

长信纯债壹号债券型证券投资基金

2015 年度 报告 摘要

不断下降,使得从长期来看,我国经济潜在增速将放缓,投入型增长模式需要向效率型增长模式转变,经济结构调整还将延续,由于需求端持续低迷的态势未有明显起色,通胀大幅反弹缺乏宏观基本面支撑,预计2016年上半年通胀上移将较为温和,通胀风险依然不大,不足以成为货币政策和股市的主要制约因素。我们认为,今年货币政策基调仍然是偏松,市场资金价格会继续目前对水平和波动性均较低的局面。经济增速放缓决定了长期来看股市仍受到较大支撑,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上行幅度有限,但人民币利率变化是今年需要重点关注的问题,债券市场持续震荡波动率增大。同时,在信用风险事件频发的大背景下,需要我们更多地介入信用风险控制,并将努力把市场调整带来的波段机会。

我们将采取谨慎的态度进行投资,积极防范流动性风险,密切关注国内外经济局势变化,需要重点规避信用风险,努力抓住市场结构性机会和波段行情。在基金的日常投资中,将继续秉承诚信、专业、负责的精神,密切关注政策节奏,更好地把握投资机会,争取为基金份额持有人谋求最大利益。

4.6 管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证券监督管理委员会2008年9月12日发布的[2008]38号文《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》的规定,长信基金管理有限公司(以下简称“公司”)制订了健全、有效的估值政策和程序,成立了估值工作小组,小组成员由投资管理部总监、固定收益部总监、研究发展部总监、交易管理部总监、金融工程部总监、基金事务部总监以及基金事务部至少一名业务骨干共同组成。相关参与人员都具有丰富的证券行业工作经验,熟悉相关法规和估值方法。基金经理不直接参与估值决策,如果基金经理认为某证券有更好的估值方法,可以申请公司估值工作小组对该证券进行专项评估,估值决策由与估值工作小组成员1/2以上多数通过。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。

4.7 管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期没有进行利润分配。

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

截至2015年3月5日,本基金连续五十六个工作日出现基金资产净值低于五千万元的情况。自2015年3月6日起,本基金的资产净值已经高于五千万元。

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

基金托管人依据《长信纯债壹号债券型证券投资基金基金合同》与《长信纯债壹号债券型证券投资基金托管协议》,托管长信纯债壹号证券投资基金(以下简称“本基金”)的全部资产。

本报告期内,本托管人严格遵守《证券投资基金法》及其他相关法律法规、基金合同和托管协议的约定,诚信、尽责地履行了基金托管人义务,不存在损害本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

本报告期内,本托管人依据国家相关法律法规、基金合同和托管协议的约定,对基金管理人在本基金的受托运作、基金资产净值的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查,未发现存在任何损害本基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等相关信息的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本年度报告中的财务数据、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,认为其真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

6 审计报告

本基金2015年度财务报告经毕马威华振会计师事务所审计,注册会计师出具了无保留意见的审计报告(毕马威华振字第1600144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

会计主体:长信纯债壹号债券型证券投资基金
报告截止日:2015年12月31日

资产	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
资产:		
银行存款	72,724,982.88	2,318,722.01
结算备付金	10,527,558.93	114,558.86
存出保证金	201,426.76	7,266.05
应收款项资产	3,604,565,085.06	22,527,507.57
其中:股票资产	-	-
基金投资	-	-
债券投资	3,604,565,085.06	22,527,507.57
资产支持证券	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	83,664,274.88	376,156.02
应收股利	-	-
应收申购款	4,668,216.58	29,595.66
递延所得税资产	-	-
其他资产	3,776,762,464.78	26,473,377.66
资产总计	7,776,762,464.78	26,473,377.66
负债和所有者权益:		
负债:		
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	1,062,593,426.00	400,464.40
应付证券清算款	40,681,910.77	400,464.40
应付赎回款	969,119.89	26,526.38
应付管理人报酬	1,327,709.22	19,599.01
应付托管费	329,342.03	5,708.24
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	33,641.18	9,460.71
应交税费	118,206.22	118,206.22
应付利息	483,686.68	66,628.67
应付股利	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	307,678.44	551,071.69
负债合计	1,106,485,362.68	1,221,394.73
所有者权益:		
实收基金	2,006,328,519.68	20,956,548.29
未分配利润	661,738,032.42	3,466,434.64
所有者权益合计	2,678,066,552.10	24,461,982.93
负债和所有者权益总计	3,776,762,464.78	26,473,377.66

注:1、报告截止日2015年12月31日,基金份额净值1.3295元,基金份额总额2,008,328,519.68份。
2、本基金本报告期为2015年1月1日至2015年12月31日,本基金基金合同于2014年7月1日起正式生效,上年度可比期间不满一个会计年度。

7.2 利润表

会计主体:长信纯债壹号债券型证券投资基金
本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

项目	本期末 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年7月1日至2014年12月31日
一、收入	106,091,884.34	4,942,120.26
1.利息收入	68,712,218.38	2,101,107.80
其中:存款利息收入	58,723,204.48	26,526.37
债券利息收入	58,300,411.32	1,926,167.44
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	381,598.06	149,410.79
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”号填列)	-119,798.28	2,660,268.34
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-119,798.28	2,660,268.34
资产支持证券投资损益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具损益	-	-
公允价值变动损益(损失以“-”号填列)	46,265,472.89	60,512.04
3.其他收入(损失以“-”号填列)	1,183,991.36	120,282.68
减:二、费用	16,479,067.36	831,148.30
1. 管理人报酬	5,280,690.07	281,643.00
2. 托管费	1,506,771.18	80,428.68
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	58,201.06	8,512.42
5. 利息支出	9,406,736.05	239,161.72
其中:应付短期融资券支出	9,406,736.05	239,161.72
6. 其他费用	221,660.09	28,518.88
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	89,513,826.98	4,110,371.96
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	89,513,826.98	4,110,371.96

注:本基金本报告期为2015年1月1日至2015年12月31日,本基金基金合同于2014年7月1日起正式生效,上年度可比期间不满一个会计年度。

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:长信纯债壹号债券型证券投资基金
本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

项目	本期末 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
一、期初所有者权益(基金净值)	20,956,548.29	3,466,434.64
二、本期损益	661,738,032.42	24,461,982.93
三、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-38,713,146.01	-7,400,296.58
四、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	1,987,332,971.39	568,767,770.80
五、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	2,996,290,116.60	840,406,398.60
六、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
七、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
八、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
九、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
十、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
十一、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
十二、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
十三、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
十四、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
十五、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
十六、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
十七、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
十八、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
十九、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
二十、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
二十一、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
二十二、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
二十三、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
二十四、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
二十五、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
二十六、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
二十七、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
二十八、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
二十九、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
三十、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
三十一、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
三十二、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
三十三、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
三十四、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
三十五、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
三十六、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
三十七、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
三十八、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
三十九、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
四十、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
四十一、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
四十二、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
四十三、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
四十四、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
四十五、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
四十六、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
四十七、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
四十八、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
四十九、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
五十、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
五十一、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
五十二、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
五十三、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
五十四、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
五十五、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
五十六、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
五十七、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
五十八、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
五十九、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
六十、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
六十一、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
六十二、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
六十三、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
六十四、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
六十五、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
六十六、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
六十七、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
六十八、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
六十九、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
七十、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
七十一、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
七十二、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
七十三、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
七十四、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
七十五、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
七十六、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
七十七、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
七十八、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
七十九、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
八十、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
八十一、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
八十二、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
八十三、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
八十四、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
八十五、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
八十六、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
八十七、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
八十八、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
八十九、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
九十、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
九十一、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
九十二、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
九十三、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
九十四、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
九十五、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
九十六、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
九十七、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
九十八、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
九十九、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80
一百、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回)	-918,887,146.21	-271,628,627.80

注:本基金本报告期为2015年1月1日至2015年12月31日,本基金基金合同于2014年7月1日起正式生效,上年度可比期间不满一个会计年度。

报表附注为财务报表的重要组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

名称	签署	名称
基金管理人负责人	王雪梅	会计师事务所负责人
基金管理人负责人	王雪梅	会计师事务所负责人

7.4 基金基本情况

长信纯债壹号证券投资基金是根据原长信中国短期债券投资基金以下简称“长信中国短期债券基金”)于2014年5月23日至2014年6月2日期间以通讯方式召开的基金份额持有人大会决议通过了《关于长信中国短期债券基金基金更名及修改基金合同及其他相关事项的决议》,经中国证监会基金部核准以下

基金管理人:长信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
送出日期:2016年3月26日

§1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金基金合同规定,于2016年3月26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。投资者有风险,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。