

信息披露 disclosure

长盛中信全债指数增强型债券投资基金

2013 年度报告摘要

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:2014年3月29日

1.1 重要提示
基金管理人承诺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。

2.1 基金基本情况
基金名称:长盛中信全债指数增强型债券投资基金
基金代码:510800
基金管理人:长盛基金管理有限公司

2.2 基金产品说明
投资目标:本基金为开放式债券基金,将采用增强的量化投资策略,力求在基金合同约定的投资范围内实现超越业绩比较基准的长期稳定增值。

2.3 基金管理人及基金托管人
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

2.4 信息披露方式
基金年度报告全文的官方网站: http://www.csfund.com.cn
基金年度报告备置地点: 基金管理人住所

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

Table with 4 columns: 2013年, 2012年, 2011年, 2010年. Rows include 本期期末资产总额, 本期利润, 加权平均基金份额本期利润, etc.

注:1. 上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,计入费用后实际投资水平要低于所列数据。
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。

Table with 4 columns: 阶段, 跟踪偏离度, 业绩比较基准, 跟踪偏离度, etc. Rows include 过去3个月, 过去6个月, 过去12个月, etc.

注:本基金业绩比较基准=中信标普全债指数收益率\*92%+中信国债指数收益率\*8%。
本基金业绩比较基准的构成:本基金为增强型指数化债券投资基金,对目标指数的投资在资产配置中最高比例为94%。

3.2.2 过去五年基金每年净值增长及其与同期业绩比较基准收益率的比较
图: 长盛中信全债指数增强型债券投资基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

Table with 5 columns: 年度, 每份基金份额净值, 基金形式发生总额, 基金净值发生总额, 年度利润分配合计.

4.1 基金管理人及其基金托管情况
4.1.1 基金管理人及其基金托管情况
基金管理人:长盛基金管理有限公司

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理情况
姓名: 曹晓波
职务: 基金经理

注:1. 上述基金经理的任职日期和离职日期均指中国证监会确定的聘任和辞聘日期。
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。

4.2 基金管理人及基金托管人内部控制制度
4.2.1 基金管理人内部控制制度
基金管理人:长盛基金管理有限公司

4.2.2 基金托管人内部控制制度
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

4.3 基金投资合规性风险控制
4.3.1 基金投资合规性风险控制
基金管理人:长盛基金管理有限公司

4.3.2 基金投资合规性风险控制
基金管理人:长盛基金管理有限公司

4.3.3 基金投资合规性风险控制
基金管理人:长盛基金管理有限公司

4.3.4 基金投资合规性风险控制
基金管理人:长盛基金管理有限公司

4.3.5 基金投资合规性风险控制
基金管理人:长盛基金管理有限公司

4.3.6 基金投资合规性风险控制
基金管理人:长盛基金管理有限公司

4.3.7 基金投资合规性风险控制
基金管理人:长盛基金管理有限公司

4.3.8 基金投资合规性风险控制
基金管理人:长盛基金管理有限公司

4.3.9 基金投资合规性风险控制
基金管理人:长盛基金管理有限公司

4.3.10 基金投资合规性风险控制
基金管理人:长盛基金管理有限公司

4.3.11 基金投资合规性风险控制
基金管理人:长盛基金管理有限公司

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。

7.2 会计报告的编制基础
本基金按照财政部颁布的《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、企业会计准则解释及其他相关规定以及符合“公允价值”的中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露编报规则》等有关规定进行编制。

7.3 遵循会计准则及其他相关规定的声明
本基金2013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2013年12月31日的财务状况以及2013年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4 本报告期采用的会计政策、会计估计与前一报告期是否一致
本报告期所采用的会计政策、会计估计与前一报告期保持一致。

7.5 会计差错更正
本报告期不存在会计差错更正。

7.6 税务
根据财政部、国家税务总局颁布的《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》(财税[2002]128号)关于企业所得税的相关规定,本基金在取得股息、利息收入时,由支付股息、利息的企业代扣代缴。

7.7 关联方关系
关联方名称: 长盛基金管理有限公司
关联方名称: 中国农业银行股份有限公司

7.8 关联交易
7.8.1 关联交易
7.8.2 关联交易

7.9 关联方关系
7.9.1 关联方关系
7.9.2 关联方关系

7.10 关联方关系
7.10.1 关联方关系
7.10.2 关联方关系

7.11 关联方关系
7.11.1 关联方关系
7.11.2 关联方关系

7.12 关联方关系
7.12.1 关联方关系
7.12.2 关联方关系

7.13 关联方关系
7.13.1 关联方关系
7.13.2 关联方关系

7.14 关联方关系
7.14.1 关联方关系
7.14.2 关联方关系

7.15 关联方关系
7.15.1 关联方关系
7.15.2 关联方关系

7.16 关联方关系
7.16.1 关联方关系
7.16.2 关联方关系

7.17 关联方关系
7.17.1 关联方关系
7.17.2 关联方关系

7.18 关联方关系
7.18.1 关联方关系
7.18.2 关联方关系

7.19 关联方关系
7.19.1 关联方关系
7.19.2 关联方关系

7.20 关联方关系
7.20.1 关联方关系
7.20.2 关联方关系

7.21 关联方关系
7.21.1 关联方关系
7.21.2 关联方关系

7.22 关联方关系
7.22.1 关联方关系
7.22.2 关联方关系

7.23 关联方关系
7.23.1 关联方关系
7.23.2 关联方关系

7.24 关联方关系
7.24.1 关联方关系
7.24.2 关联方关系

7.25 关联方关系
7.25.1 关联方关系
7.25.2 关联方关系

7.26 关联方关系
7.26.1 关联方关系
7.26.2 关联方关系

7.27 关联方关系
7.27.1 关联方关系
7.27.2 关联方关系

7.28 关联方关系
7.28.1 关联方关系
7.28.2 关联方关系

7.29 关联方关系
7.29.1 关联方关系
7.29.2 关联方关系

7.30 关联方关系
7.30.1 关联方关系
7.30.2 关联方关系

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。

7.2 会计报告的编制基础
本基金按照财政部颁布的《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、企业会计准则解释及其他相关规定以及符合“公允价值”的中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露编报规则》等有关规定进行编制。

7.3 遵循会计准则及其他相关规定的声明
本基金2013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2013年12月31日的财务状况以及2013年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4 本报告期采用的会计政策、会计估计与前一报告期是否一致
本报告期所采用的会计政策、会计估计与前一报告期保持一致。

7.5 会计差错更正
本报告期不存在会计差错更正。

7.6 税务
根据财政部、国家税务总局颁布的《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》(财税[2002]128号)关于企业所得税的相关规定,本基金在取得股息、利息收入时,由支付股息、利息的企业代扣代缴。

7.7 关联方关系
关联方名称: 长盛基金管理有限公司
关联方名称: 中国农业银行股份有限公司

7.8 关联交易
7.8.1 关联交易
7.8.2 关联交易

7.9 关联方关系
7.9.1 关联方关系
7.9.2 关联方关系

7.10 关联方关系
7.10.1 关联方关系
7.10.2 关联方关系

7.11 关联方关系
7.11.1 关联方关系
7.11.2 关联方关系

7.12 关联方关系
7.12.1 关联方关系
7.12.2 关联方关系

7.13 关联方关系
7.13.1 关联方关系
7.13.2 关联方关系

7.14 关联方关系
7.14.1 关联方关系
7.14.2 关联方关系

7.15 关联方关系
7.15.1 关联方关系
7.15.2 关联方关系

7.16 关联方关系
7.16.1 关联方关系
7.16.2 关联方关系

7.17 关联方关系
7.17.1 关联方关系
7.17.2 关联方关系

7.18 关联方关系
7.18.1 关联方关系
7.18.2 关联方关系

7.19 关联方关系
7.19.1 关联方关系
7.19.2 关联方关系

7.20 关联方关系
7.20.1 关联方关系
7.20.2 关联方关系

7.21 关联方关系
7.21.1 关联方关系
7.21.2 关联方关系

7.22 关联方关系
7.22.1 关联方关系
7.22.2 关联方关系

7.23 关联方关系
7.23.1 关联方关系
7.23.2 关联方关系

7.24 关联方关系
7.24.1 关联方关系
7.24.2 关联方关系

7.25 关联方关系
7.25.1 关联方关系
7.25.2 关联方关系

7.26 关联方关系
7.26.1 关联方关系
7.26.2 关联方关系

7.27 关联方关系
7.27.1 关联方关系
7.27.2 关联方关系

7.28 关联方关系
7.28.1 关联方关系
7.28.2 关联方关系

7.29 关联方关系
7.29.1 关联方关系
7.29.2 关联方关系

7.30 关联方关系
7.30.1 关联方关系
7.30.2 关联方关系

7.31 关联方关系
7.31.1 关联方关系
7.31.2 关联方关系

Table with 5 columns: 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(%)

注:本基金本报告期末持有上述两支股票。
8.4 期末前十名股票超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

Table with 5 columns: 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(%)

8.4.2 累计买入超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

Table with 5 columns: 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(%)

8.4.3 买入股票的成本及卖出股票的收入

Table with 5 columns: 序号, 股票品种, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 5 columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小非前的前五名债券投资组合

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小非前的前十名资产支持证券投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小非前的前五名权证投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 债券名称, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

8.9 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 债券名称, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

8.10 期末其他债券资产构成

Table with 5 columns: 序号, 名称, 金额

8.10.5 期末前十名股票在流通受限期间的说明

8.10.6 投资组合报告期末持有的其他文字描述部分

8.11 期末基金持有人户数及持有人结构

Table with 5 columns: 持有人户数(户), 户持有基金份额, 机构投资者, 个人投资者

8.12 期末基金持有人户数及持有人结构

8.13 期末基金持有人户数及持有人结构