

长信利丰债券型证券投资基金2015年半年度报告

2015年6月30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

送出日期：2015年8月27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的法律责任。本半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”，下同）根据本基金合同规定，于2015年8月26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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年1月1日起至2015年6月30日止。

1.2 目录

§ 1	重要提示及目录	2
1.1	重要提示	2
1.2	目录	3
§ 2	基金简介	5
2.1	基金基本情况	5
2.2	基金产品说明	5
2.3	基金管理人和基金托管人	5
2.4	信息披露方式	6
2.5	其他相关资料	6
§ 3	主要财务指标和基金净值表现	7
3.1	主要会计数据和财务指标	7
3.2	基金净值表现	7
§ 4	管理人报告	9
4.1	基金管理人及基金经理情况	9
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8	报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5	托管人报告	14
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3	托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	14
§ 6	半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1	资产负债表	15
6.2	利润表	16
6.3	所有者权益（基金净值）变动表	17
6.4	报表附注	18
§ 7	投资组合报告	38
7.1	期末基金资产组合情况	38
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	38
7.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	39
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	40
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	44
7.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	44
7.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	44
7.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	45
7.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	45
7.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	45
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	45
7.12	投资组合报告附注	45
§ 8	基金份额持有人信息	47
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	47
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	47
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	47

§ 9 开放式基金份额变动.....	48
§ 10 重大事件揭示.....	49
10.1 基金份额持有人大会决议.....	49
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	49
10.4 基金投资策略的改变.....	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	49
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	50
10.8 其他重大事件.....	51
§ 11 备查文件目录.....	53
11.1 备查文件目录.....	53
11.2 存放地点.....	53
11.3 查阅方式.....	53

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长信利丰债券型证券投资基金
基金简称	长信利丰债券
场内简称	长信利丰
基金主代码	519989
交易代码	519989
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	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
报告期末基金份额总额	1,755,534,013.61份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过积极主动的资产管理和严格的风险控制，在保持基金资产流动性和严格控制基金资产风险的前提下，为投资者提供稳定增长的投资收益。
投资策略	本基金为债券型基金，基金资产主要投资于固定收益类品种，其中投资于以企业为主体发行的债券不低于基金债券资产的20%，并通过投资国债、金融债和资产支持证券等，增加企业债投资组合的投资收益。
业绩比较基准	中证全债指数×90%+中证800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，属于证券投资基金产品中风险收益程度中等偏低的投资品种。

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
信息披露负责人	姓名	周永刚	林葛
	联系电话	021-61009999	010-66060069
	电子邮箱	zhouyg@cxfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-700-5566	95599
传真		021-61009800	010-63201816

注册地址	上海市浦东新区银城中路68号9楼	北京市东城区建国门内大街69号
办公地址	上海市浦东新区银城中路68号9楼	北京市西城区复兴门内大街28号 凯晨世贸中心东座F9
邮政编码	200120	100031
法定代表人	田丹	刘士余

注：自2015年7月21日起，叶焯先生担任本基金管理人董事长（法定代表人），本基金管理人正在办理法定代表人的工商变更登记。

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.cxfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	上海市浦东新区银城中路68号9楼、北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京西城区太平洋桥大街17号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2015年1月1日至2015年6月30日）
本期已实现收益	317,590,558.24
本期利润	293,668,598.20
加权平均基金份额本期利润	0.2029
本期加权平均净值利润率	14.66%
本期基金份额净值增长率	19.20%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2015年6月30日）
期末可供分配利润	323,436,304.11
期末可供分配基金份额利润	0.1842
期末基金资产净值	2,385,054,935.91
期末基金份额净值	1.359
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2015年6月30日）
基金份额累计净值增长率	102.70%

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）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。

2、期末可供分配利润为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。

3、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（例如，封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

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

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
过去一个月	-3.62%	0.95%	-0.39%	0.34%	-3.23%	0.61%
过去三个月	8.46%	0.94%	3.53%	0.28%	4.93%	0.66%
过去六个月	19.20%	0.80%	6.40%	0.24%	12.80%	0.56%

过去一年	47.60%	0.71%	16.15%	0.20%	31.45%	0.51%
过去三年	77.89%	0.55%	21.00%	0.17%	56.89%	0.38%
自基金合同生效 日起至今(2008年 12月29日-2015年 6月30日)	102.70%	0.45%	39.23%	0.18%	63.47%	0.27%

3.2.2 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



注：1、图示日期为2008年12月29日至2015年6月30日。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起6个月内为建仓期。建仓期结束时，本基金的各项投资比例已符合基金合同中的约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

长信基金管理有限责任公司是经中国证监会证监基金字【2003】63号文批准，由长江证券股份有限公司、上海海欣集团股份有限公司、武汉钢铁股份有限公司共同发起设立。注册资本1.5亿元人民币。目前股权结构为：长江证券股份有限公司占49%、上海海欣集团股份有限公司占34.33%、武汉钢铁股份有限公司占16.67%。

截至2015年6月30日，本基金管理人共管理22只开放式基金，即长信利息收益货币、长信银利精选股票、长信金利趋势股票、长信增利动态策略股票、长信双利优选混合、长信利丰债券、长信恒利优势股票、长信中证中央企业100指数（LOF）（2015年7月20日起变更为长信医疗保健混合（LOF））、长信纯债壹号债券、长信量化先锋股票、长信标普100等权重指数（QDII）、长信利鑫分级债、长信内需成长股票、长信可转债债券、长信利众分级债、长信纯债一年定开债券、长信改革红利混合、长信量化中小盘股票、长信新利混合、长信利富债券、长信利盈混合及长信利广混合。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李小羽	本基金、长信可转债债券型证券投资基金和长信利富债券型证券投资基金的基金经理、公司副总经理、固定收益部总监	2008年12月29日	—	17年	上海交通大学工学学士，华南理工大学工学硕士，具有基金从业资格，加拿大特许投资经理资格（CIM）。曾任职长城证券公司、加拿大Investors Group Financial Services Co., Ltd。2002年10月加入本公司（筹备），先后任基金经理助理、交易管理部总监、长信中短债证券投资基金、长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理、总经理助理。现任长信基金管理有

					限责任公司副总经理兼固定收益部总监、本基金、长信可转债债券型证券投资基金和长信利富债券型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：1、基金经理任职日期以本基金成立之日为准；

2、证券从业年限以基金经理进入证券业务相关机构的工作经历为时间计算标准。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

本基金将继续以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，努力为基金份额持有人谋求最大利益。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司已实行公平交易制度，并建立公平交易制度体系，已建立投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，公司已通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，除完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合外，其余各投资组合未发现参与交易所证券公开竞价同日反向交易，不涉及成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情形，未发现异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年以来，欧美等发达经济体经济保持了较好的复苏势头，美国经济复苏

最为确定，地产和消费倾向再次抬头：海外市场动荡使得美联储内部对加息进程的分歧显著，美联储加息时间可能推后，但强势美元仍较为确定。欧元区QE操作刺激经济回暖，PMI和消费者信心指数双双反弹。发布资本管制法令之后，市场对希腊发生债务违约的风险预期持续升温，希腊退出欧元区可能性进一步加大。

中国经济复苏动力不足，工业增加值等指标低于预期，大量资金流转于金融市场。宏观调控方面由于经济减速明显以及股市动荡，央行六月底再一次降息并定向降准。上半年资金面较为宽松，但财政部发行地方政府债券置换存量债务也预示着未来利率债供给压力的大增，债券市场转入震荡行情。

本基金2015年上半年维持信用债配置，适度控制久期，精选个券，规避信用风险，加大了灵活操作的力度，以提高组合的安全性。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为1.359元，报告期基金份额净值增长率为19.20%，成立以来的累计净值为1.852元，本期业绩比较基准增长率为6.40%，基金波动率为0.80%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

未来经济的政策重点在于通过改革释放增长红利，政府下调GDP增速目标基本符合预期，也反应了经济的“新常态”，地产政策放松，包括信贷支持和税收优惠，将对内需进行拉动：一带一路将成为贸易增长的重要抓手，中国通过基建走出去，拉动各国投资，成为新的增长点，带动我国外需。实体经济增长动力不足使得工业品价格大概率维持低位，将进一步拉低PPI，食品价格今年以来较为平稳，虽然猪价上涨幅度较大，但主要是由于供给减少引起的，2015年通胀短期看来并不令人担忧。整体来说，2015年中国经济仍处于产业结构调整期，经济基本面将在政策刺激下逐渐筑底，宽松的货币政策仍可期待，资金面总体而言将会保持宽松。下一阶段基本面对债市仍有利，但信用风险可能进一步加大，需要对信用债谨慎排雷，低等级债券可能进一步承压。

我们将继续秉承谨慎原则，加强组合的流动性管理，在做好利率风险控制的同时，增加对新经济环境下信用风险的审慎判断。适度控制组合久期，密切关注经济走势和政策动向，紧跟组合规模变动进行资产配置，争取在流动安全的前提下，为投资者获取更好的收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证券监督管理委员会2008年9月12日发布的[2008]38号文《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，长信基金管理有限责任公司（以下简称“公司”）制订了健全、有效的估值政策和程序，成立了估值工作小组，小组成员由投资管理部总监、固定收益部总监、研究发展部总监、交易管理部总监、金融工程部总监、基金事务部总监以及基金事务部至少一名业务骨干共同组成。相关参与人员都具有丰富的证券行业工作经验，熟悉相关法规和估值方法。基金经理不直接参与估值决策，如果基金经理认为某证券有更好的证券估值方法，可以申请公司估值工作小组对某证券进行专项评估。估值决策由与会估值工作小组成员1/2以上多数票通过。对于估值政策，公司与基金托管人充分沟通，达成一致意见。审计本基金的会计师事务所认可公司基金估值政策和程序的适当性。

参与估值流程各方不存在任何重大利益冲突。报告期内，未签订与估值相关的定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规和本基金基金合同规定的基金收益分配原则以及基金实际运作情况，本基金于2015年3月23日为权益登记日进行分红，每10份基金份额派发2.80元。

本基金收益分配原则如下：

- 1、本基金的每份基金份额享有同等分配权；
- 2、基金收益分配后每一基金份额净值不能低于面值；
- 3、收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由基金投资者自行承担；
- 4、基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；
- 5、基金当期收益应先弥补上期累计亏损后，才可进行收益分配；
- 6、在符合基金分红条件的前提下，本基金每年收益至少分配1次，最多分配12次，年度收益分配比例不低于基金年度可分配收益的50%；
- 7、本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，基金投资者可选择现金红利或将现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额进行再

投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

8、法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管长信利丰债券型证券投资基金的过程中,本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及《长信利丰债券型证券投资基金基金合同》、《长信利丰债券型证券投资基金托管协议》的约定,对长信利丰债券型证券投资基金管理人—长信基金管理有限责任公司2015年1月1日至2015年6月30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。

5.2 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,除2015年2月10日,长信利丰债券型证券投资基金,网上申购了300427_红相电力(该申购最终未中签),该只股票的主承销商为长江证券承销保荐有限公司,此关联交易事先未征得基金托管人同意,违反了相关法规的规定。长信基金管理有限责任公司在长信利丰债券型证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。

5.3 托管人对本半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,长信基金管理有限责任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信利丰债券型证券投资基金半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。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：长信利丰债券型证券投资基金

报告截止日：2015年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.6.1	161,694,974.22	41,591,341.00
结算备付金		8,959,910.86	15,023,628.98
存出保证金		814,144.86	145,620.23
交易性金融资产	6.4.6.2	2,679,297,030.61	652,463,193.50
其中：股票投资		368,435,155.19	43,115,973.24
基金投资		—	—
债券投资		2,310,861,875.42	609,347,220.26
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
衍生金融资产	6.4.6.3	—	—
买入返售金融资产	6.4.6.4	—	—
应收证券清算款		59,718,277.42	8,992,306.23
应收利息	6.4.6.5	59,395,491.91	14,239,739.78
应收股利		—	—
应收申购款		2,876,629.34	11,810,515.44
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.6.6	—	—
资产总计		2,972,756,459.22	744,266,345.16
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
负债：			
短期借款		—	—
交易性金融负债		—	—
衍生金融负债	6.4.6.3	—	—
卖出回购金融资产款		529,998,525.00	214,199,460.70
应付证券清算款		31,498,975.01	94,906.46
应付赎回款		17,408,121.02	1,573,327.85
应付管理人报酬		1,481,282.86	250,960.77

应付托管费		423,223.66	71,703.07
应付销售服务费		846,447.36	499,227.47
应付交易费用	6.4.6.7	4,797,657.14	817,723.83
应交税费		688,737.74	688,737.74
应付利息		304,431.42	76,135.50
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	6.4.6.8	254,122.10	455,297.02
负债合计		587,701,523.31	218,727,480.41
所有者权益：			
实收基金	6.4.6.9	1,755,534,013.61	377,345,769.48
未分配利润	6.4.6.10	629,520,922.30	148,193,095.27
所有者权益合计		2,385,054,935.91	525,538,864.75
负债和所有者权益总计		2,972,756,459.22	744,266,345.16

注：报告截止日2015年6月30日，基金份额净值1.359元，基金份额总额1,755,534,013.61份。

6.2 利润表

会计主体：长信利丰债券型证券投资基金

本报告期：2015年1月1日至2015年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015年1月1日至 2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至 2014年6月30日
一、收入		322,945,021.59	14,040,885.26
1. 利息收入		47,779,058.81	5,105,156.59
其中：存款利息收入	6.4.6.11	2,006,636.09	122,887.69
债券利息收入		45,503,428.89	4,903,555.89
资产支持证券利息收入		—	—
买入返售金融资产收入		268,993.83	78,654.85
其他利息收入		—	58.16
2. 投资收益（损失以“-”号填列）		296,657,179.97	1,547,875.15
其中：股票投资收益	6.4.6.12	176,924,853.39	-1,176,357.62
基金投资收益		—	—
债券投资收益	6.4.6.13	118,743,775.74	2,544,841.79
资产支持证券投资收益		—	—
贵金属投资收益	6.4.6.14	—	—

衍生工具收益	6.4.6.15	—	—
股利收益	6.4.6.17	988,550.84	179,390.98
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.6.18	-23,921,960.04	7,359,480.13
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.6.19	2,430,742.85	28,373.39
减：二、费用		29,276,423.39	3,990,942.03
1. 管理人报酬		6,948,422.46	527,676.19
2. 托管费		1,985,263.55	150,764.61
3. 销售服务费		3,970,527.14	301,529.28
4. 交易费用	6.4.6.20	6,828,890.70	934,349.66
5. 利息支出		9,373,486.96	1,941,482.64
其中：卖出回购金融资产支出		9,373,486.96	1,941,482.64
6. 其他费用	6.4.6.21	169,832.58	135,139.65
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		293,668,598.20	10,049,943.23
减：所得税费用		—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		293,668,598.20	10,049,943.23

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长信利丰债券型证券投资基金

本报告期：2015年1月1日至2015年6月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2015年1月1日至2015年6月30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)	377,345,769.48	148,193,095.27	525,538,864.75
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	293,668,598.20	293,668,598.20
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）	1,378,188,244.13	2,280,323,141.93	3,658,511,386.06
其中：1. 基金申购款	8,939,543,041.24	4,441,894,606.33	13,381,437,647.57

2. 基金赎回款	-7,561,354,797.11	-2,161,571,464.40	-9,722,926,261.51
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	—	-2,092,663,913.10	-2,092,663,913.10
五、期末所有者权益（基金净值）	1,755,534,013.61	629,520,922.30	2,385,054,935.91
项 目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30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）	176,450,889.87	7,933,908.30	184,384,798.17
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	10,049,943.23	10,049,943.23
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）	-59,922,133.89	-3,469,922.92	-63,392,056.81
其中：1. 基金申购款	45,521,085.53	4,556,233.66	50,077,319.19
2. 基金赎回款	-105,443,219.42	-8,026,156.58	-113,469,376.00
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	—	—	—
五、期末所有者权益（基金净值）	116,528,755.98	14,513,928.61	131,042,684.59

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告至财务报表由下列负责人签署：

叶焯

覃波

孙红辉

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

长信利丰债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于核准长信利丰债券型证券投资基金募集

的批复》(证监许可[2008]1252号文)批准,由长信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《长信利丰债券型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于2008年12月29日生效。本基金为契约型开放式,存续期限为不定期,首次设立募集规模为819,356,829.46份基金份额。本基金的基金管理人为长信基金管理有限责任公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司(以下简称“中国农业银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《长信利丰债券型证券投资基金基金合同》和《长信利丰债券型证券投资基金招募说明书(更新)》的有关规定,本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国债、金融债、公司债券、企业债券、短期融资券、可转换债券、资产支持证券、央行票据、回购、银行定期存单、股票、权证,以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资组合资产类别配置的基本范围为:投资于债券类资产的比例不低于基金资产的80%,其中投资于公司债、企业债、短期融资券等以企业为主体发行的债券资产投资比例不低于基金债券资产的20%;投资于股票等权益类品种的比例不高于基金资产的20%;现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为:中证全债指数 \times 90%+中证800指数 \times 10%。

根据《证券投资基金信息披露管理办法》,本基金定期报告在公开披露的第二个工作日,报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)于2006年2月15日颁布的《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、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)的要求编制,同时亦按照中国证监会公告[2010]5号《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>》以及中国证券业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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2015年6

月30日的财务状况、2015年上半度的经营成果和基金净值变动情况。

此外本财务报表同时符合如财务报表附注6.4.2所列示的其他有关规定的要求。

6.4.4 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.4.1 会计政策变更的说明

本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致。

6.4.4.2 会计估计变更的说明

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》，自2015年3月27日起，本基金管理人对旗下证券投资基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格进行估值。详情请见本基金管理人于2015年3月31日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站发布的《长信基金管理有限责任公司关于调整旗下基金交易所固定收益品种估值方法的公告》。

6.4.4.3 差错更正的说明

本基金在本报告期末未发生过重大会计差错。

6.4.5 税项

根据财税字[1998]55号文、财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号文《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、上证交字[2008]16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》、财税[2008]1号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

- (1) 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。
- (2) 基金买卖股票、债券的投资收益暂免征收营业税和企业所得税。
- (3) 对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入，由上市公司、发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税，暂不征收

企业所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2014年1月1日起，个人从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。

(4) 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。

(5) 对投资者(包括个人和机构投资者)从基金分配中取得的收入，暂不征收个人所得税和企业所得税。

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
应交债券利息收入所得税	688,737.74	688,737.74

注：该项系基金收到的债券发行人在支付债券利息时未代扣代缴的利息税部分。

6.4.6 重要财务报表项目的说明

6.4.6.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
活期存款	161,694,974.22
定期存款	—
其中：存款期限1-3个月	—
其他存款	—
合计	161,694,974.22

6.4.6.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	403,942,559.12	368,435,155.19	-35,507,403.93
债券			
交易所市场	585,272,137.73	588,293,275.42	3,021,137.69

	银行间市场	1,709,186,999.07	1,722,568,600.00	13,381,600.93
	合计	2,294,459,136.80	2,310,861,875.42	16,402,738.62
资产支持证券		—	—	—
基金		—	—	—
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—
其他		—	—	—
合计		2,698,401,695.92	2,679,297,030.61	-19,104,665.31

6.4.6.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.6.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.6.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应收活期存款利息	61,540.11
应收定期存款利息	—
应收其他存款利息	—
应收结算备付金利息	4,032.00
应收债券利息	58,823,998.33
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	505,555.07
应收黄金合约拆借孳息	—
其他	366.40
合计	59,395,491.91

注：其他为应收保证金利息。

6.4.6.6 其他资产

本报告期末本基金未持有其他资产。

6.4.6.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
交易所市场应付交易费用	4,764,158.29
银行间市场应付交易费用	33,498.85
合计	4,797,657.14

6.4.6.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	18,026.16
预提信息披露费-中证报	39,671.58
预提信息披露费-证券时报	139,671.58
预提账户维护费	27,000.00
预提审计费	29,752.78
合计	254,122.10

6.4.6.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	377,345,769.48	377,345,769.48
本期申购	8,939,543,041.24	8,939,543,041.24
本期赎回（以“-”号填列）	-7,561,354,797.11	-7,561,354,797.11
本期末	1,755,534,013.61	1,755,534,013.61

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.6.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	97,900,209.00	50,292,886.27	148,193,095.27
本期利润	317,590,558.24	-23,921,960.04	293,668,598.20
本期基金份额交易产生的变动数	2,000,609,449.97	279,713,691.96	2,280,323,141.93
其中：基金申购款	2,349,900,156.94	2,091,994,449.39	4,441,894,606.33
基金赎回款	-349,290,706.97	-1,812,280,757.43	-2,161,571,464.40
本期已分配利润	-2,092,663,913.10	—	-2,092,663,913.10
本期末	323,436,304.11	306,084,618.19	629,520,922.30

6.4.6.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
活期存款利息收入	1,337,985.52
定期存款利息收入	—
其他存款利息收入	3,749.77
结算备付金利息收入	166,228.03

其他	498,672.77
合计	2,006,636.09

注：其他存款利息收入为保证金利息收入，其他为在途利息收入。

6.4.6.12 股票投资收益

6.4.6.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	176,924,853.39
股票投资收益——赎回差价收入	—
合计	176,924,853.39

6.4.6.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
卖出股票成交总额	2,186,730,444.84
减：卖出股票成本总额	2,009,805,591.45
买卖股票差价收入	176,924,853.39

6.4.6.13 债券投资收益

6.4.6.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	118,743,775.74
债券投资收益——赎回差价收入	—
债券投资收益——申购差价收入	—
合计	118,743,775.74

6.4.6.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,734,594,788.99
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,609,428,188.01
减：应收利息总额	6,422,825.24
买卖债券差价收入	118,743,775.74

6.4.6.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本期末未持有资产支持证券。

6.4.6.14 贵金属投资收益

本基金本报告期末未持有贵金属。

6.4.6.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.6.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
股票投资产生的股利收益	988,550.84
基金投资产生的股利收益	—
合计	988,550.84

6.4.6.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
1. 交易性金融资产	-23,921,960.04
——股票投资	-30,518,149.04
——债券投资	6,596,189.00
——资产支持证券投资	—
——基金投资	—
——贵金属投资	—
——其他	—
2. 衍生工具	—
——权证投资	—
3. 其他	—
合计	-23,921,960.04

6.4.6.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
基金赎回费收入	2,356,762.27
转换费收入	73,980.58
合计	2,430,742.85

注：本基金赎回费（转换费中赎回费部分）的25%归入基金资产。

6.4.6.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
交易所市场交易费用	6,815,980.70
银行间市场交易费用	12,910.00
合计	6,828,890.70

6.4.6.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	79,343.16
交易费用_回购	—
权证	—
账户维护费	18,060.00
其他费用	42,676.64
合计	169,832.58

注：其他费用为银行划款手续费。

6.4.7 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.7.1 或有事项

截至本财务报告批准报出日，本基金未发生需要披露的或有事项。

6.4.7.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金未发生需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.8 关联方关系

6.4.8.1 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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方无变化。

6.4.8.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
长信基金管理有限责任公司	基金管理人
中国农业银行股份有限公司(简称“中国农业银行”)	基金托管人
长江证券股份有限公司(简称“长江证券”)	基金管理人的股东

6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.9.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.9.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.9.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.9.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.9.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应付关联方交易单元的佣金。

6.4.9.2 关联方报酬

6.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6 月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	6,948,422.46	527,676.19
其中：支付销售机构的客户维护费	374,320.40	121,509.49

注：支付基金管理人长信基金管理有限责任公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值0.70%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×0.70%/当年天数

6.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6 月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,985,263.55	150,764.61

注：支付基金托管人中国农业银行股份有限公司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。

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

6.4.9.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
长信基金管理有限责任公司	3,226,444.15
中国农业银行	35,747.92
长江证券	33,320.34
合计	3,295,512.41
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
长信基金管理有限责任公司	79,444.36
中国农业银行	27,348.82
长江证券	112.07
合计	106,905.25

注：支付各关联方的销售服务费按前一日基金资产净值0.40%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

计算公式为：日基金销售服务费=前一日基金资产净值×0.40%/当年天数

6.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.9.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月 30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6 月30日
报告期初持有的基金份额	—	—
报告期内申购/买入总份额	13,691,185.48	—
报告期内因拆分变动份额	—	—
减：报告期内赎回/卖出总份额	—	—
报告期末持有的基金份额	13,691,185.48	—
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.78%	—

6.4.9.4.2 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

除基金管理人之外的其他关联方在本报告期及上年度可比期间均未投资过本基金。

6.4.9.5 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		上年度可比期间	
	2015年1月1日至2015年6月30日		2014年1月1日至2014年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	161,694,974.22	1,337,985.52	14,336,671.11	65,830.45

注：本基金通过“中国农业银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于2015年6月30日的相关余额为人民币8,959,910.86元。（2014年12月31日：人民币15,023,628.98元）

6.4.9.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期及上年度可比期间均未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

6.4.9.7 其他关联交易事项的说明

上述关联交易均根据正常的商业交易条件进行，并以一般交易价格为定价基础。

6.4.10 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	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	本期利润分配合计	备注
1	2015-3-23	2015-3-23	2.800	2,024,797,778.34	67,866,134.76	2,092,663,913.10	
合计			2.800	2,024,797,778.34	67,866,134.76	2,092,663,913.10	

6.4.11 期末（2015年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.11.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.11.1.1 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:张)	期末成本总额	期末估值总额
132002	15天集EB	2015-06-11	2015-07-02	认购新发证券	100.00	100.00	11,210	1,121,000.00	1,121,000.00

6.4.11.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.11.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2015年6月30日止，本基金从事银行间债券市场正回购交易形成的卖出回购证券清算款余额为450,390,082.20元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
11599094	15 华强 SCP002	2015-7-2	100.56	700,000	70,392,000.00
11599095	15 梅花 SCP002	2015-7-2	100.63	300,000	30,189,000.00
11599097	15 桑德 SCP002	2015-7-2	100.75	400,000	40,300,000.00
11599099	15 桂建工 SCP002	2015-7-2	100.38	600,000	60,228,000.00
41560005	15 清水川 CP001	2015-7-2	100.77	200,000	20,154,000.00
101353012	13 步步高 MTN001	2015-7-2	102.50	100,000	10,250,000.00
101466012	14 东方园林 MTN002	2015-7-2	101.24	400,000	40,496,000.00
11599140	15 西王 SCP001	2015-7-2	100.59	200,000	20,118,000.00
41456058	14 三安 CP002	2015-7-2	100.60	200,000	20,120,000.00
41459068	14 新投 CP001	2015-7-2	100.79	200,000	20,158,000.00
41551005	15 盾安集 CP001	2015-7-2	100.86	300,000	30,258,000.00
41460080	14 精工 CP001	2015-7-6	101.49	200,000	20,298,000.00
41466025	14 鲁泰 CP001	2015-7-6	101.39	300,000	30,417,000.00
41560010	15 星星 CP001	2015-7-6	101.30	300,000	30,390,000.00
41560049	15 盛运环保 CP001	2015-7-6	99.74	100,000	9,974,000.00
合计				4,500,000	453,742,000.00

6.4.11.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2015年6月30日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额80,000,000.00元，于2015年7月1日前到期。该类交易

要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12 金融工具风险及管理

6.4.12.1 风险管理政策和组织架构

本基金金融工具的风险主要包括：

信用风险

流动风险

利率风险

外汇风险

其他市场价格风险

本基金在下文主要论述上述风险敞口及其形成原因：风险管理目标、政策和过程以及计量风险的方法等。

本基金的基金管理人从事风险管理的目标是使本基金在风险和收益之间取得适当的平衡，以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。基于该风险管理目标，本基金的基金管理人已制定了政策和程序来辨别和分析这些风险，设定适当的风险限额并设计相应的内部控制程序，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由风险控制委员会、金融工程部和相关职能部门构成的多级风险管理架构体系。

6.4.12.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国农业银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。

本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.12.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
A-1	523,249,000.00	—
A-1以下	—	—
未评级	—	11,253,000.00
合计	523,249,000.00	11,253,000.00

注：未评级债券为国债、政策金融债及央行票据等免评级债券。

根据中国人民银行2006年3月29日发布的“银发[2006]95号”文《中国人民银行信用评级管理指导意见》，以及2006年11月21日发布的《信贷市场和银行间债券市场信用评级规范》等文件的有关规定，短期债券信用评级等级划分为四等六级，符号表示为：A-1、A-2、A-3、B、C、D。其中，每一个信用等级可用“+”、“-”符号进行微调，表示略高或略低于本等级。

级别设置	含义
A-1	还本付息能力最强，安全性最高。
A-2	还本付息能力较强，安全性较高。
A-3	还本付息能力一般，安全性易受不良环境变化的影响。
B	还本付息能力较低，有一定的违约风险。
C	还本付息能力很低，违约风险较高。
D	不能按期还本付息。

6.4.12.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
AAA	145,780,000.00	32,375,875.51
AAA以下	972,506,600.00	148,531,112.56
未评级	—	—
合计	1,118,286,600.00	180,906,988.07

注：根据中国人民银行2006年3月29日发布的“银发[2006]95号”文《中国人民银行信用评级管理指导意见》，以及2006年11月21日发布的《信贷市场和银行间债券市场信用评级规范》等文件的有关规定，中长期债券信用等级划分成三等九

级，分别用AAA、AA、A、BBB、BB、B、CCC、CC和C表示，其中，除AAA级、CCC级(含)以下等级外，每一个信用等级可用“+”、“-”符号进行微调，表示略高或略低于本等级。

级别设置	含义
AAA	偿还债务的能力极强，基本不受不利经济环境的影响，违约风险极低。
AA	偿还债务的能力很强，受不利经济环境的影响较小，违约风险很低。
A	偿还债务的能力较强，较易受不利经济环境的影响，违约风险较低。
BBB	偿还债务的能力一般，受不利经济环境影响较大，违约风险一般。
BB	偿还债务的能力较弱，受不利经济环境影响很大，有较高违约风险。
B	偿还债务的能力较大地依赖于良好的经济环境，违约风险很高。
CCC	偿还债务的能力极度依赖于良好的经济环境，违约风险极高。
CC	在破产重组时可获得保护较小，基本不能保证偿还债务。
C	不能偿还债务。

6.4.12.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现，另一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人主要通过限制、跟踪和控制基金投资交易的不活跃品种来实现。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可于银行间同业市场交易，因此除在附注6.4.11中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式融入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金管理人金融工程部每日预测本基金的流动性需求，并设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

6.4.12.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险,包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.12.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。本基金管理人金融工程部对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值,并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.12.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2015年6月30 日	6个月以内	6个月 -1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	161,694,974.22	—	—	—	—	161,694,974.22
结算备付金	8,959,910.86	—	—	—	—	8,959,910.86
存出保证金	814,144.86	—	—	—	—	814,144.86
交易性金融资产	363,439,849.90	175,875,500.00	646,280,379.52	1,125,266,146.00	368,435,155.19	2,679,297,030.61
应收证券清算款	—	—	—	—	59,718,277.42	59,718,277.42
应收利息	—	—	—	—	59,395,491.91	59,395,491.91
应收申购款	—	—	—	—	2,876,629.34	2,876,629.34
资产总计	534,908,879.84	175,875,500.00	646,280,379.52	1,125,266,146.00	490,425,553.86	2,972,756,459.22
负债						
卖出回购金融资产款	529,998,525.00	—	—	—	—	529,998,525.00
应付证券清算款	—	—	—	—	31,498,975.01	31,498,975.01
应付赎回款	—	—	—	—	17,408,121.02	17,408,121.02
应付管理人报酬	—	—	—	—	1,481,282.86	1,481,282.86
应付托管费	—	—	—	—	423,223.66	423,223.66
应付销售服务费	—	—	—	—	846,447.36	846,447.36
应付交易费用	—	—	—	—	4,797,657.14	4,797,657.14
应交税费	—	—	—	—	688,737.74	688,737.74
应付利息	—	—	—	—	304,431.42	304,431.42
其他负债	—	—	—	—	254,122.10	254,122.10
负债总计	529,998,525.00	—	—	—	57,702,998.31	587,701,523.31
利率敏感度缺口	4,910,354.84	175,875,500.00	646,280,379.52	1,125,266,146.00	432,722,555.55	2,385,054,935.91
上年度末	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计

2014年12月31日						
资产						
银行存款	41,591,341.00	—	—	—	—	41,591,341.00
结算备付金	15,023,628.98	—	—	—	—	15,023,628.98
存出保证金	145,620.23	—	—	—	—	145,620.23
交易性金融资产	20,158,130.00	133,850,264.40	134,256,825.86	321,082,000.00	43,115,973.24	652,463,193.50
应收证券清算款	—	—	—	—	8,992,306.23	8,992,306.23
应收利息	—	—	—	—	14,239,739.78	14,239,739.78
应收申购款	—	—	—	—	11,810,515.44	11,810,515.44
资产总计	76,918,720.21	133,850,264.40	134,256,825.86	321,082,000.00	78,158,534.69	744,266,345.16
负债						
卖出回购金融资产款	214,199,460.70	—	—	—	—	214,199,460.70
应付证券清算款	—	—	—	—	94,906.46	94,906.46
应付赎回款	—	—	—	—	1,573,327.85	1,573,327.85
应付管理人报酬	—	—	—	—	250,960.77	250,960.77
应付托管费	—	—	—	—	71,703.07	71,703.07
应付销售服务费	—	—	—	—	499,227.47	499,227.47
应付交易费用	—	—	—	—	817,723.83	817,723.83
应交税费	—	—	—	—	688,737.74	688,737.74
应付利息	—	—	—	—	76,135.50	76,135.50
其他负债	—	—	—	—	455,297.02	455,297.02
负债总计	214,199,460.70	—	—	—	4,528,019.71	218,727,480.41
利率敏感度缺口	-137,280,740.49	133,850,264.40	134,256,825.86	321,082,000.00	73,630,514.98	525,538,864.75

6.4.12.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 （2015年6月30日）	上年度末 （2014年12月31日）
	市场利率下降27个基点	22,648,041.90	5,145,722.04
	市场利率上升27个基点	-22,648,041.90	-5,145,722.04

6.4.12.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.12.4.3 其他价格风险

其他市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投

资于证券交易所上市的股票和债券以及银行间同业市场交易的债券，所面临的最大其他市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括VaR(Value at Risk)等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.12.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日		上年度末 2014年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	368,435,155.19	15.45	43,115,973.24	8.20
交易性金融资产-基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产-债券投资	2,310,861,875.42	96.89	609,347,220.26	115.95
交易性金融资产-贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产-权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	2,679,297,030.61	112.34	652,463,193.50	124.15

6.4.12.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	在95%的置信区间内，于2015年6月30日，基金资产组合的市场价格风险VaR值为0.51%(2014: 0.39%)		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位：人民币元)	
		本期末 (2015年6月30日)	上年度末 (2014年12月31日)
		-12,163,780.17	-2,048,024.96

注：上述风险价值VaR的分析是基于资产负债表日所持证券过去一年市场价格波动情况而有可能发生的最大损失，且此变动适用于本基金所有的衍生工具及非衍生金融工具。取95%的置信度是基于本基金所持有的金融工具风险度量的要求。2014年的分析同样基于该假设。

6.4.13 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

以公允价值计量的金融工具

下表按公允价值三个层级列示了以公允价值计量的金融资产工具于2014年6月30日的账面价值。公允价值计量中的层级取决于对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值。三个层级的定义如下：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价；

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除市场报价以外的有关资产或负债的输入值；

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

单位：人民币元

项目	第一层级	第二层级	第三层级	合计
交易性金融资产				
股票投资	368,435,155.19	—	—	368,435,155.19
债券投资	11,322,475.16	2,299,539,400.26	—	2,310,861,875.42
合计	379,757,630.35	2,299,539,400.26	—	2,679,297,030.61

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	368,435,155.19	12.39
	其中：股票	368,435,155.19	12.39
2	固定收益投资	2,310,861,875.42	77.73
	其中：债券	2,310,861,875.42	77.73
	资产支持证券	—	—
3	贵金属投资	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	银行存款和结算备付金合计	170,654,885.08	5.74
7	其他资产	122,804,543.53	4.13
8	合计	2,972,756,459.22	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	273,146,694.40	11.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	3,535,674.19	0.15
F	批发和零售业	447,200.00	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	91,304,906.92	3.83
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—

0	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	679.68	—
S	综合	—	—
	合计	368,435,155.19	15.45

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

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（%）
1	300124	汇川技术	883,947	42,429,456.00	1.78
2	002236	大华股份	1,152,290	36,781,096.80	1.54
3	300146	汤臣倍健	829,843	32,596,233.04	1.37
4	300369	绿盟科技	476,005	24,276,255.00	1.02
5	300077	国民技术	550,000	23,397,000.00	0.98
6	603019	中科曙光	228,023	19,744,511.57	0.83
7	002104	恒宝股份	800,000	18,952,000.00	0.79
8	600571	信雅达	130,000	13,760,500.00	0.58
9	300020	银江股份	497,987	13,694,642.50	0.57
10	002407	多氟多	409,593	11,677,496.43	0.49
11	600867	通化东宝	520,000	11,403,600.00	0.48
12	300353	东土科技	178,134	10,294,363.86	0.43
13	002339	积成电子	229,976	7,681,198.40	0.32
14	002405	四维图新	158,665	6,949,527.00	0.29
15	300005	探路者	250,000	6,850,000.00	0.29
16	300028	金亚科技	244,114	6,591,078.00	0.28
17	300378	鼎捷软件	80,000	6,491,200.00	0.27
18	002253	川大智胜	144,673	6,445,182.15	0.27
19	300373	扬杰科技	98,000	6,362,160.00	0.27
20	300195	长荣股份	210,000	5,953,500.00	0.25
21	300228	富瑞特装	70,000	5,583,200.00	0.23
22	002189	利达光电	180,984	5,436,759.36	0.23
23	002385	大北农	400,000	5,408,000.00	0.23
24	300170	汉得信息	220,000	5,343,800.00	0.22
25	300253	卫宁软件	99,911	5,195,372.00	0.22
26	600410	华胜天成	100,998	4,831,744.32	0.20
27	002184	海得控制	100,000	4,592,000.00	0.19
28	002047	宝鹰股份	200,000	2,556,000.00	0.11
29	300400	劲拓股份	49,993	2,306,677.02	0.10

30	600699	均胜电子	54,113	2,073,069.03	0.09
31	300248	新开普	50,000	2,008,000.00	0.08
32	300007	汉威电子	26,157	1,954,451.04	0.08
33	300166	东方国信	53,940	1,937,524.80	0.08
34	300238	冠昊生物	40,000	1,630,800.00	0.07
35	300205	天喻信息	50,000	1,507,500.00	0.06
36	002073	软控股份	50,000	1,155,000.00	0.05
37	002375	亚厦股份	33,539	979,674.19	0.04
38	600998	九州通	20,000	447,200.00	0.02
39	300016	北陆药业	10,000	427,100.00	0.02
40	002230	科大讯飞	10,000	349,400.00	0.01
41	000733	振华科技	9,200	248,308.00	0.01
42	002664	信质电机	1,252	45,084.52	0.00
43	002675	东诚药业	874	39,880.62	0.00
44	002401	中海科技	901	21,759.15	0.00
45	002074	东源电器	453	11,238.93	0.00
46	002094	青岛金王	514	9,925.34	0.00
47	603555	贵人鸟	63	2,632.14	0.00
48	600518	康美药业	66	1,170.18	0.00
49	300291	华录百纳	18	679.68	0.00
50	603456	九洲药业	4	204.12	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

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(%)
1	601788	光大证券	118,267,155.39	22.50
2	600999	招商证券	99,818,478.86	18.99
3	601688	华泰证券	83,957,634.25	15.98
4	300124	汇川技术	75,062,176.75	14.28
5	002236	大华股份	74,565,337.25	14.19
6	601601	中国太保	58,808,249.99	11.19
7	300253	卫宁软件	57,468,595.89	10.94
8	601555	东吴证券	51,444,475.19	9.79
9	601628	中国人寿	51,171,091.00	9.74
10	300146	汤臣倍健	49,735,361.26	9.46
11	600410	华胜天成	48,977,466.65	9.32
12	002073	软控股份	43,567,964.97	8.29
13	300369	绿盟科技	42,294,680.36	8.05

14	600271	航天信息	41,134,850.30	7.83
15	002081	金螳螂	40,449,637.68	7.70
16	002496	辉丰股份	38,941,624.48	7.41
17	600998	九州通	37,984,825.96	7.23
18	002407	多氟多	37,025,938.56	7.05
19	603019	中科曙光	35,171,829.32	6.69
20	601901	方正证券	35,133,701.60	6.69
21	002108	沧州明珠	34,064,115.48	6.48
22	002189	利达光电	32,879,603.65	6.26
23	002268	卫士通	32,354,540.60	6.16
24	300077	国民技术	31,155,751.85	5.93
25	300378	鼎捷软件	30,827,185.63	5.87
26	600699	均胜电子	30,518,694.05	5.81
27	300033	同花顺	29,803,023.10	5.67
28	603555	贵人鸟	28,497,833.92	5.42
29	002385	大北农	28,178,909.24	5.36
30	300020	银江股份	27,709,095.10	5.27
31	300016	北陆药业	27,570,559.51	5.25
32	300246	宝莱特	26,335,748.20	5.01
33	600571	信雅达	25,509,759.19	4.85
34	300005	探路者	25,294,327.09	4.81
35	600518	康美药业	24,970,066.30	4.75
36	002094	青岛金王	24,729,313.11	4.71
37	002375	亚厦股份	23,815,051.14	4.53
38	002184	海得控制	22,643,196.69	4.31
39	601377	兴业证券	21,016,650.84	4.00
40	300007	汉威电子	20,732,526.31	3.95
41	002104	恒宝股份	20,274,174.94	3.86
42	002253	川大智胜	20,185,812.06	3.84
43	601336	新华保险	19,197,321.74	3.65
44	002405	四维图新	19,061,303.09	3.63
45	300028	金亚科技	18,103,203.50	3.44
46	300207	欣旺达	17,693,382.48	3.37
47	600158	中体产业	17,131,048.37	3.26
48	000555	神州信息	16,825,627.83	3.20
49	600633	浙报传媒	16,566,009.30	3.15
50	002664	信质电机	16,405,686.08	3.12
51	000538	云南白药	16,388,252.78	3.12
52	002339	积成电子	15,514,959.28	2.95
53	600521	华海药业	15,233,880.36	2.90

54	600109	国金证券	14,461,279.40	2.75
55	600717	天津港	14,233,497.24	2.71
56	002139	拓邦股份	13,425,755.72	2.55
57	601318	中国平安	13,190,005.02	2.51
58	603005	晶方科技	13,115,476.16	2.50
59	600196	复星医药	13,064,914.32	2.49
60	300353	东土科技	13,036,171.00	2.48
61	000768	中航飞机	12,773,077.84	2.43
62	600867	通化东宝	12,551,982.04	2.39
63	300349	金卡股份	10,978,804.21	2.09
64	600895	张江高科	10,614,515.00	2.02

注：本项“买入/卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑其它交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601788	光大证券	118,903,124.51	22.62
2	600999	招商证券	99,377,316.72	18.91
3	601688	华泰证券	84,230,924.66	16.03
4	601601	中国太保	59,468,017.59	11.32
5	300253	卫宁软件	59,281,611.75	11.28
6	002081	金螳螂	53,606,066.50	10.20
7	601555	东吴证券	53,003,782.46	10.09
8	002073	软控股份	52,536,216.37	10.00
9	601628	中国人寿	49,931,695.04	9.50
10	600410	华胜天成	49,489,186.56	9.42
11	600998	九州通	46,155,063.27	8.78
12	002108	沧州明珠	43,631,234.90	8.30
13	002496	辉丰股份	43,509,920.37	8.28
14	300246	宝莱特	42,820,272.41	8.15
15	600271	航天信息	41,512,973.35	7.90
16	300016	北陆药业	39,411,564.24	7.50
17	601901	方正证券	36,001,667.23	6.85
18	300124	汇川技术	34,970,338.96	6.65
19	002268	卫士通	33,503,506.98	6.38
20	600699	均胜电子	33,413,373.60	6.36
21	002189	利达光电	33,277,067.54	6.33
22	603555	贵人鸟	32,643,679.38	6.21
23	002407	多氟多	32,078,270.32	6.10

24	300378	鼎捷软件	30,980,686.50	5.90
25	002236	大华股份	29,322,953.38	5.58
26	300033	同花顺	28,803,373.59	5.48
27	002405	四维图新	27,816,089.49	5.29
28	002094	青岛金王	27,340,911.06	5.20
29	002385	大北农	26,819,773.89	5.10
30	600518	康美药业	26,303,492.00	5.01
31	300007	汉威电子	24,898,650.72	4.74
32	300005	探路者	24,163,026.89	4.60
33	002375	亚厦股份	24,088,259.48	4.58
34	300207	欣旺达	21,127,056.18	4.02
35	000555	神州信息	20,562,837.46	3.91
36	300020	银江股份	20,271,787.45	3.86
37	601377	兴业证券	20,243,299.99	3.85
38	300369	绿盟科技	19,582,535.88	3.73
39	600158	中体产业	19,404,345.09	3.69
40	601336	新华保险	18,995,534.99	3.61
41	300146	汤臣倍健	18,595,662.51	3.54
42	600633	浙报传媒	18,104,977.00	3.45
43	002664	信质电机	17,240,036.49	3.28
44	002253	川大智胜	16,409,863.00	3.12
45	000538	云南白药	16,239,550.96	3.09
46	002139	拓邦股份	15,664,832.47	2.98
47	600717	天津港	15,393,163.08	2.93
48	600109	国金证券	14,943,324.00	2.84
49	600571	信雅达	14,876,595.42	2.83
50	000768	中航飞机	14,763,929.16	2.81
51	002184	海得控制	14,683,265.61	2.79
52	600521	华海药业	13,856,238.35	2.64
53	603005	晶方科技	13,617,439.50	2.59
54	300275	梅安森	13,530,258.66	2.57
55	300352	北信源	13,003,475.55	2.47
56	601318	中国平安	12,845,593.88	2.44
57	300349	金卡股份	12,789,114.12	2.43
58	600196	复星医药	12,463,819.63	2.37
59	603019	中科曙光	10,962,181.00	2.09
60	000861	海印股份	10,548,638.55	2.01

注：本项“买入/卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑其它交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	2,365,642,922.44
卖出股票的收入（成交）总额	2,186,730,444.84

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”和“卖出股票的收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑其他交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	1,695,257,400.26	71.08
5	企业短期融资券	523,249,000.00	21.94
6	中期票据	81,033,000.00	3.40
7	可转债	11,322,475.16	0.47
8	其他	—	—
9	合计	2,310,861,875.42	96.89

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	011599094	15华强SCP002	700,000	70,392,000.00	2.95
2	011599099	15桂建工SCP002	600,000	60,228,000.00	2.53
3	1480284	14武安债	500,000	53,350,000.00	2.24
4	1380005	13资阳城投债	500,000	51,830,000.00	2.17
5	112238	15振业债	500,000	51,005,000.00	2.14

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内本基金投资的前十名证券中，多氟多（002407）的发行主体于2015年2月3日收到深圳证券交易所中小板公司管理部《关于对多氟多化工股份有限公司未及时披露诉讼进展情况的监管函》（中小板监管函【2015】第10号）。监管函认为，公司未及时披露诉讼进展情况的行为违反了深交所《股票上市规则（2014修订）》第2.1条、第11.1.1条、第11.1.5条的规定。

对该股票投资决策程序的说明：研究发展部按照内部研究工作规范对该股票进行分析后将其列入基金投资对象备选库并跟踪研究。在此基础上本基金的基金经理根据具体市场情况独立作出投资决策。该责令整改事件发生后，本基金管理人对该股票的发行主体进行了进一步了解与分析，认为此事件未对该股票投资价值判断产生重大的实质性影响。本基金投资于该股票的投资决策过程符合制度规定的投资权限范围与投资决策程序。

报告期内本基金投资的前十名证券中其余九名的发行主体未出现被监管部门立案调查或在报告编制期日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 报告期内本基金投资的前十名股票中，不存在超出基金合同规定备选股票库的情形。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	814,144.86
2	应收证券清算款	59,718,277.42
3	应收股利	—
4	应收利息	59,395,491.91
5	应收申购款	2,876,629.34
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	122,804,543.53

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	128009	歌尔转债	272,625.26	0.01

7.12.5 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。

7.12.6 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，分项之和与合计项可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人 户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
12,595	139,383.41	1,488,710,114.53	84.80%	266,823,899.08	15.20%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	1,039,780.66	0.06%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0-10
本基金基金经理持有本开放式基金	0-10

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2008年12月29日)基金份额总额	819,356,829.46
本报告期期初基金份额总额	377,345,769.48
本报告期基金总申购份额	8,939,543,041.24
减：本报告期基金总赎回份额	7,561,354,797.11
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	1,755,534,013.61

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末召开本基金的基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

10.2.1 基金管理人重大人事变动

本报告期内，原董事长田丹先生离职，覃波先生自2015年4月28日起代为履行董事长（法定代表人）职责。因新任董事长（法定代表人）叶焯先生自2015年7月21日起正式任职，覃波先生自该日起不再代为履行董事长（法定代表人）职责，本基金管理人已按相关规定进行备案，并及时办理法定代表人的工商变更登记等相关手续。

自2015年4月29日起，本基金管理人增聘邵彦明先生、李小羽先生为副总经理。

上述重大人事变动情况，本基金管理人均已在指定信息披露媒体发布相应的《关于基金行业高级管理人员变更公告》。

10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期没有涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略没有改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金未更换会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期基金管理人、托管人及其高级管理人员没有受监管部门稽查或处罚的情形。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
招商证券	2	1,365,894,843.10	30.01%	1,243,509.56	30.30%	
海通证券	2	1,027,405,785.56	22.57%	895,009.50	21.81%	
宏源证券	1	815,866,743.75	17.92%	742,764.36	18.10%	
中金公司	1	806,450,479.97	17.72%	734,190.49	17.89%	
银河证券	1	281,518,579.14	6.18%	256,294.73	6.25%	
中信证券	1	254,498,723.01	5.59%	231,695.58	5.65%	
中邮证券	1	—	—	—	—	
北京高华证券	1	—	—	—	—	
华泰证券	1	—	—	—	—	
安信证券	1	—	—	—	—	
日信证券	1	—	—	—	—	
国元证券	1	—	—	—	—	
中信建投	1	—	—	—	—	
瑞银证券	1	—	—	—	—	
国联证券	1	—	—	—	—	

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	债券交易		债券回购交易	
		成交金额	占当期债券成交总额比例	成交金额	占当期债券回购成交总额比例
招商证券	2	1,149,031,435.03	32.05%	6,725,800,000.00	36.76%
海通证券	2	964,111,027.64	26.90%	5,762,000,000.00	31.49%
宏源证券	1	147,138,084.54	4.10%	960,000,000.00	5.25%
中金公司	1	854,221,124.09	23.83%	4,356,900,000.00	23.81%
银河证券	1	197,857,684.80	5.52%	364,050,000.00	1.99%
中信证券	1	—	—	130,000,000.00	0.71%

中邮证券	1	—	—	—	—
北京高华 证券	1	272,357,070.80	7.60%	—	—
华泰证券	1	—	—	—	—
安信证券	1	—	—	—	—
日信证券	1	—	—	—	—
国元证券	1	—	—	—	—
中信建投	1	—	—	—	—
瑞银证券	1	—	—	—	—
国联证券	1	—	—	—	—

注：1、本报告期租用证券公司交易席位增加海通证券、华泰证券、安信证券交易单元各一个。

2、专用交易单元的选择标准和程序

根据中国证监会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》（证监基字<1998>29号）和《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，本公司制定了租用证券公司专用交易单元的选择标准和程序。

（1）选择标准：

- a、券商基本面评价（财务状况、经营状况）；
- b、券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）；
- c、券商每日信息评价（及时性和有效性）；
- d、券商协作表现评价。

（2）选择程序：

首先根据租用证券公司专用交易单元的选择标准形成《券商服务评价表》，然后根据评分高低进行选择基金专用交易单元。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金2014年12月31日资产净值的公告	上证报、中证报、 证券时报	2015-1-1
2	长信基金管理有限责任公司关于增加西南证券股份有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通定期定额投资业务及转换业务的公告	上证报、中证报、 证券时报、证券日 报	2015-1-15

3	长信利丰债券型证券投资基金 2014 年第 4 季度报告	中证报、证券时报	2015-1-21
4	长信利丰债券型证券投资基金更新的招募说明书（2015 年【1】号）及摘要	中证报、证券时报	2015-2-11
5	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式证券投资基金的分红预告	上证报、中证报、 证券时报	2015-2-14
6	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式证券投资基金在中国工商银行股份有限公司开通转换业务的公告	上证报、中证报、 证券时报	2015-3-4
7	长信基金管理有限责任公司关于长信利丰债券型证券投资基金 2015 年第一次分红公告	中证报、证券时报	2015-3-21
8	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金在长江证券股份有限公司开通转换、定期定额投资业务并参加基金网上交易系统及手机证券交易系统申购、定期定额投资申购费率优惠的公告	上证报、中证报、 证券时报、证券日 报	2015-3-23
9	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金在中山证券有限责任公司开通转换、定期定额投资业务及参加申购、定期定额投资申购费率优惠的公告	上证报、中证报、 证券时报、证券日 报	2015-3-23
10	长信利丰债券型证券投资基金 2014 年年报及摘要	中证报、证券时报	2015-3-28
11	长信利丰债券型证券投资基金 2015 年第 1 季度报告	中证报、证券时报	2015-4-20
12	长信基金管理有限责任公司关于增加广州证券股份有限公司为旗下基金代销机构的公告	上证报、中证报、 证券时报、证券日 报	2015-4-29
13	长信基金管理有限责任公司关于在平安银行股份有限公司开通旗下部分开放式基金定期定额投资业务的公告	上证报、中证报、 证券时报、证券日 报	2015-5-12
14	长信基金管理有限责任公司关于增加宜信普泽投资顾问（北京）有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通定期定额投资业务、参加申购（含定投申购）费率优惠活动及开通转换业务的公告	上证报、中证报、 证券时报、证券日 报	2015-6-11
15	长信基金管理有限责任公司关于在第一创业证券股份有限公司开通旗下部分开放式基金的定期定额投资业务并参加基金申购、定期定额投资费率优惠活动的公告	上证报、中证报 证券时报、证券日 报	2015-6-25

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立基金的文件；
- 2、《长信利丰债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长信利丰债券型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《长信利丰债券型证券投资基金托管协议》；
- 5、报告期内在指定报刊上披露的各种公告的原稿；
- 6、长信基金管理有限责任公司营业执照、公司章程及相关资格批复文件。

11.2 存放地点

基金管理人的办公场所

11.3 查阅方式

投资者可在有效的工作时间内免费查阅，在支付工本费后，也可在有效的工作时间内取得上述文件的复制件或复印件。

长信基金管理有限责任公司

二〇一五年八月二十七日