

# 长信量化先锋股票型证券投资基金2013年年度报告摘要

2013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：2014年3月29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2014年3月24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2013年1月1日起至2013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	119,085,071.97
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
	联系电话	021-61009999
	电子邮箱	zhouyg@cxfund.com.cn
客户服务电话	400-700-5566	95559

传真	021-61009800	021-62701216
----	--------------	--------------

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露 报纸名称	中国证券报、证券时报
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>

### § 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	2013年	2012年	2011年
本期已实现收益	23,775,282.04	-9,839,378.38	-46,864,419.19
本期利润	18,531,605.84	321,206.85	-50,272,130.40
加权平均基金份额本期利润	0.1443	0.0018	-0.2394
本期基金份额净值增长率	19.92%	-0.42%	-27.89%
3.1.2 期末数据和指标	2013年末	2012年末	2011年末
期末可供分配基金份额利润	-0.1511	-0.3098	-0.2887
期末基金资产净值	101,086,141.35	98,004,089.71	138,061,068.90
期末基金份额净值	0.849	0.708	0.711

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。

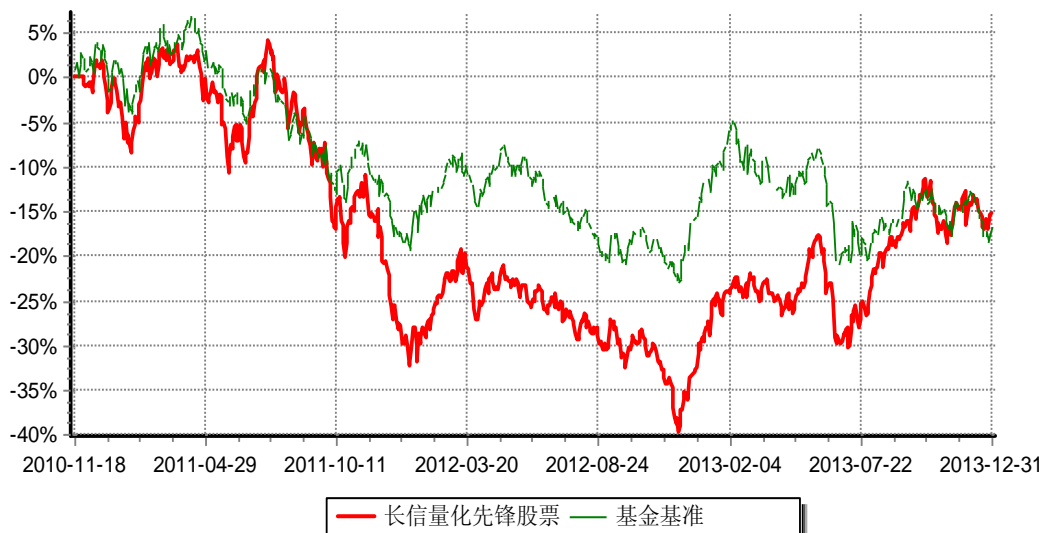
#### 3.2 基金净值表现

##### 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	-0.70%	1.14%	-2.85%	0.85%	2.15%	0.29%
过去六个月	21.11%	1.12%	3.89%	0.97%	17.22%	0.15%
过去一年	19.92%	1.16%	-5.48%	1.05%	25.40%	0.11%
过去三年	-13.89%	1.23%	-17.11%	0.99%	3.22%	0.24%
自基金合同生效日起至今（2010年11月18日至2013	-15.10%	1.22%	-16.54%	0.99%	1.44%	0.23%

年12月31日)						
----------	--	--	--	--	--	--

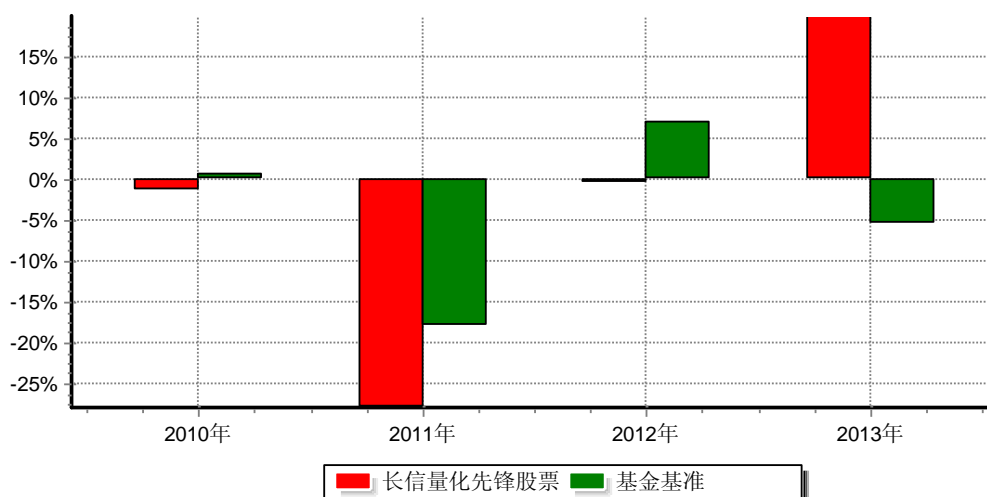
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、图示日期为2010年11月18日（基金合同生效日）至2013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的约定。

### 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

过去三年本基金未进行利润分配。

## § 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2013年12月31日，本基金管理人共管理16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、长信内需成长股票、长信可转债债券、长信利众分级债和长信纯债一年定开债券。

#### 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、公司金融工程部副总监	2011年4月14日	—	13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。

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门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

2013年，市场分化严重，中小市值股票，特别是创业板表现靓丽，而大盘股则整体疲软。期间上证综指下跌6.75%，沪深300下跌7.65%，中证100下跌13.12%，而中证500上涨16.89%，中小板指数上涨26.34%，创业板指数更是大幅上涨了74.73%。大小盘风格与2012年相比发生了完全的逆转，这种逆转在行业上同样表现明显：2012年表现不佳的TMT板块在2013年涨幅可观，按照申万一级行业分类，信息服务、信息设备和电子行业分别以78.45%、51.66%和42.78%的涨幅位列23个行业的前三名；而强周期的采掘、有色和钢铁行业则分别以31.18%、29.64%和17.27%的跌幅位列所有行业的最后三位。

2013年整体而言，本基金仓位控制基本符合市场的运行规律，股票选择为基

金业绩贡献了主要的正向收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2013年12月31日，本基金净值为0.849元，本报告期内本基金净值增长率为19.92%，同期业绩比较基准涨幅为-5.48%。

#### 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，我们认为，中国处在全面深化改革的进程中，经济结构的转型与调整将是未来相当长一段时间内的重要议题。在这一阶段，新兴产业与传统产业的分化，产业内公司间的分化将成为必然。在机遇与挑战并存的时期，市场整体趋势性向上的概率不大，结构性行情仍将成为主导。从上市公司经营层面来看，2013年业绩预告向好公司的比例在增长。表明在目前整体经济环境趋紧的情况下，局部经济仍然体现出了较大活力，部分行业部分公司增长可期。从市场层面来看，流动性和投资者情绪有所改善，市场活跃度明显好转。对于后期市场，我们保持谨慎乐观的态度，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

2013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

2013年度，长信基金管理有限责任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

2013年度，由长信基金管理有限责任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1400181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：2013年12月31日

单位：人民币元

资产	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
<b>资产：</b>		
银行存款	13,317,163.62	9,199,598.06
结算备付金	558,585.54	545,603.79
存出保证金	40,390.13	500,000.00
交易性金融资产	88,129,647.40	89,633,559.78
其中：股票投资	88,129,647.40	89,633,559.78
基金投资	—	—
债券投资	—	—
贵金属投资	—	—
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	3,048.60	1,749.92
应收股利	—	—
应收申购款	101,956.67	6,227.06
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	102,150,791.96	99,886,738.61
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2013年12月31日</b>	<b>上年度末 2012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	164,814.75	899,790.28
应付管理人报酬	129,496.20	116,850.19
应付托管费	21,582.70	19,475.04
应付销售服务费	—	—
应付交易费用	324,381.29	272,172.57
应交税费	49,844.00	49,844.00
应付利息	—	—
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	374,531.67	524,516.82
负债合计	1,064,650.61	1,882,648.90
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	119,085,071.97	138,508,302.11
未分配利润	-17,998,930.62	-40,504,212.40
所有者权益合计	101,086,141.35	98,004,089.71
负债和所有者权益总计	102,150,791.96	99,886,738.61

注：报告截止日2013年12月31日，基金份额净值0.849元，基金份额总额119,085,071.97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：2013年1月1日至2013年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年 12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年 12月31日
<b>一、收入</b>	22,735,245.33	6,602,219.51
1. 利息收入	110,290.53	392,341.25
其中：存款利息收入	110,290.53	175,964.68
债券利息收入	—	191,728.70
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	—	24,647.87
其他利息收入	—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）	27,819,839.77	-3,972,763.70



其中：股票投资收益	27,356,395.33	-5,646,917.32
基金投资收益	—	—
债券投资收益	—	435,132.45
资产支持证券投资收益	—	—
贵金属投资收益	—	—
衍生工具收益	—	—
股利收益	463,444.44	1,239,021.17
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-5,243,676.20	10,160,585.23
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	48,791.23	22,056.73
<b>减：二、费用</b>	<b>4,203,639.49</b>	<b>6,281,012.66</b>
1. 管理人报酬	1,518,356.78	1,916,192.71
2. 托管费	253,059.46	319,365.47
3. 销售服务费	—	—
4. 交易费用	2,142,856.84	3,755,952.98
5. 利息支出	—	—
其中：卖出回购金融资产支出	—	—
6. 其他费用	289,366.41	289,501.50
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>18,531,605.84</b>	<b>321,206.85</b>
减：所得税费用	—	—
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>18,531,605.84</b>	<b>321,206.85</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：2013年1月1日至2013年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期		
	2013年1月1日至2013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)	138,508,302.11	-40,504,212.40	98,004,089.71
二、本期经营活动产生的基金净	—	18,531,605.84	18,531,605.84

值变动数(本期利润)			
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)	-19,423,230.14	3,973,675.94	-15,449,554.20
其中: 1. 基金申购款	14,303,984.19	-2,811,409.28	11,492,574.91
2. 基金赎回款	-33,727,214.33	6,785,085.22	-26,942,129.11
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)	119,085,071.97	-17,998,930.62	101,086,141.35
项 目	上年度可比期间 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

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

-----  
基金管理人负责人

-----  
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2013年12月31日的财务状况、2013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《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收问题的通知》、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[2012]85号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关

税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》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》、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：

(1) 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。

(2) 证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的投资收益暂免征收营业税和企业所得税。

(3) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(4) 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。自2013年1月1日起，对所取得的股息红利收入按根据持有期限计提个人所得税：持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额，上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(5) 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。

(6) 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

项目	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
应交债券利息收入所得税	49,844.00	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未代扣代缴的税费部分。

## 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
中国交通银行	基金托管人
长江证券股份有限公司(“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
上海长江财富资产管理有限公司	基金管理人的子公司

#### 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 2013年1月1日至2013年12月31日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012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	479,400,705.11	34.42%	933,813,906.47	38.00%

###### 7.4.8.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

###### 7.4.8.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

###### 7.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间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 2013年1月1日至2013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	436,445.88	34.55%	126,805.84	39.09%
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	期末应付佣金余额	占期末应付佣

		总量的比例		金总额的比例
长江证券	808,417.65	38.94%	98,863.74	36.32%

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 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,518,356.78	1,916,192.71
其中：支付销售机构的客户维护费	587,345.34	634,850.92

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：日基金管理费=前一日基金资产净值×1.5%/当年天数

##### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	253,059.46	319,365.47

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：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%/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	上年度可比期间
	2013年1月1日至2013年12月31日	2012年1月1日至2012年12月31日
报告期初持有的基金份额	20,000,400.00	20,000,400.00
报告期间申购/买入总份额	—	—
报告期间因拆分变动份额	—	—
减：报告期间赎回/卖出总份额	—	—
报告期末持有的基金份额	20,000,400.00	20,000,400.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	16.80%	14.44%

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	
	2013年1月1日至2013年12月31日	2012年1月1日至2012年12月31日	2012年1月1日至2012年12月31日	2012年1月1日至2012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	13,317,163.62	100,228.80	9,199,598.06	157,944.97

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2013年12月31日的相关余额为人民币558,585.54元（2012年：人民币545,603.79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

本基金在本期及上年度可比期间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（2013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2013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
600370	三房巷	2013年10月22日	重要事项未公告	4.36	2014年1月6日	4.19	242,300	1,029,055.00	1,056,428.00
000558	莱茵置业	2013年12月26日	重大事项	3.44	2014年1月2日	3.63	401,582	1,329,975.27	1,381,442.08
000903	云内动力	2013年12月19日	筹划非公开发行股票事项	4.70	2014年1月6日	4.70	239,702	1,102,386.52	1,126,599.40
002602	世纪华通	2013年10月18日	重大事项	7.20	2014年1月22日	8.03	170,607	1,209,832.43	1,228,370.40

##### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

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	88,129,647.40	86.27
	其中：股票	88,129,647.40	86.27
2	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
3	贵金属投资	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	银行存款和结算备付金合计	13,875,749.16	13.58
7	其他各项资产	145,395.40	0.14
8	合计	102,150,791.96	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	1,263,163.60	1.25
B	采矿业	—	—
C	制造业	66,168,756.87	65.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,222,696.40	1.21
E	建筑业	1,198,371.78	1.19
F	批发和零售业	2,605,599.43	2.58
G	交通运输、仓储和邮政业	2,093,433.12	2.07
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,308,989.78	2.28
J	金融业	5,363,185.08	5.31
K	房地产业	3,826,648.51	3.79
L	租赁和商务服务业	—	—

M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	2,078,802.83	2.06
	合计	88,129,647.40	87.18

### 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	600150	中国船舶	90,000	2,177,100.00	2.15
2	600118	中国卫星	108,200	2,004,946.00	1.98
3	600346	大橡塑	242,485	1,634,348.90	1.62
4	603008	喜临门	151,018	1,609,851.88	1.59
5	002173	千足珍珠	179,835	1,503,420.60	1.49
6	002593	日上集团	188,806	1,489,679.34	1.47
7	002209	达意隆	215,709	1,447,407.39	1.43
8	002189	利达光电	188,125	1,431,631.25	1.42
9	002066	瑞泰科技	281,578	1,416,337.34	1.40
10	002169	智光电气	233,416	1,412,166.80	1.40

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	002199	东晶电子	6,942,330.02	7.08
2	000034	深信泰丰	6,733,150.47	6.87
3	600837	海通证券	5,488,978.75	5.60
4	600962	国投中鲁	5,468,978.16	5.58
5	000957	中通客车	5,098,109.30	5.20

6	002171	精诚铜业	5,014,022.88	5.12
7	002363	隆基机械	4,630,556.17	4.72
8	601008	连云港	4,505,271.01	4.60
9	002066	瑞泰科技	4,378,700.74	4.47
10	600477	杭萧钢构	4,331,693.49	4.42
11	002169	智光电气	4,314,860.77	4.40
12	600243	青海华鼎	4,309,721.94	4.40
13	600529	山东药玻	4,239,020.57	4.33
14	000923	河北宣工	4,189,134.82	4.27
15	002613	北玻股份	4,097,795.42	4.18
16	000702	正虹科技	4,074,100.58	4.16
17	002365	永安药业	3,590,745.70	3.66
18	002189	利达光电	3,541,976.93	3.61
19	002134	天津普林	3,537,295.04	3.61
20	002351	漫步者	3,483,751.29	3.55
21	000796	易食股份	3,441,156.60	3.51
22	000596	古井贡酒	3,422,662.04	3.49
23	000564	西安民生	3,383,831.99	3.45
24	600809	山西汾酒	3,366,682.52	3.44
25	002184	海得控制	3,311,383.69	3.38
26	002105	信隆实业	3,306,768.48	3.37
27	002279	久其软件	3,300,148.35	3.37
28	600356	恒丰纸业	3,266,978.71	3.33
29	601677	明泰铝业	3,229,076.40	3.29
30	000020	深华发A	3,219,737.33	3.29
31	600302	标准股份	3,215,148.81	3.28
32	002331	皖通科技	3,214,702.87	3.28
33	601009	南京银行	3,202,869.49	3.27
34	600173	卧龙地产	3,200,758.50	3.27
35	002173	千足珍珠	3,199,048.63	3.26
36	000785	武汉中商	3,172,892.34	3.24
37	002119	康强电子	3,165,672.14	3.23
38	000558	莱茵置业	3,118,379.05	3.18
39	600992	贵绳股份	3,105,250.84	3.17
40	002141	蓉胜超微	3,096,997.70	3.16
41	000980	金马股份	3,074,212.59	3.14

42	600159	大龙地产	3,068,657.74	3.13
43	002418	康盛股份	3,057,113.25	3.12
44	000952	广济药业	3,022,405.66	3.08
45	000524	东方宾馆	3,022,133.11	3.08
46	002295	精艺股份	3,008,693.38	3.07
47	002417	三元达	3,005,887.73	3.07
48	600706	曲江文旅	3,003,444.96	3.06
49	000711	天伦置业	2,942,688.22	3.00
50	600355	精伦电子	2,929,877.78	2.99
51	002132	恒星科技	2,924,612.40	2.98
52	600199	金种子酒	2,922,028.00	2.98
53	002607	亚夏汽车	2,916,456.04	2.98
54	600099	林海股份	2,909,633.39	2.97
55	002188	新嘉联	2,908,294.69	2.97
56	600235	民丰特纸	2,905,652.72	2.96
57	600747	大连控股	2,903,407.40	2.96
58	002633	申科股份	2,888,787.00	2.95
59	000586	汇源通信	2,877,872.75	2.94
60	002449	国星光电	2,863,733.80	2.92
61	002209	达意隆	2,848,441.27	2.91
62	002442	龙星化工	2,827,470.26	2.89
63	000546	光华控股	2,810,916.54	2.87
64	600629	棱光实业	2,749,703.34	2.81
65	600833	第一医药	2,741,930.34	2.80
66	000415	渤海租赁	2,732,565.88	2.79
67	000037	深南电A	2,727,691.59	2.78
68	600215	长春经开	2,677,286.04	2.73
69	000597	东北制药	2,666,192.45	2.72
70	002455	百川股份	2,661,671.30	2.72
71	000856	冀东装备	2,660,062.36	2.71
72	600715	松辽汽车	2,649,758.02	2.70
73	000859	国风塑业	2,640,851.35	2.69
74	600476	湘邮科技	2,604,290.67	2.66
75	600369	西南证券	2,602,195.84	2.66
76	600975	新五丰	2,580,065.48	2.63
77	002427	尤夫股份	2,579,225.18	2.63

78	603008	喜临门	2,573,480.46	2.63
79	000721	西安饮食	2,556,033.74	2.61
80	002609	捷顺科技	2,555,840.28	2.61
81	002343	禾欣股份	2,513,431.03	2.56
82	002434	万里扬	2,502,582.96	2.55
83	002247	帝龙新材	2,484,078.00	2.53
84	600783	鲁信创投	2,474,481.22	2.52
85	000595	西北轴承	2,466,478.03	2.52
86	600559	老白干酒	2,453,106.80	2.50
87	000591	桐君阁	2,411,230.52	2.46
88	002143	高金食品	2,403,157.25	2.45
89	000997	新大陆	2,368,688.00	2.42
90	002124	天邦股份	2,331,772.25	2.38
91	002379	鲁丰环保	2,265,617.33	2.31
92	600066	宇通客车	2,260,492.41	2.31
93	600573	惠泉啤酒	2,241,145.82	2.29
94	002284	亚太股份	2,214,669.01	2.26
95	600370	三房巷	2,169,801.28	2.21
96	600676	交运股份	2,146,823.77	2.19
97	600212	江泉实业	2,094,738.00	2.14
98	600346	大橡塑	2,074,454.00	2.12
99	000929	兰州黄河	2,064,853.69	2.11
100	600118	中国卫星	2,051,730.33	2.09
101	000821	京山轻机	2,046,579.00	2.09
102	002370	亚太药业	2,039,305.32	2.08
103	600527	江南高纤	2,023,600.00	2.06
104	600702	沱牌舍得	2,005,543.03	2.05
105	600763	通策医疗	1,995,067.00	2.04
106	002027	七喜控股	1,993,393.52	2.03

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	002199	东晶电子	7,882,777.63	8.04

2	000034	深信泰丰	5,431,128.50	5.54
3	000957	中通客车	5,342,561.43	5.45
4	600837	海通证券	5,231,336.29	5.34
5	002171	精诚铜业	4,998,142.67	5.10
6	600243	青海华鼎	4,909,490.03	5.01
7	000796	易食股份	4,792,757.10	4.89
8	600962	国投中鲁	4,442,218.43	4.53
9	600529	山东药玻	4,408,203.40	4.50
10	002363	隆基机械	4,293,966.56	4.38
11	000702	正虹科技	4,220,013.27	4.31
12	601008	连云港	4,205,220.53	4.29
13	002613	北玻股份	4,087,274.50	4.17
14	000564	西安民生	4,072,649.12	4.16
15	600706	曲江文旅	3,840,918.16	3.92
16	002279	久其软件	3,744,646.44	3.82
17	002351	漫步者	3,719,549.91	3.80
18	000952	广济药业	3,600,530.07	3.67
19	000415	渤海租赁	3,547,836.13	3.62
20	002184	海得控制	3,542,988.29	3.62
21	002609	捷顺科技	3,499,835.55	3.57
22	002434	万里扬	3,495,316.05	3.57
23	000596	古井贡酒	3,475,934.92	3.55
24	002169	智光电气	3,448,833.85	3.52
25	002134	天津普林	3,401,058.51	3.47
26	002066	瑞泰科技	3,373,034.48	3.44
27	600302	标准股份	3,365,912.53	3.43
28	600809	山西汾酒	3,354,701.35	3.42
29	002633	申科股份	3,300,390.03	3.37
30	000929	兰州黄河	3,265,455.49	3.33
31	600477	杭萧钢构	3,206,844.46	3.27
32	601009	南京银行	3,175,289.42	3.24
33	000785	武汉中商	3,129,209.58	3.19
34	002105	信隆实业	3,125,025.73	3.19
35	000020	深华发A	3,123,600.82	3.19
36	002295	精艺股份	3,101,351.04	3.16
37	000524	东方宾馆	3,069,783.70	3.13

38	000586	汇源通信	3,065,074.78	3.13
39	002365	永安药业	3,034,372.75	3.10
40	000711	天伦置业	2,992,873.60	3.05
41	601677	明泰铝业	2,989,354.08	3.05
42	600355	精伦电子	2,983,831.27	3.04
43	000597	东北制药	2,979,053.69	3.04
44	002417	三元达	2,946,184.99	3.01
45	002462	嘉事堂	2,943,661.89	3.00
46	002455	百川股份	2,920,075.13	2.98
47	000546	光华控股	2,919,880.94	2.98
48	600369	西南证券	2,908,025.77	2.97
49	600159	大龙地产	2,889,230.08	2.95
50	600559	老白干酒	2,821,737.77	2.88
51	000859	国风塑业	2,813,807.03	2.87
52	600833	第一医药	2,812,494.50	2.87
53	002449	国星光电	2,805,096.37	2.86
54	000721	西安饮食	2,799,247.40	2.86
55	002143	高金食品	2,793,271.08	2.85
56	002247	帝龙新材	2,792,276.65	2.85
57	000923	河北宣工	2,777,149.20	2.83
58	600199	金种子酒	2,773,702.51	2.83
59	002427	尤夫股份	2,746,015.41	2.80
60	002107	沃华医药	2,679,767.43	2.73
61	000919	金陵药业	2,677,044.55	2.73
62	600629	棱光实业	2,651,002.77	2.70
63	002124	天邦股份	2,650,449.19	2.70
64	002284	亚太股份	2,628,299.33	2.68
65	000037	深南电A	2,614,406.45	2.67
66	000595	西北轴承	2,596,902.50	2.65
67	002235	安妮股份	2,554,546.17	2.61
68	600131	岷江水电	2,524,640.96	2.58
69	002379	鲁丰环保	2,516,720.23	2.57
70	000997	新大陆	2,471,437.02	2.52
71	600215	长春经开	2,468,602.04	2.52
72	600233	大杨创世	2,434,004.80	2.48
73	002331	皖通科技	2,427,674.25	2.48



74	002132	恒星科技	2,426,965.64	2.48
75	600676	交运股份	2,386,667.41	2.44
76	600066	宇通客车	2,356,883.85	2.40
77	600573	惠泉啤酒	2,310,086.92	2.36
78	000591	桐君阁	2,292,894.72	2.34
79	002370	亚太药业	2,253,648.12	2.30
80	002228	合兴包装	2,215,180.63	2.26
81	002020	京新药业	2,212,760.51	2.26
82	600666	西南药业	2,202,757.03	2.25
83	000821	京山轻机	2,178,630.01	2.22
84	600480	凌云股份	2,159,936.97	2.20
85	601000	唐山港	2,154,461.62	2.20
86	002280	新世纪	2,140,250.28	2.18
87	002189	利达光电	2,124,526.16	2.17
88	002313	日海通讯	2,120,199.62	2.16
89	600513	联环药业	2,093,653.03	2.14
90	002388	新亚制程	2,090,970.71	2.13
91	600969	郴电国际	2,083,937.97	2.13
92	002027	七喜控股	2,076,246.61	2.12
93	000609	绵世股份	2,075,801.07	2.12
94	000990	诚志股份	2,066,238.11	2.11
95	600527	江南高纤	2,054,324.92	2.10
96	601633	长城汽车	2,044,160.22	2.09
97	000980	金马股份	2,038,229.41	2.08
98	002217	联合化工	2,034,372.64	2.08
99	002119	康强电子	2,027,812.06	2.07
100	600297	美罗药业	1,993,253.55	2.03
101	002127	*ST新民	1,977,885.20	2.02
102	600212	江泉实业	1,971,818.95	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	684,587,816.01
卖出股票的收入（成交）总额	708,204,447.52

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序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序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 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 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

本基金本报告期末未持有权证。

#### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货。

#### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

#### 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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。

#### 8.12.3 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	40,390.13
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	3,048.60
5	应收申购款	101,956.67
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	145,395.40

#### 8.12.4 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。

#### 8.12.5 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。

#### 8.12.6 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
2,363	50,395.71	20,000,400.00	16.80%	99,084,671.97	83.20%

### 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
基金管理人所有从业人员持有本基金	268,572.77	0.23%

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	138,508,302.11
本报告期基金总申购份额	14,303,984.19
减：本报告期基金总赎回份额	33,727,214.33
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	119,085,071.97

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开本基金的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，本基金管理人聘请宋小龙先生担任公司副总经理，并于2013年1月5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

本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

### 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4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		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安	1	499,716,909.37	35.88%	452,156.21	35.80%	-
长江证券	1	479,400,705.11	34.42%	436,445.88	34.55%	-
华创证券	1	413,674,649.05	29.70%	374,573.42	29.65%	-

注：1、本期租用证券公司交易单元的变更情况。

本报告期内本基金租用证券公司的交易单元没有变更。

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

二〇一四年三月二十九日