

长信利丰债券型证券投资基金2015年年度报告

2015年12月31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：2016年3月26日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会及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”，下同）根据本基金基金合同的规定，于2016年3月17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。

本报告期自2015年1月1日起至2015年12月31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、基金净值表现及利润分配情况.....	7
3.1	主要会计数据和财务指标.....	7
3.2	基金净值表现.....	7
3.3	过去三年基金的利润分配情况.....	9
§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合规守信情况的说明.....	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.....	13
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	14
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
4.9	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.....	16
§5	托管人报告.....	17
5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	17
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.....	17
5.3	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.....	17
§6	审计报告.....	18
6.1	审计报告基本信息.....	18
6.2	审计报告的基本内容.....	18
§7	年度财务报表.....	20
7.1	资产负债表.....	20
7.2	利润表.....	21
7.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	22
7.4	报表附注.....	24
§8	投资组合报告.....	53
8.1	期末基金资产组合情况.....	53
8.2	报告期末按行业分类的股票投资组合.....	53
8.3	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.....	54
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	56
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	62
8.6	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.....	63
8.7	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.....	63
8.8	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.....	63
8.9	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.....	63
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	63
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	63
8.12	投资组合报告附注.....	64

---

§9	基金份额持有人信息.....	65
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	65
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	65
9.3	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.....	65
§10	开放式基金份额变动.....	66
§11	重大事件揭示.....	67
11.1	基金份额持有人大会决议.....	67
11.2	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.....	67
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	67
11.4	基金投资策略的改变.....	67
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	67
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	68
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	68
11.8	其他重大事件.....	69
§12	备查文件目录.....	73
12.1	备查文件目录.....	73
12.2	存放地点.....	73
12.3	查阅方式.....	73

## § 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	6,373,696,755.76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
	联系电话	021-61009999
	电子邮箱	zhouyg@cxfund.com.cn
客户服务电话	400-700-5566	95599
传真	021-61009800	010-63201816

长信利丰债券型证券投资基金2015年年度报告

注册地址	中国（上海）自由贸易试验区银城中路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	叶焯	刘士余

## 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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.cxfund.com.cn
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	北京东长安街1号东方广场东2座8层
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、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 期间数据和指标	2015年	2014年	2013年
本期已实现收益	449,390,528.72	57,496,740.31	8,584,519.80
本期利润	600,921,691.66	66,041,485.90	972,675.63
加权平均基金份额本期利润	0.2689	0.4086	0.0041
本期加权平均净值利润率	19.22%	34.53%	0.38%
本期基金份额净值增长率	27.54%	33.30%	5.71%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末	2014年末	2013年末
期末可供分配利润	1,165,999,158.76	97,900,209.00	2,525,322.83
期末可供分配基金份额利润	0.1829	0.2594	0.0143
期末基金资产净值	9,266,123,431.49	525,538,864.75	184,384,798.17
期末基金份额净值	1.454	1.393	1.045
3.1.3 累计期末指标	2015年末	2014年末	2013年末
基金份额累计净值增长率	116.87%	70.04%	27.56%

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
过去三个月	8.27%	0.54%	4.34%	0.18%	3.93%	0.36%

过去六个月	6.99%	0.79%	3.48%	0.27%	3.51%	0.52%
过去一年	27.54%	0.80%	10.10%	0.26%	17.44%	0.54%
过去三年	79.72%	0.62%	24.57%	0.20%	55.15%	0.42%
过去五年	88.66%	0.53%	32.30%	0.18%	56.36%	0.35%
自基金合同生效日起至今 (2008年12月29日至2015年12月31日)	116.87%	0.48%	44.07%	0.19%	72.80%	0.29%

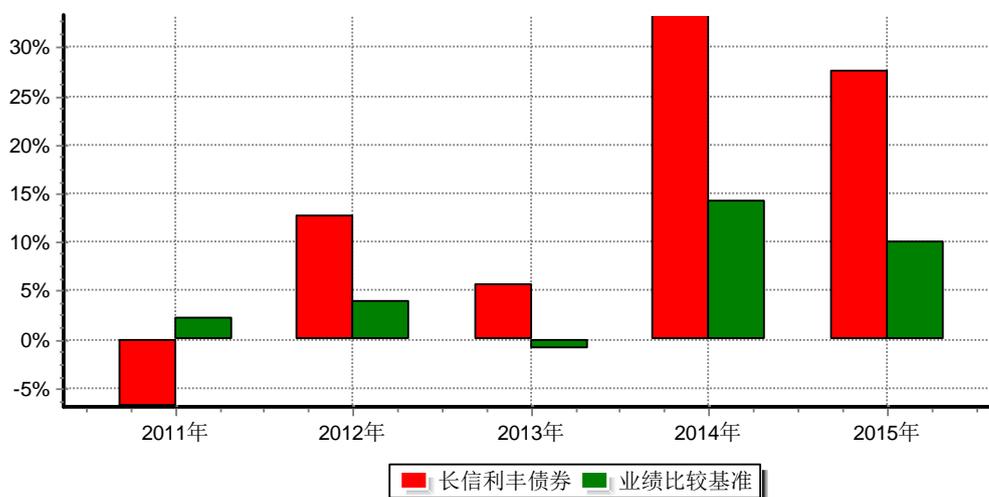
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、图示日期为2008年12月29日至2015年12月31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。

### 3.2.3 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



### 3.3 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
2015年	2.800	2,024,797,778.34	67,866,134.76	2,092,663,913.10	
2014年	—	—	—	—	
2013年	0.930	377,618,227.85	3,061,375.82	380,679,603.67	
合计	3.730	2,402,416,006.19	70,927,510.58	2,473,343,516.77	

注：本基金本报告期内进行的利润分配情况，详见4.8。

## § 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12月31日，本基金管理人共管理30只开放式基金，即长信利息收益货币、长信银利精选混合、长信金利趋势混合、长信增利动态策略混合、长信双利优选混合、长信利丰债券、长信恒利优势混合、长信量化先锋混合、长信标普100等权重指数（QDII）、长信利鑫分级债、长信内需成长混合、长信可转债债券、长信利众分级债、长信纯债一年定开债券、长信纯债壹号债券、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、长信利广混合、长信多利混合、长信睿进混合、长信量化多策略股票、长信医疗保健混合（LOF）、长信中证一带一路指数、长信富民纯债一年定开债券、长信富海纯债一年定开债券、长信利保债券、长信富安纯债一年定开债券。

#### 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、长信利富债券型证券投资基金和长信利保债券型证券投资基金	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年加入长信基金管理有限责任公司，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和长信纯债

	的基金经理、公司副总经理、固定收益部总监、投资决策委员会执行委员			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、投资决策委员会执行委员、固定收益部总监，本基金、长信可转债债券型证券投资基金、长信利富债券型证券投资基金和长信利保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；

3、在本报告期末（2015年12月31日）至报告送出日（2016年3月26日）之间，李小羽先生自2016年1月27日起兼任长信金葵纯债一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理，自2016年1月29日起兼任长信利广灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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 公平交易制度和控制方法

1、所有投资对象的投资指令必须经由交易部门总监或其授权人审核分配至交易人员执行。进行投资指令分配的人员必须保证投资指令得到公平对待。

2、公司使用的交易执行软件系统必须具备如下功能：

(1) 严格按照时间顺序发送委托指令；

(2) 对于多个投资组合在同一时点就同一证券下达的相同方向的投资指令，

并且市价在限价范围内的，系统能够将交易员针对该证券下达的每笔委托自动按照指令数量比例分拆为各投资组合的委托指令。对于不同投资组合针对交易所同一证券的同一方向竞价交易指令，指令数量比例达到5:1或以上的，可豁免启动公平交易开关。

3、交易人员对于接收到的交易指令依照价格优先、时间优先的顺序执行。在执行多个投资组合在同一时点就同一证券下达的相同方向的交易所投资指令时，除制度规定的例外指令外，必须开启系统的公平交易开关。

4、对于不同投资组合均进行债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易的投资对象，交易部门必须严格独立接收各投资组合的投资指令，在申购结果产生前，不得以任何形式向任何人泄露各投资指令的内容，包括指令价格及数量等要素。

5、对于各投资组合以独立账户名义进行申购的投资对象，除需经过公平性审核的例外指令外，申购获配的证券数量由投资管理系统接收各类证券登记结算机构发送的数据进行分配。交易部门根据证券发行人在指定公开披露媒体上披露的申购结果对系统内分配数量进行核准，数量不符的，应当第一时间告知各投资管理部门的总监及监察稽核部总监。对于以公司名义进行申购的投资对象，公司在获配额度确定后，严格按照价格优先的原则在各投资组合间进行分配。申购价格相同的投资组合则根据投资指令的数量按比例进行分配。确因特殊原因不能按照上述原则进行分配的，应启动异常交易识别流程，审核通过的，可以进行相应分配。

#### 4.3.2 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。

#### 4.3.3 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生参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情形，未发现异常交易行为。同时，对本年度同向交易价差进行专项分析，未发现异常情况。

#### 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，全球经济复苏艰难，其中美国经济复苏最为确定，美联储加息靴子落地，这将对全球金融市场形成较大影响。国际资金从新兴经济体大量流出，新兴市场货币和股市大幅下跌。

2015年中国宏观大背景为经济显著下行，既有周期性因素，也叠加了结构转型，整体经济增速下台阶，由高速转向中，中微观行业和企业利润下降，通缩蔓延。央行连续降息降准，存款基准利率从2.75%降至1.5%，创历史新低。2015年人民币汇率大幅波动，尤其8月11日央行汇改提高汇率中间价的市场化定价程度后贬值幅度较大，引发全球金融资产大震荡。货币政策难以收紧，股市下跌以及经济数据低迷，倒逼央行防水，降息降准仍可期待。债券市场2015年继续延续牛市行情，各个品种收益率均大幅下降，经济弱势，资金宽松，资产荒持续发酵，推升债券牛市。

本基金维持信用债配置，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1.454元，报告期基金份额净值增长率为27.54%，成立以来的累计净值为1.947元，本期业绩比较基准增长率为10.10%，基金波动率为0.54%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经济由工业主导向服务业主导转变的趋势更加明确，制造业内部尤其传统行业正经历调整阵痛。同时，通胀维持低位，并有通缩迹象，工业品价格环比和同比皆呈现负增长。货币政策比较持续的选择相对宽松的政策，利率的总体趋势仍然处于下行阶段。相对于历史利率水平，结构转型因素和经济增长水平的下台阶，本次利率下行的空间可能会更大。中央经济工作会议提出五大任务中去产能居首，过剩产能有序出清将加速，行业内破产清算、兼并重组加剧，产能过剩行业再融资难度加大，外部支持力度减弱，信用风险上升，需谨防踩雷，规避过剩产能主体发行的债券。汇率风险是近期焦点，近期外汇占款大幅下降，资金流出速

度超预期，央行降息降准箭在弦上。整体来说，2016年中国经济仍处于产业结构调整期，宽松的货币政策仍可期待。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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2015年度，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及配套法律法规，时刻以合规运作、防范风险为核心，以维护基金持有人利益为宗旨，保证基金合同得到严格履行。公司监察稽核部独立地开展工作，对基金运作进行事前、事中与事后的监督检查，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向公司董事会和公司管理层出具监察稽核报告。

在本报告期，基金管理人的内部监察稽核主要工作如下：

1、公司内部控制总体目标得以实现。一是公司各项业务运作严格遵守有关法律法规、监管机构的规定和行业监管规则，继续践行守法经营、规范管理的经营理念。二是公司未发生重大经营风险，确保经营业务稳健运行和受托资产安全完整。三是公司对外披露、备案、报送的基金信息、专户投资组合信息、公司财务信息及其他信息真实、准确、完整、及时。

2、公司继续贯彻“工作精细化”理念，落实“风险导向型”内控，有重点、有序推进相关内部控制工作。优化监察方式，在保证常规工作质量的前提下，继续深入贯彻监管机关的监管要求，组织多次全公司范围风险梳理工作，并根据公司内部控制要求落实包括年度全公司及子公司自查、销售适用性专项稽核、子公司内部控制专项稽核、专户管理专项稽核、信息安全自查、公司全面业务风险自查等多项自查工作。对于各项梳理及自查工作，公司各部门均以细致、全面的态度进行全面梳理，对于发现的问题及时沟通及通报，并督促整改，有效增强内部控制效果。

3、公司内部控制组织架构在公司章程与《内部控制大纲》规定的框架内顺利运作，董事会风险控制委员会、管理层内部控制委员会工作正常开展，相关内

部控制职责得以充分发挥。

4、公司较好把握内控制度建设的整体节奏，并完成内部控制制度建设流程的梳理工作，内部控制制度体系不断完善。一是监察稽核部及时指出公司内部制度更新不及时、制度规定与实际操作不符等方面的问题，对内控制度建设的及时、有效、审慎性予以定期评估；二是对监管机关新修订的法律法规或新出台的监管要求，监察稽核部及时发起制定或修订公司相关内部制度；三是各业务部门不定期评估实际运作需要，适时发起制度的修订。

5、监察稽核工作改进、内部控制与合规培训、内控逐级责任制等内控保障性措施严格执行，内部控制与风险管理基础进一步夯实。各关键业务流程环节的岗位自控和互控、跨部门业务流程中的部门自控与部门间互控工作效果继续保持，各业务部门根据风险梳理工作要求，审视部门业务流程开展过程中的各项风险，将各项内部控制要求落实到部门流程手册，相关业务流程持续协调更新，具体流程环节实现落实到岗，落实到人，内部控制细节不断深化。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则，秉持内控优先、内控从严的理念，不断提高内部监察稽核工作的科学性和实效性、并完善内部控制体系，做好各项内控工作，努力防范和控制各种风险，确保基金资产的规范运作，充分保障基金持有人的合法权益。

#### 4.7 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。

#### 4.8 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，本基金本报告期已公告实施一次分红，符合基金合同中关于利润分配条款的约定。详细情况如下：

单位：人民币元

权益登记日	除息日	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放	再投资形式发放	利润分配合计
2015-3-23	2015-3-23	2.800	2,024,797,778.34	67,866,134.76	2,092,663,913.10

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。

#### 4.9 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。

### 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，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，未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第1600140号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	长信利丰债券型证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的长信利丰债券型证券投资基金(以下简称“长信利丰债券基金”)财务报表,包括2015年12月31日的资产负债表,2015年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是长信利丰债券基金管理人长信基金管理有限责任公司管理层的责任,这种责任包括:(1)按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表,并使其实现公允反映;(2)设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价长信基金管理有限责任公司管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为</p>

长信利丰债券型证券投资基金2015年年度报告

	发表审计意见提供了基础。
审计意见段	我们认为，长信利丰债券基金财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则和在财务报表附注所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了长信利丰债券基金2015年12月31日的财务状况以及2015年度的经营成果和基金净值变动情况。
注册会计师的姓名	黄小熠、虞京京
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）
会计师事务所的地址	北京东长安街1号东方广场东2座8层
审计报告日期	2016-3-23

## §7 年度财务报表

## 7.1 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12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	1,080,047,962.66	41,591,341.00
结算备付金		21,047,327.14	15,023,628.98
存出保证金		2,984,123.59	145,620.23
交易性金融资产	7.4.7.2	9,224,698,012.74	652,463,193.50
其中：股票投资		1,281,091,739.44	43,115,973.24
基金投资		—	—
债券投资		7,943,606,273.30	609,347,220.26
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
衍生金融资产	7.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	7.4.7.4	350,001,325.00	—
应收证券清算款		—	8,992,306.23
应收利息	7.4.7.5	176,632,293.50	14,239,739.78
应收股利		—	—
应收申购款		25,740,414.15	11,810,515.44
递延所得税资产		—	—
其他资产	7.4.7.6	—	—
资产总计		10,881,151,458.78	744,266,345.16
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2015年12月31日</b>	<b>上年度末 2014年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		—	—
交易性金融负债		—	—
衍生金融负债	7.4.7.3	—	—
卖出回购金融资产款		1,099,998,310.00	214,199,460.70
应付证券清算款		493,022,725.89	94,906.46
应付赎回款		5,753,986.79	1,573,327.85
应付管理人报酬		4,315,168.28	250,960.77

## 长信利丰债券型证券投资基金2015年年度报告

应付托管费		1,232,905.22	71,703.07
应付销售服务费		2,465,810.45	499,227.47
应付交易费用	7.4.7.7	6,877,864.69	817,723.83
应交税费		688,737.74	688,737.74
应付利息		338,973.74	76,135.50
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	7.4.7.8	333,544.49	455,297.02
负债合计		1,615,028,027.29	218,727,480.41
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	6,373,696,755.76	377,345,769.48
未分配利润	7.4.7.10	2,892,426,675.73	148,193,095.27
所有者权益合计		9,266,123,431.49	525,538,864.75
负债和所有者权益总计		10,881,151,458.78	744,266,345.16

注：报告截止日2015年12月31日，基金份额净值1.454元，基金份额总额6,373,696,755.76份。

## 7.2 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12月31日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2015年1月1日至2015年12月31日	2014年1月1日至2014年12月31日
<b>一、收入</b>		672,196,172.51	76,403,586.93
1. 利息收入		141,758,855.24	12,106,013.46
其中：存款利息收入	7.4.7.11	3,564,468.90	302,204.52
债券利息收入		137,110,064.64	11,672,851.25
资产支持证券利息收入		—	—
买入返售金融资产收入		1,084,321.70	130,957.69
其他利息收入		—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）		375,224,369.12	55,677,962.44
其中：股票投资收益	7.4.7.12	267,768,918.67	15,906,167.19
基金投资收益		—	—
债券投资收益	7.4.7.13	106,435,653.09	39,564,653.69
资产支持证券投资收益	7.4.7.14	—	—
贵金属投资收益		—	—
衍生工具收益	7.4.7.15	—	—

## 长信利丰债券型证券投资基金2015年年度报告

股利收益	7.4.7.16	1,019,797.36	207,141.56
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	151,531,162.94	8,544,745.59
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	3,681,785.21	74,865.44
<b>减：二、费用</b>		71,274,480.85	10,362,101.03
1. 管理人报酬		21,498,989.40	1,325,699.97
2. 托管费		6,142,568.29	378,771.37
3. 销售服务费		12,285,136.78	757,542.83
4. 交易费用	7.4.7.19	15,203,784.08	2,308,760.93
5. 利息支出		15,819,214.57	5,311,480.91
其中：卖出回购金融资产支出		15,819,214.57	5,311,480.91
6. 其他费用	7.4.7.20	324,787.73	279,845.02
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		60,0921,691.66	66,041,485.90
减：所得税费用		—	—
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		600,921,691.66	66,041,485.90

## 7.3 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12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015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)	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)	—	600,921,691.66	600,921,691.66
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）	5,996,350,986.28	4,235,975,801.90	10,232,326,788.18
其中：1. 基金申购款	17,166,187,530.79	7,793,200,382.62	24,959,387,913.41

## 长信利丰债券型证券投资基金2015年年度报告

2. 基金赎回款	-11,169,836,544.51	-3,557,224,580.72	-14,727,061,125.23
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)	6,373,696,755.76	2,892,426,675.73	9,266,123,431.49
项 目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014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)	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)	—	66,041,485.90	66,041,485.90
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)	200,894,879.61	74,217,701.07	275,112,580.68
其中：1. 基金申购款	450,252,139.58	124,232,476.72	574,484,616.30
2. 基金赎回款	-249,357,259.97	-50,014,775.65	-299,372,035.62
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)	377,345,769.48	148,193,095.27	525,538,864.75

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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(“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。本基金投资的比例范围为: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×90%+中证800指数×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。

### 7.4.2 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>》以及中国证券投资基金业协会于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。

#### 7.4.3 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12月31日的财务状况、2015年度的经营成果和基金净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历1月1日起至12月31日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币,编制财务报表采用的货币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的把金融资产和金融负债分为不同类别:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。

本基金目前持有的股票投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

-以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债(包括交易性金融资产或金融负债)

本基金持有为了近期内出售或回购的金融资产和金融负债属于此类。

-应收款项

应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

-其他金融负债

其他金融负债是指除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以

外的金融负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于支付价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

初始确认后，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值计量，公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益；应收款项和其他金融负债以实际利率法按摊余成本计量。

当收取某项金融资产的现金流量的合同权利终止或将所有权上几乎所有的风险和报酬转移时，本基金终止确认该金融资产。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

-金融资产转移金融资产的账面价值

-结转因转移而收到的对价，与原直接计入所有者权益的公允价值变动累计额之和。

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金估计公允价值时，考虑市场参与者在计量日对相关资产或负债进行定价时考虑的特征(包括资产状况及所在位置、对资产出售或者使用的限制等)，并采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时

满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

收入是本基金在日常活动中形成的、会导致所有者权益增加且与所有者投入资本无关的经济利益的总流入。收入在其金额及相关成本能够可靠计量、相关的经济利益很可能流入本基金、并且同时满足以下不同类型收入的其他确认条件时，予以确认。

股票投资收益/(损失)、债券投资收益/(损失)和衍生工具收益/(损失)按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税(适用于企业债和可转债等)后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，逐日计提利息收入。

如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息收入。

利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在回购期内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益/(损失)核算基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、衍生金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

根据《长信利丰债券型证券投资基金基金合同》的规定，本基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值0.70%的年费率逐日计提。

根据《长信利丰债券型证券投资基金基金合同》的规定，本基金的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。

根据《长信利丰债券型证券投资基金基金合同》的规定，本基金的销售服务费按前一日基金资产净值0.40%的年费率逐日计提。

本基金的交易费用用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在回购期内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

本基金的其他费用如不影响估值日基金份额净值小数点后第四位，发生时直接计入基金损益；如果影响基金份额净值小数点后第四位的，应采用待摊或预提的方法，待摊或预提计入基金损益。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益分配方式分两种：现金红利和红利再投资，基金份额持有人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，基金份额持有人事先未做出选择的，本基金默认的收益分配方式是现金分红。基金当年收益应先弥补上年累计亏损后，才可进行当年收益分配，基金收益分配后基金份额净值不能低于面值。在符合有关基金

分红条件的前提下，本基金收益每年至少分配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%。法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部，是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于特殊事项停牌股票，根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，本基金参考《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》对重大影响基金资产净值的特殊事项停牌股票进行估值。

对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21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》（以下简称“《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的通知》”），若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易所交易天数占锁定期内总交易所交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

在银行间同业市场交易的债券品种，根据《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的公告》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

合并财务报表的合并范围以控制为基础予以确定。控制，是指本基金拥有对被投资方的权力，通过参与被投资方的相关活动而享有可变回报，并且有能力运用对被投资方的权力影响其回报金额。在判断本基金是否拥有对被投资方的权力时，本基金仅考虑与被投资方相关的实质性权利（包括本基金自身所享有的及其他方所享有的实质性权利）。

#### **7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **7.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金在本年度未发生重大会计政策变更。

##### **7.4.5.2 会计估计变更的说明**

根据估值处理标准，本基金自2015年3月27日起，对本基金所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）的估值方法进行调整，采用第三方估值机构提供的价格进行估值。于2015年3月27日，相关调整对前一估值日基金资产净值的影响不超过0.50%。

##### **7.4.5.3 差错更正的说明**

本基金在本年末未发生重大会计差错。

#### **7.4.6 税项**

##### **7.4.6.1 本基金适用的主要税项**

根据财税字[1998]55号文《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收问题的通知》、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[2012]85号文《财政部、国家税务总局、证监会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》、财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、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》及深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易

所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、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：

(a) 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。

(b) 证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。

(c) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d) 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。自2013年1月1日起，对所取得的股息红利收入按根据持有期限计提个人所得税：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，上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(e) 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。

(f) 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。

#### 7.4.6.2 应交税费

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31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元	688,737.74元

注：该项系基金收到的债券发行人在支付债券利息时代扣代缴的利息税部分。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
----	--------------------	---------------------

活期存款	1,080,047,962.66	41,591,341.00
定期存款	—	—
其中：存款期限1-3个月	—	—
其他存款	—	—
合计	1,080,047,962.66	41,591,341.00

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2015年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		1,201,459,411.57	1,281,091,739.44	79,632,327.87
贵金属投资-金交所黄金 合约		—	—	—
债券	交易所市场	883,726,805.46	904,796,517.90	21,069,712.44
	银行间市场	6,983,163,338.04	7,038,809,755.40	55,646,417.36
	合计	7,866,890,143.50	7,943,606,273.30	76,716,129.80
资产支持证券		—	—	—
基金		—	—	—
其他		—	—	—
合计		9,068,349,555.07	9,224,698,012.74	156,348,457.67
项目		上年度末 2014年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		48,105,228.13	43,115,973.24	-4,989,254.89
贵金属投资-金交所黄金 合约		—	—	—
债券	交易所市场	274,699,546.12	284,968,220.26	10,268,674.14
	银行间市场	324,841,124.52	324,379,000.00	-462,124.52
	合计	599,540,670.64	609,347,220.26	9,806,549.62
资产支持证券		—	—	—
基金		—	—	—
其他		—	—	—
合计		647,645,898.77	652,463,193.50	4,817,294.73

## 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产。

## 7.4.7.4 买入返售金融资产

## 7.4.7.4.1 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12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	350,001,325.00	-
合计	350,001,325.00	-
项目	上年度末 2014年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本年度及上年度均无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
应收活期存款利息	73,704.47	6,237.22
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	10,418.43	7,436.77
应收债券利息	175,745,275.80	14,219,111.44
应收买入返售证券利息	762,885.59	-
应收申购款利息	38,532.02	6,882.30
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	1,477.19	72.05
合计	176,632,293.50	14,239,739.78

注：其他为应收结算保证金利息。

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
交易所市场应付交易费用	6,848,499.99	805,215.63
银行间市场应付交易费用	29,364.70	12,508.20

## 长信利丰债券型证券投资基金2015年年度报告

合计	6,877,864.69	817,723.83
----	--------------	------------

## 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
应付券商交易单元保证金	—	—
应付赎回费	4,544.49	1,797.02
预提信息披露费-中证报	80,000.00	80,000.00
预提信息披露费-证券时报	180,000.00	300,000.00
预提账户维护费	9,000.00	13,500.00
预提审计费	60,000.00	60,000.00
合计	333,544.49	455,297.02

## 7.4.7.9 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12月31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	17,166,187,530.79	17,166,187,530.79
本期赎回（以“-”号填列）	-11,169,836,544.51	-11,169,836,544.51
本期末	6,373,696,755.76	6,373,696,755.76

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

## 7.4.7.10 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	97,900,209.66	50,292,885.61	148,193,095.27
本期利润	449,390,528.72	151,531,162.94	600,921,691.66
本期基金份额交易产生的变动数	2,711,372,333.48	1,524,603,468.42	4,235,975,801.90
其中：基金申购款	3,621,032,074.87	4,172,168,307.75	7,793,200,382.62
基金赎回款	-909,659,741.39	-2,647,564,839.33	-3,557,224,580.72
本期已分配利润	-2,092,663,913.10	—	-2,092,663,913.10
本期末	1,165,999,158.76	1,726,427,516.97	2,892,426,675.73

## 7.4.7.11 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12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日

活期存款利息收入	2,499,399.66	162,843.73
定期存款利息收入	—	—
其他存款利息收入	18,592.50	2,986.80
结算备付金利息收入	315,955.51	129,491.76
申购款利息收入	730,521.23	6,882.23
合计	3,564,468.90	302,204.52

注：其他存款利息收入为结算保证金利息收入18,592.50元。

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 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 12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014 年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	267,768,918.67	15,906,167.19
股票投资收益——赎回差价收入	—	—
股票投资收益——申购差价收入	—	—
合计	267,768,918.67	15,906,167.19

##### 7.4.7.12.2 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12 月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12 月31日
卖出股票成交总额	4,826,923,448.21	743,099,106.19
减：卖出股票成本总额	4,559,154,529.54	727,192,939.00
买卖股票差价收入	267,768,918.67	15,906,167.19

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 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12 月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12 月31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	106,435,653.09	39,564,653.69
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	106,435,653.09	39,564,653.69

##### 7.4.7.13.2 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12	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月
----	-------------------------	-------------------------------

	月31日	31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	3,349,743,720.19	1,048,666,335.23
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	3,204,047,049.38	995,904,587.92
减：应收利息总额	39,261,017.72	13,197,093.62
买卖债券差价收入	106,435,653.09	39,564,653.69

#### 7.4.7.14 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

#### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
股票投资产生的股利收益	1,019,797.36	207,141.56
基金投资产生的股利收益	—	—
合计	1,019,797.36	207,141.56

#### 7.4.7.17 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12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
1. 交易性金融资产	151,531,162.94	8544745.59
——股票投资	84,621,582.76	-4,989,254.89
——债券投资	66,909,580.18	13534000.48
——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	151,531,162.94	8,544,745.59

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12 月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12 月31日
基金赎回费收入	3,488,382.37	65,847.64
转换费收入	193,402.84	9,017.80
合计	3,681,785.21	74,865.44

注：本基金赎回费（转换费中赎回费部分）的25%归入基金资产。

**7.4.7.19 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12 月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12 月31日
交易所市场交易费用	15,159,699.08	2,303,110.93
银行间市场交易费用	44,085.00	5,650.00
合计	15,203,784.08	2,308,760.93

**7.4.7.20 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12 月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12 月31日
审计费用	60,000.00	60,000.00
信息披露费	160,000.00	180,000.00
权证	—	—
账户维护费	36,240.00	18,240.00
其他费用	68,547.73	21,605.02
交易费用_回购	—	—
合计	324,787.73	279,845.02

注：其他费用为银行划款手续费。

**7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明****7.4.8.1 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。

**7.4.8.2 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。

## 7.4.9 关联方关系

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(“中国农业银行”)	基金托管人
长江证券股份有限公司(“长江证券”)	基金管理人的股东
上海海欣集团股份有限公司	基金管理人的股东
武汉钢铁股份有限公司	基金管理人的股东
上海长江财富资产管理有限公司	基金管理人的子公司
长信基金-聚富1号资产管理计划	基金管理人管理的特定客户资产管理计划
长信-优享1号资产管理计划	基金管理人管理的特定客户资产管理计划
长信-策略3号资产管理计划	基金管理人管理的特定客户资产管理计划
长信-策略4号资产管理计划	基金管理人管理的特定客户资产管理计划
长信-策略6号资产管理计划	基金管理人管理的特定客户资产管理计划

## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

## 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

## 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014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
长江证券	752,574,499.92	7.14%	—	—

## 7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014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
长江证券	10,556,805.50	0.19%	—	—

## 7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014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

长江证券	430,000,000.00	1.10%	—	—
------	----------------	-------	---	---

#### 7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元--长江证券股份有限公司进行的权证交易。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
长江证券	625,614.67	6.77%	625,614.67	9.13%
关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
长江证券	—	—	—	—

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年 12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	21,498,989.40	1,325,699.97
其中：支付销售机构的客户维护费	—	265,199.24

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

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12 月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12 月31日
当期发生的基金应支付的托管费	6,142,568.29	378,771.37

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

## 7.4.10.2.3 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12月31日
	当期应支付的销售服务费
长信基金管理有限责任公司	10,322,732.54
中国农业银行	92,339.00
长江证券	71,980.09
合计	10,487,051.63
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12月31日
	当期应支付的销售服务费
长信基金管理有限责任公司	282,171.95
中国农业银行	52,199.06
长江证券	243.83
合计	334,614.84

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

## 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金在本年度与上年度均未与关联方通过银行间同业市场进行过回购交易。

## 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

## 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
	基金合同生效日（2008年12月29日）持有的基金份额	—
期初持有的基金份额	—	—
期间申购/买入总份额	13,691,185.48	—
期间因拆分变动份额	—	—
减：期间赎回/卖出总份额	—	—
期末持有的基金份额	13,691,185.48	—
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.21%	—

注：本基金各关联方投资本基金适用费率严格遵循本基金基金合同中的有关规定。

#### 7.4.10.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2015年12月31日		上年度末 2014年12月31日	
	持有基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
长信基金-聚富1号资产管理计划	9,700,577.20	0.15%	-	-
长信-优享1号资产管理计划	12,298,957.56	0.19%	-	-
长信-策略3号资产管理计划	561,740,741.66	8.81%	-	-
长信-策略4号资产管理计划	151,805,188	2.38%	-	-
长信-策略6号资产管理计划	92,691,425.55	1.45%	-	-

注：本基金各关联方投资本基金适用费率严格遵循本基金基金合同中的有关规定。

#### 7.4.10.5 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 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31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	1,080,047,962.66	2,499,399.66	41,591,341.00	162,843.73

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12月31日的相关余额为人民币21,047,327.14元。（2014年12月31日：人民币15,023,628.98元）

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本年度与上年度均未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

#### 7.4.10.7 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。

## 7.4.11 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	再投资形式发 放	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	

## 7.4.12 期末（2015年12月31日）本基金持有的流通受限证券

## 7.4.12.1 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。

## 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值 单价	复 牌 日期	复牌 开盘 单价	数量 (股)	期末成本总额	期末估值总额
300028	金亚科技	2015-6-09	重大事项	24.48	—	—	244,114	9,815,159.39	5,975,910.72
300238	冠昊生物	2015-11-11	重大事项	56.67	—	—	20,000	765,778.81	1,133,400.00
600271	航天信息	2015-10-09	重大事项	55.91	—	—	99,947	4,748,595.55	5,588,036.77
600699	均胜电子	2015-11-3	重大事项	31.25	2016-3-10	29.00	910,400	24,705,974.59	28,450,000.00
002707	众信旅游	2015-11-16	重大事项	52.62	2016-3-15	47.36	411,300	12,427,253.87	21,642,606.00
002664	信质电机	2015-12-30	重大事项	31.77	2016-3-8	28.71	461,797	13,445,007.46	14,671,290.69
002568	百润股份	2015-12-21	重大事项	42.69	2016-1-18	38.42	217,100	10,444,150.00	9,267,999.00
300010	立思辰	2015-12-30	重大事项	31.90	2016-1-8	28.71	185	6,838.16	5,901.50
600645	中源协和	2015-12-29	重大事项	65.01	2016-1-1	63.90	373	50.93	24,248.73

					-4				
002049	同方 国芯	2015- 12-10	重大 事项	60.15	-	-	52	2,202.05	3,127.80

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2015年12月31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1,099,998,310.00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
150416	15农发16	2016-1-5	100.23	3,000,000	300,690,000.00
150215	15国开15	2016-1-6	100.13	8,000,000	801,040,000.00
合计				11,000,000	1,101,730,000.00

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末,本基金未持有交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险,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内部控制委员会为核心的、由内部控制委员会、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。

##### 7.4.13.2 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并采用券款对以控制相应的信用风险。

#### 7.4.13.2.1 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12月31日	上年度末 2014年12月31日
A-1	191,628,000.00	49,911,000.00
A-1以下	—	—
未评级	5,704,166,258.40	41,389,300.00
合计	5,895,794,258.40	91,300,300.00

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。

#### 7.4.13.2.2 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	上年度末
--------	-----	------

	2015年12月31日	2014年12月31日
AAA	256,640,555.10	42,380,721.10
AAA以下	1,791,171,459.80	475,666,199.16
未评级	—	—
合计	2,047,812,014.90	518,046,920.26

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。

#### 7.4.13.3 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7.4.12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，其余金融资产均能及时变现。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。

本基金所持有的全部金融负债无固定到期日或合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或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、债券投资及买入返售金融资产等。本基金的基金管理人通过专设的金融工程部对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

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负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

单位：人民币元

本期末 2015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	1,080,047,962.66	—	—	—	—	1,080,047,962.66
结算备付金	21,047,327.14	—	—	—	—	21,047,327.14
存出	2,984,123.59	—	—	—	—	2,984,123.59

长信利丰债券型证券投资基金2015年年度报告

保证金						
交易性金融资产	1,365,387,998.10	1,886,894,841.40	3,544,610,989.60	1,146,712,444.20	1,281,091,739.44	9,224,698,012.74
买入返售金融资产	350,001,325.00	—	—	—	—	350,001,325.00
应收利息	—	—	—	—	176,632,293.50	176,632,293.50
应收申购款	—	—	—	—	25,740,414.15	25,740,414.15
资产总计	2,819,468,736.49	1,886,894,841.40	3,544,610,989.60	1,146,712,444.20	1,483,464,447.09	10,881,151,458.78
负债						
卖出回购金融资产款	1,099,998,310.00	—	—	—	—	1,099,998,310.00
应付证券清算款	—	—	—	—	493,022,725.89	493,022,725.89
应付赎回款	—	—	—	—	5,753,986.79	5,753,986.79
应付管理人报酬	—	—	—	—	4,315,168.28	4,315,168.28
应付托管费	—	—	—	—	1,232,905.22	1,232,905.22
应付销售服务费	—	—	—	—	2,465,810.45	2,465,810.45
应付交易费用	—	—	—	—	6,877,864.69	6,877,864.69
应交税费	—	—	—	—	688,737.74	688,737.74
应付利息	—	—	—	—	338,973.74	338,973.74

长信利丰债券型证券投资基金2015年年度报告

其他负债	—	—	—	—	333,544.49	333,544.49
负债总计	1,099,998,310.00	—	—	—	515,029,717.29	1,615,028,027.29
利率敏感度缺口	1,719,470,426.49	1,886,894,841.40	3,544,610,989.60	1,146,712,444.20	968,434,729.80	9,266,123,431.49
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	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	652463193.50
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

长信利丰债券型证券投资基金2015年年度报告

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	525538864.75

7.4.13.4.1.2 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12月31日	上年度末 2014年12月31日
	市场利率下降27个基点	31,548,750.36	5,145,722.04
	市场利率上升27个基点	-31,548,750.36	-5,145,722.04

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他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)等指标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。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31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	1,281,091,739.44	13.83	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	7,943,606,273.30	85.73	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	9,224,698,012.74	99.56	652,463,193.50	124.15

#### 7.4.13.4.3.2 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12月31日，基金资产组合的市场价格风险VaR值为1.01% (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12月31日)	上年度末 (2014年12月31日)
		-93,587,846.66	-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。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

- (1) 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12月31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)。

于资产负债表日，本基金的金融工具公允价值列示如下：

单位：人民币元

资产	本期末 (2015年12月31日)			
	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	1,194,329,218.23	86,762,521.21	-	1,281,091,739.44
债券投资	-	7,943,606,273.30	-	7,943,606,273.30
合计	1,194,329,218.23	8,030,368,794.51	-	9,224,698,012.74
资产	上年度末 (2014年12月31日)			
	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	43,115,973.24	-		43,115,973.24
债券投资	175,989,408.46	433,357,811.80		609,347,220.26
合计	219,105,381.70	433,357,811.80		652,463,193.50

2015年，由于会计估计变更，本基金投资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）的估值方法进行调整，采用第三方估值机构提供的价格进行估值。由此导致上述交易性金融资产中人民币1,141,374,173.30元的债券投资由第一层次转入至第二层次。本基金是在发生转换当年的报告期末确认各层次之间的转换。

#### (b) 第二层次的公允价值计量

对于本基金投资的证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于限售期间等情况时，本基金将相应进

行估值方法的变更。根据估值方法的变更，本基金综合考虑估值调整中采用的可观察与不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值的层次。

2015年，本基金上述持续和非持续第二层次公允价值计量所使用的估值技术并未发生该变更。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2015年12月31日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(2014年12月31日：无)。

(2) 其他金融工具的公允价值(年末非以公允价值计量的项目)

其他金融工具主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

## §8 投资组合报告

## 8.1 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	1,281,091,739.44	11.77
	其中：股票	1,281,091,739.44	11.77
2	固定收益投资	7,943,606,273.30	73.00
	其中：债券	7,943,606,273.30	73.00
	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	350,001,325.00	3.22
	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	1,101,095,289.80	10.12
7	其他各项资产	205,356,831.24	1.89
8	合计	10,881,151,458.78	100.00

注：本基金本报告期末未通过沪港通交易机制投资港股。

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

## 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	737,407,100.90	7.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	4,172,040.00	0.05
F	批发和零售业	25,818,888.57	0.28
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	446,574,369.57	4.82
J	金融业	1,705,543.36	0.02

K	房地产业	9,094,274.66	0.10
L	租赁和商务服务业	21,642,606.00	0.23
M	科学研究和技术服务业	24,248.73	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	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	3,552,737.60	0.04
S	综合	31,099,930.05	0.34
	合计	1,281,091,739.44	13.83

### 8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末通过沪港通交易机制投资港股。

### 8.3 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	600410	华胜天成	2,493,427	66,100,749.77	0.71
2	600588	用友网络	1,783,701	56,739,528.81	0.61
3	300124	汇川技术	1,072,561	50,624,879.20	0.55
4	300146	汤臣倍健	1,314,292	50,600,242.00	0.55
5	300016	北陆药业	1,256,379	44,614,018.29	0.48
6	300253	卫宁软件	960,942	40,244,250.96	0.43
7	000848	承德露露	2,402,600	39,642,900.00	0.43
8	300007	汉威电子	984,177	33,658,853.40	0.36
9	002073	软控股份	1,891,419	31,964,981.10	0.34
10	002189	利达光电	871,336	31,524,936.48	0.34
11	600895	张江高科	1,078,735	31,099,930.05	0.34
12	600699	均胜电子	910,400	28,450,000.00	0.31
13	600887	伊利股份	1,726,800	28,371,324.00	0.31
14	000988	华工科技	1,237,746	26,215,460.28	0.28
15	002439	启明星辰	766,274	24,520,768.00	0.26
16	000555	神州信息	570,700	24,026,470.00	0.26
17	000997	新大陆	928,388	23,506,784.16	0.25
18	300166	东方国信	725,572	23,240,071.16	0.25
19	002405	四维图新	594,424	23,063,651.20	0.25
20	300024	机器人	326,944	22,395,664.00	0.24
21	300246	宝莱特	538,482	22,239,306.60	0.24
22	002707	众信旅游	411,300	21,642,606.00	0.23

## 长信利丰债券型证券投资基金2015年年度报告

23	300369	绿盟科技	437,760	21,292,646.40	0.23
24	300359	全通教育	234,623	20,205,732.76	0.22
25	002074	国轩高科	539,060	19,999,126.00	0.22
26	300005	探路者	839,953	19,234,923.70	0.21
27	002339	积成电子	770,235	18,793,734.00	0.20
28	002184	海得控制	435,145	18,715,586.45	0.20
29	002230	科大讯飞	491,379	18,205,591.95	0.20
30	300195	长荣股份	723,299	17,279,613.11	0.19
31	600893	中航动力	366,400	16,498,992.00	0.18
32	600728	佳都科技	419,881	15,653,163.68	0.17
33	300216	千山药机	341,700	15,062,136.00	0.16
34	002139	拓邦股份	600,000	14,946,000.00	0.16
35	002609	捷顺科技	705,987	14,726,888.82	0.16
36	002664	信质电机	461,797	14,671,290.69	0.16
37	300378	鼎捷软件	240,909	14,025,721.98	0.15
38	300168	万达信息	400,000	13,252,000.00	0.14
39	600118	中国卫星	301,221	12,813,941.34	0.14
40	603555	贵人鸟	336,038	11,905,826.34	0.13
41	000768	中航飞机	477,083	11,817,345.91	0.13
42	600648	外高桥	429,941	11,294,550.07	0.12
43	002008	大族激光	373,990	9,682,601.10	0.10
44	300458	全志科技	79,989	9,518,691.00	0.10
45	300170	汉得信息	467,900	9,287,815.00	0.10
46	002568	百润股份	217,100	9,267,999.00	0.10
47	300171	东富龙	300,000	8,994,000.00	0.10
48	300229	拓尔思	269,933	8,475,896.20	0.09
49	002488	金固股份	284,000	8,236,000.00	0.09
50	600278	东方创业	417,905	7,664,377.70	0.08
51	002385	大北农	609,254	7,438,991.34	0.08
52	601231	环旭电子	499,987	7,229,812.02	0.08
53	000733	振华科技	279,200	6,980,000.00	0.08
54	002273	水晶光电	171,400	6,958,840.00	0.08
55	600998	九州通	349,998	6,859,960.80	0.07
56	300275	梅安森	184,457	6,714,234.80	0.07
57	600745	中茵股份	157,800	6,466,644.00	0.07
58	600571	信雅达	106,600	6,297,928.00	0.07
59	300028	金亚科技	244,114	5,975,910.72	0.06
60	300373	扬杰科技	270,185	5,795,468.25	0.06
61	600172	黄河旋风	226,640	5,736,258.40	0.06
62	600271	航天信息	99,947	5,588,036.77	0.06

## 长信利丰债券型证券投资基金2015年年度报告

63	603019	中科曙光	60,000	5,470,200.00	0.06
64	002268	卫士通	92,389	5,193,185.69	0.06
65	300274	阳光电源	180,000	4,935,600.00	0.05
66	300077	国民技术	108,700	4,911,066.00	0.05
67	002410	广联达	251,518	4,572,597.24	0.05
68	600305	恒顺醋业	177,000	4,543,590.00	0.05
69	002290	禾盛新材	140,000	4,523,400.00	0.05
70	300353	东土科技	156,268	3,812,939.20	0.04
71	300291	华录百纳	99,796	3,552,737.60	0.04
72	002376	新北洋	178,422	3,297,238.56	0.04
73	300096	易联众	119,960	3,199,333.20	0.03
74	002146	荣盛发展	275,722	2,627,630.66	0.03
75	002047	宝鹰股份	200,000	2,248,000.00	0.02
76	300020	银江股份	88,592	2,172,275.84	0.02
77	002081	金螳螂	103,000	1,924,040.00	0.02
78	300155	安居宝	100,000	1,800,000.00	0.02
79	601688	华泰证券	86,488	1,705,543.36	0.02
80	603001	奥康国际	48,839	1,641,967.18	0.02
81	603000	人民网	50,000	1,140,500.00	0.01
82	300238	冠昊生物	20,000	1,133,400.00	0.01
83	601126	四方股份	59,834	794,595.52	0.01
84	002657	中科金财	6,300	503,937.00	0.01
85	002407	多氟多	6,500	495,690.00	0.01
86	600630	龙头股份	8,910	264,448.80	0.00
87	600085	同仁堂	5,800	258,738.00	0.00
88	300248	新开普	4,937	183,409.55	0.00
89	600618	氯碱化工	2,582	41,673.48	0.00
90	600645	中源协和	373	24,248.73	0.00
91	000661	长春高新	200	24,090.00	0.00
92	002401	中海科技	901	23,335.90	0.00
93	002104	恒宝股份	427	10,243.73	0.00
94	300010	立思辰	185	5,901.50	0.00
95	002049	同方国芯	52	3,127.80	0.00
96	600518	康美药业	66	1,118.70	0.00
97	603456	九洲药业	4	284.44	0.00

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

## 8.4.1 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

## 长信利丰债券型证券投资基金2015年年度报告

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	300124	汇川技术	172,856,170.70	32.89
2	300253	卫宁健康	146,617,211.81	27.90
3	600410	华胜天成	136,251,224.94	25.93
4	300146	汤臣倍健	128,663,781.27	24.48
5	601788	光大证券	124,858,347.39	23.76
6	601688	华泰证券	123,826,542.55	23.56
7	300246	宝莱特	118,958,179.32	22.64
8	002339	积成电子	118,894,324.52	22.62
9	000555	神州信息	110,471,804.89	21.02
10	600895	张江高科	109,076,954.99	20.76
11	600999	招商证券	108,216,687.86	20.59
12	002073	软控股份	105,897,891.99	20.15
13	002439	启明星辰	102,179,398.16	19.44
14	300016	北陆药业	101,940,176.75	19.40
15	300369	绿盟科技	97,593,090.26	18.57
16	600571	信雅达	91,912,493.12	17.49
17	002189	利达光电	82,896,301.15	15.77
18	002236	大华股份	82,695,313.95	15.74
19	002268	卫士通	81,170,532.47	15.45
20	300378	鼎捷软件	73,544,747.23	13.99
21	600728	佳都科技	72,035,021.36	13.71
22	300007	汉威电子	71,027,620.83	13.52
23	002074	国轩高科	69,752,056.58	13.27
24	300359	全通教育	67,726,999.23	12.89
25	002405	四维图新	67,102,260.69	12.77
26	600699	均胜电子	66,031,956.33	12.56
27	002407	多氟多	65,824,519.41	12.53
28	603555	贵人鸟	65,071,284.04	12.38
29	002385	大北农	63,755,358.00	12.13
30	300020	银江股份	62,260,924.84	11.85
31	002184	海得控制	61,356,289.43	11.67
32	601601	中国太保	58,808,249.99	11.19
33	600588	用友网络	58,510,079.73	11.13
34	002081	金螳螂	58,502,508.44	11.13
35	000768	中航飞机	57,739,573.30	10.99
36	603019	中科曙光	57,158,904.32	10.88
37	300005	探路者	55,445,343.07	10.55
38	002108	沧州明珠	54,093,360.21	10.29
39	600998	九州通	51,948,544.44	9.88

## 长信利丰债券型证券投资基金2015年年度报告

40	601555	东吴证券	51,444,475.19	9.79
41	601628	中国人寿	51,171,091.00	9.74
42	300228	富瑞特装	49,828,463.83	9.48
43	300077	国民技术	49,026,641.11	9.33
44	600271	航天信息	45,883,445.85	8.73
45	300275	梅安森	44,900,500.89	8.54
46	002657	中科金财	43,077,054.08	8.20
47	300373	扬杰科技	43,003,944.80	8.18
48	600118	中国卫星	42,437,983.40	8.08
49	002664	信质电机	42,204,018.53	8.03
50	002230	科大讯飞	41,578,933.85	7.91
51	002496	辉丰股份	41,241,553.48	7.85
52	002104	恒宝股份	41,214,048.66	7.84
53	002146	荣盛发展	40,973,617.31	7.80
54	601901	方正证券	40,425,106.60	7.69
55	300024	机器人	40,202,024.86	7.65
56	000848	承德露露	40,122,268.26	7.63
57	000997	新大陆	39,622,060.27	7.54
58	300033	同花顺	38,988,645.76	7.42
59	002008	大族激光	37,609,088.82	7.16
60	600893	中航动力	37,308,418.83	7.10
61	600630	龙头股份	35,058,693.08	6.67
62	300166	东方国信	34,779,862.41	6.62
63	601336	新华保险	33,647,827.90	6.40
64	300352	北信源	33,190,129.30	6.32
65	002094	青岛金王	32,633,690.23	6.21
66	000988	华工科技	31,554,901.22	6.00
67	002139	拓邦股份	29,830,773.20	5.68
68	600332	白云山	29,391,476.64	5.59
69	002466	天齐锂业	29,216,611.50	5.56
70	300248	新开普	28,787,314.34	5.48
71	600887	伊利股份	28,485,945.59	5.42
72	600718	东软集团	27,889,852.77	5.31
73	600278	东方创业	27,516,945.42	5.24
74	002609	捷顺科技	27,123,119.14	5.16
75	600172	黄河旋风	25,114,994.62	4.78
76	600518	康美药业	24,970,066.30	4.75
77	300291	华录百纳	23,929,150.10	4.55
78	002375	亚厦股份	23,815,051.14	4.53
79	300170	汉得信息	22,130,435.82	4.21

## 长信利丰债券型证券投资基金2015年年度报告

80	002376	新北洋	21,390,135.20	4.07
81	600109	国金证券	21,288,963.40	4.05
82	601377	兴业证券	21,016,650.84	4.00
83	002253	川大智胜	20,185,812.06	3.84
84	300274	阳光电源	19,736,917.43	3.76
85	600648	外高桥	18,720,896.75	3.56
86	300028	金亚科技	18,103,203.50	3.44
87	300207	欣旺达	17,693,382.48	3.37
88	600645	中源协和	17,609,549.36	3.35
89	300171	东富龙	17,484,005.70	3.33
90	600158	中体产业	17,131,048.37	3.26
91	600633	浙报传媒	16,566,009.30	3.15
92	300195	长荣股份	16,529,113.72	3.15
93	600618	氯碱化工	16,440,825.79	3.13
94	000538	云南白药	16,388,252.78	3.12
95	002707	众信旅游	15,842,710.90	3.01
96	300216	千山药机	15,343,822.00	2.92
97	600521	华海药业	15,233,880.36	2.90
98	600717	天津港	14,233,497.24	2.71
99	300458	全志科技	14,073,266.07	2.68
100	601126	四方股份	13,693,536.50	2.61
101	601318	中国平安	13,190,005.02	2.51
102	603005	晶方科技	13,115,476.16	2.50
103	600196	复星医药	13,064,914.32	2.49
104	300353	东土科技	13,036,171.00	2.48
105	603000	人民网	12,955,001.83	2.47
106	002024	苏宁云商	12,854,432.80	2.45
107	000733	振华科技	12,760,286.08	2.43
108	002273	水晶光电	12,660,169.10	2.41
109	600867	通化东宝	12,551,982.04	2.39
110	300155	安居宝	12,534,762.55	2.39
111	002568	百润股份	11,930,460.00	2.27
112	601231	环旭电子	11,561,779.15	2.20
113	300349	金卡股份	10,978,804.21	2.09
114	300010	立思辰	10,597,213.50	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。

#### 8.4.2 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

## 长信利丰债券型证券投资基金2015年年度报告

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	125,788,712.51	23.94
2	601688	华泰证券	123,579,207.64	23.51
3	300124	汇川技术	120,639,906.68	22.96
4	300246	宝莱特	118,795,688.17	22.60
5	300253	卫宁健康	116,572,711.28	22.18
6	600999	招商证券	107,333,755.00	20.42
7	002339	积成电子	98,867,591.03	18.81
8	000555	神州信息	89,053,880.28	16.95
9	300369	绿盟科技	86,780,028.14	16.51
10	600410	华胜天成	86,407,563.82	16.44
11	002073	软控股份	86,206,937.60	16.40
12	002407	多氟多	84,609,085.14	16.10
13	600895	张江高科	82,972,611.78	15.79
14	002439	启明星辰	82,013,204.71	15.61
15	002268	卫士通	79,905,915.66	15.20
16	600571	信雅达	78,548,188.03	14.95
17	300146	汤臣倍健	76,636,429.69	14.58
18	002236	大华股份	75,900,784.85	14.44
19	300016	北陆药业	73,319,159.10	13.95
20	002405	四维图新	72,321,802.87	13.76
21	300378	鼎捷软件	70,233,750.74	13.36
22	300020	银江股份	69,082,793.58	13.15
23	002081	金螳螂	68,342,805.35	13.00
24	002108	沧州明珠	66,735,812.47	12.70
25	002189	利达光电	66,300,671.20	12.62
26	600728	佳都科技	65,634,272.58	12.49
27	603555	贵人鸟	62,222,248.34	11.84
28	002385	大北农	61,935,112.90	11.79
29	601601	中国太保	59,468,017.59	11.32
30	300007	汉威电子	57,911,958.22	11.02
31	300275	梅安森	56,973,813.14	10.84
32	600998	九州通	53,847,441.15	10.25
33	601555	东吴证券	53,003,782.46	10.09
34	601628	中国人寿	49,931,695.04	9.50
35	000768	中航飞机	48,124,692.03	9.16
36	002074	国轩高科	47,899,940.97	9.11
37	300359	全通教育	47,826,057.81	9.10
38	300352	北信源	46,644,431.14	8.88
39	002184	海得控制	46,539,428.02	8.86

## 长信利丰债券型证券投资基金2015年年度报告

40	002496	辉丰股份	46,179,041.37	8.79
41	300228	富瑞特装	45,769,258.75	8.71
42	600699	均胜电子	44,264,283.00	8.42
43	603019	中科曙光	42,703,988.03	8.13
44	002657	中科金财	42,195,595.38	8.03
45	300248	新开普	42,011,193.01	7.99
46	300005	探路者	41,781,162.21	7.95
47	601901	方正证券	41,538,465.23	7.90
48	600271	航天信息	41,512,973.35	7.90
49	300033	同花顺	40,200,301.49	7.65
50	300373	扬杰科技	39,405,676.62	7.50
51	002104	恒宝股份	38,704,759.55	7.36
52	600630	龙头股份	37,477,273.16	7.13
53	002466	天齐锂业	37,345,193.52	7.11
54	002094	青岛金王	36,691,574.44	6.98
55	600718	东软集团	35,959,060.06	6.84
56	002146	荣盛发展	35,038,324.56	6.67
57	300077	国民技术	34,578,579.66	6.58
58	601336	新华保险	33,593,760.33	6.39
59	300291	华录百纳	29,864,835.14	5.68
60	600332	白云山	29,781,491.20	5.67
61	002664	信质电机	28,998,287.43	5.52
62	002008	大族激光	28,903,019.52	5.50
63	600118	中国卫星	28,835,733.82	5.49
64	600518	康美药业	26,303,492.00	5.01
65	002375	亚厦股份	24,762,393.38	4.71
66	002230	科大讯飞	23,169,804.49	4.41
67	600278	东方创业	22,825,098.09	4.34
68	600172	黄河旋风	22,151,966.27	4.22
69	600109	国金证券	21,965,481.69	4.18
70	002253	川大智胜	21,492,225.49	4.09
71	300207	欣旺达	21,127,056.18	4.02
72	600645	中源协和	20,773,261.27	3.95
73	002139	拓邦股份	20,474,507.83	3.90
74	601377	兴业证券	20,243,299.99	3.85
75	002376	新北洋	19,689,507.83	3.75
76	600893	中航动力	19,542,435.60	3.72
77	600158	中体产业	19,404,345.09	3.69
78	300024	机器人	18,198,370.46	3.46
79	600633	浙报传媒	18,104,977.00	3.45

80	600618	氯碱化工	17,422,316.22	3.32
81	000538	云南白药	16,239,550.96	3.09
82	000997	新大陆	15,971,777.19	3.04
83	600717	天津港	15,393,163.08	2.93
84	300353	东土科技	15,002,287.71	2.85
85	300166	东方国信	14,546,958.32	2.77
86	600867	通化东宝	14,265,424.39	2.71
87	300302	同有科技	14,130,808.75	2.69
88	002609	捷顺科技	14,088,759.54	2.68
89	600521	华海药业	13,856,238.35	2.64
90	603005	晶方科技	13,617,439.50	2.59
91	300274	阳光电源	13,500,059.19	2.57
92	601318	中国平安	12,845,593.88	2.44
93	300349	金卡股份	12,789,114.12	2.43
94	600196	复星医药	12,463,819.63	2.37
95	603000	人民网	12,253,401.26	2.33
96	601126	四方股份	12,106,630.00	2.30
97	002024	苏宁云商	12,085,647.70	2.30
98	300170	汉得信息	10,816,740.58	2.06
99	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。

#### 8.4.3 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	5,712,508,712.98
卖出股票的收入（成交）总额	4,826,923,448.21

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。

#### 8.5 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	170,941,603.00	1.84
2	央行票据	—	—
3	金融债券	5,533,224,655.40	59.71
	其中：政策性金融债	5,533,224,655.40	59.71
4	企业债券	1,714,132,959.80	18.50

5	企业短期融资券	191,628,000.00	2.07
6	中期票据	82,083,000.00	0.89
7	可转债（可交换债）	251,596,055.10	2.72
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	7,943,606,273.30	85.73

#### 8.6 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	150215	15国开15	13,800,000	1,381,794,000.00	14.91
2	150408	15农发08	4,800,000	487,920,000.00	5.27
3	150416	15农发16	4,000,000	400,920,000.00	4.33
4	100303	10进出03	3,900,000	395,694,000.00	4.27
5	150413	15农发13	3,500,000	350,385,000.00	3.78

#### 8.7 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。

#### 8.8 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。

#### 8.9 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。

#### 8.10 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。

#### 8.11 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。

## 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，在报告编制日前一年内也没有受到公开谴责、处罚。

8.12.2 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。

### 8.12.3 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	2,984,123.59
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	176,632,293.50
5	应收申购款	25,740,414.15
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	205,356,831.24

### 8.12.4 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	113008	电气转债	251,596,055.10	2.72

### 8.12.5 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。

### 8.12.6 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。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 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
20,657	308,549	5,624,153,753.57	88.24%	749,543,002.19	11.76%

### 9.2 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	1,518,564.88	0.02%

### 9.3 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

## § 10 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	17,166,187,530.79
减：本报告期基金总赎回份额	11,169,836,544.51
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	6,373,696,755.76

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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

#### 11.2.1 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《基金行业高级管理人员变更公告》。

#### 11.2.2 报告期内基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 11.3 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。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略没有改变。

### 11.5 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；报告期应支付给毕马威华振会计师事务所审计的报酬为人民币60,000.00元，该审计机构为本基金提供的审计服务的连续年限为7年。

## 11.6 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。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 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	12.96%	1,243,509.56	13.47%	
海通证券	1	1,310,972,957.13	12.44%	1,081,157.95	11.71%	
东方证券	1	1,285,846,118.72	12.20%	1,062,328.27	11.50%	
中信证券	1	1,074,936,729.55	10.20%	995,770.02	10.78%	
宏源证券	1	1,056,475,619.81	10.02%	961,815.13	10.42%	
中金公司	1	1,004,446,034.74	9.53%	914,968.83	9.91%	
长江证券	1	752,574,499.92	7.14%	625,614.67	6.77%	
银河证券	1	733,927,275.32	6.96%	677,623.39	7.34%	
国元证券	1	623,992,353.61	5.92%	568,083.95	6.15%	
华泰证券	1	479,181,368.81	4.55%	396,783.40	4.30%	
平安证券	1	475,579,815.16	4.51%	395,347.61	4.28%	
安信证券	1	374,866,332.57	3.56%	311,626.47	3.37%	
中邮证券	1	—	—	—	—	
北京高华证券	1	—	—	—	—	

### 11.7.2 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	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	1,149,031,435.03	20.57%	6,725,800,000.00	17.27%
海通证券	2,020,674,907.11	36.18%	11,725,000,000.00	30.11%
东方证券	172,738,814.63	3.09%	1,102,000,000.00	2.83%
中信证券	18,525,751.62	0.33%	580,000,000.00	1.49%

宏源证券	148,360,250.58	2.66%	1,170,000,000.00	3.00%
中金公司	1,056,005,411.04	18.91%	5,676,900,000.00	14.58%
长江证券	10,556,805.50	0.19%	430,000,000.00	1.10%
银河证券	247,283,466.78	4.43%	1,094,050,000.00	2.81%
国元证券	193,818,552.84	3.47%	2,207,000,000.00	5.67%
华泰证券	50,510,581.18	0.90%	460,000,000.00	1.18%
平安证券	32,113,690.00	0.57%	7,214,800,000.00	18.53%
安信证券	6,715,279.40	0.12%	552,000,000.00	1.42%
中邮证券	—	—	—	—
北京高华证 券	478,829,401.16	8.57%	—	—

注：1、本报告期租用证券公司交易单元变化情况如下：

新增海通证券、东方证券、长江证券、华泰证券、平安证券、安信证券各 1 个交易单元，退租国元证券、日信证券、中信建投、瑞银证券、国联证券各 1 个交易单元。

## 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。

## 11.8 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	2015-01-01

## 长信利丰债券型证券投资基金2015年年度报告

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	2015-01-15
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	2015-01-21
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	2015-02-11
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	2015-02-14
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	2015-03-04
7	长信基金管理有限责任公司关于旗下开放式证券投资基金参加杭州数米基金销售有限公司申购费率优惠活动的公告	上证报、中证报、 证券时报	2015-03-09
8	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	2015-03-21
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	2015-03-23
10	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	2015-03-23
11	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	2015-03-28
12	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	2015-04-20
13	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	2015-04-29
14	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	2015-05-12
15	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	上证报、中证报、 证券时报、证券日报	2015-06-11

长信利丰债券型证券投资基金2015年年度报告

	及开通转换业务的公告		
16	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	2015-06-25
17	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	2015-07-21
18	长信基金管理有限责任公司关于增加中信期货有限公司为旗下部分基金代销机构的公告	上证报、中证报、 证券时报、证券日报	2015-08-05
19	长信基金管理有限责任公司关于增加浙江同花顺基金销售有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中证报、 证券时报、证券日报	2015-08-12
20	长信利丰债券型证券投资基金更新的招募说明书（2015年【2】号）及摘要	中证报、证券时报	2015-08-12
21	长信基金管理有限责任公司关于旗下开放式证券投资基金参加上海天天基金销售有限公司认购、申购（含定期定额投资申购）费率优惠的公告	上证报、中证报、 证券时报、证券日报	2015-08-22
22	长信利丰债券型证券投资基金2015年半年度报告及摘要	中证报、证券时报	2015-08-27
23	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参加国都证券股份有限公司申购费率优惠的公告	上证报、中证报、 证券时报、证券日报	2015-08-27
24	长信基金管理有限责任公司关于旗下开放式证券投资基金参加华宝证券有限责任公司申购费率优惠的公告	上证报、中证报、 证券时报、证券日报	2015-09-02
25	长信基金管理有限责任公司关于增加上海汇付金融服务有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中证报、 证券时报、证券日报	2015-09-10
26	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参加上海好买基金销售有限公司认购、申购（含定期定额投资申购）费率优惠的公告	上证报、中证报、 证券时报、证券日报	2015-09-24
27	长信基金管理有限责任公司关于“长金通”网上直销平台申购（含定期定额申购）费率优惠的公告	上证报、中证报、 证券时报	2015-10-21

## 长信利丰债券型证券投资基金2015年年度报告

28	长信利丰债券型证券投资基金2015年第3季度报告	中证报、证券时报	2015-10-26
29	长信基金管理有限责任公司关于增加大泰金石投资管理有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中证报、 证券时报、证券日报	2015-10-29
30	长信基金管理有限责任公司关于旗下开放式证券投资基金参加上海长量基金销售投资顾问有限公司认购、申购（含定期定额投资申购）费率优惠的公告	上证报、中证报、 证券时报	2015-11-16
31	长信基金管理有限责任公司关于增加上海陆金所资产管理有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并参加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	2015-11-26
32	长信基金管理有限责任公司关于增加上海联泰资产管理有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中证报、 证券时报、证券日报	2015-12-01
33	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金参加平安证券有限责任公司申购（含定期定额投资申购）费率优惠的公告	上证报、中证报、 证券时报、证券日报	2015-12-18
34	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金参加中国农业银行股份有限公司基金组合申购、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	2015-12-30
35	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金参加平安银行股份有限公司申购（含定期定额投资申购）费率优惠的公告	上证报、中证报、 证券时报	2015-12-30
36	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分基金参加中国工商银行股份有限公司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	2015-12-30
37	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金调整开放时间的公告	上证报、中证报、 证券时报、证券日报	2015-12-31

## § 12 备查文件目录

### 12.1 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。

### 12.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

### 12.3 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

二〇一六年三月二十六日