

信息披露 Disclosure

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
送出行日期:2011年3月31日

\$ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示
基金管理人、基金托管人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、完整性、及时性等承担责任。本基金报告书经二分之一以上独立董事签字并发表意见后，由基金管理人和基金托管人签署并报中国证监会备案。自2011年3月26日起本报告书的财务数据、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。

基金管理人以诚实信用、勤勉尽责的原则管理本基金资产，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。投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其摘要。

本年度报告摘要简要程度公开，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

\$ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称:长信中证中央企业100指数证券投资基金(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

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:131,261,644.94份

基金合同存续期间:不定期

基金份额上市的证券交易所:深圳证券交易所

基金上市日期:2010年04月16日

2.2 基金产品声明

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，力争每日跟踪误差不超过0.4%，以实现对标的指数的紧密跟踪。

本基金为被动式指数基金，原则上采行完全复制法，按照行业分类在中证中央企业100指数中的权重比例构建股票组合，并根据标的指数成分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、分红等变化时，基金管理人将根据调整方案对投资组合进行适当变动和调整，使跟踪误差控制在限制的范围内。

业绩比较基准:中证中央企业100指数收益率×95%+银行同业存款收益率×5%

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，其预期风险和预期收益水平高于货币型基金、债券型基金及货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

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

信息披露义务人:尹东

电子邮箱:zhongxq@fund.citic.com

客户服务电话:4007005566

传真:021-6109800

2.4 信息披露事项

登载半年度报告正文的管理人互联网网址:www.cxfund.com.cn

基金年度报告备置地点:上海银城中路68号时代金融中心9楼、北京西城区闹市口大街1号院1号楼

2.5 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标

2010年3月26日-2010年12月31日

本期已实现收益:4,985,003.06

本期利润:3,605,203.81

加权平均基金份额本期利润:0.0115

本期基金份额增长率为-10.0%

3.1.2 期末数据和指标

2010年末未

期末可供基金份额利润:-0.0013

本期基金份额净值:131,084,764.45

期末基金份额净值:0.999

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、减去公允价值变动收益、期间相关费用后的余额。本期利润是指本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。如果代销机构对申购、赎回费用实行优惠，则申购、赎回费用将从基金资产中扣除，因此导致的申购、赎回费用将低于零时除外。

2.本基金合同自2010年3月26日起正式生效，报告期未满一个会计年度。

3.本基金合同于2010年3月26日起正式生效，报告期未满一个会计年度。

3.2 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 份额净值增长率 业绩比较基准收益率 ①-③ ②-④

过去一个月 4.06% 1.64% 4.02% 1.64% 0.04% -

过去六个月 10.63% 1.36% 12.66% 1.43% -20%- -0.07%

本基金合同生效日至今日(2010年3月26日-2010年12月31日) -0.09%

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

图例:本基金合同生效日至今日(2010年3月26日-2010年12月31日),本基金合同生效以来基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较

图例:本基金合同生效日至今日(2010年3月26日-