

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:2015年8月27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。本半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2015年8月24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预示其未来表现,投资有风险,投资者作出投资决策前应先仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。本报告期财务报告未经审计。

本报告期自2015年1月1日起至2015年6月30日止。

2.1 基金基本情况

基金简称	长信纯债壹号债券
场内简称	长信CZYH
基金代码	519985
交易场所	深圳证券交易所
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年7月1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	129,671,790.61份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过投资于债券品种,追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	1. 资产配置策略; 2. 类属配置策略; 3. 券种选择策略; 4. 期限策略; 5. 息差策略; 6. 利率策略; 7. 资产支持证券的投资策略; 8. 国债期货的投资策略。
业绩比较基准	中债综合指数
风险收益特征	本基金为债券型基金,其预期收益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,属于中低风险的基金品种。

2.3 基金管理人及基金托管人

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
信息披露负责人	周永刚	尹洪江
联系电话	021-61099999	010-68858112
电子邮箱	zhongg@cxfund.com	buhanong@psc.com
客户服务热线	4007065666	95580
传真	021-61099808	010-68858120

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的互联网网址	www.cxfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	上海南京路中68号时代金融中心27楼,北京市西城区金融大街29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(2015年1月1日至2015年6月30日)
本期已实现收益	2,357,500.50
本期利润	2,951,309.53
加权平均基金份额本期利润	0.0647
本期基金份额净值增长率	7.56%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.2096
期末基金资产净值	162,428,712.04
期末基金份额净值	1.2526

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,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;

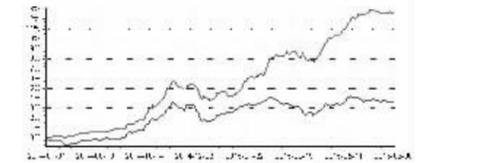
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如,封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.09%	0.08%	-0.08%	0.09%	0.17%	0.03%
过去三个月	4.13%	0.13%	1.33%	0.10%	2.78%	0.03%
过去六个月	7.56%	0.16%	1.28%	0.10%	6.30%	0.06%
过去一年	12.54%	0.14%	3.59%	0.11%	8.95%	0.03%
自基金合同生效起至今(2014年7月1日-2015年6月30日)	12.54%	0.14%	3.59%	0.11%	8.95%	0.03%

3.2.2 自基金合同生效以来基金业绩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,图示日期为2014年7月1日至2015年6月30日。

2.按基金合同规定,本基金自合同生效日起6个月内为建仓期,报告期末已完成建仓但报告期末距建仓结束不满一年;建仓期结束时,本基金各项投资比例已符合基金合同的约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及其管理基金的经验

长信基金管理有限责任公司是经中国证监会证监基金字【2003】63号文批准,由长江证券股份有限公司、上海海欣集团股份有限公司、武汉钢铁股份有限公司共同发起设立。注册资本15亿元人民币。目前股权结构为:长江证券股份有限公司占49%、上海海欣集团股份有限公司占34.33%、武汉钢铁股份有限公司占16.67%。

截至2015年6月30日,本基金管理人共管理22只开放式基金,即长信利息收益货币、长信银利精选股票、长信金利趋势股票、长信增利动态策略股票、长信双利优选混合、长信利丰债券、长信恒利优势股票、长信中证中央企业100指数(LOF)(2015年7月20日起变更为长信医疗大健康混合(LOF))、长信纯债壹号债券、长信量化先锋股票、长信标普100等权重指数(QDII)、长信利鑫分级债、长信内需成长股票、长信可转债债券、长信利众分级债、长信纯债一年定开债券、长信改革红利混合、长信量化中小盘股票、长信新利混合、长信利富债券、长信红利混合及长信广利混合。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限 任期起始日	任期终止日	证券从业年限	说明
张文刚	本基金、长信利鑫分级开放式证券投资基金、长信可转债债券型证券投资基金的基金经理、固定收益部副总监	2014年7月1日	-	21年	高级工商管理硕士,上海财经大学EMBA毕业,具有基金从业资格。曾任浦东证券交易员兼交易员、长江证券有限责任公司资产管理部主管、债券事业部投资经理、固定收益部交易部经理。2004年9月加入长信基金管理有限公司,历任长信利息收益基金交易员、基金经理助理、长信利息收益开放式证券投资基金的基金经理职务。现任固定收益部副总监、本基金、长信利鑫分级开放式证券投资基金、长信利鑫分级债券型证券投资基金的基金经理。

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.本基金基金经理的证券从业年限以基金经理进入证券业务相关机构的工作经历为时间计算标准。

4.2 管理人对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》及其他有关法律法规、基金合同的约定,勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

本基金将继续以取信于市场、取信于社会投资者公众为宗旨,承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产,在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下,努力为基金份额持有人谋求最大利益。

4.3 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,并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时,公司已建立对投资交易行为的监控、分析和评估信息披露加强对公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,除完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合外,其余各投资组合未发生参与交易所证券公开竞价反向交易,不涉及成交较少的单边交易等异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年一季度初,经济基本面仍较疲弱,年末因素逐渐消退以及央行降准降息,重启回购等因素,债券收益率下行,季末债市以调整为主,主要是受到了资金和供给的双重压力,信用债收益率跟随利率率上行。

2015年二季度债券市场恢复升势,债券市场整体收益率出现大幅下行。6月开始,股市火爆和地方政府置换的稳步推进,使得机构风险偏好改变,资金出现分流,债券显示出多空胶着的状态。

2015年上半年,我们主要增加了部分中短期企业债投资比例,提高了组合回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2015年6月30日,本基金份额净值为1.2526元,份额累计净值为1.2526元。本报告期内本基金净值增长率为7.56%,同期业绩比较基准收益率为1.20%。

5. 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2015年三季度,经济金融数据仍显乏力。近期政府稳增长政策仍在不断加码,发改委再批千亿基建项目,国务院常务会议也强调增加财政支出,在解决基建用地和地方政府融资上做努力,2015年下半年经济企稳回升概率有所增加。短期内各项稳增长政策实施落地和地方政府融资工作需要相对宽松的货币环境予以配合,较低的利率水平仍对债市构成支撑。货币政策料将稳中偏松的概率,基本面因素依然有利于债市,市场将在震荡中维持慢牛。我们将努力把握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

长信纯债壹号债券型证券投资基金

2015 半年度 报告摘要

2015年6月30日

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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会监督管理委员会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,长信基金管理有限责任公司(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副总监、固定收益部总监、研究发展部副总监、交易管理部副总监、金融工程部副总监、基金事务部副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证券估值方法,可以申请公司估值工作小组对相关证券进行专项评估,估值决策由与会估值工作小组成员1/2以上多数票通过。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 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规和本基金基金合同约定的基金收益分配原则以及基金实际运作情况,本基金本报告没有进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

5.1 报告期内本基金托管人遵守法律法规情况声明

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》,自2014年7月1日起托管长信纯债壹号债券型证券投资基金(以下称“本基金”)的全部资产。

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规定,诚信、尽责地履行了基金托管人义务,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本半年度报告内容真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本半年度报告中的财务指标、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,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。

5.4 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预示其未来表现,投资有风险,投资者作出投资决策前应先仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

5.5 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预示其未来表现,投资有风险,投资者作出投资决策前应先仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

5.6 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预示其未来表现,投资有风险,投资者作出投资决策前应先仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

5.7 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预示其未来表现,投资有风险,投资者作出投资决策前应先仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

5.8 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预示其未来表现,投资有风险,投资者作出投资决策前应先仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

5.9 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预示其未来表现,投资有风险,投资者作出投资决策前应先仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

5.10 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预示其未来表现,投资有风险,投资者作出投资决策前应先仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

5.11 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预示其未来表现,投资有风险,投资者作出投资决策前应先仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

5.12 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预示其未来表现,投资有风险,投资者作出投资决策前应先仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

5.13 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预示其未来表现,投资有风险,投资者作出投资决策前应先仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

5.14 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预示其未来表现,投资有风险,投资者作出投资决策前应先仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

5.15 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预示其未来表现,投资有风险,投资者作出投资决策前应先仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

5.16 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预示其未来表现,投资有风险,投资者作出投资决策前应先仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

5.17 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预示其未来表现,投资有风险,投资者作出投资决策前应先仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

5.18 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预示其未来表现,投资有风险,投资者作出投资决策前应先仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

5.19 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预示其未来表现,投资有风险,投资者作出投资决策前应先仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

5.20 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预示其未来表现,投资有风险,投资者作出投资决策前应先仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

5.21 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预示其未来表现,投资有风险,投资者作出投资决策前应先仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

5.22 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预示其未来表现,投资有风险,投资者作出投资决策前应先仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

5.23 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预示其未来表现,投资有风险,投资者作出投资决策前应先仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

5.24 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预示其未来表现,投资有风险,投资者作出投资决策前应先仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

5.25 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预示其未来表现,投资有风险,投资者作出投资决策前应先仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

5.26 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预示其未来表现,投资有风险,投资者作出投资决策前应先仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

5.27 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预示其未来表现,投资有风险,投资者作出投资决策前应先仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

5.28 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预示其未来表现,投资有风险,投资者作出投资决策前应先仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

5.29 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预示其未来表现,投资有风险,投资者作出投资决策前应先仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

5.30 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预示其未来表现,投资有风险,投资者作出投资决策前应先仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

5.31 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预示其未来表现,投资有风险,投资者作出投资决策前应先仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

5.32 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预示其未来表现,投资有风险,投资者作出投资决策前应先仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

5.33 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预示其未来表现,投资有风险,投资者作出投资决策前应先仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

5.34 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预示其未来表现,投资有风险,投资者作出投资决策前应先仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

5.35 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预示其未来表现,投资有风险,投资者作出投资决策前应先仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

5.36 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预示其未来表现,投资有风险,投资者作出投资决策前应先仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

5.37 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预示其未来表现,投资有风险,投资者作出投资决策前应先仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

5.38 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预示其未来表现,投资有风险,投资者作出投资决策前应先仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

5.39 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预示其未来表现,投资有风险,投资者作出投资决策前应先仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

5.40 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预示其未来表现,投资有风险,投资者作出投资决策前应先仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

5.41 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预示其未来表现,投资有风险,投资者作出投资决策前应先仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

5.42 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预示其未来表现,投资有风险,投资者作出投资决策前应先仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

5.43 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预示其未来表现,投资有风险,投资者作出投资决策前应先仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

5.44 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预示其未来表现,投资有风险,投资者作出投资决策前应先仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

5.45 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预示其未来表现,投资有风险,投资者作出投资决策前应先仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

5.46 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预示其未来表现,投资有风险,投资者作出投资决策前应先仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

5.47 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预示其未来表现,投资有风险,投资者作出投资决策前应先仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

5.48 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预示其未来表现,投资有风险,投资者作出投资决策前应先仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

5.49 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预示其未来表现,投资有风险,投资者作出投资决策前应先仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

5.50 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预示其未来表现,投资有风险,投资者作出投资决策前应先仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

5.51 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预示其未来表现,投资有风险,投资者作出投资决策前应先仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

截至本报告期末2015年6月30日止,本基金从银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额49,429,725.75元,是以如下债券作为质押:

债券代码	债券名称	到期日期	期末估值价	数量(张)	期末估值总额
011519005	15国债CP005	2015-7-10	99.91	300,000	29,973,000.00
01159280	15年普天SCP002	2015-7-10	100.06	200,000	20,012,000.00
合计				500,000	49,985,000.00

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2015年6月30日止,本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额40,731,985.70元。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况 金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	--	--
1.1	其中:股票	--	--
2	基金投资	--	--
3	固定收益投资	221,808,967.31	87.40
3.1	其中:债券	221,808,967.31	87.40
4	贵金属投资	--	--
5	金融衍生品投资	--	--
6	买入返售金融资产	--	--
6.1	其中:买断式回购的买入返售金融资产	--	--
7	银行存款和结算备付金合计	11,020,108.33	4.34
8	其他各项资产	20,945,784.43	8.25
9	合计	233,774,860.07	100.00

7.2 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。

7.3 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。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期末未买入股票。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期末未卖出股票。

7.4.3 买入股票的成本及支出金额

本基金本报告期末未投资股票。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	--	--
2	央行票据	--	--
3	金融债券	8,197,600.00	5.05
3.1	其中:政策性金融债	8,197,600.00	5.05
4	企业债券	103,384,367.31	63.77
5	企业短期融资券	110,027,100.00	67.74
6	中期票据	--	--
7	可转债	--	--
8	其他	--	--
9	合计	221,808,967.31	136.56

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

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(%)
1	011519005	15国债CP005	300,000	29,973,000.00	18.45
2	011510004	15央行票据004	200,000	20,070,000.00	12.36
4	01159280	15年普天SCP002	200,000	20,012,000.00	12.32
4	04155020	15国债CP002	200,000	20,008,000.00	12.32