

长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型 证券投资基金 更新的招募说明书摘要

2015 年第【2】号

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

本基金经 2010 年 11 月 9 日中国证券监督管理委员会证监许可【2010】1586 号文核准募集。本基金的基金合同于 2011 年 3 月 30 日正式生效。

重要提示

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。

本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

本基金主要投资于美国证券市场，基金净值会因为美国证券市场波动等因素产生波动。在投资本基金前，投资者应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策，获得基金投资收益，并承担基金投资中出现的风险，一是投资风险，包括海外市场风险、政治风险等；二是运营风险，包括操作风险、会计核算风险、税务风险、法律风险等。请投资者充分关注这两类风险。投资有风险，投资者申购基金时应认真阅读招募说明书及基金合同。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，



但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本更新的招募说明书所载的内容截止日为 2015 年 9 月 30 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2015 年 6 月 30 日（财务数据未经审计）。本基金托管人中国银行股份有限公司已经复核了本次更新的招募说明书。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

基金管理人概况			
名称	长信基金管理有限责任公司		
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 9 楼		
办公地址	上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼		
邮政编码	200120		
批准设立机关	中国证券监督管理委员会		
批准设立文号	中国证监会证监基金字[2003]63 号		
注册资本	壹亿伍仟万元人民币		
设立日期	2003 年 5 月 9 日		
组织形式	有限责任公司		
法定代表人	叶焯		
电话	021-61009999		
传真	021-61009800		
联系人	魏明东		
存续期间	持续经营		
经营范围	基金管理业务，发起设立基金，中国证监会批准的其他业务。 （依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动）		
股权结构	股东名称	出资额	出资比例
	长江证券股份有限公司	7350 万元	49%
	上海海欣集团股份有限公司	5149.5 万元	34.33%
	武汉钢铁股份有限公司	2500.5 万元	16.67%
	总计	15000 万元	100%

（二）主要人员情况

1、基金管理人的董事会成员情况

董事会成员			
姓名	职务	性别	简历

叶焯	董事长	男	中共党员，硕士研究生，现任长信基金管理有限责任公司董事长。曾任职君安证券有限公司石家庄营业部总经理、公司副总裁，国泰君安证券股份有限公司武汉分公司总经理、资产委托管理部总监，长信基金管理有限责任公司总经理，长城证券有限责任公司总经理，长江证券股份有限公司董事、总裁，长江证券承销保荐有限公司董事长。
杨泽柱	董事	男	中共党员，博士研究生，现任湖北省人大常委会委员、长江证券股份有限公司党委书记、董事长。曾任湖北省松滋县老城公社党委副书记、书记，松滋县检察院检察长，松滋县政府常务副县长、县委常委，巴东县政府县长、县委副书记，荆州地区(荆沙市)计委主任、党组副书记，荆沙市副市长，荆州市委常委、副市长、市行政学院院长，荆门市委副书记、副市长、市行政学院院长，荆门高新技术开发区党委第一书记，湖北省委台湾工作办公室、湖北省政府台湾事务办公室主任，湖北省国资委主任、党委书记，湖北省联合发展投资集团有限公司党委书记。
陈谋亮	董事	男	中共党员，法学硕士，工商管理博士，高级经济师，高级商务谈判师。现任上海海欣集团股份有限公司总裁。曾任湖北省委组织部“第三梯队干部班”干部，中国第二汽车制造厂干部，湖北经济学院讲师、特聘教授，扬子石化化工厂保密办主任、集团总裁办、股改办、宣传部、企管处管理干部、集团法律顾问，中石化/扬子石化与德国巴斯夫合资特大型一体化石化项目中方谈判代表，交大南洋部门经理兼董事会证券事务代表，海欣集团董事会秘书处主任、战略投资部总监、总裁助理、副总裁。
彭辰	董事	男	中共党员，博士研究生学历，经济学博士，正高级高级会计师，研究员。曾任武汉钢铁(集团)公司副总经理兼总会计师、党委常委、副总经理，武汉钢铁股份有限公司董事会董事、总经理。
覃波	董事	男	中共党员，硕士，上海国家会计学院 EMBA 毕业，具有基金从业资格。现任长信基金管理有限责任公司总经理。曾任职于长江证券有限责任公司。2002 年加入长信基金管理有限责任公司，历任市场开发部区域经理、营销策划部副总监、市场开发部总监、专户理财部总监、总经理助理、副总经理。
胡柏枝	独立董事	男	中共党员，大专，高级会计师，注册会计师，注册税务师。曾任湖北省财政厅副厅长、党组副书记，湖北省国有资产管理局副局长、局长，中国三峡总公司财务部主任、副总会计师，三峡财务公司总经理，财政部驻湖北省专员办监察专员、党组书记、巡视员，湖北省人大财经委、预工委副主任。
黄宪	独立董事	男	中共党员，博士，博士生导师。现任武汉大学经济

			与管理学院金融系教授、博士生导师。曾任武汉大学教师、商学院副院长，美国新泽西西东大学访问学者，武汉大学珞珈城市信用社副董事长，中港合资武新公司财务总经理。
宋晓燕	独立董事	女	中共党员，法学博士，律师。现任上海财经大学法学院教授、博士生导师。曾任武汉大学管理学院国际金融系教师。
注：上述人员之间均不存在近亲属关系			

2、监事会成员

监事会成员			
姓名	职务	性别	简历
余汉生	监事会主席	男	中共党员，本科，正高职高级会计师。现任武汉钢铁股份有限公司计划财务部部长。曾任武钢实业公司审计处处长、武钢实业公司财务处处长、武汉钢铁（集团）公司计划财务部会计处处长。
陈水元	监事	男	硕士研究生，会计师、经济师。现任长江证券股份有限公司执行副总裁、财务负责人。曾任湖北证券有限责任公司营业部财务主管、经纪事业部财务经理，长江证券有限责任公司经纪事业部总经理助理、经纪业务总部总经理助理、营业部总经理，长江证券股份有限公司营业部总经理总裁特别助理。
杨爱民	监事	男	中共党员，在职研究生学历，会计师。现任上海海欣集团股份有限公司财务总监。曾任甘肃铝厂财务科副科长、科长，甘肃省铝业公司财务处副处长、处长，上海海欣集团审计室主任、财务副总监。
李毅	监事	女	中共党员，硕士。现任长信基金管理有限责任公司零售服务部负责人。曾任长信基金管理有限责任公司综合管理部副总监。
孙红辉	监事	男	中共党员，硕士。现任长信基金管理有限责任公司总经理助理兼基金事务部总监。曾任职于上海机械研究所、上海家宝燃气具公司和长江证券有限责任公司。
魏明东	监事	男	中共党员，硕士。现任长信基金管理有限责任公司综合行政部总监兼人力资源总监。曾任职于上海市徐汇区政府、华夏证券股份有限公司和国泰基金管理有限公司。
注：上述人员之间均不存在近亲属关系			

3、经理层成员

经理层成员



姓名	职务	性别	简历
覃波	总经理	男	简历同上。
周永刚	督察长	男	经济学硕士，EMBA。现任长信基金管理有限责任公司督察长。曾任湖北证券有限责任公司武汉自治街营业部总经理，长江证券有限责任公司北方总部总经理兼北京展览路证券营业部总经理，长江证券有限责任公司经纪业务总部副总经理兼上海代表处主任、上海汉口路证券营业部总经理。
宋小龙	副总经理	男	理学硕士，北京大学计算机软件专业研究生毕业，具有基金从业资格。2012 年 10 月加入长信基金管理有限责任公司，现任长信基金管理有限责任公司副总经理，兼任长信金利趋势混合型证券投资基金、长信银利精选混合型证券投资基金和长信内需成长混合型证券投资基金的基金经理。曾任北京北大青鸟公司项目经理、富国基金管理公司项目经理、行业研究员、基金经理及权益投资部总经理。
邵彦明	副总经理	男	硕士，毕业于对外经济贸易大学，具有基金从业资格。现任长信基金管理有限责任公司副总经理兼北京分公司总经理。曾任职于北京市审计局、上海申银证券公司、大鹏证券公司、嘉实基金管理有限公司。2001 年作为筹备组成员加入长信基金，历任公司北京代表处首席代表、公司总经理助理。
李小羽	副总经理	男	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）。现任长信基金管理有限责任公司副总经理、固定收益部总监，长信利丰债券型证券投资基金、长信可转债债券型证券投资基金和长信利富债券型证券投资基金的基金经理。曾任职长城证券公司、加拿大 Investors Group Financial Services Co., Ltd。2002 年加入长信基金管理有限责任公司，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和长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金经理、总经理助理。

注：上述人员之间均不存在近亲属关系

4、基金经理

本基金历任基金经理情况			
姓名	职务	任职时间	简历
薛天	基金经理	本基金基金合同生效当日至今	美国哥伦比亚大学公共卫生学硕士和工商管理硕士，具有美国 SEC 证券业务从业资格和英国 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

			国有超过 10 年的基金管理和投资研究工作 工作经验。2009 年 5 月加入长信基金管理 有限责任公司，现任长信基金管理有限责 任公司国际业务部投资总监，兼任本基 金的基金经理。曾任法国巴黎银行（伦敦/ 纽约）股票分析师、花旗集团投资部基 金经理、美国 Empyrean Capital Partners 基金经理和合伙人，一直从事证券研究 和投资管理工作。
--	--	--	--

5、投资决策委员会成员

投资决策委员会成员	
姓名	职务
覃波	总经理
宋小龙	副总经理、投资决策委员会主任委员、长信金利趋势混合型证券投资基金、长信内需成长混合型证券投资基金和长信银利精选混合型证券投资基金的基金经理
谈洁颖	投资管理部总监、投资决策委员会执行委员、长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金、长信新利灵活配置混合型证券投资基金、长信多利灵活配置混合型证券投资基金、长信睿进灵活配置混合型证券投资基金的基金经理
李小羽	副总经理、固定收益部总监、投资决策委员会执行委员、长信利丰债券型证券投资基金、长信可转债债券型证券投资基金和长信利富债券型证券投资基金的基金经理
薛天	国际业务部投资总监、投资决策委员会执行委员、长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金的基金经理
黄建中	专户投资部（筹）投资经理、投资决策委员会执行委员
朱君荣	专户投资部（筹）副总监、投资经理
高远	研究发展部负责人
注：上述人员之间均不存在近亲属关系	

（三）内部组织结构及员工情况

内部组织结构及员工情况	
股东会是公司的最高权力机构，下设董事会和监事会。公司组织管理实行董事会领导下的总经理负责制，总经理、副总经理和督察长组成公司的经营管理层。	
公司经营管理层下设的委员会	内部控制委员会、投资决策委员会
公司内部组织结构	金融工程部、投资管理部、研究发展部、固定收益部、交易管理部、基金事务部、零售服务部、机构业务部、信息技术部、监察稽核部、综合行政部、专户理财部、国际业务部、产品开发部、电子商务部、财务管理部



分支机构	北京分公司、深圳分公司、武汉办事处
员工总数	142 人（截至 2015 年 9 月 30 日）

二、基金托管人

1、基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

首次注册登记日期：1983 年 10 月 31 日

注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

法定代表人：田国立

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号

托管部门信息披露联系人：王永民

传真：(010) 66594942

中国银行客服电话：95566

2、基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于 1998 年，现有员工 110 余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60% 以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内，中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务，为各类客户提供个性化的托管增值服务，是国内领先的大型中资托管银行。

3、证券投资基金托管情况

截至 2015 年 6 月 30 日，中国银行已托管 382 只证券投资基金，其中境内基金 356 只，QDII 基金 26 只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。



三、相关服务机构

(一) 基金份额销售机构

1、直销中心：长信基金管理有限责任公司	
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 9 楼	
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	
法定代表人：叶烨	联系人：王瑞英
电话：021-61009916	传真：021-61009917
客户服务电话：400-700-5566	公司网站：www.cxfund.com.cn
2、场外代销机构	
(1) 中国农业银行股份有限公司	
注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号	
办公地址：北京市东城区建国门内大街 69 号	
法定代表人：刘士余	联系人：张凯学
传真：010-85109219	
客户服务电话：95599	网址：www.abchina.com
(2) 中国工商银行股份有限公司	
注册地址：中国北京复兴门内大街 55 号	
办公地址：中国北京复兴门内大街 55 号	
法定代表人：姜建清	联系人：李鸿岩
电话：010-66105662	
客户服务电话：95588	网址：www.icbc.com.cn
(3) 中国银行股份有限公司	
注册地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号	
办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号	
法定代表人：田国立	联系人：宋亚平
电话：010-66593657	
客户服务电话：95566	网址：www.boc.cn
(4) 交通银行股份有限公司	
注册地址：上海市银城中路 188 号	
办公地址：上海市银城中路 188 号	
法定代表人：牛锡明	联系人：张作伟
电话：021-58781234	传真：021-58408483
客户服务电话：95559	网址：www.bankcomm.com
(5) 招商银行股份有限公司	
注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦	
办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦	



法定代表人：李建红	联系人：林本
电话：0755-83198888	传真：0755-83195109
客户服务电话：95555	网址：www.cmbchina.com
(6) 上海浦东发展银行股份有限公司	
注册地址：上海市浦东新区浦东南路 500 号	
办公地址：上海市中山东一路 12 号	
法定代表人：吉晓辉	联系人：唐苑
电话：021-61618888	传真：021-63604199
客户服务电话：95528	网址：www.spdb.com.cn
(7) 中国民生银行股份有限公司	
注册地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号	
办公地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号	
法定代表人：董文标	联系人：姚健英
电话：010-58560666	传真：010-57092611
客户服务电话：95568	网址：www.cmbc.com.cn
(8) 重庆银行股份有限公司	
注册地址：重庆市渝中区邹容路 153 号	
办公地址：重庆市渝中区邹容路 153 号	
法定代表人：马千真	联系人：孔文超
电话：023-63799379	传真：023-63792412
客户服务电话：(023)63836229	网址：www.cqcbank.com
(9) 华夏银行股份有限公司	
注册地址：北京市东城区建国门内大街 22 号华夏银行大厦	
办公地址：北京市东城区建国门内大街 22 号华夏银行大厦	
法定代表人：吴建	联系人：刘军祥
电话：010-85238667	传真：010-85238680
客户服务电话：010-95577	网址：www.hxb.com.cn
(10) 汉口银行股份有限公司	
注册地址：武汉市江汉区建设大道 933 号武汉商业银行大厦	
办公地址：武汉市江汉区建设大道 933 号	
法定代表人：陈新民	联系人：李星
电话：027-82656224	传真：027-82656236
客户服务电话：(027) 96558, 4006096558	网址：www.hkbchina.com
(11) 杭州银行股份有限公司	
注册地址：杭州银行庆春路 46 号杭州银行大厦	
办公地址：杭州银行庆春路 46 号杭州银行大厦	
法定代表人：吴太普	联系人：严峻



电话：0571-85108195	传真：0571-85106576
客户服务电话：96523, 400-8888-508	网址：www.hzbank.com.cn
（12）平安银行股份有限公司	
注册地址：深圳市深南中路 1099 号平安银行大厦	
办公地址：深圳市深南中路 1099 号平安银行大厦	
法定代表人：孙建一	联系人：张莉
电话：0755-22166118	传真：0755-25841098
客户服务电话：95511-3	网址：bank.pingan.com
（13）厦门银行股份有限公司	
注册地址：福建省厦门市思明区湖滨北路 101 号商业银行大厦	
办公地址：福建省厦门市思明区湖滨北路 101 号商业银行大厦	
法定代表人：吴世群	联系人：林黎云
电话：0592-5365735	传真：0592-5061952
客户服务电话：400-858-8888	网址：www.xmbankonline.com
（14）安信证券股份有限公司	
注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元	
办公地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元	
法定代表人：牛冠兴	联系人：陈剑虹
电话：0755-82558305	传真：0755-28558355
客户服务电话：4008-001-001	网址：www.essence.com.cn
（15）长城证券股份有限公司	
注册地址：深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层	
办公地址：深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层	
法定代表人：黄耀华	联系人：高峰
电话：0755-83516289	传真：0755-83515567
客户服务电话：400-6666-888	网址：www.cgws.com
（16）长江证券股份有限公司	
注册地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦	
办公地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦	
法定代表人：杨泽柱	联系人：李良
电话：027-65799999	传真：027-85481900
客户服务电话：95579 或 4008-888-999	网址：www.95579.com
（17）大通证券股份有限公司	
注册地址：辽宁省大连市中山区人民路 24 号	
办公地址：辽宁省大连市沙河口区会展路 129 号大连期货大厦 39 层	
法定代表人：张智河	联系人：谢立军
电话：0411-39673202	传真：0411-39673219



客户服务电话：4008-169-169	网址：www.daton.com.cn
(18) 德邦证券有限责任公司	
注册地址：上海市普陀区曹阳路 510 号南半幢 9 楼	
办公地址：上海市福山路 500 号城建国际中心 26 楼	
法定代表人：姚文平	联系人：王志琦
电话：021-68761616	传真：021-68767032
客户服务电话：400-8888-128	网址：www.tebon.com.cn
(19) 第一创业证券股份有限公司	
注册地址：深圳市罗湖区笋岗路 12 号中民时代广场 B 座 25、26 层	
办公地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 18 楼	
法定代表人：刘学民	联系人：钟兴
电话：0755-25832852	传真：0755-25831754
客户服务电话：400-888-1888	网址：www.firstcapital.com.cn
(20) 东莞证券有限责任公司	
注册地址：东莞市莞城区可园南路 1 号	
办公地址：东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼	
法定代表人：张运勇	联系人：乔芳
电话：0769-22112062	传真：0769-22119423
客户服务电话：0769-961130	网址：www.dgzq.com.cn
(21) 东吴证券股份有限公司	
注册地址：苏州工业园区星阳街 5 号	
办公地址：苏州工业园区星阳街 5 号	
法定代表人：范力	联系人：陆晓
电话：0512-62938521	传真：0512-65588021
客户服务电话：400 860 1555	网址：www.dwzq.com.cn
(22) 光大证券股份有限公司	
注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号	
办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号	
法定代表人：薛峰	联系人：刘晨
电话：021-22169999	传真：021-22169134
客户服务电话：400888788、10108998、95525	网址：www.ebscn.com
(23) 广州证券股份有限公司	
注册地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 楼、20 楼	
办公地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 楼、20 楼	
法定代表人：邱三发	联系人：林洁茹
电话：020-88836999	传真：020-88836654
客户服务电话：020-961303	网址：www.gzs.com.cn



(24) 华福证券有限责任公司	
注册地址: 福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层	
办公地址: 福州市五四路 157 号新天地大厦 7 至 10 层	
法定代表人: 黄金琳	联系人: 张腾
电话: 0591-87383623	传真: 0591-87383610
客户服务电话: 96326 (福建省外请先拨 0591)	网址: www.hfzq.com.cn
(25) 广发证券股份有限公司	
注册地址: 广州市天河北路 183 号大都会广场 43 楼	
办公地址: 广州市天河北路 183 号大都会广场 43 楼	
法定代表人: 孙树明	联系人: 黄岚
电话: 020-87555888 转各营业网点	传真: 020-87557985
客户服务电话: 95575 或致电各地营业部	网址: www.gf.com.cn
(26) 国都证券股份有限公司	
注册地址: 北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层	
办公地址: 北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层	
法定代表人: 常喆	联系人: 李弢
电话: 010-84183389	传真: 010-84183311-3389
客户服务电话: 400-818-8118	网址: www.guodu.com
(27) 国金证券股份有限公司	
注册地址: 成都市东城根上街 95 号	
办公地址: 成都市东城根上街 95 号	
法定代表人: 冉云	联系人: 刘一宏
电话: 028-86690126	传真: 028-86690126
客户服务电话: 4006600109	网址: www.gjzq.com.cn
(28) 国联证券股份有限公司	
注册地址: 江苏省无锡市县前东街 168 号	
办公地址: 江苏省无锡市太湖新城金融一街 8 号国联金融大厦 702	
法定代表人: 雷建辉	联系人: 沈刚
电话: 0510-82831662	传真: 0510-82830162
客户服务电话: 95570	网址: www.glsc.com.cn
(29) 国盛证券有限责任公司	
注册地址: 南昌市北京西路 88 号 (江信国际金融大厦)	
办公地址: 南昌市北京西路 88 号 (江信国际金融大厦)	
法定代表人: 曾小普	联系人: 陈明
电话: 0791-6281061	传真: 0791-6281061
客户服务电话: 4008-222-111	网址: www.gsstock.com



(30) 国泰君安证券股份有限公司	
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号	
办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼	
法定代表人：杨德红	联系人：芮敏祺
电话：021-38676666	传真：021-38670666
客户服务热线：4008888666	网址：www.gtja.com
(31) 国信证券股份有限公司	
注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层	
办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层	
法定代表人：何如	联系人：周杨
电话：0755-82130833	传真：0755-82133952
客户服务电话：95536	网址：www.guosen.com
(32) 国元证券股份有限公司	
注册地址：安徽省合肥市寿春路 179 号	
办公地址：安徽省合肥市寿春路 179 号	
法定代表人：凤良志	联系人：李飞
电话：05551-2615542	传真：0551-2634906
客户服务电话：955784008-888-777	网址：www.gyzq.com.cn
(33) 海通证券股份有限公司	
注册地址：上海市淮海中路 98 号	
办公地址：上海市广东路 689 号海通证券大厦	
法定代表人：王开国	联系人：李笑鸣
电话：021-23219000	传真：021-23219100
客户服务电话：400-8888-001 或 95553	网址：www.htsec.com
(34) 华安证券股份有限公司	
注册地址：安徽省合肥市长江中路 357 号	
办公地址：合肥市蜀山区南二环 959 号 B1 座华安证券	
法定代表人：李工	联系人：汪燕
电话：0551-5161666	传真：0551-5161600
客户服务电话：96518、400-80-96518	网址：www.hazq.com
(35) 华宝证券有限责任公司	
注册地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号 57 层	
办公地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号 57 层	
法定代表人：陈林	联系人：刘闻川
电话：021-68777222	传真：021-68777822
客户服务电话：400-820-9898	网址：www.cnhbstock.com
(36) 华龙证券有限责任公司	



注册地址：甘肃省兰州市城关区东岗西路 638 号财富大厦 21 楼	
办公地址：甘肃省兰州市城关区东岗西路 638 号财富大厦	
法定代表人：李晓安	联系人：邓鹏怡
电话：0931-4890208	传真：0931-4890628
客户服务电话：4006898888	网址：www.hlzqgs.com.cn
(37) 华泰联合证券有限责任公司	
注册地址：深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第五层	
办公地址：深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第 5 层、17 层、18 层、24 层、25 层、26 层	
法定代表人：马昭明	联系人：庞晓芸
电话：0755-82492000	传真：0755-82492962
客户服务电话：95513	网址：www.lhzq.com
(38) 华泰证券股份有限公司	
注册地址：南京市中山东路 90 号华泰证券大厦	
办公地址：南京市中山东路 90 号华泰证券大厦	
法定代表人：吴万善	联系人：郭琳
电话：025-83290979	传真：025-84579763
客户服务电话：95597	网址：www.htsc.com.cn
(39) 江海证券有限公司	
注册地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号	
办公地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号	
法定代表人：孙名扬	联系人：高悦铭
电话：0451-82336863	传真：0451-82287211
客户服务电话：400-666-2288	网址：www.jhzq.com.cn
(40) 中航证券有限公司	
注册地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼	
办公地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼	
法定代表人：王宜四	联系人：戴蕾
电话：0791-86768681	传真：0791-86770178
客户服务电话：400-8866-567	网址：www.avicsec.com
(41) 平安证券有限责任公司	
注册地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼	
办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼 (518048)	
法定代表人：杨宇翔	联系人：石静武
电话：0755-22626391	传真：0755-82400862
客户服务电话：95511-8	网址：www.pingan.com
(42) 中泰证券股份有限公司	



注册地址：山东省济南市市中区经七路 86 号	
办公地址：山东省济南市市中区经七路 86 号	
法定代表人：李玮	联系人：王霖
电话：0531-68889155	传真：0531-68889752
客户服务电话：95538	网址：www.qlzq.com.cn
（43）上海证券有限责任公司	
注册地址：上海市西藏中路 336 号上海证券	
办公地址：上海市西藏中路 336 号	
法定代表人：龚德雄	联系人：许曼华
电话：021-53519888	传真：021-53519888
客户服务电话：4008918918、021-962518	网址：www.962518.com
（44）申万宏源证券有限公司	
注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层	
办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 40 层	
法定代表人：李梅	联系人：黄莹
电话：021-33389888	传真：021-33388224
客户服务电话：95523 或 4008895523	网址：www.swhysc.com
（45）天风证券股份有限公司	
注册地址：中国湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路 2 号高科大厦四楼	
办公地址：中国湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路 2 号高科大厦四楼	
法定代表人：余磊	联系人：翟璟
电话：027-87618882	传真：027-87618863
客服电话：028-86711410	网址：www.tfzq.com
（46）天相投资顾问有限公司	
注册地址：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701	
办公地址：北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座 5 层	
法定代表人：林义相	联系人：尹伶
电话：010-66045529	传真：010-66045518
客户服务电话：010-66045678	网址：www.txsec.com
（47）西藏同信证券股份有限公司	
注册地址：拉萨市北京中路 101 号	
办公地址：上海市永和路 118 弄东方企业园 24 号	
法定代表人：贾绍君	联系人：汪尚斌
电话：021-36533017	传真：021-36533017
客户服务电话：400-8811-177	网址：www.xzsec.com
（48）湘财证券有限责任公司	
注册地址：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号标志商务中心 11 楼	



办公地址：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号标志商务中心 11 楼	
法定代表人：林俊波	联系人：钟康莺
电话：021-68634518	传真：021-68865680
客户服务电话：400-888-1551	网址：www.xcsc.com
（49）日信证券有限责任公司	
注册地址：呼和浩特市新城区锡林南路 18 号	
办公地址：北京西城区闹市口大街 1 号长安兴融中心西楼 11 层	
法定代表人：孔佑杰	联系人：陈文彬
电话：010-83991743	传真：010-66412537
客户服务电话：010-83991888	网址：www.rxzq.com.cn
（50）兴业证券股份有限公司	
注册地址：福州市湖东路 268 号	
办公地址：浦东新区民生路 1199 弄证大·五道口广场 1 号楼 21 层	
法定代表人：兰荣	联系人：夏中苏
电话：021-38565785	
客户服务电话：400-8888-123	网址：www.xyzq.com.cn
（51）招商证券股份有限公司	
注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 38-45 层	
办公地址：广东省深圳市福田区益田路江苏大厦 38-45 层	
法定代表人：宫少林	联系人：黄婵君
电话：0755-82960223	传真：0755-82943121
客户服务电话：95565 或 400-8888-111	网址：www.newone.com.cn
（52）中国银河证券股份有限公司	
注册地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座	
办公地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座	
法定代表人：陈有安	联系人：宋明
电话：010-66568888	传真：010-66568990
客户服务电话：4008-888-888	网址：www.chinastock.com.cn
（53）中信建投证券股份有限公司	
注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼	
办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号	
法定代表人：王常青	联系人：张颢
电话：010-85130588	传真：010-65182261
客户服务电话：400-8888-108	网址：www.csc108.com
（54）中信证券股份有限公司	
注册地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座	
办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦	



法定代表人：王东明	联系人：侯艳红
电话：010-60838888	传真：010-60833739
客户服务电话：95558	网址：www.citics.com
(55) 中信证券（山东）有限责任公司	
注册地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼 20 层（266061）	
办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼 20 层（266061）	
法定代表人：杨宝林	联系人：吴忠超
电话：0532-85022326	传真：0532-85022605
客户服务电话：95548	网址：www.citicssd.com
(56) 中山证券有限责任公司	
注册地址：深圳市福田区益田路 6009 号新世界中心 29 层	
办公地址：深圳市福田区益田路 6009 号新世界中心 29 层	
法定代表人：吴永良	联系人：罗艺琳
电话：0755-83734659	传真：0755-82960582
客户服务电话：4001022011	网址：www.zszq.com.cn
(57) 信达证券股份有限公司	
注册地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼	
办公地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼	
法定代表人：张志刚	联系人：鹿馨方
电话：010-63081000	传真：010-63080978
客服热线：4008008899	网址：www.cindasc.com
(58) 西南证券股份有限公司	
注册地址：重庆市江北区桥北苑 8 号	
办公地址：重庆市江北区桥北苑 8 号西南证券大厦	
法定代表人：余维佳	联系人：张煜
电话：023-63786633	传真：023-63786212
客服热线：4008096096	网址：www.swsc.com.cn
(59) 杭州数米基金销售有限公司	
注册地址：杭州市余杭区仓前街道文一西路 1218 号 1 幢 202 室	
办公地址：浙江省杭州市西湖区黄龙时代广场 B 座 6 楼	
法定代表人：陈柏青	联系人：韩爱彬
电话：0571-81137494	传真：4000-766-123
客户服务电话：4000-766-123	网址：www.fund123.cn
(60) 上海长量基金销售投资顾问有限公司	
注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室	
办公地址：上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层	
法定代表人：张跃伟	联系人：马良婷



电话: 021-20691832	传真: 021-20691861
客户服务电话: 400-820-2899	网址: www.erichfund.com
(61) 诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司	
注册地址: 上海市金山区廊下镇漕廊公路 7650 号 205 室	
办公地址: 上海市浦东新区陆家嘴银城中路 68 号时代金融中心 8 楼 801	
法定代表人: 汪静波	联系人: 徐诚
电话: 021-38602377	传真: 021-38509777
客户服务电话: 400-821-5399	网址: www.noah-fund.com
(62) 上海好买基金销售有限公司	
注册地址: 上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室	
办公地址: 上海市浦东新区浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903-906 室	
法定代表人: 杨文斌	联系人: 苗汀
电话: 021-58870011	传真: 021-68596916
客户服务电话: 4007009665	网址: www.ehowbuy.com
(63) 和讯信息科技有限公司	
注册地址: 北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层	
办公地址: 北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层	
法定代表人: 王莉	联系人: 吴卫东
电话: 021-68419822	传真: 021-20835779
客户服务电话: 400-920-0022	网址: www.licaike.com
(64) 上海天天基金销售有限公司	
注册地址: 上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层	
办公地址: 上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 7 楼	
法定代表人: 其实	联系人: 朱钰
电话: 021-54509998	传真: 021-64385308
客户服务电话: 400-1818-188	网址: fund.eastmoney.com
(65) 宜信普泽投资顾问(北京)有限公司	
注册地址: 北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 层 1809	
办公地址: 北京市朝阳区建国路 88 号 SOHO 现代城 C 座 1809	
法定代表人: 沈伟桦	联系人: 程刚
电话: 010-52855713	传真: 010-85894285
客户服务电话: 4006099400	网址: www.yixinfund.com
(66) 浙江同花顺基金销售有限公司	
注册地址: 杭州市文二西路 1 号 903 室	
办公地址: 浙江省杭州市西湖区翠柏路 7 号电子商务产业园 2 号楼 2 楼	
法定代表人: 凌顺平	联系人: 吴强
电话: 0571-88911818	传真: 0571-86800423



客户服务电话：4008-773-772	公司网站：www.5ifund.com
(67) 上海汇付金融服务有限公司	
注册地址：上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼	
办公地址：上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼	
法定代表人：冯修敏	联系人： 陈云卉
电话：021-33323999-5611	传真：021-33323830
客户服务电话：4008202819	网址：www.chinapnr.com
3、场内销售机构	
场内代销机构是指有基金代销资格的上海证券交易所会员，名单详见上海证券交易所网站： http://www.sse.com.cn	

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售基金，并及时公告。

(二) 与本基金有关的注册登记机构、律师事务所、会计师事务所信息：

信息类型	注册登记机构	律师事务所	会计师事务所
名称	中国证券登记结算有限责任公司	上海源泰律师事务所	毕马威华振会计师事务所
注册地址	北京市西城区太平桥大街 17 号	上海市浦东南路 256 号华夏银行大厦 1405 室	北京东长安街 1 号东方广场东 2 座 8 层
办公地址	北京市西城区太平桥大街 17 号	上海市浦东南路 256 号华夏银行大厦 1405 室	上海南京西路 1266 号恒隆广场 50 楼
法定代表人	金颖	廖海（负责人）	姚建华
联系电话	010-59378856	021-51150298	021-22122888
传真	010-59378907	021-51150398	021-62881889
联系人	崔巍	廖海、刘佳	王国蓓（石海云、陈启明为经办注册会计师）

四、基金的名称

长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金

五、基金的类型

契约型开放式

六、基金投资目标

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。

七、基金的投资范围

本基金主要投资于标普 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。

本基金为股票指数增强型基金, 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。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种, 本基金管理人在履行适当程序后, 可以将其纳入投资范围。

八、基金的投资策略

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, 并辅之以金融衍生品投资管理等, 力争使跟踪误差控制在限

定的范围之内。

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。

（一）资产配置策略

本基金的资产配置体现了股票指数增强型基金的基本投资策略：在最小化跟踪误差的前提下力争获得超出标的指数回报。基金资产净值 80%-95%的部分将投资于标普 100 等权重指数成份股；基金资产净值 0%-15%的增强型部分将主要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；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等货币市场工具占基金资产净值的 5%-20%。资产配置比例主要取决于基金管理人对于宏观经济、估值水平、技术因素等的分析和判断以及对本基金现金流的预计和管理，主要考虑因素包括但不限于以下几点：

- 1、经济的增长率；
- 2、利率政策和通胀水平；
- 3、各种资产的收益和风险比较；
- 4、各种资产的估值水平比较；
- 5、市场流动性；
- 6、本基金现金流。

（二）股票投资策略

本基金的股票投资将遵循被动投资和主动投资的双重策略。被动投资将通过完全复制的指数化策略来实施，主要目标为控制和最小化跟踪误差；主动投资将以基本面研究为基础，力争取得优于标的指数的收益率。

1、指数化投资

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，并辅之以金融衍生品投资管理等，使跟踪误差控制在限定的范围之内。

（1）对标的指数的跟踪调整

标准普尔公司会定期和不定期根据成员变化、股价变化、并购、特殊分红等进行成份股及权重调整，本基金将根据标准普尔公司的公告并在规定时间内进行相应调整。

（2）跟踪误差的控制和再平衡调整

本基金追求基金净值增长率与标普 100 等权重指数收益率之间的跟踪误差最小化，力争将日平均跟踪误差控制在 0.50% 以内（相应的年化跟踪误差控制在 7.94% 以内），以实现对标的指数的有效跟踪。

本基金采取跟踪误差和跟踪偏离度这两个指标对投资组合进行监控与评估。其中，跟踪误差为核心监控指标，跟踪偏离度为辅助监控指标，以求控制投资组合相对于目标指数的偏离风险。

本基金每周计算上述跟踪误差。如果该指标接近或者超过 0.5%，并且跟踪偏离度小于 0，则本基金管理人将通过数量分析找出跟踪误差的来源，即考察某一阶段的跟踪误差指标分别来源于交易费用、投资组合与指数成份股所含股票的差别和权重的偏离的比例，并在适当的时机进行再平衡调整操作，使得跟踪误差回复到最大容忍值以下。

2、主动型投资

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。

证券选择的起点是通过定量和定性方式初步筛选投资领域，以便发现值得深入研究的公司。在初步筛选阶段将以数量化模式为主要手段，具体筛选因素包括

市值、流动性、现金流、负债率、估值水平、销售收入和净收入的增长等。

经过筛选的公司将以行业分类, 结合对宏观经济和行业周期的研究和判断以及标普 100 等权重指数的行业配置比例, 基金管理人将对主动投资基金净值作合理的行业配置。各个行业内的公司将以各种基本面指标进行综合评级, 进一步筛选投资的目标公司, 本基金管理人认为这样的公司往往据有以下特征:

- (1) 在市场及行业内拥有主导地位, 并能获取超额利润;
- (2) 所处行业据有较高的成长潜力;
- (3) 公司的主导地位和竞争优势据有可延续性, 市场进入壁垒较高;
- (4) 公司内在价值 (intrinsic value) 高于当前市场价值, 并且下降空间有限, 使得股票据有较强的风险和回报的特质。

当选择出具有上述特征的企业后, 本基金将基于动态静态指标相结合的原则, 采用内在价值、相对价值、收购价值相结合的评估方法, 如自由现金流贴现法 (DCF)、红利贴现法 (DDM)、各部分累加法 (Sum-of-the-Part)、市盈增长比率 (PEG)、市盈率 (P/E)、市净率 (P/B)、企业价值/息税前利润 (EV/EBIT)、企业价值/息税、折旧、摊销前利润 (EV/EBITDA) 等, 对入选股票进行价值评估, 在此基础上选择股价没有充分反映价值的投资目标。

以基本面为基础的主动投资是本基金争取超值回报的主要手段, 在适当的时机下基金管理人也将采取以下策略力争获取超越标的指数的收益率:

1) 适当调整成分股权重的主动性投资

本基金将依据宏观经济形势和经济周期各个阶段不同行业表现以及当前各个行业估值水平, 并采用数量化分析与基本面研究相结合的方法对目标指数的成份股进行综合评分, 在综合考虑交易成本、交易冲击、流动性、投资比例限制等因素后, 本基金将适度增加排名靠前成份股的权重以及适度减少排名靠后成份股的权重。成分股权重的适当调整将在确保本基金的跟踪误差和跟踪偏离度在规定范围之内的前提下进行。

2) 前瞻性纳入部分备选成份股

如果预期目标指数的成份股将会发生调整, 本基金管理人将视当时具体情况, 在综合考虑跟踪误差和投资者利益的基础上, 决定是否提前纳入部分备选成份股。

（三）固定收益证券投资策略

本基金固定收益证券的投资以流动性管理需要和低风险为主要投资依据，收益率水平为辅助投资依据，由此给现金流管理提供良好的基础。本基金将根据国内外宏观经济形势、债券市场资金供求情况以及市场利率走势来预测债券市场利率变化趋势，并对各债券品种收益率、流动性、信用风险和久期进行综合分析，评定各品种的投资价值，同时着重考虑基金的流动性管理需要，主要选取到期日在一年以内的美国或中国短期政府债券和银行存款等货币市场证券将作为主要的投资工具。

（四）其他金融衍生品投资策略

在法律法规许可时，本基金可基于谨慎原则运用权证、股票指数期货等相关金融衍生品对基金投资组合进行管理，以提高投资效率，管理基金投资组合风险水平，以更好地实现本基金的投资目标。本基金管理人运用上述金融衍生品必须是出于追求基金充分投资、减少交易成本、降低跟踪误差的目的，不得应用于投机交易目的，或用作杠杆工具放大基金的投资。

1、金融衍生品主要投资策略包括：

（1）规避风险：本基金可利用货币远期和货币互换来对冲人民币和美元之间的汇率风险，避免汇率的波动性对基金的回报率和回报率的波动率产生负面影响；本基金也可利用相关的指数期货和指数期权及个股期权对市场的系统性风险和个股风险进行对冲。

（2）有效管理：本基金在建仓期及发生大规模申购或赎回时，大量买入或卖出会造成股价的短期波动而抬高交易成本，可以利用金融衍生品的流动性和杠杆作用进行短期的替代，以降低交易成本。本基金也可将待投资的现金暂时投资于相关的指数期货，以此降低和标的指数的跟踪误差。

2、主要金融衍生品及简介

金融衍生品通常是指从基础资产 (Underlying Assets) 派生出来的金融工具，这种金融工具的回报率是根据基础资产和一些其它金融要素的表现情况衍生出来的，比如利率，汇率，波动性、各种指数（股票指数，消费者物价指数，以及天气指数）等。这些要素的表现将会决定一个衍生品的回报率和回报时间。金融衍生品的共同特征是保证金交易，即只要支付一定比例的保证金就可进行全额

交易,不需实际上的本金转移,合约的了结一般也采用现金差价结算的方式进行,只有在满期日以实物交割方式履约的合约才需要买方交足贷款。所以金融衍生品具有杠杆性和高风险性。金融衍生品的主要类型有互换(Swap),权证(Warrant),期权(Options),期货(Futures)、远期(Forward)等。

(1) 互换是指当事双方同意在预先约定的时间内,通过一个中间机构来交换一连串付款义务的金融交易,或者说是当事双方同意在预先约定的时间内用一种现金流交换另一种现金流。互换协议规定了现金流交换的时间和计算的方式。一般来说,互换协议中至少有一种现金流是由利率,汇率,股权价格,或商品价格来决定的。互换中的现金流通常是依照一个本金单位来计算的。本金单位一般不在当事双方之间交换。比较常见的互换交易包含货币互换(Currency Swap)和利率互换(Interest Rate Swap)两种。现在互换是世界上交易量最大的金融产品之一。

(2) 权证是基础证券发行人或其以外的第三人发行的,约定持有人在规定期间内或特定到期日,有权按约定价格向发行人购买或出售标的证券,或以现金结算方式收取结算差价的有价证券。投资者付出权利金购买后,有权利(而非义务)在某一特定期间(或特定时点)按约定价格向发行人购买或者出售标的证券。很多时候权证被当作一种附于债券或者优先股的优惠券,使得债券或者优先股的发行者能够付更低的利息或者股息。权证也可以提高债券的收益,从而使得债券对投资者来说更具有吸引力。一般来说权证可以被拆分,独立于依附的债券或者股票进行买卖。

(3) 期权合约是一种赋予权利而不是义务的标准化契约,即在某一段特定时间内,以期权合约成交时双方同意的期权费,买卖特定价格,特定数量与质量的相关产品。买入期权是指它给予期权的持有者在给定时间或在此时间以前的任一时刻按规定的价格买入一定数量某种资产或期货合约的权利的一种法律合同。卖出期权给予其持有者在给定时间或在此时间以前的任一时刻,按规定的价格卖出一定数量某种资产或期货合约的权利的一种法律合同。期权的持有者拥有该项期权规定的权利,持有者可以行使该权利,也可以放弃该权利,期权的出卖者则只有期权合约规定的义务。

(4) 期货一般指由期货交易所统一制定的、规定在将来某一特定的时间和

地点交割一定数量标的物的标准化合约。这个标的物，又叫基础资产，是期货合约所对应的现货，可以是某种商品，如铜或原油，也可以是某个金融工具，如外汇、债券，还可以是某个金融指标，如三个月同业拆借利率或股票指数。期货合约的买方，如果将合约持有到期，就有义务买入期货合约对应的标的物；而期货合约的卖方，如果将合约持有到期，就有义务卖出期货合约对应的标的物。期货合约的交易者还可以选择在合约到期前进行反向买卖来冲销这种义务。

(5) 远期又称远期合同，是指当事双方现在同意在将来的特定时间以特定价格买卖某种资产。远期合同是和现货合同相对应的，而现货合同是指同意当前以特定价格买卖某种资产。远期合同中当事双方同意的价格被称为交割价格。同意将来买入资产的一方被称为多方，同意将来卖出资产的一方被称为少方。在远期合同中，资产价格的交换发生在资产控制权的交换之前，因此远期是一种买卖交易发生在资产交换之前的合同。远期价格一般和现场价格相对应，现场价格是指当前资产交换的价格。远期价格和现场价格的差别一般叫做远期溢价或远期折价，通常是远期合同购买者的利润或损失。

3、金融衍生品风险管理机制

本基金根据金融衍生产品的高风险、高杠杆特性，制定了金融衍生品投资风险控制策略和严格的投资风险控制流程。金融衍生品投资风险控制策略分为事前风险识别、事中风险跟踪及控制和事后风险评估总结三个方面：

(1) 事前风险识别主要包括宏观环境分析、市场分析、衍生品合约细则的认识和分析、衍生品流动性分析、衍生品波动率分析等。

(2) 事中风险跟踪及控制主要包括金融衍生品投资仓位的监控和预警、衍生品在值风险 (VaR) 估算和预测、情景分析、压力测试以及金融衍生品投资合规性的日常检查和警示等。

(3) 事后风险评估总结主要包括对金融衍生品投资盈利或损失的归因分析和总结。

4、金融衍生品的投资方式及频率

本基金主要投资与在美国市场上市交易的金融衍生品，当交易所没有本基金需要的金融衍生品时，可采用场外交易市场 (OTC) 进行买卖。

本基金采用金融衍生品的时间和频率将根据投资策略、市场环境、申购赎回

等因素决定。

随着美国证券市场投资工具的发展和丰富，基金可相应调整和更新相关投资策略，并在基金更新的招募说明书中披露。

在符合有关法律法规以及本基金基金合同规定的投资限制前提下，本基金还可进行证券借贷交易、回购交易等投资，以提高收益。

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：标准普尔 100 等权重指数总收益率

本基金为增强型股票指数基金，不低于基金资产净值 80% 的部分将投资于标准普尔 100 等权重指数成份股，不高于基金资产净值 15% 的增强型部分将主要投资于在美国公开上市的权益类证券。因此，本基金设置标准普尔 100 等权重指数总收益率作为本基金的业绩比较基准。

如果今后法律法规发生变化，或者指数编制单位停止计算编制该指数或更改指数名称、或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金业绩基准的指数时，经与基金托管人协商一致，本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

十、基金的风险收益特征

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。

十一、基金的投资组合报告

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 2015 年 10 月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。

本投资组合报告所载数据截至 2015 年 6 月 30 日（摘自本基金 2015 年半年报）。

一、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	16,347,377.06	80.87
	其中：普通股	16,347,377.06	80.87
	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	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
	其中：远期	—	—
	期货	—	—
	期权	—	—
	权证	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
7	货币市场工具	—	—
8	银行存款和结算备付金合计	3,836,150.21	18.98
9	其他各项资产	31,123.36	0.15
10	合计	20,214,650.63	100.00

二、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	16,347,377.06	83.29
合计	16,347,377.06	83.29

三、期末按行业分类的权益投资组合

1、期末指数投资按行业分类的权益投资组合

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 (%)
信息技术	2,610,677.10	13.30%

保健	2,533,077.31	12.91%
金融	2,516,459.68	12.82%
工业	2,189,033.22	11.15%
非必需消费品	2,150,265.26	10.96%
必需消费品	1,764,404.59	8.99%
能源	1,484,740.03	7.56%
材料	454,344.85	2.31%
电信服务	331,128.22	1.69%
公共事业	312,233.78	1.59%
合计	16,346,364.04	83.29%

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

2、期末积极投资按行业分类的权益投资组合

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（%）
必需消费品	520.51	0.00
能源	492.51	0.00
合计	1,013.02	0.01

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

四、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

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	占基 金资 产净 值比 例(%)
1	ELI LILLY & CO	礼来	LLY US	纽交所	美国	380	193,961.30	0.99
2	MONDELEZ INTERNATIONAL INC	Mondelez 国际公司	MDLZ US	纳斯达克	美国	770	193,665.40	0.99
3	GILEAD	Gilead科	GILD US	纳斯达克	美国	267	191,113.34	0.97



	SCIENCES INC	学						
4	AMAZON.COM INC	亚马逊公司	AMZN US	纳斯达克	美国	72	191,077.39	0.97
5	ABBVIE INC	AbbVie Inc	ABBV US	纽交所	美国	458	188,133.94	0.96
6	STARBUCKS CORP	星巴克	SBUX US	纳斯达克	美国	569	186,507.23	0.95
7	NIKE INC -CL B	耐克公司	NKE US	纽交所	美国	278	183,588.72	0.94
8	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	美国国际 集团	AIG US	纽交所	美国	480	181,412.52	0.92
9	JPMORGAN CHASE & CO	摩根大通	JPM US	纽交所	美国	436	180,616.29	0.92
10	GOLDMAN SACHS GROUP INC	高盛	GS US	纽交所	美国	141	179,980.65	0.92
11	ACCENTURE PLC-CL A	Accentur e PLC	ACN US	纽交所	美国	303	179,277.29	0.91
12	FACEBOOK INC-A	脸书	FB US	纳斯达克	美国	341	178,797.55	0.91
13	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	第一资本 金融	COF US	纽交所	美国	332	178,554.05	0.91
14	METLIFE INC	大都会集 团	MET US	纽交所	美国	517	176,969.34	0.9
15	DOW CHEMICAL CO	陶氏化学	DOW US	纽交所	美国	565	176,750.60	0.9
16	AT&T INC	美国电话 电报集团	T US	纽交所	美国	811	176,112.76	0.9
17	WALT DISNEY CO	沃尔特迪 斯尼	DIS US	纽交所	美国	250	174,451.58	0.89
18	SCHLUMBERGER LTD	斯伦贝谢	SLB US	纽交所	美国	331	174,414.22	0.89
19	GENERAL DYNAMICS CORP	通用动力	GD US	纽交所	美国	201	174,113.43	0.89
20	HALLIBURTON CO	哈利伯顿	HAL US	纽交所	美国	661	174,049.73	0.89



21	CATERPILLAR INC	卡特彼勒	CAT US	纽交所	美国	335	173,716.11	0.89
22	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	西方石油	OXY US	纽交所	美国	365	173,540.96	0.88
23	MORGAN STANLEY	摩根士丹利	MS US	纽交所	美国	731	173,354.12	0.88
24	MICROSOFT CORP	微软	MSFT US	纳斯达克	美国	642	173,285.71	0.88
25	MASTERCARD INC-CLASS A	万事达公司	MA US	纽交所	美国	303	173,164.30	0.88
26	UNITEDHEALTH GROUP INC	联合健康	UNH US	纽交所	美国	231	172,293.48	0.88
27	GENERAL ELECTRIC CO	通用电气	GE US	纽交所	美国	1,060.00	172,184.65	0.88
28	INTL BUSINESS MACHINES CORP	国际商业 机器	IBM US	纽交所	美国	173	172,037.80	0.88
29	BANK OF AMERICA CORP	美国银行	BAC US	纽交所	美国	1,650.00	171,688.23	0.87
30	ABBOTT LABORATORIES	雅培制药	ABT US	纽交所	美国	567	170,131.46	0.87
31	TIME WARNER INC	时代华纳	TWX US	纽交所	美国	316	168,867.17	0.86
32	BAXTER INTERNATIONAL INC	百特	BAX US	纽交所	美国	394	168,444.47	0.86
33	TARGET CORP	Target 百 货	TGT US	纽交所	美国	336	167,681.86	0.85
34	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	菲利普莫 里斯国际 集团	PM US	纽交所	美国	342	167,623.54	0.85
35	CITIGROUP INC	花旗集团	C US	纽交所	美国	496	167,506.77	0.85
36	DEVON ENERGY CORPORATION	戴文能源	DVN US	纽交所	美国	460	167,301.11	0.85
37	BANK OF NEW YORK MELLON	纽约银行	BK US	纽交所	美国	649	166,525.48	0.85



	CORP							
38	EBAY INC	电子湾	EBAY US	纳斯达克	美国	450	165,727.47	0.84
39	COMCAST CORP-CLASS A	康卡斯特	CMCSA US	纳斯达克	美国	450	165,452.36	0.84
40	CVS HEALTH CORP	CVS公司	CVS US	纽交所	美国	258	165,428.15	0.84
41	ALLERGAN PLC	艾尔建制 药公司	AGN US	纳斯达克	美国	89	165,115.74	0.84
42	WELLS FARGO & CO	富国银行	WFC US	纽交所	美国	480	165,037.85	0.84
43	APPLE INC	苹果电脑	AAPL US	纳斯达克	美国	215	164,861.66	0.84
44	EMC CORP	EMC公司	EMC US	纽交所	美国	1,021.00	164,726.00	0.84
45	MERCK & CO. INC.	默克	MRK US	纽交所	美国	473	164,626.35	0.84
46	VISA INC-CLASS A SHARES	维萨公司	V US	纽交所	美国	401	164,621.82	0.84
47	WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	沃尔格林 联合博姿 集团	WBA US	纳斯达克	美国	318.00	164,161.90	0.84
48	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	霍尼韦尔	HON US	纽交所	美国	263	163,955.20	0.84
49	EMERSON ELECTRIC CO	艾默生电 气	EMR US	纽交所	美国	481	162,999.76	0.83
50	AMGEN INC	安进	AMGN US	纳斯达克	美国	173	162,370.86	0.83
51	CONOCOPHILLIP S	康菲石油	COP US	纽交所	美国	431	161,812.99	0.82
52	ANADARKO PETROLEUM CORP	阿纳达科 石油	APC US	纽交所	美国	339	161,780.16	0.82
53	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	百时美施 贵宝	BMJ US	纽交所	美国	397	161,499.18	0.82
54	EXXON MOBIL CORP	艾克森美 孚石油	XOM US	纽交所	美国	317	161,242.53	0.82
55	PEPSICO INC	百事可乐	PEP US	纽交所	美国	282	160,921.45	0.82



56	FEDEX CORP	联邦快递	FDX US	纽交所	美国	154	160,430.65	0.82
57	MCDONALD'S CORP	麦当劳	MCD US	纽交所	美国	276	160,416.71	0.82
58	PFIZER INC	辉瑞制药	PFE US	纽交所	美国	781	160,096.42	0.82
59	UNITED PARCEL SERVICE-CL B	ups 公司	UPS US	纽交所	美国	270	159,966.62	0.82
60	CELGENE CORP	新基医药	CELG US	纳斯达克	美国	226	159,907.99	0.81
61	INTEL CORP	英特尔	INTC US	纳斯达克	美国	859	159,726.91	0.81
62	JOHNSON & JOHNSON	强生	JNJ US	纽交所	美国	268	159,682.83	0.81
63	COCA-COLA CO	可口可乐	KO US	纽交所	美国	665	159,491.29	0.81
64	CISCO SYSTEMS INC	思科	CSCO US	纳斯达克	美国	950	159,485.48	0.81
65	US BANCORP	US Bancorp 公司	USB US	纽交所	美国	600	159,198.14	0.81
66	BIOGEN INC	百健艾迪	BIIB US	纳斯达克	美国	64	158,049.77	0.81
67	MEDTRONIC PLC	美敦力	MDT US	纽交所	美国	348	157,650.18	0.8
68	HOME DEPOT INC	家得宝	HD US	纽交所	美国	232	157,621.81	0.8
69	EXELON CORP	Exelon 公司	EXC US	纽交所	美国	820	157,513.24	0.8
70	AMERICAN EXPRESS CO	美国运通	AXP US	纽交所	美国	330	156,799.17	0.8
71	KINDER MORGAN INC	特拉华州金德摩根公司	KMI US	纽交所	美国	665	156,076.23	0.8
72	PROCTER & GAMBLE CO	宝洁	PG US	纽交所	美国	325	155,456.62	0.79
73	Twenty-First Century Fox	21世纪福克斯公司	FOXA US	纳斯达克	美国	781	155,393.35	0.79
74	COLGATE-PALMOLIVE CO	高露洁棕榄	CL US	纽交所	美国	388	155,157.54	0.79
75	VERIZON COMMUNICATIONS INC	Verizon 通信	VZ US	纽交所	美国	544	155,015.46	0.79
76	SOUTHERN CO	南方	SO US	纽交所	美国	604	154,720.54	0.79



77	3M CO	3M CO	MMM US	纽交所	美国	164	154,705.87	0.79
78	ALTRIA GROUP INC	高利特	MO US	纽交所	美国	517	154,591.36	0.79
79	CHEVRON CORP	雪佛龙德 士古	CVX US	纽交所	美国	262	154,522.10	0.79
80	ORACLE CORP	甲骨文	ORCL US	纳斯达克	美国	627	154,479.06	0.79
81	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	BERKSHIR E HATH-B	BRK/B US	纽交所	美国	185	153,942.59	0.78
82	LOCKHEED MARTIN CORP	洛克希德 马丁	LMT US	纽交所	美国	135	153,429.96	0.78
83	SIMON PROPERTY GROUP INC	Simon Property	SPG US	纽交所	美国	145	153,377.39	0.78
84	UNITED TECHNOLOGIES CORP	联合技术	UTX US	纽交所	美国	224	151,912.69	0.77
85	ALLSTATE CORP	全州保险	ALL US	纽交所	美国	382	151,497.09	0.77
86	FORD MOTOR CO	福特汽车	F US	纽交所	美国	1,639.00	150,403.06	0.77
87	HEWLETT-PACKA RD CO	惠普	HPQ US	纽交所	美国	891	150,261.22	0.77
88	BOEING CO	波音	BA US	纽交所	美国	176	149,261.83	0.76
89	MONSANTO CO	孟山都	MON US	纽交所	美国	228	148,575.89	0.76
90	QUALCOMM INC	高通公司	QCOM US	纳斯达克	美国	387	148,180.28	0.76
91	COSTCO WHOLESALE CORP	好市多批 发	COST US	纳斯达克	美国	178	146,975.10	0.75
92	LOWE'S COS INC	劳氏	LOW US	纽交所	美国	358	146,575.15	0.75
93	TEXAS INSTRUMENTS INC	德州仪器	TXN US	纽交所	美国	465	146,433.86	0.75
94	RAYTHEON COMPANY	雷神公司	RTN US	纽交所	美国	250	146,237.31	0.75
95	GENERAL MOTORS CO	通用汽车	GM US	纽交所	美国	698	142,228.87	0.72
96	WAL-MART	沃尔玛百	WMT US	纽交所	美国	325	140,932.24	0.72



	STORES INC	货						
97	UNION PACIFIC CORP	联合太平洋	UNP US	纽交所	美国	232	135,268.54	0.69
98	NORFOLK SOUTHERN CORP	诺福克南方	NSC US	纽交所	美国	245	130,850.60	0.67
99	DU PONT (E. I.) DE NEMOURS	杜邦	DD US	纽交所	美国	330	129,018.36	0.66
100	GOOGLE INC-CL A	谷歌公司	GOOGL US	纳斯达克	美国	24	79,238.13	0.4
101	GOOGLE INC-CL C	谷歌公司	GOOG US	纳斯达克	美国	24	76,372.56	0.39

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	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	520.51	0.00
2	PHILLIPS 66	Phillips 66 公司	PSX US	纽交所	美国	1	492.51	0.00

五、报告期内权益投资组合的重大变动

1、累计买入金额超出期初基金资产净值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	占期初基金资产净值比例 (%)
1	KINDER MORGAN INC	KMI US	210,896.78	0.85
2	ALLERGAN PLC	AGN US	201,187.25	0.81
3	CELENE CORP	CELG US	197,885.28	0.80
4	HALLIBURTON CO	HAL US	78,884.06	0.32

5	ANADARKO PETROLEUM CORP	APC US	45,610.83	0.18
6	CATERPILLAR INC	CAT US	41,027.47	0.17
7	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	OXY US	35,717.67	0.14
8	SCHLUMBERGER LTD	SLB US	35,061.57	0.14
9	CONOCOPHILLIPS	COP US	34,959.20	0.14
10	INTL BUSINESS MACHINES CORP	IBM US	30,289.79	0.12
11	DEVON ENERGY CORPORATION	DVN US	26,929.39	0.11
12	CHEVRON CORP	CVX US	26,047.55	0.11
13	EMERSON ELECTRIC CO	EMR US	18,967.64	0.08
14	EXXON MOBIL CORP	XOM US	14,633.03	0.06
15	EMC CORP	EMC US	13,885.36	0.06
16	MICROSOFT CORP	MSFT US	12,146.36	0.05
17	HEWLETT-PACKARD CO	HPQ US	11,743.49	0.05
18	DOW CHEMICAL CO	DOW US	10,629.97	0.04
19	INTEL CORP	INTC US	10,142.59	0.04
20	BAXTER INTERNATIONAL INC	BAX US	8,764.35	0.04

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。

2、累计卖出金额超出期初基金资产净值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	占期初基金资产净 值比例（%）
1	APACHE CORP	APA US	136,545.14	0.55
2	LOWE'S COS INC	LOW US	135,132.08	0.55
3	NATIONAL OILWELL VARCO INC	NOV US	132,411.28	0.54
4	UNITEDHEALTH GROUP INC	UNH US	126,970.75	0.51
5	WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	WBA US	125,564.24	0.51
6	FREEPORT-MCMORAN COPPER	FCX US	122,679.30	0.5
7	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	BMJ US	119,338.50	0.48
8	BIOGEN IDEC INC	BIIB US	112,282.09	0.45
9	HOME DEPOT INC	HD US	111,939.54	0.45
10	CVS HEALTH CORP	CVS US	111,491.95	0.45

11	TARGET CORP	TGT US	111,109.07	0.45
12	STARBUCKS CORP	SBUX US	109,025.52	0.44
13	VISA INC-CLASS A SHARES	V US	102,806.01	0.42
14	APPLE INC	AAPL US	100,072.87	0.41
15	WALT DISNEY CO	DIS US	92,791.61	0.38
16	NIKE INC -CL B	NKE US	92,282.33	0.37
17	DU PONT (E. I.) DE NEMOURS	DD US	92,156.03	0.37
18	COSTCO WHOLESALE CORP	COST US	90,321.18	0.37
19	TEXAS INSTRUMENTS INC	TXN US	90,113.17	0.36
20	ALTRIA GROUP INC	MO US	89,959.91	0.36

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。

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	1,089,468.75
卖出收入（成交）总额	6,916,036.07

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。

六、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。

七、期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

八、期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

九、期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

十、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。

十一、投资组合报告附注

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。

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的股票。

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	22,032.19
4	应收利息	150.27
5	应收申购款	8,940.90
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	31,123.36

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。

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。

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。

十二、基金的业绩

本基金在业绩披露中将参照全球投资表现标准（GIPS）

- 一、在业绩表述中采用统一的货币；
- 二、参照GIPS的相关规定和标准进行计算。

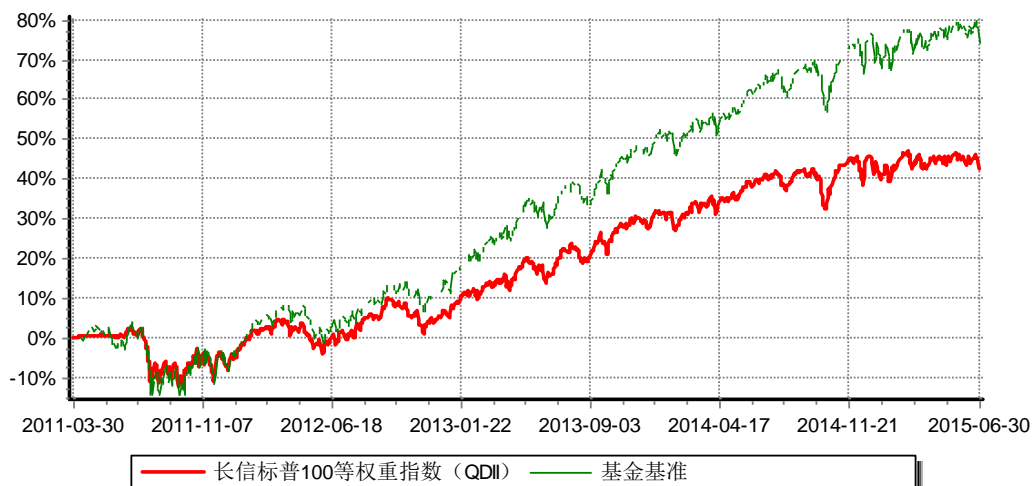
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

（一）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

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	-1.61%	0.64%	-1.77%	0.74%	0.16%	-0.10%
过去三个月	-0.20%	0.59%	0.70%	0.66%	-0.90%	-0.07%
过去六个月	-0.81%	0.74%	0.23%	0.82%	-1.04%	-0.08%
过去一年	2.11%	0.70%	6.55%	0.77%	-4.44%	-0.07%
过去三年	40.67%	0.66%	66.14%	0.74%	-25.47%	-0.08%
自基金合同生效起至今（2011年3月30日至2015年6月30日）	42.50%	0.84%	74.56%	1.00%	-32.06%	-0.16%

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。

（二）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2015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已符合基金合同的约定。

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。

十三、费用概览

（一）与基金运作有关的费用

1、基金费用的种类

- （1）基金管理人的管理费（如基金管理人委托投资顾问，包括投资顾问费）；
- （2）基金托管人的托管费（如基金托管人委托境外托管人，包括向其支付的相应服务费）；
- （3）基金的证券交易费用、在境外市场的开户、交易、清算、登记等各项费用；
- （4）基金合同生效以后的信息披露费用；
- （5）基金份额持有人大会费用；
- （6）基金合同生效以后的会计师费、律师费和其他为基金利益而产生的中介机构费用；
- （7）基金的资金汇划费用；
- （8）代表基金投票的费用；
- （9）外汇兑换交易的相关费用；

(10) 基金依照有关法律法规应当缴纳的, 购买或处置证券有关的任何税收、征费、关税、印花税、交易及其他税收及预扣提税 (以及与前述各项有关的任何利息、罚金及费用);

(11) 更换基金管理人、更换基金托管人及基金资产由原基金托管人转移至新基金托管人所引起的费用;

(12) 经生效的司法文书判决或裁定明确应由基金资产承担的与基金有关的诉讼、追索费用;

(13) 按照国家有关规定可以列入的其他费用。

2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

(1) 基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值 1.10% 的年费率计提。计算方法如下:

$$H = E \times 1.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金的管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金的管理费每日计算, 逐日累计至每月月末, 按月支付, 由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令, 基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

(2) 基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.3% 的年费率计提。托管费的计算方法如下:

$$H = E \times 0.3\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算, 逐日累计至每月月末, 按月支付, 由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令, 基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。

(3) 上述“一、基金费用的种类”中第 3—13 项费用, 根据有关法规及相应协议规定, 按费用实际支出金额列入当期费用, 由基金托管人从基金财产中支

付。

3、不列入基金费用的项目

本章第一款约定以外的其他费用，基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。

（二）与基金销售有关的费用

1、基金认购费用

基金认购费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式参见本招募说明书“九、基金的募集”相应部分。

2、申购费用

基金申购费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式参见本招募说明书“十一、基金份额的申购与赎回”相应部分。

3、赎回费用

基金赎回费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式参见本招募说明书“十一、基金份额的申购与赎回”相应部分。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求，并结合本基金管理人对本基金实施的投资经营活动，对本基金管理人对本基金原招募说明书（《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》）进行了更新，主要更新的内容如下：

1、在“五、基金投资组合报告、六、基金的业绩”部分，更新了投资组合报告的内容和基金的投资业绩；

2、在“七、基金管理人”部分，更新了公司的法定代表人、注册地址、基金管理人主要人员情况、员工情况、公司内部组织结构；

3、在“十九、基金托管人”部分，更新了基金托管人相关业务经营情况的有关资料；

4、在“二十、境外托管人”部分，更新了境外托管人相关业务经营情况的有关资料；



- 5、在“二十一、相关服务机构”部分，更新部分渠道法定代表人、联系人、电话、注册地址、办公地址等信息，更新新增的场外代销机构的信息；
- 6、在“二十四、对基金份额持有人的服务”，更新了对持有人服务的内容；
- 7、在“二十五、其他应披露的事项”部分，更新了本基金的相关公告事项。

长信基金管理有限责任公司

二〇一五年十一月十三日