

长信纯债一年定期开放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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司，根据本基金基金合同的规定，于2016年3月24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.....	6
2.4	信息披露方式.....	6
2.5	其他相关资料.....	6
§3	主要财务指标、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.....	8
3.3	过去三年基金的利润分配情况.....	10
§4	管理人报告.....	12
4.1	基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	15
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	16
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	17
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	18
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.....	19
§5	托管人报告.....	20
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	20
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.....	20
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.....	20
§6	审计报告.....	21
6.1	审计报告基本信息.....	21
6.2	审计报告的基本内容.....	21
§7	年度财务报表.....	23
7.1	资产负债表.....	23
7.2	利润表.....	24
7.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	25
7.4	报表附注.....	26
§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.....	53
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	53
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	54
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.....	54
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.....	54
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.....	54
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.....	55
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	55
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	55
8.12	投资组合报告附注.....	55

§9	基金份额持有人信息.....	57
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	57
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	57
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.....	57
§10	开放式基金份额变动.....	58
§11	重大事件揭示.....	59
11.1	基金份额持有人大会决议.....	59
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.....	59
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	59
11.4	基金投资策略的改变.....	59
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	59
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.....	60
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	60
11.8	其他重大事件.....	60
§12	备查文件目录.....	64
12.1	备查文件目录.....	64
12.2	存放地点.....	64
12.3	查阅方式.....	64

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金	
基金简称	长信纯债一年定开债券	
场内简称	CX纯债	
基金主代码	519973	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年11月29日	
基金管理人	长信基金管理有限责任公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,353,894,462.65份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	长信纯债一年定开债券A	长信纯债一年定开债券C
下属分级基金场内简称	CX纯债A	CX纯债C
下属分级基金的交易代码	519973	519972
报告期末下属分级基金的份额总额	802,811,565.28份	551,082,897.37份

2.2 基金产品说明

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

	金。
--	----

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		长信基金管理有限责任公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	周永刚	蒋松云
	联系电话	021-61009999	010-66105799
	电子邮箱	zhouyg@cxfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4007005566	95588
传真		021-61009800	010-66105798
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区 银城中路68号9楼	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		上海市浦东新区银城中路68号 时代金融中心9楼	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		200120	100140
法定代表人		叶焯	姜建清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报和证券日报
登载基金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号时代金融中心9楼、北京市西城区复兴门内大街55号

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
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	北京市西城区太平桥大街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

3.1.1 长信纯债一年定开债券A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	长信纯债一年定开债券A		
	2015年	2014年	2013年11月29日（基金合同生效日）-2013年12月31日
本期已实现收益	25,078,760.29	25,477,096.69	574,169.63
本期利润	31,355,671.66	25,152,853.08	2,435,253.89
加权平均基金份额本期利润	0.1361	0.1246	0.0119
本期加权平均净值利润率	12.61%	11.86%	1.18%
本期基金份额净值增长率	13.00%	11.45%	1.19%
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	21,322,442.71	4,727,136.06	574,169.63
期末可供分配基金份额利润	0.0266	0.0224	0.0028
期末基金资产净值	838,985,181.74	216,099,045.91	207,503,388.51
期末基金份额净值	1.0451	1.0236	1.0119
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	27.43%	12.78%	1.19%

3.1.2 长信纯债一年定开债券C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	长信纯债一年定开债券C		
	2015年	2014年	2013年11月29日（基金合同生效日）-2013年12月31日
本期已实现收益	67,687,847.22	13,441,008.51	239,725.14
本期利润	74,834,298.58	11,829,469.49	1,128,761.82
加权平均基金份额本期利润	0.1245	0.0944	0.0115
本期加权平均净值利润率	11.52%	9.07%	1.15%
本期基金份额净值增长率	12.54%	10.99%	1.15%
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	14,240,080.42	13,320,650.19	239,725.14
期末可供分配基金份额利润	0.0258	0.0213	0.0024
期末基金资产净值	575,495,159.00	638,525,635.29	99,105,768.91
期末基金份额净值	1.0443	1.0225	1.0115

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	26.33%	12.27%	1.15%

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

3.2.1.1 长信纯债一年定开债券A基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 (长信纯债一年定开债券A)	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.83%	0.08%	0.79%	0.00%	2.04%	0.08%
过去六个月	7.09%	0.08%	1.28%	0.00%	5.82%	0.08%
过去一年	13.00%	0.08%	2.54%	0.00%	10.46%	0.08%
自基金合同生效 日起至今(2013年 11月29日至2015 年12月31日)	27.43%	0.16%	5.92%	0.00%	21.51%	0.15%

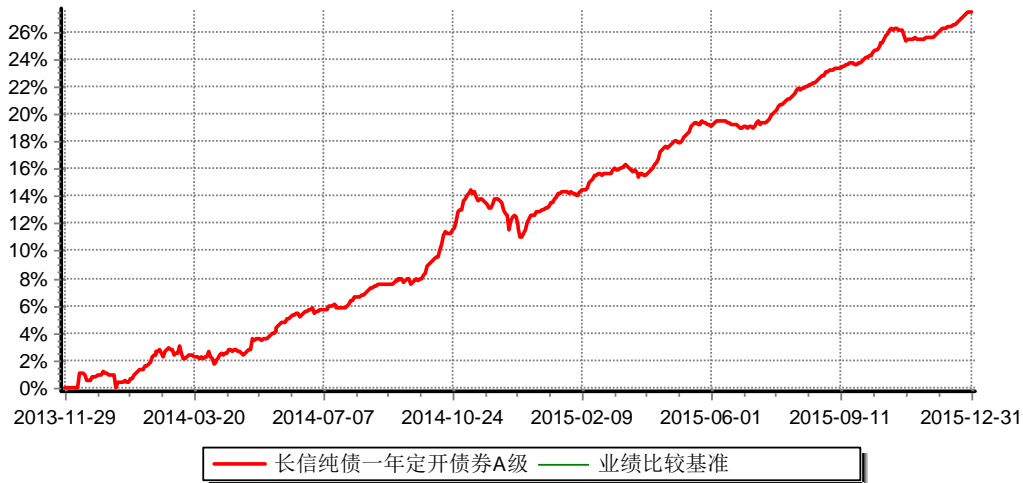
3.2.1.2 长信纯债一年定开债券C基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 (长信纯债一年定开债券C)	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.72%	0.08%	0.79%	0.00%	1.93%	0.08%
过去六个月	6.87%	0.08%	1.28%	0.00%	5.60%	0.08%
过去一年	12.54%	0.08%	2.54%	0.00%	10.00%	0.08%
自基金合同生效 日起至今(2013年	26.33%	0.16%	5.92%	0.00%	20.41%	0.15%

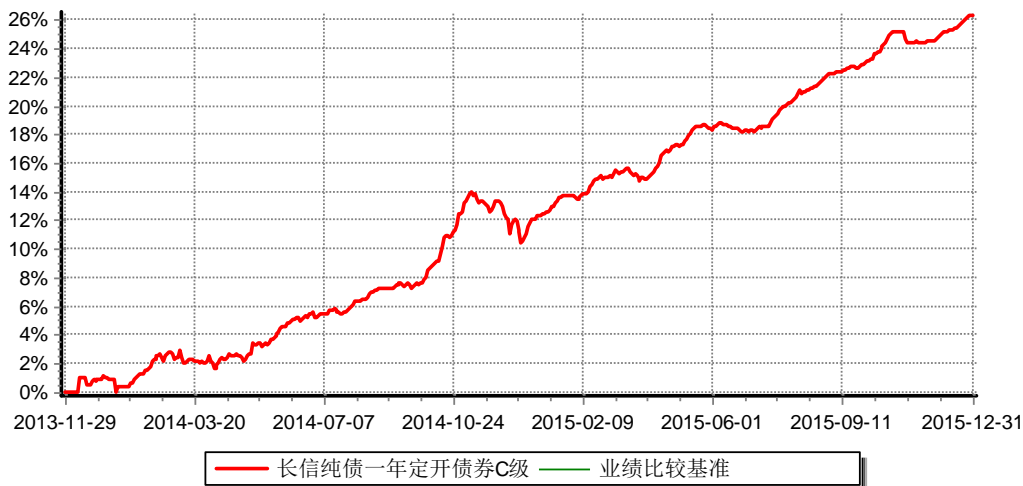
11月29日至2015 年12月31日)						
-------------------------	--	--	--	--	--	--

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

3.2.2.1 长信纯债一年定开债券A自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



3.2.2.2 长信纯债一年定开债券C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



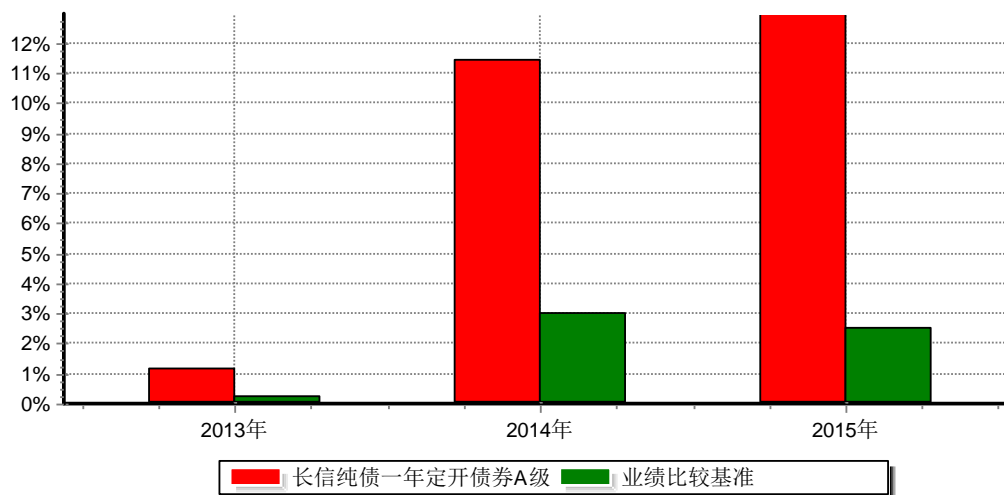
注：1、本基金基金合同生效日为2013年11月29日，图示日期为2013年11月29日至2015年12月31日。

2、按基金合同规定，本基金自合同生效日起6个月内为建仓期，建仓期结束时，本基金各项投资比例已符合基金合同中的约定。

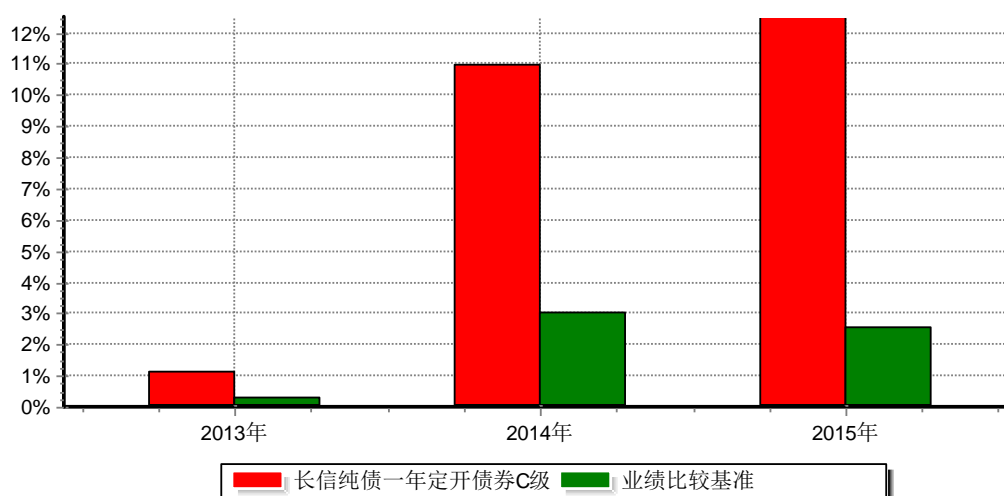
3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益

率的比较

3.2.3.1 长信纯债一年定开债券A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



3.2.3.2 长信纯债一年定开债券C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2013年11月29日，2013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

3.3.1 长信纯债一年定开债券A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
2013年					
2014年					
2015年					

长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金2015年年度报告

2015年	1.10	19,399,019.64	3,824,835.25	23,223,854.89	
2014年	1.05	18,889,985.65	2,642,168.67	21,532,154.32	
2013年	—	—	—	—	
合计	2.15	38,289,005.29	6,467,003.92	44,756,009.21	

3.3.2 长信纯债一年定开债券C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	1.05	13,512,992.63	52,059,943.94	65,572,936.57	
2014年	1.01	6,434,208.00	3,461,470.05	9,895,678.05	
2013年	—	—	—	—	
合计	2.06	19,947,200.63	55,521,413.99	75,468,614.62	

注：本基金基金合同生效日为2013年11月29日，本基金本报告期的利润分配情况，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、长信利丰债券型证券投资基金、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、长信利保债券型证券投资基金的基金经理、	2013年11月29日	2015年3月25日	17年	曾任本基金的基金经理。

	公司总经理助理、固定收益部总监、投资决策委员会执行委员				
吴哲	本基金、长信富民纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信富海纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信富安纯债一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理	2014年12月17日	-	6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、长信富民纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信富海纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信富安纯债一年定期开放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、本基金基金经理的证券从业年限以基金经理进入证券业务相关机构的工作经历为时间计算标准。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

本基金将继续以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，努力为基金份额持有人谋求最大利益。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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。大宗商品全面雪崩，铁矿石、原油、焦煤等下跌35-40%，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。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。

本基金全年维持信用债配置，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

截至本报告期末，长信纯债一年定开债券A份额净值为1.0451元，份额累计净值为1.2601元，本报告期内长信纯债一年定开债券A净值增长率为13.00%；长信纯债一年定开债券C份额净值为1.0443元，份额累计净值为1.2503元，本报告期内长信纯债一年定开债券C净值增长率为12.54%。同期业绩比较基准收益率为2.54%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

基本面来看，工业经济未稳、通缩难改，去产能短期内将带来经济阵痛，地

产去库存任重道远，经济短期内仍L型筑底，必须要低利率环境保住底线，宽松政策延续，基本面仍支撑利率维持低位。全球经济低迷制约导致大宗商品的漫漫熊市，近期也开始蔓延到农产品上，后续CPI可能跟随PPI向下，中长期通缩趋势形成。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。整体来说，2015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》的规定，长信基金管理有限责任公司（以下简称“公司”）制订了健全、有效的估值政策和程序，成立了估值工作小组，小组成员由投资管理部总监、固定收益部总监、研究发展部总监、交易管理部总监、金融工程部总监、基金事务部总监以及基金事务部至少一名业务骨干

共同组成。相关参与人员都具有丰富的证券行业工作经验，熟悉相关法规和估值方法。基金经理不直接参与估值决策，如果基金经理认为某证券有更好的证券估值方法，可以申请公司估值工作小组对某证券进行专项评估。估值决策由与会估值工作小组成员1/2以上多数票通过。对于估值政策，公司与基金托管人充分沟通，达成一致意见。审计本基金的会计师事务所认可公司基金估值政策和程序的适当性。

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

4.8 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，本基金本报告期进行了一次利润分配，具体情况如下：

单位：人民币元

序号 (长信 纯债一 年定开 债券A)	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
1	2015-12-7	2015-12-7	1.10	19,399,019.64	3,824,835.25	23,223,854.89
合计			1.10	19,399,019.64	3,824,835.25	23,223,854.89
序号 (长信 纯债一 年定开 债券C)	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
1	2015-12-7	2015-12-7	1.05	13,512,992.63	52,059,943.94	65,572,936.57
合计			1.05	13,512,992.63	52,059,943.94	65,572,936.57

本基金收益分配原则如下：

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

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

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

认的收益分配方式是现金分红。

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

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

4.9 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

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

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

本报告期内，长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金的管理人——长信基金管理有限公司在长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金对基金份额持有人进行了1次利润分配，分配金额为88796791.46元。

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纯债一年定期开放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

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1600151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	长信纯债一年定期开放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纯债一年定期开放债券型证券投资基金(以下简称“长信纯债一年定开债券基金”)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纯债一年定期开放债券型证券投资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	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。 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。

长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金2015年年度报告

	我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
审计意见段	我们认为，长信纯债一年定期开放债券型证券投资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7.4.2中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，公允反映了长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金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	王国蓓、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	2016-3-24

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2015年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
资产：			
银行存款	7.4.7.1	61,942,836.43	4,421,196.56
结算备付金		13,271,551.29	2,220,694.41
存出保证金		104,903.40	73,700.60
交易性金融资产	7.4.7.2	1,114,143,779.89	1,432,422,665.03
其中：股票投资		—	—
基金投资		—	—
债券投资		1,114,143,779.89	1,432,422,665.03
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	200,000,500.00	—
应收证券清算款		—	2,994,295.37
应收利息	7.4.7.5	30,131,684.80	34,750,490.07
应收股利		—	—
应收申购款		142,540,225.51	—
递延所得税资产		—	—
其他资产	7.4.7.6	—	—
资产总计		1,562,135,481.32	1,476,883,042.04
负债和所有者权益	附注号	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	7.4.7.3	—	—
卖出回购金融资产款		145,000,000.00	616,852,305.80
应付证券清算款		910,674.67	4,037,152.26

应付赎回款		514,634.52	—
应付管理人报酬		498,162.40	335,584.58
应付托管费		142,332.14	95,881.29
应付销售服务费		136,772.61	133,585.49
应付交易费用	7.4.7.7	25,967.47	15,759.03
应交税费		—	—
应付利息		26,465.22	248,092.39
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	7.4.7.8	400,131.55	540,000.00
负债合计		147,655,140.58	622,258,360.84
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	1,353,894,462.65	835,630,156.08
未分配利润	7.4.7.10	60,585,878.09	18,994,525.12
所有者权益合计		1,414,480,340.74	854,624,681.20
负债和所有者权益总计		1,562,135,481.32	1,476,883,042.04

注：报告截止日2015年12月31日，长信纯债一年定开债券A份额净值为1.0451元，份额总额802,811,565.28份，长信纯债一年定开债券C份额净值为1.0443元，份额总额551,082,897.37份。

7.2 利润表

会计主体：长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2015年1月1日至2015年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	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		137,113,628.13	49,909,832.79
1. 利息收入		88,720,206.18	28,795,296.72
其中：存款利息收入	7.4.7.11	339,092.79	2,631,292.46
债券利息收入		88,364,260.05	25,651,829.14
资产支持证券利息收入		—	91,625.29
买入返售金融资产收入		16,853.34	420,549.83
其他利息收入		—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）		34,962,150.17	23,030,682.59
其中：股票投资收益		—	—
基金投资收益		—	—

长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金2015年年度报告

债券投资收益	7.4.7.12	34,962,150.17	23,007,776.27
资产支持证券投资收益	7.4.7.13	—	22,906.32
贵金属投资收益		—	—
衍生工具收益	7.4.7.14	—	—
股利收益	7.4.7.15	—	—
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	13,423,362.73	-1,935,782.63
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	7,909.05	19,636.11
减：二、费用		30,923,657.89	12,927,510.22
1. 管理人报酬		6,289,786.16	2,378,353.81
2. 托管费		1,797,081.80	679,529.58
3. 销售服务费		2,608,274.98	510,592.28
4. 交易费用	7.4.7.18	66,539.81	53,530.53
5. 利息支出		19,655,848.15	8,758,819.90
其中：卖出回购金融资产支出		19,655,848.15	8,758,819.90
6. 其他费用	7.4.7.19	506,126.99	546,684.12
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		106,189,970.24	36,982,322.57
减：所得税费用		—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		106,189,970.24	36,982,322.57

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2015年1月1日至2015年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）	835,630,156.08	18,994,525.12	854,624,681.20
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	106,189,970.24	106,189,970.24
三、本期基金份额交易产生	518,264,306.57	24,198,174.19	542,462,480.76

的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）			
其中：1. 基金申购款	1,244,325,492.16	50,096,342.01	1,294,421,834.17
2. 基金赎回款	-726,061,185.59	-25,898,167.82	-751,959,353.41
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）	-	-88,796,791.46	-88,796,791.46
五、期末所有者权益（基金净值）	1,353,894,462.65	60,585,878.09	1,414,480,340.74
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）	303,045,141.71	3,564,015.71	306,609,157.42
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	36,982,322.57	36,982,322.57
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）	532,585,014.37	9,876,019.21	542,461,033.58
其中：1. 基金申购款	777,138,734.62	17,067,450.09	794,206,184.71
2. 基金赎回款	-244,553,720.25	-7,191,430.88	-251,745,151.13
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）	-	-31,427,832.37	-31,427,832.37
五、期末所有者权益（基金净值）	835,630,156.08	18,994,525.12	854,624,681.20

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

长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）于2013年7月11日经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于核准长

信纯债一年定期开放债券型证券投资基金募集的批复》(证监许可[2013]911号文)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《长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于2013年11月29日正式生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金根据认购、申购费用、赎回费用收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购基金时收取认购、申购费用,在赎回时根据持有期限收取赎回费用,而不计提销售服务费的基金份额,称为A类基金份额;在投资者认购、申购基金份额时不收取认购、申购费用,在赎回时亦不收取赎回费,而是从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为C类基金份额。不同基金份额类别之间不得互相转换。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2013年10月28日至2013年11月22日募集,募集资金总额人民币302,940,982.40元,利息转份额人民币104,159.31元,募集规模为303,045,141.71份。上述募集资金已由毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了毕马威华振验字第1300470号验资报告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》和《长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超级短期融资券、资产支持证券、次级债券、可分离交易可转债的纯债部分、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会相关规定。本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产,也不参与一级市场的新股申购或增发新股,可转债仅投资二级市场可分离交易可转债的纯债部分。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人履行适当程序后,可以将其纳入投资范围,其投资比例遵循届时有效法律法规或相关规定。

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

不低于基金资产净值的5%，在非开放期，本基金不受该比例的限制。

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

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

7.4.2 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》编制财务报表。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的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。本基金现无金融资产分类为持有至到期投资和可供出售金融资产。本基金现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

本基金目前持有的股票投资和债券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。

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，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。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，金融资产和金融负债的后续计量如下：

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。

应收款项以实际利率法按摊余成本计量。

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采用实际利率法按摊余成本进行后续计量。

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：

—所转移金融资产的账面价值

—因转移而收到的对价

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。

存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证

券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

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：

一本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；

一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。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。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

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益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。

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的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

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

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

本基金同一类别的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。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。

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%。由于本基金A类基金份额不收取销售服务费，而C类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同。

基金红利发放日距离收益分配基准日的时间不得超过15个工作日。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。

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

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金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》，根据具体情况采用《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

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。

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定

收益品种的估值处理标准》（以下简称“估值处理标准”），在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

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

为确保证券投资基金估值的合理性和公允性，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

本报告期本基金无重大会计差错。

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[2015]101号《财政部、国家税务总局、证监会关于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。

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	61,942,836.43	4,421,196.56
定期存款	—	—
其中：存款期限1-3个月	—	—
其他存款	—	—
合计	61,942,836.43	4,421,196.56

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		—	—	—
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—
债券	交易所市场	440,658,091.06	439,345,400.89	-1,312,690.17
	银行间市场	659,247,987.79	674,798,379.00	15,550,391.21
	合计	1,099,906,078.85	1,114,143,779.89	14,237,701.04
资产支持证券		—	—	—
基金		—	—	—
其他		—	—	—
合计		1,099,906,078.85	1,114,143,779.89	14,237,701.04
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		—	—	—
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—
债券	交易所市场	650,938,358.10	652,851,665.03	1,913,306.93
	银行间市场	780,669,968.62	779,571,000.00	-1,098,968.62
	合计	1,431,608,326.72	1,432,422,665.03	814,338.31
资产支持证券		—	—	—
基金		—	—	—
其他		—	—	—
合计		1,431,608,326.72	1,432,422,665.03	814,338.31

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未持有衍生金融资产/负债。

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
银行间市场	200,000,500.00	—
合计	200,000,500.00	—
项目	上年度末 2014年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
银行间市场	—	—
合计	—	—

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	9,668.75	7,097.30
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	5,972.20	1,954.47
应收债券利息	30,101,875.07	34,741,405.20
应收买入返售证券利息	14,121.58	—
应收申购款利息	—	—
应收黄金合约拆借孳息	—	—
其他	47.20	33.10
合计	30,131,684.80	34,750,490.07

注：其他为应收保证金利息。

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	—	—
银行间市场应付交易费用	25,967.47	15,759.03
合计	25,967.47	15,759.03

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	131.55	—
预提信息披露费-上证报	100,000.00	120,000.00
预提信息披露费-中证报	80,000.00	140,000.00
预提信息披露费-证券时报	80,000.00	140,000.00
预提信息披露费_证券日报	80,000.00	140,000.00
预提审计费	60,000.00	—
合计	400,131.55	540,000.00

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期

长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金2015年年度报告

(长信纯债一年定开债券A)	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	211,125,953.28	211,125,953.28
本期申购	671,609,283.20	671,609,283.20
本期赎回(以“-”号填列)	-79,923,671.20	-79,923,671.20
本期末	802,811,565.28	802,811,565.28
项目 (长信纯债一年定开债券C)	基金份额(份)	账面金额
上年度末	624,504,202.80	624,504,202.80
本期申购	572,716,208.96	572,716,208.96
本期赎回(以“-”号填列)	-646,137,514.39	-646,137,514.39
本期末	551,082,897.37	551,082,897.37

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目 (长信纯债一年定开债券A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,727,136.06	245,956.57	4,973,092.63
本期利润	25,078,760.29	6,276,911.37	31,355,671.66
本期基金份额交易产生的变动数	14,740,401.27	8,328,305.79	23,068,707.06
其中：基金申购款	16,682,940.81	9,301,543.49	25,984,484.30
基金赎回款	-1,942,539.54	-973,237.70	-2,915,777.24
本期已分配利润	-23,223,854.89	—	-23,223,854.89
本期末	21,322,442.73	14,851,173.73	36,173,616.46
项目 (长信纯债一年定开债券C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	13,320,650.19	700,782.30	14,021,432.49
本期利润	67,687,847.22	7,146,451.36	74,834,298.58
本期基金份额交易产生的变动数	-1,195,480.44	2,324,947.57	1,129,467.13
其中：基金申购款	14,076,761.13	10,035,096.58	24,111,857.71
基金赎回款	-15,272,241.57	-7,710,149.01	-22,982,390.58
本期已分配利润	-65,572,936.57	—	-65,572,936.57
本期末	14,240,080.40	10,172,181.23	24,412,261.63

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	119,068.64	90,073.38
定期存款利息收入	—	2,434,166.63

其他存款利息收入	1,235.59	1,317.10
结算备付金利息收入	218,788.56	105,735.35
其他	—	—
合计	339,092.79	2,631,292.46

7.4.7.12 债券投资收益

7.4.7.12.1 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	34,962,150.17	23,007,776.27
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	34,962,150.17	23,007,776.27

7.4.7.12.2 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
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	3,034,409,977.99	1,884,706,867.12
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,911,113,655.46	1,804,031,113.65
减：应收利息总额	88,334,172.36	57,667,977.20
买卖债券差价收入	34,962,150.17	23,007,776.27

7.4.7.13 资产支持证券投资收益

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
卖出资产支持证券成交总额	—	5,114,531.61
减：卖出资产支持证券成本总额	—	5,000,000.00
减：应收利息总额	—	91,625.29
资产支持证券投资收益	—	22,906.32

7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.15 股利收益

本基金本报告期内及上年度可比期间未持有股票，无股利收益。

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2015年1月1日至2015年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	13,423,362.73	-1,935,782.63
——股票投资	—	—
——债券投资	13,423,362.73	-1,935,782.63
——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	13,423,362.73	-1,935,782.63

7.4.7.17 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	7,909.05	19,633.64
其他收入	—	2.47
合计	7,909.05	19,636.11

注：其他为质押冻结利息收入。

7.4.7.18 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	42,329.18	28,193.03
银行间市场交易费用	24,210.63	25,337.50
合计	66,539.81	53,530.53

7.4.7.19 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
----	---------------------------------	--------------------------------------

	月31日	月31日
审计费用	120,000.00	—
信息披露费	340,000.00	513,567.68
交易费用_回购	—	—
权证	—	—
账户维护费	27,000.00	16,500.00
银行手续费	2,834.82	16,216.44
其他费用	16,292.17	400.00
合计	506,126.99	546,684.12

注：其他为账户开户费。

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
中国工商银行股份有限公司	基金托管人
长江证券股份有限公司（以下简称“长江证券”）	基金管理人的股东
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

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

本基金本报告期及上年度可比期间没有通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间没有通过关联方交易单元进行的债券交

易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间没有通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间没有通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间没有应支付关联方的佣金。

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	6,289,786.16	2,378,353.81
其中：支付销售机构的客户维护费	2,030,579.05	946,048.23

注：基金管理费按前一日基金资产净值0.70%的年费率逐日计提，按月支付。

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

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	1,797,081.80	679,529.58

注：基金托管费按前一日基金资产净值0.20%的年费率逐日计提，按月支付。

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

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

	长信纯债一年定 开债券A级	长信纯债一年定 开债券C级	合计
长信基金管理有限责任公司	—	1,920,705.85	1,920,705.85
中国工商银行股份有限公司	—	668,868.55	668,868.55
长江证券	—	227.33	227.33
合计	—	2,589,801.73	2,589,801.73
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		
	长信纯债一年定 开债券A级	长信纯债一年定 开债券C级	合计
长信基金管理有限责任公司	—	82,702.53	82,702.53
中国工商银行股份有限公司	—	422,630.46	422,630.46
长江证券	—	965.36	965.36
合计	—	506,298.35	506,298.35

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

销售服务费按照C类基金资产净值的0.40%年费率计提。计算方法如下：

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

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日基金资产净值

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

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)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

本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

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
中国工商银行股份有限公司	61,942,836.43	119,068.64	4,421,196.56	90,073.38

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13,271,551.29元。（2014年12月31日为人民币2,220,694.41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

本基金本报告期及上年度可比期间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

本基金本报告期末及上年度末无其他需要说明的关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号 (长信纯 债一年定 开债券A)	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
1	2015-12 -7	2015-1 2-7	1.100	19,399,019.64	3,824,835.25	23,223,854.89
合计			1.100	19,399,019.64	3,824,835.25	23,223,854.89
序号 (长信纯 债一年定 开债券C)	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
1	2015-12 -7	2015-1 2-7	1.050	13,512,992.63	52,059,943.94	65,572,936.57
合计			1.050	13,512,992.63	52,059,943.94	65,572,936.57

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持有股票。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有因银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 12 月 31 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 145,000,000.00 元，于 2016 年 1 月 4 日及 1 月 5 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

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

本基金金融工具的风险主要包括：

信用风险

流动性风险

市场风险

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

本基金管理人从事风险管理的目标是使本基金在风险和收益之间取得适当的平衡，以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。基于该风险管理目标，本基金管理人已制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及设计相应内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人建立了以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、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且

通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

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	20,254,000.00	314,386,000.00
A-1以下	—	—
未评级	30,004,000.00	—
合计	50,258,000.00	314,386,000.00

注：未评级债券为国债、政策金融债及央行票据等免评级债券。

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

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

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 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
AAA	30,440,860.70	3,036,000.00
AAA以下	1,033,444,919.19	1,115,000,665.03
未评级	—	—
合计	1,063,885,779.89	1,118,036,665.03

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

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

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

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，除附注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。

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

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。本基金管理人金融工程部对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

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	61,942,836.43	—	—	—	—	61,942,836.43
结算备付金	13,271,551.29	—	—	—	—	13,271,551.29
存出保证金	104,903.40	—	—	—	—	104,903.40
交易性金融资产	147,690,661.81	30,092,000.00	595,288,682.48	341,072,435.60	—	1,114,143,779.89
买入返售金融资产	200,000,500.00	—	—	—	—	200,000,500.00
应收利息	—	—	—	—	30,131,684.80	30,131,684.80
应收申购款	—	—	—	—	142,540,225.51	142,540,225.51
资产总计	423,010,452.93	30,092,000.00	595,288,682.48	341,072,435.60	172,671,910.31	1,562,135,481.32

长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金2015年年度报告

负债						
卖出回购金融资产款	145,000,000.00	—	—	—	—	145,000,000.00
应付证券清算款	—	—	—	—	910,674.67	910,674.67
应付赎回款	—	—	—	—	514,634.52	514,634.52
应付管理人报酬	—	—	—	—	498,162.40	498,162.40
应付托管费	—	—	—	—	142,332.14	142,332.14
应付销售服务费	—	—	—	—	136,772.61	136,772.61
应付交易费用	—	—	—	—	25,967.47	25,967.47
应付利息	—	—	—	—	26,465.22	26,465.22
其他负债	—	—	—	—	400,131.55	400,131.55
负债总计	145,000,000.00	—	—	—	2,655,140.58	147,655,140.58
利率敏感度缺口	278,010,452.93	30,092,000.00	595,288,682.48	341,072,435.60	170,016,769.73	1,414,480,340.74
上年度末2014年12月31日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	4,421,196.56	—	—	—	—	4,421,196.56
结算备付金	2,220,694.41	—	—	—	—	2,220,694.41
存出保证金	73,700.60	—	—	—	—	73,700.60
交易性金融资产	68,782,111.00	328,732,330.49	577,659,843.54	457,248,380.00	—	1,432,422,665.03
应收证	—	—	—	—	2,994,295.37	2,994,295.37

长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金2015年年度报告

券清算款						
应收利息	—	—	—	—	34,750,490.07	34,750,490.07
资产总计	75,497,702.57	328,732,330.49	577,659,843.54	457,248,380.00	37,744,785.44	1,476,883,042.04
负债						
卖出回购金融资产款	616,852,305.80	—	—	—	—	616,852,305.80
应付证券清算款	—	—	—	—	4,037,152.26	4,037,152.26
应付管理人报酬	—	—	—	—	335,584.58	335,584.58
应付托管费	—	—	—	—	95,881.29	95,881.29
应付销售服务费	—	—	—	—	133,585.49	133,585.49
应付交易费用	—	—	—	—	15,759.03	15,759.03
应付利息	—	—	—	—	248,092.39	248,092.39
其他负债	—	—	—	—	540,000.00	540,000.00
负债总计	616,852,305.80	—	—	—	5,406,055.04	622,258,360.84
利率敏感度缺口	-541,354,603.23	328,732,330.49	577,659,843.54	457,248,380.00	32,338,730.40	854,624,681.20

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率之外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 （2015年12月31日）	上年度末 （2014年12月31日）
	市场利率下降27个基点	49,253,023.44	10,208,998.39
	市场利率上升27个基点	-49,253,023.44	-10,208,998.39

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券以及银行间同业市场交易的债券，所面临的最大其他市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他市场价格风险，并且定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

2015年12月31日，本基金投资组合中债券投资比例为基金资产净值的78.77%，无股票投资。本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

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	—	—	—	—
交易性金融资产-基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产-债券投资	1,114,143,779.89	78.77	1,432,422,665.03	167.61
交易性金融资产-贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产-权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	1,114,143,779.89	78.77	1,432,422,665.03	167.61

7.4.13.4.3.2 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。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 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2014年6月30日的账面价值。公允价值计量中的层级取决于对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值。三个层级的定义如下：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价；

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除市场报价以外的有关资产或负债的输入值；

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

单位：人民币元

资产	本期末 2015年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	—	—	—	—
债券投资	—	1,114,143,779.89	—	1,114,143,779.89
合计	—	1,114,143,779.89	—	1,114,143,779.89
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	—	—	—	—
债券投资	423,335,162.63	1,009,087,502.40	—	1,432,422,665.03
合计	423,335,162.63	1,009,087,502.40	—	1,432,422,665.03

注：本报告期，本基金金融工具的第一层级与第二层级之间没有发生重大转换。

本报告期，本基金金融工具的公允价值估值技术并未发生改变。

7.4.14.2 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。

§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	—	—
	其中：股票	—	—
2	固定收益投资	1,114,143,779.89	71.32
	其中：债券	1,114,143,779.89	71.32
	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	200,000,500.00	12.80
	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	75,214,387.72	4.81
7	其他各项资产	172,776,813.71	11.06
8	合计	1,562,135,481.32	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

本基金本报告期末未持有股票。

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持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期内未买入股票。

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

本基金本报告期内未卖出股票。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未投资股票。

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	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	1,043,035,779.89	73.74
5	企业短期融资券	50,258,000.00	3.55
6	中期票据	20,850,000.00	1.47
7	可转债(可交换债)	—	—
8	其他	—	—
9	合计	1,114,143,779.89	78.77

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	1380270	13商洛债02	500,000	53,020,000.00	3.75
2	1480192	14宁国债	400,000	44,076,000.00	3.12
3	1280195	12雅安国资债	400,000	33,844,000.00	2.39
4	1280408	12黔宏升债	400,000	33,840,000.00	2.39
5	1580062	14三门债02	300,000	32,043,000.00	2.27

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。

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

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	104,903.40
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	30,131,684.80
5	应收申购款	142,540,225.51
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	172,776,813.71

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

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

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
长信纯债一年定期开债券A	1,272	631,141.17	620,993,861.06	77.35%	181,817,704.22	22.65%
长信纯债一年定期开债券C	5,585	98,671.96	2,038,030.46	0.37%	549,044,866.91	99.63%
合计	6,857	197,447.06	623,031,891.52	46.02%	730,862,571.13	53.98%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	长信纯债一年定期开债券A	9,745.45	0%
	长信纯债一年定期开债券C	305.80	0%
	合计	10,051.25	0%

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	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究人员持有本开放式基金	长信纯债一年定期开债券A	0
	长信纯债一年定期开债券C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	长信纯债一年定期开债券A	0
	长信纯债一年定期开债券C	0
	合计	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

	长信纯债一年定开债券A	长信纯债一年定开债券C
基金合同生效日(2013年11月29日)基金份额总额	205,068,134.62	97,977,007.09
本报告期期初基金份额总额	211,125,953.28	624,504,202.8
本报告期基金总申购份额	671,609,283.20	572,716,208.96
减：本报告期基金总赎回份额	79,923,671.20	646,137,514.39
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	802,811,565.28	551,082,897.37

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末未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 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，本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

本报告期无涉及基金管理人、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未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。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2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

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	债券交易		债券回购交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占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	佣金	占当期佣金总量的比例	
宏源证券	2	3,361,381,331.45	100.00%	25,260,172,000.00	100.00%	-	-	
安信证券	2	-	-	-	-	-	-	
国信证券	2	-	-	-	-	-	-	

注：1、本报告期内新增国信证券、安信证券各2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：

- 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。

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

长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金2015年年度报告

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	2015-1-1
2	长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金更新的招募说明书（2015 年【1】号）及摘要	上证报、中证报、证券时报	2015-1-12
3	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	2015-1-15
4	长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金 2014 年第 4 季度报告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2015-1-21
5	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	2015-3-9
6	长信基金管理有限责任公司关于长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金经理变更的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2015-3-25
7	长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金 2014 年年度报告及摘要	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2015-3-28
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中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2015-3-30
9	长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金 2015 年第 1 季度报告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2015-4-20
10	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	2015-4-29
11	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金参加中国农业银行股份有限公司网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报	2015-5-29
12	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）费率优惠活动及开通转换业务的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2015-6-11
13	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金参加交通银行股份有限公司网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2015-6-29
14	长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金更新的招募说明书（2015 年【2】号）及摘要	上证报、中证报、证券时报、	2015-7-11

		证券日报	
15	长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金2015年第1季度报告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2015-7-21
16	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上海浦东发展银行股份有限公司网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2015-7-30
17	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	2015-8-5
18	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	2015-8-12
19	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平安银行股份有限公司申购（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	2015-8-12
20	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	2015-8-22
21	长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金2015年半年度报告及摘要	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2015-8-27
22	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	2015-9-10
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	2015-9-24
24	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平安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	2015-10-16
25	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
26	长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金2015年第3季度报告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2015-10-26

27	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
28	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
29	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
30	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	2015-12-1
31	长信基金管理有限责任公司关于长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金 2015 年第一次分红公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2015-12-3
32	长信基金管理有限责任公司关于长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金开放申购与赎回业务的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2015-12-10
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、《长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金托管协议》；
- 5、报告期内在指定报刊上披露的各种公告的原稿；
- 6、长信基金管理有限责任公司营业执照、公司章程及相关资格批复文件。

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