

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)		
1	国家债券	-	-		
2	央行票据	9,995,000.00	10.69		
3	金融债券	-	-		
	其中:政策性金融债	-	-		
4	企业债券	74,560,113.90	79.72		
5	企业短期融资券	-	-		
6	中期票据	-	-		
7	可转债	24,700,744.50	26.41		
8	其他	-	-		
9	合计	109,255,858.40	116.82		
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	1001037	10央行票据37	100,000	9,995,000.00	10.69
2	122687	12金坛债	76,890	8,007,324.60	8.56
3	111063	11甬阳债	76,653	7,918,254.90	8.47
4	113002	11工行转债	70,400	7,714,432.00	8.25
5	111047	08长兴债	70,000	7,448,000.00	7.96
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。					
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五名权证投资明细					
本基金本报告期末未持有权证。					
5.8 投资组合报告附注					
5.8.1 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。					
5.8.2 本基金投资的前十名股票中,不存在超出基金合同规定的备选股票库的情形。					
5.8.3 其他资产构成					
序号	名称	金额(元)			
1	存出保证金	519,181.15			
2	应收证券清算款	1,314,054.55			
3	应收股利	-			
4	应收利息	3,098,954.18			
5	应收申购款	2,181,309.79			
6	其他应收款	-			
7	待摊费用	-			
8	其他	-			
9	合计	7,113,499.67			
5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细					
序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	
1	113002	工行转债	7,714,432.00	8.25	
2	110018	国电转债	6,758,400.00	7.23	
3	110015	石化转债	3,601,850.00	3.85	
4	113003	重工转债	1,065,204.60	1.14	
5	110001	中行转债	500,056.50	0.53	
6	110011	民生转债	31,521.40	0.03	
5.8.5 报告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。					
5.8.6 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。					
§ 6 开放式基金份额变动					
报告期间期初基金份额总额				11,409,026.35	
报告期间基金份额总申购份额				51,599,878.17	
减:报告期间基金份额总赎回份额				76,157,655.00	
报告期间期末基金份额总额				66,851,249.52	
§ 7 备查文件目录					
7.1 备查文件目录					
1. 中国证监会批准设立基金的文件;					
2. 长信利丰货币型证券投资基金基金合同;					
3. 长信利丰货币型证券投资基金基金招募说明书;					
4. 长信利丰货币型证券投资基金托管协议;					
5. 报告期内在指定报刊上披露的基金份额持有人名册;					
6. 长信基金管理有限责任公司营业执照、公司章程及相关资料批复文件;					
7. 2 存放地点					
基金管理人的住所。					
7.3 查阅方式					
长信基金管理有限责任公司网站: <a href="http://www.cxfund.com.cn">http://www.cxfund.com.cn</a> 。					
长信基金管理有限责任公司				2013年1月9日	

# 长信金利精选开放式证券投资基金

## 2012 年 第 四 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：中国农业银行股份有限公司  
报告送出日期：2013年1月19日

### § 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责任。  
所有投资者均享有阅读、复制、转载和发布信息等的权利。本报告内容均不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，基金管理人也承诺以诚实信用、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当仔细阅读本基金的招募说明书。  
本报告自发布之日起开始计算。

### § 基金产品概况

基金名称	长信金利精选股票
基金代码	519996
交易代码	前端：519997 后端：519996
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005年4月17日
报告期末基金估值总额	3,032,320,805.53份
投资目标	本基金主要投资于大盘、价值型股票，并在保持基金财产安全性和流动性的前提下，谋求基金财产的长期稳定增值。

**投资策略**  
1. 复合型投资策略  
“由上至下”的资产配置流程与“由下至上”的选股流程相结合的投资策略。其中，“由上至下”的资产配置流程表现为：从宏观层面出发，在控制风险前提下优化资产的配置比例；“由下至上”的选股流程表现为：从微观层面出发，通过定量分析对个股进行系统的分析来挖掘上市公司内在价值，积极寻求价值被低估的个股进行投资。  
2. 适度分散投资策略  
在确保基金财产的安全性和流动性的前提下，在对宏观、经济、行业、公司基本面和市场因素进行深入分析的基础上，适度分散投资于个股，谋求基金财产的长期稳定增值。

**动态调整策略**  
体现为投资组合中个股的动态调整策略和股票仓位动态调整策略两个方面。股票组合中个股的动态调整策略是指：基于对各种影响因素变化带来的深入分析，定期或临时调整投资组合中的个股投资比例；股票仓位动态调整策略是指：基于对市场趋势的判断，动态调整股票仓位。

**业绩比较基准**  
中信标普100指数×80%+中信标普国债指数×20%

**风险收益特征**  
本基金为股票型证券投资基金，属于较高预期收益和较高预期风险的基金品种。

**基金管理人**  
长信基金管理有限责任公司  
中国农业银行股份有限公司

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2012年10月1日-2012年12月31日)
1.本期已实现收益	-102,496,251.02
2.本期利润	46,512,173.53

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,397,949,943.87	77.80
	其中:股票	1,397,949,943.87	77.80
2	固定收益投资	270,502,086.40	15.05
	其中:债券	270,502,086.40	15.05
3	货币资金	-	-
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	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	119,780,794.54	6.67
6	其他各项资产	8,715,775.67	0.49
7	合计	1,796,948,600.48	100.00

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
3.2 报告期末按行业分类的股票投资组合			
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	30,418,124.10	1.71
C	制造业	553,329,726.95	31.03
C0	食品、饮料	261,174,701.05	14.65
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	18,887,000.00	1.06
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	160,005,690.36	8.97
C8	医药、生物制品	113,262,335.54	6.35
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	71,400,000.00	4.00
E	建筑业	79,991,479.96	4.42
F	交通运输、仓储业	27,039,479.48	1.49
G	信息技术业	81,725,484.97	4.58
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	399,015,356.79	22.38
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	综合类	94,804,253.24	5.33

合计					1,397,499,943.87	78.41
5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十五名股票投资明细						
序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	
1	600880	博瑞传播	9,834,466	94,804,252.24	5.32	
2	600519	贵州茅台	415,531	86,854,289.62	4.87	
3	000858	五粮液	3,064,039	86,523,227.97	4.85	
4	600837	海通证券	8,199,775	84,047,693.75	4.71	
5	601318	中国平安	1,800,848	81,560,405.92	4.57	
6	601669	中国水电	20,040,178	79,991,479.96	4.49	
7	600011	华能国际	10,000,000	71,400,000.00	4.00	
8	600000	浦发银行	6,824,629	67,700,319.68	3.80	
9	000001	平安银行	3,949,918	63,277,686.36	3.55	
10	600881	亚泰集团	11,997,219	60,226,039.38	3.38	
5.4 报告期末按股票品种分类的前五名债券投资明细						
序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)		
1	国家债券					
2	央行票据					
3	金融债券		50,020,000.00	2.81		
	其中:政策性金融债		50,020,000.00	2.81		
4	企业债券		8,961,319.80	0.50		
5	企业短期融资券					
6	中期票据					
7	可转债		211,520,766.60	11.86		
8	其他					
9	合计		270,502,086.40	15.17		
5.5 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	113002	中行转债	831,160	91,078,512.80	5.11	
2	113001	中行转债	829,150	79,888,602.50	4.48	
3	120219	12国开债	500,000	50,020,000.00	2.81	
4	110017	中海转债	354,580	31,387,421.60	1.76	
5	110007	博汇转债	71,690	7,106,629.70	0.40	
5.6 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。						
5.7 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权证投资明细						
本基金本报告期末未持有权证。						
5.8 投资组合报告附注						
5.8.1 报告期内买入的前十只股票中的买入成本超过采购初该股票公允价值2%的情况						
5.8.2 报告期内买入的股票中,不存在超出基金合同规定各选股票库的情形。						
5.8.3 报告期内卖出股票的成本超过采购初该股票公允价值2%的情况						
5.8.4 报告期内卖出的股票中,不存在超出基金合同规定各选股票库的情形。						
序号	名称	金额(元)				
1	存出保证金	2,116,196.55				
2	应收证券清算款	4,433,744.42				
3	应收股利					
4	应收利息	2,163,561.67				
5	应收申购款	2,273.03				
6	其他应收款					
7	待摊费用					
8	其他					
9	合计	8,715,775.67				
5.9 报告期末持有的基于股指期货的可转债投资明细						
序号	股票代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)		
1	113002	工行转债	91,078,512.80	5.11		
2	113001	中行转债	79,888,602.50	4.48		
3	110017	中海转债	31,387,421.60	1.76		
4	110007	博汇转债	7,106,629.70	0.40		
5	110003	新钢转债	2,059,600.00	0.12		
5.8.5 报告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。						
5.8.6 报告期末前十名股票中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。						
§ 6 开放式基金份额变动						
报告期间期初基金份额总额					3,074,429,639.75	
报告期间基金总申购份额					1,027,822.81	
减:报告期间基金总赎回份额					43,136,657.03	
报告期间基金拆分变动份额						
报告期间期末基金份额总额					3,032,320,805.53	
7 备查文件目录						
§ 7 备查文件目录						
7.1 备查文件目录						
1、中国证监会核准设立基金的文件;						
2、长期股权投资设立开放式证券投资基金;						
3、长期股权投资设立开放式证券投资基金招募说明书;						
4、长期股权投资设立开放式证券投资基金公告;						
5、报告期内在指定报刊上披露的关于各种公告;						
6、长信基金管理有限责任公司营业执照、公司章程及相关资料批复文件;						
7.2 存放地点						
长信基金管理人住所;						
7.3 查阅方式						
长信基金管理有限责任公司网站: <a href="http://www.cxfund.com.cn/">http://www.cxfund.com.cn/</a> ;						
					长信基金管理有限责任公司	
					2013年1月1日	