

长信富全纯债一年定期开放债券型证券投资基金更新的招募说

明书摘要 2016 年第[1]号

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

长信富全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 2015 年 11 月 30 日经中国证券监督管理委员会证监许可【2015】2772 号文注册募集。本基金合同于 2016 年 3 月 9 日正式生效。

重要提示

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者根据所持有的基金份额享受基金收益，同时承担相应的投资风险。投资本基金可能遇到的风险包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券市场价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，利率风险，本基金持有的信用类固定收益品种违约带来的信用风险，债券投资出现亏损的风险，基金运作风险，包括由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险等。

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。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、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、国债期货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，同时本基金不参与可转换债券投资。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法律法规或相关规定。

投资人应当认真阅读《基金合同》、《招募说明书》等基金法律文件，了解基金的风险收益特征，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判

断基金是否和投资人的风险承受能力相适应。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。

本更新的招募说明书所载的内容截止日为 2016 年 9 月 9 日，有关财务数据和净值表现截至 2016 年 6 月 30 日（财务数据未经审计）。本基金托管人中国工商银行股份有限公司已经复核了本次更新的招募说明书。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

基金管理人概况

名称 长信基金管理有限责任公司

注册地址 中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 9 楼

办公地址 上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼

邮政编码 200120

批准设立机关 中国证券监督管理委员会

批准设立文号 中国证监会证监基金字[2003]63 号

注册资本 壹亿伍仟万元人民币

设立日期 2003 年 5 月 9 日

组织形式 有限责任公司

法定代表人 叶焯

电话 021-61009999

传真 021-61009800

联系人 魏明东

存续期间 持续经营

经营范围 基金管理业务，发起设立基金，中国证监会批准的其他业务。【依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动】

股权结构 股东名称 出资额 出资比例

长江证券股份有限公司 7350 万元 49%

上海海欣集团股份有限公司 5149.5 万元 34.33%

武汉钢铁股份有限公司 2500.5 万元 16.67%

总计 15000 万元 100%

（二）主要人员情况

1、基金管理人的董事会成员情况

董事会成员

姓名 职务 性别 简历

陈谋亮 董事 男 中共党员，法学硕士，工商管理博士，高级经济师，高级商务谈判师。现任上海海欣集团股份有限公司总裁。曾任湖北省委组织部“第三梯队干部班”干部，中国第二汽车制造厂干部，湖北经济学院讲师、特聘教授，扬子石化化工厂保密办主任、集团总裁办、股改办、宣传部、企管处管理干部、集团法律顾问，中石化/扬子石化与德国巴斯夫合资特大型一体化石化项目中方谈判代表，交大南洋部门经理兼董事会证券事务代表，海欣集团董事会秘书处主任、战略投资部总监、总裁助理、副总裁。

邹继新 董事 男 中共党员，高级工程师，大学学历，硕士学位。现任武汉钢铁（集团）公司党委常委、副总经理、武汉钢铁股份有限公司总经理。曾任武汉钢铁股份有限公司三炼钢厂副厂长兼总工程师，武汉钢铁股份有限公司总经理助理兼武汉钢铁股份有限公司炼钢总厂厂长，武汉钢铁股份有限公司副总经理兼制造部部长，武汉钢铁（集团）公司副总经理，武汉钢铁（集团）公司副总经理兼武汉钢铁股份有限公司总经理。

田丹 董事 男 中共党员，硕士，EMBA。现任长江证券股份有限公司监事长。曾任湖北省军区参谋、秘书，中国人民银行湖北省分行金融调研处科长，湖北证券公司证券交易部经理、总经理助理、副总经理，三峡证券公司副总经理，湖北证券有限责任公司董事、副总裁，长江证券有限责任公司董事、副总裁、财务负责人，长江证券有限责任公司董事、总裁，长信基金管理有限责任公司董事长。

覃波 董事

（代为履行董事长职务） 男 中共党员，硕士，上海国家会计学院 EMBA 毕业，具有基金从业资格。现任长信基金管理有限责任公司总经理、投资决策委员会主任委员。曾任职于长江证券有限责任公司。2002 年加入长信基金管理有限责任公司，历任市场开发部区域经理、营销策划部副总监、市场开发部总监、专户理财部总监、总经理助理、副总经理。

胡柏枝 独立董事 男 中共党员，大专，高级会计师，注册会计师，注册税务师。曾任湖北省财政厅副厅长、党组副书记，湖北省国有资产管理局副局长、局长，中国三峡总公司财务部主任、副总会计师，三峡财务公司总经理，财政部驻湖北省专员办监察专员、党组书记、巡视员，湖北省人大财经委、预工委副主任。

吴稼祥 独立董事 男 经济学学士，研究员。现任中国生物多样性保护与绿色发

展基金会副理事长、中国体制改革研究会公共政策研究部研究员。曾任职中共中央宣传部和中共中央书记处办公室、华能贵诚信托投资公司独立董事。

谢红兵 独立董事 男 中共党员，学士。曾任营教导员、军直属政治处主任，交通银行上海分行杨浦支行副行长、营业处处长兼房地产信贷部经理、静安支行行长、杨浦支行行长，交通银行基金托管部副总经理、总经理，交银施罗德基金管理有限公司董事长，中国交银保险(香港)副董事长。

注：上述人员之间均不存在近亲属关系

2、监事会成员

监事会成员

姓名 职务 性别 简历

余汉生 监事会主席 男 中共党员，本科，正高职高级会计师。现任武汉钢铁股份有限公司总会计师。曾任武钢实业公司审计处处长、武钢实业公司财务处处长、武汉钢铁（集团）公司计划财务部会计处处长、武汉钢铁股份有限公司计划财务部部长、武汉钢铁股份有限公司副总会计师兼计划财务部部长。

陈水元 监事 男 硕士研究生，会计师、经济师。现任长江证券股份有限公司执行副总裁、财务负责人。曾任湖北证券有限责任公司营业部财务主管、经纪事业部财务经理，长江证券有限责任公司经纪事业部总经理助理、经纪业务总部总经理助理、营业部总经理，长江证券股份有限公司营业部总经理总裁特别助理。

杨爱民 监事 男 中共党员，在职研究生学历，会计师。现任上海海欣集团股份有限公司财务总监。曾任甘肃铝厂财务科副科长、科长，甘肃省铝业公司财务处副处长、处长，上海海欣集团审计室主任、财务副总监。

李毅 监事 女 中共党员，硕士。现任长信基金管理有限责任公司零售服务部总监。曾任长信基金管理有限责任公司综合行政部副总监。

孙红辉 监事 男 中共党员，硕士。现任长信基金管理有限责任公司总经理助理兼基金事务部总监。曾任职于上海机械研究所、上海家宝燃气具公司和长江证券有限责任公司。

魏明东 监事 男 中共党员，硕士。现任长信基金管理有限责任公司综合行政部总监兼人力资源总监。曾任职于上海市徐汇区政府、华夏证券股份有限公司和国泰基金管理有限公司。

注：上述人员之间均不存在近亲属关系

3、经理层成员

经理层成员

姓名 职务 性别 简历

覃波 总经理

（代为履行董事长职务） 男 简历同上。

周永刚 督察长 男 经济学硕士，EMBA。现任长信基金管理有限责任公司督察长。曾任湖北证券有限责任公司武汉自治街营业部总经理，长江证券有限责任公司北方总部总经理兼北京展览路证券营业部总经理，长江证券有限责任公司经纪业务总部副总经理兼上海代表处主任、上海汉口路证券营业部总经理。

邵彦明 副总经理 男 硕士，毕业于对外经济贸易大学，具有基金从业资格。现任长信基金管理有限责任公司副总经理兼北京分公司总经理。曾任职于北京市审计局、上海申银证券公司、大鹏证券公司、嘉实基金管理有限公司。2001年作为筹备组成员加入长信基金，历任公司北京代表处首席代表、北京分公司总经理、公司总经理助理。

李小羽 副总经理 男 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）。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，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、长信金葵纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信利广灵活配置混合型证券投资基金、长信利盈灵活配置混合型证券投资基金和长信利发债券型证券投资基金的基金经理。曾任职长城证券公司、加拿大 Investors Group Financial Services Co., Ltd。2002年加入长信基金管理有限责任公司，先后任基金经理助理、交易管理部总监、长信中短债证券投资基金和长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理、总经理助理、固定收益部总监。

注：上述人员之间均不存在近亲属关系

4、基金经理

本基金基金经理情况

姓名 职务 任职时间 简历

刘波 基金经理 自基金合同生效之日起 经济学硕士，上海财经大学国防经济专业研究生毕业，具有基金从业资格。曾任太平养老股份有限公司投资管理部投资经理。2011年2月加入长信基金管理有限公司，任固定收益部基金经理助理，曾任长信利息收益开放式证券投资基金和长信新利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。现任长信利盈灵活配置混合型证券投资基金、长信可转债债券型证券投资基金、长信利众债券型证券投资基金（LOF）、长信利广灵活配置混合型证券投资基金、长信利保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、长信金葵纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信富全纯债

一年定期开放债券型证券投资基金、长信利泰灵活配置混合型证券投资基金、长信利发债券型证券投资基金、长信富泰纯债一年定期开放债券型证券投资基金和长信先利半年定期开放混合型证券投资基金的基金经理。

5、投资决策委员会成员

投资决策委员会成员

姓名 职务

覃波 总经理（代为履行董事长职务）、投资决策委员会主任委员

李小羽 副总经理、投资决策委员会执行委员、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、长信利广灵活配置混合型证券投资基金、长信金葵纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信利盈灵活配置混合型证券投资基金和长信利发债券型证券投资基金的基金经理

程燕春 总经理助理兼专户投资部总监、投资决策委员会执行委员

常松 总经理助理兼量化投资部总监、投资决策委员会执行委员、长信量化多策略股票型证券投资基金和长信金利趋势混合型证券投资基金的基金经理

谈洁颖 投资管理部总监、投资决策委员会执行委员、长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金、长信多利灵活配置混合型证券投资基金和长信睿进灵活配置混合型证券投资基金的基金经理

薛天 国际业务部投资总监、投资决策委员会执行委员、长信美国标准普尔100等权重指数增强型证券投资基金和长信海外收益一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理。

高远 研究发展部副总监

易利红 股票交易部副总监

张文珺 固定收益部总监、长信纯债壹号债券型证券投资基金、长信利鑫债券型证券投资基金（LOF）、长信利息收益开放式证券投资基金、长信富平纯债一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理。

陆莹 债券交易部副总监

注：上述人员之间均不存在近亲属关系

二、基金托管人

（一）基金托管人情况

1、基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

成立时间：1984 年 1 月 1 日

法定代表人：易会满

注册资本：人民币 35,640,625.71 万元

联系电话：010-66105799

联系人：洪渊

2、主要人员情况

截至 2016 年 3 月末，中国工商银行资产托管部共有员工 198 人，平均年龄 30 岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

3、基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自 1998 年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、企业年金基金、QFII 资产、QDII 资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII 专户资产、ESCROW 等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至 2016 年 3 月，中国工商银行共托管证券投资基金 555 只。自 2003 年以来，本行连续十一年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的 49 项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

（二）基金托管人的内部控制制度说明

中国工商银行资产托管部自成立以来，各项业务飞速发展，始终保持在资产托管行业的优势地位。这些成绩的取得，是与资产托管部“一手抓业务拓展，一手抓内控建设”的做法是分不开的。资产托管部非常重视改进和加强内部风险管理工作，在积极拓展各项托管业务的同时，把加强风险防范和控制的力度，精心培育内控文化，完善风险控制机制，强化业务项目全过程风险管理作为重要工作来做。

继 2005、2007、2009、2010、2011、2012、2013、2014 年八次顺利通过评估组织内部控制和安全措施是否充分的最权威的 SAS70（审计标准第 70 号）审阅后，2015 年中国工商银行资产托管部第九次通过 ISAE3402（原 SAS70）审阅获得无保留意见的控制及有效性报告，表明独立第三方对我行托管服务在风险管理、内部控制方面的健全性和有效性的全面认可。也证明中国工商银行托管服务的风险控制能力已经与国际大型托管银行接轨，达到国际先进水平。目前，ISAE3402 审阅已经成为年度化、常规化的内控工作手段。

1、内部风险控制目标

保证业务运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，强化和建立守法经营、规范运作的经营思想和经营风格，形成一个运作规范化、管理科学化、监控制度化的内控体系；防范和化解经营风险，保证托管资产的安全完整；维护持有人的权益；保障资产托管业务安全、有效、稳健运行。

2、内部风险控制组织结构

中国工商银行资产托管业务内部风险控制组织结构由中国工商银行稽核监察部门（内控合规部、内部审计局）、资产托管部内设风险控制处及资产托管部各业务处室共同组成。总行稽核监察部门负责制定全行风险管理政策，对各业务部门风险控制工作进行指导、监督。资产托管部内部设置专门负责稽核监察工作的内部风险控制处，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，对业务的运行独立行使稽核监察职权。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

3、内部风险控制原则

（1）合法性原则。内控制度应当符合国家法律法规及监管机构的监管要求，并贯穿于托管业务经营管理活动的始终。

（2）完整性原则。托管业务的各项经营管理活动都必须有相应的规范程序和监督制约；监督制约应渗透到托管业务的全过程和各个操作环节，覆盖所有的部门、岗位和人员。

（3）及时性原则。托管业务经营活动必须在发生时能准确及时地记录；按照“内控优先”的原则，新设机构或新增业务品种时，必须做到已建立相关的规章制度。

（4）审慎性原则。各项业务经营活动必须防范风险，审慎经营，保证基金资产和其他委托资产的安全与完整。

（5）有效性原则。内控制度应根据国家政策、法律及经营管理的需要适时修改完善，并保证得到全面落实执行，不得有任何空间、时限及人员的例外。

(6) 独立性原则。设立专门履行托管人职责的管理部门；直接操作人员和控制人员必须相对独立，适当分离；内控制度的检查、评价部门必须独立于内控制度的制定和执行部门。

4、内部风险控制措施实施

(1) 严格的隔离制度。资产托管业务与传统业务实行严格分离，建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度，并采取了良好的防火墙隔离制度，能够确保资产独立、环境独立、人员独立、业务制度和管理独立、网络独立。

(2) 高层检查。主管行领导与部门高级管理层作为工行托管业务政策和策略的制定者和管理者，要求下级部门及时报告经营管理情况和特别情况，以检查资产托管部在实现内部控制目标方面的进展，并根据检查情况提出内部控制措施，督促职能管理部门改进。

(3) 人事控制。资产托管部严格落实岗位责任制，建立“自控防线”、“互控防线”、“监控防线”三道控制防线，健全绩效考核和激励机制，树立“以人为本”的内控文化，增强员工的责任心和荣誉感，培育团队精神和核心竞争力。并通过进行定期、定向的业务与职业道德培训、签订承诺书，使员工树立风险防范与控制理念。

(4) 经营控制。资产托管部通过制定计划、编制预算等方法开展各种业务营销活动、处理各项事务，从而有效地控制和配置组织资源，达到资源利用和效益最大化目的。

(5) 内部风险管理。资产托管部通过稽核监察、风险评估等方式加强内部风险管理，定期或不定期地对业务运作状况进行检查、监控，指导业务部门进行风险识别、评估，制定并实施风险控制措施，排查风险隐患。

(6) 数据安全控制。我们通过业务操作区相对独立、数据和传真加密、数据传输线路的冗余备份、监控设施的运用和保障等措施来保障数据安全。

(7) 应急准备与响应。资产托管业务建立专门的灾难恢复中心，制定了基于数据、应用、操作、环境四个层面的完备的灾难恢复方案，并组织员工定期演练。为使演练更加接近实战，资产托管部不断提高演练标准，从最初的按照预订时间演练发展到现在的“随机演练”。从演练结果看，资产托管部完全有能力在发生灾难的情况下两个小时内恢复业务。

5、资产托管部内部风险控制情况

(1) 资产托管部内部设置专职稽核监察部门，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，全面贯彻落实全程监控思想，确保资产托

管业务健康、稳定地发展。

(2) 完善组织结构，实施全员风险管理。完善的风险管理体系需要从上至下每个员工的共同参与，只有这样，风险控制制度和措施才会全面、有效。资产托管部实施全员风险管理，将风险控制责任落实到具体业务部门和业务岗位，每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责，通过建立纵向双人制、横向多部门制的内部组织结构，形成不同部门、不同岗位相互制衡的组织结构。

(3) 建立健全规章制度。资产托管部十分重视内控制度的建设，一贯坚持把风险防范和控制的理念和方法融入岗位职责、制度建设和工作流程中。经过多年努力，资产托管部已经建立了一整套内部风险控制制度，包括：岗位职责、业务操作流程、稽核监察制度、信息披露制度等，覆盖所有部门和岗位，渗透各项业务过程，形成各个业务环节之间的相互制约机制。

(4) 内部风险控制始终是托管部工作重点之一，保持与业务发展同等地位。资产托管业务是商业银行新兴的中间业务，资产托管部从成立之日起就特别强调规范运作，一直将建立一个系统、高效的风险防范和控制体系作为工作重点。随着市场环境的变化和托管业务的快速发展，新问题、新情况不断出现，资产托管部始终将风险管理放在与业务发展同等重要的位置，视风险防范和控制为托管业务生存和发展的生命线。

(三) 基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《基金法》、基金合同、基金托管人与基金管理人签署的《托管协议》和有关基金法规的规定，基金托管人对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金费用的支付、基金申购资金的到账和赎回资金的划付、基金收益分配、基金的融资条件等行为的合法性、合规性进行监督和核查，其中对基金投资的监督和检查自基金合同生效之后开始。

基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、基金合同、《托管协议》或有关基金法规规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对，并以书面形式对基金托管人发出回函确认。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。基金托管人有义务要求基金管理人赔偿因其过失致使投资者遭受的损失。

基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

三、相关服务机构

(一) 基金份额销售机构

1、直销中心：长信基金管理有限责任公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 9 楼

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

法定代表人：叶焯 联系人：王瑞英

电话：021-61009916 传真：021-61009917

客户服务电话：400-700-5566 公司网站：www.cxfund.com.cn

2、场外代销机构

(1) 中国工商银行股份有限公司

注册地址：中国北京复兴门内大街 55 号

办公地址：中国北京复兴门内大街 55 号

法定代表人：易会满 联系人：李鸿岩

电话：010-66105662

客户服务电话：95588 网址：www.icbc.com.cn

(2) 交通银行股份有限公司

注册地址：上海市银城中路 188 号

办公地址：上海市银城中路 188 号

法定代表人：牛锡明 联系人：张宏革

电话：021-58781234 传真：021-58408483

客户服务电话：95559 网址：www.bankcomm.com

(3) 平安银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南中路 1099 号平安银行大厦

办公地址：深圳市深南中路 1099 号平安银行大厦

法定代表人：孙建一 联系人：张莉

电话：0755-22166118 传真：0755-25841098

客户服务电话：95511-3 网址：bank.pingan.com

(4) 长江证券股份有限公司

注册地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

办公地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：尤习贵 联系人：李良

电话：027-65799999 传真：027-85481900

客户服务电话：95579 或 4008-888-999 网址：www.95579.com

(5) 第一创业证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼

办公地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 18 楼

法定代表人：刘学民 联系人：吴军

电话：0755-23838751 传真：0755-25831754

客户服务电话：95358 网址：www.firstcapital.com.cn

(6) 东吴证券股份有限公司

注册地址：苏州工业园区星阳街 5 号

办公地址：苏州工业园区星阳街 5 号

法定代表人：范力 联系人：陆晓

电话：0512-62938521 传真：0512-65588021

客户服务电话：400 860 1555 网址：www.dwzq.com.cn

(7) 光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：薛峰 联系人：刘晨

电话：021-22169999 传真：021-22169134

客户服务电话：95525 网址：www.ebscn.com

(8) 华福证券有限责任公司

注册地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层

办公地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7 至 10 层

法定代表人：黄金琳 联系人：张腾

电话：0591-87383623 传真：0591-87383610

客户服务电话：96326（福建省外请先拨 0591） 网址：www.hfzq.com.cn

(9) 国都证券股份有限公司

注册地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层

办公地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层

法定代表人：王少华 联系人：李弢

电话：010-84183389 传真：010-84183311-3389

客户服务电话：400-818-8118 网址：www.guodu.com

(10) 国金证券股份有限公司

注册地址：成都市东城根上街95号

办公地址：四川省成都市东城根上街95号

法定代表人：冉云 联系人：刘婧漪、贾鹏

电话：028-86690057、028-86690058 传真：028-86690126

客户服务电话：95310 网址：www.gjzq.com.cn

(11) 国盛证券有限责任公司

注册地址：南昌市北京西路88号（江信国际金融大厦）

办公地址：南昌市北京西路88号（江信国际金融大厦）

法定代表人：马跃进 联系人：俞驰

电话：0791-86283080 传真：0791-86288690

客户服务电话：4008-222-111 网址：www.gsstock.com

(12) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路618号

办公地址：上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼

法人代表人：杨德红 联系人：芮敏祺

电话：95521 传真：021-38670666

客户服务热线：4008888666 网址：www.gtja.com

(13) 华宝证券有限责任公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道100号57层

办公地址：上海市浦东新区世纪大道100号57层

法定代表人：陈林 联系人：刘闻川

电话：021-68777222 传真：021-68777822
客户服务电话：400-820-9898 网址：www.cnhbstock.com

(14) 华龙证券股份有限公司

注册地址：甘肃省兰州市城关区东岗西路 638 号财富大厦 21 楼
办公地址：甘肃省兰州市城关区东岗西路 638 号财富大厦
法定代表人：李晓安 联系人：邓鹏怡
电话：0931-4890208 传真：0931-4890628
客户服务电话：4006898888 网址：www.hlzqgs.com.cn

(15) 平安证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼
办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼 (518048)
法定代表人：杨宇翔 联系人：周一涵
电话：0755-22626391 传真：0755-82400862
客户服务电话：95511—8 网址：www.stock.pingan.com

(16) 中泰证券股份有限公司

注册地址：山东省济南市市中区经七路 86 号
办公地址：山东省济南市市中区经七路 86 号
法定代表人：李玮 联系人：王霖
电话：0531-68889155 传真：0531-68889752
客户服务电话：95538 网址：www.qlzq.com.cn

(17) 上海证券有限责任公司

注册地址：上海市西藏中路 336 号上海证券
办公地址：上海市西藏中路 336 号
法定代表人：龚德雄 联系人：许曼华
电话：021-53519888 传真：021-53519888
客户服务电话：4008918918、021-962518 网址：www.962518.com

(18) 申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 40 层

法定代表人：李梅 联系人：黄莹

电话：021-33389888 传真：021-33388224

客户服务电话：95523 或 4008895523 网址：www.swhysc.com

(19) 兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 268 号

办公地址：浦东新区民生路 1199 弄证大·五道口广场 1 号楼 21 层

法定代表人：兰荣 联系人：夏中苏

电话：021-38565785

客户服务电话：400-8888-123 网址：www.xyzq.com.cn

(20) 招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 38-45 层

办公地址：广东省深圳市福田区益田路江苏大厦 38-45 层

法定代表人：宫少林 联系人：黄婵君

电话：0755-82960223 传真：0755-82943121

客户服务电话：95565 或 400-8888-111 网址：www.newone.com.cn

(21) 中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

办公地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：陈有安 联系人：宋明

电话：010-66568888 传真：010-66568990

客户服务电话：4008-888-888 网址：www.chinastock.com.cn

(22) 中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：王常青 联系人：张颢

电话：010-85130588 传真：010-65182261

客户服务电话：400-8888-108 网址：www.csc108.com

(23) 中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦

法定代表人：王东明 联系人：侯艳红

电话：010-60838888 传真：010-60833739

客户服务电话：95558 网址：www.citics.com

(24) 中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼20层（266061）

办公地址：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼20层
（266061）

法定代表人：杨宝林 联系人：吴忠超

电话：0532-85022326 传真：0532-85022605

客户服务电话：95548 网址：www.citicssd.com

(25) 中山证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区益田路6009号新世界中心29层

办公地址：深圳市福田区益田路6009号新世界中心29层

法定代表人：吴永良 联系人：罗艺琳

电话：0755-83734659 传真：0755-82960582

客户服务电话：4001022011 网址：www.zszq.com.cn

(26) 信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

办公地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

法定代表人：张志刚 联系人：鹿馨方

电话：010-63081000 传真：010-63080978

客服热线：95321 网址：www.cindasc.com

(27) 西南证券股份有限公司

注册地址：重庆市江北区桥北苑8号

办公地址：重庆市江北区桥北苑8号西南证券大厦

法定代表人：余维佳 联系人：张煜

电话：023-63786633 传真：023-63786212
客服热线：4008096096 网址：www.swsc.com.cn

(28) 杭州数米基金销售有限公司

注册地址：杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号1幢202室
办公地址：浙江省杭州市西湖区黄龙时代广场B座6楼
法定代表人：陈柏青 联系人：韩爱彬
电话：0571-81137494 传真：4000-766-123
客户服务电话：4000-766-123 网址：www.fund123.cn

(29) 上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路526号2幢220室
办公地址：上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层
法定代表人：张跃伟 联系人：马良婷
电话：021-20691832 传真：021-20691861
客户服务电话：400-820-2899 网址：www.erichfund.com

(30) 诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市金山区廊下镇漕廊公路7650号205室
办公地址：上海市浦东新区陆家嘴银城中路68号时代金融中心8楼801
法定代表人：汪静波 联系人：徐诚
电话：021-38602377 传真：021-38509777
客户服务电话：400-821-5399 网址：www.noah-fund.com

(31) 上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室
办公地址：上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903-906室
法定代表人：杨文斌 联系人：苗汀
电话：021-58870011 传真：021-68596916
客户服务电话：4007009665 网址：www.ehowbuy.com

(32) 和讯信息科技有限公司

注册地址：北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层

办公地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层
法定代表人：王莉 联系人：吴卫东
电话：021-68419822 传真：021-20835779
客户服务电话：400-920-0022 网址：www.licaike.com

(33) 上海天天基金销售有限公司
注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层
办公地址：上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 7 楼
法定代表人：其实 联系人：朱钰
电话：021-54509998 传真：021-64385308
客户服务电话：400-1818-188 网址：fund.eastmoney.com

(34) 上海汇付金融服务有限公司
注册地址：上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼
办公地址：上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼
法定代表人：冯修敏 联系人：陈云卉
电话：021-33323999-5611 传真：021-33323830
客户服务电话：4008202819 网址：www.chinapnr.com

(35) 大泰金石投资管理有限公司
注册地址：南京市建邺区江东中路 359 号国睿大厦一号楼 B 区 4 楼 A506 室
办公地址：上海市长宁区虹桥路 1386 号文广大厦 15 楼
法定代表人：袁顾明 联系人：朱真卿
电话：021-22267943 传真：021-22268089
客户服务电话：400-928-2266 网址：www.dtfortune.com

(36) 上海联泰资产管理有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室
办公地址：上海长宁区福泉北路 518 号 8 座 3 楼
法定代表人：燕斌 联系人：陈东
电话：021-52822063 传真：021-52975270
客户服务电话：400-046-6788 网址：www.66zichan.com

(37) 海银基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区东方路 1217 号 16 楼 B 单元

办公地址：上海市浦东新区东方路 1217 号 6 楼

法定代表人：刘惠 联系人：毛林

电话：021-80133597 传真：021-80133413

客户服务电话：4008081016 网址：www.fundhaiyin.com

(38) 上海凯石财富基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区西藏南路 765 号 602-115 室

办公地址：上海市黄浦区延安东路 1 号凯石大厦 4 楼

法定代表人：陈继武 联系人：葛佳蕊

电话：021-80365020 传真：021-63332523

客户服务电话：4006433389 网址：www.lingxianfund.com

(39) 上海利得基金销售有限公司

注册地址：上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室

办公地址：上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 12 楼

法定代表人：沈继伟 联系人：徐鹏

电话：86-021-50583533 传真：86-021-50583633

客户服务电话：400-067-6266 网站：<http://a.leadfund.com.cn/>

(40) 珠海盈米财富管理有限公司

注册地址：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3451

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼 B1201-1203

法定代表人：肖雯 联系人：钟琛

电话：020-89629012 传真：020-89629011

客户服务电话：020-89629066 网站：www.yingmi.cn

(41) 北京汇成基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108

办公地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108

法定代表人：王伟刚 联系人：丁向坤

电话：18001102931 传真：010-62680827

客户服务电话：400-619-9059 网站：www.fundzone.cn

3、场内销售机构

场内代销机构是指有基金代销资格的上海证券交易所会员，名单详见上海证券交易所网站：<http://www.sse.com.cn>

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。

（二）其他相关机构

信息类型 登记机构 律师事务所 会计师事务所

名称 中国证券登记结算有限责任公司 上海源泰律师事务所 毕马威华振会计师事务所

注册地址 北京市西城区太平桥大街 17 号 上海市浦东南路 256 号华夏银行大厦 1405 室 北京东长安街 1 号东方广场东 2 座 8 层

办公地址 北京市西城区太平桥大街 17 号 上海市浦东南路 256 号华夏银行大厦 1405 室 上海南京西路 1266 号恒隆广场 50 楼

法定代表人 金颖 廖海（负责人） 姚建华

联系电话 010-59378856 021-51150298 021-22122888

传真 010-59378907 021-51150398 021-62881889

联系人 崔巍 廖海、刘佳 王国蓓（王国蓓、虞京京为经办注册会计师）

四、基金的名称

长信富全纯债一年定期开放债券型证券投资基金

五、基金的类型

契约型

六、基金的投资目标

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。

七、基金的投资范围

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、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、国债期货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，同时本基金不参与可转换债券投资。

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，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券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。

八、基金的投资策略

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

本基金将在基金合同约定的投资范围内，通过对宏观经济运行状况、国家货币政策和财政政策、国家产业政策及资本市场资金环境的研究，积极把握宏观经济发展趋势、利率走势、债券市场相对收益率、券种的流动性以及信用水平，优化固定收益类金融工具的资产比例配置。在有效控制风险的基础上，适时调整组合久期，以获得基金资产的稳定增值，提高基金总体收益率。

（2）类属配置策略

对于债券资产而言，是信用债、金融债和国债之间的比例配置。当宏观经济转向衰退周期，企业信用风险将普遍提高，此时降低信用债投资比例，降低幅度应该结合利差预期上升幅度和持有期收益分析结果来进行确定。相反，当宏观经济转向复苏，企业信用风险普遍下降，此时应该提高信用债投资比例，提高幅度应该结合利差预期下降幅度和持有期收益分析结果来进行确定。此外，还将考察一些特殊因素对于信用债配置产生影响，其中包括供给的节奏，主要投资主体的投资习惯，以及替代资产的冲击等均对信用利差产生影响，因此，在中国市场分析信用债投资机会，不仅需要分析信用风险趋势，还需要分析供需面和替代资产的冲击等因素，最后，在预期的利差变动范围内，进行持有期收益分析，以确定最佳

的信用债投资比例和最佳的信用债持有结构。

（3）个券选择策略

本基金主要根据各品种的收益率、流动性和信用风险等指标，挑选被市场低估的品种。在严控风险的前提下，获取稳定的收益。在确定债券组合久期之后，本基金将通过对不同信用类别债券的收益率基差分析，结合税收差异、信用风险分析、期权定价分析、利差分析以及交易所流动性分析，判断个券的投资价值，以挑选风险收益相匹配的券种，建立具体的个券组合。

（4）骑乘策略

骑乘策略是指当收益率曲线比较陡峭时，也即相邻期限利差较大时，可以买入期限位于收益率曲线陡峭处的债券，也即收益率水平处于相对高位的债券，随着持有期限的延长，债券的剩余期限将会缩短，从而此时债券的收益率水平将会较投资期初有所下降，通过债券的收益率的下滑，进而获得资本利得收益。骑乘策略的关键影响因素是收益率曲线的陡峭程度。若收益率曲线较为陡峭，则随着债券剩余期限的缩短，债券的收益率水平将会有较大下滑，进而获得较高的资本利得。

（5）息差策略

息差策略是指利用回购利率低于债券收益率的情形，通过正回购将所获得资金投资于债券的策略。息差策略实际上也就是杠杆放大策略，进行放大策略时，必须考虑回购资金成本与债券收益率之间的关系，只有当债券收益率高于回购资金成本（即回购利率）时，息差策略才能取得正的收益。

（6）利差策略

利差策略是指对两个期限相近的债券的利差进行分析，从而对利差水平的未来走势做出判断，进而相应地进行债券置换。影响两期限相近债券的利差水平的因素主要有息票因素、流动性因素及信用评级因素等。当预期利差水平缩小时，可以买入收益率高的债券同时卖出收益率低的债券，通过两债券利差的缩小获得投资收益；当预期利差水平扩大时，可以买入收益率低的债券同时卖出收益率高的债券，通过两债券利差的扩大获得投资收益。

（7）资产支持证券的投资策略

资产支持证券是将缺乏流动性但能够产生稳定现金流的资产，通过一定的结构性安排，对资产中的风险与收益进行分离组合，进而转换成可以出售、流通，并带有固定收入的证券的过程。资产支持证券的定价受市场利率、发行条款、标的资产的构成及质量、提前偿还率等多种因素影响。本基金将在基本面分析和债券市场宏观分析的基础上，对资产支持证券的交易结构风险、信用风险、提前偿还风

险和利率风险等进行分析，采取包括收益率曲线策略、信用利差曲线策略、预期利率波动率策略等积极主动的投资策略，投资于资产支持证券。

（8）国债期货的投资策略

本基金通过对基本面和资金面的分析，对国债市场走势做出判断，以作为确定国债期货的头寸方向和额度的依据。当中长期经济高速增长，通货膨胀压力浮现，央行政策趋于紧缩时，本基金建立国债期货空单进行套期保值，以规避利率风险，减少利率上升带来的亏损；反之，在经济增长趋于回落，通货膨胀率下降，甚至通货紧缩出现时，本基金通过建立国债期货多单，以获取更高的收益。

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。

九、基金的投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）本基金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，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，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；

（2）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；

（3）本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；

（4）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

（5）本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；

（6）本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

（7）本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上（含 BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

(8) 在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的 15%，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%；

(9) 在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 30%；

(10) 本基金所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）不低于基金资产的 80%；

(11) 本基金在封闭运作期间，基金的总资产不得超过基金净资产的 200%；在开放期内，基金的总资产不得超过基金净资产的 140%；

(12) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%，债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

(13) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

因证券市场波动、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。期间，基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。

基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

如果法律法规对上述投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制，但需提前公告，不需要再经基金份额持有人大会审议。

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 向其基金管理人、基金托管人出资；
- (5) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (6) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先的原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照

市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并履行信息披露义务。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过，基金管理人董事会至少每半年对关联交易事项进行审查。

法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

十、基金的业绩比较基准

中证综合债指数收益率

本基金选择中证综合债指数收益率作为业绩比较基准的原因如下：

中证综合债指数是中证指数公司编制的综合反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央行票据及短融整体走势的跨市场债券指数，其选样是在中证全债指数样本的基础上，增加了央行票据、短期融资券以及一年期以下的国债、金融债和企业债。该指数的推出旨在更全面地反映我国债券市场的整体价格变动趋势，为债券投资者提供更切合的市场基准，适合作为本基金的业绩比较基准。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩比较基准时，本基金管理人在与基金托管人协商一致，并履行适当程序后调整或变更业绩比较基准并及时公告，而无须召开基金份额持有人大会。

十一、基金的风险收益特征

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。

十二、基金投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年9月复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本投资组合报告所载数据截至2016年6月30日（摘自本基金2016年第二季度报告），本报告中所列财务数据未经审计。

（一）报告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 1,564,769,078.80 83.37

其中：债券 1,564,769,078.80 83.37

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 230,000,245.00 12.25

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 61,597,179.07 3.28

7 其他各项资产 20,532,735.78 1.09

8 合计 1,876,899,238.65 100.00

注：本基金本报告期末通过沪港通交易机制投资港股。

(二) 报告期末按行业分类的股票投资组合

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。

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。

(三) 报告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

本基金本报告期末未持有股票。

(四) 报告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 51,405,778.80 2.75

2 央行票据 --

3 金融债券 421,128,000.00 22.52

其中：政策性金融债 421,128,000.00 22.52

4 企业债券 491,541,300.00 26.29

5 企业短期融资券 600,694,000.00 32.12

6	中期票据	--
7	可转债（可交换债）	--
8	同业存单	--
9	其他	--
10	合计	1,564,769,078.80 83.68

（五）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	160207	16 国开 07	1,800,000	179,442,000.00	9.60
2	160210	16 国开 10	1,200,000	119,940,000.00	6.41
3	150201	15 国开 01	600,000	60,966,000.00	3.26
4	011699320	16 华能新能 SCP002	600,000	60,078,000.00	3.21
5	1480146	14 涪陵新城债	500,000	54,685,000.00	2.92

（六）报告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。

（七）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。

（八）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权证投资明细
 本基金本报告期末未持有权证。

（九）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。

（十）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。

（十一）投资组合报告附注

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。

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。

3、其他资产构成

单位：人民币元

序号 名称 金额

1 存出保证金 1,647.49

2 应收证券清算款 -

3 应收股利 -

4 应收利息 20,531,088.29

5 应收申购款 -

6 其他应收款 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

9 合计 20,532,735.78

4、报告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。

5、报告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。

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。

十三、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

（一）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

长信富全纯债一年定开债券 A 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

2016年4月1日至2016年6月30日 0.77% 0.02% 0.41% 0.05% 0.36% -0.03%

自基金合同生效起至今 0.84% 0.02% 0.94% 0.05% -0.10% -0.03%

长信富全纯债一年定开债券 C 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

2016 年 4 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 0.66% 0.02% 0.41% 0.05% 0.25% -0.03%

自基金合同生效起至今 0.71% 0.02% 0.94% 0.05% -0.23% -0.03%

(二) 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

长信富全纯债一年定开债券 A 自基金合同生效以来基金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

长信富全纯债一年定开债券 C 自基金合同生效以来基金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 2016 年 3 月 9 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 2016 年 3 月 9 日至 2016 年 6 月 30 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应符合基金合同中的约定：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，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券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。

截至本报告期末，本基金尚未完成建仓。

十四、费用概况

(一) 基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金销售服务费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；

- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券、期货交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、证券账户开户费用、银行账户维护费用；
- 10、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

（二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.7%年费率计提。基金管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.7\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人于次月首日起 2 个工作日内向基金托管人发送基金管理费划款指令，经基金托管人复核无误后于 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.2%的年费率计提。基金托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人于次月首日起 2 个工作日内向基金托管人发送基金托管费划款指令，经基金托管人复核无误后于 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

3、基金销售服务费

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 0.4%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务。销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值的 0.4%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.4\% \div \text{当年天数}$$

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

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人于次月首日起 2 个工作日内向基金托管人发送销售服务费划付指令，基金托管人复核无误后于 2 个工作日内从基金财产中支付到指定账户。基金销售服务费由登记机构代收，登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构等。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

上述“（一）基金费用的种类”中第 4—10 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

（三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

（四）费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后，可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率、基金销售服务费率等相关费率。

调高基金管理费率、基金托管费率或基金销售服务费率等费率，须召开基金份额持有人大会审议；调低基金管理费率、基金托管费率或基金销售服务费率等费率，无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率实施日前在指定媒介上刊登公告。

（五）基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十五、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求，并结合本基金管理人对基金实施的投资经营活动，对本基金招募说明书（《长信富全纯债一年定期开放债券型证券投资基金招募说明书》）进行了更新，主要更新的内容如下：

- 1、在“三、基金管理人”部分，对基金管理人主要人员情况进行了更新；

- 2、在“四、基金托管人”部分，更新了基金托管人的基本情况和业务经营情况有关资料；
- 3、在“五、相关服务机构”部分，更新了代销机构的信息以及会计师事务所经办会计师的信息；
- 4、在“六、基金的募集”部分，增加了基金募集的结果；
- 5、在“七、基金合同的生效”部分，增加了基金合同生效的信息；
- 6、在“九、基金份额的申购与赎回”部分，增加了赎回费归基金资产比例的信息；
- 7、在“十一、基金投资组合报告”部分，根据最新的定期报告，增加了相应的内容；
- 8、在“十二、基金的业绩”部分，根据最新的定期报告，增加了相应的内容，并经托管人复核；
- 9、在“二十三、基金份额持有人服务”部分，更新了部分内容；
- 10、在“二十四、其它应披露的事项”部分，更新了相应内容。

长信基金管理有限责任公司

二〇一六年十月二十二日