

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 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：中国光大银行股份有限公司

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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金基金合同规定，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 信息披露方式	7
2.5 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 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	15
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
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	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表	17
6.2 利润表	18
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	19

6.4 报表附注.....	20
§7 投资组合报告.....	48
7.1 期末基金资产组合情况.....	48
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	48
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	58
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.....	58
7.7 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.....	58
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.....	58
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.....	59
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	59
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	59
7.12 投资组合报告附注.....	59
§8 基金份额持有人信息.....	62
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	62
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	62
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.....	62
§9 开放式基金份额变动.....	63
§10 重大事件揭示.....	64
10.1 基金份额持有人大会决议.....	64
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.....	64
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	64
10.4 基金投资策略的改变.....	64
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	64
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.....	64
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	64
10.8 其他重大事件.....	65
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	68
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.....	68

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	68
§12 备查文件目录.....	69
12.1 备查文件目录.....	69
12.2 存放地点.....	69
12.3 查阅方式.....	69

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	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
基金简称	长信企业精选两年定开混合
基金主代码	005589
交易代码	005589
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年7月19日
基金管理人	长信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	631,806,096.26份
基金合同存续期	不定期

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，在严格控制基金资产风险的前提下，精选各个行业的优质企业进行投资，追求长期稳健的绝对回报。
投资策略	<p>本基金在封闭期与开放期采取不同的投资策略。</p> <p>1、封闭期投资策略</p> <p>(1) 资产配置策略</p> <p>(2) 股票投资策略</p> <p>(3) 债券投资策略</p> <p>(4) 其他类型资产投资策略</p> <p>2、开放期投资策略</p> <p>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比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种，减小基金净值的波动。</p>
业绩比较基准	中债综合指数收益率*30%+沪深300指数收益率*50%+恒生指数收益率*20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

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	中国光大银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周永刚	石立平
	联系电话	021-61009999	010-63639180
	电子邮箱	zhouygcxfund.com.cn	shiliping@cebbank.com

客户服务电话	4007005566	95595
传真	021-61009800	010-63639132
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区 银城中路 68 号 9 楼	北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中 心
办公地址	上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼	北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心
邮政编码	200120	100033
法定代表人	刘元瑞	李晓鹏

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
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、北京市西城区 太平桥大街 25 号中国光大中心 B 座 8 层

2.5 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	52,275,347.62
本期利润	44,384,901.02
加权平均基金份额本期利润	0.0703
本期加权平均净值利润率	6.26%
本期基金份额净值增长率	6.22%
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	34,413,355.41
期末可供分配基金份额利润	0.0545
期末基金资产净值	715,801,240.56
期末基金份额净值	1.1329
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	75.87%

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。

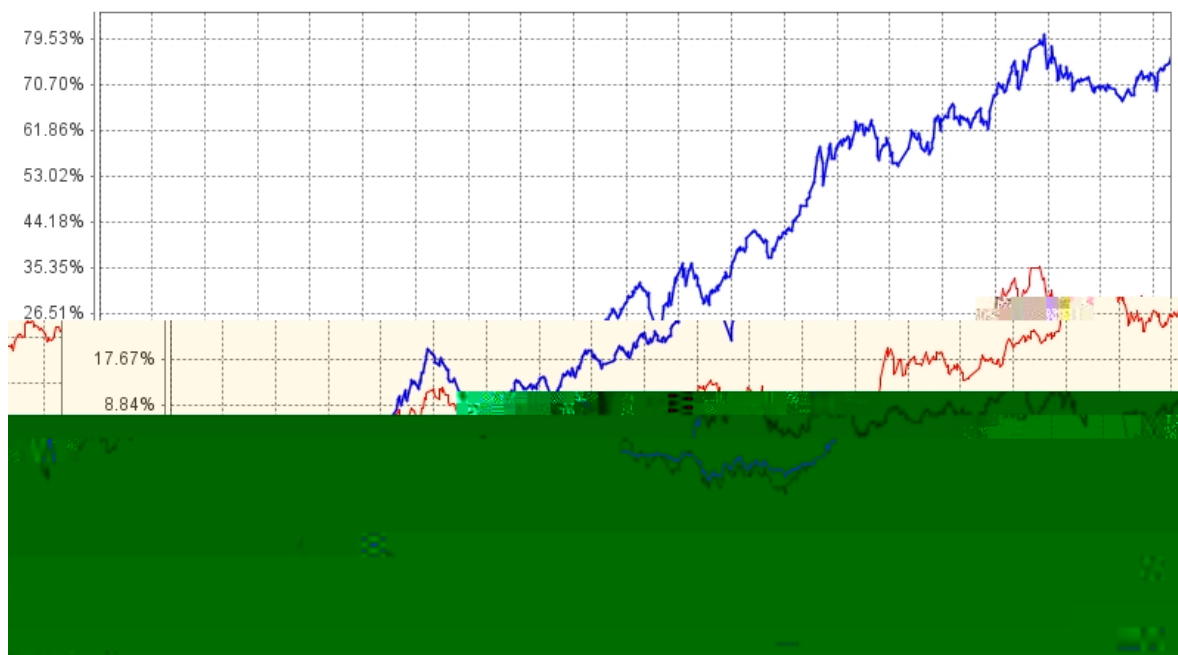
3.2 基金净值表现

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	1.87%	0.59%	-1.23%	0.51%	3.10%	0.08%
过去三个月	2.83%	0.47%	2.26%	0.61%	0.57%	-0.14%
过去六个月	6.22%	0.72%	1.75%	0.83%	4.47%	-0.11%
过去一年	18.61%	0.77%	16.40%	0.82%	2.21%	-0.05%
自基金合同生效起至今	75.87%	0.76%	27.79%	0.87%	48.08%	-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

长信企业精选两年定开混合基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、图示日期为 2018 年 7 月 19 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、长信长金通货币市场基金、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		
叶松	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、长信睿进灵活配置混合型证券投资基金和长信企业优选一年持有期灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、权益投资部总监	2018 年 7 月 19 日	-	14 年	经济学硕士，中南财经政法大学投资学专业研究生毕业。2007 年 7 月加入长信基金管理有限责任公司，担任行业研究员，从事行业和上市公司研究工作，曾任基金经理助理、长信新利灵活配置混合型证券投资基金、长信创新驱动股票型证券投资基金、长信内需成长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、长信多利灵活配置混合型证券投资基金、长信恒利优势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和长信增利动态策略混合型证券投资基金的基金经理、绝对收益部总监。现任权益投资部总监、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、长信睿进灵活配置混合型证券投资基金和长信企业优选一年持有期灵活配置混合型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 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

从全年市场的定位来看，二季度可能是全年中流动性最宽裕，风险偏好最高的阶段。从三季度开始，情况可能会有所变化。从海外来看，流动性的源头仍是美国。美国财政部一般存款余额在二季度迎来了最陡峭的下降阶段，往市场注入了巨量的流动性。而这个过程在三季度开始减缓甚至结束。

而从经济复苏的角度来看，随着疫苗的逐步覆盖，就业数据的进一步回升，三季度美联储开始讨论 Taper 的概率在持续提升。流动性的拐点若隐若现。从国内来看，二季度的流动性状况我们认为跟随的结果。在外部环境发生变化后，稳杠杆仍是较为确定的方向。

当然反复的疫情是一个重要的变量，我们可能要做好在很长一段时间内与其共存的准备。这也对经济的复苏进程产生影响，并改变部分行业的供需曲线，这里面挑战与机遇并存。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 6 月 30 日，长信企业精选两年定开混合份额净值为 1.1329 元，份额累计净值为 1.6129 元，本报告期内长信企业精选两年定开混合净值增长率为 6.22%，同期业绩比较基准收益率为 1.75%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从结构来看，估值提升仍有望往盈利驱动转换。从商品的角度看，流动性驱动的上半场可能接近尾声。但由于全球经济复苏的时滞，部分品种仍然存在基本面驱动的下半场。

我们更将倾向能源、化工、农产品。而从具备中长期 α 的成长赛道来看，流动性加上终局思维的广泛传播使得整体估值到达了较高的位置。未来可能会出现分化吗，我们需要在产业链环节上进行进一步甄选。而部分行业的中小市值龙头其成长的趋势以及空间都较为确定且估值的匹配度较为合适。如跨境物流、新能源运营，尾气处理等等。部分核心资产由于上半年的回落，估值的风险有所释放，且随着时间的推移，其性价比在逐渐显现，也是我们较为关注的。

4.6 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。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。

4.7 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，具体情况如下：长信企业精选两年定开混合：权益登记日 2021 年 2 月 3 日，除息日 2021 年 2 月 3 日，每 10 份基金份额分红 0.800 元，现金形式发放 47,446,130.72 元，再投资形式发放 2,893,303.86 元，利润分配合计 50,339,434.58 元。

本基金收益分配原则如下：

1、基金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；

4、每一基金份额享有同等分配权；

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，中国光大银行股份有限公司在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（以下称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实守信、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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，中国光大银行股份有限公司依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

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

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《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 2021 年中期报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确。

§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：长信企业精选两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金

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	74,887,417.43	214,636,913.43
结算备付金		2,040,607.20	1,865,357.16
存出保证金		587,835.93	1,776,194.61
交易性金融资产	6.4.6.2	353,947,013.47	490,897,143.87
其中：股票投资		319,545,813.47	421,326,043.87
基金投资		-	-
债券投资		34,401,200.00	69,571,100.00
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	280,000,000.00	-
应收证券清算款		5,429,265.10	16,446,396.28
应收利息	6.4.6.5	446,725.82	1,806,309.11
应收股利		123,464.01	108,624.64
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.6.6	-	-
资产总计		717,462,328.96	727,536,939.10
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		16,004.15	6,917,964.83
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		866,776.72	904,063.86
应付托管费		115,570.23	120,541.86
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.6.7	564,017.75	547,398.29
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.6.8	98,719.55	184,500.00
负债合计		1,661,088.40	8,674,468.84
所有者权益：			
实收基金	6.4.6.9	631,806,096.26	629,242,928.36
未分配利润	6.4.6.10	83,995,144.30	89,619,541.90
所有者权益合计		715,801,240.56	718,862,470.26
负债和所有者权益总计		717,462,328.96	727,536,939.10

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.1329 元，基金份额总额 631,806,096.26 份。

6.2 利润表

会计主体：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

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		53,256,240.40	34,383,628.62
1.利息收入		2,063,117.28	558,136.84
其中：存款利息收入	6.4.6.11	1,071,447.16	373,686.13
债券利息收入		676,496.98	151,349.35
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		315,173.14	33,101.36
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		59,083,569.72	37,933,561.02
其中：股票投资收益	6.4.6.12	55,899,758.10	37,100,945.49
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.6.13	32,050.00	-
资产支持证券投资收益	6.4.6.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.6.14	-	-
衍生工具收益	6.4.6.15	-	-
股利收益	6.4.6.16	3,151,761.62	832,615.53
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.6.17	-7,890,446.60	-4,108,069.24
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.6.18	-	-
减：二、费用		8,871,339.38	3,219,837.89

1. 管理人报酬	6.4.9.2.1	5,270,985.76	1,599,209.01
2. 托管费	6.4.9.2.2	702,798.08	213,227.89
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.6.19	2,794,335.99	1,308,893.39
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.6.20	103,219.55	98,507.60
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		44,384,901.02	31,163,790.73
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		44,384,901.02	31,163,790.73

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：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

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）	629,242,928.36	89,619,541.90	718,862,470.26
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	44,384,901.02	44,384,901.02
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）	2,563,167.90	330,135.96	2,893,303.86
其中：1.基金申购款	2,563,167.90	330,135.96	2,893,303.86
2.基金赎回款	-	-	-
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）	-	-50,339,434.58	-50,339,434.58
五、期末所有者权益（基金净值）	631,806,096.26	83,995,144.30	715,801,240.56

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)	202,191,609.83	21,169,156.32	223,360,766.15
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	31,163,790.73	31,163,790.73
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)	1,917,146.67	76,272.71	1,993,419.38
其中：1.基金申购款	1,917,146.67	76,272.71	1,993,419.38
2.基金赎回款	-	-	-
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)	-	-32,418,476.59	-32,418,476.59
五、期末所有者权益(基金净值)	204,108,756.50	19,990,743.17	224,099,499.67

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

长信企业精选两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金（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[2018]23号《关于准予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注册的批复》的核准，由长信基金管理有限责任公司作为管理人向社会公开募集，基金合同于2018年7月19日生效，首次设立募集规模为200,934,838.36份基金份额。本基金为契约型定期开放式，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，基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，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)、存托凭证、港股通标的股票、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)、同业存单、货币市场工具、权证、国债期货、股指期货、股票期权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)。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:本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 30%,投资于港股通标的股票的比例不高于股票资产的 50%,但在每次开放期前两个月、开放期及开放期结束后两个月的期间内,基金投资不受上述比例限制;持有全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%。在开放期内,本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货及股票期权合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值 5%的现金(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。在封闭期内,本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货及股票期权合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)。国债期货、股指期货、股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

本基金的业绩比较基准为:中债综合指数收益率*30%+沪深 300 指数收益率*50%+恒生指数收益率*20%。

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 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

6.4.5.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

6.4.5.2 增值税

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。

6.4.5.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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、营业税的单位和个人，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。

6.4.5.4 企业所得税

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》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，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、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

6.4.5.5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2015年9月8日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.5.6 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

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	74,887,417.43
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：	74,887,417.43

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	296,465,249.85	319,545,813.47	23,080,563.62
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	34,651,602.10	34,401,200.00
	银行间市场	-	-
	合计	34,651,602.10	34,401,200.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	331,116,851.95	353,947,013.47	22,830,161.52

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**

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	280,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	280,000,000.00	-

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	55,871.02
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	918.30

应收债券利息	313,228.49
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	76,443.51
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	264.50
合计	446,725.82

注：其他为应收存出保证金利息。

6.4.6.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

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	564,017.75
银行间市场应付交易费用	-
合计	564,017.75

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	-
应付证券出借违约金	-
预提账户维护费	4,500.00
预提审计费	34,712.18
预提信息披露费	59,507.37
合计	98,719.55

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	629,242,928.36	629,242,928.36
本期申购	2,563,167.90	2,563,167.90
本期赎回(以“-”号填列)	-	-

- 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	631,806,096.26	631,806,096.26

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	32,457,626.22	57,161,915.68	89,619,541.90
本期利润	52,275,347.62	-7,890,446.60	44,384,901.02
本期基金份额交易产生的变动数	19,816.15	310,319.81	330,135.96
其中：基金申购款	19,816.15	310,319.81	330,135.96
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-50,339,434.58	-	-50,339,434.58
本期末	34,413,355.41	49,581,788.89	83,995,144.30

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	1,031,079.90
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	32,195.47
其他	8,171.79
合计	1,071,447.16

注：其他为保证金利息收入。

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	1,166,478,218.39
减：卖出股票成本总额	1,110,578,460.29
买卖股票差价收入	55,899,758.10

6.4.6.13 债券投资收益

6.4.6.13.1 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	32,050.00
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	32,050.00

6.4.6.13.2 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	35,787,500.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	34,967,950.00
减：应收利息总额	787,500.00
买卖债券差价收入	32,050.00

6.4.6.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期无债券赎回差价收入。

6.4.6.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无债券申购差价收入。

6.4.6.13.5 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。

6.4.6.14 贵金属投资收益

6.4.6.14.1 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。

6.4.6.15 衍生工具收益

6.4.6.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无买卖权证差价收入。

6.4.6.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具其他投资收益。

6.4.6.16 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	3,151,761.62
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	3,151,761.62

6.4.6.17 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	-7,890,446.60
——股票投资	-7,688,496.60
——债券投资	-201,950.00
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
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	-7,890,446.60

6.4.6.18 其他收入

注：本基金本报告期无其他收入。

6.4.6.19 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	2,794,335.99
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-

赎回费	-
期货交易费用	-
合计	2,794,335.99

6.4.6.20 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	34,712.18
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	9,000.00
其他费用	-
合计	103,219.55

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

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

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
中国光大银行股份有限公司（以下简称“光大银行”）	基金托管人、基金销售机构
长江期货股份有限公司（以下简称“长江期货”）	基金管理人的股东的子公司

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

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。

6.4.9.1.3 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 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。

6.4.9.1.5 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	5,270,985.76	1,599,209.01
其中：支付销售机构的客户维护费	2,079,476.38	337,598.40

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的1.50%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	上年度可比期间
----	----	---------

	2021年1月1日至2021年6月30日	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	702,798.08	213,227.89

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。计算方法如下：

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

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：本基金本报告期末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

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年6月30日	2020年1月1日至2020年6月30日
基金合同生效日（2018年7月19日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	28,199,000.00
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-

报告期末持有的基金份额	-	28,199,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	13.82%

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。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2021年6月30日		上年度末 2020年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份 额 占基金总份 额 的比例	持有的 基金份额	持有的基金 份额 占基金总份 额 的比例
长江期货股份有 限公司	10,011,150.00	1.58%	10,011,150.00	1.59%

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金费率按本基金招募说明书公布的费率执行。

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
中国光大银 行股份有限 公司	74,887,417.43	1,031,079.90	34,375,014.52	360,802.48

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一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

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份 基金份额分红 数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2021 年 2 月 3 日	-	2021 年 2 月 3 日	0.800	47,446,130.72	2,893,303.86	50,339,434.58	
合计	-	-		0.800	47,446,130.72	2,893,303.86	50,339,434.58	

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
688083	中望 软件	2021 年 3 月 4 日	2021 年 9 月 13 日	新股 锁定	150.50	524.08	1,357	204,228.50	711,176.56	-
688076	诺泰 生物	2021 年 5 月 12 日	2021 年 11 月 22 日	新股 锁定	15.57	48.55	4,984	77,600.88	241,973.20	-
688687	凯因 科技	2021 年 1 月 29 日	2021 年 8 月 9 日	新股 锁定	18.98	27.98	5,354	101,618.92	149,804.92	-
688323	瑞华 泰	2021 年 4 月 21 日	2021 年 10 月 28 日	新股 锁定	5.97	22.78	4,513	26,942.61	102,806.14	-
300957	贝泰 妮	2021 年 3 月 18 日	2021 年 9 月 27 日	新股 锁定	47.33	251.96	388	18,364.04	97,760.48	-
688639	华恒 生物	2021 年 4 月 14 日	2021 年 10 月 22 日	新股 锁定	23.16	42.28	2,302	53,314.32	97,328.56	-
688621	阳光	2021	2021	新股	26.89	63.99	1,485	39,931.65	95,025.15	-

	诺和	年 6 月 11 日	年 12 月 21 日	锁定						
688499	利元亨	2021 年 6 月 23 日	2021 年 7 月 1 日	新股 流通 受限	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	-
301018	申菱环境	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 7 日	新股 流通 受限	8.29	8.29	7,811	64,753.19	64,753.19	-
300979	华利集团	2021 年 4 月 15 日	2021 年 10 月 26 日	新股 锁定	33.22	87.50	675	22,423.50	59,062.50	-
688087	英科再生	2021 年 6 月 30 日	2021 年 7 月 9 日	新股 流通 受限	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
688616	西力科技	2021 年 3 月 10 日	2021 年 9 月 22 日	新股 锁定	7.35	13.78	3,918	28,797.30	53,990.04	-
688195	腾景科技	2021 年 3 月 18 日	2021 年 9 月 27 日	新股 锁定	13.60	19.87	2,693	36,624.80	53,509.91	-
688685	迈信林	2021 年 4 月 30 日	2021 年 11 月 15 日	新股 锁定	9.02	19.50	2,612	23,560.24	50,934.00	-
301020	密封科技	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股 流通 受限	10.64	10.64	4,210	44,794.40	44,794.40	-
300973	立高食品	2021 年 4 月 8 日	2021 年 10 月 15 日	新股 锁定	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60	-
688565	力源科技	2021 年 5 月 6 日	2021 年 11 月 15 日	新股 锁定	9.39	14.00	2,464	23,136.96	34,496.00	-
300981	中红	2021	2021	新股	48.59	90.39	352	17,103.68	31,817.28	-

	医疗	年 4 月 19 日	年 10 月 27 日	锁定						
301021	英诺 激光	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股 流通 受限	9.46	9.46	2,899	27,424.54	27,424.54	-
300953	震裕 科技	2021 年 3 月 11 日	2021 年 9 月 22 日	新股 锁定	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	-
301009	可靠 股份	2021 年 6 月 8 日	2021 年 12 月 17 日	新股 锁定	12.54	27.89	801	10,044.54	22,339.89	-
301015	百洋 医药	2021 年 6 月 22 日	2021 年 12 月 30 日	新股 锁定	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
688226	威腾 电气	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 7 日	新股 流通 受限	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
300982	苏文 电能	2021 年 4 月 19 日	2021 年 10 月 27 日	新股 锁定	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300968	格林 精密	2021 年 4 月 6 日	2021 年 10 月 15 日	新股 锁定	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	-
300940	南极 光	2021 年 1 月 27 日	2021 年 8 月 3 日	新股 锁定	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-
300614	百川 畅银	2021 年 5 月 18 日	2021 年 11 月 25 日	新股 锁定	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300937	药易 购	2021 年 1 月 20 日	2021 年 7 月 27 日	新股 锁定	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
301013	利和	2021	2021	新股	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81	-

	兴	年 6 月 21 日	年 12 月 29 日	锁定						
300942	易瑞 生物	2021 年 2 月 2 日	2021 年 8 月 9 日	新股 锁定	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-
300933	中辰 股份	2021 年 1 月 15 日	2021 年 7 月 22 日	新股 锁定	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
300955	嘉亨 家化	2021 年 3 月 16 日	2021 年 9 月 24 日	新股 锁定	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300962	中金 辐照	2021 年 3 月 29 日	2021 年 10 月 11 日	新股 锁定	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300952	恒辉 安防	2021 年 3 月 3 日	2021 年 9 月 13 日	新股 锁定	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-
301016	雷尔 伟	2021 年 6 月 23 日	2021 年 12 月 30 日	新股 锁定	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
300966	共同 药业	2021 年 3 月 31 日	2021 年 10 月 11 日	新股 锁定	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300945	曼卡 龙	2021 年 2 月 3 日	2021 年 8 月 10 日	新股 锁定	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中 生态	2021 年 6 月 4 日	2021 年 8 月 25 日	新股 锁定- 送股	-	27.42	108	-	2,961.36	-
300948	冠中 生态	2021 年 2 月 18 日	2021 年 8 月 25 日	新股 锁定	13.00	27.42	216	2,808.00	5,922.72	-
300931	通用	2021	2021	新股	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-

	电梯	年 1 月 13 日	年 7 月 21 日	锁定						
300961	深水 海纳	2021 年 3 月 23 日	2021 年 9 月 30 日	新股 锁定	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300986	志特 新材	2021 年 4 月 21 日	2021 年 11 月 1 日	新股 锁定	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300987	川网 传媒	2021 年 4 月 28 日	2021 年 11 月 11 日	新股 锁定	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-
300978	东箭 科技	2021 年 4 月 15 日	2021 年 10 月 26 日	新股 锁定	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300926	博俊 科技	2020 年 12 月 29 日	2021 年 7 月 7 日	新股 锁定	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-
300993	玉马 遮阳	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 24 日	新股 锁定	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-
300927	江天 化学	2020 年 12 月 29 日	2021 年 7 月 7 日	新股 锁定	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
300975	商络 电子	2021 年 4 月 14 日	2021 年 10 月 21 日	新股 锁定	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300963	中洲 特材	2021 年 3 月 30 日	2021 年 10 月 11 日	新股 锁定	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-
301011	华立 科技	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 17 日	新股 锁定	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
300943	春晖	2021	2021	新股	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-

	智控	年 2 月 3 日	年 8 月 10 日	锁定							
300967	晓鸣 股份	2021 年 4 月 2 日	2021 年 10 月 13 日	新股 锁定	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-	
300929	华骐 环保	2021 年 1 月 12 日	2021 年 7 月 20 日	新股 锁定	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-	
300960	通业 科技	2021 年 3 月 22 日	2021 年 9 月 29 日	新股 锁定	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-	
300995	奇德 新材	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 26 日	新股 锁定	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-	
301007	德迈 仕	2021 年 6 月 4 日	2021 年 12 月 16 日	新股 锁定	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-	
300998	宁波 方正	2021 年 5 月 25 日	2021 年 12 月 2 日	新股 锁定	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-	
301012	扬电 科技	2021 年 6 月 15 日	2021 年 12 月 22 日	新股 锁定	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-	
301010	晶雪 节能	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 20 日	新股 锁定	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-	
002372	伟星 新材	2021 年 5 月 31 日	2021 年 12 月 1 日	大宗 交易	21.19	19.35	700,000	14,833,000.00	13,545,000.00	-	

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：本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.11.3.2 交易所市场债券正回购

注：本基金本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

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中国光大银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。

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%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并采用券款对付交割方式以控制相应的信用风险。

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	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	34,996,500.00
合计	0.00	34,996,500.00

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	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	34,401,200.00	34,574,600.00
合计	34,401,200.00	34,574,600.00

注：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。

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基金运作周期内的每个开放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。

针对定期开放运作可能导致的流动性风险，本基金主要通过根据开放前剩余期限长短情况动态调整投资组合进行应对；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	74,887,417.43	-	-	-	-	74,887,417.43
结算备付金	2,040,607.20	-	-	-	-	2,040,607.20
存出保证金	587,835.93	-	-	-	-	587,835.93
交易性金融 资产	-	34,401,200.00	-	-	319,545,813.47	353,947,013.47
买入返售金 融资产	280,000,000.00	-	-	-	-	280,000,000.00
应收证券清 算款	-	-	-	-	5,429,265.10	5,429,265.10
应收利息	-	-	-	-	446,725.82	446,725.82
应收股利	-	-	-	-	123,464.01	123,464.01
资产总计	357,515,860.56	34,401,200.00	-	-	325,545,268.40	717,462,328.96
负债						
应付证券清 算款	-	-	-	-	16,004.15	16,004.15
应付管理人 报酬	-	-	-	-	866,776.72	866,776.72
应付托管费	-	-	-	-	115,570.23	115,570.23
应付交易费 用	-	-	-	-	564,017.75	564,017.75
其他负债	-	-	-	-	98,719.55	98,719.55
负债总计	-	-	-	-	1,661,088.40	1,661,088.40
利率敏感度 缺口	357,515,860.56	34,401,200.00	-	-	323,884,180.00	715,801,240.56
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	214,636,913.43	-	-	-	-	214,636,913.43
结算备付金	1,865,357.16	-	-	-	-	1,865,357.16
存出保证金	1,776,194.61	-	-	-	-	1,776,194.61
交易性金融 资产	34,996,500.00	-	34,574,600.00	-	421,326,043.87	490,897,143.87
应收证券清 算款	-	-	-	-	16,446,396.28	16,446,396.28
应收利息	-	-	-	-	1,806,309.11	1,806,309.11
应收股利	-	-	-	-	108,624.64	108,624.64
资产总计	253,274,965.20	-	34,574,600.00	-	439,687,373.90	727,536,939.10

负债						
应付证券清算款		-	-	-	6,917,964.83	6,917,964.83
应付管理人报酬		-	-	-	904,063.86	904,063.86
应付托管费		-	-	-	120,541.86	120,541.86
应付交易费用		-	-	-	547,398.29	547,398.29
其他负债		-	-	-	184,500.00	184,500.00
负债总计		-	-	-	8,674,468.84	8,674,468.84
利率敏感度缺口	253,274,965.20		-34,574,600.00		431,012,905.06	718,862,470.26

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	69,996.81	114,511.13
	市场利率上升27个基点	-69,996.81	-114,511.13

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。本基金的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				
交易性金融资产	-	51,697,496.52	-	51,697,496.52
应收股利	-	123,464.01	-	123,464.01
资产合计	-	51,820,960.53	-	51,820,960.53
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	51,820,960.53	-	51,820,960.53
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				
交易性金融资产	-	127,411,267.41	-	127,411,267.41
应收股利	-	108,624.64	-	108,624.64
资产合计	-	127,519,892.05	-	127,519,892.05
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	127,519,892.05	-	127,519,892.05

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%，其他变量不变		
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）
	港币对人民币升值 5%	2,591,048.03	6,375,994.60
	港币对人民币贬值 5%	-2,591,048.03	-6,375,994.60

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	319,545,813.47	44.64	421,326,043.87	58.61
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	34,401,200.00	4.81	69,571,100.00	9.68
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	353,947,013.47	49.45	490,897,143.87	68.29

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 4.54%（2020 年 12 月 31 日 VaR 值为 3.53%）	-32,500,364.75	-25,364,437.93

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应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

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 303,526,491.98 元，属于第二层次的余额为人民币 34,693,169.08 元，属于第三层次的余额为人民币 15,727,352.41 元。

6.4.13.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于本基金投资的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、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，确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.13.1.2.3 第三层次公允价值计量的金融工具

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变动情况如下：

上年度末余额人民币 4,248,894.83 元，本期变动人民币 11,478,457.58 元，本期末余额人民币 15,727,352.41 元。

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	319,545,813.47	44.54
	其中：股票	319,545,813.47	44.54
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	34,401,200.00	4.79
	其中：债券	34,401,200.00	4.79
	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	280,000,000.00	39.03
	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	76,928,024.63	10.72
8	其他各项资产	6,587,290.86	0.92
9	合计	717,462,328.96	100.00

注：本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 51,697,496.52 元，占资产净值比例 7.22%。

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

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	135,879.60	0.02
B	采矿业	87,263.74	0.01
C	制造业	198,315,559.99	27.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	159,986.24	0.02
E	建筑业	196,154.94	0.03
F	批发和零售业	630,592.34	0.09
G	交通运输、仓储和邮政业	35,388,176.60	4.94
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,816,223.92	2.21
J	金融业	1,841,263.90	0.26
K	房地产业	10,095.90	0.00

L	租赁和商务服务业	65,464.36	0.01
M	科学研究和技术服务业	419,708.61	0.06
N	水利、环境和公共设施管理业	14,747,255.08	2.06
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	34,691.73	0.00
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	267,848,316.95	37.42

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
A 基础材料	-	-
B 消费者非必需品	-	-
C 消费者常用品	24,485,152.20	3.42
D 能源	-	-
E 金融	-	-
F 医疗保健	-	-
G 工业	-	-
H 信息技术	-	-
I 电信服务	27,212,344.32	3.80
J 公用事业	-	-
K 房地产	-	-
合计	51,697,496.52	7.22

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	00700	腾讯控股	56,000	27,212,344.32	3.80
2	603128	华贸物流	1,549,976	21,839,161.84	3.05
3	300316	晶盛机电	400,000	20,200,000.00	2.82
4	01458	周黑鸭	2,324,000	18,003,249.00	2.52
5	688116	天奈科技	150,000	17,700,000.00	2.47
6	600409	三友化工	1,750,000	17,692,500.00	2.47
7	603906	龙蟠科技	450,000	15,750,000.00	2.20
8	002156	通富微电	640,000	15,385,600.00	2.15
9	603517	绝味食品	180,000	15,172,200.00	2.12
10	002756	永兴材料	250,000	14,847,500.00	2.07

11	002415	海康威视	226,500	14,609,250.00	2.04
12	300816	艾可蓝	167,400	14,292,612.00	2.00
13	600570	恒生电子	150,000	13,987,500.00	1.95
14	002414	高德红外	500,000	13,790,000.00	1.93
15	002372	伟星新材	700,000	13,545,000.00	1.89
16	002352	顺丰控股	200,000	13,540,000.00	1.89
17	002675	东诚药业	600,000	12,642,000.00	1.77
18	688578	艾力斯	250,000	8,242,500.00	1.15
19	09633	农夫山泉	200,000	6,481,903.20	0.91
20	601995	中金公司	24,951	1,534,486.50	0.21
21	688063	派能科技	3,995	786,216.00	0.11
22	300979	华利集团	6,749	750,891.10	0.10
23	688083	中望软件	1,357	711,176.56	0.10
24	688680	海优新材	2,633	676,681.00	0.09
25	688617	惠泰医疗	1,673	637,396.27	0.09
26	688538	和辉光电	154,789	589,746.09	0.08
27	300973	立高食品	3,593	542,770.60	0.08
28	688626	翔宇医疗	3,652	441,307.68	0.06
29	688690	纳微科技	3,477	408,547.50	0.06
30	300981	中红医疗	3,516	388,906.32	0.05
31	688095	福昕软件	1,511	382,721.19	0.05
32	688383	新益昌	2,701	380,868.01	0.05
33	300896	爱美客	477	376,295.76	0.05
34	688276	百克生物	3,486	364,565.88	0.05
35	688819	天能股份	8,018	356,720.82	0.05
36	688161	威高骨科	3,069	325,467.45	0.05
37	688660	电气风电	36,311	319,536.80	0.04
38	688135	利扬芯片	5,658	318,998.04	0.04
39	688606	奥泰生物	2,095	312,155.00	0.04
40	300999	金龙鱼	3,589	304,921.44	0.04
41	688269	凯立新材	1,941	270,808.32	0.04
42	688317	之江生物	4,141	268,957.95	0.04
43	301009	可靠股份	8,007	265,037.97	0.04
44	300953	震裕科技	2,394	258,642.30	0.04
45	301015	百洋医药	4,614	251,115.78	0.04
46	688076	诺泰生物	4,984	241,973.20	0.03
47	688665	四方光电	1,687	229,685.05	0.03
48	688677	海泰新光	1,768	193,596.00	0.03
49	688093	世华科技	4,595	182,697.20	0.03

50	688315	诺禾致源	3,711	181,096.80	0.03
51	300968	格林精密	11,620	179,261.74	0.03
52	688609	九联科技	10,372	179,228.16	0.03
53	300614	百川畅银	3,283	176,700.30	0.02
54	300982	苏文电能	3,170	173,982.28	0.02
55	688513	苑东生物	3,847	173,307.35	0.02
56	688059	华锐精密	1,023	171,761.70	0.02
57	688345	博力威	2,332	171,518.60	0.02
58	301013	利和兴	4,704	168,966.51	0.02
59	688700	东威科技	3,049	162,755.62	0.02
60	688619	罗普特	5,856	161,040.00	0.02
61	688575	亚辉龙	3,435	152,514.00	0.02
62	688687	凯因科技	5,354	149,804.92	0.02
63	688625	呈和科技	2,672	142,764.96	0.02
64	688661	和林微纳	1,452	136,705.80	0.02
65	300940	南极光	3,068	136,458.26	0.02
66	300962	中金辐照	5,757	133,773.12	0.02
67	300937	药易购	2,434	133,599.04	0.02
68	688216	气派科技	2,000	133,400.00	0.02
69	688097	博众精工	3,983	132,235.60	0.02
70	300942	易瑞生物	4,428	131,028.71	0.02
71	600906	财达证券	7,597	128,237.36	0.02
72	688319	欧林生物	3,412	127,642.92	0.02
73	300966	共同药业	2,858	126,586.56	0.02
74	688682	霍莱沃	946	121,277.20	0.02
75	688689	银河微电	3,258	121,165.02	0.02
76	300933	中辰股份	11,117	117,462.18	0.02
77	300955	嘉亨家化	2,314	115,870.88	0.02
78	301016	雷尔伟	2,747	115,711.58	0.02
79	688314	康拓医疗	1,085	114,619.40	0.02
80	300987	川网传媒	3,004	113,378.69	0.02
81	688201	信安世纪	2,129	111,240.25	0.02
82	003035	南网能源	11,046	109,797.24	0.02
83	300978	东箭科技	5,930	105,678.53	0.01
84	300986	志特新材	2,632	103,429.84	0.01
85	688323	瑞华泰	4,513	102,806.14	0.01
86	688316	青云科技	1,428	102,102.00	0.01
87	688656	浩欧博	1,371	101,961.27	0.01
88	688329	艾隆科技	1,846	100,902.36	0.01

89	300993	玉马遮阳	4,097	99,899.55	0.01
90	300957	贝泰妮	388	97,760.48	0.01
91	688636	智明达	918	97,583.40	0.01
92	688639	华恒生物	2,302	97,328.56	0.01
93	688013	天臣医疗	3,022	96,401.80	0.01
94	300961	深水海纳	3,936	95,687.10	0.01
95	300952	恒辉安防	3,398	95,320.48	0.01
96	688621	阳光诺和	1,485	95,025.15	0.01
97	688662	富信科技	2,556	93,856.32	0.01
98	688628	优利德	2,789	93,292.05	0.01
99	300945	曼卡龙	4,731	92,939.73	0.01
100	300948	冠中生态	3,229	92,867.63	0.01
101	688533	上声电子	3,493	91,865.90	0.01
102	300931	通用电梯	6,713	89,880.14	0.01
103	300975	商络电子	4,917	88,140.51	0.01
104	688607	康众医疗	1,890	87,507.00	0.01
105	688468	科美诊断	3,919	87,432.89	0.01
106	688070	纵横股份	2,407	87,085.26	0.01
107	688633	星球石墨	1,558	87,045.46	0.01
108	688217	睿昂基因	1,040	86,736.00	0.01
109	300963	中洲特材	2,830	85,321.67	0.01
110	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.01
111	300967	晓鸣股份	5,061	81,674.88	0.01
112	601963	重庆银行	7,472	81,220.64	0.01
113	688117	圣诺生物	1,672	80,924.80	0.01
114	300926	博俊科技	3,584	80,854.80	0.01
115	301011	华立科技	1,750	79,474.50	0.01
116	688359	三孚新科	2,213	78,561.50	0.01
117	001203	大中矿业	3,809	76,751.35	0.01
118	688355	明志科技	2,710	72,384.10	0.01
119	688663	新风光	3,279	71,023.14	0.01
120	688191	智洋创新	3,203	69,184.80	0.01
121	688611	杭州柯林	1,400	68,726.00	0.01
122	300927	江天化学	2,163	65,631.72	0.01
123	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.01
124	688655	迅捷兴	3,083	62,893.20	0.01
125	688676	金盘科技	3,750	62,812.50	0.01
126	601665	齐鲁银行	6,731	62,598.30	0.01
127	688328	深科达	1,499	60,514.63	0.01

128	301007	德迈仕	3,022	60,305.15	0.01
129	300998	宁波方正	2,003	60,075.24	0.01
130	300943	春晖智控	2,542	59,955.10	0.01
131	603529	爱玛科技	1,019	59,224.28	0.01
132	688350	富淼科技	2,552	58,236.64	0.01
133	300995	奇德新材	1,909	57,368.52	0.01
134	300960	通业科技	2,332	57,006.84	0.01
135	301012	扬电科技	1,691	56,994.16	0.01
136	688683	莱尔科技	3,296	56,757.12	0.01
137	300929	华骐环保	1,827	54,892.05	0.01
138	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.01
139	688616	西力科技	3,918	53,990.04	0.01
140	688195	腾景科技	2,693	53,509.91	0.01
141	600916	中国黄金	3,371	52,317.92	0.01
142	688585	上纬新材	4,922	52,173.20	0.01
143	688685	迈信林	2,612	50,934.00	0.01
144	301010	晶雪节能	2,172	50,480.96	0.01
145	300910	瑞丰新材	474	49,556.70	0.01
146	601156	东航物流	2,090	49,470.30	0.01
147	688659	元琛科技	3,671	48,530.62	0.01
148	605337	李子园	788	46,886.00	0.01
149	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.01
150	688395	正弦电气	1,627	44,465.91	0.01
151	003026	中晶科技	461	43,384.71	0.01
152	003039	顺控发展	1,024	42,813.44	0.01
153	300894	火星人	628	42,704.00	0.01
154	688517	金冠电气	2,892	41,095.32	0.01
155	688067	爱威科技	1,259	39,520.01	0.01
156	688092	爱科科技	1,137	39,283.35	0.01
157	605339	南侨食品	864	37,307.52	0.01
158	688367	工大高科	1,717	37,035.69	0.01
159	600032	浙江新能	3,045	37,027.20	0.01
160	605090	九丰能源	1,090	35,326.90	0.00
161	688681	科汇股份	1,899	34,903.62	0.00
162	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
163	688565	力源科技	2,464	34,496.00	0.00
164	300887	谱尼测试	378	33,789.42	0.00
165	003040	楚天龙	1,101	33,470.40	0.00
166	300900	广联航空	879	32,857.02	0.00

167	605089	味知香	370	32,197.40	0.00
168	003031	中瓷电子	542	29,647.40	0.00
169	605077	华康股份	618	28,193.16	0.00
170	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
171	001201	东瑞股份	668	27,347.92	0.00
172	605296	神农集团	569	26,856.80	0.00
173	603324	盛剑环境	732	26,630.16	0.00
174	605080	浙江自然	374	23,487.20	0.00
175	603759	海天股份	1,119	22,939.50	0.00
176	605268	王力安防	1,642	22,659.60	0.00
177	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
178	003028	振邦智能	432	22,291.20	0.00
179	300911	亿田智能	309	21,407.52	0.00
180	601279	英利汽车	2,004	20,901.72	0.00
181	605389	长龄液压	356	20,890.08	0.00
182	001206	依依股份	321	20,389.92	0.00
183	300891	惠云钛业	1,143	19,876.77	0.00
184	605305	中际联合	368	19,364.16	0.00
185	605122	四方新材	703	18,770.10	0.00
186	003032	传智教育	586	18,429.70	0.00
187	603511	爱慕股份	553	18,249.00	0.00
188	300898	熊猫乳品	496	17,984.96	0.00
189	605208	永茂泰	801	17,485.83	0.00
190	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
191	605368	蓝天燃气	1,204	17,217.20	0.00
192	003029	吉大正元	716	17,069.44	0.00
193	300908	仲景食品	285	16,983.15	0.00
194	605179	一鸣食品	939	16,836.27	0.00
195	003037	三和管桩	1,274	16,765.84	0.00
196	300909	汇创达	386	16,636.60	0.00
197	300913	兆龙互连	630	16,506.00	0.00
198	605098	行动教育	289	16,262.03	0.00
199	605196	华通线缆	1,172	16,079.84	0.00
200	605300	佳禾食品	576	16,012.80	0.00
201	603836	海程邦达	733	15,994.06	0.00
202	300925	法本信息	600	15,774.00	0.00
203	300890	翔丰华	286	15,615.60	0.00
204	605016	百龙创园	445	14,222.20	0.00
205	605180	华生科技	384	14,208.00	0.00

206	605060	联德股份	883	13,933.74	0.00
207	605319	无锡振华	764	13,706.16	0.00
208	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
209	003030	祖名股份	480	13,516.80	0.00
210	605133	嵘泰股份	618	13,398.24	0.00
211	300902	国安达	551	12,981.56	0.00
212	300892	品渥食品	272	12,479.36	0.00
213	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
214	605286	同力日升	597	12,208.65	0.00
215	003036	泰坦股份	776	11,958.16	0.00
216	300889	爱克股份	479	11,639.70	0.00
217	300895	铜牛信息	339	11,529.39	0.00
218	605228	神通科技	1,217	11,464.14	0.00
219	300879	大叶股份	466	11,267.88	0.00
220	605303	园林股份	610	11,242.30	0.00
221	605488	福莱新材	416	11,103.04	0.00
222	300918	南山智尚	1,063	11,065.83	0.00
223	605289	罗曼股份	379	10,930.36	0.00
224	605055	迎丰股份	1,146	10,909.92	0.00
225	605086	龙高股份	443	10,512.39	0.00
226	003038	鑫铂股份	383	10,463.56	0.00
227	605005	合兴股份	634	10,321.52	0.00
228	605189	富春染织	423	10,190.07	0.00
229	300917	特发服务	365	10,095.90	0.00
230	300882	万胜智能	572	9,981.40	0.00
231	003041	真爱美家	349	9,876.70	0.00
232	003033	征和工业	301	9,538.69	0.00
233	300893	松原股份	414	9,240.48	0.00
234	001202	炬申股份	459	9,014.76	0.00
235	300881	盛德鑫泰	291	8,959.89	0.00
236	605298	必得科技	391	7,847.37	0.00
237	300886	华业香料	191	6,194.13	0.00
238	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600219	南山铝业	46,358,690.02	6.45
2	002078	太阳纸业	40,740,674.00	5.67
3	300566	激智科技	40,565,365.19	5.64
4	002081	金螳螂	35,814,462.00	4.98
5	600409	三友化工	33,370,491.39	4.64
6	002597	金禾实业	31,708,805.50	4.41
7	002372	伟星新材	30,197,805.00	4.20
8	603565	中谷物流	28,250,967.61	3.93
9	300791	仙乐健康	26,271,178.68	3.65
10	603128	华贸物流	24,004,001.18	3.34
11	603113	金能科技	21,560,604.25	3.00
12	601877	正泰电器	21,494,973.70	2.99
13	688023	安恒信息	21,230,093.79	2.95
14	601668	中国建筑	21,108,345.00	2.94
15	300316	晶盛机电	20,921,488.00	2.91
16	605117	德业股份	19,593,103.04	2.73
17	603517	绝味食品	19,298,427.00	2.68
18	601689	拓普集团	18,815,593.00	2.62
19	01458	周黑鸭	18,157,166.49	2.53
20	000596	古井贡酒	18,063,042.55	2.51
21	300054	鼎龙股份	17,411,553.00	2.42
22	688595	芯海科技	16,988,494.61	2.36
23	601128	常熟银行	16,122,953.00	2.24
24	603816	顾家家居	16,021,648.00	2.23
25	00883	中国海洋石油	15,573,151.15	2.17
26	002013	中航机电	15,564,553.26	2.17
27	600183	生益科技	15,037,921.42	2.09
28	01658	邮储银行	14,695,712.14	2.04
29	600570	恒生电子	14,594,608.58	2.03
30	603505	金石资源	14,502,437.56	2.02
31	002414	高德红外	14,427,546.80	2.01

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。

7.4.2 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002597	金禾实业	65,142,284.19	9.06
2	601877	正泰电器	48,974,487.70	6.81
3	300566	激智科技	48,967,968.67	6.81
4	600219	南山铝业	47,526,553.50	6.61
5	002078	太阳纸业	42,854,393.17	5.96
6	603565	中谷物流	40,287,432.97	5.60
7	01882	海天国际	38,357,331.39	5.34
8	603505	金石资源	37,663,148.84	5.24
9	601689	拓普集团	36,007,435.47	5.01
10	002081	金螳螂	32,395,603.00	4.51
11	605117	德业股份	31,193,816.91	4.34
12	300258	精锻科技	30,393,153.93	4.23
13	01999	敏华控股	28,348,821.95	3.94
14	00175	吉利汽车	28,047,817.46	3.90
15	688023	安恒信息	27,993,601.63	3.89
16	601021	春秋航空	24,265,292.78	3.38
17	688595	芯海科技	23,898,260.55	3.32
18	603113	金能科技	22,425,789.80	3.12
19	300791	仙乐健康	21,957,432.18	3.05
20	00916	龙源电力	20,462,843.81	2.85
21	002372	伟星新材	20,135,330.00	2.80
22	600497	驰宏锌锗	19,910,390.00	2.77
23	601668	中国建筑	19,636,800.00	2.73
24	000661	长春高新	17,085,066.00	2.38
25	300319	麦捷科技	16,381,467.00	2.28
26	600409	三友化工	16,184,478.00	2.25
27	603816	顾家家居	15,867,555.00	2.21
28	603096	新经典	15,823,824.00	2.20
29	002940	昂利康	15,799,734.91	2.20
30	000596	古井贡酒	15,768,949.00	2.19
31	300054	鼎龙股份	15,509,842.00	2.16
32	601636	旗滨集团	15,277,636.00	2.13
33	00883	中国海洋石油	14,933,244.48	2.08

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。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,016,486,726.49
卖出股票收入（成交）总额	1,166,478,218.39

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。

7.5 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	34,401,200.00	4.81
	其中：政策性金融债	34,401,200.00	4.81
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	34,401,200.00	4.81

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	018006	国开 1702	340,000	34,401,200.00	4.81

7.7 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。

7.8 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股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.11.3 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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中，发行主体国家开发银行于 2020 年 12 月 25 日收到中国银行保险监督管理委员会处罚决定书（银保监罚决字（2020）67 号），根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则，经查，国家开发银行：一、为违规的政府购买服务项目提供融资；二、项目资本金管理不到位，棚改贷款项目存在资本金违规抽回情况；三、违规变相发放土地储备贷款；四、设置不合理存款考核要求，以贷转存，虚增存款；五、贷款风险分类不准确；六、向资产管理公司以外的主体批量转让不良信贷资产；七、违规进行信贷资产拆分转让，隐匿信贷资产质量；八、向棚改业务代理结算行强制搭售低收益理财产品；九、扶贫贷款存贷挂钩；十、易地扶贫搬迁贷款“三查”不尽职，部分贷款资金未真正用于扶贫搬迁；十一、未落实同业业务交易对手名单制监管要求；十二、以贷款方式向金融租赁公司提供同业融资，未纳入同业借款业务管理；十三、以协定存款方式吸收同业存款，未纳入同业存款业

务管理；十四、风险隔离不到位，违规开展资金池理财业务；十五、未按规定向投资者充分披露理财产品投资非标准化债权资产情况；十六、逾期未整改，屡查屡犯，违规新增业务；十七、利用集团内部交易进行子公司间不良资产非洁净出表；十八、违规收取小微企业贷款承诺费；十九、收取财务顾问费质价不符；二十、利用银团贷款承诺费浮利分费；二十一、向检查组提供虚假整改说明材料；二十二、未如实提供信贷资产转让台账；二十三、案件信息迟报、瞒报；二十四、对以往监管检查中发现的国别风险管理问题整改不到位。综上，中国银行保险监督管理委员会决定对国家开发银行罚款 4880 万元。

对如上证券投资决策程序的说明：公司研究部门按照内部研究工作规范对该证券进行分析后将其列入基金投资对象备选库。在此基础上本基金的基金经理根据具体市场情况独立作出投资决策。该事件发生后，本基金管理人对该证券的发行主体进行了进一步了解与分析，认为此事件未对该证券投资价值判断产生重大的实质性影响。本基金投资于该证券的投资决策过程符合制度规定的投资权限范围与投资决策程序。

报告期内本基金投资的前十名证券中其余九名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。

7.12.2 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。

7.12.3 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	587,835.93
2	应收证券清算款	5,429,265.10
3	应收股利	123,464.01
4	应收利息	446,725.82
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,587,290.86

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 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

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
6,019	104,968.62	10,011,150.00	1.58%	621,794,946.26	98.42%

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	928,795.08	0.15%

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	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	50~100

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2018年7月19日）基金份额总额	200,934,838.36
本报告期期初基金份额总额	629,242,928.36
本报告期基金总申购份额	2,563,167.90
减：本报告期基金总赎回份额	-
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	631,806,096.26

§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		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	
兴业证券	1	997,405,226.46	45.86%	625,458.64	47.59%	-
东方证券	1	730,207,072.01	33.57%	406,294.64	30.92%	-
华西证券	1	447,444,170.80	20.57%	282,471.13	21.49%	-

广发证券	1	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---	---

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广发证券交易单元 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。

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	
	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
兴业证券	-	-	1,330,000,000.00	100.00%	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-

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
2	长信企业精选两年定期开放灵活配置混合型证	中国证监会电子	2021 年 1 月 22

	券投资基金 2020 年第 4 季度报告	披露网站、公司网站	日
3	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
4	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
5	长信基金管理有限责任公司关于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的分红公告	中证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021 年 2 月 1 日
6	长信基金管理有限责任公司关于增加中信建投证券股份有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、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 16 日
7	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
8	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 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
9	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
10	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
11	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 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
12	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
13	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
14	长信基金管理有限责任公司公告	上证报、中国证监	2021 年 6 月 22

		会电子披露网站、 公司网站	日
15	长信基金管理有限责任公司关于旗下 40 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 6 月 29 日
16	长信基金管理有限责任公司关于修订旗下公开募集证券投资基金法律文件并更新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 6 月 29 日
17	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 6 月 29 日
18	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基金合同	中国证监会电子 披露网站、公司网 站	2021 年 6 月 29 日
19	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托管协议	中国证监会电子 披露网站、公司网 站	2021 年 6 月 29 日
20	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 6 月 30 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、《长信企业精选两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《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招募说明书》；
- 4、《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