

长信利率债债券型证券投资基金证券投资  
基金（原长信富泰纯债一年定期开放债券  
型证券投资基金基金转型）  
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：国泰君安证券股份有限公司

送出日期：2019 年 8 月 27 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0:00起至2019年4月4日17:00止以通讯方式召开了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、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（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	
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	
报告期末基金份额总额	10,201,667.31份	
基金合同存续期	不定期	
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

### 2.1 基金基本情况（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	
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	
报告期末基金份额总额	6,448,975.63份	
基金合同存续期	不定期	
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。

### 2.2 基金产品说明（转型后）

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资产的资产比例配置。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%+银行一年期定存利率（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。

## 2.2 基金产品说明（转型前）

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	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。

## 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	国泰君安证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周永刚	王健
	联系电话	021-61009999	021-38676252
	电子邮箱	zhouyg@cxfund.com.cn	wangj222@gtjas.com
客户服务电话		4007005566	021-38917599-5
传真		021-61009800	021-38677819

## 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、上海市静安区新闻路669号博华广场19楼



### §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（转型后）

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2019年5月14日(基金转型起始日)至2019年6月30日	
	长信利率债债券 A	长信利率债债券 C
本期已实现收益	15,378.61	9,244.21
本期利润	28,761.68	24,393.00
加权平均基金份额本期利润	0.0071	0.0089
本期基金份额净值增长率	0.64%	0.59%
3.1.2 期末数据和指标	2019年6月30日	
期末可供分配基金份额利润	0.0749	0.0656
期末基金资产净值	4,560,879.46	6,821,520.94
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  
满半年。

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 主要会计数据和财务指标（转型前）

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2019年1月1日至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
本期已实现收益	141,037.47	679,736.10
本期利润	105,098.43	437,194.46
加权平均基金份额本期利润	0.0231	0.0200
本期基金份额净值增长率	2.13%	1.99%
3.1.2 期末数据和指标	2019年5月13日	
期末可供分配基金份额利润	0.0711	0.0625
期末基金资产净值	4,600,270.29	2,565,237.37
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 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

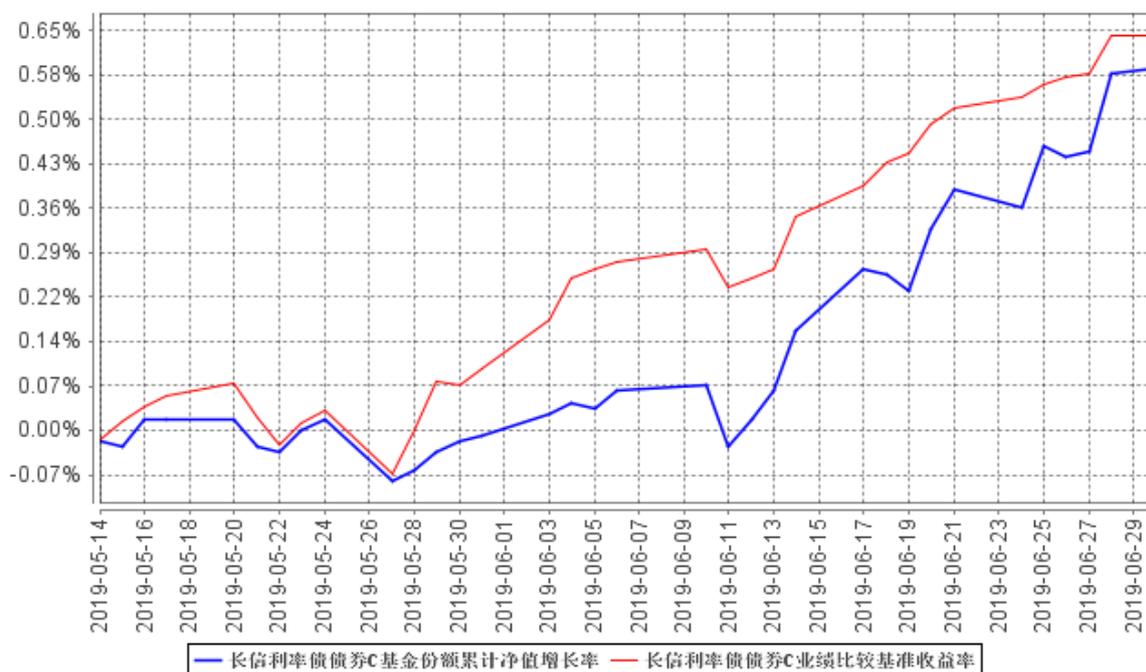
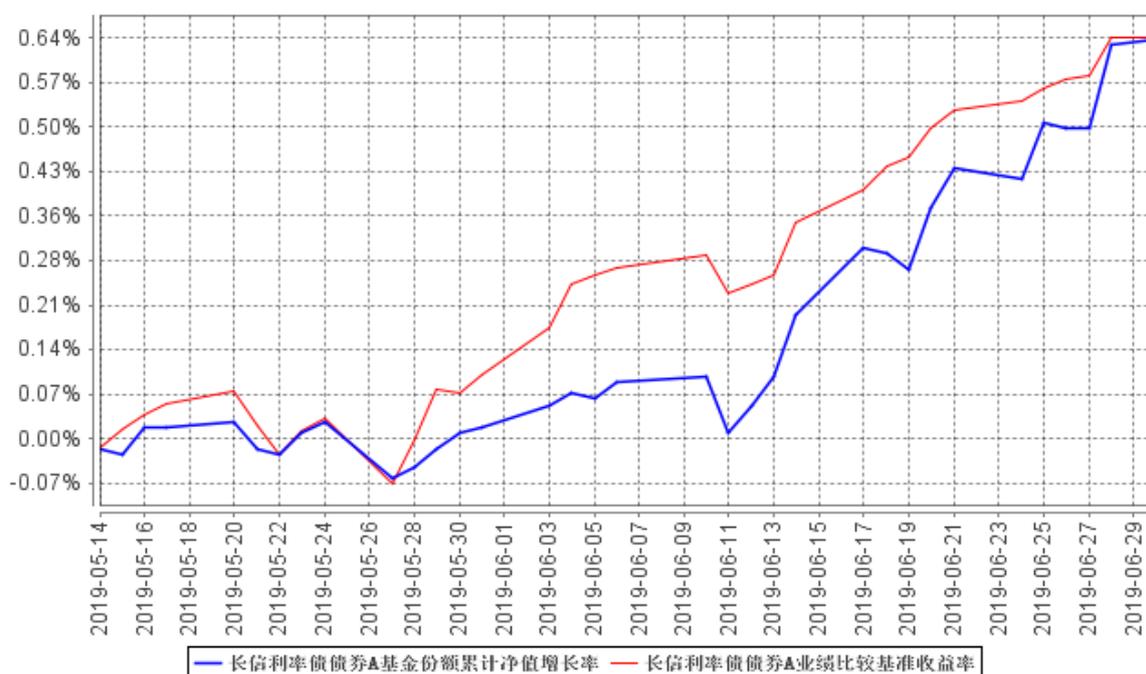
长信利率债债券 A

阶段	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	0.62%	0.06%	0.54%	0.03%	0.08%	0.03%
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	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	0.60%	0.06%	0.54%	0.03%	0.06%	0.03%
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 自基金转型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、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 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

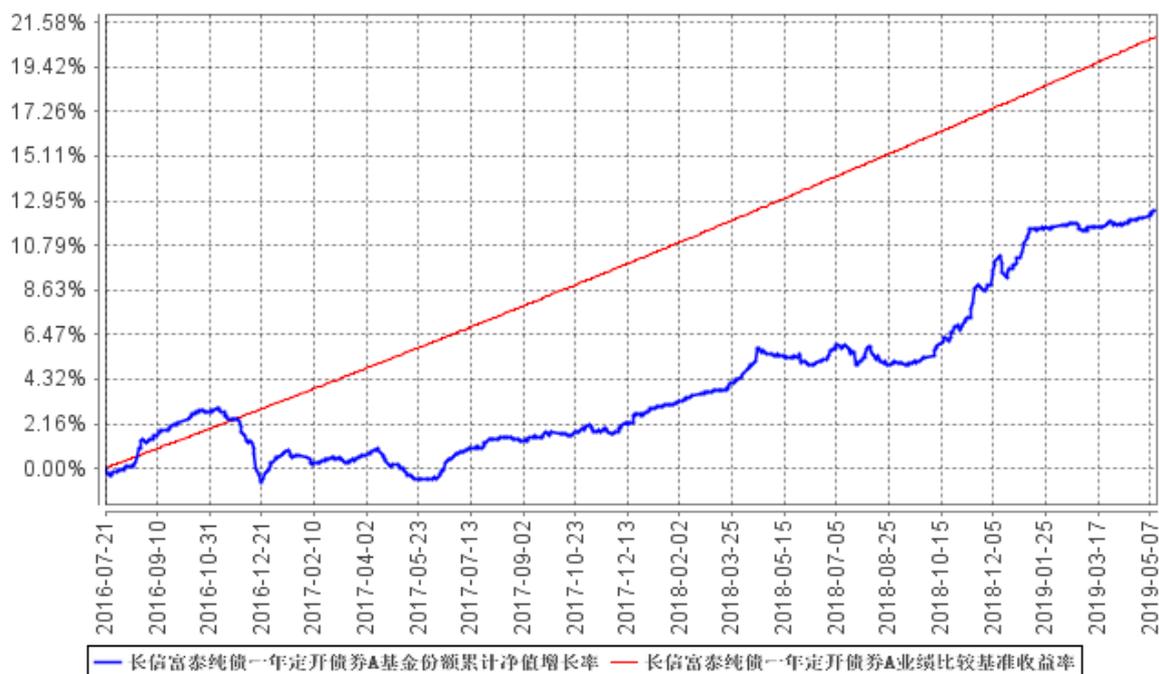
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月 (2019年 4月1日至 2019年 5月13日)	0.48%	0.05%	0.80%	0.02%	-0.32%	0.03%
过去六个月 (2019年 1月1日至 2019年 5月13日)	2.13%	0.07%	2.49%	0.02%	-0.36%	0.05%
过去一年 (2018年 7月1日至 2019年 5月13日)	6.41%	0.12%	6.04%	0.02%	0.37%	0.10%
自基金合同 生效起至基 金合同失效 前日 (2019年 5月13日)	12.49%	0.10%	20.91%	0.02%	-8.42%	0.08%

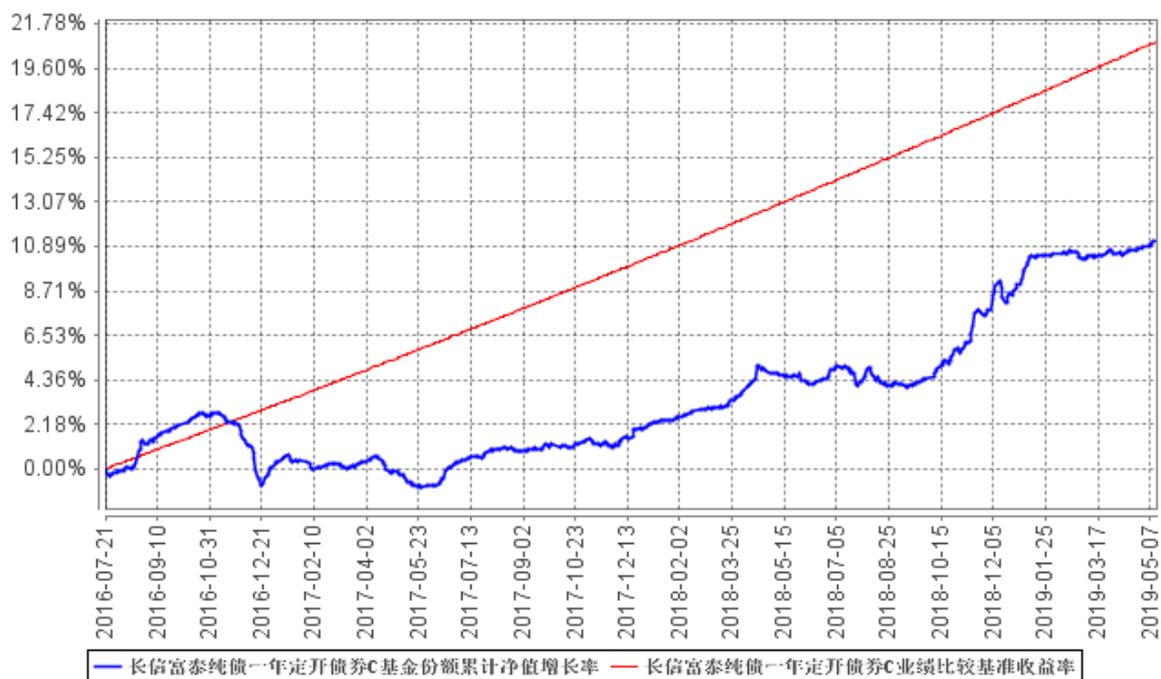
长信富泰纯债一年定开债券 C

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 (2019年 4月1日至 2019年 5月13日)	0.45%	0.05%	0.80%	0.02%	-0.35%	0.03%

过去六个月 (2019年 1月1日至 2019年 5月13日)	1.99%	0.07%	2.49%	0.02%	-0.50%	0.05%
过去一年 (2018年 7月1日至 2019年 5月13日)	6.05%	0.12%	6.04%	0.02%	0.01%	0.10%
自基金合同 生效起至基 金合同失效 前日 (2019年 5月13日)	11.18%	0.10%	20.91%	0.02%	-9.73%	0.08%

### 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%、武汉钢铁股份有限公司占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（转型后）

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		
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。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型前）

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		
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。

## 4.2 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 年上半年，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 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 2.13%，长信富泰纯债一年定开债券 C 净值增长率为 1.99%，同期业绩比较基准收益率为 2.49%；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%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

三季度经济增速可能会有所回落，四季度还有待观察。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，债券市场多空均在，震荡的大格局难改。

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。

#### 4.6 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、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金可进行收益分配，具体分红方案见基金管理人根据基金运作情况届时不定期发布的相关分红公告，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 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，国泰君安证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在长信利率债债券型证券投资基金（以下称“本基金”）（原长信富泰纯债一年定期开放债券型证券投资基金）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况（如有）、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整。

## §6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型后）

### 6.1 资产负债表

会计主体：长信利率债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
<b>资产：</b>	
银行存款	1,041,623.69
结算备付金	179,386.16
存出保证金	17,945.54
交易性金融资产	11,574,085.00
其中：股票投资	-
基金投资	-
债券投资	11,574,085.00
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	103,946.70
应收利息	200,464.09
应收股利	-
应收申购款	2,006,351.88
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	15,123,803.06
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2019年6月30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	2,700,000.00
应付证券清算款	1,016,868.80
应付赎回款	-
应付管理人报酬	2,262.81
应付托管费	323.24
应付销售服务费	1,099.77
应付交易费用	1,895.00

应交税费	-
应付利息	36.05
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	18,916.99
负债合计	3,741,402.66
<b>所有者权益：</b>	
实收基金	10,201,667.31
未分配利润	1,180,733.09
所有者权益合计	11,382,400.40
负债和所有者权益总计	15,123,803.06

注：1、报告截止日2019年6月30日，长信利率债债券A份额净值1.1213元，长信利率债债券C份额净值1.1120元。基金份额总额为10,201,667.31份，其中长信利率债债券A份额4,067,344.16份，长信利率债债券C份额6,134,323.15份。

2、本基金本报告期为2019年5月14日至2019年6月30日，转型后的基金基金合同于2019年5月14日正式生效，为报告期内合同生效的基金，本报告期的财务报表和报表附注均无同期对比数据。

## 6.2 利润表

会计主体：长信利率债债券型证券投资基金

本报告期：2019年5月14日(基金转型起始日)至2019年6月30日

单位：人民币元

项 目	本期
	2019年5月14日(基金转型起始日)至2019年6月30日
<b>一、收入</b>	72,589.28
1. 利息收入	47,691.53
其中：存款利息收入	1,866.15
债券利息收入	45,825.38
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	-
其他利息收入	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-3,634.26
其中：股票投资收益	-
基金投资收益	-
债券投资收益	-3,634.26
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）	28,531.86
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	0.15
<b>减：二、费用</b>	<b>19,434.60</b>
1. 管理人报酬	3,498.50
2. 托管费	499.78
3. 销售服务费	1,606.16
4. 交易费用	523.73
5. 利息支出	5,909.21
其中：卖出回购金融资产支出	5,909.21
6. 税金及附加	-
7. 其他费用	7,397.22
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>53,154.68</b>
减：所得税费用	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>53,154.68</b>

注：本基金本报告期为2019年5月14日至2019年6月30日，转型后的基金基金合同于2019年5月14日正式生效，为报告期内合同生效的基金，本报告期的财务报表和报表附注均无同期对比数据。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长信利率债债券型证券投资基金

本报告期：2019年5月14日(基金转型起始日)至2019年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2019年5月14日(基金转型起始日)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）	6,448,975.63	716,532.03	7,165,507.66
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	53,154.68	53,154.68
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）	3,752,691.68	411,046.38	4,163,738.06
其中：1. 基金申购款	4,157,900.79	455,886.57	4,613,787.36
2. 基金赎回款（以“-”号填列）	-405,209.11	-44,840.19	-450,049.30

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）	10,201,667.31	1,180,733.09	11,382,400.40

注：本基金本报告期为2019年5月14日至2019年6月30日，转型后的基金基金合同于2019年5月14日正式生效，为报告期内合同生效的基金，本报告期的财务报表和报表附注均无同期对比数据。

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：

<u>成善栋</u>	<u>覃波</u>	<u>孙红辉</u>
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

长信利率债债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)由长信富泰纯债一年定期开放债券型证券投资基金(以下简称“长信富泰纯债一年定开债券”)转型而来。长信富泰纯债一年定开债券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》、《长信富泰纯债一年定期开放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”)以证监许可[2015]2617号文及机构部函[2016]1344号文批准公开募集。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、申购费用收取方式的不同，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规模为1,073,054,293.32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1600546号验资报告。基金合同于2016年7月21日生效。本基金的基金管理人为长信基金管理有限责任公司，基金托管人为国泰君安证券股份有限公司。

基金管理人于2019年3月11日0:00起至2019年4月4日17:00止以通讯方式召开了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。

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《长信利率债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、可分离交易可转债的纯债部分、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）、同业存单、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、股票等资产投资，可转债仅投资二级市场可分离交易可转债的纯债部分。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：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。本基金所界定的利率债券是指国债、政策性金融债和央行票据。本基金的业绩比较基准为：中债国开行债券指数收益率 $\times$ 80%+银行一年期定存利率（税后） $\times$ 20%。

#### 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5月14日（基金转型起始日）至2019年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

## 6.4.4 重要会计政策和会计估计

### 6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。本财务报表的实际编制期间为2019年5月14日（基金转型起始日）至2019年6月30日止期间。

### 6.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

#### 1) 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和贷款及应收款项，暂无金融资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的各类应收款项、买入返售金融资产等在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产分类为贷款及应收款项。

#### 2) 金融负债的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。贷款及应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，贷款及应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价（包括转出的非现金资产或承担的新金融负债）之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层次的输入值确定公允价值计量层次。第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

- 1) 对于银行间市场交易的固定收益品种，以及交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、资产支持证券和私募债券除外），按照第三方估值机构提供的估值确定公允价值。
- 2) 对存在活跃市场的其他投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值。
- 3) 对存在活跃市场的其他投资品种，如估值日无市价且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值。
- 4) 当投资品种不再存在活跃市场，基金管理人估值委员会认为必要时，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收

基金的变动分别于上述各交易确认日认列。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配（未分配利润）已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配（未分配利润）。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

##### - 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

##### - 投资收益

债券投资收益为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本与应收利息（若有）后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本后的差额确认。

##### - 公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产卖出或到期时转出计入投资收益。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.35% 的年费率逐日计提。

本基金的基金托管费按前一日基金资产净值 0.05% 的年费率逐日计提。

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按前一日 C 类基金份额资产净值 0.40% 的年费率逐日计提。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的交易费用发生时按照确定的金额计入交易费用。

卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率逐日计提。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金可进行收益分配，具体分红方案见基金管理人根据基金运作情况届时不定期发布的相关分红公告，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，各类型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。

#### 6.4.4.12 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策与计量基础一致。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

根据《关于发布〈中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准〉的通知》（中基协发[2014]24号），在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无需说明的重大会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无需说明的重大会计估计变更。

#### 6.4.5.3 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。

## 6.4.6 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。

## 6.4.7 关联方关系

### 6.4.7.1 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

注：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。

### 6.4.7.2 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
国泰君安证券股份有限公司(以下简称“国泰君安”)	基金托管人、基金销售机构

## 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.8.1.1 股票交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 6.4.8.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年5月14日(基金转型起始日)至2019年6月30日
-------	--------------------------------------

	成交金额	占当期债券 成交总额的比例
国泰君安	11,788,904.49	100.00%

注：转型后的本基金基金合同于2019年5月14日起正式生效，无上年度可比期间数据。

#### 6.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年5月14日(基金转型起始日)至2019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
国泰君安	62,300,000.00	100.00%

注：转型后的本基金基金合同于2019年5月14日起正式生效，无上年度可比期间数据。

#### 6.4.8.1.4 权证交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期无应付关联方交易单元的佣金。

### 6.4.8.2 关联方报酬

#### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年5月14日(基金转型起始日)至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,498.50
其中：支付销售机构的客户维护费	1,992.74

注：1、转型后的本基金基金合同于2019年5月14日起正式生效，无上年度可比期间数据。

2、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×0.35%的年费率确认，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×0.35%÷当年天数。

#### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年5月14日(基金转型起始日)至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	499.78

注：1、转型后的本基金基金合同于2019年5月14日起正式生效，无上年度可比期间数据。

2、支付基金托管人国泰君安的资金托管费按前一日基金资产净值×0.05%的年费率确认，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.05%÷当年天数。

### 6.4.8.2.3 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 2019年5月14日(基金转型起始日)至2019年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长信利率债债券 A	长信利率债债券 C	合计
长信基金	-	82.71	82.71
国泰君安	-	0.96	0.96
合计	-	83.67	83.67

注：1、转型后的本基金基金合同于2019年5月14日起正式生效，无上年度可比期间数据。

2、根据基金合同的规定，长信利率债债券 A 不收取销售服务费，长信利率债债券 C 的销售服务费按基金前一日的资产净值×0.40%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：长信利率债债券 C 的日销售服务费=前一日长信利率债债券 C 资产净值×0.40%÷当年天数。

### 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金在本报告期末与关联方通过银行间同业市场进行债券(含回购)交易。

### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

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

注：本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

#### 6.4.8.4.2 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：本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未持有本基金。

### 6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

注：本基金的银行存款存放在托管人国泰君安在中国工商银行股份有限公司开立的托管账户中；本基金本报告期内无源自本基金托管人国泰君安的银行存款及利息收入。

#### **6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

注：本基金在本报告期末在承销期内购入由关联方承销的证券。

#### **6.4.8.7 其他关联交易事项的说明**

注：本基金本报告期内无其他关联交易事项。

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

#### **6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

注：本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

#### **6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

注：本基金本报告期末无暂时停牌等流通受限股票。

#### **6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

##### **6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购**

注：本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

##### **6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购**

截至本报告期末2019年6月30日止，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2,700,000.00元，其中2,600,000.00元于2019年7月1日到期，100,000.00元于2019年7月9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 半年度财务会计报告（未经审计）（转型前）

### 6.1 资产负债表

会计主体：长信富泰纯债一年定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2019年5月13日

单位：人民币元

资产	本期末 2019年5月13日	上年度末 2018年12月31日
<b>资产：</b>		
银行存款	112,346.81	335,308.30
结算备付金	708,716.51	1,716,856.23
存出保证金	20,161.39	19,435.10
交易性金融资产	7,444,620.00	51,588,460.70
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	7,444,620.00	51,588,460.70
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	-	3,171,243.86
应收利息	96,748.67	1,143,458.25
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	8,382,593.38	57,974,762.44
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2019年5月13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	-	-
卖出回购金融资产款	1,200,000.00	26,200,000.00
应付证券清算款	519.16	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	2,006.88	18,715.58
应付托管费	573.39	5,347.32
应付销售服务费	478.44	8,988.56
应付交易费用	1,422.50	4,735.88
应交税费	545.58	4,589.34
应付利息	-	-5,751.22

应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	11,539.77	129,000.00
负债合计	1,217,085.72	26,365,625.46
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	6,448,975.63	29,132,800.20
未分配利润	716,532.03	2,476,336.78
所有者权益合计	7,165,507.66	31,609,136.98
负债和所有者权益总计	8,382,593.38	57,974,762.44

注：报告截止日2019年5月13日，长信富泰纯债一年定开债券A份额净值1.1142元，长信富泰纯债一年定开债券C份额净值1.1055元。基金份额总额为6,448,975.63份，其中长信富泰纯债一年定开债券A份额4,128,623.59份，长信富泰纯债一年定开债券C份额2,320,352.04份。

## 6.2 利润表

会计主体：长信富泰纯债一年定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2019年1月1日至2019年5月13日

单位：人民币元

项 目	本期 2019年1月1日至2019年 5月13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>	827,404.09	1,925,410.74
1. 利息收入	448,969.83	1,504,550.70
其中：存款利息收入	20,846.09	18,114.73
债券利息收入	417,907.03	1,486,435.97
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	10,216.71	-
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	656,914.81	-411,254.48
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	670,614.81	-411,254.48
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-13,700.00	-
股利收益	-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-278,480.68	832,114.52
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	0.13	-
<b>减：二、费用</b>	285,111.20	719,749.81

1. 管理人报酬	72,456.35	150,911.93
2. 托管费	20,701.81	43,117.65
3. 销售服务费	34,069.09	46,598.39
4. 交易费用	5,556.91	2,831.47
5. 利息支出	130,593.11	368,981.98
其中：卖出回购金融资产支出	130,593.11	368,981.98
6. 税金及附加	594.16	4,405.83
7. 其他费用	21,139.77	102,902.56
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	542,292.89	1,205,660.93
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	542,292.89	1,205,660.93

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长信富泰纯债一年定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2019年1月1日至2019年5月13日

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年5月13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）	29,132,800.20	2,476,336.78	31,609,136.98
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	542,292.89	542,292.89
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）	-22,683,824.57	-2,302,097.64	-24,985,922.21
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-22,683,824.57	-2,302,097.64	-24,985,922.21
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）	6,448,975.63	716,532.03	7,165,507.66
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）	42,140,445.43	670,608.15	42,811,053.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,205,660.93	1,205,660.93
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）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
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）	42,140,445.43	1,876,269.08	44,016,714.51

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：

<u>成善栋</u>	<u>覃波</u>	<u>孙红辉</u>
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

长信富泰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》、《长信富泰纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“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[2015]2617号文及机构部函[2016]1344号文批准公开募集。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、申购费用收取方式的不同，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规模为1,073,054,293.32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1600546号验资报告。基金合同于2016年7月21日生效。本基金的基金管理人为长信基金管理有限责任公司，基金托管人为国泰君安证券股份有限公司。

本基金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，长信富泰纯债一年定开债券变更为长信利率债债券。修订后的《长信利率债债券型证券投资基金基金合同》于2019年5月14日生效。

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《长信富泰纯债一年定期开放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、可分离交易可转债的纯债部分、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，可转债仅投资二级市场可分离交易可转债的纯债部分。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：三年期银行定期存款利率（税后）+4%。

#### 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5月13日（基金合同失效前日）的财务状况以及2019年1月1日至2019年5月13日（基金合同失效前日）止期间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

注：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
国泰君安证券股份有限公司(以下简称“国泰君安”)	基金托管人、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：本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

**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5月13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
国泰君安	92,074,360.44	100.00%	64,035,570.06	100.00%

**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5月13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
国泰君安	911,300,000.00	100.00%	1,029,850,000.00	100.00%

**6.4.7.1.4 权证交易**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

**6.4.7.1.5 应支付关联方的佣金**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

**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 2019年1月1日至2019年 5月13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的管理费	72,456.35	150,911.93
其中：支付销售机构的客户维护费 <sup>1</sup>	7,716.78	74,668.99

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。其计算公式为：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5月13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	20,701.81	43,117.65

注：支付基金托管人国泰君安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。其计算公式为：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5月13日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	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	合计
长信基金	-	29,160.89	29,160.89
国泰君安	-	2.66	2.66
合计	-	29,163.55	29,163.55
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		
	长信富泰纯债一年定开债券A	长信富泰纯债一年定开债券C	合计
长信基金	-	723.99	723.99
国泰君安	-	3.62	3.62
合计	-	727.61	727.61

注：根据基金合同的规定，长信富泰纯债一年定开债券A不收取销售服务费，长信富泰纯债一年定开债券C的销售服务费按基金前一日的资产净值×0.40%的年费率计提，逐日累计至每月月底，

按月支付。其计算公式为：长信富泰纯债一年定开债券 C 的日销售服务费=前一日长信富泰纯债一年定开债券 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。

##### **6.4.7.4.2 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**

注：本基金的银行存款存放在托管人国泰君安在中国工商银行股份有限公司开立的托管账户中；本基金本报告期内及上年度可比期间无源自本基金托管人国泰君安的银行存款及利息收入。

#### **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：本基金本报告期内无其他关联交易事项；本基金上年度可比期间的关联交易严格履行了相关审批程序。

#### **6.4.8 期末（2019年5月13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：本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

##### **6.4.8.2 期末持有的暂时停牌股票**

注：本基金本报告期末无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**

注：本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

###### **6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购**

截至本报告期末 2019 年 5 月 13 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 1,200,000.00 元，于 2019 年 5 月 14 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（转型后）

### 7.3 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	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	其他各项资产	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。

### 7.4 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.4.1 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。

#### 7.4.2 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。

### 7.5 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。

## 7.6 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.6.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：本基金本报告期内未买入股票。

### 7.6.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：本基金本报告期内未卖出股票。

### 7.6.3 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。

## 7.7 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	2,954,810.00	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

## 7.8 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	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

## 7.9 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。

**7.10 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。

**7.11 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。

**7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****7.12.1 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。

**7.12.2 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。

**7.12.3 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。

**7.13 投资组合报告附注****7.13.1 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。

**7.13.2 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。

**7.13.3 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	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

#### **7.13.4 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。

#### **7.13.5 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。

#### **7.13.6 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。

## §7 投资组合报告（转型前）

### 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	7,444,620.00	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。

### 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	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

### 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	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

### 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

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。

### 7.10.2 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）					-13,700.00
国债期货投资本期公允价值变动（元）					-

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

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。

## 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	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

#### 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。

#### 7.12.5 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。

#### 7.11.5 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（转型后）

### 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
长信利率债债券 A	81	50,214.13	0.00	0.00%	4,067,344.16	100.00%
长信利率债债券 C	157	39,072.12	2,710.73	0.04%	6,131,612.42	99.96%
合计	238	42,864.15	2,710.73	0.03%	10,198,956.58	99.97%

### 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	长信利率债债券 A	0.00	0.00%
	长信利率债债券 C	0.00	0.00%
	合计	0.00	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	长信利率债债券 A	0
	长信利率债债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	长信利率债债券 A	0
	长信利率债债券 C	0
	合计	0

## §8 基金份额持有人信息（转型前）

### 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
长信富泰纯债一年定开债券 A	68	60,715.05	0.00	0.00%	4,128,623.59	100.00%
长信富泰纯债一年定开债券 C	134	17,316.06	0.00	0.00%	2,320,352.04	100.00%
合计	202	31,925.62	0.00	0.00%	6,448,975.63	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	长信富泰纯债一年定开债券 A	0.00	0.00%
	长信富泰纯债一年定开债券 C	0.00	0.00%
	合计	0.00	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	长信富泰纯债一年定开债券 A	0
	长信富泰纯债一年定开债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	长信富泰纯债一年定开债券 A	0
	长信富泰纯债一年定开债券 C	0
	合计	0

## §9 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
基金转型起始日基金份额总额	4,128,623.59	2,320,352.04
基金转型起始日起至报告期期末基金总申购份额	51,323.70	4,106,577.09
减:基金转型起始日起至报告期期末基金总赎回份额	112,603.13	292,605.98
基金转型起始日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	4,067,344.16	6,134,323.15

注：转型后的本基金基金合同于 2019 年 5 月 14 日起正式生效，本报告期为 2019 年 5 月 14 日至 2019 年 6 月 30 日。

## §9 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
基金合同生效日基金份额总额	426,943,908.78	646,110,384.54
本报告期期初基金份额总额	4,622,495.91	24,510,304.29
本报告期期间基金总申购份额	-	-
减:本报告期期间基金总赎回份额	493,872.32	22,189,952.25
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	4,128,623.59	2,320,352.04

注：上表中“报告期期末”为2019年5月13日。本报告期为2019年1月1日至2019年5月13日。

## §10 重大事件揭示

### 10.5 基金份额持有人大会决议

基金管理人自 2019 年 3 月 11 日 0:00 起至 2019 年 4 月 4 日 17:00 止，以通讯方式召开长信富泰纯债一年定期开放债券型证券投资基金的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》。经统计，有效参加基金份额持有人大会表决的基金份额共计 16,481,304.93 份，占权益登记日该基金总份额的 56.57%，达到法定的基金份额持有人大会召开条件。经表决，同意本次会议议案的基金份额占有效参加本次会议表决的基金份额持有人所持基金份额的 100%，本次会议议案于 2019 年 4 月 8 日获得通过，基金管理人已于 2019 年 4 月 9 日在指定信息披露媒介及公司网站上就决议生效事项进行了公告。

### 10.6 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

#### 10.6.1 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。

#### 10.6.2 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。

### 10.7 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。

### 10.8 基金投资策略的改变

自 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》正式生效，其投资策略变更为：资产配置策略、类属配置策略、个券选择策略、骑乘策略、息差策略、利差策略、资产支持证券的投资策略、国债期货的投资策略。

本基金详细的投资策略可参见《长信利率债债券型证券投资基金基金合同》等法律文件。

### 10.9 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。

**10.10 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况**

本报告期本基金管理人、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。

**10.11 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型后）****10.11.1 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	
申港证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-

**10.11.2 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
申港证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	11,788,904.49	100.00%	62,300,000.00	100.00%	-	-

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》（证监基金字【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。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前）

### 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	
申港证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	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
申港证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	92,074,360.44	100.00%	911,300,000.00	100.00%	-	-

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

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1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

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。

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。

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。

### 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