长信可转债债券型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9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:平安银行股份有限公司
报告送出日期:2013年10月23日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年10月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年7月1日起至2013年9月30日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	长信可转债债券
基金主代码	519977
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年3月30日
报告期末基金份额总额	125,920,329.79份
投资目标	本基金重点投资于可转换债券(含可分离交易可转债),主要运用可转债品种兼具债券和股票的特性,通过积极主动的可转债投资管理,力争在锁定投资组合下方风险的基础上实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金主要投资于可转债品种,一方面利用可转债的债券特性,强调投资组合的安全性和稳定性,另一方面利用可转债的股票特性,分享股市上涨产生的较高收益。
业绩比较基准	中信标普可转债指数收益率×70%+中信标普全债指数收益率×20%+沪深300指数收益率*10%
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于较低风险的证券投资基金品种,其预期收益和预期风险高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。本基金主要投资于可转换债券,在债券型基金中属于风险水平相对较高的投资产品。
基金管理人	长信基金管理有限责任公司
基金托管人	平安银行股份有限公司
下属两级基金的基金简称	长信可转债债券A / 长信可转债债券C
下属两级基金的交易代码	519977 / 519976
报告期末下属两级基金的份额总额	92,211,205.35份 / 33,709,124.44份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2013年7月1日-2013年9月30日)	
	长信可转债债券A	长信可转债债券C
1.本期已实现收益	4,588,397.13	2,935,469.57
2.本期利润	5,146,723.11	3,746,222.65
3.加权平均基金份额本期利润	0.0429	0.0964
4.期末基金资产净值	93,379,073.19	33,807,990.35
5.期末基金份额净值	1.0127	1.0029

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 本报告期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

3.2.1.1 长信可转债债券份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

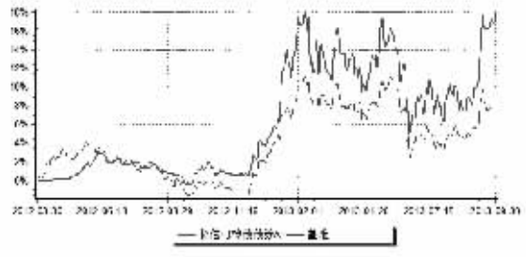
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	10.44%	0.85%	2.38%	0.50%	8.06%	0.35%

3.2.1.2 长信可转债债券C份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

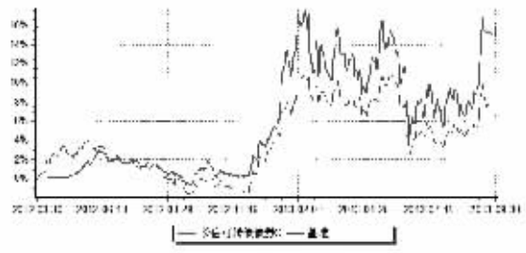
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	9.20%	0.85%	2.38%	0.50%	6.82%	0.35%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

3.2.2.1 长信可转债债券A自基金合同生效以来累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



3.2.2.2 长信可转债债券C自基金合同生效以来累计净值收益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2012年3月30日至2013年9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的约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)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		
李小羽	本基金的基金经理、长信利丰债券型证券投资基金的基金经理、公司总经理助理、固定收益部总监	2012年3月30日		15年	上海交通大学工学学士,华南理工大学工学硕士,具有基金从业资格,加拿大特许投资经理资格(CIM)。曾任职长城证券公司、加拿大Investors Group Financial Services Co.,Ltd.2002年10月加入本公司(筹备),先后任基金经理助理、交易管理部总监、长信中短债证券投资基金基金经理。现任长信基金管理有限责任公司总经理助理、固定收益部总监,本基金及长信利丰债券型证券投资基金的基金经理。
刘波	本基金的基金经理、长信利息收益开放式证券投资基金和长信利众分级债券型证券投资基金的基金经理	2012年3月30日		5年	经济学硕士,上海财经大学经济学研究生毕业。曾任天平养老保险股份有限公司固定收益投资经理。2011年2月加入长信基金管理有限责任公司,担任固定收益基金经理助理,从事投资研究工作,现任本基金、长信利息收益开放式证券投资基金、长信利众分级债券型证券投资基金的基金经理。

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 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、《长信可转债债券型证券投资基金基金合同》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。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 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。

4.3.2 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,其余各投资组合均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。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

美国经济继续保持复苏状态,美国财政问题呈现,欧元区经济继续保持稳定;日本实施超级宽松货币政策,安倍经济政策的负效应尚不明显;国际政治经济仍然不确定,对中国经济特别是对外贸易产生的负面影响未根本扭转。中国经济复苏力度较弱,中长期增长动力仍然在于结构调整。宏观调控更加注重改革和市场化方向,依靠强刺激政策的可能性很小。CPI受短期因素影响回落,大宗商品价格依然不振。信贷保持中性偏紧状态,数量放松的空间缩小,存量调整优先,继续坚持稳健货币政策防大风险的原则。社会融资依然活跃,债券市场发行量扩容提速,货币政策重点在于稳住经济,同时预期往外汇占款和人民币汇率变化进行短期调整,但货币政策总体灵活但趋向偏严。货币市场利率本季度保持在偏高位置,但未出现债券市场出现大断落,市场普遍保持谨慎。转债在股票市场影响下,总体出现分化,同时资金利率的水平也削弱了其债性的提高。

本基金继续重点配置价值突出的转债,加大灵活操作的力度,以提高组合的收益水平。

4.4.2 2013年第四季度市场展望和投资策略

未来经济的政策重点在于通过改革释放增长红利,更多的依靠市场调节。M2和M1回落至目前位置,继续大幅度上涨可能性很小,稳健的货币政策的重点在于防范系统风险。通胀在回落后,第四季度小幅反弹的可能性增加,但总体温和,未来升息和降息的可能性都比较小。货币政策的总基调还是中性偏紧,调整节奏和方式将视经济的回落和外汇占款情况而定,资金面总体而言将会保持略紧。下一阶段可转债在权益市场的带动下将趋于活跃,投资机会将明显增加。债券投资的基本面基本保持稳定,资金状况为决定因素,信用风险预期有所稳定。

我们将继续来承诺慎原则,加强组合的流动性管理,在做好利率风险控制的同时,增加对新经济环境下信用风险的审慎判断。适度控制组合久期,密切关注经济走势和政策动向,紧跟组合规模变动进行资产配置,争取在流动安全的前提下,为投资人获取更好的收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,长信可转债A份额净值为1.0127元,份额累计净值为1.1757元,本报告期内长信可转债A净值增长率为10.44%;长信可转债C份额净值为1.0029元,份额累计净值为1.1559元,本报告期内长信可转债C净值增长率为9.20%。同期业绩比较基准收益率为2.38%。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	22,697,068.02	8.70
	其中:股票	22,697,068.02	8.70
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	208,108,703.87	79.80
	其中:债券	208,108,703.87	79.80
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
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	银行存款和结算备付金合计	26,988,900.64	10.35
7	其他资产	2,980,968.63	1.14
8	合计	260,775,641.16	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	2,317,500.00	1.82
B	采矿业	-	-
C	制造业	8,341,292.42	6.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	5,782,500.00	4.55
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,534,575.60	1.21
J	金融业	-	-
K	房地产业	4,721,200.00	3.71
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	22,697,068.02	17.85

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002024	苏宁云商	450,000	5,782,500.00	4.55
2	600332	白云山	134,959	4,801,841.22	3.78
3	600649	城投控股	580,000	4,721,200.00	3.71
4	600108	亚盛集团	250,000	2,317,500.00	1.82
5	000413	宝 石A	130,000	2,198,300.00	1.73
6	002410	广联达	58,796	1,534,575.60	1.21
7	300246	宝莱特	30,000	700,500.00	0.55
8	600594	益佰制药	19,067	640,651.20	0.50

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	19,824,000.00	15.59
	其中:政策性金融债	19,824,000.00	15.59
4	企业债券	15,570,771.15	12.24
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据		-
7	可转债	172,713,932.72	135.80
8	合计	208,108,703.87	163.62

5.5 报告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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	126011	08石化债	625,000	61,531,250.00	48.38
2	110015	石化转债	413,000	40,428,570.00	31.79
3	130238	13国开38	200,000	19,824,000.00	15.59
4	113003	重工转债	145,000	18,435,300.00	14.49
5	113001	中行转债	155,240	15,528,657.20	12.21

5.6 报告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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 报告期内本基金投资的前十名股票中,不存在超出基金合同规定备选股票库的情形。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	491,536.93
2	应收证券清算款	
3	应收股利	-
4	应收利息	1,568,725.24
5	应收申购款	920,706.46
6	其他应收款	
7	其他	-
8	合计	2,980,968.63

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110015	石化转债	40,428,570.00	31.79
2	113003	重工转债	18,435,300.00	14.49
3	113001	中行转债	15,528,657.20	12.21
4	110023	民生转债	11,639,100.00	9.15
5	113002	工行转债	11,083,000.00	8.71
6	110018	国电转债	3,837,315.00	3.02
7	125089	深机转债	3,031,790.64	2.38
8	110011	歌华转债	3,005,186.40	2.36
9	127001	海直转债	2,118,348.00	1.67
10	125887	中鼎转债	544,328.40	0.43

5.10.5 报告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。

5.10.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

	长信可转债债券A	长信可转债债券C
报告期期初基金份额总额	19,589,731.66	42,161,152.11
报告期期间基金总申购份额	2,088,180,647.28	849,098.95
减:报告期期间基金总赎回份额	2,015,559,173.59	9,301,126.62
报告期期间基金拆分变动份额	-	-
报告期期末基金份额总额	92,211,205.35	33,709,124.44

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立基金的文件;

2、《长信可转债债券型证券投资基金基金合同》;

3、《长信可转债债券型证券投资基金招募说明书》;

4、《长信可转债债券型证券投资基金托管协议》;

5、报告期内在指定报刊上披露的各种公告的原稿;

6、长信基金管理有限责任公司营业执照、公司章程及相关资格批复文件。

8.2 存放地点

基金管理人的住所。

8.3 查阅方式

长信基金管理有限责任公司网站:http://www.cxfund.com.cn。

长信基金管理有限责任公司
二〇一三年十月二十三日

长信美国标准普尔100等权重指数增强型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9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
报告送出日期:2013年10月23日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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10月15日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年7月1日起至2013年9月30日止。

§2 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	26,470,138.29份
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(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或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	本基金为股票型基金,属于预期收益和预期风险较高的风险品种。
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
境外资产托管人	英文名称:Bank Of China (Hong Kong) Limited 中文名称:中国银行(香港)

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2013年7月1日-2013年9月30日)
1.本期已实现收益	2,734,429.70
2.本期利润	1,402,500.90
3.加权平均基金份额本期利润	0.0456
4.期末基金资产净值	26,684,109.91
5.期末基金份额净值	1.008

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。

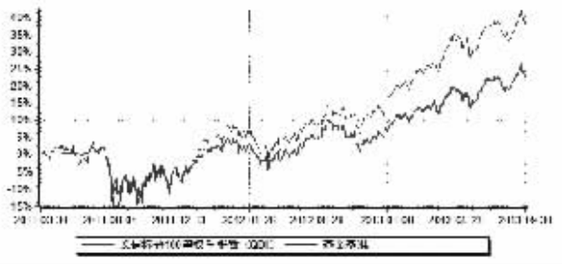
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	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	①-③	②-④
过去三个月	6.29%	0.54%	6.35%	0.62%	-0.06%	-0.08%

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累计份额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9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的约定。

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 基金经理(或基金经理小组)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、美国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)组约 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、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 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、《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》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。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 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。

4.3.2 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,其余各投资组合均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。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金的投资策略

美国市场在2013年三季度一开始似乎逐渐从美联储有可能提前退出量化宽松的阴影中走出来,标普500指数分别在八月初和九月中达到本年度新高。这主要是基于良好的经济数据,譬如就业数据,房地产销售,新开工及房屋价格等均指向美国经济的企稳复苏。相关的消费者信心指数也在7月底达到新高。但我们承认美联储在消除投资人担忧方面也做了很多努力,主要是通过温和的"Forward Guidance"(对未来预期的指导)。本季度最出乎市场预料的是美联储在9月18日的例会后宣布暂时搁置退出量化宽松,主要理由是失业率的居高不下以及10月可能出现的华盛顿政治导致的财政预算及美国国债上限谈判的僵局所带来的不确定性。然而在市场回味过美联储的这一"惊喜"后,市场逐渐冲高回落,标普500指数在季度末报收1681.55,上涨近4.7%。

本基金维持对美国经济基本面具有良好的宏观局面的看法。这是美国股市在中长期上升的根本原因。我们认为美国经济正在超预期增长,房地产市场和就业人口市场恢复强劲,经济中的重大不确定性因素已经基本消失或显著减弱。我们认为在年末的最后一个季度里,市场主要是要克服财政预算及美国国债上限谈判所带来的不确定性。但我们认为谈判的最终解决是大概率事件。如果三季报表现良好,市场会继续它的稳步向上趋势,为2014美国股市的健康发展打下良好的基础。

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,在报告期间本基金收益和标的指数收益持平。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止到2013年9月30日,本基金份额净值为1.008元,份额累计净值为1.218元,本报告期内本基金净值增长率为6.29%,同期业绩比较基准涨幅为6.35%。本基金在三季度的超额收益为-0.06%(已考虑人民币升值因素),主要归因于人民币汇率和本基金管理人对市场的偏谨慎的态度所导致的偏低的仓位。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0.32%,年化跟踪误差为5.12%。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	24,013,559.43	87.09
	其中:普通股	24,013,559.43	87.09
	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	3,348,301.40	12.14
8	其他资产	210,401.12	0.76
9	合计	27,572,261.95	100.00

5.2 报告期末在各个国家(地区)证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家(地区)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
美国	24,013,559.43	89.99
合计	24,013,559.43	89.99

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

5.3.1 报告期末指数投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
信息技术	3,592,143.66	13.46
工业	3,412,598.33	12.79
金融	3,556,802.18	13.33
保健	2,844,302.72	10.66
必需消费品	2,614,853.52	9.8
能源	2,645,337.10	9.91
非必需消费品	3,189,230.61	11.95
材料	957,201.62	3.59
电信服务	474,372.91	1.78
公用事业	726,216.64	2.72
合计	24,013,059.29	89.99

注:以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

5.3.2 报告期末积极投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
必需消费品	322.40	0.00
能源	177.74	0.00
合计	500.14	-

注:以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票及存托凭证投资明细

5.4.1 报告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股票及存托凭证投资明细

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	NIKE INC -CL B	耐克公司	NKE US	纽交所	美国	579.00	258,576.03	0.97
2	FEDEX CORP	联邦快递	_FDX US	纽交所	美国	366.00	256,766.67	0.96
3	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	百时美施贵宝	BMY US	纽交所	美国	902.00	256,645.55	0.96
4	BOEING CO/THE	波音	BA US	纽交所	美国	353.00	255,003.67	0.96
5	TIME WARNER INC	时代华纳	TWX US	纽交所	美国	628.00	254,088.72	0.95
6	AMAZON.COM INC	亚马逊公司	AMZN US	纳斯达克	美国	132.00	253,718.62	0.95
7	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	西方石油	OXY US	纽交所	美国	439.00	252,461.84	0.95
8	EBAY INC	电子湾	EBAY US	纳斯达克	美国	730.00	250,387.75	0.94
9	UNITED PARCEL SERVICE-CL B	联合包裹服务股份有限公司	UPS US	纽交所	美国	443.00	248,852.04	0.93
10	Twenty-First Century Fox	新闻集团	FOXA US	纳斯达克	美国	1,205.00	248,179.39	0.93

注:News Corp于2013年7月1日起已更名为 Twenty-First Century Fox Inc.

5.4.2 报告期末积极投资期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票及存托凭证投资明细

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	KRAFT FOODS GROUP INC	卡夫食品集团	KRFT US	纳斯达克	美国	1	322.40	0.00
2	PHILLIPS 66	Phillips 66公司	PSX US	纽交所	美国	0.5	177.74	0.00

5.5 报告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。

5.6 报告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。

5.7 报告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。

5.8 报告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。

5.9 报告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。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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、处罚的情况。

5.10.2 本基金投资的前十名股票中不存在超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	27,287.16
4	应收利息	2,104.26
5	应收申购款	181,009.70
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	210,401.12

5.10.4 报告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。

5.10.5 报告期末前十名股票中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在流通受限情况的。

5.10.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	24,987,645.33
报告期期间基金总申购份额	89,074,509.65
减:报告期期间基金总赎回份额	87,592,016.69
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	26,470,138.29

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立基金的文件;

2、《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》;

3、《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》;

4、《长信美国标准普尔100等权重指数增强型证券投资基金托管协议》;

5、报告期内在指定报刊上披露的各种公告的原稿;

6、长信基金管理有限责任公司营业执照、公司章程及相关资格批复文件。

8.2 存放地点

基金管理人的住所。

8.3 查阅方式

长信基金管理有限责任公司网站:http://www.cxfund.com.cn。

长信基金管理有限责任公司
二〇一三年十月二十三日

长信量化先锋股票型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9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:交通银行股份有限公司
报告送出日期:2013年10月23日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年10月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年7月1日起至2013年9月30日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	长信量化先锋股票
基金主代码	519983