长信富平纯债一年定期开放债券型证券投资基金 2018年半年度报告摘要

2018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:平安银行股份有限公司

送出日期:2018 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示

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。

基金托管人平安银行股份有限公司,根据本基金合同规定,于 2018 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 2018 年 1 月 1 日起至 2018 年 6 月 30 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	长信富平纯债一年定开债券	
基金主代码	002858	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年 8 月 15 日	
基金管理人	长信基金管理有限责任公司	
基金托管人	平安银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	297, 555, 883.65 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称;	长信富平纯债一年定开债券 A	长信富平纯债一年定开债券 C
下属分级基金的交易代码;	002858	002859
报告期末下属分级基金的份额总额	289, 910, 344.24 份	7, 645, 539.41 份

2.2 基金产品说明

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,追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金在封闭期与开放期采取不同的投资策略。 (一)封闭期投资策略 1、资产配置策略 2、类属配置策略 3、个券选择策略 4、骑乘策略 5、息差策略 6、利差策略 7、资产支持证券的投资策略 8、国债期货的投资策略 (二)开放期投资策略 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。
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	平安银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周永刚	方琦
	联系电话	021- 61009999	0755- 22160168
	电子邮箱	zhouyg@cxfund.com.cn	FANGQI275@pingan.com.cn
客户服务电话		4007005566	95511- 3
传真		021- 61009800	0755- 82080387

2.4 信息披露方式

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 9 楼,广东省深圳市深南东路 5047 号

§ 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	长信富平纯债一年定开债券 A	长信富平纯债一年定开债券 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018 年 1 月 1 日 - 2018 年 6 月 30 日)	报告期(2018 年 1 月 1 日 - 2018 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	5, 488, 925.20	128, 939.23
本期利润	6, 198, 217.54	147, 627.77
加权平均基金份额本期利润	0.0214	0.0193
本期基金份额净值增长率	2.13%	1.92%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)	
期末可供分配基金份额利润	0.0250	0.0211
期末基金资产净值	297, 911, 100.25	7, 826, 896.81
期末基金份额净值	1.0276	1.0237

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

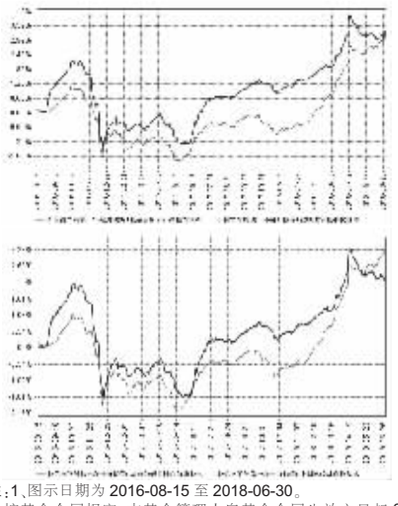
长信富平纯债一年定开债券 A

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
过去一个月	0.02%	0.06%	0.61%	0.05%	- 0.59%	0.01%
过去三个月	0.85%	0.09%	1.97%	0.09%	- 1.12%	0.00%
过去六个月	2.13%	0.07%	4.04%	0.07%	- 1.91%	0.00%
过去一年	3.25%	0.05%	4.20%	0.06%	- 0.95%	- 0.01%
自基金合同生效起至今	3.27%	0.07%	3.39%	0.07%	- 0.12%	0.00%

长信富平纯债一年定开债券 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
过去一个月	- 0.01%	0.06%	0.61%	0.05%	- 0.62%	0.01%
过去三个月	0.75%	0.09%	1.97%	0.09%	- 1.22%	0.00%
过去六个月	1.92%	0.07%	4.04%	0.07%	- 2.12%	0.00%
过去一年	2.81%	0.05%	4.20%	0.06%	- 1.39%	- 0.01%
自基金合同生效起至今	2.47%	0.07%	3.39%	0.07%	- 0.92%	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 2016-08-15 至 2018-06-30。

2、按基金合同规定,本基金管理人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 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 2018 年 6 月 30 日, 本基金管理人共管理 61 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、长信富安纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金(LOF)、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、长信海外收益一年定期开放债券型证券投资基金、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、长信富泰纯债一年定期开放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、长信量化优选混合型证券投资基金(LOF)、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、长信量化价值精选混合型证券投资基金。

4.1.2 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		
张文刚	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)、长信利息收益开放式证券投资基金、长信富平纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信稳益纯债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、长信富海纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信利众债券型证券投资基金、长信利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、长信富安纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金(LOF)、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、长信海外收益一年定期开放债券型证券投资基金、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、长信富泰纯债一年定期开放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、长信长金通货币市场基金、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、长信量化价值精选混合型证券投资基金。	2016年 8 月 15 日	-	24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。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、长信富平纯债一年定期开放债券型证券投资基金交易员、基金经理助理,长信利息收益开放式证券投资基金基金经理职务,现任固定收益部总监,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)、长信利息收益开放式证券投资基金、长信富平纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信稳势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、长信富民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、长信长金通货币市场基金的基金经理。

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

年初以来,国内外环境复杂多变,债券市场波动频繁,信用事件频发,各类资产走势分化严重。利率债呈现收益率先上后下的震荡态势,其中第一阶段的下行主要是由于流动性超预期宽松,而第二阶段的震荡则受到基本面、中美贸易摩擦等多方面因素影响。信用债收益率整体呈先下后上走势,信用分化明显,市场主导因素从年初的监管政策、一季度的流动性、切换到信用风险事件上。

上半年,我们逐步拉长久期,适当增加了利率债和高等级债券仓位,置换了部分中低等级信用债,加大了灵活操作的力度。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末, 长信富平纯债一年定开债券 A 份额净值为 1.0276 元,份额累计净值为 1.0326 元,本报告期内长信富平纯债一年定开债券 A 净值增长率为 2.13%; 长信富平纯债一年定开债券 C 份额净值为 1.0237 元,份额累计净值为 1.0247 元,本报告期内长信富平纯债一年定开债券 C 净值增长率为 1.92%。同期业绩比较基准收益率为 4.04%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市,国际形势风云变幻,国内政策可选空间日益逼仄,稳增长与去杠杆的矛盾日渐尖锐。上半年,央行通过公开市场操作和定向降准维持了流动性的宽松状态,公开市场操作也以逆回购 +MLF 为主。我们认为,货币和财政政策的边际放松是对近年去杠杆过程中的一些弊端进行调整,并不能理解成为全面的经济政策转向,后续政策的演化可能不是一般意义上的紧缩 - 刺激循环, 而是进入到一个比较纠结的状态,有收有放。从高频数据来看,基本面大概率延续下行的趋势且叠加中美贸易战的不确定性,对债券市场仍然有利,但目前债券市场对经济下行的预期已经较为充分。利率债收益率处于去年二、三季度的震荡区间中,继续向下需要找到突破点。信用债等级利差仍有继续扩大趋势,信用风险发酵未结束。

总体来看,当前资金面和基本面仍对债市具有较强支撑,市场流动性充裕合理,资金面维持稳定宽松是大概率事件,而受棚改货币化安置比例的降低的影响,房地产对经济的支撑或趋弱,加之贸易战进行实质执行阶段,外需仍持续低迷。进入三季度,债市震荡分化格局或将延续。

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。

4.6 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及适用性的情况及时修订估值程序;估值委员会成员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。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。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。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,本基金在每个封闭期内收益至少分配 1 次,每份基金份额每次收益分配比例原则上为收益分配基准日(即可供分配利润计算截止日)每份基金份额可供分配利润的 100%;

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

无。

§ 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,平安银行股份有限公司(以下称“本托管人”)在长信富平纯债一年定期开放债券型证券投资基金(以下称“本基金”)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地复核,未发现本基金管理人在存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内未进行利润分配。

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

本报告期内,由长信基金管理有限责任公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告(注:财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等内容真实、准确、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:长信富平纯债一年定期开放债券型证券投资基金

报告截止日:2018 年 6 月 30 日

单位:人民币元

资 产	本期末 2018年 6 月 30 日	上年度末 2017年 12 月 31 日
资 产:		
银行存款	1, 117, 960.20	5, 853, 993.44
结算备付金	2, 000, 696.66	150, 530.30
存出保证金	23, 426.49	46, 646.03
交易性金融资产	368, 631, 000.00	237, 224, 400.00
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	368, 631, 000.00	237, 224, 400.00
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	-	52, 140, 315.21
应收证券清算款	19, 750, 110.18	-
应收利息	7, 722, 553.30	4, 457, 362.23
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	399, 245, 746.83	299, 873, 247.21

负债和所有者权益	本期末 2018年 6 月 30 日	上年度末 2017年 12 月 31 日
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	93, 069, 646.89	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	175, 710.28	177, 817.32
应付托管费	50, 202.93	50, 804.92
应付销售服务费	2, 570.83	2, 606.69
应付交易费用	13, 181.30	10, 866.53
应交税费	36, 357.82	-
应付利息	37, 024.38	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	123, 055.34	239, 000.00
负债合计	93, 507, 749.77	481, 095.46
所有者权益:		
实收基金	297, 555, 883.65	297, 555, 883.65
未分配利润	8, 182, 113.41	1, 836, 268.10
所有者权益合计	305, 737, 997.06	299, 392, 151.75
负债和所有者权益总计	399, 245, 746.83	299, 873, 247.21

注:报告截止日 2018 年 6 月 30 日,长信富平纯债一年定开债 A 份额净值为 1.0276 元,份额总额 289,910,344.24 份,长信富平纯债一年定开债 C 份额净值为 1.0237 元,份额总额 7,645,539.41 份。长信富平纯债一年定开债份额总额合计为 297,555,883.65 份。

6.2 利润表

会计主体:长信富平纯债一年定期开放债券型证券投资基金

本报告期:2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位:人民币元

项 目	本期 2018年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
一、收入	10, 034, 496.83	25, 284, 805.70
1.利息收入	9, 165, 841.08	47, 966, 025.14
其中,存款利息收入	34, 622.04	106, 373.63
债券利息收入	8, 890, 862.95	40, 125, 715.38
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	240, 356.09	7, 733, 936.13
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	140, 674.87	- 20, 513, 592.96
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	140, 674.87	- 20, 099, 692.96
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	- 413, 900.00
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	727, 980.88	- 2, 167, 626.48
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	-	-
减:二、费用	3, 688, 651.52	12, 157, 636.02
1、管理人报酬	1, 052, 981.85	6, 087, 567.29
2、托管费	300, 852.02	1, 739, 304.92
3、销售服务费	15, 418.59	176, 484.60
4、交易费用	11, 229.39	25, 608.48
5、利息支出	2, 148, 084.43	3, 973, 241.33
其中:卖出回购金融资产支出	2, 148, 084.43	3, 973, 241.33
6、税金及附加	27, 429.90	-
7、其他费用	132, 655.34	155, 429.40
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	6, 345, 845.31	13, 127, 169.68
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	6, 345, 845.31	13, 127, 169.68

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:长信富平纯债一年定期开放债券型证券投资基金

本报告期:2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位:人民币元

项目	本期 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)	297, 555, 883.65	1, 836, 268.10	299, 392, 151.75
二、本期经营活动产生的基金净值变动(本期利润)	-	6, 345, 845.31	6, 345, 845.31
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动(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)	297, 555, 883.65	8, 182, 113.41	305, 737, 997.06

项目	上年度可比期间 2017年 1 月 1 日至 2017 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)	1, 764, 632, 292.70	- 13, 137, 017.18	1, 751, 495, 275.52
二、本期经营活动产生的基金净值变动(本期利润)	-	13, 127, 169.68	13, 127, 169.68
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动(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)	1, 764, 632, 292.70	- 9, 847.50	1, 764, 622, 445.20

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

长信富平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]1069 号《关于准予长信富平纯债一年定期开放债券型证券投资基金注册的批复》的核准,由基金管理人长信基金管理有限责任公司向社会公开发行募集。基金合同于 2016 年 8 月 15 日生效。首次设立募集规模为 1,764,632,292.70 份基金份额。本基金为契约型,定期开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构为长信基金管理有限责任公司,基金托管人为平安银行股份有限公司。

本基金将基金份额分为 A 类基金份额和 C 类基金份额。本基金的 A 类基金份额在申购时收取申购费, 赎回时根据持有期限收取赎回费;C 类基金份额不收取申购费,赎回时根据持有期限收取赎回费,但从该类别基金资产中计提销售服务费。

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。本基金不参与权证、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。

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:中证综合债指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下统称“企业会计准则”)编制,同时,对于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修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号 < 年度报告和半年度报告 >》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于 2018 年 6 月 30 日的财务状况、2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

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

6.4.5.1 印花税

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自 2008 年 4 月 24 日起,调整证券(股票)交易印花税税率,由原先的 3‰调整为 1‰;

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自 2008 年 9 月 19 日起,调整由出让方按证券(股票)交易印花税税率缴纳印花税,受让方不再征收,税率不变;

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让,暂免征收印花税。

6.4.5.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定,经国务院批准,自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点,金融业纳入试点范围,由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金(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、债券的转让收入免征增值税;国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税;存款利息收入不征收增值税;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确金面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定,金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定,金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定,本基金运营过程中发生的增值税应税行为,以本基金的基金管理人为增值税纳税人;

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定,自 2018 年 1 月 1 日起,本基金的基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照 3%的征收率缴纳增值税。对本基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从本基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

6.4.5.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例(2011 年修订)》、《征收教育费附加的暂行规定(2011 年修订)》及相关地方教育附加的征收规定,凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人,都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加(除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外)及地方教育费附加。本基金的具体缴纳标准如下:

城市维护建设税 - 按实际缴纳的流转税的 7%计缴。

教育费附加 - 按实际缴纳的流转税的 3%计缴。

地方教育附加 - 按实际缴纳的流转税的 2%计缴

6.4.5.4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定,自 2004 年 1 月 1 日起,对证券投资基金(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、债券的差价收入,继续免征企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定,对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

6.4.5.5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有