

长信纯债壹号债券型证券投资基金 2019 年半年度报告摘要

2019 年 6 月 30 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

送出日期：2019 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基金的规定，于 2019 年 8 月 26 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 2019 年 6 月 30 日止。

§2 基金简介

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	
基金主代码	519985	
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	744,554,784.52 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	长信纯债壹号债券 A	长信纯债壹号债券 C
下属分级基金场内简称:	CXCZYHA	-
下属分级基金的交易代码:	519985	004220
报告期末下属分级基金的份额总额	339,984,450.57 份	404,570,333.95 份

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、个券选择策略； 4、骑乘策略； 5、息差策略； 6、利差策略； 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，属于低风险的基金品种。

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	中国邮政储蓄银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周永刚
	联系电话	021-61009999
	电子邮箱	zhouyong@cxfund.com.cn
客户服务电话	4007005566	95580
传真	021-61009800	010-68858120

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.cxfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼、北京市西城区金融大街 3 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

基金级别	长信纯债壹号债券 A	长信纯债壹号债券 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	15,805,831.87	16,739,452.34
本期利润	8,233,196.91	8,422,042.15
加权平均基金份额本期利润	0.0213	0.0187
本期基金份额净值增长率	1.93%	1.61%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)	
期末可供分配基金份额利润	0.1260	0.0869
期末基金资产净值	411,001,285.12	451,320,715.91
期末基金份额净值	1.2089	1.1156

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

长信纯债壹号债券 A

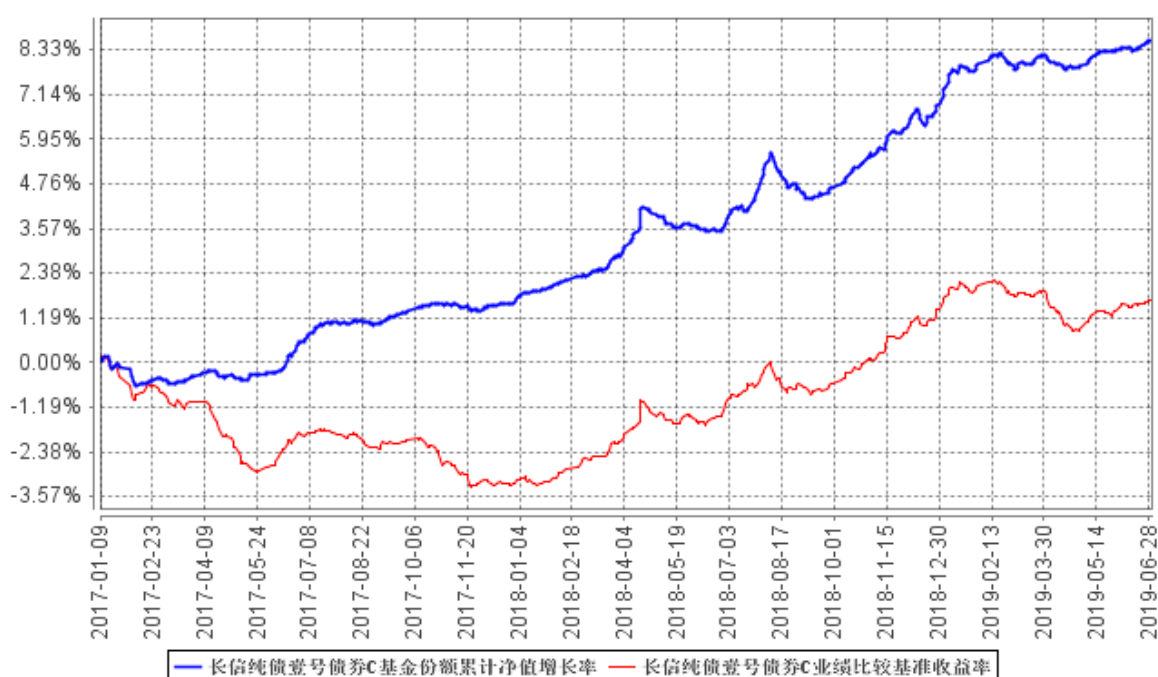
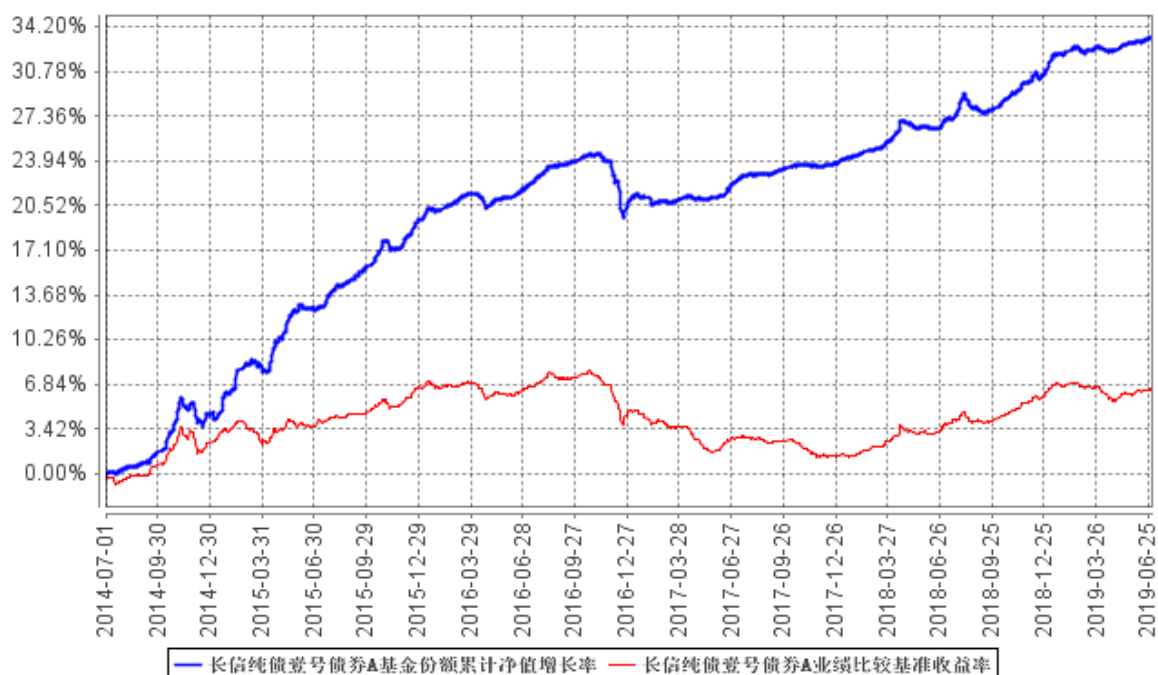
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.32%	0.02%	0.28%	0.03%	0.04%	-0.01%
过去三个月	0.51%	0.03%	-0.24%	0.06%	0.75%	-0.03%
过去六个月	1.93%	0.05%	0.24%	0.06%	1.69%	-0.01%
过去一年	5.34%	0.06%	2.82%	0.06%	2.52%	0.00%
过去三年	9.60%	0.07%	0.03%	0.08%	9.57%	-0.01%
自基金合同生效起至今	33.39%	0.09%	6.47%	0.08%	26.92%	0.01%

长信纯债壹号债券 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
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

过去一个月	0.24%	0.02%	0.28%	0.03%	-0.04%	-0.01%
过去三个月	0.35%	0.03%	-0.24%	0.06%	0.59%	-0.03%
过去六个月	1.61%	0.05%	0.24%	0.06%	1.37%	-0.01%
过去一年	4.71%	0.06%	2.82%	0.06%	1.89%	0.00%
自份额增加日起至今	8.59%	0.05%	1.67%	0.07%	6.92%	-0.02%

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、基金管理人自 2017 年 1 月 9 日起对长信纯债壹号债券基金进行份额分类，原有基金份额

为 A 类份额，增设 C 类份额。

2、长信纯债壹号债券 A 图示日期为 2014 年 7 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日，长信纯债壹号债券 C 图示日期为 2017 年 1 月 9 日（份额增加日）至 2019 年 6 月 30 日。

3、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。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 2019 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 65 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、长信长金通货币市场基金、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）、长信价值优选混合型证券投资基金、长信利率债债券型证券投资基金、长信沪深 300 指数增强型证券投资基金、长信富安纯债半年定期开放债券型证券投资基金、长信合利混合型证券投资基金。

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		
张文琍	长信纯债壹号债券型证券投资基金、长信利鑫债券型证券投资基金（LOF）、长信利息收益开放式证券投资基金、长信富平纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信稳益纯债债券型证券投资基金、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、长信稳势纯债债券型证券投资基金和长信长金通货币市场基金的基金经理、固定收益部总监	2014 年 7 月 1 日	-	25 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。曾任湖北证券公司交易一部交易员、长江证券有限责任公司资产管理事业部主管、债券事业总部投资部经理、固定收益总部交易部经理。2004 年 9 月加入长信基金管理有限责任公司，历任长信利息收益开放式证券投资基金交易员、基金经理助理、长信利息收益开放式证券投资基金、长信中短债证券投资基金基金经理职务。现任固定收益部总监、长信纯债壹号债券型证券投资基金、长信利鑫债券型证券投资基金（LOF）、长信利息收益开放式证券投资基金、长信富平纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信稳益纯债债券型证券投资基金、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、长信稳势纯债债券型证券投资基金和长信长金通货币市场基金的基金经理。
--	--	--	--	--	--

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合规守信情况的说明

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。

4.3.2 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。

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

2019 年初以来债券收益率先上后下，上行主要受经济数据回升、货币政策预期收紧影响；4 月后中旬政治局会议再提“去杠杆”，经济基本面和政策出现边际变化，货币政策进入观察期，或有边际收紧的迹象，债券收益率先快速上行后略有下行；但 5 月初的贸易战恶化和 5 月底的包商银行接管事件，再次扭转货币政策边际收紧的趋向，宽松边际再次加码。市场表现为短端资金利率创新低，但收益率曲线长端利率部分波动不大。

开年来，我们根据市场变化，适当调整了部分券种，降低了利率债和部分信用债仓位，加大了灵活操作的力度。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2019 年 6 月 30 日，本基金 A 类份额净值为 1.2089 元，累计份额净值为 1.4589 元；本基金 C 类份额净值为 1.1156 元，累计份额净值为 1.4356 元。本报告期内本基金 A 净值增长率为 1.93%，同期业绩比较基准收益率为 0.24%；本基金 C 类份额净值增长率为 1.61%，同期业绩比较基准收益率为 0.24%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度，在全球经济共振下行的背景下，中国经济增长小幅下行概率较大，但总体上仍然以稳为主。同时，货币政策会随着经济下行而小幅放松，其着力点也在于总量上的稳，用结构性的精准滴灌代替传统的总量型大水漫灌。地产周期回归下总需求边际承压，财政政策支出端再次发力，货币政策和流动性环境宽松周期回归，流动性分层扰动仍在，贸易谈判存在较大不确定性，趋势性利好下存在债市行情，利率交易空间仍在，但受到相对位置限制。需高度关注“预期差”带来的市场交易机会。

我们将继续秉承谨慎原则，加强组合的流动性管理，加大对信用风险的审慎判断。适度调整组合久期，密切关注经济走势和政策动向，紧跟组合规模变动进行资产配置，争取在流动安全的前提下，为投资者获取更好的收益。

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，本基金本报告期没有进行利润分配。本基金收益分配原则如下：

1、基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式（指将现金红利按除息日除权后的基金份额净值为计算基准自动转为相应类别的基金份额进行再投资），基金份额持有人可选择现金方式或红利再投资方式；若基金份额持有人事先未做出选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；若基金份额持有人选择红利再投资，红利再投资的份额免收申购费用；

2、同一类别每一基金份额享有同等分配权；

3、收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记结算机构可将投资者的现金红利按除息日除权后的基金份额净值自动转为基金份额；

4、在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益每年最多分配 12 次，每次收益分配最低比例不得低于收益分配基准日可供分配利润的 50%，若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；

5、基金收益分配基准日的各类基金份额的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配净额后不能低于面值；

6、分红权益登记日申请申购的基金份额不享受当次分红，分红权益登记日申请赎回的基金份额享受当次分红；

7、基金红利发放日距离收益分配基准日（即期末可供分配利润计算截至日）的时间不得超

过 15 个工作日。

8、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

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》，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。

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，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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，本托管人依据国家相关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为。

本报告期内，本基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由长信基金管理有限责任公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：长信纯债壹号债券型证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	1,501,959.78	9,136,127.51
结算备付金	32,375.28	227,506.35
存出保证金	38,061.38	3,294.24
交易性金融资产	1,027,261,070.00	1,292,729,990.00
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	1,027,261,070.00	1,292,729,990.00
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	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	14,845,842.63	27,768,555.64
应收股利	-	-
应收申购款	283,434.40	505,782.41
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,043,962,743.47	1,330,371,256.15
负债和所有者权益	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
负债：		
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	179,229,054.65	267,965,660.55
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	990,722.63	671,467.38
应付管理人报酬	557,811.79	615,829.02
应付托管费	159,374.78	175,951.14
应付销售服务费	151,924.72	192,258.03
应付交易费用	19,127.61	18,773.61
应交税费	227,714.09	373,513.18

应付利息	102,979.92	360,369.92
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	202,032.25	351,044.88
负债合计	181,640,742.44	270,724,867.71
所有者权益：		
实收基金	744,554,784.52	931,954,663.45
未分配利润	117,767,216.51	127,691,724.99
所有者权益合计	862,322,001.03	1,059,646,388.44
负债和所有者权益总计	1,043,962,743.47	1,330,371,256.15

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，长信纯债壹号债券 A 份额净值 1.2089 元，长信纯债壹号债券 C 份额净值 1.1156 元，基金份额总额为 744,554,784.52 份，其中长信纯债壹号债券 A 份额 339,984,450.57 份；长信纯债壹号债券 C 份额 404,570,333.95 份。

6.2 利润表

会计主体：长信纯债壹号债券型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入	24,390,353.32	36,335,134.87
1.利息收入	24,547,733.50	36,672,248.56
其中：存款利息收入	63,945.57	121,407.18
债券利息收入	24,152,386.52	35,389,232.02
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	331,401.41	1,161,609.36
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	15,229,496.74	-3,552,887.30
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	15,229,496.74	-3,552,887.30
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-15,890,045.15	2,934,305.21
4.汇兑收益（损失以“-”号填	-	-

列)		
5.其他收入（损失以“-”号填列）	503,168.23	281,468.40
减：二、费用	7,735,114.26	11,358,187.66
1. 管理人报酬	3,349,205.25	4,355,887.34
2. 托管费	956,915.78	1,244,539.28
3. 销售服务费	996,218.57	1,328,754.54
4. 交易费用	17,997.73	28,242.97
5. 利息支出	2,239,875.50	4,150,058.65
其中：卖出回购金融资产支出	2,239,875.50	4,150,058.65
6. 税金及附加	65,288.01	113,091.95
7. 其他费用	109,613.42	137,612.93
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	16,655,239.06	24,976,947.21
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	16,655,239.06	24,976,947.21

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长信纯债壹号债券型证券投资基金

本报告期：2019年1月1日至2019年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30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）	931,954,663.45	127,691,724.99	1,059,646,388.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	16,655,239.06	16,655,239.06
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）	-187,399,878.93	-26,579,747.54	-213,979,626.47
其中：1.基金申购款	449,768,670.38	80,981,721.69	530,750,392.07
2.基金赎回款	-637,168,549.31	-107,561,469.23	-744,730,018.54
四、本期向基金份额	-	0.00	-

持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	744,554,784.52	117,767,216.51	862,322,001.03
项目	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30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）	1,108,275,826.71	82,678,505.62	1,190,954,332.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	24,976,947.21	24,976,947.21
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）	50,326,931.15	19,148,193.94	69,475,125.09
其中：1.基金申购款	659,644,932.26	73,748,138.21	733,393,070.47
2.基金赎回款	-609,318,001.11	-54,599,944.27	-663,917,945.38
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）	-	0.00	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,158,602,757.86	126,803,646.77	1,285,406,404.63

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

长信纯债壹号债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)由长信中短债证券投资基金(以下

简称“长信中短债债券基金”)转型而成。长信中短债债券基金系由基金管理人长信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《长信中短债证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规的规定,经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)以证监许可[2010]481号文批准公开募集,于2010年6月28日募集成立。本基金为契约型开放式基金,存续期限为不定期,首次设立募集基金份额为2,234,260,528.19份,经上海众华沪银会计师事务所验证。长信中短债债券基金基金管理人为长信基金管理有限责任公司,基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。

长信中短债债券基金于2014年5月23日至2014年6月2日止期间以通讯方式召开了基金份额持有人大会,大会审议了《关于长信中短债证券投资基金变更投资范围及其他相关事项的议案》,并由参加大会的基金份额持有人及代理人对本次会议议案表决通过,决议于2014年7月1日生效。长信中短债债券基金名称变更为“长信纯债壹号债券型证券投资基金”,修订后的《长信纯债壹号债券型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)于2014年7月1日生效。本基金的基金管理人和基金托管人保持不变。

根据2017年1月4日发布的《长信基金管理有限责任公司关于长信纯债壹号债券型证券投资基金增设C类基金份额相关事项的公告》,从2017年1月9日起,本基金增设C类份额(以下简称“长信纯债壹号债券C”),长信纯债壹号债券C的年销售服务费率为0.40%。本基金分类后,原有基金份额将自动划归为本基金A类基金份额(以下简称“长信纯债壹号债券A”),长信纯债壹号债券A不收取销售服务费。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、截至报告期末最新公告的基金合同及《长信纯债壹号债券型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的国债、金融债、公司债、企业债、政府机构债、央行票据、短期融资券、超级短期融资券、资产支持证券、次级债券、债券回购等固定收益品种,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、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%。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)以及到期日在1年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。如出现法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为:中债综合指数。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)以及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,同时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发布的若干基金行业实务操作。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.4.1 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一致的说明

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。

6.4.4.2 差错更正的说明

本基金本报告期内无需说明的重大会计差错更正。

6.4.5 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140号《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》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作,本基金同类型基金涉及的主要税项请参见下文,本基金本期依法适用相关条款:

1) 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、债券免征增值税;2018年1月1日起,公开募集证券投资基金运营过程中发生的其他增值税应税行为,以基金管理人为增值税纳税人,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。

2) 对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖债券的差价收入、债券的利息收入及其他收入,暂不缴纳企业所得税。

3) 对基金取得的债券利息收入,由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的

个人所得税，暂不缴纳企业所得税。

6.4.6 关联方关系

6.4.6.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方无变化。

6.4.6.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
长信基金管理有限责任公司(以下简称“长信基金”)	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
中国邮政储蓄银行股份有限公司(以下简称“中国邮储银行”)	基金托管人、基金销售机构
长江证券股份有限公司(以下简称“长江证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构

6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.7.1.1 股票交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.7.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30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	268,550,010.96	93.02%	326,218,646.19	82.96%

6.4.7.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月 30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30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	1,260,000,000.00	100.00%	1,943,500,000.00	87.09%
------	------------------	---------	------------------	--------

6.4.7.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.7.1.5 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付关联方交易单元的佣金。

6.4.7.2 关联方报酬

6.4.7.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,349,205.25	4,355,887.34
其中：支付销售机构的客户维护费	1,087,715.13	1,688,769.67

注：支付基金管理人长信基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.70% 的年费率确认，逐日累计至每月月底，按月支付。

计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×0.70%/当年天数

6.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	956,915.78	1,244,539.28

注：支付基金托管人中国邮储银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.20% 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×0.20%/当年天数

6.4.7.2.3 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
	2019年1月1日至2019年6月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费

	长信纯债壹号债券 A	长信纯债壹号债券 C	合计
长信基金	-	129,197.95	129,197.95
合计	-	129,197.95	129,197.95
获得销售服务费的 各关联方名称	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长信纯债壹号债券 A	长信纯债壹号债券 C	合计
	长信基金	-	53,824.54
合计	-	53,824.54	53,824.54

注：根据基金合同的规定，长信纯债壹号债券 A 不收取销售服务费，长信纯债壹号债券 C 的销售服务费按前一日基金资产净值×0.40%的年费率来计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：长信纯债壹号债券 C 的日销售服务费=前一日长信纯债壹号债券 C 资产净值×0.40%÷当年天数。

6.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金在本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过银行间同业市场进行债券(含回购)交易。

6.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.7.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

注：本报告期及上年度可比期间基金管理人均未运用自有资金投资本基金。

6.4.7.4.2 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：本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未持有本基金。

6.4.7.5 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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国邮政银行	1,501,959.78	41,789.07	27,062,333.28	94,809.21

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2019年6月30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（2018年12月31日：同）

6.4.7.6 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由关联方承销的证券。

6.4.7.7 其他关联交易事项的说明

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

6.4.8 期末（2019 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券**6.4.8.1 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。

6.4.8.2 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暂时停牌等流通受限股票。

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 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为 150,229,054.65 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
101759023	17 中化工 MTN001	2019 年 7 月 5 日	101.44	100,000	10,144,000.00
101764045	17 上海大众 MTN002	2019 年 7 月 5 日	102.31	17,000	1,739,270.00
011901146	19 首钢 SCP006	2019 年 7 月 1 日	100.15	200,000	20,030,000.00
011901162	19 安琪酵母 SCP001	2019 年 7 月 1 日	100.23	300,000	30,069,000.00
101772011	17 江阴公 MTN001	2019 年 7 月 1 日	102.18	100,000	10,218,000.00
011900414	19 桐乡城投 SCP002	2019 年 7 月 8 日	100.07	268,000	26,818,760.00
011900401	19 冀东水泥 SCP001	2019 年 7 月 11 日	100.13	200,000	20,026,000.00
101800385	18 湖州城投 MTN001	2019 年 7 月 11 日	104.03	200,000	20,806,000.00
101800177	18 萧山钱江 MTN001	2019 年 7 月 1 日	103.58	200,000	20,716,000.00

合计				1,585,000	160,567,030.00
----	--	--	--	-----------	----------------

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2019 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为 29,000,000.00 元，于 2019 年 7 月 15 日到期。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。

§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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,027,261,070.00	98.40
	其中：债券	1,027,261,070.00	98.40
	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	1,534,335.06	0.15
8	其他各项资产	15,167,338.41	1.45
9	合计	1,043,962,743.47	100.00

注：本基金本报告期末未通过港股通交易机制投资港股。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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。

7.2.2 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。

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

注：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

注：本基金本报告期内未买入股票。

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

注：本基金本报告期内未卖出股票。

7.4.3 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。

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	141,897,000.00	16.46
	其中：政策性金融债	141,897,000.00	16.46
4	企业债券	302,253,070.00	35.05
5	企业短期融资券	260,253,000.00	30.18
6	中期票据	322,858,000.00	37.44
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,027,261,070.00	119.13

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

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	180208	18 国开 08	800,000	81,408,000.00	9.44
2	143623	18 粤电 01	500,000	51,030,000.00	5.92
3	1380032	13 海控债	500,000	50,865,000.00	5.90
4	180202	18 国开 02	500,000	50,560,000.00	5.86
5	011901153	19 开滦 SCP002	400,000	40,044,000.00	4.64

7.7 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。

7.8 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。

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

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 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持有国债期货。

7.10.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.11.3 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	38,061.38
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	14,845,842.63
5	应收申购款	283,434.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,167,338.41

7.11.4 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。

7.11.5 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。

7.11.6 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。

§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

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
长信纯债壹号债券 A	13,473	25,234.50	297,926,949.22	87.63%	42,057,501.35	12.37%
长信纯债壹号债券 C	50,507	8,010.18	69,558,308.11	17.19%	335,012,025.84	82.81%
合计	63,980	11,637.31	367,485,257.33	49.36%	377,069,527.19	50.64%

8.2 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	长信纯债壹号债券 A	-	-
	长信纯债壹号债券 C	2,495.42	0.00%
	合计	2,495.42	0.00%

8.3 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	长信纯债壹号债券 A	0
	长信纯债壹号债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	长信纯债壹号债券 A	0
	长信纯债壹号债券 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长信纯债壹号债券 A	长信纯债壹号债券 C
基金合同生效日（2014 年 7 月 1 日）基金份额总额	59,708,694.30	-
本报告期期初基金份额总额	413,307,480.63	518,647,182.82
本报告期期间基金总申购份额	348,526,505.21	101,242,165.17
减：本报告期期间基金总赎回份额	421,849,535.27	215,319,014.04
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	339,984,450.57	404,570,333.95

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 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

10.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内自 2019 年 3 月 2 日起，李小羽先生不再担任本基金管理人的副总经理。

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公告。

10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

10.3 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。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金未改聘会计师事务所。

10.6 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-

10.7.2 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	268,550,010.96	93.02%	1,260,000,000.00	100.00%	-	-
广发证券	20,158,666.16	6.98%	-	-	-	-

注：1、本期租用证券公司交易单元的变更情况

本报告期内本基金租用证券公司交易单元没有变更。

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：

- 1) 券商基本面评价（财务状况、经营状况）；
- 2) 券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）；
- 3) 券商每日信息评价（及时性和有效性）；
- 4) 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。

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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

注：本基金本报告期内未有单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 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 8 月 27 日