

长信富海纯债一年定期开放债券型证券投资 基金 2016 年半年度报告

2016 年 6 月 30 日

基金管理人：长信基金管理有限责任公司

基金托管人：渤海银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 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、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人渤海银行股份有限公司，根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 2016 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	13
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18
§7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况.....	35
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	35
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	35
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	36
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	36
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	36
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	36
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	36
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	37
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	37
7.12 投资组合报告附注.....	37

§8 基金份额持有人信息	38
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	38
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	38
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	38
§9 开放式基金份额变动	39
§10 重大事件揭示	40
10.1 基金份额持有人大会决议.....	40
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	40
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	40
10.4 基金投资策略的改变.....	40
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	40
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	40
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	41
10.8 其他重大事件.....	41
§11 备查文件目录	43
11.1 备查文件目录.....	43
11.2 存放地点.....	43
11.3 查阅方式.....	43

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长信富海纯债一年定期开放债券型证券投资基金
基金简称	长信富海纯债一年定开债券
场内简称	长信富海
基金主代码	519953
交易代码	519953
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年9月30日
基金管理人	长信基金管理有限责任公司
基金托管人	渤海银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,182,700,474.41份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为纯债基金，以获取高于业绩比较基准的回报为目标，追求每年较高的绝对回报。
投资策略	本基金在封闭期与开放期采取不同的投资策略。 1、封闭期投资策略 (1) 资产配置策略 (2) 类属配置策略 (3) 个券选择策略 (4) 骑乘策略 (5) 息差策略 (6) 利差策略 (7) 资产支持证券的投资策略 2、开放期投资策略 开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种，减小基金净值的波动。
业绩比较基准	固定业绩基准 7%
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，其预期风险与收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

名称	长信基金管理有限责任公司	渤海银行股份有限公司	
信息披露负责人	姓名	周永刚	阮劲松
	联系电话	021-61009999	010-66270109
	电子邮箱	zhouyg@cxfund.com.cn	js.ruan@cbhb.com.cn
客户服务电话	4007005566	400-888-8811	
传真	021-61009800	022-58314791	
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区银城中路68号9楼	天津市河东区海河东路218号	
办公地址	上海市浦东新区银城中路68号9楼	天津市河东区海河东路218号	
邮政编码	200120	300012	
法定代表人	叶烨	李伏安	

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.cxfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	上海市浦东新区银城中路68号9楼、天津市河东区海河东路218号渤海银行大厦57层

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2016年1月1日 - 2016年6月30日)
本期已实现收益	47,263,394.28
本期利润	31,592,044.29
加权平均基金份额本期利润	0.0267
本期加权平均净值利润率	2.55%
本期基金份额净值增长率	2.58%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016年6月30日)
期末可供分配利润	61,557,481.78
期末可供分配基金份额利润	0.0520
期末基金资产净值	1,254,973,660.47
期末基金份额净值	1.0611
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016年6月30日)
基金份额累计净值增长率	6.11%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

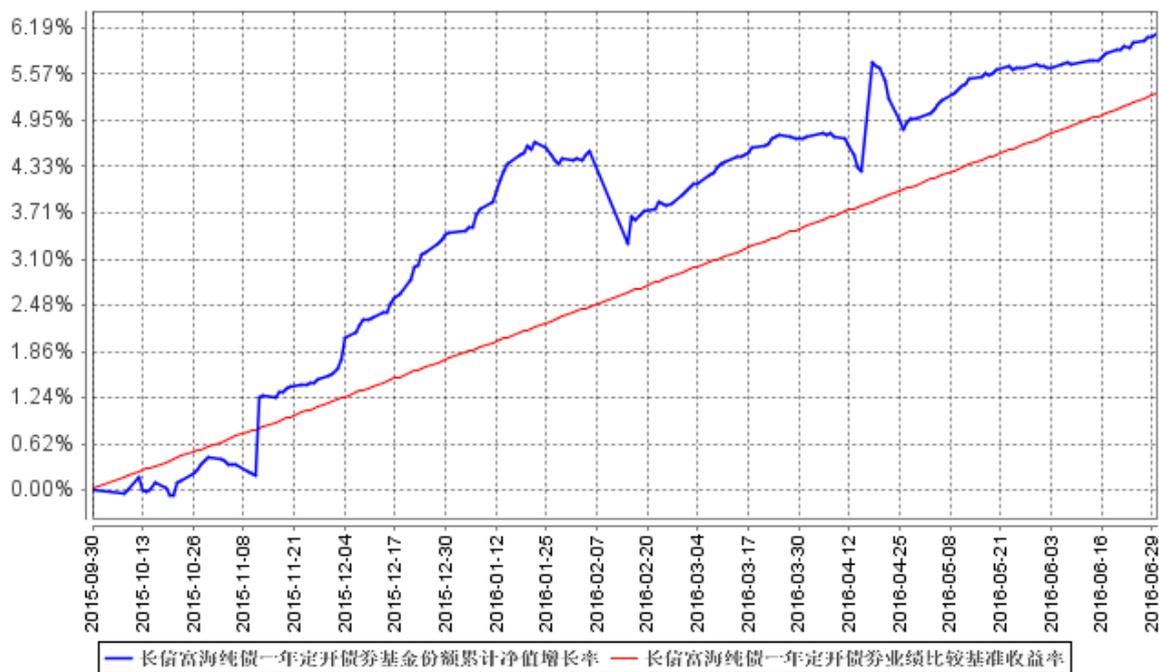
3、期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.42%	0.03%	0.58%	0.02%	-0.16%	0.01%
过去三个月	1.33%	0.19%	1.76%	0.02%	-0.43%	0.17%
过去六个月	2.58%	0.18%	3.55%	0.02%	-0.97%	0.16%
自基金合同生效起至今	6.11%	0.17%	5.41%	0.02%	0.70%	0.15%

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 9 月 30 日，基金合同生效日至报告期期末，本基金运作不满一年。图示日期为 2015 年 9 月 30 日至 2016 年 6 月 30 日。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内为建仓期，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。

§ 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 2016 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 37 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)、长信利鑫债券 (LOF)、长信内需成长混合、长信可转债债券、长信利众债券 (LOF)、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、长信中证能源互联网指数 (LOF)、长信金葵纯债一年定开债券、长信富全纯债一年定开债券、长信利泰混合、长信海外收益一年定开债券 (QDII)、长信先锐债券、长信利发债券。

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（助理） 期限		证券从 业年限	说明
		任职日期	离任日期		
吴哲	本基金、长信纯债一年定开债券基金、长信富民纯债一年定开债券基金、长信富安纯债一年定开债券基金和长信先锐债券基金的基金经理	2015 年 9 月 30 日	-	7 年	运筹学与控制论专业硕士，复旦大学研究生毕业，具备基金从业资格。曾任职于汇丰晋信基金管理有限责任公司，担任助理债券研究员；2013 年加入长信基金管理有限责任公司，担任公司固定收益部基金经理助理。现任本基金、长信纯债一年定开债

					券基金、长信富民纯债一年定开债券基金、长信富安纯债一年定开债券基金和长信先锐债券基金的基金经理。
--	--	--	--	--	--

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、本基金基金经理的证券从业年限以基金经理进入证券业务相关机构的工作经历为时间计算标准。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，除完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合外，其余各投资组合未发生参与交易所公开竞价同日反向交易且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。

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

2016 年以来，全球经济继续维持弱复苏状态，美联储加息一次后受制于经济增长和通胀因素开始趋于谨慎，新兴市场货币和股市年初大幅下跌后逐渐企稳。6 月英国脱欧事件对全球金融市场冲击较大，全球风险偏好下降。2016 年上半年中国经济继续缓慢下行，一季度发放天量信贷后数据开始降温。大宗商品价格在一季度暴涨后开始回调，带动 CPI 小幅下行。

2016 年一季度利率债收益率缓慢上行，城投收益率持续走低，4 月份债券市场经历了一波较大的调整，主要是资金利率短期波动，经济数据短期显著走强以及信用风险集中爆发所致。5 月份，利空得到缓解，经济数据再度走弱，权威人士称经济 L 型，信贷社融不及预期；并且信用违约没有新增超预期的主体。之后债券收益率小幅下降，但整体买盘不踊跃。6 月份在英国脱欧事件带动下，避险情绪上升，债券市场走出了一波较好的行情。从品种来看，城投债收益率下行幅度较大，是今年以来资本利得最大的品种，低评级民企信用利差持续扩大。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.0611 元，份额累计净值为 1.0611 元，本报告期内本基金净值增长率为 2.58%，同期业绩比较基准涨幅为 3.55%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从基本面来看，今年较去年出现了一些变化，随着外围市场不稳定导致政策预期波动较大，经济数据和金融市场都波动较大。大宗商品也开始逐渐走出几年的漫漫熊市，CPI 低位震荡，PPI 负值收窄。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。未来一段时间是过剩债券到期的高峰期，下一个信用债的雷在哪里非常难判断，但经济继续探底，违约率上升毋庸置疑。此外，今年以来评级下调次数上升幅度明显；未来两个月是评级调整的高峰期，对信用债市场造成进一步的影响。打破刚兑后的信用风险仍未在估值中充分反应，未来有进一步发酵的可能。因此仍然维持利率债市场震荡，低等级债券承压的判断。

我们将继续秉承谨慎原则，加强组合的流动性管理，在做好利率风险控制的同时，增加对新

经济环境下信用风险的审慎判断。适度控制组合久期，密切关注经济走势和政策动向，紧跟组合规模变动进行资产配置，争取在流动安全的前提下，为投资者获取更好的收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规和本基金基金合同规定的基金收益分配原则以及基金实际运作情况，本基金本报告期没有进行利润分配。

本基金收益分配原则如下：

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

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

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富海纯债一年定期开放债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在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，本基金托管人根据《证券投资基金法》等有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本基金托管人对长信富海纯债一年定期开放债券型证券投资基金 2016 年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：长信富海纯债一年定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2016年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.6.1	9,199,178.73	7,962,498.13
结算备付金		-	16,769,802.39
存出保证金		92,979.51	398,111.43
交易性金融资产	6.4.6.2	1,047,968,957.80	1,845,638,661.90
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,047,968,957.80	1,845,638,661.90
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.6.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.6.4	179,901,309.85	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.6.5	19,318,948.47	46,456,468.51
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.6.6	-	-
资产总计		1,256,481,374.36	1,917,225,542.36
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 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	6.4.6.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	688,698,707.45
应付证券清算款		-	3,053,837.92
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		718,064.28	720,758.54
应付托管费		205,161.22	205,931.02
应付销售服务费		410,322.44	411,862.04
应付交易费用	6.4.6.7	10,067.47	6,928.80

应交税费		-	-
应付利息		-	575,900.41
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.6.8	164,098.48	170,000.00
负债合计		1,507,713.89	693,843,926.18
所有者权益：			
实收基金	6.4.6.9	1,182,700,474.41	1,182,700,474.41
未分配利润	6.4.6.10	72,273,186.06	40,681,141.77
所有者权益合计		1,254,973,660.47	1,223,381,616.18
负债和所有者权益总计		1,256,481,374.36	1,917,225,542.36

注：1、报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0611 元，基金份额总额 1,182,700,474.41 份。

2、本基金基金合同于 2015 年 9 月 30 日起正式生效，本报告期的财务报表和报表附注均无同期对比数据。

6.2 利润表

会计主体：长信富海纯债一年定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		41,596,840.46
1.利息收入		41,078,629.74
其中：存款利息收入	6.4.6.11	109,705.39
债券利息收入		40,337,950.00
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		630,974.35
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		16,189,560.71
其中：股票投资收益	6.4.6.12	-
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.6.13	16,189,560.71
资产支持证券投资收益	6.4.6.13.3	-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.6.14	-
股利收益	6.4.6.15	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-15,671,349.99
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.6.17	-
减：二、费用		10,004,796.17
1. 管理人报酬	6.4.9.2.1	4,313,484.15
2. 托管费	6.4.9.2.2	1,232,424.08
3. 销售服务费	6.4.9.2.3	2,464,848.06
4. 交易费用	6.4.6.18	19,553.02
5. 利息支出		1,772,228.00
其中：卖出回购金融资产支出		1,772,228.00
6. 其他费用	6.4.6.19	202,258.86
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		31,592,044.29
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		31,592,044.29

注：本基金本报告期为2016年1月1日至2016年6月30日，本基金基金合同于2015年9月30日起正式生效，本报告期的财务报表和报表附注均无同期对比数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长信富海纯债一年定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,182,700,474.41	40,681,141.77	1,223,381,616.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	31,592,044.29	31,592,044.29
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,182,700,474.41	72,273,186.06	1,254,973,660.47

注：本基金本报告期为 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日，本基金基金合同于 2015 年 7 月 1 日起正式生效，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 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>覃波</u>	<u>覃波</u>	<u>孙红辉</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

长信富海纯债一年定期开放债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于准予长信富海纯债一年定期开放债券型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2015]1395号)准予注册，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《长信富海纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》发售，基金合同于 2015 年 9 月 30 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，基金托管人为渤海银行股份有限公司(以下简称“渤海银行”)。

本基金于 2015 年 9 月 14 日至 2015 年 9 月 24 日募集，募集资金总额人民币 1,182,430,496.79 元，利息转份额人民币 269,977.62 元，募集规模为 1,182,700,474.41 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 1500949 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、《长信富海纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》和《长信富海纯债一年定期开放债券型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超级短期融资券、资产支持证券、次级债券、可分离交易可转债的纯债部分、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。本基金不参与权证、股票等权益类资产投资，可转债仅投资二级市场可分离交易可转债的纯债部分。

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

基金的投资组合比例为：投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，但在每次开放期前

三个月、开放期及开放期结束后三个月的期间内，基金投资不受上述比例限制；开放期内，现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，在非开放期，本基金不受该比例的限制。

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

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证监会《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》编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2016 年 6 月 30 日的财务状况、2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.4.1 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政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.4.2 差错更正的说明

本基金在本报告期未发生过重大会计差错。

6.4.5 税项

根据财税字[1998]55 号文《财政部、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根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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，股权登记日为自 2013 年 1 月 1 日起至 2015 年 9 月 7 日期间的，暂减按 25% 计入应纳税所得额，股权登记日在 2015 年 9 月 8 日及以后的，暂免征收个人所得税。

(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。

6.4.6 重要财务报表项目的说明

6.4.6.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
活期存款	9,199,178.73
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	9,199,178.73

6.4.6.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	42,309,416.03	41,693,642.40
	银行间市场	994,943,837.49	1,006,275,315.40
	合计	1,037,253,253.52	1,047,968,957.80
			-615,773.63
			11,331,477.91
			10,715,704.28

资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,037,253,253.52	1,047,968,957.80	10,715,704.28

6.4.6.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.6.4 买入返售金融资产

6.4.6.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间	179,901,309.85	-
合计	179,901,309.85	-

6.4.6.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.6.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	6,587.18
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	-
应收债券利息	19,143,057.74
应收买入返售证券利息	169,261.65
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	41.90
合计	19,318,948.47

注：其他为应收结算保证金利息。

6.4.6.6 其他资产

本报告期末本基金未持有其他资产。

6.4.6.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	10,067.47
合计	10,067.47

6.4.6.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提信息披露费	129,289.16
预提审计费	34,809.32
合计	164,098.48

6.4.6.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,182,700,474.41	1,182,700,474.41
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	1,182,700,474.41	1,182,700,474.41

注：本基金以定期开放式方式运作，自基金合同生效日起每封闭一年集中开放申购与赎回一次，

本报告期本基金没有开放申购与赎回。

6.4.6.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	14,294,087.50	26,387,054.27	40,681,141.77
本期利润	47,263,394.28	-15,671,349.99	31,592,044.29
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-

本期末	61,557,481.78	10,715,704.28	72,273,186.06
-----	---------------	---------------	---------------

6.4.6.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
活期存款利息收入	79,426.54
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	27,221.37
其他	3,057.48
合计	109,705.39

注：其他存款利息收入为结算保证金利息收入。

6.4.6.12 股票投资收益

本基金本报告期末投资股票，无股票投资收益。

6.4.6.13 债券投资收益

6.4.6.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
债券投资收益——买卖债券、债转股及债券到期兑付) 差价收入	16,189,560.71
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	16,189,560.71

6.4.6.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,649,242,158.90
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,583,567,479.12
减：应收利息总额	49,485,119.07
买卖债券差价收入	16,189,560.71

6.4.6.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.6.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.6.15 股利收益

本基金本报告期内未投资股票，无股利收益。

6.4.6.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
1. 交易性金融资产	-15,671,349.99
——股票投资	-
——债券投资	-15,671,349.99
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-15,671,349.99

6.4.6.17 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

6.4.6.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	7,275.52
银行间市场交易费用	12,277.50
合计	19,553.02

6.4.6.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	53,809.32
信息披露费	129,289.16
帐户维护费	12,000.00
其他费用	7,160.38
合计	202,258.86

注：其他费用为银行手续费。

6.4.7 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.7.1 或有事项

截至本财务报告批准报出日，本基金未发生需要披露的或有事项。

6.4.7.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金未发生需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.8 关联方关系

6.4.8.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方无变化。

6.4.8.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
长信基金管理有限责任公司	基金管理人
长江证券股份有限公司	基金管理人股东
渤海银行股份有限公司（“渤海银行”）	基金托管人

6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.9.1.1 股票交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.9.1.2 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。

6.4.9.1.3 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。

6.4.9.1.4 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.9.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应付关联方交易单元—长江证券的佣金。

6.4.9.2 关联方报酬

6.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	4,313,484.15
其中：支付销售机构的客户维护费	988,277.20

注：1、本基金基金合同于2015年9月30日起正式生效，无上年度可比期间数据。

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

计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×0.70%/当年天数

6.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,232,424.08

注：1、本基金基金合同于2015年9月30日起正式生效，无上年度可比期间数据。

2、支付基金托管人渤海银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数

6.4.9.2.3 销售服务费

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的销售服务费	1,527,312.45

注：1、本基金基金合同于2015年9月30日起正式生效，无上年度可比期间数据。

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

计算公式为：日基金销售服务费=前一日基金资产净值×0.40%/当年天数

6.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.9.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
基金合同生效日（2015年9月30日）持有的基金份额	5,001,125.00
期初持有的基金份额	5,001,125.00
期间申购/买入总份额	-
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	5,001,125.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.4200%

注：1、本基金基金合同于2015年9月30日起正式生效，无上年度可比期间数据。

2、基金管理人运用固有资金投资本基金费率按严格遵循本基金招募说明书的有关规定。

6.4.9.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.9.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2016年1月1日至2016年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
渤海银行	9,199,178.73	79,426.54

注：1、本基金基金合同于2015年9月30日起正式生效，无上年度可比期间数据。

2、本基金通过“渤海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2016年6月30日的相关余额为人民币0元。（2015年12月31日：人民币16,769,802.39元）。

6.4.9.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期末在承销期内购入由关联方承销的证券。

6.4.9.7 其他关联交易事项的说明

上述关联交易均根据正常的商业交易条件进行，并以一般交易价格为定价基础。

6.4.10 利润分配情况

本报告期本基金未进行利润分配。

6.4.11 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.11.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未因认购新发/增发证券而持有流通受限证券。

6.4.11.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末未持有因债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.12 金融工具风险及管理

6.4.12.1 风险管理政策和组织架构

本基金金融工具的风险主要包括：

信用风险

流动性风险

市场风险

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

本基金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、量化投资部和相关职能部门构成的多级风险管理架构体系。

6.4.12.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的银行存款存放在本基金的托管行渤海银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证

券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司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。

6.4.12.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
A-1	60,069,000.00	70,324,000.00
A-1 以下	-	-
未评级	420,669,000.00	-
合计	480,738,000.00	70,324,000.00

注：未评级债券为国债、政策金融债、央行票据、超短期融资券等免评级债券。

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

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

6.4.12.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
AAA	-	55,570,000.00
AAA 以下	567,230,957.80	1,719,744,661.90
未评级	-	-
合计	567,230,957.80	1,775,314,661.90

注：根据中国人民银行 2006 年 3 月 29 日发布的“银发[2006]95 号”文《中国人民银行信用评级

管理指导意见》，以及 2006 年 11 月 21 日发布的《信贷市场和银行间债券市场信用评级规范》等文件的有关规定，中长期债券信用等级划分成三等九级，分别用 AAA、AA、A、BBB、BB、B、CCC、CC 和 C 表示，其中，除 AAA 级、CCC 级(含)以下等级外，每一个信用等级可用“+”、“-”符号进行微调，表示略高或略低于本等级。

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

6.4.12.3 流动性风险

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人主要通过限制、跟踪和控制基金投资交易的不活跃品种来实现。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，除 6.4.11 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余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，并同时通过专设的量化投资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。

6.4.12.4 市场风险

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

6.4.12.4.1 利率风险

利率风险是指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量化投资部对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

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

6.4.12.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年6月30日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	9,199,178.73	-	-	-	-	9,199,178.73
存出保证金	92,979.51	-	-	-	-	92,979.51
交易性金融资产	480,738,000.00	27,351.00	336,860,106.80	230,343,500.00	-	1,047,968,957.80
买入返售金融资产	179,901,309.85	-	-	-	-	179,901,309.85
应收利息	-	-	-	-	19,318,948.47	19,318,948.47
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	669,931,468.09	27,351.00	336,860,106.80	230,343,500.00	19,318,948.47	1,256,481,374.36
负债						
应付管理人报酬	-	-	-	-	718,064.28	718,064.28
应付托管费	-	-	-	-	205,161.22	205,161.22
应付销售服务费	-	-	-	-	410,322.44	410,322.44
应付交易费用	-	-	-	-	10,067.47	10,067.47
其他负债	-	-	-	-	164,098.48	164,098.48
负债总计	-	-	-	-	1,507,713.89	1,507,713.89
利率敏感度缺口	669,931,468.09	27,351.00	336,860,106.80	230,343,500.00	17,811,234.58	1,254,973,660.47
上年度末 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	7,962,498.13	-	-	-	-	7,962,498.13
结算备付金	16,769,802.39	-	-	-	-	16,769,802.39
存出保证金	398,111.43	-	-	-	-	398,111.43

交易性金融资产	232,414,800.00	39,916,000.00	829,154,396.50	744,153,465.40	-	1,845,638,661.90
应收利息	-	-	-	-	46,456,468.51	46,456,468.51
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	257,545,211.95	39,916,000.00	829,154,396.50	744,153,465.40	46,456,468.51	1,917,225,542.36
负债						
卖出回购金融资产款	688,698,707.45	-	-	-	-	688,698,707.45
应付证券清算款	-	-	-	-	3,053,837.92	3,053,837.92
应付管理人报酬	-	-	-	-	720,758.54	720,758.54
应付托管费	-	-	-	-	205,931.02	205,931.02
应付销售服务费	-	-	-	-	411,862.04	411,862.04
应付交易费用	-	-	-	-	6,928.80	6,928.80
应付利息	-	-	-	-	575,900.41	575,900.41
其他负债	-	-	-	-	170,000.00	170,000.00
负债总计	688,698,707.45	-	-	-	5,145,218.73	693,843,926.18
利率敏感度缺口	-431,153,495.50	39,916,000.00	829,154,396.50	744,153,465.40	41,311,249.78	1,223,381,616.18

6.4.12.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 （2016年6月30日）	上年度末 （2015年12月31日）
	市场利率下降27个基点	27,577,904.60	12,634,806.73
市场利率上升27个基点	-27,577,904.60	-12,634,806.73	

6.4.12.4.2 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。

6.4.12.4.3 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。

于2016年6月30日，本基金投资组合中无股票投资，债券投资比例为基金资产净值的83.51%。于2016年6月30日，本基金面临的其他价格风险列示如下：

6.4.12.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日		上年度末 2015年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	-	-	-	-
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	1,047,968,957.80	83.51	1,845,638,661.90	150.86
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,047,968,957.80	83.51	1,845,638,661.90	150.86

6.4.12.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金主要投资债券等固定收益品种，因此未进行其他价格风险的敏感性分析。

6.4.13 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.13.1 公允价值计量

(1) 公允价值计量的层次

下表列示了本基金在每个资产负债表日持续和非持续以公允价值计量的资产和负债于本报告期末的公允价值信息及其公允价值计量的层次。公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

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			
	2016年6月30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	—	—	—	—
债券投资	—	1,047,968,957.80	—	1,047,968,957.80

合计	—	1,047,968,957.80	—	1,047,968,957.80
----	---	------------------	---	------------------

本报告期，本基金上述持续以公允价值计量的资产和负债金融工具的第一层次与第二层次之间没有发生重大转换。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。

本报告期，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2016年6月30日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.13.2 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。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	1,047,968,957.80	83.41
	其中：债券	1,047,968,957.80	83.41
	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	179,901,309.85	14.32
	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	9,199,178.73	0.73
7	其他各项资产	19,411,927.98	1.54
8	合计	1,256,481,374.36	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。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

7.2.2 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持有股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

本基金本报告期末未持有股票。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	567,230,957.80	45.20
5	企业短期融资券	480,738,000.00	38.31
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,047,968,957.80	83.51

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	011699383	16 雅砻江 SCP002	600,000	60,018,000.00	4.78
2	1480495	14 嘉峪关债	500,000	54,105,000.00	4.31
3	1580083	15 白云工投债	500,000	53,360,000.00	4.25
4	011560002	15 东航 SCP002	500,000	50,210,000.00	4.00
5	011699093	16 广州地铁 SCP001	500,000	50,085,000.00	3.99

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

7.12.2 本基金本报告期末未投资股票，不存在投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情形。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	92,979.51
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	19,318,948.47
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	19,411,927.98

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
11,097	106,578.40	15,052,936.25	1.27%	1,167,647,538.16	98.73%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	1,074,172.27	0.09%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年9月30日）基金份额总额	1,182,700,474.41
本报告期期初基金份额总额	1,182,700,474.41
本报告期基金总申购份额	-
减：本报告期基金总赎回份额	-
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	1,182,700,474.41

注：本基金以定期开放方式运作，其封闭期为自基金合同生效之日起（包括基金合同生效之日）或自每一开放期结束之日次日起（包括该日）一年的期间。本基金的第一个封闭期为自基金合同生效之日起一年。本报告期本基金处于封闭期。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期未召开本基金的基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

10.2.1 报告期内本基金管理人的重大人事变动

本报告期内，原董事长叶焯先生离职，总经理覃波先生自 2016 年 6 月 3 日起代为履行董事长（法定代表人）职责。

报告截止日至报告批准送出日期间，自 2016 年 7 月 30 日起，宋小龙先生不再担任本基金管理人副总经理。

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》。

10.2.2 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。

本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金未更换为基金审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金管理人、托管人及其高级管理人员没有受监管部门稽查或处罚的情形。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华泰证券	2	-	-	-	-	-

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华泰证券	506,245,200.16	100.00%	831,000,000.00	100.00%	-	-

注：1、本期租用证券公司交易单元的变更情况

本报告期内本基金租用证券公司交易单元没有变更。

2、专用交易单元的选择标准和程序

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

（1）选择标准：

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

（2）选择程序：

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

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长信富海纯债一年定期开放债券型证券投资	上证报、中证报、证	2016年1月20日

	基金 2015 年第 4 季度报告	券时报	
2	长信基金管理有限责任公司关于增加海银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	2016 年 3 月 1 日
3	长信富海纯债一年定期开放债券型证券投资基金 2015 年年度报告及摘要	上证报、中证报、证券时报	2016 年 3 月 26 日
4	长信基金管理有限责任公司关于调整网上直销平台招商银行借记卡费率优惠方案的公告	上证报、中证报、证券时报	2016 年 4 月 7 日
5	长信富海纯债一年定期开放债券型证券投资基金 2016 年第 1 季度报告	上证报、中证报、证券时报	2016 年 4 月 21 日
6	长信基金管理有限责任公司关于增加上海凯石财富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	2016 年 5 月 11 日
7	长信富海纯债一年定期开放债券型证券投资基金更新的招募说明书（2016 年第【1】号）及摘要	上证报、中证报、证券时报	2016 年 5 月 13 日
8	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金参加交通银行股份有限公司网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报	2016 年 6 月 28 日

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立基金的文件；
- 2、《长信富海纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长信富海纯债一年定期开放债券型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《长信富海纯债一年定期开放债券型证券投资基金托管协议》；
- 5、报告期内在指定报刊上披露的各种公告的原稿；
- 6、长信基金管理有限责任公司营业执照、公司章程及相关资格批复文件。

11.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

11.3 查阅方式

长信基金管理有限责任公司网站：<http://www.cxfund.com.cn>。

长信基金管理有限责任公司
2016年8月26日