

长信利丰债券型证券投资基金

2014 半年度 报告摘要

2014年6月30日

会计主体:长信利丰债券型证券投资基金
报告截止日期:2014年6月30日

资产负债表: 资产 负债和所有者权益
单位:人民币元
2014年6月30日 2013年12月31日

利润表: 营业收入 公允价值变动收益
单位:人民币元
2014年1月1日至2014年6月30日 2013年1月1日至2013年6月30日

所有者权益变动表: 一、收入 二、费用
单位:人民币元
2014年1月1日至2014年6月30日 2013年1月1日至2013年6月30日

基金净值增长表: 阶段 基金份额净值增长率
单位:人民币元
过去一个月 过去三个月 过去六个月 过去一年 过去二年

基金业绩比较基准: 阶段 基金份额净值增长率
单位:人民币元
过去一个月 过去三个月 过去六个月 过去一年 过去二年

基金管理人及基金经理简介: 姓名 职务 任职日期 离任日期 年限
李小明 基金经理 2008年12月29日 - 16年

基金管理人内部控制制度: 内部控制环境 风险评估 控制活动 信息与沟通 内部监督

基金管理人内部控制制度: 基金管理人内部控制制度 基金管理人内部控制制度

关联方名称 与本基金的关系
长信基金管理有限责任公司 基金管理人
中国农业银行股份有限公司(简称“中国农业银行”) 基金托管人

当期发生的基金应支付的托管费
单位:人民币元
2014年1月1日至2014年6月30日 2013年1月1日至2013年6月30日

当期发生的基金应支付的销售服务费
单位:人民币元
2014年1月1日至2014年6月30日 2013年1月1日至2013年6月30日

6.4.1.1 买入返售金融资产
6.4.1.2 卖出回购金融资产
6.4.1.3 买入返售金融资产
6.4.1.4 卖出回购金融资产

注:本项“买入/卖出金额”均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑其交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或20%的股票明细

股票明细表: 序号 股票代码 股票名称 本期累计卖出金额 占期初基金资产净值比例(%)

注:本项“买入/卖出金额”均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑其交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

买入股票成本(成交)总额 222,571,694.50
卖出股票收入(成交)总额 286,937,675.08

注:本项“买入/卖出金额”均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑其交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

债券投资组合表: 序号 债券品种 公允价值 占基金资产净值比例(%)

注:本项“买入/卖出金额”均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑其交易费用。

7.6 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

前五名债券投资明细表: 序号 债券代码 债券名称 数量(张) 公允价值 占基金资产净值比例(%)

注:本项“买入/卖出金额”均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑其交易费用。

7.7 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

前十名资产支持证券投资明细表: 序号 债券代码 债券名称 数量(张) 公允价值 占基金资产净值比例(%)

注:本项“买入/卖出金额”均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑其交易费用。

7.8 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

前五名贵金属投资明细表: 序号 贵金属名称 数量(克) 公允价值 占基金资产净值比例(%)

注:本项“买入/卖出金额”均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑其交易费用。

7.9 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

前五名权证投资明细表: 序号 权证代码 权证名称 数量(张) 公允价值 占基金资产净值比例(%)

注:本项“买入/卖出金额”均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑其交易费用。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况

7.12.2 报告期内本基金投资的前十名股票中,不存在超出基金合同规定选股范围的情况

7.12.3 期末其他各项资产构成

其他各项资产构成表: 序号 名称 金额

注:本项“买入/卖出金额”均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑其交易费用。

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

处于转股期的可转换债券明细表: 序号 债券代码 债券名称 公允价值 占基金资产净值比例(%)

注:本项“买入/卖出金额”均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑其交易费用。

7.12.5 期末持有的流通受限证券的情况

7.12.6 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。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

基金份额持有人结构表: 持有人户数(户) 户均持有的基金份额 机构投资者持有基金份额 个人投资者持有基金份额

注:本项“买入/卖出金额”均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑其交易费用。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金开放式基金份额区间情况

基金管理人从业人员持有基金份额区间表: 项目 持有基金份额总额区间(万份)

注:本项“买入/卖出金额”均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑其交易费用。

9 开放式基金份额变动

基金份额变动表: 基金合同生效日(2008年12月29日)基金份额总额 本期申购基金份额总额

注:本项“买入/卖出金额”均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑其交易费用。

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动

10.3 涉及基金管理人、基金托管人、基金销售机构的诉讼

10.4 基金投资策略的重大改变

10.5 基金管理人聘任会计师事务所情况

10.6 基金管理人、托管人及其他基金服务人员受调查或处罚情况

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

基金租用证券公司交易单元有关情况表: 券商名称 交易单元数量 报告期内基金通过该券商交易金额

注:本项“买入/卖出金额”均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑其交易费用。

注:1.本报告租用证券公司交易单元无变化。

2.有关交易单元的选择标准和程序

根据中国证监会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》(证监基金字[1998]29号)和《关于完善证券投资基金交易单元选择有关问题的通知》(证监基金字[2007]48号)的有关规定,本公司制定了租用证券公司专用交易单元。

(1)选择标准:

a.券商基本面评价(财务状况、经营状况);

b.券商研究机构和评价(报告质量、及时性和数量);

c.券商每日信息评价(及时性和有效性);

d.券商协作表现评价。

(2)选择程序:

首先根据租用证券公司专用交易单元的选择标准形成《券商商务评价表》,然后根据评分高低进行选择基金专用交易单元。