

长信利丰债券型证券投资基金 2017 年半年度报告

2017 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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 24 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司（以下简称“中国农业银行”，下同）根据本基金基金合同规定，于 2017 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 2017 年 1 月 1 日起至 2017 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	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
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.....	14
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.....	14
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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	16
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
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.....	17
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.....	17
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	18
6.1 资产负债表.....	18
6.2 利润表.....	19
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	20

6.4 报表附注.....	21
§7 投资组合报告.....	45
7.1 期末基金资产组合情况.....	45
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	45
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.....	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	48
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.....	49
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.....	49
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.....	49
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.....	49
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	49
7.11 投资组合报告附注.....	50
§8 基金份额持有人信息.....	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	51
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.....	51
§9 开放式基金份额变动.....	52
§10 重大事件揭示.....	53
10.1 基金份额持有人大会决议.....	53
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.....	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	53
10.4 基金投资策略的改变.....	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	53
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.....	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	53
10.8 其他重大事件.....	55
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	58
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况.....	58
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	58

§12 备查文件目录	59
12.1 备查文件目录.....	59
12.2 存放地点.....	59
12.3 查阅方式.....	59

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长信利丰债券型证券投资基金	
基金简称	长信利丰债券	
基金主代码	519989	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2008 年 12 月 29 日	
基金管理人	长信基金管理有限责任公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,853,217,100.52 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	长信利丰债券 C	长信利丰债券 E
下属分级基金场内简称:	长信 LFC	-
下属分级基金的交易代码:	519989	004651
报告期末下属分级基金的份额总额	1,853,216,361.42 份	739.10 份

注：基金管理人决定自 2017 年 5 月 19 日起对长信利丰债券型证券投资基金进行份额分类，原有基金份额为 C 类份额，增设 E 类份额，具体事宜可详见基金管理人于 2017 年 5 月 17 日发布的《长信基金管理有限责任公司关于长信利丰债券型证券投资基金增设 E 类基金份额相关事项的公告》。

2.2 基金产品说明

投资目标	通过积极主动的资产管理和严格的风险控制，在保持基金资产流动性和严格控制基金资产风险的前提下，为投资者提供稳定增长的投资收益。
投资策略	本基金为债券型基金，基金资产主要投资于固定收益类品种，其中投资于以企业为主体发行的债券不低于基金债券资产的 20%，并通过投资国债、金融债和资产支持证券等，增加企业债投资组合的投资收益。
业绩比较基准	中证全债指数×90%+中证 800 指数×10%
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期收益和预期风险低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金，属于证券投资基金产品中风险收益程度中等偏低的投资品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		长信基金管理有限责任公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周永刚	林葛
	联系电话	021-61009999	010-66060069
	电子邮箱	zhouyg@cxfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com

客户服务电话	4007005566	95599
传真	021-61009800	010-68121816
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 9 楼	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址	上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 9 层
邮政编码	200120	100031
法定代表人	成善栋	周慕冰

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、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、北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 9 层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
C 类注册登记机构	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
E 类注册登记机构	长信基金管理有限责任公司	上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼

§ 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

基金级别	长信利丰债券 C	长信利丰债券 E
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2017年1月1日 - 2017年6月30日)	报告期(2017年5月19日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	-97,450,639.17	-0.93
本期利润	-1,892,891.67	26.65
加权平均基金份额本期利润	-0.0009	0.0361
本期加权平均净值利润率	-0.06%	2.64%
本期基金份额净值增长率	0.22%	2.13%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)	
期末可供分配利润	188,536,363.93	259.97
期末可供分配基金份额利润	0.1017	0.3517
期末基金资产净值	2,574,613,996.16	1,026.65
期末基金份额净值	1.389	1.389
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	107.18%	2.13%

注：1、长信利丰债券 E 份额增加日为 2017 年 5 月 19 日，截至本报告期末，长信利丰债券 E 份额运作时间未满半年；

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

3、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。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

长信利丰债券 C

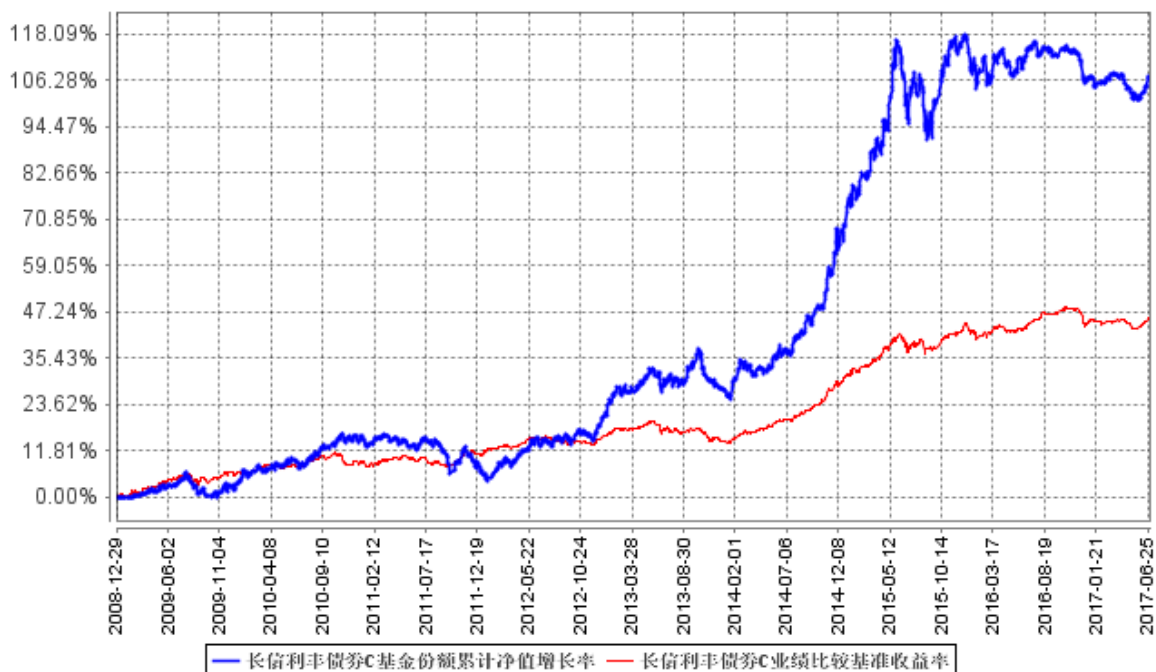
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	2.51%	0.25%	1.59%	0.08%	0.92%	0.17%

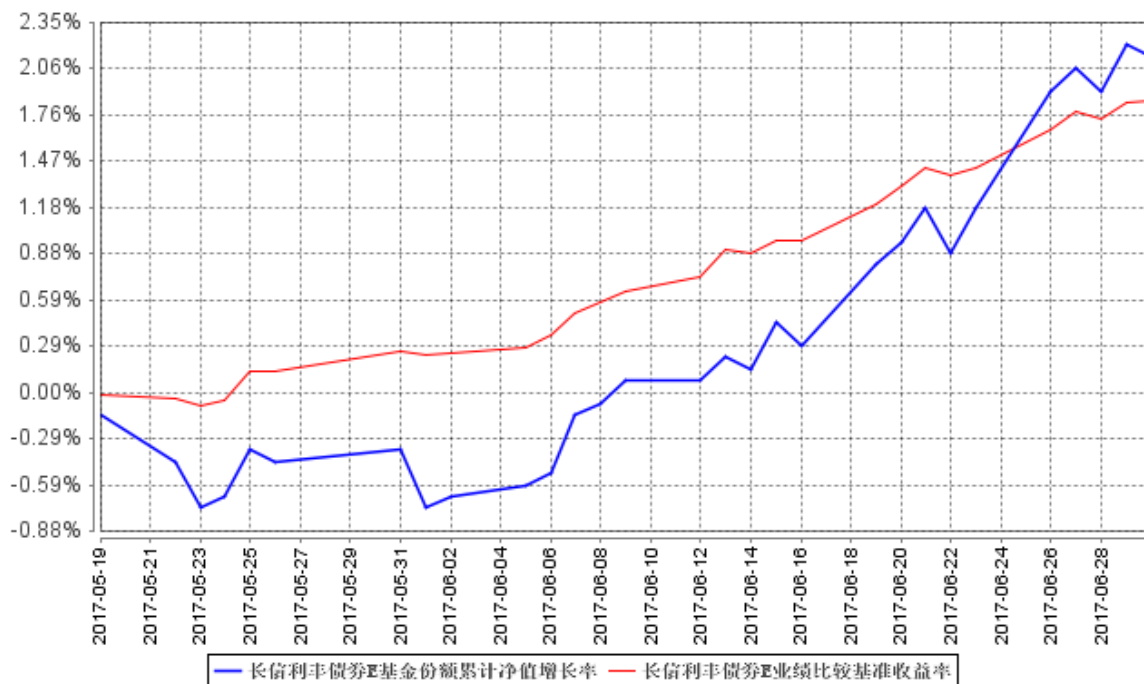
过去三个月	0.07%	0.24%	0.43%	0.11%	-0.36%	0.13%
过去六个月	0.22%	0.22%	0.51%	0.10%	-0.29%	0.12%
过去一年	-3.27%	0.23%	1.29%	0.12%	-4.56%	0.11%
过去三年	50.86%	0.59%	21.55%	0.20%	29.31%	0.39%
自基金合同生效起至今	107.18%	0.46%	45.70%	0.19%	61.48%	0.27%

长信利丰债券 E

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	2.51%	0.25%	1.59%	0.08%	0.92%	0.17%
自份额增加日起至今 (2017年5月19日-2017年6月30日)	2.13%	0.25%	1.85%	0.08%	0.28%	0.17%

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、基金管理人自 2017 年 5 月 19 日起对长信利丰债券型证券投资基金进行份额分类，原有基金份额为 C 类份额，增设 E 类份额。

2、长信利丰债券 C 图示日期为 2008 年 12 月 29 日至 2017 年 6 月 30 日，长信利丰债券 E 图示日期为 2017 年 5 月 19 日（份额增加日）至 2017 年 6 月 30 日。

3、按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内为建仓期。建仓期结束时，本基金的各项投资比例已符合基金合同的约定。

§ 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 1.65 亿元人民币，目前股权结构为：长江证券股份有限公司占 44.55%、上海海欣集团股份有限公司占 31.21%、武汉钢铁股份有限公司占 15.15%、上海彤胜投资管理中心（有限合伙）为 4.55%、上海彤骏投资管理中心（有限合伙）为 4.54%。

截至 2017 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 49 只开放式基金，即长信利息收益开放式证券投资基金、长信银利精选混合型证券投资基金、长信金利趋势混合型证券投资基金、长信增利动态策略混合型证券投资基金、长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金、长信利丰债券型证券投资基金、长信恒利优势混合型证券投资基金、长信量化先锋混合型证券投资基金、长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金、长信利鑫债券型证券投资基金 (LOF)、长信内需成长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)、长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信纯债壹号债券型证券投资基金、长信改革红利灵活配置混合型证券投资基金、长信量化中小盘股票型证券投资基金、长信新利灵活配置混合型证券投资基金、长信利富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、长信利广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、长信睿进灵活配置混合型证券投资基金、长信量化多策略股票型证券投资基金、长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)、长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金、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、长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金 (LOF)、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、长信海外收益一年定期开放债券型证券投资基金、长信先锐债券型证券投资基金、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、长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金、长信富平纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信先利半年定期开放混合型证券投资基金、长信创新驱动股票型证券投资基金、长信稳益纯债债券型证券投资基金、长信利信灵活配置混合型证券

投资基金、长信稳健纯债债券型证券投资基金、长信上证港股通指数型发起式证券投资基金、长信纯债半年债券型证券投资基金、长信国防军工量化灵活配置混合型证券投资基金、长信中证上海改革发展主题指数型证券投资基金（LOF）。

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		
李小羽	长信利广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、长信利丰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、长信利富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、长信利发债券型证券投资基金、长信利众债券型证券投资基金（LOF）、长信富安纯债一年定期开放债券型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、公司副总经理、投资决策委员会执行委员	2008 年 12 月 29 日	-	19 年	上海交通大学工学学士，华南理工大学工学硕士，具有基金从业资格，加拿大特许投资经理资格（CIM）。曾任职长城证券公司、加拿大 Investors Group Financial Services Co., Ltd。2002 年加入长信基金管理有限责任公司，先后任基金经理助理、交易管理部总监、长信中短债证券投资基金和长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理、固定收益部总监、总经理助理。现任长信基金管理有限责任公司副总经理、投资决策委员会执行委员，长信利广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、长信利丰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、长信利富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、长信利发债券型证券投资基金、长信利众债券型证券投资基金（LOF）、长信富安纯债一年定期开放债券型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。
胡琼予	长信利盈灵活配置混合型证券投资基金、长信利众债券型证券投资基金（LOF）、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助理	2016 年 12 月 12 日	-	5 年	美国波士顿大学经济学硕士，具有基金从业资格。曾任美世咨询研究分析师，2013 年加入长信基金管理有限责任公司，曾任债券交易部高级债券交易员，现任职于固定收益部，担任长信利盈灵活配置混合型证券投资基金、长信利众债券型证券投资基金（LOF）、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助理。

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；

3、自 2017 年 7 月 28 日起，吴晖女士开始担任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、长信利丰债券型证券投资基金和长信可转债债券型证券投资基金的基金经理助理；

4、自 2017 年 8 月 8 日起，李小羽先生不再担任长信利发债券型证券投资基金的基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

2017 年上半年，全球经济维持复苏态势，美债收益率下行，美股一路走高。欧元区的政治和经济风险小于预期，欧元稳步走强。国内经济展现了超预期的韧性，叠加监管政策压力，债券市场震荡调整。前两个季度的信贷和社融数据持续高位，房地产及基建投资增速表现超预期。价格方面，受供给侧改革推动，工业原材料价格不断冲高，但由于对下游传导路径较复杂，消费品物价指数维持平稳。货币政策保持稳健中性，整体节奏波动较大。一季度央行上调政策利率，造成资金利率明显抬升。二季度金融监管持续升级，市场波动性加剧，同业存单和理财收益率居高不下。临近六月末，随着央行削峰填谷的稳健操作，引导资金面平衡，以及监管协调性加强，市场利率出现拐点。可转债一级市场供给加速，二级市场估值仍处于压缩通道，整体表现为震荡格局。

报告期内，本基金结合规模变动因素逐渐调整了债券仓位及结构，具体而言，一季度本基金降低杠杆和久期，避免市场回调的损失。二季度本基金逐步配置中短期城投债，以期获得稳定的投资收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2017 年 6 月 30 日，长信利丰债券 C 基金份额净值为 1.389 元，份额累计净值为 1.882 元，本报告期长信利丰债券 C 份额净值增长率为 0.22%，同期业绩比较基准收益率为 0.51%；长信利丰债券 E 基金份额净值为 1.389 元，份额累计净值为 1.389 元，本报告期长信利丰债券 E 份额净值增长率为 2.13%；同期业绩比较基准收益率为 1.85%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，境外美国年内缩表和加息步伐有望确定，欧元区经济平稳持续。国内而言，宏观经济持续向好，韧性十足。三季度十九大的召开有望开启新一轮政治和经济周期，密切关注相关政策颁布和经济基本面数据。受到供给侧改革和环保措施的严格推进，上游原材料价格维持高位，工业品价格将减速小幅下行。货币政策维持中性，以不紧不松为资金面的合意水平，利率区间或将保持窄幅波动。同时，汇率水平和外汇占款的稳定，有利于基础货币投放。市场情绪方面，观望情绪较重，震荡格局下，配置机会和交易机会交替出现。可转债有望开启信用申购，随着一级市场供给加速，打新的累积收益预期可观。并且，持续寻找转债发行中的正股博弈机会，获得交易性收益。

下一阶段，我们将继续秉承谨慎原则，加强组合的流动性管理，在做好利率风险控制的同时，增加对新经济环境下信用风险的审慎判断。适度控制组合久期，密切关注经济走势和政策动向，紧跟组合规模变动进行资产配置，争取在流动安全的前提下，为投资者获取更好的收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证券监督管理委员会 2008 年 9 月 12 日发布的[2008]38 号文《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，长信基金管理有限责任公司（以下简称“公司”）制订了健全、有效的估值政策和程序，成立了估值工作小组，小组成员由基金事务部、投资、研究、交易等相关业务部门负责人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、本基金同一类别的每份基金份额享有同等分配权；
- 2、基金收益分配后各类基金份额每一基金份额净值不能低于面值；

- 3、收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由基金投资者自行承担；
- 4、基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；
- 5、基金当期收益应先弥补上期累计亏损后，才可进行收益分配；
- 6、在符合基金分红条件的前提下，本基金每年收益至少分配 1 次，最多分配 12 次，年度收益分配比例不低于基金年度可分配收益的 50%；
- 7、本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，基金投资者可选择现金红利或将现金红利按除息日的基金份额净值自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；
- 8、法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管长信利丰债券型证券投资基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及《长信利丰债券型证券投资基金基金合同》、《长信利丰债券型证券投资基金托管协议》的约定，对长信利丰债券型证券投资基金管理人—长信基金管理有限责任公司 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，长信基金管理有限责任公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，长信基金管理有限责任公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的长信利丰债券型证券投资基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 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：长信利丰债券型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.6.1	34,419,006.71	47,314,841.50
结算备付金		3,473,483.51	7,022,165.60
存出保证金		544,480.47	1,233,105.52
交易性金融资产	6.4.6.2	3,093,984,135.47	3,693,523,927.37
其中：股票投资		457,986,494.52	685,631,356.23
基金投资		-	-
债券投资		2,635,997,640.95	3,007,892,571.14
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	-	-
应收证券清算款		44,519,986.12	5,437,198.22
应收利息	6.4.6.5	53,118,515.93	80,413,969.49
应收股利		-	-
应收申购款		25,056,747.08	57,943.62
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.6.6	-	-
资产总计		3,255,116,355.29	3,835,003,151.32
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 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		649,032,479.94	304,499,173.25
应付证券清算款		25,197,502.42	3,243,813.57
应付赎回款		1,217,682.67	1,044,418.45
应付管理人报酬		1,373,765.27	2,832,088.80
应付托管费		392,504.38	809,168.23
应付销售服务费		785,008.70	1,618,336.43
应付交易费用	6.4.6.7	1,445,316.27	1,056,011.58

应交税费		688,737.74	688,737.74
应付利息		89,322.93	190,327.99
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.6.8	279,012.16	330,087.24
负债合计		680,501,332.48	316,312,163.28
所有者权益：			
实收基金	6.4.6.9	1,853,217,100.52	2,537,876,810.89
未分配利润	6.4.6.10	721,397,922.29	980,814,177.15
所有者权益合计		2,574,615,022.81	3,518,690,988.04
负债和所有者权益总计		3,255,116,355.29	3,835,003,151.32

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，长信利丰债券 C 基金份额净值 1.389 元，基金份额总额 1,853,216,361.42 份；长信利丰债券 E 基金份额净值 1.389 元，基金份额总额 739.10 份。长信利丰债券份额总额合计为 1,853,217,100.52 份。

6.2 利润表

会计主体：长信利丰债券型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		31,240,356.41	-89,655,402.83
1.利息收入		76,153,004.66	162,266,627.58
其中：存款利息收入	6.4.6.11	529,571.50	1,808,400.92
债券利息收入		75,623,433.16	159,894,359.78
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	563,866.88
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-140,968,336.75	-185,778,081.37
其中：股票投资收益	6.4.6.12	-106,167,149.86	-176,923,225.55
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.6.13	-37,300,068.60	-13,566,978.46
资产支持证券投资收益	6.4.6.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.6.14	-	-
衍生工具收益	6.4.6.15	-	-
股利收益	6.4.6.16	2,498,881.71	4,712,122.64
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.6.17	95,557,775.08	-68,041,315.78
4.汇兑收益（损失以“-”号填		-	-

列)			
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.6.18	497,913.42	1,897,366.74
减：二、费用		33,133,221.43	77,718,414.09
1. 管理人报酬	6.4.9.2.1	10,459,723.19	31,515,183.30
2. 托管费	6.4.9.2.2	2,988,492.36	9,004,338.12
3. 销售服务费	6.4.9.2.3	5,976,984.63	18,008,676.12
4. 交易费用	6.4.6.19	4,420,222.37	9,419,080.00
5. 利息支出		9,138,004.31	9,601,244.85
其中：卖出回购金融资产支出		9,138,004.31	9,601,244.85
6. 其他费用	6.4.6.20	149,794.57	169,891.70
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,892,865.02	-167,373,816.92
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,892,865.02	-167,373,816.92

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长信利丰债券型证券投资基金

本报告期：2017年1月1日至2017年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017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）	2,537,876,810.89	980,814,177.15	3,518,690,988.04
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,892,865.02	-1,892,865.02
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）	-684,659,710.37	-257,523,389.84	-942,183,100.21
其中：1.基金申购款	758,485,794.67	291,017,570.78	1,049,503,365.45
2.基金赎回款	-1,443,145,505.04	-548,540,960.62	-1,991,686,465.66
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)	1,853,217,100.52	721,397,922.29	2,574,615,022.81
项目	上年度可比期间 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)	6,373,696,755.76	2,892,426,675.73	9,266,123,431.49
二、本期经营活动产生 的基金净值变动数(本 期利润)	-	-167,373,816.92	-167,373,816.92
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)	-421,029,650.43	-130,504,402.79	-551,534,053.22
其中：1.基金申购款	4,977,031,688.12	2,060,895,428.04	7,037,927,116.16
2.基金赎回款	-5,398,061,338.55	-2,191,399,830.83	-7,589,461,169.38
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)	5,952,667,105.33	2,594,548,456.02	8,547,215,561.35

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：

_____ 成善栋 _____ 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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

长信利丰债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于核准长信利丰债券型证券投资基金募集的批复》(证监许可[2008]1252号文)批准,由长信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《长信利丰债券型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于2008年12月29日生效。本基金为

契约型开放式，存续期限为不定期，首次设立募集规模为 819,356,829.46 份基金份额。本基金的基金管理人为长信基金管理有限责任公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司（以下简称“中国农业银行”）。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《长信利丰债券型证券投资基金基金合同》和《长信利丰债券型证券投资基金招募说明书(更新)》的有关规定，本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国债、金融债、公司债券、企业债券、短期融资券、可转换债券、资产支持证券、央行票据、回购、银行定期存单、股票、权证，以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资范围及比例为：投资于债券类资产的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于公司债、企业债、短期融资券等以企业为主体发行的债券资产投资比例不低于基金债券资产的 20%；投资于股票等权益类品种的比例不高于基金资产的 20%；现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

本基金的业绩比较基准为：中证全债指数×90%+中证 800 指数×10%。

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

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颁布的《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 2017 年 6 月 30 日的财务状况、2017 年 1 月 1 日至 2017 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

本基金在本报告期末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[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》、财税[2016]36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号文《税务总局关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2015] 125 号文《关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

- (a) 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不征收营业税。
- (b) 证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。
- (c) 自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券收入免征增值税。对香港市场投资者（包括单位和个人）通过基金互认买卖内地基金份额免征增值税。自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下称资管产品运营业务），暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。
- (d) 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。
- (e) 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。

(f) 关于香港市场投资者通过基金互认买卖内地基金份额的所得税问题：对香港市场投资者（包括企业和个人）通过基金互认买卖内地基金份额取得的转让差价所得，暂免征收所得税。对香港市场投资者（包括企业和个人）通过基金互认从内地基金分配取得的收益，由内地上市公司向该内地基金分配股息红利时，对香港市场投资者按照 10% 的税率代扣所得税；或发行债券的企业向该内地基金分配利息时，对香港市场投资者按照 7% 的税率代扣所得税，并由内地上市公司或发行债券的企业向其主管税务机关办理扣缴申报。该内地基金向投资者分配收益时，不再扣缴所得税。内地基金管理人应当向相关证券登记结算机构提供内地基金的香港市场投资者的相关信息。

(g) 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。

(h) 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。

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
应交债券利息收入所得税	688,737.74	688,737.74

注：该项系基金收到的债券发行人在支付债券利息时未代扣代缴的利息税部分。

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 2017 年 6 月 30 日
活期存款	34,419,006.71
定期存款	—
其中：存款期限 1-3 个月	—
其他存款	—

合计:	34,419,006.71
-----	---------------

6.4.6.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	457,917,419.21	457,986,494.52	69,075.31
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	604,356,226.63	608,087,940.95
	银行间市场	2,027,871,830.80	2,027,909,700.00
	合计	2,632,228,057.43	2,635,997,640.95
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	3,090,145,476.64	3,093,984,135.47	3,838,658.83

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

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.6.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购取得的债券。

6.4.6.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应收活期存款利息	20,738.75
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	1,563.00
应收债券利息	53,092,068.92
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	3,900.26
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	245.00

合计	53,118,515.93
----	---------------

注：其他为应收保证金利息。

6.4.6.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.6.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	1,408,499.51
银行间市场应付交易费用	36,816.76
合计	1,445,316.27

6.4.6.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	916.22
预提信息披露费—中证报	39,671.58
预提信息披露费—证券时报	139,671.58
预提账户维护费	9,000.00
预提审计费	89,752.78
合计	279,012.16

6.4.6.9 实收基金

金额单位：人民币元

长信利丰债券 C		
项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,537,876,810.89	2,537,876,810.89
本期申购	758,485,055.57	758,485,055.57
本期赎回(以“-”号填列)	-1,443,145,505.04	-1,443,145,505.04
- 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	1,853,216,361.42	1,853,216,361.42

金额单位：人民币元

长信利丰债券 E		
项目	本期 2017 年 5 月 19 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	739.10	739.10
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	739.10	739.10

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.6.10 未分配利润

单位：人民币元

长信利丰债券 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	376,770,470.70	604,043,706.45	980,814,177.15
本期利润	-97,450,639.17	95,557,747.50	-1,892,891.67
本期基金份额交易产生的变动数	-90,783,467.60	-166,740,183.14	-257,523,650.74
其中：基金申购款	99,344,269.68	191,673,040.20	291,017,309.88
基金赎回款	-190,127,737.28	-358,413,223.34	-548,540,960.62
本期已分配利润	-	-	-
本期末	188,536,363.93	532,861,270.81	721,397,634.74

单位：人民币元

长信利丰债券 E			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	-0.93	27.58	26.65
本期基金份额交易产生的变动数	260.90	-	260.90
其中：基金申购款	260.90	-	260.90
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	259.97	27.58	287.55

6.4.6.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
活期存款利息收入	453,713.99
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	45,257.41
其他	30,600.10
合计	529,571.50

注：其他为结算保证金利息收入、存出保证金利息收入及申购款利息收入。

6.4.6.12 股票投资收益

6.4.6.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出股票成交总额	1,594,550,041.83
减：卖出股票成本总额	1,700,717,191.69
买卖股票差价收入	-106,167,149.86

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 2017年1月1日至2017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	-37,300,068.60
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	-37,300,068.60

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 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	2,819,325,607.36
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	2,782,809,326.24
减：应收利息总额	73,816,349.72
买卖债券差价收入	-37,300,068.60

6.4.6.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期无债券赎回差价收入。

6.4.6.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无债券申购差价收入。

6.4.6.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.6.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.6.15 衍生工具收益**6.4.6.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.6.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.6.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,498,881.71
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,498,881.71

6.4.6.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
1. 交易性金融资产	95,557,775.08
——股票投资	86,320,889.24
——债券投资	9,236,885.84
——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	95,557,775.08

6.4.6.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
基金赎回费收入	472,836.11
转换费收入	25,077.31
合计	497,913.42

注：本基金赎回费（转换费中赎回费部分）的 25% 归入基金资产。

6.4.6.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
交易所市场交易费用	4,391,922.37
银行间市场交易费用	28,300.00
合计	4,420,222.37

6.4.6.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	79,343.16
帐户维护费	18,150.00
其他费用	22,548.63
合计	149,794.57

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

注：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

注：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

经长信基金管理有限责任公司股东会审议通过，新增上海彤胜投资管理中心（有限合伙）和上海彤骏投资管理中心（有限合伙）为基金管理人的股东，基金管理人已履行相关程序办理完成股东变更事项的工商变更登记并向监管机构备案，并已于 2017 年 2 月 8 日就上述股东变更事项进行公告。

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
中国农业银行股份有限公司	基金托管人
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（简称“长江证券”）	基金管理人的股东

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
长江证券	1,260,246,419.75	42.27%	1,202,282,312.46	18.19%

6.4.9.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例	成交金额	占当期债券 成交总额的比例
长江证券	-	-	2,075,152.87	0.44%

6.4.9.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
长江证券	786,700,000.00	18.34%	90,000,000.00	1.10%

6.4.9.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
长江证券	1,047,642.74	41.37%	837,652.54	59.47%
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
长江证券	999,458.93	17.19%	353,792.05	10.28%

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 2017年1月1日至2017年6月30日	上年度可比期间 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	10,459,723.19
其中：支付销售机构的客户维护费	599,742.54	1,552,731.44

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

计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×0.70%/当年天数

6.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
	当期发生的基金应支付	2,988,492.36

的托管费		
------	--	--

注：支付基金托管人中国农业银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数

6.4.9.2.3 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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长信利丰债券 C	长信利丰债券 E	合计
长信基金管理有限责任公司	4,821,625.76	0.23	4,821,625.99
中国农业银行	37,945.38	-	37,945.38
长江证券	1,504.85	-	1,504.85
合计	4,861,075.99	0.23	4,861,076.22
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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		
	长信利丰债券 C	长信利丰债券 E	合计
长信基金管理有限责任公司	15,617,710.84	-	15,617,710.84
中国农业银行	102,784.61	-	102,784.61
长江证券	30,965.90	-	30,965.90
合计	15,751,461.35	-	15,751,461.35

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

计算公式为：日基金销售服务费=前一日基金资产净值×0.40%/当年天数

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

注：本基金在本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过银行间同业市场进行债券(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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	长信利丰债券 C	长信利丰债券 E
期初持有的基金份额	-	-
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	-	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	-

项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	长信利丰债券 C	长信利丰债券 E
期初持有的基金份额	13,691,185.48	-
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	10,000,000.00	-
期末持有的基金份额	3,691,185.48	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.06%	-

注：基金管理人运用固有资金投资本基金费率按本基金招募说明书公布的费率执行。

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

注：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。

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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	34,419,006.71	453,713.99	190,051,835.81	1,500,695.59

注：本基金通过“中国农业银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于 2017 年 6 月 30 日的相关余额为人民币 3,473,483.51 元。(2016 年 12 月 31 日的相关余额为人民币 7,022,165.60 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

注：本基金在本报告期及上年度可比期间均未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

6.4.9.7 其他关联交易事项的说明

注：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

注：本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.11 期末（2017 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

注：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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300367	东方网力	2016 年 12 月 15 日	临时停牌	20.63	2017 年 7 月 3 日	18.01	3,178,230	78,932,903.60	65,566,884.90	-

6.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.11.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间债券市场正回购交易形成的卖出回购证券清算款余额为 400,032,479.94 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
1180041	11 太仓恒通债	2017 年 7 月 4 日	101.89	54,000	5,502,060.00
1480003	14 仪征债	2017 年 7 月 4 日	85.53	200,000	17,106,000.00
1480029	14 盘县宏财债	2017 年 7 月 4 日	85.30	300,000	25,590,000.00
1480163	13 随州债 02	2017 年 7 月 4 日	84.93	190,000	16,136,700.00
1480231	14 南化债	2017 年 7 月 4 日	84.72	200,000	16,944,000.00
1480346	14 井开债	2017 年 7 月 4 日	84.24	100,000	8,424,000.00

1480475	14 娄底梯都债	2017 年 7 月 4 日	104.32	200,000	20,864,000.00
1480319	14 保山债	2017 年 7 月 4 日	83.62	200,000	16,724,000.00
1480515	14 德兴城经债	2017 年 7 月 4 日	102.10	100,000	10,210,000.00
1480542	14 三门债 01	2017 年 7 月 4 日	102.81	100,000	10,281,000.00
1480447	14 福鼎债	2017 年 7 月 5 日	103.91	300,000	31,173,000.00
1480501	14 安康高新债	2017 年 7 月 5 日	105.09	400,000	42,036,000.00
170210	17 国开 10	2017 年 7 月 5 日	98.75	815,000	80,481,250.00
150312	15 进出 12	2017 年 7 月 6 日	99.65	500,000	49,825,000.00
140438	14 农发 38	2017 年 7 月 6 日	100.06	201,000	20,112,060.00
合计				3,860,000	371,409,070.00

6.4.11.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 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 249,000,000.00 元，于 2017 年 7 月 3 日前到期。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。

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

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，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。

本基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立风险控制委员会，负责对公司经营管理和基金业务运作的合法性、合规性进行全面的检查和评估等；在管理层层面设立内部控

制委员会，主要职责是讨论审议公司内部控制制度及针对公司在经营管理和投资组合运作中的风险进行识别、评估并研究制订有效的防范措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部负责协调并与各部门合作完成运作风险管理工作，量化投资部负责进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部向督察长负责，并向总经理汇报日常行政事务。

本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

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中国农业银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，本基金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付交割方式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 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
A-1	0.0	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	974,338,000.00
合计	0.00	974,338,000.00

注：未评级债券为国债、央行票据、政策性金融债、同业存单及超短期融资券等无信用评级债券。

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 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
AAA	223,854,843.7	0.00
AAA 以下	1,384,767,797.25	1,493,055,571.14
未评级	1,027,375,000.00	540,499,000.00
合计	2,635,997,640.95	2,033,554,571.14

注：未评级债券为国债、央行票据、政策性金融债、同业存单及超短期融资券等无信用评级债券。

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，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与可能遭受的损失。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 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。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及存出保证金等。本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。

6.4.12.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
-----	--------	----------	-------	-------	-----	----

2017 年 6 月 30 日						
资产						
银行存款	34,419,006.71	-	-	-	-	34,419,006.71
结算备付金	3,473,483.51	-	-	-	-	3,473,483.51
存出保证金	544,480.47	-	-	-	-	544,480.47
交易性金融资产	74,673,613.00	216,963,729.45	1,226,157,034.80	1,118,203,263.70	457,986,494.52	3,093,984,135.47
应收证券清算款	-	-	-	-	44,519,986.12	44,519,986.12
应收利息	-	-	-	-	53,118,515.93	53,118,515.93
应收申购款	25,010,000.00	-	-	-	46,747.08	25,056,747.08
资产总计	138,120,583.69	216,963,729.45	1,226,157,034.80	1,118,203,263.70	555,671,743.65	3,255,116,355.29
负债						
卖出回购金融资产款	649,032,479.94	-	-	-	-	649,032,479.94
应付证券清算款	-	-	-	-	25,197,502.42	25,197,502.42
应付赎回款	-	-	-	-	1,217,682.67	1,217,682.67
应付管理人报酬	-	-	-	-	1,373,765.27	1,373,765.27
应付托管费	-	-	-	-	392,504.38	392,504.38
应付销售服务费	-	-	-	-	785,008.70	785,008.70
应付交易费用	-	-	-	-	1,445,316.27	1,445,316.27
应付利息	-	-	-	-	89,322.93	89,322.93
应交税费	-	-	-	-	688,737.74	688,737.74
其他负债	-	-	-	-	279,012.16	279,012.16
负债总计	649,032,479.94	-	-	-	31,468,852.54	680,501,332.48
利率敏感度缺口	-510,911,896.25	216,963,729.45	1,226,157,034.80	1,118,203,263.70	524,202,891.11	2,574,615,022.81
上年度末 2016 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	47,314,841.50	-	-	-	-	47,314,841.50

结算备付金	7,022,165.60	-	-	-	-	7,022,165.60
存出保证金	1,233,105.52	-	-	-	-	1,233,105.52
交易性金融资产	823,837,539.80	207,087,297.60	1,850,735,733.74	126,232,000.00	685,631,356.23	3,693,523,927.37
应收证券清算款	-	-	-	-	5,437,198.22	5,437,198.22
应收利息	-	-	-	-	80,413,969.49	80,413,969.49
应收申购款	-	-	-	-	57,943.62	57,943.62
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	879,407,652.42	207,087,297.60	1,850,735,733.74	126,232,000.00	771,540,467.56	3,835,003,151.32
负债						
卖出回购金融资产款	304,499,173.25	-	-	-	-	304,499,173.25
应付证券清算款	-	-	-	-	3,243,813.57	3,243,813.57
应付赎回款	-	-	-	-	1,044,418.45	1,044,418.45
应付管理人报酬	-	-	-	-	2,832,088.80	2,832,088.80
应付托管费	-	-	-	-	809,168.23	809,168.23
应付销售服务费	-	-	-	-	1,618,336.43	1,618,336.43
应付交易费用	-	-	-	-	1,056,011.58	1,056,011.58
应付利息	-	-	-	-	190,327.99	190,327.99
应交税费	-	-	-	-	688,737.74	688,737.74
其他负债	-	-	-	-	330,087.24	330,087.24
负债总计	304,499,173.25	-	-	-	11,812,990.03	316,312,163.28
利率敏感度缺口	574,908,479.17	207,087,297.60	1,850,735,733.74	126,232,000.00	759,727,477.53	3,518,690,988.04

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

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（2017年6月30日）	上年度末（2016年12月31日）
	市场利率下降 27 个基点	28,749,947.75	11,237,363.25
	市场利率上升 27 个基点	-28,749,947.75	-11,237,363.25

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 6 月 30 日，本基金面临的其他市场价格风险列示如下：

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 2017年6月30日		上年度末 2016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	457,986,494.52	17.79	685,631,356.23	19.49
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	2,635,997,640.95	102.38	3,007,892,571.14	85.48
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	3,093,984,135.47	120.17	3,693,523,927.37	104.97

6.4.12.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	在 95% 的置信区间内，基金资产组合的市场价格风险	
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（2017年6月30日）	上年度末（2016年12月31日）
	VaR 值为 0.34%（2016年12月31日 VaR 值为 0.85%）	-8,815,172.99	-29,908,873.40

注：上述风险价值 VaR 的分析是基于资产负债表日所持证券过去一年市场价格波动情况而有可能发生的最大损失，且此变动适用于本基金所有的衍生工具及非衍生金融工具。取 95%的置信度是基于本基金所持有的金融工具风险度量的要求。2016 年的分析同样基于该假设。

6.4.13 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值计量

(a) 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。

单位：人民币元

项目	本期末 2017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	392,419,609.62	65,566,884.90	—	457,986,494.52
债券投资	—	2,635,997,640.95	—	2,635,997,640.95
合计	392,419,609.62	2,701,564,525.85	—	3,093,984,135.47

2017 年上半年，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) 公允价值所属层次间的重大变动

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）、或属于非公开发行等情况时，本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。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。

2017 年上半年，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。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2017 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。

(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买入返售金融资产、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	457,986,494.52	14.07
	其中：股票	457,986,494.52	14.07
2	固定收益投资	2,635,997,640.95	80.98
	其中：债券	2,635,997,640.95	80.98
	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	-	-
	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	37,892,490.22	1.16
7	其他各项资产	123,239,729.60	3.79
8	合计	3,255,116,355.29	100.00

注：本基金本报告期末通过港股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

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	325,449,111.52	12.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	88,039,082.36	3.42
J	金融业	-	-
K	房地产业	44,498,300.64	1.73

L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	457,986,494.52	17.79

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资港股。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600887	伊利股份	3,294,094	71,119,489.46	2.76
2	300367	东方网力	3,178,230	65,566,884.90	2.55
3	603589	口子窖	1,059,812	41,110,107.48	1.60
4	600340	华夏幸福	820,408	27,549,300.64	1.07
5	000063	中兴通讯	1,080,922	25,661,088.28	1.00
6	300310	宜通世纪	1,828,198	24,168,777.56	0.94
7	002242	九阳股份	1,217,062	23,939,609.54	0.93
8	600702	沱牌舍得	879,214	23,395,884.54	0.91
9	002230	科大讯飞	579,027	23,103,177.30	0.90
10	300007	汉威电子	1,063,345	20,480,024.70	0.80
11	600332	白云山	692,340	20,105,553.60	0.78
12	600570	恒生电子	411,150	19,192,482.00	0.75
13	600048	保利地产	1,700,000	16,949,000.00	0.66
14	300496	中科创达	308,100	8,719,230.00	0.34
15	600305	恒顺醋业	810,505	8,315,781.30	0.32
16	002376	新北洋	600,000	8,232,000.00	0.32
17	002402	和而泰	793,000	7,818,980.00	0.30
18	300078	思创医惠	593,580	6,369,113.40	0.25
19	300059	东方财富	476,400	5,726,328.00	0.22
20	300020	银江股份	200,000	2,768,000.00	0.11
21	300036	超图软件	140,250	2,293,087.50	0.09

22	002410	广联达	110,000	2,068,000.00	0.08
23	600889	南京化纤	203,978	1,935,751.22	0.08
24	300246	宝莱特	51,146	1,398,843.10	0.05

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600887	伊利股份	113,156,860.10	3.22
2	000063	中兴通讯	103,008,004.86	2.93
3	600340	华夏幸福	65,673,819.00	1.87
4	002230	科大讯飞	63,144,649.73	1.79
5	002242	九阳股份	56,907,411.86	1.62
6	300078	思创医惠	52,058,554.04	1.48
7	300059	东方财富	48,416,214.17	1.38
8	002108	沧州明珠	46,648,948.89	1.33
9	600702	沱牌舍得	45,780,762.20	1.30
10	300020	银江股份	40,374,261.05	1.15
11	603589	口子窖	37,908,203.72	1.08
12	300310	宜通世纪	32,437,735.60	0.92
13	000001	平安银行	28,380,143.30	0.81
14	600889	南京化纤	27,619,849.74	0.78
15	600169	太原重工	26,987,113.00	0.77
16	600570	恒生电子	23,374,585.30	0.66
17	002405	四维图新	22,491,728.96	0.64
18	002402	和而泰	21,626,948.39	0.61
19	600873	梅花生物	20,670,197.71	0.59
20	002407	多氟多	19,809,164.39	0.56

注：本项“买入金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑其它交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002230	科大讯飞	95,310,778.96	2.71
2	000063	中兴通讯	86,207,378.10	2.45

3	300020	银江股份	60,778,174.43	1.73
4	300078	思创医惠	57,907,113.66	1.65
5	002410	广联达	53,614,115.80	1.52
6	600887	伊利股份	46,574,135.30	1.32
7	002108	沧州明珠	45,861,231.19	1.30
8	300369	绿盟科技	45,502,766.65	1.29
9	300166	东方国信	42,112,927.14	1.20
10	300059	东方财富	40,762,082.71	1.16
11	300007	汉威科技	39,772,346.88	1.13
12	600340	华夏幸福	38,002,334.27	1.08
13	002405	四维图新	35,848,322.88	1.02
14	002609	捷顺科技	35,670,461.73	1.01
15	600745	中茵股份	34,250,798.35	0.97
16	002242	九阳股份	32,879,522.96	0.93
17	002308	威创股份	30,867,627.07	0.88
18	600728	佳都科技	30,383,377.91	0.86
19	002268	卫士通	28,784,321.38	0.82
20	000001	平安银行	27,671,601.99	0.79

注：本项“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑其它交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,386,751,440.74
卖出股票收入（成交）总额	1,594,550,041.83

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

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	1,027,375,000.00	39.90
	其中：政策性金融债	1,027,375,000.00	39.90
4	企业债券	1,341,518,831.25	52.11
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	9,932,000.00	0.39

7	可转债（可交换债）	257,171,809.70	9.99
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,635,997,640.95	102.38

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	170210	17 国开 10	6,500,000	641,875,000.00	24.93
2	160213	16 国开 13	2,600,000	235,820,000.00	9.16
3	113011	光大转债	1,995,910	209,710,263.70	8.15
4	150312	15 进出 12	1,000,000	99,650,000.00	3.87
5	1580017	15 新郑债 02	500,000	51,455,000.00	2.00

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国债期货交易情况说明

7.10.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

7.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

7.10.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 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。

7.11.2 报告期内本基金投资的前十名股票中，不存在超出基金合同规定备选股票库的情形。

7.11.3 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	544,480.47
2	应收证券清算款	44,519,986.12
3	应收股利	-
4	应收利息	53,118,515.93
5	应收申购款	25,056,747.08
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	123,239,729.60

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	110034	九州转债	12,655,000.00	0.49
2	110032	三一转债	22,555,368.00	0.88
3	132001	14 宝钢 EB	12,251,178.00	0.48

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	300367	东方网力	65,566,884.90	2.55	临时停牌

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

注：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

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
长信利丰债券 C	15,115	122,607.76	1,481,331,730.95	79.93%	371,884,630.47	20.07%
长信利丰债券 E	1	739.10	0.00	0.00%	739.10	100.00%
合计	15,116	122,599.70	1,481,331,730.95	79.93%	371,885,369.57	20.07%

8.2 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	长信利丰债券 C	93,374.13	0.01%
	长信利丰债券 E	-	-
	合计	93,374.13	0.01%

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	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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	长信利丰债券 C	0
	长信利丰债券 E	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	长信利丰债券 C	0
	长信利丰债券 E	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长信利丰债券 C	长信利丰债券 E
基金合同生效日（2008 年 12 月 29 日）基金份额总额	819,356,829.46	-
本报告期期初基金份额总额	2,537,876,810.89	-
本报告期基金总申购份额	758,485,055.57	739.10
减：本报告期基金总赎回份额	1,443,145,505.04	-
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	1,853,216,361.42	739.10

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末召开本基金的基金份额持有人大会。

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 基金管理人的重大人事变动

本报告期内基金管理人未发生重大人事变动。

10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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

本报告期本基金未改聘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	
长江证券	1	1,260,246,419.75	42.27%	1,047,642.74	41.37%	-

西南证券	1	557,785,897.84	18.71%	463,685.75	18.31%	-
中信证券	1	417,904,136.32	14.02%	389,194.78	15.37%	-
海通证券	1	310,170,513.67	10.40%	257,843.49	10.18%	-
平安证券	1	167,095,620.38	5.60%	138,906.52	5.48%	-
东方证券	1	143,263,301.92	4.81%	119,094.53	4.70%	-
中邮证券	1	124,835,592.69	4.19%	116,259.69	4.59%	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
北京高华证 券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-

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
长江证券	-	-	786,700,000.00	18.34%	-	-
西南证券	11,993,014.80	4.59%	1,141,300,000.00	26.61%	-	-
中信证券	-	-	490,600,000.00	11.44%	-	-
海通证券	249,472,098.87	95.41%	946,600,000.00	22.07%	-	-
平安证券	-	-	439,000,000.00	10.23%	-	-
东方证券	-	-	379,300,000.00	8.84%	-	-
中邮证券	-	-	54,000,000.00	1.26%	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-

国联证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
北京高华证 券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	52,000,000.00	1.21%	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

注：1、本期租用证券公司交易单元的变更情况

本报告期内本基金退租国元证券交易单元 2 个，广发证券交易单元 1 个。

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蚂蚁（杭州）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、公司网站	2017 年 1 月 12 日
2	长信基金管理有限责任公司关于变更旗	上证报、中证报、证券	2017 年 1 月 13 日

	下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告	时报、公司网站	
3	长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2017 年 1 月 14 日
4	长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2017 年 1 月 17 日
5	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金所持证券调整估值价的公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2017 年 1 月 17 日
6	长信利丰债券型证券投资基金 2016 年第 4 季度报告	中证报、证券时报、公司网站	2017 年 1 月 21 日
7	长信基金管理有限责任公司关于股东及股东出资比例变更的公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2017 年 2 月 8 日
8	长信利丰债券型证券投资基金更新的招募说明书（2017 年第【1】号）及摘要（仅摘要见报）	中证报、证券时报、公司网站	2017 年 2 月 11 日
9	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手机银行基金申购（含定期定额投资申购）费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2017 年 2 月 23 日
10	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宜信普泽投资顾问（北京）有限公司基金认购、申购（含定期定额投资申购）费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2017 年 3 月 10 日
11	长信基金管理有限责任公司关于增加上海华夏财富投资管理有限公司为旗下部分开放式基金代销机构的公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2017 年 3 月 22 日
12	长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2017 年 3 月 22 日
13	长信利丰债券型证券投资基金 2016 年年度报告及摘要（仅摘要见报）	中证报、证券时报、公司网站	2017 年 3 月 27 日
14	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股份有限公司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、公司网站	2017 年 3 月 30 日
15	长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2017 年 4 月 1 日
16	长信利丰债券型证券投资基金 2017 年第 1 季度报告	中证报、证券时报、公司网站	2017 年 4 月 22 日
17	长信基金管理有限责任公司关于旗下部	上证报、中证报、证券	2017 年 4 月 22 日

	分开放式基金参加交通银行股份有限公司手机银行基金申购（含定期定额投资申购）费率优惠活动的公告	时报、公司网站	
18	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银行股份有限公司申购(含定期定额投资申购)费率优惠活动的公告	上证报、中证报、公司网站	2017年5月4日
19	长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2017年5月12日
20	长信基金管理有限责任公司关于长信利丰债券型证券投资基金增设 E 类基金份额相关事项的公告	中证报、证券时报、公司网站	2017年5月17日
21	长信利丰债券型证券投资基金基金合同（增加 E 份额后更新的合同）	公司网站	2017年5月17日
22	长信利丰债券型证券投资基金托管协议（增加 E 份额后更新的托管协议）	公司网站	2017年5月17日
23	长信基金管理有限责任公司关于增加招商银行股份有限公司为旗下长信利丰债券型证券投资基金（E 类份额）代销机构并开通定期定额投资业务的公告	中证报、证券时报、公司网站	2017年5月17日
24	长信基金管理有限责任公司关于长信利丰债券型证券投资基金 E 类基金份额净值计算与披露方法的说明	中证报、证券时报、公司网站	2017年5月19日
25	长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2017年5月24日
26	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泰证券股份有限公司申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2017年5月26日
27	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手机银行基金申购（含定期定额投资申购）费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2017年6月30日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内未有单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期未发生影响投资者决策的其他重要信息。

§ 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、《长信利丰债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长信利丰债券型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《长信利丰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

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

2017年8月24日