

长信中证中央企业100指数证券投资基金 (LOF)

2013 年 度 报 告 摘 要

与通胀并存的时期,市场整体趋势性向上的概率不大,结构性行情仍将成为主导,从上市公司经营层面来看,2013年业绩预告向好公司的比例在增长。表明在目前整体经济环境趋紧的情况下,局部经济仍然出现了较大活力,部分行业部分公司增长可期。从市场层面来看,流动性和投资者情绪有所改善,市场活跃度明显好转。对于后期市场,我们保持谨慎乐观的态度。

作为一只指数基金,我们将按照基金合同的规定,严守指数基金被动化投资的目标,通过严格的投资纪律约束和量化风险管理手段,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。

4.6 管理人对于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,参与人员和具有丰富证券行业工作经验,熟悉相关估值方法和估值程序,估值程序直接参考公允价值,如果基金经认为某证券有更好得证券估值方法,可以申请公司估值工作小组对其证券进行专项评估,相关决策由与估值工作小组成员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 管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
根据相关法律法规和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,基金登记机构可将投资人的现金红利扣除后除权后的余额自动转为基金份额;
3. 在符合有关基金分红条件的情况下,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个月则不进行收益分配;

5. 本基金收益分配方式为两种: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基金份额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,具体收益分配程序等有关事项遵照深交所和中国证券登记结算有限公司的相关规定;

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应分配的现金金额后不得低于面值。

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损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本报告期报告中财务信息等情况的真实、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 审计报告

本报告期本基金2013年度财务报告经毕马威会计师事务所审计,注册会计师出具了无保留意见的审计报告(毕马威报审字第1400182号),投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

7 年度财务报表

7.1 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:2013年12月31日

7.2 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.3 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.4 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.5 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.6 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.7 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.8 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.9 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.10 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.11 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.12 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.13 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.14 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.15 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.16 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.17 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.18 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.19 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.20 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.21 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.22 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.23 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.24 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.25 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.26 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.27 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.28 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.29 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.30 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.31 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.32 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.33 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.34 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.35 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.36 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.37 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.38 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.39 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.40 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.41 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.42 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.43 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.44 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.45 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.46 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.47 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.48 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.49 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.50 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.51 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.52 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.53 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.54 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.55 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.56 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.57 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.58 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.59 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.60 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.61 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.62 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.63 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.64 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.65 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.66 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.67 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.68 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.69 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.70 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.71 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.72 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.73 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.74 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.75 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.76 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.77 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.78 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.79 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.80 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.81 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.82 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.83 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.84 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.85 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.86 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.87 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.88 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.89 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.90 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.91 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.92 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.93 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.94 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.95 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.96 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.97 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.98 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.99 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.100 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.101 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.102 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.103 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.104 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.105 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.106 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.107 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.108 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.109 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.110 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.111 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.112 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.113 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.114 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月31日

7.115 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)
报告截止日:2013年1月1日至2013年12月