

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

基金管理人的董事会、董事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、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本基金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。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读基金的招募说明书及其摘要。

本年度报告需要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

本报告期自2014年1月1日起至2014年12月31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)
场内简称	长100
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
报告期末基金资产总额	146,678,72856份
基金合同存续期	不长期
基金上市的证券交易所	深证证券交易所
上市日期	2010年4月16日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金将通过被动式指数化配置，通过严格的投资纪律和量化风险管理，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，从而实现基金净值增长率超越基准的收益。
投资策略	本基金将通过被动式指数化配置，通过严格的投资纪律和量化风险管理，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，从而实现基金净值增长率超越基准的收益。
业绩比较基准	中证中央企业100指数收益率*95%+银行同期存款收益率*5%
风险收益特征	本基金为股票型指数基金，属于证券投资基金中的较高风险品种，其预期风险和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
信息披露义务人	周永刚	田青
联系电话	021-61000099	010-67966006
电子邮箱	zhongxin@zfxfund.com.cn	tianqing@cboc.com
客户服务电话	4007000566	010-67966006
传真	021-61000080	010-66276883

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告的管理人互联网网址	www.czxfund.com.cn
基金年度报告置臵地点	上海银城国际时代金融中心9楼、北京西城区闹市口大街1号院9号楼

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2014年 2013年 2012年
本期实现收益	-2,120,650.00 -5,890,650.00 -3,932,448.04
本期利润	40,824,022.67 -8,706,177.02 5,026,337.00
加权平均基金份额本期利润	0.05677 -0.01633 0.0599
本期基金份额净值	69.62% -12.72% 82.4%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末 2013年末
可供分配基金份额利润	-0.0883 -0.2663 -0.1688
期末基金资产净值	181,324,817.61 56,637,721.41 75,826,066.00
期末基金资产净值	1.24% 0.73% 0.94%

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,本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。

2. 所述基金绩效指标不包括个人认购或交易基金的费用(例如,封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、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为与其同期业绩比较基准收益率的比较

3.1.1 期间数据和指标	份额净值增长率为	业绩比较基准收益率	差额百分比	(①-③)/③	(②-④)/④
过去三个月	63.14%	1.7%	64.81%	1.7%	-1.67%
过去六个月	78.02%	1.3%	77.22%	1.4%	-1.02%
过去一年	69.62%	1.21%	68.02%	1.21%	1.60%
过去三年	60.23%	1.20%	56.15%	1.19%	4.08%
自基金合同生效日起至今(2010年3月26日至2014年12月31日)	24.00%	1.10%	11.99%	1.25%	12.51%
2010年3月26日至2014年12月31日	-	-	-	-0.08%	-

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定期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

过去三年本基金未进行利润分配。

3.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

3.4.1 公平交易制度和控制方法

所有投资对象的投票权指派必须经由交易部门总监或其授权人审核分配至交易人员执行。进行投资指令分配的人员必须保证投票指派令公平对待。

(1)严格按照时间顺序发送委托指令。

(2)对于多只投资组合同一时点就同一证券下达的相同方向的投资指令，并且市价在限价范围内，系统能够将交易员针对该证券下达的每笔委托自动按照指数量比例拆分给各投资组合的委托指令。

(3)交易人员在接到收到的交易指令后，依照价格优先、时间优先的原则执行。在执行多个投资组合在同一时点下达的相同的交易的证券投资指令时，除制度规定的例外指令外，必须开启系统的公平交易开关。

(4)对于不同投资组合均进行竞价一級市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易的投资对象，交易人员必须严格执行接收入股投资组合指令，在申购结果产生前，不得以任何向形式向任一人泄露各投资指令的内容，包括指数量及价格等要素。

5. 对于各投资组合以账户名义进行申购的投资对象，除需通过公平性审核的例外指令外，申购获配的证券投资基金将直接接受类账户登记机构的清算分配。交易部根据所涉账户的指定交易人对公开募集基金账户上披露的申购结果对系统分配数进行核准，数量不符的，应当第一时间告知各投资管理部的总监或基金经理，督促任本基金的基金经理对获配数进行确认，从而确保获配数准确无误。

6. 对于各投资组合以账户名义进行申购的投资对象，除需通过公平性审核的例外指令外，申购获配的证券投资基金将直接接受类账户登记机构的清算分配。交易部根据所涉账户的指定交易人对公开募集基金账户上披露的申购结果对系统分配数进行核准，数量不符的，应当第一时间告知各投资管理部的总监或基金经理，督促任本基金的基金经理对获配数进行确认，从而确保获配数准确无误。

7. 对于各投资组合以账户名义进行申购的投资对象，除需通过公平性审核的例外指令外，申购获配的证券投资基金将直接接受类账户登记机构的清算分配。交易部根据所涉账户的指定交易人对公开募集基金账户上披露的申购结果对系统分配数进行核准，数量不符的，应当第一时间告知各投资管理部的总监或基金经理，督促任本基金的基金经理对获配数进行确认，从而确保获配数准确无误。

8. 对于各投资组合以账户名义进行申购的投资对象，除需通过公平性审核的例外指令外，申购获配的证券投资基金将直接接受类账户登记机构的清算分配。交易部根据所涉账户的指定交易人对公开募集基金账户上披露的申购结果对系统分配数进行核准，数量不符的，应当第一时间告知各投资管理部的总监或基金经理，督促任本基金的基金经理对获配数进行确认，从而确保获配数准确无误。

9. 对于各投资组合以账户名义进行申购的投资对象，除需通过公平性审核的例外指令外，申购获配的证券投资基金将直接接受类账户登记机构的清算分配。交易部根据所涉账户的指定交易人对公开募集基金账户上披露的申购结果对系统分配数进行核准，数量不符的，应当第一时间告知各投资管理部的总监或基金经理，督促任本基金的基金经理对获配数进行确认，从而确保获配数准确无误。

10. 对于各投资组合以账户名义进行申购的投资对象，除需通过公平性审核的例外指令外，申购获配的证券投资基金将直接接受类账户登记机构的清算分配。交易部根据所涉账户的指定交易人对公开募集基金账户上披露的申购结果对系统分配数进行核准，数量不符的，应当第一时间告知各投资管理部的总监或基金经理，督促任本基金的基金经理对获配数进行确认，从而确保获配数准确无误。

11. 对于各投资组合以账户名义进行申购的投资对象，除需通过公平性审核的例外指令外，申购获配的证券投资基金将直接接受类账户登记机构的清算分配。交易部根据所涉账户的指定交易人对公开募集基金账户上披露的申购结果对系统分配数进行核准，数量不符的，应当第一时间告知各投资管理部的总监或基金经理，督促任本基金的基金经理对获配数进行确认，从而确保获配数准确无误。

12. 对于各投资组合以账户名义进行申购的投资对象，除需通过公平性审核的例外指令外，申购获配的证券投资基金将直接接受类账户登记机构的清算分配。交易部根据所涉账户的指定交易人对公开募集基金账户上披露的申购结果对系统分配数进行核准，数量不符的，应当第一时间告知各投资管理部的总监或基金经理，督促任本基金的基金经理对获配数进行确认，从而确保获配数准确无误。

13. 对于各投资组合以账户名义进行申购的投资对象，除需通过公平性审核的例外指令外，申购获配的证券投资基金将直接接受类账户登记机构的清算分配。交易部根据所涉账户的指定交易人对公开募集基金账户上披露的申购结果对系统分配数进行核准，数量不符的，应当第一时间告知各投资管理部的总监或基金经理，督促任本基金的基金经理对获配数进行确认，从而确保获配数准确无误。

14. 对于各投资组合以账户名义进行申购的投资对象，除需通过公平性审核的例外指令外，申购获配的证券投资基金将直接接受类账户登记机构的清算分配。交易部根据所涉账户的指定交易人对公开募集基金账户上披露的申购结果对系统分配数进行核准，数量不符的，应当第一时间告知各投资管理部的总监或基金经理，督促任本基金的基金经理对获配数进行确认，从而确保获配数准确无误。

15. 对于各投资组合以账户名义进行申购的投资对象，除需通过公平性审核的例外指令外，申购获配的证券投资基金将直接接受类账户登记机构的清算分配。交易部根据所涉账户的指定交易人对公开募集基金账户上披露的申购结果对系统分配数进行核准，数量不符的，应当第一时间告知各投资管理部的总监或基金经理，督促任本基金的基金经理对获配数进行确认，从而确保获配数准确无误。

16. 对于各投资组合以账户名义进行申购的投资对象，除需通过公平性审核的例外指令外，申购获配的证券投资基金将直接接受类账户登记机构的清算分配。交易部根据所涉账户的指定交易人对公开募集基金账户上披露的申购结果对系统分配数进行核准，数量不符的，应当第一时间告知各投资管理部的总监或基金经理，督促任本基金的基金经理对获配数进行确认，从而确保获配数准确无误。

17. 对于各投资组合以账户名义进行申购的投资对象，除需通过公平性审核的例外指令外，申购获配的证券投资基金将直接接受类账户登记机构的清算分配。交易部根据所涉账户的指定交易人对公开募集基金账户上披露的申购结果对系统分配数进行核准，数量不符的，应当第一时间告知各投资管理部的总监或基金经理，督促任本基金的基金经理对获配数进行确认，从而确保获配数准确无误。

18. 对于各投资组合以账户名义进行申购的投资对象，除需通过公平性审核的例外指令外，申购获配的证券投资基金将直接接受类账户登记机构的清算分配。交易部根据所涉账户的指定交易人对公开募集基金账户上披露的申购结果对系统分配数进行核准，数量不符的，应当第一时间告知各投资管理部的总监或基金经理，督促任本基金的基金经理对获配数进行确认，从而确保获配数准确无误。

19. 对于各投资组合以账户名义进行申购的投资对象，除需通过公平性审核的例外指令外，申购获配的证券投资基金将直接接受类账户登记机构的清算分配。交易部根据所涉账户的指定交易人对公开募集基金账户上披露的申购结果对系统分配数进行核准，数量不符的，应当第一时间告知各投资管理部的总监或基金经理，督促任本基金的基金经理对获配数进行确认，从而确保获配数准确无误。

20. 对于各投资组合以账户名义进行申购的投资对象，除需通过公平性审核的例外指令外，申购获配的证券投资基金将直接接受类账户登记机构的清算分配。交易部根据所涉账户的指定交易人对公开募集基金账户上披露的申购结果对系统分配数进行核准，数量不符的，应当第一时间告知各投资管理部的总监或基金经理，督促任本基金的基金经理对获配数进行确认，从而确保获配数准确无误。

21. 对于各投资组合以账户名义进行申购的投资对象，除需通过公平性审核的例外指令外，申购获配的证券投资基金将直接接受类账户登记机构的清算分配。交易部根据所涉账户的指定交易人对公开募集基金账户上披露的申购结果对系统分配数进行核准，数量不符的，应当第一时间告知各投资管理部的总监或基金经理，督促任本基金的基金经理对获配数进行确认，从而确保获配数准确无误。

22. 对于各投资组合以账户名义进行申购的投资对象，除需通过公平性审核的例外指令外，申购获配的证券投资基金将直接接受类账户登记机构的清算分配。交易部根据所涉账户的指定交易人对公开募集基金账户上披露的申购结果对系统分配数进行核准，数量不符的，应当第一时间告知各投资管理部的总监或基金经理，督促任本基金的基金经理对获配数进行确认，从而确保获配数准确无误。

23. 对于各投资组合以账户名义进行申购的投资对象，除需通过公平性审核的例外指令外，申购获配的证券投资基金将直接接受类账户登记机构的清算分配。交易部根据所涉账户的指定交易人对公开募集基金账户上披露的申购结果对系统分配数进行核准，数量不符的，应当第一时间告知各投资管理部的总监或基金经理，督促任本基金的基金经理对获配数进行确认，从而确保获配数准确无误。

24. 对于各投资组合以账户名义进行申购的投资对象，除需通过公平性审核的例外指令外，申购获配的证券投资基金将直接接受类账户登记机构的清算分配。交易部根据所涉账户的指定交易人对公开募集基金账户上披露的申购结果