

长信利富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：中国工商银行股份有限公司

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的法律责任。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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司（以下简称“中国工商银行”，下同）根据本基金基金合同规定，于2016年3月23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5月6日（本基金基金合同生效日）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	长信利富债券
场内简称	长信利富
基金主代码	519967
交易代码	519967
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年5月6日
基金管理人	长信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,753,364,083.95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，力争为投资者提供稳定增长的投资收益。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金将利用全球信息平台、外部研究平台、行业信息平台以及自身的研究平台等信息资源，基于本基金的投资目标和投资理念，从宏观和微观两个角度进行研究，开展战略资产配置，之后通过战术资产配置再平衡基金资产组合，实现组合内各类别资产的优化配置，并对各类资产的配置比例进行定期或不定期调整。</p> <p>2、债券投资策略</p> <p>本基金主要采用积极管理型的投资策略，自上而下分为战略性策略和战术性策略两个层面，结合对各市场上不同投资品种的具体分析，共同构成本基金的投资策略结构。</p> <p>3、股票投资策略</p> <p>(1) 行业配置策略</p> <p>在行业配置层面，本基金将运用“自上而下”的行业配置方法，通过对国内外宏观经济走势、经济结构转型的方向、国家经济与产业政策导向和经济周期调整的深入研究，采用价值理念与成长理念相结合的方法对行业进行筛选。</p> <p>(2) 个股投资策略</p> <p>本基金将结合定性与定量分析，主要采取自下而上的选股策略。基金依据约定的投资范围，基于对上市公司的品质</p>

长信利富债券型证券投资基金2015年年度报告摘要

	<p>评估分析、风险因素分析和估值分析，筛选出基本面良好的股票进行投资，在有效控制风险前提下，争取实现基金资产的长期稳健增值。</p> <p>4、其他类型资产投资策略</p> <p>在法律法规或监管机构允许的情况下，本基金将在严格控制投资风险的基础上适当参与权证、资产支持证券等金融工具的投资。</p>
业绩比较基准	三年期银行定期存款利率(税后)+ 1.5%
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险和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	中国工商银行股份有限公司
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	95588
传真	021-61009800	010-66105798

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55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5月6日（基金合同生效日）-2015年12月31日
本期已实现收益	45,314,272.31
本期利润	109,418,759.72
加权平均基金份额本期利润	0.0771
本期基金份额净值增长率	5.05%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末
期末可供分配基金份额利润	0.0029
期末基金资产净值	2,892,280,277.44
期末基金份额净值	1.0505

注：1、本基金基金合同生效日为2015年5月6日，截至本报告期末，本基金运作未满一年。

2、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。

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	8.28%	0.56%	1.09%	0.00%	7.19%	0.56%
过去六个月	5.17%	0.85%	2.29%	0.00%	2.88%	0.85%
自基金合同生效日起至今（2015年5月6日-2015年12月31日）	5.05%	0.81%	3.07%	0.00%	1.98%	0.81%

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、本基金基金合同生效日为2015年5月6日，基金合同生效日至本报告期末，本基金运作时间未满一年。图示日期为2015年5月6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，报告期末已完成建仓但报告期末距建仓结束不满一年；建仓期结束时，本基金的各项投资比例已符合基金合同的约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金基金合同生效日为2015年5月6日，2015年净值增长率按当年实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金基金合同生效日为2015年5月6日,本基金基金合同生效日起至本报告期末未进行利润分配。

§ 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、长信利丰债券型证券投资基金和长信	2015年5月6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。2003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一年定期开放债券

	利保债券型证券投资基金的基金经理、公司副总经理、固定收益部总监、投资决策委员会执行委员			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、长信利丰债券型证券投资基金、长信利保债券型证券投资基金和长信可转债债券型证券投资基金的基金经理。
--	---	--	--	--

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

2、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2015年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。

本基金自成立后维持信用债配置，适度控制久期，精选个券，规避信用风险，加大了灵活操作的力度，以提高组合的安全性。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2015年12月31日，本基金单位净值为1.0505元，份额累计净值为1.0505元，本报告期内本基金净值增长率为5.05%，同期业绩比较基准涨幅为3.07%。

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，本基金本报告期没有进行利润分配。

本基金收益分配原则如下：

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认为的收益分配方式是现金分红；

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

4、每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

本报告期内，长信利富债券型证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对长信基金管理有限责任公司编制和披露的长信利富债券型证券投资基金 2015 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

本报告期本基金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1600155号），投资者可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：长信利富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
资 产：	
银行存款	507,626,462.43
结算备付金	15,881,319.11
存出保证金	836,336.90
交易性金融资产	3,045,471,062.47
其中：股票投资	483,233,610.27
基金投资	—
债券投资	2,562,237,452.20
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	50,000,195.00
应收证券清算款	1,913,551.51
应收利息	58,484,398.10
应收股利	—
应收申购款	25,158,080.73
递延所得税资产	—
其他资产	—
资产总计	3,705,371,406.25
负债和所有者权益	本期末 2015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	602,998,495.50
应付证券清算款	205,778,602.98
应付赎回款	513,077.81
应付管理人报酬	1,670,021.98

长信利富债券型证券投资基金2015年年度报告摘要

应付托管费	477,149.12
应付销售服务费	—
应付交易费用	1,233,788.21
应交税费	—
应付利息	148,835.32
应付利润	—
递延所得税负债	—
其他负债	271,157.89
负债合计	813,091,128.81
所有者权益：	
实收基金	2,753,364,083.95
未分配利润	138,916,193.49
所有者权益合计	2,892,280,277.44
负债和所有者权益总计	3,705,371,406.25

注：1、报告截止日2015年12月31日，基金份额净值1.0505元，基金份额总额2,753,364,083.95份。

2、本基金本报告期为2015年5月6日至2015年12月31日，本基金基金合同于2015年5月6日起正式生效，为报告期内合同生效的基金，本报告期的财务报表和报表附注均无同期对比数据。

7.2 利润表

会计主体：长信利富债券型证券投资基金

本报告期：2015年5月6日至2015年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2015年5月6日（基金合同生效日）至2015年12月31日
一、收入	125,635,579.51
1. 利息收入	39,660,320.11
其中：存款利息收入	931,813.31
债券利息收入	38,447,737.12
资产支持证券利息收入	—
买入返售金融资产收入	280,769.68
其他利息收入	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）	21,335,228.89
其中：股票投资收益	31,339,399.99
基金投资收益	—

长信利富债券型证券投资基金2015年年度报告摘要

债券投资收益	-10,128,128.40
资产支持证券投资收益	—
贵金属投资收益	—
衍生工具收益	—
股利收益	123,957.30
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	64,104,487.41
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	535,543.10
减：二、费用	16,216,819.79
1. 管理人报酬	6,579,266.06
2. 托管费	1,879,790.22
3. 销售服务费	—
4. 交易费用	5,122,285.01
5. 利息支出	2,349,145.23
其中：卖出回购金融资产支出	2,349,145.23
6. 其他费用	286,333.27
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	109,418,759.72
减：所得税费用	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	109,418,759.72

注：本基金本报告期为2015年5月6日至2015年12月31日，本基金基金合同于2015年5月6日起正式生效，为报告期内合同生效的基金，本报告期的财务报表和报表附注均无同期对比数据。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长信利富债券型证券投资基金

本报告期：2015年5月6日至2015年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期		
	2015年5月6日（基金合同生效日）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)	568,039,225.55	—	568,039,225.55
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	109,418,759.72	109,418,759.72
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减	2,185,324,858.40	29,497,433.77	2,214,822,292.17

少以“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	2,875,181,447.63	53,693,373.04	2,928,874,820.67
2. 基金赎回款	-689,856,589.23	-24,195,939.27	-714,052,528.50
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)	2,753,364,083.95	138,916,193.49	2,892,280,277.44

注：本基金本报告期为2015年5月6日至2015年12月31日，本基金基金合同于2015年5月6日起正式生效，为报告期内合同生效的基金，本报告期的财务报表和报表附注均无同期对比数据。

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 烨	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

长信利富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”)《关于准予长信利富债券型证券投资基金注册的批复》(中国证监会证监许可[2015]1243号)批准，由长信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《长信利富债券型证券投资基金基金合同》发售，基金合同于2015年5月6日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为长信基金管理有限责任公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称“中国工商银行”)。

本基金于2015年4月15日至2015年4月30日募集，募集资金总额人民币567,792,381.27元，利息转份额人民币246,844.28元，募集规模为568,039,225.55份。上述募集资金已由毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)验证，并出具了毕马威华振验字第1500369号验资报告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《长信利富债券型

证券投资基金基金合同》和《长信利富债券型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金主要投资于具有良好流动性的固定收益类金融工具，包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、短期融资券、超级短期融资券、中期票据、资产支持证券、次级债券、可转债及分离交易可转债、中小企业私募债、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

本基金还可持有可转债转股所得的股票、投资二级市场股票以及权证等中国证监会允许基金投资的其它金融工具。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，其投资比例遵循届时有效的法律法规和相关规定。

基金的投资组合比例为：本基金投资于债券的比例不低于基金资产的80%，投资于权益类资产的比例不超过基金资产的20%，现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为：三年期银行定期存款利率（税后）+1.5%。

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5月6日至2015年12月31日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。本期会计报表的实际编制期间为2015年5月6日（基金合同生效日）至2015年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。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

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：

-金融所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《长信利富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《长信利富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。

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

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为12次，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认为的收益分配方式是现金分红；

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

4、每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，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通知》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

本基金在本期间未发生重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本年末未发生重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本期间未发生重大会计差错更正。

7.4.6 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：

(1)以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(2)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。

(3)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。

(4)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。

(5) 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。

(6) 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。

7.4.7 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
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	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-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

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.8.1.2 债券交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.8.1.3 债券回购交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

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5月6日（基金合同生效日）至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	6,579,266.06
其中：支付销售机构的客户维护费	1,160,556.25

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5月6日（基金合同生效日）至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,879,790.22

注：支付基金托管人中国工商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

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方通过银行间同业市场进行过债券(含回购)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

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
长信-优享1号资产管理计划	17,224,745.39	0.63%
长信-策略3号资产管理计划	515,152,717.59	18.71%

长信-策略4号资产管理计划	379,077,623.77	13.77%
长信-策略6号资产管理计划	170,939,380.00	6.21%

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5月6日（基金合同生效日）至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	507,626,462.43	839,182.13

注：本基金通过“中国工商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15,881,319.11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

本基金本报告期内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
600271	航天信息	2015-12-10	重大资产重组	55.91	-	-	50,000	2,375,278.00	2,795,500.00
600645	中源协和	2015-12-31	重要事项未公告	65.01	2016-01-04	63.90	47,100	2,397,845.32	3,061,971.00
600699	均胜电子	2015-11-04	重大资产重组	31.25	2016-03-10	29.00	259,919	6,787,136.19	8,122,468.75
002568	百润股份	2015-12-21	重大事项	42.69	2016-01-18	38.42	114,100	5,487,409.95	4,870,929.00
002664	信质电机	2015-12-30	拟披露重大事	31.77	2016-03-08	28.59	162,300	4,550,141.54	5,156,271.00

长信利富债券型证券投资基金2015年年度报告摘要

			项						
002707	众信旅游	2015-11-16	重大资产重组	52.62	2016-03-15	47.36	90,398	2,535,783.37	4,756,742.76
300010	立思辰	2015-12-30	拟披露重大事项	31.90	2016-01-08	28.71	201	7,146.21	6,411.90
300028	金亚科技	2015-6-9	重大事项	24.48	-	-	65,000	2,769,727.00	1591200.00

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602,998,495.50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
1480283	14仁怀城投债	2016-01-06	110.04	400,000	44,016,000.00
1580067	15苏通债	2016-01-06	107.45	300,000	32,235,000.00
1580049	15乳山债	2016-01-06	106.95	400,000	42,780,000.00
150206	15国开06	2016-01-06	100.43	1,400,000	140,602,000.00
1480003	14仪征债	2016-01-06	112.35	300,000	33,705,000.00
1280261	12咸宁城投债	2016-01-06	79.03	400,000	31,612,000.00
150417	15农发17	2016-01-11	101.42	1,000,000	101,420,000.00
150413	15农发13	2016-01-11	100.11	1,500,000	150,165,000.00
150403	15农发03	2016-01-11	100.20	500,000	50,100,000.00
合计					626,635,000.00

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因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	483,233,610.27	13.04
	其中：股票	483,233,610.27	13.04
2	固定收益投资	2,562,237,452.20	69.15
	其中：债券	2,562,237,452.20	69.15
	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	50,000,195.00	1.35
	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	523,507,781.54	14.13
7	其他各项资产	86,392,367.24	2.33
8	合计	3,705,371,406.25	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	257,459,894.84	8.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	5,604.00	—
F	批发和零售业	7,987,000.00	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	185,124,268.54	6.40
J	金融业	3,856,068.52	0.13

长信利富债券型证券投资基金2015年年度报告摘要

K	房地产业	2,881,648.70	0.10
L	租赁和商务服务业	4,756,742.76	0.16
M	科学研究和技术服务业	3,061,971.00	0.11
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	31,007.60	—
S	综合	18,069,404.31	0.62
	合计	483,233,610.27	16.71

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	1,386,509	36,756,353.59	1.27
2	300124	汇川技术	566,625	26,744,700.00	0.92
3	300146	汤臣倍健	664,904	25,598,804.00	0.89
4	300016	北陆药业	719,192	25,538,507.92	0.88
5	300253	卫宁软件	486,173	20,360,925.24	0.70
6	600895	张江高科	626,757	18,069,404.31	0.62
7	600588	用友网络	558,114	17,753,606.34	0.61
8	002439	启明星辰	502,449	16,078,368.00	0.56
9	300007	汉威电子	419,686	14,353,261.20	0.50
10	000848	承德露露	715,900	11,812,350.00	0.41

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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例（%）
1	300124	汇川技术	82,482,675.24	2.85
2	300146	汤臣倍健	75,390,887.23	2.61
3	002339	积成电子	75,227,681.60	2.60

长信利富债券型证券投资基金2015年年度报告摘要

4	300253	卫宁健康	70,610,288.27	2.44
5	002439	启明星辰	53,303,358.19	1.84
6	600571	信雅达	50,631,227.93	1.75
7	600410	华胜天成	50,564,398.52	1.75
8	300016	北陆药业	45,696,359.68	1.58
9	300378	鼎捷软件	41,000,773.96	1.42
10	300369	绿盟科技	40,312,488.48	1.39
11	002407	多氟多	39,748,467.73	1.37
12	601688	华泰证券	39,739,499.96	1.37
13	300246	宝莱特	39,548,824.88	1.37
14	300077	国民技术	39,301,593.89	1.36
15	300007	汉威电子	35,151,363.96	1.22
16	600895	张江高科	34,190,034.20	1.18
17	000555	神州信息	34,020,050.88	1.18
18	600728	佳都科技	33,395,294.43	1.15
19	002184	海得控制	31,767,405.41	1.10
20	603019	中科曙光	30,376,939.91	1.05

注：本项“买入金额”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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	002339	积成电子	62,940,580.45	2.18
2	300253	卫宁健康	51,160,321.40	1.77
3	300124	汇川技术	49,832,253.61	1.72
4	300146	汤臣倍健	44,487,431.37	1.54
5	002407	多氟多	42,170,336.34	1.46
6	600571	信雅达	40,475,506.90	1.40
7	002439	启明星辰	37,940,633.80	1.31
8	300246	宝莱特	36,745,408.54	1.27
9	300378	鼎捷软件	36,126,234.62	1.25
10	601688	华泰证券	35,681,434.49	1.23
11	300369	绿盟科技	34,553,132.97	1.19
12	600728	佳都科技	33,367,468.54	1.15
13	002385	大北农	31,077,592.65	1.07
14	300007	汉威电子	30,992,128.36	1.07
15	000555	神州信息	28,549,976.55	0.99
16	600999	招商证券	27,778,695.58	0.96
17	600718	东软集团	26,486,388.96	0.92

长信利富债券型证券投资基金2015年年度报告摘要

18	002184	海得控制	26,017,867.13	0.90
19	603019	中科曙光	25,146,014.81	0.87
20	002189	利达光电	24,701,238.84	0.85

注：本项“卖出股票的收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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	2,043,158,690.37
卖出股票的收入（成交）总额	1,619,810,170.62

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

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	152,017,147.40	5.26
2	央行票据	—	—
3	金融债券	1,432,074,000.00	49.51
	其中：政策性金融债	1,432,074,000.00	49.51
4	企业债券	745,236,931.60	25.77
5	企业短期融资券	100,201,000.00	3.46
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	132,708,373.20	4.59
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	2,562,237,452.20	88.59

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	150211	15国开11	3,000,000	300,870,000.00	10.40
2	150302	15进出02	2,000,000	202,500,000.00	7.00
3	150206	15国开06	1,500,000	150,645,000.00	5.21
4	150413	15农发13	1,500,000	150,165,000.00	5.19
5	113008	电气转债	963,960	132,708,373.20	4.59

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

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	836,336.90
2	应收证券清算款	1,913,551.51
3	应收股利	—
4	应收利息	58,484,398.10
5	应收申购款	25,158,080.73
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—

8	其他	—
9	合计	86,392,367.24

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	132,708,373.20	4.59

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
1,959	1,405,494.68	2,614,063,114.01	94.94%	139,300,969.94	5.06%

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	1,874.74	0.00%

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
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2015年5月6日)基金份额总额	568,039,225.55
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	2,875,181,447.63
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	689,856,589.23
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	2,753,364,083.95

§ 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

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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

本报告期本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审计服务的连续年限为1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

本报告期本基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关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	
安信证券	2	1,403,284,247.16	38.31%	1,166,550.04	37.70%	
宏源证券	2	819,117,313.10	22.36%	745,724.51	24.10%	
国信证券	2	745,501,347.22	20.35%	616,751.31	19.93%	
申银万国	1	695,065,953.51	18.98%	565,093.54	18.26%	

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
安信证券	292,514,564.93	13.98%	3,807,000,000.00	28.04%
宏源证券	901,749,718.94	43.10%	950,000,000.00	7.00%
国信证券	844,206,899.65	40.35%	8,822,000,000.00	64.97%
申银万国	53,836,453.08	2.57%	—	—

注：1、本报告期租用证券公司交易单元新增了国信证券2个席位、安信证券2个席位、申银万国1个席位和宏源证券2个席位。

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