

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:2013年3月6日

§ 1 重要提示及目录

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责任。本公司管理人保证本年度报告已按三分之一以上独立董事签字同意。本公司承诺不将年度报告以书面或电子文本的方式报送中国证监会，以电子文本方式报送的，应保证报送文本与书面报送文本的一致性。
本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”根据基金合同规定，本公司对本基金进行了年度报告的审核，确认本年度报告的内容真实、准确、完整，不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。
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的基金额，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。投资基金管理人做投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

年度报告摘要自年度报告正文发布之日起，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2012年1月1日起至2012年12月31日止。

§ 2 基金简介

基金名称	长盛中信全债指数增强型债券投资基金
基金主代码	510800
基金次代码	510800
归因交易代码	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
报告期基金合同期间	260.178-547.209
基金合同存续期间	不确定

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，在力求基金安全的基础上，追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金在资产配置上将根据宏观经济形势、政策环境、资金面、利率水平、信用利差、信用风险、信用品种等多方面因素，综合运用各种投资策略，通过分析债券品种的相对投资价值，选择具有较好投资价值的债券品种进行投资。
业绩比较基准	中债综合全债指数收益率*92%+信用债A股综合指数收益率*8%
风险收益特征	本基金属于债券基金中的高风险品种，其长期平均风险和预期收益均低于债券型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人	
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
信息披露义务人	010-82019988 叶金玲
电子邮箱	yejinling@clsunds.com.cn

客户服务电话	400-888-2668-010-62350088
电子邮箱	010-82255988

2.4 信息披露方式	
公告基金年度报告的管理人互联网网址	http://www.clsunds.com.cn

基金管理人和基金托管人的办公地址
长盛基金管理有限公司 中国农业银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况
金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标
2012年 2011年 2010年
本期已实现收益 -3,335,450.76 -21,345,388.82 42,664,285.96
本期利润 -659,303.70 -28,114,670.43 27,705,017.55
加权平均基金份额本期利润 -0.0022 -0.0729 0.0544
期末基金份额净值 -0.43% -6.28% 4.63%

3.1.2 期间数据和指标
2012年末 2011年末 2010年末
期末可供分配基金份额利润 -0.0170 -0.0017 0.1597
期末基金份额净值 1.1187 1.1235 1.2983
注:上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,计算费用后实际收益水平将低于所示净值。

3.1.3 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		
份额(%)	净值增长率	同期业绩比较基准收益率的比较
过去一个月 1.55% 0.11% 0.00%		
过去六个月 -1.44% 0.99% 0.08%		
过去一年 -0.43% 0.22% 0.10%		
过去三年 -2.36% 0.26% 0.13%		
过去五年 3.06% 0.31% 0.17%		
注:上表所列基金份额净值增长率是指本报告期内每万份基金份额的收益。		

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		
份额(%)	净值增长率	同期业绩比较基准收益率的比较
过去一个月 0.15% 0.11% 0.00%		
过去六个月 -1.44% 0.99% 0.08%		
过去一年 -0.43% 0.22% 0.10%		
过去三年 -2.36% 0.26% 0.13%		
过去五年 3.06% 0.31% 0.17%		
注:上表所列基金份额净值增长率是指本报告期内每万份基金份额的收益。		

3.2.2 自基金合同生效以来基金期间各年度所有者权益变动表
金额单位:人民币元
3.2.2.1 本期末基金所有者权益变动表
3.2.2.2 本报告期基金所有者权益变动表
3.2.2.3 本报告期所有者权益变动表

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		
基金份额净值	净值增长率	同期业绩比较基准收益率的比较
过去五年 1.1187 1.1235 1.2983		
过去四年 1.1187 1.1235 1.2983		
过去三年 1.1187 1.1235 1.2983		
过去两年 1.1187 1.1235 1.2983		
过去一年 1.1187 1.1235 1.2983		
过去六个月 1.1187 1.1235 1.2983		
过去一个月 1.1187 1.1235 1.2983		
注:上表所列基金份额净值增长率是指本报告期内每万份基金份额的收益。		

3.2.4 基金合同生效以来基金期间各年度所有者权益变动表
金额单位:人民币元
3.2.4.1 本期末基金所有者权益变动表
3.2.4.2 本报告期基金所有者权益变动表
3.2.4.3 本报告期所有者权益变动表

3.2.5 基金管理人报告
基金管理人对基金年度报告分析
基金管理人对基金年度报告分析
基金管理人对基金年度报告分析
基金管理人对基金年度报告分析

3.2.6 基金托管人报告
基金托管人对基金年度报告分析
基金托管人对基金年度报告分析
基金托管人对基金年度报告分析
基金托管人对基金年度报告分析

3.2.7 基金管理人对年度报告的审批意见
基金管理人对基金年度报告分析
基金管理人对基金年度报告分析
基金管理人对基金年度报告分析
基金管理人对基金年度报告分析

3.2.8 基金管理人对年度报告的披露意见
基金管理人对基金年度报告分析
基金管理人对基金年度报告分析
基金管理人对基金年度报告分析
基金管理人对基金年度报告分析

3.2.9 基金管理人对年度报告的声明
基金管理人对基金年度报告分析
基金管理人对基金年度报告分析
基金管理人对基金年度报告分析
基金管理人对基金年度报告分析

3.2.10 基金管理人对年度报告的承诺
</