

(上接B236版)

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

关联方名称	本期 2019年6月10日至2019年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国民生银行	1,140.81	1,888.82

注:本基金通过“中国民生银行基金托管资金专用存款账户”转存于中国建设银行登记结算有限责任公司等结算账户,于2019年6月30日的相关余额为人民币769,932.33元。

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:本基金本报告期末未因认购新发/增发证券而持有流通受限证券。
6.4.12.17 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。
6.4.12.18 期末债券正回购交易中作为抵押的债券
6.4.12.18.1 银行间市场债券正回购
截至本报告期末2019年6月30日止,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 7,989,868.01元,是以下列债券作为质押:

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值净额	数量(张)	期末估值总额
101000007	16广佛铁路MTN002	2019年7月5日	86.66	85,000	8,386,100.00
合计				85,000	8,386,100.00

6.4.12.18.2 交易所市场债券正回购
截至本报告期末2019年6月30日止,本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额37,500,000.00元。于2019年7月1日(先后)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。

6.1 资产负债表
会计主体:长信富安纯债一年定期开放债券型证券投资基金
报告截止日:2019年6月9日

资产	本期末 2019年6月9日	上年度末 2018年12月31日
资产:		
银行存款	12,968,989.56	3,726,206.15
结算备付金	770,155.15	7,711,229.97
存出保证金	26,818.88	6,269.23
交易性金融资产	278,022,332.20	247,697,594.89
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	278,022,332.20	247,697,594.89
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	-	126,562,428.34
应收证券清算款	2,360,000.00	-
应收利息	5,425,690.75	4,347,739.69
应收股利	-	-
应收申购款	1,609,514.99	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	301,792,481.53	389,060,566.63
资产总计	683,745.10	523,519,388.34
负债和所有者权益		
负债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	63,116,539.92	52,000,000.00
应付证券清算款	890,230.29	42,178.05
应付赎回款	4,469,361.26	-
应付管理人报酬	40,691.12	129,083.44
应付托管费	11,697.46	36,881.01
应付销售服务费	2,798.17	11,392.49
应付交易费	8,317.40	11,476.97
应交税费	50,703.69	49,004.03
应付利息	20,356.89	10,326.35
应付短期融资款	-	-
其他负债	73,153.69	229,000.00
负债合计	68,933,745.10	523,519,388.34
所有者权益:		
实收基金	226,770,685.07	330,770,863.20
未分配利润	7,426,016.36	5,769,766.09
所有者权益合计	233,196,701.43	336,540,619.29
负债和所有者权益总计	301,792,481.53	389,060,566.63

注:本报告期末2019年6月9日,长信富安纯债一年定期开放A基金份额净值1.0331元,基金份额总额200,636,183.67份;长信富安纯债一年定期开放C基金份额净值1.0314元,基金份额总额255,134,501.40份。长信富安纯债一年定期开放债券型总额合计为225,770,685.07份。

6.2 利润表
会计主体:长信富安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6月9日

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月9日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
一、收入	8,340,251.33	6,517,641.94
1.利息收入	9,691,816.44	7,318,336.95
其中:存款利息收入	54,139.69	79,586.68
债券利息收入	9,568,119.07	7,227,710.33
资产支持证券投资利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	39,157.68	11,013.09
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	-2,559,288.27	-1,776,421.47
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-2,559,288.27	-1,786,418.56
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具投资收益	-	10,097.08
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	1,297,276.84	976,626.43
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	9,444.32	-
减:二、费用	3,613,391.46	2,702,495.85
1.管理人报酬	996,647.16	603,197.31
2.托管费	284,759.33	172,342.16
3.销售服务费	100,349.69	42,181.97
4.交易费用	8,248.24	1,702.97
5.利息支出	2,106,806.44	1,724,009.01
其中:卖出回购金融资产支出	1,208,806.44	1,724,009.01
6.税金及附加	23,943.70	25,474.18
7.其他费用	90,641.90	123,526.76
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	4,726,859.87	3,815,183.36
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	4,726,859.87	3,815,183.36

6.3 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:长信富安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6月9日

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月9日	上期期末余额
一、期初所有者权益(基金净值)	330,770,863.20	336,540,619.29
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-4,726,859.87	-4,726,859.87
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净申购/赎回/转入/转出)	-105,000,178.13	-108,077,741.73
其中:1.基金申购款	9,549,172.88	294,016.13
2.基金赎回款	-114,549,350.71	-3,272,129.73
四、本期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净收益分配)	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	225,770,685.07	228,186,736.43
项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上期期末余额
一、期初所有者权益(基金净值)	170,449,277.57	1,152,923.99
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	3,815,183.36
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净申购/赎回/转入/转出)	-	-
其中:1.基金申购款	-	-
2.基金赎回款	-	-
四、本期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净收益分配)	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	170,449,277.57	4,968,107.35

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:

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
长信富安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》、《长信富安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,经中国证监会基金备案委员会(以下简称“中国证监会”)以证监基金[2015]2310号文批准公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定期。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。本基金首次发售募集基金份额为1,482,871,919.06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1600965号验资报告。基金合同于2015年11月23日生效。本基金的管理人为长信基金管理有限公司,基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

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《关于长信富安纯债一年定期开放债券型证券投资基金变更注册的议案》,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5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《长信富安纯债半年定期开放债券型证券投资基金基金合同》生效后,长信富安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5月10日至2019年6月6日。日本次基金份额持有人大会决议生效后,选择期结束之日次一个工作日(2019年6月10日)起,长信富安纯债一年定期开放债券变更为长信富安纯债半年定期开放债。修订后的《长信富安纯债半年定期开放债券型证券投资基金基金合同》于2019年6月10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《长信富安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,本基金投资于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和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。如法律法规监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人将在履行适当程序后,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%,但在每次开放申购前三个月、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所保证金后,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约束。本基金业绩比较基准为: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,同时在具体会计处理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9日的财务状况以及2019年1月1日至2019年6月9日期间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贷款辅助服务增值税征收政策的通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]190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)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,以基金管理人作为增值税纳税人,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。

2)对基金从证券市场取得的收入,包括买卖债券的差价收入、债券的利息收入及其他收入,暂不缴纳企业所得税。
3)对基金取得的债券利息收入,由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税,暂不缴纳企业所得税。
6.4.6 关联方关系
6.4.6.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况
本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方无变化。

6.4.6.2 本报告期与基金发生关联关系的各方关联

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	基金托管人、基金销售机构
长江证券股份有限公司(以下简称“长江证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构

6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易
6.4.7.1.1 股票交易
注:本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。
6.4.7.1.2 债券交易

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月9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	133,433,322.32	93,03%
长江证券	133,433,322.32	91,962,124.29 71.66%

6.4.7.1.3 债券回购交易
6.4.7.1.3.1 银行间市场
6.4.7.1.3.2 交易所市场

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月9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	133,433,322.32	93,03%
长江证券	133,433,322.32	91,962,124.29 71.66%

6.4.7.1.4 债券正回购交易
6.4.7.1.4.1 银行间市场
6.4.7.1.4.2 交易所市场

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月9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	133,433,322.32	93,03%
长江证券	133,433,322.32	91,962,124.29 71.66%

6.4.7.1.5 债券逆回购交易
6.4.7.1.5.1 银行间市场
6.4.7.1.5.2 交易所市场

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月9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	133,433,322.32	93,03%
长江证券	133,433,322.32	91,962,124.29 71.66%

6.4.7.1.6 债券正回购交易
6.4.7.1.6.1 银行间市场
6.4.7.1.6.2 交易所市场

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月9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	133,433,322.32	93,03%
长江证券	133,433,322.32	91,962,124.29 71.66%

6.4.7.1.7 债券逆回购交易
6.4.7.1.7.1 银行间市场
6.4.7.1.7.2 交易所市场

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月9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	133,433,322.32	93,03%
长江证券	133,433,322.32	91,962,124.29 71.66%

6.4.7.1.8 债券正回购交易
6.4.7.1.8.1 银行间市场
6.4.7.1.8.2 交易所市场

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月9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	133,433,322.32	93,03%
长江证券	133,433,322.32	91,962,124.29 71.66%

6.4.7.1.9 债券逆回购交易
6.4.7.1.9.1 银行间市场
6.4.7.1.9.2 交易所市场

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月9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	133,433,322.32	93,03%
长江证券	133,433,322.32	91,962,124.29 71.66%

6.4.7.1.10 债券正回购交易
6.4.7.1.10.1 银行间市场
6.4.7.1.10.2 交易所市场

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月9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	133,433,322.32	93,03%
长江证券	133,433,322.32	91,962,124.29 71.66%

6.4.7.1.11 债券逆回购交易
6.4.7.1.11.1 银行间市场
6.4.7.1.11.2 交易所市场

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月9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	133,433,322.32	93,03%
长江证券	133,433,322.32	91,962,124.29 71.66%

6.4.7.1.12 债券正回购交易
6.4.7.1.12.1 银行间市场
6.4.7.1.12.2 交易所市场

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月9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	133,433,322.32	93,03%
长江证券	133,433,322.32	91,962,124.29 71.66%

6.4.7.1.13 债券逆回购交易
6.4.7.1.13.1 银行间市场
6.4.7.1.13.2 交易所市场

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月9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	133,433,322.32	93,03%
长江证券	133,433,322.32	91,962,124.29 71.66%

6.4.7.1.14 债券正回购交易
6.4.7.1.14.1 银行间市场
6.4.7.1.14.2 交易所市场

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月9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	12,968,989.56	24,713.43
当期利息收入	1,332,948.66	16,411.90

注:本基金通过“中国民生银行基金托管资金专用存款账户”转存于中国建设银行登记结算有限责任公司等结算账户,于2019年6月30日的余额为759,932.33元。(2018年12月31日的余额余额为1,747,483.82元)。

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:本基金本报告期及上年度可比期间无其他关联交易事项。
6.4.8 期末(2019年6月9日)本基金持有的流通受限证券
6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券
注:本基金本报告期末未因认购新发/增发证券而持有流通受限证券。
6.4.8.2 期末持有的暂时停牌股票
注:本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。
6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券
6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购
截至本报告期末2019年6月30日止,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 37,500,000.00元,是以下列债券作为质押:

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值净额	数量(张)	期末估值总额
01190115	19广佛铁路MTN001	2019年6月13日	100.09	100,000	10,009,000.00
101690007	16广佛铁路MTN002	2019年6月13日	98.98	100,000	9,898,000.00
101000001	16广佛铁路MTN001	2019年6月13日	98.92	58,000	5,789,560.00
10100010	19广佛铁路MTN001	2019年6月10日	100.54	167,000	16,750,000.00
合计				425,000	42,486,560.00

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购
截至本报告期末2019年6月30日止,本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额7,989,868.01元。于2019年7月1日(先后)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。

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
011901153	19开滦SCF002	2019年6月13日	100.09	100,000	10,009,000.00
10166006	16伊犁财通	2019年6月13日	98.98	100,000	9,898,000.00