

长信美国标准普尔100等权重指数增强型证券投资基金
2013年半年度报告摘要

2013年6月30日

基金管理人：长信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2013年8月29日

§ 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2013年8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2013年1月1日起至2013年6月30日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	长信标普100等权重指数（QDII）
基金主代码	519981
交易代码	519981
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年3月30日
基金管理人	长信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	24,978,640.43份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过增强型指数化的投资来追求美国超大市值蓝筹股股票市场的中长期资本增值，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段力争将基金净值增长率和美国标准普尔100等权重指数（本基金的标的指数，以下简称“标普100等权重指数”）收益率之间的日均跟踪误差控制在0.50%以内（相应的年化跟踪误差控制在7.94%以内）。在控制跟踪误差的前提下通过有效的资产及行业组合和基本面研究，力求实现对标的指数的有效跟踪并取得优于标的指数的收益率。
投资策略	本基金为股票指数增强型基金，原则上不少于80%的基金净资产采用完全复制法，按照成份股在标普100等权重指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成分股及其权重的变化、进行相应的调整。对于不高于基金净资产15%的主动型投资部分，基金管理人会根据深入的公司基本面和数量化研究以及对美国及全球宏观经济的理解和判断，在美国公开发行或上市交易的证券中有选择地重点投资于基金管理人认为最具有中长期成长价值的企业或本基金允许投资的固定收益类品种、货币市场工具、金融衍生品以及有关法律法規和中国证监会允许本基金投资的其他金融工具。
业绩比较基准	标准普尔100等权重指数总收益率

风险收益特征	本基金是股票指数增强型基金，本基金的净值波动与美国大市值蓝筹股票市场的整体波动高度相关，为较高预期收益和较高预期风险的基金品种。
--------	--

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		长信基金管理有限责任公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	周永刚	唐州徽
	联系电话	021-61009999	95566
	电子邮箱	zhouyg@cxfund.com.cn	tgxxpl@bank-of-china.com
客户服务电话		4007005566	95566
传真		021-61009800	010-66594942

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	-	Bank Of China (Hong Kong) Limited
	中文	-	中国银行(香港)有限公司
注册地址		-	香港花园道1号中银大厦
办公地址		-	香港花园道1号中银大厦
邮政编码		-	-

2.5 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.cxfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	上海银城中路68号时代金融中心9楼、北京西城区复兴门内大街1号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2013年1月1日—2013年6月30日）
本期已实现收益	1,940,999.04
本期利润	2,882,037.21
加权平均基金份额本期利润	0.1085
本期基金份额净值增长率	9.25%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2013年6月30日）
期末可供分配基金份额利润	0.0790
期末基金资产净值	28,023,826.08
期末基金份额净值	1.122

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、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），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

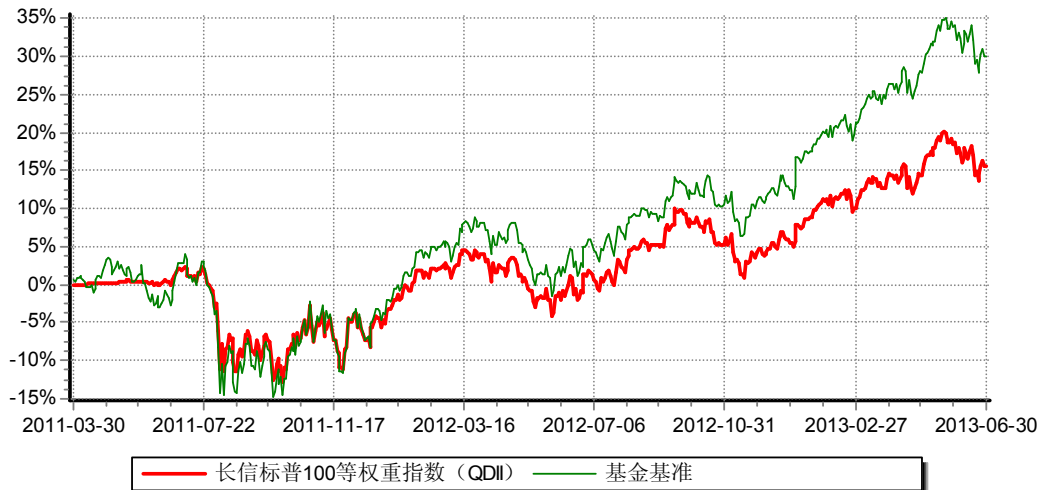
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-1.41%	0.92%	-1.52%	1.06%	0.11%	-0.14%
过去三个月	0.99%	0.79%	2.96%	0.88%	-1.97%	-0.09%
过去六个月	9.25%	0.72%	15.19%	0.82%	-5.94%	-0.10%
过去一年	14.07%	0.72%	23.78%	0.80%	-9.71%	-0.08%
自基金合同生效起至今（2011年3月30日至	15.55%	0.99%	30.05%	1.20%	-14.50%	-0.21%

2013年6月30日)

注：同期业绩比较基准以美元计价，不包含人民币汇率变动等因素产生的效应。

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：1、图示日期为2011年3月30日至2013年6月30日。

2、按基金合同规定，本基金自合同生效日起6个月内为建仓期，建仓期结束时，本基金各项投资比例已符合基金合同中关于投资范围、资产配置比例和投资限制的有关规定：对标普100等权重指数的成份股的投资比例为基金资产净值的80%–95%；现金、现金等价物及到期日在一年以内的美国或中国短期政府债券的比例为基金资产净值的5%–20%；主动投资部分占基金资产净值的0%–15%，投资于在美国证券市场公开发行或挂牌交易的权益类品种、固定收益类品种、金融衍生品以及有关法律法规和中国证监会允许本基金投资的其他金融工具。

3、同期业绩比较基准以美元计价，不包含人民币汇率变动等因素产生的效应。

§ 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

长信基金管理有限责任公司是经中国证监会证监基金字【2003】63号文批准，由长江证券股份有限公司、上海海欣集团股份有限公司、武汉钢铁股份有限公司共同发起设立。注册资本1.5亿元人民币。目前股权结构为：长江证券股份有限公司占49%、上海海欣集团股份有限公司占34.33%、武汉钢铁股份有限公司占16.67%。

截至2013年6月30日，本基金管理人共管理15只开放式基金，即长信利息收益货币、长信银利精选股票、长信金利趋势股票、长信增利动态策略股票、长信双利优选混合、长信利丰债券、长信恒利优势股票、长信中证中央企业100指数（LOF）、长信中短债债券、长信量化先锋股票、长信美国标准普尔100等权重指数（QDII）、长信利鑫分级债、长信内需成长股票、长信可转债债券和长信利众分级债。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
薛天	本基金的基金经理、国际业务部投资总监	2011年3月30日	—	16年	美国哥伦比亚大学工商管理硕士和公共卫生学硕士，具有美国SEC证券业务从业资格、英国SFA证券与金融衍生品从业资格和中国基金从业资格。薛天先生在美国基金管理行业和投资研究行业有超过10年的工作经验。曾任法国巴黎银行（伦敦/纽约）股票分析师、花旗集团投资部基金经理、美国 Empyrean Capital Partners 基金经理和合伙人，一直从事证券研究和投

					资管理工作。于2009年5月加入长信基金，现任国际业务部投资总监和本基金的基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：1、首任基金经理任职日期以本基金成立之日为准；新增或变更以刊登新增/变更基金经理的公告披露日为准。

2、本基金基金经理的证券从业年限以基金经理进入证券业务相关机构的工作经历为时间计算标准。

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金未聘请境外投资顾问。

4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

本基金将继续以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，努力为基金份额持有人谋求最大利益。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司已实行公平交易制度，并建立公平交易制度体系，已建立投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，公司已通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

4.4.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，除完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合外，其余各投资组合未参与交易所公开竞价同日反向交易，不涉及成交较少的单边交易量超过

该证券当日成交量5%的情形，未发现异常交易行为。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

美国市场在2013年上半年表现出色，其市场代表标普500指数在本报告期内涨幅12.63%，而且市场的波动性处在较低的水平。美国股市的上升最主要的原因在于经济基本面的强劲恢复，大部分宏观经济数据超出预期。当前美国经济中最为重要的两大支柱-就业市场和房地产市场在本报告期内出现了明显的复苏和增长，尤其是住宅房地产市场，无论是价格、交易量还是一些先行指标如开工许可等都出现了非常强劲的上扬。美国经济已经完全从金融危机后的虚弱增长中恢复，并有进一步加快的趋势。2012年存在的一些潜在的，对经济有重大影响的负面因素都已经消失或大为减弱，比如财政悬崖事件、总统大选、欧债危机等。良好的经济数据导致了市场形成对美联储宽松政策提早退出的预期，美国债市由此在二季度经历了一次利率的大幅上升，波动性也显著加大。一方面流动性收紧的预期使股市估值受到压制，而且无风险利率的上升也使股市的理论估值下降；另一方面宽松货币政策的提早推出是基于良好的宏观经济局面，这是美国股市在中长期上升的基本面基础。标普500指数在二季度先扬后抑再扬，涨幅为2.36%。我们认为在接下去的一两个季度里市场会逐步消化流动性收紧的负面影响，经济的超预期增长将为股市的中长期上升打下良好的基础。

报告期间本基金严格按照基金合同的规定，努力控制和减小和标的指数的跟踪误差，基金的日平均误差和年度误差均大幅低于合同规定的上限。在主动性投资上主要采取了基于宏观策略研究和市场趋势判断的宏观择时交易，由于大额申购赎回，人民币汇率以及股票仓位稍微保守的影响下，主动型投资对基金业绩并未创造正性的超额收益。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截止到2013年6月30日，本基金份额净值为1.122元，份额累计净值为1.152元，本报告期内本基金净值增长率为9.25%，同期业绩比较基准涨幅为15.19%。本基金在报告期内所取得的超额收益为-5.94%（已考虑人民币升值因素）。本报告期内，本基金相对于标普100等权重全收益指数的日均跟踪误差为0.19%，年化

跟踪误差为3.01%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为美国经济仍然是主要经济体中最为健康的，它的增长方向明确，增长动力正在逐步加强。经济和市场的不确定性在目前已经显著的降低，这对美国股市是一个重要的正性因素。虽然欧债危机还远未彻底解决，且时有突发事件引发资本市场的避险情绪，我们认为，相对而言，这些国际市场的不确定性和流动性的逐步收紧正为国际资本流向确定性较高的美国市场打下良好的铺垫。美国股市在2013年上半年已连创历史新高，反映了大部分经济和市场上的利好，在缺乏新的利好的情况下，且随着时间的推移，在年初退出的经济刺激政策的影响可能会逐渐显现，影响美国的消费者的心里及消费行为，股市可能在短期面临着窄幅区间震荡或小幅调整。基于美国经济良好的基本面和增长趋势，我们对2013年的美国股市持相对乐观的观点，我们认为市场的调整将是提高仓位的良好时机，本基金在资产配置上将会反映出以上的投资策略。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证券监督管理委员会2008年9月12日发布的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》（[2008]38号文）的规定，长信基金管理有限责任公司（以下简称“公司”）制订了健全、有效的估值政策和程序，成立了估值工作小组，小组成员由投资管理部总监、固定收益部总监、研究发展部总监、交易管理部总监、金融工程部总监、基金事务部总监以及基金事务部至少一名业务骨干共同组成。相关参与人员都具有丰富的证券行业工作经验，熟悉相关法规和估值方法。基金经理不直接参与估值决策，如果基金经理认为某证券有更好的证券估值方法，可以申请公司估值工作小组对某证券进行专项评估。估值决策由与会估值工作小组成员1/2以上多数票通过。对于估值政策，公司与基金托管人充分沟通，达成一致意见。审计本基金的会计师事务所认可公司基金估值政策和程序的适当性。

参与估值流程各方不存在任何重大利益冲突。报告期内，未签订与估值相关的定价服务。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规和本基金基金合同规定的基金收益分配原则以及基金实际运作情况，本基金本报告期没有进行利润分配。

本基金收益分配原则如下：

- 1、基金的每份基金份额享有同等分配权；
- 2、基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式，基金份额持有人可自行选择收益分配方式；基金份额持有人事先未做出选择的，默认的分红方式为现金红利；
- 3、收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记结算机构可将投资者的现金红利按分红权益再投资日（具体以届时的基金分红公告为准）的基金份额净值自动转为基金份额；
- 4、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为12次，每份基金份额每次分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的10%；若基金合同生效不满3个月，可不进行收益分配；
- 5、基金当期收益先弥补上期亏损后，方可进行当期收益分配；
- 6、基金收益分配后每一基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额净值分配金额后不能低于面值；
- 7、基金红利发放日距离收益分配基准日（即期末可供分配利润计算截至日）的时间不得超过15个工作日。
- 8、法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：长信美国标准普尔100等权重指数增强型证券投资基金

报告截止日：2013年6月30日

单位：人民币元

资 产	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
资 产：		
银行存款	4,341,715.16	28,490,782.74
结算备付金	—	—
存出保证金	—	—
交易性金融资产	25,097,011.27	27,498,336.34
其中：股票投资	25,097,011.27	27,498,336.34
基金投资		—
债券投资	—	—
资产支持证券投资	—	—
衍生金融资产	—	—
买入返售金融资产	—	—
应收证券清算款	—	—
应收利息	321.42	2,033.13
应收股利	28,819.50	24,475.86
应收申购款	100,719.35	710,060.55
递延所得税资产		—
其他资产	—	—
资产总计	29,568,586.70	56,725,688.62
负债和所有者权益	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
负 债：		
短期借款	—	—
交易性金融负债	—	—
衍生金融负债	—	—
卖出回购金融资产款	—	—

应付证券清算款	—	—
应付赎回款	829,262.30	106,429.48
应付管理人报酬	25,918.21	31,973.67
应付托管费	7,068.61	8,720.10
应付销售服务费	—	—
应付交易费用	—	—
应交税费	—	—
应付利息	—	—
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	682,511.50	687,235.54
负债合计	1,544,760.62	834,358.79
所有者权益：		
实收基金	24,978,640.43	54,445,302.05
未分配利润	3,045,185.65	1,446,027.78
所有者权益合计	28,023,826.08	55,891,329.83
负债和所有者权益总计	29,568,586.70	56,725,688.62

注：报告截止日2013年6月30日，基金份额净值1.122元，基金份额总额24,978,640.43份。

6.2 利润表

会计主体：长信美国标准普尔100等权重指数增强型证券投资基金

本报告期：2013年1月1日至2013年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月 30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月 30日
一、收入	3,365,585.47	3,872,207.07
1. 利息收入	11,656.30	14,313.09
其中：存款利息收入	11,656.30	14,313.09
债券利息收入	—	—
资产支持证券利息收入	—	—

买入返售金融资产收入	—	—
其他利息收入	—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）	2,456,821.23	844,304.91
其中：股票投资收益	2,212,346.17	436,598.49
基金投资收益	—	—
债券投资收益	—	—
资产支持证券投资收益	—	—
衍生工具收益	—	—
股利收益	244,475.06	407,706.42
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	941,038.17	2,979,873.18
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-86,686.54	6,771.74
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	42,756.31	26,944.15
减：二、费用	483,548.26	622,501.52
1. 管理人报酬	161,871.38	262,642.68
2. 托管费	44,146.79	71,629.84
3. 销售服务费	—	—
4. 交易费用	14,628.56	20,415.40
5. 利息支出	—	—
其中：卖出回购金融资产支出	—	—
6. 其他费用	262,901.53	267,813.60
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	2,882,037.21	3,249,705.55
减：所得税费用	—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	2,882,037.21	3,249,705.55

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长信美国标准普尔100等权重指数增强型证券投资基金

本报告期：2013年1月1日至2013年6月30日

单位：人民币元

项目	本期		
	2013年1月1日至2013年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	54,445,302.05	1,446,027.78	55,891,329.83
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	2,882,037.21	2,882,037.21
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-29,466,661.62	-1,282,879.34	-30,749,540.96
其中：1. 基金申购款	4,090,400.03	461,283.14	4,551,683.17
2. 基金赎回款	-33,557,061.65	-1,744,162.48	-35,301,224.13
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	—	—	—
五、期末所有者权益(基金净值)	24,978,640.43	3,045,185.65	28,023,826.08
项目	上年度可比期间		
	2012年1月1日至2012年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	49,608,221.95	-2,518,640.55	47,089,581.40
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	3,249,705.55	3,249,705.55
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-6,684,082.90	-178,538.08	-6,862,620.98
其中：1. 基金申购款	14,952,986.32	205,203.00	15,158,189.32
2. 基金赎回款	-21,637,069.22	-383,741.08	-22,020,810.30
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	—	—	—
五、期末所有者权益(基金净值)	42,924,139.05	552,526.92	43,476,665.97

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

田丹	蒋学杰	孙红辉
----	-----	-----

基金管理公司负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人
-----------	-----------	---------

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

长信美国标准普尔100等权重指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于核准长信美国标准普尔100等权重指数增强型证券投资基金募集的批复》(证监基金字[2010]1586号文)批准,由长信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《长信美国标准普尔100等权重指数增强型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于2011年3月30日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为长信基金管理有限责任公司,基金托管人为中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”),境外资产托管人为中国银行(香港)有限公司(以下简称“中银香港”)。

本基金于2011年2月28日至2011年3月25日募集,募集资金总额人民币507,960,871.41元,利息转份额人民币463,841.99元,募集规模为508,424,713.40份。上述募集资金已由上海众华沪银会计师事务所有限公司验证,并出具了沪众会字(2011)第2913号验资报告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》、《长信美国标准普尔100等权重指数增强型证券投资基金基金合同》和《长信美国标准普尔100等权重指数增强型证券投资基金招募说明书(更新)》的有关规定,本基金主要投资于标普100等权重指数成份股,同时也可主动投资于下列金融产品或工具:权益类品种(包括在美国证券市场挂牌交易的普通股、优先股、美国存托凭证、交易型开放式指数基金等);固定收益类品种(包括美国政府债券、美国市场公开发行的公司债券及可转换债券等债券资产);回购协议、美国或中国短期政府债券、现金等价物、货币市场基金等货币市场工具;经中国证监会认可的境外交易所(美国)挂牌交易的金融衍生品(包括期权期货);以及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金为股票指数增强型基金,对标普100等权重指数的成份股的投资比例为基金资产净值的80%-95%;现金、现金等价物及到期日在一年以内的美国或中

国短期政府债券的比例为基金资产净值的5%-20%；主动投资部分占基金资产净值的0%-15%，投资于在美国证券市场公开发行或挂牌交易的权益类品种、固定收益类品种、金融衍生品以及有关法律法规和中国证监会允许本基金投资的其他金融工具。本基金的业绩比较基准为：标准普尔100等权重指数总收益率。

根据《证券投资基金信息披露管理办法》，本基金定期报告在公开披露的第二个工作日，报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金按照财政部颁布的企业会计准则、中国证券业协会2007年颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《长信美国标准普尔100等权重指数增强型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注6.4.4所列示的基金行业实务操作的规定编制年度财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)于2006年2月15日颁布的《企业会计准则-基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)的要求，真实、完整地反映了本基金的财务状况、经营成果和基金净值变动情况。

此外本财务报表同时符合如财务报表附注6.4.2所列示的其他有关规定的要求。

6.4.4 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.4.2 差错更正的说明

本基金在本报告期未发生过重大会计差错。

6.4.5 税项

根据财税字[1998]55号文、财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他境内外相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

- 1) 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不征收营业税。
- 2) 目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂免征营业税和企业所得税。
- 3) 目前基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂未征收个人所得税和企业所得税。

6.4.6 关联方关系

6.4.6.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方无变化。

6.4.6.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
长信基金管理有限责任公司	基金管理人
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人
长江证券股份有限公司（“长江证券”）	基金管理人的股东

6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间没有通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.7.2 关联方报酬

6.4.7.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付	161,871.38	262,642.68

的管理费		
其中：支付销售机构的客户维护费	50,873.01	75,584.22

注：支付基金管理人长信基金管理有限责任公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值1.1%的年费率确认，逐日累计至每月月底，按月支付。

计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×1.1%/当年天数

6.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2013年1月1日至2013年6月30日	2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	44,146.79	71,629.84

注：支付基金托管人中国银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.3%的年费率确认，逐日累计至每月月底，按月支付。

计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.3%/当年天数

6.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过银行间同业市场进行债券(含回购)交易。

6.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.7.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2013年1月1日至2013年6月30日	2012年1月1日至2012年6月30日
期初持有的基金份额	10,001,888.88	10,001,888.88
期间申购/买入总份额	—	—
期间赎回/卖出总份额	—	—
期间由于拆分增加的份额	—	—
期末持有的基金份额	10,001,888.88	10,001,888.88
期末持有的基金份额占基金总份额比例	40.04%	23.30%

注：基金管理人运用固有资金投资本基金费率按本基金基金合同公布的费率执

行。

6.4.7.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

除基金管理人之外的其他关联方在本报告期及上年度可比期间均未投资过本基金。

6.4.7.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2013年1月1日至2013年6月30日		2012年1月1日至2012年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	1,539,865.45	11,643.27	707,322.25	14,300.54
中国银行(香港)	2,801,849.71	—	4,594,090.04	—

6.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期及上年度可比期间均未在承销期内购入由关联方承销的证券。

6.4.7.7 其他关联交易事项的说明

上述关联交易均根据正常的商业交易条件进行，并以一般交易价格为定价基础。

6.4.8 期末（2013年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

截止本报告期末，本基金未因认购新发/增发而持有流通受限证券。

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末未持有因债券正回购交易而作为抵押的债券。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	25,097,011.27	84.88
	其中：普通股	25,097,011.27	84.88
	存托凭证	—	—
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
	其中：远期	—	—
	期货	—	—
	期权	—	—
	权证	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	货币市场工具	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	4,341,715.16	14.68
8	其他各项资产	129,860.27	0.44
9	合计	29,568,586.70	100.00

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家(地区)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
美国	25,097,011.27	89.56
合计	25,097,011.27	89.56

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

7.3.1 期末积极投资按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
信息技术	1,377,355.80	4.91
必需消费品	345.20	0.00
能源	182.02	0.00
合计	1,377,883.02	4.92

注：以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

7.3.2 期末指数投资按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
信息技术	3,516,839.80	12.55
工业	3,340,325.53	11.92
金融	3,586,621.91	12.80
保健	2,823,369.63	10.07
必需消费品	2,571,628.69	9.18
能源	2,606,943.85	9.30
非必需消费品	3,160,607.64	11.28
材料	918,301.75	3.28
公共事业	719,321.72	2.57
电信服务	475,167.73	1.70
合计	23,719,128.25	84.64

注：以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细

7.4.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券 代码	所在 证券 市场	所属 国家 (地 区)	数量 (股)	公允价值	占基 金资 产净 值比 例(%)
----	--------------	--------------	----------	----------------	----------------------	-----------	------	------------------------------

1	COMCAST CORP-CLASS A	康卡斯特	CMC SA US	纳斯 达克	美国	981.00	253,847.44	0.91
2	NEWS CORP-CL A	新闻集团	NWS A US	纳斯 达克	美国	1,247.0 0	251,177.75	0.90
3	METLIFE INC	大都会集 团	MET US	纽交 所	美国	887.00	250,788.00	0.89
4	US BANCORP	US Bancorp 公司	USB US	纽交 所	美国	1,114.0 0	248,823.05	0.89
5	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	第一资本 金融	COF US	纽交 所	美国	639.00	247,985.77	0.88
6	NIKE INC -CL B	耐克公司	NKE US	纽交 所	美国	630.00	247,879.56	0.88
7	WELLS FARGO & CO	富国银行	WFC US	纽交 所	美国	971.00	247,600.10	0.88
8	ALLSTATE CORP	全州保险	ALL US	纽交 所	美国	832.00	247,369.44	0.88
9	UNITEDHEALTH GROUP INC	联合健康	UNH US	纽交 所	美国	611.00	247,199.16	0.88
10	AMERICAN EXPRESS CO	美国运通	AXP US	纽交 所	美国	534.00	246,665.07	0.88

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有权益投资明细，应阅读登载于长信基金管理有限责任公司网站（www.cxfund.com.cn）的半年度报告正文。

7.4.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证 券 代 码	所 在 证 券 市 场	所 属 国 家 (地 区)	数 量 (股)	公 允 价 值	占 基 金 资 产 净 值 比 例 (%)
1	SINA CORP	新浪	SIN	纳斯	美国	4,000.0	1,377,355.8	4.91

			A US	达克		0	0	
2	KRAFT FOODS GROUP INC	卡夫食品集团	KRF T US	纳斯达克	美国	1.00	345.20	0.00
3	PHILLIPS 66	Phillips 66 公司	PSX US	纽交所	美国	0.50	182.02	0.00

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有权益投资明细，应阅读登载于长信基金管理有限责任公司网站（www.cxfund.com.cn）的半年度报告正文。

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	ABBOTT LABORATORIES	ABT US	247,316.63	0.44
2	ABBVIE INC	ABBV US	236,162.10	0.42
3	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	AIG US	222,609.04	0.40
4	GENERAL MOTORS CO	GM US	219,660.47	0.39
5	APPLE INC	AAPL US	192,178.71	0.34
6	FREEMPORT-MCMORAN COPPER	FCX US	184,557.00	0.33
7	CATERPILLAR INC	CAT US	168,424.17	0.30
8	EXELON CORP	EXC US	167,897.13	0.30
9	EBAY INC	EBAY US	162,743.92	0.29
10	EMC CORP/MASS	EMC US	160,448.64	0.29
11	SOUTHERN CO	SO US	160,036.62	0.29
12	WILLIAMS COS INC	WMB US	159,203.48	0.28
13	EXXON MOBIL CORP	XOM US	158,859.38	0.28
14	QUALCOMM INC	QCOM US	157,170.75	0.28
15	AMGEN INC	AMGN US	157,017.16	0.28
16	CONOCOPHILLIPS	COP US	155,202.94	0.28

17	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	PM US	154,561.89	0.28
18	AT&T INC	T US	154,452.12	0.28
19	DEVON ENERGY CORPORATION	DVN US	153,785.69	0.28
20	COCA-COLA CO/THE	KO US	153,779.26	0.28

注：本项买入金额均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑其它交易费用。

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	HJ HEINZ CO	HNZ US	402,656.00	0.72
2	BAKER HUGHES INC	BHI US	388,665.32	0.70
3	DELL INC	DELL US	320,211.83	0.57
4	HEWLETT-PACKARD CO	HPQ US	255,186.27	0.46
5	WALGREEN CO	WAG US	232,246.92	0.42
6	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	BMJ US	227,955.84	0.41
7	BOEING CO/THE	BA US	220,575.85	0.39
8	MICROSOFT CORP	MSFT US	210,785.17	0.38
9	UNITEDHEALTH GROUP INC	UNH US	207,789.49	0.37
10	FORD MOTOR CO	F US	205,938.09	0.37
11	LOCKHEED MARTIN CORP	LMT US	205,429.32	0.37
12	GILEAD SCIENCES INC	GILD US	204,232.37	0.37
13	NIKE INC -CL B	NKE US	201,121.49	0.36
14	RAYTHEON COMPANY	RTN US	200,086.34	0.36
15	MEDTRONIC INC	MDT US	197,948.56	0.35

16	WILLIAMS COS INC	WMB US	196,016.74	0.35
17	MORGAN STANLEY	MS US	195,058.43	0.35
18	GOLDMAN SACHS GROUP INC	GS US	194,868.86	0.35
19	EXELON CORP	EXC US	194,855.45	0.35
20	CVS CAREMARK CORP	CVS US	194,133.70	0.35

注：本项卖出金额均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑其它交易费用。

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	14,084,100.42
卖出收入（成交）总额	19,638,809.33

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”和“卖出股票的收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资 明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资 明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未出现被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.11.2 本基金投资的前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	—
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	28,819.50
4	应收利息	321.42
5	应收申购款	100,719.35
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	129,860.27

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资的前十名股票中不存在流通受限情况。

7.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资的前五名股票中不存在流通受限情况。

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金 份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有 份额	占总份 额比例	持有 份额	占总份 额比例
1,078	23,171.28	10,001,888.88	40.04%	14,976,751.55	59.96%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	150,285.35	0.60%

注：1、期末本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 10 万份至 50 万份（含）；

2、期末该只基金的基金经理持有该只基金份额总量的数量区间为 0 至 10 万份（含）。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2011年3月30日)基金份额总额	508,424,713.40
本报告期期初基金份额总额	54,445,302.05
本报告期基金总申购份额	4,090,400.03
减：本报告期基金总赎回份额	33,557,061.65
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	24,978,640.43

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、2013年1月5日，基金管理人对外发布了《关于基金行业高级管理人员变更公告》，增聘宋小龙先生担任公司副总经理。

2、2013年3月17日，根据国家金融工作需要，肖钢先生辞去中国银行股份有限公司董事长职务。中国银行股份有限公司已于2013年3月17日公告上述事项。

3、2013年6月1日，中国银行股份有限公司发布公告，自2013年5月31日起，田国立先生就任本行董事长、执行董事、董事会战略发展委员会主席及委员。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金未更换会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况

本报告期本基金管理人、托管人及其高级管理人员没有受监管部门稽查或处罚的情形。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占股票	佣金	占当期	

	数量		成交总 额比例		佣金 总量的 比例	
Morgan Stanley & Co. International plc	-	33,508,025.90	99.36%	14,174.05	100%	
Citigroup Inc	-	-	-	-	-	

注：本基金本报告期内交易单元无变化。

基金租用交易单元的选择标准和程序

根据中国证监会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》（证监基字〔1998〕29号）和《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基字〔2007〕48号）的有关规定，本公司制定了租用证券公司专用交易单元的选择标准和程序。

（1）选择标准：

- a、券商基本面评价（财务状况、经营状况）；
- b、券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）；
- c、券商每日信息评价（及时性和有效性）；
- d、券商协作表现评价。

（2）选择程序：

首先根据租用证券公司专用交易单元的选择标准形成《券商服务评价表》，然后根据评分高低进行选择基金专用交易单元。

长信基金管理有限责任公司

二〇一三年八月二十九日