

长信利丰债券型证券投资基金2015年年度报告摘要

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

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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自2015年1月1日起至2015年12月31日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	长信利丰债券
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

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	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

§ 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

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。

3.2 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	116.87%	0.48%	44.07%	0.19%	72.80%	0.29%

(2008年12月29日至2015年12月31日)						
---------------------------	--	--	--	--	--	--

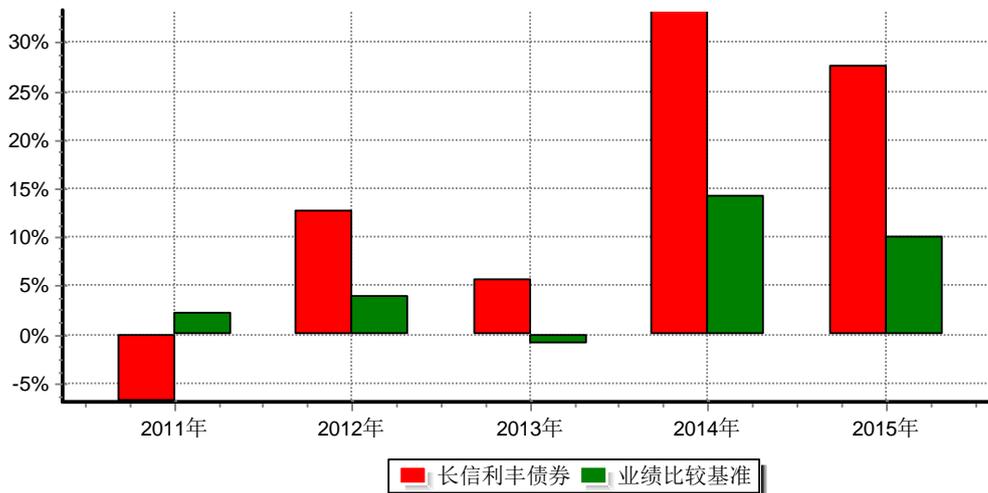
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



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

长信利丰债券型证券投资基金2015年年度报告摘要

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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规和本基金基金合同规定的基金收益分配原则以及基金实际运作情况，本基金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。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

本基金2015年度财务报告经毕马威华振会计师事务所审计,注册会计师出具了无保留意见的审计报告(毕马威华振审字第1600140号),投资者可以通过年度报告正文查看审计报告全文。

§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	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
资产：		
银行存款	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	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	—	—
买入返售金融资产	350,001,325.00	—
应收证券清算款	—	8,992,306.23
应收利息	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	—	—
资产总计	10,881,151,458.78	744,266,345.16
负债和所有者权益	本期末 2015年12月31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	—	—
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年年度报告摘要

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	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	333,544.49	455,297.02
负债合计	1,615,028,027.29	218,727,480.41
所有者权益：		
实收基金	6,373,696,755.76	377,345,769.48
未分配利润	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	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
一、收入	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	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	267,768,918.67	15,906,167.19
基金投资收益	—	—
债券投资收益	106,435,653.09	39,564,653.69
资产支持证券投资收益	—	—
贵金属投资收益	—	—
衍生工具收益	—	—

长信利丰债券型证券投资基金2015年年度报告摘要

股利收益	1,019,797.36	207,141.56
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	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）	3,681,785.21	74,865.44
减：二、费用	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	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	324,787.73	279,845.02
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	60,092,691.66	66,041,485.90
减：所得税费用	—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	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
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	—	-2,092,663,913.10	-2,092,663,913.10

长信利丰债券型证券投资基金2015年年度报告摘要

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)	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 \times 90%+中证800指数 \times 10%。

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

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 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计估计发生变更，对本基金本报告期无重大影响，会计政策与上年度会计报表一致。

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 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

长信利丰债券型证券投资基金2015年年度报告摘要

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

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 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%	—	—

7.4.8.1.2 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%	—	—

7.4.8.1.3 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%	—	—

7.4.8.1.4 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。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

长信利丰债券型证券投资基金2015年年度报告摘要

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	—	—	—	—

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 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

7.4.8.2.2 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

7.4.8.2.3 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

长信利丰债券型证券投资基金2015年年度报告摘要

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

7.4.8.3 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。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 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。

7.4.8.4.2 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。

7.4.8.5 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）

7.4.8.6 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。

7.4.8.7 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。

7.4.9 期末（2015年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 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。

7.4.9.2 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	2016-1-4	63.90	373	50.93	24,248.73
002049	同方国芯	2015-12-10	重大事项	60.15	—	—	52	2,202.05	3,127.80

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 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

7.4.9.3.2 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。

§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

长信利丰债券型证券投资基金2015年年度报告摘要

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

本基金本报告期末未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前十名股票投资明细

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

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于长信基金管理有限责任公司网站的年度报告正文。

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

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

长信利丰债券型证券投资基金2015年年度报告摘要

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
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

长信利丰债券型证券投资基金2015年年度报告摘要

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
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

长信利丰债券型证券投资基金2015年年度报告摘要

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

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

长信利丰债券型证券投资基金2015年年度报告摘要

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
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

长信利丰债券型证券投资基金2015年年度报告摘要

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

长信利丰债券型证券投资基金2015年年度报告摘要

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前十名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%

长信利丰债券型证券投资基金2015年年度报告摘要

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。

长信基金管理有限责任公司

二〇一六年三月二十六日