

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。本基金年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由监事会签章。

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摘要。

本半年度报告摘要须公平地反映自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告全文。

本报告中财务数据未经审计。

本报告日期为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	24,958,640.43份
基金合同存续期间	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渠道来实现超越标的指数的收益。力争在扣除费用后每年收益率达到10%以上。本基金将通过严格的风险管理体系和数量化风险管理能力努力争取基金净值增长率与美国标准普尔100等权重指数(以下简称“标普100等权重指数”)收盘单之间的日均跟踪误差控制在0.5%以内(相应的年跟踪误差不超过5%)，年化跟踪误差不超过8%。
投资策略	本基金将通过以下途径实现对标的指数的有效跟踪并获得优于标的指数的收益：1、通过定期调整资产配置比例，使基金的资产配置比例与标的指数的构成比例相一致；2、通过定期调整资产配置比例，使基金的资产配置比例与标的指数的构成比例相一致；3、通过定期调整资产配置比例，使基金的资产配置比例与标的指数的构成比例相一致；4、在符合有关基金分红条款的前提下，本基金每年度分红次数最多不超过12次，每份基金份额每次分配比例不得低于该年度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。
业绩比较基准	标准普尔100等权重指数收益率。

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市场整体波动高度相关，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
联系人姓名	周永刚	董春雷
联系电话	021-61099999	95566
电子邮箱	zhongguo@cxfund.com.cn	tgxps@bank-of-china.com
客户服务电话	4007005566	95566
传真	021-61099800	010-66949492

## 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	-	Bank Of China (Hong Kong) Limited
中文名称	-	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	上海银城路168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

金额单位:人民币元

3.1 期间数据和指标	报告期(2013年1月1日至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为	9.25%

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，本期利润即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。

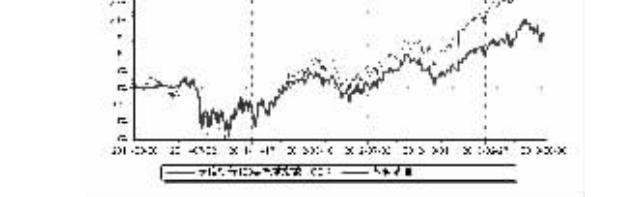
## 3.2 基金净值表现

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	份额净增长率(①)	份额净增长率(②)	业绩比较基准收益率(③)	业绩比较基准收益率(④)
过去一个月	-1.41%	0.92%	-1.52%	1.06%
过去3个月	0.99%	0.79%	2.96%	0.88%
过去6个月	9.25%	7.72%	15.19%	0.82%
过去一年	14.07%	7.72%	23.78%	0.80%
自基金合同生效起至今(2011年3月30日至2013年6月30日)	15.55%	0.99%	30.05%	1.20%

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，本基金自合同生效之日起六个月内建仓，建仓期结束时，本基金各项投资比例已符合基金合同关于投资范围、资产配置比例和投资限制的相关规定；对标的指数100等权重指数成份股的投资比例为基金净资产的80%-95%；现金、现金等价物以及法律法规允许的其他金融工具占基金总资产的0%-15%，投资于美国证券市场的境外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持有的其他金融工具。

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 基金管理人基本情况

长信基金管理有限责任公司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%，上海海欣集团有限公司占4%，武汉钢铁股份有限公司占43.49%。

截至2013年6月30日，本基金资产总规模15.55亿元，其中大额资金持有者占基金资产净值的50%以上，主要为机构投资者。

4.2 基金管理人及其基金经理的诚信记录

本基金基金经理在报告期内因基金从业资格被取消或暂停，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

本基金基金经理因违反基金从业人员行为规范，被基金行业自律组织公开谴责，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内基金运作合规性的专项说明

本基金基金经理在报告期内，严格按照法律法规、基金合同的规定，勤勉尽责地履行职责，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.4 公平交易制度的执行情况

本公司在实行公平交易制度，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，并通过作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，本公司已通过对投资交易行为的监控评估，分析评估信息来加强对公平交易过程和结果的监督。

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

本基金将继续以进取为主，密切关注市场动态，把握投资机会，严格执行投资策略，在严格控制风险的前提下，努力为基金份额持有人谋取最大利益。

4.6 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

本公司在实行公平交易制度，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，并通过作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，本公司已通过对投资交易行为的监控评估，分析评估信息来加强对公平交易过程和结果的监督。

4.7 异常交易行为的专项说明

本公司在报告期内，严格按照指数化投资的规则进行投资的组合外，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。

4.8 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

本基金将继续以进取为主，密切关注市场动态，把握投资机会，严格执行投资策略，在严格控制风险的前提下，努力为基金份额持有人谋取最大利益。

4.9 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

本基金将继续以进取为主，密切关注市场动态，把握投资机会，严格执行投资策略，在严格控制风险的前提下，努力为基金份额持有人谋取最大利益。

4.10 管理人对基金评价的声明

我们以为中国经济仍然是全球经济中最有活力的，其增长动力最强，增长动力正在逐步加强。经济和市场的稳定性在很大程度上取决于中国经济的基本面的强劲复苏，大部分宏观经济数据超出预期，当前中国经济的主要任务是恢复和稳定，就业市场和房地产市场，无论是价格还是成交量都是一些先行指标，而且从一些先行指标看出了非常强劲的复苏势头。中国经济已经从金融危机后的低谷中恢复过来，并且进入进一步的快速增长阶段。中国经济在中长期的走势上，依然具有良好的基本面和增长趋势，这是中国经济在中长期走势上的基本特征。我们认为中国经济在中长期走势上，依然具有良好的基本面和增长趋势，这是中国经济在中长期走势上的基本特征。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其他配套规则，《合格境内机构投资者境外证券投资管理暂行办法》，《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》，《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》，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“中国银行(香港)”)。

本基金在报告期内，严格按照指数化投资的规则进行投资的组合外，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。

4.11 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

本基金将继续以进取为主，密切关注市场动态，把握投资机会，严格执行投资策略，在严格控制风险的前提下，努力为基金份额持有人谋取最大利益。

4.12 报告期内基金的业绩表现

截至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。本基金在报告期内所取得的超额收益为+5.94%(已考虑货币市场基金的因素)。本基金在报告期内所取得的超额收益为+5.94%(已考虑货币市场基金的因素)。

本基金在报告期内，严格按照指数化投资的规则进行投资的组合外，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。

4.13 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

本基金将继续以进取为主，密切关注市场动态，把握投资机会，严格执行投资策略，在严格控制风险的前提下，努力为基金份额持有人谋取最大利益。

4.14 管理人对基金评价的声明

我们以为中国经济仍然是全球经济中最有活力的，其增长动力最强，增长动力正在逐步加强。经济和市场的稳定性在很大程度上取决于中国经济的基本面的强劲复苏，大部分宏观经济数据超出预期，当前中国经济的主要任务是恢复和稳定，就业市场和房地产市场，无论是价格还是成交量都是一些先行指标，而且从一些先行指标看出了非常强劲的复苏势头。中国经济已经从金融危机后的低谷中恢复过来，并且进入进一步的快速增长阶段。中国经济在中长期走势上，依然具有良好的基本面和增长趋势，这是中国经济在中长期走势上的基本特征。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其他配套规则