长盛中信全债指数增强型债券投资基金 2008年年度报告摘要

重要提示

一、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2009年3月27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2008年1月1日起至12月31日止。

第一章 基金简介

一、基金基本情况

基金简称	长盛全债指数增强基金
交易代码	510080（前端收费模式） 511080（后端收费模式）
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
报告期末基金份额总额	1,103,037,594.27份

二、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	中信全债指数收益率×92%＋中信综合指数收益率×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。

三、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	010-68424199
	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	010-68424181

四、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	http://www.csfunds.com.cn
基金年度报告置备地点	基金管理人和基金托管人的办公地址

第二章 主要财务指标、基金净值表现和利润分配情况

一、主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

期间数据和指标	2008年	2007年	2006年
本期已实现收益	-3,713,088.44	159,890,333.50	27,460,434.26
本期利润	-58,469,116.92	249,435,243.63	37,931,502.90
加权平均基金份额本期利润	-0.0434	0.3823	0.3177
本期基金份额净值增长率	-2.08%	42.43%	32.71%
期末数据和指标	2008年	2007年	2006年
期末可供分配基金份额利润	-0.0112	0.0686	0.0822
期末基金资产净值	1,311,587,692.30	1,402,944,334.22	143,517,499.04
期末基金份额净值	1.1891	1.3001	1.1370

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。表中的“期末”均指本报告期最后一日，即12月31日。

二、基金净值表现

（一）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	4.62%	0.33%	2.96%	0.27%	1.66%	0.06%
过去六个月	4.93%	0.31%	3.97%	0.25%	0.96%	0.06%
过去一年	-2.08%	0.39%	1.39%	0.26%	-3.47%	0.13%
过去三年	85.10%	0.42%	17.99%	0.20%	67.11%	0.22%
过去五年	105.07%	0.37%	28.19%	0.19%	78.88%	0.18%
自基金合同生效起至今	113.50%	0.37%	27.92%	0.18%	85.58%	0.19%

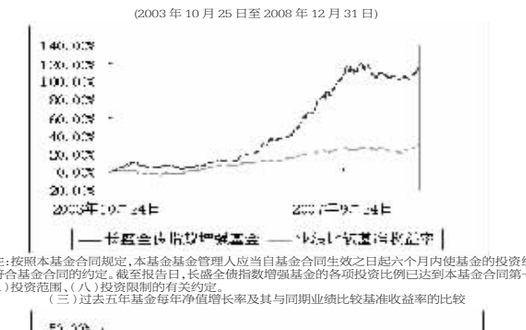
注：本基金业绩比较基准＝中信全债指数收益率×92%＋中信综合指数收益率×8%。

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：中信全债指数收益率×92%＋中信综合指数收益率×8%。目前投资人可以通过登录中信证券研究网获取中信全债指数和中信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。

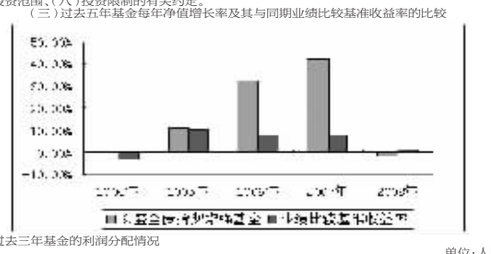
（二）自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

(2003年10月25日至2008年12月31日)



注：按照本基金合同规定，本基金基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。截至报告日，长盛全债指数增强基金的各项投资比例已达到本基金合同第十四条（二）投资范围、（八）投资限制的有关约定。

（三）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



三、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
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
2007年	1.600	79,421,809.75	61,847,021.80	141,268,831.55	除息日：2007年9月24日
	1.100	16,517,290.98	4,847,283.13	21,364,574.11	除息日：2007年2月6日
2006年	1.600	18,150,555.63	2,107,813.99	20,258,369.62	除息日：2006年11月7日
	0.600	7,226,851.38	513,876.14	7,740,727.52	除息日：2006年1月20日
合计	5.700	187,302,729.85	122,588,420.85	309,891,150.70	

第三章 管理人报告

第一节 基金管理人及基金经理情况

一、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2008年12月31日，基金管理人共管理两支封闭式基金、十支开放式基金，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。

二、基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
刘静	本基金的基金经理，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	—	8年	女，1977年1月出生，中国国籍，毕业于中央财经大学投资管理系，获经济学学士。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。
王茜	本基金的基金经理，长盛货币市场基金基金经理。	2003年10月25日	2008年11月6日	6年	女，1976年3月出生。武汉大学工商管理硕士，1996年7月至2002年6月，历任武汉市商业银行信贷管理部交易员、副经理、总经理助理。2002年7月至2002年8月，任职于中信证券固定收益部，2002年9月加入长盛基金管理有限公司，负责债券组合管理，曾担任全国社保基金债券委托组合经理助理，自2003年10月25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2006年12月12日起兼任长盛货币市场基金基金经理。目前已离职。

注：1、任职日期、离任日期均指公司作出决定之日。

2、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。

第二节 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。

第三节 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

一、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。

二、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。

三、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。

第四节 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

一、报告期内行情回顾和本基金投资策略分析

2008年债券市场经历了一场“如火如荼”的牛市，政策面和资金面推动各债券指数不断创出新高，全年国债总指数上涨12.58%，金融债总指数上涨8.60%，企业债指数上涨12.96%。

回顾2008年的宏观经济环境也是风云变幻，2008年我国经济由热转冷。上半年经济偏热，在奥运效应和国际油价高企的支撑下，高增长和高通胀并行，人民币不断升值；下半年，国际经济环境发生变化，金融危机影响席卷全球，我国的经济增长速度也迅速减缓。受此影响，财政政策从“稳健”转为“积极”，货币政策从“从紧”转为“适度宽松”。为控院经济下滑的不利影响，从9月16日开始，央行连续五次降息，其中最大的一次降息幅度达到108bp。在这样的宏观环境下，债券市场也走出了阶段性行情，大致可分为三段：（一）1季度延续2007年末资金推动型上涨行情；（二）2季度高通胀预期延续至8月中旬的谨慎调整行情；（三）8月下旬后，通胀回落，经济减速，宽松政策启动的大幅上冲行情。而从结构上看，收益率曲线大幅下行同时在期限和券种上有所分化：（一）国债收益率曲线以货币政策转向为节点，由平坦化转为陡峭化。（二）金融债隐含税率不断降低，牛市后期国债、央票替代效应突现，资金追捧过度。（三）信用利差保持平稳的同时年末突然扩大。

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，紧跟市场久期，并且在适当时期果断的对组合久期进行有效的调整，面对市场出现波动并由此带来投资机会的时候，本组合基本都及时把握机会，果断的参与其中，并且获得了较好的投资收益；在08年债市出现趋势性上涨的牛市行情过程中，本组合果断的调整投资策略，在法规允许的范围内，及时将组合久期放到规定跟踪基准的上限，并且最大限度的利用杠杆效应为组合争取收益的最大化；另一方面在报告期间，本组合通过对一二级市场的深入研究，以及对债券市场各投资主体结构及其投资心态的深入了解，适时适度的抓住了一级市场的投资机会，获取了较好的无风险投资收益。就权益类资产部分而言，在2008年本基金坚持风险控制的原则，对该部分资产进行动态调整，策略上仍是坚持自下而上的原则进行配置。但由于我们在上半年对整个宏观经济认识不够清晰，在企业经营状况开始恶化、整体宏观经济形势开始转变时，没有及时果断的大幅减少权益类资产的仓位，致使组合未能更好的规避市场持续大幅下跌的风险，给基金净值带来较大的负面影响。通过对前期组合投资进行充分深刻的检讨后，我们在后期将权益类资产调整到了合理的低仓位比例，为后续的能出现的市场变化作好可攻可守的战略准备。

二、本基金业绩表现

截止报告期末，本基金份额净值为1.1891元，本报告期份额净值增长率为-2.08%，同期业绩比较基准增长率为1.39%。

第五节 对宏观经济、证券市场及行业走势等的简要展望

2008年后半段开始陆续出台的积极财政政策和货币政策在2009年年初已经初见成效；去年12月份信贷开始恢复，2009年1月人民币贷款增长21.33%，当月人民币贷款增加1.62万亿元，同比多增8141亿元。资金面的宽松为中国经济率先走出困境提供了支持，也为投资者注入了信心。看债券市场，宽松的货币环境为债市继续保持强势提供了支持，但是由于流动性的大量释放，又使大家提前对年末可能出现的通涨表示担心，而同时由于财政需要及拉动固定资产投资，今年国债和企业债的发行规模合计应该会大幅增长，增量或超过1万亿规模，债券供给新增规模给债市的“牛气”带来了压力。所以，总体我们判断，2009年的债券市场可能是平衡中潜伏着危机，一旦以美国为中心的大经济体出现恢复，中国在积极政策作用下可能会有更高速的增长，目前看，2009年出现这种拐点的机率在加大。总体来看，债券市场在这种经济拐点时期通常将保持平稳走势，期间由于货币政策的出台可能出现阶段性调整，如果下半年通胀确实开始复苏，市场将面临较大压力。

基于上述判断，在未来一年中，本基金将坚持一贯的稳健投资风格，在风险收益合理配比的原则下，保持对中信全债指数债券部分的战略性配置及对权益类资产的适度配置。一方面，在债券资产配置上，要积极关注宏观经济形势的变化及政策的变化，动态调整组合久期，在必要时期适时适度的偏离市场久期，以期获取超额收益；但同时在债券市场面临不确定因素较多，由此导致资金对债市的影响程度较为显著的前提下，本组合管理人将要更积极的关注货币及信贷政策的变化，以期能提前对债市未来走势作出判断，并及时对组合进行合理调整，规避日益积累的市场风险爆发；另一方面，今年地方政府债券的出台、以及企业债发行规模的扩大，都将给今年的债券市场增添新的血液，同时也给投资带来新的风险和机会，对此我们会加强对该类产品的研究，力争寻找出这片新领域里的估值洼地。在权益类资产的配置上，要坚守作为固定收益类投资品种的原则，把风险控制放在首位，重点采取动态调整权益类资产的配置策略。今年股票市场更多的可能是在宏观经济的主旋下出现阶段性行情和局部热点行情，因此在这种情况下，我们会重点在组合结构性调整和仓位控制两方面下功夫，力争寻找两者的最佳平衡点；具体表现为在权益类组合的构建上主要以精选个股为主，积极关注优质股票的投资机会；最后，在股票市场投资机会有所显现的前提下，可转债市场将迎来阶段性的投资机会；本组合将在未来的投资过程中积极关注可转债市场，进一步深化对可转债市场的研究，包括对存量和转债一级市场的研究，寻找良好的投资机会，力争在确保基金资产稳定增值的同时，为组合带来更多的超额收益。

第六节 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则》、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》、中国证券监督管理委员会颁布的《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉有关衔接事宜的通知》（证监会计字[2007]15号）、《关于证券投资基金执行＜企业会计准则＞估值业务及份额净值计价有关事项的通知》（证监会计字[2007]21号）与《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》(证监会公告[2008]38号)等文件，本公司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、参考独立第三方机构估值数据等多种方式的有效结合，减少或避免估值偏差的发生。

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。

基金管理人设立基金估值小组时充分考虑参与估值流程各方及人员的经验、专业胜任能力和独立性，人员构成如下：

人员	职务	职责
杨思乐	长盛基金管理有限公司副总经理	长盛基金估值小组组长；领导、统筹估值小组工作，完成基金资产估值。
叶金松	长盛基金管理有限公司督察长	长盛基金估值小组组长；领导、统筹估值小组工作，完成基金资产估值。
白仲光	金融工程部总监	出具估值时所采用的估值模型、假设、参数。
侯继雄	研究发展部副总监，长盛同德主题增长股票型证券投资基金基金经理，基金同盛证券投资基金基金经理	出具估值时所采用的假设、判定依据。
詹凌蔚	总经理助理和投资管理部总监，长盛同德主题增长股票型证券投资基金基金经理	判定估值价格合理性。
郝善勇	信息技术部总监	建立辅助估值系统，提供估值价格。
张利宁	监察稽核部总监	审查监督估值制度、程序执行过程的合规性。
戴君棉	业务运营部副总监	采用调整后价格进行基金资产估值。
龚昕	业务运营部副总监	采用调整后价格进行基金资产估值。

参与估值流程各方之间均为基金管理人各部门人员，均具有基金执业证书，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。

第七节 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据中国证监会基金部通知[2008]12号《关于2007年证券投资基金年度报告编制及披露相关问题的通知》、中国证监会基金部通知[2009]4号关于发布《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》（试行）》等问题的通知中对基金期末可分配利润计算方法的规定，以及《长盛中信全债指数增强型债券投资基金基金合同》第十八条中对基金利润分配原则的约定，本基金截至2008年12月31日期末可供分配利润为208,550,098.03元，其中：未分配利润已实现部分为-12,387,873.38元，未分配利润未实现部分为220,937,971.41元。按照上述通知及基金合同的规定，2008年度分配利润119,258,647.90元（详见第二章表三）。

第四章 托管人报告

一、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2008年1月1日至2008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。

二、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、基金费用开支及利润分配等问题上，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。

三、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。

中国农业银行托管业务部

2009年3月27日

第五章 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2009年3月18日对本基金2008年12月31日的资产负债表、2008年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表和财务报表附注出具了普华永道中天审字(2009)第20162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。

第六章 年度财务报表

第一节 基金财务报表（经审计）

一、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：2008年12月31日

单位：人民币元

资 产	本期末 2008年12月31日	上年度末 2007年12月31日
资 产：		
银行存款	57,018,790.29	227,899,508.50
结算备付金	3,352,983.49	973,012.48
存出保证金	710,000.00	710,000.00
交易性金融资产	1,503,241,030.25	1,157,910,587.89
其中：股票投资	74,725,439.65	214,645,776.65
基金投资	-	-
债券投资	1,428,515,590.60	943,264,811.24
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	2,147,968.51
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	12,895,742.57	-
应收利息	15,103,217.07	10,556,610.90
应收股利	-	-
应收申购款	598,011.09	7,948,191.92
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,592,919,774.76	1,408,145,880.20
负债和所有者权益	本期末 2008年12月31日	上年度末 2007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	277,999,353.00	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	1,357,776.26	3,456,729.43
应付管理人报酬	829,690.57	853,526.69
应付托管费	221,250.84	227,607.13
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	258,572.25	112,173.08
应交税费	376,683.53	228,456.73
应付利息	29,178.76	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	259,577.25	323,052.92
负债合计	281,332,082.46	5,201,545.98
所有者权益：		
实收基金	1,103,037,594.27	1,079,131,597.87
未分配利润	208,550,098.03	323,812,736.35
所有者权益合计	1,311,587,692.30	1,402,944,334.22
负债和所有者权益总计	1,592,919,774.76	1,408,145,880.20

注：报告截止日2008年12月31日，基金份额净值：1.1891元，基金份额总额1,103,037,594.27份。

二、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：2008年1月1日至2008年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2008年1月1日至2008年12月31日	上年度可比期间 2007年1月1日至2007年12月31日
一、收入	-33,082,861.39	265,636,181.99
1.利息收入	54,985,994.85	17,711,578.81
其中：存款利息收入	1,833,265.94	2,087,303.42
债券利息收入	53,152,728.91	15,556,946.22
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	67,329.17
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-34,266,516.61	157,612,901.14
其中：股票投资收益	-36,786,433.20	133,454,755.39
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-4,168,196.96	20,120,080.68
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	5,242,420.91	3,539,128.29
股利收益	1,445,692.64	498,936.78
3.公允价值变动收益（损失以“-”填列）	-54,756,028.48	89,544,910.13
4.汇兑收益（损失以“-”填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”填列）	953,688.85	766,791.91
二、费用（以“-”号填列）	-25,386,255.53	-16,200,938.36
1.管理人报酬	-12,121,960.12	-6,082,605.48
2.托管费	-3,232,522.70	-1,622,028.17
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	-2,865,030.25	-1,606,815.13
5.利息支出	-6,798,742.46	-6,529,479.58
其中：卖出回购金融资产支出	-6,798,742.46	-6,529,479.58
6.其他费用	-368,000.00	-360,010.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-58,469,116.92	249,435,243.63
所得税费用（以“-”号填列）	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-58,469,116.92	249,435,243.63

三、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：2008年1月1日至2008年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2008年1月1日至2008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）	1,079,131,597.87	323,812,736.35	1,402,944,334.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	0.00	-58,469,116.92	-58,469,116.92
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）	23,905,996.40	62,465,126.50	86,371,122.90
其中：1.基金申购款	1,146,789,908.65	282,977,511.34	1,429,767,419.99
2.基金赎回款(以“-”号填列)	-1,122,883,912.25	-220,512,384.84	-1,343,396,297.09
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）		-119,258,647.90	-119,258,647.90
五、期末所有者权益（基金净值）	1,103,037,594.27	208,550,098.03	1,311,587,692.30
项 目	上年度可比期间金额 2007年1月1日至2007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）	126,222,587.34	17,294,911.70	143,517,499.04
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	0.00	249,435,243.63	249,435,243.63
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）	952,909,010.53	219,715,986.68	1,172,624,997.21
其中：1.基金申购款	1,813,458,826.00	445,679,168.35	2,259,137,994.35
2.基金赎回款(以“-”号填列)	-860,549,815.47	-225,963,181.67	-1,086,512,997.14
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	0.00	-162,633,405.66	-162,633,405.66
五、期末所有者权益（基金净值）	1,079,131,597.87	323,812,736.35	1,402,944,334.22

第二节 报表附注（经审计）

一、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

（一）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。

二、会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

（一）会计政策变更的说明：无。

（二）会计估计变更的说明：无。

（三）差错更正的说明：无。

三、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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

（一）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。

（二）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。

（三）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。

（四）基金买卖股票于2008年4月24日之前按照0.3%的税率缴纳股票交易印花税，自2008年4月24日起至2008年9月18日止按0.1%的税率缴纳。自2008年9月19日起基金卖出股票按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。

四、关联方关系

（一）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

截至资产负债表日，未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。

（二）本报告期本基金的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
长盛基金管理有限公司(“长盛基金”)	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

根据长盛基金管理有限公司于2008年11月5日发布的公告，公司股东国元证券有限责任公司更名为国元证券股份有限公司、安徽省创新投资有限公司更名为安徽省信用担保集团有限公司。

五、本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

（一）通过关联方交易单元进行的交易

1、股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2008年1月1日至2008年12月31日		上年度可比期间 2007年1月1日至2007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	599,175,256.08	62.28	315,176,582.98	67.54

2、权证交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2008年1月1日至2008年12月31日		上年度可比期间 2007年1月1日至2007年12月31日	
	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
国元证券	16,481,572.89	68.84	10,983,908.20	94.75

3、债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2008年1月1日至2008年12月31日		上年度可比期间 2007年1月1日至2007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	487,840,094.80	75.54	101,241,012.90	62.56

4、债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2008年1月1日至2008年12月31日		上年度可比期间 2007年1月1日至2007年12月31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(%)
国元证券	1,414,600,000.00	100.00	1,698,500,000.00	100.00

5、应支付关联方佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2008年1月1日至2008年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例(%)	期末佣金余额	占应付佣金余额的比例(%)
国元证券	509,297.93	63.34	156,483.85	65.36
关联方名称	上年度可比期间 2007年1月1日至2007年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例(%)	期末佣金余额	占应付佣金余额的比例(%)
国元证券	257,845.00	68.51	50,272.86	69.42

注：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、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。债券及权证交易不计佣金。

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。

（二）关联方报酬

1、基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2008年1月1日至2008年12月31日	上年度可比期间 2007年1月1日至2007年12月31日
当期应支付的管理费	12,121,960.12	6,082,605.48
其中：当期已支付	11,292,269.55	5,229,078.79
期末未支付	829,690.57	853,526.69

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：日基金管理人报酬＝前一日基金资产净值×0.75%/当年天数。

2、基金托管费

工 单位：人民币元

项目	本期 2008年1月1日至2008年12月31日	上年度可比期间 2007年1月1日至2007年12月31日
当期应支付的托管费	3,232,522.70	1,622,028.17
其中：当期已支付	3,011,271.86	1,394,421.04
期末未支付	221,250.84	227,607.13

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。

（三）与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易：无。

（四）各关联方投资本基金的情况

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 2008年1月1日至2008年12月31日	上年度可比期间 2007年1月1日至2007年12月31日
期初持有基金份额	29,937,118.12	17,004,858.53
本期认购总份额	-	-
本期申购/买入总份额	-	12,932,259.59
本期因拆分增加的份额	-	-
本期赎回/卖出总份额	-	-
期末持有基金份额	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(%)	2.71	2.77

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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于2008年、2007年的报告期末均未持有本基金份额。

（五）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 2008年1月1日至2008年12月31日		上年度可比期间 2007年1月1日至2007年12月31日	
	期末金额	当期利息收入	期末金额	当期利息收入
中国农业银行	57,018,790.29	1,767,530.80	227,899,508.50	1,988,885.37

（六）本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于2008年度及2007年度均未参与关联方承销证券交易。

六、期末（2008年12月31日）本基金持有的流通受限证券

（一）因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金于期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限证券。

（二）期末