

## 长信金利趋势股票型证券投资基金

## [2013] 第一季度报告

基金管理人:长信基金管理有限责任公司  
基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司  
报告送出日期:2013年4月22日

## 1 重要提示

基金管理人的董事会及高级管理人员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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2013年4月19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，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年1月1日起至2013年3月31日止。

## 2 基金产品概况

基金简称:长信金利趋势股票

基金主代码:519989

交易代码:前端:519995 后端:519994

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2006年4月30日

报告期末基金份额总额:9,304,505,680.05份

投资目标:本基金在有效控制风险的前提下精选受益于城市化、工业化和老龄化各个中国趋势点的持续增长的上市公司股票主动投资，追求基金资产的长期稳定增值。本基金选择投资的上市公司股票包括价值股和成长股，股票选择是基于中国趋势点分析，品质分析和持续增长分析等不同的方面深入分析。

投资策略:本基金采用“自上而下”的主动投资管理策略，在充分研究中国经济增长趋势、中国趋势点和资本市场发展趋势的基础上，深入分析受益于中国趋势点的持续增长的上市公司股票选择是基于中国趋势点分析，品质分析和持续增长分析等不同的方面深入分析。

业绩比较基准:上证A股指数×70%+中信标普国债指数×30%

风险收益特征:本基金为股票型基金，属于预期收益和预期风险较高的风险品种。

基金管理人:长信基金管理有限责任公司

基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

报告期(2013年1月1日-2013年3月31日) 单位:人民币元

1.本期已实现收益 -124,516,529.77

2.本期利润 -327,344,757.75

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0347

4.期末基金份额净值 5,755,212,938.79

5.期末基金资产净值 0.6185

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(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.所列数据不包括持有人认购或交易基金的费用(例如，申购或赎回基金的交易佣金、开放式基金的申购费用、红利再投资费用、基金转换费用等)，计入费用后实际收益水平将低于所列数据。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本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 净值增长率(%) 业绩比较基准(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -5.50% 1.66% -0.91% 1.00% -4.59% 0.66%

3.2.2 本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2006年4月30日至2013年3月31日。

2.按基金合同规定，本基金管理人应当自基金合同生效之日起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，股票类资产占基金总资产的比例为60%-95%，债券类资产占基金总资产净值比例为0-35%；货币市场工具占基金总资产净值比例为5%-15%。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理 或基金经理小组简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期间 证券从业年限 离任日期 说明

宋小丽 公司副总经理、本基金的基金经理 2013年2月5日 - 14年 理学硕士，北京大学计算机软件与理论专业毕业，具有基金从业资格。曾任北京大学公司项目经理、长信基金管理有限公司项目经理、行业研究员、基金经理及权益投资部总经理。2010年1月加入长信基金管理有限公司，担任长信基金管理有限公司副总经理，兼任本基金的基金经理。

胡志军 公司投资总监、长信增利趋势股票型证券投资基金和本基金的基金经理 2012年10月27日 - 15年 经济学硕士，南京大学国际贸易专业研究生毕业，具有基金从业资格。曾先后任中国国泰君安证券股份有限公司资产管理部高级经理、公司项目部经理、行业研究员、基金经理及权益投资部总经理。2006年5月加入长信基金管理有限公司，担任长信基金管理有限公司副总经理，兼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起为准；新增或变更基金经理变更后基金经理的公告披露日期为准。

2.基金经理的证券从业年限以基金经理进入证券行业相关机构的工作经历为时间计算标准。

3.2.2 本基金合同规定的前十名股票中，不存在超出基金合同规定的备选股票库的情形。

3.2.3 其他资产构成

序号 名称 金额(元)

1 存出保证金 2,745,116.06

2 应收证券清算款 10,895,646.53

3 应收股利 -

4 应收利息 9,510,666.98

5 应收申购款 121,275.35

6 其他应收款 -

7 持待费用 -

8 其他 -

9 合计 449,420,000.00

5.5 报告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

序号 债券代码 债券名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 120409 12农发09 2,000,000 199,520,000.00 3.47

2 130201 13国开01 1,000,000 99,960,000.00 1.74

3 1001037 10农票037 500,000 49,990,000.00 0.87

4 1001042 10央行票042 500,000 49,985,000.00 0.87

5 1001060 10央行票06 500,000 49,965,000.00 0.87

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名资产支持证券投资明细

序号 债券代码 债券名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 1494000 平安银行 16,954,584 341,126,230.08 5.93

2 601998 中信银行 60,828,321 284,068,259.07 4.94

3 002428 云南锗业 10,009,690 252,244,188.00 4.38

4 000660 中金岭南 27,850,349 250,931,644.49 4.36

5 000501 鄂武商A 23,759,364 247,099,385.60 4.29

6 600266 北京城建 21,013,779 246,491,627.67 4.28

7 601688 华泰证券 25,886,594 245,924,106.00 4.27

8 000807 云铝股份 47,700,543 236,594,693.28 4.11

9 002223 信邦医疗 13,348,548 230,128,967.52 4.00

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资明细

序号 证券代码 证券名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 1494000 平安银行 1,000,000 2,000,000.00 0.04

2 200428 云南锗业 1,000,000 1,998,000.00 0.04

3 000660 中金岭南 1,000,000 1,998,000.00 0.04

4 000501 鄂武商A 1,000,000 1,998,000.00 0.04

5 002223 信邦医疗 1,000,000 1,998,000.00 0.04

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名贵金属投资情况说明

序号 证券代码 证券名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 1494000 平安银行 1,000,000 1,998,000.00 0.04

2 200428 云南锗业 1,000,000 1,998,000.00 0.04

3 000660 中金岭南 1,000,000 1,998,000.00 0.04

4 000501 鄂武商A 1,000,000 1,998,000.00 0.04

5 002223 信邦医疗 1,000,000 1,998,000.00 0.04

5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细

序号 证券代码 证券名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 120409 12农发09 2,000,000 199,520,000.00 3.47

2 130201 13国开01 1,000,000 99,960,000.00 1.74

3 1001037 10农票037 500,000 49,990,000.00 0.87

4 1001042 10央行票042 500,000 49,985,000.00 0.87

5 1001060 10央行票06 500,000 49,965,000.00 0.87

5.10 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资组合情况

序号 债券代码 债券名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 120409 12农发09 2,000,000 199,520,000.00 3.47

2 130201 13国开01 1,000,000 99,960,000.00 1.74

3 1001037 10农票037 500,000 49,990,000.00 0.87

4 1001042 10央行票042 500,000 49,985,000.00 0.87

5 1001060 10央行票06 500,000 49,965,000.00 0.87

5.11 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资组合情况

序号 证券代码 证券名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 1494000 平安银行 1,000,000 1,998,000.00 0.04

2 200428 云南锗业 1,000,000 1,998,000.00 0.04

3 000660 中金岭南 1,000,000 1,998,000.00 0.04

4 000501 鄂武商A 1,000,000 1,998,000.00 0.04

5 002223 信邦医疗 1,000,000 1,998,000.00 0.04

5.12 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资组合情况

序号 证券代码 证券名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 120409 12农发09 2,000,000 199,520,000.00 3.47

2 130201 13国开01 1,000,000 99,960,000.00 1.74

3 1001037 10农票037 500,000 49,990,000.00 0.87

4 1001042 10央行票042 500,000 49,985,000.00 0.87

5 1001060 10央行票06 500,000 49,965,000.00 0.87