

长信富海纯债一年定期开放债券型证券投资
基金
2023 年第 3 季度报告

2023 年 9 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：渤海银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 10 月 25 日

§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责任。

基金托管人渤海银行股份有限公司根据本基金基金合同规定，于 2023 年 10 月 23 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 2023 年 7 月 1 日起至 2023 年 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长信富海纯债一年定开债券
基金主代码	519953
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 9 月 30 日
报告期末基金份额总额	494,749,458.08 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>1、封闭期投资策略</p> <p>(1) 资产配置策略</p> <p>(2) 类属配置策略</p> <p>(3) 个券选择策略</p> <p>(4) 骑乘策略</p> <p>(5) 息差策略</p> <p>(6) 利差策略</p> <p>(7) 资产支持证券的投资策略</p> <p>2、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	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。	
基金管理人	长信基金管理有限责任公司	
基金托管人	渤海银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	长信富海纯债一年定开债券 A	长信富海纯债一年定开债券 C
下属分级基金的交易代码	005068	519953
报告期末下属分级基金的份额总额	483,857,008.57 份	10,892,449.51 份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2023 年 7 月 1 日-2023 年 9 月 30 日）	
	长信富海纯债一年定开债券 A	长信富海纯债一年定开债券 C
1. 本期已实现收益	2,424,035.59	54,287.24
2. 本期利润	1,590,196.86	35,509.16
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0033	0.0033
4. 期末基金资产净值	534,494,732.80	12,036,965.53
5. 期末基金份额净值	1.1047	1.1051

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

长信富海纯债一年定开债券 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
过去三个月	0.30%	0.06%	0.69%	0.05%	-0.39%	0.01%
过去六个月	2.10%	0.05%	2.49%	0.05%	-0.39%	0.00%
过去一年	4.28%	0.05%	3.39%	0.05%	0.89%	0.00%
过去三年	13.53%	0.04%	15.96%	0.04%	-2.43%	0.00%

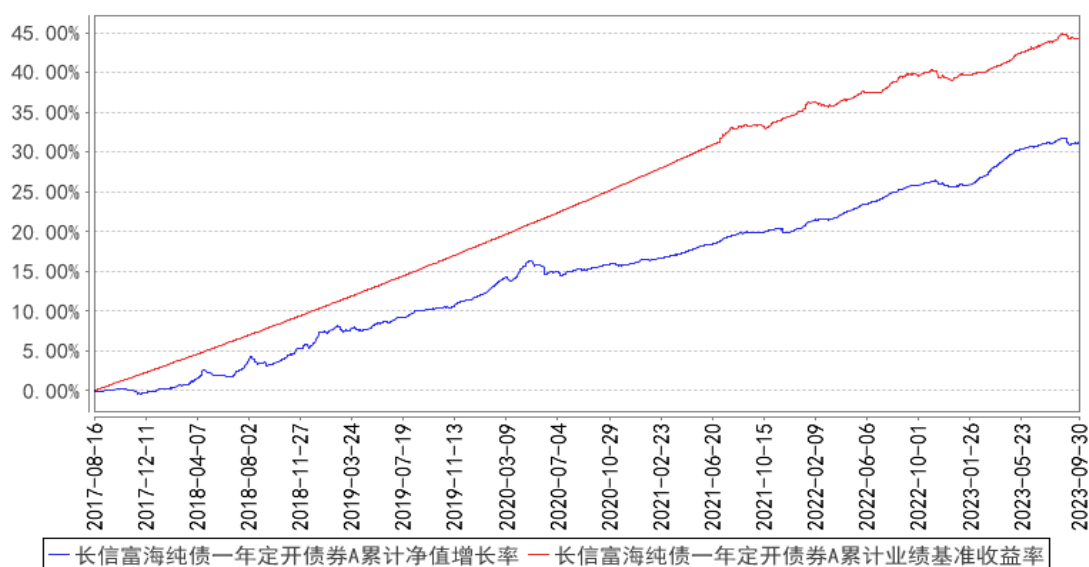
过去五年	26.87%	0.05%	33.39%	0.03%	-6.52%	0.02%
自份额增加 日起至今	31.19%	0.05%	44.32%	0.03%	-13.13%	0.02%

长信富海纯债一年定开债券 C

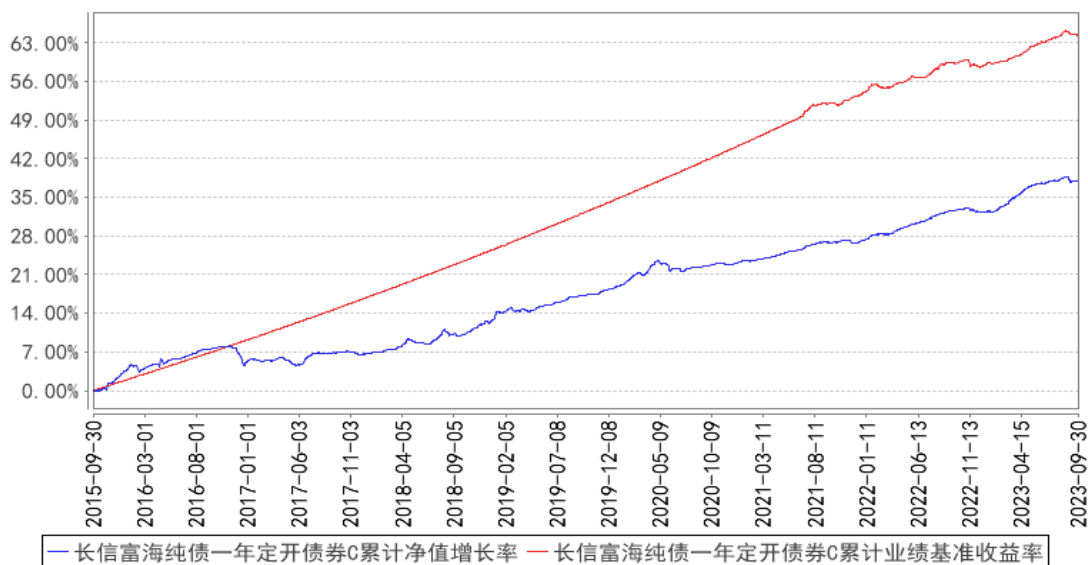
阶段	净值增长率①	净值增长率标准 差②	业绩比较基准 收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	0.30%	0.06%	0.69%	0.05%	-0.39%	0.01%
过去六个月	2.10%	0.05%	2.49%	0.05%	-0.39%	0.00%
过去一年	4.18%	0.05%	3.39%	0.05%	0.79%	0.00%
过去三年	12.56%	0.04%	15.96%	0.04%	-3.40%	0.00%
过去五年	25.45%	0.05%	33.39%	0.03%	-7.94%	0.02%
自基金合同 生效起至今	38.10%	0.08%	64.58%	0.02%	-26.48%	0.06%

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

长信富海纯债一年定开债券A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势
对比图



长信富海纯债一年定开债券C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、基金管理人自 2017 年 8 月 16 日起对长信富海纯债一年定期开放债券型证券投资基金进行份额分类，原有基金份额为 C 类份额，增设 A 类份额。

2、长信富海纯债一年定开债券 C 图示日期为 2015 年 9 月 30 日至 2023 年 9 月 30 日，长信富海纯债一年定开债券 A 图示日期为 2017 年 8 月 16 日（份额增加日）至 2023 年 9 月 30 日。

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

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

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		
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	2016 年 12 月 13 日	-	29 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，中国国籍。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、固定收益部副总监、固定收益部总监、长信中短债证券投资基金、长信利息收益开放式证券投资基金、长信长金通货币市场基金、长信富民纯债一年定期开放债券型

	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和长信富全纯债一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理、固收多策略部副总监				证券投资基金和长信稳势纯债债券型证券投资基金的基金经理。现任固收多策略部副总监、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、长信富海纯债一年定期开放债券型证券投资基金和长信富全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；新增或变更基金经理的日期根据对外披露的公告日期填写；

2、证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

进入三季度，受经济数据及央行调整政策利率影响，债券收益率开始下行；8 月后债券收益率逐步反弹，央行超预期降息后资金面也由偏宽逐步收敛。

三季度，我们根据市场变化相应调整策略，选择相对灵活的久期，组合保持平稳。

从经济基本面来看，多项政策出台有助于促进消费潜力释放、地产销售企稳，拉动经济逐步回升。从货币政策来看，稳增长压力下预计仍然保持偏宽松的基调，但汇率贬值压力较大，对国内货币政策宽松的约束也较强。向后看，债券市场进入重要观察期。

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。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 9 月 30 日，长信富海纯债一年定开债券 A 基金份额净值为 1.1047 元，份额累计净值为 1.2847 元，本报告期内长信富海纯债一年定开债券 A 净值增长率为 0.30%；长信富海纯债一年定开债券 C 基金份额净值为 1.1051 元，份额累计净值为 1.3396 元，本报告期内长信富海纯债一年定开债券 C 净值增长率为 0.30%，同期业绩比较基准收益率为 0.69%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

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	543,027,774.17	99.30
	其中：债券	543,027,774.17	99.30
	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	3,830,804.14	0.70
8	其他资产	-	-
9	合计	546,858,578.31	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。本基金本报告期末未参与转融通证券出借业务。

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

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

本基金本报告期末通过港股通交易机制投资港股。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 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

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	央行票据	-	-
3	金融债券	262,509,953.92	48.03
	其中：政策性金融债	20,706,378.30	3.79
4	企业债券	97,459,417.31	17.83
5	企业短期融资券	10,317,980.33	1.89
6	中期票据	74,773,069.00	13.68
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	97,967,353.61	17.93
9	其他	-	-
10	合计	543,027,774.17	99.36

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	2380044	23 高新债 01	300,000	32,561,065.57	5.96
2	102380032	23 宿州城投 MTN001	300,000	32,526,123.29	5.95
3	2021038	20 杭联农商二级 01	300,000	32,018,309.59	5.86
4	232280012	22 广州银行二级 资本债 01	300,000	31,899,657.53	5.84

5	2120038	21 东莞银行二级 02	300,000	31,676,786.89	5.80
---	---------	-----------------	---------	---------------	------

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

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

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

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

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

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是否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

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体杭州联合农村商业银行股份有限公司于 2022 年 11 月 21 日收到中国银保监会浙江监管局行政处罚信息公开表（浙银保监罚决字（2022）34 号），经查，杭州联合农村商业银行存在贷款用途管控不力，个人消费贷款资金被挪用于购房的行为，根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第（五）项规定，中国银行保险监督管理委员会浙江监管局决定对杭州联合农村商业银行处以罚款人民币 30 万元。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体杭州联合农村商业银行股份有限公司于 2023 年 7 月 13 日收到中国银保监会浙江监管局行政处罚信息公开表（浙银保监罚决字（2023）20 号），经查，杭州联合农村商业银行存在分支机构未经批准自行停业、报送行政许可请示材料隐瞒重要事实的行为，根据《中华人民共和国商业银行法》第二十三条第二款、《中华人民共和国银行业监

督管理法》第四十六条第三项、第四十八条第二项规定，中国银行保险监督管理委员会浙江监管局决定吊销杭州联合农村商业银行股份有限公司梅家坞分理处金融许可证，对杭州联合农村商业银行股份有限公司罚款人民币 30 万元，并对相关主管人员进行警告。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体青岛银行股份有限公司于 2023 年 1 月 11 日收到青岛银保监局行政处罚信息公开表（青银保监罚决字（2022）143 号），根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条规定，经查，青岛银行股份有限公司存在以下行为：保理业务管理严重不尽职；对公贷款资金被挪用；项目贷款未按工程进度放款，贷款资金被挪用；资产分类不准确；置换贷款管理严重不审慎；投资业务授信管理不审慎；绕道债权融资计划为房地产企业提供流资；个人贷款资金被挪用进入资本市场；个人线上贷款资金被挪用；理财产品相互交易调节收益；违规办理信用卡业务。综上，中国银行保险监督管理委员会青岛监管局决定对青岛银行股份有限公司处以罚款人民币 605 万元。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体青岛银行股份有限公司于 2023 年 1 月 11 日收到青岛银保监局行政处罚信息公开表（青银保监罚决字（2022）144 号），根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条规定，经查，青岛银行股份有限公司存在开展私募股权投资基金托管、存放和保管业务不审慎的行为。综上，中国银行保险监督管理委员会青岛监管局决定对青岛银行股份有限公司处以罚款人民币 150 万元。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体青岛银行股份有限公司于 2023 年 7 月 4 日收到青岛银保监局行政处罚信息公开表（青银保监罚决字（2023）54 号），根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条规定，经查，青岛银行股份有限公司存在向小微企业收取银行承兑汇票敞口承诺费、互联网贷款信息披露不规范、夸大营销的行为。综上，中国银行保险监督管理委员会青岛监管局决定对青岛银行股份有限公司处以罚款人民币 52 万元。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体长沙银行股份有限公司于 2023 年 6 月 26 日收到湖南银保监局机关行政处罚信息公开表（湘银保监罚决字（2023）59 号），经查，长沙银行股份有限公司存在员工异常行为排查不到位的情况，根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条，中国银行保险监督管理委员会湖南监管局决定对长沙银行股份有限公司罚款 40 万元。

对如上证券投资决策程序的说明：公司研究部门按照内部研究工作规范对该证券进行分析后将其列入基金投资对象备选库。在此基础上本基金的基金经理根据具体市场情况独立作出投资决策。该事件发生后，本基金管理人对该证券的发行主体进行了进一步了解与分析，认为此事件未对该证券投资价值判断产生重大的实质性影响。本基金投资于该证券的投资决策过程符合制度规

定的投资权限范围与投资决策程序。

报告期内本基金投资的前十名证券中其余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是否超出基金合同规定的备选股票库

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

本基金本报告期末未持有其他资产。

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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

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

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

单位：份

项目	长信富海纯债一年定开债券 A	长信富海纯债一年定开债券 C
报告期期初基金份额总额	483,857,008.57	10,892,449.51
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	-	-
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	483,857,008.57	10,892,449.51

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

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

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	2023 年 7 月 1 日至 9 月 30 日	472,678,200.04	-	-472,678,200.04	472,678,200.04	95.54
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

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、《长信富海纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长信富海纯债一年定期开放债券型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《长信富海纯债一年定期开放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。

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：<https://www.cxfund.com.cn>。

长信基金管理有限责任公司

2023 年 10 月 25 日