

长盛中信全债指数增强型债券投资基金 招募说明书（更新）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

重要提示：

本基金于2003年7月30日经中国证监会证监基金字【2003】90号文批准募集。

本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

投资有风险，投资人申购基金时应认真阅读本招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本招募说明书（更新）所载内容截止日为2012年4月25日，有关财务数据和净值表现截止日为2012年3月31日（财务数据未经审计）。

一、基金合同生效的日期

2003年10月25日。

二、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：长盛基金管理有限公司

住所：深圳市福田区福中三路1006号诺德中心八楼GH单元

办公地址：北京市海淀区北太平庄路18号城建大厦A座21层

法定代表人：凤良志

电话：(010) 82019988

传真：(010) 82255988

联系人：叶金松

本基金管理人经中国证监会证监基金字[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。截至目前，本公司股东及其出资比例为：国元证券股份有限公司占注册资本的41%；新加坡星展银行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(现名称为安徽省投资集团控股有限公司)占注册资本的13%。截至2012年4月25日,基金管理人共管理两只封闭式基金、十八只开放式基金和五只社保基金委托资产,同时管理多只专户理财产品。

(二) 主要人员情况

1、基金管理人董事会成员

凤良志先生,董事长,博士,高级经济师。曾任安徽省政府办公厅二办副主任,安徽省国际信托投资公司副总经理,安徽省证券管理办公室主任,香港黄山有限公司董事长、总经理,安徽国元控股(集团)有限责任公司董事长、党委书记,安徽国元信托投资有限责任公司董事长。现任国元证券股份有限公司董事长。

钱正先生,董事,学士,高级经济师。曾任安徽省人大常委办公厅副处长、处长,安徽省信托投资公司副总经理、党委副书记,安徽省国有资产管理局分党组书记。现任安徽省信用担保集团有限公司总经理。

杜长棣先生,董事,学士。曾任安徽省第一轻工业厅研究室副主任,安徽省轻工业厅生产技术处、企业管理处处长、副厅长,安徽省巢湖市市委常委、常务副市长,安徽省发改委副主任。现任安徽省投资集团有限责任公司(现名称为安徽省投资集团控股有限公司)党委书记、董事长。

蔡咏先生,董事,学士,高级经济师。曾任安徽财经大学财政金融系讲师、会计教研室主任,安徽省国际经济技术合作公司美国分公司财务经理,安徽省国际信托投资公司国际金融部经理、深圳证券部经理、证券总部副总经理,香港黄山有限公司总经理助理。现任国元证券股份有限公司董事、总裁。

陈淑珊女士,董事,硕士。曾任职多个金融机构,包括ING霸菱证券公司、花旗银行、摩根士丹利。现任星展银行有限公司私人银行业务部董事总经理兼主管。

张在荣先生,董事,学士。曾任职多个金融机构,包括法国东方汇理银行、美洲银行、渣打银行、星展银行有限公司。现任星展银行(中国)有限公司执行董事兼行政总裁。

周兵先生,董事、总经理,硕士,经济师。曾任中国银行总行综合计划部副主任科员、香港南洋商业银行内地融资部副经理、香港中银国际亚洲有限公司企业财务部经理、广发证券股份有限公司北京业务总部副总经理(期间兼任海南华

银国际信托投资公司北京证券营业部托管组负责人)、北京朝阳门大街证券营业部总经理。2004年10月加入长盛基金管理有限公司,曾任公司副总经理。现任长盛基金管理有限公司总经理。

李伟强先生,独立董事,美国加州大学洛杉矶分校工商管理硕士,美国宾州州立大学政府管理硕士和法国文学硕士。曾任摩根士丹利纽约、新加坡、香港等地投资顾问、副总裁,花旗环球金融亚洲有限公司高级副总裁。现任香港国际资本管理有限公司董事长。

张仁良先生,独立董事,金融学讲座教授。曾任香港消费者委员会有关银行界调查的项目协调人、太平洋经济合作理事会(PECC)属下公司管制研究小组主席、上海交通大学管理学院兼职教授、上海复旦大学顾问教授、香港城市大学讲座教授。现任香港浸会大学工商管理学院院长、民政事务总署辖下的《伙伴倡自强》小区协作计划主席、香港金融管理局ABF香港创富债券指数基金监督委员会主席以及香港特区政府策略发展委员会委员。2007年被委任为太平绅士。2009年获香港特区政府颁发铜紫荆星章。

荣兆梓先生,独立董事,教授。曾任安徽大学经济学院副院长、院长。现任安徽大学教授、校学术委员会委员、政治经济学博士点学科带头人、产业经济学和工商管理硕士点学科带头人,武汉大学商学院博士生导师,中国科技大学兼职教授,安徽省政府特邀咨询员,全国马经史学会常务理事,全国资本论研究会常务理事,安徽省经济学会副会长。

陈华平先生,独立董事,博士毕业,教授,博士生导师。曾任中国科技大学信息管理与决策研究室主任、管理学院副院长。现任中国科学技术大学计算机学院执行院长、管理学院商务智能实验室主任。

2、监事会成员

陈锦光先生,监事会主席,学士,特许金融分析师。曾任职于美国银行直投伙伴公司私募股权投资部门,历任野村证券高科技产业研究分析师、野村证券上海办事处及证券研究部门负责人、星展资产管理有限公司研究总监以及投资亚洲和中国国内市场的投资经理人。现任星展资产管理有限公司股票投资团队总监。

沈和付先生,监事,法学学士。曾任安徽省国际经济技术合作公司经理助理、安徽省信托投资公司法律部副主任。现任国元证券股份有限公司合规总监。

叶斌先生，监事，学士，高级经济师。曾任安徽大学管理系讲师、教研室副主任，安徽省信托投资公司部门经理、副总经理。现任安徽省中小企业信用担保中心副主任、安徽省信用担保集团有限公司副总经理。

钱进先生，监事，硕士研究生。曾任安徽省节能中心副主任、安徽省经贸投资集团董事、安徽省医药集团股份公司总经理，安徽省投资集团有限责任公司资本运营部经理、总经理助理、总经济师。现任安徽省投资集团有限责任公司（现名称为安徽省投资集团控股有限公司）党委委员、副总经理。

张利宁女士，监事，学士。曾任华北计算技术研究所会计，太极计算机公司子公司北京润物信息技术有限公司主管会计，历任长盛基金管理有限公司业务运营部总监、财务会计部总监。现任长盛基金管理有限公司监察稽核部总监。

3、管理层成员

凤良志先生，董事长，博士，高级经济师。同上。

周兵先生，董事、总经理，硕士，经济师。同上。

朱剑彪先生，金融学博士。曾任广东商学院投资金融系教师、党支部书记，广州证券有限公司宏观与策略研究员、投资银行部项目经理、基金部经理，金鹰基金管理有限公司筹备组成员、董事会秘书、研究总监、投研副总监兼研究总监和督察长。2007年4月起加入长盛基金管理有限公司，历任社保业务管理部总监、固定收益部总监、总经理助理、副总经理等职。现任长盛基金管理有限公司常务副总经理、社保组合组合经理。

杨思乐先生，英国籍，拥有北京大学法学学士学位与英国伦敦政治经济学院硕士学位。从1992年9月开始曾先后任职于太古集团、摩根银行、野村项目融资有限公司、汇丰投资银行亚洲、美亚能源有限公司、康联马洪资产管理公司、星展银行有限公司（新加坡）。2007年8月起加入长盛基金管理有限公司，现任长盛基金管理有限公司副总经理。

叶金松先生，大学，会计师。曾任美菱股份有限公司财会部经理，安徽省信托投资公司财会部副经理，国元证券有限责任公司清算中心主任、风险监管部副经理、经理。2004年10月起加入长盛基金管理有限公司，现任长盛基金管理有限公司督察长。

4、本基金基金经理

梁婷女士，1975年6月出生。中国社会科学院研究生院经济学博士。曾任中国对外经济贸易信托投资公司投资银行部项目经理；2000年10月加入长盛基金管理有限公司，先后担任产品设计经理、固定收益研究员、社保组合经理助理、社保组合经理。现任社保业务管理部副总监，社保组合组合经理，自2011年2月15日起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，自2011年2月15日起兼任长盛货币市场基金基金经理。

本基金历任基金经理：

王茜女士，2003年10月25日—2008年11月6日任本基金基金经理；刘静女士，2008年8月11日—2011年2月15日任本基金基金经理。

(本招募说明书基金经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。)

5、投资决策委员会成员

朱剑彪先生，金融学博士，常务副总经理，同上。

王宁先生，EMBA。历任华夏基金管理有限公司基金经理助理，兴业基金经理等职务。2005年8月加盟长盛基金管理有限公司，曾任投资管理部基金经理助理、长盛动态精选基金基金经理等职务。现任投资管理部总监，长盛成长价值证券投资基金基金经理，长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金基金经理。

侯继雄先生，清华大学博士。历任国泰君安证券研究所任研究员、策略部经理。2007年2月加入长盛基金管理有限公司，现任研究发展部总监，同盛证券投资基金基金经理。

吴达先生，伦敦政治经济学院金融经济学硕士，美国特许金融分析师CFA。曾就职于新加坡星展资产管理有限公司，历任星展珊瑚全球收益基金经理助理、星展增裕基金经理；新加坡毕盛高荣资产管理公司亚太专户投资组合经理、资产配置委员会成员；华夏基金管理有限公司国际策略分析师、固定收益投资经理；2007年8月起加入长盛基金管理有限公司，现任国际业务部总监，长盛积极配置债券型证券投资基金基金经理，长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金基金经理。

蔡宾先生，中央财经大学硕士，美国特许金融分析师CFA。历任宝盈基金管理有限公司研究员、基金经理助理。2006年2月加入长盛基金管理有限公司，

曾任研究员、社保组合助理、投资经理，长盛积极配置债券基金基金经理等职务。现任固定收益部总监，长盛同鑫保本混合型证券投资基金基金经理，长盛同禧信用增利债券型证券投资基金基金经理。

刘斌先生，清华大学工学学士、中国科学院工学博士。2006年5月加入长盛基金管理有限公司，在公司期间历任金融工程研究员、高级金融工程研究员、基金经理助理、长盛沪深300指数证券投资基金基金经理等职务。现任金融工程与量化投资部副总监，长盛量化红利策略股票型证券投资基金基金经理。

上述人员之间均不存在近亲属关系。

三、基金托管人

（一）基金托管人情况

1、基本情况

名称：中国农业银行股份有限公司（简称中国农业银行）

住所：北京市东城区建国门内大街69号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座

法定代表人：蒋超良

成立日期：2009年1月15日

注册资本：32,479,411.7万元人民币

存续期间：持续经营

联系电话：010-63201510

传真：010-63201816

联系人：李芳菲

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分，总行设在北京。经国务院批准，中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于2009年1月15日依法成立。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行网点遍布中国城乡，成为国内网点最多、业务辐射范围最广，服务领域最广，服务对象最多，业务功能齐全的大型国有商业银行之一。在海外，中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉，每年位居《财富》世界500强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行，中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经

营理念，坚持审慎稳健经营、可持续发展，立足县域和城市两大市场，实施差异化竞争策略，着力打造“伴你成长”服务品牌，依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品，致力为广大客户提供优质的金融服务，与广大客户共创价值、共同成长。

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行，经验丰富，服务优质，业绩突出，2004年被英国《全球托管人》评为中国“最佳托管银行”。2007年中国农业银行通过了美国 SAS70 内部控制审计，并获得无保留意见的 SAS70 审计报告，表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强能力建设，品牌声誉进一步提升，在 2010 年首届“‘金牌理财’TOP10 颁奖盛典”中成绩突出，获“最佳托管银行”奖。2010 年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的“最佳资产托管奖”。

中国农业银行证券投资基金托管部于 1998 年 5 月经中国证监会和中国人民银行批准成立，2004 年 9 月更名为托管业务部，内设养老金管理中心、技术保障处、营运中心、委托资产托管处、保险资产托管处、证券投资基金托管处、境外资产托管处、综合管理处、风险管理处，拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

2、主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工 146 名，其中高级会计师、高级经济师、高级工程师、律师等专家 10 余名，服务团队成员专业水平高、业务素质好、剪务能力强，高级管理层均有 20 年以上金融从业经验和高级技术职称，精通国内外证券市场的运作。

3、基金托管业务经营情况

截止2012年4月25日，中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共120只，包括长盛中信全债指数增强型债券投资基金、富国天源平衡混合型证券投资基金、华夏平稳增长混合型证券投资基金、大成积极成长股票型证券投资基金、大成景阳领先股票型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金、长盛同德主题增长股票型证券投资基金、裕阳证券投资基金、汉盛证券投资基金、裕隆证券投资基金、景福证券投资基金、鸿阳证券投资基金、丰和

价值证券投资基金、久嘉证券投资基金、长盛成长价值证券投资基金、宝盈鸿利收益证券投资基金、大成价值增长证券投资基金、大成债券投资基金、银河稳健证券投资基金、银河收益证券投资基金、长信利息收益开放式证券投资基金、长盛动态精选证券投资基金、景顺长城内需增长开放式证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、长信银利精选开放式证券投资基金、富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金、鹏华货币市场证券投资基金、中海分红增利混合型证券投资基金、国泰货币市场证券投资基金、新华优选分红混合型证券投资基金、交银施罗德精选股票证券投资基金、泰达宏利货币市场基金、交银施罗德货币市场证券投资基金、景顺长城资源垄断股票型证券投资基金、大成沪深300指数证券投资基金、信诚四季红混合型证券投资基金、富国天时货币市场基金、富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金、益民货币市场基金、长城安心回报混合型证券投资基金、中邮核心优选股票型证券投资基金、景顺长城内需增长贰号股票型证券投资基金、交银施罗德成长股票证券投资基金、长盛中证100指数证券投资基金、泰达宏利首选企业股票型证券投资基金、东吴价值成长双动力股票型证券投资基金、鹏华动力增长混合型证券投资基金、宝盈策略增长股票型证券投资基金、国泰金牛创新成长股票型证券投资基金、益民创新优势混合型证券投资基金、中邮核心成长股票型证券投资基金、华夏复兴股票型证券投资基金、富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金、长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金、富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金、申万巴黎竞争优势股票型证券投资基金、新华优选成长股票型证券投资基金、金元比联成长动力灵活配置混合型证券投资基金、天治稳健双盈债券型证券投资基金、中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、长信利丰债券型证券投资基金、金元比联丰利债券型证券投资基金、交银施罗德先锋股票证券投资基金、东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、银华内需精选股票型证券投资基金(LOF)、大成行业轮动股票型证券投资基金、交银施罗德上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金联接基金、上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金、富兰克林国海沪深300指数增强型证券投资基金、南方中证500指数证券投资基金(LOF)、景顺长城能源基建股票型证券投资基金、中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信中小

盘成长股票型证券投资基金、东吴货币市场证券投资基金、博时创业成长股票型证券投资基金、招商信用添利债券型证券投资基金、易方达消费行业股票型证券投资基金、富国汇利分级债券型证券投资基金、大成景丰分级债券型证券投资基金、兴业沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)、工银瑞信深证红利交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信深证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金、富国可转换债券证券投资基金、大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金、泰达宏利领先中小盘股票型证券投资基金、交银施罗德信用添利债券证券投资基金、东吴中证新兴产业指数证券投资基金、工银瑞信四季收益债券型证券投资基金、招商安瑞进取债券型证券投资基金、汇添富社会责任股票型证券投资基金、工银瑞信消费服务行业股票型证券投资基金、易方达黄金主题证券投资基金(LOF)、中邮中小盘灵活配置混合型证券投资基金、浙商聚潮产业成长股票型证券投资基金、嘉实领先成长股票型证券投资基金、广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金、广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金联接基金、南方保本混合型证券投资基金、交银施罗德先进制造股票证券投资基金、上投摩根新兴动力股票型证券投资基金、富兰克林国海策略回报灵活配置混合型证券投资基金、金元比联保本混合型证券投资基金、招商安达保本混合型证券投资基金、交银施罗德深证300价值交易型开放式指数证券投资基金、南方中国中小盘股票指数证券投资基金(LOF)、交银施罗德深证300价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金、富国中证500指数增强型证券投资基金(LOF)、长信内需成长股票型证券投资基金、大成中证内地消费主题指数证券投资基金、中海消费主题精选股票型证券投资基金、长盛同瑞中证200指数分级证券投资基金、景顺长城核心竞争力股票型证券投资基金、汇添富信用债债券型证券投资基金、光大保德信行业轮动股票型证券投资基金、富兰克林国海亚洲(除日本)机会股票型证券投资基金、汇添富逆向投资股票型证券投资基金、大成新锐产业股票型证券投资基金。

四、相关服务机构

(一) 基金份额发售机构

1、直销机构

长盛基金管理有限公司直销中心

地址：北京市海淀区北太平庄路 18 号城建大厦 A 座 20 层

邮政编码：100088

电话：(010) 82019799、82019795

传真：(010) 82255981、82255982

联系人：张莹、张晓丽

2、代销机构

(1) 中国农业银行股份有限公司

住所：北京市东城区建国门内大街69号

办公地址：北京市东城区建国门内大街69号

法定代表人：蒋超良

客户服务电话：95599

公司网址：www.abchina.com

(2) 中信银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

法定代表人：田国立

联系人：赵树林

电话：010-65556960

传真：010-65550981

客户服务电话：95558

公司网址：<http://bank.ecitic.com>

(3) 交通银行股份有限公司

注册地址：上海市仙霞路18号

办公地址：上海市银城中路188号

法定代表人：胡怀邦

联系人：林芳

电话：021-58781234

传真：021-58408842

客户服务电话：95559

公司网址：www.bankcomm.com

(4) 深圳发展银行股份有限公司

办公地址：深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦

法定代表人：肖遂宁

联系人：张青

联系电话：0755-82088888

传真电话：0755-82080714

客服电话：95501

公司网站：www.sdb.com.cn

(5) 招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

办公地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

法定代表人：傅育宁

联系人：邓炯鹏

电话：0755 - 83077278

传真：0755 - 83195050

客户服务电话：95555

公司网址：www.cmbchina.com

(6) 中国银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：肖钢

联系人：吴雪妮

电话：010 - 66594851

传真：010 - 66594946

客户服务电话：95566

公司网址：www.boc.cn

(7) 中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街25号

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

法定代表人：王洪章

联系人：何奕

电话：010-67596093

传真：010-66275654

客户服务电话：95533

公司网址：www.ccb.com

(8) 广发银行股份有限公司

注册地址：广州市越秀区东风东路713号

办公地址：广州市越秀区东风东路713号

法定代表人：董建岳

联系人：李静筠

电话：020-38321739

传真：020-87311780

客户服务电话：400-830-8003

公司网址：www.cgbchina.com.cn

(9) 中国民生银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街2号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街2号

法定代表人：董文标

联系人：董云巍

电话：010-57092851

传真：010-57092611

客户服务电话：95568

公司网址：www.cmbc.com.cn

(10) 上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市中山东一路12号

办公地址：上海市中山东一路12号

法定代表人：吉晓辉

联系人：虞谷云

电话：021—61616206

传真：021—63604199

客户服务电话：95528

公司网站：www.spdb.com.cn

(11) 中国工商银行股份有限公司

注册地址：中国北京复兴门内大街 55 号

办公地址：中国北京复兴门内大街 55 号

法定代表人：姜建清

联系人：王隼

电话：010-66107900

传真：010-66107914

客户服务电话：95588

公司网址：www.icbc.com.cn

(12) 华夏银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

法定代表人：吴建

联系人：李慧

电话：010-85238000

传真：010-85238680

客户服务电话：95577

公司网址：www.hxb.com.cn

(13) 国元证券股份有限公司

住所：合肥市寿春路 179 号

办公地址：合肥寿春路 179 号

法定代表人：凤良志

联系人：祝丽萍

开放式基金咨询电话：安徽地区：96888；全国：400-8888-777

开放式基金业务传真：(0551) 2272100

公司网址:www.gyzq.com.cn

(14) 中信证券(浙江)有限责任公司

住所:浙江省杭州市中河南路11号万凯庭院商务楼A座

办公地址:浙江省杭州市中河南路11号万凯庭院商务楼A座

法定代表人:刘军

联系人:王勤

联系电话:0571-85783750

客户咨询电话:0571-96598

公司网址:www.bigsun.com.cn

(15) 中信证券股份有限公司

注册地址:北京市朝阳区新源南路6号京城大厦

法定代表人:王东明

联系人:张于爱

电话:010-84864818

传真:010-84865560

公司网址:www.ecitic.com

(16) 中信建投证券股份有限公司

住所:北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址:北京市朝阳区门内大街188号

法定代表人:王常青

联系人:权唐

开放式基金咨询电话:400-8888-108

开放式基金业务传真:(010)65182261

客服电话:400-8888-108

公司网址:www.csc.com.cn

(17) 国泰君安证券股份有限公司

住所:上海市浦东新区商城路618号

办公地址:上海市延平路135号

法定代表人:万建华

联系人：芮敏祺

电话：(021) 62580818-213

传真：(021) 62569400

客服电话：95521

公司网址：www.gtja.com

(18) 广发证券股份有限公司

注册地址：广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼

办公地址：广州天河北路大都会广场5、18、19、36、38、41和42楼

法定代表人：林治海

联系人：黄岚

统一客户服务热线：95575 或致电各地营业网点

公司网站：www.gf.com.cn

(19) 招商证券股份有限公司

住所：深圳市福田区益田路江苏大厦A座40—45层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座40—45层

法定代表人：宫少林

联系人：林生迎

电话：0755-82943666

传真：0755-82943237

客户服务热线：95565、4008881111、(0755) 26951111

公司网址：www.newone.com.cn

(20) 兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路268号

办公地址：浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼21层

法定代表人：兰荣

联系人：谢高得

电话：021-38565785

传真：021-38565955

客服服务热线：95562

公司网址：www.xyzq.com.cn

(21) 海通证券股份有限公司

住所：上海市广东路 689 号海通证券大厦

办公地址：上海市广东路 689 号海通证券大厦

法定代表人：王开国

联系人：李笑鸣

联系电话：021-53594566-4125

传真：021-53858549

客服电话：400-8888-001、(021) 962503

公司网址：www.htsec.com

(22) 申银万国证券股份有限公司

住所：上海市常熟路 171 号

办公地址：上海市常熟路 171 号

法定代表人：丁国荣

联系人：李清怡

电话：021-54033888

传真：021-54035333

客户服务电话：95523 或 4008895523

公司网址：www.sywg.com

(23) 长江证券股份有限公司

注册地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：胡运钊

联系人：李良

联系电话：027-65799999

传真：027-85481900

客服电话：95579 或 4008-888-999

公司网址：www.95579.com

(24) 中国银河证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

办公地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：顾伟国

联系人：田薇

电话：(010) 66568430

传真：(010) 66568536

客服电话：400-888-8888

公司网站：www.chinastock.com.cn

(25) 中信万通证券有限责任公司

住所：青岛市崂山区苗岭路 29 号澳柯玛大厦 15 层 (1507-1510 室)

办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层

法定代表人：张智河

联系人：吴忠超

电话：0532-85022326

传真：0532-85022605

客户咨询电话：0532-96577

公司网址：www.zxwt.com.cn

(26) 东北证券股份有限公司

住所：长春市自由大路 1138 号

办公地址：长春市自由大路 1138 号

法定代表人：矫正中

联系人：李敬国

联系电话：0431-85096531

客服电话：4006000686，0431-85096733

公司网址：www.nesc.cn

(27) 光大证券股份有限公司

住所：上海市静安区新闻路1508号

办公地址：上海市静安区新闻路1508号

法定代表人：徐浩明

联系人：刘晨、李芳芳

联系电话：021-22169999

客户服务热线：4008888788、10108998

公司网址：www.ebscn.com

(28) 华福证券有限责任公司

住所：福州市五四路157号新天地大厦7、8层

办公地址：福州市五四路157号新天地大厦7至10层

法定代表人：黄金琳

联系人：张腾

电话：(0591) 87383623

传真：(0591) 87383610

统一客户服务电话：96326

公司网址：www.hfzq.com.cn

(29) 德邦证券有限责任公司

住所：上海市普陀区曹杨路510号南半幢9楼

办公地址：上海市福山路500号城建大厦26楼

法定代表人：方加春

联系人：罗芳

电话：021-68761616

传真：021-68767981

客户服务电话：400-888-8128

公司网址：www.tebon.com.cn

(30) 恒泰证券有限责任公司

住所：内蒙古自治区呼和浩特市新城区东风路111号

办公地址：上海浦东松林路357号通贸大厦20楼

法定代表人：刘汝军

联系人：张同亮

电话：021-68405273

传真：021-68405181

网址：www.cnht.com.cn

客户服务电话：0471-4961259

(31) 国都证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区华强北路赛格广场 45 层

法定代表人：常喆

联系人：黄静

电话：800-810-8809

传真：010-64482090

公司网址：www.guodu.com

(32) 渤海证券有限责任公司

住所：天津市经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

法定代表人：杜庆平

联系人：王兆权

电话：022-28451861

传真：022-28451892

网址：www.bhzq.com

客户服务电话：400-651-5988

(33) 国联证券股份有限公司

住所：江苏省无锡市县前东街 168 号国联大厦 6 层

办公地址：江苏省无锡市太湖新城金融一街 8 号国联金融大厦 702

法定代表人：雷建辉

联系人：沈刚

开放式基金咨询电话：(0510) 82831662

开放式基金业务传真：(0510) 82830162

客户服务热线：4008885288 或 95570

公司网址：www.glsc.com.cn

(34) 华泰证券股份有限公司

地址：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

法定代表人：吴万善

联系人：程高峰

电话:025-84457777-893

传真:025-84579763

客户咨询电话：95597

公司网址：www.htsc.com.cn

（35）齐鲁证券有限公司

注册地址：济南市经七路 86 号

办公地址：济南市经七路 86 号 23 层

法定代表人：李玮

联系人：吴阳

电话：0531 - 68889155

传真：0531 - 68889752

客户服务热线：95538

公司网址：www.qlzq.com.cn

（36）安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

办公地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

深圳市福田区深南大道 2008 号中国凤凰大厦 1 栋 9 层

法定代表人：牛冠兴

联系人：陈剑虹

电话：0755-82825551

传真：0755-82558355

统一客服电话：4008001001

公司网站地址：www.essence.com.cn

（37）长城证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层

办公地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层

法定代表人：黄耀华

联系人：李春芳

电话：0755-83516089

传真：0755-83515567

客户服务热线：0755-33680000 400-6666-888

公司网站：www.cgws.com

(38) 第一创业证券股份有限公司

住所：深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25、26层

办公地址：深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25、26层

法定代表人：刘学民

联系人：崔国良

电话：(0755) 25832852

传真：(0755) 25831718

客户服务热线：4008881888

公司网址：www.firstcapital.com.cn

(39) 红塔证券股份有限公司

注册地址：昆明市北京路155号附1号红塔大厦9楼

办公地址：昆明市北京路155号附1号红塔大厦9楼

法定代表人：况雨林

联系人：王敏

电话：0871-3577011

客户服务热线：0871-3577930

网址：www.hongtastock.com

(40) 瑞银证券有限责任公司

注册地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层

法定代表人：刘弘

联系人：牟冲

电话：010-5832-8112

客户服务热线：400-887-8827

公司网址：www.ubssecurities.com

(41) 中国中投证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层

-21 层及第 04 层 01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23 单元

办公地址：深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 04、18 层至
21 层

法定代表人：龙增来

联系人：刘毅

电话：0755-82023442

传真：0755-82026539

客服电话 400 600 8008

网址：www.china-invs.cn

(42) 华宝证券有限责任公司

注册地址：上海市陆家嘴环路 166 号未来资产大厦 27 层

法定代理人：陈林

联系人：楼斯佳

联系电话：021-50122107

客户服务热线：400-820-9898

公司网址：www.cnhbstock.com

(43) 中航证券有限公司

注册地址：江西省南昌市抚河北路 291 号

办公地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼

法定代表人：杜航

联系人：戴蕾

电话：0791-86768681

客户服务热线：400-8866-567

公司网址：www.avicsec.com

(44) 平安证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼

办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼(518048)

法定代表人：杨宇翔

联系人：郑舒丽

电话：0755-22626391

开放式基金业务传真：0755-82400862

客服电话：95511—8

公司网址：www.pingan.com

(45) 信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

法定代表人：高冠江

联系人：唐静

电话：010-63081000

传真：010-63080978

客服电话：400-800-8899

公司网址：www.cindasc.com

(46) 民生证券有限责任公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16-20层

办公地址：北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16-20层

法定代表人：岳献春

客服热线：4006 19 8888

公司网址：www.msza.com

(47) 五矿证券有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心办公室47层01单元

办公地址：深圳市福田区金田路4028号经贸中心47-49楼

法定代表人：高竹

联系人：赖君伟

电话：0755-82545555

传真：0755-82545500

客服电话：40018-40028

公司网址：www.wkzq.com.cn

(二) 注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：金颖

电话：(010) 59378888

传真：(010) 66210938

联系人：朱立元

(三) 出具法律意见书的律师事务所

名称：北京市信利律师事务所

注册地址：中国北京建国门内大街 18 号恒基中心一座 609-611 室

办公地址：中国北京建国门内大街 18 号恒基中心一座 609-611 室

法定代表人：江山

电话：(010) 65186980

传真：(010) 65186981

经办律师：谢思敏、阎建国

(四) 审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所有限公司

住所注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

法定代表人：杨绍信

电话：(021) 23238888

传真：(021) 23238800

经办注册会计师：汪棣、张鸿

五、基金的名称

本基金名称：长盛中信全债指数增强型债券投资基金

六、基金的类型

基金类型：契约型开放式

七、基金的投资目标

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，追求基金资产的当期收益和超过比较基准的长期稳定增值。

八、基金的投资方向

本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行、上市或拟上市的各种债券、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%。

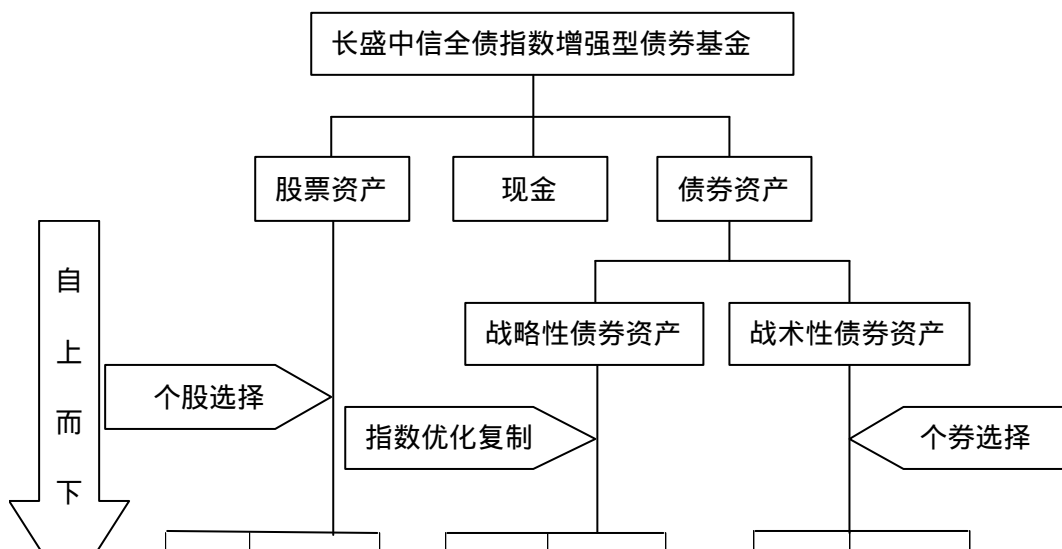
九、基金的投资策略与程序

（一）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。

1、在对宏观经济形势和证券市场走势进行科学分析的基础上，自上而下进行资产配置。

本基金将重点关注经济增长率、工业总产值增长率、产品产销率、外贸进出口额、物价指数等宏观经济指标，通过对宏观经济形势、财政政策及货币政策的深入分析，对未来经济走势、投资环境变化及利率走势做出科学、合理地判断，并在此基础上采用“自上而下”的资产配置策略，首先确定基金资产在债券、股票和现金资产之间的配置，再确定债券资产中战略性与战术性债券资产间的配置比例，最后按照不同方法具体构建债券、股票投资组合。



2、运用指数化的增强性投资策略，获得超过目标指数的收益水平。

在指数化投资的基础上，针对债券市场当前存在的结构性失衡，通过控制债券投资组合久期与指数久期有限度偏离，运用收益率差异策略、资产选择策略等积极资产组合管理策略，依据总收益分析实现对各类属资产的合理配置。

同时，遵循稳健投资原则，积极参与股票增发，并运用投资组合保险策略适当进行股票投资，提高组合的整体收益。

3、充分利用市场无风险套利机会，适当运用杠杆原理，有效提高投资组合的收益水平。

本基金还将充分利用以下无风险套利机会提高资产盈利水平：

（1）利用同一债券品种在不同债券市场上的价格差异，通过无风险套利操作获得由于市场分割带来的超额收益；

（2）利用同期限债券回购品种在不同市场上的利率差异，通过开展无风险套利操作，提高投资组合的盈利能力；

（3）利用同期限债券品种在一、二级市场上的收益率差异，通过投资品种的转换获得一、二级市场的差价收入；

（4）通过债券回购所获得的资金参与新股申购和新股配售，获得稳定的股票一级市场收益；

（5）随着未来利率期货、利率期权、利率互换等可以有效规避利率风险金融衍生产品的推出，在主管机关批准后积极开展套利操作。

此外，多层次的风险监控体系和组合动态调整机制将确保各种积极投资策略和无风险套利操作的有效实施和执行。

（二）基金投资决策与程序

1、研究过程

研究部门通过对宏观经济形势及证券市场走势的研究与分析,向投资决策委员会提交资产配置研究报告;

2、决策机制与决策过程

(1) 决策依据

国家有关法律、法规和本基金合同的有关规定是本基金进行投资的前提;宏观经济发展态势、微观经济运行环境和证券市场走势是本基金投资决策的基础;投资对象收益和风险的科学合理配比是本基金维护投资者利益的重要保障。

(2) 决策机制与程序

本基金实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。投资决策委员会根据研究部门提交的报告对基金的资产配置及指数化的增强性投资下达指导性意见,基金经理按照上述要求提交具体的投资方案,经投资决策委员会批准后,在授权范围内组织投资方案的实施,并对投资方案的实施绩效负责;

3、投资组合的构建

投资组合的构建是“自上而下”进行债券、股票、现金配置与“自下而上”进行个券、个股选择相结合的过程。

(1) 债券投资组合的构建。

在债券投资方面,本基金将债券资产配置分为战略性资产和战术性资产两部分。

战略性资产配置体现指数化投资原则,将以中信全债指数样本券为基础,通过保持投资组合久期与目标指数久期有限度的偏离(偏离度5%),实现对目标指数的优化复制。战略性债券资产配置的最低比例为基金净资产的64%。随着债券市场有效性的提高,战略性债券资产配置的比重可适度增加。

战术性资产配置体现指数化的增强性投资,其投资品种不受指数样本库的限制,组合久期管理不受目标指数的限制,但受整个组合久期的限制。战术性资产投资于因投资主体偏好、流动性需求差别及市场分割而凸显投资价值的流动性较好的债券,是一个“自下而上”进行个券选择的过程。战术性债券资产最多可通过回购放大1倍操作。

	久期偏离下限	久期偏离上限
战略性债券资产	目标指数久期的 95%	目标指数久期的 105%
战术性债券资产		

债券资产组合	目标指数久期的 80%	目标指数久期的 130%
--------	-------------	--------------

本基金对战略性债券资产和战术性债券资产实行“分户经营，统一管理”。

(2) 股票投资组合的构建

本基金的股票投资作为债券投资的有益补充，可以提高投资组合收益并适当分散风险。本基金主要参与新股认购和股票增发，并将适当投资于行业地位领先、业绩优良、有持续分红记录的大盘价值股。其中：通过新股认购所获的不符合个股选择标准的股票，本基金将在该股票上市后 1 个月内卖出；本基金投资的大盘价值股全部来自于公司建立的股票池。

股票投资组合的构建过程是自下而上进行个股选择的过程。

4、交易过程

基金经理通过投资管理系统向交易部下达投资指令。交易部负责交易执行和一线监控。

5、投资组合调整过程

基金经理密切关注宏观经济及市场形势，结合基金申购赎回情况和指数组合调整情况等，对投资组合进行动态监控和调整。

6、业绩与风险评估过程

基金经理小组和公司专职投资评估员按照投资决策委员会指导性方针和投资实施方案对投资业绩进行评估。

(三) 证券选择标准

1、个券选择标准

本基金在进行指数化的增强性投资时，其个券选择主要标准如下：

- (1) 类似信用等级和期限的债券中选择到期收益率较高的债券；
- (2) 类似信用等级、久期及到期收益率水平的债券中选择凸性较大的债券；
- (3) 流动性较高的债券；
- (4) 可获得较好当期收益的债券；
- (5) 其他价值被低估、有增值潜力的债券。

2、个股选择标准

- (1) 公司发展战略清晰，管理科学稳健，处于行业领先地位；
- (2) 业绩优良，有持续分红记录；
- (3) 流通市值大于市场平均水平且市净率较低的股票；

(4) 其他价值被低估的股票。

(四) 投资限制

基金管理人应依据有关法律法规及《基金合同》规定，运作管理本基金。

本基金投资组合的构建应遵循以下限制：

- 1、本基金投资于债券、股票的比例，不低于本基金资产总值的80%；
- 2、本基金投资于目标指数的比例不低于本基金资产净值的64%，其中投资于国债的比例不低于本基金资产净值的20%；
- 3、本基金持有一家上市公司的股票，不超过基金资产净值的10%。
- 4、本基金与由本基金管理人管理的其它基金持有一家公司发行的证券总和，不超过该证券的10%，并按有关规定履行信息披露义务；
- 5、本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为1年，债券回购到期后不得展期，且债券回购融入的资金余额不得超过基金净资产的40%；
- 6、本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%；
- 7、本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的3%；
- 8、本基金与本基金管理人管理的其他基金持有的同一权证不得超过该权证的10%；
- 9、本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的10%；
- 10、本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过该基金资产净值的10%；
- 11、本基金与本基金管理人管理的其他基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%；
- 12、本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过该基金资产净值的20%；
- 13、中国证监会规定的其它比例限制。

(五) 禁止行为

禁止用本基金资产从事以下行为：

- 1、投资于其它证券投资基金；

- 2、以基金的名义使用不属于基金名下的资金买卖证券；
- 3、动用银行信贷资金从事基金投资；
- 4、将基金资产用于担保、资金拆借或者贷款；
- 5、从事证券信用交易；
- 6、以基金资产进行房地产投资；
- 7、从事可能使基金资产承担无限责任的投资；
- 8、将基金资产投资于与基金托管人或者基金管理人有利害关系的公司发行的证券；
- 9、《基金法》及相关法律法规禁止从事的其它行为。

十、基金的业绩比较标准

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设定为：

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%。

目前投资人可以通过登录中信标普指数服务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。如果中信标普指数体系信息发布渠道增加，本基金管理人将另行公告。

十一、基金的风险收益特征

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。

十二、基金的投资组合报告

本基金管理人的董事会及董事保证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。

本基金的托管人——中国农业银行根据本基金合同规定复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本投资组合报告所载数据截至 2012 年 3 月 31 日,本报告财务资料未经会计师事务所审计。

1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	26,351,161.82	5.52
	其中:股票	26,351,161.82	5.52
2	固定收益投资	388,666,134.90	81.36
	其中:债券	378,666,134.90	79.26
	资产支持证券	10,000,000.00	2.09
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	9,000,000.00	1.88
	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	47,011,819.27	9.84
6	其他资产	6,710,918.10	1.40
7	合计	477,740,034.09	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	2,854,864.00	0.78
C	制造业	6,972,604.50	1.92
C0	食品、饮料	3,798,587.00	1.04
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	-	-
C5	电子	139,020.00	0.04
C6	金属、非金属	1,536,515.80	0.42
C7	机械、设备、仪表	1,111,500.00	0.31
C8	医药、生物制品	386,981.70	0.11
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,068,199.72	0.29
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	4,516,200.00	1.24

I	金融、保险业	9,118,216.60	2.51
J	房地产业	1,821,077.00	0.50
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	26,351,161.82	7.24

3、报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601628	中国人寿	339,316	5,547,816.60	1.53
2	600036	招商银行	276,000	3,284,400.00	0.90
3	600153	建发股份	310,000	2,269,200.00	0.62
4	600859	王府井	75,000	2,247,000.00	0.62
5	600298	安琪酵母	70,000	1,864,800.00	0.51
6	600048	保利地产	161,300	1,821,077.00	0.50
7	601088	中国神华	65,000	1,664,650.00	0.46
8	601699	潞安环能	48,600	1,190,214.00	0.33
9	601669	中国水电	258,644	1,068,199.72	0.29
10	000799	酒鬼酒	34,100	957,187.00	0.26

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	5,000,500.00	1.37
2	央行票据	-	-
3	金融债券	80,378,000.00	22.10
	其中:政策性金融债	80,378,000.00	22.10
4	企业债券	147,079,415.30	40.43
5	企业短期融资券	20,273,000.00	5.57
6	中期票据	-	-
7	可转债	125,935,219.60	34.62
8	其他	-	-
9	合计	378,666,134.90	104.09

5、报告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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110015	石化转债	816,540	82,535,863.20	22.69
2	110315	11 进出 15	200,000	20,544,000.00	5.65

3	113001	中行转债	213,220	20,196,198.40	5.55
4	113002	工行转债	185,400	20,073,258.00	5.52
5	080207	08 国开 07	200,000	20,070,000.00	5.52

6、报告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

序号	证券代码	证券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	119017	宁公控 1	100,000	10,000,000.00	2.75

注：本基金本报告期末仅持有上述一支资产支持证券。

7、报告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资产。

8、投资组合报告附注

(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。

本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。

(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。

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。

(3) 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	800,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,906,739.43
5	应收申购款	4,178.67
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,710,918.10

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110015	石化转债	82,535,863.20	22.69
2	113001	中行转债	20,196,198.40	5.55

3	113002	工行转债	20,073,258.00	5.52
4	110018	国电转债	3,129,900.00	0.86

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

(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。

十三、基金的业绩

本基金成立以来的业绩如下：

阶段	基金份额净值 增长率	同期业绩比较 基准收益率	超额收益率
2003年10月25日(基金合同生效日)至2003年12月31日	4.12%	1.40%	2.72%
2004年度	0.18%	-3.04%	3.22%
2005年度	10.59%	10.30%	0.29%
2006年度	32.71%	7.99%	24.72%
2007年度	42.43%	7.76%	34.67%
2008年度	-2.08%	1.39%	-3.47%
2009年度	7.79%	6.63%	1.16%
2010年度	4.63%	1.77%	2.86%
2011年度	-6.28%	0.91%	-7.22%
2012年1月1日至2012年3月31日	-0.24%	1.22%	-1.46%
2003年10月25日(基金合同生效日)至2012年3月31日	125.12%	41.83%	83.29%

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩不代表未来表现。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。

十四、基金费用与税收

(一) 与基金运营有关的费用

1、费用种类

- (1) 基金管理人的管理费；
- (2) 基金托管人的托管费；
- (3) 证券交易费用；

- (4) 基金信息披露费用；
- (5) 基金份额持有人大会费用；
- (6) 与基金相关的会计师费和律师费；
- (7) 按照国家有关规定可以列入的其它费用。

2、费用计提方法、计提标准和支付方式

(1) 基金管理人的管理费

基金管理费按前一日基金资产净值的0.75%年费率计算。计算方法如下：

$$H = E \times 0.75\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

(2) 基金托管人的托管费

基金托管费按前一日的基金资产净值的0.20%的年费率计算。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

(3) 上述(一)项1中(3)至(7)项费用由基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付，列入当期基金费用。基金成立前所发生的律师费和会计师费等费用自基金发行费用中列支，不另从基金资产中支付，与基金有关的法定信息披露费按有关法规列支。

(二) 基金的申购费、赎回费与转换费

1、投资者可选择在申购本基金或赎回本基金时交纳申购费用。投资者选择在申购时交纳的称为前端申购费用，投资者选择在赎回时交纳的称为后端申购费用。申购费用由申购人承担，不列入基金资产。

2、投资者选择交纳前端申购费用时，申购费率按照单笔申购金额递减，最

高为不超过申购金额的1.5%，具体费率如下：

申购金额	申购费率
100 万以内	1.0%
满 100 万不满 500 万	0.8%
满 500 万不满 1000 万	0.6%
满 1000 万以上	按笔收取，1000 元/笔

3、投资者选择交纳后端申购费用时，申购费率按持有期递减，具体费率如下：

持有期	后端申购费率
一年以内	1.2%
满一年不满二年	1.0%
满二年不满三年	0.5%
满三年以后	0

4、本基金赎回费率按持有期递减，最高不超过赎回金额的0.3%，赎回费率表如下：

持有期	赎回费率
一年以内	0.3%
满一年不满两年	0.2%
满两年不满三年	0.1%
满三年后	0%

本基金的赎回费用由赎回人承担，赎回费的25%归入基金财产，余额为注册登记费和其他手续费。

5、基金管理人对部分基金投资人费用的减免不构成对其他投资人的同等义务。

6、基金管理人可以调整申购费率、赎回费率或收费方式，最新的申购费率、赎回费率和收费方式在更新的招募说明书中列示。如调整费率或收费方式，基金管理人最迟将于新的费率或收费方式开始实施前3个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

7、基金管理人可以根据相关法律法规以及本基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的、且由同一注册登记机构办理注册登记的其他基金之间的转换业务，基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及本基金合同的规定制定并公告，并及时告知基金托管人与相关机

构。

（三）税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

十五、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《基金法》、《运作办法》、《销售方法》、《信息披露办法》及其他有关法律法规的要求，对本基金的基金招募说明书进行了更新，主要更新的内容如下：

（一）在“重要提示”中，明确了更新的招募说明书内容的截止日期及有关财务数据的截止日期。

（二）在“三、基金管理人”中，更新了基金管理人的相关基本情况。

（三）在“四、基金托管人”中，更新了基金托管人的相关基本情况。

（四）在“五、相关服务机构”中，更新了代销机构的有关信息。

（五）在“九、基金的投资”中，更新了“（十二）基金投资组合报告”的相关内容。

（六）在“十、基金的业绩”中，更新了基金业绩的相关内容。

（七）在“十四、基金的费用与税收”中，更新了相关内容。

（八）在“二十、基金托管协议的内容摘要”中，更新了相关内容。

（九）在“二十一、对基金份额持有人的服务”中，更新了相关内容。

（十）在“二十二、其他应披露事项”中，更新了本次招募说明书更新期间所涉及的相关信息披露。

十六、签署日期

本招募说明书（更新）于2012年5月8日签署。

长盛基金管理有限公司

二〇一二年五月十六日