# 长信美国标准普尔100等权重指数增强型证券投资基金

## 2011 半年度 报告摘要

2011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：2011年8月27日**

### §1 重要提示及目录

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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2011年8月24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2011年3月30日起至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 | 59,705,540.50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规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 | （010）66594855 |
| | 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 |

### §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（2011年3月30日-2011年6月30日） |
|---|---|
| 本期已实现收益 | 926,639.75 |
| 本期利润 | 1,627,580.54 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0062 |
| 本期基金份额净值增长率 | 1.50% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末（2011年6月30日） |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0028 |
| 期末基金资产净值 | 60,587,700.94 |
| 期末基金份额净值 | 1.015 |

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、本基金合同于2011年3月30日生效，截至报告期末本基金合同生效未满半年，报告期的期间数据和指标按实际存续期计算。

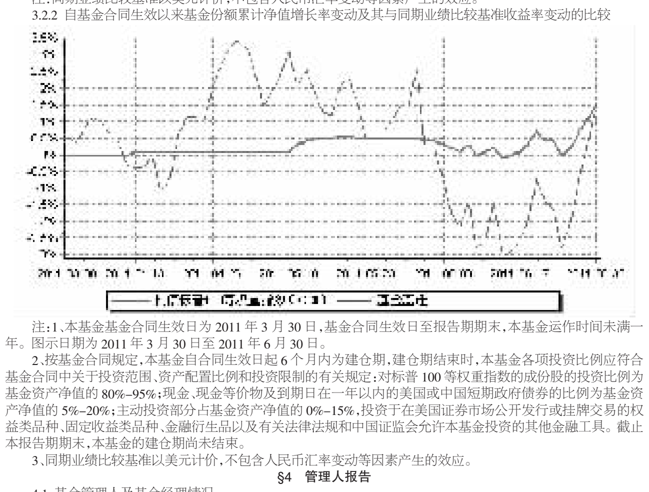
3.2 基金净值表现

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 | 1.00% | 0.26% | 1.04% | 1.04% | -0.04% | -0.78% |
| 过去三个月 | 1.50% | 0.15% | 1.10% | 0.78% | 0.40% | -0.63% |
| 自基金合同生效起至今（2011年03月30日至2011年06月30日） | 1.50% | 0.15% | 0.93% | 0.77% | 0.57% | -0.62% |

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、本基金基金合同生效日为2011年3月30日，基金合同生效日至报告期期末，本基金运作时间未满一年。图示日期为2011年3月30日至2011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应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。截止本报告期期末，本基金的建仓期尚未结束。

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2011年6月30日，本基金管理人管理12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、长信美国标普100等权重指数（QDII）和长信利鑫分级债。

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 | - | 14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证券与金融衍生物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遵规守信情况的说明

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，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 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本报告期内，公司所管理的各基金之间不存在投资风格相类似的投资组合；公司没有管理的投资风格相似的不同投资组合之间的业绩表现差异超过5%之情形。

4.4.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现可能异常交易行为。

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

在美联储第二轮量化宽松政策和良好的宏观经济数据的作用下，标普100等权重指数在本报告期的前二个月中震荡上行；由于受到欧债危机、经济增速放缓、美债违约问题等因素的影响，美国市场在六月上半期出现了较大幅度的回落。随着欧债危机的初步缓解和宏观数据的好转，美国市场在本报告期的最后几个交易日大幅上涨，标普100等权重指数（全收益）收于1539点。

在报告期内本基金管理人对美国经济和市场在中长期持谨慎乐观态度，但因为欧债危机和日本地震对供应链的影响等一些短期的负面因素，市场会以震荡为主。本基金作为一个增强型指数基金，建仓时机的选择有很高的重要性。在充分分析宏观经济和市场因素的基础上，并考虑到第二次量化宽松政策结束带来的潜在风险，本基金在在报告期内逐步谨慎建仓，取得了一定的超额收益。

本基金尚处于建仓期，我们将会在建仓完成后开始对跟踪误差进行报告。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截止到2011年6月30日，本基金份额净值为1.015元，份额累计净值为1.015元，本报告期内本基金净值增长率为1.50%，同期业绩比较基准涨幅为0.93%。本基金在报告期内所取得的超额收益主要来自于基于宏观经济分析的建仓时机的选择。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

7月和8月出现了一些积极因素如欧债危机的初步缓解、美债违约问题的解决以及日本地震对世界经济的影响的逐渐消退等，这些积极因素为美国经济和市场的回升提供了基础。到目前为止大部分美国上市公司的第二季度季报业绩超预期，企业盈利在压缩开支的基础上有较好的表现，较低的估值也是美国股市具有吸引力的一个因素。

另一方面，欧债危机只是得到了初步缓解，其结构性问题的解决还有很长的路要走；宏观经济的好转还并未形成趋势，需要进一步观察：通胀处于低位，但有上升的迹象；大宗商品和美元的走势还未明朗；房地产市场尚未出现好转；美国国债上限的争议还在继续，就业市场恢复乏力。本基金管理人认为美国经济和市场在短期内有可能出现震荡局面，这将为本基金的继续建仓提供机会。除非美国经济和市场出现进一步恶化，本基金认为目前第三次量化宽松政策的推出可能性较小。

本基金将密切关注近期美国经济的动向，尤其是就业人口、通胀、房地产等方面的数据，加强在市场动荡期间对相关个股的研究工作，在市场出现大幅度调整的时候继续进行有选择性的谨慎建仓工作。

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，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）、投资组合报告等内容真实、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：2011年6月30日

单位：人民币元

| 资产 | 本期末 2011年6月30日 |
|---|---|
| 资产： | |
| 银行存款 | 39,293,230.82 |
| 结算备付金 | - |
| 存出保证金 | - |
| 交易性金融资产 | 22,391,116.83 |
| 其中：股票投资 | 22,391,116.83 |
| 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 | 7,329.72 |
| 应收股利 | 18,255.67 |
| 应收申购款 | 2,668.68 |
| 递延所得税资产 | |
| 其他资产 | - |
| 资产总计 | 61,712,601.72 |
| **负债和所有者权益** | **本期末 2011年6月30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 | 899,767.30 |
| 应付管理人报酬 | 55,449.68 |
| 应付托管费 | 15,122.65 |
| 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 | 154,561.15 |
| 负债合计 | 1,124,900.78 |
| 所有者权益： | |
| 实收基金 | 59,705,540.50 |
| 未分配利润 | 882,160.44 |
| 所有者权益合计 | 60,587,700.94 |
| 负债和所有者权益总计 | 61,712,601.72 |

注：1、报告截止日2011年6月30日，基金份额净值1.015元，基金份额总额59,705,540.50份。

2、本基金本报告期为2011年3月30日至2011年6月30日，本基金基金合同于2011年3月30日起正式生效，为报告期内合同生效的基金，本报告期的财务报表和报表附注均无同期对比数据。

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：2011年3月30日至2011年6月30日

单位：人民币元

| 资产 | 本期 2011年3月30日至2011年6月30日 |
|---|---|
| 一、收入 | 2,747,557.41 |
| 1.利息收入 | 1,532,749.84 |
| 其中：存款利息收入 | 1,532,747.99 |
| 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 | 1.85 |
| 2.投资收益（损失以"-"填列） | -49.96 |
| 其中：股票投资收益 | -22,260.88 |
| 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 | 22,210.92 |
| 3.公允价值变动收益（损失以"-"号填列） | 700,940.79 |
| 4.汇兑收益（损失以"-"号填列） | -48,319.80 |
| 5.其他收入（损失以"-"号填列） | 562,236.54 |
| 减：二、费用 | 1,119,976.87 |
| 1.管理人报酬 | 746,013.75 |
| 2.托管费 | 203,458.29 |
| 3.销售服务费 | - |
| 4.交易费用 | 12,878.19 |
| 5.利息支出 | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | - |
| 6.其他费用 | 157,626.64 |
| 三、利润总额（亏损总额以"-"号填列） | 1,627,580.54 |

注：本基金本报告期为2011年3月30日至2011年6月30日，本基金基金合同于2011年3月30日起正式生效，为报告期内合同生效的基金，本报告期的财务报表和报表附注均无同期对比数据。

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：2011年3月30日至2011年6月30日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2011年3月30日至2011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） | 508,424,713.40 | - | 508,424,713.40 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 1,627,580.54 | 1,627,580.54 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少 | -448,719,172.90 | -745,420.10 | -449,464,593.00 |
| 其中：1.基金申购款 | 322,824.38 | 1,401.71 | 324,226.09 |
| 2.基金赎回款（以"-"号填列） | -449,041,997.28 | -746,821.81 | -449,788,819.09 |
| 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） | 59,705,540.50 | 882,160.44 | 60,587,700.94 |

注：本基金本报告期为2011年3月30日至2011年6月30日，本基金基金合同于2011年3月30日起正式生效，为报告期内合同生效的基金，本报告期的财务报表和报表附注均无同期对比数据。

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，首次设立募集规模为508,424,713.40份基金份额。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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《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》的有关规定，本基金的投资范围为主要投资于标普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。本基金投资组合的比例范围为：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所示的其他有关规定的要求。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2011年3月30日至2011年6月30日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融资产在初始确认时按基金对金融资产的持有意图和持有能力分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。本基金目前持有的股票投资、债券投资和衍生工具（主要为权证投资）划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产；其他金融资产划分为应收款项，暂无金融资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。除衍生工具所产生的金融资产外，以公允价值计量且其变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示。

金融负债在初始确认时按承担负债的目的分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。除衍生工具所产生的金融负债外，以公允价值计量且其公允价值变动计入当期损益的金融负债在资产负债表中以交易性金融负债列示。衍生工具所产生的金融负债在资产负债表中以衍生金融负债列示。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，应当单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资（包括股票存托凭证）、债券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

（1）存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

（2）存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

（3）当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金在核算基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于期末全额转入未分配利润/（累计亏损）。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资收益/（损失）于卖出交易日按卖出股票成交金额与其成本的差额确认。

债券投资收益/（损失）于卖出交易日按卖出债券成交金额与其成本和应收利息的差额确认。

衍生工具收益/（损失）于交易日按卖出权证成交金额与其成本的差额确认。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额于除权除息日确认。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息收入。

存款利息收入按存款本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在回购期内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益/（损失）核算基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、衍生金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

6.4.4.10 费用的确认和计量

根据《长信美国标准普尔等权重指数增强型证券投资基金基金合同》的规定，本基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值1.1%的年费率逐日计提。

根据《长信美国标准普尔等权重指数增强型证券投资基金基金合同》的规定，本基金的基金托管费按前一日基金资产净值0.3%的年费率逐日计提。

本基金的交易费用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在回购期内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

本基金的其他费用如不影响估值日基金份额净值小数点后第四位，发生时直接计入基金损益；如果影响基金份额净值小数点后第四位的，应采用待摊或预提的方法，待摊或预提计入基金损益。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

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。

法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13 分部报告

本基金目前以一个经营分部运作。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 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。

6.4.6 税项

主要税项说明：

根据财税字[1998]55号文、[2001]61号文《关于证券投资基金税收问题的通知》、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》、财税字[2005]11号文《关于调整证券（股票）交易印花税税率的通知》、财税[2005]102号文《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2005]107号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2007]84号文《财政部国家税务总局关于调整证券（股票）交易印花税税率的通知》、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）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）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，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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 |

6.4.8 本报告期的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本报告期没有通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2011年3月30日至2011年6月30日 |
|---|---|
| 当期应支付的管理费 | 746,013.75 |
| 其中：支付给销售机构的客户维护费 | - |

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

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2011年3月30日至2011年6月30日 |
|---|---|
| 当期应支付的托管费 | 203,458.29 |

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

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期末与关联方通过银行间同业市场进行债券（含回购）交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 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 2011年3月30日至2011年6月30日 |
|---|---|
| 基金合同生效日持有的基金份额 | 10,001,888.88 |
| 期间申购/买入总份额 | - |
| 期间因拆分变动份额 | - |
| 减：期间赎回/卖出总份额 | - |
| 期末持有的基金份额 | 10,001,888.88 |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 16.75% |

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。

6.4.8.4.2 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

本基金除基金管理人之外的其它关联方在本报告期末未持有过本基金。

6.4.8.5 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 2011年3月30日至2011年6月30日 | |
|---|---|---|
| | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国银行 | 36,412,935.09 | 1,532,747.99 |
| 中国银行（香港） | 2,880,295.73 | - |

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期未在承销期内购入由关联方承销的证券。

6.4.8.7 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。

6.4.9 期末（2011年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 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2011年6月30日止，本基金未因认购新发/增发而持有流通受限证券。

6.4.9.2 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。

6.4.9.3 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 | 22,391,116.83 | 36.28 |
| | 其中：普通股 | 22,391,116.83 | 36.28 |
| | 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 | 39,293,230.82 | 63.67 |
| 8 | 其他资产 | 28,254.07 | 0.05 |
| 9 | 合计 | 61,712,601.72 | 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 | 22,391,116.83 | 36.96 |
| 合计 | 22,391,116.83 | 36.96 |

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股票及存托凭证投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票及存托凭证。

7.3.2 期末指数投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

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（%） |
|---|---|---|
| 保健 | 2,194,795.71 | 3.62 |
| 必需消费品 | 2,795,790.82 | 4.61 |
| 材料 | 1,163,789.12 | 1.92 |
| 电信服务 | 668,296.76 | 1.10 |
| 非必需消费品 | 2,500,779.34 | 4.13 |
| 工业 | 3,156,655.45 | 5.21 |
| 公用事业 | 865,870.96 | 1.43 |
| 金融 | 3,114,285.73 | 5.14 |
| 能源 | 2,499,509.20 | 4.13 |
| 信息技术 | 3,431,343.74 | 5.66 |
| 合计 | 22,391,116.83 | 36.96 |

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前十名权益投资明细

7.4.1 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十名权益投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资股票及存托凭证。

7.4.2 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（人民币元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | MASTERCARD INC-CLASS A | 万事达公司 | MA US | 纽交所 | 美国 | 125 | 243768.99 | 0.4 |
| 2 | VISA INC-CLASS A SHARES | 维萨公司 | V US | 纽交所 | 美国 | 447 | 243,747.77 | 0.4 |
| 3 | NATIONAL OILWELL VARCO INC | 美国国民油井 | NOV US | 纽交所 | 美国 | 481 | 243,455.19 | 0.4 |
| 4 | CATERPILLAR INC | 卡特彼勒 | CAT US | 纽交所 | 美国 | 347 | 239,071.39 | 0.39 |
| 5 | NIKE INC -CL B | 耐克公司 | NKE US | 纽交所 | 美国 | 410 | 238,748.97 | 0.39 |
| 6 | HALLIBURTON CO | 哈利伯顿 | HAL US | 纽交所 | 美国 | 722 | 238,297.26 | 0.39 |
| 7 | FREEPORT-MCMORAN COPPER | 自由港迈克墨伦 | FCX US | 纽交所 | 美国 | 693 | 237,246.91 | 0.39 |
| 8 | NEWS CORP-CL A | 新闻集团 | NWSA US | 纳斯达克 | 美国 | 2,070 | 237,112.95 | 0.39 |
| 9 | MONSANTO CO | 孟山都 | MON US | 纽交所 | 美国 | 505 | 237,072.18 | 0.39 |
| 10 | AMAZON.COM INC | 亚马逊公司 | AMZN US | 纳斯达克 | 美国 | 179 | 236,884.57 | 0.39 |

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末基金资产净值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 | 占期末基金资产净值比例 |
|---|---|---|---|---|
| 1 | BANK OF AMERICA CORP | BAC US | 369,732.81 | 0.61% |
| 2 | UNITEDHEALTH GROUP INC | UNH US | 248,001.07 | 0.41% |
| 3 | AMAZON.COM INC | AMZN US | 246,946.40 | 0.41% |
| 4 | JOHNSON & JOHNSON | JNJ US | 242,827.90 | 0.40% |
| 5 | MASTERCARD INC-CLASS A | MA US | 241,727.90 | 0.40% |
| 6 | BAXTER INTERNATIONAL INC | BAX US | 241,686.89 | 0.40% |
| 7 | MERCK & CO. INC. | MRK US | 240,485.62 | 0.40% |
| 8 | COLGATE-PALMOLIVE CO | CL US | 240,218.86 | 0.40% |
| 9 | CVS CAREMARK CORP | CVS US | 240,047.66 | 0.40% |
| 10 | COSTCO WHOLESALE CORP | COST US | 239,496.74 | 0.40% |
| 11 | MCDONALD'S CORP | MCD US | 239,191.21 | 0.39% |
| 12 | AMERICAN ELECTRIC POWER | AEP US | 238,523.53 | 0.39% |
| 13 | AMGEN INC | AMGN US | 238,372.30 | 0.39% |
| 14 | DELL INC | DELL US | 237,291.20 | 0.39% |
| 15 | KRAFT FOODS NC-CLASS A | KFT US | 237,088.06 | 0.39% |
| 16 | INTEL CORP | INTC US | 236,999.48 | 0.39% |
| 17 | PHILIP MORRIS INTERNATIONAL | PM US | 236,448.09 | 0.39% |
| 18 | PEPSICO INC | PEP US | 235,802.01 | 0.39% |
| 19 | AMERICAN EXPRESS CO | AXP US | 235,252.59 | 0.39% |
| 20 | AT&T INC | T US | 235,086.09 | 0.39% |

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末基金资产净值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 | 占期末基金资产净值比例 |
|---|---|---|---|---|
| 1 | BANK OF AMERICA CORP | BAC US | 127,303.07 | 0.21% |
| 2 | UNITEDHEALTH GROUP INC | UNH US | 37,306.04 | 0.06% |
| 3 | COLGATE-PALMOLIVE CO | CL US | 31,284.40 | 0.05% |
| 4 | AMAZON.COM INC | AMZN US | 31,280.26 | 0.05% |
| 5 | JOHNSON & JOHNSON | JNJ US | 28,656.25 | 0.05% |
| 6 | MCDONALD'S CORP | MCD US | 27,687.30 | 0.05% |
| 7 | COSTCO WHOLESALE CORP | COST US | 26,815.97 | 0.04% |
| 8 | BAXTER INTERNATIONAL INC | BAX US | 26,687.75 | 0.04% |
| 9 | AMERICAN ELECTRIC POWER | AEP US | 24,312.76 | 0.04% |
| 10 | KRAFT FOODS INC-CLASS A | KFT US | 24,077.78 | 0.04% |
| 11 | CVS CAREMARK CORP | CVS US | 23,858.27 | 0.04% |
| 12 | MERCK & CO. INC. | MRK US | 23,496.16 | 0.04% |
| 13 | PHILIP MORRIS INTERNATIONAL | PM US | 23,494.74 | 0.04% |
| 14 | DELL INC | DELL US | 22,481.34 | 0.04% |
| 15 | AT&T INC | T US | 22,039.27 | 0.04% |
| 16 | AMERICAN EXPRESS CO | AXP US | 21,288.35 | 0.04% |
| 17 | HJ HEINZ CO | HNZ US | 21,212.20 | 0.04% |
| 18 | MASTERCARD INC-CLASS A | MA US | 20,650.19 | 0.03% |
| 19 | AMGEN INC | AMGN US | 20,634.47 | 0.03% |
| 20 | ALTRIA GROUP INC | MO US | 20,169.95 | 0.03% |

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 | 22,613,752.45 |
| 卖出收入（成交）总额 | 900,340.96 |

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 本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 | 18,255.67 |
| 4 | 应收利息 | 7,329.72 |
| 5 | 应收申购款 | 2,668.68 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 28,254.07 |

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

本基金本报告期末前十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 |
| 1,083 | 55,129.77 | 18,465,707.59 | 30.93% | 41,239,832.91 | 69.07% |

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

| 项目 | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|---|---|---|
| 基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金 | 401,339.50 | 0.67% |

### §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 | 508,424,713.40 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额 | 322,824.38 |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额 | 449,041,997.28 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 59,705,540.50 |

### §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、报告期内基金管理人未发生重大人事变动。

2、本基金托管人的基金托管部门的重大人事变动：

本报告期内，根据证监会《关于核准中国银行股份有限公司李爱华基金行业高级管理人员任职资格的批复》，李爱华先生担任本基金托管人——中国银行托管及投资者服务部总经理；因工作调动，董杰先生不再担任中国银行托管及投资者服务部总经理。该人事变动已按相关规定备案并公告。

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 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| Morgan Stanley & Co. International plc | - | 11,089,577.82 | 47.16% | 6,162.39 | 47.92% | - |
| Citigroup Inc | - | 12,423,541.11 | 52.84% | 6,697.03 | 52.08% | - |

注：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》（证监基金字[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**
**2011年8月27日**