

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：2012年8月25日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本基金披露文件不存在虚假记载、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基金合同规定，于2012年8月20日在核对了本报表中的财务数据、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。

本年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告全文。

本报告期自2012年1月1日起至2012年6月30日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称：长信中证中央企业100指数(LOF)

基金代码：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：98,898,933.47份

基金合同存续期：不定期

基金上市的证券交易所：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

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的风险管理手段，追求基金净值增长率与业绩比较基准收益率之间的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1.4%，以实现对标的指数的跟踪误差。

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，并根据标的指数成分股及其权重的变动进行相应的调整。

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基金跟踪标的指数的效果可能产生影响时，或因某些特殊原因导致流动性不足时，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和调整，使跟踪误差控制在限定的范围之内。

中证中央企业100指数收益率*95%+银行同业存款收益率*5%

本基金为股票型基金，属于证券投资基金中较高风险收益水平高于混合型基金、债券基金及货币市场基金。

风险收益特征

本基金为股票型基金，属于证券投资基金中较高风险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

姓名 周刚 岳东

信息披露负责人 021-61009999 010-67595003

联系电话 电子邮箱 zhongy@cfxfund.com.cn yindong.dh@cib.com

客户服务电话 4007055666 010-67595096

传真 021-61009800 010-66275853

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人 www.cfxfund.com.cn

基金半年度报告备置地点 上海商城中路68号时代金融中心9楼、北京西城区闹市口大街1号院1号院

§ 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(2012年1月1日至2012年6月30日)

本期已实现收益 -1,746,178.53

本期利润 2,498,997.77

加权平均基金份额本期利润 0.0249

本期基金份额净值增长率 3.09%

3.1.2 期末数据和指标 报告期末(2012年6月30日)

期末可供分配基金份额利润 -0.1985

期末基金资产净值 79,267,372.78

期末基金份额净值 0.801

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申购基金时所发生的费用(例如：封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购费用、转托管费用、赎回费用、基金转换费等)，计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 分份净增长额 分份净值增长 率比基 准收益 率差额(%) ①②

长单 标准差 ③④

过去一个月 -4.53% 0.96% -5.42% 0.96% 0.89% -

过去三个月 0.88% 0.97% -0.37% 0.96% 1.25% 0.01%

过去六个月 3.09% 1.14% 2.39% 1.13% 0.70% 0.01%

过去一年 -18.18% 1.19% -17.44% 1.18% -0.74% 0.01%

自基金合同生 效日起至 2010年3月26日 -19.90% 1.17% -26.57% 1.28% 6.67% -0.11%

2010年4月6日 -19.90% 1.17% -26.57% 1.28% 6.67% -0.11%

2012年6月30日 -19.90% 1.17% -26.57% 1.28% 6.67% -0.11%

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

见图1。

注：图示日期为2010年3月26日至2012年6月30日。

2.按基金合同规定，本基金自合同生效之日起6个月内为建仓期，建仓期结束时，本基金的各项投资比例已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指数成份股及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内的政府债券的比例不高于基金资产净值的5%。

§ 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

长信基金管理有限公司是经中国证监会证监基金字[2003]163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1亿元人民币。目前股权结构为：长江证券股份有限公司占49.49%，上海海欣集团股份有限公司占34.33%，武汉钢股份有限公司占16.67%。

截至2012年6月30日，基金管理人共管理14只开放式基金，即长信利息收益货币、长信银利精选股

票、长信金利趋势货币、长信利得货币基金、长信利丰债券、长信利恒货币基金、长信利源货币基金、

长信中证中央企业100指数(LOF)、长信中短债货币、长信量化先锋股、长信美国标准普尔100等权重指

数(OD)、长信利盈分级债、长信内需成长股和长信利得转债基金。

4.1.2 基金经理或基金经理小组成员及基金经理助理简介

姓名 职务 任期日期 从事行业年限 说明

蒋学杰 基金经理 2010年9月21日 -

孙红辉 基金经理 2010年9月21日 -

本基金的基金经理，长信量化先锋股型基金经理和基金经理助理，长信内需成长股型基金经理和基金经理助理。

注：1.首次基金经理任职日期以本基金成立之日起为准。新增或变更以刊登新增/变更基金经理的公告披露为准。
2.证券从业年限指以公开募集证券业务机构的工作经历为时间计算标准。

3.基金管理人在报告期内对本基金的操作遵循《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取利益，使基金的经营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取最大利益。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 平等对待所有客户的执行情况

报告期内，公司已实行公平交易制度，并建立投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，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 不涉及关联交易的日常交易

报告期内，除养老金计划外无关联交易进行投资组合的其余部分，其余各投资组合未参与与所交易公司同日反向交易，不涉及成本差异的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情形，未发现异常交易行为。

4.4 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 报告期内本基金的基本情况

报告期内，本基金投资于股票资产的比例已符合基金合同中规定的投资比例，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指数成份股及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内的政府债券的比例不高于基金资产净值的5%。

4.4.2 本报告期内基金的业绩表现

截至2012年6月30日，本基金净值单位为人民币0.801元，本基金报告期净值增长率为3.09%，同期业

绩比较基准收益率为3.09%，年化跟踪误差为0.0070%，年化跟踪误差为0.01%。

4.5 管理人对宏观经济及证券市场的简要展望

2012年一季度在对经济复苏、政策面的预期中，走出了一波反弹行情，但是二季度开始，在对经济复苏预期的不断分歧中，市场显得脆弱，对于流动性指标的敏感性在增强，对于宏观政策的预期，从海外经济萧条走低，传统制造业、财政政策的边际效应递减；从上市公司中期业绩来看，业绩环比有所改善，但是由于基数较低，从而导致业绩同比增幅下降，从而动能不足，下行动能依旧。展望未来，我们认为向好，市场仍然缺乏趋势向上的动力。

作为一只指数基金，我们将按照基金合同的约定，通过严格的资产配置和风险管理手段，力争跟踪误差的小化。

4.6 管理人对报告期基金的经营情况的说明

根据中国证监会证监基金字[2010]12号文发布的《关于规范证券投资基金估值业务的指导意见》(以下简称“指导意见”)，长信基金管理有限公司修订了健全、有效的估值政策和程序，成立了估值委员会，制定了估值政策、估值程序和授权制度，明确了估值对象、方法、程序和时间，并对不同类别资产的估值方法进行了明确的划分，确保基金估值的准确性、合理性和客观性。

根据中国证监会证监基金字[2007]136号文批准，长信基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2003]163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1亿元人民币。目前股权结构为：长江证券股份有限公司占49.49%，上海海欣集团股份有限公司占34.33%，武汉钢股份有限公司占16.67%。

截至2012年6月30日，基金管理人共管理14只开放式基金，即长信利息收益货币、长信银利精选股

票、长信金利趋势货币、长信利得货币基金、长信利丰债券、长信利恒货币基金、长信利源货币基金、

长信中证中央企业100指数(LOF)、长信中短债货币、长信量化先锋股、长信美国标准普尔100等权重指

数(OD)、长信利盈分级债、长信内需成长股和长信利得转债基金。

4.7 管理人对报告期内基金的经营情况的说明

根据中国证监会证监基金字[2010]12号文发布的《关于规范证券投资基金估值业务的指导意见》(以下简称“指导意见”)，长信基金管理有限公司修订了健全、有效的估值政策和程序，成立了估值委员会，制定了估值政策、估值程序和授权制度，明确了估值对象、方法、程序和时间，并对不同类别资产的估值方法进行了明确的划分，确保基金估值的准确性、合理性和客观性。

根据中国证监会证监基金字[2007]136号文批准，长信基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2003]163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1亿元人民币。目前股权结构为：长江证券股份有限公司占49.49%，上海海欣集团股份有限公司占34.33%，武汉钢股份有限公司占16.67%。

截至2012年6月30日，基金管理人共管理14只开放式基金，即长信利息收益货币、长信银利精选股

票、长信金利趋势货币、长信利得货币基金、长信利丰债券、长信利恒货币基金、长信利源货币基金、

长信中证中央企业100指数(LOF)、长信中短债货币、长信量化先锋股、长信美国标准普尔100等权重指

数(OD)、长信利盈分级债、长信内需成长股和长信利得转债基金。

4.8 管理人对报告期内基金的经营情况的说明

根据中国证监会证监基金字[2010]12号文发布的《关于规范证券投资基金估值业务的指导意见》(以下简称“指导意见”)，长信基金管理有限公司修订了健全、有效的估值政策和程序，成立了估值委员会，制定了估值政策、估值程序和授权制度，明确了估值对象、方法、程序和时间，并对不同类别资产的估值方法进行了明确的划分，确保基金估值的准确性、合理性和客观性。

根据中国证监会证监基金字[2007]136号文批准，长信基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2003]163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1亿元人民币。目前股权结构为：长江证券股份有限公司占49.49%，上海海欣集团股份有限公司占34.33%，武汉钢股份有限公司占16.67%。

截至2012年6月30日，基金管理人共管理14只开放式基金，即长信利息收益货币、长信银利精选股

票、长信金利趋势货币、长信利得货币基金、长信利丰债券、长信利恒货币基金、长信利源货币基金、

长信中证中央企业100指数(LOF)、长信中短债货币、长信量化先锋股、长信美国标准普尔100等权重指

数(OD)、长信利盈分级债、长信内需成长股和长信利得转债基金。