

长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型  
证券投资基金  
2021 年第 3 季度报告

2021 年 9 月 30 日

基金管理人：长信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 10 月 27 日

## §1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金基金合同的规定，于 2021 年 10 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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本基金的

本报告中财务资料未

本报告期 2021 年 7 月 1 日 2021 年 9 月 30 日

## §2 基金产

### 2.1 基金基本

基金	长信标普 100 等权重指数 ( )
内	长信标普 100
基金代	5199 1
代	5199 1
基金运作	型
基金合同日	2011 年 3 月 30 日
报告期 基金份	2 2 0 525 30 份
投资标	本基金 过增强型指数 的投资来 美国 大 值 股股 的中长期资本增值， 过 的投资 和数 风险管理 基 基金净值增长 和美国标准普尔 100 等权重指数(本 基金的标的指数,以 标普 100 等权重指数 ) 的日 误 在 0.50 以内 ( 应的年 误 在 7.9% 以内)。在 误 的前提 过有 的资产及行业组合和基本 , 实现对标的指数的有 并 于标的指数的 。
投资策	本基金 股 指数增强型基金,原则 不 于 0 的基金净资产 用完 复 , 份股在标普 100 等权重指数中的基准权重 指数 投资组合,并根据标的指数 股及其权重的 、 行

	应的 整。对于不 于基金净资产 15 的 型 投资 , 基金管理人会根据 的公司基本 和 数 以及对美国及 的理 和 , 在美国公 行或 的证券中有 重 投资于基金管理人 有中长期 长 值的 业或本基金 投资的 定 、 、金 以及有 规和中 国证 会 本基金投资的其 金 。
业绩 基准	标准普尔 100 等权重指数
风险	本基金 股 指数增强型基金, 本基金的净值 美国大 值 股 的整 度 , 期 和 期风险的基金 。
基金管理人	长信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
资产托管人	: ( ) 中 : 中国银行 ( ) 有限公司

: 1、基金管理人决定 2021 年 7 月 1 日 对长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资  
投资基金 行份 , 原有基金份 人 份 , 增 美 份 , 事 基金管  
理人于 2021 年 月 29 日 的 长信基金管理有限责任公司 于长信美国标准普尔 100 等权重  
指数增强型证券投资基金增 美 基金份 事 的公告 , 美 份 基金代 01170 ,  
人 份 并表

2、 本报告期 , 本基金人 份 净值 1 2 , 人 份 27 39 79 55 份 本  
基金美 份 净值 0 251 美 , 美 份 00 5 75 份。

### §3 要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 要财务指标

: 人

要财务指标	报告期 ( 2021 年 7 月 1 日 2021 年 9 月 30 日 )
1 本期 实现	73 709 30
2 本期利	0 9 7 75
3 权 基金份 本期利	0 01 7
期 基金资产净值	5 9 12 99
5 期 基金份 净值	1 2

: 1、本期 实现 指基金本期利 、投资 、其 (不 公 值 )  
用的 , 本期利 本期 实现 本期公 值

2、所述基金业绩指标不 有人 或 基金的 用( , 基金 金、 基金的 、 利 投资 、基金 等), 用 实 要 于所 数 。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长 及其 同期业绩 基准 的

	净值增长	净值增长 标准	业绩 基准	业绩 基准 标准		
过 个月	0 7	0	0 20	0 9	0 7	0 05
过 个月	3	0	7 51	0 9	3 0	0 03
过 一 年	27 09	0 5	3 52	0 91	9 3	0 0
过 年	33 29	1 21	51 5	1 51	1 5	0 30
过 年	7 27	1 01	105 37	1 23	3 10	0 22
基金 合同	1 1 99	0 93	2 1 2	1 12	119 3	0 19

### 3.2.2 基金合同 以来基金 净值增长 及其 同期业绩 基准 的

长信标普100等权重指数 (QDII) 基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



： 1、 示日期 2011 年 3 月 30 日 2021 年 9 月 30 日。

2、 基金合同规定，本基金 合同 日 个月内 期， 期 ， 本基金 投资 合基金合同中的 定。

3、同期业绩 基准以美 ， 不 人 等 产 的 应。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金 理 (或基金 理 组)

任本基金的基金 理期限	任 日期	任日期	证券 业年限	大 金 ， 有基金 业资。 任 于中国 业银行、 务 有限公司， 201 年 月 长信基金 管理有限责任公司，现任 国 业务 、长信 美国标准普尔 100 等权重 指数增强型证券投资基金
	2020 年 1 月 2 日		年	

	金的基金 理、国 业务				和长信 券证券投资 基金的基金 理。
--	-------------------	--	--	--	-----------------------

：1、任基金 理任 日期以本基金 日 准 增或 基金 理 的日期根据对  
的公告日期

2、证券 业的 证券业 业人 资 管理 的 规定。

#### 4.2 投资 本基金提 投资 的 要

：本基金 投资 。

#### 4.3 报告期内本基金运作 规 信

本基金管理人在报告期内， 了 中 人 共和国证券投资基金 及其 有  
规、基金合同的规定，勤勉尽责 基金份 有人 利 ，不存在 基金份 有人利  
的行 。

本基金 以 信于 、 信于 会投资公 ，承诺 一 往 本 诚实信用、  
勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，在规 基金运作和 投资风险的前提 ， 基  
金份 有人 大利 。

#### 4.4 公

##### 4.4.1 公 度的 行

本报告期内，公司 实行公 度，并 公 度 ， 投资决策 ，  
强 行 的内 ，并 过 作 度、 和 保证公 原则的实现。同  
，公司 过对投资 行 的 、 和信 来 强对公 过 和 的  
。

##### 4.4.2 行 的

本报告期内，完 有 指数的 行投资的组合 ，其 投资组合未  
所公 同日 的 过 证券 日 的 5 的 ，未  
现 行 。

## 4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现

### 4.5.1 报告期内基金的投资策略和运作

季度，美 国 大 股 指 ， 的 行 的 的 。 数 据 ， ， 9 月 30 日，美国 3 93 ， 人 3 7 ， 季 度 提 10 个 ， 10 的 人 ， 美 国 的 限 要 产 ， 美 国 9 月 业 1 1， 于 于 期 59 ， 其 中 应 指 数、 指 数 别 73 、 1 2， 行 的 要 ， 示 存 在 大 业 ， 9 月 增 业 人 19 ， 于 期 的 50 和 月 的 3 人， 要 行 业 和 业 所 ， 业 金、 A 等 数 据 ， 业 ， 业 提 ， 出 行 ， 业 数 据 一 复。

往 ， 美 利 在 未 来 个 季 度 或 ， 但 股 值 的 在 季 度 有 所 ， 前 或 基 本 了 美 年 内 的 期， 季 度 的 或 在 于 美 标 利 的 及 对 22、23 年 美 的 期 。 要 及 美 国 务 限 等 的 ， 期 度 不 确 定 性 风 险， 风 险 提 。

， 美 股 核 长 性 标 的 的 期 。 本 季 度 标 普 500 指 数 0 2 ， 本 基 金 的 标 普 100 等 权 重 指 数 0 2 ， 同 期 人 对 美 0 （ 美 值 ）， 增 了 人 份 。 现 金 的 用 和 ， 基 金 净 值 增 长 指 数 基 本 合 。

## 5 2 报告期内基金的业绩表现

2021 年 9 月 30 日，本 基 金 人 份 净 值 1 2 ， 份 净 值 2 1 5 ， 美 份 净 值 0 251 美 ， 份 净 值 0 251 美 。 本 报 告 期 基 金 份 净 值 增 长 0 7 ， 业 绩 基 准 0 20 。

## 4.6 报告期内基金 有人数或基金资产净值

2017 年 10 月 11 日 2021 年 月 2 日，本 基 金 资 产 净 值 连 过 个 作 日 于 ， 本 基 金 管 理 人 中 国 证 会 报 送 了 决 。 2021 年 月 25 日 报 告 期 ， 本 基 金 要 的 有 人 数 或 基 金 资 产 净 值 。

## §5 投资组合报告

### 5.1 报告期 基金资产组合

		金 (人 )	基金 资产的 ( )
1	权 投资	1 350 590 72	7 30
	其中：普 股	0 570 311	5 5
	股		
	存托 证	7 0 279 2	1 5
	产信托 证		
2	基金投资		
3	定 投资		
	其中： 券		
	资产 证券		
	金 投资		
	其中： 期		
	期		
	期权		
	权证		
5	金 资产		
	其中： 的		
	金 资产		
7	银行存 和 金	5 53 703 22	12 3
	合		
	其 资产	1 2 3 37	0 3
9	合	7 3 7 157 31	100 00

：本基金本报告期 未 过 股 投资 股。本基金本报告期 未 证券出 业务。

### 5.2 报告期 在 个 国 ( ) 证券 的 股 及存托 证投资

国 ( )	公 值 (人 )	基金资产净值 ( )
美国	1 350 590 72	9 92
合	1 350 590 72	9 92

### 5.3 报告期 行业 的 股 及存托 证投资组合

#### 5.3.1 报告期 指数投资 行业 的 股 及存托 证投资组合

行业 别	公 值 (人 )	基金资产净值 ( )
保	5 1 7 57 7	11 19

	3 0 19	10 10
料	1 077 310 1	2 3
信 务	1 532 71 55	3 33
	5 13 53 17	11 77
业	5 277 077 5	11
公共事业	1 20 335 10	3 52
金	15 157	13 95
	1 213 5 0	2
信	7 50 23 70	1 33
合	39 9 02 75	

: 以 用 行业 标准 。

### 5.3.2 报告期 投资 行业 的股 及存托 证投资组合

行业 别	公 值 (人 )	基金资产净值 ( )
信 务	2 15 11	0 3
料	721 2 73	1 57
金	72 2 0 9	1 03
业	19 2	0 0
合	1 501 5 5 97	3 27

: 以 用 行业 标准 。

### 5.4 期 公 值 基金资产净值 大 的权 投资

#### 5.4.1 报告期 指数投资 公 值 基金资产净值 大 的前 股 及存托 证投资

	公司	公司 中	证券代	所在证券	所 国	数 (股)	公 值 (人 )	基金资产净值 ( )
1	A	公司	A	A A	美国	102	512 9 0	1 12
2		公司		A A	美国	127	502 703 9	1 09
3		公 司			美国	13	9 510	1 0
	A A				美国	251	95 57 21	1 0
5	A			A A	美国	1 3	75 01 9	1 03

	A		A	A A	美国	3	7 5 3 3	1 02
7					美国	1 03	5 59 09	0 99
	A	股份有限公司			美国	25	53 1 31	0 99
9	A A	公司	A		美国	21	52 30 0	0 9
10	A	公司	AA	A A	美国	7	912 1	0 97

#### 5.4.2 报告期 投资公 值 基金资产净值 大 的前 股 及存托 证投资

	公司	公司中	证券代	所在证券	所 国	数 (股)	公 值 (人 )	基金资产净值 ( )
1	A A	美 公司	A		美国	000	579 275 93	1 2
2		股 有 限 公 司		A A	美国	00	72 2 0 9	1 03
3	A A	保 公 司	A		美国	100	1 2 010 0	0 31
		公 司		A A	美国	2 300	119 77 5	0 2
5	A	度 股 份 有 限 公 司		A A	美国	100	99 713 03	0 22

#### 5.4.3 期 公 值 基金资产净值 大 的 国 中 业 股 份 股 投 资

：本基金本报告期 未 有 国 中 业 股 份 股 。

#### 5.5 报告期 券信用等 的 券投资组合

：本基金本报告期 未 有 券。

#### 5.6 报告期 公 值 基金资产净值 大 的前 券投资

：本基金本报告期 未 有 券。

**5.7 报告期 公 值 基金资产净值 大 的前 资产 证券投资**

：本基金本报告期 未 有资产 证券。

**5.8 报告期 公 值 基金资产净值 大 的前 金 投资**

：本基金本报告期 未 有金 。

**5.9 报告期 公 值 基金资产净值 大 的前 基金投资**

：本基金本报告期 未 有基金。

**5.10 投资组合报告**

**5.10.1 本基金投资的前 证券的行 本期 以及 的 的**

报告期内本基金投资的前 证券的行 未出现 管 ，或在报告 日 前一年内 公 责、 的 。

**5.10.2 基金投资的前 股 出基金合同规定的 股 的**

报告期内本基金投资的前 股 中，不存在 出基金合同规定 股 的 。

**5.10.3 其 资产**

		金 (人 )
1	存出保证金	
2	应 证券	
3	应 股利	32 015 9
	应 利	77 31
5	应	130 770 10
	其 应	
7	其	
	合	1 2 3 37

**5.10.4 报告期 有的 于 股期的 券**

：本基金本报告期 未 有 于 股期的 券。

**5.10.5 报告期 前 股 中存在 限 的**

**5.10.5.1 报告期 指数投资前 股 中存在 限 的**

：本基金本报告期 指数投资前 股 中不存在 限 。

**5.10.5.2 报告期 投资前 股 中存在 限 的**

：本基金本报告期 投资前 股 中不存在 限 。

**5.10.6 投资组合报告 的其 述**

： 于 的原 ， 和 合 存在 。

**§6 基金份**

： 份

报告期期 基金份	2 19 19
报告期期 基金 份	9 73 573 53
报告期期 基金 份	7 2 71
报告期期 基金 份 (份 以 )	
报告期期 基金份	2 2 0 525 30

： 述份 人 份 及美 份 的 。

**§7 基金管理人运用 有资金投资本基金**

**7.1 基金管理人 有本基金份**

报告期期 管理人 有的本基金份	7 501
报告期期 份	0 00
报告期期 出 份	0 00
报告期期 管理人 有的本基金份	7 501
报告期期 有的本基金份 基金 份 ( )	2 5

： 基金管理人运用 有资金投资本基金 本基金 公 的 行。

**7.2 基金管理人运用 有资金投资本基金**

： 本报告期内基金管理人未运用 有资金投资本基金。

## §8 投资者决策的其 重要信

### 8.1 报告期内 一投资者 有基金份 或 过 20%的

投资者 别	报告期内 有基金份					报告期 有基金	
		有基金份 或者 过 20 的	期 份	份	份	有份	份
	1	2021 年 7 月 1 日 2021 年 9 月 30 日	7 501	0 00	0 00	7 501	2 5
个人							
产 有风险							
<p>1、基金净值大 的风险</p> <p>一 有基金 过 的投资者连 大 ， 会 基金投资的 性和 定性，增 现 本。同 ， 净值 理规则 基金份 净值 或 。</p> <p>2、 期 理的风险</p> <p>一 有基金 过 的投资者大 本基金 ，导 同期中 投资者 期 理的 。</p>							

### 8.2 投资者决策的其 重要信

：本基金本报告期末 投资者决策的其 重要信 。

## §9

### 9.1

- 1、中国证 会 准 基金的
- 2、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
- 3、长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金

- 、长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金托管
- 5、报告期内在指定报 告的原
- 、长信基金管理有限责任公司 业 、公司 及 资 复 。

## 9.2 存

基金管理人的 公 所。

## 9.3

长信基金管理有限责任公司 :

长信基金管理有限责任公司

2021 年 10 月 27 日