

长信中证中央企业100指数证券投资基金 (LOF)

2014 年度 报告 摘要

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:2015年3月28日

1 重要提示

1.1 重要提示

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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失或保证最低收益。基金管理人不对基金资产的增值或亏损做出任何承诺,也不对基金资产的流动性做出任何承诺。基金管理人不对基金资产的增值或亏损做出任何承诺,也不对基金资产的流动性做出任何承诺。

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2015年3月20日复核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。

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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失或保证最低收益。基金管理人不对基金资产的增值或亏损做出任何承诺,也不对基金资产的流动性做出任何承诺。

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2015年3月20日复核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。

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)
场内简称	长信100
基金代码	160101
交易代码	160101
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2010年3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
期末基金份额总额	136,679,728.69份
基金合同存续期	不定期
上市交易所	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

投资目标:本基金进行被动式指数化投资,通过严格的跟踪偏离度和跟踪误差控制,追求基金净值增长率与业绩比较基准收益之差额长期控制在0.2%以内,力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%,年化跟踪误差不超过0.4%,以求实现对目标指数的有效跟踪。

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,按照成份股在长信中证中央企业100指数中的基准权重构建投资组合,并根据成份股及其权重进行日常管理,力求跟踪偏离度和跟踪误差控制在0.2%以内。

业绩比较基准:中证中央企业100指数收益率*95%+银行同业存款利率*5%

风险收益特征:本基金为股票型基金,其预期收益和风险水平高于混合型基金,债券基金及货币型基金。

2.3 基金管理人及基金托管人

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
负责人	张健	王洪章
地址	北京市朝阳区望京东路2号	北京市西城区金融大街25号
电话	010-69267863	010-69267863

2.4 信息披露安排

基金年度报告官方网站: www.chinaxinxin.com

基金年度报告备置地点: 上海银城中路68号东方财富中心9楼,北京西城区南口大街1号11号楼

3.1 主要会计数据和财务指标

项目	2014年	2013年	2012年
本期3季度末资产总额	42,120,460.00	-8,389,568.68	-3,932,448.04
本期3季度末负债总额	-0.82	-8,706,177.92	6,300,337.67
期末可供分配基金份额利润	0.0577	-0.1503	0.0590
期末可供分配利润	69.62%	-12.72%	8.24%
期末基金份额净值	1.246	0.734	0.841

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

期间	基金份额净值增长率①	业绩比较基准收益率②	①-②	②-④	
过去三个月	53.14%	1.74%	54.81%	1.77%	-0.03%
过去六个月	79.67%	1.38%	77.23%	1.40%	-0.02%
过去一年	69.62%	1.21%	68.02%	1.21%	0.00%
自基金合同生效起至今(2010年3月26日至2014年12月31日)	245.0%	1.19%	11.90%	1.25%	-0.06%

3.2.2 自基金合同生效以来基金业绩跟踪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:本基金合同生效日为2010年3月26日,2010年净值增长率与同期业绩比较基准收益率按当年实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的投资组合情况

3.3.1 基金资产净值及基金份额净值

3.3.2 基金资产净值及基金份额净值

4.1 基金管理人及其基金托管人

4.1.1 基金管理人及其基金托管人的基本情况

4.1.2 基金管理人及其基金托管人的主要人员情况

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金基金经理的日期	证券从业年限	说明
胡娟	基金经理	2011年07月21日	13	经济学博士,上海财经大学世界经济专业硕士研究生,具有基金从业资格,曾先后担任再鼎证券资产管理有限公司研究分析师、高级分析师、首席分析师、金融工程负责人等职务。2010年5月加入长信基金管理有限责任公司,负责量化投资研究工作,现任金融工程管理部副经理、基金管理部副经理、基金部基金经理、基金部基金经理。

4.2 管理人报告期内基金运作的遵信情况的说明

4.3 管理人报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和内部控制

4.3.2 异常交易的专项说明

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

4.4.2 报告期内基金业绩表现

4.5 报告期内基金管理人及其基金托管人

4.5.1 基金管理人及其基金托管人的基本情况

4.5.2 基金管理人及其基金托管人的主要人员情况

4.6 报告期内基金管理人及其基金托管人

4.6.1 基金管理人及其基金托管人的基本情况

4.6.2 基金管理人及其基金托管人的主要人员情况

4.7 报告期内基金管理人及其基金托管人

4.7.1 基金管理人及其基金托管人的基本情况

4.7.2 基金管理人及其基金托管人的主要人员情况

4.8 报告期内基金管理人及其基金托管人

4.8.1 基金管理人及其基金托管人的基本情况

4.8.2 基金管理人及其基金托管人的主要人员情况

4.9 报告期内基金管理人及其基金托管人

4.9.1 基金管理人及其基金托管人的基本情况

4.9.2 基金管理人及其基金托管人的主要人员情况

4.10 报告期内基金管理人及其基金托管人

4.10.1 基金管理人及其基金托管人的基本情况

4.10.2 基金管理人及其基金托管人的主要人员情况

4.11 报告期内基金管理人及其基金托管人

4.11.1 基金管理人及其基金托管人的基本情况

4.11.2 基金管理人及其基金托管人的主要人员情况

4.12 报告期内基金管理人及其基金托管人

4.12.1 基金管理人及其基金托管人的基本情况

4.12.2 基金管理人及其基金托管人的主要人员情况

4.13 报告期内基金管理人及其基金托管人

4.13.1 基金管理人及其基金托管人的基本情况

4.13.2 基金管理人及其基金托管人的主要人员情况

4.14 报告期内基金管理人及其基金托管人

4.14.1 基金管理人及其基金托管人的基本情况

4.14.2 基金管理人及其基金托管人的主要人员情况

4.15 报告期内基金管理人及其基金托管人

4.15.1 基金管理人及其基金托管人的基本情况

4.15.2 基金管理人及其基金托管人的主要人员情况

4.16 报告期内基金管理人及其基金托管人

4.16.1 基金管理人及其基金托管人的基本情况

4.16.2 基金管理人及其基金托管人的主要人员情况

4.17 报告期内基金管理人及其基金托管人

4.17.1 基金管理人及其基金托管人的基本情况

4.17.2 基金管理人及其基金托管人的主要人员情况

4.18 报告期内基金管理人及其基金托管人

4.18.1 基金管理人及其基金托管人的基本情况

4.18.2 基金管理人及其基金托管人的主要人员情况

4.19 报告期内基金管理人及其基金托管人

4.19.1 基金管理人及其基金托管人的基本情况

4.19.2 基金管理人及其基金托管人的主要人员情况

4.20 报告期内基金管理人及其基金托管人

4.20.1 基金管理人及其基金托管人的基本情况

4.20.2 基金管理人及其基金托管人的主要人员情况

4.21 报告期内基金管理人及其基金托管人

4.21.1 基金管理人及其基金托管人的基本情况

4.21.2 基金管理人及其基金托管人的主要人员情况

4.22 报告期内基金管理人及其基金托管人

4.22.1 基金管理人及其基金托管人的基本情况

4.22.2 基金管理人及其基金托管人的主要人员情况

4.23 报告期内基金管理人及其基金托管人

4.23.1 基金管理人及其基金托管人的基本情况

4.23.2 基金管理人及其基金托管人的主要人员情况

4.24 报告期内基金管理人及其基金托管人

4.24.1 基金管理人及其基金托管人的基本情况

4.24.2 基金管理人及其基金托管人的主要人员情况

4.25 报告期内基金管理人及其基金托管人

4.25.1 基金管理人及其基金托管人的基本情况

4.25.2 基金管理人及其基金托管人的主要人员情况

4.26 报告期内基金管理人及其基金托管人

4.26.1 基金管理人及其基金托管人的基本情况

4.26.2 基金管理人及其基金托管人的主要人员情况

4.27 报告期内基金管理人及其基金托管人

4.27.1 基金管理人及其基金托管人的基本情况

4.27.2 基金管理人及其基金托管人的主要人员情况

4.28 报告期内基金管理人及其基金托管人

4.28.1 基金管理人及其基金托管人的基本情况

4.28.2 基金管理人及其基金托管人的主要人员情况

4.29 报告期内基金管理人及其基金托管人

4.29.1 基金管理人及其基金托管人的基本情况

4.29.2 基金管理人及其基金托管人的主要人员情况

4.30 报告期内基金管理人及其基金托管人

4.30.1 基金管理人及其基金托管人的基本情况

4.30.2 基金管理人及其基金托管人的主要人员情况

4.31 报告期内基金管理人及其基金托管人

4.31.1 基金管理人及其基金托管人的基本情况

4.31.2 基金管理人及其基金托管人的主要人员情况

4.32 报告期内基金管理人及其基金托管人

4.32.1 基金管理人及其基金托管人的基本情况

4.32.2 基金管理人及其基金托管人的主要人员情况

4.33 报告期内基金管理人及其基金托管人

4.33.1 基金管理人及其基金托管人的基本情况

4.33.2 基金管理人及其基金托管人的主要人员情况

4.34 报告期内基金管理人及其基金托管人

4.34.1 基金管理人及其基金托管人的基本情况

4.34.2 基金管理人及其基金托管人的主要人员情况

4.35 报告期内基金管理人及其基金托管人

4.35.1 基金管理人及其基金托管人的基本情况

4.35.2 基金管理人及其基金托管人的主要人员情况

4.36 报告期内基金管理人及其基金托管人

4.36.1 基金管理人及其基金托管人的基本情况

4.36.2 基金管理人及其基金托管人的主要人员情况

4.37 报告期内基金管理人及其基金托管人

4.37.1 基金管理人及其基金托管人的基本情况

4.37.2 基金管理人及其基金托管人的主要人员情况

4.38 报告期内基金管理人及其基金托管人

4.38.1 基金管理人及其基金托管人的基本情况

4.38.2 基金管理人及其基金托管人的主要人员情况

4.39 报告期内基金管理人及其基金托管人

4.39.1 基金管理人及其基金托管人的基本情况

4.39.2 基金管理人及其基金托管人的主要人员情况

8.2.2 报告期末(前)报告按行业分类的股票投资组合

8.2.3 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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	000036	招商银行	877,191	14,220,760.69	7.94
2	000030	中信证券	411,543	13,961,307.70	7.68
3	000002	万科A	506,319	7,023,034.00	3.87
4	601668	中国铁建	798,018	6,714,031.04	3.15
5	601328	交通银行	804,839	5,472,006.20	3.02
6	601901	中信银行	164,474	5,312,610.20	2.93
7	601918	光大银行	1,044,227	5,096,827.76	2.81
8	601228	农业银行	1,341,728	4,977,810.08	2.76
9	601388	工商银行	889,888	4,333,716.16	2.29
10	000009	招商证券	229,794	3,488,980.88	2.02

注:投资组合报告期末本基金投资的股票公允价值,应扣除该基金份额在报告期末的公允价值变动损益。

8.3.2 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

8.4 报告期末本基金投资的股指期货投资

8.4.1 买入股指期货投资期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000036	招商银行	6,384,652.26	12.53
2	000030	中信证券	6,712,856.10	12.97
3	000002	万科A	3,246,518.41	6.29
4	601668	中国铁建	2,666,682.00	5.14
5	601918	光大银行	2,528,215.00	4.94
6	601328	交通银行	2,428,525.76	4.70
7	601228	农业银行	2,379,741.00	4.61
8	601888	华泰证券	2,378,907.00	4.61
9	601388	工商银行	2,151,479.00	4.19
10	000099	招商证券	2,060,756.19	3.97
11	601989	中信建投	1,879,786.00	3.59
12	601918	光大银行	1,741,392.27	3.33
13	000048	保利地产	1,616,690.00	3.11
14	601390	中航电子	1,440,676.00	2.80
15	600000	长电科技	1,400,550.00	2.69
16	000026	长安汽车	1,389,268.00	2.61
17	600766	国电电力	1,222,838.00	2.30
18	601198	中国铁建	1,200,290.00	2.19
19	600050	中国联通	1,119,476.32	2.01
20	601987	招商证券	1,098,712.00	1.97

注:本项“买入金额”均按买入成交金额(成交金额以成交数量)填列,不考虑其交易费用。

8.4.2 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

8.4.2 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000036	招商银行	686,964.63	1.09
2	000002	万科A	441,244.81	0.70
3	601401	中信银行	417,716.12	0.65
4	000030	中信证券	334,328.22	0.50
5	601228	农业银行	273,594.24	0.49
6	601299	中国北车	248,853.69	0.44
7	601766	国电电力	245,976.52	0.44
8	601052	中钢国际	233,660.80	0.42
9	601328	交通银行	233,615.53	0.42
10	601668	中国铁建	223,940.46	0.40
11	601398	工商银行	204,542.64	0.37
12	002106	莱茵药业	202,463.40	0.36
13	601089	中国重工	198,340.07	0.34
14	601818	光大银行	186,112.46	0.33
15	601018	中国中免	180,492.68	0.33
16	601919	海螺新材	182,707.11	0.33
17	000008	格力电器	174,841.07	0.32
18	000004	国华地产	175,552.95	0.32
19	000070	中国国贸	170,015.50	0.31
20	000060	安泰科技	133,381.62	0.24

注:本项“卖出金额”均按卖出成交金额(成交金额以成交数量)填列,不考虑其交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

项目	金额
买入股票的成本(成交)总额	86,900,541.95
卖出股票的收入(成交)总额	6,793,036.64

注:本项“买入股票的成本(成交)总额”和“卖出股票的收入(成交)总额”均按买卖成交金额(成交金额以成交数量)填列,不考虑其交易费用。

8.5 期末按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

8.6 期末按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

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

8.8 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贵金属投资明细

8.9 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

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本报告期末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

8.12.2 本基金投资的前十名股票中,不存在投资于超出基金合同规定备选股票库的情形

8.12.3 期末其他各项资产构成

8.12.3 期末其他各项资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,472.20
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收股利	2,871.81
5	应收中融汇	9,141,527.76
6	其他应收款	-
7	待摊费用	46,774.37
8	其他	-
合计	-	9,191,647.14

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

8.13 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

8.14 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

8.15 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

8.16 投资组合报告附注的其他文字描述部分

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	户数	持有基金份额	占总份额比例
机构投资者	140	140,735,264.07	96.60%
个人投资者	1	-	-
合计	141	140,735,264.07	100.00%

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	光大安泰	697,143.00	8.56%
2	冯奕东	291,865.00	3.76%
3	汪明华	218,291.00	2.80%
4	崔立文	200,040.00	2.57%
5	曹彬华	200,040.00	2.57%
6	曹彬华	177,000.00	2.27%
7	曹彬华	173,100.00	2.23%
8	曹彬华	141,100.00	1.81%
9	刘群英	140,120.00	1.80%
10	郑祥华	131,941.00	1.69%

注:持有人为场内持有人。

9.3 期末本基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有基金份额(份)	占基金总份额比例
----	-----------	----------