

长信纯债一年定期开放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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司，根据本基金合同规定，于2015年8月25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	6
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	10
4.1	基金管理人及基金经理情况	10
4.2	管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	11
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	14
§ 5	托管人报告	15
5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	15
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	15
5.3	托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§ 6	半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1	资产负债表	16
6.2	利润表	17
6.3	所有者权益（基金净值）变动表	18
6.4	报表附注	19
§ 7	投资组合报告	38
7.1	期末基金资产组合情况	38
7.2	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股票投资明细	38
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	38
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	39
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	39
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	39
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	39
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	39
7.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	39
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	40
7.12	投资组合报告附注	40
§ 8	基金份额持有人信息	41
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	41
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况	41
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	41
§ 9	开放式基金份额变动	42

§ 10 重大事件揭示.....	43
10.1 基金份额持有人大会决议.....	43
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.....	43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	43
10.4 基金投资策略的改变.....	43
10.5 基金改聘会计师事务所情况.....	43
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况.....	43
10.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	44
10.8 其他重大事件.....	44
§ 11 备查文件目录.....	46
11.1 备查文件目录.....	46
11.2 存放地点.....	46
11.3 查阅方式.....	46

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金	
基金简称	长信纯债一年定开债券	
场内简称	CX纯债	
基金主代码	519973	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年11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	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	835,630,156.08份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	长信纯债一年定开债券A	长信纯债一年定开债券C
下属分级基金的交易代码	519973	519972
报告期末下属分级基金的份额总额	211,125,953.28份	624,504,202.80份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为纯债基金，以获取高于银行一年期定期存款利率（税后） $\times 1.3+1.1\%$ 的回报为目标，追求每年较高的绝对回报。
投资策略	<p>（一）封闭期投资策略</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、资产配置策略 2、类属配置策略 3、个券选择策略 4、骑乘策略 5、息差策略 6、利差策略 7、资产支持证券的投资策略 <p>（二）开放期投资策略</p> <p>开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资的前提下，将主要投资于流动性高的投资品种，减小基金净值的波动。</p>
业绩比较基准	银行一年定期存款利率（税后） $\times 1.3+1.1\%$
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，其预期风险与收益高于货币市场基金，低于混合基金和股票型基金。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	周永刚	赵会军
	联系电话	021-61009999	010-66105799
	电子邮箱	zhouyg@cxfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4007005566	95588
传真		021-61009800	010-66105778
注册地址		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55号
办公地址		上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心9楼	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		200120	100140
法定代表人		田丹	姜建清

注：自2015年7月21日起，叶烨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、上海证券报、证券时报和证券日报
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号时代金融中心9楼、北京市西城区复兴门内大街55号

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	北京市西城区太平桥大街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

	报告期（2015年1月1日—2015年6月30日）	
3.1.1 期间数据和指标	长信纯债一年定开债券A	长信纯债一年定开债券C
本期已实现收益	8,351,639.66	23,346,779.34
本期利润	11,862,802.67	33,717,626.61
加权平均基金份额本期利润	0.0562	0.0540
本期基金加权平均净值利润率	5.31%	5.12%
本期基金份额净值增长率	5.48%	5.27%
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	13,078,775.72	36,667,429.53
期末可供分配基金份额利润	0.0619	0.0587
期末基金资产净值	227,961,848.58	672,243,261.90
期末基金份额净值	1.0797	1.0764
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	18.96%	18.18%

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、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、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。

3.2 基金净值表现

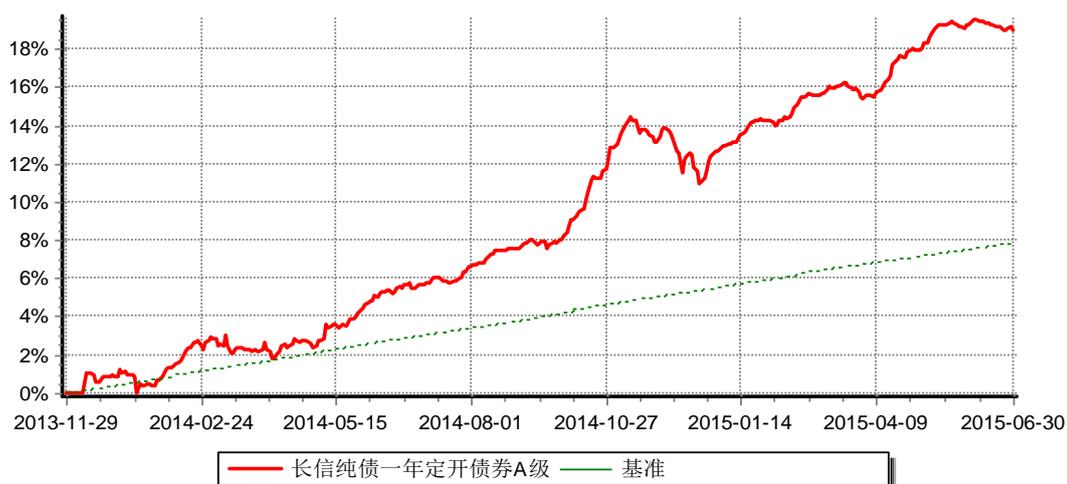
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 (长信纯债一年定开 债券A)	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	-0.18%	0.07%	0.33%	0.01%	-0.51%	0.06%
过去三个月	2.99%	0.11%	1.04%	0.01%	1.95%	0.10%
过去六个月	5.48%	0.10%	2.18%	0.01%	3.30%	0.09%
过去一年	12.82%	0.17%	4.75%	0.01%	8.07%	0.16%
自基金合同生效日起至今（2013年11月29日-2015年6月30日）	18.96%	0.18%	7.86%	0.01%	11.10%	0.17%
阶段 (长信纯债一年定开债券C)	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	-0.22%	0.07%	0.33%	0.01%	-0.55%	0.06%
过去三个月	2.88%	0.11%	1.04%	0.01%	1.84%	0.10%
过去六个月	5.27%	0.11%	2.18%	0.01%	3.09%	0.10%
过去一年	12.35%	0.17%	4.75%	0.01%	7.60%	0.16%
自基金合同生效日起至今（2013年11月29日-2015年6月30日）	18.18%	0.18%	7.86%	0.01%	10.32%	0.17%

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

3.2.2.1 自基金合同生效以来长信纯债一年定开债券 A 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



3.2.2.2 自基金合同生效以来长信纯债一年定开债券 C 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、本基金基金合同生效日为2013年11月29日，图示日期为2013年11月29日至2015年6月30日。

2、按基金合同规定，本基金自合同生效日起6个月内为建仓期，建仓期结束时，本基金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		
吴哲	本基金的基金经理	2014年12月17日	—	6年	运筹学与控制论硕士，复旦大学研究生毕业，具备基金从业资格。曾任职于汇丰晋信基金管理有限责任公司，担任债券研究员；2013年加入长信基金管理有限责任公司，担任公司固定收益部基金经理助理，现任本基金的基金经理。
李小羽	本基金、长信利丰债券型证券投资基金、长信可转债	2013年11月29日	2015年3月25日	17年	曾任本基金的基金经理。

	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				
--	--	--	--	--	--

注：1、首任基金经理任职日期以本基金成立之日为准；新增或变更以刊登新增/变更基金经理的公告披露日为准。

2、本基金基金经理的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。2015年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2015年6月30日，长信纯债一年定开债券A份额净值为1.0797元，份额累计净值为1.1847元，本报告期内长信纯债一年定开债券A净值增长率为5.48%；长信纯债一年定开债券C份额净值为1.0764元，份额累计净值为1.1774元，本报告期内长信纯债一年定开债券C净值增长率为5.27%。同期业绩比较基准收益率为2.18%。

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》的规定，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，本基金本报告期没有进行利润分配。

本基金收益分配原则如下：

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金在每个封闭期内收益至少分配1次，每份基金份额每次收益分配比例原则上为收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）每份基金份额可供分配利润的100%。

2、由于本基金A类基金份额不收取销售服务费，而C类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。

3、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利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。

4、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

5、法律法规或监管机关另有规定的，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

本报告期内，本基金托管人在对长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金的管理人——长信基金管理有限责任公司在长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对长信基金管理有限公司编制和披露的长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金2015年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 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：长信纯债一年定期开放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	41,609,662.21	4,421,196.56
结算备付金		8,851,121.07	2,220,694.41
存出保证金		60,400.48	73,700.60
交易性金融资产	6.4.6.2	1,389,843,589.46	1,432,422,665.03
其中：股票投资		—	—
基金投资		—	—
债券投资		1,389,843,589.46	1,432,422,665.03
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	10,000,125.00	—
应收证券清算款		230,460.54	2,994,295.37
应收利息	6.4.6.5	33,067,433.60	34,750,490.07
应收股利		—	—
应收申购款		—	—
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.6.6	—	—
资产总计		1,483,662,792.36	1,476,883,042.04
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年06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		573,198,615.00	616,852,305.80
应付证券清算款		8,953,836.56	4,037,152.26
应付赎回款		—	—
应付管理人报酬		519,245.51	335,584.58

应付托管费		148,355.86	95,881.29
应付销售服务费		221,583.96	133,585.49
应付交易费用	6.4.6.7	18,005.43	15,759.03
应交税费		—	—
应付利息		199,683.47	248,092.39
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	6.4.6.8	198,356.09	540,000.00
负债合计		583,457,681.88	622,258,360.84
所有者权益：			
实收基金	6.4.6.9	835,630,156.08	835,630,156.08
未分配利润	6.4.6.10	64,574,954.40	18,994,525.12
所有者权益合计		900,205,110.48	854,624,681.20
负债和所有者权益总计		1,483,662,792.36	1,476,883,042.04

注：报告截止日2015年6月30日，基金份额净值1.0773元，基金份额总额835,630,156.08份。其中长信纯债一年定开债券A份额净值为1.0797元，份额总额211,125,953.28份，长信纯债一年定开债券C份额净值为1.0764元，份额总额624,504,202.80份。

6.2 利润表

会计主体：长信纯债一年定期开放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		63,954,514.58	19,484,825.72
1. 利息收入		45,779,971.47	15,108,640.50
其中：存款利息收入	6.4.6.11	124,808.32	2,524,926.24
债券利息收入		45,654,877.19	12,407,866.58
资产支持证券利息收入		—	45,369.86
买入返售金融资产收入		285.96	130,477.82
其他利息收入		—	—
2. 投资收益		4,292,532.83	3,031,621.67
其中：股票投资收益	6.4.6.12	—	—
基金投资收益		—	—
债券投资收益	6.4.6.13	4,292,532.83	3,031,621.67

资产支持证券投资收益		—	—
贵金属投资收益		—	—
衍生工具收益	6.4.6.14	—	—
股利收益	6.4.6.15	—	—
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.6.16	13,882,010.28	1,344,561.08
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.6.17	—	2.47
减：二、费用		18,374,085.30	6,802,987.21
1. 管理人报酬		3,061,015.76	1,079,702.28
2. 托管费		874,575.95	308,486.27
3. 销售服务费		1,306,534.90	199,291.05
4. 交易费用	6.4.6.18	21,565.56	14,082.14
5. 利息支出		12,827,561.86	4,941,789.22
其中：卖出回购金融资产支出		12,827,561.86	4,941,789.22
6. 其他费用	6.4.6.19	282,831.27	259,636.25
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		45,580,429.28	12,681,838.51
减：所得税费用		—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		45,580,429.28	12,681,838.51

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长信纯债一年定期开放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)	835,630,156.08	18,994,525.12	854,624,681.20
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	45,580,429.28	45,580,429.28
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）	—	—	—
其中：1. 基金申购款	—	—	—
2. 基金赎回款	—	—	—

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)	835,630,156.08	64,574,954.40	900,205,110.48
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)	303,045,141.71	3,564,015.71	306,609,157.42
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	12,681,838.51	12,681,838.51
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)	—	—	—
其中：1. 基金申购款	—	—	—
2. 基金赎回款	—	—	—
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)	303,045,141.71	16,245,854.22	319,290,995.93

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4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

长信纯债一年定期开放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”)《关于核准长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金募集的批复》(证监许可[2013]911号)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《长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于2013年11月29日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集规模为303,045,141.71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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金于2013年10月28日至2013年11月22日募集，募集资金总额人民币302,940,982.40元，利息转份额人民币104,159.31元，募集规模为303,045,141.71份。上述募集资金已由毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)验证，并出具了毕马威华振验字第1300470号验资报告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》和《长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超级短期融资券、资产支持证券、次级债券、可分离交易可转债的纯债部分、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。

本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产，也不参与一级市场的新股申购或增发新股，可转债仅投资二级市场可分离交易可转债的纯债部分。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，其投资比例遵循届时有效法律法规或相关规定。

本基金的投资组合比例为：投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%，但在每次开放期前三个月、开放期及开放期结束后三个月的期间内，基金投资不受上述比例限制；开放期内，现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%，在非开放期，本基金不受该比例的限制。

本基金的业绩比较基准为银行一年期定期存款利率（税后） $\times 1.3 + 1.1\%$

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》、《长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注6.4.4所列示的基金行业实务操作的规定编制财务报表。

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的财务状况、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

本报告期本基金无重大会计差错。

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2013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税。

(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。

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	41,609,662.21
定期存款	—
其中：存款期限1-3个月	—
其他存款	—
合计	41,609,662.21

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	估值增值
股票	—	—	—
债券	交易所市场	615,819,791.73	3,427,147.73
	银行间市场	759,327,449.14	11,269,200.86
	合计	1,375,147,240.87	14,696,348.59
资产支持证券	—	—	—
基金	—	—	—
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—
其他	—	—	—
合计	1,375,147,240.87	1,389,843,589.46	14,696,348.59

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

6.4.6.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
银行间市场	10,000,125.00	—
合计	10,000,125.00	—

6.4.6.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

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	3,428.00
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	3,584.70
应收债券利息	33,060,110.46
应收买入返售证券利息	285.96
应收申购款利息	—
应收黄金合约拆借孳息	—

其他	24.48
合计	33,067,433.60

注：其他为应收资产支持证券利息和应收保证金利息。

6.4.6.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

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	—
银行间市场应付交易费用	18,005.43
合计	18,005.43

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	—
预提信息披露费-上证报	49,588.57
预提信息披露费-中证报	39,671.58
预提信息披露费-证券时报	39,671.58
预提信息披露费_证券日报	39,671.58
预提审计费	29,752.78
合计	198,356.09

6.4.6.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目 (长信纯债一年定开债券A)	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	211,125,953.28	211,125,953.28
本期申购	—	—
本期赎回(以“—”号填列)	—	—
期末数	211,125,953.28	211,125,953.28
项目 (长信纯债一年定开债券C)	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	624,504,202.80	624,504,202.80
本期申购	—	—

本期赎回（以“—”号填列）	—	—
期末数	624,504,202.80	624,504,202.80

6.4.6.10 未分配利润

单位：人民币元

项目 (长信纯债一年定开债券A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,727,136.06	245,956.57	4,973,092.63
本期利润	8,351,639.66	3,511,163.01	11,862,802.67
本期基金份额交易产生的变动数	—	—	—
其中：基金申购款	—	—	—
基金赎回款	—	—	—
本期已分配利润	—	—	—
本期末	13,078,775.72	3,757,119.58	16,835,895.30

项目 (长信纯债一年定开债券C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	13,320,650.19	700,782.30	14,021,432.49
本期利润	23,346,779.34	10,370,847.27	33,717,626.61
本期基金份额交易产生的变动数	—	—	—
其中：基金申购款	—	—	—
基金赎回款	—	—	—
本期已分配利润	—	—	—
本期末	36,667,429.53	11,071,629.57	47,739,059.10

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	36,642.28
定期存款利息收入	—
其他存款利息收入	568.98
结算备付金利息收入	87,597.06
其他	—
合计	124,808.32

6.4.6.12 股票投资收益

本基金本报告期内未进行股票投资。

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	4,292,532.83
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	4,292,532.83

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	895,061,519.67
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	862,138,111.29
减：应收利息总额	28,630,875.55
买卖债券差价收入	4,292,532.83

6.4.6.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.6.14 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.6.15 股利收益

本基金本报告期未进行股票投资，无股利收益。

6.4.6.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
1. 交易性金融资产	13,882,010.28
——股票投资	—
——债券投资	13,882,010.28
——资产支持证券投资	—
——基金投资	—
——贵金属投资	—
2. 衍生工具	—
——权证投资	—
3. 其他	—
合计	13,882,010.28

6.4.6.17 其他收入

本基金本报告期末无其他收入。

6.4.6.18 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	14,615.43
银行间市场交易费用	6,950.13
合计	21,565.56

6.4.6.19 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	89,752.78
信息披露费	168,603.31
交易费用_回购	—
权证	—
账户维护费	13,500.00
银行手续费	10,975.18
其他费用	—
合计	282,831.27

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
中国工商银行股份有限公司	基金托管人
长江证券股份有限公司（以下简称“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通过关联方交易单元进行权证交易。

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支付关联方的佣金。

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

关联方名称	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	3,061,015.76	1,079,702.28
其中：支付销售机构的客户维护费	459,154.11	461,749.27

注：基金管理费按前一日基金资产净值0.70%的年费率逐日计提，按月支付。

计算方法： $H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$ （H为每日应计提的基金管理费，E为前一日基金资产净值）。

6.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

关联方名称	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	874,575.95	308,486.27
----------------	------------	------------

注：基金托管费按前一日基金资产净值0.20%的年费率逐日计提，按月支付。

计算方法： $H=E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$ （H为每日应计提的基金托管费，E为前一日基金资产净值）。

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		
	长信纯债一年定开 债券A	长信纯债一年定开 债券C	合计
长信基金管理有限责任公司	—	967,633.59	967,633.59
中国工商银行股份有限公司	—	330,937.90	330,937.90
长江证券	—	107.48	107.48
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		
	长信纯债一年定开 债券A	长信纯债一年定开 债券C	合计
长信基金管理有限责任公司	—	193.48	193.48
中国工商银行股份有限公司	—	196,749.81	196,749.81
长江证券	—	498.90	498.90

注：本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费年费率为0.40%。

销售服务费按照C类基金资产净值的0.40%年费率计提。计算方法如下：

$H=E \times \text{年销售服务费率} \div \text{当年天数}$

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日基金资产净值

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

基金管理人在本报告期及上年度可比期间内均未运用固有资金投资本基金。

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
中国工商银行股份有限公司	41,609,662.21	36,642.28	1,696,272.74	28,283.58

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

本基金本报告期末无其他需要说明的关联交易事项。

6.4.10 利润分配情况

本报告期本基金未进行利润分配。

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

本基金本报告期末未因认购新发/增发证券而持有流通受限证券。

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，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额303,198,825.20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
1380068	13 华峰债	2015-7-6	100.92	600,000	60,552,000.00

1380311	13平天湖债	2015-7-7	102.77	100,000	10,277,000.00
1480259	14安吉债	2015-7-1	106.92	270,000	28,868,400.00
1480342	14恩施城投债	2015-7-6	104.99	200,000	20,998,000.00
1480345	14海东债	2015-7-7	105.16	100,000	10,516,000.00
1480475	14娄底梯都债	2015-7-10	105.32	200,000	21,064,000.00
1480231	14南化债	2015-7-7	107.72	300,000	32,316,000.00
1480192	14宁国债	2015-7-10	106.37	200,000	21,274,000.00
1480235	14潜江城投债	2015-7-7	106.68	100,000	10,668,000.00
1480542	14三门债01	2015-7-10	102.38	200,000	20,476,000.00
1480485	14随州建投债	2015-7-10	105.00	300,000	31,500,000.00
1480198	14遂河投债	2015-7-6	107.07	200,000	21,414,000.00
1480479	14新密财源债	2015-7-10	106.37	300,000	31,911,000.00
合计				3,070,000	321,834,400.00

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，本基金证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额269,999,789.80元，于2015年6月30日（左右）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

流动性风险

市场风险

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，本基金管理人已制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及设计相应内部控制流程，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、拒绝支付到期本息等情况，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工商银行股份有限公司，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的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，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为交易对手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	80,676,000.00	314,386,000.00
A-1以下	—	—
未评级	—	—
合计	80,676,000.00	314,386,000.00

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	—	3,036,000.00
AAA以下	1,309,167,589.46	1,115,000,665.03
未评级	—	—
合计	1,309,167,589.46	1,118,036,665.03

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，其余亦可在银行间同业市场交易，除附注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，本基金的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。

本基金的基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过专设的金融工程部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。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。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	41,609,662.21	—	—	—	—	41,609,662.21
结算备付金	8,851,121.07	—	—	—	—	8,851,121.07
存出保证金	60,400.48	—	—	—	—	60,400.48

交易性金融资产	43,295,900.00	80,676,000.00	624,547,565.28	641,324,124.18	—	1,389,843,589.46
买入返售金融资产	10,000,125.00	—	—	—	—	10,000,125.00
应收证券清算款	—	—	—	—	230,460.54	230,460.54
应收利息	—	—	—	—	33,067,433.60	33,067,433.60
资产总计	103,817,208.76	80,676,000.00	624,547,565.28	641,324,124.18	33,297,894.14	1,483,662,792.36
负债						
卖出回购金融资产款	573,198,615.00	—	—	—	—	573,198,615.00
应付证券清算款	—	—	—	—	8,953,836.56	8,953,836.56
应付管理人报酬	—	—	—	—	519,245.51	519,245.51
应付托管费	—	—	—	—	148,355.86	148,355.86
应付销售服务费	—	—	—	—	221,583.96	221,583.96
应付交易费用	—	—	—	—	18,005.43	18,005.43
应付利息	—	—	—	—	199,683.47	199,683.47
其他负债	—	—	—	—	198,356.09	198,356.09
负债总计	573,198,615.00	—	—	—	10,259,066.88	583,457,681.88
利率敏感度缺口	-469,381,406.24	80,676,000.00	624,547,565.28	641,324,124.18	23,038,827.26	900,205,110.48
上年度末 2014年12月31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	4,421,196.56	—	—	—	—	4,421,196.56
结算备付金	2,220,694.41	—	—	—	—	2,220,694.41
存出保证金	73,700.60	—	—	—	—	73,700.60
交易性金融资产	68,782,111.00	328,732,330.49	577,659,843.54	457,248,380.00	—	1,432,422,665.03
应收证券清算款	—	—	—	—	2,994,295.37	2,994,295.37
应收利息	—	—	—	—	34,750,490.07	34,750,490.07
资产总计	75,497,702.57	328,732,330.49	577,659,843.54	457,248,380.00	37,744,785.44	1,476,883,042.04
负债						
卖出回购金融资产款	616,852,305.80	—	—	—	—	616,852,305.80
应付证券清算款	—	—	—	—	4,037,152.26	4,037,152.26
应付管理人报酬	—	—	—	—	335,584.58	335,584.58
应付托管费	—	—	—	—	95,881.29	95,881.29
应付销售服务费	—	—	—	—	133,585.49	133,585.49
应付交易费用	—	—	—	—	15,759.03	15,759.03
应付利息	—	—	—	—	248,092.39	248,092.39
其他负债	—	—	—	—	540,000.00	540,000.00
负债总计	616,852,305.80	—	—	—	5,406,055.04	622,258,360.84
利率敏感度缺口	-541,354,603.23	328,732,330.49	577,659,843.54	457,248,380.00	32,338,730.40	854,624,681.20

注：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分类。

6.4.12.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率之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	14,956,946.56	10,208,998.39
	市场利率上升27个基点	-14,956,946.56	-10,208,998.39

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其他市场价格风险，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)指标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。

2015年6月30日，本基金投资组合中债券投资比例为基金资产净值的154.39%，无股票投资。本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

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	—	—	—	—
交易性金融资产-基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产-债券投资	1,389,843,589.46	154.39	1,432,422,665.03	167.61
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	1,389,843,589.46	154.39	1,432,422,665.03	167.61
----	------------------	--------	------------------	--------

6.4.12.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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。本基金主要投资债券等固定收益品种，因此无重大其他市场价格风险。

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2015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

资产	本期末 2015年6月30日			
	第一层级	第二层级	第三层级	合计
股票投资	-	-	-	-
债券投资	-	1,389,843,589.46	-	1,389,843,589.46
资产支持证券	-	-	-	-
合计	1	1,389,843,589.46	-	1,389,843,589.46

注：本报告期，本基金金融工具的第一层级与第二层级之间没有发生重大转换。

本报告期，本基金金融工具的公允价值估值技术并未发生改变。

§ 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	—	—
	其中：股票	—	—
2	固定收益投资	1,389,843,589.46	93.68
	其中：债券	1,389,843,589.46	93.68
	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	10,000,125.00	0.67
	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	50,460,783.28	3.40
7	其他各项资产	33,358,294.62	2.25
8	合计	1,483,662,792.36	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期内未买入股票。

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

本基金本报告期内未卖出股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未投资股票。

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	1,309,167,589.46	145.43
5	企业短期融资券	80,676,000.00	8.96
6	中期票据	—	—
7	可转债	—	—
8	其他	—	—
9	合计	1,389,843,589.46	154.39

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	1380068	13华峰债	600,000	60,552,000.00	6.73
2	112228	14怡亚债	549,010	56,987,238.00	6.33
3	1480041	14铜旅游	500,000	53,390,000.00	5.93
4	112174	13广田01	490,000	49,725,200.00	5.52
5	112142	12格林债	412,814	43,415,648.38	4.82

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投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

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的发行主体未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。

7.12.2 本基金本报告期末投资股票，不存在投资的前十名股票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	60,400.48
2	应收证券清算款	230,460.54
3	应收股利	—
4	应收利息	33,067,433.60
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	33,358,294.62

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

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

份额级别	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
长信纯债一年定开债券 A	660	319,887.81	142,925,735.39	67.70%	68,200,217.89	32.30%
长信纯债一年定开债券 C	7470	83,601.63	107,811.43	0.02%	624,396,391.37	99.98%
合计	8130	102,783.54	143,033,546.82	17.12%	692,596,609.26	82.88%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	长信纯债一年定开债券A	9,745.45	0.00%
	长信纯债一年定开债券C	1,995.19	0.00%
	合计	11,740.64	0.00%

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	份额级别	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	长信纯债一年定开债券 A	0
	长信纯债一年定开债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	长信纯债一年定开债券 A	0
	长信纯债一年定开债券 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	长信纯债一年定开债券A	长信纯债一年定开债券C
基金合同生效日(2013年11月29日)基金份额总额	205,068,134.62	97,977,007.09
本报告期期初基金份额总额	211,125,953.28	624,504,202.80
本报告期基金总申购份额	—	—
减：本报告期基金总赎回份额	—	—
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期末基金份额总额	211,125,953.28	624,504,202.80

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末未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 报告期内本基金管理人的重大人事变动

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

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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

本报告期本基金投资策略未改变。

10.5 基金改聘会计师事务所情况

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监管部门稽查或处罚的情况

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 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

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		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占债券成交总额比例	成交金额	占债券回购成交总额比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
宏源证券	2	1,649,864,017.98	100.00%	15,437,183,000.00	100.00%	—	—	
国信证券	2	0.00	0.00%	0.00	0.00%	—	—	
安信证券	2	0.00	0.00%	0.00	0.00%	—	—	

注：1、本报告期租用证券公司交易单元的变更情况

本报告期内新增国信证券、安信证券交易单元各两个。

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：

- 1) 券商基本面评价（财务状况、经营状况）；
- 2) 券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）；
- 3) 券商每日信息评价（及时性和有效性）；
- 4) 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	信息披露方式	披露日期
1	长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金更新的招募说明书（2015年【1】号）及摘要	上证报、中证报、证券时报	2015-1-12
2	长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金2014年第4季度报告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2015-1-21
3	长信基金管理有限责任公司关于长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金经理变更的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2015-3-25
4	长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金2014年年度报告及摘要	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2015-3-28
5	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2015-3-30
6	长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金2015年第1季度报告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2015-4-20
7	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金参加中国农业银行股份有限公司网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报	2015-5-29
8	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金参加交通银行股份有限公司网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告	上证报、中证报 证券时报、证券日报	2015-6-29

§ 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、《长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《长信纯债一年定期开放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