

长信量化先锋股票型证券投资基金  
2012年年度报告摘要

2012年12月31日

基金管理人：长信基金管理有限责任公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2013年03月26日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 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法律责任。本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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2013年3月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、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本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自2012年1月1日起至2012年12月31日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	长信量化先锋股票
基金主代码	519983
交易代码	519983
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年11月18日
基金管理人	长信基金管理有限责任公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	138,508,302.11
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过数量化模型，合理配置资产权重，精选个股，在充分控制投资风险的前提下，力求实现基金资产的长期、稳定增值。
投资策略	本基金的投资策略包括两部分：一是通过自上而下的资产配置策略确定各类标的资产的配置比例，并对组合进行动态管理，进一步优化整个组合的风险收益参数；二是通过自下而上的上市公司研究，借助长信行业多因素选股模型选取具有投资价值的上市公司股票。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*75%+中证综合债券指数收益率*25%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期收益和预期风险高于混合型基金和债券型基金，属于较高预期收益和较高预期风险的基金品种。

### 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	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	周永刚	裴学敏
	联系电话	021-61009999	021-32169999
	电子邮箱	zhouyg@cxfund.com.cn	zh_jjb@bankcomm.com
客户服务电话		400-700-5566	95559
传真		021-61009800	021-62701262

## 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.cxfund.com.cn">www.cxfund.com.cn</a>
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、上海市仙霞路18号

### § 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	2012年	2011年	2010年11月18日 -2010年12月31日
本期已实现收益	-9,839,378.38	-46,864,419.19	-4,066,311.77
本期利润	321,206.85	-50,272,130.40	-4,509,662.64
加权平均基金份额本期利润	0.0018	-0.2394	-0.0139
本期基金份额净值增长率	-0.42%	-27.89%	-1.40%
3.1.2 期末数据和指标	2012年末	2011年末	2010年末
期末可供分配基金份额利润	-0.3098	-0.2887	-0.0139
期末基金资产净值	98,004,089.71	138,061,068.90	320,162,034.78
期末基金份额净值	0.708	0.711	0.986

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，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

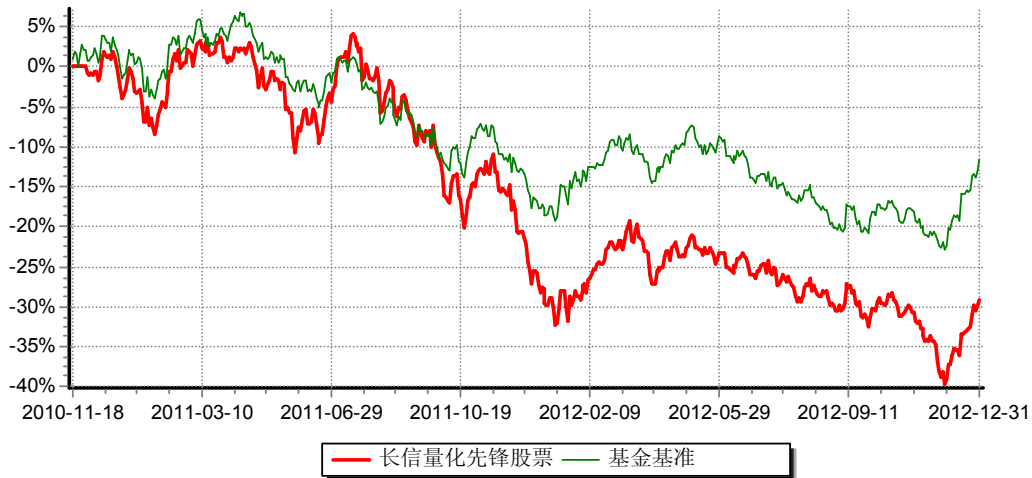
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

#### 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①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.58%	1.23%	7.70%	0.96%	-6.12%	0.27%
过去六个月	-4.97%	1.14%	2.20%	0.93%	-7.17%	0.21%
过去一年	-0.42%	1.19%	6.95%	0.96%	-7.37%	0.23%
自基金合同生效日起至今（2010年11月18日至2011年12月31日）	-29.20%	1.24%	-11.70%	0.97%	-17.50%	0.27%

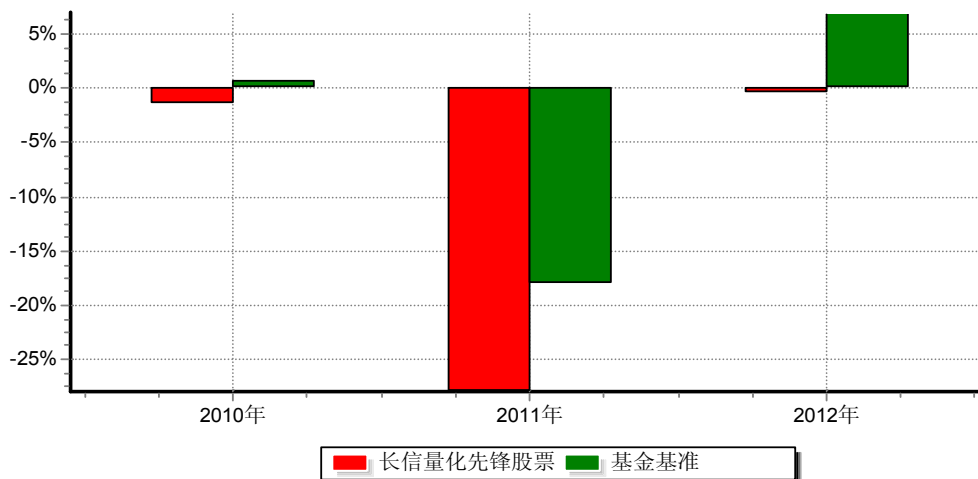
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、图示日期为2010年11月18日（基金合同生效日）至2012年12月31日。

2、按基金合同规定，本基金自合同生效日起6个月内为建仓期，建仓期结束时，本基金的各项投资比例已符合基金合同中关于投资范围、资产配置比例和投资限制的有关规定：股票投资比例范围为基金资产的60%-95%，权证投资比例范围为基金资产净值的0%-3%，债券、货币市场工具、资产支持证券以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种的比例范围为基金资产的5%-40%，其中现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。本基金利用数量化模型进行股票投资的比例不低于股票资产的80%。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金合同生效日为2010年11月18日，2010年净值增长率按当年实际存续期计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金基金合同生效日为2010年11月18日，本基金基金合同生效日起至本报告期末未进行利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

长信基金管理有限责任公司是经中国证监会证监基金字【2003】63号文批准，由长江证券股份有限公司、上海海欣集团股份有限公司、武汉钢铁股份有限公司共同发起设立。注册资本1.5亿元人民币。目前股权结构为：长江证券股份有限公司占49%、上海海欣集团股份有限公司占34.33%、武汉钢铁股份有限公司占16.67%。

截至2012年12月31日，本基金管理人共管理14只开放式基金，即长信利息收益货币、长信银利精选股票、长信金利趋势股票、长信增利动态策略股票、长信双利优选混合、长信利丰债券、长信恒利优势股票、长信中证中央企业100指数（LOF）、长信中短债债券、长信量化先锋股票、长信标普100等权重指数（QDII）、长信利鑫分级债券、长信内需成长股票和长信可转债。

#### 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	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
胡倩	本基金的基金经理、长信中证中央企业100指数证券投资基金（LOF）的基金经理、金融工程部副总监	2011年4月14日	—	12年	经济学博士，上海财经大学世界经济专业博士研究生毕业，具有基金从业资格。曾先后担任海通证券股份有限公司研究所分析师、高级分析师、首席分析师、金融工程部负责人等职务。2010年5月加入长信基金管理有限责任公司，担任金融工程部副总监，负责量化投资研究工作。现兼任本基金和长信中证中央企业100指数证券投资基金（LOF）的基金经理。
叶琦	本基金的基金经理、总经理助理、金融工程部总监和国际业务部总监	2011年11月1日	2012年3月7日	6年	曾任本基金的基金经理



注：1、首任基金经理任职日期以本基金成立之日为准；新增或变更以刊登新增/变更基金经理的公告披露日为准。

2、本基金基金经理的证券从业年限以基金经理进入证券业务相关机构的工作经历为时间计算标准。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、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。

本基金将继续以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，努力为基金份额持有人谋求最大利益。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

1、所有投资对象的投资指令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资指令得到公平对待。

2、公司使用的交易执行软件系统必须具备如下功能：

(1) 严格按照时间顺序发送委托指令；

(2) 对于多个投资组合在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的，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令数量比例分拆为各投资组合的委托指令。

3、交易人员对于接收到的交易指令依照价格优先、时间优先的顺序执行。在执行多个投资组合在同一时点就同一证券下达的相同方向的交易所投资指令时，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债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易的投资对象，交易部门必须严格独立接收各投资组合的投资指令，在申购结果产生前，不得以任何形式向任何人泄露各投资指令的内容，包括指令价格及数量等要素。

5、对于各投资组合以独立账户名义进行申购的投资对象，除需经过公平性审核的例外指令外，申购获配的证券数量由投资管理系统接收各类证券登记结算机构发送的数据进行分配。交易部门根据证券发行人在指定公开披露媒体上披露的申购结果对系统内分配数量进行核准，数量不符的，应当第一时间告知各投资管理部的总监及监察稽核部总监。对于以公司名义进行申购的投资对象，公司在获配额度确定后，严格按照价格优先的原则在各投资组合间进行分配。申购价格相同的投资组合则根据投资指令的数量按比例进行分配。确因特殊原因不能按照上述原则进行分配的，应启动异常交易识别流程，审核通过的，可以进行相应分配。

#### **4.3.2 公平交易制度的执行情况**

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、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

#### **4.3.3 异常交易行为的专项说明**

本报告期内，除完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合外，其余各投资组合均未参与交易所公开竞价同日反向交易，不涉及成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情形，对本年度同向交易价差进行专项分析，未发现异常情况。

### **4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明**

#### **4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析**

2012年，市场年初年尾上行，而年中整体呈现下跌趋势，大盘股走强，中小市值股票表现较差。期间上证综指上涨3.17%，沪深300上涨7.55%，中证100上涨10.77%，中证500上涨0.28%，而中小板指数和创业板指数则分别下跌1.63%和1.91%。板块分化明显，地产、金融和家用电器分别以31.73%、19.21%和15.84%的涨幅位列行业板块的前三位，而信息服务、商业贸易和机械设备则分别以11.95%、11.83%和11.83%的跌幅成为了行业板块中跌幅最大的三大行业。

2012 年整体而言，本基金仓位控制基本符合了市场的运行规律，为基金业绩贡献了正向收益，但是量化组合相对分散的行业配置以及在中小市值股票上的超配对基金业绩产生了较为明显负面影响。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2012年12月31日，本基金净值为0.708元，本报告期内本基金净值增长率为-0.42%，同期业绩比较基准涨幅为6.95%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们建立了涵盖宏观、流动性、市场结构特征、交易特征等多个层面的择时模型来监测市场可能存在的运行规律及发生的变动。展望未来，我们倾向于认为，经济基本走出谷底走向复苏，虽然从已披露的财务报表来看，上市公司业绩尚无明显改善，但是业绩预告统计显示整体经营状况有所恢复。从市场层面来看，流动性和投资者情绪有所改善，市场活跃度较最悲观时期已有明显好转。对于后期市场，我们保持相对乐观的态度，坚持自下而上的选股策略。与此同时，我们将不断更新数据，实时监控市场动向，通过合理的仓位控制、个股选择把握未来的投资机会。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证券监督管理委员会2008年9月12日发布的【2008】38号文《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》的规定，长信基金管理有限责任公司（以下简称“公司”）制订了健全、有效的估值政策和程序，成立了估值工作小组，小组成员由投资管理部总监、固定收益部总监、研究发展部总监、交易管理部总监、金融工程部总监、基金事务部总监以及基金事务部至少一名业务骨干共同组成。相关参与人员都具有丰富的证券行业工作经验，熟悉相关法规和估值方法。基金经理不直接参与估值决策，如果基金经理认为某证券有更好的证券估值方法，可以申请公司估值工作小组对某证券进行专项评估。估值决策由与会估值工作小组成员1/2以上多数票通过。对于估值政策，公司与基金托管人充分沟通，达成一致意见。审计本基金的会计师事务所认可公司基金估值政策和程序的适当性。

参与估值流程各方不存在任何重大利益冲突。报告期内，未签订与估值相关的定价服务。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规和本基金基金合同规定的基金收益分配原则以及基金实际运作情况，本基金本报告期没有进行利润分配。

本基金收益分配原则如下：

1、基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式（指将现金红利按除息日除权后的基金份额净值为计算基准自动转为基金份额进行再投资），基金份额持有人可选择现金方式或红利再投资方式；若基金份额持有人事先未做出选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；若基金份额持有人选择红利再投资，红利再投资的份额免收申购费用；

2、每一基金份额享有同等分配权；

3、在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益每年最多分配6次，每次收益分配最低比例不得低于收益分配基准日可供分配利润的30%，若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配（可供分配利润是指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数）；

4、基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配净额后不能低于面值；

5、分红权益登记日申请申购的基金份额不享受当次分红，分红权益登记日申请赎回的基金份额享受当次分红；

6、基金红利发放日距离收益分配基准日（即期末可供分配利润计算截至日）的时间不得超过15个工作日。

7、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2012年度，基金托管人在长信量化先锋股票型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2012年度，长信基金管理有限公司在长信量化先锋股票型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2012年度，由长信基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关长信量化先锋股票型证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## § 6 审计报告

本报告期本基金2012年度财务报告经毕马威华振事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师出具了无保留意见的审计报告（毕马威华振审字第1300074号），投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：长信量化先锋股票型证券投资基金

报告截止日：2012年12月31日

单位：人民币元

资产	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
<b>资产：</b>		
银行存款	9,199,598.06	14,196,304.90
结算备付金	545,603.79	1,288,241.83
存出保证金	500,000.00	388,934.98
交易性金融资产	89,633,559.78	123,163,107.08
其中：股票投资	89,633,559.78	119,925,525.08
基金投资		
债券投资	—	3,237,582.00
资产支持证券投资	—	—
衍生金融资产	—	—
买入返售金融资产	—	—
应收证券清算款	—	—
应收利息	1,749.92	169,818.25
应收股利	—	—
应收申购款	6,227.06	1,383.40
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	99,886,738.61	139,207,790.44
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2012年12月31日</b>	<b>上年度末 2011年12月31日</b>
<b>负债：</b>		
短期借款	—	—
交易性金融负债	—	—
衍生金融负债	—	—
卖出回购金融资产款	—	—
应付证券清算款	—	—
应付赎回款	899,790.28	3,052.07

应付管理人报酬	116,850.19	188,055.43
应付托管费	19,475.04	31,342.58
应付销售服务费	—	—
应付交易费用	272,172.57	399,763.11
应交税费	49,844.00	—
应付利息	—	—
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	524,516.82	524,508.35
负债合计	1,882,648.90	1,146,721.54
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	138,508,302.11	194,091,301.59
未分配利润	-40,504,212.40	-56,030,232.69
所有者权益合计	98,004,089.71	138,061,068.90
负债和所有者权益总计	99,886,738.61	139,207,790.44

注：报告截止日2012年12月31日，基金份额净值0.708元，基金份额总额138,508,302.11份。

## 7.2 利润表

会计主体：长信量化先锋股票型证券投资基金

本报告期：2012年1月1日至2012年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期	上年度可比期间
	2012年1月1日至2012年12月31日	2011年1月1日至2011年12月31日
<b>一、收入</b>	6,602,219.51	-42,640,979.09
1. 利息收入	392,341.25	582,712.30
其中：存款利息收入	175,964.68	271,949.19
债券利息收入	191,728.70	45,094.49
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	24,647.87	265,668.62
其他利息收入	—	—
2. 投资收益（损失以“-”	-3,972,763.70	-40,046,571.58



填列)		
其中：股票投资收益	-5,646,917.32	-40,915,574.23
基金投资收益		
债券投资收益	435,132.45	93,319.99
资产支持证券投资 收益	—	—
衍生工具收益	—	—
股利收益	1,239,021.17	775,682.66
3. 公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	10,160,585.23	-3,407,711.21
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	22,056.73	230,591.40
<b>减：二、费用</b>	<b>6,281,012.66</b>	<b>7,631,151.31</b>
1. 管理人报酬	1,916,192.71	2,987,476.37
2. 托管费	319,365.47	497,912.73
3. 销售服务费	—	—
4. 交易费用	3,755,952.98	3,852,469.67
5. 利息支出	—	—
其中：卖出回购金融资产支 出	—	—
6. 其他费用	289,501.50	293,292.54
<b>三、利润总额（亏损总额以 “-”号填列）</b>	<b>321,206.85</b>	<b>-50,272,130.40</b>
减：所得税费用	—	—
<b>四、净利润（净亏损以“-” 号填列）</b>	<b>321,206.85</b>	<b>-50,272,130.40</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长信量化先锋股票型证券投资基金

本报告期：2012年1月1日至2012年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计

一、期初所有者权益(基金净值)	194,091,301.59	-56,030,232.69	138,061,068.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	321,206.85	321,206.85
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-55,582,999.48	15,204,813.44	-40,378,186.04
其中：1. 基金申购款	3,185,803.99	-841,044.99	2,344,759.00
2. 基金赎回款	-58,768,803.47	16,045,858.43	-42,722,945.04
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	—	—	—
五、期末所有者权益(基金净值)	138,508,302.11	-40,504,212.40	98,004,089.71
项 目	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	324,671,697.42	-4,509,662.64	320,162,034.78
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	-50,272,130.40	-50,272,130.40
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-130,580,395.83	-1,248,439.65	-131,828,835.48
其中：1. 基金申购款	52,522,702.66	1,100,818.32	53,623,520.98
2. 基金赎回款	-183,103,098.49	-2,349,257.97	-185,452,356.46
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	—	—	—
五、期末所有者权益(基金净值)	194,091,301.59	-56,030,232.69	138,061,068.90

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

田丹

蒋学杰

孙红辉

基金管理公司负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

长信量化先锋股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于核准长信量化先锋股票型证券投资基金募集的批复》(证监许可【2010】962号文)批准,由长信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《长信量化先锋股票型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于2010年11月18日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为长信基金管理有限责任公司,基金托管人为中国交通银行股份有限公司(以下简称“交通银行”)。

本基金于2010年10月11日至2010年11月12日募集,募集资金总额人民币324,510,451.15元,利息转份额人民币161,246.27元,募集规模为324,671,697.42份。上述募集资金已由上海众华沪银会计师事务所有限公司验证,并出具了沪众会字(2010)第4128号验资报告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《长信量化先锋股票型证券投资基金基金合同》和《长信量化先锋股票型证券投资基金招募说明书》(更新)的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的投资组合比例为:股票投资比例范围为基金资产的60%-95%,权证投资比例范围为基金资产净值的0%-3%,债券、货币市场工具、资产支持证券以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种的比例范围为基金资产的5%-40%,其中现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。本基金利用数量化模型进行股票投资的比例不低于股票资产的80%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,本基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率\*75%+中证综合债券指数收益率\*25%。

根据《证券投资基金信息披露管理办法》，本基金定期报告在公开披露的第二个工作日，报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

#### **7.4.2 会计报表的编制基础**

本基金的财务报表按照中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)于2006年2月15日颁布的《企业会计准则-基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)的要求编制,同时亦按照中国证监会公告【2010】5号《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》以及中国证券业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制。

#### **7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2012年12月31日的财务状况、2012年度的经营成果和基金净值变动情况。

此外本财务报表同时符合如财务报表附注7.4.2所列示的其他有关规定的要求。

#### **7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明**

本报告期所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表一致。

#### **7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **7.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金在本报告期末发生重大会计政策变更。

##### **7.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金在本报告期末发生过重大会计估计变更。

##### **7.4.5.3 差错更正的说明**

本基金在本报告期末发生过重大会计差错。

### 7.4.6 税项

#### (1) 主要税项说明

根据财税字【1998】55号文、财税字【2002】128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税【2004】78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税【2005】102号文《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税【2005】107号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》及深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、上证交字【2008】16号《关于做好调整证券交易印花税率相关工作的通知》、财税【2008】1号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a) 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(b) 基金买卖股票、债券的投资收益暂免征收营业税和企业所得税。

(c) 对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入，由上市公司、发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税，暂不征收企业所得税，对个人投资者从上市公司取得的股票的股息、红利收入暂减按50%计算个人所得税，暂不征收企业所得税。

(d) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(e) 对投资者(包括个人和机构投资者)从基金分配中取得的收入，暂不征收个人所得税和企业所得税。

#### (2) 应交税费

单位：人民币元

	2012年12月31日	2011年12月31日
债券利息收入所得税	49,844.00	-

注：该项系基金收到的债券发行人在支付债券利息时代扣代缴的利息税部分。

### 7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
长信基金管理有限责任公司	基金管理人

交通银行股份有限公司	基金托管人
长江证券股份有限公司(以下简称“长江证券”)	基金管理人的股东
上海海欣集团股份有限公司	基金管理人的股东
武汉钢铁股份有限公司	基金管理人的股东
长江证券承销保荐有限公司	基金管理人控股股东的控股子公司
长江证券控股(香港)有限公司	基金管理人控股股东的控股子公司
长江期货有限公司	基金管理人控股股东的控股子公司
长江成长资本投资有限公司	基金管理人控股股东的控股子公司

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年12月31日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
长江证券	933,813,906.47	38.00%	1,101,640,663.41	43.59%

###### 7.4.8.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年12月31日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
长江证券	-	-%	8,177,587.90	72.46%

###### 7.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年12月31日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
长江证券	-	-	105,000,000.00	100%

###### 7.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

**7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
长江证券	808,417.65	38.94%	98,863.74	36.32%
关联方名称	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
长江证券	936,388.29	44.71%	1,587.15	0.40%

注：股票交易佣金计提标准如下：

深圳证券交易所交易佣金=买(卖)成交金额×1‰-清算库中买(卖)经手费-证券结算风险基金(按股票成交金额的十万分之三收取)

上海证券交易所交易佣金=买(卖)成交金额×1‰-买(卖)经手费-买(卖)证管费-证券结算风险基金(按股票成交金额的十万分之三收取)

上述交易佣金比率均在合理商业条款范围内收取，并符合行业标准。

根据《证券交易席位及证券综合服务协议》，本基金管理人在租用长江证券股份有限公司证券交易专用交易单元进行股票和债券交易的同时，还从长江证券股份有限公司获得证券研究综合服务。

**7.4.8.2 关联方报酬**
**7.4.8.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
	当期发生的基金应支付的管理费	1,916,192.71
其中：支付销售机构的客户维护费	634,850.92	988,934.03

注：支付基金管理人长信基金管理有限责任公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%的年费率确认，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

$$\text{日基金管理费} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.5\% / \text{当年天数}$$

#### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月 31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31 日
当期发生的基金应支付的托管费	319,365.47	497,912.73

注：支付基金托管人中国建设银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率确认，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

#### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金在本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过银行间同业市场进行债券(含回购)交易。

#### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月 31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31 日
期初持有的基金份额	20,000,400.00	20,000,400.00
期间申购/买入总份额	—	—
期间赎回/卖出总份额	—	—
期间由于拆分增加的份额	—	—
期末持有的基金份额	20,000,400.00	20,000,400.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	14.44%	10.30%

注：基金管理人运用固有资金投资本基金费率按本基金基金合同公布的费率执行。

##### 7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

除基金管理人之外的其他关联方于本年末及上年末均未持有本基金。

#### 7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间



	2012年1月1日至2012年12月31日		2011年1月1日至2011年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行股份有限公司	9,199,598.06	157,944.97	14,196,304.90	251,317.15

注：本基金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于2012年12月31日的相关余额为人民币545,603.79元（2011年：人民币1,288,241.83元）。

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本年度与上一会计年度均未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

#### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

上述关联交易均根据正常的商业交易条件进行，并以一般交易价格为定价基础。

#### 7.4.9 期末（2012年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

根据《证券发行与承销管理办法》，证券投资基金参与网下配售，应当承诺获得网下配售的股票持有期限不少于3个月，持有期自公开发行的股票上市之日起计算。基金通过网上申购获配的新股，从新股获配日至该新股上市日期间，为流通受限制而不能自由转让的资产。此外，基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起12个月内不得转让。

截至本报告期末2012年12月31日，本基金未因认购新发或增发证券而持有流通受限证券。

##### 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额
000527	美的	2012-08-27	重大资产	9.18	尚未复牌	-	59,500	557,981.00	546,210.00

	电 器		重组						
002460	赣 锋 锂 业	2012-12-25	筹划 非公 开发 行股 票事 项	19.31	2013-01-04	21.24	29,838	646,754.25	576,171.78

#### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末未持有因债券正回购交易而作为抵押的债券。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	89,633,559.78	89.74
	其中：股票	89,633,559.78	89.74
2	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
3	金融衍生品投资	—	—
4	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
5	银行存款和结算备付金合计	9,745,201.85	9.76
6	其他各项资产	507,976.98	0.51
7	合计	99,886,738.61	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	1,069,733.00	1.09
B	采掘业	2,348,905.68	2.40
C	制造业	49,771,368.99	50.78
C0	食品、饮料	8,415,315.03	8.59
C1	纺织、服装、皮毛	2,107,521.22	2.15
C2	木材、家具	1,385,905.00	1.41
C3	造纸、印刷	4,003,406.12	4.08
C4	石油、化学、塑胶、塑料	4,250,650.96	4.34
C5	电子	4,534,497.04	4.63
C6	金属、非金属	4,447,025.06	4.54
C7	机械、设备、仪表	11,654,382.34	11.89
C8	医药、生物制品	8,345,540.22	8.52
C99	其他制造业	627,126.00	0.64
D	电力、煤气及水的生产和供应	7,819,214.68	7.98

业			
E	建筑业	1,057,169.54	1.08
F	交通运输、仓储业	1,989,982.06	2.03
G	信息技术业	5,554,081.06	5.67
H	批发和零售贸易	6,214,436.04	6.34
I	金融、保险业	4,527,774.63	4.62
J	房地产业	1,932,196.36	1.97
K	社会服务业	5,740,853.51	5.86
L	传播与文化产业	683,738.23	0.70
M	综合类	924,106.00	0.94
	合计	89,633,559.78	91.46

### 8.3 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

金额单位：人民币元

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	002462	嘉事堂	164,892	1,312,540.32	1.34
2	600778	友好集团	120,250	1,291,485.00	1.32
3	002049	同方国芯	52,386	1,143,586.38	1.17
4	000750	国海证券	92,600	1,110,274.00	1.13
5	000785	武汉中商	179,515	1,089,656.05	1.11
6	002505	大康牧业	152,819	1,069,733.00	1.09
7	002600	江粉磁材	96,400	1,049,796.00	1.07
8	600980	北矿磁材	90,300	1,039,353.00	1.06
9	600055	华润万东	119,113	1,025,562.93	1.05
10	000796	易食股份	186,154	995,923.90	1.02

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于长信基金管理有限责任公司网站的年度报告正文。

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.4.1 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

金额单位：人民币元

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	002501	利源铝业	8,637,582.57	6.26
2	002365	永安药业	7,780,992.85	5.64
3	002321	华英农业	7,158,380.81	5.18

4	002458	益生股份	7,084,533.58	5.13
5	002327	富安娜	6,787,232.89	4.92
6	600967	北方创业	6,750,083.82	4.89
7	002492	恒基达鑫	6,599,226.24	4.78
8	002020	京新药业	6,539,916.43	4.74
9	600723	首商股份	6,340,395.53	4.59
10	002568	百润股份	5,998,118.65	4.34
11	600036	招商银行	5,809,550.62	4.21
12	002612	朗姿股份	5,781,255.45	4.19
13	600073	上海梅林	5,734,420.32	4.15
14	002565	上海绿新	5,672,569.16	4.11
15	002045	国光电器	5,551,429.02	4.02
16	002144	宏达高科	5,309,129.31	3.85
17	000566	海南海药	5,192,552.23	3.76
18	002485	希努尔	5,028,546.19	3.64
19	002394	联发股份	4,935,558.10	3.57
20	600461	洪城水业	4,907,325.28	3.55
21	002369	卓翼科技	4,830,931.99	3.50
22	002550	千红制药	4,827,883.00	3.50
23	002293	罗莱家纺	4,786,857.01	3.47
24	600016	民生银行	4,708,175.00	3.41
25	600975	新五丰	4,680,381.59	3.39
26	002557	洽洽食品	4,548,790.24	3.29
27	002486	嘉麟杰	4,543,010.78	3.29
28	002351	漫步者	4,521,911.10	3.28
29	002582	好想你	4,517,621.56	3.27
30	002124	天邦股份	4,468,609.94	3.24
31	600366	宁波韵升	4,431,691.47	3.21
32	600519	贵州茅台	4,393,010.63	3.18
33	002461	珠江啤酒	4,374,512.80	3.17
34	000802	北京旅游	4,339,932.84	3.14
35	002484	江海股份	4,339,432.49	3.14
36	600587	新华医疗	4,321,353.58	3.13
37	002548	金新农	4,300,513.84	3.11
38	601009	南京银行	4,223,830.24	3.06
39	601166	兴业银行	4,219,664.50	3.06

40	600000	浦发银行	4,208,987.22	3.05
41	002306	湘鄂情	4,197,304.99	3.04
42	002142	宁波银行	4,183,492.00	3.03
43	002317	众生药业	4,166,186.55	3.02
44	600396	金山股份	4,163,065.36	3.02
45	600232	金鹰股份	4,156,921.89	3.01
46	002344	海宁皮城	4,156,827.93	3.01
47	601169	北京银行	4,116,266.56	2.98
48	002558	世纪游轮	4,088,171.74	2.96
49	000990	诚志股份	4,070,184.05	2.95
50	601318	中国平安	4,048,344.98	2.93
51	002304	洋河股份	3,998,442.20	2.90
52	002507	涪陵榨菜	3,976,631.71	2.88
53	601518	吉林高速	3,951,088.45	2.86
54	002033	丽江旅游	3,895,590.72	2.82
55	600282	南钢股份	3,856,373.48	2.79
56	002189	利达光电	3,824,284.62	2.77
57	002502	骅威股份	3,816,196.81	2.76
58	000858	五粮液	3,772,968.25	2.73
59	600356	恒丰纸业	3,768,211.09	2.73
60	002085	万丰奥威	3,722,737.71	2.70
61	600595	中孚实业	3,713,465.21	2.69
62	600729	重庆百货	3,687,668.27	2.67
63	600310	桂东电力	3,686,208.60	2.67
64	600697	欧亚集团	3,676,168.05	2.66
65	600483	福建南纺	3,657,944.76	2.65
66	000900	现代投资	3,617,132.75	2.62
67	000661	长春高新	3,605,657.33	2.61
68	000623	吉林敖东	3,578,764.31	2.59
69	600111	包钢稀土	3,556,822.91	2.58
70	600694	大商股份	3,555,798.68	2.58
71	600199	金种子酒	3,511,329.65	2.54
72	601888	中国国旅	3,500,182.96	2.54
73	600593	大连圣亚	3,498,303.76	2.53
74	002187	广百股份	3,472,749.63	2.52
75	600969	郴电国际	3,465,721.85	2.51

76	601799	星宇股份	3,461,922.82	2.51
77	002159	三特索道	3,457,358.57	2.50
78	601601	中国太保	3,453,013.84	2.50
79	002216	三全食品	3,424,000.42	2.48
80	002330	得利斯	3,422,080.75	2.48
81	000970	中科三环	3,392,740.90	2.46
82	002301	齐心文具	3,175,350.14	2.30
83	002477	雏鹰农牧	3,117,038.91	2.26
84	002378	章源钨业	3,115,305.04	2.26
85	000886	海南高速	3,104,907.73	2.25
86	002082	栋梁新材	3,079,541.04	2.23
87	002107	沃华医药	3,067,934.91	2.22
88	002044	江苏三友	3,051,373.55	2.21
89	002398	建研集团	3,045,557.51	2.21
90	002572	索菲亚	3,029,581.54	2.19
91	600796	钱江生化	3,020,012.72	2.19
92	601008	连云港	2,981,744.06	2.16
93	600279	重庆港九	2,968,785.13	2.15
94	000799	酒鬼酒	2,953,329.90	2.14
95	601088	中国神华	2,914,535.62	2.11
96	601199	江南水务	2,906,176.95	2.10
97	000423	东阿阿胶	2,869,700.78	2.08
98	000796	易食股份	2,868,659.81	2.08
99	601288	农业银行	2,864,350.00	2.07
100	002494	华斯股份	2,861,066.78	2.07
101	002348	高乐股份	2,847,392.41	2.06
102	601398	工商银行	2,832,265.00	2.05
103	002601	佰利联	2,820,369.95	2.04
104	002462	嘉事堂	2,799,050.65	2.03
105	002397	梦洁家纺	2,773,748.08	2.01

注：本项“买入金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑其它交易费用。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
----	------	------	----------	----------------

1	002501	利源铝业	8,521,489.92	6.17
2	002458	益生股份	8,505,772.91	6.16
3	002321	华英农业	8,129,477.08	5.89
4	002365	永安药业	6,973,357.07	5.05
5	600967	北方创业	6,888,284.36	4.99
6	002492	恒基达鑫	6,658,178.32	4.82
7	002568	百润股份	6,353,932.88	4.60
8	600723	首商股份	6,267,275.48	4.54
9	002020	京新药业	6,235,590.27	4.52
10	002327	富安娜	6,196,013.72	4.49
11	600036	招商银行	6,179,108.71	4.48
12	600461	洪城水业	6,097,414.77	4.42
13	002142	宁波银行	6,080,318.94	4.40
14	002394	联发股份	5,988,879.84	4.34
15	002548	金新农	5,890,901.02	4.27
16	002484	江海股份	5,820,097.90	4.22
17	002612	朗姿股份	5,820,088.45	4.22
18	600073	上海梅林	5,781,536.43	4.19
19	600587	新华医疗	5,667,001.96	4.10
20	002124	天邦股份	5,633,348.50	4.08
21	600232	金鹰股份	5,611,842.88	4.06
22	601398	工商银行	5,416,493.36	3.92
23	000566	海南海药	5,357,021.12	3.88
24	600975	新五丰	5,199,148.05	3.77
25	002045	国光电器	5,116,634.00	3.71
26	600519	贵州茅台	5,008,821.26	3.63
27	600016	民生银行	4,990,308.92	3.61
28	300101	国腾电子	4,976,306.25	3.60
29	601799	星宇股份	4,963,332.78	3.60
30	002369	卓翼科技	4,914,216.92	3.56
31	600396	金山股份	4,910,556.78	3.56
32	002330	得利斯	4,910,530.21	3.56
33	002477	雏鹰农牧	4,907,255.68	3.55
34	002144	宏达高科	4,904,464.92	3.55
35	002378	章源钨业	4,895,136.26	3.55
36	601008	连云港	4,890,859.09	3.54



37	002565	上海绿新	4,887,359.60	3.54
38	002485	希努尔	4,830,649.71	3.50
39	002550	千红制药	4,794,373.54	3.47
40	002301	齐心文具	4,755,013.82	3.44
41	002159	三特索道	4,731,698.90	3.43
42	002557	洽洽食品	4,714,794.31	3.42
43	002293	罗莱家纺	4,687,910.36	3.40
44	002486	嘉麟杰	4,632,848.22	3.36
45	002306	湘鄂情	4,527,531.59	3.28
46	002351	漫步者	4,521,100.46	3.27
47	002317	众生药业	4,515,518.92	3.27
48	601318	中国平安	4,512,356.97	3.27
49	600366	宁波韵升	4,446,898.82	3.22
50	600000	浦发银行	4,388,686.17	3.18
51	002582	好想你	4,365,425.99	3.16
52	601857	中国石油	4,318,825.85	3.13
53	601199	江南水务	4,312,248.99	3.12
54	002572	索菲亚	4,310,120.96	3.12
55	002461	珠江啤酒	4,290,075.59	3.11
56	601166	兴业银行	4,237,279.38	3.07
57	601169	北京银行	4,158,134.76	3.01
58	002558	世纪游轮	4,142,886.52	3.00
59	002467	二六三	4,102,475.60	2.97
60	000900	现代投资	4,087,751.29	2.96
61	000802	北京旅游	4,084,438.92	2.96
62	601088	中国神华	4,068,743.18	2.95
63	000858	五粮液	4,061,762.63	2.94
64	601009	南京银行	4,056,262.85	2.94
65	002344	海宁皮城	4,019,648.29	2.91
66	002304	洋河股份	4,000,380.23	2.90
67	601518	吉林高速	3,982,867.75	2.88
68	002472	双环传动	3,949,016.54	2.86
69	600111	包钢稀土	3,913,646.50	2.83
70	601601	中国太保	3,908,554.29	2.83
71	002425	凯撒股份	3,905,129.30	2.83
72	002522	浙江众成	3,895,486.04	2.82

73	002085	万丰奥威	3,859,436.74	2.80
74	000715	中兴商业	3,859,100.79	2.80
75	002034	美欣达	3,839,574.74	2.78
76	000623	吉林敖东	3,822,706.33	2.77
77	600356	恒丰纸业	3,812,407.08	2.76
78	002189	利达光电	3,796,400.57	2.75
79	600282	南钢股份	3,791,202.80	2.75
80	600697	欧亚集团	3,779,183.44	2.74
81	600729	重庆百货	3,778,574.14	2.74
82	002502	骅威股份	3,772,278.02	2.73
83	000661	长春高新	3,731,307.32	2.70
84	000990	诚志股份	3,700,759.95	2.68
85	002139	拓邦股份	3,693,798.79	2.68
86	600595	中孚实业	3,691,515.98	2.67
87	600694	大商股份	3,641,077.69	2.64
88	600666	西南药业	3,630,339.04	2.63
89	002507	涪陵榨菜	3,580,183.71	2.59
90	600483	福建南纺	3,575,626.73	2.59
91	601628	中国人寿	3,532,183.98	2.56
92	601888	中国国旅	3,509,718.02	2.54
93	002216	三全食品	3,491,209.79	2.53
94	002187	广百股份	3,490,959.12	2.53
95	000970	中科三环	3,443,731.77	2.49
96	600798	宁波海运	3,441,197.91	2.49
97	000789	江西水泥	3,421,915.65	2.48
98	000886	海南高速	3,377,191.34	2.45
99	600199	金种子酒	3,367,165.55	2.44
100	600801	华新水泥	3,366,048.54	2.44
101	002126	银轮股份	3,332,107.80	2.41
102	002044	江苏三友	3,275,269.18	2.37
103	002033	丽江旅游	3,224,784.02	2.34
104	002421	达实智能	3,172,322.84	2.30
105	601988	中国银行	3,137,675.09	2.27
106	002103	广博股份	3,095,934.61	2.24
107	002448	中原内配	3,092,818.44	2.24
108	000002	万科A	3,069,708.04	2.22

109	002398	建研集团	3,063,548.42	2.22
110	600668	尖峰集团	3,040,529.18	2.20
111	002082	栋梁新材	3,017,386.54	2.19
112	600548	深高速	3,015,263.32	2.18
113	601288	农业银行	2,981,437.80	2.16
114	002412	汉森制药	2,922,241.36	2.12
115	600318	巢东股份	2,919,759.12	2.11
116	600310	桂东电力	2,900,578.74	2.10
117	000868	安凯客车	2,878,139.30	2.08
118	000799	酒鬼酒	2,876,812.58	2.08
119	600279	重庆港九	2,834,829.65	2.05
120	002348	高乐股份	2,818,070.97	2.04
121	000885	同力水泥	2,785,656.61	2.02
122	002397	梦洁家纺	2,779,715.54	2.01
123	601001	大同煤业	2,779,064.95	2.01
124	002494	华斯股份	2,771,835.35	2.01

注：本项“卖出股票的收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	1,211,367,314.54	1,211,367,314.54
卖出股票的收入（成交）总额	1,248,112,794.92	1,248,255,442.12

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（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 8.9 投资组合报告附注

8.9.1 本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未出现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。

8.9.2 本报告期内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。

#### 8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	500,000.00
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	1,749.92
5	应收申购款	6,227.06
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	507,976.98

#### 8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 8.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
2,674	51,798.17	20,099,217.73	14.51%	118,409,084.38	85.49%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本基金	274,572.77	0.20%

注：1、期末本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为0万份至10万份（含）；

2、期末该只基金的基金经理持有该只基金份额总量的数量区间为10万份至50万份（含）。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2010年11月18日)基金份额总额	324,671,697.42
本报告期期初基金份额总额	194,091,301.59
本报告期基金总申购份额	3,185,803.99
减：本报告期基金总赎回份额	58,768,803.47
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	138,508,302.11

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 11.2.1 报告期内本基金管理人的重大人事变动：

本报告期内，副总经理付勇先生离职，本基金管理人于2012年11月1日在指定信息披露媒体发布相应的《关于基金行业高级管理人员变更公告》。

#### 11.2.2 报告期内基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

基金托管人交通银行于2012年5月28日公布了《交通银行股份有限公司关于资产托管部总经理变更的公告》，交通银行资产托管部原总经理谷娜莎同志不再担任资产托管部总经理职务。资产托管部总经理职务由刘树军同志担任。具体内容请参阅在2012年5月30日《上海证券报》上发布的《交通银行股份有限公司关于资产托管部总经理变更的公告》。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略没有改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金未更换会计师事务所；报告期应支付给毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）审计的报酬为人民币70,000.00元，该审计机构为本基金提供审计服务的连续年限为3年。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况

本报告期本基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员没有受监管部门稽查或处罚的情形。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		债券交易		债券回购交易		权证交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占股票成交总额比例	成交金额	占债券成交总额比例	成交金额	占债券回购成交总额比例	成交金额	占权证成交总额比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安	1	1,158,842,711.32	47.16%	3,543,102.08	100.00%	—	—	—	—	953,701.29	45.93%	
长江证券	1	933,813,906.47	38.00%	—	—	—	—	—	—	808417.65	38.94%	
华创证券	1	364,761,386.14	14.84%	—	—	—	—	—	—	314085.76	15.13%	

注：1、截止2012年年底本基金共增加1个交易单元：华创证券。

#### 2、专用交易单元的选择标准和程序

根据中国证监会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》（证监基字<1998>29号）和《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字【2007】48号）的有关规定，本公司制定了租用证券公司专用交易单元的选择标准和程序。

##### （1）选择标准：

- 1) 券商基本面评价（财务状况、经营状况）；
- 2) 券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）；
- 3) 券商每日信息评价（及时性和有效性）；
- 4) 券商协作表现评价。

##### （2）选择程序：



首先根据租用证券公司专用交易单元的选择标准形成《券商服务评价表》，然后根据评分高低进行选择基金专用交易单元。

长信基金管理有限责任公司

二〇一三年三月二十六日