

基金管理人:长信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
送出日期:2013年03月26日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示
本基金的基金管理人及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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司(以下简称“中国工商银行”,下同)根据本基金合同规定,于2013年3月25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并运用基金资产,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,投资人在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及基金更新。
本年度报告所载内容截止至报告正文,投资者需要了解详细情况,应阅读年度报告正文。
本报告自2012年1月1日起至2012年12月31日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况	长信利丰债券
基金代码	519189
交易场所	深圳证券交易所
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年12月29日
基金管理人	长信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	86,851,249.52份
基金合同期限	不定期

2.2 基金产品说明	
投资目标	通过积极主动的资产管理和严格的风险控制,在保持基金资产流动性和严格控制基金资产风险的前提下,为投资者提供稳定增长的长期投资回报。
投资策略	本基金为债券型基金,基金资产主要投资于固定收益类品种,其中投资于企业债为主体资产的债券不低于非固定收益类资产的20%,并通过投资国债、金融债和资产支持证券等,增加企业债投资组合的投资收益。
业绩比较基准	中证全债指数*90%+中证800指数*10%
风险收益特征	本基金为债券型基金,其预期风险和预期收益低于股票型基金和混合型基金,高于货币型基金。属证券投资基金产品中风险收益程度中偏低的投资品种。

2.3 基金管理人	基金托管人
名称	长信基金管理有限责任公司
法定代表人	李万勇
信息披露负责人	李万勇
联系电话	021-61009999
电子邮箱	zhuyao@fundchina.com.cn
客户服务电话	400-700-5566
网址	021-61009800

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	www.fundchina.com
基金年度报告备置地点	上海市浦东新区银城中路68号9楼,北京市西城区复兴门内大街28号凯晨国际中心东座19

六甲内大街28号凯展世贸中心东座19

§ 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

3.1.1 期间数据和指标	2012年	2011年	2010年
---------------	-------	-------	-------

本期已实现收益	5,469,067.23	-11,616,362.73	37,934,228.99
本期利润	14,434,396.55	-18,017,905.01	38,031,315.76
加权平均基金份额本期利润	0.1132	-0.0574	0.0900
本期基金份额净值增长率	12.77%	-6.92%	10.81%
3.1.2 期末数据和指标	2012年末	2011年末	2010年末
期末可供分配基金份额利润	0.0185	-0.0458	0.0010
期末基金资产净值	93,525,596.53	166,409,654.92	568,892,763.97

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额净值增长率变化及其与同期业绩比较基准收益率变化的比较	
注:1、图示日期为2008年12月29日至2012年12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,本基金资产配置比例应符合基金合同约定的资产配置比例。截至报告期末,本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。	

注:1、图示日期为2008年12月29日至2012年12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,本基金资产配置比例应符合基金合同约定的资产配置比例。截至报告期末,本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。	
3、截至报告期末,本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。	

注:1、图示日期为2008年12月29日至2012年12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,本基金资产配置比例应符合基金合同约定的资产配置比例。截至报告期末,本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。	
3、截至报告期末,本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。	

注:1、图示日期为2008年12月29日至2012年12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,本基金资产配置比例应符合基金合同约定的资产配置比例。截至报告期末,本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。	
3、截至报告期末,本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。	

注:1、图示日期为2008年12月29日至2012年12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,本基金资产配置比例应符合基金合同约定的资产配置比例。截至报告期末,本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。	
3、截至报告期末,本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。	

注:1、图示日期为2008年12月29日至2012年12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,本基金资产配置比例应符合基金合同约定的资产配置比例。截至报告期末,本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。	
3、截至报告期末,本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。	

注:1、图示日期为2008年12月29日至2012年12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,本基金资产配置比例应符合基金合同约定的资产配置比例。截至报告期末,本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。	
3、截至报告期末,本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。	

注:1、图示日期为2008年12月29日至2012年12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,本基金资产配置比例应符合基金合同约定的资产配置比例。截至报告期末,本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。	
3、截至报告期末,本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。	

注:1、图示日期为2008年12月29日至2012年12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,本基金资产配置比例应符合基金合同约定的资产配置比例。截至报告期末,本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。	
3、截至报告期末,本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。	

注:1、图示日期为2008年12月29日至2012年12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,本基金资产配置比例应符合基金合同约定的资产配置比例。截至报告期末,本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。	
3、截至报告期末,本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。	

注:1、图示日期为2008年12月29日至2012年12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,本基金资产配置比例应符合基金合同约定的资产配置比例。截至报告期末,本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。	
3、截至报告期末,本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。	

注:1、图示日期为2008年12月29日至2012年12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,本基金资产配置比例应符合基金合同约定的资产配置比例。截至报告期末,本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。	
3、截至报告期末,本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。	

注:1、图示日期为2008年12月29日至2012年12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,本基金资产配置比例应符合基金合同约定的资产配置比例。截至报告期末,本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。	
3、截至报告期末,本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。	

注:1、图示日期为2008年12月29日至2012年12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,本基金资产配置比例应符合基金合同约定的资产配置比例。截至报告期末,本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。	
3、截至报告期末,本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。	

注:1、图示日期为2008年12月29日至2012年12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,本基金资产配置比例应符合基金合同约定的资产配置比例。截至报告期末,本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。	
3、截至报告期末,本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。	

注:1、图示日期为2008年12月29日至2012年12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,本基金资产配置比例应符合基金合同约定的资产配置比例。截至报告期末,本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。	
3、截至报告期末,本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。	

注:1、图示日期为2008年12月29日至2012年12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,本基金资产配置比例应符合基金合同约定的资产配置比例。截至报告期末,本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。	
3、截至报告期末,本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。	

注:1、图示日期为2008年12月29日至2012年12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,本基金资产配置比例应符合基金合同约定的资产配置比例。截至报告期末,本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。	
3、截至报告期末,本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。	

注:1、图示日期为2008年12月29日至2012年12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,本基金资产配置比例应符合基金合同约定的资产配置比例。截至报告期末,本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。	
3、截至报告期末,本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。	

注:1、图示日期为2008年12月29日至2012年12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,本基金资产配置比例应符合基金合同约定的资产配置比例。截至报告期末,本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。	
3、截至报告期末,本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。	

注:1、图示日期为2008年12月29日至2012年12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,本基金资产配置比例应符合基金合同约定的资产配置比例。截至报告期末,本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。	
3、截至报告期末,本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。	

注:1、图示日期为2008年12月29日至2012年12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,本基金资产配置比例应符合基金合同约定的资产配置比例。截至报告期末,本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。	
3、截至报告期末,本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。	

注:1、图示日期为2008年12月29日至2012年12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,本基金资产配置比例应符合基金合同约定的资产配置比例。截至报告期末,本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。	
3、截至报告期末,本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。	

注:1、图示日期为2008年12月29日至2012年12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,本基金资产配置比例应符合基金合同约定的资产配置比例。截至报告期末,本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。	
3、截至报告期末,本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。本基金资产配置比例符合基金合同约定的资产配置比例。	

长信利丰债券型证券投资基金

2012 年 度 报 告 摘 要

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列明如下:

1)以发行方式募集资金,不属于营业税征收范围,不征收营业税。
2)基金买卖股票、债券的投资收益暂免征收营业税和企业所得税。
3)对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入、由上市公司、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,对个人投资者从上市公司取得的股票的股息、红利收入暂减按50%计入个人所得税,暂不征收企业所得税。
4)基金卖出股票按1%的税率缴纳印花税,买入股票不征收股票交易印花税。
5)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 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
应交债券利息收入所得税	3,500,887.52	3,209,509.61

注:该项系基金收到的债券发行人在支付债券利息时未代扣代缴的利息税部分。

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
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人
长信基金管理有限责任公司(“长信基金”)	基金管理人控股股东
上海海欣集团股份有限公司	基金管理人股东
武汉钢铁股份有限公司	基金管理人股东
长江证券承销保荐有限公司	基金管理人控股股东的控股子公司
长江证券控股(香港)有限公司	基金管理人控股股东的控股子公司
长江期货有限公司	基金管理人控股股东的控股子公司
长江成长资本投资有限公司	基金管理人控股股东的控股子公司

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联交易
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
本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元——长江证券股份有限公司进行的股票交易。
7.4.8.1.2 权证交易
本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元——长江证券股份有限公司进行的权证交易。
7.4.8.1.3 债券回购交易
本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元——长江证券股份有限公司进行的债券回购交易。
7.4.8.1.4 应支付关联方的佣金
本报告期及上年度可比期间未发生应支付关联方交易单元——长江证券股份有限公司的佣金。
7.4.8.2 关联方交易
7.4.8.2.1 基金管理费

7.4.8.1.4 应支付关联方的佣金

本报告期及上年度可比期间无应付关联方交易单元——长江证券股份有限公司的佣金。

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 2012年1月1日至2012年12	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12
----	-------------------------	------------------------------

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0.70%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。计算公式为:
日基金管理人费=前一日基金资产净值*0.70%/当年天数
7.4.8.2.2 基金托管费

7.4.8.2.2 基金托管费		单位:人民币元
项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	256,606.80	642,079.19

注:支付基金托管人中国工商银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值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:
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

	当期发生的基金应支付的销售服务费	
长信基金管理有限责任公司		169,791.13
中国农业银行		54,180.34
长江证券		277.67
合计		224,249.14

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0.70%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。计算公式为:
日基金管理人费=前一日基金资产净值*0.70%/当年天数
7.4.8.2.2 基金托管费

合计	865,150.80
注:支付各关联方的销售服务费按前一日基金资产净值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: 日基金销售服务费=前一日基金资产净值×0.40%/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	单位:人民币元
获得销售服务费的各关联方名称	

注:支付基金托管人中国工商银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值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:
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

银行间市场交易的相关 方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	基金买入	基金卖出	交易金额
中国农业银行	-	-	-	-	-	-

注：本基金在本年度与上年度均未与关联方通过银行间同业市场进行过债券回购交易。

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

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0.70%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。计算公式为:
日基金管理人费=前一日基金资产净值*0.70%/当年天数
7.4.8.2.2 基金托管费

	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有 限公司	3,657,772.68	66,820.99	6,598,023.87	149,089.24

注:本基金通过“中国农业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2012年12月31日的相关余额为人民币1,693,927.61元。 2011年:人民币2,158,713.25元)。

注:支付基金托管人中国工商银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值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:
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

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而不能自由转让的资产。基金通过网上申购获得的新股或上市的新发或增发债券,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。

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0.70%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。计算公式为:
日基金管理人费=前一日基金资产净值*0.70%/当年天数
7.4.8.2.2 基金托管费

000,000.00元,将于2013年3月4日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

§ 8 投资组合报告

金额单位:人民币元

8.1 期末基金资产组合情况

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
----	----	----	--------------

注:支付基金托管人中国工商银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值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:
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

3	金融衍生品投资	-	-
4	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	5,351,700.29	3.83
6	其他各项资产	7,113,499.67	5.09
7	合计	139,823,658.54	100.00

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0.70%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。计算公式为:
日基金管理人费=前一日基金资产净值*0.70%/当年天数
7.4.8.2.2 基金托管费

C0	食品、饮料	2,379,933.68	2.54
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	2,459,948.40	2.63
C5	电子	1,330,729.60	1.42

注:支付基金托管人中国工商银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值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:
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

E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	2,001,307.50	2.14
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	3,186,321.00	3.41

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0.70%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。计算公式为:
日基金管理人费=前一日基金资产净值*0.70%/当年天数
7.4.8.2.2 基金托管费

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	000046	泛海建设	509,615	2,751,921.00	2.94
2	000012	南 玻 A	295,000	2,433,750.00	2.60
3	600332	广州药业	123,000	2,388,660.00	2.55
4	300054	鼎龙股份	73,263	1,963,448.40	2.10
5	002230	科大讯飞	63,525	1,024,807.50	2.06

注:支付基金托管人中国工商银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值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:
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

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于长信基金管理有限责任公司的网站的年度报告正文。

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 金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600557	康缘药业	18,653,301.82	11.21

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0.70%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。计算公式为:
日基金管理人费=前一日基金资产净值*0.70%/当年天数
7.4.8.2.2 基金托管费

7	300059	东方财富	10,537,887.93	6.33
8	600458	时代新材	10,216,147.89	6.14
9	000661	长春高新	9,980,304.13	6.00
10	300054	鼎龙股份	9,334,125.06	5.61
11	600085	同仁堂	8,558,459.68	5.14
12	600141	兴发集团	7,430,768.81	4.47

注:支付基金托管人中国工商银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值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:
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

18	000960	锡业股份	6,261,750.84	3.76
19	600332	广州药业	6,249,828.79	3.76
20	000860	顺鑫农业	6,089,026.87	3.66
21	600702	沱牌舍得	6,012,413.96	3.61
22	002138	顺络电子	5,854,467.53	3.52
23	000046	深赛格	5,841,452.76	3.51

23	000090	中信建投	3,041,942.70	3.31
24	000562	宏源证券	5,692,765.03	3.42
25	000858	五粮液	5,591,299.50	3.36

26	002296	辉辉科技	5,536,100.34	3.33
27	300168	华昌达	5,511,420.02	3.31
28	600589	老白干酒	5,469,134.98	3.29
29	000261	拓维信息	5,441,061.76	3.27
30	002376	新北洋	5,131,589.41	3.08
31	000050	深天马A	4,965,624.54	2.98
32	002155	辰州矿业	4,964,588.19	2.98
33	000012	南 玻 A	4,901,556.67	2.95
34	002428	云南铜业	4,742,975.69	2.85
35	300101	国脉科技	4,636,449.21	2.81
36	002008	大族激光	4,580,492.50	2.75
37	002254	泰和新材	4,534,019.78	2.72
38	600549	厦门钨业	4,142,882.00	2.49
39	300041	圆环控股	4,060,737.11	2.44
40	002574	榕基软件	3,937,585.65	2.39
41	600880	博彦科技	3,940,259.11	2.37
42	300027	博彦科技	3,846,807.60	2.31
43	300002	神州泰岳	3,814,210.01	2.29
44	300020	银江股份	3,768,228.50	2.26
45	600176	中国国航	3,672,841.00	2.21
46	600766	武汉钢铁	3,541,585.29	2.13
47	000069	华侨城A	3,489,142.30	2.10
48	300048	合康变频	3,475,387.18	2.09
49	600199	金种子酒	3,468,645.01	2.08
50	600518	康美药业	3,406,777.92	2.05
51	000631	顺发实业	3,396,145.00	2.04