

长信中证中央企业100指数证券投资基金（LOF）

2012年第3季度报告

2012年09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

报告送出日期：2012年10月25日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2012年10月15日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2012年7月1日起至2012年9月30日止。

## § 2 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	97,519,606.22份
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%，以实现对标的指数的有效跟踪。
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。
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

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2012年07月01日-2012年09月30日）
1. 本期已实现收益	-779, 243. 69
2. 本期利润	-4, 917, 801. 46
3. 加权平均基金份额本期利润	-0. 0499
4. 期末基金资产净值	73, 297, 993. 49
5. 期末基金份额净值	0. 752

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

#### 3.2 基金净值表现

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

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-6.12%	1.00%	-6.47%	1.01%	0.35%	-0.01%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、图示日期为2010年3月26日至2012年9月30日。

2、按基金合同规定，本基金自合同生效日起6个月内为建仓期，建仓期结束时，本基金的各项投资比例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%。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
胡倩	本基金的	2011年09月	—	11年	经济学博士，上海财经大学

	基金经 理、长信 量化先锋 股票型证 券投资基 金的基金 经理、金 融工程部 副总监	21日		世界经济专业博士研究生毕业，具有基金从业资格。曾先后担任海通证券股份有限公司研究所分析师、高级分析师、首席分析师、金融工程部负责人等职务。2010年5月加入长信基金管理有限责任公司，担任金融工程部副总监，负责量化投资研究工作。现任本基金和长信量化先锋股票型证券投资基金的基金经理。
--	--	-----	--	--

注：1、首任基金经理任职日期以本基金成立之日为准；新增或变更以刊登新增/变更基金经理的公告披露日为准；

2、本基金基金经理的证券从业年限以基金经理进入证券业务相关机构的工作经历为时间计算标准。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作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、《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 公平交易专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司已实行公平交易制度，并建立公平交易制度体系，已建立投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，公司已通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现异常交易行为。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内，本基金日均跟踪误差0.072%，年化跟踪误差1.12%，符合基金合同约定。根据基金合同，本基金的投资目标主要为跟踪中证央企100指数。其跟踪误差来源主要在以下几个方面：指数中成份股的调整、申购赎回及由于标的指数成份股中存在法律法规禁止本基金投资的股票而需寻求替代股票所造成的影响。在本报告期内，日常基金申购和赎回的交易成本对本基金的收益产生了一定的负面影响。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2012年9月30日，本基金单位净值为0.752元，本报告期内本基金净值增长率为-6.12%，同期业绩比较基准涨幅为-6.47%，央企指数涨幅为-6.82%。

本报告期内，本基金相对于央企100指数的日均跟踪偏离度为0.0027%，年化跟踪误差为1.12%。

### § 5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	67,504,260.36	91.31
	其中：股票	67,504,260.36	91.31
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	6,132,404.34	8.30

6	其他各项资产	291,320.43	0.39
7	合计	73,927,985.13	100.00

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采掘业	8,891,618.26	12.13
C	制造业	12,322,219.68	16.81
C0	食品、饮料	113,352.72	0.15
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	142,098.32	0.19
C5	电子	713,043.80	0.97
C6	金属、非金属	3,895,403.32	5.31
C7	机械、设备、仪表	5,808,069.48	7.92
C8	医药、生物制品	1,650,252.04	2.25
C99	其他制造业	—	—
D	电力、煤气及水的生产和供应业	3,769,506.00	5.14
E	建筑业	4,608,818.05	6.29
F	交通运输、仓储业	1,770,007.30	2.41
G	信息技术业	2,572,635.19	3.51
H	批发和零售贸易	460,413.54	0.63
I	金融、保险业	25,211,990.18	34.4
J	房地产业	5,840,187.47	7.97
K	社会服务业	1,682,611.45	2.3
L	传播与文化产业	—	—
M	综合类	374,253.24	0.51
	合计	67,504,260.36	92.1

### 5.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

## 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

### 5.3.1 指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600036	招商银行	494,946	5,028,651.36	6.86
2	601328	交通银行	917,569	3,908,843.94	5.33
3	000002	万科A	390,349	3,290,642.07	4.49
4	600030	中信证券	276,842	3,263,967.18	4.45
5	601088	中国神华	132,275	3,043,647.75	4.15
6	601601	中国太保	126,892	2,567,025.16	3.50
7	601398	工商银行	613,288	2,299,830.00	3.14
8	601288	农业银行	827,846	2,036,501.16	2.78
9	601668	中国建筑	605,721	1,859,563.47	2.54
10	600048	保利地产	171,062	1,840,627.12	2.51

### 5.3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

### 5.4 报告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。

### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有权证。

### 5.8 投资组合报告附注



5.8.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未出现被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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

### 5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	250,000.00
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	19,372.29
4	应收利息	1,224.24
5	应收申购款	20,723.90
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	291,320.43

### 5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 5.8.5.1 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。

#### 5.8.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

5.8.6 由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	98,898,933.47
本报告期基金总申购份额	2,687,910.05
减：本报告期基金总赎回份额	4,067,237.30

本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	97,519,606.22

## § 7 备查文件目录

### 7.1 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。

### 7.2 存放地点

基金管理人的住所。

### 7.3 查阅方式

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

长信基金管理有限责任公司

2012年10月25日