

# 长信利丰债券型证券投资基金 2018 年年度报告摘要

2018 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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2019 年 3 月 29 日

## § 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的规定，于 2019 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 2018 年 12 月 31 日止。

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	长信利丰债券	
场内简称	长信利丰	
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, 239, 382, 908. 69 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
下属分级基金的场内简称:	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, 149, 143, 841. 75 份	90, 239, 066. 94 份

### 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
	联系电话	021-61009999
	电子邮箱	zhouyig@cxfund.com.cn
客户服务电话	4007005566	95599
传真	021-61009800	010-68121816

## 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.cxfund.com.cn
基金年度报告备置地点	上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼、北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 9 层

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数 据和指 标	2018 年		2017 年		2016 年	
	长信利丰债券 C	长信利丰债券 E	长信利丰债券 C	长信利丰债券 E	长信利丰债券 C	长信利丰债券 E
本期已实现收益	-2,681,245.73	63,837.66	-37,207,254.09	202,848.15	-132,404,162.63	-
本期利润	-61,876,323.10	-1,412,721.89	9,357,490.52	-2,005,367.99	-380,471,736.55	-
加权平均基金份额本期利润	-0.0409	-0.0083	0.0047	-0.1787	-0.0673	-
本期基金份额净值增长率	-3.42%	-3.35%	1.08%	3.08%	-4.68%	-
3.1.2 期末数 据和指 标	2018 年末		2017 年末		2016 年末	
	长信利丰债券 C	长信利丰债券 E	长信利丰债券 C	长信利丰债券 E	长信利丰债券 C	长信利丰债券 E
期末可供分配基金份额利润	0.0282	0.2199	0.0710	0.3225	0.1485	-
期末基金资产净值	1,439,196,822.05	110,078,987.01	2,744,401,176.21	351,168,008.61	3,518,690,988.04	-
期末基金份额净值	1.252	1.220	1.336	1.337	1.386	-

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。

## 3.2 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

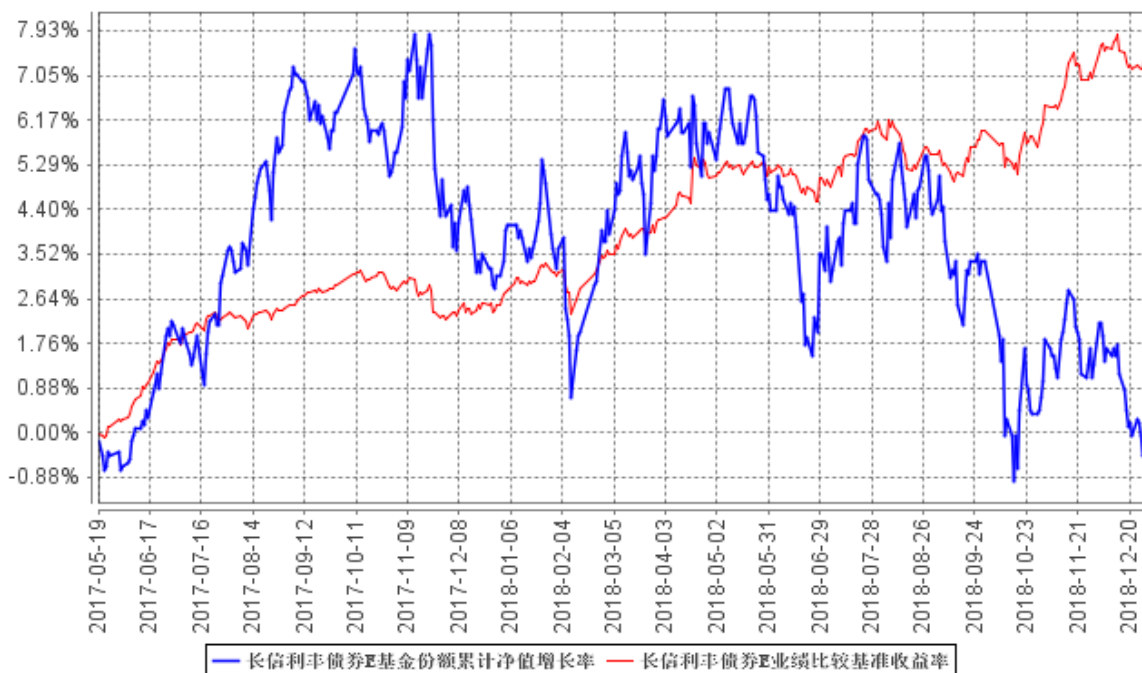
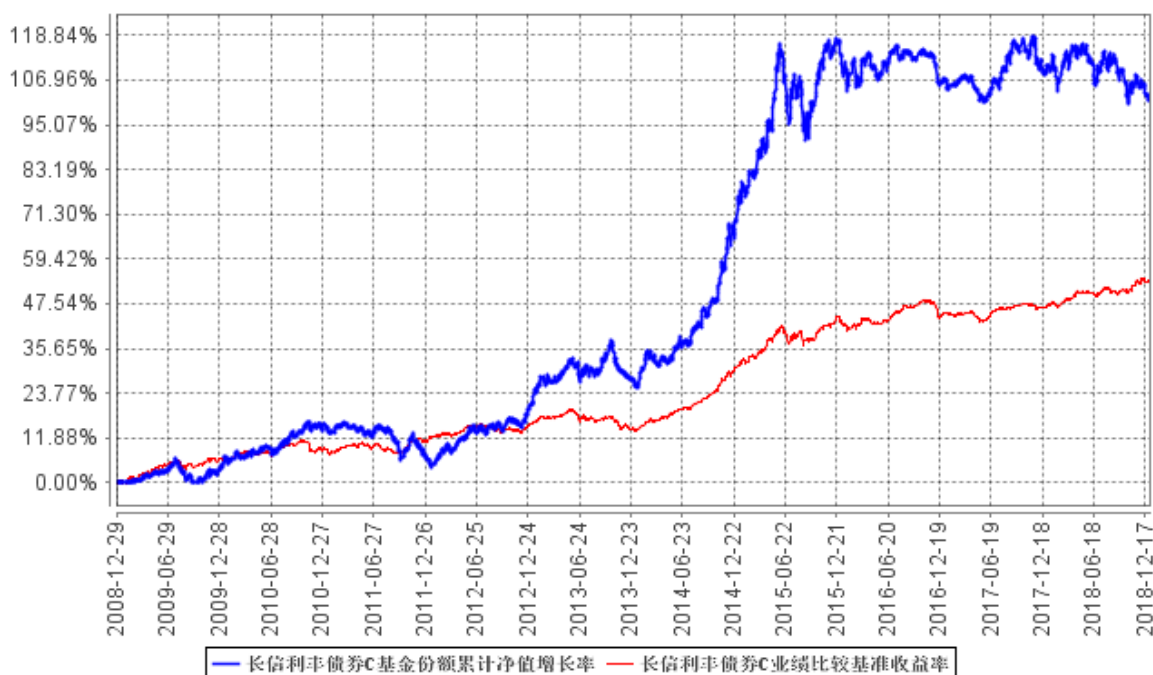
长信利丰债券 C

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
过去三个月	-3.69%	0.52%	1.32%	0.17%	-5.01%	0.35%
过去六个月	-3.83%	0.49%	2.24%	0.15%	-6.07%	0.34%
过去一年	-3.42%	0.50%	4.74%	0.14%	-8.16%	0.36%
过去三年	-6.95%	0.43%	6.61%	0.14%	-13.56%	0.29%
过去五年	58.20%	0.55%	34.12%	0.17%	24.08%	0.38%
自基金合同生效起至今	101.81%	0.47%	53.60%	0.18%	48.21%	0.29%

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
过去三个月	-3.63%	0.53%	1.32%	0.17%	-4.95%	0.36%
过去六个月	-3.77%	0.50%	2.24%	0.15%	-6.01%	0.35%
过去一年	-3.35%	0.50%	4.74%	0.14%	-8.09%	0.36%
自基金合同生效起至今	-0.37%	0.46%	7.37%	0.12%	-7.74%	0.34%

### 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



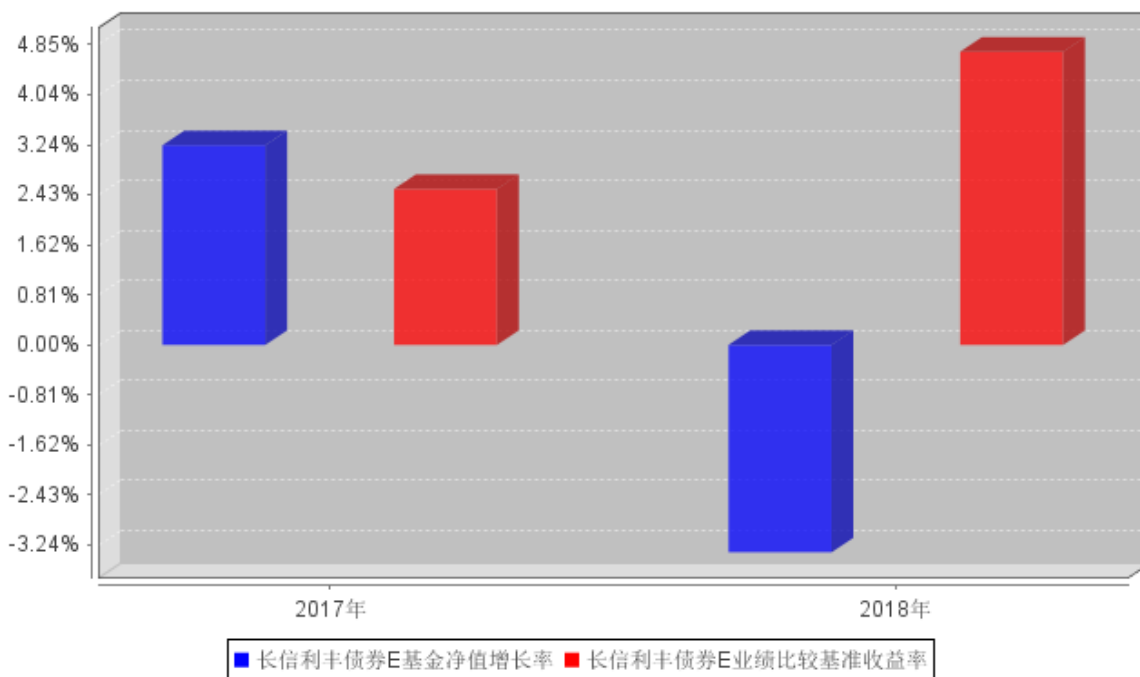
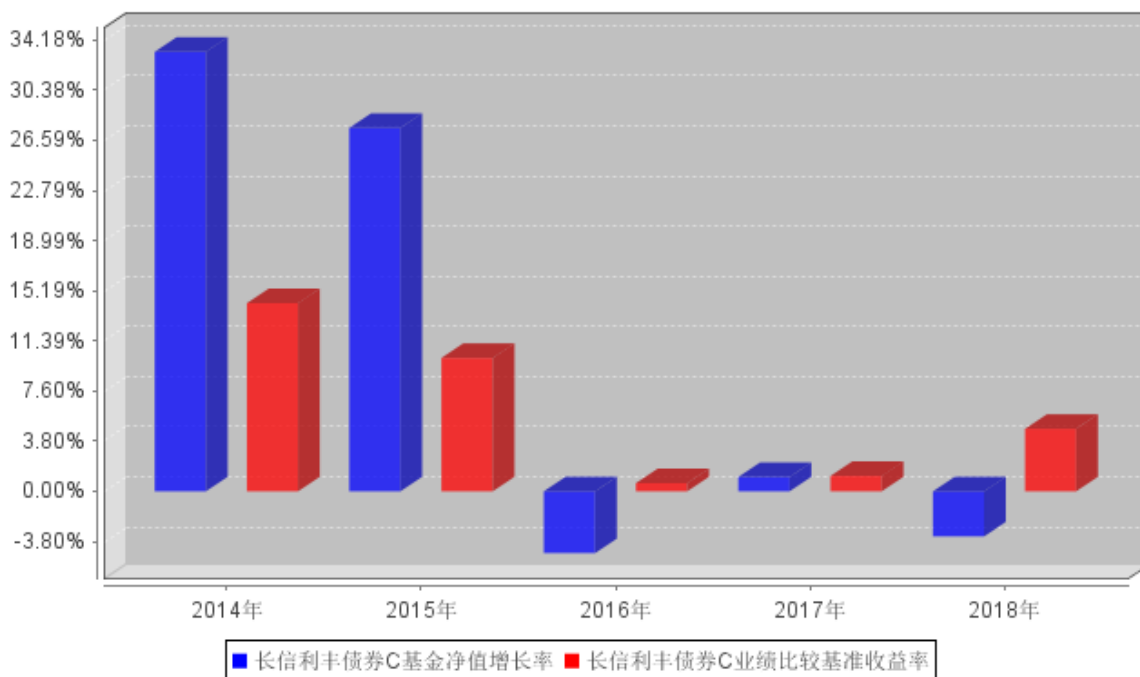
注：1、基金管理人自 2017 年 5 月 19 日起对长信利丰债券型证券投资基金进行份额分类，原有基金份额为 C 类份额，增设 E 类份额。

2、长信利丰债券 C 图示日期为 2008 年 12 月 29 日至 2018 年 12 月 31 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 2018 年 12 月 31 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约定。

### 3.2.3 过去五年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：长信利丰债券 E 图示份额计算期间为自份额增加日 2017 年 5 月 19 日至 2018 年 12 月 31 日，2017 年净值增长率按长信利丰债券 E 份额实际存续期计算。

长信利丰债券 C 份额过去五年计算期间为基金合同生效日为 2013 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日，



## 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

长信利丰债券 C					
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
2018 年	0.400	49,349,027.25	4,558,466.72	53,907,493.97	
2017 年	0.650	124,540,322.22	11,424,815.27	135,965,137.49	
2016 年	-	-	-	-	
合计	1.050	173,889,349.47	15,983,281.99	189,872,631.46	

单位：人民币元

长信利丰债券 E					
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
2018 年	0.750	15,090,366.28	-	15,090,366.28	
2017 年	0.650	17,992,744.33	-	17,992,744.33	
2016 年	-	-	-	-	
合计	1.400	33,083,110.61	-	33,083,110.61	

注：本基金本报告期的利润分配情况，详见 4.7。

## §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%、武汉钢铁有限公司占 15.15%、上海彤胜投资管理中心（有限合伙）占 4.55%、上海彤骏投资管理中心（有限合伙）占 4.54%。

截至 2018 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理 64 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、长信先优债券型证券投资基金、长信稳势纯债债券型证券投资基金、长信中证 500 指数增强型证券投资

基金、长信长金货币市场基金、长信稳通三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金、长信利尚一年定期开放混合型证券投资基金、长信乐信灵活配置混合型证券投资基金、长信全球债券证券投资基金、长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信先机两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、长信消费精选行业量化股票型证券投资基金、长信量化价值精选混合型证券投资基金、长信企业精选两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、长信量化价值驱动混合型证券投资基金、长信价值蓝筹两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、长信稳裕三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信稳进资产配置混合型基金中基金（FOF）。

#### 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利广灵活配置混合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	-	20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年加入本公司（筹备），先后任基金经理助理、交易管理部总监、固定收益部总监、长信中短债证券投资基金、长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信利发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）、长信富安纯债一年定期开放债券型证券投资基金和长信利尚一年定期开放混合型证券投资基金的基金经理。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利广灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
李家春	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、长信利广灵活配置混合型证券投资基金和长信利盈灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、总经理助理	2018 年 12 月 5 日	-	19 年	香港大学工商管理硕士，具有基金从业资格。曾任职于长江证券有限责任公司、汉唐证券有限责任公司、泰信基金管理有限公司、交银施罗德基金管理有限公司、富国基金管理有限公司和上海东方证券资产管理有限公司。2018 年 7 月加入长信基金管理有限责任公司，现任公司总经理助理兼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、长信利广灵活配置混合型证券投资基金和长信利盈灵活配置混合型证券投资基金的基

					金经理。
吴晖	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	2017 年 7 月 28 日	-	3 年	清华大学工学硕士毕业，具有基金从业资格。曾任职于上海浦东发展银行、东方证券股份有限公司，2017 年 5 月加入长信基金管理有限责任公司，现任职于固定收益部，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。
胡琼予	曾任本基金的基金经理助理	2016 年 12 月 12 日	2018 年 5 月 22 日	6 年	曾任本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、报告截止日至报告批准送出日期间，自 2019 年 2 月 2 日起，李小羽先生不再担任本基金的基金经理。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

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

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

1、所有投资对象的投资指令必须经由交易部门总监或其授权人审核分配至交易人员执行。进行投资指令分配的人员必须保证投资指令得到公平对待。

2、公司使用的交易执行软件系统必须具备如下功能：

(1) 严格按照时间顺序发送委托指令；

(2) 对于多个投资组合在同一时点就同一证券下达的相同方向的投资指令，并且市价在限价范围内的，系统能够将交易员针对该证券下达的每笔委托自动按照指令数量比例分拆为各投资组合的委托指令。对于不同投资组合针对交易所同一证券的同一方向竞价交易指令，指令数量比例达到 5:1 或以上的，可豁免启动公平交易开关。

3、交易人员对于接收到的交易指令依照价格优先、时间优先的顺序执行。在执行多个投资组合在同一时点就同一证券下达的相同方向的交易所投资指令时，除制度规定的例外指令外，必须开启系统的公平交易开关。

4、对于不同投资组合均进行债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易的投资对象，交易部门必须严格独立接收各投资组合的投资指令，在申购结果产生前，不得以任何形式向任何人泄露各投资指令的内容，包括指令价格及数量等要素。

5、对于各投资组合以独立账户名义进行申购的投资对象，除需经过公平性审核的例外指令外，申购获配的证券数量由投资管理系统接收各类证券登记结算机构发送的数据进行分配。交易部门根据证券发行人在指定公开披露媒体上披露的申购结果对系统内分配数量进行核准，数量不符的，应当第一时间告知各投资管理部门的总监及监察稽核部总监。对于以公司名义进行申购的投资对象，公司在获配额度确定后，严格按照价格优先的原则在各投资组合间进行分配。申购价格相同的投资组合则根据投资指令的数量按比例进行分配。确因特殊原因不能按照上述原则进行分配的，应启动异常交易识别流程，审核通过的，可以进行相应分配。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，除完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合外，其余各投资组合未发生参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形，未发现异常交易行为。同时，对本年度同向交易价差进行专项分析，未发现异常情况。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2018 年，全球经济增长动能减弱，主要经济体经济走势出现分化。美国受税改因素提振因素，经济保持强劲势头，而非美经济整体放缓。反映到资产价格上，美元相对强势，美股和原油波动较大，而其它国家，尤其新兴市场的股市、汇率等都较为疲弱。

受外部环境不确定性以及国内融资环境收紧等因素的影响，2018 年，国内经济前高后低，整体增速下行，全年 GDP 实际增速 6.6%，较 2017 年回落 0.2%。价格方面，GDP 平减指数从 2017 年 2 季度开始，连续 7 个季度下滑至 2018 年末 2.9%。从经济增长动力来看，消费、投资、进出口三大需求均走弱。政策方面，央行上半年虽有定向降准但整体保持稳健偏紧，6-7 月之后，通过公开市场操作等方式进一步引导市场流动性实现稳健偏松，整体政策意图由去杠杆向稳增长转变。全年实现 M2 同比增长 8.1%，社会融资规模同比增长 9.8%，新增人民币贷款 16.17 万亿元。

本基金债券部分，加大利率债配置力度，并积极参与波段交易机会。同时，保持信用债中性久期，精选优质个券，优化信用结构，以提高组合的安全性和收益性。股票部分，选择业绩确定性强且估值合理的标的，此外择机参与周期品和科技成长的波段交易机会。整体组合保持适当杠杆，合理分配各类资产比例。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，长信利丰债券 C 份额净值为 1.252 元，份额累计净值为 1.850 元，本报告期内长信利丰债券 C 净值增长率为-3.42%，同期业绩比较基准收益率为 4.74%；长信利丰债券 E 份额净值为 1.220 元，份额累计净值为 1.360 元，本报告期内长信利丰债券 E 净值增长率为-3.35%。同期业绩比较基准收益率为 4.74%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2019 年经济下行压力仍在，分项看，预计投资继续回落，结构上地产下滑幅度较大，同时基建企稳回升。受全球需求转弱影响，进出口难有增长起色。内需自然回升动力不足，终端消费也难以走高。因此，支持债券市场利率低位运行的基本面因素仍在存在。同时，我们也看到各项政策积极的一面来托底经济的下行，包括对民营和实体企业的扶持，对科技创新企业的鼓励等。权益市场经过一年的调整，目前整体市场的估值水平已经处于历史最低区间，经济下行和风险因素已经充分反映。2019 年，市场化改革将会继续深化，财政货币政策将转向更加积极，资本市场支持政策频出，经济下行趋势有望企稳。

我们将继续秉承谨慎原则，加强组合的流动性管理，在做好风险控制的同时，增加对新经济环境下信用风险的审慎判断，积极寻找权益资产的增强机会，配置上将继续延续寻找盈利向上的行业和公司。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

根据相关法律法规，长信基金管理有限责任公司（以下简称“公司”）制订了健全、有效的估值政策和估值程序，成立了估值委员会，估值委员会是公司基金估值的主要决策机构，负责拟定公司的估值政策、估值方法及采用的估值程序和技术，健全公司估值决策体系，对公司现有程序和技术进行复核和审阅，当发生了影响估值程序和技术的有效性及其适用性的情况及时修订估值程序；估值委员会成员由基金事务部、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，均具备估值业务所需的专业胜任能力。基金经理不直接参与估值决策，估值决策由与会估值工作小组成员 1/2 以上多数票通过。对于估值政策和估值原则，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。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据以及流通受限股票的折扣率。参与估值流程各方不存在任何重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及相关法律法规、《长信利丰债券型证券投资基金基金合同》，结合本报告期基金实际运作情况，基金管理人于 2018 年 3 月 9 日发布《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 2017 年年度分红公告》，收益分配基准日为 2017 年 12 月 31 日，权益登记日为 2018 年 3 月 13 日，现金红利发放日 2018 年 3 月 15 日。分红总额 17,639,700.95 元，其中现金分红 16,440,328.48 元；2018 年 9 月 26 日发布《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的分红公告》，收益分配基准日为 2018 年 9 月 19 日，权益登记日为 2018 年 9 月 28 日，现金红利发放日 2018 年 10 月 9 日。分红总额 51,358,159.30 元，其中现金分红 47,999,065.05 元。本基金收益分配应遵循下列原则：

- 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

在托管本基金的过程中，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基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—长信基金管理有限责任公司 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 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本基金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 审计报告

本报告期末基金 2018 年度财务报告经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师出具了无保留意见的审计报告（安永华明(2019)审字第 61399737\_B19 号），投资者可以通过年度报告正文查看审计报告全文。

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：长信利丰债券型证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	3,781,514.49	113,757,355.99
结算备付金	2,989,171.31	14,482,192.26
存出保证金	232,510.31	1,365,908.87
交易性金融资产	1,862,945,389.56	2,862,469,046.76
其中：股票投资	286,079,377.56	346,176,676.11
基金投资	-	-
债券投资	1,576,866,012.00	2,516,292,370.65
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	54,964,267.48
应收证券清算款	9,169,753.98	-
应收利息	26,705,116.34	61,976,804.19
应收股利	-	-
应收申购款	43,452.00	80,030.24
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,905,866,907.99	3,109,095,605.79
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2018 年 12 月 31 日</b>	<b>2017 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	345,999,872.50	-
应付证券清算款	7,433,672.11	2,532,911.57
应付赎回款	1,735.23	5,417,882.24
应付管理人报酬	1,029,562.98	1,542,282.74
应付托管费	294,160.87	440,652.24
应付销售服务费	588,321.68	881,304.43
应付交易费用	148,823.70	1,689,582.46
应交税费	849,036.34	688,737.74
应付利息	-83,087.79	-

应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	329,001.31	333,067.55
负债合计	356,591,098.93	13,526,420.97
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	1,239,382,908.69	2,316,688,179.57
未分配利润	309,892,900.37	778,881,005.25
所有者权益合计	1,549,275,809.06	3,095,569,184.82
负债和所有者权益总计	1,905,866,907.99	3,109,095,605.79

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，长信利丰债券 C 份额净值 1.252 元，长信利丰债券 E 份额净值 1.220 元，基金份额总额为 1,239,382,908.69 份，其中长信利丰债券 C 份额 1,149,143,841.75 份；长信利丰债券 E 份额 90,239,066.94 份。

## 7.2 利润表

会计主体：长信利丰债券型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	-21,566,750.20	69,846,744.60
1.利息收入	75,679,715.52	131,349,329.09
其中：存款利息收入	950,461.56	1,236,937.91
债券利息收入	74,716,366.39	129,979,938.08
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	12,887.57	132,453.10
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-37,875,598.48	-107,095,399.85
其中：股票投资收益	-20,828,345.12	-53,429,029.88
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-19,963,022.04	-56,857,884.50
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	2,915,768.68	3,191,514.53
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-60,671,636.92	44,356,528.47
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	1,300,769.68	1,236,286.89
<b>减：二、费用</b>	<b>41,722,294.79</b>	<b>62,494,622.07</b>
1. 管理人报酬	15,647,811.78	19,445,294.51
2. 托管费	4,470,803.41	5,555,798.50
3. 销售服务费	8,941,606.71	11,111,596.87
4. 交易费用	5,033,552.66	10,880,026.34
5. 利息支出	7,184,041.78	15,199,665.82
其中：卖出回购金融资产支出	7,184,041.78	15,199,665.82
6. 税金及附加	157,593.63	-
7. 其他费用	286,884.82	302,240.03
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>-63,289,044.99</b>	<b>7,352,122.53</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>-63,289,044.99</b>	<b>7,352,122.53</b>

### 7.3 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：2018年1月1日至2018年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018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）	2,316,688,179.57	778,881,005.25	3,095,569,184.82
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-63,289,044.99	-63,289,044.99
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）	-1,077,305,270.88	-336,701,199.64	-1,414,006,470.52
其中：1. 基金申购款	2,843,413,017.00	932,764,378.54	3,776,177,395.54
2. 基金赎回款	-3,920,718,287.88	-1,269,465,578.18	-5,190,183,866.06
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）	-	-68,997,860.25	-68,997,860.25

五、期末所有者权益 (基金净值)	1,239,382,908.69	309,892,900.37	1,549,275,809.06
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017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)	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)	-	7,352,122.53	7,352,122.53
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)	-221,188,631.32	-55,327,412.61	-276,516,043.93
其中:1.基金申购款	3,303,562,688.68	1,365,071,566.22	4,668,634,254.90
2.基金赎回款	-3,524,751,320.00	-1,420,398,978.83	-4,945,150,298.83
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)	-	-153,957,881.82	-153,957,881.82
五、期末所有者权益 (基金净值)	2,316,688,179.57	778,881,005.25	3,095,569,184.82

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：

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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2008]1252号文《关于核准长信利丰债券型证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人长信基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于2008年12月29日正式生效，首次设立募集规模为819,356,829.46份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为长信基金管理有限责任公司，各类份额的注册登记机构分别为中国证券登记结算有限责任公司和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。

2017 年 5 月 19 日，本基金在原基金份额基础之上对基金份额进行分类，原有长信利丰债券型证券投资基金基金份额归为 C 类份额，并增设 E 类份额。C 类基金份额的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司；E 类基金份额的注册登记机构为长信基金管理有限责任公司。

本基金主要投资于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。如出现法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金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（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）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%。

本基金业绩比较基准为：中证全债指数×90%+中证 800 指数×10%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果和净值变动情况。



#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表一致。

#### 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

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 7.4.6 税项

##### 7.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

##### 7.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，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试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（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、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，本基金的基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对本基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从本基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

#### **7.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加**

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业发展费附加的单位外）及地方教育费附加。

#### **7.4.6.4 企业所得税**

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（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、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

#### **7.4.6.5 个人所得税**

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《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》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《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》的规定，自2015年9月8日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

#### 7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
长信基金管理有限责任公司（“长信基金”）	基金管理人、E类份额注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（“农业银行”）	基金托管人、基金代销机构
长江证券股份有限公司（“长江证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
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（股权转让前的股东）
上海长江财富资产管理有限公司	基金管理人的子公司
上海彤胜投资管理中心（有限合伙）	基金管理人的股东
上海彤骏投资管理中心（有限合伙）	基金管理人的股东
武汉钢铁有限公司	基金管理人的股东（股权转让后的股东）

注：（1）以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

（2）经长信基金管理有限责任公司股东会审议通过，并获中国证券监督管理委员会《关于核准长信基金管理有限责任公司变更股权的批复》（证监许可[2018]1905号），长信基金管理有限责任公司原股东武汉钢铁股份有限公司将其持有的长信基金管理有限责任公司15.15%的股

权全部转让给武汉钢铁有限公司。长信基金管理有限责任公司 2018 年 12 月 21 日已就股东变更事宜发布公告，股东变更为长江证券股份有限公司、上海海欣集团股份有限公司、武汉钢铁有限公司、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）。

## 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 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	1,291,927,498.53	37.25%	3,247,725,482.76	43.42%

#### 7.4.8.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 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	101,851,655.46	6.75%	14,178,490.35	2.12%

#### 7.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 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	60,000,000.00	0.22%	1,372,310,000.00	10.26%

#### 7.4.8.1.4 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的权证交易。

**7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年12月31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	1,073,978.66	36.44%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31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	2,699,838.62	43.42%	1,016,352.40	61.26%

注：上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

**7.4.8.2 关联方报酬****7.4.8.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年 12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月 31日
	当期发生的基金应支付的管理费	15,647,811.78
其中：支付销售机构的客户维护费	587,937.63	1,118,560.66

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

计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×0.70%/当年天数

**7.4.8.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年 12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月 31日
	当期发生的基金应支付的托管费	4,470,803.41

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

### 7.4.8.2.3 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 2018年1月1日至2018年12月31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	6,963,919.66	910,522.39	7,874,442.05
中国农业银行	42,422.35	-	42,422.35
长江证券	2,775.83	-	2,775.83
合计	7,009,117.84	910,522.39	7,919,640.23
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31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	9,043,214.82	32,914.77	9,076,129.59
中国农业银行	70,995.35	-	70,995.35
长江证券	3,105.77	-	3,105.77
合计	9,117,315.94	32,914.77	9,150,230.71

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

### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

#### 7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

注：基金管理人在本报告期及上年度可比期间均未运用自有资金投资本基金。

#### 7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：除基金管理人之外的其他关联方在本年末及上年度末均未持有本基金。

**7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 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
中国农业银行	3,781,514.49	625,859.29	113,757,355.99	969,666.04

注：本基金用于证券交易结算的资金通过本基金托管人的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，按银行同业利率计息。于 2018 年 12 月 31 日的相关余额在资产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示（2017 年 12 月 31 日：同）。

**7.4.8.6 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。

**7.4.8.7 其他关联交易事项的说明**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

**7.4.9 期末（2018 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券****7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

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。

**7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

**7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末 2018 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 4,999,872.50 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
180401	18 农发 01	2019 年 1 月 3 日	106.54	50,000	5,327,000.00
合计				50,000	5,327,000.00

**7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购**

截至本报告期末 2018 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人民币 341,000,000.00 元，于 2019 年 1 月 2 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。



## §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	286,079,377.56	15.01
	其中：股票	286,079,377.56	15.01
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,576,866,012.00	82.74
	其中：债券	1,576,866,012.00	82.74
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	6,770,685.80	0.36
8	其他各项资产	36,150,832.63	1.90
9	合计	1,905,866,907.99	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资港股。

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	139,142,659.24	8.98
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	135,146,718.32	8.72
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-

M	科学研究和技术服务业	11,790,000.00	0.76
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	286,079,377.56	18.47

### 8.2.2 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。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	603986	兆易创新	359,880	22,427,721.60	1.45
2	300166	东方国信	2,160,099	22,378,625.64	1.44
3	300373	扬杰科技	1,500,000	21,660,000.00	1.40
4	002410	广联达	900,000	18,729,000.00	1.21
5	000977	浪潮信息	900,000	14,328,000.00	0.92
6	300054	鼎龙股份	2,188,852	13,942,987.24	0.90
7	000333	美的集团	376,600	13,881,476.00	0.90
8	600887	伊利股份	606,055	13,866,538.40	0.90
9	002415	海康威视	536,100	13,809,936.00	0.89
10	300474	景嘉微	337,500	12,204,000.00	0.79

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于长信基金管理有限责任公司网站的年度报告正文。

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	603986	兆易创新	96,829,002.40	3.13
2	000063	中兴通讯	91,282,631.94	2.95
3	002049	紫光国微	56,056,322.53	1.81
4	300348	长亮科技	54,157,336.78	1.75

5	300166	东方国信	52,206,308.80	1.69
6	603019	中科曙光	50,414,722.55	1.63
7	601688	华泰证券	50,009,721.52	1.62
8	600030	中信证券	49,338,067.68	1.59
9	002405	四维图新	44,066,340.00	1.42
10	600588	用友网络	43,639,841.78	1.41
11	300373	扬杰科技	41,314,136.02	1.33
12	000069	华侨城 A	39,826,820.32	1.29
13	300253	卫宁健康	37,021,708.72	1.20
14	000977	浪潮信息	36,231,125.44	1.17
15	002153	石基信息	33,903,103.68	1.10
16	600048	保利地产	33,514,099.26	1.08
17	300212	易华录	32,595,772.07	1.05
18	002920	德赛西威	30,366,527.55	0.98
19	600340	华夏幸福	28,991,319.00	0.94
20	000001	平安银行	28,965,503.73	0.94

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

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 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	000063	中兴通讯	118,448,418.89	3.83
2	603019	中科曙光	114,550,097.10	3.70
3	603986	兆易创新	66,345,429.48	2.14
4	000100	TCL 集团	62,242,619.28	2.01
5	002405	四维图新	50,462,035.04	1.63
6	300348	长亮科技	50,071,870.33	1.62
7	601688	华泰证券	45,271,210.97	1.46
8	300253	卫宁健康	45,111,204.94	1.46
9	600030	中信证券	45,025,607.00	1.45
10	601877	正泰电器	43,975,772.24	1.42
11	002049	紫光国微	39,874,253.05	1.29
12	600588	用友网络	37,544,253.83	1.21
13	000069	华侨城 A	34,217,749.40	1.11
14	000636	风华高科	33,787,153.50	1.09

15	600048	保利地产	33,204,117.18	1.07
16	002410	广联达	31,383,256.38	1.01
17	600340	华夏幸福	31,049,435.71	1.00
18	002371	北方华创	30,073,489.53	0.97
19	002920	德赛西威	29,136,778.50	0.94
20	601601	中国太保	28,180,117.67	0.91

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。

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,761,857,775.91
卖出股票收入（成交）总额	1,706,470,524.49

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

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	417,091,000.00	26.92
	其中：政策性金融债	412,132,000.00	26.60
4	企业债券	329,043,633.90	21.24
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	463,721,000.00	29.93
7	可转债（可交换债）	367,010,378.10	23.69
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,576,866,012.00	101.78

### 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	113011	光大转债	1,275,170	134,045,870.40	8.65
2	180204	18 国开 04	1,200,000	125,664,000.00	8.11
3	132009	17 石油 EB	1,201,470	121,096,161.30	7.82

4	113013	国君转债	1,018,080	106,979,846.40	6.91
5	160215	16 国开 15	800,000	79,808,000.00	5.15

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序前十名资产支持证券投资明细

注：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

注：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

注：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国债期货交易情况说明

#### 8.10.1 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。

#### 8.10.2 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。

#### 8.10.3 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。

### 8.11 投资组合报告附注

#### 8.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，在报告编制日前一年内也没有受到公开谴责、处罚。

#### 8.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

报告期内本基金投资的前十名股票中，不存在超出基金合同规定备选股票库的情形。

#### 8.11.3 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	232,510.31
2	应收证券清算款	9,169,753.98

3	应收股利	-
4	应收利息	26,705,116.34
5	应收申购款	43,452.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	36,150,832.63

#### 8.11.4 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	113011	光大转债	134,045,870.40	8.65
2	113013	国君转债	106,979,846.40	6.91

#### 8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 8.11.6 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。

## § 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
长信利丰债券 C	10,367	110,846.32	967,217,648.25	84.17%	181,926,193.50	15.83%
长信利丰债券 E	13	6,941,466.69	90,191,721.05	99.95%	47,345.89	0.05%
合计	10,380	119,401.05	1,057,409,369.30	85.32%	181,973,539.39	14.68%

### 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	长信利丰债券 C	30,259.09	0.00%
	长信利丰债券 E	-	-
	合计	30,259.09	0.00%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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	0~10
	长信利丰债券 E	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	长信利丰债券 C	0~10
	长信利丰债券 E	0
	合计	0~10

## § 10 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	2,054,085,372.20	262,602,807.37
本报告期期间基金总申购份额	2,753,172,234.64	90,240,782.36
减:本报告期期间基金总赎回份额	3,658,113,765.09	262,604,522.79
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,149,143,841.75	90,239,066.94



## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期未召开本基金的基金份额持有人大会。

### 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 基金管理人的重大人事变动

本报告期内自 2018 年 8 月 28 日起，本基金管理人增聘安昀先生为副总经理。

上述重大人事变动情况，本基金管理人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，本行总行聘任刘琳同志、李智同志为本行托管业务部高级专家。

### 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

本报告期本基金未更换会计师事务所；报告期应支付给安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）审计的报酬为人民币 60,000.00 元，该审计机构为本基金提供的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

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易	应支付该券商的佣金	备注

		成交金额	占当期股票 成交总额的比 例	佣金	占当期佣金 总量的比例	
长江证券	1	1,291,927,498.53	37.25%	1,073,978.66	36.44%	-
西南证券	1	480,752,169.22	13.86%	399,648.88	13.56%	-
太平洋证券	1	326,403,817.83	9.41%	238,699.25	8.10%	-
中金公司	1	309,917,161.49	8.94%	288,624.01	9.79%	-
华泰证券	2	262,762,066.91	7.58%	218,434.34	7.41%	-
中信建投	1	155,641,036.20	4.49%	144,948.12	4.92%	-
安信证券	1	140,191,506.22	4.04%	116,541.59	3.95%	-
川财证券	1	138,698,142.59	4.00%	129,170.31	4.38%	-
银河证券	1	107,015,677.93	3.09%	99,663.45	3.38%	-
中邮证券	1	92,497,557.31	2.67%	86,143.39	2.92%	-
招商证券	2	83,273,116.03	2.40%	77,552.84	2.63%	-
宏源证券	1	79,248,550.14	2.28%	73,805.51	2.50%	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
北京高华证 券	1	-	-	-	-	-
广发证券 (已退租)	2	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
西藏东方财 富	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		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	101,851,655.46	6.75%	60,000,000.00	0.22%	-	-

西南证券	429,339,312.77	28.44%	15,792,000,000.00	58.44%	-	-
太平洋证券	51,173,080.57	3.39%	3,170,000,000.00	11.73%	-	-
中金公司	174,434,078.91	11.55%	3,250,000,000.00	12.03%	-	-
华泰证券	199,919,028.00	13.24%	12,000,000.00	0.04%	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	13,444,513.98	0.89%	-	-	-	-
中邮证券	158,497.80	0.01%	1,400,000,000.00	5.18%	-	-
招商证券	539,544,265.68	35.73%	3,340,000,000.00	12.36%	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
北京高华证 券	-	-	-	-	-	-
广发证券 (已退租)	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
西藏东方财 富	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-

注：1、本报告期租用证券公司交易单元变化如下：

新增信达证券交易单元 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：

- a、券商基本面评价（财务状况、经营状况）；
- b、券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）；
- c、券商每日信息评价（及时性和有效性）；

d、券商协作表现评价。

(2) 选择程序：

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

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 1 月 30 日； 2018 年 2 月 12 日至 2018 年 12 月 31 日	883,765,364.94	373,020,022.56	909,540,495.45	347,244,892.05	28.02%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>1、基金净值大幅波动的风险 单一持有基金比例过高的投资者连续大量赎回，可能会影响基金投资的持续性和稳定性，增加变现成本。同时，按照净值计算尾差处理规则可能引起基金份额净值异常上涨或下跌。</p> <p>2、赎回申请延期办理的风险 单一持有基金比例过高的投资者大额赎回后可能触发本基金巨额赎回条件，导致同期中小投资者小额赎回面临部分延期办理的情况。</p> <p>3、基金投资策略难以实现的风险</p>							

单一持有基金比例过高的投资者大额赎回后，可能引起基金资产总净值显著降低，从而使基金在投资时受到限制，导致基金投资策略难以实现。

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：本基金本报告期未发生影响投资者决策的其他重要信息。

长信基金管理有限责任公司

2019年3月29日