差显著的主要原因。

4.3.3 公平交易执行的情况说明

在证监局会“证券投资基金公司公平交易制度指引意见”后,由金融工程部组织,对交易部和投资部相关人员进行了培训,相关人员严格遵守该制度。为确保该制度的严格执行,公司与泰禾资本共同开发了公平交易系统,并按月度、季度、年度生成各只基金的公平交易报告,并定期向相关部门和人员,对报告中产生的异常情况,进行分析得出结论后发送给相关部门和人员,完善公平、公正的公平交易制度。

4.3.4 公平交易价差的说明

取时间窗为5日,分别计算与其它各基金之间的交易价差,其中成长与优秀、成长与主题的5日交易价差的均值价差为-0.42%,未通过TPE模型进一步分析后发现,基金经理在个股买卖、买入、卖出、深康佳A的交易量是导致价差显著的主要原因。

4.3.5 公平交易执行的情况说明

在证监局会“证券投资基金公司公平交易制度指引意见”后,由金融工程部组织,对交易部和投资部相关人员进行了培训,相关人员严格遵守该制度。为确保该制度的严格执行,公司与泰禾资本共同开发了公平交易系统,并按月度、季度、年度生成各只基金的公平交易报告,并定期向相关部门和人员,对报告中产生的异常情况,进行分析得出结论后发送给相关部门和人员,完善公平、公正的公平交易制度。

4.3.6 公平交易价差的说明

取时间窗为5日,分别计算与其它各基金之间的交易价差,其中成长与优秀、成长与主题的5日交易价差的均值价差为-0.42%,未通过TPE模型进一步分析后发现,基金经理在个股买卖、买入、卖出、深康佳A的交易量是导致价差显著的主要原因。

4.3.7 公平交易执行的情况说明

在证监局会“证券投资基金公司公平交易制度指引意见”后,由金融工程部组织,对交易部和投资部相关人员进行了培训,相关人员严格遵守该制度。为确保该制度的严格执行,公司与泰禾资本共同开发了公平交易系统,并按月度、季度、年度生成各只基金的公平交易报告,并定期向相关部门和人员,对报告中产生的异常情况,进行分析得出结论后发送给相关部门和人员,完善公平、公正的公平交易制度。

4.3.8 公平交易价差的说明

取时间窗为5日,分别计算与其它各基金之间的交易价差,其中成长与优秀、成长与主题的5日交易价差的均值价差为-0.42%,未通过TPE模型进一步分析后发现,基金经理在个股买卖、买入、卖出、深康佳A的交易量是导致价差显著的主要原因。

4.3.9 公平交易执行的情况说明

在证监局会“证券投资基金公司公平交易制度指引意见”后,由金融工程部组织,对交易部和投资部相关人员进行了培训,相关人员严格遵守该制度。为确保该制度的严格执行,公司与泰禾资本共同开发了公平交易系统,并按月度、季度、年度生成各只基金的公平交易报告,并定期向相关部门和人员,对报告中产生的异常情况,进行分析得出结论后发送给相关部门和人员,完善公平、公正的公平交易制度。

4.3.10 公平交易价差的说明

取时间窗为5日,分别计算与其它各基金之间的交易价差,其中成长与优秀、成长与主题的5日交易价差的均值价差为-0.42%,未通过TPE模型进一步分析后发现,基金经理在个股买卖、买入、卖出、深康佳A的交易量是导致价差显著的主要原因。

4.3.11 公平交易执行的情况说明

在证监局会“证券投资基金公司公平交易制度指引意见”后,由金融工程部组织,对交易部和投资部相关人员进行了培训,相关人员严格遵守该制度。为确保该制度的严格执行,公司与泰禾资本共同开发了公平交易系统,并按月度、季度、年度生成各只基金的公平交易报告,并定期向相关部门和人员,对报告中产生的异常情况,进行分析得出结论后发送给相关部门和人员,完善公平、公正的公平交易制度。

4.3.12 公平交易价差的说明

取时间窗为5日,分别计算与其它各基金之间的交易价差,其中成长与优秀、成长与主题的5日交易价差的均值价差为-0.42%,未通过TPE模型进一步分析后发现,基金经理在个股买卖、买入、卖出、深康佳A的交易量是导致价差显著的主要原因。

4.3.13 公平交易执行的情况说明

在证监局会“证券投资基金公司公平交易制度指引意见”后,由金融工程部组织,对交易部和投资部相关人员进行了培训,相关人员严格遵守该制度。为确保该制度的严格执行,公司与泰禾资本共同开发了公平交易系统,并按月度、季度、年度生成各只基金的公平交易报告,并定期向相关部门和人员,对报告中产生的异常情况,进行分析得出结论后发送给相关部门和人员,完善公平、公正的公平交易制度。

4.3.14 公平交易价差的说明

取时间窗为5日,分别计算与其它各基金之间的交易价差,其中成长与优秀、成长与主题的5日交易价差的均值价差为-0.42%,未通过TPE模型进一步分析后发现,基金经理在个股买卖、买入、卖出、深康佳A的交易量是导致价差显著的主要原因。

4.3.15 公平交易执行的情况说明

在证监局会“证券投资基金公司公平交易制度指引意见”后,由金融工程部组织,对交易部和投资部相关人员进行了培训,相关人员严格遵守该制度。为确保该制度的严格执行,公司与泰禾资本共同开发了公平交易系统,并按月度、季度、年度生成各只基金的公平交易报告,并定期向相关部门和人员,对报告中产生的异常情况,进行分析得出结论后发送给相关部门和人员,完善公平、公正的公平交易制度。

4.3.16 公平交易价差的说明

取时间窗为5日,分别计算与其它各基金之间的交易价差,其中成长与优秀、成长与主题的5日交易价差的均值价差为-0.42%,未通过TPE模型进一步分析后发现,基金经理在个股买卖、买入、卖出、深康佳A的交易量是导致价差显著的主要原因。

4.3.17 公平交易执行的情况说明

在证监局会“证券投资基金公司公平交易制度指引意见”后,由金融工程部组织,对交易部和投资部相关人员进行了培训,相关人员严格遵守该制度。为确保该制度的严格执行,公司与泰禾资本共同开发了公平交易系统,并按月度、季度、年度生成各只基金的公平交易报告,并定期向相关部门和人员,对报告中产生的异常情况,进行分析得出结论后发送给相关部门和人员,完善公平、公正的公平交易制度。

4.3.18 公平交易价差的说明

取时间窗为5日,分别计算与其它各基金之间的交易价差,其中成长与优秀、成长与主题的5日交易价差的均值价差为-0.42%,未通过TPE模型进一步分析后发现,基金经理在个股买卖、买入、卖出、深康佳A的交易量是导致价差显著的主要原因。

4.3.19 公平交易执行的情况说明

在证监局会“证券投资基金公司公平交易制度指引意见”后,由金融工程部组织,对交易部和投资部相关人员进行了培训,相关人员严格遵守该制度。为确保该制度的严格执行,公司与泰禾资本共同开发了公平交易系统,并按月度、季度、年度生成各只基金的公平交易报告,并定期向相关部门和人员,对报告中产生的异常情况,进行分析得出结论后发送给相关部门和人员,完善公平、公正的公平交易制度。

4.3.20 公平交易价差的说明

取时间窗为5日,分别计算与其它各基金之间的交易价差,其中成长与优秀、成长与主题的5日交易价差的均值价差为-0.42%,未通过TPE模型进一步分析后发现,基金经理在个股买卖、买入、卖出、深康佳A的交易量是导致价差显著的主要原因。

4.3.21 公平交易执行的情况说明

在证监局会“证券投资基金公司公平交易制度指引意见”后,由金融工程部组织,对交易部和投资部相关人员进行了培训,相关人员严格遵守该制度。为确保该制度的严格执行,公司与泰禾资本共同开发了公平交易系统,并按月度、季度、年度生成各只基金的公平交易报告,并定期向相关部门和人员,对报告中产生的异常情况,进行分析得出结论后发送给相关部门和人员,完善公平、公正的公平交易制度。

4.3.22 公平交易价差的说明

取时间窗为5日,分别计算与其它各基金之间的交易价差,其中成长与优秀、成长与主题的5日交易价差的均值价差为-0.42%,未通过TPE模型进一步分析后发现,基金经理在个股买卖、买入、卖出、深康佳A的交易量是导致价差显著的主要原因。

4.3.23 公平交易执行的情况说明

在证监局会“证券投资基金公司公平交易制度指引意见”后,由金融工程部组织,对交易部和投资部相关人员进行了培训,相关人员严格遵守该制度。为确保该制度的严格执行,公司与泰禾资本共同开发了公平交易系统,并按月度、季度、年度生成各只基金的公平交易报告,并定期向相关部门和人员,对报告中产生的异常情况,进行分析得出结论后发送给相关部门和人员,完善公平、公正的公平交易制度。

4.3.24 公平交易价差的说明

取时间窗为5日,分别计算与其它各基金之间的交易价差,其中成长与优秀、成长与主题的5日交易价差的均值价差为-0.42%,未通过TPE模型进一步分析后发现,基金经理在个股买卖、买入、卖出、深康佳A的交易量是导致价差显著的主要原因。

4.3.25 公平交易执行的情况说明

在证监局会“证券投资基金公司公平交易制度指引意见”后,由金融工程部组织,对交易部和投资部相关人员进行了培训,相关人员严格遵守该制度。为确保该制度的严格执行,公司与泰禾资本共同开发了公平交易系统,并按月度、季度、年度生成各只基金的公平交易报告,并定期向相关部门和人员,对报告中产生的异常情况,进行分析得出结论后发送给相关部门和人员,完善公平、公正的公平交易制度。

4.3.26 公平交易价差的说明

取时间窗为5日,分别计算与其它各基金之间的交易价差,其中成长与优秀、成长与主题的5日交易价差的均值价差为-0.42%,未通过TPE模型进一步分析后发现,基金经理在个股买卖、买入、卖出、深康佳A的交易量是导致价差显著的主要原因。

4.3.27 公平交易执行的情况说明

在证监局会“证券投资基金公司公平交易制度指引意见”后,由金融工程部组织,对交易部和投资部相关人员进行了培训,相关人员严格遵守该制度。为确保该制度的严格执行,公司与泰禾资本共同开发了公平交易系统,并按月度、季度、年度生成各只基金的公平交易报告,并定期向相关部门和人员,对报告中产生的异常情况,进行分析得出结论后发送给相关部门和人员,完善公平、公正的公平交易制度。

4.3.28 公平交易价差的说明

取时间窗为5日,