

长信金葵纯债一年定期开放债券型证券投资  
基金  
2018 年年度报告摘要

2018 年 12 月 31 日

基金管理人：长信基金管理有限责任公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2019 年 3 月 29 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。

基金托管人招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”，下同）根据本基金基金合同的规定，于 2019 年 3 月 27 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其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 2018 年 12 月 31 日止。

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	长信金葵纯债一年定开债券	
基金主代码	002254	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 1 月 27 日	
基金管理人	长信基金管理有限责任公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	175,083,212.16 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	长信金葵纯债一年定开债券 A	长信金葵纯债一年定开债券 C
下属分级基金的交易代码:	002254	002255
报告期末下属分级基金的份额总额	166,034,780.28 份	9,048,431.88 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为纯债基金，以获取高于业绩比较基准的回报为目标，追求每年较高的绝对回报。
投资策略	<p>本基金在封闭期与开放期采取不同的投资策略。</p> <p>1、封闭期投资策略</p> <p>(1) 资产配置策略</p> <p>(2) 类属配置策略</p> <p>(3) 个券选择策略</p> <p>(4) 骑乘策略</p> <p>(5) 息差策略</p> <p>(6) 利差策略</p> <p>(7) 资产支持证券的投资策略</p> <p>(8) 国债期货的投资策略</p> <p>2、开放期投资策略 开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种，减小基金净值的波动。</p>
业绩比较基准	中证综合债指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，其预期风险与收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

### 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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周永刚
	联系电话	021-61009999
		张燕
		0755-83199084

	电子邮箱	zhouyg@cxfund.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		4007005566	95555
传真		021-61009800	0755—83195201

## 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.cxfund.com.cn
基金年度报告备置地点	上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼、深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2018 年		2017 年		2016 年 1 月 27 日 (基金合同生效日)-2016 年 12 月 31 日	
	长信金葵纯债一年定开债券 A	长信金葵纯债一年定开债券 C	长信金葵纯债一年定开债券 A	长信金葵纯债一年定开债券 C	长信金葵纯债一年定开债券 A	长信金葵纯债一年定开债券 C
本期已实现收益	8,611,956.98	446,334.33	3,410,034.24	174,382.59	28,289,643.95	8,900,518.42
本期利润	14,986,051.04	819,945.58	4,774,836.82	728,488.72	25,301,569.70	7,871,228.46
加权平均基金份额本期利润	0.0873	0.0702	0.0189	0.0151	0.0357	0.0319
本期基金份额净值增长率	8.96%	8.52%	1.66%	1.24%	3.57%	3.19%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末		2017 年末		2016 年末	
	期末可供分配基金份额利润	0.0516	0.0482	0.0133	0.0093	0.0357
期末基金资产净值	180,619,729.41	9,812,936.57	212,701,611.78	29,667,716.65	734,043,146.02	254,853,720.05
期末基金份额净值	1.0878	1.0845	1.0133	1.0093	1.0357	1.0319

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

长信金葵纯债一年定开债券 A

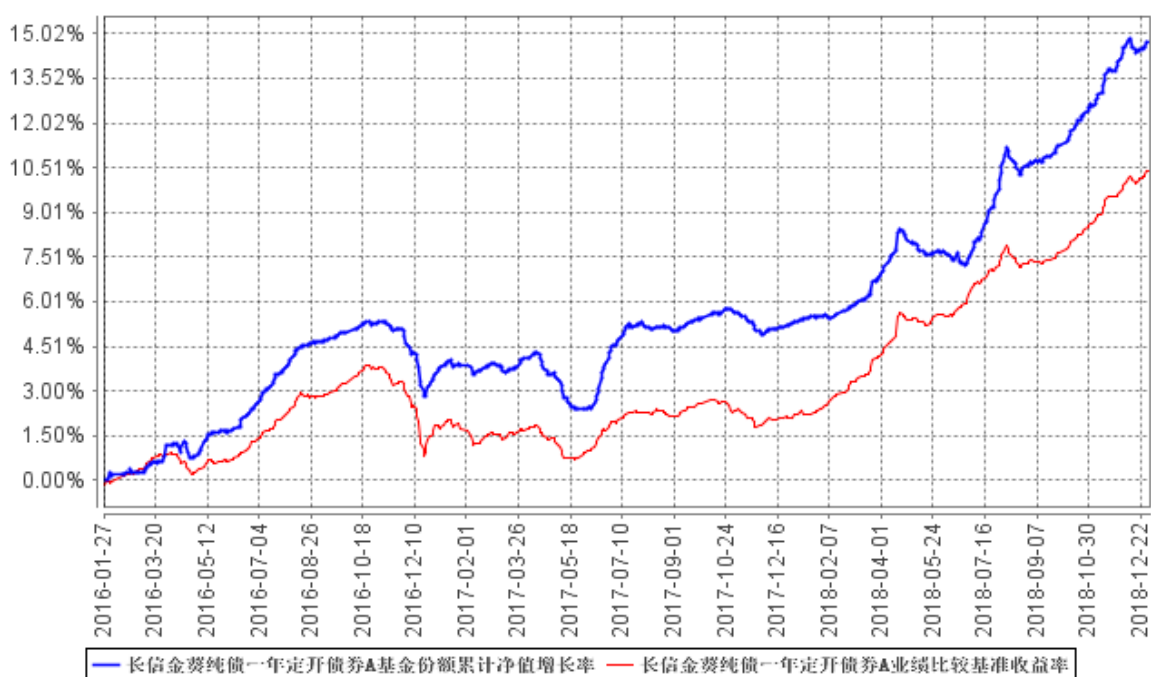
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标	业绩比较基准收益	业绩比较基准收益率标准差	①—③	②—④
----	----------	----------	----------	--------------	-----	-----

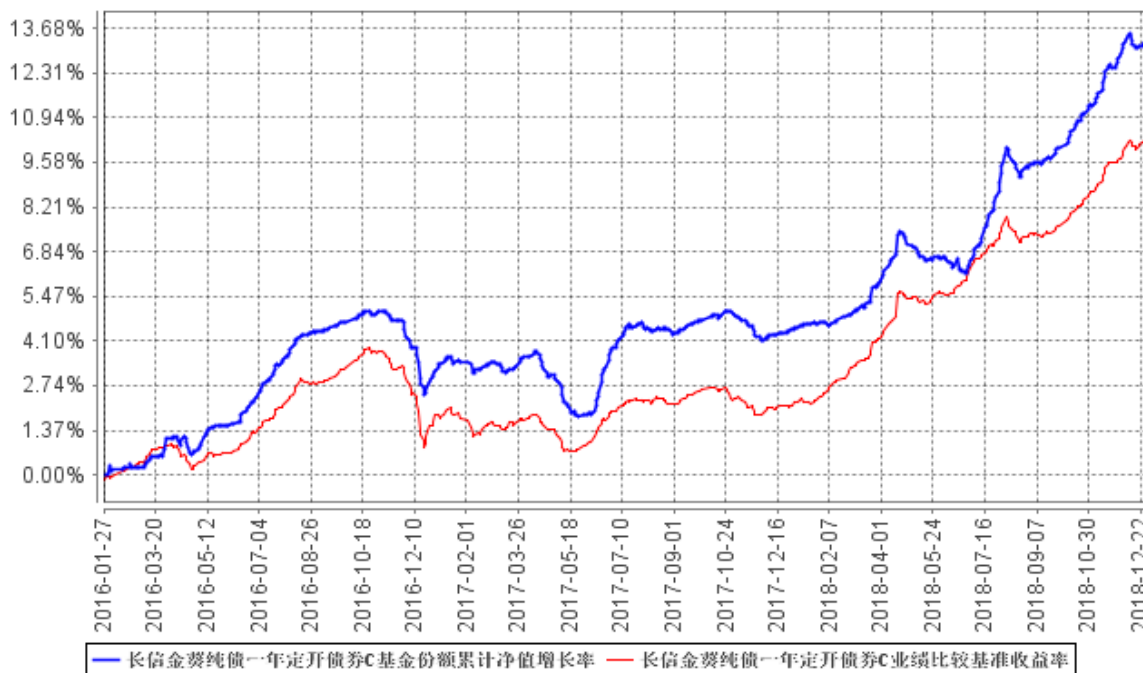
		准差②	率③	④		
过去三个月	3.13%	0.07%	2.57%	0.05%	0.56%	0.02%
过去六个月	6.76%	0.08%	3.93%	0.05%	2.83%	0.03%
过去一年	8.96%	0.08%	8.12%	0.06%	0.84%	0.02%
自基金合同生效起至今	14.72%	0.08%	10.42%	0.07%	4.30%	0.01%

长信金葵纯债一年定开债券 C

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
过去三个月	3.03%	0.07%	2.57%	0.05%	0.46%	0.02%
过去六个月	6.55%	0.08%	3.93%	0.05%	2.62%	0.03%
过去一年	8.52%	0.08%	8.12%	0.06%	0.40%	0.02%
自基金合同生效起至今	13.37%	0.08%	10.42%	0.07%	2.95%	0.01%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

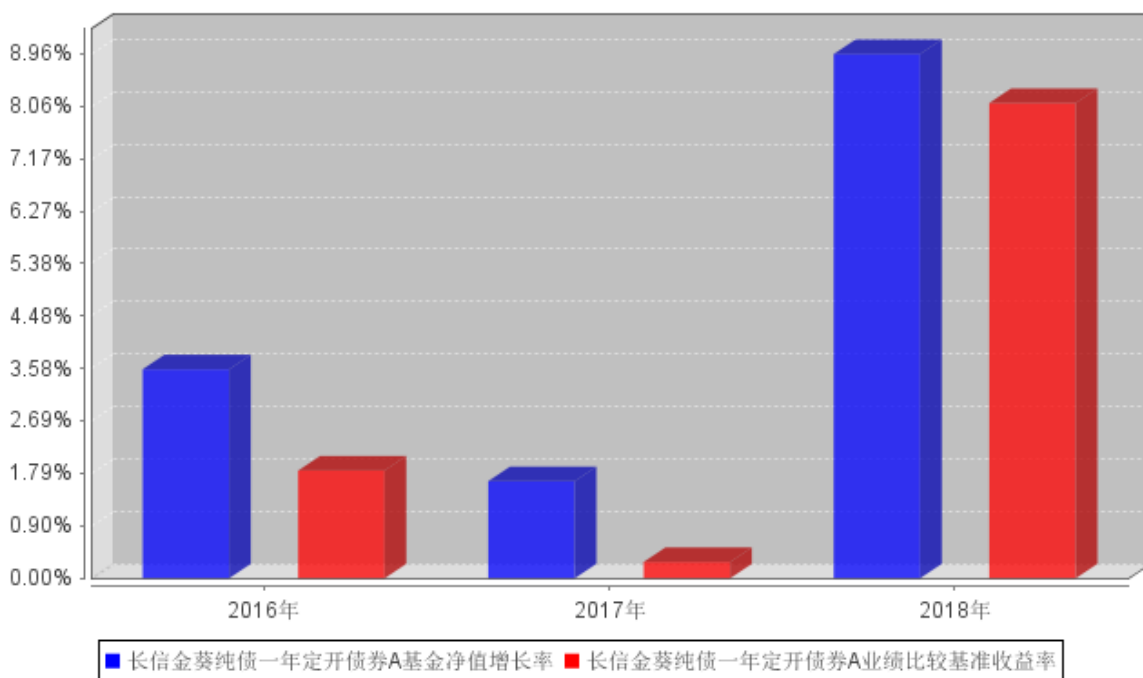


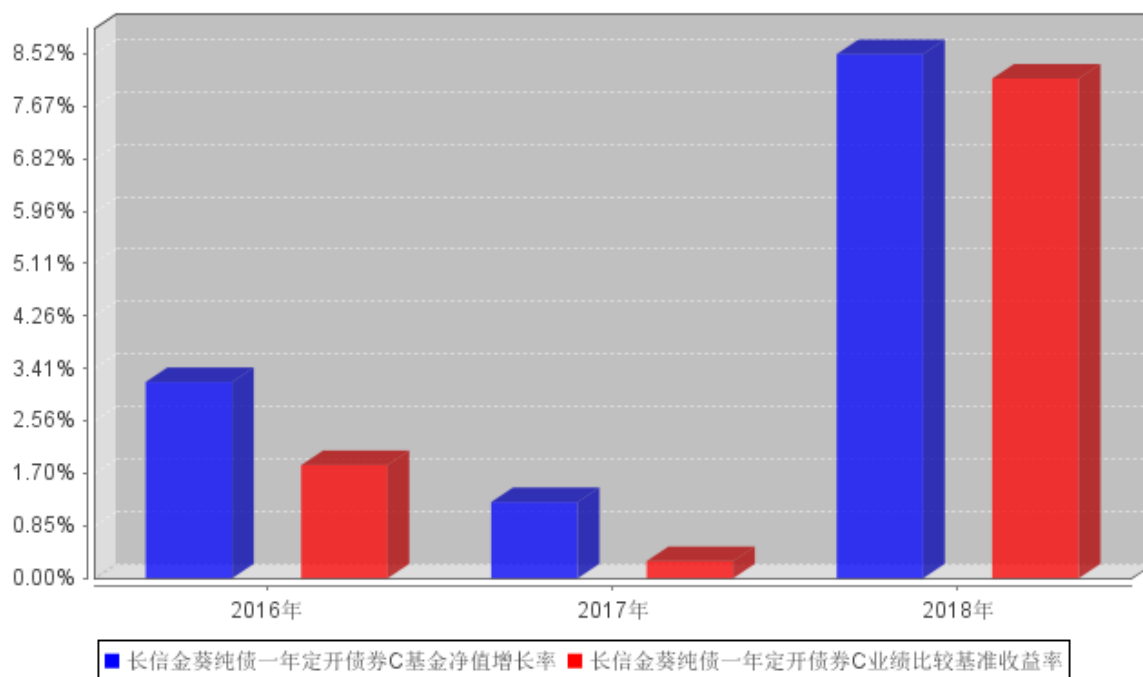


注：1、图示日期为 2016 年 1 月 27 日至 2018 年 12 月 31 日。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内为建仓期。建仓期结束时，本基金的各项投资比例已符合基金合同约定。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较





注：本基金基金合同生效日为 2016 年 1 月 27 日，2016 年净值增长率按当年实际存续期计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2018 年	0.150	3,115,405.68	33,145.14	3,148,550.82	
2017 年	0.390	27,277,362.67	363,558.94	27,640,921.61	
2016 年	-	-	-	-	
合计	0.540	30,392,768.35	396,704.08	30,789,472.43	

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2018 年	0.100	281,785.59	12,172.18	293,957.77	
2017 年	0.350	8,450,939.93	193,448.05	8,644,387.98	
2016 年	-	-	-	-	
合计	0.450	8,732,725.52	205,620.23	8,938,345.75	

注：本基金本报告期的利润分配情况，详见 4.7。



## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 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 1.65 亿元人民币。目前股权结构为：长江证券股份有限公司占 44.55%、上海海欣集团股份有限公司占 31.21%、武汉钢铁有限公司占 15.15%、上海彤胜投资管理中心（有限合伙）占 4.55%、上海彤骏投资管理中心（有限合伙）占 4.54%。

截至 2018 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理 64 只开放式基金，即长信利息收益开放式证券投资基金、长信银利精选混合型证券投资基金、长信金利趋势混合型证券投资基金、长信增利动态策略混合型证券投资基金、长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金、长信利丰债券型证券投资基金、长信恒利优势混合型证券投资基金、长信量化先锋混合型证券投资基金、长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金、长信利鑫债券型证券投资基金 (LOF)、长信内需成长混合型证券投资基金、长信可转债债券型证券投资基金、长信利众债券型证券投资基金 (LOF)、长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信纯债壹号债券型证券投资基金、长信改革红利灵活配置混合型证券投资基金、长信量化中小盘股票型证券投资基金、长信新利灵活配置混合型证券投资基金、长信利富债券型证券投资基金、长信利盈灵活配置混合型证券投资基金、长信利广灵活配置混合型证券投资基金、长信多利灵活配置混合型证券投资基金、长信睿进灵活配置混合型证券投资基金、长信量化多策略股票型证券投资基金、长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)、长信富民纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信富海纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信利保债券型证券投资基金、长信富安纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金 (LOF)、长信金葵纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信富全纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信利泰灵活配置混合型证券投资基金、长信先锐债券型证券投资基金、长信利发债券型证券投资基金、长信富泰纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金、长信富平纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信先利半年定期开放混合型证券投资基金、长信创新驱动股票型证券投资基金、长信稳益纯债债券型证券投资基金、长信利信灵活配置混合型证券投资基金、长信稳健纯债债券型证券投资基金、长信上证港股通指数型发起式证券投资基金、长信纯债半年债券型证券投资基金、长信国防军工量化灵活配置混合型证券投资基金、长信先优债券型证券投资基金、长信稳势纯债债券型证券投资基金、长信中证 500 指数增强型证券投资

基金、长信长金货币市场基金、长信稳通三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金、长信利尚一年定期开放混合型证券投资基金、长信乐信灵活配置混合型证券投资基金、长信全球债券证券投资基金、长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信先机两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、长信消费精选行业量化股票型证券投资基金、长信量化价值精选混合型证券投资基金、长信企业精选两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、长信量化价值驱动混合型证券投资基金、长信价值蓝筹两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、长信稳裕三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信稳进资产配置混合型基金中基金（FOF）。

#### 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（助理） 期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
胡琼予	长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信金葵纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信富安纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信利众债券型证券投资基金（LOF）和长信稳裕三个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理	2018年6月4日	-	6年	经济学硕士，具有基金从业资格。2013年加入长信基金管理有限责任公司，曾任高级债券交易员、投资经理助理和基金经理助理，现任职于固定收益部并担任长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信金葵纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信富安纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信利众债券型证券投资基金（LOF）和长信稳裕三个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。
李小羽	曾任本基金的基金经理	2016年1月27日	2018年7月11日	20年	曾任本基金的基金经理
刘婧	曾任本基金的基金经理	2016年12月12日	2018年2月2日	5年	曾任本基金的基金经理助理

	助理				
胡琼予	曾任本基金的基金经理助理	2017 年 7 月 28 日	2018 年 5 月 22 日	6 年	曾任本基金的基金经理助理

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、基金合同的规定，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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

1、所有投资对象的投资指令必须经由交易部门总监或其授权人审核分配至交易人员执行。进行投资指令分配的人员必须保证投资指令得到公平对待。

2、公司使用的交易执行软件系统必须具备如下功能：

(1) 严格按照时间顺序发送委托指令；

(2) 对于多个投资组合在同一时点就同一证券下达的相同方向的投资指令，并且市价在限价范围内的，系统能够将交易员针对该证券下达的每笔委托自动按照指令数量比例分拆为各投资组合的委托指令。对于不同投资组合针对交易所同一证券的同一方向竞价交易指令，指令数量比例达到 5:1 或以上的，可豁免启动公平交易开关。

3、交易人员对于接收到的交易指令依照价格优先、时间优先的顺序执行。在执行多个投资组合在同一时点就同一证券下达的相同方向的交易所投资指令时，除制度规定的例外指令外，必须开启系统的公平交易开关。

4、对于不同投资组合均进行债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易的

投资对象，交易部门必须严格独立接收各投资组合的投资指令，在申购结果产生前，不得以任何形式向任何人泄露各投资指令的内容，包括指令价格及数量等要素。

5、对于各投资组合以独立账户名义进行申购的投资对象，除需经过公平性审核的例外指令外，申购获配的证券数量由投资管理系统接收各类证券登记结算机构发送的数据进行分配。交易部门根据证券发行人在指定公开披露媒体上披露的申购结果对系统内分配数量进行核准，数量不符的，应当第一时间告知各投资管理部门的总监及监察稽核部总监。对于以公司名义进行申购的投资对象，公司在获配额度确定后，严格按照价格优先的原则在各投资组合间进行分配。申购价格相同的投资组合则根据投资指令的数量按比例进行分配。确因特殊原因不能按照上述原则进行分配的，应启动异常交易识别流程，审核通过的，可以进行相应分配。

#### 4.3.2 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，公司已通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

#### 4.3.3 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公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形，未发现异常交易行为。同时，对本年度同向交易价差进行专项分析，未发现异常情况。

### 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

展望 2019 年，货币政策方面大概率维持稳健、松紧适度。在资金供给方面，财政支出有一定不确定性；预计央行继续在公开市场进行呵护操作，并且继续保持每季度一次的置换式降准改善存款类机构的负债端，同时利用 TMLF 等创新型工具改善公开市场货币工具结构，保持流动性合理充裕，引导企业融资成本下行；在资金需求方面，经济继续呈现低位运行迹象，一季度融资需求或将继续呈现弱势格局，二季度后可能边际企稳，下半年可能开始回升。在央行稳健的货币政策下，资金面预计总体保持宽松局面，资金利率围绕公开市场操作利率窄幅震荡，波动性不大。基本面来看，一季度经济基本面仍存在下行压力，下半年开始可能边际企稳，甚至回升。投资方

面，在地产调控仍未放松，影子银行持续被限制的背景下，宽信用政策效果目前仍然不显著，但处于向好的趋势之中；具体来说，制造业受产能利用率与盈利回落影响，进一步上升空间有限。地产受调控影响，预计投资增速有所回落。投资仅依赖基建势单力薄。出口方面，由于贸易战不确定性及海外经济放缓而承压。消费方面受制于收入增速回落，有下行压力。目前，扩大内需是托底经济的重要支点，财政政策更加积极，稳健的货币政策配合，持续进行企业和个人减税降费改革，进一步激发消费潜力；中央财政加大支出力度，地方政府专项债券加快发行，以支撑基建投资增速对冲经济下行。总体来看，资金面宽松稳定，经济基本面仍差且宽信用见效仍需要一定时间，监管方面态度友善，海外经济放缓，各大央行货币政策或重回宽松，债市今年仍具备一定机会。未来我们将严格控制信用风险，时时关注宽信用效果和市场变化，合理配置各类资产，把握债券市场调整带来的投资机会，为投资者争取更好的组合收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，长信金葵纯债一年定开债券 A 份额净值为 1.0878 元，份额累计净值为 1.1418 元，本报告期内长信金葵纯债一年定开债券 A 净值增长率为 8.96%；长信金葵纯债一年定开债券 C 份额净值为 1.0845 元，份额累计净值为 1.1295 元，本报告期内长信金葵纯债一年定开债券 C 净值增长率为 8.52%。同期业绩比较基准收益率为 8.12%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2019 年，全球下行压力较大，PMI 数据持续新低，美国顶部已过，加息渐缓。国内方面，中国经济下行压力依然存在，基本面需求较弱，基建有托底对冲作用，房地产预计政策仍有定力。货币政策方面预计依然以防控金融风险、维护金融市场稳定为主基调，资金面依然充裕，债券牛市的基本面因素尚存。利率债方面，期限利差还在高位，长端还有一定空间，短端下行空间存在资金利率制约。需要持续关注宽信用政策推进力度和社融增速反弹的幅度与持续性。信用债方面，信用债发行进一步扩容，民营企业信贷投放增加，有利于缓释信用风险，行业龙头企业优先受益。但仍然需要警惕信用资质较弱、存在激进投资扩张以及发生负面事件等的民营企业信用风险。城投债方面，积极地方财政政策加速地方政府债发行，城头企业债信用资质分化将加剧。我们将继续坚持审慎原则，积极寻找确定性高的优质资产，为投资者获取长期、稳健的回报。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据相关法律法规，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

估值政策和估值程序，成立了估值委员会，估值委员会是公司基金估值的主要决策机构，负责拟定公司的估值政策、估值方法及采用的估值程序和技术，健全公司估值决策体系，对公司现有程序和技术进行复核和审阅，当发生了影响估值程序和技术的有效性、适用性的情况及时修订估值程序；估值委员会成员由基金事务部、投资、研究、交易等相关业务部门负责人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，均具备估值业务所需的专业胜任能力。基金经理不直接参与估值决策，估值决策由与会估值工作小组成员 1/2 以上多数票通过。对于估值政策和估值原则，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。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据以及流通受限股票的折扣率。参与估值流程各方不存在任何重大利益冲突。

#### 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规定的基金收益分配原则以及基金实际运作情况，本基金本报告期进行了一次利润分配，具体情况如下：

##### 长信金葵纯债一年定开债券A

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
1	2018 年 2 月 7 日	2018 年 2 月 7 日	0.150	3,115,405.68	33,145.14	3,148,550.82	
合计	-	-	0.150	3,115,405.68	33,145.14	3,148,550.82	

##### 长信金葵纯债一年定开债券 C

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
1	2018 年 2 月 7 日	2018 年 2 月 7 日	0.100	281,785.59	12,172.18	293,957.77	
合计	-	-	0.100	281,785.59	12,172.18	293,957.77	

本基金收益分配原则如下：

- 1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金在每个封闭期内收益至少分配 1 次，每份基

基金份额每次收益分配比例原则上为收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）每份基金份额可供分配利润的 100%；

2、由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各类别基金份额对应的可供分配利润将有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

3、本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的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是现金分红；

4、基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去该类每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

5、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

#### **4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

无。

## §5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

### 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。



## §6 审计报告

本报告期末基金 2018 年度财务报告经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师出具了无保留意见的审计报告（安永华明(2019)审字第 61399737\_B01 号），投资者可以通过年度报告正文查看审计报告全文。

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：长信金葵纯债一年定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	154,376.68	3,302,530.73
结算备付金	4,811,763.50	3,445,070.51
存出保证金	1,497.11	17,765.91
交易性金融资产	290,799,400.00	130,580,373.60
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	290,799,400.00	130,580,373.60
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	101,901,912.85
应收证券清算款	-	-
应收利息	6,276,304.87	3,559,976.17
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	302,043,342.16	242,807,629.77
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2018 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2017 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	111,099,722.50	-
应付证券清算款	17,757.58	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	113,029.61	143,850.06
应付托管费	32,294.16	41,100.03
应付销售服务费	3,328.77	10,063.40
应付交易费用	12,221.04	4,287.85
应交税费	51,853.06	-
应付利息	91,469.46	-

应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	189,000.00	239,000.00
负债合计	111,610,676.18	438,301.34
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	175,083,212.16	239,299,154.77
未分配利润	15,349,453.82	3,070,173.66
所有者权益合计	190,432,665.98	242,369,328.43
负债和所有者权益总计	302,043,342.16	242,807,629.77

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，长信金葵纯债一年定开债券 A 份额净值 1.0878 元，长信金葵纯债一年定开债券 C 份额净值 1.0845 元，基金份额总额为 175,083,212.16 份，其中长信金葵纯债一年定开债券 A 份额 166,034,780.28 份；长信金葵纯债一年定开债券 C 份额 9,048,431.88 份。

## 7.2 利润表

会计主体：长信金葵纯债一年定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	21,544,900.68	10,489,235.73
1.利息收入	13,584,035.02	21,373,805.07
其中：存款利息收入	97,850.19	128,626.00
债券利息收入	12,740,518.03	18,658,111.81
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	745,666.80	2,587,067.26
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	1,213,138.07	-12,865,846.44
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	1,213,138.07	-12,701,896.44
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-163,950.00
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6,747,705.31	1,918,908.71

4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	22.28	62,368.39
<b>减：二、费用</b>	<b>5,738,904.06</b>	<b>4,985,910.19</b>
1. 管理人报酬	1,329,199.78	2,217,501.73
2. 托管费	379,771.37	633,571.87
3. 销售服务费	48,044.01	210,898.27
4. 交易费用	10,264.29	14,285.97
5. 利息支出	3,692,524.31	1,613,779.90
其中：卖出回购金融资产支出	3,692,524.31	1,613,779.90
6. 税金及附加	37,073.86	-
7. 其他费用	242,026.44	295,872.45
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>15,805,996.62</b>	<b>5,503,325.54</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>15,805,996.62</b>	<b>5,503,325.54</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长信金葵纯债一年定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	239,299,154.77	3,070,173.66	242,369,328.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	15,805,996.62	15,805,996.62
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-64,215,942.61	-84,207.87	-64,300,150.48
其中：1. 基金申购款	46,073.68	3.56	46,077.24
2. 基金赎回款	-64,262,016.29	-84,211.43	-64,346,227.72
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基	-	-3,442,508.59	-3,442,508.59

金净值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	175,083,212.16	15,349,453.82	190,432,665.98
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	955,724,067.91	33,172,798.16	988,896,866.07
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	5,503,325.54	5,503,325.54
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-716,424,913.14	679,359.55	-715,745,553.59
其中：1. 基金申购款	702,428.23	-539.35	701,888.88
2. 基金赎回款	-717,127,341.37	679,898.90	-716,447,442.47
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-36,285,309.59	-36,285,309.59
五、期末所有者权益（基金净值）	239,299,154.77	3,070,173.66	242,369,328.43

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 成善栋 _____	_____ 覃波 _____	_____ 孙红辉 _____
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

长信金葵纯债一年定期开放债券型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2015]2773号《关于准予长信金葵纯债一年定期开放债券型证券投资基金注册的批复》的核准，由基金管理人长信基金管理有限公司向社会公开发行募集。基金合同于2016年1月27日生效。首次设立募集规模为955,724,067.91份

基金份额。本基金为契约型，定期开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构为长信基金管理有限责任公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金将基金份额分为 A 类基金份额和 C 类基金份额。本基金的 A 类基金份额在申购时收取申购费，赎回时根据持有期限收取赎回费；C 类基金份额不收取申购费，赎回时根据持有期限收取赎回费，但从该类别基金资产中计提销售服务费。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超级短期融资券、资产支持证券、次级债券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、国债期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。本基金不参与权证、股票等权益类资产投资，同时本基金不参与可转换债券投资。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，其投资比例遵循届时有效法律法规或相关规定。

基金的投资组合比例为：投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，但在每次开放期前三个月、开放期及开放期结束后三个月的期间内，基金投资不受上述比例限制；开放期内，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；在非开放期，本基金不受该比例的限制。

本基金的业绩比较基准为：中证综合债指数收益率。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果和净值变动情况。

### 7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表一致。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

### 7.4.6 税项

#### 7.4.6.1 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服

务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，本基金的基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对本基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从本基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

#### 7.4.6.2 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

#### 7.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

#### 7.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

### 7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
长信基金管理有限责任公司（“长信基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人、基金销售机构
长江证券股份有限公司（“长江证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
上海海欣集团股份有限公司	基金管理人的股东



武汉钢铁股份有限公司	基金管理人的股东（股权转让前的股东）
上海彤胜投资管理中心（有限合伙）	基金管理人的股东
上海彤骏投资管理中心（有限合伙）	基金管理人的股东
上海长江财富资产管理有限公司	基金管理人的子公司
长江期货股份有限公司（原名：长江期货有限公司）（“长江期货”）	基金管理人的股东的子公司
武汉钢铁有限公司	基金管理人的股东（股权转让后的股东）

注：（1）以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

（2）经长信基金管理有限责任公司股东会审议通过，并获中国证券监督管理委员会《关于核准长信基金管理有限责任公司变更股权的批复》（证监许可[2018]1905号），长信基金管理有限责任公司原股东武汉钢铁股份有限公司将其持有的长信基金管理有限责任公司 15.15% 的股权全部转让给武汉钢铁有限公司。长信基金管理有限责任公司 2018 年 12 月 21 日已就股东变更事宜发布公告，股东变更为长江证券股份有限公司、上海海欣集团股份有限公司、武汉钢铁有限公司、上海彤胜投资管理中心（有限合伙）和上海彤骏投资管理中心（有限合伙）。

## 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.8.1.1 股票交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 7.4.8.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例
长江证券	232,874,249.90	100.00%	365,111,713.45	100.00%

#### 7.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	
	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例
长江证券	5,680,015,000.00	100.00%	3,099,900,000.00	100.00%

#### 7.4.8.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

### 7.4.8.2 关联方报酬

#### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,329,199.78	2,217,501.73
其中：支付销售机构的客户维护费	140,795.01	572,692.31

注：支付基金管理人长信基金管理有限责任公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值

0.7%费率确认，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×0.7%/当年天数。

#### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	379,771.37	633,571.87

注：支付基金托管人交通银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.2%的年费率确认，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.2%/当年天数

#### 7.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长信金葵纯债一年定开债券 A	长信金葵纯债一年定开债券 C	合计
招商银行	-	40,201.29	40,201.29
长信基金	-	144.65	144.65
合计	-	40,345.94	40,345.94
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长信金葵纯债一年定开债券 A	长信金葵纯债一年定开债券 C	合计
招商银行	-	155,373.17	155,373.17
长信基金	-	1,788.98	1,788.98
合计	-	157,162.15	157,162.15

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%。销售服务费按照 C 类基金资产净值的 0.40% 年费率计提。计算方法如下： $H = E \times \text{年销售服务费率} \div \text{当年天数}$  H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费 E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

#### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：基金管理人在本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

##### 7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：除基金管理人之外的其他关联方在本年末及上年度末均未持有本基金。

#### 7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	154,376.68	34,864.61	3,302,530.73	90,303.32

注：本基金用于证券交易结算的资金通过本基金托管人的基金托管结算资金专用存款账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息。于 2018 年 12 月 31 日的相关余额在资

产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示（2017 年 12 月 31 日：同）。

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在本报告期及上年度可比期间均未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

#### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期末存放于长江期货的结算备付金金额为人民币 2,278,006.21 元（2017 年：人民币 2,250,782.41 元）。本基金本报告期无通过长江期货买卖国债期货成交额（2017 年：人民币 24,702,450.00 元），当期未发生应支付给长江期货的交易费用（2017 年：人民币 110.51 元），本报告期末无应付长江期货的交易费用余额（2017 年：无）。

#### 7.4.9 期末（2018 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本报告期末未因认购新发/增发证券而持有流通受限证券。

##### 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有股票。

##### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币 24,999,722.50 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
1780045	17 岳阳惠 华债 01	2019 年 1 月 3 日	101.67	100,000	10,167,000.00
180211	18 国开 11	2019 年 1 月 7 日	101.33	150,000	15,199,500.00
合计				250,000	25,366,500.00

###### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 12 月 31 日止，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人民币 86,100,000.00 元，于 2019 年 1 月 2 日、2019 年 1 月 3 日（先后）到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。



## §8 投资组合报告

### 8.1 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	290,799,400.00	96.28
	其中：债券	290,799,400.00	96.28
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	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	4,966,140.18	1.64
8	其他各项资产	6,277,801.98	2.08
9	合计	302,043,342.16	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资港股。

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有股票。

#### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有股票。

### 8.3 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

注：本基金本报告期末未持有股票。

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.4.1 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

注：本基金本报告期内未买入股票。

#### 8.4.2 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

注：本基金本报告期内未卖出股票。

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注：本基金本报告期内未投资股票。

### 8.5 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	30,795,100.00	16.17
	其中：政策性金融债	30,795,100.00	16.17
4	企业债券	188,530,300.00	99.00
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	71,474,000.00	37.53
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	290,799,400.00	152.70

### 8.6 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

金额单位：人民币元

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	180211	18 国开 11	200,000	20,266,000.00	10.64
2	1580013	15 德宏债	200,000	16,458,000.00	8.64
3	112328	16 曲文 01	150,000	14,986,500.00	7.87
4	136725	16 中材 01	150,000	14,922,000.00	7.84
5	136283	16 浙交 01	150,000	14,803,500.00	7.77

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 8.8 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贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

### 8.9 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

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.10.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

### 8.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

### 8.10.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

## 8.11 投资组合报告附注

### 8.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

报告期内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，在报告编制日前一年内也没有受到公开谴责、处罚。

### 8.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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。

### 8.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,497.11
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	6,276,304.87
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,277,801.98

### 8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有股票。



### **8.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
长信金葵纯债一年定开债券 A	115	1,443,780.70	149,977,962.48	90.33%	16,056,817.80	9.67%
长信金葵纯债一年定开债券 C	110	82,258.47	0.00	0.00%	9,048,431.88	100.00%
合计	225	778,147.61	149,977,962.48	85.66%	25,105,249.68	14.34%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	长信金葵纯债一年定开债券 A	0.00	0.00%
	长信金葵纯债一年定开债券 C	0.00	0.00%
	合计	0.00	0.00%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	长信金葵纯债一年定开债券 A	0
	长信金葵纯债一年定开债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	长信金葵纯债一年定开债券 A	0
	长信金葵纯债一年定开债券 C	0
	合计	0



## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长信金葵纯债一年定开 债券 A	长信金葵纯债一年定开 债券 C
基金合同生效日（2016 年 1 月 27 日）基 金份额总额	708,741,576.32	246,982,491.59
本报告期期初基金份额总额	209,903,392.40	29,395,762.37
本报告期期间基金总申购份额	33,298.04	12,775.64
减:本报告期期间基金总赎回份额	43,901,910.16	20,360,106.13
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减 少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	166,034,780.28	9,048,431.88

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期未召开本基金的基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 11.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内自 2018 年 8 月 28 日起，本基金管理人增聘安昀先生为副总经理。

上述重大人事变动情况，本基金管理人已在指定信息披露媒体发布相应的《基金行业高级管理人员变更公告》。

#### 11.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略未改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金未更换会计师事务所；报告期应支付给安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）审计的报酬为人民币 50,000.00 元，该审计机构为本基金提供的审计服务的连续年限为 2 年。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期基金管理人、托管人及其高级管理人员没有受监管部门稽查或处罚的情形。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易	应支付该券商的佣金	备注

		成交金额	占当期股票 成交总额的比 例	佣金	占当期佣金 总量的比例	
长江证券	2	-	-	-	-	-

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例	成交金额	占当期债 券回购 成交总额 的比例	成交金额	占当期权 证 成交总额 的比例
长江证券	232,874,249.90	100.00%	5,680,015,000.00	100.00%	-	-

注：1、本报告期租用证券公司交易单元无变化。

#### 2、专用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》（证监基字<1998>29号）和《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（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的选择标准和程序。

##### （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《券商服务评价表》，然后根据评分高低进行选择基金专用交易单元。

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	149,977,962.48	0.00	0.00	149,977,962.48	85.66%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>1、基金净值大幅波动的风险 单一持有基金比例过高的投资者连续大量赎回，可能会影响基金投资的持续性和稳定性，增加变现成本。同时，按照净值计算尾差处理规则可能引起基金份额净值异常上涨或下跌。</p> <p>2、赎回申请延期办理的风险 单一持有基金比例过高的投资者大额赎回后可能触发本基金巨额赎回条件，导致同期中小投资者小额赎回面临部分延期办理的情况。</p> <p>3、基金投资策略难以实现的风险 单一持有基金比例过高的投资者大额赎回后，可能引起基金资产总净值显著降低，从而使基金在投资时受到限制，导致基金投资策略难以实现。</p>							

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：本基金本报告期未发生影响投资者决策的其他重要信息。

长信基金管理有限责任公司

2019 年 3 月 29 日