

长信利鑫分级债券型证券投资基金

2014 第二季度报告

注:1. 报告日期为2014年6月24日至2014年6月30日。 2. 按基金合同约定,本基金自合同生效之日起每六个月为一个建仓期,建仓期结束时,本基金各投资组合比例符合基金合同的约定。

3.3 其他指标 金额单位:人民币元

Table with columns: 其他指标, 报告期(2014年4月1日-2014年6月30日), 长信利鑫分级A与长信利鑫分级债券基金份额配比, 长信利鑫分级A的参考净值, etc.

注:1. 前任基金经理自任职日期以本基金成立之日为准,新增或变更以可续新增/变更基金经理的公告披露日期为准。 2. 基金经理的任职日期以本基金管理人证券业务相关机构的工作经历为时间计算标准。

持有人谋求大利益。

4.1 报告期内基金的业绩表现 截至2014年6月30日,本基金份额净值为1.1890元,本基金之长信利鑫分级A的参考净值为1.0068元,本基金之长信利鑫分级B的份额净值为1.2727元,本报告期内本基金净值增长率为57%,同期业绩比较基准收益率为3.28%。

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%). Rows include 权益投资, 其中:股票, 固定收益投资, etc.

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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前十名股票投资明细

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

Table with columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 国债, 央行票据, 金融债, etc.

5.6 报告期末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

Table with columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 140201, 140202, etc.

5.7 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11 投资组合报告附注

5.12 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未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。

5.13 其他资产构成

Table with columns: 序号, 名称, 金额(元). Rows include 存出保证金, 应收证券清算款, etc.

5.14 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.15 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 流通受限部分的公允价值(元), 占基金资产净值比例(%), 流通受限情况说明.

5.16 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.17 开放式基金份额变动

Table with columns: 报告期初基金份额总额, 报告期基金总申购份额, 报告期基金总赎回份额, etc.

5.18 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.19 备查文件目录

8.1 备查文件目录 1. 中国证监会核准设立基金的文件;

8.2 存放地点 基金管理人住所。

8.3 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 二〇一四年七月十八日

注:1. 前任基金经理自任职日期以本基金成立之日为准,新增或变更以可续新增/变更基金经理的公告披露日期为准。

2. 基金经理的任职日期以本基金管理人证券业务相关机构的工作经历为时间计算标准。

4.2 基金经理人报告期内,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规,《长信利鑫分级债券型证券投资基金基金合同》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。

4.3 公平交易专项说明 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、分析和评估等措施加强对公平交易过程和结果的监督。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析 2014年二季度,债市行情可谓“冰火两重天”,在基本面和资金面配合下,收益基本呈现趋势性的下行态势。政府决策层对经济稳增长的关注度,从年初至今“始终没有放松过”,利率实际已接近“零利率”,同时,进入二季度,政府稳增长决心更加坚定,市场预期近期降准可能性加大,直接带动了债市在二季度呈现牛市,具体来看,2014年4月5日市场资金面相对宽松,以及宏观层面的加息预期下,国债收益率整体下行,中债-综合债指数整体上行,2014年6月,基本呈现“小”行情,其资金面保持平稳态势。

4.5 报告期内基金的业绩表现 截止2014年6月30日,本基金份额净值为1.094元,份额累计净值为0.94元,本报告期内本基金净值增长率为4.31%,同期业绩比较基准收益率为1.39%。

5. 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%). Rows include 权益投资, 其中:股票, 固定收益投资, etc.

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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前十名股票投资明细

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

Table with columns: 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(%). Rows include 600285, 600898, etc.

5.6 报告期末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

5.7 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11 投资组合报告附注

5.12 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未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。

5.13 其他资产构成

Table with columns: 序号, 名称, 金额(元). Rows include 存出保证金, 应收证券清算款, etc.

5.14 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.15 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 流通受限部分的公允价值(元), 占基金资产净值比例(%), 流通受限情况说明.

5.16 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.17 开放式基金份额变动

Table with columns: 报告期初基金份额总额, 报告期基金总申购份额, 报告期基金总赎回份额, etc.

5.18 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.19 备查文件目录

8.1 备查文件目录 1. 中国证监会核准设立基金的文件;

8.2 存放地点 基金管理人住所。

8.3 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 二〇一四年七月十八日

长信量化先锋股票型证券投资基金

2014 第二季度报告

注:1. 报告日期为2014年6月24日至2014年6月30日。 2. 按基金合同约定,本基金自合同生效之日起每六个月为一个建仓期,建仓期结束时,本基金各投资组合比例符合基金合同的约定。

3.3 其他指标 金额单位:人民币元

Table with columns: 其他指标, 报告期(2014年4月1日-2014年6月30日), 长信量化先锋股票型证券投资基金基金份额配比, 长信量化先锋股票型证券投资基金的参考净值, etc.

注:1. 前任基金经理自任职日期以本基金成立之日为准,新增或变更以可续新增/变更基金经理的公告披露日期为准。 2. 基金经理的任职日期以本基金管理人证券业务相关机构的工作经历为时间计算标准。

4.2 基金经理人报告期内,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规,《长信量化先锋股票型证券投资基金基金合同》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。

4.3 公平交易专项说明 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、分析和评估等措施加强对公平交易过程和结果的监督。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析 2014年二季度,创业板、中小盘再度崛起,在市场整体走势趋弱的情况下,强势回升。期间,上证指数基本收平,季收益率为0.74%,代表创业板板块的创业板综指上升,季收益率为0.80%,中小企业综合指数则上涨了6.71%,创业板综合指数更是上涨了11.27%。从行业板块来看,多数权重,其中国防军工以14.96%的涨幅排在申万28个一级行业之首,而交通運輸行业则以6.0%的跌幅排在28个行业最后一位。2014年二季度,本基金净值上涨了4.31%,受益板块中创业板权重影响较大,二季度本基金表现平平。

4.5 报告期内基金的业绩表现 截止2014年6月30日,本基金份额净值为0.94元,份额累计净值为0.94元,本报告期内本基金净值增长率为4.31%,同期业绩比较基准收益率为1.39%。

5. 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%). Rows include 权益投资, 其中:股票, 固定收益投资, etc.

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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前十名股票投资明细

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

Table with columns: 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(%). Rows include 600285, 600898, etc.

5.6 报告期末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

5.7 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11 投资组合报告附注

5.12 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未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。

5.13 其他资产构成

Table with columns: 序号, 名称, 金额(元). Rows include 存出保证金, 应收证券清算款, etc.

5.14 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.15 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 流通受限部分的公允价值(元), 占基金资产净值比例(%), 流通受限情况说明.

5.16 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.17 开放式基金份额变动

Table with columns: 报告期初基金份额总额, 报告期基金总申购份额, 报告期基金总赎回份额, etc.

5.18 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.19 备查文件目录

8.1 备查文件目录 1. 中国证监会核准设立基金的文件;

8.2 存放地点 基金管理人住所。

8.3 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 二〇一四年七月十八日

长信美国标准普尔100等权重指数增强型证券投资基金

2014 第二季度报告

注:1. 报告日期为2014年6月24日至2014年6月30日。 2. 按基金合同约定,本基金自合同生效之日起每六个月为一个建仓期,建仓期结束时,本基金各投资组合比例符合基金合同的约定。

3.3 其他指标 金额单位:人民币元

Table with columns: 其他指标, 报告期(2014年4月1日-2014年6月30日), 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配比, 长信美国标准普尔100等权重指数增强型证券投资基金的参考净值, etc.

注:1. 前任基金经理自任职日期以本基金成立之日为准,新增或变更以可续新增/变更基金经理的公告披露日期为准。 2. 基金经理的任职日期以本基金管理人证券业务相关机构的工作经历为时间计算标准。

4.2 基金经理人报告期内,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规,《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》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。

4.3 公平交易专项说明 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、分析和评估等措施加强对公平交易过程和结果的监督。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析 2014年二季度,美股市场在美联储加息预期下,整体呈现震荡上行态势。在整体上行态势下,二季度出现的一些下降并非由基本面因素驱动,而是由技术性调整引发的。美股市场在美联储加息预期下,整体呈现震荡上行态势。在整体上行态势下,二季度出现的一些下降并非由基本面因素驱动,而是由技术性调整引发的。

4.5 报告期内基金的业绩表现 截止2014年6月30日,本基金份额净值为1.04元,份额累计净值为1.04元,本报告期内本基金净值增长率为4.1%,同期业绩比较基准收益率为1.8%。

5. 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with columns: 序号, 项目, 金额(人民币元), 占基金总资产的比例(%). Rows include 权益投资, 其中:普通股, 固定收益投资, etc.

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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前十名股票投资明细

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

Table with columns: 序号, 股票名称(英文), 股票名称(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(%). Rows include ANADARKO PETROLEUM CORP, etc.

5.6 报告期末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

5.7 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11 投资组合报告附注

5.12 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未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。

5.13 其他资产构成

Table with columns: 序号, 名称, 金额(人民币元). Rows include 存出保证金, 应收证券清算款, etc.

5.14 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.15 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

Table with columns: 报告期初基金份额总额, 报告期基金总申购份额, 报告期基金总赎回份额, etc.

5.16 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.17 备查文件目录

8.1 备查文件目录 1. 中国证监会核准设立基金的文件;

8.2 存放地点 基金管理人住所。

8.3 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 二〇一四年七月十八日

长信基金资产管理有限责任公司

基金管理人:长信基金资产管理有限责任公司 基金托管人:交通银行股份有限公司 报告送出日期:2014年7月18日

基金管理人及董事、监事和高级管理人员不存在任何虚假记载、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法律责任。

基金管理人及高级管理人员均不存在任何违法违规、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人及高级管理人员均不存在任何违法违规、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人及高级管理人员均不存在任何违法违规、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人及高级管理人员均不存在任何违法违规、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人及高级管理人员均不存在任何违法违规、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人及高级管理人员均不存在任何违法违规、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人及高级管理人员均不存在任何违法违规、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人及高级管理人员均不存在任何违法违规、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人及高级管理人员均不存在任何违法违规、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人及高级管理人员均不存在任何违法违规、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人及高级管理人员均不存在任何违法违规、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人及高级管理人员均不存在任何违法违规、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人及高级管理人员均不存在任何违法违规、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人及高级管理人员均不存在任何违法违规、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人及高级管理人员均不存在任何违法违规、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人及高级管理人员均不存在任何违法违规、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人及高级管理人员均不存在任何违法违规、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人及高级管理人员均不存在任何违法违规、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人及高级管理人员均不存在任何违法违规、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人及高级管理人员均不存在任何违法违规、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人及高级管理人员均不存在任何违法违规、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人及高级管理人员均不存在任何违法违规、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人及高级管理人员均不存在任何违法违规、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人及高级管理人员均不存在任何违法违规、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人及高级管理人员均不存在任何违法违规、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人及高级管理人员均不存在任何违法违规、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人及高级管理人员均不存在任何违法违规、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人及高级管理人员均不存在任何违法违规、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人及高级管理人员均不存在任何违法违规、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人及高级管理人员均不存在任何违法违规、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人及高级管理人员均不存在任何违法违规、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人及高级管理人员均不存在任何违法违规、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人及高级管理人员均不存在任何违法违规、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人及高级管理人员均不存在任何违法违规、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人及高级管理人员均不存在任何违法违规、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人及高级管理人员均不存在任何违法违规、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人及高级管理人员均不存在任何违法违规、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人及高级管理人员均不存在任何违法违规、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人及高级管理人员均不存在任何违法违规、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人及高级管理人员均不存在任何违法违规、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人及高级管理人员均不存在任何违法违规、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人及高级管理人员均不存在任何违法违规、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人及高级管理人员均不存在任何违法违规、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人及高级管理人员均不存在任何违法违规、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人及高级管理人员均不存在任何违法违规、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人及高级管理人员均不存在任何违法违规、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人及高级管理人员均不存在任何违法违规、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人及高级管理人员均不存在任何违法违规、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人及高级管理人员均不存在任何违法违规、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人及高级管理人员均不存在任何违法违规、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人及高级管理人员均不存在任何违法违规、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人及高级管理人员均不存在任何违法违规、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人及高级管理人员均不存在任何违法违规、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人及高级管理人员均不存在任何违法违规、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人及高级管理人员均不存在任何违法违规、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人及高级管理人员均不存在任何违法违规、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人及高级管理人员均不存在任何违法违规、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人及高级管理人员均不存在任何违法违规、误导性陈述或重大遗漏。