长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金 2009年半年度报告摘要

2009年06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:2009年08月27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的法律责任。本半年度报告摘要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2009年8月24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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2009年1月1日起至2009年6月30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
前端交易代码	519991
后端交易代码	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
报告期末基金份额总额	197,087,017.93
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	李芳菲
	联系电话	021-61009999	010-68424199
	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	010-68424181

2.4 信息披露方式

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9楼	北京市海淀区西三环北路100号金玉大厦

§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(2009年01月01日-2009年06月30日)
本期已实现收益	46,259,141.53
本期利润	53,616,531.57
加权平均基金份额本期利润	0.3398
本期基金份额净值增长率	36.15%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2009年06月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0769
期末基金资产净值	212,251,261.68
期末基金份额净值	1.0770

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
过去一个月	9.51%	0.69%	7.37%	0.68%	2.14%	0.01%
过去三个月	17.16%	1.18%	14.43%	0.91%	2.73%	0.27%
过去六个月	36.15%	1.21%	40.75%	1.18%	-4.60%	0.03%
过去一年	21.03%	1.32%	14.19%	1.56%	6.84%	-0.24%
自基金合同生效日起至今(2008年06月19日-2009年06月30日)	20.90%	1.30%	9.99%	1.59%	10.91%	-0.29%

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6月30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。

§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2009年6月30日,本基金管理人共管理6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、长信双利优选混合和长信利丰债券。

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		
胡志宝	本基金的基金经理,长信银利精选基金的基金经理	2008年06月19日	-	11年	胡志宝先生,经济学硕士,具有基金从业资格。曾任国泰君安证券股份有限公司资产管理部基金经理、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。现担任本基金的基金经理。
张甦伟	本基金的基金经理	2008年07月25日	-	12年	张甦伟先生,工商管理硕士,具有基金从业资格。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,现担任本基金的基金经理。

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公告日;

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,本基金管理人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,本基金管理人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,本基金管理人所管理的各基金之间不存在投资风格相类似的投资组合;本基金管理人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

截止2009年6月30日,本基金份额净值为:1.077元,份额累计净值为:1.197元;本基金本期净值增长率为:36.15%;同期业绩比较基准增长率为:40.75%。

年初我们判断宏观经济(尤其是发达经济体经济)和市场环境并不乐观,因而采取了比较稳健的投资策略。3月份,美联储开动"印钞机",全球通缩阴影即将过去,而通胀预期将逐步形成。在这种宏观背景下,我们全面做多,加大股票仓位,提高组合的攻击性,为二季度取得良好的投资业绩奠定了基础。

二季度,中国经济率先全面复苏的趋势已然确立,投资者信心也在迅速恢复之中,我们围绕"资产+资源"配置的金融、地产、煤炭、有色等行业取得了良好的超额收益。同时,我们也较好地把握住"甲流"所带来的投资机遇,在疫苗类股上获得了较高的超额收益。尽管基金份额的波动加大了操作难度,但我们仍积极把握住市场机会,为投资者创造了良好的收益。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今年以来,金砖四国股市的涨幅均位列全球股市前十之内,显示了新兴市场国家经济率先复苏以及美元疲软导致资金流向新兴市场的趋势。在城市化进程尚未完成的情况下,我们看好中国经济房地产业的长期发展前景,房地产投资的复苏将成为中国经济复苏的强大推动力。尽管下半年市场所面临的不确定因素有所增加,但我们对A股市场仍然比较乐观。

本基金在报告期内两次分红,及时回馈投资者,并形成了积极、稳健、平衡的投资风格——积极而不激进,稳健而不保守,平衡而不刻板。本基金将一如既往地恪守投资人利益至上的原则,勤勉尽责,为投资人谋求长期资本增值。

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》,本基金管理人制订了健全、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本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,可以申请基金管理人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,本基金管理人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本基金管理人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,本基金本报告期分红情况如下:

单位:人民币元

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
合计	1.200	12,664,086.42	1,608,903.19	14,272,989.61

§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》等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:长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日:2009年6月30日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2009年06月30日	上年度末 2008年12月31日
资产:			
银行存款		27,445,759.55	78,319,698.14
结算备付金		613,721.92	1,143,499.58
存出保证金		250,000.00	250,000.00
交易性金融资产		147,955,494.61	141,101,810.00
其中:股票投资		112,678,042.21	101,881,810.00
债券投资		35,277,452.40	39,220,000.00
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		41,530,944.76	104,108.73
应收利息		965,458.17	501,536.88
应收股利		36,891.90	-
应收申购款		422,481.74	985.22
其他资产		-	-
资产总计		219,220,752.65	221,421,638.55
负债和所有者权益	附注号	本期末 2009年06月30日	上年度末 2008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		-	-
应付赎回款		5,726,181.61	207,107.73
应付管理人报酬		220,577.28	290,993.57
应付托管费		36,762.86	48,498.89
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		559,094.30	462,009.41
应交税费		3,640.80	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
其他负债		423,234.12	340,780.56
负债合计		6,969,490.97	1,349,390.16
所有者权益:			
实收基金		197,087,017.93	247,727,720.54
未分配利润		15,164,243.75	-27,655,472.15
所有者权益合计		212,251,261.68	220,072,248.39
负债和所有者权益总计		219,220,752.65	221,421,638.55

注:报告截止日2009年6月30日,基金份额净值1.077元,基金份额总额197,087,017.93份。

6.2 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6月30日

单位:人民币元

项目	附注号	本期2009年01月01日-2009年06月30日	上年度可比期间 2008年06月19日-2008年06月30日
一、收入		57,044,437.74	-411,250.66
1.利息收入		704,829.14	140,419.82
其中:存款利息收入		121,348.53	140,419.82
债券利息收入		583,480.61	-
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"-"填列)		48,693,042.57	-52,152.38
其中:股票投资收益		47,956,024.81	-97,872.38
债券投资收益		201,075.77	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		535,941.99	45,720.00
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		7,357,390.04	-499,547.64
4.其他收入(损失以"-"号填列		289,175.99	29.54
二、费用(以"-"号填列)		-3,427,906.17	-345,055.68
1. 管理人报酬		-1,182,938.95	-230,385.27
2. 托管费		-197,156.47	-38,397.56
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		-1,884,518.42	-59,732.37
5. 利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		-163,292.33	-16,540.48
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		53,616,531.57	-756,306.34

注:本基金合同生效日为2008年6月19日,上年度可比期间数据为2008年06月19日-2008年06月30日。

6.3 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6月30日

单位:人民币元

项目	本期2009年01月01日-2009年06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	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	-	53,616,531.57	53,616,531.57
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-50,640,702.61	3,476,173.94	-47,164,528.67
其中:1.基金申购款	179,440,738.91	4,916,188.76	184,356,927.67
2.基金赎回款	-230,081,441.52	-1,440,014.82	-231,521,456.34
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-14,272,989.61	-14,272,989.61
五、期末所有者权益(基金净值)	197,087,017.93	15,164,243.75	212,251,261.68
项目	上年度可比期间 2008年06月19日-2008年06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	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	-	-756,306.34	-756,306.34
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	91,421.50	-91.47	91,330.03
其中:1.基金申购款	91,421.50	-91.47	91,330.03
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	511,124,373.67	-756,397.81	510,367,975.86

注:本基金合同生效日为2008年6月19日,上年度可比期间数据为2008年06月19日-2008年06月30日。

6.4 报表附注

6.4.1 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。

6.4.2 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(2006)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等相关信息。

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

本报告期本基金没有发生重大会计差错。

6.4.5 税项

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。

6.4.6 关联方关系

6.4.6.1 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。

6.4.6.2 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、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司(中国农业银行)	基金托管人、基金代销机构

6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.7.1.1 股票交易

本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。

6.4.7.1.2 应支付关联方的佣金

本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。

6.4.7.2 关联方报酬

6.4.7.2.1 基金管理费

单位:人民币元

关联方名称	本期 2009年01月01日-2009年06月30日	上年度可比期间 2008年06月19日(基金合同生效日)-2008年06月30日
当期应支付的管理费	1,182,938.95	230,385.27
其中:当期已支付	962,361.67	-
期末未支付	220,577.28	230,385.27

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

6.4.7.2.2 基金托管费

单位:人民币元

关联方名称	本期 2009年01月01日-2009年06月30日	上年度可比期间 2008年06月19日(基金合同生效日)-2008年06月30日
当期应支付的托管费	197,156.47	38,397.56
其中:当期已支付	160,393.61	-
期末未支付	36,762.86	38,397.56

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

6.4.7.3 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。

6.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.7.4.1 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:人民币元

项目	本期 2009年01月01日-2009年06月30日	上年度可比期间 2008年06月19日(基金合同生效日)-2008年06月30日
期初持有的基金份额	25,002,375.00	25,002,375.00
期间认购总份额	-	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间赎回/卖出总份额	-	-
期间由于拆分增加的份额	-	-
期末持有的基金份额	25,002,375.00	25,002,375.00
占基金总份额比例	12.69%	10.09%

注: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。

6.4.7.4.2 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

本基金除基金管理人之外的其它关联方在本报告期内未投资本基金。

6.4.7.5 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 2009年01月01日-2009年06月30日		上年度可比期间 2008年06月19日(基金合同生效日)-2008年06月30日	
	期末存款余额	当期存款利息收入	期末存款余额	当期存款利息收入
中国农业银行股份有限公司	27,445,759.55	115,980.78	261,663,941.58	140,419.82

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6月30日的相关余额为人民币613,721.92元((2008年12月31日:1,143,499.58元))

6.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期内未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

6.4.8 期末(2009年06月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

截至本报告期末,本基金未持有因认购首发或增发证券而持有的流通受限证券。

6.4.8.1.2 期末持有的暂时停牌股票

截至本报告期末,本基金未持有暂时停牌股票。

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

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券。

§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	112,678,042.21	51.40
	其中:股票	112,678,042.21	51.40
2	固定收益投资	35,277,452.40	16.09
	其中:债券	35,277,452.40	16.09
	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	28,059,481.47	12.80
6	其他资产	43,205,776.57	19.71
7	合计	219,220,752.65	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	22,063,500.00	10.39
C	制造业	39,064,561.50	18.40
C0	食品、饮料	6,905,500.00	3.25
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	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	7,332,000.00	3.45
C7	机械、设备、仪表	16,351,061.50	7.70
C8	医药、生物制品	8,476,000.00	3.99
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	4,465,000.00	2.10
F	交通运输、仓储业	8,472,000.00	3.99
G	信息技术业	3,389,000.00	1.60
H	批发和零售贸易	4,821,000.00	2.27
I	金融、保险业	18,428,500.00	8.68
J	房地产业	5,341,480.71	2.52
K	社会服务业	2,760,500.00	1.30
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	3,872,500.00	1.82
	合计	112,678,042.21	53.09

7.3 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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601006	大秦铁路	800,000	8,472,000.00	3.99
2	002007	华兰生物	200,000	7,346,000.00	3.46
3	000858	五粮液	350,000	6,905,500.00	3.25
4	601988	中国银行	1,500,000	6,735,000.00	3.17
5	000933	神火股份	330,000	6,600,000.00	3.11
6	600015	华夏银行	500,000	6,265,000.00	2.95
7	601001	大同煤业	150,000	5,457,000.00	2.57
8	600837	海通证券	330,000	5,428,500.00	2.56
9	601168	西部矿业	350,000	5,334,000.00	2.51
10	600582	天地科技	250,000	5,137,500.00	2.42

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(www.cxfund.com.cn)的半年度报告正文。

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	600030	中信证券	24,728,453.33	11.24
2	600016	民生银行	18,792,335.10	8.54
3	601601	中国太保	17,030,633.00	7.74
4	600048	保利地产	16,985,352.90	7.72
5	600015	华夏银行	16,953,315.18	7.70
6	601328	交通银行	16,186,696.12	7.36
7	000024	招商地产	15,063,846.05	6.84
8	000933	神火股份	14,262,768.76	6.48
9	601166	兴业银行	12,876,611.84	5.85
10	601988	中国银行	12,799,294.80	5.82
11	600028	中国石化	12,574,665.22	5.71
12	601006	大秦铁路	12,388,244.03	5.63
13	600050	中国联通	10,936,803.00	4.97
14	000858	五粮液	10,480,756.90	4.76
15	600582	天地科技	9,690,768.00	4.40
16	600161	天坛生物	9,496,721.76	4.32
17	600635	大众公用	8,771,361.88	3.99
18	601390	中国中铁	8,727,000.00	3.97
19	000060	中金岭南	8,518,202.06	3.87
20	601919	中国远洋	8,085,425.27	3.67
21	600837	海通证券	8,077,135.67	3.67
22	600740	山西焦化	7,905,606.31	3.59
23	002007	华兰生物	7,660,958.38	3.48
24	000002	万 科A	7,567,986.90	3.44
25	600808	马钢股份	7,411,555.00	3.37
26	601318	中国平安	7,310,138.00	3.32
27	600895	张江高科	7,057,822.53	3.21
28	000709	唐钢股份	6,734,000.00	3.06
29	601168	西部矿业	6,490,815.94	2.95
30	000402	金 融 街	6,448,952.70	2.93
31	600138	中青旅	6,180,869.90	2.81
32	600000	浦发银行	5,696,770.00	2.59
33	600581	八一钢铁	5,648,190.66	2.57
34	600143	金发科技	5,507,641.00	2.50
35	000826	合加资源	5,477,970.12	2.49
36	000778	新兴铸管	5,448,616.33	2.48
37	600491	龙元建设	5,423,240.00	2.46
38	601600	中国铝业	5,421,522.30	2.46
39	601001	大同煤业