

信息披露 Disclosure

长信纯债壹号债券型证券投资基金



基金管理人:长信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国邮政储蓄银行股份有限公司
报告送出日期:2014年10月27日

1 重要提示
基金管理人及董事承诺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。

基金管理人承诺以诚信信用、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,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

2 基金产品概况
基金名称:长信纯债壹号债券型证券投资基金
基金代码:519085

Table with 2 columns: Item and Value. Includes details on investment strategy, risk indicators, and management info.

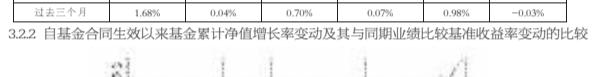
注:本基金管理人于2014年9月23日(00:00起至2014年9月23日17:00止),以通讯方式召开长信纯债壹号债券型证券投资基金持有人大会重新对《关于长信纯债壹号债券型证券投资基金变更投资范围及其他相关事项的决议》进行表决...

3 主要财务指标和基金净值表现
3.1 主要财务指标
单位:人民币元

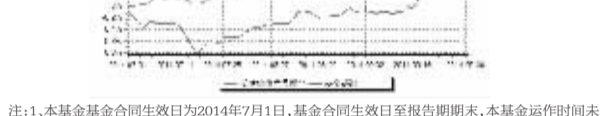
Table with 2 columns: Item and Value. Shows financial metrics like net income, expenses, and net assets.

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...

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



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.本基金基金合同生效日为2014年7月1日,基金合同生效日至本报告期末,本基金运作时间不满一年...

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介
姓名 职务 在本基金的基金经理年限 证券从业年限 说明

Table listing fund managers with their names, titles, and experience.

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。

4.2 管理人对于报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
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》及其他法律法规、《长信纯债壹号债券型证券投资基金基金合同》的规定...

4.3 公平交易专项说明
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...

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析
2014年二季度经济数据呈现预期企稳回升势头,在三季度延续回调,基建投资难以弥补房地产下滑对经济的负面影响...

基金管理人:长信基金管理有限责任公司
基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司
报告送出日期:2014年10月27日

基金管理人及董事承诺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。

基金管理人承诺以诚信信用、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。

2 基金产品概况
基金名称:长信利众分级债券型证券投资基金
基金代码:519085

Table with 2 columns: Item and Value. Includes details on investment strategy, risk indicators, and management info.

注:1.本基金基金合同生效日为2013年2月4日,图示日期为2013年2月4日至2014年9月30日。
2.本基金基金合同生效日,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符合基金合同关于投资范围、资产配置比例和投资限制的有关规定...

3 主要财务指标和基金净值表现
3.1 主要财务指标
单位:人民币元

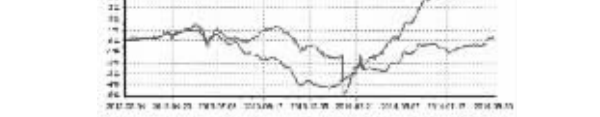
Table with 2 columns: Item and Value. Shows financial metrics for the fund.

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...

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



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.本基金基金合同生效日为2013年2月4日,图示日期为2013年2月4日至2014年9月30日。
2.本基金基金合同生效日,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符合基金合同关于投资范围、资产配置比例和投资限制的有关规定...

等因素影响,债市整体收益率有所下行。8月份,在经济基本面疲弱、经济向好预期降温以及央行加码再贷款、通过公开市场操作稳定利率水平等多重因素的影响下,债券市场收益率曲线平坦化下行。9月,央行投放6000亿SLF,加之对银行季末存款偏离度的严防严控,以及正回购招标利率的主动下行,导致季末债市市场利率不升反降,月末资金紧张得以平稳度过,各品种债券收益率继续大幅下滑。

2014年三季度,我们对原有组合进行了调整,增持了高分利率债、高收益债,以提升基金收益性价比。
4.1.2 2014年四季度市场展望和投资策略
2014年四季度,经济运行乏力依旧,目前的地产、基建、制造业步履蹒跚,经济短期出现明显改善的概率不大,基本面对股市构成一定支撑,牛市的启动尚存。经济“新常态”过程中货币财政政策思路和方式均发生了变化,货币政策稳健增长和风险防范最自由运用的工具,趋势仍是继续保持宽松。近期房地产市场下限调整表明央行试图直接作用于实体经济融资成本,但短期效果待检验;年内通胀压力较低,债周期限难以大幅上行推动通胀水平,展望四季度债市,在资金面维持宽松的环境下预计收益率曲线仍有一定的下行空间。

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,努力关注政策节奏,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。

4.2 报告期末基金资产状况
截至2014年9月30日,本基金份额净值为1.1317元,份额累计净值为1.1317元。本报告期内本基金净值增长率为1.68%,同期业绩比较基准收益率为0.70%。

5 投资组合报告
5.1 报告期末基金资产组合情况

Table showing portfolio composition by asset class and industry.

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

Table showing portfolio composition by bond type.

5.5 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债券投资明细

Table listing top 5 bond holdings.

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。

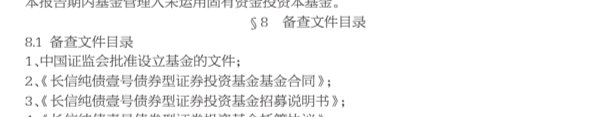
5.11 投资组合报告附注
5.11.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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。

5.11.3 其他资产构成

Table showing other assets.

5.12 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.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.本基金基金合同生效日,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符合基金合同关于投资范围、资产配置比例和投资限制的有关规定...

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介
姓名 职务 在本基金的基金经理年限 证券从业年限 说明

Table listing fund managers for the second fund.

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.本基金基金合同生效日,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符合基金合同关于投资范围、资产配置比例和投资限制的有关规定...

4.2 管理人对于报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
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》及其他法律法规、《长信利众分级债券型证券投资基金基金合同》的规定...

4.3 公平交易专项说明
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...

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析
2014年三季度,美国经济复苏势头在三季度明显减弱,基建投资难以弥补房地产下滑对经济的负面影响...

基金管理人:长信基金管理有限责任公司
基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司
报告送出日期:2014年10月27日

基金管理人及董事承诺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。

基金管理人承诺以诚信信用、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。

2 基金产品概况
基金名称:长信利众分级债券型证券投资基金
基金代码:519085

Table with 2 columns: Item and Value. Includes details on investment strategy, risk indicators, and management info.

注:1.本基金基金合同生效日为2013年2月4日,图示日期为2013年2月4日至2014年9月30日。
2.本基金基金合同生效日,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符合基金合同关于投资范围、资产配置比例和投资限制的有关规定...

长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金



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
报告送出日期:2014年10月27日

1 重要提示
基金管理人及董事承诺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。

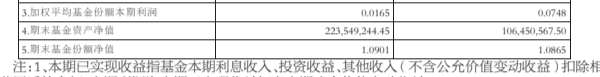
基金管理人承诺以诚信信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。
基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

2 基金产品概况
基金名称:长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金
基金代码:519073

Table with 2 columns: Item and Value. Includes details on investment strategy, risk indicators, and management info.

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...

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



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.本基金基金合同生效日为2013年11月20日,基金合同生效日至本报告期末,本基金运作时间不满一年,图示日期为2013年11月20日至2014年9月30日。

2.本基金基金合同生效日,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符合基金合同关于投资范围、资产配置比例和投资限制的有关规定...

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介
姓名 职务 在本基金的基金经理年限 证券从业年限 说明

Table listing fund managers for the third fund.

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.本基金基金合同生效日,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符合基金合同关于投资范围、资产配置比例和投资限制的有关规定...

4.2 管理人对于报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
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》及其他法律法规、《长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》的规定...

4.3 公平交易专项说明
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...

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析
2014年三季度,美国经济复苏势头在三季度明显减弱,基建投资难以弥补房地产下滑对经济的负面影响...

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:2014年10月27日

基金管理人及董事承诺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。

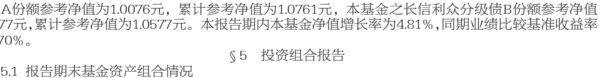
基金管理人承诺以诚信信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。
基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

2 基金产品概况
基金名称:长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金
基金代码:519073

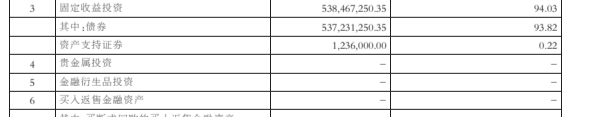
Table with 2 columns: Item and Value. Includes details on investment strategy, risk indicators, and management info.

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...

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



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.本基金基金合同生效日为2013年11月20日,基金合同生效日至本报告期末,本基金运作时间不满一年,图示日期为2013年11月20日至2014年9月30日。

2.本基金基金合同生效日,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符合基金合同关于投资范围、资产配置比例和投资限制的有关规定...

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介
姓名 职务 在本基金的基金经理年限 证券从业年限 说明

Table listing fund managers for the fourth fund.

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.本基金基金合同生效日,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符合基金合同关于投资范围、资产配置比例和投资限制的有关规定...

4.2 管理人对于报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
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》及其他法律法规、《长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》的规定...