长信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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年8月28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	长信纯债一年定开债券	
场内简称	CX纯债	
基金主代码	519973	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年11月29日	
基金管理人	长信基金管理有限责任公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	442,667,798.92份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称：	长信纯债一年定开债券A	长信纯债一年定开债券C
下属分级基金场内简称：	CX纯债A	CX纯债C
下属分级基金的交易代码：	519973	519972
报告期末下属分级基金的份额总额	427,095,429.61份	15,572,369.31份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为纯债基金，以获取高于银行一年期定期存款利率（税后）×1.3+1.1%的回报为目标，追求每年较高的绝对回报。
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（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的前提下，将主要投资于流动性高的投资品种，减小基金净值的波动。
业绩比较基准	银行一年定期存款利率（税后）×1.3+1.1%
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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周永刚	郭明
	联系电话	021-61009999	010-66105798
	电子邮箱	zhouyg@cxfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4007005566	95588
传真		021-61009800	010-66105799

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号时代金融中心9楼、北京市西城区复兴门内大街55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	长信纯债一年定开债券A	长信纯债一年定开债券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	3,175,481.41	-985,654.91
本期利润	9,774,456.53	667,521.14
加权平均基金份额本期利润	0.0198	0.0172
本期基金份额净值增长率	2.02%	1.77%
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	0.0163	0.0136
期末基金资产净值	436,006,054.48	15,854,938.09
期末基金份额净值	1.0209	1.0181

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

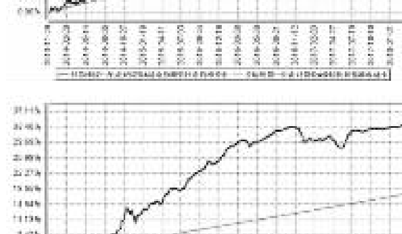
长信纯债一年定开债券A

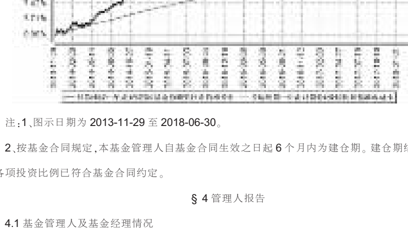
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	-0.08%	0.06%	0.25%	0.01%	-0.33%	0.05%
过去三个月	0.41%	0.09%	0.76%	0.01%	-0.35%	0.08%
过去六个月	2.02%	0.07%	1.52%	0.01%	0.50%	0.06%
过去一年	3.71%	0.06%	3.10%	0.01%	0.61%	0.05%
过去三年	16.12%	0.08%	9.76%	0.01%	6.36%	0.07%
自基金合同生效起至今	38.14%	0.12%	18.39%	0.01%	19.75%	0.11%

长信纯债一年定开债券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	-0.12%	0.06%	0.25%	0.01%	-0.37%	0.05%
过去三个月	0.31%	0.09%	0.76%	0.01%	-0.45%	0.08%
过去六个月	1.77%	0.07%	1.52%	0.01%	0.25%	0.06%
过去一年	3.26%	0.06%	3.10%	0.01%	0.16%	0.05%
过去三年	14.67%	0.08%	9.76%	0.01%	4.91%	0.07%
自基金合同生效起至今	35.52%	0.12%	18.39%	0.01%	17.13%	0.11%

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2013-11-29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 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 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 任职日期	任本基金的基金经理（助理）期限 离任日期	证券从业年限	说明
李小羽	长信利丰债券型证券投资基金、长信利富债券型证券投资基金、长信可转债债券型证券投资基金、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、长信利盈灵活配置混合型证券投资基金、长信利众债券型证券投资基金（LOF）、长信富安纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金和长信利尚一年定期开放混合型证券投资基金的基金经理、公司副总经理、投资决策委员会执行委员	2016年12月13日	-	20年	上海交通大学工学学士，华南理工大学工学硕士，具有基金从业资格，加拿大特许投资经理资格（CIM）。曾任职长城证券公司、加拿大Investors Group Financial Services Co.,Ltd。2002年加入本公司（筹备），先后任基金经理助理、交易管理部总监、固定收益部总监、长信中短债证券投资基金、长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金和长信利发债券型证券投资基金的基金经理。现任长信基金管理有限责任公司副总经理、长信利丰债券型证券投资基金、长信利富债券型证券投资基金、长信可转债债券型证券投资基金、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、长信利盈灵活配置混合型证券投资基金、长信利众债券型证券投资基金（LOF）、长信富安纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金和长信利尚一年定期开放混合型证券投资基金的基金经理。
胡琛予	长信纯债一年定期开放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、长信富安纯债一年定期开放债券型证券投资基金和长信利众债券型证券投资基金（LOF）的基金经理	2018年6月4日	-	6年	经济学硕士，具有基金从业资格。2013年加入长信基金管理有限责任公司，曾任高级债券交易员、投资经理助理和基金经理助理，现任职于固定收益部并担任长信纯债一年定期开放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、长信富安纯债一年定期开放债券型证券投资基金和长信利众债券型证券投资基金（LOF）的基金经理。
胡琛予	曾任本基金的基金经理助理	2016年12月12日	2018年5月22日	6年	曾任本基金的基金经理助理

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、报告截止日至报告批准送出日期间，自2018年7月11日起，李小羽先生不再担任本基金的基金经理。

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

2018年以来，利率债收益率在流动性宽松、中长期经济下行预期以及外部贸易风险的推动下震荡下行。截至6月末，国债短端1年期收益率较上年末大幅下行63bp，中端3-5年期下行47-49bp，长端7-10年期下行41bp。政策性金融债收益率曲线也陡峭化下行，下行幅度大于国债。本组合在本报告期加仓短久期高等级债券，合理运用杠杆操作，辅以利率债波段操作，努力控制回撤，争取为投资人获取了稳定的回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2018年6月30日，长信纯债一年定开债券A份额净值为1.0209元，份额累计净值为1.3437元，本报告期内长信纯债一年定开债券A净值增长率为2.02%；长信纯债一年定开债券C份额净值为1.0181元，份额累计净值为1.3229元，本报告期内长信纯债一年定开债券C净值增长率为1.77%。同期业绩比较基准收益率为1.52%。

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，政策面宽财政、缓信用、稳货币的信号逐渐清晰。结构性去杠杆目标下，初步预计此次边际宽松仍以定向方式为主，但我们仍需紧密跟踪政策实施的进度与幅度，同时关注经济数据是否有超预期的情况。结合进入三季度债券供给发力，对利率债而言大概率将会进入多空交织情绪下的底部震荡，斜率仍向下，但下行幅度比上半年收窄。信用债方面，央行窗口指导通过MLF定向支持信贷及中低等级产业债，国常会释放强调积极财政信号，此套政策组合的主要目的依然在于改善当前再融资环境，但机构风险偏好较难短时间逆转，预计利好资质优良的中高等级信用债。我们将精选个券，控制风险，争取为持有人获取长期、稳健的回报。

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，熟悉相关法律法规和估值方法，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，本基金本报告期进行了一次利润分配，分配金额为40,470,794.97元。

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，各基金份额类别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、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

5、法律法规或监管机关另有规定的，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，本基金托管人在对长信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》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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，长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金的管理人——长信基金管理有限责任公司在长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金进行了一次利润分配，分配金额为40,470,794.97元。

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

本托管人依法对长信基金管理有限责任公司编制和披露的长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金2018年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§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	838,460.27	3,905,139.94
结算备付金	5,349,769.67	-
存出保证金	18,233.27	38,752.58
交易性金融资产	741,755,606.30	839,674,429.70
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	741,755,606.30	839,674,429.70
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	-	569,996,095.00
应收证券清算款	14,159,598.92	-
应收利息	14,041,864.63	14,482,367.36
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	776,163,533.06	1,428,096,784.58
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	309,598,773.39	-
应付证券清算款	14,019,090.46	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	259,773.08	846,533.09
应付托管费	74,220.87	241,866.61
应付销售服务费	5,209.39	94,365.81
应付交易费用	19,697.20	23,725.27
应交税费	109,305.15	-
应付利息	88,458.02	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	128,012.93	329,000.00
负债合计	324,302,540.49	1,535,490.78
所有者权益：		
实收基金	442,667,798.92	1,385,174,081.45
未分配利润	9,193,193.65	41,387,212.35
所有者权益合计	451,860,992.57	1,426,561,293.80
负债和所有者权益总计	776,163,533.06	1,428,096,784.58

注：报告截止日2018年6月30日，长信纯债一年定开债券A级基金份额净值1.0209元，基金份额总额427,095,429.61份；长信纯债一年定开债券C级基金份额净值1.0181元，基金份额总额15,572,369.31份。长信纯债一年定开债券份额总额合计为442,667,798.92份。

6.2 利润表

会计主体：长信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	17,819,138.48	30,011,281.28
1.利息收入	19,778,824.78	51,795,657.67
其中：存款利息收入	110,702.73	164,048.46
债券利息收入	18,093,985.44	49,117,766.32
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	1,574,136.61	2,513,842.89
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以"-"填列）	-10,255,408.49	-8,592,898.37
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-10,255,408.49	-8,592,898.37
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）	8,252,151.17	-13,249,667.06
4.汇兑收益（损失以"-"号填列）	-	-
5.其他收入（损失以"-"号填列）	43,571.02	58,189.04
减：二、费用	7,377,160.81	15,107,303.09
1. 管理人报酬	1,867,563.67	4,817,475.22
2. 托管费	533,589.64	1,376,421.39
3. 销售服务费	76,777.88	558,135.33
4. 交易费用	10,138.81	20,132.69
5. 利息支出	4,676,246.51	8,128,162.67
其中：卖出回购金融资产支出	4,676,246.51	8,128,162.67
6. 税金及附加	62,604.56	-
7. 其他费用	150,239.74	206,975.79
三、利润总额（亏损总额以"-"号填列）	10,441,977.67	14,903,978.19
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以"-"号填列）	10,441,977.67	14,903,978.19

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长信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）	1,385,174,081.45	41,387,212.35	1,426,561,293.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	10,441,977.67	10,441,977.67
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）	-942,506,282.53	-2,165,201.40	-944,671,483.93
其中：1.基金申购款	11,916,261.96	24,540.41	11,940,802.37
2.基金赎回款	-954,422,544.49	-2,189,741.81	-956,612,286.30
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）	-	-40,470,794.97	-40,470,794.97
五、期末所有者权益（基金净值）	442,667,798.92	9,193,193.65	451,860,992.57
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）	1,618,877,936.07	4,276,184.95	1,623,154,121.02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	14,903,978.19	14,903,978.19
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）	-233,703,854.62	-594,854.95	-234,298,709.57
其中：1.基金申购款	823,464,957.99	4,285,264.35	827,750,222.34
2.基金赎回款	-1,057,168,812.61	-4,880,119.30	-1,062,048,931.91
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）	1,385,174,081.45	18,585,308.19	1,403,759,389.64

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[2013]911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，首次设立募集基金份额为303,045,141.71份，经毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）验证，并出具了毕马威华振验字第1300470号的验资报告。基金合同于2013年11月29日正式生效。本基金的基金管理人为长信基金管理有限责任公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

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《长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金的招募说明书》相关规定，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。本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产，也不参与一级市场的新股申购或增发新股，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，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的投资比例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：银行一年期定期存款利率（税后）×1.3+1.1%。

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2018年6月30日的财务状况以及2018年1月1日至2018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 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，主要税项列示如下：

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。

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。

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
中国工商银行股份有限公司（以下简称"中国工商银行"）	基金托管人、基金代销机构
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、基金代销机构

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

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债券交易。

6.4.7.1.3 债券回购交易

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债券回购交易。

6.4.7.1.4 权证交易

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：本基金本报告期及上年度可比期间均无应付关联方交易单元的佣金。

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 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
当期发生的基金应支付的管理费	1,867,563.67	4,817,475.22
其中：支付销售机构的客户维护费	629,716.04	690,454.16

注：基金管理费按前一日基金资产净值0.70%的年费率逐日计提，按月支付。

计算方法：H＝E×年管理费率÷当年天数（H为每日应计提的基金管理费，E为前一日基金资产净值）。

6.4.7.2.2 基金托管费

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
当期发生的基金应支付的托管费	533,589.64	1,376,421.39

注：基金托管费按前一日基金资产净值0.20%的年费率逐日计提，按月支付。

计算方法：H＝E×年托管费率÷当年天数（H为每日应计提的基金托管费，E为前一日基金资产净值）。

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 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 长信纯债一年定开债券A	长信纯债一年定开债券C	合计
长信基金管理有限责任公司	-	45,533.79	45,533.79
中国工商银行股份有限公司	-	25,108.92	25,108.92
长江证券	-	8.33	8.33
合计	-	70,651.04	70,651.04
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 当期发生的基金应支付的销售服务费 长信纯债一年定开债券A	长信纯债一年定开债券C	合计
长信基金管理有限责任公司	-	463,722.49	463,722.49
中国工商银行股份有限公司	-	72,274.17	72,274.17
长江证券	-	131.39	131.39
合计	-	536,128.05	536,128.05

注：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年费率为0.40%。

销售服务费按照C类基金资产净值的0.40%年费率计提。

计算方法如下：

H＝E×年销售服务费率÷当年天数

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日基金资产净值

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

单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日 期末余额	当期利息收入	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	838,460.27	56,694.86	4,621,482.50	132,724.29

注：本基金通过"中国工商银行基金托管结算资金专用存款账户"转存于中国证券登记结算有限责任公司等结算账户，于2018年6月30日的相关余额为人民币5,349,769.67元（2017年12月31日的相关余额为人民币0.00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过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：上述关联交易均根据正常的商业交易条件进行，并以一般交易价格为定价基础。本基金非基金中基金，不存在当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用。

6.4.8 期末（2018年6月30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。

6.4.8.3 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2018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124,398,773.39元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

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
180205	18国开05	2018年7月5日	104.87	200,000	20,974,000.00
180205	18国开05	2018年7月6日	104.87	100,000	10,487,000.00
1280317	12湘临港债	2018年7月2日	25.39	30,000	761,700.00
1480542	14三门债01	2018年7月2日	79.91	85,000	6,792,350.00
1524007	15匀棚改项目债	2018年7月2日	95.99	100,000	9,599,000.00
101800280	18武进经发MTN001	2018年7月2日	99.49	100,000	9,949,000.00
101800361	18太仓资产MTN001	2018年7月2日	98.90	100,000	9,890,000.00
101800491	18济宁高新MTN002	2018年7月2日	97.95	5,000	489,750.00
1624010	16盘县棚改项目债	2018年7月2日	96.59	200,000	19,318,000.00
1580130	15遵义道桥债	2018年7月4日	83.82	125,000	10,477,500.00
1680388	16汝州鑫源债	2018年7月4日	92.14	200,000	18,428,000.00
1780100	17阿纺织	2018年7月4日	96.29	100,000	9,629,000.00
合计				1,345,000	126,795,300.00

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2018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185,200,000.00元，其中25,000,000.00元于2018年7月2日到期，11,000,000.00元于2018年7月3日到期，85,000,000.00元于2018年7月5日到期，40,000,000.00元于2018年7月6日到期，24,200,000.00元于2018年7月13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

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	741,755,606.30	95.57
	其中：债券	741,755,606.30	95.57
	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	6,188,229.94	0.80
8	其他各项资产	28,219,696.82	3.64
9	合计	776,163,533.06	100.00

注：本基金本报告期末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：本基金本报告期内未通过港股通交易机制投资港股。

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	77,893,500.00	17.24
	其中：政策性金融债	77,893,500.00	17.24
4	企业债券	604,543,106.30	133.79
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	59,319,000.00	13.13
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	741,755,606.30	164.16

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	180205	18国开05	450,000	47,191,500.00	10.44
2	180206	18国开06	300,000	30,702,000.00	6.79
3	127426	16渝江01	300,000	29,397,000.00	6.51
4	1280368	12黔东南债	700,000	28,329,000.00	6.27
5	122377	14首开债	250,000	24,945,000.00	5.52

7.7 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。

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

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

7.10.2 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。

7.10.3 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。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 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 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	18,233.27
2	应收证券清算款	14,159,598.92
3	应收股利	-
4	应收利息	14,041,864.63
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	28,219,696.82

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。

7.11.5 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。

7.11.6 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。

§8 基金份额持有人信息

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 持有份额	机构投资者 占总份额比例	个人投资者 持有份额	个人投资者 占总份额比例
长信纯债一年定开债券A	314	1,360,176.53	409,920,479.62	95.98%	17,174,949.99	4.02%
长信纯债一年定开债券C	262	59,436.52	1,923,076.92	12.35%	13,649,292.39	87.65%
合计	576	768,520.48	411,843,556.54	93.04%	30,824,242.38	6.96%

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	长信纯债一年定开债券A	1,546.72	0.00%
	长信纯债一年定开债券C	0.00	0.00%
	合计	1,546.72	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	长信纯债一年定开债券A	0
	长信纯债一年定开债券C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	长信纯债一年定开债券A	0
	长信纯债一年定开债券C	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长信纯债一年定开债券A	长信纯债一年定开债券C
基金合同生效日（2013年11月29日）基金份额总额	205,068,134.62	97,977,007.09
本报告期期初基金份额总额	1,114,067,174.73	271,106,906.72
本报告期基金总申购份额	10,638,957.71	1,277,304.25
减：本报告期基金总赎回份额	697,610,702.83	256,811,841.66
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	427,095,429.61	15,572,369.31

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期未召开本基金的基金份额持有人大会。

10.2 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

本报告期基金管理人、托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 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。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略未发生改变。

10.5 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。

10.6 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，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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

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 成交金额	股票交易 占当期股票成交总额的比例	应支付该券商的佣金 佣金	应支付该券商的佣金 占当期佣金总量的比例	备注
申万宏源证券	2	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	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 成交金额	债券交易 占当期债券成交总额的比例	债券回购交易 成交金额	债券回购交易 占当期债券回购成交总额的比例	权证交易 成交金额	权证交易 占当期权证成交总额的比例
申万宏源证券	359,694,090.08	100.00%	9,059,675,000.00	100.00%	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-

注：1、本期租用证券公司交易单元的变更情况

本报告期内本基金退租国信证券交易单元1个，申万宏源证券交易单元1个。

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	序号	报告期内持有基金份额变化情况 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	报告期末持有基金情况 持有份额	份额占比
机构	1	2018年1月1日至2018年1月15日；2018年1月19日至2018年6月30日	298,328,361.18	8,931,095.54	199,560,965.88	107,698,490.84	24.33%
机构	2	2018年1月1日至2018年6月30日	289,546,375.83	0.00	89,784,517.16	199,761,858.67	45.13%
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。

§12

长信基金管理有限责任公司

2018年8月29日