

## 长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金2009年年度报告摘要

2009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

报告送出日期：2010年03月27日

## 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2010年3月26日复核了本报告中的财务指标、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2009年1月1日起至2009年12月31日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|             |                |
|-------------|----------------|
| 基金简称        | 长信双利优选混合       |
| 基金主代码       | 519991         |
| 基金前端/后端交易代码 | 519991/519990  |
| 基金运作方式      | 契约型开放式         |
| 基金合同生效日     | 2008年06月19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  | 139,153,490.52 |
| 基金合同存续期     | 不定期            |

### 2.2 基金产品说明

|        |  |
|--------|--|
| 投资目标   | 本基金通过对股票和债券等金融资产进行积极配置，并精选优质个股和券种，从而在保障基金资产流动性和安全性的前提下，谋求超越比较基准的投资回报，实现基金资产的长期稳定增值。  |
| 投资策略   | 本基金为主动式混合型基金，以战略性资产配置（SAA）策略体系为基础决定基金资产在股票类、固定收益类等资产中的配置。将股票价值优选策略模型和修正久期控制策略模型作为个股和债券的选择依据，投资于精选的优质股票和债券，构建动态平衡的投资组合，实现基金资产超越比较基准的稳健增值。 |
| 业绩比较基准 | 中证800指数×60%+上证国债指数×40%   |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型证券投资基金，其风险和收益高于债券基金和货币市场基金，属于证券投资基金产品中风险收益程度中等偏高的投资品种。  |

### 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                  |
|         | 联系电话         | 021-61009999         |
|         | 电子邮箱         | zhouyg@xcfund.com.cn |
| 客户服务电话  | 400-700-5566 | 95599                |
| 传真      | 021-61009800 | 010-68424181         |

### 2.4 信息披露方式



|                         |  |
|-------------------------|--|
| 登载基金年度报告正文的<br>管理人互联网网址 | <a href="http://www.cxfund.com.cn">www.cxfund.com.cn</a> |
| 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<br>北京市海淀区西三环北路100号金玉大厦                  |

### § 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 | 2009 年         | 2008年6月19日至2008年12月31日 |
|---------------|----------------|------------------------|
| 本期已实现收益       | 60,790,132.47  | -38,368,614.59         |
| 本期利润          | 67,186,769.28  | -40,086,596.23         |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.422          | -0.121                 |
| 本期基金份额净值增长率   | 43.94%         | -11.20%                |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2009 年末        | 2008年末                 |
| 期末可供分配基金份额利润  | -0.037         | -0.112                 |
| 期末基金资产净值      | 134,056,472.82 | 220,072,248.39         |
| 期末基金份额净值      | 0.963          | 0.888                  |

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                                | 10.18%         | 1.48%                | 13.01%             | 1.06%                    | -2.83%  | 0.42%  |
| 过去六个月                                | 5.72%          | 1.68%                | 10.68%             | 1.28%                    | -4.96%  | 0.40%  |
| 过去一年                                 | 43.94%         | 1.47%                | 55.78%             | 1.23%                    | -11.84% | 0.24%  |
| 自基金合同生效日起至今（2008年06月19日-2009年12月31日） | 27.82%         | 1.44%                | 21.74%             | 1.49%                    | 6.08%   | -0.05% |

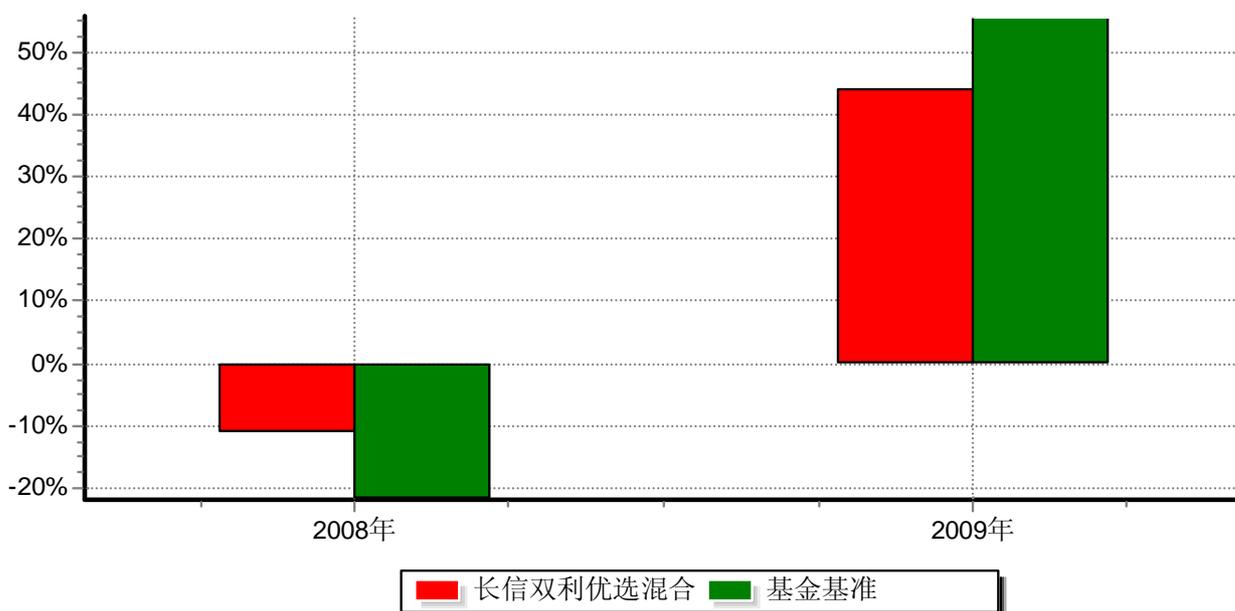
##### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、图示日期为2008年6月19日至2009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：本基金投资组合中，股票类资产的投资比例为基金资产的30-80%；固定收益类资产的投资比例为基金资产的15-65%；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%；投资于权证、资产支持证券的比例遵从法律法规及中国证监会的规定。

### 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6月19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

| 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 |
|-------|-------------|---------------|--------------|---------------|----|
| 2009年 | 3.000       | 38,122,250.78 | 5,704,090.16 | 43,826,340.94 |    |
| 2008年 | —           | —             | —            | —             |    |
| 合计    | 3.000       | 38,122,250.78 | 5,704,090.16 | 43,826,340.94 |    |

#### 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2009年12月31日，本基金管理人共管理7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、长信利丰债券和长信恒利优势股票；管理1只一对多产品，即长信价值量化资产管理计划。

##### 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 |        |   |
| 胡志宝 | 本基金基金经理，长信银利精选股票的基金经理 | 2008年06月19日 | —    | 12年    | 经济学硕士，南京大学国际贸易专业研究生毕业，具有基金从业资格。曾先后任职于国泰君安证券股份有限公司资产管理部投资经理、国海证券有限责任公司资产管理部副总经理、民生证券有限责任公司资产管理部总经理。2006年5月加入长信基金管理有限责任公司投资管理部，从事投资策略研究工作。2006年12月7日起，担任本基金的基金经理至今，2008年6月19日开始兼任长信双利优选混合基金的基金经理。 |
| 张甦伟 | 本基金基金经理               | 2008年07月25日 | —    | 13年    | 工商管理硕士，上海财经大学工商管理专业研究生毕业，具有证券和基金从业资格。曾就职于华夏证券有限公司、上海海威资产管理有限公司、东吴证  |

|  |  |  |  |  |   |
|--|--|--|--|--|---|
|  |  |  |  |  | 券有限责任公司、东吴基金管理有限责任公司，分别从事投资银行、证券研究和投资工作。2006年10月加入长信基金管理有限责任公司，担任策略研究员，2008年4月开始兼任基金经理助理，2008年7月25日开始担任本基金基金经理。 |
|--|--|--|--|--|---|

注：1、首任基金经理任职日期为本基金成立之日，增聘基金经理任职日期为本公司对外披露日；

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遵规守信情况的说明

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。

##### 4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本报告期内，公司所管理的各基金之间不存在投资风格相类似的投资组合；公司没有管理的投资风格相似的不同投资组合之间的业绩表现差异超过5%之情形。

##### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现可能异常交易行为。

## 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

09年初，我们在操作上的谨慎和保守加大了后续操作的难度。在我国宏观经济运行于底部、外部环境恶化的一季度，我们表现得比较谨慎，既有2月下旬的成功“逃顶”，也有3月初的踏空。谨慎操作的结果造成业绩基数小，加大了后续追赶排名的难度。尽管如此，我们并不轻言放弃，在二、第三季度的操作中取得了几次阶段性领先机会。

四季度初，我们把握住了周期品反弹的机会，基金排名大幅跃升。遗憾的是，四季度对房地产调控政策的掉以轻心以及在地产股的重仓配置导致上述努力功亏一篑，尤其12月份，地产股的暴跌给基金净值带来了较大损失。

基金份额的不稳定也加大了操作难度。尽管如此，全年我们仍实现四次分红，及时回馈投资者。来年，我们仍一如既往地吧投资者利益放在首位。

### 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0.963元，报告期基金份额净值增长率为43.94%，成立以来的累计净值为1.263元，本期业绩比较基准增长率为55.78%，基金波动率为1.47%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经过08、09两年的大幅波动后，2010年A股市场的波动幅度或将收敛。预计全年大盘涨跌幅度将比较有限，对阶段性机会的把握将决定投资的成败。如果说去年是宏观策略大获全胜，那么今年可能是“个股为王”。在企业盈利快速增长、市场流动性逐步收缩的背景下，精选个股将成为最重要的投资课题。

两类个股有望战胜市场甚至取得不错的正收益：一类是被市场忽视或低估的价值型股票，如金融、钢铁、交通运输等；另一类是盈利超预期的成长型股票，如消费品、低碳经济等。我们将围绕这两类股票深入挖掘，努力为投资者创造良好的收益。

## 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、《长信双利优选灵活配置混合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，本基金本报告期已公告实施四次分红，符合基金合同中关于利润分配条款的约定。详细情况如下：

| 权益登记日、除息日  | 每10份基金份额分红数 | 现金形式发放总额      | 在投资形式发放总额    | 利润分配合计        |
|------------|-------------|---------------|--------------|---------------|
| 2009-04-24 | 0.400       | 4,062,211.51  | 519,205.23   | 4,581,416.74  |
| 2009-06-03 | 0.800       | 8,601,874.91  | 1,089,697.96 | 9,691,572.87  |
| 2009-07-06 | 0.800       | 12,397,984.10 | 1,608,429.87 | 14,006,413.97 |
| 2009-07-29 | 1.000       | 13,060,180.26 | 2,486,757.10 | 15,546,937.36 |
| 合计         | 3.000       | 38,122,250.78 | 5,704,090.16 | 43,826,340.94 |

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管长信双利优选灵活配置混合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《长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》的约定，对长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金管理人——长信基金管理有限责任公司2009年1月1日至2009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双利优选灵活配置混合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双利优选灵活配置混合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，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## § 6 审计报告

本报告期本基金2009年度财务报告经毕马威华振会计师事务所审计，注册会计师出具了无保留意见的审计报告（KPMG-B(2010)AR No. 0241 ），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：长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2009年12月31日

单位：人民币元

| 资产                   | 附注号        | 本期末<br>2009年12月31日         | 上年度末<br>2008年12月31日         |
|----------------------|------------|----------------------------|-----------------------------|
| <b>资产：</b>           |            |                            |                             |
| 银行存款                 |            | 7,577,400.23               | 78,319,698.14               |
| 结算备付金                |            | 255,527.20                 | 1,143,499.58                |
| 存出保证金                |            | 261,623.70                 | 250,000.00                  |
| 交易性金融资产              |            | 126,706,961.45             | 141,101,810.00              |
| 其中：股票投资              |            | 96,619,961.45              | 101,881,810.00              |
| 债券投资                 |            | 30,087,000.00              | 39,220,000.00               |
| 资产支持证<br>券投资         |            | —                          | —                           |
| 衍生金融资产               |            | —                          | —                           |
| 买入返售金融资<br>产         |            | —                          | —                           |
| 应收证券清算款              |            | —                          | 104,108.73                  |
| 应收利息                 |            | 778,609.51                 | 501,536.88                  |
| 应收股利                 |            | —                          | —                           |
| 应收申购款                |            | 5,123.74                   | 985.22                      |
| 其他资产                 |            | —                          | —                           |
| 资产总计                 |            | 135,585,245.83             | 221,421,638.55              |
| <b>负债和所有者权<br/>益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2009年12月31日</b> | <b>上年度末<br/>2008年12月31日</b> |
| <b>负债：</b>           |            |                            |                             |
| 短期借款                 |            | —                          | —                           |
| 交易性金融负债              |            | —                          | —                           |
| 衍生金融负债               |            | —                          | —                           |
| 卖出回购金融资<br>产款        |            | —                          | —                           |
| 应付证券清算款              |            | 388,559.20                 | —                           |
| 应付赎回款                |            | 375,809.88                 | 207,107.73                  |
| 应付管理人报酬              |            | 176,250.93                 | 290,993.57                  |
| 应付托管费                |            | 29,375.13                  | 48,498.89                   |
| 应付销售服务费              |            | —                          | —                           |

|               |         |                |                |
|---------------|---------|----------------|----------------|
| 应付交易费用        |         | 219,283.47     | 462,009.41     |
| 应交税费          | 7.4.6.2 | 3,640.80       | —              |
| 应付利息          |         | —              | —              |
| 应付利润          |         | —              | —              |
| 其他负债          |         | 335,853.60     | 340,780.56     |
| 负债合计          |         | 1,528,773.01   | 1,349,390.16   |
| <b>所有者权益：</b> |         |                |                |
| 实收基金          |         | 139,153,490.52 | 247,727,720.54 |
| 未分配利润         |         | -5,097,017.70  | -27,655,472.15 |
| 所有者权益合计       |         | 134,056,472.82 | 220,072,248.39 |
| 负债和所有者权益总计    |         | 135,585,245.83 | 221,421,638.55 |

注：报告截止日2009年12月31日，基金份额净值0.963元，基金份额总额139,153,490.52份。

## 7.2 利润表

会计主体：长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2009年1月1日至2009年12月31日

单位：人民币元

| 项目                    | 附注号 | 本期<br>2009年01月01日至<br>2009年12月31日 | 上年度可比期间<br>2008年6月19日（基金合<br>同生效日）至2008年12月<br>31日 |
|-----------------------|-----|-----------------------------------|--|
| <b>一、收入</b>           |     | <b>73,526,217.92</b>              | <b>-35,246,402.97</b>                              |
| 1. 利息收入               |     | 1,273,444.34                      | 1,410,922.18                                       |
| 其中：存款利息收入             |     | 173,662.13                        | 741,388.61   |
| 债券利息收入                |     | 1,099,782.21                      | 669,533.57   |
| 资产支持证券<br>利息收入        |     | —                                 | —  |
| 买入返售金融<br>资产收入        |     | —                                 | —  |
| 2. 投资收益（损失以<br>“-”填列） |     | 65,414,858.63                     | -35,257,537.12                                     |
| 其中：股票投资收益             |     | 64,501,058.57                     | -35,744,091.27                                     |
| 债券投资收益                |     | 74,108.07                         | 231,230.00   |
| 资产支持证券<br>投资收益        |     | —                                 | —  |
| 衍生工具收益                |     | —                                 | —  |
| 股利收益                  |     | 839,691.99                        | 255,324.15   |
| 3. 公允价值变动收益           |     | 6,396,636.81                      | -1,717,981.64                                      |

|               |           |                      |                      |
|---------------|-----------|----------------------|----------------------|
| (损失以“-”填列)    |           |                      |                      |
| 4. 其他收入       |           | 441,278.14           | 318,193.61           |
| <b>减：二、费用</b> |           | <b>6,339,448.64</b>  | <b>4,840,193.26</b>  |
| 1. 管理人报酬      | 7.4.8.2.1 | 2,355,685.30         | 2,462,961.92         |
| 2. 托管费        | 7.4.8.2.2 | 392,614.13           | 410,493.63           |
| 3. 销售服务费      |           | —                    | —                    |
| 4. 交易费用       |           | 3,262,600.59         | 1,690,094.98         |
| 5. 利息支出       |           | —                    | —                    |
| 其中：卖出回购金融资产支出 |           | —                    | —                    |
| 6. 其他费用       |           | 328,548.62           | 276,642.73           |
| <b>三、利润总额</b> |           | <b>67,186,769.28</b> | <b>40,086,596.23</b> |

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2009年1月1日至2009年12月31日

单位：人民币元

| 项 目                                   | 本期<br>2009年01月01日至2009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)                       | 247,727,720.54                             | -27,655,472.15 | 220,072,248.39  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)              | —  | 67,186,769.28  | 67,186,769.28   |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”填列)      | -108,574,230.02                            | -801,973.89    | -109,376,203.91 |
| 其中：1. 基金申购款                           | 253,454,582.11                             | 3,807,998.55   | 257,262,580.66  |
| 2. 基金赎回款                              | -362,028,812.13                            | -4,609,972.44  | -366,638,784.57 |
| 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“-”填列) | —  | -43,826,340.94 | -43,826,340.94  |
| 五、期末所有者权益(基金净值)                       | 139,153,490.52                             | -5,097,017.70  | 134,056,472.82  |
| 项 目                                   | 上年度可比期间<br>2008年6月19日(基金合同生效日)至2008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)                       | 511,032,952.17                             | —              | 511,032,952.17  |

|                                       |                 |                |                 |
|---------------------------------------|-----------------|----------------|-----------------|
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）              | —               | -40,086,596.23 | -40,086,596.23  |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”填列）      | -263,305,231.63 | 12,431,124.08  | -250,874,107.55 |
| 其中：1. 基金申购款                           | 4,016,058.53    | -359,032.26    | 3,657,026.27    |
| 2. 基金赎回款                              | -267,321,290.16 | 12,790,156.34  | -254,531,133.82 |
| 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“-”填列） | —               | —              | —               |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                       | 247,727,720.54  | -27,655,472.15 | 220,072,248.39  |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.3 财务报表由下列负责人签署：

田丹

蒋学杰

孙红辉

基金管理人负责人

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

长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金（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”）《关于核准长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》（证监许可[2008] 357 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《长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》发售，基金合同于 2008 年 6 月 19 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集规模为 511,032,952.17 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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》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，包括国内依法发行的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券及法律、法规或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：股票类资产的投

资比例为基金资产的 30%-80%；固定收益类资产的投资比例为基金资产的 15-65%；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%；投资于权证、资产支持证券的比例遵从法律法规及中国证监会的规定。本基金的业绩比较基准为：中证 800 指数×60%+上证国债指数×40%。

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**

本基金按照财政部颁布的企业会计准则(2006)、中国证券业协会 2007 年颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注 7.4.4 所列示的基金行业实务操作的规定编制年度财务报表。

#### **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，真实、完整地反映了本基金的财务状况、经营成果和基金净值变动情况。

此外本财务报表同时符合如财务报表附注 7.4.2 所列示的其他有关规定的要求。

#### **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**

本基金在本年度未发生重大会计政策变更。

##### **7.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金在本年度未发生过重大会计估计变更。

##### **7.4.5.3 差错更正的说明**

本基金在本年度未发生过重大会计差错。

#### **7.4.6 税项**

**7.4.6.1** 根据财税字[1998]55号文、[2001]61号文《关于证券投资基金税收问题的通知》、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》、财税字[2005]11号文《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》、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]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、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》、财税[2007]84号文《财政部国家税务总局关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》、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) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价, 暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。
- (4) 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, 自 2005 年 6 月 13 日起, 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。
- (5) 自 2005 年 1 月 24 日起, 基金买卖 A 股、B 股股权所书立的股权转让书据按照 0.1% 的税率征收证券(股票)交易印花税。自 2007 年 5 月 30 日起, 该税率上调至 0.3%。自 2008 年 4 月 24 日起, 证券(股票)交易印花税税率由 0.3% 降至 0.1%。自 2008 年 9 月 19 日起, 证券(股票)交易印花税改为单边征收, 即仅对卖出 A 股、B 股股权按 0.1% 的税率征收, 对受让方不再征税。
- (6) 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<br>2009年12月31日 | 上年度末<br>2008年12月31日 |
|-------------|--------------------|---------------------|
| 应交债券利息收入所得税 | 3,640.80           | —                   |

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

与基金存在重大利益关系的主要关联方的名称及关联关系

| 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       |
| 上海海欣资产管理有限公司           | 基金管理人的股东的控股子公司 |
| 武汉钢铁集团财务有限公司           | 基金管理人的股东的控股子公司 |
| 长江证券承销保荐有限公司           | 基金管理人的股东的控股子公司 |
| 上海海欣生物技术有限公司           | 基金管理人的股东的控股子公司 |

#### 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 通过关联方交易单元进行的交易

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交易。

###### 7.4.8.1.2 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<br>2009年01月01日至2009年12<br>月31日 | 上年度可比期间<br>2008年6月19日（基金合同生效日）<br>至2008年12月31日 |
|---------------------|-----------------------------------|--|
| 当期发生的基金应<br>支付的管理费  | 2,355,685.30                      | 2,462,961.92                                   |
| 其中：支付销售机<br>构的客户维护费 | 374,760.82                        | 197,382.54                                     |

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1.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金管理费=前一日基金资产净值×1.5%/当年天数

#### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2009年01月01日至2009年12月31日 | 上年度可比期间<br>2008年6月19日（基金合同生效日）至2008年12月31日 |
|----------------|-------------------------------|--|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 392,614.13                    | 410,493.63                                 |

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

0.25%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×0.25%/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

本基金在本报告期及上年度可比期间未与关联方通过银行间同业市场进行债券(含回购)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

份额单位：份

| 项目                         | 本期<br>2009年01月01日至2009年12月31日 | 上年度可比期间<br>2008年6月19日（基金合同生效日）至2008年12月31日 |
|----------------------------|-------------------------------|--|
| 基金合同生效日（2008年6月19日）持有的基金份额 | —                             | 25,002,375.00                              |
| 期初持有的基金份额                  | 25,002,375.00                 | —  |
| 期间申购/买入总份额                 | —                             | —  |
| 期间因拆分变动份额                  | —                             | —  |
| 减：期间赎回/卖出总份额               | —                             | —  |
| 期末持有的基金份额                  | 25,002,375.00                 | 25,002,375.00                              |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例          | 17.97%                        | 10.09%                                     |

注：1、本基金各关联方投资本基金适用费率严格遵循本基金基金合同中的有关规定。

2、期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额；期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

##### 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它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<br>2009年01月01日至2009年12月31日 |              | 上年度可比期间<br>2008年6月19日(基金合同生效日)至2008年12月31日 |              |
|--------------|-------------------------------|--------------|--|--------------|
|              | 期末<br>存款余额                    | 当期<br>存款利息收入 | 期末<br>存款余额                                 | 当期<br>存款利息收入 |
| 中国农业银行股份有限公司 | 7,577,400.23                  | 162,742.58   | 78,319,698.14                              | 735,109.28   |

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2009年12月31日的相关余额为人民币255,527.20元。

(2008年：人民币1,143,499.58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一会计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 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（2009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

本基金于2009年12月31日持有的因认购新发/增发证券而流通受限的证券如下：

金额单位：人民币元

| 7.4.9.11 受限证券类别：股票 |      |            |            |          |       |        |          |           |           |
|--------------------|------|------------|------------|----------|-------|--------|----------|-----------|-----------|
| 证券代码               | 证券名称 | 成功认购日      | 可流通日       | 流通受限类型   | 认购价格  | 期末估值单价 | 数量(单位：股) | 期末成本总额    | 期末估值总额    |
| 002332             | 仙琚制药 | 2009-12-30 | 2010-01-12 | 网上申购流通受限 | 8.20  | 8.20   | 500      | 4,100.00  | 4,100.00  |
| 300037             | 新宙邦  | 2009-12-28 | 2010-01-08 | 网上申购流通受限 | 28.99 | 28.99  | 500      | 14,495.00 | 14,495.00 |

##### 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

| 股票代码   | 股票名称 | 停牌日期       | 停牌原因 | 期末估值单价 | 复牌日期       | 复牌开盘单价 | 数量(股)  | 期末成本总额       | 期末估值总额       |
|--------|------|------------|------|--------|------------|--------|--------|--------------|--------------|
| 600739 | 辽    | 2009-12-28 | 重    | 38.09  | 2010-01-11 | 41.90  | 49,905 | 1,813,188.65 | 1,900,881.45 |

|  |     |  |     |  |  |  |  |  |  |
|--|-----|--|-----|--|--|--|--|--|--|
|  | 宁成大 |  | 大事项 |  |  |  |  |  |  |
|--|-----|--|-----|--|--|--|--|--|--|

#### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

截至本报告期末2009年12月31日，本基金不持有因债券正回购交易而作为抵押的债券。

## § 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（元）          | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 96,619,961.45  | 71.26        |
|    | 其中：股票             | 96,619,961.45  | 71.26        |
| 2  | 固定收益投资            | 30,087,000.00  | 22.19        |
|    | 其中：债券             | 30,087,000.00  | 22.19        |
|    | 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      | 7,832,927.43   | 5.78         |
| 6  | 其他资产              | 1,045,356.95   | 0.77         |
| 7  | 合计                | 135,585,245.83 | 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（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|-----|----------------|---------------|--------------|
| A   | 农、林、牧、渔业       | —             | —            |
| B   | 采掘业            | 14,715,500.00 | 10.98        |
| C   | 制造业            | 31,165,680.00 | 23.25        |
| C0  | 食品、饮料          | —             | —            |
| C1  | 纺织、服装、皮毛       | 21,585.00     | 0.02         |
| C2  | 木材、家具          | —             | —            |
| C3  | 造纸、印刷          | 2,067,000.00  | 1.54         |
| C4  | 石油、化学、塑胶、塑料    | 1,884,495.00  | 1.41         |
| C5  | 电子             | —             | —            |
| C6  | 金属、非金属         | 17,639,000.00 | 13.16        |
| C7  | 机械、设备、仪表       | 4,007,500.00  | 2.99         |
| C8  | 医药、生物制品        | 5,546,100.00  | 4.14         |
| C99 | 其他制造业          | —             | —            |
| D   | 电力、煤气及水的生产和供应业 | —             | —            |
| E   | 建筑业            | 1,171,000.00  | 0.87         |
| F   | 交通运输、仓储业       | 10,001,000.00 | 7.46         |
| G   | 信息技术业          | 2,448,000.00  | 1.83         |

|   |         |               |       |
|---|---------|---------------|-------|
| H | 批发和零售贸易 | 1,900,881.45  | 1.42  |
| I | 金融、保险业  | 19,580,500.00 | 14.61 |
| J | 房地产业    | 14,561,000.00 | 10.86 |
| K | 社会服务业   | 1,076,400.00  | 0.80  |
| L | 传播与文化产业 | —             | —     |
| M | 综合类     | —             | —     |
|   | 合计      | 96,619,961.45 | 72.07 |

### 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  | 601166 | 兴业银行 | 150,000 | 6,046,500.00 | 4.51         |
| 2  | 000983 | 西山煤电 | 150,000 | 5,983,500.00 | 4.46         |
| 3  | 000060 | 中金岭南 | 200,000 | 5,580,000.00 | 4.16         |
| 4  | 002007 | 华兰生物 | 100,000 | 5,542,000.00 | 4.13         |
| 5  | 000933 | 神火股份 | 150,000 | 5,532,000.00 | 4.13         |
| 6  | 601318 | 中国平安 | 100,000 | 5,509,000.00 | 4.11         |
| 7  | 000024 | 招商地产 | 200,000 | 5,326,000.00 | 3.97         |
| 8  | 601006 | 大秦铁路 | 500,000 | 5,150,000.00 | 3.84         |
| 9  | 601601 | 中国太保 | 200,000 | 5,124,000.00 | 3.82         |
| 10 | 000402 | 金融街  | 300,000 | 3,639,000.00 | 2.71         |

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  | 600030 | 中信证券 | 37,557,902.04 | 17.07          |
| 2  | 601328 | 交通银行 | 30,156,441.94 | 13.70          |
| 3  | 600016 | 民生银行 | 29,161,335.10 | 13.25          |
| 4  | 600048 | 保利地产 | 26,251,101.92 | 11.93          |
| 5  | 601166 | 兴业银行 | 25,293,895.34 | 11.49          |
| 6  | 601601 | 中国太保 | 23,512,368.10 | 10.68          |
| 7  | 000024 | 招商地产 | 21,537,078.47 | 9.79           |
| 8  | 600015 | 华夏银行 | 21,492,415.36 | 9.77           |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 9  | 000060 | 中金岭南 | 20,953,666.21 | 9.52 |
| 10 | 000933 | 神火股份 | 20,467,596.76 | 9.30 |
| 11 | 601318 | 中国平安 | 18,803,390.23 | 8.54 |
| 12 | 601168 | 西部矿业 | 18,257,096.37 | 8.30 |
| 13 | 601666 | 平煤股份 | 17,299,823.30 | 7.86 |
| 14 | 601006 | 大秦铁路 | 17,288,244.03 | 7.86 |
| 15 | 000858 | 五粮液  | 16,454,129.90 | 7.48 |
| 16 | 000402 | 金融街  | 16,078,500.90 | 7.31 |
| 17 | 600050 | 中国联通 | 15,796,803.00 | 7.18 |
| 18 | 600117 | 西宁特钢 | 15,400,621.73 | 7.00 |
| 19 | 002007 | 华兰生物 | 14,649,760.46 | 6.66 |
| 20 | 000002 | 万科A  | 14,086,736.99 | 6.40 |
| 21 | 601919 | 中国远洋 | 13,670,961.63 | 6.21 |
| 22 | 600000 | 浦发银行 | 13,367,789.11 | 6.07 |
| 23 | 601088 | 中国神华 | 13,238,104.00 | 6.02 |
| 24 | 000778 | 新兴铸管 | 13,186,065.33 | 5.99 |
| 25 | 601988 | 中国银行 | 12,799,294.80 | 5.82 |
| 26 | 600028 | 中国石化 | 12,574,665.22 | 5.71 |
| 27 | 600376 | 首开股份 | 12,375,408.73 | 5.62 |
| 28 | 600582 | 天地科技 | 11,630,363.00 | 5.28 |
| 29 | 601600 | 中国铝业 | 11,570,205.04 | 5.26 |
| 30 | 600997 | 开滦股份 | 11,329,447.70 | 5.15 |
| 31 | 000983 | 西山煤电 | 11,282,606.00 | 5.13 |
| 32 | 002202 | 金风科技 | 10,758,469.19 | 4.89 |
| 33 | 600001 | 邯郸钢铁 | 10,115,197.11 | 4.60 |
| 34 | 601169 | 北京银行 | 9,988,130.52  | 4.54 |
| 35 | 600161 | 天坛生物 | 9,496,721.76  | 4.32 |
| 36 | 600837 | 海通证券 | 9,239,743.66  | 4.20 |
| 37 | 600581 | 八一钢铁 | 9,182,214.78  | 4.17 |
| 38 | 601001 | 大同煤业 | 9,135,635.90  | 4.15 |
| 39 | 600418 | 江淮汽车 | 9,067,664.99  | 4.12 |
| 40 | 600635 | 大众公用 | 8,771,361.88  | 3.99 |
| 41 | 601390 | 中国中铁 | 8,727,000.00  | 3.97 |
| 42 | 000839 | 中信国安 | 8,191,470.80  | 3.72 |
| 43 | 600675 | 中华企业 | 8,187,145.76  | 3.72 |
| 44 | 600740 | 山西焦化 | 7,905,606.31  | 3.59 |
| 45 | 600406 | 国电南瑞 | 7,814,676.50  | 3.55 |
| 46 | 000157 | 中联重科 | 7,483,517.50  | 3.40 |
| 47 | 600808 | 马钢股份 | 7,411,555.00  | 3.37 |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 48 | 600641 | 万业企业 | 7,180,311.28 | 3.26 |
| 49 | 600026 | 中海发展 | 7,154,126.74 | 3.25 |
| 50 | 600895 | 张江高科 | 7,057,822.53 | 3.21 |
| 51 | 600531 | 豫光金铅 | 6,978,233.41 | 3.17 |
| 52 | 002088 | 鲁阳股份 | 6,887,394.18 | 3.13 |
| 53 | 000709 | 唐钢股份 | 6,734,000.00 | 3.06 |
| 54 | 600036 | 招商银行 | 6,700,804.50 | 3.04 |
| 55 | 600208 | 新湖中宝 | 6,614,299.83 | 3.01 |
| 56 | 601009 | 南京银行 | 6,563,920.61 | 2.98 |
| 57 | 600195 | 中牧股份 | 6,323,496.32 | 2.87 |
| 58 | 600383 | 金地集团 | 6,313,058.70 | 2.87 |
| 59 | 600138 | 中青旅  | 6,180,869.90 | 2.81 |
| 60 | 601628 | 中国人寿 | 6,128,200.80 | 2.78 |
| 61 | 000401 | 冀东水泥 | 6,099,479.97 | 2.77 |
| 62 | 600104 | 上海汽车 | 5,824,914.03 | 2.65 |
| 63 | 600018 | 上港集团 | 5,766,203.53 | 2.62 |
| 64 | 600031 | 三一重工 | 5,684,684.01 | 2.58 |
| 65 | 600143 | 金发科技 | 5,507,641.00 | 2.50 |
| 66 | 600219 | 南山铝业 | 5,490,192.62 | 2.49 |
| 67 | 000826 | 合加资源 | 5,477,970.12 | 2.49 |
| 68 | 600491 | 龙元建设 | 5,423,240.00 | 2.46 |
| 69 | 601958 | 金钼股份 | 5,296,953.04 | 2.41 |
| 70 | 000537 | 广宇发展 | 5,104,963.20 | 2.32 |
| 71 | 002024 | 苏宁电器 | 4,675,718.82 | 2.12 |
| 72 | 600585 | 海螺水泥 | 4,475,500.00 | 2.03 |
| 73 | 601111 | 中国国航 | 4,473,886.01 | 2.03 |

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  | 600030 | 中信证券 | 46,892,684.93 | 21.31          |
| 2  | 601328 | 交通银行 | 31,442,922.99 | 14.29          |
| 3  | 600016 | 民生银行 | 30,357,047.10 | 13.79          |
| 4  | 600048 | 保利地产 | 28,151,083.78 | 12.79          |
| 5  | 601601 | 中国太保 | 23,580,493.43 | 10.71          |
| 6  | 002007 | 华兰生物 | 23,279,825.30 | 10.58          |

|    |        |      |               |       |
|----|--------|------|---------------|-------|
| 7  | 601166 | 兴业银行 | 22,723,113.86 | 10.33 |
| 8  | 600015 | 华夏银行 | 22,612,409.18 | 10.27 |
| 9  | 000933 | 神火股份 | 21,984,269.05 | 9.99  |
| 10 | 601168 | 西部矿业 | 19,501,090.98 | 8.86  |
| 11 | 002202 | 金风科技 | 17,729,584.20 | 8.06  |
| 12 | 000858 | 五粮液  | 17,699,797.99 | 8.04  |
| 13 | 000024 | 招商地产 | 17,048,489.05 | 7.75  |
| 14 | 600050 | 中国联通 | 16,641,074.20 | 7.56  |
| 15 | 600117 | 西宁特钢 | 15,673,783.86 | 7.12  |
| 16 | 000060 | 中金岭南 | 15,434,914.61 | 7.01  |
| 17 | 600000 | 浦发银行 | 14,755,250.65 | 6.70  |
| 18 | 000778 | 新兴铸管 | 14,662,485.89 | 6.66  |
| 19 | 000002 | 万科A  | 14,592,354.00 | 6.63  |
| 20 | 601666 | 平煤股份 | 14,571,581.63 | 6.62  |
| 21 | 600406 | 国电南瑞 | 14,134,215.85 | 6.42  |
| 22 | 600895 | 张江高科 | 14,019,699.77 | 6.37  |
| 23 | 601988 | 中国银行 | 13,845,000.00 | 6.29  |
| 24 | 000402 | 金融街  | 13,782,114.52 | 6.26  |
| 25 | 600028 | 中国石化 | 13,771,705.94 | 6.26  |
| 26 | 601006 | 大秦铁路 | 13,576,555.99 | 6.17  |
| 27 | 601318 | 中国平安 | 13,245,112.24 | 6.02  |
| 28 | 002088 | 鲁阳股份 | 12,699,696.47 | 5.77  |
| 29 | 600997 | 开滦股份 | 12,334,505.60 | 5.60  |
| 30 | 601919 | 中国远洋 | 12,111,477.03 | 5.50  |
| 31 | 601088 | 中国神华 | 11,895,347.94 | 5.41  |
| 32 | 600376 | 首开股份 | 11,750,705.48 | 5.34  |
| 33 | 601600 | 中国铝业 | 11,505,352.58 | 5.23  |
| 34 | 600161 | 天坛生物 | 11,399,792.74 | 5.18  |
| 35 | 600582 | 天地科技 | 10,828,828.46 | 4.92  |
| 36 | 600418 | 江淮汽车 | 10,765,936.80 | 4.89  |
| 37 | 600616 | 金枫酒业 | 10,738,159.40 | 4.88  |
| 38 | 600001 | 邯郸钢铁 | 10,414,337.64 | 4.73  |
| 39 | 601001 | 大同煤业 | 10,289,019.72 | 4.68  |
| 40 | 600581 | 八一钢铁 | 10,060,586.22 | 4.57  |
| 41 | 600635 | 大众公用 | 9,990,271.62  | 4.54  |
| 42 | 600837 | 海通证券 | 9,988,613.40  | 4.54  |
| 43 | 600195 | 中牧股份 | 9,491,689.99  | 4.31  |
| 44 | 000839 | 中信国安 | 9,097,669.26  | 4.13  |
| 45 | 601186 | 中国铁建 | 8,946,017.95  | 4.07  |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 46 | 601390 | 中国中铁 | 8,441,199.61 | 3.84 |
| 47 | 600740 | 山西焦化 | 8,430,785.29 | 3.83 |
| 48 | 600143 | 金发科技 | 8,385,483.00 | 3.81 |
| 49 | 601628 | 中国人寿 | 8,329,847.36 | 3.79 |
| 50 | 600808 | 马钢股份 | 8,211,000.00 | 3.73 |
| 51 | 000157 | 中联重科 | 7,896,282.50 | 3.59 |
| 52 | 600641 | 万业企业 | 7,893,840.28 | 3.59 |
| 53 | 601169 | 北京银行 | 7,858,024.45 | 3.57 |
| 54 | 002266 | 浙富股份 | 7,827,322.00 | 3.56 |
| 55 | 600675 | 中华企业 | 7,666,897.99 | 3.48 |
| 56 | 600219 | 南山铝业 | 7,131,313.15 | 3.24 |
| 57 | 000709 | 唐钢股份 | 7,035,093.20 | 3.20 |
| 58 | 600531 | 豫光金铅 | 6,676,159.60 | 3.03 |
| 59 | 601009 | 南京银行 | 6,607,455.30 | 3.00 |
| 60 | 600031 | 三一重工 | 6,580,686.00 | 2.99 |
| 61 | 600036 | 招商银行 | 6,381,943.50 | 2.90 |
| 62 | 000537 | 广宇发展 | 6,304,933.88 | 2.86 |
| 63 | 600138 | 中青旅  | 6,275,628.60 | 2.85 |
| 64 | 600208 | 新湖中宝 | 6,151,113.40 | 2.80 |
| 65 | 000401 | 冀东水泥 | 5,797,627.86 | 2.63 |
| 66 | 600104 | 上海汽车 | 5,776,783.93 | 2.62 |
| 67 | 601398 | 工商银行 | 5,734,000.00 | 2.61 |
| 68 | 600690 | 青岛海尔 | 5,655,045.09 | 2.57 |
| 69 | 600649 | 城投控股 | 5,487,594.58 | 2.49 |
| 70 | 600491 | 龙元建设 | 5,356,153.02 | 2.43 |
| 71 | 600018 | 上港集团 | 5,286,270.96 | 2.40 |
| 72 | 600886 | 国投电力 | 5,155,411.49 | 2.34 |
| 73 | 000826 | 合加资源 | 5,113,241.82 | 2.32 |
| 74 | 601958 | 金钼股份 | 5,019,710.41 | 2.28 |
| 75 | 601111 | 中国国航 | 4,859,090.56 | 2.21 |
| 76 | 000983 | 西山煤电 | 4,843,915.00 | 2.20 |
| 77 | 600383 | 金地集团 | 4,771,653.44 | 2.17 |
| 78 | 002024 | 苏宁电器 | 4,759,252.01 | 2.16 |

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

金额单位：人民币元

|               |                  |
|---------------|------------------|
| 买入股票的成本（成交）总额 | 1,013,277,943.47 |
|---------------|------------------|

|               |                  |
|---------------|------------------|
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 1,090,327,757.40 |
|---------------|------------------|

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      | 30,087,000.00 | 22.44        |
| 3  | 金融债券      | —             | —            |
|    | 其中：政策性金融债 | —             | —            |
| 4  | 企业债券      | —             | —            |
| 5  | 企业短期融资券   | —             | —            |
| 6  | 可转债       | —             | —            |
| 7  | 其他        | —             | —            |
| 8  | 合计        | 30,087,000.00 | 22.44        |

### 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  | 0701016 | 07央行票据16 | 300,000 | 30,087,000.00 | 22.44        |

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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 报告期内基金投资的前十名证券的发行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。

8.9.2 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。

### 8.9.3 其他资产构成

金额单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|----|----|
|----|----|----|

|   |         |              |
|---|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金   | 261,623.70   |
| 2 | 应收证券清算款 | —            |
| 3 | 应收股利    | —            |
| 4 | 应收利息    | 778,609.51   |
| 5 | 应收申购款   | 5,123.74     |
| 6 | 其他应收款   | —            |
| 7 | 待摊费用    | —            |
| 8 | 其他      | —            |
| 9 | 合计      | 1,045,356.95 |

#### 8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 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 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<br>(户) | 户均持有的基<br>金份额 | 持有人结构         |            |                |            |
|--------------|---------------|---------------|------------|----------------|------------|
|              |               | 机构投资者         |            | 个人投资者          |            |
|              |               | 持有<br>份额      | 占总份<br>额比例 | 持有<br>份额       | 占总份<br>额比例 |
| 9,815        | 14,177.64     | 29,695,354.88 | 21.34%     | 109,458,135.64 | 78.66%     |

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

份额单位：份

| 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开<br>放式基金 | 1,796,019.95 | 1.29%    |

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

|                            |                |
|----------------------------|----------------|
| 基金合同生效日(2008年06月19日)基金份额总额 | 511,032,952.17 |
| 报告期期初基金份额总额                | 247,727,720.54 |
| 报告期期间基金总申购份额               | 253,454,582.11 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额             | 362,028,812.13 |
| 报告期期间基金拆分变动份额              | —              |
| 报告期期末基金份额总额                | 139,153,490.52 |

## § 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

- 1、报告期内本基金管理人未发生重大人事变动；
- 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 80,000.00 元，该审计机构为本基金提供的审计服务的连续年限为 2 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 本期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 | 股票交易             |           | 债券交易          |           | 应支付该券商的佣金    |            | 备注          |
|------------|------|------------------|-----------|---------------|-----------|--------------|------------|-------------|
|            | 数量   | 成交金额             | 占股票成交总额比例 | 成交金额          | 占债券成交总额比例 | 佣金           | 占当期佣金总量的比例 |             |
| 中国国际金融有限公司 | 1    | 1,564,052,617.30 | 74.39%    | 23,274,031.71 | 100.00%   | 1,329,438.60 | 75.24%     | —           |
| 中信证券       | 1    | 538,339,513.57   | 25.61%    |               |           | 437,404.90   | 24.76%     | —           |
| 中邮证券       | 1    | —                | —         | —             | —         | —            | —          | 公司更名，变更前为华弘 |

|          |   |                  |         |               |         |              |         |    |
|----------|---|------------------|---------|---------------|---------|--------------|---------|----|
|          |   |                  |         |               |         |              |         | 证券 |
| 高华<br>证券 | 1 | —                | —       | —             | —       | —            | —       | —  |
| 合计       | 4 | 2,102,392,130.87 | 100.00% | 23,274,031.71 | 100.00% | 1,766,843.50 | 100.00% | —  |

注：本报告期内本基金新增高华证券1个交易单元，截止2009年年底本基金共有4个交易单元：中邮证券、中国国际金融有限公司、中信证券和高华证券各一个交易单元。

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。