



信息披露 Disclosure

D209
2012年3月28日星期三

基金管理人:长信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

送出日期:2012年03月28日

1.1 重要提示及目录
基金管理人、基金托管人及基金份额持有人应当遵守法律法规、职业道德规范及诚实信用原则，并对基金的内容的真实性、准确性和完整性承担法律责任。本基金公告经三分之二以上独立董事同意，报中国证监会备案后生效。

基金管理人:中国农业银行股份有限公司(以下简称“中国农业银行”)，下同。根据本基金合同规定，于2012年3月26日复核了本报告中的各项指标、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。投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告摘要摘录年度报告全文数据，投资人欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

本报告期自2011年1月1日起至2011年12月31日止。

§1 重要提示及目录

基金管理人、基金托管人及基金份额持有人应当遵守法律法规、职业道德规范及诚实信用原则，并对基金的内容的真实性、准确性和完整性承担法律责任。本基金公告经三分之二以上独立董事同意，报中国证监会备案后生效。

基金管理人:中国农业银行股份有限公司(以下简称“中国农业银行”)，下同。根据本基金合同规定，于2012年3月26日复核了本报告中的各项指标、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。投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告摘要摘录年度报告全文数据，投资人欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

本报告期自2011年1月1日起至2011年12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称 长信利丰债券
基金代码 519989
交易代码 519989
基金运作方式 约定期开放式
基金的首次日起日 2008年12月29日
基金管理人 长信基金管理有限责任公司
基金托管人 中国农业银行股份有限公司
报告期基金总份额 174,231,258.48份
基金份额净值 1.095元
基金合同生效日期 不定期型

投资目标 通过积极主动的资产配置和严格的风控机制，在保持基金流动性的同时，为投资者提供稳定的收益。

投资策略 本基金将作为绝对收益型基金，基金投资于固定收益类品种，其中投资于企业债为主的投资债券占基金总资产的20%，并通过投资国债、金融债和货币市场工具等，增厚基金的潜在收益。

业绩比较基准 中证国债指数×90%+上证100指数×10%

风险收益特征 本基金为债券型基金，其预期风险和预期收益水平低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金，属于证券投资产品中风险收益水平中等偏高的投资品种。

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 长信基金管理有限责任公司 中国农业银行股份有限公司
性别 周晓鹏 李亚非
联系人 021-61009999 010-63201816
客户服务电话 400-700-5566 95999
传真 021-61009800 010-63201816

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告公告的管理人网址 www.csfund.com.cn
登载基金半年度报告公告的基金托管人网址

基金年度报告备置地点 上海市浦东新区陆家嘴环路100号9楼
北京朝阳区农展馆南路19号B座2层

§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 利润数据和指标 2011年末 2010年末 2009年末

本期实现收益 -11,616,362.73 37,934,228.99 9,230,474.10

本期利润 -18,017,905.01 38,031,315.76 10,453,993.60

加权平均基金份额本期利润 -0.0574 0.0901 0.0222

本期基金份额净值增长率 -6.92% 10.81% 3.74%

3.1.2 利润数据和指标 2011年末 2010年末 2009年末

期末可供基金份额利润 -0.0458 0.0010 0.0074

期末基金净资产 -166,409,654.92 568,892,763.92 273,702,211.81

期末基金份额净值 0.955 1.0260 1.017

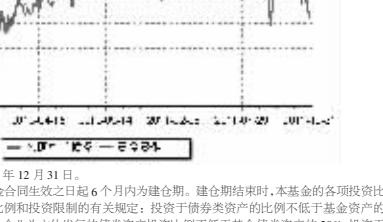
注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)减除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
2.所列基金净值增长率不包括持有人认购或交易基金的费用(例如,申购或赎回费、开放式基金的冲销售服务费、红利再投费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数据。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率与其同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净增长 率(%)	份额净值增长 率(%)	业绩比较基 准收益率(%)	业绩比较基 准收益率的差 额(%)	①-③	②-④
过去三个月	0.63%	0.44%	2.90%	0.18%	-2.27%	0.26%
过去六个月	-5.91%	0.42%	1.28%	0.17%	-7.19%	0.25%
过去一年	-6.92%	0.38%	2.17%	0.18%	-9.09%	0.17%
过去三年	7.00%	0.33%	11.39%	0.20%	-4.33%	0.13%
自基金成立以来至至今 (2008年12月29日-2011年12月31日)	7.00%	11.26%	0.20%	-4.26%	0.13%	

3.2.2 基金份额累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:1.图示日期为2008年12月29日至2011年12月31日。
2.按基金合同期规定,基金管理人应当自基金合同期日起1个月内进行建仓。建仓期结束时,本基金的各项指标均符合基金合同期中关于投资范围、资产配置比例及限制的规定;投资于债券类资产的比例不低于基金资产的80%,其中投资于货币市场基金、企业债、短期融资券等以企业为主体的债券资产投资比例不高于基金资产的20%;投资于股票等权益类资产的比例不高于基金资产的20%;投资于现金的比例不超过基金资产净值的5%。

3.2.3 自基金合同生效以来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



注:2008年计算期间为自基金合同生效日2008年12月29日至2008年12月31日,基金运作时间未满一年,净值增长率为本基金成立以来至2008年12月31日的净值。

3.2.4 基金近三年的利润分配情况

单位:人民币元

年度	每10份基金份额 分红次数	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
2011年	-	-	-	-	
2010年	1,000	104,735,622.99	4,103,031.80	108,838,654.79	
2009年	0,200	5,239,703.30	173,041.21	5,412,744.51	
合计	1,200	109,975,326.29	4,276,073.01	114,251,399.30	

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其主要负责人的经验

长信基金管理有限公司是中国证监会批准设立的、由上海长信投资集团有限公司、武汉钢联投资有限公司共同发起成立、注册资本1亿元人民币。目前股权结构为:长江证券股份有限公司占49%,上海长信投资集团有限公司占43.3%,武汉钢联投资有限公司占6.67%。

截至2011年12月31日,本基金管理人共管理13只开放式基金,即长期利率收益基金、长信利丰精选股票、长信利富债券基金、长信货币基金、长信理财债券、长信恒利债券、长信货币基金、长信中央企业100指数(LOF)、长信货币基金、长信货币基金分级、长信货币基金零风险等。

4.1.2 基金经理的管理经验

基金管理人对基金经理的评价标准

4.1.3 基金经理的薪酬情况

4.1.4 基金经理的从业经历

4.1.5 基金经理的诚信记录

4.1.6 基金经理的过往管理业绩

4.1.7 基金经理的年度报告

4.1.8 基金经理的声明

4.1.9 基金经理的其他情况

4.2 管理人对报告期内基金的经营情况的评价

本报告期内,本基金严格遵守《基金法》及其他法律法规、规章、基金合同,恪守职业道德,勤勉尽责地管理基金,并取得了良好的经营业绩,实现了基金资产的保值增值。

4.3 管理人对宏观经济及行业状况的评价

本报告期内,宏观经济运行平稳,宏观调控政策效果显著,经济运行稳中向好,稳中有进,稳中提质,经济结构持续优化,转型升级取得新进展,经济运行总体平稳,稳中有进,稳中向好。

4.4 管理人对报告期内基金的经营策略和业绩表现的说明

本报告期内,本基金严格遵守《基金法》及其他法律法规、规章、基金合同,恪守职业道德,勤勉尽责地管理基金,并取得了良好的经营业绩,实现了基金资产的保值增值。

4.5 管理人对宏观经济及行业状况的评价

本报告期内,宏观经济运行平稳,宏观调控政策效果显著,经济运行稳中向好,稳中有进,稳中提质,经济结构持续优化,转型升级取得新进展,经济运行总体平稳,稳中有进,稳中向好。

4.6 管理人对报告期内基金估值政策和程序的说明

本基金的估值政策和程序符合《基金法》及其他法律法规、规章、基金合同,恪守职业道德,勤勉尽责地管理基金,并取得了良好的经营业绩,实现了基金资产的保值增值。

4.7 管理人对报告期内基金的经营情况的评价

本报告期内,本基金严格遵守《基金法》及其他法律法规、规章、基金合同,恪守职业道德,勤勉尽责地管理基金,并取得了良好的经营业绩,实现了基金资产的保值增值。

4.8 管理人对基金未来投资运作的展望

本基金将密切关注宏观经济运行情况,把握经济运行脉搏,结合国家政策导向,适时调整投资策略,努力为投资者创造良好的投资回报。

4.9 管理人对基金未来收益的预测

本基金将密切关注宏观经济运行情况,把握经济运行脉搏,结合国家政策导向,适时调整投资策略,努力为投资者创造良好的投资回报。

4.10 管理人对基金未来投资运作的展望

本基金将密切关注宏观经济运行情况,把握经济运行脉搏,结合国家政策导向,适时调整投资策略,努力为投资者创造良好的投资回报。

4.11 管理人对基金未来收益的预测

本基金将密切关注宏观经济运行情况,把握经济运行脉搏,结合国家政策导向,适时调整投资策略,努力为投资者创造良好的投资回报。

4.12 管理人对基金未来投资运作的展望

本基金将密切关注宏观经济运行情况,把握经济运行脉搏,结合国家政策导向,适时调整投资策略,努力为投资者创造良好的投资回报。

4.13 管理人对基金未来收益的预测

本基金将密切关注宏观经济运行情况,把握经济运行脉搏,结合国家政策导向,适时调整投资策略,努力为投资者创造良好的投资回报。

4.14 管理人对基金未来投资运作的展望

本基金将密切关注宏观经济运行情况,把握经济运行脉搏,结合国家政策导向,适时调整投资策略,努力为投资者创造良好的投资回报。

4.15 管理人对基金未来收益的预测

本基金将密切关注宏观经济运行情况,把握经济运行脉搏,结合国家政策导向,适时调整投资策略,努力为投资者创造良好的投资回报。

4.16 管理人对基金未来投资运作的展望

本基金将密切关注宏观经济运行情况,把握经济运行脉搏,结合国家政策导向,适时调整投资策略,努力为投资者创造良好的投资回报。

4.17 管理人对基金未来收益的预测

本基金将密切关注宏观经济运行情况,把握经济运行脉搏,结合国家政策导向,适时调整投资策略,努力为投资者创造良好的投资回报。

4.18 管理人对基金未来投资运作的展望