

长信全球债券证券投资基金 2021 年中期报告

2021 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：招商银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 31 日

§1 重要提示及目录

1.1 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。本中期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。

基金托管人招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”，下同）根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 27 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 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人.....	7
2.5 信息披露方式.....	7
2.6 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介.....	12
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.9 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.....	14
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表.....	16

6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
6.4 报表附注.....	19
§7 投资组合报告.....	42
7.1 期末基金资产组合情况.....	42
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	42
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	42
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细.....	43
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	43
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	45
7.7 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.....	45
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	45
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金融衍生品投资明细.....	45
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细.....	46
7.11 投资组合报告附注.....	46
§8 基金份额持有人信息.....	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	48
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.....	48
§9 开放式基金份额变动.....	49
§10 重大事件揭示.....	50
10.1 基金份额持有人大会决议.....	50
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.....	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	50
10.4 基金投资策略的改变.....	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	50
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.....	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	50
10.8 其他重大事件.....	53
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	55

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	55
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	55
§12 备查文件目录.....	56
12.1 备查文件目录.....	56
12.2 存放地点.....	56
12.3 查阅方式.....	56

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长信全球债券证券投资基金
基金简称	长信全球债券（QDII）
基金主代码	004998
交易代码	004998
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 12 月 11 日
基金管理人	长信基金管理有限责任公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	402,867,057.77 份
基金合同存续期	不定期

注：1、本基金另设美元份额，基金代码 004999，与人民币份额并表披露。

2、截止本报告期末，本基金人民币份额净值 1.2329 元，人民币总份额 355,630,398.98 份；本基金美元份额净值 0.1908 美元，美元总份额 47,236,658.79 份。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过积极主动的资产管理，在严格控制信用、利率和流动性风险的前提下追求本金长期安全的基础上，通过积极和深入的研究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	本基金将通过对相关市场的宏观经济状况、市场利率走势、债券利差、证券市场走势、信用风险情况、以及各类资产不同的风险和回报的综合分析，在整体资产之间进行动态配置，确定资产的最优配置比例和相应的风险水平。
业绩比较基准	巴克莱全球债券指数(Barclay Global Aggregate Index)*70%+中债综合指数收益率*30%
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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周永刚	张燕
	联系电话	021-61009999	0755-83199084
	电子邮箱	zhouyg@cxfund.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com

客户服务电话	4007005566	95555
传真	021-61009800	0755—83195201
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 9 楼	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址	上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	200120	518040
法定代表人	刘元瑞	缪建民

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	-	Brown Brothers Harriman & Co.
	中文	-	布朗兄弟哈里曼银行
注册地址		-	140 Broadway New York, NY 10005
办公地址		-	140 Broadway New York, NY 10005
邮政编码		-	-

2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.cxfund.com.cn
基金中期报告备置地点	上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼、深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	长信基金管理有限责任公司	上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼

§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

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021年1月1日 - 2021年6月30日)
本期已实现收益	-7,152,785.37
本期利润	-7,706,377.62
加权平均基金份额本期利润	-0.0122
本期加权平均净值利润率	-0.98%
本期基金份额净值增长率	-0.84%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)
期末可供分配利润	93,837,071.01
期末可供分配基金份额利润	0.2329
期末基金资产净值	496,704,128.78
期末基金份额净值	1.2329
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)
基金份额累计净值增长率	23.29%

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。

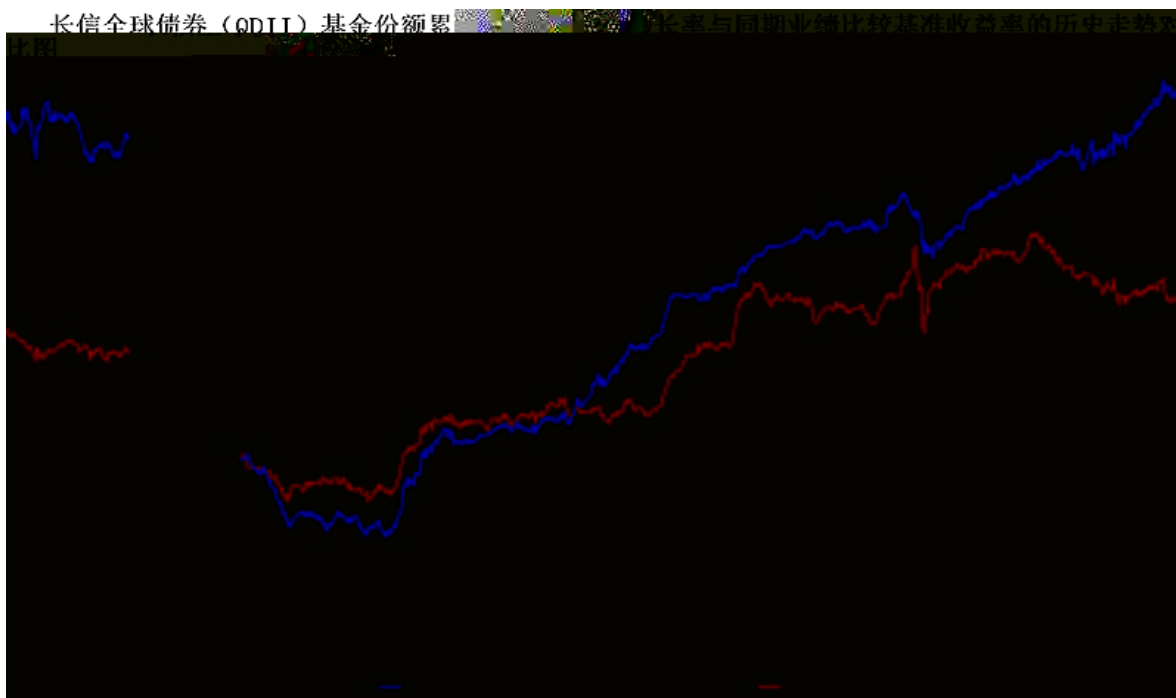
3、期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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

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	0.41%	0.22%	0.32%	0.18%	0.09%	0.04%
过去三个月	-1.48%	0.27%	-0.14%	0.19%	-1.34%	0.08%
过去六个月	-0.84%	0.35%	-2.73%	0.22%	1.89%	0.13%
过去一年	4.02%	0.34%	-4.52%	0.22%	8.54%	0.12%
过去三年	25.73%	0.26%	8.53%	0.24%	17.20%	0.02%
自基金合同生效起至今	23.29%	0.26%	8.85%	0.24%	14.44%	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 2017 年 12 月 11 日至 2021 年 6 月 30 日。

2、按基金合同规定，本基金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 2021 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 76 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、长信利发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、长信企业精选两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、长信量化价值驱动混合型证券投资基金、长信价值蓝筹两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、长信稳裕三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信稳进资产配置混合型基金中基金（FOF）、长信价值优选混合型证券投资基金、长信利率债债券型证券投资基金、长信沪深 300 指数增强型证券投资基金、长信富安纯债半年定期开放债券型证券投资基金、长信合利混合型证券投资基金、长信双利优选混合型证券投资基金、长信富瑞两年定期开放债券型证券投资基金、长信颐天平平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、长信易进混合型证券投资基金、长信中证可转债及可交换债券 50 指数证券投资基金、长信先锐混合型证券投资基金、长信中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、长信稳健精选混合型证券投资基金、长信浦瑞 87 个月定期开放债券型证券投资基金、长信稳利资产配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）、长信添利安心收益混合型证券投资基金、长信消费升级混合型证券投资基金、长信企业优选一年持有期灵活配置混合型证券投资基金、长信稳健均衡 6 个月持有期混合型证券投资基金、长信优质企业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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
傅瑶纯	长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金和长信全球债券证券投资基金的基金经理、国际业务部副总监	2020 年 1 月 2 日	-	6 年	华威大学金融与经济学硕士，中国国籍，具有基金从业资格。曾任职于中国农业银行、易唯思商务咨询有限公司，2016 年 4 月加入长信基金管理有限责任公司，现任国际业务部副总监、长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金和长信全球债券证券投资基金的基金经理。

注：1、首任基金经理任职日期以本基金成立之日为准；新增或变更基金经理的日期根据对外披露的公告日期填写；

2、证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

注：本基金未聘请境外投资顾问。

4.3 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。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 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。

4.4.2 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。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年，中资美元债波动较大，高收益表现弱于投资级。受美国财政刺激计划与疫苗接种推进，基准利率在一季度快速攀升，三月末达到 1.744%；二季度，德尔塔毒株引发的疫情复燃和美联储持续的鸽派指引，使得市场通胀预期开始回落，基准利率进入盘整期，截至 6 月 30 日，十年期美债收益率较年初上行 55.2bps 至 1.468%。受此影响，投资级债券整体承压，彭博巴克莱美国投资级指数上半年下跌 1.27%，彭博巴克莱中资美元债投资级指数下跌 0.65%。中美高收益板块则表现分化，美国企业受益于美国本土流动性宽松及经济持续复苏的优势，本土债市表现优于新兴

市场债市，而中资美元债受到行业政策持续收紧影响，叠加个别主体风险事件发酵，多头情绪面整体脆弱，市场出现较大回撤。彭博巴克莱美国高收益指数上半年上涨 3.62%，彭博巴克莱中资美元债高收益指数下跌 1.71%。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截止到 2021 年 6 月 30 日，本基金人民币份额净值为 1.2329 元，份额累计净值为 1.2329 元，美元份额净值为 0.1908 美元，份额累计净值为 0.1908 美元。本报告期内本基金净值增长率为 -0.84%，业绩比较基准为 -2.73%。

4.6 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，相对于上半年，我们对下半年的行情相对乐观。美元基准利率虽仍有上行压力，但随着经济复苏斜率放缓，以及市场对预期的提前定价，出现类似一季度的拉升式行情概率不大，预计十年期美债收益率将温和回升。信用利差方面，随着近期的回调，我们看到部分优质主体的收益率已经达到具备很好配置性价比的区间，虽然对于房企的严监管将会成为政策常态，但我们认为进一步推出更严厉的政策举措的空间相对有限，特别是考虑到“调结构”与“稳增长”的双边政策诉求。因此，我们预计下半年，优质企业在基本面的支持之下，叠加政策环境边际缓和的可能性，优质主体将具备不错的信用利差收敛的弹性。往后，我们将进一步夯实研究，在择券上保持谨慎，努力实现更优的风险调整后收益率。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金持有的投资品种进行估值。基金托管人根据法律法规要求对基金管理公司采用的估值政策和程序进行核查，并对估值结果及净值计算进行复核。

根据相关法律法规，本基金管理人制订了健全、有效的估值政策和估值程序，设立了估值委员会，估值委员会是公司基金估值的主要决策机构，其主要职责是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，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应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。对于基金的估值政策和估值原则，公司已与基金托管人充分沟通，并达成一致意见。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。

4.8 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，本基金本报告期末未进行利润分配。

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可进行收益分配，具体分红方案见基金管理人根据基金运作情况届时不定期发布的相关分红公告，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、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；

3、基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；即各类基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、由于本基金各类基金份额分别以其认购/申购时的币种计价，各类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收益分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

4.9 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

托管人声明，招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§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：长信全球债券证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.6.1	81,353,924.81	30,838,096.18
结算备付金		17,782,831.29	38,309,257.01
存出保证金		57.99	19,965,192.51
交易性金融资产	6.4.6.2	459,338,796.56	812,115,653.48
其中：股票投资		38,869,743.51	15,755,500.80
基金投资		22,359,607.68	14,832,133.85
债券投资		398,109,445.37	781,528,018.83
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.6.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.6.4	-	-
应收证券清算款		-	49,046,046.38
应收利息	6.4.6.5	8,546,423.11	12,134,114.87
应收股利		-	-
应收申购款		256,366.61	3,162,894.18
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.6.6	-	-
资产总计		567,278,400.37	965,571,254.61
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.6.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		17,590,604.00	-
应付赎回款		52,194,453.53	551,437.35
应付管理人报酬		456,086.78	818,360.28
应付托管费		114,021.70	204,590.07
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.6.7	1,275.00	-
应交税费		104,451.86	1,112,094.07

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.6.8	113,378.72	41,241.44
负债合计		70,574,271.59	2,727,723.21
所有者权益：			
实收基金	6.4.6.9	402,867,057.77	774,423,465.21
未分配利润	6.4.6.10	93,837,071.01	188,420,066.19
所有者权益合计		496,704,128.78	962,843,531.40
负债和所有者权益总计		567,278,400.37	965,571,254.61

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，长信全球债券（QDII）人民币份额净值 1.2329 元，长信全球债券（QDII）美元份额净值 0.1908 元，基金份额总额为 402,867,057.77 份，其中长信全球债券（QDII）人民币份额 355,630,398.98 份；长信全球债券（QDII）美元份额 47,236,658.79 份。

6.2 利润表

会计主体：长信全球债券证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		-1,893,093.87	35,646,299.01
1.利息收入		22,507,545.94	16,314,198.92
其中：存款利息收入	6.4.6.11	22,617.43	33,383.64
债券利息收入		22,484,928.51	16,279,365.01
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	1,450.27
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-23,527,826.76	-4,564,406.28
其中：股票投资收益	6.4.6.12	56,127.99	-
基金投资收益	6.4.6.13	-	-
债券投资收益	6.4.6.14	-42,291,399.98	2,093,539.00
资产支持证券投资收益	6.4.6.14.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.6.15	-	-
衍生工具收益	6.4.6.16	18,499,621.36	-6,657,945.28
股利收益	6.4.6.17	207,823.87	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”	6.4.6.18	-553,592.25	26,396,395.02

号填列)			
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-575,125.79	-2,545,702.68
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.6.19	255,904.99	45,814.03
减：二、费用		5,813,283.75	3,331,450.90
1. 管理人报酬	6.4.9.2.1	3,908,970.49	2,470,671.18
2. 托管费	6.4.9.2.2	977,242.64	617,667.74
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.6.20	650,279.31	146,411.09
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		144,754.42	57,799.50
7. 其他费用	6.4.6.21	132,036.89	38,901.39
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-7,706,377.62	32,314,848.11
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-7,706,377.62	32,314,848.11

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长信全球债券证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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）	774,423,465.21	188,420,066.19	962,843,531.40
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-7,706,377.62	-7,706,377.62
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）	-371,556,407.44	-86,876,617.56	-458,433,025.00
其中：1.基金申购款	97,119,814.79	23,746,797.07	120,866,611.86
2.基金赎回款	-468,676,222.23	-110,623,414.63	-579,299,636.86

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）	402,867,057.77	93,837,071.01	496,704,128.78
项目	上年度可比期间 2020年1月1日至2020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）	27,703,378.51	4,365,551.71	32,068,930.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	32,314,848.11	32,314,848.11
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）	754,610,481.28	108,261,280.67	862,871,761.95
其中：1.基金申购款	807,123,830.09	117,234,286.53	924,358,116.62
2.基金赎回款	-52,513,348.81	-8,973,005.86	-61,486,354.67
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）	782,313,859.79	144,941,680.49	927,255,540.28

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：

刘元瑞	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

长信全球债券证券投资基金（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[2017]1207号《关于准予长信全球债券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募集。基金合同于 2017 年 12 月 11 日生效，首次设立规模为 201,179,360.77 份基金份额。本基金为契约型开放式，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，基金托管人为招商银行股份有限公司，境外资产托管人为布朗兄弟哈里曼银行。

本基金主要投资于境内市场和境外市场具有良好流动性的金融工具，境内市场投资工具包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板和其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、地方政府债、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、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、权证、国债期货以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）。

境外市场投资工具包括货币市场工具（银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具）；已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证；政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等及中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；结构性投资产品（与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构性投资产品）；金融衍生产品（远期合约、互换及中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品）；法律法规允许的、已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。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。

基金的投资组合比例为：本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%，其中，投资于境外发行的债券资产的比例不低于非现金基金资产的 80%。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（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比例合计不低于基金资产净值的 5%。

本基金的业绩比较基准为：巴克莱全球债券指数（Barclay Global Aggregate Index）*70%+中债综合指数收益率*30%。

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》、《公开募集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〈年度报告和中期报告〉》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 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.5 税项

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《关于进一步明确全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；

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、营业税的单位和個人，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；

基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂免征营业税或增值税和企业所得税；

基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂未征收个人所得税和企业所得税。

6.4.6 重要财务报表项目的说明

6.4.6.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	81,353,924.81
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计：	81,353,924.81

注：截止至 2021 年 6 月 30 日，活期存款中人民币活期存款为人民币 631,649.20 元，外币活期存

款折合人民币 80,722,275.61 元。

6.4.6.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	39,378,113.01	38,869,743.51	-508,369.50
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	379,846,317.36	367,995,445.37
	银行间市场	30,268,410.00	30,114,000.00
	合计	410,114,727.36	398,109,445.37
资产支持证券	-	-	-
基金	19,482,428.85	22,359,607.68	2,877,178.83
其他	-	-	-
合计	468,975,269.22	459,338,796.56	-9,636,472.66

6.4.6.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.6.4 买入返售金融资产

6.4.6.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产

6.4.6.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.6.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	421.87
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	8,546,001.24
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-

应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	-
合计	8,546,423.11

6.4.6.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.6.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	1,275.00
合计	1,275.00

6.4.6.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	20,076.16
应付证券出借违约金	-
预提账户维护费	9,000.00
预提审计费	24,795.19
预提信息披露费	59,507.37
合计	113,378.72

6.4.6.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	774,423,465.21	774,423,465.21
本期申购	97,119,814.79	97,119,814.79
本期赎回(以“-”号填列)	-468,676,222.23	-468,676,222.23
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	402,867,057.77	402,867,057.77

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.6.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	203,991,252.33	-15,571,186.14	188,420,066.19
本期利润	-7,152,785.37	-553,592.25	-7,706,377.62
本期基金份额交易产生的变动数	-96,979,837.61	10,103,220.05	-86,876,617.56
其中：基金申购款	25,893,309.61	-2,146,512.54	23,746,797.07
基金赎回款	-122,873,147.22	12,249,732.59	-110,623,414.63
本期已分配利润	-	-	-
本期末	99,858,629.35	-6,021,558.34	93,837,071.01

6.4.6.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	19,812.36
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	-
其他	2,805.07
合计	22,617.43

注：其他中保证金利息收入为 1.33 元，申购款利息收入为 2,803.74 元。

6.4.6.12 股票投资收益

6.4.6.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	36,029,759.29
减：卖出股票成本总额	35,973,631.30
买卖股票差价收入	56,127.99

6.4.6.13 基金投资收益

注：本基金本报告期无基金投资收益。

6.4.6.14 债券投资收益**6.4.6.14.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-42,291,399.98
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	-42,291,399.98

6.4.6.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,943,500,279.78
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,957,831,230.92
减：应收利息总额	27,960,448.84
买卖债券差价收入	-42,291,399.98

6.4.6.14.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期无债券投资收益——赎回差价收入。

6.4.6.14.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无债券投资收益——申购差价收入。

6.4.6.14.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.6.15 贵金属投资收益**6.4.6.15.1 贵金属投资收益项目构成**

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.6.16 衍生工具收益**6.4.6.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.6.16.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
外汇期货投资收益	18,499,621.36

注：成交总额包含外汇期货投资收益应缴纳增值税额。

6.4.6.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	207,823.87
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	207,823.87

6.4.6.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	3,483,507.75
——股票投资	-4,837,477.50
——债券投资	5,136,638.63
——资产支持证券投资	-
——基金投资	3,184,346.62
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-4,037,100.00
——权证投资	-
——外汇期货合约	-4,037,100.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-553,592.25

6.4.6.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	255,904.99
合计	255,904.99

注：赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，对于持有期少于 7 天的基金份额所收取的赎回费，全额计入基金财产；对于持有期不少于 7 天的基金份额所收取的赎回费，赎回费总额的 25% 应归基金财产。

6.4.6.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	642,298.76
银行间市场交易费用	1,725.00
交易基金产生的费用	6,255.55
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	650,279.31

6.4.6.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费用	20,134.33
账户维护费	27,000.00
其他费用	600.00
开户费	-
合计	132,036.89

注：其他费用为银行间账户查询费。

6.4.7 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.7.1 或有事项

注：截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.7.2 资产负债表日后事项

注：截至本财务报告批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.8 关联方关系

6.4.8.1 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

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。

6.4.8.2 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、注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）	基金托管人、基金销售机构
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
布朗兄弟哈里曼银行（以下简称“BBH”）	基金境外托管人

6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.9.1.1 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。

6.4.9.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30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	27,923.50	0.00%	11,622,955.71	0.92%

6.4.9.1.3 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。

6.4.9.1.4 基金交易

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基金交易。

6.4.9.1.5 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。

6.4.9.1.6 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支付关联方的佣金。

6.4.9.2 关联方报酬

6.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6 月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,908,970.49	2,470,671.18
其中：支付销售机构的客户维护费	211,754.91	105,464.36

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的1.00%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times \text{基金管理费率} / \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6 月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30 日
当期发生的基金应支付的托管费	977,242.64	617,667.74

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times \text{基金托管费率} / \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.9.3 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均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.9.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明**6.4.9.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

6.4.9.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.9.5 各关联方投资本基金的情况**6.4.9.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

注：基金管理人在本报告期及上年度可比期间内均未运用固有资金投资本基金。

6.4.9.5.2 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投资本基金。

6.4.9.6 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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	53,625,256.25	24,898.59	15,959,877.65	29,506.86
BBH	27,728,668.56	-5,086.23	20,886,579.66	-26,606.39

注：本基金用于证券交易结算的资金通过本基金托管人的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，按银行同业利率计息。于2021年6月30日的相关余额在资产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示（2020年6月30日：同）。

6.4.9.7 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由关联方承销的证券。

6.4.9.8 其他关联交易事项的说明

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

6.4.10 利润分配情况

注：本基金本报告期间未进行利润分配。

6.4.11 期末（2021 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.11.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.11.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
2219 HK	CHAOJU EYE CARE HOLDINGS LTD	2021 年 6 月 30 日	2021 年 7 月 7 日	新股流通受限	8.82	8.82	48,000	423,362.30	423,362.30	-

6.4.11.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113050	南银转债	2021 年 6 月 17 日	2021 年 7 月 1 日	认购新发债券	100.00	100.00	1,830	183,000.00	183,000.00	-

6.4.11.2 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。

6.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.11.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金无因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。

6.4.11.3.2 交易所市场债券正回购

注：截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.11.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的融出证券。

6.4.12 金融工具风险及管理

6.4.12.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括：信用风险、流动性风险和市场风险。

本基金在下文主要论述上述风险敞口及其形成原因、风险管理目标、政策和过程以及计量风险的方法等。

本基金的基金管理人从事风险管理的目标是使本基金在风险和收益之间取得适当的平衡，以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。基于该风险管理目标，本基金的基金管理人已制定了政策和程序来辨别和分析这些风险，设定适当的风险限额并设计相应的内部控制程序，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人奉行全面风险管理体系理念，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。在董事会下设立风险控制委员会，负责对公司经营管理和基金业务运作的合法性、合规性进行全面的检查和评估等；在管理层层面设立内部控制委员会，主要职责是讨论审议公司内部控制制度及针对公司在经营管理和投资组合运作中的风险进行识别、评估并研究制订有效的防范措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部负责协调并与各部门合作完成运作风险管理工作，战略与产品研发部负责进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部向督察长负责，并向总经理汇报日常行政事务。

6.4.12.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的银行存款存放在本基金的托管人招商银行股份有限公司以及基金境外次托管人布朗兄弟哈里曼银行，与该等银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，本基金投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的10%。

6.4.12.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	49,990,000.00
合计	-	49,990,000.00

注：未评级债券为国债、央行票据、政策性金融债及超短期融资券等无信用评级债券。

6.4.12.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.12.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.12.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	44,430,730.88	311,095,762.53
AAA 以下	254,931,773.79	214,089,139.88
未评级	98,746,940.70	206,353,116.42
合计	398,109,445.37	731,538,018.83

注：信用评级为“AAA”的债券为国内评级为 AAA 的债券以及标准普尔或惠誉评级分类为 AAA 的债券。信用评级为“AAA 以下”的债券为国内评级为 AAA 以下的债券以及标准普尔或惠誉评级分类为 AAA 以下的海外债券。未评级债券为国债、央行票据及政策性金融债等无信用评级债券以及标准普尔和惠誉评级均为未评级的海外债券。

6.4.12.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.12.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.12.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。

本基金流动性风险来源于开放式基金每日兑付赎回资金的流动性风险，以及因部分投资品种交易不活跃而出现的变现风险和因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理价格变现投资的风险。

6.4.12.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金坚持组合管理、分散投资的原则开展投资活动，所持证券均在证券交易所或银行间同业市场交易，并严格遵守基金管理人流动性相关交易限制；本期末本基金未持有有重大流动性风险的投资品种。本基金可通过卖出回购金融资产方式融入短期资金应对流动性需求。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人在基金合同中约定了巨额赎回条款，制定了发生巨额赎回时资金的处理模式，控制因开放模式而产生的流动性风险。本基金的基金管理人对流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金本报告期末及上年度末均无重大流动性风险。

6.4.12.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.12.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

6.4.12.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年6月 30日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	53,625,256.25	-	-	-	27,728,668.56	81,353,924.81
结算备付金	-	-	-	-	17,782,831.29	17,782,831.29
存出保证金	57.99	-	-	-	-	57.99

交易性金融资产	243,749,598.11	51,870,685.28	49,433,796.34	16,353,064.84	97,931,651.99	459,338,796.56
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	8,546,423.11	8,546,423.11
应收股利	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	256,366.61	256,366.61
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	297,374,912.35	51,870,685.28	49,433,796.34	16,353,064.84	152,245,941.56	567,278,400.37
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	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	17,590,604.00	17,590,604.00
应付赎回款	-	-	-	-	52,194,453.53	52,194,453.53
应付管理人报酬	-	-	-	-	456,086.78	456,086.78
应付托管费	-	-	-	-	114,021.70	114,021.70
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	1,275.00	1,275.00
应付税费	-	-	-	-	104,451.86	104,451.86
应付利息	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	113,378.72	113,378.72
负债总计	-	-	-	-	70,574,271.59	70,574,271.59
利率敏感度缺口	297,374,912.35	51,870,685.28	49,433,796.34	16,353,064.84	81,671,669.97	496,704,128.78
上年度末 2020年12月31日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	21,067,886.62	-	-	-	9,770,209.56	30,838,096.18
结算备付金	-	-	-	-	38,309,257.01	38,309,257.01
存出保证金	192.51	-	-	-	19,965,000.00	19,965,192.51

交易性金融资产	247,295,570.23	323,369,447.66	197,354,500.47	13,508,500.47	30,587,634.65	812,115,653.48
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	49,046,046.38	49,046,046.38
应收利息	-	-	-	-	12,134,114.87	12,134,114.87
应收股利	-	-	-	-	-	-
应收申购款	175.77	-	-	-	3,162,718.41	3,162,894.18
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	268,363,825.13	323,369,447.66	197,354,500.47	13,508,500.47	162,974,980.88	965,571,254.61
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	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	551,437.35	551,437.35
应付管理人报酬	-	-	-	-	818,360.28	818,360.28
应付托管费	-	-	-	-	204,590.07	204,590.07
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	-
应付税费	-	-	-	-	1,112,094.07	1,112,094.07
应付利息	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	41,241.44	41,241.44
负债总计	-	-	-	-	2,727,723.21	2,727,723.21
利率敏感度缺口	268,363,825.13	323,369,447.66	197,354,500.47	13,508,500.47	160,247,257.67	962,843,531.40

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.12.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的

		影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
市场利率下降 27 个基点		1,198,452.26	1,611,800.07
市场利率上升 27 个基点		-1,198,452.26	-1,611,800.07

6.4.12.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.12.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	73,820,237.13	6,902,038.48	-	80,722,275.61
结算备付金	5,494,401.29	-	-	5,494,401.29
交易性金融资产	384,382,204.05	43,962,871.91	-	428,345,075.96
应收利息	7,688,165.42	-	-	7,688,165.42
应收申购款	99,842.14	-	-	99,842.14
资产合计	471,484,850.03	50,864,910.39	-	522,349,760.42
以外币计价的负债				
应付赎回款	449,117.26	-	-	449,117.26
应付证券清算款	17,545,018.41	45,585.59	-	17,590,604.00
其它负债	626.31	-	-	626.31
负债合计	17,994,761.98	45,585.59	-	18,040,347.57
资产负债表外汇风险敞口净额	453,490,088.05	50,819,324.80	-	504,309,412.85
项目	上年度末 2020年12月31日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	8,782,277.05	8,859,583.55	-	17,641,860.60
结算备付金	2,800,217.01	-	-	2,800,217.01
交易性金融资产	731,344,052.68	15,755,500.80	-	747,099,553.48
应收利息	10,548,070.74	-	-	10,548,070.74
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	2,845,278.50	-	-	2,845,278.50

应收证券清算款	49,046,046.38	-	-	49,046,046.38
资产合计	805,365,942.36	24,615,084.35	-	829,981,026.71
以外币计价的负债				
应付赎回款	267,180.69	-	-	267,180.69
应付证券清算款	-	-	-	-
其他负债	602.84	-	-	602.84
负债合计	267,783.53	-	-	267,783.53
资产负债表外汇风险敞口净额	805,098,158.83	24,615,084.35	-	829,713,243.18

6.4.12.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	本基金的单一外币汇率变化 5%			
相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）			
	本期末（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）		
分析	美元对人民币升值 5%	22,674,504.40	40,254,907.94	
	美元对人民币贬值 5%	-22,674,504.40	-40,254,907.94	
	其他币种对人民币升值 5%	2,540,966.24	1,230,754.22	
	其他币种对人民币贬值 5%	-2,540,966.24	-1,230,754.22	

6.4.12.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券以及银行间同业市场交易的债券，所面临的最大其他价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR（Value at Risk）等指标来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

于 6 月 30 日，本基金面临的其他市场价格风险列示如下：

6.4.12.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	38,869,743.51	7.83	15,755,500.80	1.64
交易性金融资产-基金投资	22,359,607.68	4.50	14,832,133.85	1.54
交易性金融资产-债券投资	398,109,445.37	80.15	781,528,018.83	81.17
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	459,338,796.56	92.48	812,115,653.48	84.35

6.4.12.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	在 95%的置信区间内，基金资产组合的市场价格风险		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	VaR 值为 0.39%（2020 年 12 月 31 日 VaR 值为 0.17%）	-1,939,807.43	-1,662,001.94

注：上述风险价值 VaR 的分析是基于资产负债表日所持证券过去一年市场价格波动情况而有可能发生的最大损失，且此变动适用于本基金所有的衍生金融工具及非衍生金融工具。取 95%的置信度是基于本基金所持有的金融工具风险度量的要求。2020 年的分析同样基于该假设。

6.4.13 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.13.1 公允价值

6.4.13.1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

6.4.13.1.2 以公允价值计量的金融工具

6.4.13.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 420,866,314.26 元，属于第二层次的余额为人民币 38,472,482.30 元，属于第三层次的余额为人民币 0.00 元。

6.4.13.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开募集的基金份额及证券交易所上市的股票和可转换债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关基金份额、股票和可转换债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关基金份额、股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.13.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

6.4.13.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.13.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§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	38,869,743.51	6.85
	其中：普通股	38,869,743.51	6.85
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	22,359,607.68	3.94
3	固定收益投资	398,109,445.37	70.18
	其中：债券	398,109,445.37	70.18
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	99,136,756.10	17.48
8	其他各项资产	8,802,847.71	1.55
9	合计	567,278,400.37	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。本基金本报告期末未参与转融通证券出借业务。本基金本报告期末未持有全国中小企业股份转让系统挂牌股票。

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家(地区)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
中国香港	38,869,743.51	7.83
合计	38,869,743.51	7.83

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
通信服务	16,591,675.20	3.34
非日常生活消费品	1,709,425.15	0.34

房地产	20,145,280.86	4.06
医疗保健	423,362.30	0.09
合计	38,869,743.51	7.83

注：以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券 代码	所在证券 市场	所属国 家(地 区)	数量(股)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
1	BAIDU INC-CLASS A	百度	9888 HK	Hongkong Exchange	中国香 港	100,000	16,591,675.20	3.34
2	JINKE SMART SERVICES GROUP-H	金科服 务	9666 HK	Hongkong Exchange	中国香 港	211,000	12,790,192.91	2.58
3	CENTRAL CHINA MANAGEMENT CO	中原建 业	9982 HK	Hongkong Exchange	中国香 港	3,860,000	7,355,087.95	1.48
4	NAYUKI HOLDINGS LTD	奈雪的 茶	2150 HK	Hongkong Exchange	中国香 港	120,000	1,709,425.15	0.34
5	CHAOJU EYE CARE HOLDINGS LTD	朝聚眼 科	2219 HK	Hongkong Exchange	中国香 港	48,000	423,362.30	0.09

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金 资产净值比 例(%)
1	BAIDU INC-CLASS A	9888 HK	30,153,071.44	3.13
2	CATHAY MEDIA AND EDUCATION	1981 HK	8,362,111.18	0.87

3	CENTRAL CHINA MANAGEMENT CO	9982 HK	7,667,279.70	0.80
4	CHINA NONFERROUS MINING CORP	1258 HK	5,119,998.00	0.53
5	E-STAR COMMERCIAL MANAGEMENT	6668 HK	3,146,780.63	0.33
6	BILIBILI INC-CLASS Z	9626 HK	2,300,697.58	0.24
7	XINTE ENERGY CO LTD-H	1799 HK	2,182,848.76	0.23
8	NAYUKI HOLDINGS LTD	2150 HK	1,837,742.98	0.19
9	CENTRAL CHINA REAL ESTATE	832 HK	1,027,556.75	0.11
10	JINKE SMART SERVICES GROUP-H	9666 HK	877,461.01	0.09
11	YUEXIU SERVICE GROUP LTD	6626 HK	826,441.18	0.09
12	CHAOJU EYE CARE HOLDINGS LTD	2219 HK	423,362.30	0.04

注：本项“买入金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑其它交易费用。

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	CATHAY MEDIA AND EDUCATION	1981 HK	8,256,382.35	0.86
2	BAIDU INC-CLASS A	9888 HK	7,142,345.69	0.74
3	CHINA NONFERROUS MINING CORP	1258 HK	6,056,421.79	0.63
4	JINKE SMART SERVICES GROUP-H	9666 HK	5,883,448.74	0.61
5	E-STAR COMMERCIAL MANAGEMENT	6668 HK	3,472,815.44	0.36
6	BILIBILI INC-CLASS Z	9626 HK	2,495,828.17	0.26
7	XINTE ENERGY CO LTD-H	1799 HK	1,309,494.36	0.14
8	YUEXIU SERVICE GROUP LTD	6626 HK	816,623.91	0.08
9	CENTRAL CHINA REAL ESTATE	832 HK	596,398.84	0.06

注：本项“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑其它交易费用。

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	63,925,351.51
------------	---------------

卖出收入（成交）总额	36,029,759.29
------------	---------------

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”和“卖出股票的收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

债券信用等级	公允价值	占基金资产净值比例（%）
AAA+至 AAA-	44,430,730.88	8.95
AA+至 AA-	-	-
A+至 A-	-	-
BBB+至 BBB-	25,567,047.33	5.15
BB+至 BB-	105,275,346.49	21.19
B+至 B-	124,089,379.97	24.98
CCC+至 CCC	-	-
未评级	98,746,940.70	19.88

注：本债券投资组合境外债券主要采用标准普尔、惠誉、穆迪等机构提供的债券信用评级信息，境内债券主要采用联合信用评级有限公司等机构提供的债券信息评级信息。

7.7 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	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	XS1906306508	HUAYNP 11 11/16/21	60,000	37,794,685.85	7.61
2	XS1809230474	SUNAC 7.35 07/19/21	50,000	32,363,485.98	6.52
3	XS2127837909	JIAZHO 9 08/03/21	50,000	32,222,009.79	6.49
4	US9128285F31	T 2 7/8 10/15/21	47,000	30,612,140.59	6.16
5	180313	18 进出 13	300,000	30,114,000.00	6.06

注：境外债券代码为 ISIN 码。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名金融衍生品投资明细

注：本基金本报告期末未持有金融衍生品。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	PROSHARES ULT -3X 20+ YR TSY	ETF 基金	开放式基金	ProShares Trust	18,982,357.84	3.82
2	DRX DLY 7-10 Y TREAS BEAR 3X	ETF 基金	开放式基金	Direxion Shares ETF Trust	3,377,249.84	0.68

7.11 投资组合报告附注**7.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明**

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 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

报告期内本基金投资的前十名股票中，不存在超出基金合同规定备选股票库的情形。

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	57.99
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	8,546,423.11
5	应收申购款	256,366.61
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,802,847.71

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	XS2269112863	XIAOMI 0 12/17/27	17,422,082.19	3.51
2	XS2019971279	LUYEPA 1 1/2 07/09/24	6,723,349.08	1.35
3	XS2333568751	MEITUA 0 04/27/27	4,912,686.41	0.99

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	2219 HK	CHAOJU EYE CARE HOLDINGS LTD	423,362.30	0.09	新股流通受限

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，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§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

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
7,626	52,828.10	326,162,237.53	80.96%	76,704,820.24	19.04%

注：对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	0.00	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	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2017 年 12 月 11 日）基金份额总额	201,179,360.77
本报告期期初基金份额总额	774,423,465.21
本报告期基金总申购份额	97,119,814.79
减：本报告期基金总赎回份额	468,676,222.23
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	402,867,057.77

注：上述份额变动包含人民币份额及美元份额的情况。

§10 重大事件揭示

10.1 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。

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

10.2.1 基金管理人的重大人事变动

自 2021 年 1 月 25 日起，成善栋先生不再担任公司董事长，由总经理覃波先生代任董事长。

自 2021 年 4 月 28 日起，刘元瑞先生担任公司董事长，总经理覃波先生不再代任董事长。

上述重大人事变动情况，本基金管理人均已在规定信息披露媒介发布相关公告。

10.2.2 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

本报告期本基金未更换会计师事务所。

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		应支付该券商的佣金		备注
		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	
BNP	-	-	-	-	-	-
BOCI SECURITIES LIMITED	-	-	-	-	-	-

CCB	-	98,705,306.40	98.75%	417,407.85	95.70%	-
CITIC	-	-	-	-	-	-
Citigroup Global Markets Inc.	-	-	-	-	-	-
CREDIT SUISSE	-	-	-	-	-	-
DBS BANK LIMITED HONG KONG BRANCH	-	-	-	-	-	-
Goldman Sachs Services Private Limited	-	-	-	6,255.55	1.43%	-
GUOTAI JUNAN SECURITIES (HONGKONG) LIMITED	-	-	-	-	-	-
Huatai	-	1,249,804.40	1.25%	12,498.04	2.87%	-
ICBC INTERNATIONAL H	-	-	-	-	-	-
JP Morgan	-	-	-	-	-	-
Morgan Stanley	-	-	-	-	-	-
NOMURA INTERNATIONAL	-	-	-	-	-	-
SC Lowy Financial (HK) Ltd	-	-	-	-	-	-
STANDARD CHARTERED BANK	-	-	-	-	-	-
UBS AG	-	-	-	-	-	-
ZHONGTAI INTERNATIONAL FINANCIAL PRODUCTS LIMITED	-	-	-	-	-	-
海通国际	-	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-

注：1、本期租用证券公司交易单元的变更情况

本报告期内本基金租用证券公司交易单元没有变更。

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》（证监基金字【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。

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		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
BNP	54,700,476.97	1.93%	-	-	-	-	-	-
BOCI SECURITIES LIMITED	23,983,199.20	0.84%	-	-	-	-	-	-
CCB	51,623,016.92	1.82%	-	-	-	-	-	-
CITIC	79,017,111.66	2.78%	-	-	-	-	-	-
Citigroup Global Markets Inc.	311,012,198.72	10.95%	-	-	-	-	-	-
CREDIT SUISSE	210,786,418.86	7.42%	-	-	-	-	-	-
DBS BANK LIMITED HONG KONG BRANCH	378,545,125.74	13.32%	-	-	-	-	-	-
Goldman Sachs Services Private Limited	204,703,808.63	7.20%	-	-	-	-	4,343,127.21	100.00%
GUOTAI JUNAN SECURITIES (HONGKONG) LIMITED	150,565,582.24	5.30%	-	-	-	-	-	-
Huatai	26,174,333.41	0.92%	-	-	-	-	-	-
ICBC INTERNATIONAL H	29,841,669.04	1.05%	-	-	-	-	-	-
JP Morgan	63,289,454.96	2.23%	-	-	-	-	-	-
Morgan Stanley	319,662,249.80	11.25%	-	-	-	-	-	-

NOMURA INTERNATIONAL	318,256,954.22	11.20%	-	-	-	-	-	-
SC Lowy Financial (HK) Ltd	46,887,208.10	1.65%	-	-	-	-	-	-
STANDARD CHARTERED BANK	88,051,686.16	3.10%	-	-	-	-	-	-
UBS AG	375,344,216.08	13.21%	-	-	-	-	-	-
ZHONGTAI INTERNATIONAL FINANCIAL PRODUCTS LIMITED	3,240,542.55	0.11%	-	-	-	-	-	-
海通国际	73,133,178.36	2.57%	-	-	-	-	-	-
长江证券	27,923.50	0.00%	-	-	-	-	-	-
中金公司	32,305,517.08	1.14%	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长信基金管理有限责任公司关于长信全球债券证券投资基金暂停申购、赎回、定期定额投资等业务的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021年1月14日
2	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金在天风证券股份有限公司开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021年1月14日
3	长信全球债券证券投资基金2020年第4季度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2021年1月22日
4	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金2020年第4季度报告提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021年1月22日
5	长信基金管理有限责任公司关于基金行业高级管理人员变更公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021年1月26日
6	长信基金管理有限责任公司关于旗下28只公募基金增加侧袋机制并相应修改法律文件的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021年3月2日
7	长信基金管理有限责任公司关于修订旗下28只公开募集证券投资基金基金合同和托管协议并更新招募说明书及产品资料概要的提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021年3月2日
8	长信全球债券证券投资基金更新的招募说明书及基金产品资料概要（更新）	中国证监会电子披露网站、公司网站	2021年3月2日
9	长信全球债券证券投资基金基金合同	中国证监会电子披露网	2021年3月2日

		站、公司网站	
10	长信全球债券证券投资基金托管协议	中国证监会电子披露网站、公司网站	2021 年 3 月 2 日
11	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金参加国金证券股份有限公司申购费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021 年 3 月 26 日
12	长信全球债券证券投资基金 2020 年年度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2021 年 3 月 30 日
13	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2020 年年度报告提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021 年 3 月 30 日
14	长信基金管理有限责任公司关于长信全球债券证券投资基金暂停申购、赎回、定期定额投资等业务的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021 年 3 月 31 日
15	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金参加中国银行股份有限公司申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021 年 3 月 31 日
16	长信全球债券证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2021 年 4 月 21 日
17	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2021 年第一季度报告提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021 年 4 月 21 日
18	长信全球债券证券投资基金更新的招募说明书（2021 年第【1】号）及基金产品资料概要（更新）	中国证监会电子披露网站、公司网站	2021 年 4 月 23 日
19	长信基金管理有限责任公司关于董事长变更公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021 年 4 月 30 日
20	长信基金管理有限责任公司关于长信全球债券证券投资基金暂停申购、赎回、定期定额投资等业务的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021 年 5 月 17 日
21	长信基金管理有限责任公司关于长信全球债券证券投资基金暂停申购、赎回、定期定额投资等业务的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021 年 5 月 27 日
22	长信基金管理有限责任公司公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021 年 6 月 22 日
23	长信基金管理有限责任公司关于长信全球债券证券投资基金暂停申购、赎回、定期定额投资等业务的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021 年 6 月 29 日

§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

注：本基金本报告期内未有单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

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 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立基金的文件；
- 2、《长信全球债券证券投资基金基金合同》；
- 3、《长信全球债券证券投资基金招募说明书》；
- 4、《长信全球债券证券投资基金托管协议》；
- 5、报告期内在指定报刊上披露的各种公告的原稿；
- 6、长信基金管理有限责任公司营业执照、公司章程及相关资格批复文件。

12.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

12.3 查阅方式

长信基金管理有限责任公司网站：

。

长信基金管理有限责任公司

2021 年 8 月 31 日