

## 长信中短债证券投资基金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：中国邮政储蓄银行股份有限公司

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、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。

基金托管人中国邮政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、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	长信中短债债券
基金主代码	519985
交易代码	519985
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年6月28日
基金管理人	长信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	38,262,744.56
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金把投资组合的久期控制在三年以内，在追求本金安全和保持基金资产流动性的基础上，力争实现超越比较基准的投资收益。
投资策略	本基金为中短债基金，采用积极管理型的投资策略，将投资组合的久期控制在三年以内，在控制利率风险、尽量降低基金净值波动风险并满足流动性的前提下，提高基金收益率。
业绩比较基准	三年期银行定期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金，属于低风险的基金品种。

### 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	中国邮政储蓄银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周永刚	胡涛
	联系电话	021-61009999	010-68858112
	电子邮箱	zhouyg@cxfund.com.cn	hutao@psbcoa.com.cn
客户服务电话		4007005566	95580
传真		021-61009800	010-68858120

## 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、北京市西城区金融大街3号A座

### § 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	7,340,010.85	10,228,839.66	7,002,208.56
本期利润	4,997,162.75	15,700,267.39	4,955,054.26
加权平均基金份额本期利润	0.0279	0.0637	0.0091
本期基金份额净值增长率	1.42%	7.37%	-0.06%
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	0.0667	0.0444	0.0061
期末基金资产净值	41,949,508.26	322,714,684.23	129,565,391.94
期末基金份额净值	1.0964	1.0811	1.0069

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。

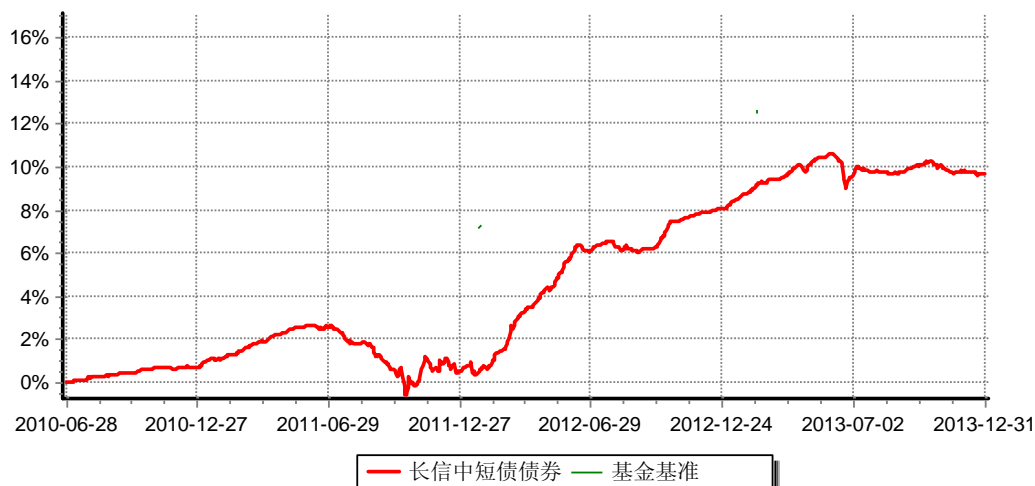
#### 3.2 基金净值表现

##### 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	-0.37%	0.04%	1.09%	0.00%	-1.46%	0.04%
过去六个月	0.16%	0.04%	2.20%	0.00%	-2.04%	0.04%
过去一年	1.42%	0.06%	4.40%	0.00%	-2.98%	0.06%
过去三年	8.82%	0.08%	14.83%	0.00%	-6.01%	0.08%
自基金合同生效日起至今（2010	9.64%	0.07%	16.96%	0.00%	-7.32%	0.07%

年6月28日至2013 年12月31日)						
-------------------------	--	--	--	--	--	--

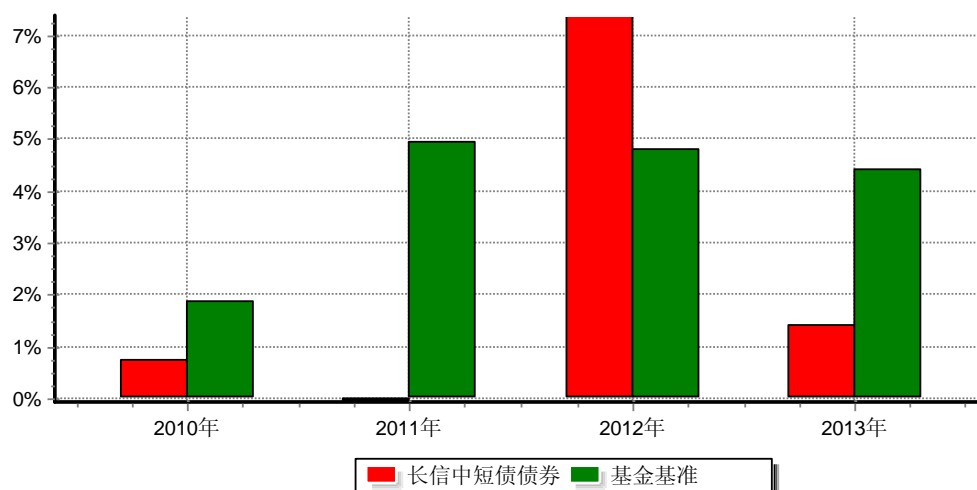
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、图示日期为2010年6月28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，本基金各项投资比例已符合基金合同的约定。

### 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：2010年计算期间为自基金合同生效日2010年6月28日至2010年12月31日，基金运作时间未滿一年，净值增长率按本基金实际存续期计算。

### 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		
张文珺	本基金的基金经理、长信利鑫分级债券型证券投资基金和长信利息收益开放式证券投资基金的基金经理、固定收益部副总监	2010年6月28日	—	19年	高级工商管理硕士，上海财经大学EMBA毕业，具有基金从业资格。曾任湖北证券公司交易一部交易员、长江证券有限责任公司资产管理事业部主管、债券事业总部投资部经理、固定收益总部交易部经理。2004年9月加入长信基金管理有限责任公司，历任长信利息收益基金交易员、基金经理助理。现任固定收益部副总监、本基金、长信利鑫分级债券型证券投资基金和长信利息收益开放式证券投资基金的基金经



					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遵规守信情况的说明

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 年一季度，债券市场主要受资金面影响震荡波动，在流动性宽松及经济下行预期的推动下，债券市场延续牛市格局，无论是息差收入还是估值变动收益均丰厚。2013 年二季度债券市场资金面出现了空前的紧张局面，收益曲线形态跌宕起伏。特别是 4 月份，市场氛围开始改变，债券监管风暴及资金面的收紧，令市场走势出现方向性变化，市场由多转空。2013 年第三季度的债市延续了 620 “钱荒” 期间以来的调整格局，收益率曲线整体上行，尤其中长端上行幅度

较大，债券收益率出现系统性重估。2013 年四季度，央行维持资金面紧平衡的态度更加明确，债券市场再次恐慌性下跌。

2013 年一季度我们跟随市场和规模变化，增持了部分利率品种，基金净值保持了较好回报。2013 年二季度后，基金规模的变动较大，同时市场价格下挫，我们相应减少了债券低等级信用仓位，以达到组合对投资流动性日益提高的要求。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2013 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.0964 元，份额累计净值为 1.0964 元。本报告期内本基金净值增长率为 1.42%，同期业绩比较基准收益率为 4.40%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2014 年全球经济预期会出现弱而稳定的复苏。以美国为代表的发达经济体复苏的趋势已经形成，全球流动性收缩成为影响 2014 年债券市场的主要因素之一。2014 年中国新一轮经济体制改革是重点，一系列相关措施将围绕利率市场化、货币国际化、国际资本化等展开。预期国内宏观经济中出口前景相对改善，房地产和基建投资受政策影响投资缓慢回落，整体消费保持平稳，总体经济可能呈现稳中趋降的态势。CPI 相对稳定，货币政策将继续执行稳健的货币政策，预计只有在宏观经济出现严重下行风险时，央行才有可能放松货币政策。

我们将采取谨慎的态度进行投资，积极防范流动性风险，密切关注国内外经济局势变化，需要重点规避信用风险，努力抓住市场结构性机会和波段行情。在基金的日常投资中，将继续秉承诚信、专业、负责的精神，密切关注政策节奏，更好地把握投资机会，争取为基金份额持有人谋求最大利益。

#### 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、收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记结算机构可将投资者的现金红利按除息日除权后的基金份额净值自动转为基金份额；

4、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12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50%，若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配；

5、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；

6、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；

7、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；

8、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

基金托管人依据《长信中短债证券投资基金基金合同》与《长信中短债证券投资基金托管协议》，自2010年6月28日起托管长信中短债证券投资基金（以下简称本基金）的全部资产。

本报告期内，本托管人严格遵守《证券投资基金法》及其他相关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本报告期内，本托管人依据国家相关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内，本基金未进行利润分配。

### 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

本托管人认真复核了本年度报告中的财务指标、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，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 审计报告

本报告期本基金2013年度财务报告经毕马威华振会计师事务所审计,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1400172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：长信中短债证券投资基金

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	6,202,904.64	171,303,779.84
结算备付金	35,612.43	599,163.15
存出保证金	8,370.89	250,000.00
交易性金融资产	37,026,978.40	259,388,943.50
其中：股票投资	—	—
基金投资	—	—
债券投资	37,026,978.40	259,388,943.50
资产支持证券投资	—	—
贵金属投资	—	—
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	720,266.10	7,243,339.84
应收股利	—	—
应收申购款	36,400.00	4,378,037.42
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	44,030,532.46	443,163,263.75
<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	—	107,482,323.70



应付证券清算款	—	10,016,100.00
应付赎回款	1,115,529.02	1,473,501.58
应付管理人报酬	21,447.16	198,615.51
应付托管费	7,798.97	72,223.83
应付销售服务费	11,698.43	108,335.73
应付交易费用	6,462.09	14,401.10
应交税费	462,569.70	344,364.92
应付利息	—	138,914.60
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	455,518.83	599,798.55
负债合计	2,081,024.20	120,448,579.52
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	38,262,744.56	298,501,633.20
未分配利润	3,686,763.70	24,213,051.03
所有者权益合计	41,949,508.26	322,714,684.23
负债和所有者权益总计	44,030,532.46	443,163,263.75

注：报告截止日2013年12月31日，基金份额净值1.0964元，基金份额总额38,262,744.56份。

## 7.2 利润表

会计主体：长信中短债证券投资基金

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>	9,955,239.86	22,374,987.56
1. 利息收入	10,438,533.19	15,680,077.94
其中：存款利息收入	1,752,494.48	4,010,745.26
债券利息收入	7,867,148.22	11,544,819.41
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	818,890.49	124,513.27
其他利息收入	—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）	1,859,554.77	1,223,481.89

其中：股票投资收益	—	—
基金投资收益	—	—
债券投资收益	1,859,554.77	1,223,481.89
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	—	—
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-2,342,848.10	5,471,427.73
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	—	—
<b>减：二、费用</b>	<b>4,958,077.11</b>	<b>6,674,720.17</b>
1. 管理人报酬	1,092,302.28	1,412,368.62
2. 托管费	397,200.78	513,588.63
3. 销售服务费	595,801.27	770,382.79
4. 交易费用	19,565.03	19,976.04
5. 利息支出	2,476,807.75	3,586,895.90
其中：卖出回购金融资产支出	2,476,807.75	3,586,895.90
6. 其他费用	376,400.00	371,508.19
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>4,997,162.75</b>	<b>15,700,267.39</b>
减：所得税费用	—	—
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>4,997,162.75</b>	<b>15,700,267.39</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长信中短债证券投资基金

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）	298,501,633.20	24,213,051.03	322,714,684.23
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	4,997,162.75	4,997,162.75

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）	-260,238,888.64	-25,523,450.08	-285,762,338.72
其中：1. 基金申购款	1,428,357,083.77	135,220,956.21	1,563,578,039.98
2. 基金赎回款	-1,688,595,972.41	-160,744,406.29	-1,849,340,378.70
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）	38,262,744.56	3,686,763.70	41,949,508.26
<b>项目</b>	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）	128,671,526.26	893,865.68	129,565,391.94
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	15,700,267.39	15,700,267.39
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）	169,830,106.94	7,618,917.96	177,449,024.90
其中：1. 基金申购款	2,806,912,785.16	149,725,122.64	2,956,637,907.80
2. 基金赎回款	-2,637,082,678.22	-142,106,204.68	-2,779,188,882.90
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）	298,501,633.20	24,213,051.03	322,714,684.23

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  
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

长信中短债证券投资基金(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”)《关于核准长信中短债证券投资基金募集的批复》(证监许可【2010】481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《长信中短债证券投资基金基金合同》发售,基金合同于2010年6月28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,基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司(以下简称“中国邮储银行”)。

本基金于2010年5月24日至2010年6月23日募集,募集资金总额人民币2,233,385,241.05元,利息转份额人民币875,287.14元,募集规模为2,234,260,528.19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3568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、《长信中短债证券投资基金基金合同》和《长信中短债证券投资基金招募说明书(更新)》的有关规定,本基金投资范围为具有良好流动性的固定收益类金融工具,包括国内依法发行上市的国债、金融债、公司债、企业债、短期融资券、政府机构债、央行票据、回购、可转债(不包括分离交易可转债)以及中国证监会允许基金投资的其他固定收益类金融工具。本基金对可转债的投资仅限于可转债的申购,且申购获得的可转债不得转换成股票。本基金投资组合资产类别配置的基本范围为:债券类金融工具的投资比例不低于基金资产的80%;剩余期限在三百九十七天以内的债券、现金和剩余期限在十四天以内的回购余额不低于基金资产净值的20%;现金以及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为三年期银行定期存款税后利率。

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。

#### 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

本基金在本年度未发生重大会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本年度未发生重大会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本年度未发生重大会计差错。

#### 7.4.6 税项

##### 7.4.6.1 本基金适用的主要税项

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》、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) 基金买卖债券的投资收益暂免征收营业税和企业所得税。
- (3) 对基金取得的债券的利息收入，由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。
- (4) 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。

#### 7.4.6.2 应交税费

单位：人民币元

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	462,569.70	344,364.92

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
中国邮储银行	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

本基金本报告期及上年度可比期间没有通过关联方交易单元进行的股票交易。

##### 7.4.8.1.2 债券交易

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	66,577,542.71	54.92%	217,649,586.08	87.26%

#### 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 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	284,300,000.00	56.34%	733,100,000.00	57.89%

#### 7.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间没有通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间没有应支付关联方的佣金。

#### 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	1,092,302.28	1,412,368.62
其中：支付销售机构的客户维护费	308,677.20	426,401.57

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0.55%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×0.55%/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	397,200.78	513,588.63
--------------------	------------	------------

注：支付基金托管人中国邮储银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.20%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×0.20%/当年天数

#### 7.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	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
	当期发生的基金应支付的 销售服务费	当期发生的基金应支付的 销售服务费
中国邮政储蓄银行股份有限公司	143,271.71	201,885.72
长信基金管理有限责任公司	84,232.32	20,347.92
长江证券股份有限公司	1,154.93	217.04
合计	228,658.96	222,450.68

注：销售机构的销售服务费用按前一日的基金资产净值的0.30%年费率逐日计提，按月支付。

计算公式为：日基金销售服务费=前一日基金资产净值×0.30%/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

本基金本报告期及上年度可比期间没有与关联方进行银行间同业市场的债券(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

基金管理人在本报告期及上年度可比期间均未持有过本基金。

##### 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 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入



中国邮政储蓄银行股份有限公司	6,202,904.64	78,774.16	11,303,779.84	65,259.19
----------------	--------------	-----------	---------------	-----------

注：本基金通过“中国邮政储蓄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35,612.43元。（2012年：人民币599,163.15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**

本基金在本报告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**

上述关联交易均按照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，可与发行人、承销商自主约定网下配售股票的持有期限。持有期自公开发行的股票上市之日起计算。在持有期内的股票为流动受限制而不能自由转让的资产。基金通过网上申购获配的新股或认购的新发或增发债券，从新股获配日或债券成功认购日至该证券上市日期间，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。

本基金期末未因认购新发/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**

本基金期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

**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**

截至本报告期末2013年12月31日止，本基金未持有因银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

**7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购**

---

截至本报告期末2013年12月31日止，本基金未持有因交易所市场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	—	—
	其中：股票	—	—
2	固定收益投资	37,026,978.40	84.09
	其中：债券	37,026,978.40	84.09
	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	6,238,517.07	14.17
7	其他各项资产	765,036.99	1.74
8	合计	44,030,532.46	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

### 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

本基金本报告期末未持有股票。

### 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

本基金本报告期末未买入股票。

#### 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

本基金本报告期末未卖出股票。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末投资股票。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	29,886,000.00	71.24
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	7,140,978.40	17.02
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债	—	—
8	其他	—	—
9	合计	37,026,978.40	88.27

#### 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	130014	13付息国债14	300,000	29,886,000.00	71.24
2	122020	09复地债	20,000	2,004,000.00	4.78
3	122028	09华发债	20,000	2,000,000.00	4.77
4	122810	11邹平债	19,790	1,840,470.00	4.39
5	111064	11长交债	8,108	788,908.40	1.88

#### 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。

### 8.10 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持有股指期货。

### 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持有国债期货。

### 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 报告期内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 本基金本报告期末投资股票，不存在投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情形。

### 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	8,370.89
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	720,266.10
5	应收申购款	36,400.00
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	765,036.99

### 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

本基金本报告期末未持有股票。

### 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
6,746	5,671.92	837,238.75	2.19%	37,425,505.81	97.81%

### 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	9,820.29	0.03%

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。

2、期末本基金的基金经理持有该只基金份额总量的数量区间为0。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2010年6月28日)基金份额总额	2,234,260,528.19
本报告期期初基金份额总额	298,501,633.20
本报告期基金总申购份额	1,428,357,083.77
减：本报告期基金总赎回份额	1,688,595,972.41
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	38,262,744.56



## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末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，基金托管人中国邮政储蓄银行托管业务部总经理变更为胡涛先生，并已完成监管报备程序。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期没有涉及基金管理人、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60,000.00元，该审计机构为本基金提供的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、托管人及其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		应支付该券商的佣金	
		成交金额	占当期股票成交总额比例	成交金额	占当期债券成交总额比例	成交金额	占当期债券回购成交总额比例	佣金	占当期佣金总量的比例
长江证券	1	—	—	66,577,542.71	54.92%	284,300,000.00	56.34%	—	—
广发证券	1	—	—	54,638,513.46	45.08%	220,279,000.00	43.66%	—	—

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

二〇一四年三月二十九日