

# 长信纯债半年债券型证券投资基金 2019 年半年度报告

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：中国民生银行股份有限公司

送出日期：2019 年 8 月 27 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会及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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同的规定，于 2019 年 8 月 23 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。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§2 基金简介</b>	<b>6</b>
2.1 基金基本情况	6
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	8
<b>§4 管理人报告</b>	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
<b>§5 托管人报告</b>	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>17</b>
6.1 资产负债表	17
6.2 利润表	18
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	19

6.4 报表附注 .....	20
<b>§7 投资组合报告 .....</b>	<b>38</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	38
7.2 期末按行业分类的股票投资组合 .....	38
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	39
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 .....	39
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细 .....	39
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 .....	39
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 .....	39
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	40
7.11 投资组合报告附注 .....	40
<b>§8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>42</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	42
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	42
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 .....	42
<b>§9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>43</b>
<b>§10 重大事件揭示 .....</b>	<b>44</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	44
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 .....	44
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	44
10.4 基金投资策略的改变 .....	44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	44
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 .....	44
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	44
10.8 其他重大事件 .....	46
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>49</b>
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 .....	49
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	49

<b>§12 备查文件目录 .....</b>	<b>50</b>
12.1 备查文件目录 .....	50
12.2 存放地点 .....	50
12.3 查阅方式 .....	50

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	长信纯债半年债券型证券投资基金	
基金简称	长信纯债半年债券	
基金主代码	003126	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 12 月 23 日	
基金管理人	长信基金管理有限责任公司	
基金托管人	中国民生银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	6,300,902.78 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	长信纯债半年债券 A	长信纯债半年债券 C
下属分级基金的交易代码:	003126	003127
报告期末下属分级基金的份额总额	90,958.51 份	6,209,944.27 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险和有效保持资产流动性的前提下，力争为投资者创造较高的当期收益和长期资产增值。
投资策略	本基金将在基金合同约定的投资范围内，通过对宏观经济运行状况、国家货币政策和财政政策、国家产业政策及资本市场资金环境的研究，积极把握宏观经济发展趋势、利率走势、债券市场相对收益率、券种的流动性以及信用水平，优化固定收益类金融工具的资产比例配置。在有效控制风险的基础上，适时调整组合久期，以获得基金资产的稳定增值，提高基金总体收益率。
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	中国民生银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周永刚
	联系电话	021-61009999
	电子邮箱	zhouyg@cxfund.com.cn
客户服务电话	4007005566	95568
传真	021-61009800	010-58560798
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 9 楼	北京市西城区复兴门内大街 2 号
办公地址	上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼	北京市西城区复兴门内大街 2 号
邮政编码	200120	100031

法定代表人	成善栋	洪崎
-------	-----	----

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
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 号时代金融中心 9 楼、 北京市西城区复兴门内大街 2 号

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	长信基金管理有限责任公司	上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼

### § 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	长信纯债半年债券 A	长信纯债半年债券 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	1,658.64	74,191.57
本期利润	1,148.97	55,674.89
加权平均基金份额本期利润	0.0086	0.0080
本期加权平均净值利润率	0.79%	0.75%
本期基金份额净值增长率	0.93%	0.78%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)	
期末可供分配利润	4,054.43	224,638.62
期末可供分配基金份额利润	0.0446	0.0362
期末基金资产净值	99,128.80	6,714,831.40
期末基金份额净值	1.0898	1.0813
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	8.98%	8.13%

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、期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

#### 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

长信纯债半年债券 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	0.40%	0.03%	0.52%	0.03%	-0.12%	0.00%
过去三个月	0.07%	0.07%	0.64%	0.06%	-0.57%	0.01%
过去六个月	0.93%	0.06%	2.00%	0.06%	-1.07%	0.00%
过去一年	3.41%	0.06%	6.00%	0.06%	-2.59%	0.00%
自基金合同	8.98%	0.06%	11.32%	0.06%	-2.34%	0.00%

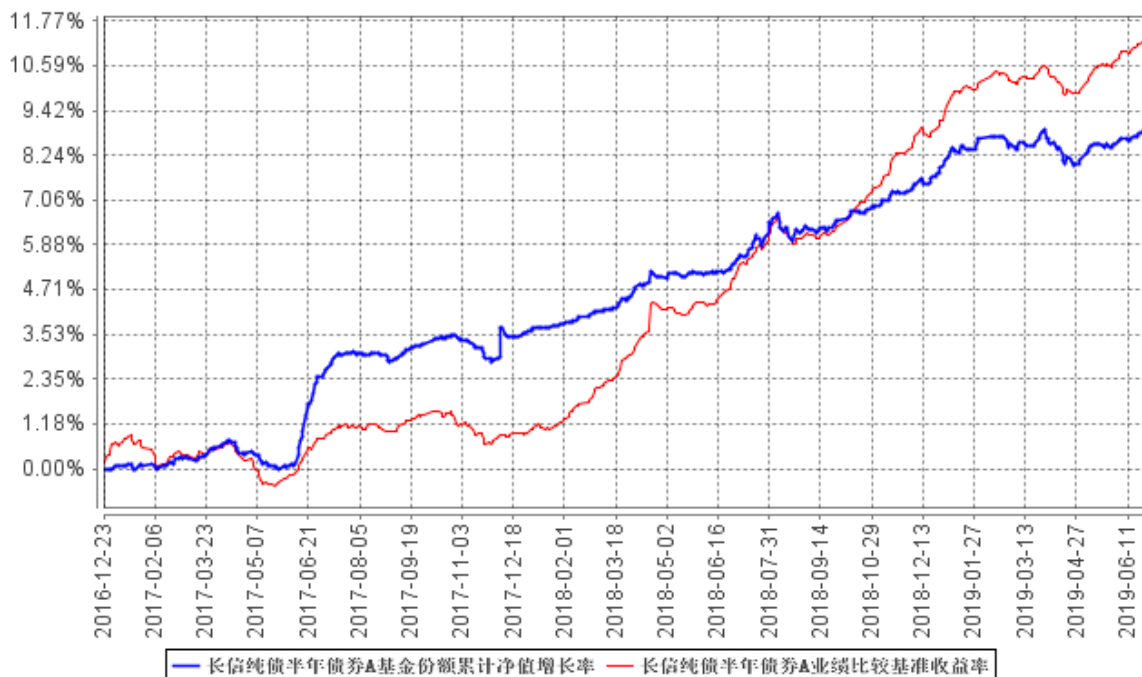


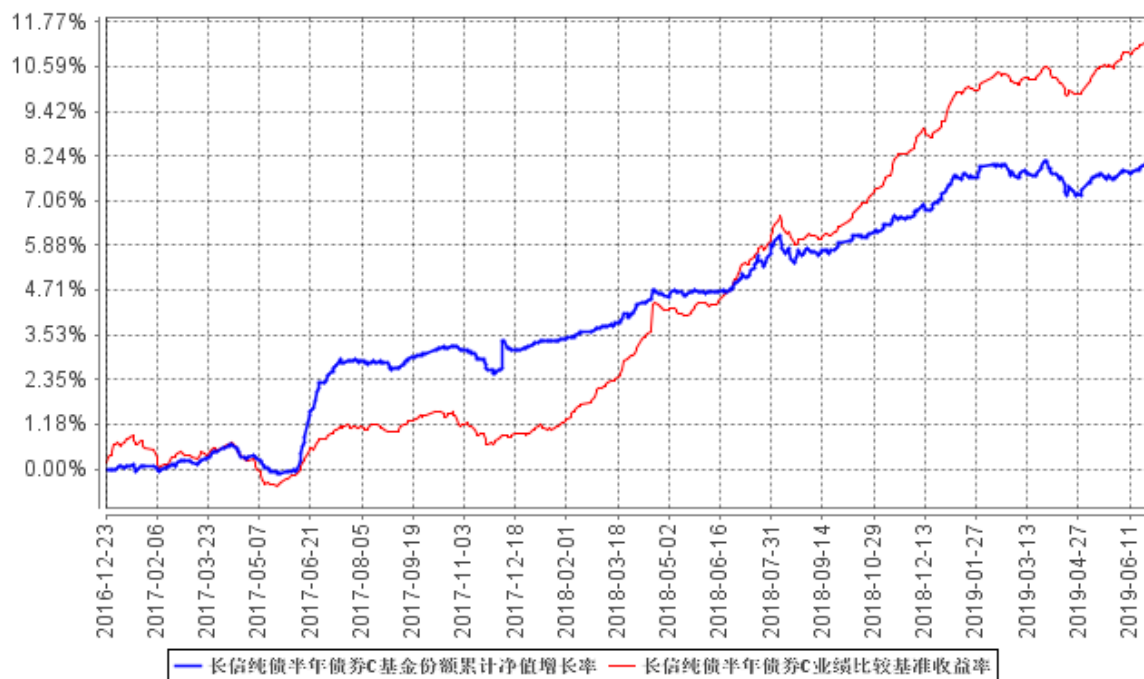
生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

长信纯债半年债券 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	0.37%	0.03%	0.52%	0.03%	-0.15%	0.00%
过去三个月	0.00%	0.07%	0.64%	0.06%	-0.64%	0.01%
过去六个月	0.78%	0.06%	2.00%	0.06%	-1.22%	0.00%
过去一年	3.10%	0.06%	6.00%	0.06%	-2.90%	0.00%
自基金合同生效起至今	8.13%	0.06%	11.32%	0.06%	-3.19%	0.00%

### 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 12 月 23 日至 2019 年 6 月 30 日。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效日起 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		
陆莹	长信利息收益开放式证券投资基金、长信纯债半年债券型证券投资基金、长信稳健纯债债券型证券投资基金、长信长金货币基金、长信稳通三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金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、现金理财部总监	2017 年 1 月 12 日	-	9 年	管理学学士，毕业于上海交通大学，2010 年 7 月加入长信基金管理有限责任公司，曾任基金事务部基金会计，交易管理部债券交易员、交易主管，债券交易部副总监、总监。现任现金理财部总监、长信利息收益开放式证券投资基金、长信纯债半年债券型证券投资基金、长信稳健纯债债券型证券投资基金、长信长金货币基金、长信稳通三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金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。

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 年上半年，债券市场收益率呈现先上后下趋势，整体与去年年末基本持平。具体来说，年初在资金宽松、降息预期加强、股市行情尚未全面启动、18 年牛市惯性思维的推动下，各期限利率快速大幅下行。后随着经济边际改善迹象逐步显现，市场对经济企稳预期增强，且利率估值已经较低，市场分歧逐步加大；叠加降息预期减弱，资金面虽整体保持宽松但波动加大，股市强势上涨压制债市，风险偏好提高，收益率逐步走高，短端在宽松资金面支持下上行幅度小于长端。二季度开始，债市在一季度经济数据大超预期，供给压力以及央行货币政策从救急模式转为政策

观察期等压力下，收益率快速调整，其中 10 年国开调整幅度接近 40bp。后随经济数据回落、海外鸽声一片、央行由于包商事件投放大量流动性，债券收益率大幅回落。上半年我们适当提高杠杆，参与利率债波段操作，保持了组合净值的稳定增长。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，长信纯债半年债券 A 份额净值为 1.0898 元，份额累计净值为 1.0898 元，本报告期长信纯债半年债券 A 净值增长率为 0.93%；长信纯债半年债券 C 份额净值为 1.0813 元，份额累计净值为 1.0813 元，本报告期长信纯债半年债券 C 净值增长率为 0.78%，同期业绩比较基准收益率为 2.00%。

#### 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、四季度，总体上认为债券市场以震荡为主，下有底，上有顶，经济基本面偏友好，但利率中枢下行空间有限。具体来看：经济基本面有托底但向上动力不足。投资方面，专项债新规有助于基建加码，但实际拉动效果有限；在地产调控仍未实质性放松，地方政府隐性债务仍处于高压状态，实体融资需求继续被抑制，宽信用仍然缺乏有力抓手；制造业受减税降费正面影响的同时由于外需仍然低迷、国企仍然处于结构性去杠杆阶段，预计三季度继续下行，四季度有望企稳。出口方面，由于海外经济放缓而承压。消费方面受减税政策以及今年以来楼市和股市财富效应有向好动力。通胀方面预计三季度 PPI 转负，CPI 维持低位。货币政策方面目前处于政策观察期，经过前期的多次降准后，无风险利率已经下降到历史低位，未来更多是运用结构性工具定向支持实体经济。本基金将适时调整利率债和高等级信用债投资比例，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。

#### 4.6 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。

基金收益分配应遵循下列原则：

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

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

自 2017 年 12 月 7 日至 2018 年 3 月 6 日，本基金资产净值已连续六十个工作日低于五千万元，本基金管理人已向中国证监会报送了解决方案。截至报告期末，本基金资产净值仍低于五千万元。

## § 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

本报告期内，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，依法安全保管了基金财产，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 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，按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 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

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。



## § 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：长信纯债半年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	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.6.1	65,228.86	175,365.85
结算备付金		47,512.02	93,976.48
存出保证金		915.06	1,413.09
交易性金融资产	6.4.6.2	7,649,144.20	7,414,853.00
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		7,649,144.20	7,414,853.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.6.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.6.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.6.5	77,232.94	161,002.18
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.6.6	-	-
资产总计		7,840,033.08	7,846,610.60
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2018 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	6.4.6.3	-	-
卖出回购金融资产款		1,000,000.00	-
应付证券清算款		165.70	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		4,045.02	4,852.94
应付托管费		1,155.70	1,386.58
应付销售服务费		1,707.60	2,033.57
应付交易费用	6.4.6.7	-	243.86
应交税费		-	-

应付利息		81.87	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.6.8	18,916.99	109,000.00
负债合计		1,026,072.88	117,516.95
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.6.9	6,300,902.78	7,202,881.32
未分配利润	6.4.6.10	513,057.42	526,212.33
所有者权益合计		6,813,960.20	7,729,093.65
负债和所有者权益总计		7,840,033.08	7,846,610.60

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，长信纯债半年债券 A 基金份额净值 1.0898 元，基金份额总额 90,958.51 份；长信纯债半年债券 C 基金份额净值 1.0813 元，基金份额总额 6,209,944.27 份。长信纯债半年定开债券份额总额合计为 6,300,902.78 份。

## 6.2 利润表

会计主体：长信纯债半年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	附注号	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
<b>一、收入</b>		148,858.04	459,459.22
1.利息收入		166,676.94	263,657.42
其中：存款利息收入	6.4.6.11	947.78	2,643.29
债券利息收入		165,507.61	242,852.84
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		221.55	18,161.29
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,207.45	81,996.04
其中：股票投资收益	6.4.6.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.6.13	1,207.45	81,996.04
资产支持证券投资收益	6.4.6.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.6.14	-	-
衍生工具收益	6.4.6.15	-	-
股利收益	6.4.6.16	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.6.17	-19,026.35	113,805.76
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.6.18	-	-
<b>减：二、费用</b>		92,034.18	195,487.02
1. 管理人报酬	6.4.9.2.1	26,455.82	57,268.93
2. 托管费	6.4.9.2.2	7,558.79	16,362.60
3. 销售服务费	6.4.9.2.3	11,121.86	24,281.80
4. 交易费用	6.4.6.19	5.01	535.16
5. 利息支出		18,215.71	8,458.64
其中：卖出回购金融资产支出		18,215.71	8,458.64
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.6.20	28,676.99	88,579.89
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		56,823.86	263,972.20
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		56,823.86	263,972.20

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长信纯债半年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）	7,202,881.32	526,212.33	7,729,093.65
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	56,823.86	56,823.86
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）	-901,978.54	-69,978.77	-971,957.31
其中：1.基金申购款	445,370.85	35,118.45	480,489.30
2.基金赎回款	-1,347,349.39	-105,097.22	-1,452,446.61
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)			
五、期末所有者权益(基金净值)	6,300,902.78	513,057.42	6,813,960.20
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)	17,470,501.82	566,944.07	18,037,445.89
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	263,972.20	263,972.20
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)	-5,429,613.60	-241,312.28	-5,670,925.88
其中：1.基金申购款	1,661,044.41	65,320.29	1,726,364.70
2.基金赎回款	-7,090,658.01	-306,632.57	-7,397,290.58
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)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	12,040,888.22	589,603.99	12,630,492.21

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

长信纯债半年债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)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》、《长信纯债半年债券型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”)证监许可

[2016]1619 号文准予公开募集注册。本基金为契约型开放式基金，存续期限为不定期。本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为 A 类基金份额和 C 类基金份额。本基金首次设立募集基金份额为 202,131,567.57 份，经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)验证，并出具了编号为毕马威华振验字第 1600898 号验资报告。《长信纯债半年债券型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)于 2016 年 12 月 23 日正式生效。本基金的基金管理人为长信基金管理有限责任公司，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

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《长信纯债半年债券型证券投资基金招募说明书》的有关规定，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。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。本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%，但在每个开放期前 3 个工作日、开放期及开放期后 3 个工作日的期间内，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，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的投资比例应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。

#### 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相一致的说明

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

本基金在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 重要财务报表项目的说明

### 6.4.6.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
活期存款	65,228.86
定期存款	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-

其他存款	-
合计:	65,228.86

#### 6.4.6.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	3,570,371.07	3,578,744.20
	银行间市场	4,021,496.00	4,070,400.00
	合计	7,591,867.07	7,649,144.20
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	7,591,867.07	7,649,144.20	57,277.13

#### 6.4.6.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.6.4 买入返售金融资产

##### 6.4.6.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.6.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.6.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应收活期存款利息	13.07
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	21.40
应收债券利息	77,198.07
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-

应收黄金合约拆借孳息	-
其他	0.40
合计	77,232.94

注：其他为应收结算保证金利息。

#### 6.4.6.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.6.7 应付交易费用

注：本基金本报告期末无应付交易费用。

#### 6.4.6.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用-账户维护费	9,000.00
预提信息披露费	-
审计费	9,916.99
合计	18,916.99

#### 6.4.6.9 实收基金

金额单位：人民币元

长信纯债半年债券 A		
项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	134,734.89	134,734.89
本期申购	17,028.37	17,028.37
本期赎回(以“-”号填列)	-60,804.75	-60,804.75
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	90,958.51	90,958.51

金额单位：人民币元

长信纯债半年债券 C	
项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日



	基金份额（份）	账面金额
上年度末	7,068,146.43	7,068,146.43
本期申购	428,342.48	428,342.48
本期赎回(以“-”号填列)	-1,286,544.64	-1,286,544.64
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	6,209,944.27	6,209,944.27

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.6.10 未分配利润

单位：人民币元

长信纯债半年债券 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,334.32	6,411.53	10,745.85
本期利润	1,658.64	-509.67	1,148.97
本期基金份额交易产生的变动数	-1,938.53	-1,786.00	-3,724.53
其中：基金申购款	581.13	859.80	1,440.93
基金赎回款	-2,519.66	-2,645.80	-5,165.46
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,054.43	4,115.86	8,170.29

单位：人民币元

长信纯债半年债券 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	180,086.61	335,379.87	515,466.48
本期利润	74,191.57	-18,516.68	55,674.89
本期基金份额交易产生的变动数	-29,639.56	-36,614.68	-66,254.24
其中：基金申购款	12,093.66	21,583.86	33,677.52
基金赎回款	-41,733.22	-58,198.54	-99,931.76
本期已分配利润	-	-	-
本期末	224,638.62	280,248.51	504,887.13

#### 6.4.6.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
活期存款利息收入	325.85
定期存款利息收入	-

其他存款利息收入	25.27
结算备付金利息收入	596.66
其他	-
合计	947.78

注：此处其他列示的是交易保证金和基金申购款的利息收入。

#### 6.4.6.12 股票投资收益

##### 6.4.6.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

注：本基金本报告期无股票投资收益。

#### 6.4.6.13 债券投资收益

##### 6.4.6.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	1,207.45
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	1,207.45

##### 6.4.6.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	2,699,584.32
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	2,668,200.55
减：应收利息总额	30,176.32
买卖债券差价收入	1,207.45

##### 6.4.6.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期无债券赎回差价收入。

##### 6.4.6.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无债券申购差价收入。

**6.4.6.13.5 资产支持证券投资收益**

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

**6.4.6.14 贵金属投资收益****6.4.6.14.1 贵金属投资收益项目构成**

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

**6.4.6.15 衍生工具收益****6.4.6.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期无买卖权证差价收入。

**6.4.6.15.2 衍生工具收益——其他投资收益**

注：本基金本报告期无其他衍生工具投资收益。

**6.4.6.16 股利收益**

注：本基金本报告期末投资股票，无股票投资收益。

**6.4.6.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
1. 交易性金融资产	-19,026.35
——股票投资	-
——债券投资	-19,026.35
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	-19,026.35

**6.4.6.18 其他收入**

注：本基金本报告期内无其他收入。

**6.4.6.19 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
交易所市场交易费用	5.01
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	5.01

#### 6.4.6.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
审计费用	9,916.99
信息披露费	-
银行手续费	160.00
账户维护费	18,000.00
其他费用	600.00
合计	28,676.99

注：其他费用为上清所查询费。

#### 6.4.7 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.7.1 或有事项

注：截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 6.4.7.2 资产负债表日后事项

注：截至本财务报告批准报出日，本基金未发生需要披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.8 关联方关系

##### 6.4.8.1 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。

##### 6.4.8.2 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	基金管理人、基金销售机构

中国民生银行股份有限公司（简称“中国民生银行”）	基金托管人、基金销售机构
长江证券股份有限公司（简称“长江证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

#### 6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.9.1.1 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。

###### 6.4.9.1.2 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	4,990,926.10	100.00%	24,783,550.00	100.00%

###### 6.4.9.1.3 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	87,900,000.00	100.00%	52,800,000.00	100.00%

###### 6.4.9.1.4 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。

###### 6.4.9.1.5 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。

##### 6.4.9.2 关联方报酬

###### 6.4.9.2.1 基金管理费

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
当期发生的基金应支付	26,455.82	57,268.93

的管理费		
其中：支付销售机构的客户维护费	17,952.16	60,109.43

注：基金管理费按前一日基金资产净值 0.70% 的年费率逐日计提，按月支付。

计算方法： $H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$ （H 为每日应计提的基金管理费，E 为前一日基金资产净值）。

#### 6.4.9.2.2 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	7,558.79	16,362.60

注：基金托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率逐日计提，按月支付。

计算方法： $H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$ （H 为每日应计提的基金托管费，E 为前一日基金资产净值）。

#### 6.4.9.2.3 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		
	长信纯债半年债券 A	长信纯债半年债券 C	合计
长信基金	-	0.81	0.81
中国民生银行	-	11,077.04	11,077.04
合计	-	11,077.85	11,077.85
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		
	长信纯债半年债券 A	长信纯债半年债券 C	合计
长信基金	-	193.97	193.97
中国民生银行	-	24,067.24	24,067.24
合计	-	24,261.21	24,261.21

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 0.30%。

销售服务费按照 C 类基金资产净值的 0.30% 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

#### 6.4.9.3 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。

#### 6.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

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

注：本报告期及上年度可比期间基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.9.4.2 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。

#### 6.4.9.5 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
中国民生银行	65,228.86	325.85	92,967.60	2,014.27

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）

#### 6.4.9.6 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。

#### 6.4.9.7 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。

#### 6.4.10 利润分配情况

注：本报告期本基金未进行利润分配。

## 6.4.11 期末（2019 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

### 6.4.11.1 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。

### 6.4.11.2 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。

### 6.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.11.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本报告期末未持有因银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

#### 6.4.11.3.2 交易所市场债券正回购

注：截至本报告期末 2019 年 6 月 30 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 1,000,000.00 元，于 2019 年 7 月 1 日、2019 年 7 月 2 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。

## 6.4.12 金融工具风险及管理

### 6.4.12.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括：信用风险、流动性风险和市场风险。本基金在下文主要论述上述风险敞口及其形成原因、风险管理目标、政策和过程以及计量风险的方法等。

本基金的基金管理人从事风险管理的目标是使本基金在风险和收益之间取得适当的平衡，以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。基于该风险管理目标，本基金的基金管理人已制定了政策和程序来辨别和分析这些风险，设定适当的风险限额并设计相应的内部控制程序，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人奉行全面风险管理体系理念，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。在董事会下设立风险控制委员会，负责对公司经营管理和基金业务运作的合法性、合规性进行全面的检查和评估等；在管理层层面设立内部控制委员会，主要职责是讨论审议公司内部控制制度及针对公司在经营管理和投资组合运作中的风险进行识别、评估并研究制订有效的防范措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽



核部负责协调并与各部门合作完成运作风险管理工作，战略与产品研发部负责进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部向督察长负责，并向总经理汇报日常行政事务。

#### 6.4.12.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国民生银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，本基金投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并采用券款对付交割方式以控制相应的信用风险。

##### 6.4.12.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	399,680.00	0.00
合计	399,680.00	0.00

注：未评级债券为国债、央行票据、政策性金融债及超短期融资券等无信用评级债券。

##### 6.4.12.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

##### 6.4.12.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

##### 6.4.12.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00

未评级	7,249,464.20	7,414,853.00
合计	7,249,464.20	7,414,853.00

注：未评级债券为国债、央行票据、政策性金融债及超短期融资券等无信用评级债券。

#### 6.4.12.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.12.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

### 6.4.12.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金流动性风险来源于开放式基金每日兑付赎回资金的流动性风险，以及因部分投资品种交易不活跃而出现的变现风险和因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理价格变现投资的风险。

#### 6.4.12.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金坚持组合管理、分散投资的原则开展投资活动，所持证券均在证券交易所或银行间同业市场交易，并严格遵守基金管理人流动性相关交易限制；本期末本基金未持有有重大流动性风险的投资品种。本基金可通过卖出回购金融资产方式融入短期资金应对流动性需求。

针对定期开放运作可能导致的流动性风险，本基金主要通过根据开放前剩余期限长短情况动态调整投资组合进行应对；针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人在基金合同中约定了巨额赎回条款，制定了发生巨额赎回时资金的处理模式，控制因开放模式而产生的流动性风险。本基金的基金管理人对流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金本报告期末及上年度末均无重大流动性风险。

#### 6.4.12.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 6.4.12.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

##### 6.4.12.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019年6月30日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	65,228.86	-	-	-	-	65,228.86
结算备付金	47,512.02	-	-	-	-	47,512.02
存出保证金	915.06	-	-	-	-	915.06
交易性金融资产	-	399,680.00	7,249,464.20	-	-	7,649,144.20
应收利息	-	-	-	-	77,232.94	77,232.94
资产总计	113,655.94	399,680.00	7,249,464.20	-	77,232.94	7,840,033.08
负债						
卖出回购金融资产款	1,000,000.00	-	-	-	-	1,000,000.00
应付证券清算款	-	-	-	-	165.70	165.70
应付管理人报酬	-	-	-	-	4,045.02	4,045.02
应付托管费	-	-	-	-	1,155.70	1,155.70
应付销售服务费	-	-	-	-	1,707.60	1,707.60
应付利息	-	-	-	-	81.87	81.87
其他负债	-	-	-	-	18,916.99	18,916.99
负债总计	1,000,000.00	-	-	-	26,072.88	1,026,072.88
利率敏感度缺口	-886,344.06	399,680.00	7,249,464.20	-	51,160.06	6,813,960.20
上年度末 2018年12月31日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	175,365.85	-	-	-	-	175,365.85
结算备付金	93,976.48	-	-	-	-	93,976.48
存出保证金	1,413.09	-	-	-	-	1,413.09
交易性金融资产	703,080.00	-	6,711,773.00	-	-	7,414,853.00
应收利息	-	-	-	-	161,002.18	161,002.18
资产总计	973,835.42	-	6,711,773.00	-	161,002.18	7,846,610.60
负债						
应付管理人报酬	-	-	-	-	4,852.94	4,852.94
应付托管费	-	-	-	-	1,386.58	1,386.58
应付销售服务费	-	-	-	-	2,033.57	2,033.57
应付交易费用	-	-	-	-	243.86	243.86
其他负债	-	-	-	-	109,000.00	109,000.00
负债总计	-	-	-	-	117,516.95	117,516.95

利率敏感度缺口	973,835.42	-6,711,773.00	-43,485.23	7,729,093.65
---------	------------	---------------	------------	--------------

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 6.4.12.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2019年6月30日）	上年度末（2018年12月31日）
	市场利率下降27个基点	40,811.59	47,391.96
市场利率上升27个基点	-40,811.59	-47,391.96	

#### 6.4.12.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.12.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的债券以及银行间同业市场交易的债券，所面临的最大其他价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR (Value at Risk) 等指标来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

于6月30日，本基金面临的其他市场价格风险列示如下：

##### 6.4.12.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日		上年度末 2018年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	-
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-

交易性金融资产—债券投资	7,649,144.20	112.26	7,414,853.00	95.93
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	7,649,144.20	112.26	7,414,853.00	95.93

#### 6.4.12.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：本基金主要投资债券等固定收益品种，无重大其他价格风险，因此未进行其他价格风险的敏感性分析。

#### 6.4.13 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具 不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

##### (b) 以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2019 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为人民币 7,649,144.20 元，无属于第一层次和第三层次的余额。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于本基金投资的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。

##### (iii) 第三层次公允价值计量的金融工具

无。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 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	7,649,144.20	97.57
	其中：债券	7,649,144.20	97.57
	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	112,740.88	1.44
8	其他各项资产	78,148.00	1.00
9	合计	7,840,033.08	100.00

注：本基金本报告期末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所有股票投资明细

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	3,578,744.20	52.52
2	央行票据	-	-
3	金融债券	4,070,400.00	59.74
	其中：政策性金融债	4,070,400.00	59.74
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	7,649,144.20	112.26

### 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	40,000	4,070,400.00	59.74
2	010107	21 国债(7)	21,060	2,166,652.80	31.80
3	010303	03 国债(3)	10,010	1,012,411.40	14.86
4	019611	19 国债 01	4,000	399,680.00	5.87

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有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投资国债期货。

### 7.10.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

## 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	915.06
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	77,232.94
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	78,148.00

### 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
长信纯债半年债券 A	48	1,894.97	0.00	0.00%	90,958.51	100.00%
长信纯债半年债券 C	327	18,990.66	0.00	0.00%	6,209,944.27	100.00%
合计	375	16,802.41	0.00	0.00%	6,300,902.78	100.00%

### 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	长信纯债半年债券 A	1.00	0.00%
	长信纯债半年债券 C	8,000.00	0.13%
	合计	8,001.00	0.13%

### 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	长信纯债半年债券 A	0
	长信纯债半年债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	长信纯债半年债券 A	0
	长信纯债半年债券 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长信纯债半年债券 A	长信纯债半年债券 C
基金合同生效日（2016 年 12 月 23 日）基金份额总额	140,350,149.91	61,781,417.66
本报告期期初基金份额总额	134,734.89	7,068,146.43
本报告期期间基金总申购份额	17,028.37	428,342.48
减：本报告期期间基金总赎回份额	60,804.75	1,286,544.64
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	90,958.51	6,209,944.27

## § 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

本报告期基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 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	2	-	-	-	-	-

国金证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
国联证券(已 退租)	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
财富证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
民族证券(已 退租)	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
申港证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-

### 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	4,990,926.10	100.00%	87,900,000.00	100.00%	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
国联证券(已 退租)	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
民族证券(已	-	-	-	-	-	-

退租)						
中银国际	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-

注：1、本期租用证券公司交易单元的变更情况

本报告期内本基金退租国联证券交易单元 1 个、民族证券(即方正证券)交易单元 1 个。

## 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。

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金 2018 年 12 月 31 日资产净值的公告	公司网站	2019 年 1 月 1 日
2	长信基金管理有限责任公司关于长信纯债半年债券型证券投资基金开放申购和赎回业务的第一次提示性公告	上证报、中证报、公司网站	2019 年 1 月 2 日
3	长信基金管理有限责任公司关于长信纯债半年债券型证券投资基金开放申购和赎回业务的第	上证报、中证报、公司网站	2019 年 1 月 3 日

	二次提示性公告		
4	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式证券投资基金参加平安银行股份有限公司申购(含定期定额投资申购)费及转换业务的申购补差费率优惠活动的公告	上证报、中证报、 证券时报、公司 网站	2019 年 1 月 10 日
5	长信纯债半年债券型证券投资基金 2018 年第 4 季度报告	上证报、公司网 站	2019 年 1 月 19 日
6	长信基金管理有限责任公司关于长信纯债半年债券型证券投资基金开放申购和赎回业务的公告	上证报、公司网 站	2019 年 1 月 29 日
7	长信基金管理有限责任公司关于长信纯债半年债券型证券投资基金开放申购和赎回业务的第一次提示性公告	上证报、公司网 站	2019 年 1 月 30 日
8	长信基金管理有限责任公司关于长信纯债半年债券型证券投资基金开放申购和赎回业务的第二次提示性公告	上证报、公司网 站	2019 年 1 月 31 日
9	长信纯债半年债券型证券投资基金更新的招募说明书(2019 年第【1】号)及摘要(仅摘要见报)	上证报、公司网 站	2019 年 2 月 2 日
10	长信基金管理有限责任公司关于长信纯债半年债券型证券投资基金开放申购和赎回业务的公告	上证报、公司网 站	2019 年 2 月 27 日
11	长信基金管理有限责任公司关于长信纯债半年债券型证券投资基金开放申购和赎回业务的第一次提示性公告	上证报、公司网 站	2019 年 2 月 28 日
12	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	上证报、公司网 站	2019 年 3 月 1 日
13	长信基金管理有限责任公司关于长信纯债半年债券型证券投资基金开放申购和赎回业务的第二次提示性公告	上证报、公司网 站	2019 年 3 月 1 日
14	长信基金管理有限责任公司公告	证券时报、公司 网站	2019 年 3 月 2 日
15	长信基金管理有限责任公司关于增加北京汇成基金销售有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购(含定投申购)费率优惠活动的公告	上证报、中证报、 证券时报、证券 日报、公司网站	2019 年 3 月 25 日
16	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金参加交通银行股份有限公司手机银行基金申购(含定期定额投资申购)费率优惠活动的公告	上证报、公司网 站	2019 年 3 月 28 日
17	长信纯债半年债券型证券投资基金 2018 年年度报告及摘要(仅摘要见报)	上证报、公司网 站	2019 年 3 月 29 日
18	长信基金管理有限责任公司关于长信纯债半年债券型证券投资基金开放申购和赎回业务的公告	上证报、公司网 站	2019 年 4 月 1 日
19	长信基金管理有限责任公司关于长信纯债半年债券型证券投资基金开放申购和赎回业务的第一次提示性公告	上证报、公司网 站	2019 年 4 月 2 日
20	长信基金管理有限责任公司关于长信纯债半年债券型证券投资基金开放申购和赎回业务的第	上证报、公司网 站	2019 年 4 月 3 日

	二次提示性公告		
21	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	上证报、公司网站	2019年4月8日
22	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金在上海联泰基金销售有限公司开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、公司网站	2019年4月15日
23	长信纯债半年债券型证券投资基金 2019 年第 1 季度报告	上证报、公司网站	2019年4月22日
24	长信基金管理有限责任公司关于长信纯债半年债券型证券投资基金开放申购和赎回业务的公告	上证报、公司网站	2019年4月25日
25	长信基金管理有限责任公司关于增加华鑫证券有限责任公司为旗下部分开放式证券投资基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、公司网站	2019年4月26日
26	长信基金管理有限责任公司关于长信纯债半年债券型证券投资基金开放申购和赎回业务的第一次提示性公告	上证报、公司网站	2019年4月26日
27	长信基金管理有限责任公司关于长信纯债半年债券型证券投资基金开放申购和赎回业务的第二次提示性公告	上证报、公司网站	2019年4月29日
28	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	上证报、公司网站	2019年5月7日
29	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金参加中国民生银行股份有限公司直销银行基金通平台申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、公司网站	2019年5月14日
30	长信基金管理有限责任公司关于增加江苏汇林保大基金销售有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、公司网站	2019年5月17日
31	长信基金管理有限责任公司关于长信纯债半年债券型证券投资基金开放申购和赎回业务的公告	上证报、公司网站	2019年5月30日
32	长信基金管理有限责任公司关于长信纯债半年债券型证券投资基金开放申购和赎回业务的第一次提示性公告	上证报、公司网站	2019年5月31日
33	长信基金管理有限责任公司关于长信纯债半年债券型证券投资基金开放申购和赎回业务的第二次提示性公告	上证报、公司网站	2019年6月3日
34	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金所持证券调整估值价的公告	上证报、公司网站	2019年6月26日
35	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金参加中国银行股份有限公司定期定额投资申购费率优惠活动的公告	上证报、公司网站	2019年6月27日



## § 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。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立基金的文件；
- 2、《长信纯债半年债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长信纯债半年债券型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《长信纯债半年债券型证券投资基金托管协议》；
- 5、报告期内在指定报刊上披露的各种公告的原稿；
- 6、长信基金管理有限责任公司营业执照、公司章程及相关资格批复文件。

### 12.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

### 12.3 查阅方式

长信基金管理有限责任公司网站：<http://www.cxfund.com.cn>。

长信基金管理有限责任公司

2019年8月27日