

基金管理人:长信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国邮政储蓄银行股份有限公司
送出日期:2014年8月28日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对基金定期报告的真实性、准确性、完整性承担责任。本基金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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2014年8月22日对本基金的财务指标、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定期报告。

本半年度报告摘要自2014年6月20日起公告，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告全文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年1月1日起至2014年6月30日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

企业名称	长信利鑫分级债券型证券投资基金
场内简称	长信利鑫
基金代码	163003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年6月24日
基金管理人	长信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司
份额期末净资产总额	313,200,832.09
基金份额持有人数	不适用
深证证券交易所	深证证券交易所
上市日期	2011年9月25日
下属分级基金的基金简称	长信利鑫分级债A
长信利鑫分级债B	长信利鑫分级债B
下属分级基金的交易代码	163004
150042	150042
份额期末A级份额总额	101,102,738.90
份额期末B级份额总额	212,098,093.19

2.2 基金产品说明

投资目标 本基金的投资目标是严格控制投资风险以及追求资产稳定的回报。力争在充分分散风险的前提下,为投资者争取超越市场平均水平的稳定收益。

本基金主要投资于国债、金融债、企业债、短期融资券、可分离债、资产支持证券等固定收益类金融工具。本基金不直接从二级市场上买入股票、权证等权益类资产,但可以参与一级市场新股申购或增发新股,并持有因可转债转股所形成的股票,因所持股票所涉的股权投资因可转债而产生的权证等非固定收益类资产的比例不高于基金资产的20%。持有的现有股票到期日到同一年内以内的政府债券不高于基金资产价值的5%。如出现法律法规或监管机构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。

本基金的收益分配原则如下:

1、本基金基金合同生效之日起5年内,不进行收益分配;法律、法规或监管机关另有规定的,从其规定。

2、本基金转换为上市开放式基金(LOF)后的收益分配原则

(1)本基金的每份基金份额享受同等分配权;

(2)在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为12次,每次收益分配比例不得低于最近一次可供分配利润的10%;

(3)本基金收益分配方式分为现金分红和红利再投资。

场外个人或机构申购的基金份额,投资者可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值自动转为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为现金分红;投资者在不作同销售机构的不同交易账户可选择不同的分红方式,若投资者在某一销售机构交易账户不选择收益分配方式,则按该账户的收益分配方式处理;若基金份额持有人另有选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红。

场内转入、申购和上市交易的基金份额的分红方式为现金分红,投资者不能选择其他的分红方式。具体收益分配方式及相关事项遵循证券交易所与中国证监会登记结算有限责任公司的相关规定。

业绩比较基准 中债综合指数

本基金为债券型基金,属于较低风险的证券投资品种,其预期收益率和预期风险均高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。

风险特征 本基金为债券型基金,属于较低风险的证券投资品种,其预期收益率和预期风险均高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。

下阶段基金的风险收益特征 长信利鑫分级债A 长信利鑫分级债B 高风险,较高收益

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 中国邮政储蓄银行股份有限公司

姓名 周刚 席刚

信息披露义务人 021-61009999 010-68858112

联系人 联系电话 shouyigj@czfund.com.cn hutoa@psbc.com.cn

客户服务电话 4007005566 95880

传真 021-61009800 010-68858120

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址: www.czfund.com

基金半年度报告备置地点 上海市淮海中路68号时代金融中心9楼,北京市西城区金融大街3号A座

§ 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

3.1.1 期间数据和指标 报告期(2014年1月1日至2014年6月30日)

本期已实现收益 10,077,658.50

本期利润 28,003,012.05

加权平均基金份额本期利润 0.0702

本期基金份额净值增长率 10.23%

3.1.2 期末数据和指标 报告期末(2014年6月30日)

期末可供分配基金份额利润 0.0189

期末基金资产净值 371,127,660.65

注:1.本产品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将低于所列数据。

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

单位:人民币元

阶段 份额净值增长 率 份额净值增长 率 相比基准收益 率(%) ①-③ ②-④

过去一个月 4.51% 0.85% 0.73% 0.07% 3.78% 0.78%

过去二个月 7.57% 0.49% 3.28% 0.08% 4.29% 0.41%

过去六个月 10.23% 0.37% 5.82% 0.08% 4.41% 0.29%

过去一年 12.26% 0.33% 2.92% 0.09% 9.34% 0.24%

过去三年 27.58% 0.23% 13.61% 0.08% 13.97% 0.15%

自基金合同生效日起至今日 27.59% 0.23% 13.89% 0.08% 13.7% 0.15%

注:1.本基金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将低于所列数据。

3.2.2 基金份额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

单位:人民币元

阶段 份额净值增长 率 份额净值增长 率 基金净值增长 率(%) ①-② ②-③

过去一个月 4.51% 0.85% 0.73% 0.07% 3.78% 0.78%

过去二个月 7.57% 0.49% 3.28% 0.08% 4.29% 0.41%

过去六个月 10.23% 0.37% 5.82% 0.08% 4.41% 0.29%

过去一年 12.26% 0.33% 2.92% 0.09% 9.34% 0.24%

过去三年 27.58% 0.23% 13.61% 0.08% 13.97% 0.15%

自基金合同生效日起至今日 27.59% 0.23% 13.89% 0.08% 13.7% 0.15%

注:1.本基金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将低于所列数据。

3.2.3 基金份额净值

3.2.3.1 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

单位:人民币元

阶段 份额净值增长 率 份额净值增长 率 基金净值增长 率(%) ①-② ②-③

过去一个月 4.51% 0.85% 0.73% 0.07% 3.78% 0.78%

过去二个月 7.57% 0.49% 3.28% 0.08% 4.29% 0.41%

过去六个月 10.23% 0.37% 5.82% 0.08% 4.41% 0.29%

过去一年 12.26% 0.33% 2.92% 0.09% 9.34% 0.24%

过去三年 27.58% 0.23% 13.61% 0.08% 13.97% 0.15%

自基金合同生效日起至今日 27.59% 0.23% 13.89% 0.08% 13.7% 0.15%

注:1.本基金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将低于所列数据。

3.2.3.2 基金份额净值

3.2.3.3 基金份额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

单位:人民币元

阶段 份额净值增长 率 份额净值增长 率 基金净值增长 率(%) ①-② ②-③

过去一个月 4.51% 0.85% 0.73% 0.07% 3.78% 0.78%

过去二个月 7.57% 0.49% 3.28% 0.08% 4.29% 0.41%

过去六个月 10.23% 0.37% 5.82% 0.08% 4.41% 0.29%

过去一年 12.26% 0.33% 2.92% 0.09% 9.34% 0.24%

过去三年 27.58% 0.23% 13.61% 0.08% 13.97% 0.15%

自基金合同生效日起至今日 27.59% 0.23% 13.89% 0.08% 13.7% 0.15%

注:1.本基金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将低于所列数据。

3.2.3.4 基金份额净值

3.2.3.5 基金份额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

单位:人民币元

阶段 份额净值增长 率 份额净值增长 率 基金净值增长 率(%) ①-② ②-③

过去一个月 4.51% 0.85% 0.73% 0.07% 3.78% 0.78%

过去二个月 7.57% 0.49% 3.28% 0.08% 4.29% 0.41%

过去六个月 10.23% 0.37% 5.82% 0.08% 4.41% 0.29%

过去一年 12.26% 0.33% 2.92% 0.09% 9.34% 0.24%

过去三年 27.58% 0.23% 13.61% 0.08% 13.97% 0.15%

自基金合同生效日起至今日 27.59% 0.23% 13.89% 0.08% 13.7% 0.15%

注:1.本基金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将低于所列数据。

3.2.3.6 基金份额净值</