长信纯债壹号债券型证券投资基金
2020 年第 2 季度报告

2020 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：中国邮政储蓄银行股份有限公司

报告送出日期：2020 年 7 月 21 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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金基金的合同规定，于 2020 年 7 月 17 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 2020 年 4 月 1 日起至 2020 年 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长信纯债壹号债券	
基金主代码	519985	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014 年 7 月 1 日	
报告期末基金份额总额	665,176,910.65 份	
投资目标	本基金通过投资于债券品种，追求基金资产的长期稳健增值。	
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。	
业绩比较基准	中债综合指数	
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期收益和预期风险高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金，属于低风险的基金品种。	
基金管理人	长信基金管理有限责任公司	
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	长信纯债壹号债券 A	长信纯债壹号债券 C
下属分级基金的交易代码	519985	004220
报告期末下属分级基金的份额总额	325,637,583.82 份	339,539,326.83 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（ 2020 年 4 月 1 日 － 2020 年 6 月 30 日 ）	
	长信纯债壹号债券 A	长信纯债壹号债券 C
1. 本期已实现收益	6,171,991.81	5,571,768.66
2. 本期利润	605,761.95	1,429,387.81
3. 加权平　基金份额本期利润	0.0016	0.0036
4. 期末基金资产净值	361,520,317.38	357,412,257.20
5. 期末基金份额净值	1.1102	1.0526

：1、本期已实现收益指基金本期利息收　、投资收益、其　收　（不　公　　值　　收益）用　的　额，本期利润为本期已实现收益加　本期公　　值　　收益；

2、所述基金业绩指标不　　持有人　　或交易基金的　　用（　　，　　式基金交易　金、开放式基金的　　、　利　投资　、基金　　等），计　　用　实　收益　平要低于所数　。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长　及其　同期业绩比较基准收益　的比较

长信纯债壹号债券 A

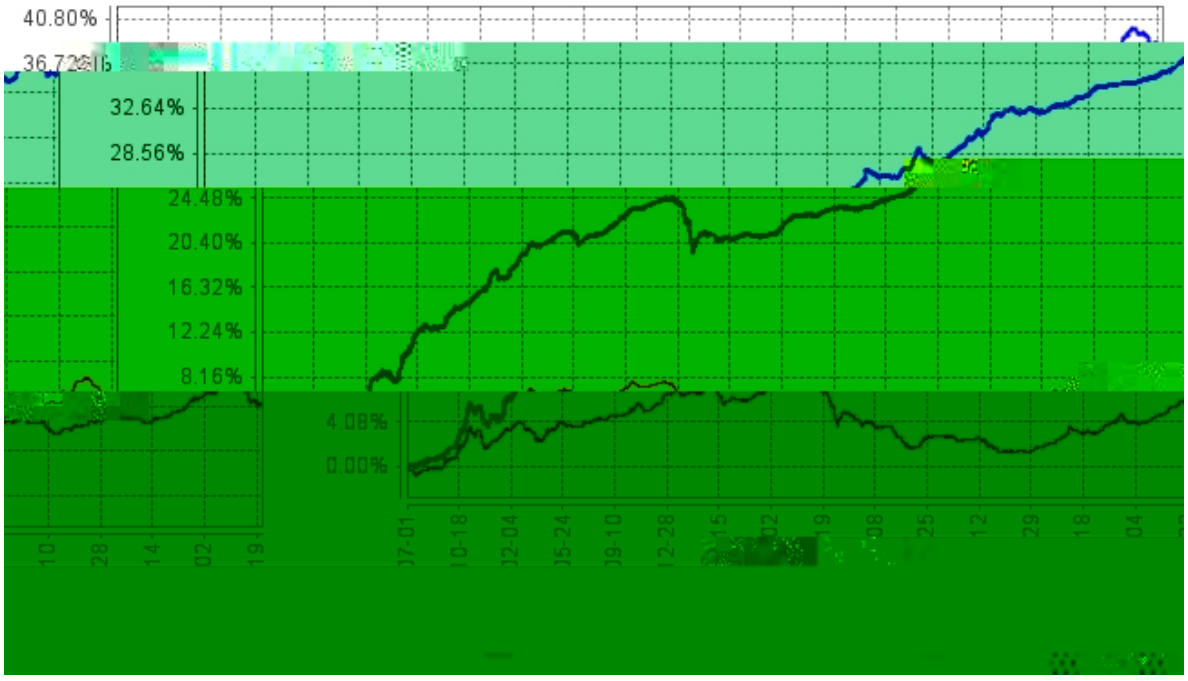
	净值增长	净值增长标准差	业绩比较基准收益	业绩比较基准收益　标准差	—	—
过　　个　月	0.33	0.09	1.04	0.12	1.37	0.03
过　　个　月	1.91	0.07	0.79	0.11	1.12	0.04
过　一年	3.86	0.05	1.87	0.08	1.99	0.03
过　　年	13.36	0.05	5.61	0.07	7.75	0.02
过　　年	23.09	0.07	4.70	0.08	18.39	0.01
自基金合同生效起　至	38.53	0.08	8.46	0.08	30.07	0.00

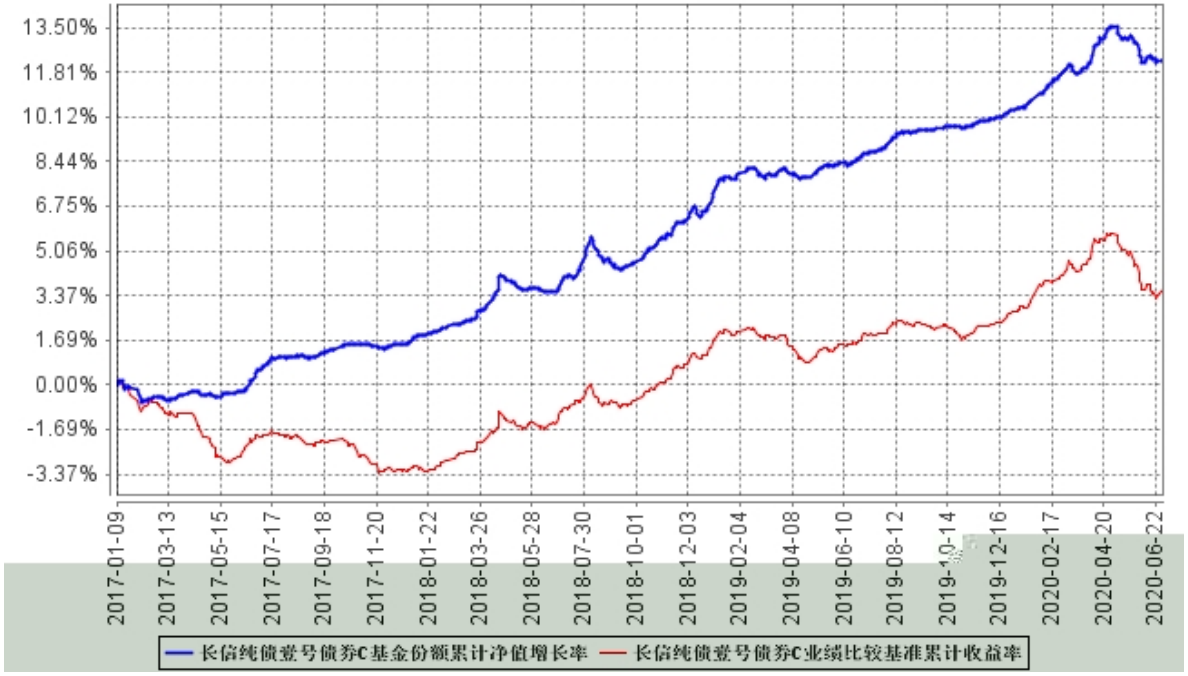
长信纯债壹号债券 C

	净值增长	净值增长标准差	业绩比较基准收益	业绩比较基准收益　标准差	—	—
过　　个　月	0.23	0.09	1.04	0.12	1.27	0.03
过　　个	1.72	0.07	0.79	0.11	0.93	0.04

月						
过　一年	3.42	0.05	1.87	0.08	1.55	0.03
过　　年	11.67	0.05	5.61	0.07	6.06	0.02
自基金合同生效日起	12.30	0.05	3.57	0.07	8.73	0.02

3.2.2 自基金合同生效以来基金　计净值增长　　及其　同期业绩比较基准收益的比较





：1、基金管理人自 2017 年 1 月 9 日起对长信纯债壹号债券基金　行份额分类，原有基金份额为 A 类份额，增　C 类份额。

2、长信纯债壹号债券 A　示日期为 2014 年 7 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日，长信纯债壹号债券 C　示日期为 2017 年 1 月 9 日（份额增加日）至 2020 年 6 月 30 日。

3、　基金合同规定，本基金自合同生效日起 6 个月内为　　期。　　期　　，本基金投资比　已　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　组）简

	务	任本基金的基金经理期限		证券　业年限	说明
		任　日期	任日期		
	长信纯债壹号债券型证券投资基金、长信利　债券型证券投资基金　　、长信　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　　纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信稳　纯债债券型证券投资基金和	2014 年 7 月 1 日		26 年	高级　管理　，　财经大　A　业，　有基金　业资　。　任　证券公司交易一　交易　、长　证券有限责任公司资产管理事业　主管、债券事业总　投资　经理、　定收益总　交易　经理。2004 年 9 月加　长信基金管理有限责任公司，　任长信利息收益开放式证券投资基金交易　、基金经理　理、长信中　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和长信　民纯债一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理　务。现任　定收益　总　、长信纯债壹号债券型证券投资基金、长信利　债券型证券投资基金　　、长信　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　纯债一年定期开放债券型

	长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理、定收益总				证券投资基金、长信稳 纯债债券型证券投资基金和长信 纯债一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理。

：1、 任基金经理任 日期以本基金 日为准； 增或 基金经理的日期根据对的公告日期 ；

2、证券 业的 证券业 业人 资 管理 的 规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作 规 信 况的说明

本基金管理人在报告期内， 了 中 人民共和国证券投资基金 及其 有规、基金合同的规定，勤勉尽责 为基金份额持有人 求利益，不存在 基金份额持有人利益的行为。

本基金 以 信于市场、 信于 会投资公 为 ，承诺 一 往 本 诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，在规 基金运作和 投资风险的前提下， 为基金份额持有人 求 大利益。

4.3 公平交易 说明

4.3.1 公平交易 度的 行 况

本报告期内，公司已实行公平交易 度，并 公平交易 度 ，已 投资决策 ，加 交易 行 的内 ，并通过 作 度、 和 保证公平交易原则的实现。同 ，公司已通过对投资交易行为的 、分 和信息 来加 对公平交易过 和 的 。

4.3.2 交易行为的 说明

本报告期内， 完 有 指数的 比 行投资的组合 ，其 投资组合未 生交易所公开 同日 交易 交较 的单 交易 过 证券 日 交 的 5 的 ，未现 交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分

季度以来，收益 下 ，债市整 型 。4 月 ， 行下 额存 准 金利 开利 下限， 期品种收益 明 益，收益 下行， 期限 了 2016 年的收益 低 。5 月开 ， 增 方 债及特别国债等财政政策 一 ，债券市场整 放 现， 加货币政策 不及预期，整 ,债市出现明 下 ，债券交投 度 明 下 。

季度， 主要以 持 分长 期信用债和利 债为原则， 低了组合整 。

季度以来， 经 一个 况 的 复期， 、 季度的经 增长 况 重要。目前国内基本 复 ，下 年 复过 中， 和 的持性 要重 ，货币政策已 出 3、4 月份的 式 ， 总 合理、 的政策 。债市 期或 性的投资 会，行 期；较为有限的交易 会 来自于 复带来的风险 、货币政策配合政 债券 行 放 信号、金数据或经 数据 复不及预期、中 易 复等，但交易 以 。

承 原则，加 组合的 性管理，加大对信用风险的审 。 度 整组合 期， 经 和政策 ， 组合规 行资产配置， 在 的前提下，为投资者 的收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

至 2020 年 6 月 30 日，本基金 A 类份额净值为 1.1102 元， 计份额净值为 1.5022 元；本基金 C 类份额净值为 1.0526 元， 计份额净值为 1.4716 元。本报告期内本基金 A 类净值增长为 0.33 ，同期业绩比较基准收益 为 1.04 ；本基金 C 类份额净值增长 为 0.23 ，同期业绩比较基准收益 为 1.04 。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预 说明

。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合 况

号	目	金额（元）	基金总资产的比 （ ）
1	权益投资		
	其中：股票		
2	基金投资		
3	定收益投资	747,171,646.00	79.44
	其中：债券	747,171,646.00	79.44
	资产支持证券		
4	金属投资		
5	金 生品投资		
6	金 资产	74,757,552.13	7.95
	其中: 式 的 金 资产		
7	银行存 和 金合计	61,996,676.54	6.59
8	其 资产	56,588,974.10	6.02
9	合计	940,514,848.77	100.00

：本基金本报告期未通过 股通交易 投资 股。

5.2 报告期末 行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末 行业分类的 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 行业分类的 股通投资股票投资组合

：本基金本报告期末未持有股票。

5.3 报告期末 公 值 基金资产净值比 大 的前 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 债券品种分类的债券投资组合

号	债券品种	公 值（元）	基金资产净值比 （ ）
1	国 债券	30,015,000.00	4.17
2	行票据		
3	金 债券	129,249,796.00	17.98
	其中：政策性金 债	129,249,796.00	17.98
4	业债券	139,995,900.00	19.47

5	业　期　资券	68,838,150.00	9.58
6	中期票据	379,072,800.00	52.73
7	债（　交　债）		
8	同业存单		
9	其		
10	合计	747,171,646.00	103.93

5.5 报告期末　公　　值　基金资产净值比　大　　的前　　债券投资明细

号	债券代码	债券　称	数　（　）	公　　值（元）	基金资产净值比　（　）
1	102000014	20　　001	500,000	50,470,000.00	7.02
2	190406	19　　06	400,000	41,040,000.00	5.71
3	101900713	19　　投　　002	400,000	40,616,000.00	5.65
4	190215	19 国开 15	400,000	40,552,000.00	5.64
5	101901174	19　　投　　006	300,000	30,486,000.00	4.24

5.6 报告期末　公　　值　基金资产净值比　大　　的前　　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　公　　值　基金资产净值比　大　　的前　　金属投资明细

：本基金本报告期末未持有　金属。

5.8 报告期末　公　　值　基金资产净值比　大　　的前　　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　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　和　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

：本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10 投资组合报告

5.10.1 本基金投资的前　　证券的　行主　本期　　以及　　的　况的说明

报告期内本基金投资的前　　证券的　行主　未出现　　管　　，或在报告　　日前一年内　　公开　责、　　的　　。

5.10.2 基金投资的前　　股票　出基金合同规定的　选股票　　况的说明

本基金本报告期末未投资股票，不存在投资的前　　股票　出基金合同规定的　选股票　的　　。

5.10.3 其　资产

号	称	金额（元）
1	存出保证金	8,383.57
2	应收证券	40,000,000.00
3	应收股利	
4	应收利息	15,163,547.70
5	应收	1,417,042.83
6	其　应收	
7	用	
8	其	
9	合计	56,588,974.10

5.10.4 报告期末持有的　于　股期的　　债券明细

：本基金本报告期末未持有　于　股期的　　债券。

5.10.5 报告期末前　　股票中存在　通　限　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　　的其　　述　分

：　于　　的原　，分　　和　合计　　存在　差。

§6 开放式基金份额

单位：份

目	长信纯债壹号债券 A	长信纯债壹号债券 C
报告期期　基金份额总额	338,901,945.92	420,750,554.74
报告期期　基金总　　份额	95,348,686.25	55,101,733.94
报告期期　基金总　　份额	108,613,048.35	136,312,961.85
报告期期　基金　分　　份额（份额以　　）		
报告期期末基金份额总额	325,637,583.82	339,539,326.83

§7 基金管理人运用 有资金投资本基金 况

7.1 基金管理人持有本基金份额 况

：本报告期内基金管理人未运用 有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用 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 有资金投资本基金。

§8 投资者决策的其 重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比 或 过 20%的 况

：本基金本报告期内未有单一投资者持有基金份额比 或 过 20 的 况。

8.2 投资者决策的其 重要信息

：本基金本报告期未 生 投资者决策的其 重要信息。

§9 目

9.1 目

1、中国证 会 准 基金的 ；

2、 长信纯债壹号债券型证券投资基金基金合同 ；

3、 长信纯债壹号债券型证券投资基金招募说明书 ；

4、 长信纯债壹号债券型证券投资基金托管 ；

5、报告期内在指定报 的 种公告的原 ；

6、长信基金管理有限责任公司 业 、公司 及 资 复 。

9.2 存放

基金管理人的 公场所。

9.3 阅方式

长信基金管理有限责任公司 ： . . . 。

长信基金管理有限责任公司

2020 年 7 月 21 日