

长信美国标准普尔100等权重指数增强型证券投资基金
2011年半年度报告

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。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§ 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.....	6
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人.....	6
2.5 信息披露方式.....	6
2.6 其他相关资料.....	7
§ 3 主要财务指标和基金净值表现.....	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§ 4 管理人报告.....	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
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.....	11
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	11
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
§ 5 托管人报告.....	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
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.....	15
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	16
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
6.4 报表附注.....	19

§ 7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	38
7.3 期末按行业分类的权益投资组合	39
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细	39
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动	43
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	44
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	44
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	44
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	45
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	45
7.11 投资组合报告附注	45
§ 8 基金份额持有人信息	46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	46
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	46
§ 9 开放式基金份额变动	47
§ 10 重大事件揭示	48
10.1 基金份额持有人大会决议	48
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	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	48
10.4 基金投资策略的改变	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	48
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	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	48
10.8 其他重大事件	49
§ 11 备查文件目录	51
11.1 备查文件目录	51
11.2 存放地点	51
11.3 查阅方式	51

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	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
注册地址		上海市浦东新区银城中路68号9楼	北京西城区复兴门内大街1号
办公地址		上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心9楼	北京西城区复兴门内大街1号
邮政编码		200120	100818
法定代表人		田丹	肖钢

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

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、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

2.6 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	北京西城区太平桥大街17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（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
本期加权平均净值利润率	0.62%
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）
期末可供分配利润	165,902.95
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
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2011年6月30日）
基金份额累计净值增长率	1.50%

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。

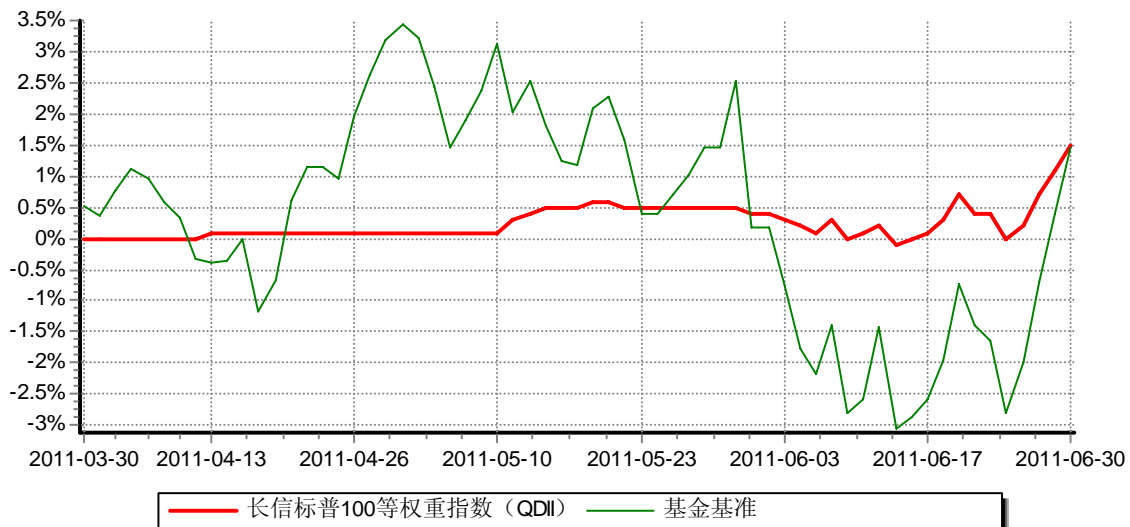
3.2 基金净值表现

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的工作。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 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、通胀水平上

升等因素的影响，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，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	附注号	本期末 2011年6月30日
资产：		
银行存款	6.4.7.1	39,293,230.82
结算备付金		—
存出保证金		—
交易性金融资产	6.4.7.2	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	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	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	6.4.7.6	—
资产总计		61,712,601.72
负债和所有者权益	附注号	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	6.4.7.7	—
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	154,561.15
负债合计		1,124,900.78
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	59,705,540.50
未分配利润	6.4.7.10	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

项目	附注号	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	6.4.7.11	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	6.4.7.12	-22,260.88
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	22,210.92
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	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）	6.4.7.17	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	6.4.7.18	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	6.4.7.19	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
基金管理人负责人	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

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，在境内暂未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 2011年6月30日
活期存款	39,293,230.82
定期存款	—
其他存款	—
合计	39,293,230.82

注：活期存款包括人民币活期存款36,412,932.63元，美元活期存款折合人民币2,880,298.19元。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日		
	成本	公允价值	估值增值
股票	21,690,176.04	22,391,116.83	700,940.79
债券	交易所市场	—	—
	银行间市场	—	—
	合计	—	—
资产支持证券	—	—	—
其他	—	—	—
合计	21,690,176.04	22,391,116.83	700,940.79

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末未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 2011年6月30日
应收活期存款利息	7,327.87
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	1.85
合计	7,329.72

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其它资产。

6.4.7.7 应付交易费用

本基金本报告期末无应付交易费用。

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	3,391.05
预提审计费	26,859.33
预提信息披露费	100,721.79
预提指数授权费	18,145.07
预提指数使用费	5,443.91
合计	154,561.15

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2011年3月30日至2011年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	508,424,713.40	508,424,713.40
本期申购	322,824.38	322,824.38
本期赎回（以“-”号填列）	-449,041,997.28	-449,041,997.28
本期末	59,705,540.50	59,705,540.50

6.4.7.10 未分配利润

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	926,639.75	700,940.79	1,627,580.54
本期基金份额交易产生的变动数	-760,736.80	15,316.70	-745,420.10
其中：基金申购款	1,322.62	79.09	1,401.71
基金赎回款（以“-”号填列）	-762,059.42	15,237.61	-746,821.81
本期已分配利润	—	—	—
本期末	165,902.95	716,257.49	882,160.44

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年3月30日至2011年6月30日
活期存款利息收入	289,747.99
定期存款利息收入	1,243,000.00
其他存款利息收入	—
结算备付金利息收入	—
其他	—
合计	1,532,747.99

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 2011年3月30日至2011年6月30日
卖出股票成交总额	900,340.96
减：卖出股票成本总额	922,601.84
买卖股票差价收入	-22,260.88

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年3月30日至2011年6月30日
股票投资产生的股利收益	22,210.92
基金投资产生的股利收益	—
合计	22,210.92

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年3月30日至2011年6月30日
1. 交易性金融资产	700,940.79
——股票投资	700,940.79
——债券投资	—
——资产支持证券投资	—
——基金投资	—
2. 衍生工具	—
——权证投资	—
3. 其他	—
合计	700,940.79

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年3月30日至2011年6月30日
基金赎回费收入	562,236.54
合计	562,236.54

注：本基金赎回费的25%归入基金资产。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2011年3月30日至2011年6月30日
交易所市场交易费用	12,878.19
银行间市场交易费用	—

合计	12,878.19
----	-----------

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2011年3月30日至2011年6月30日
审计费用	26,859.33
信息披露费	100,721.79
指数授权费	18,164.02
指数使用费	5,449.60
银行汇划费	6,431.90
合计	157,626.64

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，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

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，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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

6.4.10 本报告期的关联方交易

6.4.10.1 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。

6.4.10.2 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 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

6.4.10.2.2 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

6.4.10.3 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

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。

6.4.10.4.2 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

本基金除基金管理人之外的其它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 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	—

6.4.10.6 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

本基金本报告期末进行利润分配。

6.4.12 期末（2011年6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。

6.4.12.2 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。

6.4.12.3 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。

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约责任，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银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。

本基金在交易所进行的交易均通过有资格的经纪商和结算机构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。

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，因此除在附注6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。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，面临的利率风险很有限。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。

下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末 2011年6 月30日	6个月以内	6个月 -1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	36,412,935.09	—	—	—	2,880,295.73	39,293,230.82
交易性金融资产	—	—	—	—	22,391,116.83	22,391,116.83
应收利息	—	—	—	—	7,329.72	7,329.72
应收股利	—	—	—	—	18,255.67	18,255.67
应收申购款	—	—	—	—	2,668.68	2,668.68
其他资产	—	—	—	—	—	—
资产总计	36,412,935.09	—	—	—	25,299,666.63	61,712,601.72
负债						
短期借款	—	—	—	—	—	—
卖出回购金融资产	—	—	—	—	—	—

款						
应付证券清算款	—	—	—	—	—	—
应付赎回款	—	—	—	—	899,767.30	899,767.30
应付管理人报酬	—	—	—	—	55,449.68	55,449.68
应付托管费	—	—	—	—	15,122.65	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	—	—	—	—	—	—
其他负债	—	—	—	—	154,561.15	154,561.15
负债总计	—	—	—	—	1,124,900.78	1,124,900.78
利率敏感度缺口	36,412,935.09	—	—	—	24,174,765.85	60,587,700.94

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的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

本报告期末，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价				

银行存款	2,880,298.19	—	—	2,880,298.19
交易型金融	22,391,116.83	—	—	22,391,116.83
应收股利	18,255.67	—	—	18,255.67
资产合计	25,289,670.69	—	—	25,289,670.69
以外币计价				
预提指数授	18,145.07	—	—	18,145.07
预提指数使	5,443.91	—	—	5,443.91
负债合计	23,588.98	—	—	23,588.98
资产负债表 外汇风险敞 口净额	25,266,081.71	—	—	25,266,081.71

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

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 2011年6月30日	
假设除美元以外的其它变量都不变			
	美元对人民币升值5%		195,207.4
	美元对人民币贬值5%		-195,207.4

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，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。

本基金投资组合中股票投资比例为基金资产净值的36.96%，于2011年6月30日，本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

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 2011年6月30日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	22,391,116.83	36.96

交易性金融资产—基金投资	—	—
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	22,391,116.83	36.96

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

截止本报告期末，本基金成立不足三个月，尚处于建仓期，无法有效估计市场指数波动带来的价格风险。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

下表按公允价值三个层级列示了以公允价值计量的金融资产工具于2011年6月30日的账面价值。公允价值计量中的层级取决于对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值。三个层级的定义如下：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价；

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除市场报价以外的有关资产或负债的输入值；

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

单位：人民币元

资产	第一层级	第二层级	第三层级	合计
交易性金融资产				
股票投资	22,391,116.83	—	—	22,391,116.83
债券投资	—	—	—	—
合计	22,391,116.83	—	—	22,391,116.83

本报告期，本基金金融工具的第一层级与第二层级之间没有发生重大转换。

本报告期，本基金金融工具的公允价值的估值技术并未发生改变。

§ 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所有权益投资明细

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所有权益投资明细

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所有权益投资明细

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	FREEMPORT-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
11	FEDEX CORP	联邦快递	FDX US	纽交所	美国	382	234,483.54	0.39
12	DU PONT (E. I.) DE NEMOURS	杜邦	DD US	纽交所	美国	670	234,359.29	0.39
13	CITIGROUP INC	花旗集团	C US	纽交所	美国	868	233,906.40	0.39
14	METLIFE INC	大都会集团	MET US	纽交所	美国	823	233,657.18	0.39
15	EMERSON ELECTRIC CO	艾默生电气	EMR US	纽交所	美国	638	232,249.55	0.38
16	FORD MOTOR CO	福特汽车	F US	纽交所	美国	2,599	231,943.50	0.38
17	QUALCOMM INC	高通公司	QCOM US	纳斯达克	美国	630	231,538.96	0.38
18	ALCOA INC	美铝	AA US	纽交所	美国	2,255	231,452.24	0.38
19	WEYERHAEUSER CO	惠好	WY US	纽交所	美国	1,634	231,160.63	0.38
20	COMCAST CORP-CLASS A	康卡斯特	CMCSA US	纳斯达克	美国	1,406	230,570.42	0.38
21	MICROSOFT CORP	微软	MSFT US	纳斯达克	美国	1,369	230,350.13	0.38
22	WILLIAMS COS INC	威廉姆斯公司	WMB US	纽交所	美国	1,174	229,829.17	0.38
23	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	霍尼韦尔	HON US	纽交所	美国	595	229,457.37	0.38
24	EMC CORP/MASS	EMC 公司	EMC US	纽交所	美国	1,286	229,284.26	0.38
25	AMERICAN EXPRESS CO	美国运通	AXP US	纽交所	美国	685	229,188.48	0.38
26	SCHLUMBERGER LTD	斯伦贝谢	SLB US	纽交所	美国	407	227,572.52	0.38
27	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	第一资本金融	COF US	纽交所	美国	680	227,383.55	0.38
28	XEROX CORP	施乐	XRX US	纽交所	美国	3,372	227,169.47	0.37
29	UNITED PARCEL SERVICE-CL B	ups 公司	UPS US	纽交所	美国	481	227,019.39	0.37
30	NORFOLK SOUTHERN CORP	诺福克南方	NSC US	纽交所	美国	468	226,941.15	0.37
31	ORACLE CORP	甲骨文	ORCL US	纳斯达克	美国	1,065	226,824.08	0.37
32	APACHE CORP	阿帕契	APA US	纽交所	美国	284	226,782.73	0.37
33	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	百时美施贵宝	BMY US	纽交所	美国	1,207	226,212.97	0.37
34	GOOGLE INC-CL A	谷歌公司	GOOG US	纳斯达克	美国	69	226,119.13	0.37
35	TEXAS INSTRUMENTS INC	德州仪器	TXN US	纽交所	美国	1,064	226,060.24	0.37

36	APPLE INC	苹果电脑	AAPL US	纳斯达克	美国	104	225,921.49	0.37
37	HOME DEPOT INC	家得宝	HD US	纽交所	美国	963	225,728.50	0.37
38	VERIZON COMMUNICATIONS INC	Verizon 通信	VZ US	纽交所	美国	936	225,517.66	0.37
39	GILEAD SCIENCES INC	Gilead 科学	GILD US	纳斯达克	美国	841	225,378.71	0.37
40	UNITED TECHNOLOGIES CORP	联合技术	UTX US	纽交所	美国	393	225,110.92	0.37
41	UNION PACIFIC CORP	联合太平洋	UNP US	纽交所	美国	333	224,986.47	0.37
42	BAKER HUGHES INC	贝克休斯	BHI US	纽交所	美国	479	224,928.48	0.37
43	CONOCOPHILLIPS	康菲石油	COP US	纽交所	美国	462	224,809.02	0.37
44	INTEL CORP	英特尔	INTC US	纳斯达克	美国	1,567	224,724.50	0.37
45	INTL BUSINESS MACHINES CORP	国际商业机器	IBM US	纽交所	美国	202	224,261.00	0.37
46	CISCO SYSTEMS INC	思科	CSCO US	纳斯达克	美国	2,219	224,167.10	0.37
47	US BANCORP	US Bancorp 公司	USB US	纽交所	美国	1,356	223,862.74	0.37
48	DELL INC	戴尔	DELL US	纳斯达克	美国	2,075	223,854.26	0.37
49	GENERAL DYNAMICS CORP	通用动力	GD US	纽交所	美国	464	223,770.33	0.37
50	DOW CHEMICAL CO/THE	陶氏化学	DOW US	纽交所	美国	960	223,658.50	0.37
51	HEWLETT-PACKARD CO	惠普	HPQ US	纽交所	美国	949	223,552.36	0.37
52	SPRINT NEXTEL CORP	斯普林特	S US	纽交所	美国	6,400	223,244.31	0.37
53	CHEVRON CORP	雪佛龙德士古	CVX US	纽交所	美国	335	222,955.68	0.37
54	TIME WARNER INC	时代华纳	TWX US	纽交所	美国	946	222,662.00	0.37
55	3M CO	3M	MMM US	纽交所	美国	362	222,206.92	0.37
56	UNITEDHEALTH GROUP INC	联合健康	UNH US	纽交所	美国	665	221,980.41	0.37
57	EXXON MOBIL CORP	艾克森美孚石油	XOM US	纽交所	美国	421	221,723.36	0.37
58	ALLSTATE CORP	全州保险	ALL US	纽交所	美国	1,121	221,484.88	0.37
59	WALT DISNEY CO/THE	沃尔特迪斯尼	DIS US	纽交所	美国	874	220,817.20	0.36
60	WELLS FARGO & CO	富国银行	WFC US	纽交所	美国	1,216	220,817.20	0.36
61	COCA-COLA CO/THE	可口可乐	KO US	纽交所	美国	507	220,785.30	0.36
62	EXELON CORP	Exelon 公司	EXC US	纽交所	美国	796	220,685.70	0.36
63	PEPSICO INC	百事可乐	PEP US	纽交所	美国	484	220,604.68	0.36
64	BANK OF AMERICA CORP	美国银行	BAC US	纽交所	美国	3,110	220,588.37	0.36

65	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	BERKSHIRE HATH-B	BRK/B US	纽交所	美国	440	220,368.33	0.36
66	DEVON ENERGY CORPORATION	戴文能源	DVN US	纽交所	美国	432	220,331.58	0.36
67	BAXTER INTERNATIONAL INC	百特	BAX US	纽交所	美国	570	220,185.19	0.36
68	AVON PRODUCTS INC	雅芳	AVP US	纽交所	美国	1,214	219,982.63	0.36
69	MCDONALD'S CORP	麦当劳	MCD US	纽交所	美国	403	219,911.18	0.36
70	KRAFT FOODS INC-CLASS A	卡夫食品公司	KFT US	纽交所	美国	964	219,786.67	0.36
71	COSTCO WHOLESALE CORP	好市多批发	COST US	纳斯达克	美国	418	219,764.66	0.36
72	RAYTHEON COMPANY	雷神公司	RTN US	纽交所	美国	681	219,696.91	0.36
73	LOWE'S COS INC	劳氏	LOW US	纽交所	美国	1,456	219,641.96	0.36
74	AT&T INC	美国电话电报集团	T US	纽交所	美国	1,080	219,534.79	0.36
75	GENERAL ELECTRIC CO	通用电气	GE US	纽交所	美国	1,797	219,331.71	0.36
76	ABBOTT LABORATORIES	雅培制药	ABT US	纽交所	美国	643	218,964.39	0.36
77	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	西方石油	OXY US	纽交所	美国	325	218,824.21	0.36
78	PFIZER INC	辉瑞制药	PFE US	纽交所	美国	1,640	218,636.53	0.36
79	SOUTHERN CO	南方	SO US	纽交所	美国	835	218,204.88	0.36
80	LOCKHEED MARTIN CORP	洛克希德马丁	LMT US	纽交所	美国	416	217,986.27	0.36
81	MEDTRONIC INC	美敦力	MDT US	纽交所	美国	870	216,935.15	0.36
82	TARGET CORP	Target 百货	TGT US	纽交所	美国	714	216,758.09	0.36
83	MORGAN STANLEY	摩根士丹利	MS US	纽交所	美国	1,455	216,666.26	0.36
84	CVS CAREMARK CORP	CVS 公司	CVS US	纽交所	美国	890	216,450.43	0.36
85	AMGEN INC	安进	AMGN US	纳斯达克	美国	573	216,375.03	0.36
86	WAL-MART STORES INC	沃尔玛百货	WMT US	纽交所	美国	629	216,313.62	0.36
87	JOHNSON & JOHNSON	强生	JNJ US	纽交所	美国	501	215,675.91	0.36
88	JPMORGAN CHASE & CO	摩根大通	JPM US	纽交所	美国	814	215,667.11	0.36
89	AMERICAN ELECTRIC POWER	美国电力	AEP US	纽交所	美国	883	215,319.45	0.36
90	MERCK & CO. INC.	默克	MRK US	纽交所	美国	939	214,451.42	0.35
91	BOEING CO/THE	波音	BA US	纽交所	美国	448	214,343.53	0.35
92	COLGATE-PALMOLIVE CO	高露洁棕榄	CL US	纽交所	美国	378	213,828.01	0.35
93	HJ HEINZ CO	亨氏	HNZ US	纽交所	美国	618	213,090.63	0.35
94	ENTERGY CORP	Entergy 公司	ETR US	纽交所	美国	479	211,660.93	0.35
95	PROCTER & GAMBLE CO/THE	宝洁	PG US	纽交所	美国	514	211,459.40	0.35

96	BANK OF NEW YORK MELLON CORP	纽约银行	BK US	纽交所	美国	1,268	210,237.43	0.35
97	ALTRIA GROUP INC	高利特	MO US	纽交所	美国	1,227	209,712.65	0.35
98	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	菲利普莫里斯国际集团	PM US	纽交所	美国	485	209,572.74	0.35
99	GOLDMAN SACHS GROUP INC	高盛	GS US	纽交所	美国	243	209,297.17	0.35
100	WALGREEN CO	沃尔格林	WAG US	纽交所	美国	744	204,439.40	0.34

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。

7.9 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.	—	11,089,577.82	47.16%	6,162.39	47.92%	—

International plc						
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。

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	长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金基金份额发售公告	中证报、证券时报、上证报	2011-2-23
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及摘要	中证报、证券时报、上证报	2011-2-23
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	中证报、证券时报、上证报	2011-2-23
4	关于增加华夏银行为长信标普 100 等权重指数增强型基金代销机构的公告	中证报、证券时报、上证报	2011-2-26
5	关于增加中信金通证券为长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型基金代销机构的公告	中证报、证券时报、上证报	2011-3-5
6	关于增加上海浦东发展银行为长信美国标普 100 等权重指数增强型基金代销机构的公告	中证报、证券时报、上证报	2011-3-14
7	关于运用本公司自有资金投资长信美国标准普尔 100 等权重指数	中证报、证券时报、上证报	2011-3-16

	增强型证券投资基金的公告		
8	长信基金管理有限责任公司关于开通汇付天下“天天盈”账户网上直销业务的公告	中证报、证券时报、上证报	2011-3-18
9	关于长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金基金合同生效公告	中证报、证券时报、上证报	2011-3-31
10	长信基金管理有限责任公司关于增加中信证券股份有限公司为旗下基金代销机构并开通部分基金定期定额投资业务的公告	中证报、证券时报、上证报、 证券时报	2011-4-11
11	关于长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告	中证报、证券时报、上证报	2011-5-7
12	关于长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金开放日的提示性公告	中证报、证券时报、上证报	2011-5-7
13	长信基金管理有限责任公司关于长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金暂停申购、赎回、转托管等业务的公告	中证报、证券时报、上证报	2011-5-28
14	长信基金管理有限责任公司关于开通多交易账户业务的公告	中证报、证券时报、上证报、 证券时报	2011-6-10
15	长信基金管理有限责任公司关于增加国盛证券有限责任公司为旗下部分基金代销机构并开通定期定额投资业务的公告	中证报、证券时报、上证报、 证券时报	2011-6-18
16	长信基金管理有限责任公司关于在中国工商银行开通基金定期定额投资业务并参加其“2011 倾心回馈”基金定投费率优惠活动的公告	中证报、证券时报、上证报	2011-6-21
17	长信基金管理有限责任公司关于长信美国标普 100 等权重指数增强型证券投资基金开放日常定期定额投资业务的公告	中证报、证券时报、上证报	2011-6-21
18	长信基金管理有限责任公司关于长信美国标普 100 等权重指数增强型证券投资基金参加“长金通”网上直销基金定期不定额申购及相关业务费率优惠的公告	中证报、证券时报、上证报	2011-6-22
19	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分基金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	中证报、证券日报、上证报	2011-6-28

§ 11 备查文件目录

11.1 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。

11.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

11.3 查阅方式

投资者可在有效的工作时间内免费查阅，在支付工本费后，也可在有效的工作时间内取得上述文件的复制件或复印件。

长信基金管理有限责任公司

2011年8月27日