

(上接 D97 版)

股票代码	股票名称	卖出累计金额	占基金资产净值比例
600028	中国石化	853,261,571.21	442.52%
600030	中信证券	470,230,319.66	243.97%
601328	交通银行	150,432,201.19	78.02%
600026	中国发展	103,988,519.04	53.94%
600887	伊利股份	101,131,628.21	52.45%
600090	长江电力	100,397,670.99	52.07%
600562	宏源证券	92,617,822.01	48.03%
600635	大众公用	84,850,000.00	44.00%
000751	锌业股份	78,310,953.28	40.61%
601168	华联矿业	66,300,777.27	34.38%
601987	中国石油	56,570,400.00	29.34%
000002	万科 A	49,365,911.01	25.91%
600011	华能国际	48,485,019.87	25.23%
600150	中国船舶	43,560,653.90	22.59%
600718	东药股份	43,498,221.65	22.51%
000027	深圳能源	36,391,033.98	19.13%
600004	白云机场	36,105,390.72	18.76%
600831	广电网络	36,058,023.80	18.70%
600631	百联股份	31,848,001.28	16.52%
600019	宝钢股份	29,388,411.44	15.24%
601919	中国远洋	28,846,000.00	14.96%
600016	民生证券	28,751,793.72	14.91%
600012	皖通高速	25,462,409.52	13.30%
000858	五 粮 液	24,119,362.54	12.51%
600036	招商银行	22,974,125.17	11.91%
600009	上海机场	21,425,071.35	11.11%
601166	兴业银行	21,149,175.15	10.97%
600110	中科三环	20,687,346.87	10.42%
601200	中国中铁	20,015,956.56	10.38%
600177	鲁 克 斯	19,217,721.44	9.97%
600547	山东黄金	18,493,931.06	9.59%
600885	银河科技	18,294,989.72	9.48%
000063	中兴通讯	16,735,606.65	8.68%
600693	东百集团	15,610,694.00	8.10%
600717	天津港	15,420,546.22	8.00%
600348	国际能源	15,023,223.88	7.79%
600159	天龙地产	14,805,037.05	7.68%
600639	浦东金桥	13,988,016.68	7.26%
600037	歌华有线	13,789,859.31	7.15%
000025	长安汽车	13,748,562.99	7.13%
600879	大雁股份	13,568,573.60	7.03%
000031	中粮地产	13,322,808.97	6.91%
600563	法拉电子	13,111,000.59	6.80%
600428	中远航运	13,016,192.60	6.75%
000748	长信科技	12,523,296.52	6.49%
600176	中国远洋	12,309,175.36	6.39%
000410	沈阳机床	12,258,037.19	6.36%
000157	中联重科	12,078,367.57	6.26%
000799	磨坊股份	11,936,850.08	6.19%
600271	方向软件	11,526,670.17	6.13%
000639	粤电力 A	11,516,728.77	6.02%
600299	景新材料	11,321,352.38	5.87%
600077	欧亚集团	10,698,353.58	5.50%
601896	中国铝业	10,446,234.75	5.42%
000825	太原钢铁	10,388,402.16	5.36%
600258	首旅股份	9,981,919.68	5.12%
600031	三一重工	9,719,213.00	5.04%

## 长信金利趋势股票型证券投资基金 2007 年年度报告摘要

股票代码	股票名称	数量	市值(元)	占基金资产净值比
601318	中国平安	9,575,564.04	497.7%	4.97%
600015	华夏银行	8,701,686.16	451.1%	4.51%
601628	中国人寿	8,365,893.57	432%	4.32%
600083	金地集团	6,280,445.25	4.30%	4.30%
600043	航天动力	7,702,890.87	3.90%	3.90%
600439	瑞贝卡	7,681,638.40	3.98%	3.98%
600050	中国联通	7,567,500.00	3.92%	3.92%
000878	云南铜业	7,203,020.00	3.74%	3.74%
000601	鄂武钢 A	7,142,123.71	3.70%	3.70%
000638	云南白药	7,046,515.10	3.65%	3.65%
600426	华鲁恒升	7,040,338.50	3.65%	3.65%
600116	洪都航空	6,882,182.28	3.57%	3.57%
000017	广电传媒	6,712,128.05	3.48%	3.48%
000569	泸州老窖	6,691,720.29	3.47%	3.47%
000662	鲁 美 特	6,578,886.69	3.41%	3.41%
000078	海王生物	6,529,877.40	3.39%	3.39%
600067	冠城大通	6,149,794.83	3.19%	3.19%
600188	克明纸业	5,942,723.99	3.08%	3.08%
600100	同方股份	5,728,932.00	2.97%	2.97%
600118	XR中钢卫	5,533,557.91	2.87%	2.87%
600416	湘电股份	5,300,792.00	2.75%	2.75%
600219	南山铝业	5,297,807.00	2.75%	2.75%
600075	中华企业	5,173,308.88	2.68%	2.68%
000089	深圳机场	4,886,956.00	2.54%	2.54%
000629	柳 工	4,983,792.00	2.52%	2.52%
600104	上海汽车	4,634,069.93	2.40%	2.40%
600085	海螺水泥	4,497,678.50	2.33%	2.33%
000633	万家乐	4,423,452.19	2.29%	2.29%
600832	东方明珠	4,409,222.00	2.29%	2.29%
000630	赣锋有色	4,407,294.16	2.29%	2.29%
601001	大同矿业	4,282,993.53	2.22%	2.22%
600289	赣粤高速	4,129,153.05	2.14%	2.14%
600872	中国铝业	4,012,562.72	2.08%	2.08%
600485	中创信测	3,962,075.56	2.06%	2.06%

3. 本报告期内买入股票的成本总额 16,962,643,846.06 元; 卖出股票的收入总额为 3,381,697,482.66 元。

(五) 债券投资组合

债券种类	债券市值(元)	占基金资产净值比
企业债	10,339,200.00	0.06%
合计	10,339,200.00	0.06%

3. 基金投资前五名债券明细:

债券代码	债券名称	数量	市值(元)	占基金资产净值比
120908	08上国债	144,000	10,339,200.00	0.06%

(六) 权证投资组合

1. 按行权方式分类的权证投资组合:

权证种类	权证市值	占基金资产净值
欧式认购权证	4,710,026.88	0.02%
合计	4,710,026.88	0.02%

3. 基金投资前五名权证明细:

权证代码	权证名称	数量	市值(元)	市值占基金资产净值比
580016	上汽 CWB1	518,400	4,710,026.88	0.02%

(七) 股指期货

1. 报告期内本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没有受到公开谴责、处罚。

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。

3. 其他资产的构成:

项目	金额(元)
交易保证金	4,142,138.75
应收利息	0.00
应收股利	692,322.68
应收申购款	13,887,068.29
应收证券清算款	0.00
待摊费用	0.00
合计	18,722,529.72

4. 处于转股期的可转换债券明细:

5. 由于四舍五入的原因, 分项之和与合计项可能存在尾差

6. 权证投资的有关情况:

权证代码	权证名称	获取数量	成本总额(元)	类别	期末持有数量
580016	上汽 CWB1	518,400	4,137,520.02	认购权证	518,400

八、基金持有人

(一) 本报告期末基金份额持有人户数:720,536 户

(二) 本报告期末平均每户持有基金份额:18,333.57 份

(三) 基金份额持有人构成:

投资者类别	持有份额	占总份额的比例
机构投资者	176,482,942.50	1.33%
个人投资者	13,034,302,733.83	98.67%
合计	13,209,956,676.33	100.00%

(四) 本报告期末本基金管理机构从业人员投资开放式基金的情况

项目	期末持有本开放式基金份额的总量(份)	占本基金总份额的比例
本基金管理机构持有本基金的所有从业人员	1,446,706.40	0.011%

九、开放式基金费变动

(一) 基金合同生效日基金费总额:613,254,516.24 份

(二) 自基金合同生效以来基金费变动的变动情况:

项目	期末持有本开放式基金份额的总量(份)	占本基金总份额的比例
期初基金份额	145,061,114.90	
本期总申购份额	16,182,569,012.45	
基金新增份额	272,751,632.53	
本期总赎回份额	3,300,406,083.55	
本报告期末基金份额	13,209,956,676.33	

十、重大事件提示

(一) 本报告期未召开本基金的基金份额持有人大会。

(二) 本基金管理人在本报告期内发生重大人事变动情况:

基金管理人于 2007 年 4 月 4 日发布公告, 长信利精选基金基金经理张大军先生离任, 基金管理人于 2007 年 5 月 18 日发布公告, 长信金利趋势基金基金经理李永林先生离任, 基金管理人于 2007 年 10 月 11 日发布公告, 长信基金管理有限责任公司副经理陈茂先生离任, 陈茂先生离任, 基金管理人于 2007 年 11 月 30 日发布公告, 长信基金管理有限责任公司聘任陈茂先生为非独立董事, 基金管理人于 2007 年 11 月 30 日发布公告, 长信基金管理有限责任公司聘任陈茂先生为非独立董事。

(三) 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。

(四) 本报告期基金投资策略没有改变。

(五) 本报告期基金已经发生的收益分配事项:

本基金以截止 2007 年 7 月 27 日已实现的可供分配收益 568,194,762.49 元为基础, 向基金份额持有人每 10 份基金份额派发现金红利 1.10 元, 权益登记日: 2007 年 7 月 30 日。

(六) 本报告期内基金支付给会计师事务所、报告编制会计师事务所的审计费用为人民币 125,850.00 元, 该审计机构为本基金提供的审计服务的连续期限为 2 年。

(七) 本报告期基金管理人、托管人及其高级管理人员没有受过监管部门稽查或处罚的情形。

(八) 本报告期基金租用证券公司专用交易单元的有关情况如下:

1. 本期基金租用交易单元的交易量情况

证券公司名称	交易单元租用数量(个)
长江证券	1

2. 本期基金租用交易单元的交易量情况

证券公司名称	交易单元租用数量(个)
长江证券	1

3. 本报告期内租用的证券公司交易单元没有发生变更。

4. 专用交易单元的选择标准和程序

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》(证监基金字&lt;1998&gt;-29 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. 公司能为创新类券商;

b. 公司具有较较强的研究团队和研究能力;

c. 公司能及时、有效、准确提供信息资讯服务;

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。

(九) 本报告期本基金不存在“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的

偏离度的绝对值达到或者超过 0.5% 的情况。

(十) 其他重要事项

除上述事项之外, 本基金管理人已在临时报告中披露过本报告期内发生的其他重要事

项(信息披露的报纸为: 中国证券报、上海证券报、证券时报):

1. 2007 年 1 月 20 日, 基金管理人刊登了《关于旗下基金更改直销网点首次申购最低

限额的公告》;

2. 2007 年 1 月 22 日, 基金管理人刊登了《关于长信利息收益基金收益分配的提示性

公告(07 年第 1 号)》;

3. 2007 年 3 月 1 日, 基金管理人刊登了《关于长信利息收益基金收益分配的提示性公

告(07 年第 2 号)》;

4. 2007 年 3 月 21 日, 基金管理人刊登了《关于长信利息收益基金收益分配的提示性

公告(07 年第 3 号)》;

5. 2007 年 3 月 26 日, 基金管理人刊登了《关于改变利息收益基金收益分配结转周期

的公告》;

6. 2007 年 4 月 23 日, 基金管理人刊登了《关于长信利息收益基金收益支付的公告》;

7. 2007 年 4 月 24 日, 基金管理人刊登了《关于长信利息收益基金 2007 年一季度报

告数据更正公告》;

8. 2007 年 4 月 25 日, 基金管理人刊登了《关于开通旗下基金转换业务的公告》。

(上接 D99 版)

5 年末债券正回购交易中作为质押的债券

于 2007 年 12 月 31 日, 本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证

券款余额为人民币 0 元(2006 年: 人民币 219,000,600.00 元), 因此没有债券作为质押。

## 七、投资组合报告

(一) 报告期末基金资产组合

资产组合	金额(元)	占基金总资产的比例
债券投资	2,318,011,778.82	96.24%
买入返售证券	1,473,087,774.63	58.74%
其中: 买断式回购的买入返售证券	0.00	0.00%
银行存款和清算备付金合计	322,708,728.87	7.85%
其中: 商业银行协议存款	0.00	0.00%
其他资产	7,914,939.38	0.19%
合计	4,121,722,219.70	100.00%

(二) 报告期末债券回购融资情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例
1	报告期内债券回购融资余额	83,870,337,760.62	94.1%
	其中: 买断式回购融资	201,115,000.00	0.03%
2	报告期末债券回购融资余额	0.00	0.00%
	其中: 买断式回购融资	0.00	0.00%

注: 1. 上表中, 报告期内债券回购融资余额取报告期内每日融资余额的合计数, 报告

期内债券回购融资余额占基金资产净值比例取报告期内每日融资余额占基金资产净值

比例的简单平均值。

2. 报告期内货币市场基金债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的情况: 不

存在。

(三) 基金投资组合平均剩余期限

1. 投资组合平均剩余期限基本情况??

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	67
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	163
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	65

报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 天的情况: 本报告期不存在。

2. 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值	各期限负债占基金资产净值的
1	30 天以内	44.08%	0.00%
	其中: 剩余存续期超过		
	397 天的浮动利率债	0.00%	0.00%
2	30 天(含)-60 天	17.27%	0.00%
	60 天(含)-90 天	15.93%	0.00%
	其中: 剩余存续期超过		
	397 天的浮动利率债	0.00%	0.00%
4	90 天(含)-180 天	12.40%	0.00%
	其中: 剩余存续期超过		
	397 天的浮动利率债	3.88%	0.00%
5	180 天(含)-397 天(含)	11.74%	0.00%
	合计	101.42%	0.00%

(四) 报告期末债券投资组合

1. 按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	成本(元)	占基金资产净值的比例
1	国家债券	0.00	0.00%
2	金融债券	157,573,821.30	3.88%
	其中: 政策性金融债	0.00	0.00%
3	央行票据	1,387,151,700.32	34.20%
4	企业债券	773,236,267.20	19.06%