

# 长信纯债半年债券型证券投资基金 2017年年度报告摘要

2017年12月31日

基金管理人：长信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国民生银行股份有限公司

送出日期：2018年3月31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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司（以下简称“中国民生银行”，下同）根据本基金基金合同的规定，于2018年3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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自2017年1月1日起至2017年12月31日止。

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	长信纯债半年债券	
基金主代码	003126	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年12月23日	
基金管理人	长信基金管理有限责任公司	
基金托管人	中国民生银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	17,470,501.82份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	长信纯债半年债券A	长信纯债半年债券C
下属分级基金的交易代码:	003126	003127
报告期末下属分级基金的份额总额	221,195.74份	17,249,306.08份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险和有效保持资产流动性的前提下，力争为投资者创造较高的当期收益和长期资产增值。
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。
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	中国民生银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周永刚
	联系电话	021-61009999
	电子邮箱	zhouyg@cxfund.com.cn
客户服务电话	4007005566	95568
传真	021-61009800	010-58560798

### 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，北京市西城区复兴门内大街2号

## § 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

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2017年		2016年12月23日(基金合同生效日)- 2016年12月31日	
	长信纯债半年 债券A	长信纯债半年 债券C	长信纯债半年债 券A	长信纯债半年债 券C
本期已实现收益	2,536,101.14	433,227.20	12,544.41	1,470.53
本期利润	1,935,216.79	1,034,916.10	12,544.41	1,470.53
加权平均基金份额本期利润	0.0214	0.0220	0.0001	0.0000
本期基金份额净值增长率	3.58%	3.24%	0.01%	0.00%
3.1.2 期末数据和指标	2017年末		2016年末	
期末可供分配基金份额利润	-0.0091	-0.0125	0.0001	0.0000
期末基金资产净值	229,133.81	17,808,312.08	140,362,694.32	61,782,888.19
期末基金份额净值	1.0359	1.0324	1.0001	1.0000

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

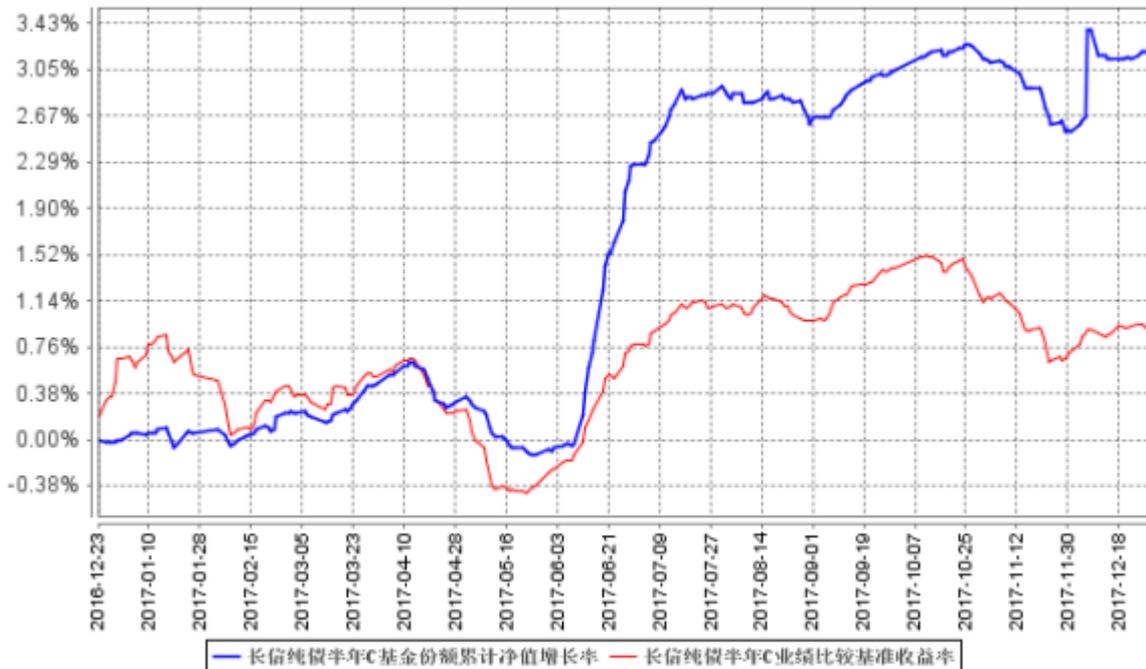
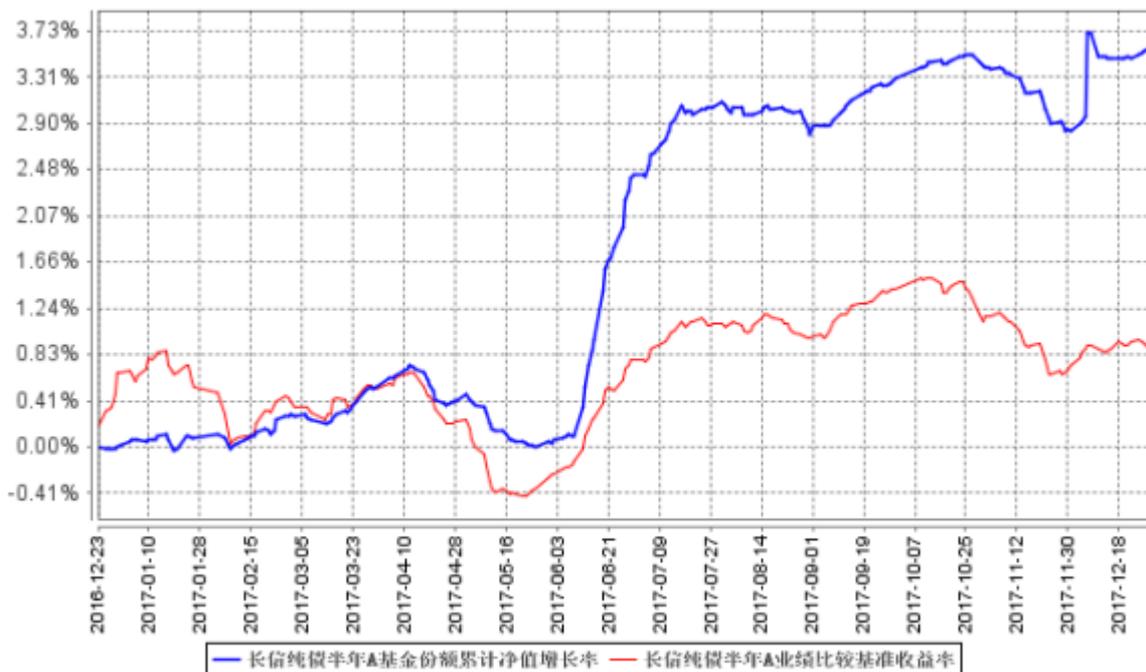
长信纯债半年债券A

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	0.29%	0.10%	-0.47%	0.05%	0.76%	0.05%
过去六个月	1.13%	0.08%	0.16%	0.04%	0.97%	0.04%
过去一年	3.58%	0.07%	0.28%	0.05%	3.30%	0.02%
自基金合同 生效起至今	3.59%	0.07%	0.94%	0.05%	2.65%	0.02%

长信纯债半年债券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	0.18%	0.10%	-0.47%	0.05%	0.65%	0.05%
过去六个月	0.95%	0.07%	0.16%	0.04%	0.79%	0.03%
过去一年	3.24%	0.07%	0.28%	0.05%	2.96%	0.02%
自基金合同 生效起至今	3.24%	0.07%	0.94%	0.05%	2.30%	0.02%

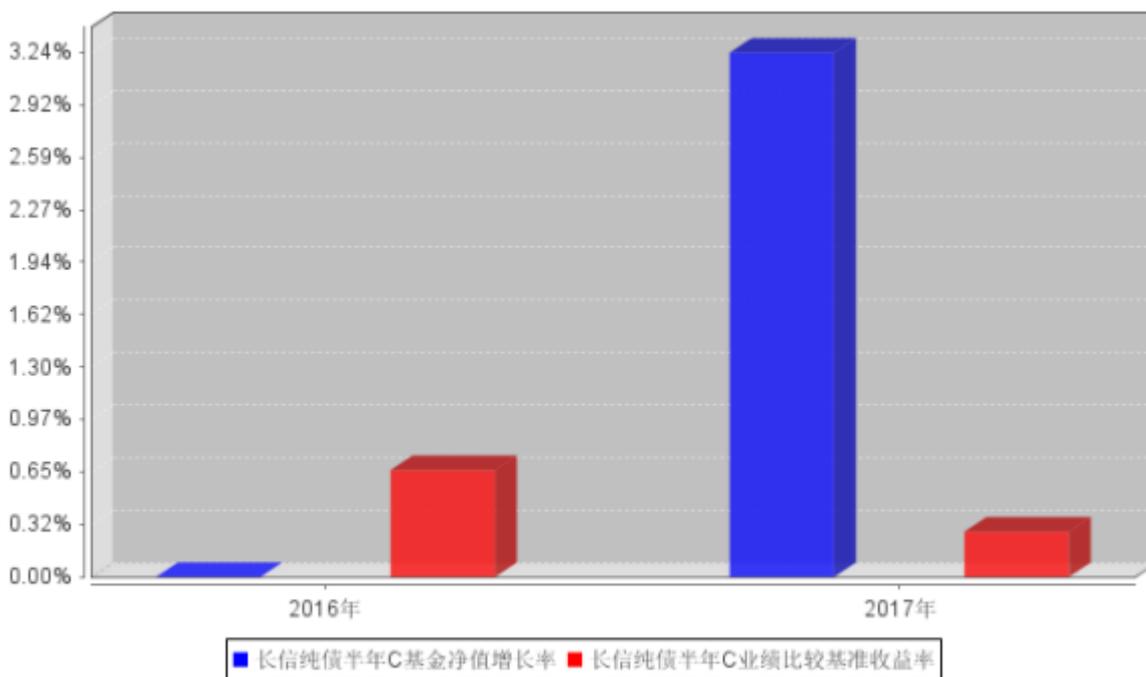
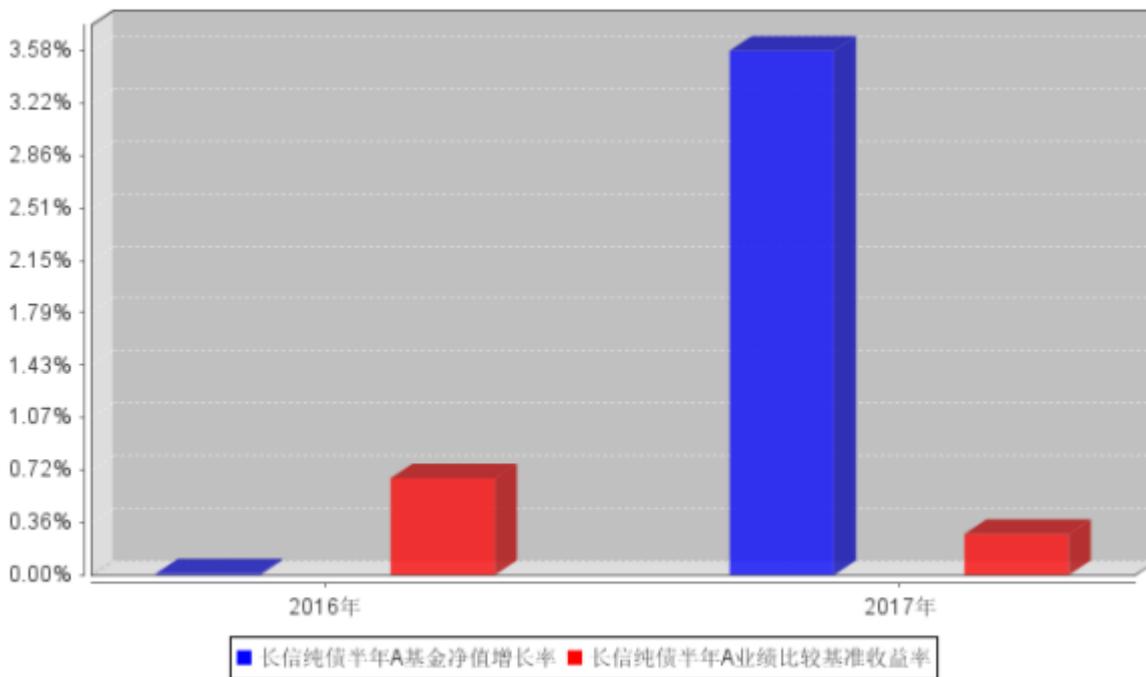
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、图示日期为2016年12月23日至2017年12月31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。报告期末已完成建仓但报告期末距建仓结束不满一年；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。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金基金合同生效日为2016年12月23日，2016年净值增长率按当年实际存续期计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金基金合同生效日为2016年12月23日，本基金基金合同生效日起至本报告期末未进行利润分配。



## §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2017年12月31日，本基金管理人共管理58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)、长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金、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。

#### 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		
陆莹	长信利息收益开放式证券投资基金、长信稳健纯债债券型证券投资基金、长信纯债半年债券型证券投资基金、长信长金货币市场基金和长信稳通三个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理	2017年1月12日	-	7年	管理学学士，上海交通大学管理学学士，2010年7月加入长信基金管理有限责任公司，曾任基金事务部基金会计，交易管理部债券交易员、交易主管，债券交易部副总监、总监，现任长信利息收益开放式证券投资基金、长信稳健纯债债券型证券投资基金、长信纯债半年债券型证券投资基金、长信长金货币市场基金和长信稳通三个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理。
吴哲	曾任本基金的基金经理	2016年12月23日	2017年1月25日	8年	曾任本基金的基金经理
赵鹏霄	曾任本基金的基金经理助理	2017年7月28日	2017年12月29日	5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、自2018年1月19日起，陆莹女士开始担任长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理

4、自2018年2月22日起，陆莹女士开始担任现金理财部总监。

## 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 公平交易制度和控制方法

1、所有投资对象的投资指令必须经由交易部门总监或其授权人审核分配至交易人员执行。进行投资指令分配的人员必须保证投资指令得到公平对待。

2、公司使用的交易执行软件系统必须具备如下功能：

(1) 严格按照时间顺序发送委托指令；

(2) 对于多个投资组合在同一时点就同一证券下达的相同方向的投资指令，并且市价在限价范围内的，系统能够将交易员针对该证券下达的每笔委托自动按照指令数量比例分拆为各投资组合的委托指令。对于不同投资组合针对交易所同一证券的同一方向竞价交易指令，指令数量比例达到5:1或以上的，可豁免启动公平交易开关。

3、交易人员对于接收到的交易指令依照价格优先、时间优先的顺序执行。在执行多个投资组合在同一时点就同一证券下达的相同方向的交易所投资指令时，除制度规定的例外指令外，必须开启系统的公平交易开关。

4、对于不同投资组合均进行债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易的投资对象，交易部门必须严格独立接收各投资组合的投资指令，在申购结果产生前，不得以任何形式向任何人泄露各投资指令的内容，包括指令价格及数量等要素。

5、对于各投资组合以独立账户名义进行申购的投资对象，除需经过公平性审核的例外指令外，申购获配的证券数量由投资管理系统接收各类证券登记结算机构发送的数据进行分配。交易部门根据证券发行人在指定公开披露媒体上披露的申购结果对系统内分配数量进行核准，数量不符的，应当第一时间告知各投资管理部门的总监及监察稽核部总监。对于以公司名义进行申购的投资对象，公司在获配额度确定后，严格按照价格优先的原则在各投资组合间进行分配。申购价格相同的投资组合则根据投资指令的数量按比例进行分配。确因特殊原因不能按照上述原则进行分配的，应启动异常交易识别流程，审核通过的，可以进行相应分配。

### 4.3.2 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。

### 4.3.3 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。同时，对本年度同向交易价差进行专项分析，未发现异常情况。

## 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

2017年债市整体处于调整行情，主要是由于经济增长数据显著超预期、央行货币政策维持中性偏紧的操作以及监管政策的陆续出台等因素共同导致。一至三月份MLF 利率和公开市场利率两次上调，并伴随持续上调预期，使资金成本明显上升，债券收益率一路上行。随着6月央行提前开展MLF操作向市场投放4980亿元，显示了其对六月份流动性的呵护，并且在美联储宣布加息25bp后，央行未跟随调整，促使跨半年末的资金利率大幅下行。流动性改善，叠加金融去杠杆取得一定成果，使得市场情绪缓和，债市迎来大幅反弹，十年期国开下行超20bp，信用利差尤其是城投债与产业债的利差再度缩小。半年末后经济基本面仍保持了足够的韧性，之后经济数据出现一定程度的下行，市场预期出现分化，但资金面重回中性偏紧导致短端利率水平较高，以及环保预期下的大宗商品价格上行导致的通胀预期，总体长端利率震荡为主。后期随着美联储如期加息，央行象征性上调公开市场利率，债券市场对于利空的反应开始有所钝化。

组合在六月建仓期满，我们逐步增加了信用债的配置比例，一季度组合整体仓位较轻，二季度适当拉长久期，参与利率债波段，抓住了六月份的市场机会，获得一定的收益。下半年组合进行了一定程度的减仓锁定收益操作，主要维持较短久期策略，以票息收入作为组合收益的主要来源，在一定程度上减小了收益率上行带来的损失。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，长信纯债半年债券A份额净值为1.0359元，份额累计净值为1.0359元，本报告期长信纯债半年债券A净值增长率为3.58%；长信纯债半年债券C份额净值为1.0324元，份额

累计净值为1.0324元，本报告期长信纯债半年债券C净值增长率为3.24%，同期业绩比较基准收益率为0.28%。

#### 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，2018年预计政策层面“严监管+货币稳健中性”的组合仍将继续，随着资管新规等监管政策的落地以及后续监管政策的出台，对市场的影响尚待观察。整体来看，春节前后的流动性适度宽裕可能预示着今年的资金面不会像之前那样紧张，而信用扩张速度呈现的边际放缓迹象显示了经济去杠杆带来的增长动力下降，预计后期经济数据的逐步下行将带来基本面程度的利好从而使利率下行。需要注意的是年初以来信用事件频频发生，一些现金流紧张、风格激进、管理层频繁变动的发行人在当前监管从严、业务不断规范的背景下，经营情况将受到负面影响，信用风险抬升。

未来我们将加强信用研究与风险管理，适时增加组合久期，在保持组合基本收益的基础上，择机进行债券波段操作，为投资者争取更好的组合收益。

#### 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。

基金收益分配应遵循下列原则：

- 1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，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，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，依法安全保管了基金财产，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，按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关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，本基金未进行利润分配。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

## §6 审计报告

本报告期末基金2017年度财务报告经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）会计师事务所审计，注册会计师出具了无保留意见的审计报告（德师报(审)字(18)第P00414号），投资者可以通过年度报告正文查看审计报告全文。

## §7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：长信纯债半年债券型证券投资基金

报告截止日：2017年12月31日

单位：人民币元

资产	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
<b>资产：</b>		
银行存款	16,818.09	2,131,567.57
结算备付金	-	-
存出保证金	3,764.02	-
交易性金融资产	14,500,100.00	-
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	14,500,100.00	-
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	7,000,130.50	200,000,000.00
应收证券清算款	92,764.15	-
应收利息	166,938.48	127,825.40
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	21,780,515.24	202,259,392.97
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2017年12月31日</b>	<b>上年度末 2016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	3,500,000.00	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	21,344.48	30,924.21
应付托管费	6,098.42	8,835.49
应付销售服务费	5,344.17	4,050.76
应付交易费用	3,091.25	-
应交税费	-	-
应付利息	-1,808.97	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	209,000.00	70,000.00

负债合计	3,743,069.35	113,810.46
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	17,470,501.82	202,131,567.57
未分配利润	566,944.07	14,014.94
所有者权益合计	18,037,445.89	202,145,582.51
负债和所有者权益总计	21,780,515.24	202,259,392.97

注：1、报告截止日2017年12月31日，长信纯债半年债券A基金份额净值1.0359元，基金份额总额221,195.74份；长信纯债半年债券C基金份额净值1.0324元，基金份额总额17,249,306.08份。长信纯债半年定开债券份额总额合计为17,470,501.82份。

2、本基金本报告期为2017年1月1日至2017年12月31日，本基金基金合同于2016年12月23日正式生效，上年度可比期间不满一个会计年度。

## 7.2 利润表

会计主体：长信纯债半年债券型证券投资基金

本报告期：2017年1月1日至2017年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年12月23日(基金合同生效日)至2016年12月31日
<b>一、收入</b>	4,985,263.92	127,825.40
1.利息收入	8,405,770.62	127,825.40
其中：存款利息收入	55,640.07	28,226.30
债券利息收入	7,188,260.89	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	1,161,869.66	99,599.10
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-3,421,311.25	-
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-3,421,311.25	-
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）	804.55	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	-	-
<b>减：二、费用</b>	2,015,131.03	113,810.46
1. 管理人报酬	994,092.03	30,924.21
2. 托管费	284,026.31	8,835.49

3. 销售服务费	145,375.62	4,050.76
4. 交易费用	12,510.51	-
5. 利息支出	338,786.82	-
其中：卖出回购金融资产支出	338,786.82	-
6. 其他费用	240,339.74	70,000.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>2,970,132.89</b>	<b>14,014.94</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>2,970,132.89</b>	<b>14,014.94</b>

注：本基金本报告期为2017年1月1日至2017年12月31日，本基金基金合同于2016年12月23日正式生效，上年度可比期间不满一个会计年度。

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长信纯债半年债券型证券投资基金

本报告期：2017年1月1日至2017年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31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）	202,131,567.57	14,014.94	202,145,582.51
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,970,132.89	2,970,132.89
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）	-184,661,065.75	-2,417,203.76	-187,078,269.51
其中：1. 基金申购款	16,711,872.42	161,608.62	16,873,481.04
2. 基金赎回款	-201,372,938.17	-2,578,812.38	-203,951,750.55
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）	17,470,501.82	566,944.07	18,037,445.89
项目	上年度可比期间 2016年12月23日（基金合同生效日）至2016年12月31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）	202,131,567.57	-	202,131,567.57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本	-	14,014.94	14,014.94



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。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。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%,但在每个开放期前3个工作日、开放期及开放期后3个工作日的期间内,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,现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例应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。

#### **7.4.2 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。

#### **7.4.3 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2016年12月31日和2017年12月31日的财务状况以及2016年12月23日(基金成立日)至2016年12月31日止期间和2017年度的经营成果和基金净值变动情况。

#### **7.4.4 重要会计政策和会计估计**

##### **7.4.4.1 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。

##### **7.4.4.2 记账本位币**

本基金以人民币为记账本位币。

##### **7.4.4.3 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。

### 7.4.4.4 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。

### 7.4.4.5 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。

#### **7.4.4.6 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。

#### **7.4.4.7 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。

#### **7.4.4.8 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）。

#### **7.4.4.9 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

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认。

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。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额确认，由上市公司代扣代缴的个人所得税于卖出交易日按实际代扣代缴金额确认。

#### -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。

### 7.4.4.10 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0.7%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0.2%的年费率逐日计提。

本基金C类基金份额的基金销售服务费按该类份额前一日基金资产净值0.3%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。

### 7.4.4.11 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，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，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。

#### **7.4.4.12 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。

#### **7.4.4.13 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。

### **7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

#### **7.4.5.1 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。

#### **7.4.5.2 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。

#### **7.4.5.3 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。

### **7.4.6 税项**

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》、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、债券免征营业税和增值税；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。

#### 7.4.7 关联方关系

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、基金注册登记机构
中国民生银行股份有限公司（简称“中国民生银行”）	基金托管人、基金销售机构
长江证券股份有限公司（简称“长江证券”）	基金管理人的股东
上海海欣集团股份有限公司	基金管理人的股东
武汉钢铁股份有限公司	基金管理人的股东
上海彤胜投资管理中心(有限合伙)（以下简称“彤胜投资”）	基金管理人的股东
上海彤骏投资管理中心(有限合伙)（以下简称“彤骏投资”）	基金管理人的股东
上海长江财富资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注：经长信基金管理有限责任公司股东会审议通过，新增上海彤胜投资管理中心(有限合伙)和上海彤骏投资管理中心(有限合伙)为基金管理人的股东，基金管理人已履行相关程序办理完成股东变更事项的工商变更登记并向监管机构备案，并已于2017年2月8日就上述股东变更事项进行公告。

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.8.1.1 股票交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

### 7.4.8.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年12月23日(基金合同生效日) 至2016年12月31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
长江证券	71,509,074.83	100.00%	-	-

### 7.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年12月23日(基金合同生效日) 至2016年12月31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
长江证券	885,600,000.00	100.00%	200,000,000.00	100.00%

### 7.4.8.1.4 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的权证交易。

### 7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期没有应支付关联方的佣金。

## 7.4.8.2 关联方报酬

### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31 日	上年度可比期间 2016年12月23日(基金合同生效日) 至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	994,092.03	30,924.21
其中：支付销售机构的客户维护费	116,637.50	237.22

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： $H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$ （H为每日应计提的基金管理费，E为前一日基金资产净值）。

### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31 日	上年度可比期间 2016年12月23日(基金合同生效日) 至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	284,026.31	8,835.49

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： $H=E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$ （H为每日应计提的基金托管费，E为前一日基金资产净值）。

### 7.4.8.2.3 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 2017年1月1日至2017年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长信纯债半年债券A	长信纯债半年债券C	合计
长信基金管理有限责任公司	-	762.83	762.83
中国民生银行		143,248.55	143,248.55
合计	-	144,011.38	144,011.38
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2016年12月23日(基金合同生效日)至2016年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长信纯债半年债券A	长信纯债半年债券C	合计
长信基金管理有限责任公司	-	4,435.60	4,435.60
中国民生银行		62.01	62.01
合计	-	4,497.61	4,497.61

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0.30%。

销售服务费按照C类基金资产净值的0.30%年费率计提。计算方法如下：

$H=E \times \text{年销售服务费率} \div \text{当年天数}$

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

### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	
	长信纯债半年债券A	长信纯债半年债券C
基金合同生效日（2016年12月23日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	62,999,000.00	-

期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	62,999,000.00	-
期末持有的基金份额	-	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

项目	上年度可比期间	
	2016年12月23日(基金合同生效日)至2016年12月31日	
	长信纯债半年债券A	长信纯债半年债券C
基金合同生效日(2016年12月23日)持有的基金份额	62,999,000.00	-
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	62,999,000.00	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	31.17%	-

注：基金管理人运用固有资金投资本基金费率按本基金招募说明书公布的费率执行。

#### 7.4.8.4.2 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：除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末及上年度末均未持有本基金。

#### 7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年12月23日(基金合同生效日) 至2016年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国民生银行	16,818.09	47,613.44	2,131,567.57	28,226.30

注：本基金通过“民生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2017年12月31日的相关余额为人民币0元（2016年12月31日：人民币0元）。

#### 7.4.8.6 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。

#### 7.4.8.7 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。

## **7.4.9 期末（2017年12月31日）本基金持有的流通受限证券**

### **7.4.9.1 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。

### **7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

注：截至本报告期末，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

### **7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

#### **7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购**

注：本基金本报告期末未持有因银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

#### **7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购**

注：截至本报告期末2017年12月31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3,500,000.00元，于2018年1月2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。

## §8 投资组合报告

### 8.1 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	14,500,100.00	66.57
	其中：债券	14,500,100.00	66.57
	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	7,000,130.50	32.14
	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	16,818.09	0.08
8	其他各项资产	263,466.65	1.21
9	合计	21,780,515.24	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。

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 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。

#### 8.2.2 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。

### 8.3 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。

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.4.1 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。

#### 8.4.2 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。

#### 8.4.3 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。

### 8.5 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	14,500,100.00	80.39
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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	14,500,100.00	80.39

### 8.6 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	179951	17贴现国债51	100,000	9,907,000.00	54.92
2	019563	17国债09	46,000	4,593,100.00	25.46

### 8.7 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。

### 8.8 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。

### 8.9 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。

### 8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.10.1 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。

#### 8.10.2 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。

#### 8.10.3 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。

## 8.11 投资组合报告附注

8.11.1 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，在报告编制日前一年内也没有受到公开谴责、处罚。

8.11.2 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。

### 8.11.3 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	3,764.02
2	应收证券清算款	92,764.15
3	应收股利	-
4	应收利息	166,938.48
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	263,466.65

### 8.11.4 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。

### 8.11.5 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。

### 8.11.6 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 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
长信纯债半年债券A	41	5,395.02	0.00	0.00%	221,195.74	100.00%
长信纯债半年债券C	632	27,293.21	0.00	0.00%	17,249,306.08	100.00%
合计	673	25,959.14	0.00	0.00%	17,470,501.82	100.00%

### 9.2 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	长信纯债半年债券A	1.00	0.00%
	长信纯债半年债券C	132,242.12	0.77%
	合计	132,243.12	0.76%

### 9.3 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	长信纯债半年债券A	0
	长信纯债半年债券C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	长信纯债半年债券A	0
	长信纯债半年债券C	0
	合计	0

## § 10开放式基金份额变动

单位：份

项目	长信纯债半年债券A	长信纯债半年债券C
基金合同生效日（2016年12月23日）基金份额总额	140,350,149.91	61,781,417.66
本报告期期初基金份额总额	140,350,149.91	61,781,417.66
本报告期基金总申购份额	117,970.94	16,593,901.48
减:本报告期基金总赎回份额	140,246,925.11	61,126,013.06
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	221,195.74	17,249,306.08

## § 11重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 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

#### 11.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期基金管理人未发生重大人事变动。

#### 11.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 11.3 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。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略未改变。

### 11.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本基金非基金中基金，报告期内未持有基金。

### 11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金改聘为基金审计的会计师事务所，报告期应支付给德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）审计的报酬为人民币40,000.00元，该审计机构为本基金提供审计服务的连续年限为1年。

### 11.7 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。

### 11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.8.1 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	
		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

长江证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-

### 11.8.2 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
长江证券	71,509,074.83	100.00%	885,600,000.00	100.00%	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-

华泰证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-

注：1、本报告期租用证券公司交易单元变化情况如下：

退租中泰证券（原齐鲁证券）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：

- a、券商基本面评价（财务状况、经营状况）；
- b、券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）；
- c、券商每日信息评价（及时性和有效性）；
- d、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。

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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	2017年1月1日至2017年12月6日	62,999,000.00	0.00	62,999,000.00	0.00	0.00%
个人	-	-	-	-	-	-	-
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>							

### 12.2 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

2018年3月31日