

# 长信利鑫分级债券型证券投资基金

## 【2015】第三季度报告

基金管理人:长信基金管理有限责任公司  
基金托管人:中国工商银行股份有限公司  
报告送出日期:2015年10月26日

### 1 重要提示

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基金合同规定,于2015年10月20日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、误导性陈述或重大遗漏。  
本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,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。  
本报告期自2015年7月1日起至2015年9月30日止。

### 2 基金产品概况

基金名称	长信利鑫分级债券
场内简称	长信利鑫
基金代码	360303
基金运作方式	契约型
基金合同生效日	2011年10月24日
报告期末基金份额总额	261,148,305.69份
投资目标	本基金的投资目标是:在严格控制风险的前提下,通过积极主动的投资管理,力争为基金份额持有人实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金采取自上而下、宏观政策、中观行业、微观个股相结合的投资策略,在严格控制风险的前提下,通过积极主动的投资管理,力争为基金份额持有人实现超越业绩比较基准的投资回报。
业绩比较基准	中债综合指数
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中风险较低品种,其预期收益和风险低于股票型基金、混合型基金及货币市场基金。
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
下属分级基金的基金简称	长信利鑫分级债券A 长信利鑫分级债券B
下属分级基金的场内简称	利鑫A 利鑫B
下属分级基金的代码	360304 360302
报告期末下属分级基金的份额总额	27,065,512.28份 212,082,793.41份
下属分级基金的风险收益特征	低风险、收益稳定 较高风险、预期收益较高

### 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期(2015年7月1日至2015年9月30日)
1.本期已实现收益	9,141,781.17
2.本期利润	16,599,265.94
3.加权平均基金份额本期利润	0.0641
4.期末基金资产净值	377,233,760.65

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 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
过去三个月	4.42%	0.07%	2.01%	0.06%	2.42%	0.01%

##### 3.2.2 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、图示日期为2011年6月24日至2015年9月30日。  
2、按基金合同约定,本基金自合同生效日起6个月内为建仓期,建仓期结束时,本基金各项投资比例已符合基金合同的约定。  
3.3 其他指标

其他指标	报告期(2015年7月1日至2015年9月30日)
长信利鑫分级债券A与长信利鑫分级债券B基金资产净值比例	0.7368/0.2631
期末长信利鑫分级债券A的资产净值	10,000
期末长信利鑫分级债券B的资产净值	1,772
期末长信利鑫分级债券A的资产净值占基金资产净值比例	10.00%
期末长信利鑫分级债券B的资产净值占基金资产净值比例	1.77%

注:根据《基金合同》的规定,在基金合同生效日当日,基金管理人将根据届时中国人民银行公布并执行的金融机构人民币1年期银行定期存款基准利率设定利鑫A的首次年收益率;在利鑫A的每个开放日,基金管理人将根据该日中国人民银行公布并执行的金融机构人民币1年期银行定期存款基准利率重新设定利鑫A的年收益率,且约定收益率为单利。截至本报告期末,长信利鑫分级债券A年收益率为3.28%,根据本合同约定利鑫A的第八个开放日,即2015年6月23日中国人民银行公布并执行的金融机构人民币1年期银行定期存款基准利率2.25%的1.1倍+0.8%(小数点后位1)进行计算。

姓名	职务	任本基金基金经理的期限	证券从业年限	说明
张永明	本基金、长信纯债、长信利鑫分级债券A、长信利鑫分级债券B的基金经理、公司固定收益部总经理	2011年6月24日 - 至今	21年	高级工商管理硕士,上海交通大学EMBA,曾任光大证券研究所固定收益部主管,现任光大证券研究所固定收益部主管,兼任光大证券资产管理部基金经理,长信利鑫分级债券A、长信利鑫分级债券B、长信利鑫分级债券C、长信利鑫分级债券D、长信利鑫分级债券E、长信利鑫分级债券F、长信利鑫分级债券G、长信利鑫分级债券H、长信利鑫分级债券I、长信利鑫分级债券J、长信利鑫分级债券K、长信利鑫分级债券L、长信利鑫分级债券M、长信利鑫分级债券N、长信利鑫分级债券O、长信利鑫分级债券P、长信利鑫分级债券Q、长信利鑫分级债券R、长信利鑫分级债券S、长信利鑫分级债券T、长信利鑫分级债券U、长信利鑫分级债券V、长信利鑫分级债券W、长信利鑫分级债券X、长信利鑫分级债券Y、长信利鑫分级债券Z、长信利鑫分级债券AA、长信利鑫分级债券AB、长信利鑫分级债券AC、长信利鑫分级债券AD、长信利鑫分级债券AE、长信利鑫分级债券AF、长信利鑫分级债券AG、长信利鑫分级债券AH、长信利鑫分级债券AI、长信利鑫分级债券AJ、长信利鑫分级债券AK、长信利鑫分级债券AL、长信利鑫分级债券AM、长信利鑫分级债券AN、长信利鑫分级债券AO、长信利鑫分级债券AP、长信利鑫分级债券AQ、长信利鑫分级债券AR、长信利鑫分级债券AS、长信利鑫分级债券AT、长信利鑫分级债券AU、长信利鑫分级债券AV、长信利鑫分级债券AW、长信利鑫分级债券AX、长信利鑫分级债券AY、长信利鑫分级债券AZ、长信利鑫分级债券BA、长信利鑫分级债券BB、长信利鑫分级债券BC、长信利鑫分级债券BD、长信利鑫分级债券BE、长信利鑫分级债券BF、长信利鑫分级债券BG、长信利鑫分级债券BH、长信利鑫分级债券BI、长信利鑫分级债券BJ、长信利鑫分级债券BK、长信利鑫分级债券BL、长信利鑫分级债券BM、长信利鑫分级债券BN、长信利鑫分级债券BO、长信利鑫分级债券BP、长信利鑫分级债券BQ、长信利鑫分级债券BR、长信利鑫分级债券BS、长信利鑫分级债券BT、长信利鑫分级债券BU、长信利鑫分级债券BV、长信利鑫分级债券BW、长信利鑫分级债券BX、长信利鑫分级债券BY、长信利鑫分级债券BZ、长信利鑫分级债券CA、长信利鑫分级债券CB、长信利鑫分级债券CC、长信利鑫分级债券CD、长信利鑫分级债券CE、长信利鑫分级债券CF、长信利鑫分级债券CG、长信利鑫分级债券CH、长信利鑫分级债券CI、长信利鑫分级债券CJ、长信利鑫分级债券CK、长信利鑫分级债券CL、长信利鑫分级债券CM、长信利鑫分级债券CN、长信利鑫分级债券CO、长信利鑫分级债券CP、长信利鑫分级债券CQ、长信利鑫分级债券CR、长信利鑫分级债券CS、长信利鑫分级债券CT、长信利鑫分级债券CU、长信利鑫分级债券CV、长信利鑫分级债券CW、长信利鑫分级债券CX、长信利鑫分级债券CY、长信利鑫分级债券CZ、长信利鑫分级债券DA、长信利鑫分级债券DB、长信利鑫分级债券DC、长信利鑫分级债券DD、长信利鑫分级债券DE、长信利鑫分级债券DF、长信利鑫分级债券DG、长信利鑫分级债券DH、长信利鑫分级债券DI、长信利鑫分级债券DJ、长信利鑫分级债券DK、长信利鑫分级债券DL、长信利鑫分级债券DM、长信利鑫分级债券DN、长信利鑫分级债券DO、长信利鑫分级债券DP、长信利鑫分级债券DQ、长信利鑫分级债券DR、长信利鑫分级债券DS、长信利鑫分级债券DT、长信利鑫分级债券DU、长信利鑫分级债券DV、长信利鑫分级债券DW、长信利鑫分级债券DX、长信利鑫分级债券DY、长信利鑫分级债券DZ、长信利鑫分级债券EA、长信利鑫分级债券EB、长信利鑫分级债券EC、长信利鑫分级债券ED、长信利鑫分级债券EE、长信利鑫分级债券EF、长信利鑫分级债券EG、长信利鑫分级债券EH、长信利鑫分级债券EI、长信利鑫分级债券EJ、长信利鑫分级债券EK、长信利鑫分级债券EL、长信利鑫分级债券EM、长信利鑫分级债券EN、长信利鑫分级债券EO、长信利鑫分级债券EP、长信利鑫分级债券EQ、长信利鑫分级债券ER、长信利鑫分级债券ES、长信利鑫分级债券ET、长信利鑫分级债券EU、长信利鑫分级债券EV、长信利鑫分级债券EW、长信利鑫分级债券EX、长信利鑫分级债券EY、长信利鑫分级债券EZ、长信利鑫分级债券FA、长信利鑫分级债券FB、长信利鑫分级债券FC、长信利鑫分级债券FD、长信利鑫分级债券FE、长信利鑫分级债券FF、长信利鑫分级债券FG、长信利鑫分级债券FH、长信利鑫分级债券FI、长信利鑫分级债券FJ、长信利鑫分级债券FK、长信利鑫分级债券FL、长信利鑫分级债券FM、长信利鑫分级债券FN、长信利鑫分级债券FO、长信利鑫分级债券FP、长信利鑫分级债券FQ、长信利鑫分级债券FR、长信利鑫分级债券FS、长信利鑫分级债券FT、长信利鑫分级债券FU、长信利鑫分级债券FV、长信利鑫分级债券FW、长信利鑫分级债券FX、长信利鑫分级债券FY、长信利鑫分级债券FZ、长信利鑫分级债券GA、长信利鑫分级债券GB、长信利鑫分级债券GC、长信利鑫分级债券GD、长信利鑫分级债券GE、长信利鑫分级债券GF、长信利鑫分级债券GG、长信利鑫分级债券GH、长信利鑫分级债券GI、长信利鑫分级债券GJ、长信利鑫分级债券GK、长信利鑫分级债券GL、长信利鑫分级债券GM、长信利鑫分级债券GN、长信利鑫分级债券GO、长信利鑫分级债券GP、长信利鑫分级债券GQ、长信利鑫分级债券GR、长信利鑫分级债券GS、长信利鑫分级债券GT、长信利鑫分级债券GU、长信利鑫分级债券GV、长信利鑫分级债券GW、长信利鑫分级债券GX、长信利鑫分级债券GY、长信利鑫分级债券GZ、长信利鑫分级债券HA、长信利鑫分级债券HB、长信利鑫分级债券HC、长信利鑫分级债券HD、长信利鑫分级债券HE、长信利鑫分级债券HF、长信利鑫分级债券HG、长信利鑫分级债券HH、长信利鑫分级债券HI、长信利鑫分级债券HJ、长信利鑫分级债券HK、长信利鑫分级债券HL、长信利鑫分级债券HM、长信利鑫分级债券HN、长信利鑫分级债券HO、长信利鑫分级债券HP、长信利鑫分级债券HQ、长信利鑫分级债券HR、长信利鑫分级债券HS、长信利鑫分级债券HT、长信利鑫分级债券HU、长信利鑫分级债券HV、长信利鑫分级债券HW、长信利鑫分级债券HX、长信利鑫分级债券HY、长信利鑫分级债券HZ、长信利鑫分级债券IA、长信利鑫分级债券IB、长信利鑫分级债券IC、长信利鑫分级债券ID、长信利鑫分级债券IE、长信利鑫分级债券IF、长信利鑫分级债券IG、长信利鑫分级债券IH、长信利鑫分级债券II、长信利鑫分级债券IJ、长信利鑫分级债券IK、长信利鑫分级债券IL、长信利鑫分级债券IM、长信利鑫分级债券IN、长信利鑫分级债券IO、长信利鑫分级债券IP、长信利鑫分级债券IQ、长信利鑫分级债券IR、长信利鑫分级债券IS、长信利鑫分级债券IT、长信利鑫分级债券IU、长信利鑫分级债券IV、长信利鑫分级债券IW、长信利鑫分级债券IX、长信利鑫分级债券IY、长信利鑫分级债券IZ、长信利鑫分级债券JA、长信利鑫分级债券JB、长信利鑫分级债券JC、长信利鑫分级债券JD、长信利鑫分级债券JE、长信利鑫分级债券JF、长信利鑫分级债券JG、长信利鑫分级债券JH、长信利鑫分级债券JI、长信利鑫分级债券JJ、长信利鑫分级债券JK、长信利鑫分级债券JL、长信利鑫分级债券JM、长信利鑫分级债券JN、长信利鑫分级债券JO、长信利鑫分级债券JP、长信利鑫分级债券JQ、长信利鑫分级债券JR、长信利鑫分级债券JS、长信利鑫分级债券JT、长信利鑫分级债券JU、长信利鑫分级债券JV、长信利鑫分级债券JW、长信利鑫分级债券JX、长信利鑫分级债券JY、长信利鑫分级债券JZ、长信利鑫分级债券KA、长信利鑫分级债券KB、长信利鑫分级债券KC、长信利鑫分级债券KD、长信利鑫分级债券KE、长信利鑫分级债券KF、长信利鑫分级债券KG、长信利鑫分级债券KH、长信利鑫分级债券KI、长信利鑫分级债券KJ、长信利鑫分级债券KL、长信利鑫分级债券KM、长信利鑫分级债券KN、长信利鑫分级债券KO、长信利鑫分级债券KP、长信利鑫分级债券KQ、长信利鑫分级债券KR、长信利鑫分级债券KS、长信利鑫分级债券KT、长信利鑫分级债券KU、长信利鑫分级债券KV、长信利鑫分级债券KW、长信利鑫分级债券KX、长信利鑫分级债券KY、长信利鑫分级债券KZ、长信利鑫分级债券LA、长信利鑫分级债券LB、长信利鑫分级债券LC、长信利鑫分级债券LD、长信利鑫分级债券LE、长信利鑫分级债券LF、长信利鑫分级债券LG、长信利鑫分级债券LH、长信利鑫分级债券LI、长信利鑫分级债券LJ、长信利鑫分级债券LK、长信利鑫分级债券LL、长信利鑫分级债券LM、长信利鑫分级债券LN、长信利鑫分级债券LO、长信利鑫分级债券LP、长信利鑫分级债券LQ、长信利鑫分级债券LR、长信利鑫分级债券LS、长信利鑫分级债券LT、长信利鑫分级债券LU、长信利鑫分级债券LV、长信利鑫分级债券LW、长信利鑫分级债券LX、长信利鑫分级债券LY、长信利鑫分级债券LZ、长信利鑫分级债券MA、长信利鑫分级债券MB、长信利鑫分级债券MC、长信利鑫分级债券MD、长信利鑫分级债券ME、长信利鑫分级债券MF、长信利鑫分级债券MG、长信利鑫分级债券MH、长信利鑫分级债券MI、长信利鑫分级债券MJ、长信利鑫分级债券MK、长信利鑫分级债券ML、长信利鑫分级债券MN、长信利鑫分级债券MO、长信利鑫分级债券MP、长信利鑫分级债券MQ、长信利鑫分级债券MR、长信利鑫分级债券MS、长信利鑫分级债券MT、长信利鑫分级债券MU、长信利鑫分级债券MV、长信利鑫分级债券MW、长信利鑫分级债券MX、长信利鑫分级债券MY、长信利鑫分级债券MZ、长信利鑫分级债券NA、长信利鑫分级债券NB、长信利鑫分级债券NC、长信利鑫分级债券ND、长信利鑫分级债券NE、长信利鑫分级债券NF、长信利鑫分级债券NG、长信利鑫分级债券NH、长信利鑫分级债券NI、长信利鑫分级债券NJ、长信利鑫分级债券NK、长信利鑫分级债券NL、长信利鑫分级债券NM、长信利鑫分级债券NO、长信利鑫分级债券NP、长信利鑫分级债券NQ、长信利鑫分级债券NR、长信利鑫分级债券NS、长信利鑫分级债券NT、长信利鑫分级债券NU、长信利鑫分级债券NV、长信利鑫分级债券NW、长信利鑫分级债券NX、长信利鑫分级债券NY、长信利鑫分级债券NZ、长信利鑫分级债券OA、长信利鑫分级债券OB、长信利鑫分级债券OC、长信利鑫分级债券OD、长信利鑫分级债券OE、长信利鑫分级债券OF、长信利鑫分级债券OG、长信利鑫分级债券OH、长信利鑫分级债券OI、长信利鑫分级债券OJ、长信利鑫分级债券OK、长信利鑫分级债券OL、长信利鑫分级债券OM、长信利鑫分级债券ON、长信利鑫分级债券OO、长信利鑫分级债券OP、长信利鑫分级债券OQ、长信利鑫分级债券OR、长信利鑫分级债券OS、长信利鑫分级债券OT、长信利鑫分级债券OU、长信利鑫分级债券OV、长信利鑫分级债券OW、长信利鑫分级债券OX、长信利鑫分级债券OY、长信利鑫分级债券OZ、长信利鑫分级债券PA、长信利鑫分级债券PB、长信利鑫分级债券PC、长信利鑫分级债券PD、长信利鑫分级债券PE、长信利鑫分级债券PF、长信利鑫分级债券PG、长信利鑫分级债券PH、长信利鑫分级债券PI、长信利鑫分级债券PJ、长信利鑫分级债券PK、长信利鑫分级债券PL、长信利鑫分级债券PM、长信利鑫分级债券PN、长信利鑫分级债券PO、长信利鑫分级债券PP、长信利鑫分级债券PQ、长信利鑫分级债券PR、长信利鑫分级债券PS、长信利鑫分级债券PT、长信利鑫分级债券PU、长信利鑫分级债券PV、长信利鑫分级债券PW、长信利鑫分级债券PX、长信利鑫分级债券PY、长信利鑫分级债券PZ、长信利鑫分级债券QA、长信利鑫分级债券QB、长信利鑫分级债券QC、长信利鑫分级债券QD、长信利鑫分级债券QE、长信利鑫分级债券QF、长信利鑫分级债券QG、长信利鑫分级债券QH、长信利鑫分级债券QI、长信利鑫分级债券QJ、长信利鑫分级债券QK、长信利鑫分级债券QL、长信利鑫分级债券QM、长信利鑫分级债券QN、长信利鑫分级债券QO、长信利鑫分级债券QP、长信利鑫分级债券QQ、长信利鑫分级债券QR、长信利鑫分级债券QS、长信利鑫分级债券QT、长信利鑫分级债券QU、长信利鑫分级债券QV、长信利鑫分级债券QW、长信利鑫分级债券QX、长信利鑫分级债券QY、长信利鑫分级债券QZ、长信利鑫分级债券RA、长信利鑫分级债券RB、长信利鑫分级债券RC、长信利鑫分级债券RD、长信利鑫分级债券RE、长信利鑫分级债券RF、长信利鑫分级债券RG、长信利鑫分级债券RH、长信利鑫分级债券RI、长信利鑫分级债券RJ、长信利鑫分级债券RK、长信利鑫分级债券RL、长信利鑫分级债券RM、长信利鑫分级债券RN、长信利鑫分级债券RO、长信利鑫分级债券RP、长信利鑫分级债券RQ、长信利鑫分级债券RS、长信利鑫分级债券RT、长信利鑫分级债券RU、长信利鑫分级债券RV、长信利鑫分级债券RW、长信利鑫分级债券RX、长信利鑫分级债券RY、长信利鑫分级债券RZ、长信利鑫分级债券SA、长信利鑫分级债券SB、长信利鑫分级债券SC、长信利鑫分级债券SD、长信利鑫分级债券SE、长信利鑫分级债券SF、长信利鑫分级债券SG、长信利鑫分级债券SH、长信利鑫分级债券SI、长信利鑫分级债券SJ、长信利鑫分级债券SK、长信利鑫分级债券SL、长信利鑫分级债券SM、长信利鑫分级债券SN、长信利鑫分级债券SO、长信利鑫分级债券SP、长信利鑫分级债券SQ、长信利鑫分级债券SR、长信利鑫分级债券SS、长信利鑫分级债券ST、长信利鑫分级债券SU、长信利鑫分级债券SV、长信利鑫分级债券SW、长信利鑫分级债券SX、长信利鑫分级债券SY、长信利鑫分级债券SZ、长信利鑫分级债券TA、长信利鑫分级债券TB、长信利鑫分级债券TC、长信利鑫分级债券TD、长信利鑫分级债券TE、长信利鑫分级债券TF、长信利鑫分级债券TG、长信利鑫分级债券TH、长信利鑫分级债券TI、长信利鑫分级债券TJ、长信利鑫分级债券TK、长信利鑫分级债券TL、长信利鑫分级债券TM、长信利鑫分级债券TN、长信利鑫分级债券TO、长信利鑫分级债券TP、长信利鑫分级债券TQ、长信利鑫分级债券TR、长信利鑫分级债券TS、长信利鑫分级债券TT、长信利鑫分级债券TU、长信利鑫分级债券TV、长信利鑫分级债券TW、长信利鑫分级债券TX、长信利鑫分级债券TY、长信利鑫分级债券TZ、长信利鑫分级债券UA、长信利鑫分级债券UB、长信利鑫分级债券UC、长信利鑫分级债券UD、长信利鑫分级债券UE、长信利鑫分级债券UF、长信利鑫分级债券UG、长信利鑫分级债券UH、长信利鑫分级债券UI、长信利鑫分级债券UJ、长信利鑫分级债券UK、长信利鑫分级债券UL、长信利鑫分级债券UM、长信利鑫分级债券UN、长信利鑫分级债券UO、长信利鑫分级债券UP、长信利鑫分级债券UQ、长信利鑫分级债券UR、长信利鑫分级债券US、长信利鑫分级债券UT、长信利鑫分级债券UU、长信利鑫分级债券UV、长信利鑫分级债券UW、长信利鑫分级债券UX、长信利鑫分级债券UY、长信利鑫分级债券UZ、长信利鑫分级债券VA、长信利鑫分级债券VB、长信利鑫分级债券VC、长信利鑫分级债券VD、长信利鑫分级债券VE、长信利鑫分级债券VF、长信利鑫分级债券VG、长信利鑫分级债券VH、长信利鑫分级债券VI、长信利鑫分级债券VJ、长信利鑫分级债券VK、长信利鑫分级债券VL、长信利鑫分级债券VM、长信利鑫分级债券VN、长信利鑫分级债券VO、长信利鑫分级债券VP、长信利鑫分级债券VQ、长信利鑫分级债券VR、长信利鑫分级债券VS、长信利鑫分级债券VT、长信利鑫分级债券VU、长信利鑫分级债券VV、长信利鑫分级债券VW、长信利鑫分级债券VX、长信利鑫分级债券VY、长信利鑫分级债券VZ、长信利鑫分级债券WA、长信利鑫分级债券WB、长信利鑫分级债券WC、长信利鑫分级债券WD、长信利鑫分级债券WE、长信利鑫分级债券WF、长信利鑫分级债券WG、长信利鑫分级债券WH、长信利鑫分级债券WI、长信利鑫分级债券WJ、长信利鑫分级债券WK、长信利鑫分级债券WL、长信利鑫分级债券WM、长信利鑫分级债券WN、长信利鑫分级债券WO、长信利鑫分级债券WP、长信利鑫分级债券WQ、长信利鑫分级债券WR、长信利鑫分级债券WS、长信利鑫分级债券WT、长信利鑫分级债券WU、长信利鑫分级债券WV、长信利鑫分级债券WW、长信利鑫分级债券WX、长信利鑫分级债券WY、长信利鑫分级债券WZ、长信利鑫分级债券XA、长信利鑫分级债券XB、长信利鑫分级债券XC、长信利鑫分级债券XD、长信利鑫分级债券XE、长信利鑫分级债券XF、长信利鑫分级债券XG、长信利鑫分级债券XH、长信利鑫分级债券XI、长信利鑫分级债券XJ、长信利鑫分级债券XK、长信利鑫分级债券XL、长信利鑫分级债券XM、长信利鑫分级债券XN、长信利鑫分级债券XO、长信利鑫分级债券XP、长信利鑫分级债券XQ、长信利鑫分级债券XR、长信利鑫分级债券XS、长信利鑫分级债券XT、长信利鑫分级债券XU、长信利鑫分级债券XV、长信利鑫分级债券XW、长信利鑫分级债券XX、长信利鑫分级债券XY、长信利鑫分级债券XZ、长信利鑫分级债券YA、长信利鑫分级债券YB、长信利鑫分级债券YC、长信利鑫分级债券YD、长信利鑫分级债券YE、长信利鑫分级债券YF、长信利鑫分级债券YG、长信利鑫分级债券YH、长信利鑫分级债券YI、长信利鑫分级债券YJ、长信利鑫分级债券YK、长信利鑫分级债券YL、长信利鑫分级债券YM、长信利鑫分级债券YN、长信利鑫分级债券YO、长信利鑫分级债券YP、长信利鑫分级债券YQ、长信利鑫分级债券YR、长信利鑫分级债券YS、长信利鑫分级债券YT、长信利鑫分级债券YU、长信利鑫分级债券YV、长信利鑫分级债券YW、长信利鑫分级债券YX、长信利鑫分级债券YY、长信利鑫分级债券YZ、长信利鑫分级债券ZA、长信利鑫分级债券ZB、长信利鑫分级债券ZC、长信利鑫分级债券ZD、长信利鑫分级债券ZE、长信利鑫分级债券ZF、长信利鑫分级债券ZG、长信利鑫分级债券ZH、长信利鑫分级债券ZI、长信利鑫分级债券ZJ、长信利鑫分级债券ZK、长信利鑫分级债券ZL、长信利鑫分级债券ZM、长信利鑫分级债券ZN、长信利鑫分级债券ZO、长信利鑫分级债券ZP、长信利鑫分级债券ZQ、长信利鑫分级债券ZR、长信利鑫分级债券ZS、长信利鑫分级债券ZT、长信利鑫分级债券ZU、长信利鑫分级债券ZV、长信利鑫分级债券ZW、长信利鑫分级债券ZX、长信利鑫分级债券ZY、长信利鑫分级债券ZZ。

注:1、曾任基金经理任职日期以本基金成立之日为准;新增或变更以刊登新增/变更基金经理的公告披露日为准。  
2、本基金基金经理的证券从业年限以基金经理进入证券业务相关机构的工作经历为时间计算标准。

4.2 管理人对于报告期内本基金运作遵守信情况的说明  
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、《长信利鑫分级债券型证券投资基金基金合同》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。

本基金将继续以诚信于市场、诚信于社会公众为宗旨,承诺将一如既往地本着诚信信用、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 公平交易制度的执行情况  
本报告期,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,公司已通过投资交易行为的事前、事中、事后监控和信息披露来加强对公平交易过程及结果的监督。

4.3.2 异常交易行为的专项说明  
本报告期,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金额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 报告期内基金的投资策略和运作分析  
4.4.1 报告期内基金的投资策略和运作分析  
2015年7月,经济基本面偏弱,政策宽松预期不减,资金利率稳定低位,股市大幅下跌,股债跷跷板效应明显,资金流向债市和信用债市场,信用债收益率和信用利差双双下行,企业债、中期票据等债券的信用

利有所收窄,利率债收益率曲线短端有所上行,其他品种收益率均小幅下行。8月份,经济数据的超预期恶化以及央行降准降准,更为债市行情添砖加瓦。市场风险偏好下降,企业债、中期票据等债券的信用利差略有放大,债券收益率曲线短端分化,利率债和政金债收益率曲线短端略有下行,信用债收益率曲线短端上行。美联储9月份推迟了加息,年内还有加息预期,汇率的冲击边际在减弱,央行货币政策持续保持宽松操作,整体流动性保持低水平。债市市场似乎也开始适应汇率的波动了,短期资金成本相比上月小幅下降,但债市面边际改善幅度有限,短期债券收益率涨势不减,14年期国债利率水平反弹了11bp,6个月国开债小幅下降了5bp,10年期国债收益率下降了2bp,收益率曲线呈现平坦化特征。

2015年三季度,本基金主要增持了部分公司债,适当增加杠杆,保证了组合回报。  
4.4.2 2015年四季度市场展望和投资策略  
展望后市,产业结构调整升级过程中,期内生动力减弱,新经济增长点尚未形成规模,三因素叠加的新常态下,潜在经济增速下行难以避免。短期因素是财政政策不断加码,政策在推动资金进入实体的渠道上下大力,简政放权、国企改革等改革措施释放政策红利,一系列稳增长政策短期内可能对经济起到一定托底作用,但难以拉动经济明显反弹。2015年四季度,经济增速放缓决定了中长期来看债市仍受到较大支撑,投资回报率的降低将制约社会融资需求,资产的匮乏将导致利率易上难下。受制于工业领域增速放缓,长期看,经济下行压力在控制目标以内,经济基本面向好,为债市带来明显的负面影响,市场环境依然有利于债市,我们将努力把把握市场起调带来的波段机会。

4.5 报告期内基金的业绩表现  
截至2015年9月30日,本基金份额净值为1.5140元,本基金之长信利鑫分级债券A份额参考净值为1.0089元,本基金之长信利鑫分级债券B份额参考净值为1.0022元。本报告期内本基金净值增长率为4.42%,同期业绩比较基准收益率为7.10%。  
4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

### 5 投资组合报告

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	619,124,770.70	96.96
4	其中:债券	619,124,770.70	96.96
5	资产支持证券	-	-
6	贵金属投资	-	-
7	金融衍生品投资	-	-
8	买入返售金融资产	-	-
9	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
10	银行存款和结算备付金合计	9,726,400.00	1.51
11	其他资产	16,299,790.00	2.53
12	合计	645,150,960.70	100.00

#### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.3 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。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	-	-
2	金融债	-	-
3	企业债	20,044,000.00	5.31
4	中期票据	20,044,000.00	5.31
5	公司债	548,022,770.70	146.44
6	资产支持证券	50,458,000.00	13.38
7	其他	-	-
8	合计	619,124,770.70	164.13

序号	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	122262 11国债	200,000	21,320,000.00	5.81
2	124137 13国债	100,000	21,600,000.00	5.94
3	1448083 14广深铁路	200,000	21,572,313.60	5.92
4	111063 11国债	202,000	21,176,784.00	5.81
5	124270 13国债	200,000	20,944,000.00	5.86

5.6 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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细  
本基金本报告期末未持有权证。

5.9 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。

5.10 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。

5.11 投资组合报告附注  
5.11.1 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。

5.11.2 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。

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	43,026.70
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	16,256,861.11
5	其他应收款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

5.11.4 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。

5.11.5 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。

5.11.6 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。

5.12 开放式基金份额变动

	长信利鑫分级债券A	长信利鑫分级债券B
报告期末的基金份额总额	27,065,512.28	212,082,003.19
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--
报告期前基金份额总额期初	--	--