

长信利丰债券型证券投资基金

2013 年 半 年 度 报 告 摘 要

本基金本报告期及上年度可比期间均无应付关联方交易单元的佣金。

6.4.7.2 关联方报酬
6.4.7.2.1 基金管理费

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6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,076,874.48	496,783.30	
其中:支付销售机构的客户维护费	175,081.40	83,968.05	

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基金资产净值0.70%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。
计算公式为:基金管理人前一基金资产净值×0.70%÷当年天数

6.4.7.2.2 基金托管费

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6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	307,678.40	141,938.10	

注:支付基金托管人中国农业银行股份有限公司的基金托管费按前一基金资产净值0.20%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

计算公式为:基金托管费=前一基金资产净值×0.20%÷当年天数

6.4.7.2.3 销售服务费

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6月30日
当期发生的基金应支付的销售服务费	244,272.43	244,272.43	

注:本基金管理人长信基金管理有限责任公司为基金管理人报酬按前一基金资产净值0.40%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。
计算公式为:基金管理人前一基金资产净值×0.40%÷当年天数

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6月30日
当期发生的基金应支付的销售服务费	140,956.37	140,956.37	

注:支付各关联方的销售服务费按前一基金资产净值0.40%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

计算公式为:基金销售服务费=前一基金资产净值×0.40%÷当年天数

6.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券交易

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6月30日
银行间市场交易的各关联方名称	基金买入	基金卖出	交易金额
中国工商银行	-	-	-

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6月30日
银行间市场交易的各关联方名称	基金买入	基金卖出	交易金额
中国工商银行	9,834,733.88	-	-

6.4.7.4 各关联方投资本基金的情况
6.4.7.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.7.4.2 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.7.4.3 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.7.5 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.7.6 本基金在承销期前参与关联方承销的情况
6.4.7.7 本基金在承销期前参与关联方承销的情况

6.4.7.8 本基金在承销期前参与关联方承销的情况

6.4.7.9 本基金在承销期前参与关联方承销的情况

6.4.7.10 本基金在承销期前参与关联方承销的情况

6.4.7.11 本基金在承销期前参与关联方承销的情况

6.4.7.12 本基金在承销期前参与关联方承销的情况

6.4.7.13 本基金在承销期前参与关联方承销的情况

6.4.7.14 本基金在承销期前参与关联方承销的情况

6.4.7.15 本基金在承销期前参与关联方承销的情况

6.4.7.16 本基金在承销期前参与关联方承销的情况

6.4.7.17 本基金在承销期前参与关联方承销的情况

6.4.7.18 本基金在承销期前参与关联方承销的情况

6.4.7.19 本基金在承销期前参与关联方承销的情况

6.4.7.20 本基金在承销期前参与关联方承销的情况

6.4.7.21 本基金在承销期前参与关联方承销的情况

6.4.7.22 本基金在承销期前参与关联方承销的情况

6.4.7.23 本基金在承销期前参与关联方承销的情况

6.4.7.24 本基金在承销期前参与关联方承销的情况

6.4.7.25 本基金在承销期前参与关联方承销的情况

6.4.7.26 本基金在承销期前参与关联方承销的情况

6.4.7.27 本基金在承销期前参与关联方承销的情况

6.4.7.28 本基金在承销期前参与关联方承销的情况

6.4.7.29 本基金在承销期前参与关联方承销的情况

6.4.7.30 本基金在承销期前参与关联方承销的情况

6.4.7.31 本基金在承销期前参与关联方承销的情况

6.4.7.32 本基金在承销期前参与关联方承销的情况

6.4.7.33 本基金在承销期前参与关联方承销的情况

6.4.7.34 本基金在承销期前参与关联方承销的情况

6.4.7.35 本基金在承销期前参与关联方承销的情况

6.4.7.36 本基金在承销期前参与关联方承销的情况

6.4.7.37 本基金在承销期前参与关联方承销的情况

6.4.7.38 本基金在承销期前参与关联方承销的情况

6.4.7.39 本基金在承销期前参与关联方承销的情况

6.4.7.40 本基金在承销期前参与关联方承销的情况

6.4.7.41 本基金在承销期前参与关联方承销的情况

6.4.7.42 本基金在承销期前参与关联方承销的情况

6.4.7.43 本基金在承销期前参与关联方承销的情况

6.4.7.44 本基金在承销期前参与关联方承销的情况

6.4.7.45 本基金在承销期前参与关联方承销的情况

6.4.7.46 本基金在承销期前参与关联方承销的情况

6.4.7.47 本基金在承销期前参与关联方承销的情况

6.4.7.48 本基金在承销期前参与关联方承销的情况

6.4.7.49 本基金在承销期前参与关联方承销的情况

注:本期“买入卖出金额”均按买卖成交金额(成交金额×净价)以成交数量(顺列,不考虑其它交易费用)。

7.4.2 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	600332	广州药业	26,534,137.11	28.37
2	600887	伊利股份	21,827,325.31	23.34
3	600597	光明乳业	15,917,318.80	17.02
4	300155	安居宝	11,798,228.47	12.61
5	002273	水晶光电	11,049,065.89	11.81
6	600557	康缘药业	9,897,892.79	10.58
7	300168	万达信息	9,871,072.92	10.55
8	300229	拓尔思	8,442,498.63	9.03
9	000848	承德露露	8,272,264.05	8.84
10	300054	鼎龙股份	7,455,847.77	7.97
11	600702	华信金得	7,233,410.00	7.73
12	000559	万向钱潮	7,048,212.65	7.54
13	000768	中航飞机	6,960,957.14	7.44
14	300355	蒙草抗旱	6,467,742.21	6.92
15	002003	以岭药业	6,419,105.49	6.86
16	000012	南 玻 A	6,169,962.32	6.60
17	300146	汤臣倍健	5,718,400.82	6.11
18	002407	多美多	5,371,492.50	5.74
19	002007	华兰生物	5,309,467.35	5.68
20	300348	长亮科技	5,241,936.13	5.60
21	600497	驰源环保	4,806,723.72	5.14
22	000999	华润三九	4,739,585.23	5.07
23	002013	中航精机	4,724,227.32	5.05
24	002410	广联达	4,259,018.43	4.55
25	002570	贝因美	4,103,782.40	4.39
26	300177	中海达	3,993,993.20	4.27
27	300015	爱尔眼科	3,847,137.63	4.11
28	002568	百润股份	3,806,618.80	4.07
29	601377	兴业证券	3,806,381.76	4.07
30	000960	锡业股份	3,736,920.88	4.00
31	000046	泛海建设	3,729,401.76	3.99
32	600073	上海梅林	3,514,146.46	3.76
33	000413	宝 石 A	3,438,962.62	3.68
34	000631	顺发恒业	3,349,211.35	3.58
35	300026	红日药业	3,181,131.36	3.40
36	002091	江苏国泰	2,899,657.19	3.10
37	300101	国锐电子	2,793,840.58	2.99
38	300246	宝莱特	2,763,732.73	2.92
39	300182	捷成股份	2,743,211.69	2.93
40	000895	双环发展	2,427,914.00	2.60
41	300245	天玑科技	2,362,816.36	2.53
42	300037	新宙斯	2,302,208.00	2.46
43	002484	江淮股份	2,071,843.62	2.22
44	600062	华润双鹤	2,038,193.00	2.18
45	000630	铜陵有色	1,936,110.00	2.07
46	600763	通策医疗	1,875,600.00	2.01

注:本期“买入卖出金额”均按买卖成交金额(成交金额×净价)以成交数量(顺列,不考虑其它交易费用)。

7.4.3 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	326,607,362.70
卖出股票的收入(成交)总额	310,413,326.72

注:本期“买入卖出金额”均按买卖成交金额(成交金额×净价)以成交数量(顺列,不考虑其它交易费用)。

7.5 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	-	-
2	央行票据	9,974,000.00	4.60
3	金融债券	50,225,000.00	23.16
其中:政策性金融债	50,225,000.00	23.16	
4	企业债券	93,932,356.64	43.61
5	企业中期票据	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	37,444,920.00	17.27
8	其他	191,576,276.64	88.34

7.6 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

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
1	130203	13国债03	500,000	50,225,000.00
2	113003	重工转债	100,000	10,932,000.00
3	1280183	12鄂州城投债	100,000	10,176,000.00
4	1180041	11太债债	100,000	10,122,000.00
5	1380063	13德清债	100,000	10,102,000.00

7.7 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

7.8 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

7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况的说明

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况的说明

7.10.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行人主体没有被监管部门立案调查,在报告编制日前一年内也没有受到公开谴责、处罚。

7.10.2 本基金投资前十名股票中,不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.10.3 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	15,960.79
2	应收证券清算款	8,858,624.70
3	应收利息	-
4	应收股利	3,409,006.79
5	应收申购款	1,075,893.80
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,498,486.08

7.10.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元			
序号	债券代码	债券名称	公允价值
1	113003	重工转债	10,932,000.00
2	110018	国电转债	8,598,400.00
3	110011	国华转债	5,578,670.00
4	110016	川投转债	3,624,000.00
5	110015	石化转债	2,994,600.00

7.10.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元				
序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	000999	华润三九	3,142,245.60	1.45

7.10.6 报告期末本基金持有的其他文字描述部分

7.10.7 报告期末本基金持有的其他文字描述部分

7.10.8 报告期末本基金持有的其他文字描述部分

7.10.9 报告期末本基金持有的其他文字描述部分

7.10.10 报告期末本基金持有的其他文字描述部分

7.10.11 报告期末本基金持有的其他文字描述部分

7.10.12 报告期末本基金持有的其他文字描述部分

7.10.13 报告期末本基金持有的其他文字描述部分

7.10.14 报告期末本基金持有的其他文字描述部分

7.10.15 报告期末本基金持有的其他文字描述部分

7.10.16 报告期末本基金持有的其他文字描述部分

7.10.17 报告期末本基金持有的其他文字描述部分

7.10.18 报告期末本基金持有的其他文字描述部分

7.10.19 报告期末本基金持有的其他文字描述部分

7.10.20 报告期末本基金持有的其他文字描述部分

7.10.21 报告期末本基金持有的其他文字描述部分

7.10.22 报告期末本基金持有的其他文字描述部分

7.10.23 报告期末本基金持有的其他文字描述部分

7.10.24 报告期末本基金持有的其他文字描述部分

7.10.25 报告期末本基金持有的其他文字描述部分

7.10.26 报告期末本基金持有的其他文字描述部分

7.10.27 报告期末本基金持有的其他文字描述部分

7.10.28 报告期末本基金持有的其他文字描述部分

7.10.29 报告期末本基金持有的其他文字描述部分

7.10.30 报告期末本基金持有的其他文字描述部分

7.10.31 报告期末本基金持有的其他文字描述部分

7.10.32 报告期末本基金持有的其他文字描述部分

7.10.33 报告期末本基金持有的其他文字描述部分

7.10.34 报告期末本基金持有的其他文字描述部分

7.10.35 报告期末本基金持有的其他文字描述部分

7.10.36 报告期末本基金持有的其他文字描述部分

7.10.37 报告期末本基金持有的其他文字描述部分

7.10.38 报告期末本基金持有的其他文字描述部分

7.10.39 报告期末本基金持有的其他文字描述部分

7.10.40 报告期末本基金持有的其他文字描述部分

7.10.41 报告期末本基金持有的其他文字描述部分

7.10.42 报告期末本基金持有的其他文字描述部分

7.10.43 报告期末本基金持有的其他文字描述部分