

长盛中信全债指数增强型债券投资基金

2010 年年度报告摘要

2010 年 12 月 31 日

基金管理人：长盛基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2011 年 3 月 31 日

## § 1 重要提示

### 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的法律责任。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”）根据本基金合同规定，于 2011 年 3 月 30 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，投资者在做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。

本年度报告财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2010 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	长盛全债指数增强债券
基金主代码	510080
前端交易代码	510080
后端交易代码	511080
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003年10月25日
基金管理人	长盛基金管理有限公司
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	430,121,047.91份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为开放式债券型基金，将运用增强的指数化投资策略，在力求本金安全的基础上，追求基金资产当期收益和超过比较基准的长期稳定增值。
投资策略	本基金采用“自上而下”的投资策略对各类资产进行合理配置。通过指数化债券投资策略确保债券资产的长期稳定增值，同时运用一些积极的、低风险的投资策略来提高债券投资组合的收益。
业绩比较基准	中信标普全债指数收益率×92%+中信标普A股综合指数收益率×8%
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中的低风险品种，其长期平均风险和预期收益均低于股票型基金。

### 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		长盛基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	叶金松	李芳菲
	联系电话	010-82255818	010-63201510
	电子邮箱	yejs@csfunds.com.cn	lifangfei@abchina.com

客户服务电话	400-888-2666、010-62350088	95599
传真	010-82255988	010-63201816

#### 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.csfunds.com.cn">http://www.csfunds.com.cn</a>
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公地址

## § 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	2010年	2009年	2008年
本期已实现收益	42,604,285.96	114,292,574.68	-3,713,088.44
本期利润	27,705,017.55	89,374,888.20	-58,469,116.92
加权平均基金份额本期利润	0.0544	0.0931	-0.0434
本期基金份额净值增长率	4.63%	7.79%	-2.08%
3.1.2 期末数据和指标	2010年末	2009年末	2008年末
期末可供分配基金份额利润	0.1597	0.0682	-0.0112
期末基金资产净值	558,406,337.56	750,868,888.06	1,311,587,692.30
期末基金份额净值	1.2983	1.2408	1.1891

注：1、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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、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。

3、期末可供分配利润，采用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（为期末余额，不是当期发生数）。表中的“期末”均指本报告期最后一日，即12月31日。

### 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	1.11%	0.40%	-1.03%	0.18%	2.14%	0.22%
过去六个月	5.72%	0.32%	1.21%	0.15%	4.51%	0.17%
过去一年	4.63%	0.31%	1.77%	0.14%	2.86%	0.17%
过去三年	10.44%	0.35%	10.02%	0.20%	0.42%	0.15%
过去五年	108.75%	0.38%	28.04%	0.19%	80.71%	0.19%
自基金合同生效起至今	140.79%	0.36%	38.82%	0.18%	101.97%	0.18%

注：本基金业绩比较基准=中信标普全债指数收益率×92%+中信标普A股综合指数收益率×8%。

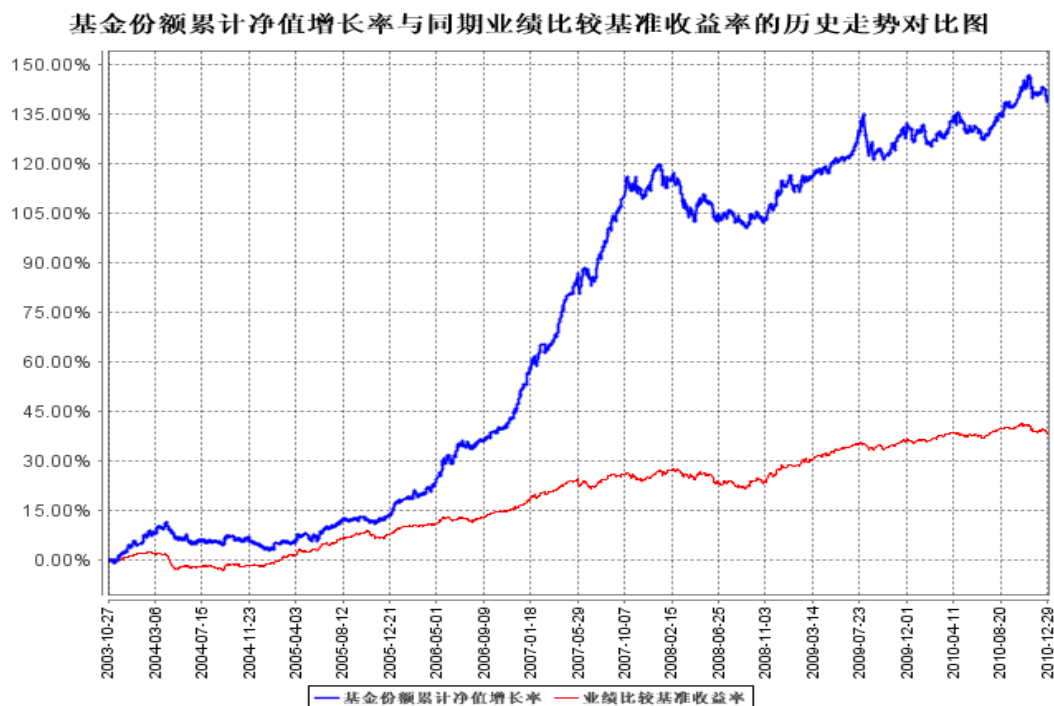
本基金业绩比较基准的构建：本基金为增强性指数化债券型投资基金，对目标指

数的投资在资产配置中最低比例为 64%，股票资产配置最高比例为 16%，现金持有最低比例为 3%。由于本基金主要投资于债券，股票投资是作为增强型投资提高收益的一种手段，预计股票投资比例的平均值为 8%，因此将基金业绩比较基准设定为：中信标普全债指数收益率×92%+中信标普 A 股综合指数收益率×8%。目前投资人可以通过登录中信证券研究网获取中信标普全债指数和中信标普 A 股综合指数的相关信息。如果中信指数体系信息发布渠道增加，本基金管理人将另行公告。

本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

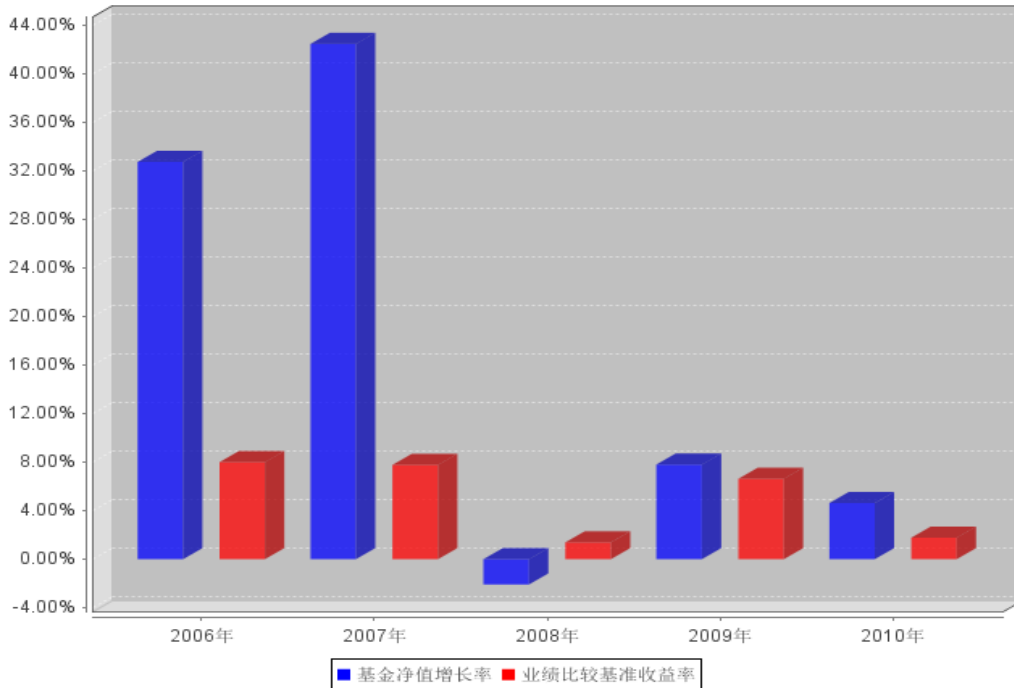
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

(2003 年 10 月 25 日至 2010 年 12 月 31 日)



### 3.2.3 过去五年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

过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

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
2010 年	-	-	-	-	2010 年度未分配收益
2009 年	0.400	12,363,502.99	16,360,432.44	28,723,935.43	除息日：2009 年 10 月 29 日
2008 年	0.800	65,986,222.11	53,272,425.79	119,258,647.90	除息日：2008 年 6 月 30 日
合计	1.200	78,349,725.10	69,632,858.23	147,982,583.33	

## § 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

本基金管理人经中国证监会证监基字[1999]6号文件批准，于1999年3月成立，注册资本为人民币15000万元。目前，本公司股东及其出资比例为：国元证券股份有限公司（以下简称“国元证券”）占注册资本的41%；新加坡星展资产管理有限公司占注册资本的33%；安徽省信用担保集团有限公司占注册资本的13%；安徽省投资集团有限责任公司占注册资本的13%。截止2010年12月31日，基金管理人共管理两支封闭式基金、十三支开放式基金，并于2002年12月，首批取得了全国社保基金管理资格。基金管理人于2007年9月，取得合格境内机构投资者资格，并于2008年2月，取得从事特定客户资产管理业务资格。

#### 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 (助理) 期限		证券从 业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘静	本基金基金经理，长盛货币市场基金基金经理，长盛积极配置债券型证券投资基金基金经理。	2008年8月 11日	—	10年	女，1977年1月出生，中国国籍。中央财经大学经济学硕士。2000年7月至2003年6月就职于北京证券有限责任公司；2003年7月加入长盛基金管理有限公司，先后担任交易部交易员、首席债券交易员。现任长盛中信全债指数增强型债券投资基金（本基金）基金经理，长盛货币市场基金基金经理，长盛积极配置债券型证券投资基金基金经理。



梁珂	本基金经理助理，债券研究员。	2010年12月10日	—	2年	男，1983年6月出生，中国国籍。北京大学硕士。2008年7月加入长盛基金管理有限公司，现任债券研究员，长盛中信全债指数增强型债券投资基金（本基金）基金经理助理，长盛货币市场基金基金经理助理。
----	----------------	-------------	---	----	--

注：1、上表基金经理及基金经理助理的任职日期和离任日期均指公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2、“证券从业年限”中“证券从业”的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

3、报经中国证券业协会同意，目前刘静女士已不再担任长盛中信全债指数增强型债券投资基金基金经理，由梁婷女士担任本基金基金经理。该事项公司已于2011年2月16日进行公告。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施准则、《长盛中信全债指数增强型债券投资基金基金合同》和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

#### 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，本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度等规定，从投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格把关，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行，确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送，保护投资者的合法权益。

##### 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

本基金管理人管理的投资组合中没有与本基金投资风格相似的投资组合，暂无法对本基金的投资业绩进行比较。

##### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未发生异常交易情况。

#### 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

2010 年的债券市场在上下半年走出了截然不同的走势。上半年，随着对欧洲主权债务危机引发全球经济二次探底的担忧加剧和对国内经济加速下滑的担忧，加息预期逐渐减弱，债券市场到期收益率持续下行，10 年国债和政策性金融债到期收益率一度下探到 3.2% 以及 3.54% 左右的低点，重启后的 3 年央票收益率也一路下行 20bp，最低曾到 2.55%。从曲线陡度来看，2010 年上半年收益率曲线持续平坦化，10 年国债和 1 年国债点差由年初的 2.15%，到 6 月 30 号下降至 1.15%。下半年，随着经济过度悲观情绪的消散，市场对经济大幅下滑的担忧减弱，债券市场到期收益率开始爬升，进入 10 月份后，经济增长环比底部得到确认，物价持续上涨超出预期，政府终于开始上调基准利率并通过法定存款准备金率的提高回笼市场流动性，债市收益率水平随之急速上行，绝大多数债券品种到期收益率创出 2009 年以来新高，10 年国债到期收益率最高达到 4.01%，同时收益率曲线也快速陡峭化。随后随着 CPI 的持续走高，存款准备金持续上调收缩流动性，短期限品种到期收益率持续上行，中长期品种到期收益率出现一定幅度回落，收益率曲线进一步加速平坦化，部分短期限品种还出现到期收益率倒挂现象，10 年国债相对 1 年国债到期收益率点差接近历史低位。

国内股票市场走势同样不尽如人意，虽然国庆前后，随着宏观经济环比底部的确认，煤炭、有色等资源类股票价格的一波急剧拉升带动上证指数一路反弹至 3180 点一线，但随着政策重心向“防通胀”的逐渐倾斜，趋于正常化的货币政策的急剧收缩导致 A 股市场在全球股市集体冲高的环境下选择了独自回落，最终收官于 2800 点附近，全年下跌 14.31%，成为主要市场中表现最差的前三，在经济同比增长达到 10% 左右的情况仅仅略好于深处于债务危机之中的希腊和西班牙股市。另一方面，中小企业集中上市的中小板指则全年上扬了 21.26%，使得大小盘股票的风格差异走向了极致。不过，临近年末，我们还是从盘面中察觉到部分资金开始提前介入银行、地产以及煤炭、有色等大盘蓝筹股票，这一风格的转化能否在新的一年里形成趋势我们将拭目以待。

在报告期内，本基金在债券资产配置策略上继续保持一贯稳健投资风格，对组合采用战略性和战术性配置相结合的一贯策略。基于债券市场投资收益难以与风险相匹配的判断，本组合在报告期内，将组合久期降到规定范围的最低限，较好的抵御了利

率上行的风险，但由于本基金有基准久期和指数样本的限定，因此超额收益无法实现最优化放大。就权益类资产部分而言，本基金始终坚持风险控制的原则，对该部分资产进行动态调整，投资期内基本保持较为积极的仓位，特别是3季度及时提高了仓位；策略上采取自上而下与自下而上相结合的资产配置策略，总体来说，还是取得了一定的投资收益，但由于期间市场热点转换频繁、政策波动较大，特别是4季度市场波动剧烈，客观上为基金在权益类资产上获取收益造成了很大困难。另一方面，我们继续保持着对新股市场的持续跟踪，通过参与资质较佳，申购价值突出的品种积极介入，也获取了较好的投资收益。另外，在报告期内我们在组合操作上继续加强了转债部分投资的操作，并加强了波段操作力度，报告期间也获得一定的投资收益。

#### 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 1.2983 元，本报告期份额净值增长率为 4.63%，同期业绩比较基准增长率为 1.77%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们判断在高基数作用下，经济增长同比在1季度仍将进一步小幅回落，但全年来看，这一同比数据将呈现前低后高、逐步攀升的态势，趋势上的表现要好于2010年前高后低的走势。国内政策调控使得经济结构适当调整后有望重新开始健康增长，美国经济的复苏形势将更为明朗，从而对全球经济带来新的增长动力。尽管不确定性很多，但我们对下半年的实体经济持相对乐观的态度。从总体水平上看，我们估计2011年的GDP同比增长有望达到接近9.5%的水平，整体的经济增长仍将表现得较为强劲。

物价方面，我们则继续持相对谨慎的态度。虽然政府临时性的价格管制措施有望在短期内稳定物价，1季度内还难以看到物价同比达到11月的高点，进入下半年，翘尾因素的逐渐消退也会使恶性通胀爆发的可能明显减少。但我们依旧强调局部农产品供给短板、恶劣气候条件和自然灾害以及输入性通胀等预期外因素爆发推高通胀的可能。此外，在经济和人口结构面临转型的背景下，中低端劳动要素价格的刚性提升将系统性地提高通胀的波动中枢水平，这样一种历史趋势是短期的行政性措施难以改变的。

政策走势上，我们注意到决策正在采取更为积极的手段来扼制银行突击放贷的冲动，这在一定程度上可能会加大商业银行被动配置债券的阶段压力，不过，我们也注意到相比于往年，债券供给在季节分布上也有相应的季节性调整，体现了决策层的

通盘考虑。因此从大致的方向看，供需的天平还难以看到明显的倾斜。而无论是基准利率还是存款准备金率，进一步的小幅上调都很可能会对当前收益率的紧平衡状态产生非常明显的冲击，由此来看，债券市场的风险依旧有待继续释放。

在债券市场操作上，考虑到债市风险释放仍不充分，短期的波段性机会在流动性制约下难以把握，因此，我们将继续保持对风险和流动性的关注程度，延续谨慎的投资原则，重点关注并挖掘票息保护能力较强信用类产品的配置价值，并且继续加强对可转债市场的研究和个券配置，力争在此领域获得较好的超额收益。

股票市场方面，尽管1季度的严厉的政策调控对经济和市场都会产生明显的影响，但经济总量和结构在得到适当调整后有望重新开始健康增长，但资本市场由于受到流动性等多种因素的影响，存在较大的不确定性。美国经济的复苏对全球资本流动的影响不可低估。因此我们认为全年股票市场将呈现震荡走势，本基金总体上将保持相对保守的仓位，力争做好波段操作以获取绝对收益。在配置方向上，我们认为，追求相对确定的机会，把握相对确定的收益，对于组合操作更加重要。本基金将主要配置在估值相对安全、需求相对确定、受国家产业政策支持确定性较高、未来有望成为中国下一阶段经济增长主导行业的行业和个股；在市场大小盘估值严重分化的情况下，风格上适当转向低估值的大盘股，以规避未来市场风格转换带来的系统性风险。

#### **4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明**

根据中国证监会相关规定及本基金合同约定，本基金管理人严格按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持投资品种进行估值。本基金管理人制订了证券投资基金估值政策与估值程序，设立基金估值小组，参考行业协会估值意见和独立第三方机构估值数据，确保基金估值的公平、合理。

本基金管理人制订的证券投资基金估值政策与估值程序确定了估值目的、估值日、估值对象、估值程序、估值方法以及估值差错处理、暂停估值和特殊情形处理等事项。本基金管理人设立了由公司副总经理（担任估值小组组长）、督察长（担任估值小组组长）及投资管理部、金融工程及量化投资部、研究发展部、监察稽核部、业务运营部等部门负责人组成的基金估值小组，负责研究、指导并执行基金估值业务。小组成员均具有多年证券、基金从业经验，具备基金估值运作、行业研究、风险管理或法律合规等领域的专业胜任能力。

基金经理参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日

常估值的执行。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管人有责任要求基金管理公司作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金未签约与任何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《证券投资基金运作管理办法》的规定以及本基金基金合同第十八条中对基金利润分配原则的约定，本基金于 2011 年 1 月 10 日对 2010 年度收益进行了分配，分配金额为 42,812,460.00 元。

本基金截至 2010 年 12 月 31 日，期末可供分配收益为 68,706,828.79 元，未分配收益已实现部分为 68,706,828.79 元，未分配收益未实现部分为 59,578,460.86 元。

## § 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

在托管长盛中信全债指数增强型债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《长盛中信全债指数增强型债券投资基金基金合同》、《长盛中信全债指数增强型债券投资基金托管协议》的约定，对长盛中信全债指数增强型债券投资基金管理人——长盛基金管理有限公司 2010 年 1 月 1 日至 2010 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，长盛基金管理有限公司在长盛中信全债指数增强型债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，长盛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盛中信全债指数增强型债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

普华永道中天会计师事务所有限公司注册会计师薛竞、张鸿 2011 年 3 月 29 日对本基金 2010 年 12 月 31 日的资产负债表、2010 年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注出具了普华永道中天审字(2011)第 20553 号无保留意见的审计报告。投资者欲查看审计报告全文，应阅读本年度报告正文。

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：长盛中信全债指数增强型债券投资基金

报告截止日：2010年12月31日

单位：人民币元

资 产	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
<b>资 产：</b>		
银行存款	38,823,900.00	222,734,567.19
结算备付金	2,730,793.67	5,592,041.11
存出保证金	960,000.00	1,080,974.77
交易性金融资产	489,984,643.85	759,785,163.32
其中：股票投资	77,121,368.65	119,599,121.12
基金投资	-	-
债券投资	412,863,275.20	640,186,042.20
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	8,580,503.39	109,169,736.19
应收利息	2,384,906.08	7,286,838.56
应收股利	-	-
应收申购款	20,109,890.78	229,298.58
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
<b>资产总计</b>	<b>563,574,637.77</b>	<b>1,105,878,619.72</b>
	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>2010年12月31日</b>	<b>2009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	-	-
卖出回购金融资产款	-	349,999,575.00
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	782,813.21	1,504,864.88
应付管理人报酬	346,653.14	487,628.01
应付托管费	92,440.82	130,034.17
应付销售服务费	-	-



应付交易费用	384,459.76	395,800.07
应交税费	2,981,320.81	2,044,186.77
应付利息	-	114,706.61
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	580,612.47	332,936.15
<b>负债合计</b>	<b>5,168,300.21</b>	<b>355,009,731.66</b>
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	430,121,047.91	605,133,452.00
未分配利润	128,285,289.65	145,735,436.06
<b>所有者权益合计</b>	<b>558,406,337.56</b>	<b>750,868,888.06</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>	<b>563,574,637.77</b>	<b>1,105,878,619.72</b>

注：报告截止日2010年12月31日，基金份额净值1.2983元，基金份额总额430,121,047.91份。

## 7.2 利润表

会计主体：长盛中信全债指数增强型债券投资基金

本报告期：2010年1月1日至2010年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2010年1月1日至 2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至 2009年12月31日
<b>一、收入</b>	<b>38,450,633.58</b>	<b>106,846,481.63</b>
1. 利息收入	14,944,711.68	33,913,598.04
其中：存款利息收入	922,889.05	1,250,579.34
债券利息收入	13,965,493.22	32,663,018.70
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	56,329.41	-
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	38,329,308.88	97,317,556.78
其中：股票投资收益	26,258,094.58	52,866,158.32
基金投资收益	-	-
债券投资收益	11,490,638.48	42,925,480.88
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	580,575.82	1,525,917.58
3. 公允价值变动收益（损失以“-”填列）	-14,899,268.41	-24,917,686.48
4. 汇兑收益（损失以“-”填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”填列）	75,881.43	533,013.29
<b>减：二、费用</b>	<b>10,745,616.03</b>	<b>17,471,593.43</b>
1. 管理人报酬	4,812,855.96	8,870,727.97
2. 托管费	1,283,428.29	2,365,527.56
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	2,154,757.35	3,493,473.77
5. 利息支出	2,126,304.43	2,373,864.13
其中：卖出回购金融资产支出	2,126,304.43	2,373,864.13
6. 其他费用	368,270.00	368,000.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>27,705,017.55</b>	<b>89,374,888.20</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>27,705,017.55</b>	<b>89,374,888.20</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长盛中信全债指数增强型债券投资基金

本报告期：2010年1月1日至2010年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2010年1月1日至2010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）	605,133,452.00	145,735,436.06	750,868,888.06
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	27,705,017.55	27,705,017.55
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）	-175,012,404.09	-45,155,163.96	-220,167,568.05
其中：1. 基金申购款	55,691,746.61	15,261,823.81	70,953,570.42
2. 基金赎回款	-230,704,150.70	-60,416,987.77	-291,121,138.47
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）	430,121,047.91	128,285,289.65	558,406,337.56
项 目	上年度可比期间 2009年1月1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）	1,103,037,594.27	208,550,098.03	1,311,587,692.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	89,374,888.20	89,374,888.20
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）	-497,904,142.27	-123,465,614.74	-621,369,757.01
其中：1. 基金申购款	231,944,160.14	50,352,275.70	282,296,435.84
2. 基金赎回款	-729,848,302.41	-173,817,890.44	-903,666,192.85
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）	-	-28,723,935.43	-28,723,935.43
五、期末所有者权益（基金净值）	605,133,452.00	145,735,436.06	750,868,888.06

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

陈礼华

杨思乐

戴君棉

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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

长盛中信全债指数增强型债券投资基金(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”)证监基金字[2003]90号《关于同意长盛中信全债指数增强型债券投资基金设立的批复》核准,由长盛基金管理有限公司依照《证券投资基金管理暂行办法》及其实施细则、《开放式证券投资基金试点办法》等有关规定和《长盛中信全债指数增强型债券投资基金基金契约》(后更名为《长盛中信全债指数增强型债券投资基金基金合同》)发起,并于2003年10月25日募集成立。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币924,036,786.93元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道验字(2003)第141号验资报告予以验证。募集期内产生的认购资金利息折合1,051,897.05份基金份额,分别计入各投资者基金账户。本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛中信全债指数增强型债券投资基金基金合同》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,包括国内依法公开发行的、上市的各种债券、股票及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。作为债券型基金,本基金主要投资于各类债券品种,品种主要包括:国债、金融债、企业债与可转换债券。本基金对目标指数的投资在资产配置中的比例最低为64%,股票投资在资产配置中的比例不超过16%。本基金的业绩比较基准为:中信标普全债指数收益率 $\times$ 92%+中信标普A股综合指数收益率 $\times$ 8%。

本财务报表由本基金的基金管理人长盛基金管理有限公司于2011年3月29日批准报出。

### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于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”)、中国证监会公告[2010]5号《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券业协会于2007年5月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《长盛中信全债指数增强型债券投资基金基金合同》和如财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会发布的有

关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### **7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本基金 2010 年度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 2010 年 12 月 31 日的财务状况以及 2010 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### **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、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### **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**

本年度不存在会计政策变更。

##### **7.4.5.2 会计估计变更的说明**

本年度不存在会计估计变更。

##### **7.4.5.3 差错更正的说明**

本年度不存在差错更正。

#### **7.4.6 税项**

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《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《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102 号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107 号《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《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，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、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。
- 3、对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20%的个人所得税，暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50%计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20%代扣代缴个人所得税，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。

#### 7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
长盛基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国农业银行	基金托管人、基金代销机构
国元证券	基金管理人的股东、基金代销机构
新加坡星展资产管理有限公司	基金管理人的股东
安徽省信用担保集团有限公司	基金管理人的股东
安徽省投资集团有限责任公司	基金管理人的股东

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 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 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日		上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国元证券	634,860,423.49	46.93%	1,483,137,766.95	66.60%

##### 7.4.8.1.2 权证交易

本基金本期及上年度可比期间未通过关联方交易单元发生权证交易。

##### 7.4.8.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日		上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
国元证券	883,315,650.89	84.81%	1,279,619,205.97	76.28%

##### 7.4.8.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国元证券	539,629.79	48.05%	164,743.49	43.18%
关联方名称	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日			

	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金 余额	占期末应付佣金 总额的比例
国元证券	1,260,663.81	67.59%	258,225.61	66.27%

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。债券及权证交易不计佣金。

2、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

#### 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 2010年1月1日至 2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至 2009年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	4,812,855.96	8,870,727.97
其中：支付销售机构的客户维护费	804,384.37	1,102,765.56

注：支付基金管理人长盛基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值0.75%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×0.75%/当年天数。

##### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至 2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至 2009年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,283,428.29	2,365,527.56

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0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

##### 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

单位：人民币元

本期 2010年1月1日至2010年12月31日						
银行间市场交易 的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国农业银行	20,016,534.24	10,066,123.63	-	-	98,000,000.00	89,889.47

上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日						
银行间市场交易 的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国农业银行	-	-	-	-	-	-

#### 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 2010年1月1日至 2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至 2009年12月31日
基金合同生效日（2003年10月25日）持有的基金份额	-	-
期初持有基金份额	29,937,118.12	29,937,118.12
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	29,937,118.12	29,937,118.12
期末持有的基金份额占基金总份额比例	6.96%	4.95%

##### 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他关联方本期及上年度可比期间未投资本基金。

##### 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 2010年1月1日至2010年12月31日		上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	38,823,900.00	884,080.37	222,734,567.19	1,204,526.82

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

##### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

##### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期及上年度可比期间无其他关联交易事项。



## 7.4.9 期末（2010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

金额单位：人民币元

7.4.9.1.1 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	备注
300137	先河环保	2010-10-27	2011-02-09	新股网下申购	22.00	38.21	91,907	2,021,954.00	3,511,766.47	
300127	银河磁体	2010-09-27	2011-01-13	新股网下申购	18.00	27.90	84,461	1,520,298.00	2,356,461.90	
601118	海南橡胶	2010-12-30	2011-04-07	新股网下申购	5.99	5.99	307,886	1,844,237.14	1,844,237.14	
601126	四方股份	2010-12-28	2011-03-31	新股网下申购	23.00	31.11	43,172	992,956.00	1,343,080.92	
601933	永辉超市	2010-12-9	2011-03-15	新股网下申购	23.98	31.24	39,572	948,936.56	1,236,229.28	
601890	亚星锚链	2010-12-17	2011-03-28	新股网下申购	22.50	21.50	31,187	701,707.50	670,520.50	
合计								8,030,089.20	10,962,296.21	

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

### 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

#### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

## 7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

### 1、公允价值

#### (1) 不以公允价值计量的金融工具

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相差很小。

#### (2) 以公允价值计量的金融工具

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

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、除第一层级中的市场报价以外的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)。

于 2010 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 330,407,643.85 元，属于第二层级的余额为 159,577,000.00 元，无属于第三层级的余额(2009 年 12 月 31 日：第一层级 518,108,163.32 元，第二层级 241,677,000.00 元，无第三层级)。

对于持有的重大事项停牌股票，本基金将相关股票公允价值所属层级于停牌期间从第一层级转入第二层级，并于复牌后从第二层级转回第一层级(2009 年度：同)。

2、除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 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	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	77,121,368.65	13.68
	其中：股票	77,121,368.65	13.68
2	固定收益投资	412,863,275.20	73.26
	其中：债券	412,863,275.20	73.26
	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	41,554,693.67	7.37
6	其他各项资产	32,035,300.25	5.68
7	<b>合计</b>	<b>563,574,637.77</b>	<b>100.00</b>

### 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	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	1,844,237.14	0.33
B	采掘业	1,298,500.00	0.23
C	制造业	50,380,161.71	9.02
C0	食品、饮料	17,094,296.02	3.06
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	6,033,100.00	1.08
C5	电子	6,221,591.90	1.11
C6	金属、非金属	4,382,720.00	0.78
C7	机械、设备、仪表	16,648,453.79	2.98
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	6,278,693.20	1.12
F	交通运输、仓储业	4,513,291.92	0.81
G	信息技术业	5,020,448.00	0.90
H	批发和零售贸易	4,950,036.68	0.89
I	金融、保险业	-	-

J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	2,836,000.00	0.51
	合计	77,121,368.65	13.81

### 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	000895	双汇发展	68,301	5,942,187.00	1.06
2	601111	中国国航	329,919	4,513,291.92	0.81
3	600537	海通集团	99,939	4,015,549.02	0.72
4	600284	浦东建设	199,934	3,958,693.20	0.71
5	002484	江海股份	125,900	3,865,130.00	0.69
6	600887	伊利股份	100,000	3,826,000.00	0.69
7	300137	先河环保	91,907	3,511,766.47	0.63
8	600519	贵州茅台	18,000	3,310,560.00	0.59
9	000528	柳工	85,000	3,145,000.00	0.56
10	600403	欣网视讯	85,900	2,913,728.00	0.52

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 <http://www.csfunds.com.cn> 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的比例（%）
1	600352	浙江龙盛	38,357,318.03	5.11
2	000792	盐湖钾肥	17,325,774.21	2.31
3	002024	苏宁电器	17,187,805.76	2.29
4	000917	电广传媒	16,807,679.27	2.24
5	300086	康芝药业	16,725,166.20	2.23
6	600256	广汇股份	13,946,936.71	1.86
7	601318	中国平安	13,768,458.92	1.83
8	601766	中国南车	12,789,987.00	1.70
9	000969	安泰科技	12,339,133.22	1.64
10	600066	宇通客车	11,931,836.18	1.59
11	002415	海康威视	11,840,056.71	1.58
12	002438	江苏神通	10,090,042.20	1.34
13	002334	英威腾	9,678,918.70	1.29

14	600216	浙江医药	9,301,663.34	1.24
15	601111	中国国航	8,770,777.17	1.17
16	002029	七匹狼	8,124,585.58	1.08
17	600875	东方电气	8,116,206.18	1.08
18	002477	雏鹰农牧	8,058,466.30	1.07
19	601101	昊华能源	7,924,516.00	1.06
20	600517	置信电气	7,658,659.00	1.02

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名股票明细

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的比例(%)
1	600352	浙江龙盛	37,970,275.59	5.06
2	000917	电广传媒	17,988,086.88	2.40
3	002024	苏宁电器	17,368,061.38	2.31
4	300086	康芝药业	16,724,603.25	2.23
5	000792	盐湖钾肥	14,667,768.18	1.95
6	600256	广汇股份	14,652,340.44	1.95
7	000969	安泰科技	14,156,929.22	1.89
8	600066	宇通客车	13,726,812.53	1.83
9	601318	中国平安	13,407,417.99	1.79
10	601766	中国南车	13,304,694.58	1.77
11	002438	江苏神通	12,150,846.39	1.62
12	002042	华孚色纺	12,106,366.84	1.61
13	002415	海康威视	11,716,705.08	1.56
14	601998	中信银行	11,310,174.38	1.51
15	002431	棕榈园林	11,072,690.51	1.47
16	002334	英威腾	10,629,523.00	1.42
17	600036	招商银行	10,264,610.69	1.37
18	002477	雏鹰农牧	9,652,316.22	1.29
19	600216	浙江医药	9,357,788.60	1.25
20	600875	东方电气	8,927,254.72	1.19

#### 8.4.3 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

买入股票成本（成交）总额	700,160,156.33
卖出股票收入（成交）总额	760,308,771.63

注：本项中 8.4.1、8.4.2 和 8.4.3 表中的“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填写，不考虑相关交易费用。

## 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	68,730,816.30	12.31
2	央行票据	-	-
3	金融债券	149,636,000.00	26.80
	其中：政策性金融债	149,636,000.00	26.80
4	企业债券	105,579,860.80	18.91
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	88,916,598.10	15.92
7	其他	-	-
8	合计	412,863,275.20	73.94

## 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	113002	工行转债	429,720	50,767,120.80	9.09
2	010308	03 国债(8)	489,590	48,905,145.10	8.76
3	080207	08 国开 07	400,000	39,892,000.00	7.14
4	080223	08 国开 23	400,000	39,464,000.00	7.07
5	090306	09 进出 06	300,000	30,348,000.00	5.43

## 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

## 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 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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。

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查，无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

## 8.9.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

本基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

### 8.9.3 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	960,000.00
2	应收证券清算款	8,580,503.39
3	应收股利	-
4	应收利息	2,384,906.08
5	应收申购款	20,109,890.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	32,035,300.25

### 8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113001	中行转债	24,169,200.00	4.33
2	110003	新钢转债	8,066,100.00	1.44
3	110009	双良转债	5,564,760.40	1.00

### 8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	300137	先河环保	3,511,766.47	0.63	新股流通受限

### 8.9.6 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，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 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(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
19,051	22,577.35	90,592,224.49	21.06%	339,528,823.42	78.94%

### 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

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放式基金	19,013.44	0.00%

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2003年10月25日)基金份额总额	925,088,683.98
本报告期期初基金份额总额	605,133,452.00
本报告期基金总申购份额	55,691,746.61
减：本报告期基金总赎回份额	230,704,150.70
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	430,121,047.91



## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期未召开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

#### 11.2.1 本基金管理人的高级管理人员重大人事变动情况

本基金管理人于 2010 年 6 月 18 日发布公告，经长盛基金管理有限公司第五届董事会第一次会议审议通过，并报中国证监会审核批准(证监许可[2010]762 号)，聘任公司董事凤良志先生担任公司董事长，陈平先生不再担任公司董事长一职。

本基金管理人于 2010 年 6 月 23 日发布公告，经长盛基金管理有限公司第五届董事会第二次会议审议通过，决定聘任朱剑彪先生担任公司副总经理职务。

#### 11.2.2 基金经理变动情况

本报告期基金经理未发生变动。

#### 11.2.3 本基金托管人的基金托管部门重大人事变动情况

本报告期本基金托管人的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

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 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

本基金聘任的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所有限公司，本报告期内本基金未更换会计师事务所，本报告期应支付给该会计师事务所的报酬 80,000.00 元，已连续为本基金提供审计服务 8 年。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

2010 年 9 月 6 日，本基金管理人因旗下长盛创新先锋基金所持债券投资比例连续 12 个交易日不符合基金合同的约定，以及长盛货币市场基金所持“10 柳化工 CP01”债券的数量超过该债券发行数量的 10% 的原因，受到北京证监局的行政监管措施。本基金管理人根据行政监管措施决定书的要求及时、认真地对公司投资管理制度流程、风险管理、监察稽核及执行等各方面进行了整改、梳理和完善。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金	
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例
国元证券	1	634,860,423.49	46.93%	539,629.79	48.05%
安信证券	1	526,040,276.30	38.89%	427,411.93	38.06%
中山证券	1	191,887,194.64	14.18%	155,909.85	13.88%

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行债券投资及债券回购的情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	债券交易		债券回购交易	
		成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交总额	占当期债券回购成交总额的比例
国元证券	1	883,315,650.89	84.81%	2,774,000,000.00	100.00%
安信证券	1	102,117,404.91	9.81%	-	-
中山证券	1	56,043,989.30	5.38%	-	-

注：1、本公司选择证券经营机构的标准

(1) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为本公司提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告等，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

(2) 资金雄厚，信誉良好。

(3) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。

(4) 经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚。

(5) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。

(6) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本公司基金进行证券交易的需要，并能为本公司基金提供全面的信息服务。

2、本公司租用券商交易单元的程序

(1) 研究机构提出服务意向，并提供相关研究报告；

(2) 研究机构的研究报告需要有一定的试用期。试用期视服务情况和研究服务评价结果而定；

(3) 研究发展部、投资管理等部门试用研究机构的研究报告后，按照研究服务评价规定，对研究机构进行综合评价；

(4) 试用期满后，评价结果符合条件，双方认为有必要继续合作，经公司领导审批后，我司与研究机构签定《研究服务协议》、《券商交易单元租用协议》，并办理基金专用交易单元租用手续。评价结果如不符合条件则终止试用；

(5) 本公司每两个月对签约机构的服务进行一次综合评价。经过评价，若本公司认为签约机构的服务不能满足要求，或签约机构违规受到国家有关部门的处罚，本公司有权终止签署的协议，并撤销租用的交易单元；

(6) 交易单元租用协议期限为一年，到期后若双方没有异议可自动延期一年。

### 3、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

(1) 本基金报告期内新增租用交易单元情况：

序号	证券公司名称	交易单元所属市场	数量
1	安信证券	深圳	1

(2) 本基金报告期内停止租用交易单元情况：无。