

**长信中证中央企业100指数证券投资基金（LOF）2010年半年度报告**

**2010年06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：中国建设银行股份有限公司**

**送出日期：2010年08月24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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2010年8月20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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2010年3月26日（基金合同生效日）起至6月30日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示.....	2
§2 基金简介.....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告.....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
§5 托管人报告.....	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
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.....	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	15
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18
§7 投资组合报告.....	39

7.1 期末基金资产组合情况.....	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	39
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	46
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	46
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权证投资明细.....	46
7.8 投资组合报告附注.....	46
§8 基金份额持有人信息.....	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	48
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	48
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况.....	48
§9 开放式基金份额变动.....	49
§10 重大事件揭示.....	50
10.1 基金份额持有人大会决议.....	50
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.....	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	50
10.4 基金投资策略的改变.....	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	50
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.....	50
10.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	50
10.8 其他重大事件.....	51
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	54
§12 备查文件目录.....	55
12.1 备查文件目录.....	55
12.2 存放地点.....	55
12.3 查阅方式.....	55

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	长信中证中央企业100指数证券投资基金（LOF）
基金简称	长信中证中央企业100指数（LOF）
基金主代码	163001
交易代码	163001
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2010年03月26日
基金管理人	长信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	334,749,691.67
基金合同存续期	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	2010年4月16日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，追求基金净值增长率与业绩比较基准收益率之间跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%，以实现对标指数的有效跟踪。
投资策略	本基金为被动式指数基金，原则上采用完全复制法，按照成份股在中证中央企业100指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应的调整。 当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，使跟踪误差控制在限定的范围之内。
业绩比较基准	中证中央企业100指数收益率*95%+银行同行业存款收益率*5%
风险收益特征	本基金为股票型指数基金，属于证券投资基金中较高预期收益和较高风险特征的证券投资基金产品，其预期风险和收益水平高于混合型基金、债券基金及货币市场基金。

### 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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	周永刚	尹东
	联系电话	021-61009999	010-67595003
	电子邮箱	zhouyg@cxfund.com.cn	yindong.zh@ccb.com
客户服务电话		4007005566	010-67595096
传真		021-61009800	010-66275853
注册地址		上海市浦东新区银城中路 68号9楼	北京市西城区金融大街25号
办公地址		上海市浦东新区银城中路 68号9楼	北京市西城区闹市口大街1号院1 号楼
邮政编码		200120	100033
法定代表人		田丹	郭树清

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报和证券时报
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、北京西城区闹市口大街1号院1号楼

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京西城区金融大街27号投资广场 23层

### § 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（2010年03月26日-2010年06月30日）
本期已实现收益	-10,510,887.58
本期利润	-37,106,789.94
加权平均基金份额本期利润	-0.0779
本期加权平均净值利润率	-7.96%
本期基金份额净值增长率	-9.70%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2010年06月30日）
期末可供分配利润	-32,444,211.70
期末可供分配基金份额利润	-0.0969
期末基金资产净值	302,305,479.97
期末基金份额净值	0.903
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2010年06月30日）
基金份额累计净值增长率	-9.70%

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、期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

4、本基金基金合同于2010年3月26日起正式生效，截至2010年6月30日本基金运作时间未满一年。

#### 3.2 基金净值表现

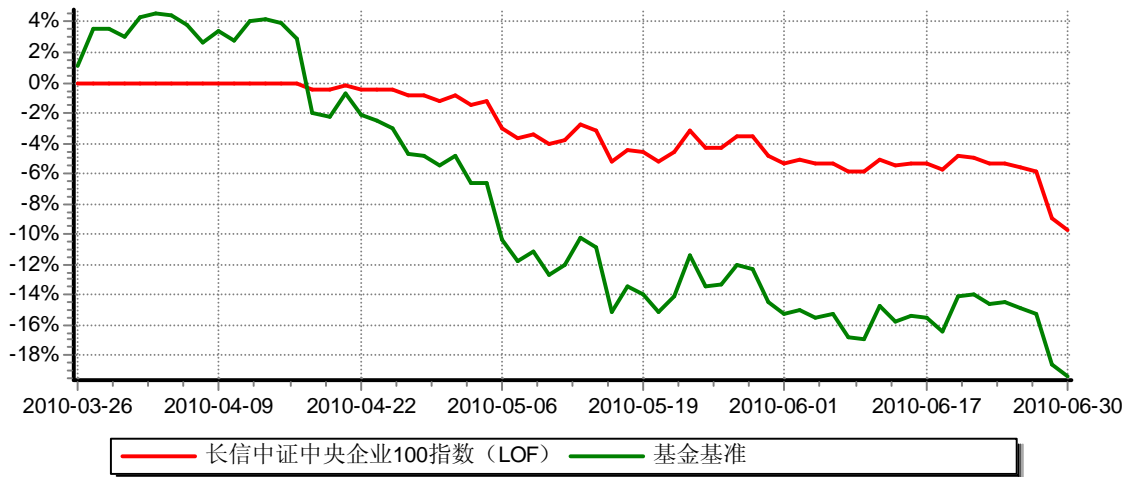
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	①-③	②-④

				④		
过去一个月	-5.15%	0.85%	-5.68%	1.47%	0.53%	-0.62%
过去三个月	-9.70%	0.74%	-21.82%	1.63%	12.12%	-0.89%
自基金合同生效日起至今 (2010年03月26日-2010年06月30日)	-9.70%	0.72%	-19.41%	1.62%	9.71%	-0.90%

注：本基金基金合同于2010年3月26日起正式生效，截至2010年6月30日本基金运作时间未满一年。

### 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2010年3月26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2010年3月26日至2010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，本基金的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：本基金投资于股票资产的比例占基金资产的90%–95%，其中，中证中央企业100指数的成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产的90%。本基金投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。截至本报告期期末，本基金的建仓期尚未结束。



## § 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2010年6月30日，本基金管理人共管理9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）和长信中短债债券。

#### 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		
许万国	本基金基金经理、长信金利基金的基金经理	2010年03月26日	—	12年	经济学硕士，具有基金从业资格。曾任蔚深证券研究部研究员、深圳市恒宝鼎投资有限公司证券投资部负责人、融通基金管理有限公司策略研究员、蓝筹成长基金经理助理。先后从事上市公司行业研究、策略研究、投资管理等工作。2007年9月加入长信基金管理有限责任公司投资管理部，担任基金经理助理，现任长信金利趋势股票基金和本基金基金经理。
卢曼	本基金基金经理	2010年06月28日	—	6年	卢曼女士，美国加州大学戴维斯分校MBA、伯克利分校金融工程硕士，CFA，具有基金从业资格。曾先后任中国纺织机械工业总公司业务员、美国Lam半导体公司高级财务分析师、美国Covad通讯公司高级财务分析师、美国Camden基金管理公司风险管理经理、美国

					Shoreline投资管理公司投资分析师、美国Gerken投资公司基金经理助理、美国展誉投资管理公司投资分析师，分别从事财务分析和证券投资研究工作，2009年7月加入长信基金管理有限责任公司，担任基金经理助理，从事证券研究和投资工作。2010年6月28日开始担任本基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

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 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、《长信中证中央企业100指数证券投资基金（LOF）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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 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 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，公司所管理的各投资组合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。

##### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现可能的异常交易行为。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金的合同生效日是3月26日，回顾A股市场的走势，三月末正是市场窄幅震荡，面临选择方向的时点。一方面，一季度经济数据良好，A股公司业绩预期喜人，另一方面，对通胀，房地产调控和流动性收缩的预期又使得股市徘徊不前。4月中，市场终于在国务院定调实行差异化房贷政策等一系列房地产调控措施的影响下，由地产股引领，开始了一轮大幅度的调整。在这样一种复杂的环境下，本着基金持有人利益优先的原则，本基金采用了缓步建仓策略，在建仓期内进行了仓位控制并轻度调整了各行业配置速度，取得了较好的效果。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2010年6月30日，本基金单位净值为0.903元，本基金净值增长率为-9.70%，同期业绩比较基准涨幅为-19.41%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为中国经济短期仍面临很多压力，宏观上既有经济转型调结构和高通胀的挑战，也有房地产行业走势以及其对中国经济未来发展的影响的不确定性；另外，海外经济复苏道路的曲折预计也会对刚有起色的出口行业造成一定的负面影响；这些都可能会使近期A股市场的震荡延续。但是中期来看，我们对中国的股票市场抱有信心。虽然公司盈利增长可能在以后的几个季度有所下行，但是我们预期经济转型，城镇化和西部重点建设最终会支持中国经济在良性轨道上健康发展。

中央企业广泛分布在不同行业，对国民经济的发展有着举足轻重的影响。大多数央企资产和收入规模巨大，在各行业中优势明显或其本身就是一个行业，并且运行情况良好。由国资委主导的央企之间的合并重组预计会加速进行，这可能会给众多中央企业尤其是涵盖在央企100指数中的企业带来较好的投资机会。

我们感谢基金持有人对我们管理团队的信任。展望未来，我们会本着长信一贯的“真诚坦率，认真负责”的态度，在基金合同和相应政策的指引下，规范运作，力求以良好的业绩来回馈基金持有人。

## 4.6 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[2008]38号文《关于进一步规范

证券投资基金估值业务的指导意见》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。

#### **4.7 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、本基金的每份基金份额享有同等分配权；
- 2、收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人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，基金注册登记机构可将投资人的现金红利按除息日除权后的份额净值自动转为基金份额；
- 3、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年最多分配 6 次，每次基金收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的 30%；
- 4、若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配；
- 5、本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按除息日除权后的份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

场内认购、申购和上市交易的基金份额的分红方式为现金红利，投资人不能选择其他的分红方式，具体权益分配程序等有关事项遵循深交所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；

6、基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过 15 个工作日；

7、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收益分配金额后不能低于面值；

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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

### 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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

### 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

本托管人复核审查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。

## § 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：长信中证中央企业100指数证券投资基金（LOF）

报告截止日：2010年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2010年06月30日
<b>资产：</b>		
银行存款	6.4.7.1	60,682,166.14
结算备付金		—
存出保证金		250,000.00
交易性金融资产	6.4.7.2	242,448,117.05
其中：股票投资		242,448,117.05
基金投资		—
债券投资		—
资产支持证券投资		—
衍生金融资产	6.4.7.3	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	—
应收证券清算款		—
应收利息	6.4.7.5	22,956.66
应收股利		160,945.16
应收申购款		11,471.57
递延所得税资产		—
其他资产	6.4.7.6	49,110.70
资产总计		303,624,767.28
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2010年06月30日</b>
<b>负债：</b>		
短期借款		—
交易性金融负债		—
衍生金融负债	6.4.7.3	—
卖出回购金融资产款		—
应付证券清算款		—
应付赎回款		227,004.63
应付管理人报酬		198,267.36
应付托管费		39,653.49
应付销售服务费		—

应付交易费用	6.4.7.7	428,467.36
应交税费		—
应付利息		—
应付利润		—
递延所得税负债		—
其他负债	6.4.7.8	425,894.47
负债合计		1,319,287.31
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	6.4.7.9	334,749,691.67
未分配利润	6.4.7.10	-32,444,211.70
所有者权益合计		302,305,479.97
负债和所有者权益总计		303,624,767.28

注：1、报告截止日2010年6月30日，基金份额净值0.903元，基金份额总额334,749,691.67份。

2、本基金本报告期为2010年3月26日-2010年6月30日，本基金基金合同于2010年3月26日起正式生效。

## 6.2 利润表

会计主体：长信中证中央企业100指数证券投资基金（LOF）

本报告期：2010年03月26日-2010年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2010年03月26日-2010年06月30日
<b>一、收入</b>		-35,159,010.20
1. 利息收入		992,120.84
其中：存款利息收入	6.4.7.11	416,944.28
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		575,176.56
其他利息收入		—
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-10,078,990.18
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-11,651,881.96
基金投资收益		—
债券投资收益	6.4.7.13	—
资产支持证券投资收益		—
衍生工具收益	6.4.7.14	—
股利收益	6.4.7.15	1,572,891.78
3. 公允价值变动收益（损失以	6.4.7.16	-26,595,902.36



“-”号填列)		
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		—
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	6. 4. 7. 17	523, 761. 50
<b>减: 二、费用</b>		1, 947, 779. 74
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	913, 293. 86
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	182, 658. 79
3. 销售服务费		—
4. 交易费用	6. 4. 7. 18	645, 287. 83
5. 利息支出		—
其中: 卖出回购金融资产支出		—
6. 其他费用	6. 4. 7. 19	206, 539. 26
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		-37, 106, 789. 94
减: 所得税费用		—
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		-37, 106, 789. 94

注: 本基金本报告期为2010年3月26日-2010年6月30日, 本基金基金合同于2010年3月26日起正式生效。

### 6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 长信中证中央企业100指数证券投资基金(LOF)

本报告期: 2010年03月26日-2010年06月30日

单位: 人民币元

项目	本期 2010年03月26日-2010年06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)	743, 255, 611. 35	—	743, 255, 611. 35
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	-37, 106, 789. 94	-37, 106, 789. 94
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)	-408, 505, 919. 68	4, 662, 578. 24	-403, 843, 341. 44
其中: 1. 基金申购款	2, 186, 382. 57	-81, 414. 27	2, 104, 968. 30
2. 基金赎回款	-410, 692, 302. 25	4, 743, 992. 51	-405, 948, 309. 74

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)	334,749,691.67	-32,444,211.70	302,305,479.97

注：本基金本报告期为2010年3月26日-2010年6月30日，本基金基金合同于2010年3月26日起正式生效。

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: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
田丹	蒋学杰	孙红辉

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

长信中证中央企业100指数证券投资基金（LOF）（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”）《关于核准长信中证中央企业100指数证券投资基金（LOF）募集的批复》（证监许可[2009]1361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《长信中证中央企业100指数证券投资基金（LOF）基金合同》发售，募集期为：2010年2月4日至2010年3月19日，本基金管理人已向中国证监会办理完毕基金备案手续，并于2010年3月26日获得其书面确认（基金部函[2010]149号），本基金基金合同自该日起正式生效。本基金为上市契约型开放式，存续期限为不定期。

经上海众华沪银会计师事务所有限公司验证（沪众会字（2010）第2413号验资报告），本基金有效集中认购份额为742,975,016.75份，募集期间产生的利息为人民币280,594.60元，折成基金份额280,594.60份，本次集中认购实收基金份额共为743,255,611.35份。

本基金的基金管理人为长信基金管理有限责任公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《长信中证中央企业 100

指数证券投资基金(LOF)基金合同》和《长信中证中央企业 100 指数证券投资基金(LOF)招募说明书》的有关规定,本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具,主要包括中证中央企业 100 指数的成份股及其备选成份股、新股(一级市场初次发行或增发)、现金或者到期日在一年以内的政府债券等。本基金投资于股票资产的比例占基金资产的 90%-95%,其中,中证中央企业 100 指数的成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产的 90%。本基金投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。此外,本基金还可以投资于经中国证监会批准的允许本基金投资的其它金融工具,待指数衍生金融产品推出以后,基金管理人可以履行适当程序使本基金运用衍生金融产品进行风险管理。

本基金业绩比较基准为:中证中央企业100指数收益率\*95%+银行同行业存款收益率\*5%。

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(2006)、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》、《长信中证中央企业100指数证券投资基金(LOF)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 重要会计政策和会计估计**

##### **6.4.4.1 会计年度**

本基金的会计年度自公历 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 2010 年 3 月 26 日(基金合同生效日)至 2010 年 6 月 30 日止。

#### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。本基金编制财务报表采用的货币为人民币。

#### 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

(1)以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

##### 1)股票投资

买入股票于交易日确认为股票投资。股票投资成本按交易日股票的公允价值确认，取得时发生的相关交易费用直接计入当期损益。收到股权分置改革过程中由流通股股东支付的现金对价于股权分置方案实施复牌日冲减股票投资成本。

卖出股票于交易日确认股票投资收益/(损失)。出售股票的成本按移动加权平均法于交易日结转。

##### 2)债券投资

买入交易所或银行间的债券均于交易日确认为债券投资。债券投资成本按交易日债券的公允价值确认，取得时发生的相关交易费用直接计入当期损益，上述公允价值不包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息(作为应收利息单独核算)。

认购新发行的分离交易可转债于获配日按支付的全部价款确认为债券投资，于权证

实际取得日按附注6.4.4.4(1)3)所示的方法单独核算权证成本，并相应调整债券投资成本。

卖出债券于交易日确认债券投资收益/(损失)。出售债券的成本按移动加权平均法结转。

### 3)权证投资

买入权证于交易日确认为权证投资。权证投资成本按交易日权证的公允价值确认，取得时发生的相关交易费用直接计入当期损益。因认购新发行的分离交易可转债而取得的权证在实际取得日，按权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本。获赠权证(包括配股权证)在除权日，按持有的股数及获赠比例计算并记录增加的权证数量。

卖出权证于交易日确认衍生工具收益/(损失)。出售权证的成本按移动加权平均法于交易日结转。

### (2)应收款项

应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

应收款项以公允价值作为初始确认金额，采用实际利率法以摊余成本进行后续计量，直线法与实际利率法确定的金额差异较小的可采用直线法，其中买入返售金融资产以融出资金应付或实际支付的总额作为初始确认金额，相关交易费用计入初始成本。终止确认或摊销时收入计入当期损益。

### (3)其他金融负债

其他金融负债是指除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债。

其他金融负债按公允价值和相关交易费用作为初始确认金额，采用实际利率法以摊余成本进行后续计量，直线法与实际利率法确定的金额差异较小的可采用直线法，其中卖出回购金融资产款以融入资金应收或实际收到的总额作为初始确认金额，相关交易费用计入初始成本。终止确认或摊销时支出计入当期损益。

## 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，应采用市价确定公允价值；估值日无市价，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，采用最近交易市价确定公允价值。如估值日无市价，且最近交易日后

经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在0.25%以上的，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，确定公允价值。

当投资品种不再存在活跃市场，且其潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在0.25%以上的，应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，确定投资品种的公允价值。

公允价值是指在公平交易中熟悉情况的交易双方自愿进行资产交换或者债务清偿的金额。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。

本基金的金融资产和金融负债以上述原则确定的公允价值进行估值，另外对金融资产的特殊情况处理如下：

#### (1)股票投资

1) 对因特殊事项长期停牌的股票，该停牌股票对基金资产净值产生重大影响，则采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法估值。即在估值日，以公开发布的相应行业指数的日收益率作为该股票的收益率计算该股票当日的公允价值。

2)送股、转增股、配股和公开增发新股等未上市的股票，按估值日在证券交易所上市的同一种股票的收盘价估值；该日无交易的，以最近一日的收盘价估值。

3)首次公开发行未上市的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

4)首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一种股票的收盘价估值。

5)非公开发行有明确锁定期的股票，若在证券交易所上市的同一种股票的收盘价低于非公开发行股票初始投资成本，按估值日证券交易所上市的同一种股票的收盘价估值；若在证券交易所上市的同一种股票的收盘价高于非公开发行股票初始投资成本，其两者之间的差价按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例确认为估值增值。

#### (2)债券投资

1)交易所上市实行净价列示的债券按估值原则确认的相应交易日收盘价估值，交易所上市未实行净价列示的债券按估值原则确认的相应交易日的收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。

2)对交易所发行未上市的国债、企业债、公司债，按成本估值；对在交易所发行未上市的可转换证券，自债券确认日至上市期间的每个估值日，按中国证券业协会证券投资基金估值工作小组公布的参考价格估值。

3) 全国银行间债券市场交易的债券根据行业协会指导的处理标准或意见并综合考虑市场成交价、市场报价、流动性及收益率曲线等因素确定其公允价值进行估值。对全国银行间债券市场未上市，且中央国债登记结算公司未提供估值价格的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异，未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，按成本估值。

4) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

### (3)权证投资

1)首次公开发行未上市的权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

2)配售及认购分离交易可转债所获得的权证自实际取得日至在交易所上市交易前，采用估值技术确定公允价值。如估值技术难以可靠计量，则按成本计量。

3)因持有股票而享有的配股权证以及停止交易但未行权的权证按采用估值技术确定的公允价值估值。

如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

实际成本与估值的差异计入“公允价值变动损益”科目。

#### **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

损益平准金核算在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(适用于企业债和可转债等)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《长信中证中央企业100指数证券投资基金（LOF）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0.75%的年费率逐日计提。

根据《长信中证中央企业100指数证券投资基金（LOF）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0.15%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**

本基金的每份基金份额享有同等分配权；收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人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，基金注册登记机构可将投资人的现金红利按除息日除权后的份额净值自动转为基金份额；在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年最多分配6次，每次基金收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的30%；若基金合同生效不满3个月则可不进行收益分配；

本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按除息日除权后的份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；场内认购、申购和上市交易的基金份额的

分红方式为现金红利，投资人不能选择其他的分红方式，具体权益分配程序等有关事项遵循深交所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；

基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过 15 个工作日；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收益分配金额后不能低于面值；法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

## **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**

本基金在本报告期末发生重大会计政策变更。

### **6.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金在本报告期末发生过重大会计估计变更。

### **6.4.5.3 差错更正的说明**

本基金在本报告期末发生过重大会计差错。

## **6.4.6 税项**

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[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)基金买卖股票、债券的投资收益暂免征收营业税和企业所得税。

(3)基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(4)对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入，由上市公司、发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税，自2005年6月13日起，对个

人投资者从上市公司取得的股票的股息、红利收入暂减按50%计算个人所得税。

(5) 自2007年5月30日起，基金买卖A股、B股股权所书立的股权转让书据按照0.3%的税率征收证券(股票)交易印花税。自2008年4月24日起，证券(股票)交易印花税税率，由0.3%降至0.1%。自2008年9月19日起，证券(股票)交易印花税改为单边征收，即仅对卖出A股、B股股权按0.1%的税率征收，对受让方不再征税。

(6)对投资者(包括个人和机构投资者)从基金分配中取得的收入，暂不征收个人所得税和企业所得税。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2010年06月30日
活期存款	60,682,166.14
定期存款	—
其他存款	—
合计	60,682,166.14

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2010年06月30日		
	成本	公允价值	估值增值
股票	269,044,019.41	242,448,117.05	-26,595,902.36
债券	交易所市场	—	—
	银行间市场	—	—
	合计	—	—
资产支持证券	—	—	—
其他	—	—	—
合计	269,044,019.41	242,448,117.05	-26,595,902.36

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2010年06月30日
应收活期存款利息	22,956.66
应收定期存款利息	—
应收其他存款利息	—
应收结算备付金利息	—
应收债券利息	—
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	—
其他	—
合计	22,956.66

#### 6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2010年06月30日
其他应收款	—
待摊费用	49,110.70
合计	49,110.70

注：待摊费用为待摊上市费。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2010年06月30日
交易所市场应付交易费用	428,467.36
银行间市场应付交易费用	—
合计	428,467.36

#### 6.4.7.8 其他负债

项目	本期末 2010年06月30日
应付券商交易单元保证金	250,000.00
应付赎回费	855.49
指数使用费	47,318.11
审计费	34,519.39
信息披露费-上证报	31,067.16
信息披露费-中证报	31,067.16
信息披露费-证券时报	31,067.16
合计	425,894.47

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2010年03月26日（基金合同生效日）-2010年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	743,255,611.35	743,255,611.35
本期申购	2,186,382.57	2,186,382.57
本期赎回（以“-”填列）	-410,692,302.25	-410,692,302.25
本期末	334,749,691.67	334,749,691.67

注：1、此处申购含转换入份额，赎回含转换出份额；

2、本基金基金合同于2010年3月26日起正式生效，报告期未满一个会计年度；

3、本基金募集期间认购份额为742,975,016.75份，利息为人民币280,594.60元，折成基金份额280,594.60份，本次集中认购实收基金份额共为743,255,611.35份。

#### 6.4.7.10 未分配利润

金额单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	—	—	—
本期利润	-10,510,887.58	-26,595,902.36	-37,106,789.94
本期基金份额交易产生的变动数	125,112.58	4,537,465.66	4,662,578.24
其中：基金申购款	-12,274.44	-69,139.83	-81,414.27

基金赎回款	137,387.02	4,606,605.49	4,743,992.51
本期已分配利润	—	—	—
本期末	-10,385,775.00	-22,058,436.70	-32,444,211.70

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2010年03月26日-2010年06月30日
活期存款利息收入	405,608.13
定期存款利息收入	—
其他存款利息收入	—
结算备付金利息收入	11,335.42
其他	0.73
合计	416,944.28

注：其他为申购款利息收入。

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2010年03月26日-2010年06月30日
卖出股票成交总额	114,454,008.48
减：卖出股票成本总额	126,105,890.44
买卖股票差价收入	-11,651,881.96

#### 6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期末持有债券。

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期末持有衍生工具。

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2010年03月26日-2010年06月30日
股票投资产生的股利收益	1,572,891.78
基金投资产生的股利收益	—
合计	1,572,891.78

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期
	2010年03月26日-2010年06月30日
1.交易性金融资产	-26,595,902.36
——股票投资	-26,595,902.36
——债券投资	—
——资产支持证券投资	—
2.衍生工具	—
——权证投资	—
3.其他	—
合计	-26,595,902.36

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2010年03月26日-2010年06月30日
基金赎回费收入	507,437.87
其他	16,323.63
合计	523,761.50

注：1、本基金赎回费的25%归入基金资产；  
 2、其他为认购款利息转份额后的结余部分。

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2010年03月26日-2010年06月30日

交易所市场交易费用	645,287.83
银行间市场交易费用	—
合计	645,287.83

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2010年03月26日-2010年06月30日
审计费用	34,519.39
信息披露费	93,201.48
银行费用	4,710.98
上市费	25,889.30
指数使用费	47,318.11
其他费用	900.00
合计	206,539.26

注：其他费用主要为证券账户费。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至本财务报告批准报出日，本基金未发生需要披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金未发生需要披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

与基金存在重大利益关系的主要关联方的名称及关联关系

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
中国建设银行股份有限公司	基金托管人
长江证券股份有限公司(以下简称长江证券)	基金管理人的股东
上海海欣集团股份有限公司	基金管理人的股东
武汉钢铁股份有限公司	基金管理人的股东
上海海欣资产管理有限责任公司	基金管理人的股东的控股子公司
武汉钢铁集团财务有限责任公司	基金管理人的股东的控股子公司
长江证券承销保荐有限责任公司	基金管理人的股东的控股子公司
上海海欣生物技术有限责任公司	基金管理人的股东的控股子公司



## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期没有通过关联方交易单元进行的股票交易。

#### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期没有通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期没有应支付关联方的佣金。

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2010年03月26日-2010年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	913,293.86
其中：应支付给销售机构的客户维护费	54,430.32

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0.75%的年费率确认，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

$$\text{日基金管理费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.75\% / \text{当年天数}$$

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2010年03月26日-2010年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	182,658.79

注：支付基金托管人中国建设银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.15%的年费率确认，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% / \text{当年天数}$$

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金在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。

### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金管理人在本报告期末投资过本基金。

#### 6.4.10.4.2 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末投资过本基金。

### 6.4.10.5 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 2010年03月26日-2010年06月30日	
	期末 存款余额	当期 存款利息收入
中国建设银行股份有限公司	60,682,166.14	405,608.13

### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期末在承销期内购入由关联方承销的证券。

### 6.4.10.7 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。

### 6.4.11 利润分配情况

#### 6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金本报告期没有进行利润分配。

### 6.4.12 期末（2010年06月30日）本基金持有的流通受限证券

#### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

截至本报告期末，本基金不持有因认购新发/增发证券而流通受限证券。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票

截至本报告期末，本基金不持有暂时停牌股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

截至本报告期末，本基金不持有因债券正回购交易而作为抵押的债券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金金融工具的风险主要包括：

信用风险

流动性风险

利率风险

外汇风险

其他市场价格风险

本基金在下文主要论述上述风险敞口及其形成原因；风险管理目标、政策和过程以及计量风险的方法等。

本基金管理人已制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以投资决策委员会、内部控制委员会为核心的、由金融工程部和相关职能部门构成的多级风险管理架构体系。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度与可能遭受的损失。本基金的流

动性风险一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难，另一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人主要通过限制、跟踪和控制基金投资交易的不活跃品种来实现。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可用于银行间同业市场交易，均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式融入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金管理人金融工程部每日预测本基金的流动性需求，并设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

#### 6.4.13.4 市场风险

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。本基金管理人金融工程部对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末 2010年6月30 日	3个月以内	3个月至 1年	1年至5 年	5年以 上	不计息	合计
资产						
银行存款	60,682,166.14	-	-	-	-	60,682,166.14
结算备付金	-	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	250,000.00	250,000.00
交易性金融资产	-	-	-	-	242,448,117.05	242,448,117.05
应收利息	-	-	-	-	22,956.66	22,956.66
应收股利	-	-	-	-	160,945.16	160,945.16

应收申购款	-	-	-	-	11,471.57	11,471.57
其他资产					49,110.70	49,110.70
资产总计	60,682,166.14	-	-	-	242,942,601.14	303,624,767.28
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	227,004.63	227,004.63
应付管理人报酬	-	-	-	-	198,267.36	198,267.36
应付托管费	-	-	-	-	39,653.49	39,653.49
应付交易费用	-	-	-	-	428,467.36	428,467.36
其他负债	-	-	-	-	425,894.47	425,894.47
负债总计	-	-	-	-	1,319,287.31	1,319,287.31
利率敏感度缺口	60,682,166.14	-	-	-	241,623,313.83	302,305,479.97

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定重新定价日或到期日孰早者进行分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金于本报告期末未持有债券投资，无重大利率风险，因而未进行敏感性分析。银行存款及结算备付金之浮动利率根据中国人民银行的基准利率和相关机构的相关政策浮动。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券以及银行间同业市场交易的债券，所面临的最大其他市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他市场价格风险，并且定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末		上年度末	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)

交易性金融资产-股票投资	242,448,117.05	80.20	—	—
交易性金融资产-债券投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	242,448,117.05	80.20	—	—

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	在95%的置信区间内，基金资产组合的市场价格风险		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末	上年度末
	VaR值为2.13%	-6,439,106.72	—

注：上述风险价值VaR的分析是基于资产负债表日所持证券过去一年市场价格波动情况而有可能发生的最大损失，且此变动适用于本基金所有的衍生工具及非衍生工具金融工具。取95%的置信度是基于本基金所持有的金融工具风险度量的要求。

## § 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（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	242,448,117.05	79.85
	其中：股票	242,448,117.05	79.85
2	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
3	金融衍生品投资	—	—
4	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
5	银行存款和结算备付金合计	60,682,166.14	19.99
6	其他各项资产	494,484.09	0.16
7	合计	303,624,767.28	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采掘业	29,182,494.52	9.65
C	制造业	43,269,509.81	14.31
C0	食品、饮料	1,155,233.32	0.38
C1	纺织、服装、皮毛	—	—
C2	木材、家具	—	—
C3	造纸、印刷	—	—
C4	石油、化学、塑胶、塑料	1,490,318.18	0.49
C5	电子	—	—
C6	金属、非金属	13,504,976.02	4.47

C7	机械、设备、仪表	20,006,744.93	6.62
C8	医药、生物制品	6,448,760.08	2.13
C99	其他制造业	663,477.28	0.22
D	电力、煤气及水的生产和供应业	15,858,730.77	5.25
E	建筑业	16,130,561.79	5.34
F	交通运输、仓储业	9,863,343.98	3.26
G	信息技术业	13,066,405.85	4.32
H	批发和零售贸易	1,984,609.97	0.66
I	金融、保险业	90,526,614.73	29.95
J	房地产业	18,992,621.89	6.28
K	社会服务业	3,088,096.00	1.02
L	传播与文化产业	—	—
M	综合类	364,122.74	0.12
	合计	242,327,112.05	80.16

### 7.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采掘业	—	—
C	制造业	27,805.00	0.01
C0	食品、饮料	—	—
C1	纺织、服装、皮毛	—	—
C2	木材、家具	—	—
C3	造纸、印刷	—	—
C4	石油、化学、塑胶、塑料	—	—
C5	电子	7,035.00	0.00
C6	金属、非金属	20,770.00	0.01
C7	机械、设备、仪表	—	—
C8	医药、生物制品	—	—
C99	其他制造业	—	—
D	电力、煤气及水的生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	交通运输、仓储业	—	—



G	信息技术业	—	—
H	批发和零售贸易	—	—
I	金融、保险业	—	—
J	房地产业	—	—
K	社会服务业	93,200.00	0.03
L	传播与文化产业	—	—
M	综合类	—	—
	合计	121,005.00	0.04

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

#### 7.3.1 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所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600036	招商银行	2,229,815	29,009,893.15	9.60
2	600030	中信证券	1,270,900	14,869,530.00	4.92
3	601088	中国神华	601,855	13,222,754.35	4.37
4	000002	万科A	1,780,161	12,069,491.58	3.99
5	601398	工商银行	2,696,580	10,948,114.80	3.62
6	600900	长江电力	815,388	10,184,196.12	3.37
7	601328	交通银行	1,560,388	9,377,931.88	3.10
8	601601	中国太保	377,475	8,595,105.75	2.84
9	600050	中国联通	1,559,914	8,314,341.62	2.75
10	601857	中国石油	702,219	7,197,744.75	2.38
11	601988	中国银行	2,119,600	7,185,444.00	2.38
12	601628	中国人寿	270,502	6,681,399.40	2.21
13	000898	鞍钢股份	686,903	4,931,963.54	1.63
14	601186	中国铁建	567,300	4,084,560.00	1.35
15	600048	保利地产	368,737	3,772,179.51	1.25
16	601390	中国中铁	885,328	3,674,111.20	1.22
17	601766	中国南车	735,482	3,545,023.24	1.17
18	600068	葛洲坝	298,182	3,110,038.26	1.03
19	000069	华侨城A	280,736	3,088,096.00	1.02
20	601111	中国国航	270,441	2,780,133.48	0.92

21	600875	东方电气	63,066	2,746,524.30	0.91
22	600028	中国石化	321,256	2,512,221.92	0.83
23	600019	宝钢股份	399,619	2,353,755.91	0.78
24	000768	西飞国际	237,578	2,328,264.40	0.77
25	000800	一汽轿车	152,166	2,312,923.20	0.77
26	601998	中信银行	414,680	2,239,272.00	0.74
27	000839	中信国安	182,156	2,007,359.12	0.66
28	600320	振华重工	320,819	1,960,204.09	0.65
29	000039	中集集团	157,891	1,878,902.90	0.62
30	000999	华润三九	80,608	1,849,953.60	0.61
31	600029	南方航空	287,955	1,808,357.40	0.60
32	000024	招商地产	120,232	1,789,052.16	0.59
33	600062	双鹤药业	67,378	1,749,132.88	0.58
34	000423	东阿阿胶	48,768	1,695,175.68	0.56
35	000562	宏源证券	110,575	1,619,923.75	0.54
36	601668	中国建筑	444,336	1,559,619.36	0.52
37	600489	中金黄金	29,447	1,521,232.02	0.50
38	601919	中国远洋	170,119	1,485,138.87	0.49
39	000629	*ST钒钛	178,312	1,426,496.00	0.47
40	600271	航天信息	90,720	1,349,913.60	0.45
41	600795	国电电力	407,545	1,332,672.15	0.44
42	601600	中国铝业	140,743	1,290,613.31	0.43
43	600011	华能国际	199,749	1,264,411.17	0.42
44	600879	航天电子	125,088	1,250,880.00	0.41
45	000625	长安汽车	133,359	1,158,889.71	0.38
46	600161	天坛生物	49,422	1,154,497.92	0.38
47	601898	中煤能源	136,354	1,144,010.06	0.38
48	000031	中粮地产	165,394	1,137,910.72	0.38
49	600528	中铁二局	138,019	1,117,953.90	0.37
50	600150	中国船舶	19,530	1,082,157.30	0.36
51	601872	招商轮船	261,184	1,060,407.04	0.35
52	600970	中材国际	57,677	1,038,186.00	0.34
53	600511	国药股份	42,891	933,737.07	0.31
54	600737	中粮屯河	98,188	921,985.32	0.30

55	601991	大唐发电	131,165	903,726.85	0.30
56	000059	辽通化工	111,990	865,682.70	0.29
57	600087	长航油运	178,883	862,216.06	0.29
58	002128	露天煤业	49,961	850,835.83	0.28
59	600550	天威保变	43,772	825,539.92	0.27
60	000758	中色股份	69,152	820,142.72	0.27
61	600893	航空动力	30,951	750,252.24	0.25
62	601618	中国中冶	181,035	725,950.35	0.24
63	000969	安泰科技	45,196	663,477.28	0.22
64	000968	煤气化	48,736	662,809.60	0.22
65	000780	平庄能源	76,868	645,691.20	0.21
66	600021	上海电力	154,361	615,900.39	0.20
67	601866	中海集运	177,011	596,527.07	0.20
68	000778	新兴铸管	95,086	593,336.64	0.20
69	600058	五矿发展	41,250	580,387.50	0.19
70	600583	海油工程	116,847	579,561.12	0.19
71	600657	信达地产	80,064	510,808.32	0.17
72	600151	航天机电	56,594	505,950.36	0.17
73	601808	中海油服	44,090	487,635.40	0.16
74	000021	长城开发	45,906	486,144.54	0.16
75	600500	中化国际	52,745	470,485.40	0.16
76	600026	中海发展	56,968	467,137.60	0.15
77	600270	外运发展	69,095	462,936.50	0.15
78	000612	焦作万方	26,803	453,238.73	0.15
79	600316	洪都航空	13,158	435,266.64	0.14
80	600118	中国卫星	25,421	397,838.65	0.13
81	600176	中国玻纤	24,708	397,304.64	0.13
82	000793	华闻传媒	70,841	364,122.74	0.12
83	600582	天地科技	19,824	358,021.44	0.12
84	600508	上海能源	21,221	357,998.27	0.12
85	600428	中远航运	47,422	340,489.96	0.11
86	600027	华电国际	89,282	338,378.78	0.11
87	600236	桂冠电力	77,378	333,499.18	0.11
88	600886	国投电力	44,051	311,000.06	0.10

89	600006	东风汽车	69,353	308,620.85	0.10
90	600456	宝钛股份	15,893	304,986.67	0.10
91	600863	内蒙华电	43,414	291,742.08	0.10
92	601918	国投新集	27,847	283,203.99	0.09
93	600581	八一钢铁	28,964	271,682.32	0.09
94	600195	中牧股份	9,850	233,248.00	0.08
95	600299	*ST新材	29,447	227,330.84	0.08
96	600638	新黄浦	25,338	223,987.92	0.07
97	000927	一汽夏利	28,420	219,686.60	0.07
98	600685	广船国际	12,531	218,540.64	0.07

### 7.3.2 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所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300070	碧水源	1,000	93,200.00	0.03
2	002428	云南锗业	500	20,770.00	0.01
3	002426	胜利精密	500	7,035.00	0.00

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	600036	招商银行	43,142,300.70	14.27
2	601088	中国神华	21,348,333.43	7.06
3	601328	交通银行	20,020,768.43	6.62
4	000002	万科A	18,896,982.41	6.25
5	600030	中信证券	17,161,790.33	5.68
6	601398	工商银行	16,618,366.00	5.50
7	600900	长江电力	14,516,323.56	4.80
8	600050	中国联通	12,063,715.76	3.99
9	601857	中国石油	11,068,727.77	3.66

10	601628	中国人寿	9,853,589.57	3.26
11	601601	中国太保	9,554,651.22	3.16
12	601988	中国银行	8,429,207.49	2.79
13	000898	鞍钢股份	8,348,103.67	2.76
14	600048	保利地产	6,654,227.92	2.20
15	601390	中国中铁	6,163,320.53	2.04
16	600028	中国石化	6,158,514.19	2.04
17	601186	中国铁建	6,036,171.24	2.00
18	601766	中国南车	5,277,491.99	1.75
19	600019	宝钢股份	5,200,073.92	1.72
20	000069	华侨城A	5,177,280.02	1.71

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，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	600036	招商银行	12,142,703.98	4.02
2	601328	交通银行	8,714,250.99	2.88
3	601088	中国神华	5,738,706.05	1.90
4	000002	万科A	5,334,341.11	1.76
5	601398	工商银行	4,609,673.57	1.52
6	600900	长江电力	3,946,078.90	1.31
7	600050	中国联通	3,300,057.18	1.09
8	601857	中国石油	2,888,119.10	0.96
9	601628	中国人寿	2,751,578.32	0.91
10	600028	中国石化	2,618,946.80	0.87
11	600019	宝钢股份	2,481,316.52	0.82
12	000898	鞍钢股份	2,247,679.21	0.74
13	600048	保利地产	1,900,242.18	0.63
14	601390	中国中铁	1,737,581.16	0.57
15	601919	中国远洋	1,673,071.73	0.55

16	600489	中金黄金	1,650,972.32	0.55
17	601186	中国铁建	1,624,005.00	0.54
18	601668	中国建筑	1,589,097.81	0.53
19	000069	华侨城A	1,510,756.52	0.50
20	601600	中国铝业	1,490,431.96	0.49

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，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	395,149,909.85
卖出股票的收入（成交）总额	114,454,008.48

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。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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。

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.8 投资组合报告附注

**7.8.1** 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

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

#### 7.8.3 期末其他各项资产构成

金额单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	250,000.00

2	应收证券清算款	—
3	应收股利	160,945.16
4	应收利息	22,956.66
5	应收申购款	11,471.57
6	其他应收款	—
7	待摊费用	49,110.70
8	其他	—
9	合计	494,484.09

#### 7.8.4 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。

##### 7.8.5.1 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。

##### 7.8.5.2 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。

#### 7.8.6 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
9,469	35,352.17	7,100,215.02	2.12%	327,649,476.65	97.88%

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额	占上市总份额的比例
1	范阳秋	6,001,200.00	7.27%
2	吴炎龙	2,400,192.00	2.91%
3	冯宝东	2,197,065.00	2.66%
4	王玲	2,020,444.00	2.45%
5	王强	2,000,256.00	2.42%
6	江苏翔威贸易有限公司	1,600,112.00	1.94%
7	李谊君	1,200,036.00	1.45%
8	陈春彩	1,010,030.00	1.22%
9	于泳	1,000,094.00	1.21%
10	赵凤春	1,000,080.00	1.21%

注：持有人为场内持有人。

### 8.3 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	10,152.59	0.00%



## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2010年03月26日)基金份额总额	743,255,611.35
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	2,186,382.57
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	410,692,302.25
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	334,749,691.67

注：本基金基金合同于2010年3月26日起正式生效，报告期未满一个会计年度。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 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、报告期内本基金管理人重大人事变动。

本报告期本基金新增卢曼女士为基金经理，与许万国先生共同管理。

2、报告期内基金托管人的基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期没有涉及基金管理人、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没有改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金没有改聘为基金进行审计的会计师事务所。

### 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 本期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		债券回购交易		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	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华泰联合证券有限公司	1	100,411,811.42	19.75%	-	-	81,585.70	19.04%	-
中信建投有限责任公司	1	408,098,074.41	80.25%	2,000,000,000.00	100.00%	346,881.66	80.96%	-

注： 1、本期租用证券公司交易单元的变更情况

本报告期内本基金新增了2个交易单元，分别为华泰联合证券有限公司、中信建投有限责任公司。

## 2、专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》（证监基金字<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：

- 1) 券商基本面评价（财务状况、经营状况）；
- 2) 券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）；
- 3) 券商每日信息评价（及时性和有效性）；
- 4) 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。

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长信中证中央企业 100 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同摘要	上海证券报、中国证券报、证券时报	2010-2-1
2	长信中证中央企业 100 指数证券投资基金 (LOF) 招募说明书	上海证券报、中国证券报、证券时报	2010-2-1
3	长信中证中央企业 100 指数证券投资基金 (LOF) 基金份额发售公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2010-2-1
4	长信基金管理有限责任公司关于增加中国工商银行、平安证券和中国民族证券为旗下长信中证中央企业 100 指数证券投资基金 (LOF) 代销机构的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2010-2-2
5	长信基金管理有限责任公司关于增加中国民生银行为旗下长信中证中央企业 100 指数证券投资基金 (LOF) 代销机构的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2010-2-4
6	长信基金管理有限责任公司关于长信中证中央企业 100 指数证券投资基金 (LOF) 上网发售提示性公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2010-2-4
7	长信基金管理有限责任公司关于增加江南证券有限责任公司为旗下长信中	上海证券报、中国证券报、证券时报	2010-2-6

	证中央企业 100 指数证券投资基金 (LOF) 代销机构的公告		
8	长信基金管理有限责任公司关于增加天相投资顾问有限公司为旗下基金代销机构的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2010-3-6
9	长信基金管理有限责任公司关于增加大通证券为旗下基金代销机构的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2010-3-10
10	长信基金管理有限责任公司关于长信中证中央企业 100 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同生效公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2010-3-27
11	长信中证中央企业 100 指数证券投资基金 (LOF) 上市交易公告书	上海证券报、中国证券报、证券时报	2010-4-13
12	长信基金管理有限责任公司关于长信中证中央企业 100 指数证券投资基金 (LOF) 参加“长金通”网上直销费率优惠的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2010-4-14
13	长信基金管理有限责任公司关于长信中证中央企业 100 指数证券投资基金 (LOF) 开放日常申购、赎回业务的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2010-4-14
14	长信基金管理有限责任公司关于长信中证中央企业 100 指数证券投资基金 (LOF) 上市交易提示性公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2010-4-16
15	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分基金参加中国邮政储蓄银行定期定额投资业务费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2010-4-17
16	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金参加中国银河证券网上费率优惠及定期定额投资业务费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2010-4-17
17	长信基金管理有限责任公司关于通过网上直销平台和部分代销机构办理旗下长信中证中央企业 100 指数证券投资基金 (LOF) 定期定额投资业务的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2010-4-17
18	长信基金管理有限责任公司关于调整旗下基金转换业务规则的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2010-4-17
19	长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2010-4-21
20	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金参加中信建投证券网上费率优惠及定期定额投资业务费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2010-4-24
21	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金持有的停牌股票恢复市价估值方	上海证券报、中国证券报、证券时报	2010-5-6

	法的提示性公告		
22	长信基金管理有限责任公司关于增加华安证券为旗下基金代销机构并开通旗下基金定期定额投资业务的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2010-5-27
23	长信基金管理有限责任公司关于参加中信银行股份有限公司基金网上申购费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2010-5-29
24	长信基金管理有限责任公司关于增加天源证券为旗下基金代销机构的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2010-6-1
25	长信基金管理有限责任公司关于参加中国农业银行股份有限公司基金网上申购费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2010-6-2
26	长信基金管理有限责任公司关于在申银万国证券开通旗下基金定投业务的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2010-6-4
27	长信基金管理有限责任公司关于参加交通银行股份有限公司基金网上申购费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2010-6-28
28	长信基金管理有限责任公司关于增聘卢曼为长信中证中央企业 100 指数证券投资基金基金经理的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2010-6-28
29	长信基金管理有限责任公司关于参加上海浦东发展银行电子渠道基金申购费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2010-6-30
30	长信基金管理有限责任公司关于参加中国邮政储蓄银行有限责任公司基金网上申购费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2010-6-30

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

基金托管人中国建设银行股份有限公司其他重要信息如下

2010年1月29日，托管人中国建设银行股份有限公司发布第二届董事会第二十八次会议决议公告，决议聘任庞秀生先生担任中国建设银行股份有限公司副行长。

2010年5月13日，托管人中国建设银行股份有限公司发布关于高级管理人员辞任的公告，范一飞先生已提出辞呈，辞去中国建设银行股份有限公司副行长的职务。

2010年6月21日，托管人中国建设银行股份有限公司发布关于中央汇金投资有限责任公司承诺认购配股股票的公告。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立基金的文件；
- 2、《长信中证中央企业100指数证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 3、《长信中证中央企业100指数证券投资基金（LOF）招募说明书》；
- 4、《长信中证中央企业100指数证券投资基金（LOF）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。

### 12.2 存放地点

基金管理人的住所。

### 12.3 查阅方式

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