

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
报告日期：2013年3月26日

重要提示及目录

1.1 重要提示
本基金的基金份额持有人、基金管理人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法律责任。本基金在募集期间，基金管理人和基金托管人对本基金的财务指标、净值表现、利润分配情况、费用计提方法、报告期损益、投资报告、投资组合报告等信息进行了披露，投资人可以在基金合同、招募说明书、定期报告、临时公告、基金净值公告、基金宣传推介材料、基金销售机构的网站上查阅或获取上述信息。
本基金的过往业绩并不代表未来表现，投资有风险，投资人认购基金前应认真阅读基金的招募说明书及其更新。

1.2 基金简介
1.2.1 基金基本情况

基金简称

长城久兆中小板300指数分级证券投资基金

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

81,414,883.59份

基金合同存续期间

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

基金类型

股票型基金

基金规模

60,292,950.59份

报告期末下属分级基金份额总额

60,292,950.59份

基金资产净值

8,448,773.00份

基金份额净值

12,673,160.00份

1.2.2 基金简介

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

81,414,883.59份

基金合同存续期间

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

基金类型

股票型基金

基金规模

60,292,950.59份

报告期末下属分级基金份额总额

60,292,950.59份

基金资产净值

8,448,773.00份

基金份额净值

12,673,160.00份

1.2.3 基金产品属性

基金属性

股票型基金

投资目标

本基金通过投资于中小板300成份股，力争实现超越业绩基准的收益。

投资策略

本基金采用定投复利策略，按照标的指数成份股构成其建仓比例并结合其基本面情况动态调整，但因特殊原因导致本基金无法有效跟踪标的指数时，本基金将使用其他方法建立投资组合，力求实现基金相关投资目标。

业绩比较基准

中小板300成份股指数收益率×95%+银行存款利率(税后)×5%

风险收益特征

本基金的长期风险和预期收益水平高于股票型基金，混合型基金、债券型基金、货币市场基金，为高风险、高收益品种。

下属三级基金的风险收益特征

本基金的长期风险和预期收益水平具有低风险、高预期收益的特征。

基金费率

本基金的长期平均风险和预期收益水平均低于股票型基金，混合型基金、货币市场基金等，风险相对稳定的特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目

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

信息披露负责人

联系人姓名

车君

联系电话

0755-23982388

电子邮箱

chejung@ccfund.com.cn

客户服务电话

400-8868-666

传真

0755-23982328

2.4 信息披露方式

网址

www.ccfund.com.cn

基金年度报告正式发布的管理人互联网网址

www.ccfund.com.cn

基金年度报告备置地点

深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心41层

3.1 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标

2012年1月30日(基金合同生效日)-2012年12月31日

本期

本报告期

本期利润

本期利润总额增长率为

-11.80%

本期利润

-1.10%

本期利润

71,775,194.82

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，即为可供分配的基金收益；(2)期末可供分配利润为截至期末按摊余成本计算的基金未分配利润，加上本期利润减去本期利润已经分配部分；(3)报告期利润指报告期利息收入、投资收益、公允价值变动收益、其他收入扣除相关费用后的净额。

3.2 基金合同于2012年1月30日生效，基金合同生效当年不提取风险准备金。

3.3 基金合同生效当年以基金资产净值增长率与同期业绩基准收益率的差值作为业绩报酬计提比例，即：(基金资产净值增长率-同期业绩基准收益率)×0.05%，当基金资产净值增长率大于或等于同期业绩基准收益率时，计提比例为0.05%；当基金资产净值增长率小于同期业绩基准收益率时，计提比例为0%。

3.4 基金合同生效当年以基金资产净值增长率与同期业绩基准收益率的差值作为业绩报酬计提比例，即：(基金资产净值增长率-同期业绩基准收益率)×0.05%，当基金资产净值增长率大于或等于同期业绩基准收益率时，计提比例为0.05%；当基金资产净值增长率小于同期业绩基准收益率时，计提比例为0%。

3.5 基金合同生效当年以基金资产净值增长率与同期业绩基准收益率的差值作为业绩报酬计提比例，即：(基金资产净值增长率-同期业绩基准收益率)×0.05%，当基金资产净值增长率大于或等于同期业绩基准收益率时，计提比例为0.05%；当基金资产净值增长率小于同期业绩基准收益率时，计提比例为0%。

3.6 基金合同生效当年以基金资产净值增长率与同期业绩基准收益率的差值作为业绩报酬计提比例，即：(基金资产净值增长率-同期业绩基准收益率)×0.05%，当基金资产净值增长率大于或等于同期业绩基准收益率时，计提比例为0.05%；当基金资产净值增长率小于同期业绩基准收益率时，计提比例为0%。

3.7 基金合同生效当年以基金资产净值增长率与同期业绩基准收益率的差值作为业绩报酬计提比例，即：(基金资产净值增长率-同期业绩基准收益率)×0.05%，当基金资产净值增长率大于或等于同期业绩基准收益率时，计提比例为0.05%；当基金资产净值增长率小于同期业绩基准收益率时，计提比例为0%。

3.8 基金合同生效当年以基金资产净值增长率与同期业绩基准收益率的差值作为业绩报酬计提比例，即：(基金资产净值增长率-同期业绩基准收益率)×0.05%，当基金资产净值增长率大于或等于同期业绩基准收益率时，计提比例为0.05%；当基金资产净值增长率小于同期业绩基准收益率时，计提比例为0%。

3.9 基金合同生效当年以基金资产净值增长率与同期业绩基准收益率的差值作为业绩报酬计提比例，即：(基金资产净值增长率-同期业绩基准收益率)×0.05%，当基金资产净值增长率大于或等于同期业绩基准收益率时，计提比例为0.05%；当基金资产净值增长率小于同期业绩基准收益率时，计提比例为0%。

3.10 基金合同生效当年以基金资产净值增长率与同期业绩基准收益率的差值作为业绩报酬计提比例，即：(基金资产净值增长率-同期业绩基准收益率)×0.05%，当基金资产净值增长率大于或等于同期业绩基准收益率时，计提比例为0.05%；当基金资产净值增长率小于同期业绩基准收益率时，计提比例为0%。

3.11 基金合同生效当年以基金资产净值增长率与同期业绩基准收益率的差值作为业绩报酬计提比例，即：(基金资产净值增长率-同期业绩基准收益率)×0.05%，当基金资产净值增长率大于或等于同期业绩基准收益率时，计提比例为0.05%；当基金资产净值增长率小于同期业绩基准收益率时，计提比例为0%。

3.12 基金合同生效当年以基金资产净值增长率与同期业绩基准收益率的差值作为业绩报酬计提比例，即：(基金资产净值增长率-同期业绩基准收益率)×0.05%，当基金资产净值增长率大于或等于同期业绩基准收益率时，计提比例为0.05%；当基金资产净值增长率小于同期业绩基准收益率时，计提比例为0%。

3.13 基金合同生效当年以基金资产净值增长率与同期业绩基准收益率的差值作为业绩报酬计提比例，即：(基金资产净值增长率-同期业绩基准收益率)×0.05%，当基金资产净值增长率大于或等于同期业绩基准收益率时，计提比例为0.05%；当基金资产净值增长率小于同期业绩基准收益率时，计提比例为0%。

3.14 基金合同生效当年以基金资产净值增长率与同期业绩基准收益率的差值作为业绩报酬计提比例，即：(基金资产净值增长率-同期业绩基准收益率)×0.05%，当基金资产净值增长率大于或等于同期业绩基准收益率时，计提比例为0.05%；当基金资产净值增长率小于同期业绩基准收益率时，计提比例为0%。

3.15 基金合同生效当年以基金资产净值增长率与同期业绩基准收益率的差值作为业绩报酬计提比例，即：(基金资产净值增长率-同期业绩基准收益率)×0.05%，当基金资产净值增长率大于或等于同期业绩基准收益率时，计提比例为0.05%；当基金资产净值增长率小于同期业绩基准收益率时，计提比例为0%。

3.16 基金合同生效当年以基金资产净值增长率与同期业绩基准收益率的差值作为业绩报酬计提比例，即：(基金资产净值增长率-同期业绩基准收益率)×0.05%，当基金资产净值增长率大于或等于同期业绩基准收益率时，计提比例为0.05%；当基金资产净值增长率小于同期业绩基准收益率时，计提比例为0%。

3.17 基金合同生效当年以基金资产净值增长率与同期业绩基准收益率的差值作为业绩报酬计提比例，即：(基金资产净值增长率-同期业绩基准收益率)×0.05%，当基金资产净值增长率大于或等于同期业绩基准收益率时，计提比例为0.05%；当基金资产净值增长率小于同期业绩基准收益率时，计提比例为0%。

3.18 基金合同生效当年以基金资产净值增长率与同期业绩基准收益率的差值作为业绩报酬计提比例，即：(基金资产净值增长率-同期业绩基准收益率)×0.05%，当基金资产净值增长率大于或等于同期业绩基准收益率时，计提比例为0.05%；当基金资产净值增长率小于同期业绩基准收益率时，计提比例为0%。

3.19 基金合同生效当年以基金资产净值增长率与同期业绩基准收益率的差值作为业绩报酬计提比例，即：(基金资产净值增长率-同期业绩基准收益率)×0.05%，当基金资产净值增长率大于或等于同期业绩基准收益率时，计提比例为0.05%；当基金资产净值增长率小于同期业绩基准收益率时，计提比例为0%。

3.20 基金合同生效当年以基金资产净值增长率与同期业绩基准收益率的差值作为业绩报酬计提比例，即：(基金资产净值增长率-同期业绩基准收益率)×0.05%，当基金资产净值增长率大于或等于同期业绩基准收益率时，计提比例为0.05%；当基金资产净值增长率小于同期业绩基准收益率时，计提比例为0%。

3.21 基金合同生效当年以基金资产净值增长率与同期业绩基准收益率的差值作为业绩报酬计提比例，即：(基金资产净值增长率-同期业绩基准收益率)×0.05%，当基金资产净值增长率大于或等于同期业绩基准收益率时，计提比例为0.05%；当基金资产净值增长率小于同期业绩基准收益率时，计提比例为0%。

3.22 基金合同生效当年以基金资产净值增长率与同期业绩基准收益率的差值作为业绩报酬计提比例，即：(基金资产净值增长率-同期业绩基准收益率)×0.05%，当基金资产净值增长率大于或等于同期业绩基准收益率时，计提比例为0.05%；当基金资产净值增长率小于同期业绩基准收益率时，计提比例为0%。

3.23 基金合同生效当年以基金资产净值增长率与同期业绩基准收益率的差值作为业绩报酬计提比例，即：(基金资产净值增长率-同期业绩基准收益率)×0.05%，当基金资产净值增长率大于或等于同期业绩基准收益率时，计提比例为0.05%；当基金资产净值增长率小于同期业绩基准收益率时，计提比例为0%。

3.24 基金合同生效当年以基金资产净值增长率与同期业绩基准收益率的差值作为业绩报酬计提比例，即：(基金资产净值增长率-同期业绩基准收益率)×0.05%，当基金资产净值增长率大于或等于同期业绩基准收益率时，计提比例为0.05%；当基金资产净值增长率小于同期业绩基准收益率时，计提比例为0%。

3.25 基金合同生效当年以基金资产净值增长率与同期业绩基准收益率的差值作为业绩报酬计提比例，即：(基金资产净值增长率-同期业绩基准收益率)×0.05%，当基金资产净值增长率大于或等于同期业绩基准收益率时，计提比例为0.05%；当基金资产净值增长率小于同期业绩基准收益率时，计提比例为0%。

3.26 基金合同生效当年以基金资产净值增长率与同期业绩基准收益率的差值作为业绩报酬计提比例，即：(基金资产净值增长率-同期业绩基准收益率)×0.05%，当基金资产净值增长率大于或等于同期业绩基准收益率时，计提比例为0.05%；当基金资产净值增长率小于同期业绩基准收益率时，计提比例为0%。

3.27 基金合同生效当年以基金资产净值增长率与同期业绩基准收益率的差值作为业绩报酬计提比例，即：(基金资产净值增长率-同期业绩基准收益率)×0.05%，当基金资产净值增长率大于或等于同期业绩基准收益率时，计提比例为0.05%；当基金资产净值增长率小于同期业绩基准收益率时，计提比例为0%。

3.28 基金合同生效当年以基金资产净值增长率与同期业绩基准收益率的差值作为业绩报酬计提比例，即：(基金资产净值增长率-同期业绩基准收益率)×0.05%，当基金资产净值增长率大于或等于同期业绩基准收益率时，计提比例为0.05%；当基金资产净值增长率小于同期业绩基准收益率时，计提比例为0%。