

长信纯债壹号债券型证券投资基金

[2014]年度报告摘要

长信基金管理有限公司
基金名称：长信纯债壹号债券型证券投资基金

基金简称：长信纯债壹号债券型证券投资基金

基金代码：510995

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2010年6月28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

报告期末基金份额总额：59,708,694.20份

基金会计年度：不定期

基金管理人：长信基金管理有限责任公司

基金销售代理人：中国邮政储蓄银行股份有限公司

报告期末总资产净值总额：20,996,548.20份

基金合同存续期间：不定期

投资目标：本基金将结合持有的长期控制在三年以内，在追求本金安全和保持基金资产流动性的基础上，力争实现超越比较基准的投资收益。

本基金为中低风险基金，采取稳健型的资产策略，将投资组合的长期控制在三年以内。

投资策略：在严格控制风险、保证本金安全的前提下，通过积极的资产配置，精选具有较好投资价值的债券品种，力求在风险与收益之间取得平衡。

业绩评价基准：本基金的业绩基准，即其预期回报和预期风险高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金，属于风险的债券品种。

风险收益特征：本基金通过投资于债券资产，追求基金资产的长期稳健增值。

投资目标：本基金通过投资于债券资产，追求基金资产的长期稳健增值。

1. 资产配置策略：

2. 债券投资策略：

3. 策略调整策略：

4. 风险管理策略：

5. 息差策略：

6. 资本利得策略：

7. 资本支撑策略：

8. 国债期货的投资策略。

业绩比较基准：中短期国债指数。

风险收益特征：本基金为债券型基金，其预期回报和预期风险高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金，属中低风险的基金品种。

2.2 基金的基本信息

项目 本期 上年度对比期间

2014年1月1日至2014年6月30日 2013年1月1日至2013年12月31日

一、收入 1,042,648.28 9,955,239.96

1. 利息收入 762,238.07 10,438,533.19

其中：存款利息收入 17,598.61 1,752,494.46

债券利息收入 676,113.04 7,867,142.22

资产支持证券利息收入 - -

买入返售金融资产收入 68,526.92 818,890.49

其他利息收入 - -

二、投资收益（损失以“-”号填列） -93,466.80 1,890,564.77

其中：股票投资收益 - -

债券投资收益 -93,466.00 1,890,564.77

资产支持证券投资收益 - -

衍生工具收益 - -

固定收益类投资收益 - -

股权投资收益 - -

三、公允价值变动收益（损失以“-”号填列） 373,890.51 -2,342,846.10

4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） - -

5. 其他收入（损失以“-”号填列） - -

减：二、费用 439,257.87 4,958,077.11

1. 管理人报酬 109,958.70 1,092,302.28

2. 托管费 39,985.01 397,200.76

3. 销售服务费 59,977.48 598,801.27

4. 交易费用 2,367.97 19,565.03

5. 利息支出 34,967.21 2,476,807.75

6. 其他费用 192,001.50 376,400.00

减：三、利润（亏损）（亏损以“-”号填列） 603,390.41 4,997,162.75

减：所得税费用 - -

四、净利润（净亏损）（亏损以“-”号填列） 603,390.41 4,997,162.75

五、期末所有者权益（基金额度） 603,390.41 4,997,162.75

注：1. 本基金的财务报表于2014年6月30日经长信基金管理有限公司审计委员会批准。根据中国证监会《关于进一步规范证券投资基金信息披露工作有关问题的通知》（证监基金字[2007]3号文）的要求，本公司对本报告的内容进行必要的披露，投资人欲了解详细情况，应当阅读基金合同和招募说明书。

2. 本报告期无重大会计政策、会计估计变更以及重大会计差错更正事项。

3. 本报告期无重大会计差错更正事项。

4. 本报告期无关联方交易。

5. 本报告期无重大会计差错更正事项。

6. 本报告期无重大会计差错更正事项。

7. 本报告期无重大会计差错更正事项。

8. 本报告期无重大会计差错更正事项。

9. 本报告期无重大会计差错更正事项。

10. 本报告期无重大会计差错更正事项。

11. 本报告期无重大会计差错更正事项。

12. 本报告期无重大会计差错更正事项。

13. 本报告期无重大会计差错更正事项。

14. 本报告期无重大会计差错更正事项。

15. 本报告期无重大会计差错更正事项。

16. 本报告期无重大会计差错更正事项。

17. 本报告期无重大会计差错更正事项。

18. 本报告期无重大会计差错更正事项。

19. 本报告期无重大会计差错更正事项。

20. 本报告期无重大会计差错更正事项。

21. 本报告期无重大会计差错更正事项。

22. 本报告期无重大会计差错更正事项。

23. 本报告期无重大会计差错更正事项。

24. 本报告期无重大会计差错更正事项。

25. 本报告期无重大会计差错更正事项。

26. 本报告期无重大会计差错更正事项。

27. 本报告期无重大会计差错更正事项。

28. 本报告期无重大会计差错更正事项。

29. 本报告期无重大会计差错更正事项。

30. 本报告期无重大会计差错更正事项。

31. 本报告期无重大会计差错更正事项。

32. 本报告期无重大会计差错更正事项。

33. 本报告期无重大会计差错更正事项。

34. 本报告期无重大会计差错更正事项。

35. 本报告期无重大会计差错更正事项。

36. 本报告期无重大会计差错更正事项。

37. 本报告期无重大会计差错更正事项。

38. 本报告期无重大会计差错更正事项。

39. 本报告期无重大会计差错更正事项。

40. 本报告期无重大会计差错更正事项。

41. 本报告期无重大会计差错更正事项。

42. 本报告期无重大会计差错更正事项。

43. 本报告期无重大会计差错更正事项。

44. 本报告期无重大会计差错更正事项。

45. 本报告期无重大会计差错更正事项。

46. 本报告期无重大会计差错更正事项。

47. 本报告期无重大会计差错更正事项。

48. 本报告期无重大会计差错更正事项。

49. 本报告期无重大会计差错更正事项。

50. 本报告期无重大会计差错更正事项。

51. 本报告期无重大会计差错更正事项。

52. 本报告期无重大会计差错更正事项。

53. 本报告期无重大会计差错更正事项。

54. 本报告期无重大会计差错更正事项。

55. 本报告期无重大会计差错更正事项。

56. 本报告期无重大会计差错更正事项。

57. 本报告期无重大会计差错更正事项。

58. 本报告期无重大会计差错更正事项。

59. 本报告期无重大会计差错更正事项。

60. 本报告期无重大会计差错更正事项。

61. 本报告期无重大会计差错更正事项。

62. 本报告期无重大会计差错更正事项。

63. 本报告期无重大会计差错更正事项。

64. 本报告期无重大会计差错更正事项。

65. 本报告期无重大会计差错更正事项。

66. 本报告期无重大会计差错更正事项。

67. 本报告期无重大会计差错更正事项。

68. 本报告期无重大会计差错更正事项。

69. 本报告期无重大会计差错更正事项。

70. 本报告期无重大会计差错更正事项。

71. 本报告期无重大会计差错更正事项。

72. 本报告期无重大会计差错更正事项。

73. 本报告期无重大会计差错更正事项。

74. 本报告期无重大会计差错更正事项。

75. 本报告期无重大会计差错更正事项。

76. 本报告期无重大会计差错更正事项。

77. 本报告期无重大会计差错更正事项。

78. 本报告期无重大会计差错更正事项。

79. 本报告期无重大会计差错更正事项。

80. 本报告期无重大会计差错更正事项。

81. 本报告期无重大会计差错更正事项。

82. 本报告期无重大会计差错更正事项。

83. 本报告期无重大会计差错更正事项。

84. 本报告期无重大会计差错更正事项。

85. 本报告期无重大会计差错更正事项。

86. 本报告期无重大会计差错更正事项。

87. 本报告期无重大会计差错更正事项。

88. 本报告期无重大会计差错更正事项。

89. 本报告期无重大会计差错更正事项。

90. 本报告期无重大会计差错更正事项。

91. 本报告期无重大会计差错更正事项。

92. 本报告期无重大会计差错更正事项。

93. 本报告期无重大会计差错更正事项。

94. 本报告期无重大会计差错更正事项。

95. 本报告期无重大会计差错更正事项。

96. 本报告期无重大会计差错更正事项。

97. 本报告期无重大会计差错更正事项。

98. 本报告期无重大会计差错更正事项。

99. 本报告期无重大会计差错更正事项。

100. 本报告期无重大会计差错更