基金管理人:长信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国邮政储蓄银行股份有限公司
送出日期:2013年8月29日

长信中短债证券投资基金

2013 半年度 报告摘要

2013年6月30日

§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的法律责任。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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定, 于2013年8月23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2013年1月1日起至2013年6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	长信中短债债券
基金主代码	519985
交易代码	519985
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年6月28日
基金管理人	长信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	108,249,033.97份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金把投资组合的久期控制在三年以内,在追求本金安全和保持基金资产流动性的基础上,力争实现超越比较基准的投资收益。
投资策略	本基金为中短债基金,采用积极管理型的投资策略,将投资组合的久期控制在三年以内,在控制利率风险、尽量降低基金净值波动风险并满足流动性的前提下,提高基金收益率。
业绩比较基准	三年期银行定期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为债券型基金,其预期收益和预期风险高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金,属于低风险的基金品种。

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	中国邮政储蓄银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周永刚	胡涛
	联系电话	021-61009999	010-68858112
	电子邮箱	zhouyg@cxfund.com.cn	hutao@psbcoa.com.cn
客户服务电话		4007005566	95580
传真		021-61009800	010-68858120

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	上海银城中路68号时代金融中心9楼、北京市西城区金融大街3号A座

§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

单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2013年1月1日至2013年6月30日)
本期已实现收益	6,539,861.08
本期利润	4,637,947.64
加权平均基金份额本期利润	0.0168
本期基金份额净值增长率	1.26%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0621
期末基金资产净值	118,497,089.25
期末基金份额净值	1.0947

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。

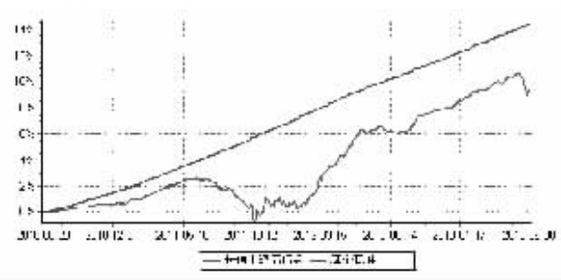
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如,封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-0.99%	0.17%	0.35%	0.00%	-1.34%	0.17%
过去三个月	-0.18%	0.10%	1.08%	0.00%	-1.26%	0.10%
过去六个月	1.26%	0.08%	2.16%	0.00%	-0.90%	0.08%
过去一年	3.19%	0.06%	4.41%	0.00%	-1.22%	0.06%
过去三年	9.47%	0.08%	14.42%	0.00%	-4.95%	0.08%
自基金合同生效日起至今(2010年06月28日-2013年06月30日)	9.47%	0.08%	14.45%	0.00%	-4.98%	0.08%

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2010年6月28日至2013年6月30日。

2、按基金合同规定,本基金自合同生效日起6个月内为建仓期,建仓期结束时,本基金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;债券类金融工具的比例不低于基金资产的80%, 剩余期限在397天以内的债券、现金和剩余期限在14天以内的回购余额不低于基金资产净值的20%,现金及到期日在1年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

§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2013年6月30日,本基金管理人共管理15只开放式基金,即长信利息收益货币、长信银利精选股票、长信金利趋势股票、长信增利动态策略股票、长信双利优选混合、长信利丰债券、长信恒利优势股票、长信中证中央企业100指数(LOF)、长信中短债债券、长信量化先锋股票、长信标普100等权重指数(QDII)、长信利鑫分级债券、长信内需成长股票、长信可转债分级债券和长信利众分级债。

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		
张文琍	本基金和长信利鑫分级债券型证券投资基金的基金经理、固定收益部副总监	2010年6月28日	-	19年	高级工商管理硕士, 上海财经大学EMBA毕业,具有基金从业资格。曾任湖北证券公司交易一部交易员、长江证券有限责任公司资产管理事业部主管、债券事业总部投资部经理、固定收益总部交易部经理。2004年9月加入长信基金管理有限责任公司,历任长信利息收益基金交易员、基金经理助理、长信利息收益货币基金基金经理职务。现任固定收益部副总监、本基金和长信利鑫分级债券型证券投资基金的基金经理。

注:1、首任基金经理任职日期以本基金成立之日为准;新增或变更以刊登新增/变更基金经理的公告披露日为准。

2、本基金基金经理的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 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

一季度,债券市场主要受资金面影响震荡波动,在流动性宽松及经济下行预期的推动下,债券市场延续牛市格局,无论是息差收入还是估值变动收益均丰厚。二季度债券市场资金面出现了空前的紧张局面,收益曲线形态跌宕起伏。特别是4月份之后,市场氛围开始改变,监管的加强及资金面的收紧,令市场走势出现方向性变化,市场已然由多转空。

一季度我们跟随市场和规模变化,增持了部分利率品种,基金净值保持了较好回报。

二季度,基金规模的变动较大同时市场价格下挫,我们相应减少了债券信用仓位,以达到组合对投资流动性日益提高的要求。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2013年6月30日,本基金份额净值为1.0947元,份额累计净值为1.0947元。本报告期内本基金净值增长率为1.26%,同期业绩比较基准收益率为2.16%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

二季度以来,国际经济环境及市场对货币环境的预期变动较大,在美国退出QE成为主流预期的情况下,风险偏好抬头,资金回流将在下半年成为主流趋势。

相关宏观数据显示,当前中国经济依然疲弱,而且未现明显企稳回升的趋势,中国经济复苏前景弱于预期。目前通胀水平延续低位,尽管下半年CPI会小幅回升,但尚不足以成为债券市场的关键因素。6月底,央行发布公告称,总体上看,当前流动性总量并不短缺,要求商业银行加强同业业务期限错配风险防范;同时,按照"用好增量、盘活存量"的要求,在保持信贷平稳适度增长的同时,调整优化信贷结构。从这些表态看,在复杂的国际金融环境下,央行更侧重于"控风险",我们认为短期货币政策仍以稳健为主基调,三季度债券收益率将维持震荡行情。

我们将采取谨慎地态度进行投资,积极防范流动性风险,密切关注国内外经济局势变化,需要重点规避信用风险,努力抓住市场结构性机会和波段行情。在基金的日常投资中,将继续秉承诚信、专业、负责的精神,密切关注政策节奏,更好地把握投资机会,争取为基金份额持有人谋求最大利益。

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》的规定,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、基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式(指将现金红利按除息日除权后的基金份额净值为计算基准自动转为基金份额进行再投资),基金份额持有人可选择现金方式或红利再投资方式;若基金份额持有人事先未做出选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;若基金份额持有人选择红利再投资,红利再投资的份额免收申购费用;

2、每一基金份额享有同等分配权;

3、收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额,不足以支付银行转账或其他手续费用时,基金登记结算机构可将投资者的现金红利按除息日除权后的基金份额净值自动转为基金份额;

4、在符合有关基金分红条件的前提下,基金收益每年最多分配12次,每次收益分配最低比例不得低于收益分配基准日可供分配利润的50%,若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配;

5、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净额后不能低于面值;

6、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;

7、基金红利发放日距离收益分配基准日(即期末可供分配利润计算截至日)的时间不得超过15个工作日。

8、法律法规或监管机构另有规定的,从其规定。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

基金托管人依据《长信中短债证券投资基金基金合同》与《长信中短债证券投资基金托管协议》,自2010年06月28日起托管长信中短债证券投资基金(以下称本基金)的全部资产。

本报告期内,本托管人严格遵守《证券投资基金法》及其他相关法律法规、基金合同和托管协议的规定,诚信、尽责地履行了基金托管人义务,不存在损害本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

本报告期内,本托管人依据国家相关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查,未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为。

本报告期内,本基金未进行利润分配。

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

本托管人认真复核了本半年度报告中的财务指标、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,认为其真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§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:长信中短债证券投资基金

报告截止日:2013年6月30日

单位:人民币元

资 产	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
资 产:		
银行存款	31,605,828.86	171,303,779.84
结算备付金	264,174.19	599,163.15
存出保证金	10,532.75	250,000.00
交易性金融资产	126,311,515.17	259,388,943.50
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	126,311,515.17	259,388,943.50
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	14,850,142.28	-
应收证券清算款	3,843,400.07	-
应收利息	3,018,634.28	7,243,339.84
应收股利	-	-
应收申购款	419,401.70	4,378,037.42
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	180,323,629.30	443,163,263.75
负债和所有者权益	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012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	60,099,690.10	107,482,323.70
应付证券清算款	-	10,016,100.00
应付赎回款	652,611.89	1,473,501.58
应付管理人报酬	87,856.08	198,615.51
应付托管费	31,947.68	72,223.83
应付销售服务费	47,921.49	108,335.73
应付交易费用	14,845.66	14,401.10
应交税费	462,569.70	344,364.92
应付利息	151,495.95	138,914.60
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	277,601.50	599,798.55
负债合计	61,826,540.05	120,448,579.52
所有者权益:		
实收基金	108,249,033.97	298,501,633.20
未分配利润	10,248,055.28	24,213,051.03
所有者权益合计	118,497,089.25	322,714,684.23
负债和所有者权益总计	180,323,629.30	443,163,263.75

注:报告截止日2013年6月30日,基金份额净值1.0947元,基金份额总额108,249,033.97份。

6.2 利润表

会计主体:长信中短债证券投资基金

本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

单位:人民币元

项 目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
一、收入	8,427,715.17	13,852,088.62
1.利息收入	8,049,977.83	6,861,804.02
其中:存款利息收入	1,722,119.81	1,329,147.85
债券利息收入	5,907,674.98	5,442,793.30
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	420,183.04	89,862.87
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	2,279,650.78	-337,692.42
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	2,279,650.78	-337,692.42
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-1,901,913.44	7,327,977.02
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列	-	-
减:二、费用	3,789,767.53	2,727,352.23
1.管理人报酬	824,541.47	588,032.67
2.托管费	299,833.24	213,830.12
3.销售服务费	449,749.91	320,744.99
4.交易费用	14,411.17	12,698.05
5.利息支出	2,014,230.24	1,404,495.25
其中:卖出回购金融资产支出	2,014,230.24	1,404,495.25
6.其他费用	187,001.50	187,551.15
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	4,637,947.64	11,124,736.39
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	4,637,947.64	11,124,736.39

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:长信中短债证券投资基金

本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

单位:人民币元

项 目	本期 2013年1月1日至2013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)	298,501,633.20	24,213,051.03	322,714,684.23
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	4,637,947.64	4,637,947.64
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)	-190,252,599.23	-18,602,943.39	-208,855,542.62
其中:1.基金申购款	1,184,899,583.52	111,265,740.03	1,296,165,323.55
2.基金赎回款	-1,375,152,182.75	-129,868,683.42	-1,505,020,866.17
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)	108,249,033.97	10,248,055.28	118,497,089.25
项 目	上年度可比期间 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)	128,671,526.26	893,865.68	129,565,391.94
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	11,124,736.39	11,124,736.39
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)	77,298,509.49	531,634.28	77,830,143.77
其中:1.基金申购款	1,725,280,465.88	72,820,333.87	1,798,100,799.75
2.基金赎回款	-1,647,981,956.39	-72,288,699.59	-1,720,270,655.98
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)	205,970,035.75	12,550,236.35	218,520,272.10

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
基金管理人负责人	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

长信中短债证券投资基金(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")《关于核准长信中短债证券投资基金募集的批复》(证监许可[2010]481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《长信中短债证券投资基金基金合同》发售,基金合同于2010年6月28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2,234,260,528.19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,基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。(以下简称"中国邮储银行")。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《长信中短债证券投资基金基金合同》和《长信中短债证券投资基金招募说明书(更新)》的有关规定,本基金投资范围为具有良好流动性的固定收益类金融工具,包括国内依法发行上市的国债、金融债、公司债、企业债、短期融资券、政府机构债、央行票据、回购、可转债(不包括分离交易可转债)以及中国证监会允许基金投资的其他固定收益类金融工具。本基金对可转债的投资仅限于可转债的申购,且申购获得的可转债不得转换成股票。本基金投资组合资产类别配置的基本范围为:债券类金融工具的投资比例不低于基金资产的80%;剩余期限在三百九十七天以内的债券、现金和剩余期限在十四天以内的回购余额不低于基金资产净值的20%; 现金以及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为三年期银行定期存款税后利率。

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》、《长信中短债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2013年6月30日的财务状况、2013年1至6月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、会计估计与最近一期年度会计报表相一致。

6.4.4.2 差错更正的说明

本基金在本报告期未发生过重大会计差错。

6.4.5 税项

6.4.5.1 主要税项说明

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》、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) 对基金取得的债券的利息收入,由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。

(4)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。

6.4.5.2 应缴税费

单位:人民币元

应交债券利息收入所得税	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
	462,569.70	344,364.92

注:该项税费为代扣代缴的债券利息所得税。

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
中国邮政储蓄银行股份有限公司	基金托管人
长江证券股份有限公司(以下简称"长江证券")	基金管理人的股东

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

本基金本报告期与上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.7.1.2 债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日	
	成交金额	占当期债券交易成交总额的比例	成交金额	占当期债券交易成交总额的比例
长江证券	34,303,769.32	45.61%	108,090,816.47	83.76%

6.4.7.1.3 债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
长江证券	229,500,000.00	56.87%	339,200,000.00	69.91%

6.4.7.1.4 权证交易

本基金本报告期与上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.7.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应付关联方的佣金。

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

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 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	824,541.47	588,032.67
其中:应支付销售机构的客户维护费	234,990.90	235,200.83

注: 支付基金管理人长信基金管理有限责任公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值0.55%的年费率确认,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×0.55%/当年天数

6.4.7.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 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	299,833.24	213,830.12

注:支付基金托管人中国邮储银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.20%的年费率确认,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×0.20%/当年天数

6.4.7.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
中国邮政储蓄银行股份有限公司	93,641.57
长信基金管理有限责任公司	62,669.65
长江证券股份有限公司	909.75
合计	157,220.97
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
中国邮政储蓄银行股份有限公司	112,081.14
长信基金管理有限责任公司	7,270.92
长江证券股份有限公司	77.18
合计	119,429.24

注:销售机构的销售服务费用按前一日的基金资产净值的0.30%年费率逐日计提,按月支付。

计算公式为:日基金销售服务费=前一日基金资产净值×0.30%/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

本基金在本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场债券(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

基金管理人在本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

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

除基金管理人之外的其它关联方在本期间与上年度可比期间均未投资过本基金。

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 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国邮政储蓄银行股份有限公司	1,605,828.86	57,398.37	27,590,343.94	28,290.38

注: 本基金的证券交易结算资金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算有限责任公司,于2013年6月30日的相关余额为人民币264,174.19元(2012年12月31日:人民币599,163.15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

本基金在本期间与上年度可比期间未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

6.4.7.7 其他关联交易事项的说明

上述关联交易均按照正常的商业交易条件进行,并以一般交易价格为定价基础。

6.4.8 期末(2013年6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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而持有流通受限证券。

6.4.8.2 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。

6.4.8.3 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2013年6月30日止, 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39,599,700.60元,是以如下债券作为质押:

金额单位:人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
041360001	13锦公用CP001	2013-07-02	100.10	100,000	10,010,000.00
130201	13国开01	2013-07-11	99.45	300,000	29,835,000.00
合计				400,000	39,845,000.00

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2013年6月30日止, 基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额20,499,989.50元,分别于2013年7月1日前(先后)到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

§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	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	126,311,515.17	70.05
	其中:债券	126,311,515.17	70.05
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	14,850,142.28	8.24
	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	31,870,003.05	17.67
6	其他各项资产	7,291,968.80	4.04
7	合计	180,323,629.30	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期未买入股票。

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

本基金本报告期未卖出股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期未投资股票。

7.5 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	-	-
3	金融债券	29,835,000.00	25.18
	其中:政策性金融债	29,835,000.00	25.18
4	企业债券	56,545,515.17	47.72
5	企业短期融资券	39,931,000.00	33.70
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	126,311,515.17	106.59

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

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	130201	13国开01	300,000	29,835,000.00	25.18
2	1180028	11南太湖债	100,000	10,467,000.00	8.83
3	1180076	11镇投债	100,000	10,268,000.00	8.67
4	041369002	13北建工CP001	100,000	10,021,000.00	8.46
5	041360001	13锦公用CP001	100,000	10,010,000.00	8.45

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10 投资组合报告附注

7.10.1 报告期内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也没有受到公开谴责、处罚的情形。

7.10.2 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。

7.10.3 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	10,532.75
2	应收证券清算款	3,843,400.07
3	应收股利	-
4	应收利息	3,018,634.28
5	应收申购款	419,401.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,291,968.80

7.10.4 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。

7.10.5 期末前十名股