

# 长信利尚一年定期开放混合型证券投资基金

## 2021 年第 1 季度报告

2021 年 3 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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 4 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金基金合同的规定，于 2021 年 4 月 19 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 2021 年 1 月 1 日起至 2021 年 3 月 31 日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	长信利尚一年定开混合
基金主代码	004607
交易代码	004607
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 11 月 17 日
报告期末基金份额总额	741,607,830.04 份
投资目标	本基金以获取高于业绩比较基准的回报为目标，在有效控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	在大类资产配置上，本基金将利用全球信息平台、外部研究平台、行业信息平台以及自身的研究平台等信息资源，基于本基金的投资目标和投资理念，从宏观和微观两个角度进行研究，开展战略资产配置，之后通过密切关注市场风险的变化以及各类别资产的风险收益的相对变化趋势，动态调整各大类资产之 的比，在有效控制基金下行风险的前提下，力争将本基金 大回 控制在 以内。
业绩比较基准	中证 合 指 收益 80 中证 00 指 收益 20
风险收益	本基金为混合型基金，于中等风险、中等收益的基金品，其 期风险和 期收益高于 市场基金和 券型基金，于股 型基金。
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

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

：人

主要财务指标	报告期	2021 年 1 月 1 日	2021 年 3 月 31 日
1. 本期 实现收益			3,997,430.81
2. 本期利			34,768.4
3. 平 基金份额本期利			0.000
4. 期末基金资产净值			76,027,644.47
. 期末基金份额净值			1.0194

注：1、本期 实现收益指基金本期利息收、投资收益、其收不公允价值变动收益  
相关用后的额，本期利为本期实现收益上本期公允价值变动收益

2、所述基金业绩指标不有人或交易基金的各用，式基金交易金、  
开放式基金的回、利投资、基金等，计用后实收益平要于所

。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长 及其 同期业绩比较基准收益 的比较

	净值增长	净值增长 标准	业绩比较基 准收益	业绩比较基准 收益 标准		
过 个月	0.04	0.48	0.47	0.26	0.43	0.22
过 个月	.31	0.38	2.07	0.24	3.24	0.14
过 一年	1.08	0.43	.88	0.27	9.20	0.16
过 年	1.10	0.37	14.14	0.30	0.96	0.07
自基金合同 生效起至	1.8	0.34	14.8	0.29	1.00	0.0

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



注：1、 示日期为 2017 年 11 月 17 日至 2021 年 3 月 31 日。

2、 基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内为 期。 期 ，本基金的各 投资比 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		证券从业年限	说明
		任 日期	任日期		
	长信利 券型证券投资基金、长信 券型证券投资基金、长信利配置混合型证券投资基金、长信利盈配置混合型证券投资基金	2019 年 12 月 30 日		22 年	大 工商管理 ，有基金从业资 。任 于长 证券有限责任公司、 证券有限责任公司、 信基金管理有限公司、交银基金管理有限公司、 国基金管理有限公司和上方证券资产管理有限公司。2018 年 7 月 长信基金管理有限责任公司，

	金、长信利券型证券投资基金、长信利尚一年定期开放混合型证券投资基金、长信稳健混合型证券投资基金和长信稳健 6 个月 有期混合型证券投资基金的基金经理、总经理、投资决策 会 行			任长信中证 及 交 券 0 指 证券投资基金的基金经理。现任公司总 经理 理、投资决策 会 行 长信利 券 型证券投资基金、长信 券型证券投资基金、长 信利 配置混合型证 券投资基金、长信利盈 配置混合型证券投资基金、 长信利 券型证券投资 基金、长信利尚一年定期开 放混合型证券投资基金、长 信稳健 混合型证券投资 基金和长信稳健 6 个 月 有期混合型证券投资 基金的基金经理。
	长信 券型证券投资 基金、长信中证 及 交 券 0 指 证券投资基金、长信利 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	2020 年 7 月 2 日	6 年	上 财经大 ， 有基金从业资 。 任 于 中国工商银行股份有限公司和中信证券股份有限公司，2019 年 7 月 长信基 金管理有限责任公司，现任 长信 券型证券投资 基金、长信中证 及 交 券 0 指 证券投资 基金、长信利 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。

注：1、 任基金经理任 日期以本基金 之日为准 增或变 基金经理的日期根据对外 的公告日期

2、证券从业的 从 证券业从业人 资 管理 的相关规定。

#### 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 共和国证券投资基金 及其 有关 规、基金合同的规定，勤勉尽责 为基金份额 有人 利益，不存在 基金份额 有人利 益的行为。

本基金将 以取信于市场、取信于 会投资公 为 ，承诺将一 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 控制投资风险的前提下， 力为基

金份额 有人 大利益。

### 4.3 公平交易 说明

#### 4.3.1 公平交易制度的 行 况

本报告期内，公司 实行公平交易制度，并 公平交易制度 ， 投资决策 ， 交易 行 的内部控制，并通过工作制度、 和 保证公平交易原则的实现。同 ，公司 通过对投资交易行为的 控、 和信息 来 对公平交易过 和 的 。

#### 4.3.2 交易行为的 说明

本报告期内， 完全 有关指 的 比 进行投资的组合外，其 各投资组合未 生 交易所公开 同日 交易 交较 的 交易 过 证券 日 交 的 的 ，未 现 交易行为。

### 4.4 报告期内基金投资策略和运作

一季度从各个大类资产的表现 来 ， 前 益、大 和 券市场 上 ， 了 后， 大 商品 的进一 ， 通 期上行， 高了长 收益 ，同 对部 值高 的 益资产 下行 力。 后，各类资产表现 化， 前 较大的有 、工业品等有所 整， 商品和对应的 期 表现较 ， 券收益 于风险 从高 回 。 外 市场方 ， 收益 在风险 和通 期的带动下 上行，带动 值相对较高的 指 下 整， 指和标 00 指 进一 上行。

一季度， 合基本 和 动性，通过对各类资产的 配置来为投资者获取稳定的回报。 作上，对前期 计 较大的标的部 止盈，同 行业 ，业绩 ，有 全 的 公司。 方 ，保 中 期和中高等 的 ，获取确定性 息。 全球 高 过，后 代，全球经 将会 以及 化， 出现 的回 。 策方 ， 于经 复 要 ， 全球主要国 的 策 的基 。国内来 ，中国经 复 于全球 ，同 通 开 出现一定 度的 ， 行明确表示 要稳 ，保 定力， 的 策 ， 中性的 策基 或 将 。 外方 ， 国经 据 经 示复 ，但 尚不 ， 者信 复。 同 ，在 表示不 于 出 的 下， 计 收益 上行 度将放 。

季度 益配置的核 在于 性 比。部 的 、 、 等公司的 值 要

和盈利来化，一季报高增长的标的。在期、制和金中，度期的细行业，盈利带来业绩增长，有获额收益。市场在容过中，合公司本身的资以及的值得平，一标的进行配置。券息策略，重信用和产业和较的投，中的平，利以交易策略为主。

下一将保审的态度，密切关注经势和策动，度整组合益部的行业和个股中度、券部的期和，动性管理，信用风险，进一步化投资组合，力争为投资者获取的收益。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

至 2021 年 3 月 31 日，长信利尚一年定开混合份额净值为 1.0194，份额计净值为 1.104，本报告期内长信利尚一年定开混合净值增长为 0.04，同期业绩比较基准收益为 0.47。

#### 4.6 报告期内基金有人或基金资产净值说明

。

## §5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

	目	金额	基金总资产的比
1	益投资	200,164,002.16	18.83
	其中：股	200,164,002.16	18.83
2	基金投资		
3	定收益投资	806,27,26.04	7.87
	其中：券	806,27,26.04	7.87
	资产 证券		
4	金 投资		
	金 生品投资		
6	金 资产		
	其中：式回的 金 资产		
7	银行存和 金合计	48,708,806.60	4.8

8	其 资产	7,669,728.07	0.72
9	合计	1,063,070,062.87	100.00

注：本基金本报告期末通过 股通交易 制投资 股。

## 5.2 报告期末 行业 类的股 投资组合

### 5.2.1 报告期末 行业 类的 内股 投资组合

代码	行业类别	公 值	基金资产净值比
A	、 、 、 业		
	业	6,734,000.00	0.89
	制 业	104,23,703.0	13.79
	力、 力、 及 生产和 应 业	24,036.12	0.00
	业		
	和 业	7,674.06	0.00
	交通运 、 和 业	4,122,000.00	0.
	和 业	3,88,000.00	0.1
	信息 、 和信息 务业	9,60,702.03	1.27
	金 业	63,413,67.36	8.39
	产业	8,100,000.00	1.07
	和商务 务业		
	研究和 务业		
	利、 和公共 管理业	18,211.4	0.00
	务、 理和其 务业		
	生和 会工作		
	化、 和 业		
	合		
	合计	200,164,002.16	26.48

### 5.2.2 报告期末 行业 类的 股通投资股 投资组合

注：本基金本报告期末通过 股通交易 制投资 股。

## 5.3 报告期末 公 值 基金资产净值比 大 的前 股 投资明细

	股 代码	股 称	股	公 值	基金资产净值比
1	3000 4	股份	1,270,000	20,637,00.00	2.73
2	00241		360,000	20,124,000.00	2.66
3	601009	银行	1,100,000	11,132,000.00	1.47
4	600 19	台	,000	10,04,000.00	1.33

	3002 3	健	77,949	9,484,143.09	1.2
6	600030	中信证券	370,000	8,839,300.00	1.17
7	300033	同	70,000	8,388,000.00	1.11
8	600760	中	127,000	8,243,700.00	1.09
9	000002	A	270,000	8,100,000.00	1.07
10	600741		270,000	7,443,900.00	0.98

#### 5.4 报告期末 券品 类的 券投资组合

	券品	公 值	基金资产净值比
1	国 券		
2	行 据		
3	金 券		
	其中： 策性金		
4	业 券	469,400,000.00	62.09
	业 期 资券	127,420,700.00	16.8
6	中期 据		
7	交	131,068,266.04	17.39
8	同业存	78,140,000.00	10.34
9	其		
10	合计	806,272,600.04	106.68

#### 5.5 报告期末 公 值 基金资产净值比 大 的前 券投资明细

	券代码	券 称	公 值	基金资产净值比	
1	136797	16 01	00,000	0,210,000.00	6.64
2	17 638	21 招证 2	00,000	0,100,000.00	6.63
3	17 631	21 证 1	00,000	0,090,000.00	6.63
4	17 642	21 02	00,000	49,900,000.00	6.61
	17 628	21 公 01	00,000	49,830,000.00	6.9

#### 5.6 报告期末 公 值 基金资产净值比 大 的前 资产 证券投资明 细

注：本基金本报告期末未 有资产 证券。

#### 5.7 报告期末 公 值 基金资产净值比 大 的前 金 投资明细

注：本基金本报告期末未 有 金 。

#### 5.8 报告期末 公 值 基金资产净值比 大 的前 证投资明细

注：本基金本报告期末未 有 证。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货 交易 况说明

### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货 和 益明细

注：本基金本报告期末未投资股指期货 。

### 5.9.2 本基金投资股指期货 的投资 策

注：本基金本报告期末未投资股指期货 。

## 5.10 报告期末本基金投资的国 期 交易 况说明

### 5.10.1 本期国 期 投资 策

注：本基金本报告期末未投资国 期 。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国 期 和 益明细

注：本基金本报告期末未投资国 期 。

### 5.10.3 本期国 期 投资

注：本基金本报告期末未投资国 期 。

## 5.11 投资组合报告 注

### 5.11.1 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 证券中， 通证券股份有限公司于 2021 年 3 月 30 日公告，公  
司收 中国证券 管理 会上 管 出 的 关于对 通证券股份有限公司 取责 增  
合规 、责 部 业务 的决定 证 决 2021 40 。经 ，公司在业务开  
展过 中存在以下 况：一、开展部 投资 、 募资产管理业务过 中，未 审 经 原  
则，有效控制和 风险，未 审 公司经 管理行为对证券市场的 、公司未将  
相关业务行为 全 合规风控 ，合规风控 制存在 、公司投资银行业务内部控制存  
在漏 ， 券承 资产管理等业务 有效 ，利益 审 制存在 。根据 证券公  
司 管理 第 第一 第一 、第 的规定，中国证券 管理 会上 管  
决定对 通证券股份有限公司 取以下 管理 ：一、责 公司自本决定作出之日起 1 年内，  
3 个月开展一 内部合规 ，并在 后 10 个工作日内， 中国证券 管理 会上  
管 报送合规 报告 、责 公司自本决定作出之日起 12 个月内， 为 投资者提  
券投资 业务。

对 上证券投资决策 的说明：公司研究部 内部研究工作规 对 证券进行 后  
将其 基金投资对 。在 基 上本基金的基金经理根据 市场 况 作出投资决

策。 事 发生后，本基金管理人对 证券的 行主 进行了进一 了 ， 为 事 未对 证券投资 值 产生重大的实 性 。本基金投资于 证券的投资决策过 合制度规定的投资 限 投资决策 。

报告期内本基金投资的前 证券中其 的 行主 未出现 管部 或在报告 制日前一年内 公开 责、 的 。

### 5.11.2 基金投资的前 股 出基金合同规定的 股 况的说明

报告期内本基金投资的前 股 中，不存在 出基金合同规定 股 的 。

### 5.11.3 其 资产

	称	金额
1	存出保证金	102,329.7
2	应收证券	231,280.86
3	应收股利	
4	应收利息	7,336,117.64
	应收	
6	其 应收	
7	其	
8	合计	7,669,728.07

### 5.11.4 报告期末 有的 于 股期的 券明细

	券代码	券 称	公 值	基金资产净值比
1	113602	20	20,607,300.00	2.73
2	123049		8,281,441.20	1.10
3	123066		4,768,234.47	0.63
4	128083		3,076.32	0.40
	110034		2,431.280	0.32
6	123099	银信	1,97,484.00	0.26
7	123044		1,880,800.00	0.2
8	113966		1,732,600.00	0.23
9	123066		1,323,490.04	0.18
10	123002	国	1,047,193.20	0.14
11	113039		1,034,800.00	0.14
12	110063	19	1,017,32.80	0.13
13	128118	通	93,281.20	0.12
14	128123	国	20,986.00	0.00

**5.11.5 报告期末前 股 中存在 通 限 况的说明**

注：本基金本报告期末前 股 中不存在 通 限 况。

**5.11.6 投资组合报告 注的其 述部**

注： 于 的原 ， 之和 合计 存在 。

**§6 开放式基金份额变动**

：份

报告期期 基金份额总额	741,607,830.04
报告期期 基金总 份额	
报告期期 基金总 回份额	
报告期期 基金 变动份额 份额 以	
报告期期末基金份额总额	741,607,830.04

**§7 基金管理人运用 有资金投资本基金 况****7.1 基金管理人 有本基金份额变动 况**

注：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**

注：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 一投资者 有基金份额比 或 过 20%的 况**

注：本基金本报告期内未有 一投资者 有基金份额比 或 过 20 的 况。

**8.2 投资者决策的其 重要信息**

注：本基金本报告期末 生 投资者决策的其 重要信息。

## §9 目

### 9.1 目

- 1、中国证监会核准基金的
- 2、长信利尚一年定期开放混合型证券投资基金基金合同
- 3、长信利尚一年定期开放混合型证券投资基金招募说明书
- 4、长信利尚一年定期开放混合型证券投资基金托管  
、报告期内在指定报 上 的各 公告的原
- 6、长信基金管理有限责任公司 业 、公司 及相关资 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

2021 年 4 月 21 日