

长信利率债债券型证券投资基金（原长信
富泰纯债一年定期开放债券型证券投资基
金）

2019 年第 2 季度报告

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：国泰君安证券股份有限公司

报告送出日期：2019 年 7 月 18 日

§1 重要提示

长信利率债债券型证券投资基金由长信富泰纯债一年定期开放债券型证券投资基金转型而来。基金管理人于2019年3月11日起至2019年4月4日期间召开长信富泰纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金份额持有人大会，审议《关于长信富泰纯债一年定期开放债券型证券投资基金修改法律文件的议案》，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2019年4月8日生效。根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定，本次基金份额持有人大会表决通过后，修改后的《长信利率债债券型证券投资基金基金合同》生效前，长信富泰纯债一年定期开放债券型证券投资基金将安排不少于20个工作日的选择期供基金份额持有人做出选择，本基金选择期为2019年4月10日至2019年5月13日。自本次基金份额持有人大会决议生效后，选择期结束之日的次日（2019年5月14日）起，《长信利率债债券型证券投资基金基金合同》生效，《长信富泰纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》同时失效。

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责任。

基金托管人国泰君安证券股份有限公司根据本基金基金合同的规定，于2019年7月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年4月1日起至2019年6月30日止。

§2 基金产品概况

转型后：

基金简称	长信利率债债券
基金主代码	519943
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019年5月14日

报告期末基金份额总额	10,201,667.31份	
投资目标	本基金以利率债券为主要投资对象，合理控制风险，在追求本金安全的基础上谨慎投资，力争实现基金资产的长期稳定增值。	
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	中债国开行债券指数收益率*80%+银行一年期定期存款利率（税后）*20%	
风险收益特征	本基金为债券型基金，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。	
基金管理人	长信基金管理有限责任公司	
基金托管人	国泰君安证券股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	长信利率债债券 A	长信利率债债券 C
下属分级基金的场内简称	CXLLZA	CXLLZC
下属分级基金的交易代码	519943	519942
报告期末下属分级基金的份额总额	4,067,344.16份	6,134,323.15份

转型前：

基金简称	长信富泰纯债一年定开债券
基金主代码	519943
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年7月21日
报告期末基金份额总额	6,448,975.63份
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>（一）封闭期投资策略</p> <p>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。</p> <p>（二）开放期投资策略</p> <p>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</p>

	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。	
业绩比较基准	三年期银行定期存款利率（税后）+4%	
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。	
基金管理人	长信基金管理有限责任公司	
基金托管人	国泰君安证券股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	长信富泰纯债一年定开债券 A	长信富泰纯债一年定开债券 C
下属分级基金的场内简称	富泰 A	富泰 C
下属分级基金的交易代码	519943	519942
报告期末下属分级基金的份额总额	4,128,623.59 份	2,320,352.04 份

注：上表中“报告期期末”为2019年5月13日。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标（转型后）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2019年5月14日—2019年6月30日）	
	长信利率债债券 A	长信利率债债券 C
1. 本期已实现收益	15,378.61	9,244.21
2. 本期利润	28,761.68	24,393.00
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0071	0.0089
4. 期末基金资产净值	4,560,879.46	6,821,520.94
5. 期末基金份额净值	1.1213	1.1120

注：1、转型后的本基金基金合同生效日为2019年5月14日，截至本报告期末，本基金运作未满一个季度；

2、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；

3、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。

3.1 主要财务指标（转型前）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2019年4月1日—2019年5月13日）
--------	---------------------------

	长信富泰纯债一年定开债券 A	长信富泰纯债一年定开债券 C
1. 本期已实现收益	10,205.87	17,268.91
2. 本期利润	22,229.83	27,275.50
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0051	0.0017
4. 期末基金资产净值	4,600,270.29	2,565,237.37
5. 期末基金份额净值	1.1142	1.1055

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（转型后）

3.2.1 本报告期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

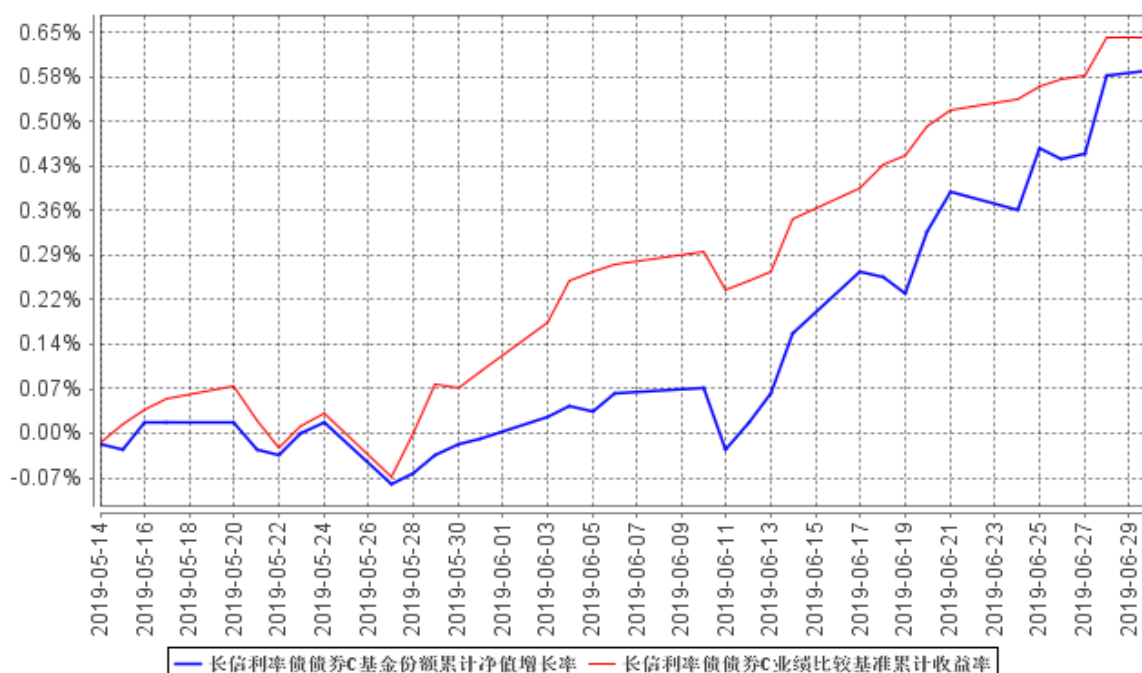
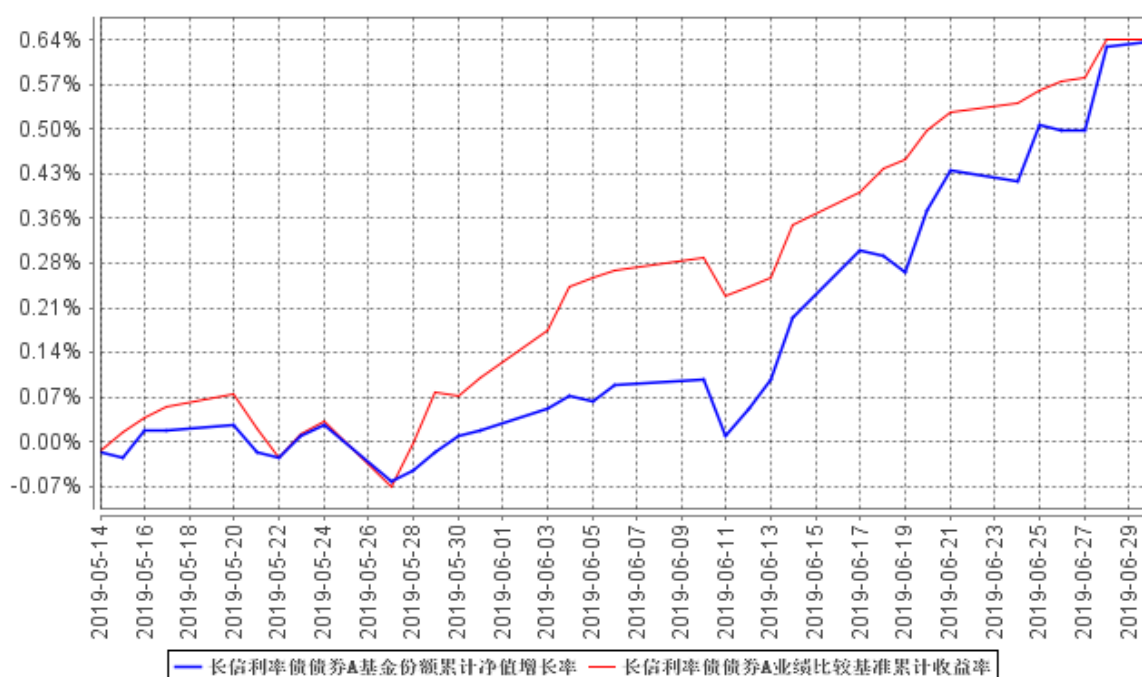
长信利率债债券 A

阶段	净值增长率①	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
自转型生效日起至今 (2019年5月14日-2019年6月30日)	0.64%	0.05%	0.64%	0.04%	0.00%	0.01%

长信利率债债券 C

阶段	净值增长率①	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
自转型生效日起至今 (2019年5月14日-2019年6月30日)	0.59%	0.05%	0.64%	0.04%	-0.05%	0.01%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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、转型后的本基金合同生效日为2019年5月14日，基金合同生效日至本报告期末，本基金运作时间未满一年。图示日期为2019年5月14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之日起6个月内为建仓期，建仓期结束时，本基金各项投资比例应符合基金合同中的约定：本基金投资于债券的比例不低于基金资产的80%，投资于利率债券的比例不低于非现金基金资产的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，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款。

截至本报告期末，本基金尚未完成建仓。

3.2 基金净值表现（转型前）

3.2.1 本报告期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

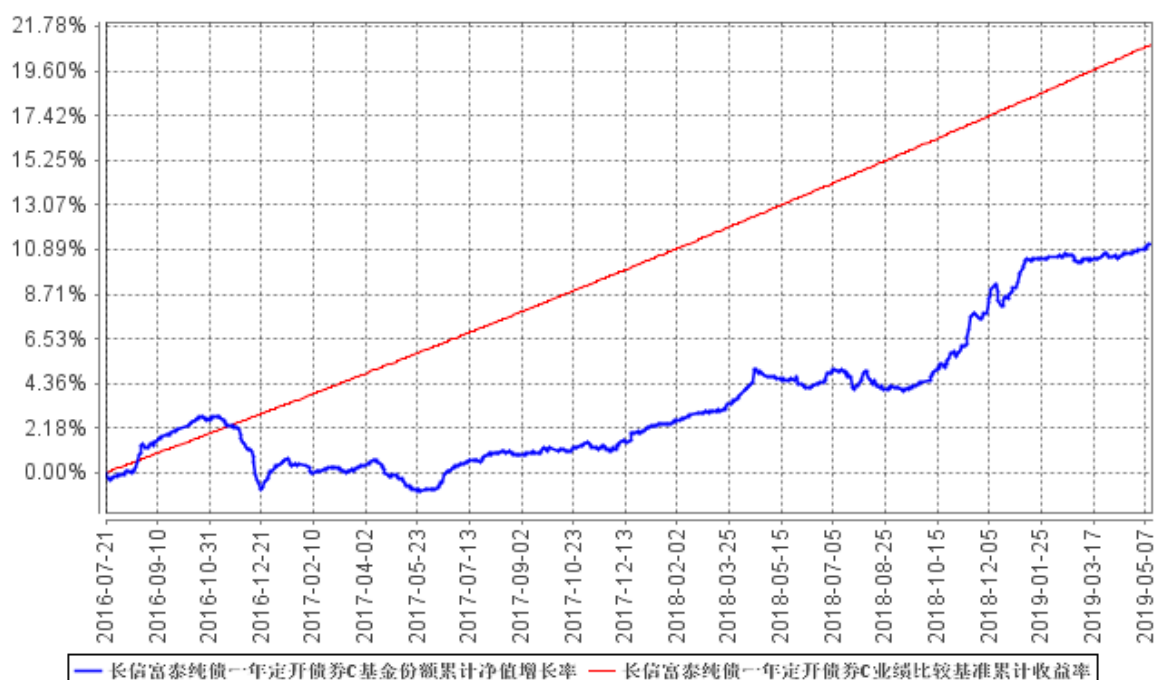
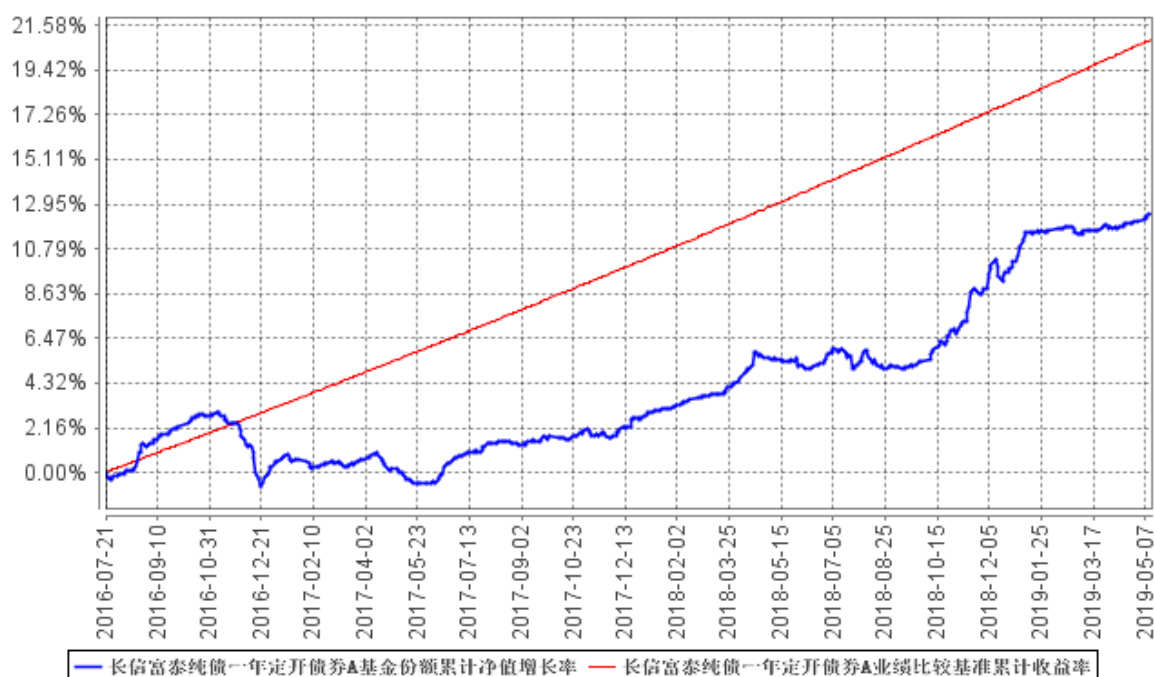
长信富泰纯债一年定开债券 A

阶段	净值增长率①	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
2019年4月 1日- 2019年5月 13日（基金 合同失效前 日）	0.48%	0.05%	0.80%	0.02%	-0.32%	0.03%

长信富泰纯债一年定开债券 C

阶段	净值增长率①	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
2019年4月 1日- 2019年5月 13日（基金 合同失效前 日）	0.45%	0.05%	0.80%	0.02%	-0.35%	0.03%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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7月21日至2019年5月13日（基金合同失效前日）。

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 基金经理（或基金经理小组）简介（转型前）

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
姜锡峰	长信富泰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、长信富全纯债一年定期开放债券型证券投资基金和长信富民纯债一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理	2016年7月28日	2019年5月13日	8年	管理学硕士，上海财经大学企业管理专业研究生毕业，曾任湘财证券股份有限公司担任债券研究员、浦银安盛基金管理有限公司债券研究员、基金经理助理，2016年5月加入长信基金管理有限责任公司，历任基金经理助理、长信利发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、长信先利半年定期开放混合型证券投资基金和长信先锐债券型证券投资基金的基金经理。现任长信富泰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、长信富全纯债一年定期开放债券型证券投资基金和长信富民纯债一年定期开放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。

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型后）

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
姜锡峰	长信稳益纯债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、长信富民纯债一年定期开放债券型证券投资基金和长信利率债债券型证券投资基金的基金经理	2019年5月14日	-	8年	管理学硕士，上海财经大学企业管理专业研究生毕业，曾任湘财证券股份有限公司担任债券研究员、浦银安盛基金管理有限公司债券研究员、基金经理助理，2016年5月加入长信基金管理有限责任公司，历任基金经理助理、长信利发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、长信先利半年定期开放混合型证券投资基金、长信先锐债券型证券投资基金和长信富泰纯债一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理。现任长信稳益纯债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、长信富民纯债一年定期开放债券型证券投资基金和长信利率债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；

3、自2019年5月14日起，长信富泰纯债一年定期开放债券型证券投资基金转型为长信利率债债券型证券投资基金，姜锡峰仍担任该基金的基金经理。

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 公平交易专项说明

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且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 报告期内基金投资策略和运作分析

4.4.1 报告期内基金的投资策略和运作分析

2019年二季度，国内经济增速平稳。通胀方面，CPI波动不大；政策方面，央行货币政策仍较为宽松。市场方面，债券市场收益率震荡为主。

报告期内，本基金保持了较稳健的操作策略。

4.4.2 2019年三季度市场展望和投资策略

三季度经济增速可能会有所回落。从PMI等高频指标来看，经济增速经过一季度的改善后，现处于走平的状态。货币政策方面，总体基调可能仍偏宽松。其他政策方面，考虑到债券市场部分企业仍有违约的压力，预计宽信用相关政策可能再次加码，对债券市场或有负面影响。

综合来看，债券市场震荡的格局难改。

从品种方面而言，经济回落背景下，信用债个券信用风险依然较大，信用债标的需要加强个券筛选；下一阶段我们将继续保持审慎严谨的态度，进一步优化投资组合，争取为投资人提供安全、稳健的投资收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2019年6月30日，长信利率债债券A份额净值为1.1213元，份额累计净值为1.1309元；长信利率债债券C份额净值为1.1120元，份额累计净值为1.1177元。本报告期内转型前长信富泰纯债一年定开债券A净值增长率为0.48%，长信富泰纯债一年定开债券C净值增长率为0.45%，同期业绩比较基准收益率为0.80%；本报告期内转型后长信利率债债券A净值增长率为0.64%，长信利率债债券C净值增长率为0.59%，同期业绩比较基准收益率为0.64%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

自2017年7月28日至2017年10月25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2019年5月13日长信富泰纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金合同失效前日，本基金资产净值仍低于五千万元。自2019年5月14日长信利率债债券型证券投资基金合同生效日至2019年6月11日，本基金资产净值已连续二十个工作日低于五千万元。截至报告期末，本基金资产净值仍低于五千万元。

§5 投资组合报告

转型后：

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	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	11,574,085.00	76.53
	其中：债券	11,574,085.00	76.53
	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	1,221,009.85	8.07
8	其他资产	2,328,708.21	15.40
9	合计	15,123,803.06	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。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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。

5.2.2 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。

5.3 报告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。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	2,954,810.00	25.96
2	央行票据	-	-
3	金融债券	8,619,275.00	75.72
	其中：政策性金融债	8,619,275.00	75.72
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	11,574,085.00	101.68

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	018006	国开 1702	29,950	3,057,895.00	26.87
2	108604	国开 1805	24,000	2,428,080.00	21.33
3	180203	18 国开 03	20,000	2,052,000.00	18.03
4	019536	16 国债 08	12,600	1,196,244.00	10.51
5	019547	16 国债 19	12,100	1,109,086.00	9.74

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.9.3 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。

5.10 投资组合报告附注**5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	17,945.54
2	应收证券清算款	103,946.70
3	应收股利	-
4	应收利息	200,464.09
5	应收申购款	2,006,351.88
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,328,708.21

5.10.4 报告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。

5.10.5 报告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。

5.10.6 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。

转型前：

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	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	7,444,620.00	88.81
	其中：债券	7,444,620.00	88.81
	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	821,063.32	9.79
8	其他资产	116,910.06	1.39
9	合计	8,382,593.38	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。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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。

5.2.2 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。

5.3 报告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。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	698,880.00	9.75
2	央行票据	-	-
3	金融债券	6,745,740.00	94.14
	其中：政策性金融债	6,745,740.00	94.14
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	7,444,620.00	103.90

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	180203	18 国开 03	50,000	5,134,500.00	71.66
2	018007	国开 1801	15,000	1,509,450.00	21.07
3	019611	19 国债 01	7,000	698,880.00	9.75
4	018006	国开 1702	1,000	101,790.00	1.42

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金通过对基本面和资金面的分析，对国债市场走势做出判断，以作为确定国债期货的头寸方向和额度的依据。当中长期经济高速增长，通货膨胀压力浮现，央行政策趋于紧缩时，本基金建立国债期货空单进行套期保值，以规避利率风险，减少利率上升带来的亏损；反之，在经济增长趋于回落，通货膨胀率下降，甚至通货紧缩出现时，本基金通过建立国债期货多单，以获取更高的收益。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险指标说明
-	-	-	-	-	符合本基金基金契约及投资目标
公允价值变动总额合计（元）					-
国债期货投资本期收益（元）					-2,750.00

国债期货投资本期公允价值变动（元）	5,550.00
-------------------	----------

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价

国债期货有助于管理组合的久期、流动性风险水平。本基金按照相关法律法规，结合宏观经济形势和政策趋势的分析，对国债市场走势作出判断。同时，本基金对国债期货与现货间的基差、国债期货的波动率、资金利率和 IRR 等指标进行跟踪，力争为投资人提供安全、稳健的投资收益。本基金国债期货投资符合既定的投资政策和投资目标。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	20,161.39
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	96,748.67
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	116,910.06

5.10.4 报告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。

5.10.5 报告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。

5.10.6 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。

§6 开放式基金份额变动（转型后）

单位：份

项目	长信利率债债券 A	长信利率债债券 C
基金合同生效日（2019年5月14日）基金份额总额	4,128,623.59	2,320,352.04
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	51,323.70	4,106,577.09
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	112,603.13	292,605.98
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	4,067,344.16	6,134,323.15

§6 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

项目	长信富泰纯债一年定开债券 A	长信富泰纯债一年定开债券 C
报告期期初基金份额总额	4,622,495.91	24,510,304.29
报告期期间基金总申购份额	-	-
减：报告期期间基金总赎回份额	493,872.32	22,189,952.25
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	4,128,623.59	2,320,352.04

注：上表中“报告期期末”为2019年5月13日。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型后）

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况（转型后）

注：本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细（转型后）

注：本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型前）

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况（转型前）

注：本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细（转型前）

注：本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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	2019年4月1日至2019年4月28日	14,563,758.39	0.00	14,563,758.39	0.00	0.00%
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>							

8.2 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。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立基金的文件；
- 2、《长信富泰纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长信富泰纯债一年定期开放债券型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《长信富泰纯债一年定期开放债券型证券投资基金托管协议》；
- 5、《长信利率债债券型证券投资基金基金合同》；
- 6、《长信利率债债券型证券投资基金招募说明书》；
- 7、《长信利率债债券型证券投资基金托管协议》；
- 8、报告期内在指定报刊上披露的各种公告的原稿；
- 9、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。

9.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

9.3 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7月18日