

长信利丰债券型证券投资基金2012年年度报告摘要

2012年12月31日

基金管理人：长信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2013年03月26日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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。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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司（以下简称“中国农业银行”，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仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自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

基金简称	长信利丰债券
基金主代码	519989
交易代码	519989
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	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	86,851,249.52份
基金合同存续期	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投资收益。
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，其中投资于以企业为主体发行的债券不低于基金债券资产的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，高于货币市场基金，属于证券投资基金产品中风险收益程度中等偏低的投资品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		长信基金管理有限责任公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周永刚	李芳菲
	联系电话	021-61009999	010-66060069
	电子邮箱	zhouyg@cxfund.com.cn	lifangfei@abchina.com
客户服务电话		400-700-5566	95599
传真		021-61009800	010-63201816

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.cxfund.com.cn
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号凯晨世贸中心东座F9

§ 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：人民币元

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	0.0901
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	568,892,763.92
期末基金份额净值	1.0770	0.9550	1.0260

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（不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、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

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①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	5.07%	0.31%	1.36%	0.13%	3.71%	0.18%
过去六个月	5.90%	0.32%	0.51%	0.13%	5.39%	0.19%
过去一年	12.77%	0.34%	3.95%	0.14%	8.82%	0.20%
过去三年	16.32%	0.34%	8.64%	0.17%	7.68%	0.17%
自基金合同生效日起至今（2008年12月29日至	20.67%	0.33%	15.66%	0.19%	5.01%	0.14%

2012年12月31日)						
--------------	--	--	--	--	--	--

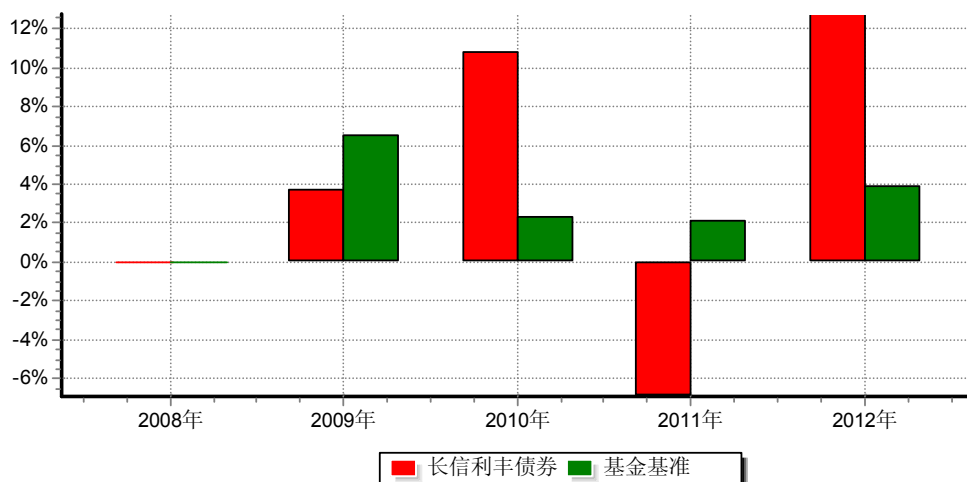
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



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：投资于债券类资产的比例不低于基金资产的80%，其中投资于公司债、企业债、短期融资券等以企业为主体发行的债券资产投资比例不低于基金债券资产的20%；投资于股票等权益类品种的比例不高于基金资产的20%；投资于现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。

3.2.3 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



注：2008年计算期间为自基金合同生效日2008年12月29日至2008年12月31日，基金运作时间未满一年，净值增长率按本基金实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2012年	—	—	—	—	
2011年	—	—	—	—	
2010年	1.000	104,735,622.99	4,103,031.80	108,838,654.79	
合计	1.000	104,735,622.99	4,103,031.80	108,838,654.79	

注：本基金合同生效日2008年12月29日。本基金本报告期没有进行利润分配，详见4.7。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

长信基金管理有限责任公司是经中国证监会证监基金字【2003】63号文批准，由长江证券股份有限公司、上海海欣集团股份有限公司、武汉钢铁股份有限公司共同发起设立。注册资本1.5亿元人民币。目前股权结构为：长江证券股份有限公司占49%、上海海欣集团股份有限公司占34.33%、武汉钢铁股份有限公司占16.67%。

截至2012年12月31日，本基金管理人共管理14只开放式基金，即长信利息收益货币、长信银利精选股票、长信金利趋势股票、长信增利动态策略股票、长信双利优选混合、长信利丰债券、长信恒利优势股票、长信中证中央企业100指数（LOF）、长信中短债债券、长信量化先锋股票、长信标普100等权重指数（QDII）、长信利鑫分级债、长信内需成长股票和长信可转债债券。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李小羽	本基金的基金经理、长信可转债债券型证券投资基金的基金经理、固定收益部总监	2008年12月29日	—	15年	工学硕士，华南理工大学管理工程研究生毕业，具有基金从业资格，加拿大特许投资经理资格（CIM）。曾任长城证券公司证券分析师，加拿大 Investors Group Financial Services Co., Ltd 投资经理和投资顾问。2002年10月加入长信基金管理有限责任公司，先后任基金经理助理、交易管理部总监、固定收益部总监。现任固定收益部总监，本基金和长信可转债债券型证券投资基金的基金经理。

注：1、基金经理任职日期以本基金成立之日为准；

2、证券从业年限以基金经理进入证券业务相关机构的工作经历为时间计算标准。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在报告期内，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谋求利益，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

本基金将继续以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，努力为基金份额持有人谋求最大利益。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

1、所有投资对象的投资指令必须经由交易部门总监或其授权人审核分配至交易人员执行。进行投资指令分配的人员必须保证投资指令得到公平对待。

2、公司使用的交易执行软件系统必须具备如下功能：

(1) 严格按照时间顺序发送委托指令；

(2) 对于多个投资组合在同一时点就同一证券下达的相同方向的投资指令，并且市价在限价范围内的，系统能够将交易员针对该证券下达的每笔委托自动按照指令数量比例分拆为各投资组合的委托指令。

3、交易人员对于接收到的交易指令依照价格优先、时间优先的顺序执行。在执行多个投资组合在同一时点就同一证券下达的相同方向的交易所投资指令时，除制度规定的例外指令外，必须开启系统的公平交易开关。

4、对于不同投资组合均进行债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易的投资对象，交易部门必须严格独立接收各投资组合的投资指令，在申购结果产生前，不得以任何形式向任何人泄露各投资指令的内容，包括指令价格及数量等要素。

5、对于各投资组合以独立账户名义进行申购的投资对象，除需经过公平性审核的例外指令外，申购获配的证券数量由投资管理系统接收各类证券登记结算机构发送的数据进行分配。交易部门根据证券发行人在指定公开披露媒体上披露

的申购结果对系统内分配数量进行核准，数量不符的，应当第一时间告知各投资管理部门的总监及监察稽核部总监。对于以公司名义进行申购的投资对象，公司在获配额度确定后，严格按照价格优先的原则在各投资组合间进行分配。申购价格相同的投资组合则根据投资指令的数量按比例进行分配。确因特殊原因不能按照上述原则进行分配的，应启动异常交易识别流程，审核通过的，可以进行相应分配。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司已实行公平交易制度，并建立公平交易制度体系，已建立投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，公司已通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，除完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合外，其余各投资组合均未参与交易所公开竞价同日反向交易，不涉及成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情形，对本年度同向交易价差进行专项分析，未发现异常情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本年度希腊引发欧债危机扩散和爆发，欧洲多国陷入危机或萧条，在经历危机高峰后逐步得到缓解，在下半年欧元区经济最坏阶段过去，但仍未摆脱经济萧条；美国经济继续其复苏进程，财政悬崖有惊无险得以初步解决，美国货币政策和财政政策正处于后危机调整阶段；同时国际政治经济出现新的动荡，对中国经济产生直接影响。前三季度中国经济延续了调整态势，但在四季度出现显著企稳，投资出现好转，消费稳定但出口仍在下滑，中长期增长动力减弱，增长的均衡水平下移确定。宏观调控放松的力度更加倾向于稳定增长，但放松的力度受通胀和汇率的制约，经济增长更加突出市场化改革。房地产投资回升，销售大幅回暖，地方投资随城镇化逐步释放。CPI 企稳回升，大宗商品价格大幅反弹，预示未来对物价将有所推动。信贷放松步伐停滞，突显稳健货币政策稳中求进的主旨。社

会融资依然活跃，债券市场发行量扩容较大，融资结构的变化将导致总体信用风险的转移。货币政策重点在于稳住经济，同时盯住外汇占款和人民币汇率变化进行短期调整。货币市场利率基本保持稳定，债券市场持续上涨三个季度的牛市行情，特别是信用债出现轮番上涨，三季度末出现一定幅度回调，但随后证明仍然是一次短期调整，债券市场重新回到上升通道。

本基金根据宏观经济形势和债券市场趋势，适度增加组合久期，在债券投资中随市场变化对债券品种和期限结构进行了灵活配置，适度加大可转债和权益类投资以增强组合收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末，本基金份额净值为1.077元，报告期基金份额净值增长率为12.77%，成立以来的累计净值为1.197元，本期业绩比较基准增长率为3.95%，基金波动率为0.34%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

未来经济的政策重点在于通过改革释放增长红利，更多的依靠市场调节。M2和M1回落至目前位置，已经进入稳中有升，但货币供给更注重通过回购进行短期化微调，稳健的货币政策可能对存准调整会更加谨慎。通胀在未来小幅反弹的确定性增加，未来降息应会相对谨慎。货币政策的总基调仍然是放松，放松的节奏和方式将视经济的回落和外汇占款情况而定，资金面总体而言将会保持松中有紧，短期调节。下一阶段债券波动横盘可能性比较大，信用债相对收益更明显，但信用风险在发债主体增加扩容下会逐步凸显。

我们将继续秉承谨慎原则，加强组合的流动性管理，在做好利率风险控制的同时，增加对新经济环境下信用风险的审慎判断。合理控制组合久期，密切关注经济走势和政策动向，紧跟组合规模变动进行资产配置，争取在流动安全的前提下，为投资人获取更好的收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证券监督管理委员会2008年9月12日发布的【2008】38号文《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，长信基金管理有限责任公司（以下简称“公司”）制订了健全、有效的估值政策和程序，成立了估值工作小组，

小组成员由投资管理部总监、固定收益部总监、研究发展部总监、交易管理部总监、金融工程部总监、基金事务部总监以及基金事务部至少一名业务骨干共同组成。相关参与人员都具有丰富的证券行业工作经验，熟悉相关法规和估值方法。基金经理不直接参与估值决策，如果基金经理认为某证券有更好的证券估值方法，可以申请公司估值工作小组对某证券进行专项评估。估值决策由与会估值工作小组成员1/2以上多数票通过。对于估值政策，公司与基金托管人充分沟通，达成一致意见。审计本基金的会计师事务所认可公司基金估值政策和程序的适当性。

参与估值流程各方不存在任何重大利益冲突。报告期内，未签订与估值相关的定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及相关法律法规、《长信利丰债券型证券投资基金基金合同》，结合本报告期基金实际运作情况，本基金本报告期没有进行利润分配。

本基金收益分配原则如下：

- 1、本基金的每份基金份额享有同等分配权；
- 2、基金收益分配后每一基金份额净值不能低于面值；
- 3、收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由基金投资者自行承担；
- 4、基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；
- 5、基金当期收益应先弥补上期累计亏损后，才可进行收益分配；
- 6、在符合基金分红条件的前提下，本基金每年收益至少分配1次，最多分配12次，年度收益分配比例不低于基金年度可分配收益的50%；
- 7、本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，基金投资者可选择现金红利或将现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；
- 8、法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管长信利丰债券型证券投资基金的过程中，本基金托管人——中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及《长信利丰债券型证券投资基金基金合同》、《长信利丰债券型证券投资基金托管协议》的约定，对长信利丰债券型证券投资基金管理人——长信基金管理有限责任公司2012年1月1日至2012年12月31日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为，长信基金管理有限责任公司在长信利丰债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，长信基金管理有限责任公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的长信利丰债券型证券投资基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

§ 6 审计报告

本报告期本基金2012年度财务报告经毕马威华振事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师出具了无保留意见的审计报告（毕马威华振审字第1300081号），投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：长信利丰债券型证券投资基金

报告截止日：2012年12月31日

单位：人民币元

资 产	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
资 产：		
银行存款	3,657,772.68	6,598,023.87
结算备付金	1,693,927.61	2,158,713.25
存出保证金	519,181.15	250,000.00
交易性金融资产	127,358,458.58	185,227,287.06
其中：股票投资	18,102,600.18	28,707,306.58
基金投资	—	—
债券投资	109,255,858.40	156,519,980.48
资产支持证券投资	—	—
衍生金融资产	—	—
买入返售金融资产	—	—
应收证券清算款	1,314,054.55	315,973.71
应收利息	3,098,954.18	5,263,302.93
应收股利	—	—
应收申购款	2,181,309.79	47,600.00
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	139,823,658.54	199,860,900.82
负债和所有者权益	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
负 债：		
短期借款	—	—
交易性金融负债	—	—
衍生金融负债	—	—
卖出回购金融资产款	41,000,000.00	28,100,000.00
应付证券清算款	—	845,134.43

应付赎回款	677,911.39	389,295.97
应付管理人报酬	61,009.72	102,221.31
应付托管费	17,431.37	29,206.07
应付销售服务费	34,862.72	58,412.21
应付交易费用	235,496.70	206,703.62
应交税费	3,500,887.52	3,209,509.61
应付利息	25,453.92	15,970.10
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	745,008.67	494,792.58
负债合计	46,298,062.01	33,451,245.90
所有者权益：		
实收基金	86,851,249.52	174,231,258.48
未分配利润	6,674,347.01	-7,821,603.56
所有者权益合计	93,525,596.53	166,409,654.92
负债和所有者权益总计	139,823,658.54	199,860,900.82

注：报告截止日2012年12月31日，基金份额净值1.077元，基金份额总额86,851,249.52份。

7.2 利润表

会计主体：长信利丰债券型证券投资基金

本报告期：2012年1月1日至2012年12月31日

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
一、收入	19,090,797.61	-9,045,730.39
1. 利息收入	6,729,167.66	13,621,763.28
其中：存款利息收入	93,462.40	176,825.26
债券利息收入	6,608,576.70	13,442,682.76
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	27,128.56	2,255.26
其他利息收入	—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）	3,332,915.89	-16,401,944.79
其中：股票投资收益	450,769.83	-13,913,452.50

基金投资收益	—	—
债券投资收益	2,686,720.24	-2,658,091.48
资产支持证券投资收益	—	—
衍生工具收益	—	—
股利收益	195,425.82	169,599.19
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	8,965,329.32	-6,401,542.28
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)	—	—
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	63,384.74	135,993.40
减：二、费用	4,656,401.06	8,972,174.62
1. 管理人报酬	898,123.98	2,247,277.29
2. 托管费	256,606.80	642,079.19
3. 销售服务费	513,213.84	1,284,158.52
4. 交易费用	1,347,841.48	2,614,870.51
5. 利息支出	1,366,256.03	1,911,990.14
其中：卖出回购金融资产支出	1,366,256.03	1,911,990.14
6. 其他费用	274,358.93	271,798.97
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	14,434,396.55	-18,017,905.01
减：所得税费用	—	—
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	14,434,396.55	-18,017,905.01

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：长信利丰债券型证券投资基金

本报告期：2012年1月1日至2012年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	174,231,258.48	-7,821,603.56	166,409,654.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	14,434,396.55	14,434,396.55
三、本期基金份额交易产生的	-87,380,008.96	61,554.02	-87,318,454.94

基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	162,518,560.74	3,718,505.84	166,237,066.58
2. 基金赎回款	-249,898,569.70	-3,656,951.82	-253,555,521.52
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	—	—	—
五、期末所有者权益(基金净值)	86,851,249.52	6,674,347.01	93,525,596.53
项 目	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	554,326,726.11	14,566,037.81	568,892,763.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	-18,017,905.01	-18,017,905.01
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-380,095,467.63	-4,369,736.36	-384,465,203.99
其中：1. 基金申购款	157,802,944.06	4,090,213.98	161,893,158.04
2. 基金赎回款	-537,898,411.69	-8,459,950.34	-546,358,362.03
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	—	—	—
五、期末所有者权益(基金净值)	174,231,258.48	-7,821,603.56	166,409,654.92

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

田丹	蒋学杰	孙红辉
_____	_____	_____
基金管理公司负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

长信利丰债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于核准长信利丰债券型证券投资基金募集

的批复》(证监许可【2008】1252号文)批准,由长信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《长信利丰债券型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于2008年12月29日生效。本基金为契约型开放式,存续期限为不定期,首次设立募集规模为819,356,829.46份基金份额。本基金的基金管理人为长信基金管理有限责任公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司(以下简称“中国农业银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《长信利丰债券型证券投资基金基金合同》和《长信利丰债券型证券投资基金招募说明书(更新)》的有关规定,本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国债、金融债、公司债券、企业债券、短期融资券、可转换债券、资产支持证券、央行票据、回购、银行定期存单、股票、权证,以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资组合资产类别配置的基本范围为:投资于债券类资产的比例不低于基金资产的80%,其中投资于公司债、企业债、短期融资券等以企业为主体发行的债券资产投资比例不低于基金债券资产20%;投资于股票等权益类品种的比例不高于基金资产的20%;现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为:中证全债指数 $\times$ 90%+中证800指数 $\times$ 10%。

根据《证券投资基金信息披露管理办法》,本基金定期报告在公开披露的第二个工作日,报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)于2006年2月15日颁布的《企业会计准则-基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)的要求编制,同时亦按照中国证监会公告[2010]5号《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》以及中国证券业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2012年12

月31日的财务状况、2012年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期未发生重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期未发生过重大会计差错。

7.4.6 税项

7.4.6.1 本基金适用的主要税项

根据财税字[1998]55号文、财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号文《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、上证交字[2008]16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《财政部、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项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金，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%计算个人所得税，暂不征收企业所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，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
中国农业银行股份有限公司(“中国农业银行”)	基金托管人
长江证券股份有限公司(“长江证券”)	基金管理人的股东
上海海欣集团股份有限公司	基金管理人的股东
武汉钢铁股份有限公司	基金管理人的股东
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
长江成长成本投资有限公司	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方交易

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

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管理费	898,123.98	2,247,277.29
其中：支付销售机构的客户维护费	175,952.19	226,996.82

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：

$$\text{日基金管理费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.70\% / \text{当年天数}$$

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农业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：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

7.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年12月31日
	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

获得销售服务费的各关联方名称	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销售服务费
长信基金管理有限责任公司	806,305.98
中国农业银行	58,556.76
长江证券	288.06
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：

$$\text{日基金销售服务费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.40\% / \text{当年天数}$$

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

本期 2012年01月01日-2012年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	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	利息收入	交易金额	利息支出
中国农业银行	9,834,733.88	—	—	—	—	—
上年度可比期间 2011年01月01日-2011年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	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

本报告期及上年度可比期间基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

除基金管理人之外的其他关联方在本期末及上年度末均未持有本基金。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间
-------	----	---------

	2012年1月1日至2012年12月31日		2011年1月1日至2011年12月31日	
	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）。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本年度与上年度均未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

上述关联交易均根据正常的商业交易条件进行，并以一般交易价格为定价基础。

7.4.9 期末（2012年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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制而不能自由转让的资产。基金通过网上申购获配的新股或认购的新发或增发债券，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。

于2012年12月31日，本基金未持有因认购新发或增发证券而持有的流通受限证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 交易所市场债券正回购

于2012年12月31日，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币41,000,000.00元，将于2013年1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

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	18,102,600.18	12.95
	其中：股票	18,102,600.18	12.95
2	固定收益投资	109,255,858.40	78.14
	其中：债券	109,255,858.40	78.14
	资产支持证券	—	—
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

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采掘业	—	—
C	制造业	12,914,971.68	13.81
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	1,330,229.60	1.42
C6	金属、非金属	2,433,750.00	2.60
C7	机械、设备、仪表	383,250.00	0.41
C8	医药、生物制品	3,927,860.00	4.20
C99	其他制造业	—	—

D	电力、煤气及水的生产和供应业	—	—
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
K	社会服务业	—	—
L	传播与文化产业	—	—
M	综合类	—	—
	合计	18,102,600.18	19.36

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

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	1,924,807.50	2.06
6	600557	康缘药业	74,000	1,539,200.00	1.65
7	300155	安居宝	105,910	1,330,229.60	1.42
8	600702	沱牌舍得	36,728	1,058,133.68	1.13
9	600559	老白干酒	20,000	739,800.00	0.79
10	300146	汤臣倍健	10,000	582,000.00	0.62

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公司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
2	002230	科大讯飞	14,895,039.47	8.95
3	000024	招商地产	13,918,273.49	8.36

4	601377	兴业证券	11,776,895.73	7.08
5	300026	红日药业	10,790,597.34	6.48
6	300261	雅本化学	10,565,155.20	6.35
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	7,430,268.81	4.47
13	300105	龙源技术	7,390,087.95	4.44
14	002340	格林美	7,263,984.69	4.37
15	600048	保利地产	7,141,001.25	4.29
16	000848	承德露露	6,951,245.84	4.18
17	600276	恒瑞医药	6,700,753.45	4.03
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	泛海建设	5,841,452.76	3.51
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	辉煌科技	5,536,100.34	3.33
27	300168	万达信息	5,511,360.02	3.31
28	600559	老白干酒	5,469,134.98	3.29
29	002261	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	云南锗业	4,742,975.60	2.85
35	300101	国腾电子	4,636,449.21	2.79
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	回天胶业	4,060,737.11	2.44

40	002474	榕基软件	3,969,585.65	2.39
41	600880	博瑞传播	3,940,259.11	2.37
42	300027	华谊兄弟	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	中国玻纤	3,672,841.00	2.21
46	600976	武汉健民	3,541,585.29	2.13
47	000069	华侨城A	3,488,142.30	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	顺发恒业	3,396,145.00	2.04

注：本项“买入/卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑其它交易费用。

8.4.2 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	600557	康缘药业	17,908,838.48	10.76
2	000024	招商地产	13,770,888.49	8.28
3	002230	科大讯飞	13,263,325.82	7.97
4	601377	兴业证券	11,671,929.41	7.01
5	300026	红日药业	11,356,199.14	6.82
6	300261	雅本化学	10,961,727.77	6.59
7	000661	长春高新	10,232,078.63	6.15
8	300059	东方财富	10,206,176.04	6.13
9	600458	时代新材	10,074,324.92	6.05
10	002340	格林美	8,986,245.70	5.40
11	300054	鼎龙股份	8,599,115.42	5.17
12	600085	同仁堂	8,456,724.19	5.08
13	600141	兴发集团	7,527,250.05	4.52
14	300105	龙源技术	7,427,340.47	4.46
15	000848	承德露露	7,325,048.04	4.40
16	002376	新北洋	7,324,554.35	4.40
17	002261	拓维信息	7,239,154.28	4.35
18	600048	保利地产	7,207,493.36	4.33

19	600276	恒瑞医药	6,653,729.35	4.00
20	002008	大族激光	6,511,571.85	3.91
21	000860	顺鑫农业	6,379,527.35	3.83
22	000960	锡业股份	6,330,095.31	3.80
23	002138	顺络电子	5,903,863.32	3.55
24	002428	云南锗业	5,811,181.07	3.49
25	000562	宏源证券	5,806,918.82	3.49
26	300168	万达信息	5,671,315.08	3.41
27	600702	沱牌舍得	5,507,399.96	3.31
28	000858	五 粮 液	5,430,012.92	3.26
29	600825	新华传媒	5,318,820.62	3.20
30	002296	辉煌科技	5,283,677.40	3.18
31	600088	中视传媒	5,079,255.43	3.05
32	600559	老白干酒	5,022,435.25	3.02
33	000050	深天马 A	5,012,176.99	3.01
34	300027	华谊兄弟	4,985,149.35	3.00
35	002155	辰州矿业	4,912,925.29	2.95
36	300070	碧 水 源	4,603,873.86	2.77
37	300101	国腾电子	4,571,647.69	2.75
38	002474	榕基软件	4,413,696.27	2.65
39	300020	银江股份	4,384,332.26	2.63
40	002254	泰和新材	4,313,345.07	2.59
41	600549	厦门钨业	3,999,176.98	2.40
42	600880	博瑞传播	3,979,767.89	2.39
43	600176	中国玻纤	3,972,098.00	2.39
44	300002	神州泰岳	3,952,732.42	2.38
45	300041	回天胶业	3,930,658.91	2.36
46	600332	广州药业	3,835,095.66	2.30
47	600518	康美药业	3,654,611.70	2.20
48	300048	合康变频	3,575,778.58	2.15
49	002339	积成电子	3,551,976.19	2.13
50	600976	武汉健民	3,531,964.10	2.12
51	600199	金种子酒	3,504,975.86	2.11
52	600809	山西汾酒	3,492,874.04	2.10
53	000069	华侨城 A	3,422,853.07	2.06

注：本项“买入/卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，

不考虑其它交易费用。

8.4.3 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	433,585,443.74
卖出股票的收入（成交）总额	448,434,762.23

注：本项“买入/卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑其它交易费用。

8.5 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	9,995,000.00	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

8.6 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	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富阳债	76,653	7,918,254.90	8.47
4	113002	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

8.7 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 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

本基金本报告期末未持有权证。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本报告期末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。

8.9.2 本基金投资的前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库的情形。

8.9.3 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	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

8.9.4 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	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	113001	中行转债	500,056.50	0.53
6	110011	歌华转债	31,521.40	0.03

8.9.5 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。

8.9.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
6,097	14,244.92	4,307,104.71	4.96%	82,544,144.81	95.04%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本基金	89,478.89	0.10%

注：1、期末本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为0；

2、期末该只基金的基金经理持有该只基金份额总量的数量区间为0份至10万份。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2008年12月29日)基金份额总额	819,356,829.46
本报告期期初基金份额总额	174,231,258.48
本报告期基金总申购份额	162,518,560.74
减：本报告期基金总赎回份额	249,898,569.70
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	86,851,249.52

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末召开本基金的基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

11.2.1 报告期内本基金管理人的重大人事变动

本报告期内，副总经理付勇先生离职，本基金管理人于2012年11月1日在指定信息披露媒体发布相应的《关于基金行业高级管理人员变更公告》。

11.2.2 报告期内基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期没有涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略没有改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金未更换会计师事务所；报告期应支付给毕马威华振会计师事务所审计的报酬为人民币60,000.00元，该审计机构为本基金提供的审计服务的连续年限为4年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况

本报告期基金管理人、托管人及其高级管理人员没有受监管部门稽查或处罚的情形。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		债券交易		债券回购交易		权证交易		应支付该券商的佣金	
		成交金额	占股票成交总	成交金额	占债券成交总	成交金额	占债券回购成	成交	占权证成	佣金	占当期佣金总

			额比例		额比例		交总额 比例	金 额	交总 额比 例		量的比 例
银河 证券	1	213,580,269.03	24.22%	14,550,387.15	1.95%	93,963,000.00	3.78%	—	—	181,379.59	23.98%
中信 证券	1	188,395,747.28	21.36%	23,995,260.23	3.21%	83,967,000.00	3.38%	—	—	154,538.09	20.43%
国元 证券	1	165,673,430.88	18.78%	349,678,350.11	46.81%	1,265,900,000.00	50.88%	—	—	146,892.36	19.42%
宏源 证券	1	110,567,923.99	12.54%	4,571,594.81	0.61%	68,000,000.00	2.73%	—	—	97,841.60	12.94%
中金 公司	1	91,057,032.26	10.32%	143,392,387.72	19.20%	656,300,000.00	26.38%	—	—	77,398.35	10.23%
日信 证券	1	54,683,309.05	6.20%	127,311,249.17	17.04%	289,500,000.00	11.64%	—	—	49,783.86	6.58%
大通 证券	1	20,943,396.46	2.37%	—	—	6,167,000.00	0.25%	—	—	17,016.57	2.25%
中信 建投	1	18,552,235.25	2.10%	2,411,390.76	0.32%	—	—	—	—	15,074.04	1.99%
瑞银 证券	1	18,550,201.77	2.10%	2,309,416.19	0.31%	24,000,000.00	0.96%	—	—	16,415.09	2.17%
北京 高华 证券	1	—	—	78,756,951.12	10.54%	—	—	—	—	—	—
中邮 证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

注：本报告期内本基金新增1个交易单元——瑞银证券，为与长信银利精选股票和长信内需成长股票共用交易单元；退租1个交易单元——大通证券。截止2012年12月31日本基金共有14个交易单元：高华证券、银河证券、招商证券、中邮证券、中金公司、日信证券、中信建投证券、中信证券、英大证券、瑞银证券、国联证券和宏源证券各1个交易单元，国元证券2个交易单元。

根据中国证监会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》（证监基字〔1998〕29号）和《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字【2007】48号）的有关规定，本公司制定了租用证券公司专用交易单元的选择标准和程序。

（1）选择标准：

- a、券商基本面评价（财务状况、经营状况）；
- b、券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）；
- c、券商每日信息评价（及时性和有效性）；

d、券商协作表现评价。

(2) 选择程序：

首先根据租用证券公司专用交易单元的选择标准形成《券商服务评价表》，然后根据评分高低进行选择基金专用交易单元。

长信基金管理有限责任公司

二〇一三年三月二十六日