

信息披露| Disclosure

长信金利趋势股票型证券投资基金

[2010] 年度报告摘要

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
送出日期:2011年3月31日

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。
基金托管人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。
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。

基金过往业绩并不代表未来表现。投资人选择投资在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本年度报告摘要节选自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本基金报告期2010年1月1日起至2012月31日止。

§ 2 基金简介

基金名称	长信金利趋势股票
基金代码	519994
交易方式	519995/519994
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年04月30日
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
报告期末基金份额总额	10,419,209,781.37
基金合同存续期	不定期

2.1 基金基本情况
本基金在有效控制风险的前提下精选受益于城市化、工业化和老龄化等各中国经济持续增长的上市公司的主动投资，寻求基金资产的长期稳健增值。本基金选择投资的上市公司股票包括价值股和成长股两个方面的深入分析论。

本基金采用“自上而下”的投资管理策略，在充分研究宏观经济形势、中国股市的特点和资本市场发展趋势的基础上，深入分析研究并基于中国股市的趋势分析，选取上市的上市公司股票，以期在风险可控的前提下实现投资组合的长期增值。

上证综指指数×70%+中证债券指数×30%

本基金为股票型基金，属于股票型基金中收益较高且较为预期风险较高的品种。

2.2 基金产品说明

本基金在有效控制风险的前提下精选受益于城市化、工业化和老龄化等各中国经济持续增长的上市公司的主动投资，寻求基金资产的长期稳健增值。本基金选择投资的上市公司股票包括价值股和成长股两个方面的深入分析论。

本基金采用“自上而下”的投资管理策略，在充分研究宏观经济形势、中国股市的特点和资本市场发展趋势的基础上，深入分析研究并基于中国股市的趋势分析，选取上市的上市公司股票，以期在风险可控的前提下实现投资组合的长期增值。

本基金为股票型基金，属于股票型基金中收益较高且较为预期风险较高的品种。

2.3 基金管理人员和基金托管人

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

信息披露义务人:陈晓东 021-61009990 021-61618888

电子邮箱:zhouy@efund.com.cn shouy@spdb.com.cn

客户服务电话:4000705566 95528

传真:021-61090804 021-63602540

2.4 信息披露方式

本基金年度报告正式文本可在www.efund.com.cn 网站上查阅。

本基金年度报告备置地点:上海市银城中路68号新时代金融中心9楼,上海市中山一路12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(元)

金额单位:人民币元

3.1.1 本期年初数据和指标

2010年 2009年 2008年

本期初总资产 43,481,085.46 -1,665,191,825.16 -4,378,223,143.73

本期初总负债 -340,420,397.83 4,014,310,567.85 -9,654,963,088.53

本期初所有者净增长率为 -0.307% 0.325% -0.730%

3.1.2 期末数据和指标

2010年末 2009年末 2008年末

期末可供分配基金份额 -0.0627 -0.0675 0.0632

期末基金资产净值 8,027,883,558.32 9,280,403,995.66 6,280,723,710.47

期末基金份额净值 0.7705 0.7976 0.4805

注:1.本项已实现收益指本基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动损益)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.本基金业定期报告不包括持有人认购或交易产生的各项费用(例如,封闭式基金交易佣金、开放式基金申购或赎回费、股票型基金申购费、基金转换费等),计入后实际收益水平将低于所列数字。

3.2 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

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 (%) 阶段比较基准收益率 (%) 基准收益率差 (%) ①-③ ②-④

过去三个月 7.33% 1.25% 4.49% 1.29% 2.84% -0.04%

过去六个月 25.69% 1.21% 13.99% 1.13% 12.10% 0.08%

过去一年 -3.40% 1.32% -11.88% 1.17% 8.48% 0.15%

过去三年 -33.75% 1.90% -41.32% 1.79% 7.57% 0.11%

自基金合同生效日起至今 131.66% 1.90% 73.31% 1.75% 58.35% 0.15%

注:1.图示日期为2006年4月30日至2010年12月31日。
2.按基金合同约定,本基金管理人应自基金合同生效之日起6个月内为建仓期,建仓结束后,本基金的各项投资比例应符合基金合同约定的投资范围、资金配置比例和投资限制的规定。

3.2.2 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

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及基金经理的基本情况

长信基金管理有限公司于2006年4月30日与中国证监会签署基金销售业务资格(以下简称“基金销售业务”)合同,成为基金业协会会员,并共同设立了基金业协会,注册资本1亿元人民币,目前股权结构为:长江证券股份有限公司占49%,上海浦东发展银行股份有限公司占34.33%,武汉钢铁股份有限公司占16.67%。

4.1.2 基金经理(基金经理助理)/基金经理助理简介

姓名 职务 任职日期 离任日期 说明

付勇 副总经理、本基金的基本基金经理 2010年06月28日 - 10年

许万国 基金经理、长信基金管理有限公司中央企业100指数基金经理(LOF)的基本基金经理 2008年06月02日 - 12年

安昀 本基金基金经理助理 2010年05月11日 - 4年

注:1.自基金经理任职日期起至基金成立之日为止,新增或变更以刊登新增或变更基金经理的公告为准;任期未满的,由原基金经理继续履行职责。
2.基金业协会对基金经理的评价仅作为参考,不代表基金业协会的立场。
3.2.3 基金业协会对基金经理的评价仅作为参考,不代表基金业协会的立场。

4.2 管理人报告期内基金运作报告说明

本基金报告期内,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的利益服务,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

本基金报告期内,公司对基金的投资风格和持有的投资组合进行了调整,从而对基金的业绩产生了积极影响,使基金的净值增长率超过了同期的业绩比较基准。

4.3 管理人对报告期内基金运作的专项说明

4.3.1 公司交易行为的执行情况

本基金报告期内,严格执行公平交易制度体系,已建立投决策体系,加强交易监控和评估,对公平交易行为的监控、分析评估和及时反馈,确保公平交易制度的执行。

4.3.2 本基金组合与其他投资风格相似的组合之间的业绩比较

本基金报告期内,公司没有管理的投资风格与本基金不同,因此未对本基金的业绩产生影响。

4.3.3 投资组合的行业分布情况

本基金报告期内,未发现有明显异常的行业分布。

4.4 管理人对报告期内基金的经营业绩的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略分析

本基金报告期内,上半年以沪深300指数为基准,适当配置中小市值股票,流动性较好的股票占据了较大的权重,并适时调整仓位,根据市场变化,适时调整持仓结构,并根据市场情况,适时调整仓位,从而使得相关的股票大幅上涨,整个市场投机气氛浓厚。

4.4.2 会计报表的编制基础

4.4.3 会计报表的编制原则及主要项目的数据来源

4.4.4 会计报表的批准报出

4.4.5 会计报表的批准报出日期

4.4.6 会计报表的批准报出人签章

4.4.7 会计报表的批准报出人声明

4.4.8 会计报表的批准报出人对会计报表的简要说明

4.4.9 会计报表的批准报出人对会计报表的简要说明

4.4.10 会计报表的批准报出人对会计报表的简要说明

4.4.11 会计报表的批准报出人对会计报表的简要说明

4.4.12 会计报表的批准报出人对会计报表的简要说明

4.4.13 会计报表的批准报出人对会计报表的简要说明

4.4.14 会计报表的批准报出人对会计报表的简要说明

4.4.15 会计报表的批准报出人对会计报表的简要说明

4.4.16 会计报表的批准报出人对会计报表的简要说明

4.4.17 会计报表的批准报出人对会计报表的简要说明

4.4.18 会计报表的批准报出人对会计报表的简要说明

4.4.19 会计报表的批准报出人对会计报表的简要说明

4.4.20 会计报表的批准报出人对会计报表的简要说明

4.4.21 会计报表的批准报出人对会计报表的简要说明

4.4.22 会计报表的批准报出人对会计报表的简要说明

4.4.23 会计报表的批准报出人对会计报表的简要说明

4.4.24 会计报表的批准报出人对会计报表的简要说明

4.4.25 会计报表的批准报出人对会计报表的简要说明

4.4.26 会计报表的批准报出人对会计报表的简要说明

4.4.27 会计报表的批准报出人对会计报表的简要说明

4.4.28 会计报表的批准报出人对会计报表的简要说明

4.4.29 会计报表的批准报出人对会计报表的简要说明

4.4.30 会计报表的批准报出人对会计报表的简要说明

4.4.31 会计报表的批准报出人对会计报表的简要说明

4.4.32 会计报表的批准报出人对会计报表的简要说明

4.4.33 会计报表的批准报出人对会计报表的简要说明

4.4.34 会计报表的批准报出人对会计报表的简要说明

4.4.35 会计报表的批准报出人对会计报表的简要说明

4.4.36 会计报表的批准报出人对会计报表的简要说明

4.4.37 会计报表的批准报出人对会计报表的简要说明

4.4.38 会计报表的批准报出人对会计报表的简要说明

4.4.39 会计报表的批准报出人对会计报表的简要说明

4.4.40 会计报表的批准报出人对会计报表的简要说明

4.4.41 会计报表的批准报出人对会计报表的简要说明

4.4.42 会计报表的批准报出人对会计报表的简要说明

4.4.43 会计报表的批准报出人对会计报表的简要说明

4.4.44 会计报表的批准报出人对会计报表的简要说明

4.4.45 会计报表的批准报出人对会计报表的简要说明

4.4.46 会计报表的批准报出人对会计报表的简要说明

4.4.47 会计报表的批准报出人对会计报表的简要说明