

长信内需成长股票型证券投资基金2012年半年度报告

2012年6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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2012年8月25日

§ 1 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责任。本半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2012年8月22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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2012年1月1日起至2012年6月30日止。

1.2 目录

| | | |
|------|--|----|
| §1 | 重要提示及目录..... | 2 |
| 1.1 | 重要提示..... | 2 |
| 1.2 | 目录..... | 3 |
| §2 | 基金简介..... | 5 |
| 2.1 | 基金基本情况..... | 5 |
| 2.2 | 基金产品说明..... | 5 |
| 2.3 | 基金管理人和基金托管人..... | 5 |
| 2.4 | 信息披露方式..... | 6 |
| 2.5 | 其他相关资料..... | 6 |
| §3 | 主要财务指标和基金净值表现..... | 7 |
| 3.1 | 主要会计数据和财务指标..... | 7 |
| 3.2 | 基金净值表现..... | 7 |
| §4 | 管理人报告..... | 9 |
| 4.1 | 基金管理人及基金经理情况..... | 9 |
| 4.2 | 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明..... | 10 |
| 4.3 | 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 10 |
| 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..... | 10 |
| 4.5 | 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 11 |
| 4.6 | 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 12 |
| 4.7 | 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 12 |
| §5 | 托管人报告..... | 14 |
| 5.1 | 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... | 14 |
| 5.2 | 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明..... | 14 |
| 5.3 | 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见..... | 14 |
| §6 | 半年度财务会计报告（未经审计）..... | 15 |
| 6.1 | 资产负债表..... | 15 |
| 6.2 | 利润表..... | 16 |
| 6.3 | 所有者权益（基金净值）变动表..... | 17 |
| 6.4 | 报表附注..... | 18 |
| §7 | 投资组合报告..... | 35 |
| 7.1 | 期末基金资产组合情况..... | 35 |
| 7.2 | 期末按行业分类的股票投资组合..... | 35 |
| 7.3 | 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细..... | 36 |
| 7.4 | 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 37 |
| 7.5 | 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 40 |
| 7.6 | 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..... | 40 |
| 7.7 | 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细..... | 41 |
| 7.8 | 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..... | 41 |
| 7.9 | 投资组合报告附注..... | 41 |
| §8 | 基金份额持有人信息..... | 42 |
| 8.1 | 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 42 |
| 8.2 | 期末基金管理人的从业人员持有本开基金的情况..... | 42 |
| §9 | 开放式基金份额变动..... | 43 |
| §10 | 重大事件揭示..... | 44 |
| 10.1 | 基金份额持有人大会决议..... | 44 |
| 10.2 | 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..... | 44 |

| | | |
|------|-------------------------------|----|
| 10.3 | 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 44 |
| 10.4 | 基金投资策略的改变..... | 44 |
| 10.5 | 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 44 |
| 10.6 | 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况..... | 44 |
| 10.7 | 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 44 |
| 10.8 | 其他重大事件..... | 47 |
| §11 | 备查文件目录..... | 50 |
| 11.1 | 备查文件目录..... | 50 |
| 11.2 | 存放地点..... | 50 |
| 11.3 | 查阅方式..... | 50 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|-----------------|
| 基金名称 | 长信内需成长股票型证券投资基金 |
| 基金简称 | 长信内需成长股票 |
| 基金主代码 | 519979 |
| 交易代码 | 519979 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2011年10月20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 | 97,287,276.19份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

注：本基金的基金合同于2011年10月20日起正式生效，截至2012年6月30日本基金运作未满一年。

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|---|
| 投资目标 | 本基金主要投资于受益于内需增长且具有较好成长潜力的上市公司，力争在有效控制投资组合风险的前提下实现基金资产的长期增值 |
| 投资策略 | 本基金将充分依托基金管理人的投研团队及规范的投研流程，采用科学有效的分析方法和积极主动的投资策略，重点投资于内需增长背景下具备较好成长潜力的上市公司，在严格控制风险的前提下，力求实现基金资产的长期稳定增值。 |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数收益率*80%+中证综合债券指数收益率*20% |
| 风险收益特征 | 本基金属于股票型证券投资基金，属于证券投资基金中较高预期风险和预期收益的证券投资基金产品，其预期风险和收益水平高于混合型基金、债券基金及货币市场基金。 |

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 | | 4007005566 | 95599 |
| 传真 | | 021-61009999 | 010-63201510 |
| 注册地址 | | 上海市浦东新区银城中路68号9 | 北京市东城区建国门内大街 |

| | | |
|-------|------------------------|---------------------------|
| | 楼 | 69号 |
| 办公地址 | 上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心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 |
| 邮政编码 | 200120 | 100031 |
| 法定代表人 | 田丹 | 蒋超良 |

2.4 信息披露方式

| | |
|----------------------|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 上海证券报、证券时报 |
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | www.cxfund.com.cn |
| 基金半年度报告备置地点 | 上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心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 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|----------------|---------------|
| 注册登记机构 | 中国证券登记结算有限责任公司 | 北京西城区太平桥大街17号 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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 | 报告期（2012年1月1日至2012年6月30日） |
|---------------|---------------------------|
| 本期已实现收益 | -12,940,936.24 |
| 本期利润 | 11,154,529.59 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0986 |
| 本期加权平均净值利润率 | 11.17% |
| 本期基金份额净值增长率 | 12.32% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末（2012年06月30日） |
| 期末可供分配利润 | -13,103,418.75 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.1347 |
| 期末基金资产净值 | 93,147,711.93 |
| 期末基金份额净值 | 0.957 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末（2012年06月30日） |
| 基金份额累计净值增长率 | -4.30% |

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、期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3、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。

4、本基金的基金合同生效日为2011年10月20日，截至本报告期末，本基金运作未满一年。

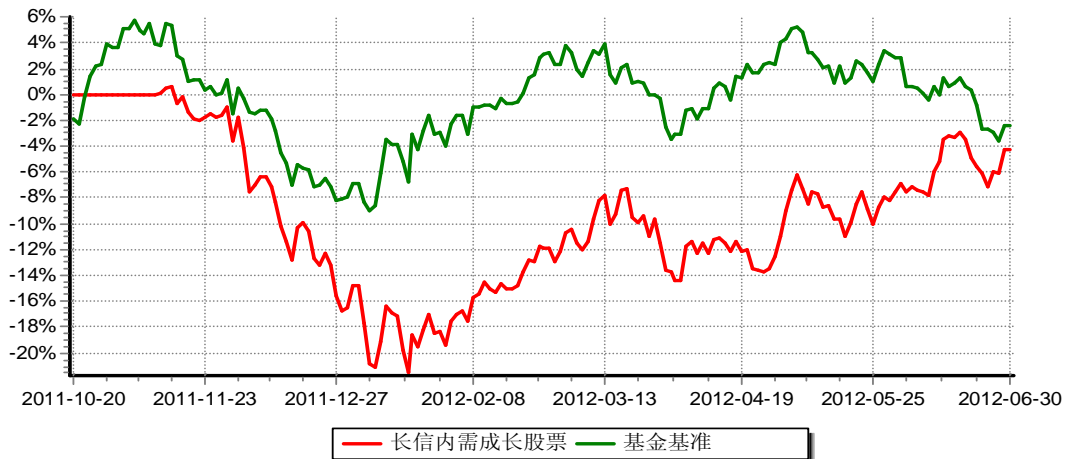
3.2 基金净值表现

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 | 业绩比较 | 业绩比较基 | ①-③ | ②-④ |
|----|------|------|-------|-----|-----|
|----|------|------|-------|-----|-----|

| | 增长率① | 增长率标准差② | 基准收益率③ | 基准收益率标准差④ | | |
|---|--------|---------|--------|-----------|--------|-------|
| 过去一个月 | 3.57% | 0.99% | -5.12% | 0.87% | 8.69% | 0.12% |
| 过去三个月 | 11.80% | 1.12% | 0.72% | 0.89% | 11.08% | 0.23% |
| 过去六个月 | 12.32% | 1.38% | 4.72% | 1.06% | 7.60% | 0.32% |
| 自基金合同生效日起至今 (2011年10月20日至2012年6月30日) | -4.30% | 1.33% | -2.42% | 1.07% | -1.88% | 0.26% |

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、本基金的基金合同生效日为2011年10月20日，图示日期为2011年10月20日至2012年6月30日。截至本报告期末，本基金运作时间未满一年。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效日起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：股票投资比例范围为基金资产的60%–95%，债券、货币市场工具、资产支持证券、现金、权证以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种的比例范围为基金资产的5%–40%，其中现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%，权证投资比例范围为基金资产净值的0%–3%。本基金对于受益于内需增长且具有较好成长潜力的上市公司的投资比例不低于股票资产的80%。截至本报告期末，本基金建仓结束未满一年。

§ 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6月30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、长信美国标准普尔100等权重指数（QDII）、长信利鑫分级债券、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 | | |
| 安昀 | 本基金的基金经理、研究发展部副总监 | 2011年10月20日 | — | 6年 | 经济学硕士，上海复旦大学数量经济学专业研究生毕业，具有基金从业资格。2006年起就职于申银万国证券研究所，担任策略研究工作，曾获2007年新财富最佳策略分析师评选第一名，2008年新财富最佳策略分析师评选第二名。2008年11月加入长信基金管理有限责任公司，历任策略研究员，长信金利趋势股票型证券投资基金的基金经理助理。现任研究发展部副总监兼本基金的基金经理。 |

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 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，未发现异常交易行为。

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

市场上半年反弹后回落，年初至今上证指数微跌，而深证成指数和中证500指数微涨，从风格上看，中小市值股票的表现略好于大市值股票，但两者的差距并不大。

从行业结构看，分化巨大。非银行金融、有色金属、食品饮料和房地产取得10%以上正收益，而电力设备、通信和国防军工取得-10%以上的负收益。

上半年本基金贯彻了投资以内需为主的投资主线，运用自上而下与自下而上结合的研究方法，比较坚定地持有了消费类股票，没有增加投资品的配置，所以整个上半年来看表现尚可。

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0.957元，报告期基金份额净值增长率为12.32%，成立以来的累计净值为0.957元，本期业绩比较基准增长率为4.72%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们依然维持对于经济基本面比较悲观的看法，但市场情绪这么差的情况下，我们觉得没必要对股市过分悲观。

首先，我们认为未来经济的增速将逐级下台阶。长期来看，由于人口红利拐点来临和资本回报率递减的影响，中国经济的潜在增长率要下调，再刻意地追求高增速极易引发通胀。中短期来看，我们并不看好地产投资的回升，目前的投资回升也难以持续。我们不看好基建投资的持续性，因为基建投资是没有盈利模式的，现金流转正可能要等很多年，而地产投资是有盈利模式的，只要房价平稳上涨，开发商就有动力进行开工和销售的循环。目前的情况是基建投资正在回升，但关键在于回升的基建投资以及逐渐宽松的信贷是否可以引致地产投资的回升，从而使得投资周期可以持续。但目前政府对于房价回升的高压态势使得开发商的预期是比较紊乱的，很难想象一个景气向下或者景气受限的行业会引致供给的繁荣

其次，从流动性看，我们也比较悲观。目前欧洲和新兴市场的货币政策非常弱势，使得美元被动走强，从而造成全球事实上的通缩。而中国经济减速的预期也在微观上造成比较大的资金流出压力，在数据上就表现为外汇占款的持续疲软和人民币贬值，以及银行越来越大的存款压力。真正决定投资的是储蓄，如果存款持续下滑，则投资前景是堪忧的。与2006-2007年相反，未来我们可能会面临M2增速持续低于信贷增速的情况。

再次，我们对通胀的形势并不乐观。这一轮通胀背后的最终因素是人口结构的变迁。中国将在2015年迎来人口红利的拐点，这意味着经济中边际上消费的力量将大于生产的力量和储蓄的力量，这将带来较持续的通胀和资产估值的下移。

短期来看，食品价格下半年可能反弹，猪肉价格下跌的空间也已经不大。长期来看，美元中长期贬值的压力比较大，因为历史上看政府都倾向于用通胀稀释债务，而全世界实际上只有美联储有印货币的资格。

综合而言：我们对经济基本面是比较悲观的，但是在市场情绪十分悲观的情况下，我们对股市并不十分悲观。从中长期看，中国经济转型的逻辑十分清晰，就是提高内需和消费对经济增长的贡献，我们将摒弃博弈的想法，从基本面出发精选内需成长类个股。

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

根据相关法律法规和本基金基金合同规定的基金收益分配原则以及基金实际运作情况，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、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为6

次，每份基金份额每次分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的30%；若基金合同生效不满3个月，可不进行收益分配；

3、基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、分红权益登记日申请申购的基金份额不享受当次分红，分红权益登记日申请赎回的基金份额享受当次分红；

5、基金红利发放日距离收益分配基准日的时间不得超过15个工作日；

6、本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若基金份额持有人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

7、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

在托管长信内需成长股票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《长信内需成长股票型证券投资基金基金合同》、《长信内需成长股票型证券投资基金托管协议》的约定，对长信内需成长股票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6月30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内需成长股票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 托管人对本半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内需成长股票型证券投资基金半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：长信内需成长股票型证券投资基金

报告截止日：2012年6月30日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2012年6月30日 | 上年度末 2011年12月31日 |
|-----------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.6.1 | 11,598,039.66 | 6,343,401.74 |
| 结算备付金 | | 158,487.16 | 1,236,098.71 |
| 存出保证金 | | 18,834.94 | — |
| 交易性金融资产 | 6.4.6.2 | 82,258,114.47 | 106,764,822.19 |
| 其中：股票投资 | | 82,258,114.47 | 106,764,822.19 |
| 基金投资 | | — | — |
| 债券投资 | | — | — |
| 资产支持证券投资 | | — | — |
| 衍生金融资产 | 6.4.6.3 | — | — |
| 买入返售金融资产 | 6.4.6.4 | — | — |
| 应收证券清算款 | | 998,008.90 | 1,630,856.27 |
| 应收利息 | 6.4.6.5 | 1,783.97 | 2,388.96 |
| 应收股利 | | — | — |
| 应收申购款 | | 35,279.88 | 985.22 |
| 递延所得税资产 | | — | — |
| 其他资产 | 6.4.6.6 | — | — |
| 资产总计 | | 95,068,548.98 | 115,978,553.09 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2012年6月30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 | | — | — |

| | | | |
|---------------|----------|---------------|----------------|
| 应付证券清算款 | | 1,463,356.12 | 1,241,493.78 |
| 应付赎回款 | | 39,458.58 | 635,631.74 |
| 应付管理人报酬 | | 115,403.76 | 159,605.88 |
| 应付托管费 | | 19,233.98 | 26,600.99 |
| 应付销售服务费 | | — | — |
| 应付交易费用 | 6.4.6.7 | 114,528.23 | 145,637.74 |
| 应交税费 | | — | — |
| 应付利息 | | — | — |
| 应付利润 | | — | — |
| 递延所得税负债 | | — | — |
| 其他负债 | 6.4.6.8 | 168,856.38 | 122,395.59 |
| 负债合计 | | 1,920,837.05 | 2,331,365.72 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 6.4.6.9 | 97,287,276.19 | 133,388,429.79 |
| 未分配利润 | 6.4.6.10 | -4,139,564.26 | -19,741,242.42 |
| 所有者权益合计 | | 93,147,711.93 | 113,647,187.37 |
| 负债和所有者权益总计 | | 95,068,548.98 | 115,978,553.09 |

注：报告截止日2012年6月30日，基金份额净值0.957元，基金份额总额97,287,276.19份。

6.2 利润表

会计主体：长信内需成长股票型证券投资基金

本报告期：2012年1月1日至2012年6月30日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2012年1月1日至2012年6月30日 |
|----------------|----------|----------------------------|
| 一、收入 | | 13,350,504.30 |
| 1. 利息收入 | | 49,001.37 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.6.11 | 49,001.37 |
| 债券利息收入 | | — |
| 资产支持证券利息收入 | | — |
| 买入返售金融资产收入 | | — |
| 2. 投资收益（损失以“-” | | -10,835,896.29 |

| | | |
|-------------------------------------|----------|----------------|
| 填列) | | |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.6.12 | -11,339,213.92 |
| 基金投资收益 | | — |
| 债券投资收益 | 6.4.6.13 | — |
| 资产支持证券投资 收益 | | — |
| 衍生工具收益 | 6.4.6.14 | — |
| 股利收益 | 6.4.6.15 | 503,317.63 |
| 3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列） | 6.4.6.16 | 24,095,465.83 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列） | | — |
| 5. 其他收入（损失以“-” 号填列） | 6.4.6.17 | 41,933.39 |
| 减：二、费用 | | 2,195,974.71 |
| 1. 管理人报酬 | | 746,653.19 |
| 2. 托管费 | | 124,442.20 |
| 3. 销售服务费 | | — |
| 4. 交易费用 | 6.4.6.18 | 1,166,158.99 |
| 5. 利息支出 | | — |
| 其中：卖出回购金融资产 支出 | | — |
| 6. 其他费用 | 6.4.6.19 | 158,720.33 |
| 三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列） | | 11,154,529.59 |
| 减：所得税费用 | | — |
| 四、净利润（净亏损以“-” 号填列） | | 11,154,529.59 |

注：本基金的基金合同生效日为2011年10月20日。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长信内需成长股票型证券投资基金

本报告期：2012年1月1日至2012年6月30日

单位：人民币元

| | |
|-----|----------------------|
| 项 目 | 本期 |
| | 2012年1月1日至2012年6月30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) | 133,388,429.79 | -19,741,242.42 | 113,647,187.37 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | — | 11,154,529.59 | 11,154,529.59 |
| 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) | -36,101,153.60 | 4,447,148.57 | -31,654,005.03 |
| 其中：1. 基金申购款 | 2,073,039.26 | -182,747.56 | 1,890,291.70 |
| 2. 基金赎回款(以“-”号填列) | -38,174,192.86 | 4,629,896.13 | -33,544,296.73 |
| 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) | 97,287,276.19 | -4,139,564.26 | 93,147,711.93 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4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 |

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

长信内需成长股票型证券投资基金(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”)《关于核准长信内需成长股票型证券投资基金募集的批复》(证监许可[2011]439号)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《长信内需成长股票型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于2011年10月20日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。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”)。

本基金于2011年9月5日至2011年10月14日募集,募集资金总额人民币355,282,502.43元,利息转份额人民币117,265.96元,募集规模为355,399,768.39份。上述募集资金已经验证,并出具了验资报告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《长信内需成长股票型证券投资基金基金合同》和《长信内需成长股票型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板和创业板及其他中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合证监会的相关规定)。本基金的投资组合比例为:股票投资比例范围为基金资产的60%-95%,债券、货币市场工具、资产支持证券、现金、权证以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种的比例范围为基金资产的5%-40%,其中现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%,权证投资比例范围为基金资产净值的0%-3%。本基金对于受益于内需增长且具有较好成长潜力的上市公司的投资比例不低于股票资产的80%。本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率*80%+中证综合债券指数收益率*20%。

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。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金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”)、中国证券业协会于2007年颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《长信内需成长股票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6.4.4所列示的基金行业实务操作的规定编制年度财务报表。

6.4.3 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6月30日的财务状况、2012年上半年度的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6.4.2所列示的其他有关规定的要求。

6.4.4 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.4.1 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。

6.4.4.2 差错更正的说明

本基金在本报告期末发生过重大会计差错。

6.4.5 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》、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，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，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。

6.4.6 重要财务报表项目的说明

6.4.6.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2012年6月30日 |
|------|-------------------|
| 活期存款 | 11,598,039.66 |
| 定期存款 | — |
| 其他存款 | — |
| 合计 | 11,598,039.66 |

6.4.6.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2012年6月30日 | | |
|--------|----------------|---------------|--------------|
| | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 72,812,702.44 | 82,258,114.47 | 9,445,412.03 |
| 债券 | 交易所市场 | — | — |
| | 银行间市场 | — | — |
| | 合计 | — | — |
| 资产支持证券 | — | — | — |
| 其他 | — | — | — |
| 合计 | 72,812,702.44 | 82,258,114.47 | 9,445,412.03 |

6.4.6.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产。

6.4.6.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.6.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2012年6月30日 |
|-----------|-------------------|
| 应收活期存款利息 | 1,710.80 |
| 应收结算备付金利息 | 71.40 |
| 应收债券利息 | — |

| | |
|------------|----------|
| 应收买入返售证券利息 | — |
| 应收申购款利息 | 1.77 |
| 其他 | — |
| 合计 | 1,783.97 |

6.4.6.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.6.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2012年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 114,528.23 |
| 银行间市场应付交易费用 | — |
| 合计 | 114,528.23 |

6.4.6.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2012年6月30日 |
|--------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | — |
| 应付赎回费 | 148.68 |
| 预提信息披露费-上证报 | 69,672.34 |
| 预提信息披露费-证券时报 | 59,726.04 |
| 预提帐户维护费 | 4,500.00 |
| 审计费 | 34,809.32 |
| 合计 | 168,856.38 |

6.4.6.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期2012年1月1日至2012年6月30日 | |
|------|------------------------|----------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 133,388,429.79 | 133,388,429.79 |
| 本期申购 | 2,073,039.26 | 2,073,039.26 |
| 本期赎回 | -38,174,192.86 | -38,174,192.86 |
| 本期末 | 97,287,276.19 | 97,287,276.19 |

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额；

6.4.6.10 未分配利润

单位：人民币元

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|----------------|----------------|----------------|
| 上年度末 | -6,005,634.37 | -13,735,608.05 | -19,741,242.42 |
| 本期利润 | -12,940,936.24 | 24,095,465.83 | 11,154,529.59 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 5,843,151.86 | -1,396,003.29 | 4,447,148.57 |
| 其中：基金申购款 | -320,470.52 | 137,722.96 | -182,747.56 |
| 基金赎回款 | 6,163,622.38 | -1,533,726.25 | 4,629,896.13 |
| 本期已分配利润 | — | — | — |
| 本期末 | -13,103,418.75 | 8,963,854.49 | -4,139,564.26 |

6.4.6.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期2012年1月1日至2012年6月30日 |
|-----------|------------------------|
| 活期存款利息收入 | 43,175.18 |
| 结算备付金利息收入 | 5,824.42 |
| 其他 | 1.77 |
| 合计 | 49,001.37 |

注：此处其他列示的是申购款的利息收入。

6.4.6.12 股票投资收益

6.4.6.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2012年1月1日至2012年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 卖出股票成交总额 | 397,129,267.71 |
| 减：卖出股票成本总额 | 408,468,481.63 |
| 买卖股票差价收入 | -11,339,213.92 |

6.4.6.13 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.6.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.6.15 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2012年1月1日至2012年6月30日 |
|----|----------------------------|
|----|----------------------------|

| | |
|-------------|------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 503,317.63 |
| 基金投资产生的股利收益 | — |
| 合计 | 503,317.63 |

6.4.6.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2012年1月1日至2012年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | 24,095,465.83 |
| ——股票投资 | 24,095,465.83 |
| ——债券投资 | — |
| ——资产支持证券投资 | — |
| 2. 衍生工具 | — |
| ——权证投资 | — |
| 3. 其他 | — |
| 合计 | 24,095,465.83 |

6.4.6.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2012年1月1日至2012年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 41,933.39 |
| 合计 | 41,933.39 |

注：本基金赎回费和转换费的25%归入基金资产。

6.4.6.18 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2012年1月1日至2012年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 1,166,158.99 |
| 银行间市场交易费用 | — |
| 合计 | 1,166,158.99 |

6.4.6.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2012年1月1日至2012年6月30日 |
|-------|----------------------------|
| 审计费用 | 34,809.32 |
| 信息披露费 | 109,398.38 |

| | |
|-------|------------|
| 权证 | — |
| 上市年费 | — |
| 帐户维护费 | 10,680.00 |
| 律师费 | — |
| 注册登记费 | — |
| 分红手续费 | — |
| 其他费用 | 3,832.63 |
| 合计 | 158,720.33 |

6.4.7 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.7.1 或有事项

截至本财务报告批准报出日，本基金未发生需要披露的或有事项。

6.4.7.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金未发生需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.8 关联方关系

6.4.8.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方无变化。

6.4.8.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 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 |

6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.9.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2012年1月1日至2012年6月30日 |
|-------|----------------------------|
| | |

| | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 |
|------|----------------|--------------|
| 长江证券 | 221,635,264.91 | 29.28% |

6.4.9.1.2 债券交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.9.1.3 债券回购交易

本基金本报告期末通过关联方长江证券交易单元进行债券回购交易。

6.4.9.1.4 权证交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.9.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2012年1月1日至2012年6月30日 | | | |
|-------|----------------------------|------------|----------|------------|
| | 当期佣金 | 占当期佣金总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占应付佣金余额的比例 |
| 长江证券 | 188,389.72 | 29.99% | — | — |

注：股票交易佣金计提标准如下：

深圳证券交易所交易佣金=买(卖)成交金额×1%-清算库中买(卖)经手费-证券结算风险基金(按股票成交金额的十万分之三收取)

上海证券交易所交易佣金=买(卖)成交金额×1%-买(卖)经手费-买(卖)证管费-证券结算风险基金(按股票成交金额的十万分之三收取)

上述佣金比率均在合理商业条款范围内收取，并符合行业标准。

根据《证券交易席位及证券综合服务协议》，本基金的基金管理人在租用长江证券股份有限公司证券交易专用交易单元进行股票和债券交易的同时，还从长江证券股份有限公司获得证券研究综合服务。

6.4.9.2 关联方报酬

6.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2012年1月1日至2012年6月30日 |
|----------------|----------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 746,653.19 |

| | |
|------------------|------------|
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 408,216.71 |
|------------------|------------|

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

6.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----------------|----------------------|
| | 2012年1月1日至2012年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 124,442.20 |

注：支付基金托管人中国农业银行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

6.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

6.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.9.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.9.4.2 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

份额单位：份

| 关联方名称 | 本期末 2012年6月30日 | | 上年度末 2011年12月31日 | |
|------------------|-------------------|--------------------------|---------------------|--------------------------|
| | 持有的 基金份额 | 持有的基金份额 占基金总份额的 比例 | 持有的 基金份额 | 持有的基金份额 占基金总份额的 比例 |
| 上海海欣集团股 份有限公司 | 4,999,450.00 | 5.14% | 4,999,450.00 | 3.75% |

6.4.9.5 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 2012年1月1日至2012年6月30日 | |
|---------|----------------------------|-----------|
| | 期末存款余额 | 当期存款利息收入 |
| 中国农业银行股 | 11,598,039.66 | 43,175.18 |

| | | |
|-------|--|--|
| 份有限公司 | | |
|-------|--|--|

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6月30日的相关余额为人民币158,487.16元。

6.4.9.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期末在承销期内购入过由关联方承销的证券。

6.4.9.7 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。

6.4.10 利润分配情况

本报告期本基金未进行收益分配。

6.4.11 期末（2012年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.11.1 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，应当承诺获得网下配售的股票持有期限不少于3个月，持有期自公开发行的股票上市之日起计算。基金通过网上申购获配的新股，从新股获配日至该新股上市日期间，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6月30日，本基金未有因认购新发或增发证券而持有上述流通受限证券。

6.4.11.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

截至本报告期末，本基金未持有因债券正回购交易而作为抵押的债权。

6.4.12 金融工具风险及管理

6.4.12.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括：

信用风险

流动性风险

市场风险

本基金在下文主要论述上述风险敞口及其形成原因：风险管理目标、政策和过程以及计量风险的方法等。

本基金的基金管理人从事风险管理的目标是使本基金在风险和收益之间取得适当的平衡，以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。基于该风险管理目标，本基金的基金管理人已制定了政策和程序来辨别和分析这些风险，设定适当的风险限额并设计相应的内部控制程序，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由风险控制委员会、金融工程部和相关职能部门构成的多级风险管理架构体系。

6.4.12.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国农业银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

本基金于期末未持有债券投资，因此不存在因债券投资而面临的信用风险。

6.4.12.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现，另一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人主要通过限制、跟踪和控制基金投资交易的不活跃品种来实现。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，除附注6.4.11中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式融入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，

约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金的基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过专设的金融工程部设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

6.4.12.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.12.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款和结算备付金等。本基金的基金管理人通过专设的金融工程部对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.12.4.1.1 利率风险敞口

| 本期末 2012年6月30日 | 6个月以内 | 6个月 -1年 | 1-5 年 | 5年以 上 | 不计息 | 合计 |
|---------------------|---------------|------------|----------|----------|----------------|----------------|
| 资产 | | | | | | |
| 银行存款 | 11,598,039.66 | | — | — | — | 11,598,039.66 |
| 结算备付金 | 158,487.16 | | — | — | — | 158,487.16 |
| 存出保证金 | | | — | — | 18,834.94 | 18,834.94 |
| 交易性金融资产 | | | — | — | 82,258,114.47 | 82,258,114.47 |
| 应收证券清算款 | | | — | — | 998,008.90 | 998,008.90 |
| 应收利息 | | | — | — | 1,783.97 | 1,783.97 |
| 应收申购款 | | | — | — | 35,279.88 | 35,279.88 |
| 资产总计 | 11,756,526.82 | — | — | — | 83,312,022.16 | 95,068,548.98 |
| 负债 | | | | | | |
| 应付证券清算款 | | | — | — | 1,463,356.12 | 1,463,356.12 |
| 应付赎回款 | | | — | — | 39,458.58 | 39,458.58 |
| 应付管理人报酬 | | | — | — | 115,403.76 | 115,403.76 |
| 应付托管费 | | | — | — | 19,233.98 | 19,233.98 |
| 应付交易费用 | | | — | — | 114,528.23 | 114,528.23 |
| 其他负债 | | | — | — | 168,856.38 | 168,856.38 |
| 负债总计 | — | — | — | — | 1,920,837.05 | 1,920,837.05 |
| 利率敏感度缺口 | 11,756,526.82 | — | — | — | 81,391,185.11 | 93,147,711.93 |
| 上年度末 2011年12月31日 | 6个月以内 | 6个月 -1年 | 1-5 年 | 5年以 上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | | |
| 银行存款 | 6,343,401.74 | | — | — | — | 6,343,401.74 |
| 结算备付金 | 1,236,098.71 | | — | — | — | 1,236,098.71 |
| 交易性金融资产 | | | — | — | 106,764,822.19 | 106,764,822.19 |
| 应收证券清算款 | | | — | — | 1,630,856.27 | 1,630,856.27 |
| 应收利息 | | | — | — | 2,388.96 | 2,388.96 |
| 应收申购款 | | | — | — | 985.22 | 985.22 |
| 资产总计 | 7,579,500.45 | — | — | — | 108,399,052.64 | 115,978,553.09 |
| 负债 | | | | | | |
| 应付证券清算款 | | | — | — | 1,241,493.78 | 1,241,493.78 |
| 应付赎回款 | | | — | — | 635,631.74 | 635,631.74 |
| 应付管理人报酬 | | | — | — | 159,605.88 | 159,605.88 |
| 应付托管费 | | | — | — | 26,600.99 | 26,600.99 |

| | | | | | | |
|---------|--------------|---|---|---|----------------|----------------|
| 应付交易费用 | | | — | — | 145,637.74 | 145,637.74 |
| 其他负债 | | | — | — | 122,395.59 | 122,395.59 |
| 负债总计 | — | — | — | — | 2,331,365.72 | 2,331,365.72 |
| 利率敏感度缺口 | 7,579,500.45 | — | — | — | 106,067,686.92 | 113,647,187.37 |

注：本基金根据所持有资产和负债的按摊余成本法确定的公允价值，按合约规定的重新定价日及剩余到期日中的孰早者进行分类。

6.4.12.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金于本报告期末未持有债券投资，无重大利率风险，因而未进行敏感性分析。银行存款及结算备付金之浮动利率根据中国人民银行的基准利率和相关机构的相关政策浮动。

6.4.12.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.12.4.3 其他价格风险

其他市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券以及银行间同业市场交易的债券，所面临的最大其他市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括VaR(Value at Risk)等指标来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

于2012年6月30日，本基金投资组合中股票投资比例为基金资产净值的88.31%、无债券投资。于2012年6月30日，本基金面临的其他价格风险列示如下：

6.4.12.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 | | 上年度末 | |
|--------------|---------------|---------------|----------------|---------------|
| | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
| 交易性金融资产-股票投资 | 82,258,114.47 | 88.31 | 106,764,822.19 | 93.94 |

| | | | | |
|--------------|---------------|-------|----------------|-------|
| 交易性金融资产-债券投资 | — | — | — | — |
| 衍生金融资产-权证投资 | — | — | — | — |
| 其他 | — | — | — | — |
| 合计 | 82,258,114.47 | 88.31 | 106,764,822.19 | 93.94 |

6.4.12.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| | | | |
|----|--|---------------------------------|-----------------------|
| 假设 | 在95%的置信区间内，于2012年6月30日，基金资产组合的市场价格风险VaR值为2.01%（2011：2.16%） | | |
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元) | |
| | | 本期末 (2012年6月30日) | 上年度末 (2011年12月31日) |
| | | -1,872,269.01 | -2,454,779.25 |

注：上述风险价值VaR的分析是基于资产负债表日所持证券过去一年市场价格波动情况而有可能发生的最大损失，且此变动适用于本基金所有的衍生工具及非衍生金融工具。取95%的置信度是基于本基金所持有的金融工具风险度量的要求。

6.4.13 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 以公允价值计量的金融工具

下表按公允价值三个层级列示了以公允价值计量的金融资产工具于2011年12月31日的账面价值。公允价值计量中的层级取决于对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值。三个层级的定义如下：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价；

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除市场报价以外的有关资产或负债的输入值；

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

单位：人民币元

| 项目 | 第一层级 | 第二层级 | 第三层级 | 合计 |
|---------|---------------|------|------|---------------|
| 交易性金融资产 | | | | |
| 股票投资 | 82,258,114.47 | - | - | 82,258,114.47 |
| 债券投资 | - | - | - | - |

| | | | | |
|----|---------------|---|---|---------------|
| 合计 | 82,258,114.47 | - | - | 82,258,114.47 |
|----|---------------|---|---|---------------|

根据估值方法的变更,本基金综合考虑估值调整中采用的可观察与不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关证券公允价值的层级。

(2) 其他金融工具的公允价值(非以公允价值计量账面价值)

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值之间无重大差异。

§ 7 投资组合报告

7.1 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 | 82,258,114.47 | 86.53 |
| | 其中：股票 | 82,258,114.47 | 86.53 |
| 2 | 固定收益投资 | — | — |
| | 其中：债券 | — | — |
| | 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 | 11,756,526.82 | 12.37 |
| 6 | 其他资产 | 1,053,907.69 | 1.11 |
| 7 | 合计 | 95,068,548.98 | 100.00 |

7.2 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 | — | — |
| C | 制造业 | 67,543,067.52 | 72.51 |
| C0 | 食品、饮料 | 38,265,055.61 | 41.08 |
| 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 | 3,081,790.00 | 3.31 |
| C5 | 电子 | — | — |
| C6 | 金属、非金属 | — | — |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 3,036,676.50 | 3.26 |
| C8 | 医药、生物制品 | 23,159,545.41 | 24.86 |

| | | | |
|-----|----------------|---------------|-------|
| 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 | — | — |
| H | 批发和零售贸易 | 8,645,580.60 | 9.28 |
| I | 金融、保险业 | — | — |
| J | 房地产业 | 6,069,466.35 | 6.52 |
| K | 社会服务业 | — | — |
| L | 传播与文化产业 | — | — |
| M | 综合类 | — | — |
| | 合计 | 82,258,114.47 | 88.31 |

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------|--------------|--------------|
| 1 | 600809 | 山西汾酒 | 172,086 | 6,485,921.34 | 6.96 |
| 2 | 002262 | 恩华药业 | 276,012 | 6,428,319.48 | 6.90 |
| 3 | 002304 | 洋河股份 | 47,450 | 6,384,397.50 | 6.85 |
| 4 | 600340 | 华夏幸福 | 335,515 | 6,069,466.35 | 6.52 |
| 5 | 300146 | 汤臣倍健 | 76,898 | 5,165,238.66 | 5.55 |
| 6 | 600535 | 天士力 | 109,600 | 4,791,712.00 | 5.14 |
| 7 | 002294 | 信立泰 | 174,054 | 4,699,458.00 | 5.05 |
| 8 | 600199 | 金种子酒 | 186,703 | 4,663,840.94 | 5.01 |
| 9 | 000423 | 东阿阿胶 | 116,500 | 4,661,165.00 | 5.00 |
| 10 | 000596 | 古井贡酒 | 91,754 | 4,334,458.96 | 4.65 |
| 11 | 000538 | 云南白药 | 71,952 | 4,265,314.56 | 4.58 |
| 12 | 600519 | 贵州茅台 | 16,700 | 3,993,805.00 | 4.29 |
| 13 | 002646 | 青青稞酒 | 122,999 | 3,895,378.33 | 4.18 |
| 14 | 600276 | 恒瑞医药 | 128,930 | 3,701,580.30 | 3.97 |
| 15 | 000869 | 张裕A | 49,688 | 3,342,014.88 | 3.59 |
| 16 | 600315 | 上海家化 | 79,000 | 3,081,790.00 | 3.31 |
| 17 | 002223 | 鱼跃医疗 | 204,490 | 3,036,676.50 | 3.26 |
| 18 | 300005 | 探路者 | 126,556 | 2,217,261.12 | 2.38 |
| 19 | 002603 | 以岭药业 | 37,761 | 1,040,315.55 | 1.12 |

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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 | 600340 | 华夏幸福 | 13,127,350.69 | 11.55 |
| 2 | 300146 | 汤臣倍健 | 12,295,262.37 | 10.82 |
| 3 | 601933 | 永辉超市 | 9,567,056.80 | 8.42 |
| 4 | 000568 | 泸州老窖 | 8,423,511.97 | 7.41 |
| 5 | 000861 | 海印股份 | 8,409,569.87 | 7.40 |
| 6 | 600030 | 中信证券 | 8,048,842.25 | 7.08 |
| 7 | 000423 | 东阿阿胶 | 7,976,904.63 | 7.02 |
| 8 | 002603 | 以岭药业 | 7,882,483.84 | 6.94 |
| 9 | 600518 | 康美药业 | 7,774,601.19 | 6.84 |
| 10 | 000989 | 九芝堂 | 7,510,461.04 | 6.61 |
| 11 | 000538 | 云南白药 | 7,259,975.87 | 6.39 |
| 12 | 002223 | 鱼跃医疗 | 6,727,226.07 | 5.92 |
| 13 | 002594 | 比亚迪 | 6,653,061.26 | 5.85 |
| 14 | 002069 | 獐子岛 | 6,216,959.37 | 5.47 |
| 15 | 002294 | 信立泰 | 6,166,529.41 | 5.43 |
| 16 | 002304 | 洋河股份 | 6,070,355.47 | 5.34 |
| 17 | 600036 | 招商银行 | 6,013,609.00 | 5.29 |
| 18 | 601166 | 兴业银行 | 5,982,857.47 | 5.26 |
| 19 | 600809 | 山西汾酒 | 5,970,920.50 | 5.25 |
| 20 | 601601 | 中国太保 | 5,940,346.98 | 5.23 |
| 21 | 000596 | 古井贡酒 | 5,924,448.93 | 5.21 |
| 22 | 601336 | 新华保险 | 5,902,638.66 | 5.19 |
| 23 | 601318 | 中国平安 | 5,743,390.00 | 5.05 |
| 24 | 002251 | 步步高 | 5,476,472.09 | 4.82 |
| 25 | 600837 | 海通证券 | 5,325,078.01 | 4.69 |
| 26 | 601688 | 华泰证券 | 5,188,024.00 | 4.57 |
| 27 | 002262 | 恩华药业 | 5,174,225.76 | 4.55 |
| 28 | 600315 | 上海家化 | 4,979,634.07 | 4.38 |
| 29 | 300005 | 探路者 | 4,507,583.38 | 3.97 |
| 30 | 600199 | 金种子酒 | 4,480,683.05 | 3.94 |
| 31 | 002007 | 华兰生物 | 4,394,853.20 | 3.87 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 32 | 002657 | 中金金财 | 4,260,606.70 | 3.75 |
| 33 | 600887 | 伊利股份 | 4,148,115.51 | 3.65 |
| 34 | 600763 | 通策医疗 | 4,136,961.73 | 3.64 |
| 35 | 002482 | 广田股份 | 4,116,283.77 | 3.62 |
| 36 | 002293 | 罗莱家纺 | 4,062,893.50 | 3.58 |
| 37 | 000799 | 酒鬼酒 | 4,024,815.11 | 3.54 |
| 38 | 601328 | 交通银行 | 4,020,250.00 | 3.54 |
| 39 | 601628 | 中国人寿 | 4,000,125.65 | 3.52 |
| 40 | 600535 | 天士力 | 3,993,162.23 | 3.51 |
| 41 | 000540 | 中天城投 | 3,981,986.00 | 3.50 |
| 42 | 000686 | 东北证券 | 3,967,916.01 | 3.49 |
| 43 | 002557 | 洽洽食品 | 3,829,775.90 | 3.37 |
| 44 | 002646 | 青青稞酒 | 3,773,901.90 | 3.32 |
| 45 | 600519 | 贵州茅台 | 3,692,010.38 | 3.25 |
| 46 | 600276 | 恒瑞医药 | 3,598,577.62 | 3.17 |
| 47 | 600436 | 片仔癀 | 3,570,137.50 | 3.14 |
| 48 | 601100 | 恒立油缸 | 3,557,617.52 | 3.13 |
| 49 | 000869 | 张裕A | 3,508,427.55 | 3.09 |
| 50 | 601998 | 中信银行 | 3,095,900.00 | 2.72 |
| 51 | 600019 | 宝钢股份 | 3,080,013.81 | 2.71 |
| 52 | 600048 | 保利地产 | 3,063,388.20 | 2.70 |
| 53 | 002024 | 苏宁电器 | 3,047,147.55 | 2.68 |
| 54 | 000069 | 华侨城A | 2,924,800.00 | 2.57 |
| 55 | 300253 | 卫宁软件 | 2,866,803.22 | 2.52 |
| 56 | 600511 | 国药股份 | 2,595,104.49 | 2.28 |

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。

7.4.2 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 | 600340 | 华夏幸福 | 15,133,166.79 | 13.32 |
| 2 | 300146 | 汤臣倍健 | 10,481,423.85 | 9.22 |
| 3 | 002594 | 比亚迪 | 9,761,535.68 | 8.59 |
| 4 | 601933 | 永辉超市 | 9,327,312.96 | 8.21 |
| 5 | 600030 | 中信证券 | 8,922,298.44 | 7.85 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 6 | 000568 | 泸州老窖 | 8,724,574.19 | 7.68 |
| 7 | 002603 | 以岭药业 | 8,484,072.34 | 7.47 |
| 8 | 000861 | 海印股份 | 8,473,430.63 | 7.46 |
| 9 | 000989 | 九芝堂 | 8,146,928.77 | 7.17 |
| 10 | 600518 | 康美药业 | 7,764,420.93 | 6.83 |
| 11 | 002007 | 华兰生物 | 6,552,565.65 | 5.77 |
| 12 | 601166 | 兴业银行 | 6,505,810.00 | 5.72 |
| 13 | 600837 | 海通证券 | 6,486,172.39 | 5.71 |
| 14 | 601318 | 中国平安 | 6,328,931.26 | 5.57 |
| 15 | 600036 | 招商银行 | 6,307,953.00 | 5.55 |
| 16 | 601601 | 中国太保 | 6,149,269.12 | 5.41 |
| 17 | 601336 | 新华保险 | 6,022,967.14 | 5.30 |
| 18 | 601688 | 华泰证券 | 6,003,830.00 | 5.28 |
| 19 | 002069 | 獐子岛 | 5,527,930.97 | 4.86 |
| 20 | 002251 | 步步高 | 5,418,149.75 | 4.77 |
| 21 | 300253 | 卫宁软件 | 5,405,264.10 | 4.76 |
| 22 | 000799 | 酒鬼酒 | 4,815,489.77 | 4.24 |
| 23 | 601328 | 交通银行 | 4,299,600.00 | 3.78 |
| 24 | 300258 | 精锻科技 | 4,289,643.20 | 3.77 |
| 25 | 601628 | 中国人寿 | 4,122,610.34 | 3.63 |
| 26 | 600887 | 伊利股份 | 4,046,336.95 | 3.56 |
| 27 | 002657 | 中科金财 | 4,040,778.84 | 3.56 |
| 28 | 000540 | 中天城投 | 4,006,114.00 | 3.53 |
| 29 | 002482 | 广田股份 | 3,985,136.43 | 3.51 |
| 30 | 600763 | 通策医疗 | 3,984,943.19 | 3.51 |
| 31 | 002293 | 罗莱家纺 | 3,935,810.26 | 3.46 |
| 32 | 000686 | 东北证券 | 3,915,753.10 | 3.45 |
| 33 | 300244 | 迪安诊断 | 3,843,719.61 | 3.38 |
| 34 | 600511 | 国药股份 | 3,837,170.65 | 3.38 |
| 35 | 300122 | 智飞生物 | 3,837,036.63 | 3.38 |
| 36 | 002557 | 洽洽食品 | 3,820,506.71 | 3.36 |
| 37 | 601100 | 恒立油缸 | 3,816,546.65 | 3.36 |
| 38 | 600436 | 片仔癀 | 3,799,500.43 | 3.34 |
| 39 | 002223 | 鱼跃医疗 | 3,617,545.17 | 3.18 |
| 40 | 600315 | 上海家化 | 3,555,125.00 | 3.13 |
| 41 | 000538 | 云南白药 | 3,541,834.54 | 3.12 |

| | | | | |
|----|--------|-------|--------------|------|
| 42 | 600048 | 保利地产 | 3,336,000.00 | 2.94 |
| 43 | 000651 | 格力电器 | 3,212,761.36 | 2.83 |
| 44 | 601998 | 中信银行 | 3,129,300.00 | 2.75 |
| 45 | 000887 | 中鼎股份 | 3,074,338.96 | 2.71 |
| 46 | 300041 | 回天胶业 | 3,073,261.72 | 2.70 |
| 47 | 300274 | 阳光电源 | 3,057,670.00 | 2.69 |
| 48 | 600019 | 宝钢股份 | 3,043,593.60 | 2.68 |
| 49 | 300005 | 探路者 | 3,032,777.73 | 2.67 |
| 50 | 000581 | 威孚高科 | 3,027,937.36 | 2.66 |
| 51 | 000069 | 华侨城 A | 3,005,110.66 | 2.64 |
| 52 | 000423 | 东阿阿胶 | 2,988,723.63 | 2.63 |
| 53 | 002024 | 苏宁电器 | 2,968,940.00 | 2.61 |
| 54 | 002123 | 荣信股份 | 2,866,934.10 | 2.52 |
| 55 | 000661 | 长春高新 | 2,693,400.77 | 2.37 |
| 56 | 600499 | 科达机电 | 2,530,852.69 | 2.23 |
| 57 | 002551 | 尚荣医疗 | 2,509,240.00 | 2.21 |
| 58 | 300257 | 开山股份 | 2,482,252.26 | 2.18 |
| 59 | 000596 | 古井贡酒 | 2,435,632.78 | 2.14 |
| 60 | 002154 | 报喜鸟 | 2,288,645.90 | 2.01 |

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。

7.4.3 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 | 359,866,308.08 |
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 397,129,267.71 |

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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

7.8 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。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 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。

7.9.2 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。

7.9.3 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 | 18,834.94 |
| 2 | 应收证券清算款 | 998,008.90 |
| 3 | 应收股利 | — |
| 4 | 应收利息 | 1,783.97 |
| 5 | 应收申购款 | 35,279.88 |
| 6 | 其他应收款 | — |
| 7 | 待摊费用 | — |
| 8 | 其他 | — |
| 9 | 合计 | 1,053,907.69 |

7.9.4 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。

7.9.5 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。

7.9.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 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 |
| 5,185 | 18,763.22 | 22,133,289.06 | 22.75% | 75,153,987.13 | 77.25% |

8.2 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 | 135,921.50 | 0.14% |

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。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|----------------------------|----------------|
| 基金合同生效日(2011年10月20日)基金份额总额 | 355,399,768.39 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 133,388,429.79 |
| 本报告期基金总申购份额 | 2,073,039.26 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 38,174,192.86 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | — |
| 本报告期期末基金份额总额 | 97,287,276.19 |

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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

报告期内本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 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。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略没有改变。

10.5 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。

10.6 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。

10.7 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 | 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 | 占股票成交总额比例 | 成交金额 | 占债券 | 成交金额 | 占债券 | 成交金额 | 占权证 | 佣金 | 占当期佣金总量的比 |
| | | | | | | | | | | | |

| | 量 | | | 额 | 成交总额比例 | 额 | 回购成交总额比例 | 额 | 成交总额比例 | | 例 |
|------|---|----------------|--------|---|--------|---|----------|---|--------|------------|--------|
| 长江证券 | 1 | 221,635,264.91 | 29.28% | — | — | — | — | — | — | 188,389.72 | 29.99% |
| 中信证券 | 1 | 135,693,943.02 | 17.93% | — | — | — | — | — | — | 110,252.89 | 17.55% |
| 国元证券 | 2 | 90,602,991.79 | 11.97% | — | — | — | — | — | — | 73,616.16 | 11.72% |
| 银河证券 | 2 | 87,875,741.67 | 11.61% | — | — | — | — | — | — | 71,399.64 | 11.36% |
| 民生证券 | 1 | 66,175,144.69 | 8.74% | — | — | — | — | — | — | 56,248.26 | 8.95% |
| 宏源证券 | 1 | 44,428,491.86 | 5.87% | — | — | — | — | — | — | 36,098.40 | 5.75% |
| 英大证券 | 1 | 30,752,237.35 | 4.06% | — | — | — | — | — | — | 24,986.58 | 3.98% |
| 国联证券 | 1 | 29,322,312.49 | 3.87% | — | — | — | — | — | — | 23,873.72 | 3.80% |

| | | | | | | | | | | | |
|--------|---|---------------|-------|---|---|---|---|---|---|-----------|-------|
| 招商证券 | 2 | 20,552,155.86 | 2.71% | — | — | — | — | — | — | 17,941.76 | 2.86% |
| 瑞银证券 | 1 | 16,897,910.96 | 2.23% | — | — | — | — | — | — | 14,321.05 | 2.28% |
| 申银万国 | 1 | 13,059,381.19 | 1.73% | — | — | — | — | — | — | 11,134.59 | 1.77% |
| 中银国际证券 | 1 | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — |
| 国都证券 | 1 | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — |
| 天风证券 | 1 | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — |
| 齐鲁证券 | 1 | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — |
| 华创证券 | 1 | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — |
| 中信建投 | 1 | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — |

注：本报告期内本基金交易单元全部共用长信银利精选基金交易单元，新增4个交易单元，分别为齐鲁证券、银河证券、华创证券和瑞银证券；退租1个交易单

元-大通证券。截止2012年6月30日，本基金上海有11个交易单元：国元证券、中银国际证券、民生证券、长江证券、国都证券、天风证券、申银万国证券、招商证券、齐鲁证券、银河证券、华创证券，深圳有9个交易单元：中信证券、招商证券、银河证券、中信建投、英大证券、瑞银证券、国联证券、宏源证券、国元证券。

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：

- 1) 券商基本面评价（财务状况、经营状况）；
- 2) 券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）；
- 3) 券商每日信息评价（及时性和有效性）；
- 4) 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。

10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|----|---|------------------|-----------|
| 1 | 长信基金管理有限责任公司关于旗下基金 2011 年年度资产净值的公告 | 上证报、中证报、 证券时报 | 2012-1-4 |
| 2 | 长信基金管理有限责任公司关于长信内需成长股票型证券投资基金在长金通网上直销平台开通转换、定投等业务并实施相关费率优惠的公告 | 上证报、证券时报 | 2012-1-7 |
| 3 | 长信基金管理有限责任公司关于旗下部分基金参加汉口银行基金电子渠道申购费率和定期定额申购费率优惠活动的公告 | 上证报、中证报、 证券时报 | 2012-1-13 |
| 4 | 长信内需成长股票型证券投资基金 2011 年第 4 季度报告 | 上证报、证券时报 | 2012-1-19 |

| | | | |
|----|--|---------------------------|-----------|
| 5 | 长信基金管理有限责任公司关于旗下部分基金参加齐鲁证券基金网上申购费率优惠活动的公告 | 中证报、上证报、 证券时报 | 2012-2-9 |
| 6 | 长信基金管理有限责任公司关于在“长金通”网上直销平台新增上海银联电子支付服务有限公司相关银行卡支付业务的公告 | 上证报、中证报、 证券时报、证券日 报 | 2012-3-16 |
| 7 | 长信基金管理有限责任公司关于增加日信证券为旗下基金代销机构并参加部分基金网上申购费率优惠活动的公告 | 上证报、中证报、 证券时报、证券日 报 | 2012-3-23 |
| 8 | 长信内需成长股票型证券投资基金 2011 年年度报告及摘要 | 上证报、证券时报 | 2012-3-28 |
| 9 | 长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告 | 上证报、中证报、 证券时报 | 2012-3-30 |
| 10 | 关于增加中信万通证券有限责任公司为旗下部分基金代销机构并开通定期定额投资业务的公告 | 上证报、中证报、 证券时报、证券日 报 | 2012-4-12 |
| 11 | 长信内需成长股票型证券投资基金 2012 年第 1 季度报告 | 上证报、证券时报 | 2012-4-20 |
| 12 | 长信基金管理有限责任公司关于调整直销柜台首次申购最低金额的公告 | 上证报、中证报、 证券时报、证券日 报 | 2012-4-27 |
| 13 | 长信基金管理有限责任公司关于提醒投资者谨防假冒以本公司名义从事非法证券活动的提示性公告 | 上证报、中证报、 证券时报、证券日 报 | 2012-5-4 |
| 14 | 长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金参加东吴证券基金网上申购费率优惠活动的公告 | 上证报、中证报、 证券时报 | 2012-5-4 |
| 15 | 长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金参加重庆银行基金网上申购和定期定额投资业务费率优惠活动的公告 | 上证报、中证报、 证券时报 | 2012-5-18 |
| 16 | 长信内需成长股票型证券投资基金更新的招募说明书（2012 年第【1】号）及摘要（仅摘要见报） | 上证报、证券时报 | 2012-6-4 |
| 17 | 长信基金管理有限责任公司关于在招商银行股份有限公司等基金销售机构开通旗下部分开放式基金定期定额投资业务的公告 | 上证报、中证报、 证券时报、证券日 报 | 2012-6-6 |
| 18 | 长信基金管理有限责任公司关于旗下基金参加交通银行基金网上申购费率优惠活动的公告 | 上证报、中证报、 证券时报 | 2012-6-27 |
| 19 | 长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金参加中信银行股份有限公司 2012-2013 年度电子银行基金申购费率优惠活动 | 上证报、中证报、 证券时报 | 2012-6-28 |

| | | | |
|----|--------------------------------------|------|-----------|
| 20 | 长信基金管理有限责任公司关于旗下基金 2012 年半年度末资产净值的公告 | 公司网站 | 2012-6-30 |
|----|--------------------------------------|------|-----------|

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立基金的文件；
- 2、《长信内需成长股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长信内需成长股票型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《长信内需成长股票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各种公告的原稿；
- 6、长信基金管理有限责任公司营业执照、公司章程及相关资格批复文件。

11.2 存放地点

基金管理人的办公场所

11.3 查阅方式

投资者可在有效的工作时间内免费查阅，在支付工本费后，也可在有效的工作时间内取得上述文件的复制件或复印件。

长信基金管理有限责任公司

2012年8月25日