

# 长信富瑞两年定期开放债券型证券投资基金

## 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：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）根据本基金基金合同的规定，于 2021 年 8 月 26 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

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
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
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	16
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>17</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
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.....	17
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.....	17
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>18</b>
6.1 资产负债表.....	18
6.2 利润表.....	19
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	20

6.4 报表附注.....	21
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>41</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	41
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	41
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小 序的所有股票投资明细.....	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	41
7.5 期末按债券品 分类的债券投资组合.....	42
7.6 期末按 本占基金资产净值比例大小 序的前 债券投资明细.....	42
7.7 期末按 本占基金资产净值比例大小 的前 资产 持证券投资明细.....	42
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小 序的前 金 投资明细.....	42
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小 序的前 权证投资明细.....	43
7.10 报告期末本基金投资的 债期 交易情况说明.....	43
7.11 投资组合报告附注.....	43
<b>§8 基金份 持有人信息.....</b>	<b>45</b>
8.1 期末基金份 持有人 数及持有人 .....	45
8.2 期末基金管理人的 业人 持有本基金的情况.....	45
8.3 期末基金管理人的 业人 持有本开放式基金份 的情况.....	45
<b>开放式基金份 变动.....</b>	<b>46</b>
<b>§10 重大事 示.....</b>	<b>47</b>
10.1 基金份 持有人大会决 .....	47
10.2 基金管理人、基金托管人的专 基金托管 的重大人事变动.....	47
10.3 及基金管理人、基金财产、基金托管业务的 .....	47
10.4 基金投资策略的 变.....	47
10.5 基金 行审计的会计 事务所情况.....	47
10.6 管理人、托管人及其 管理人 或 等情况.....	47
10.7 基金 用证券公司交易 的有关情况.....	47
10.8 其他重大事 .....	48
<b>§11 投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>51</b>
11.1 报告期内 一投资者持有基金份 比例 或 过 20%的情况 .....	51
11.2 投资者决策的其他重要信息.....	51

<b>§12</b>	<b>目录</b> .....	<b>52</b>
12.1	目录.....	52
12.2	存放 .....	52
12.3	阅方式.....	52

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	长信富瑞两年定期开放债券型证券投资基金	
基金简称	长信富瑞两年定开债券	
基金主代码	00 18	
基金运作方式	型开放式	
基金合同生效日	201 年 月 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	
报告期末基金总份额	60 3 6 10 份	
基金合同存续期	不定期	
下属基金的基金简称：	长信富瑞两年定开债券 A	长信富瑞两年定开债券
下属基金的基金代码：	00 18	00 28
报告期末下属基金的总份额	83 862 8 3 份	21 0 8 2 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用持有期策略，基金资产配置于到期日（或期限）在到期之前的固定收益资产，实现基金资产的特定增值。
投资策略	本基金在到期前，债券、银行存单、债券等大类资产的市场行市组合。在到期前，本基金采用持有期策略投资组合，基本保持大类资产配置的比例稳定。本基金资产投资于到期日（或期限）在到期之前的债券类资产、债券和银行存单，基金资产在开放前完全变现。 开放期内，本基金组合原则上保持现金。基金管理人有效管理，保基金运作，流动性风险，开放期流动性的。
业绩比较基准	1 个时期的业绩比较基准 期起日的两年定期存款利率（ ）
风险收益	本基金债券型基金，其预期收益及预期风险水平于股票型基金和混合型基金，于市场基金。

### 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	021 6100	0 831 08
电话	00 00 66	
传真	021 6100 800	0 831 201
注册地	中（上）自由易 银中 68	市大 088 招商 银行大

公	上 市 新 银 中 68	市 大 088 招商 银行大
	200120	180 0
法定代表人	瑞	

## 2.4 信息披露方式

本基金 定的信息披露报 称	证 券 报
载基金中期报告 的管理人	
基金中期报告	上 市 新 银 中 68 、 市 大 088 招商银行大

## 2.5 其他相关资料

项 目	称	公
注 记	长信基金管理有限责任公司	上 市 新 银 中 68

### §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

基金 别	长信富瑞两年定开债券 A	长信富瑞两年定开债券
3 1 1 期 数据 和 指标	报 告 期 2021 年 1 月 1 日 至 2021 年 6 月 30 日	报 告 期 2021 年 1 月 1 日 至 2021 年 6 月 30 日
本 期 已 实 现 益	10 83 0 31	3 8 131
本 期 利 润	10 83 0 31	3 8 131
每 份 基 金 份 额 本 期 利 润	0 0180	0 0166
本 期 每 份 基 金 份 额 净 值 利 润	1 1	1
本 期 每 份 基 金 份 额 净 值 增 长	1 3	1 60
3 1 2 期 末 数 据 和 指 标	报 告 期 末 2021 年 6 月 30 日	
期 末 每 份 基 金 份 额 分 配 利 润	6 3 0 26	130 86
期 末 每 份 基 金 份 额 分 配 基 金 份 额 利 润	0 010	0 0061
期 末 基 金 资 产 净 值	0 210 3 1	21 21 602 3
期 末 每 份 基 金 份 额 净 值	1 010	1 0061
3 1 3 计 期 末 指 标	报 告 期 末 2021 年 6 月 30 日	
每 份 基 金 份 额 计 期 末 净 值 增 长	6 20	2

注：1、本期已实现 益指基金本期利息、投资 益、其他（不 公允价值变动 益）相关 用 的，本期利润 本期已实现 益 上本期公允价值变动 益。

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

3、期末 分配利润 期末资产负债表中未分配利润 未分配利润中已实现 分的 数。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份 净值 长 及其 同期业绩比 基准 益 的比

长信富瑞两年定开债券 A

	份 净值 长	份 净值 长 标 准	业绩比 基准 益	业绩比 基准 益 标准		
过 一个 月	0 6	0 0	0 26	0 01	0 30	0 03
过 三个 月	1 21	0 03	0 8	0 01	0 3	0 02
过 一个 年	1 3	0 02	1	0 01	0 18	0 01
过 一年	3 6	0 02	3 1	0 01	0 2	0 01
自基金合同	6 20	0 02	82	0 01	0 38	0 01

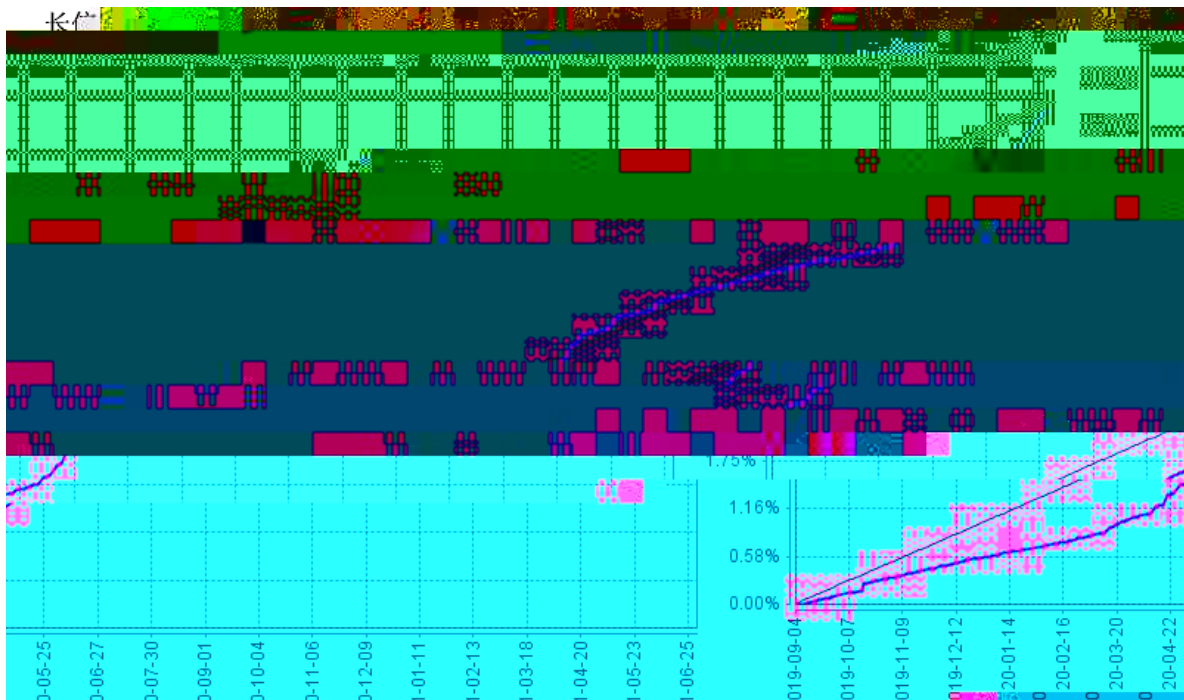
起至						
----	--	--	--	--	--	--

长信富瑞两年定开债券

	份 净值 长	份 净值 长 标 准	业绩比 基准 益	业绩比 基准 益 标准		
过 一个月	0 3	0 0	0 26	0 01	0 2	0 03
过 三个月	1 1	0 03	0 8	0 01	0 36	0 02
过 个月	1 60	0 02	1	0 01	0 0	0 01
过 一年	3 1	0 02	3 1	0 01	0 26	0 01
自基金合同 起至	2	0 02	82	0 01	0 10	0 01

3.2.2 自基金合同 以来基金份 计净值 长 变动及其 同期业绩比 基准 益 变动的比





注：1、 示日期 201 年 月 日至 2021 年 6 月 30 日。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同 之日起 6 个月内 期。 期 ，本基金的 项投资比例已 合基金合同 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

长信基金管理有限责任公司 经中 证 会证 基金字 2003 63 准，由长 证券股份有限公司、上 股份有限公司、 股份有限公司共同发起 立。注 资本 1 6 人 。目前股权 ：长 证券股份有限公司占 、上 股份有限公司占 31 21 、 有限公司占 1 1 、上 投资管理中 （有限合 ）占 、上 投资管理中 （有限合 ）占 。

至 2021 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 6 开放式基金， 长信利息 益开放式证券投资 投资基金、长信银利 合型证券投资基金、长信金利 势 合型证券投资基金、长信 利动 策略 合型证券投资基金、长信利 债券型证券投资基金、长信 利 势 合型证券投资基金、长信 合型证券投资基金、长信 标准 100 等权重指数 型证券投资基金、长信利 债券型证券投资基金 、长信内 长 合型证券投资基金、长信 债债券型证券投资 投资基金、长信利 债券型证券投资基金 、长信 债一年定期开放债券型证券投资基金、长信 债 债券型证券投资基金、长信 利 配 合型证券投资基金、长信 中小 股 票型证券投资基金、长信新利 配 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 配 合型证券投资基金、长信利 配 合型证券投资基金、长信 利 配 合型证券投资基金、长信 配 合型证券投资基金、长信 策略股票型证券投资 投资基金、长信 保 行业 配 合型证券投资基金（ ）、长信富 债一年定期开放债 券型证券投资基金、长信富 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 债一年定期开放债券型证券投资基金、长信富 债一年定期开放债券型证券投资 基金、长信利 配 合型证券投资基金、长信利发债券型证券投资基金、长信 信 息行业 配 合型证券投资基金、长信富平 债一年定期开放债券型证券投资基金、长 信 利半年定期开放 合型证券投资基金、长信 新 动股票型证券投资基金、长信 益 债债 券型证券投资基金、长信利信 配 合型证券投资基金、长信 债债券型证券投资基金、长信 配 合型证券投资基金、长信 债券型证券投资基金、长信 势 债 债债券型证券投资基金、长信中证 00 指数 型证券投资基金、长信长金 市场基金、长信 三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信 保行业 股票型证券投资基金、 长信利 一年定期开放 合型证券投资基金、长信 信 配 合型证券投资基金、长信

债券证券投资基金、长信 三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信 两年定期开放 配 合型证券投资基金、长信 行业 股票型证券投资基金、长信 业 两 年定期开放 配 合型证券投资基金、长信 价值 动 合型证券投资基金、长信价值 两年定期开放 配 合型证券投资基金、长信 三个月定期开放债券型发起式证券投资 基金、长信 资产配 合型基金中基金（ ）、长信价值 合型证券投资基金、长信利 债债券型证券投资基金、长信 300 指数 型证券投资基金、长信富 债半年定期开放 债券型证券投资基金、长信合利 合型证券投资基金、长信 利 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 平 目标三年持有期 合型基金中基金 （ ）、长信易 合型证券投资基金、长信中证 债及 交 债券 0 指数证券投资基金、长 信 合型证券投资基金、长信中债 1 3 年 策性金 债指数证券投资基金、长信 合型证券投资基金、长信 瑞 8 个月定期开放债券型证券投资基金、长信 利资产配 一年持有 期 合型基金中基金（ ）、长信 利 益 合型证券投资基金、长信 合型证券 投资基金、长信 业 一年持有期 配 合型证券投资基金、长信 6 个月持有期 合型证券投资基金、长信 业 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 理简介

	务	任本基金的基金经理( 理) 期限		证券 业年限	说明
		任 日期	任日期		
	长信利息 益开 放式证券投资基 金、长信易 合型证券投资基 金、长信 债债券型证券投 资基金、长信长 金 市场基 金、长信 三 个月定期开放债 券型发起式证券 投资基金、长信 富瑞两年定期开 放债券型证券投资 基金、长信中 债 1 3 年 策性金 债指数证券	201 年 月 16 日		11 年	管理 ， 业于上 交 大 ， 2010 年 月 长信基金管理有限 责任 公司， 任基金事务 基 金会计， 交易管理 债券 交易 、 交易主管， 债券 交易 、 、 长 信 三个月定期开放债 券型发起式证券投资 基金、 长信 债半年债券型证券 投资基金和长信 三 个月定期开放债券型发起 式证券投资基金的基金 经理。 现任现金理财 、 长 信利息 益开放式证券 投资基金、长信易 合型 证券投资基金、长信

	投资基金和长信瑞 8 个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理、现金理财			债债券型证券投资基金、长信长金 市场基金、长信 三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信富瑞两年定期开放债券型证券投资基金、长信中债 1 3 年 策性金债指数证券投资基金和长信 瑞 8 个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理。
	长信长金市场基金、长信富瑞两年定期开放债券型证券投资基金、长信 三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信易 合型证券投资基金和长信 势 债债券型证券投资基金的基金经理	2020 年 3 月 2 日	年	上 财经大 经济 , 有基金 业资 。 任 于 勤 会 计 事 务 所 ( 合 ), 201 年 6 月 长信基金管理有限责任公司, 任基金会计、债券交易 和基金经理 理, 现任长信长金 市场基金、长信富瑞两年定期开放债券型证券投资基金、长信 三 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信易 合型证券投资基金和长信 势 债债券型证券投资基金的基金经理。

注：1、 任基金经理任 日期以本基金 立之日 准 新 或变更基金经理的日期根据对 披露的公告日期

2、证券 业的 遵 证券业 业人 资 管理法 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， 遵守了 中 人 共和 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 基金份 持有人 利益，不存在 基金份 持有人利益的行 。

本基金 以 信于市场、 信于 会投资公 ，承诺 一 往 本 诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，在规 基金运作和 投资风险的前提下， 基 金份 持有人 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 度的 行情况

本报告期内，公司已实行公平交易 度，并 立公平交易 度 ，已 立投资决策 ，交易 行 的内 ，并 过 作 度、 程和 保证公平交易原则的实现。同 ，公司已 过对投资交易行 的 、分 估和信息披露来 对公平交易过程和 的 。

#### 4.3.2 交易行 的专项说明

本报告期内，完 按 有关指数的 比例 行投资的组合 ，其 投资组合未发 交易所公开 价同日 交易 交 的 交易 过 证券 日 交 的情形，未发现 交易行 。

### 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

2021 年上半年， 内 ，经济 动 年 复， 带动 内出 持 度。 业 长平 运行， 业投资 持 长， 产投资保持 性，基 投资表现则相对 。 月 会 用 长 小的 期，或 财 下了一定 。 方 ， 和上行， 则 以及 基数 在二 度 来 上行，预计二 度 年内 。 现 月下行 势， 动性有所 ，但信 对 上并不 ，实 经济中长期 的 。债市在 1 月末资金 益 大 上行， 小 市 来一 下行，上半年整 来 ， 年 债 年 3 1 附 上行至 3 3 重新 至 3 1 附 ， 1 年期 股存 年 2 附 上行至 3 2 重新 至 2 8 附 。 上半年中， 持 平，主要配 中 等 信用债，在风险 的情况下 组合 更 的 益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

至 2021 年 6 月 30 日，长信富瑞两年定开债券 A 份 净值 1 010 ，份 计净值 1 061 ，本报告期内长信富瑞两年定开债券 A 净值 长 1 3 长信富瑞两年定开债券 份 净值 1 0061 ，份 计净值 1 0 1 ，本报告期内长信富瑞两年定开债券 净值 长 1 60 ，同期业绩比 基准 益 1 。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2021 年下半年，更 复 ， 内经济 复不 不 ， 长 小 的 期或已关 ， 连 的 业 示经济 长动 未来有 放 的 ， 月 会 宏观 策 期 ， 的财 策要提 ， 的 策保持 动性 合理 。 月 的 准 示了 行提前对 策预 来应对未来 在经济放 的 准 作。下半年财 度发 ， 方债发行提 在 ， 资金 一定的 动，同 或于 三 度 出，以上 内债券 益 一 下行，在 有新 利 的大 下大 持 。中期来 ， 下行，经济复 放 ， ， 度利 ， 相对债市来说更 。

未来 持中 等 信用债投资比例， 个券 会， 投资者 更 的组 合 益。

#### 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 按 业会计准则、中 证 会相关规定和基金合同关于估值的 定，对 基金持有的投资品 行估值。基金托管人根据法律法规要 对基金管理公司 用的估值 策和 程序 行核 ， 并对估值 及净值计算 行复核。

根据相关法律法规，本基金管理人 了 、有 的估值 策和估值程序， 立了估值 会，估值 会 公司基金估值的主要决策 ，其主要 责 负责 定公司的估值 策、估 值方法及 用的估值程序和 ， 对公司现有程序和 行复核和审阅， 发 了 估值程 序和 的有 性及 用性的情况及 估值程序 估值 会 由基金事务 、投资、 、交易等相关业务 负责人以及基金事务 至 一 业务 共同组 ，相关 人 有 富的证券行业 作经 ， 相关法规和估值方法， 估值业务所 的专业 任 。 对于基金的估值 策和估值原则，公司已 基金托管人 分 ， 并 一 意见。审计本基金的 会计 事务所 公司基金估值 策和程序的 性。

本基金管理人已 中 债 记 算有限责任公司及中证指数有限公司签 务 ， 由其 按 定分别提 银行 同业市场及交易所交易的债券品 的估值数据以及 限股票的 。 估值 程 方不存在任 重大利益 。

#### 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 益分配原则以及基金实 运作情况，本基

金本报告期 行了一 利润分配， 情况 下：

长信富瑞两年定开债券 A：权益 记日 2021 年 6 月 23 日， 息日 2021 年 6 月 23 日， 10 份基金份额 分 0 10 ， 现金形式发放 2 00 12 ， 投资形式发放 0 ， 利润分配合计 2 00 12 。

长信富瑞两年定开债券 ：权益 记日 2021 年 6 月 23 日， 息日 2021 年 6 月 23 日， 10 份基金份额 分 0 10 ， 现金形式发放 1 101 133 33 ， 投资形式发放 0 ， 利润分配合计 1 101 133 33 。

本基金 益分配原则 下：

1、本基金在 合基金法定分 的前提下 行 益分配， 分 方 见基金管理人根据基金运作情况 不定期发 的相关分 公告，本基金 益分配比例不 于 分配利润的 30 ， 基金合同 不 3 个月 不 行 益分配

2、本基金 益分配方式：现金分

3、基金 益分配 类基金份额 净值不 于 值 基金 益分配基准日的 类基金份额 净值 类基金份额 益分配金 不 于 值

、由于本基金 A 类基金份额 不 务 ， 类基金份额 务 ， 类别基金份额 对应的 分配利润 有所不同。本基金同一类别的 一基金份额 有同等分配权

、法律法规或 管 关 有规定的， 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

。

## §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

招商银行 完 的公司 理 、内 核 度和风险 度， 行在 行托管 责中， 遵守有关法律法规、托管 的规定，尽 尽责 行托管 务并 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 定的投资 ，对托管产品的投资行 行 ， 并根据 管要 行报告 务。

招商银行按 托管 定的 一记 方法和会计 理原则，独立 、 录和保管本产 品的 ， 行会计核算和资产估值并 管理人 立对 。

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：长信富瑞两年定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

：人

资产	附注	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.6.1	1 33 0 3	1 336 6 0 20
算 金		3 12 0 2 38	12 82 30 0
存出保证金			8
交易性金融资产	6.4.6.2		
其中：股票投资			
基金投资			
债券投资			
资产 持证券投资			
金 投资			
金 资产	6.4.6.3		
金 资产	6.4.6.4		
应 证券 算			
应 利息	6.4.6.5	1 200 38 6	18 666 01 2
应 股利			
应			
所 资产			
其他资产	6.4.6.6	6 13 330 33	1 1 88 8
资产 计		86 801 666 62	1 180 20 3 8
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注</b>	<b>本期末 2021 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2020 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>			
期			
交易性金 负债			
金 负债	6.4.6.3		
出 金 资产		1 000 000 00	8 168 0
应 证券 算		1 8 8 3	120 103
应			
应 管理人报		126 26	18 18 8
应 托管		2 0	3 81 36
应 务		622	3 2
应 交易 用	6.4.6.7	8 8 1	1 0 3
应交		13 3	6 8 22

应 利息		0 1	1 03 1
应 利润			
所 负债			
其他负债	6.4.6.8	3 302 6	1 000 00
负债合计		1 86 12 0	8 2 133 2
<b>所有者权益：</b>			
实 基金	6.4.6.9	60 3 6 10	60 3 6 10
未分配利润	6.4.6.10	6 8 2 12	26 1 23 32
所有者权益合计		611 31 22	631 68 20 2
负债和所有者权益 计		86 801 666 62	1 180 20 3 8

注：1、报告 止日 2021 年 6 月 30 日，长信富瑞两年定开债券 A 份 净值 1 010 ，长信富瑞两年定开债券 份 净值 1 0061 ，基金份 60 3 6 10 份，其中长信富瑞两年定开债券 A 份 83 862 8 3 份 长信富瑞两年定开债券 份 21 0 8 2 份。

2、报表中其他资产 持有至 期投资。

## 6.2 利润表

会计主 ：长信富瑞两年定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

：人

项 目	附注	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度 比期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、		18 00 38 2	1 8 6 1
1.利息		18 00 38 2	1 8 6 1
其中：存 利息	6.4.6.11	3 60 1	61 00 1
债券利息		1 0 2 1 6	1 81 3
资产 持证券利息			
金 资产		11 661 0	
证券出 利息			
其他利息			
2.投资 益（ 以“-” ）			
其中：股票投资 益	6.4.6.12		
基金投资 益			
债券投资 益	6.4.6.13		
资产 持证券投资 益	6.4.6.13.5		
金 投资 益	6.4.6.14		
益	6.4.6.15		
股利 益	6.4.6.16		
3.公允价值变动 益（ 以	6.4.6.17		

“-” )			
4. 益 ( 以 “-” )			
5.其他 ( 以 “-” )	6.4.6.18		
：二、用		163 866 02	113 36 3
1 管理人报	6.4.9.2.1	1 101 2 1	1 06 8
2 托管	6.4.9.2.2	31 86 36	30 02 0
3 务	6.4.9.2.3	2 8	2 1 6 22
4 交易 用	6.4.6.19		
5 利息 出		33 1	61 8
其中：出 金 资产 出		33 1	61 8
6 金及附		0 6	60 31 6
7 其他 用	6.4.6.20	106 326 6	10 08 2
三、利润 ( 以 “ ” )		10 8 1 6 2 2	10 62 8 1
：所 用			
、净利润 (净 以 “ ” )		10 8 1 6 2 2	10 62 8 1

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主 ：长信富瑞两年定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

：人

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实 基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期 所有者权益 (基金净值)	60 3 6 10	26 1 23 32	631 68 20 2
二、本期经 动产 的基金净值变动数(本 期利润)		10 8 1 6 2 2	10 8 1 6 2 2
三、本期基金份 交易 产 的基金净值变动 数 (净值 以 “-” )			
其中：1.基金			

2 基金			
、本期 基金份 持 有人分配利润产 的 基金净值变动（净值 以“-”）		30 8 8 138	30 8 8 138
、期末所有者权益 （基金净值）	60 3 6 10	6 8 2 12	611 31 22
项目	上年度 比期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实 基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期 所有者权益 （基金净值）	60 3 6 10	3 8 231	60 31 28 8
二、本期经 动产 的基金净值变动数（本 期利润）		10 62 8 1	10 62 8 1
三、本期基金份 交易 产 的基金净值变动 数 （净值 以“-” ）			
其中：1.基金			
2 基金			
、本期 基金份 持 有人分配利润产 的 基金净值变动（净值 以“-”）			
、期末所有者权益 （基金净值）	60 3 6 10	1 1 016 88	620 1 13 8

报表附注 财务报表的组 分。

本报告 6 1 至 6 财务报表由下 负责人签 ：

瑞

基金管理人负责人

主管会计 作负责人

会计 负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

长信富瑞两年定期开放债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）， 经中 证券 管理

会（以下简称“中 证 会”）证 2018 311 关于准 长信富瑞三年定期开放债券型证券投资基金注 的 复 和 201 8 2 关于准 长信富瑞三年定期开放债券型证券投资基金变更注 的 复 的核准，由基金管理人长信基金管理有限责任公司 会公开发行募 ，基金合同于 201 年 月 日 式 ， 立募 规 60 3 6 10 份基金份额 。本基金 型定期开放式，存 期限不定。本基金的基金管理人和注 记 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。

本基金 基金份额 分 A 类基金份额 和 类基金份额 两 。本基金的 A 类基金份额 在投资者 用 不计提 务 ， 在 根据持有期限 类基金份额 在投资者 不 用 本类别基金资产中计提 务 ， 在 根据持有期限 。

本基金的投资 有 动性的金 ， 内 法发行上市的 债、 行票据、 金 债券、 业债券、公司债券、中期票据、 期 资券、 期 资券、公开发行的 债券、 方 债、资产 持证券、债券 、 银行存 （ 存 、 定期存 及其他银行存 ）、 同业存 、 市场 以及法律法规或中 证 会允 基金投资的其他金 。本基金不 行股票等权益类资产的投资， 不投资 债券、 交 债券，但 以投资 分 交易 债 的 债 分。 法律法规或 管 以 允 基金投资其他品 ，基金管理人在 行 程序 ， 以 其 投资 。

基金的投资组合比例 ：本基金对债券的投资比例不 于基金资产的 80 但在 开放期开 前 3 个月、 3 个月及开放期内，基金投资不 上述比例限 。在开放期内，本基金 个交易日日 应 保持不 于基金资产净值 的现金（不 算 金、存出保证金、应 等）或者 期日在一年以内的 债券， 期内不 上述比例限 。 法律法规或中 证 会变更投资品 的投资比例限 ，基金管理人在 行 程序 ， 以 整上述投资品 的投资比例。

本基金业绩比 基准 ： 个 期的业绩比 基准 期起 日的两年定期存 利 （ ） 1 。

## 6.4.2 会计报表的 基

本财务报表 按 财 的 业会计准则 基本准则 以及其 及 的 会 计准则、应用指 、 以及其他相关规定（以下 称“ 业会计准则”） ， 同 ，对于在 会计核算和信息披露方 ， 了中 证券投资基金业 会 并发 的 证券投资基金会

会计核算业务指 、中 证 会 定 的 中 证 券 管 理 会 关 于 证 券 投 资 基 金 估 值 业 务 的 指 导 意 见 、 公 开 募 证 券 投 资 基 金 信 息 披 露 管 理 法 、 证 券 投 资 基 金 信 息 披 露 内 容 式 准 则 第 2 年 度 报 告 的 内 容 式 、 证 券 投 资 基 金 信 息 披 露 报 告 规 则 第 3 会 计 报 表 附 注 的 及 披 露 、 证 券 投 资 基 金 信 息 披 露 第 3 年 度 报 告 和 中 期 报 告 及 其 他 中 证 会 及 中 证 券 投 资 基 金 业 会 的 相 关 规 定。

本财务报表以本基金持 经 基 报。

### 6.4.3 遵 业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的 合 业会计准则和中 证 会 发 的 关 于 基 金 行 业 实 务 作 的 有 关 规 定 的 要 ， 真 实 、 完 整 了 本 基 金 2021 年 6 月 30 日 的 财 务 况 以 及 2021 年 1 月 1 日 至 2021 年 6 月 30 日 止 期 的 经 和 基 金 净 值 变 动 情 况。

### 6.4.4 会 策和会计估计变更以及 更 的说明

#### 6.4.4.1 本 报 告 期 所 用 的 会 计 策、会 计 估 计 一 期 年 度 报 告 相 一 的 说 明

本 报 告 期 所 用 的 会 计 策、会 计 估 计 一 期 年 度 报 告 相 一 。

#### 6.4.4.2 更 的说明

本 基 金 在 本 报 告 期 说 明 的 重 大 会 计 更 。

### 6.4.5 项

#### 6.4.5.1 值

根 据 财 、 务 财 2016 36 关 于 开 业 值 的 的 规 定 ， 经 务 准 ， 自 2016 年 月 1 日 起 在 内 开 业 值 ， 金 业 ， 由 业 值 。 对 证 券 投 资 基 金 （ 式 证 券 投 资 基 金 ， 开 放 式 证 券 投 资 基 金 ） 管 理 人 运 用 基 金 股 票 、 债 券 的 值 债 、 方 债 利 息 以 及 金 同 业 往 来 利 息 值 存 利 息 不 值

根 据 财 、 务 财 2016 6 关 于 一 明 确 开 金 业 有 关 策 的 的 规 定 ， 金 开 展 的 式 金 商 品 业 务 及 持 有 策 性 金 债 券 的 利 息 于 金 同 业 往 来 利 息

根 据 财 、 务 财 2016 0 关 于 金 同 业 往 来 等 值 策 的

的规定，金开展的式金商品业务、同业存、同业存以及持有金债券的利息于金同业往来利息

根据财、务财 2016 1 0 关于明确金、产开发、务等值策的规定，本基金运过程中发的值应行，以本基金的基金管理人值人

根据财、务财 201 6 关于资管产品值有关的的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，本基金的基金管理人运本基金过程中发的值应行，用简易计方法，按 3 的 值。

#### 6.4.5.2 市、附、方附

根据中 人 共和 市 行 例（2011 年）、附的行规定（2011 年）及相关方附的规定，、值、业的和个人，应规定市、附（按相关规定事业附的）及方附。

#### 6.4.5.3 业所

根据财、务财 200 8 关于证券投资基金策的规定，自 200 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金股票、债券的价，业所

根据财、务财 2008 1 关于业所策的规定，对证券投资基金证券市场中，股票、债券的价，股权的股息、利，债券的利息及其他，不业所。

#### 6.4.5.4 个人所

根据财、务财 2008 132 财、务关于存利息所 有个人所策的规定，自 2008 年 10 月 日起，对存利息所个人所。

### 6.4.6 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.6.1 银行存

: 人

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
期存	1 33 0 3
定期存	
其中：存 期限 1 个月以内	
存 期限 1 3 个月	
存 期限 3 个月以上	
其他存	
合计：	1 33 0 3

#### 6.4.6.2 交易性金 资产

注：本基金本报告期末未持有交易性金 资产。

#### 6.4.6.3 金 资产/负债

注：本基金本报告期末未持有 金 资产 负债。

#### 6.4.6.4 金 资产

##### 6.4.6.4.1 项 金 资产期末

注：本基金本报告期末未持有 金 资产。

##### 6.4.6.4.2 期末 式 交易中 的债券

注：本基金本报告期末 式 交易中 的债券。

#### 6.4.6.5 应 利息

：人

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应 期存 利息	1 3 1
应 定期存 利息	
应 其他存 利息	
应 算 金利息	1 0 80
应 债券利息	1 1
应 资产 持证券利息	
应 证券利息	
应 利息	
应 金合 息	
应 出 证券利息	
其他	
合计	1 200 38 6

## 6.4.6.6 其他资产

：人

项目	本期末 2021年6月30日
其他应 用	
持有至 期投资	6 13 330 33
合计	6 13 330 33

注 持有至 期投资中，交易所市场 本 3 18 2 ， 价值 3 18 2

银行 市场 本 1 1 00 ， 价值 1 1 00 。

## 6.4.6.7 应 交易 用

：人

项目	本期末 2021年6月30日
交易所市场应 交易 用	
银行 市场应 交易 用	8 8 1
合计	8 8 1

## 6.4.6.8 其他负债

：人

项目	本期末 2021年6月30日
应 券商交易 保证金	
应	
应 证券出 金	
预提	000 00
预提审计	2 1
预提信息披露	0 3
合计	3 302 6

## 6.4.6.9 实 基金

金 ：人

长信富瑞两年定开债券 A		
项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份 (份)	金
上年度末	83 862 8 3	83 862 8 3
本期		
本期 (以"-")		

基金 分/份 算前		
基金 分/份 算变动份		
本期		
本期 (以"-")		
本期末	83 862 8 3	83 862 8 3

金 : 人

长信富瑞两年定开债券		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份 (份)	金
上年度末	21 0 8 2	21 0 8 2
本期		
本期 (以"-")		
基金 分/份 算前		
基金 分/份 算变动份		
本期		
本期 (以"-")		
本期末	21 0 8 2	21 0 8 2

注： 利 投、 份 ， 出份 。

## 6.4.6.10 未分配利润

: 人

长信富瑞两年定开债券 A			
项目	已实现 分	未实现 分	未分配利润合计
上年度末	2 6 0 2 0		2 6 0 2 0
本期利润	10 83 0 31		10 83 0 31
本期基金份额 交易 产的变动数			
其中：基金			
基金			
本期已分配利润	2 00 12		2 00 12
本期末	6 3 0 26		6 3 0 26

: 人

长信富瑞两年定开债券			
项目	已实现 分	未实现 分	未分配利润合计
上年度末	8 3 1 2		8 3 1 2
本期利润	3 8 131		3 8 131
本期基金份额 交易			

产的变动数			
其中：基金			
基金			
本期已分配利润	1 101 133 33		1 101 133 33
本期末	130 86		130 86

#### 6.4.6.11 存 利息

：人

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
期存 利息	1 81
定期存 利息	
其他存 利息	
算 金利息	061 01
其他	2 6
合计	3 60 1

注：其他 算保证金利息 、存出保证金利息 及 利息 。

#### 6.4.6.12 股票投资 益

注：本基金本报告期 股票投资 益。

#### 6.4.6.13 债券投资 益

##### 6.4.6.13.1 债券投资 益项目

注：本基金本报告期 债券投资 益。

##### 6.4.6.13.2 债券投资 益 债券 价

：人

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
出债券（、债 股及债券 期 ） 交	2 03 23 3
： 出债券（、债 股及债券 期 ） 本	00 000 00
： 应 利息	23 203 23 3
债券 价	

##### 6.4.6.13.3 债券投资 益 价

注：本基金本报告期 债券投资 益 价 。

**6.4.6.13.4 债券投资 益 价**

注：本基金本报告期 债券投资 益 价 。

**6.4.6.13.5 资产 持证券投资 益**

注：本基金本报告期 资产 持证券投资 益。

**6.4.6.14 金 投资 益****6.4.6.14.1 金 投资 益项目**

注：本基金本报告期 金 投资 益。

**6.4.6.15 益****6.4.6.15.1 益 权证 价**

注：本基金本报告期 权证 价 。

**6.4.6.15.2 益 其他投资 益**

注：本基金本报告期 其他 投资 益。

**6.4.6.16 股利 益**

注：本基金本报告期 股利 益。

**6.4.6.17 公允价值变动 益**

注：本基金本报告期 公允价值变动 益。

**6.4.6.18 其他**

注：本基金本报告期内 其他 。

**6.4.6.19 交易 用**

注：本基金本报告期 交易 用。

**6.4.6.20 其他 用**

：人

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
审计 用	2 1
信息披露	0 3
证券出 金	
	18 000 00
其他 用	02 00

合计	106 326 6
----	-----------

注：其他 用 银行 等。

## 6.4.7 或有事项、资产负债表日 事项的说明

### 6.4.7.1 或有事项

注： 至资产负债表日，本基金 要说明的重大或有事项。

### 6.4.7.2 资产负债表日 事项

根据 长信基金管理有限责任公司关于 整长信富瑞两年定期开放债券型证券投资基金管理和托管 并 基金合同等事 的公告，自 2021 年 月 20 日起，本基金的基金管理人报由 0 3 年 整 0 1 年，基金托管人的托管 由 0 10 年 整 0 0 年。

至本财务报告 准报出日， 上述事项，本基金 其他 要披露的资产负债表日 事项。

## 6.4.8 关 方关

### 6.4.8.1 本报告期存在 关 或其他重大利 关 的关 方发 变 的情况

本报告期存在 关 或其他重大利 关 的关 方 变。

### 6.4.8.2 本报告期 基金发 关 交易的 关 方

关 方 称	本基金的关
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 记、基金
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
长 证券股份有限公司（以下简称“长证券”）	基金管理人的股、基金

## 6.4.9 本报告期及上年度 比期 的关 方交易

### 6.4.9.1 过关 方交易 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 比期 未 过关 方交易 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 比期 未 过关 方交易 行债券交易。

### 6.4.9.1.3 债券 交易

金：人

关 方 称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度 比期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	交金	占 期债券 交 的比 例	交金	占 期债券 交 的比 例
长 证券	6 0 00 000 00	100 00	8 6 83 000 00	100 00

### 6.4.9.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度 比期 未 过关 方交易 行权证交易。

### 6.4.9.1.5 应 关 方的 金

注：本基金本报告期及上年度 比期 应 关 方交易 的 金。

## 6.4.9.2 关 方报

### 6.4.9.2.1 基金管理

：人

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度 比期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
期发 的基金应 的管理	1 101 2 1	1 06 8
其中: 的	1 21	2

注：基金管理 按前一日的基金资产净值的 0.3% 的年 计提。计算方法 下：

$$\text{基金管理 年 年 数}$$

$$\text{日应计提的基金管理}$$

$$\text{前一日的基金资产净值}$$

基金管理 日计提， 日 计至 月月末，按月 。

### 6.4.9.2.2 基金托管

：人

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度 比期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
----	--	--

期发的基金应 的托管	31 86 36	30 02 0
---------------	----------	---------

注：基金托管 按前一日基金资产净值的 0.10% 的年 计提。计算方法 下：

基金托管 年 年 数

日应计提的基金托管

前一日的基金资产净值

基金托管 日计提， 日 计至 月月末，按月 。

### 6.4.9.2.3 务

：人

务的 关方称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		
	期发的基金应的务		
	长信富瑞两年定开 债券A	长信富瑞两年定开 债券	合计
招商银行		10 01 61	10 01 61
长信基金			
合计		10 01 61	10 01 61
务的 关方称	上年度比期 2020年1月1日至2020年6月30日		
	期发的基金应的务		
	长信富瑞两年定开 债券A	长信富瑞两年定开 债券	合计
招商银行		30	30
长信基金			
合计		30	30

注：本基金 A 类基金份额 不 务， 类基金份额的 务年 0.2%。类基

金份的基金 务 按前一日 类基金资产净值的 0.2% 年 计提。计算方法 下：

类基金份额的 务年 年 数

类基金份额 日应计提的 务

类基金份额 前一日的基金资产净值

基金 务 日计提， 日 计至 月月末，按月 。

### 6.4.9.3 关方行银行 同业市场的债券( )交易

注：本基金本报告期及上年度 比期 未 关方 过银行 同业市场 行债券 ( ) 交易。

**6.4.9.4 报告期内 证券出借业务发生重大关联交易事项的说明****6.4.9.4.1 关联方通过定期报告方式披露的证券出借业务的情况**

注：本基金本报告期及上年度 比期 未 关 方 过 定 报 方 式 行 用 定 期 限 的 证 券 出 借 业 务。

**6.4.9.4.2 关联方通过定期报告方式披露的市场期限的证券出借业务的情况**

注：本基金本报告期及上年度 比期 未 关 方 过 定 报 方 式 行 用 市 场 期 限 的 证 券 出 借 业 务。

**6.4.9.5 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自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 比期 内 未 运 用 自 有 资 金 投 资 本 基 金。

**6.4.9.5.2 报告期末基金管理人及其他关联方投资本基金的情况**

注：基金管理人及其他关 方 在 本 报 告 期 末 及 上 年 度 末 未 投 资 本 基 金。

**6.4.9.6 由关联方保管的银行存款及 期产 的利息**

： 人

关 方 称	本 期		上 年 度 比 期	
	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	
	期 末	期 利 息	期 末	期 利 息
招商银行	1 33 0 3	1 81	1 2 2	2 08 60

注：本基金用于证券交易 算的资金 过本基金托管人的基金托管 算资金专用存 存于 中 证 券 记 算 有 限 责 任 公 司 ， 按 银 行 同 业 利 计 息 。 于 2021 年 6 月 30 日 的 相 关 在 资 产 负 债 表 中 的 “ 算 金 ” 目 中 独 示 （2020 年 6 月 30 日：同）。

**6.4.9.7 本基金在承 期内 关 方承 证券的情况**

注：本基金在本报告期及上一年度 比期 未 在 承 期 内 由 关 方 承 的 证 券。

**6.4.9.8 其他关 交易事项的说明**

注：本基金本报告期内及上年度 比期 其 他 关 交 易 事 项。

**6.4.10 利润分配情况**

## 长信富瑞两年定开债券 A

金 人

序	权益 记日	息日		10 份 基金份 分 数	现金形式 发放	投资形式 发放	本期利润分配 合计	注
		场内	场					
1	2021 年 6 月 23 日		2021 年 6 月 23 日	0 10	2 00 12		2 00 12	
合计				0 10	2 00 12		2 00 12	

## 长信富瑞两年定开债券

金 人

序	权益 记日	息日		10 份 基金份 分 数	现金形式 发放	投资形式 发放	本期利润分配 合计	注
		场内	场					
1	2021 年 6 月 23 日		2021 年 6 月 23 日	0 10	1 101 133 33		1 101 133 33	
合计				0 10	1 101 133 33		1 101 133 33	

**6.4.11 期末（2021 年 6 月 30 日）本基金持有的 限证券****6.4.11.1 新发/ 发证券 于期末持有的 限证券**

注：本基金本报告期末未 新发 发证券 持有 限证券。

**6.4.11.2 期末持有的 等 限股票**

注：本基金本报告期末未持有 等 限股票。

**6.4.11.3 期末债券 交易中作 的债券****6.4.11.3.1 银行 市场债券**

注：本基金本报告期末 银行 市场债券 交易 的债券。

**6.4.11.3.2 交易所市场债券**

至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，基金 事证券交易所债券 交易形 的 出  
 证券 1 000 000 00 ，于 2021 年 月 1 日 期。 类交易要 本基金在 期内持有

的证券交易所交易的债券或在新式下的债券，按证券交易所规定的比例计算标准券，不于债券交易的。

#### 6.4.11.4 期末 证券出 业务的证券

注：本基金本报告期末 证券出 业务的 出证券。

### 6.4.12 金 风险及管理

#### 6.4.12.1 风险管理 策和组

本基金在日常中 金 的风险，主要：信用风险、 动性风险和市场风险。

本基金在下 主要 述上述风险 及其形 原、风险管理目标、 策和过程以及计 风险的方法等。

本基金的基金管理人 事风险管理的目标 本基金在风险和 益之 的平，以实现“风险和 益相 配”的风险 益目标。基于 风险管理目标，本基金的基金管理人已 定了 策和程序来 别和分 风险，定 的风险限 并 计相应的内 程序，过 的管理及信息 持 上述 类风险。

本基金管理人 行 风险管理 理，立了以风险 会 核的、由 长、 核和相关业务 的风险管理。在董事会下 立风险 会，负责对公司经 管理和基金业务运作的合法性、合规性 行 的和 估等 在管理 立内 会，主要 责 审 公司内 度及 对公司在经 管理和投资组合运作中的风险 行 别、 估并 有的 在业务 作 风险管理 责主要由 核 负责 并 合作完 运作风险管理 作，略 产品 发 负责 行投资风险分 绩 估。 核 长负责，并 经理 报日 行 事务。

#### 6.4.12.2 信用风险

信用风险 指基金在交易过程中 交易对 未 行合 责任，或者基金所投资证券之发行人出现、 期本息，导 基金资产 和 益变 的风险。本基金的银行存 存放在本基金的托管人招商银行股份有限公司， 银行存 相关的信用风险不重大。

本基金的基金管理人 立了信用风险管理 程，本基金投资于 有 信用等 的证券， 过分 投资以分 信用风险。本基金投资于一 公司发行的证券市值不 过基金资产净值的 10%， 本基金 由本基金管理人管理的其他基金共同持有一 公司发行的证券，不 过 证券

的 10。

本基金在交易所 行的交易 中 证券 记 算有限责任公司完 证券交 和 项 算，  
风险发 的 性 小 本基金在 行银行 同业市场交易前 对交易对 行信用  
估并 用券 对 交 方式以 相应的信用风险。

#### 6.4.12.2.1 按 期信用 示的债券投资

：人

期信用	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
A-1	0 00	1 1 2 0
A-1 以下	0 00	0 00
未	1 0 0 2 16 62	0 0
合计	1 0 0 2 16 62	6 1 20

注：未 债券 债、 行票据、 策性金 债及 期 资券等 信用 债券。

#### 6.4.12.2.2 按 期信用 示的资产 持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末 按 期信用 示的资产 持证券投资。

#### 6.4.12.2.3 按 期信用 示的同业存 投资

：人

期信用	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	8 2 6 1 6	8 0 0 36
合计	8 2 6 1 6	8 0 0 36

注：本基金持有同业存 的主 AA 及以上。

#### 6.4.12.2.4 按长期信用 示的债券投资

：人

长期信用	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	33 268 0 2	06 20 3 8 0
AAA 以下	200 183 0 0	83 0 6 3 3
未	0 00	0 00
合计	3 1 62 0	8 28 31 3

注：未 债券 债、 行票据及 策性金 债等 信用 债券。

#### 6.4.12.2.5 按长期信用 示的资产 持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末 按长期信用 示的资产 持证券投资。

#### 6.4.12.2.6 按长期信用 示的同业存 投资

注：本基金本报告期末及上年度末 按长期信用 示的同业存 投资。

#### 6.4.12.3 动性风险

动性风险 指基金管理人未 以合理价 及 变现基金资产以 投资者 项的风险。本基金 动性风险来 于基金运作 期内的 个开放日 资金的 动性风险，以及 分 投资品 交易不 出现的变现风险和 投资 中 法在市场出现 动的情况下以合理 价 变现投资的风险。

##### 6.4.12.3.1 报告期内本基金组合资产的 动性风险分

本基金的基金管理人 按 公开募 证券投资基金运作管理 法 及 公开募 开放式 证券投资基金 动性风险管理规定 等有关法规的要 立 开放式基金 动性风险管理的内 ，审 估 类资产的 动性， 对性 定 动性风险管理 ，对本基金组合资产 的 动性风险 行管理。本基金 持组合管理、分 投资的原则开展投资 动，所持证券 在证 券交易所或银行 同业市场交易，并 遵守基金管理人 动性相关交易限 本期末本基金未 持有有重大 动性风险的投资品 。本基金 过 出 金 资产方式 期资金应对 动 性 。

对定期开放运作 导 的 动性风险，本基金主要 过根据开放前 期限长 情况动 整投资组合 行应对 对 资金的 动性风险，本基金的基金管理人在基金合同中 定了 ， 定了发 资金的 理 式， 开 放 式 产 的 动 性 风险。本基金的基金管理人对 动性指标 行持 的 和分 。

本基金本报告期末及上年度末 重大 动性风险。

#### 6.4.12.4 市场风险

市场风险 指基金所持金 的公允价值或未来现金 所 市场 类价 的变动 发 动的风险， 利 风险、 风险和其他价 风险。

##### 6.4.12.4.1 利 风险

利 风险 指金 的公允价值或现金 市场利 变动 发 动的风险。本基金的 息资产主要 银行存 、 算 金、存出保证金及其他资产等。

###### 6.4.12.4.1.1 利 风险

：人

本期末	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以	不计息	合计
-----	--------	----------	-------	------	-----	----

2021年6月30日				上		
资产						
银行存	1 33 0 3					1 33 0 3
算 金	3 12 0 2 38					3 12 0 2 38
交易性金 资 产						
应 利息					1 200 38 6	1 200 38 6
其他资产	6 13 330 33					6 13 330 33
资产 计	6 601 2 06				1 200 38 6	86 801 666 62
负债						
出 金 资产	1 000 000 00					1 000 000 00
应 证券 算					1 8 8 3	1 8 8 3
应 管理人报					126 26	126 26
应 托管					2 0	2 0
应 务					622	622
应 交易 用					8 8 1	8 8 1
应 利息					0 1	0 1
应交					13 3	13 3
其他负债					3 302 6	3 302 6
负债 计	1 000 000 00				86 12 0	1 86 12 0
利 度	601 2 06				16 330 6 16	611 31 22
上年度末 2020年12月 31日	6个月以内	6个月 1年	1 年	年以 上	不计息	合计
资产						
银行存	1 336 6 0 20					1 336 6 0 20
算 金	12 82 30 0					12 82 30 0
存出保证金	8					8
交易性金 资 产						
应 利息					18 666 01 2	18 666 01 2
其他资产	1 20 8	6 68 13 2				1 1 88 8
资产 计	6 3 0 3 8 83	6 68 13 2			18 666 01 2	1 180 20 3 8
负债						
出 金 资产	8 168 0					8 168 0

应 证 券 算					120 103	120 103
应 管 理 人 报					18 18 8	18 18 8
应 托 管					3 81 36	3 81 36
应 务					3 2	3 2
应 交 易 用					1 0 3	1 0 3
应 利 息					1 03 1	1 03 1
应 交					6 8 22	6 8 22
其 他 负 债					1 000 00	1 000 00
负 债 计	8 168 0				83 223 68	8 2 133 2
利 度	1 201 8 0	6 68 13 2			18 082 1 61	631 68 20 2

注：表中所示 本基金资产及交易形 负债的 价值，并按 合 规定的利 重新定价日或 期日 者 行了分类。

#### 6.4.12.4.1.2 利 风险的 性分

注：本基金于本报告期末持有债券 定利 持有至 期投资， 重大利 风险， 未 行 性分 。银行存 及 算 金之 动利 根据中 人 银行的基准利 和相关 的相关 策 动。

#### 6.4.12.4.2 风险

风险 指金 的公允价值或未来现金 变动 发 动的风险。本基 金的所有资产及负债以人 计价， 重大 风险。

#### 6.4.12.4.3 其他价 风险

其他价 风险 指基金所持金 的公允价值或未来现金 市场利 和 以 的市场价 变动 发 动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的债券和银行 同 业市场交易的 定 益品 ， 重大其他市场价 风险。

### 6.4.13 有 于理 和分 会计报表 要说明的其他事项

#### 1 公允价值

不以公允价值计 的金

不以公允价值计 的金 资产和负债主要 银行存 、 算 金、存出保证金、应 项、 出 金 资产 以及其他金 负债， 持有至 期金 资产 的其他金 资产 其

期限不长，公允价值与价值相。

本基金公允价值与公允价值小的金额之的类别金额的价值公允价值的比情况下：

交易所市场 本 3 18 2 ，公允价值 3 000 00 银行 市场  
 本 1 1 00 ，公允价值 21 000 00 合计 本 6 13 330 33  
 ，公允价值 66 000 00 。

以公允价值计 的金

本基金本报告期末及上年度末未持有以公允价值计 的金 。

## 2 承诺事项

至资产负债表日，本基金 要说明的承诺事项。

## 3 其他事项

至资产负债表日，本基金 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 人

序	项目	金	占基金 资产的比例 (%)
1	权益投资		
	其中：股票		
2	基金投资		
3	定 益投资	6 13 330 33	2
	其中：债券	6 13 330 33	2
	资产 持证券		
4	金 投资		
5	金 品投资		
6	金 资产		
	其中：式 的 金 资产		
7	银行存 和 算 金合计	63 6 3	0
8	其他 项资产	1 200 38 6	2 1
9	合计	86 801 666 62	100 00

注：本基金本报告期末未 过 股 交易 投资 股。本基金本报告期末未 证券出  
业务。本基金本报告期末未持有 中小 业股份 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 内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有股票。

#### 7.2.2 报告期末按行业分类的 股 投资股票投资组合

注：本基金本报告期末 过 股 交易 投资 股。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小 序的所有股票投资明细

注：本基金本报告期末未持有股票。

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 1 计 金 出期 基金资产净值 2 或前 20 的股票明细

注：本基金本报告期内未 股票。

## 2 计算出金 出期 基金资产净值 2 或前 20 的股票明细

注：本基金本报告期内未 出股票。

### 7.4.3 股票的本 及 出股票的

注：本基金本报告期内未投资股票。

## 7.5 期末按债券品 分类的债券投资组合

金 人

序	债券品	本	占基金资产净值比例（%）
1	债券		
2	行票据		
3	金 债券		
	其中： 策性金 债		
	业债券	3 18 2	6 1
	业 期 资券	1 0 0 2 16 62	22 8
6	中期票据	1 0 266 32 0	31 0
	债（交 债）		
8	同业存	8 2 6 1 6	1 6
	其他		
10	合计	6 13 330 33	12 0

## 7.6 期末按 本占基金资产净值比例大小 序的前 债券投资明细

金 人

序	债券代	债券 称	数（%）	本	占基金资产净值比例（%）
1	136612	16 不动产	600 000	88 8 8	80
2	11218161	21 商业 银行 0	600 000	33 1 1	6
3	1122 3	1 金 01	0 000	116 1	01
	012101081	21 交运 001	00 000	0 08 8 8 1	8 1
	112 32	16 中 02	00 000	0 0 0 01 1	8 18

## 7.7 期末按 本占基金资产净值比例大小 的前 资产 持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产 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 序的前 金 投资明细

注：本基金本报告期末未持有 金 。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小 序的前 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 债期 交易情况说明

### 7.10.1 本期 债期 投资 策

注：本基金本报告期末未投资 债期 。

### 7.10.2 报告期末本基金投资的 债期 持 和 益明细

注：本基金本报告期末未投资 债期 。

### 7.10.3 本期 债期 投资 价

注：本基金本报告期末未投资 债期 。

## 7.11 投资组合报告附注

### 7.11.1 本基金投资的前 证券的发行主 本期 以及 的情况的说明

报告期内本基金投资的前 证券中,发行主 商业银行股份有限公司于 2021 年 月 1 日 中 银保 会 管 行 决定书 ( 银保 决字 2021 1 ), 根据 中 人 共和 银行业 管理法 第二 一 第三 、第 第 项, 中 人 共和 商业 银行法 第三 、 个人 管理 行 法 第 二 、第 三 、第三 、第三 , 中 银 会 公 关于 信 管理 规放 的 第二 , 商业银行内 指 第 三 、第一 三 , 商业银行内 指 第 、第 的相关规定, 经 , 商业银行股份有限公司存在 业务 重 审 经 规则。 上, 中 银保 会 管 公司 人 0 。

对 上证券投资决策程序的说明: 公司 按 内 作规 对 证券 行分 其 基金投资对 。在 基 上本基金的基金经理根据 市场情况独立作出投资决策。 事 发 , 本基金管理人对 证券的发行主 行 了 一 了 分 , 事 未 对 证券投资价值 产 重大的实 性 。本基金投资于 证券的投资决策过程 合 度规 定的投资权限 投资决策程序。

报告期内本基金投资的前 证券中其 的发行主 未出现 管 立 或在报 告 日前一年内 公开 责、 的情形。

### 7.11.2 基金投资的前 股票 出基金合同规定的 股票 情况的说明

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

情形。

### 7.11.3 期末其他 项资产

：人

序	称	金
1	存出保证金	
2	应 证券 算	
3	应 股利	
4	应 利息	1 200 38 6
5	应	
6	其他应	
7	用	
8	其他	
9	合计	1 200 38 6

### 7.11.4 期末持有的 于 股期的 债券明细

注：本基金本报告期末未持有 于 股期的 债券。

### 7.11.5 期末前 股票中存在 限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有股票。

### 7.11.6 投资组合报告附注的其他 字 述 分

注：由于 的原 ，分项之和 合计项 存在 。

## §8 基金份额 持有人信息

### 8.1 期末基金份额 持有人 数及持有人

份 : 份

份 别	持有人 数( )	持有的基 金份	持有人			
			投资者		个人投资者	
			持有份	占 份 比 例	持有份	占 份 比 例
长信富瑞 两年定开 债券 A	1	0 603 0	80 28	3	3 00 0	0 61
长信富瑞 两年定开 债券	3	61 86 1	0 00	0 00	21 0 8 2	100 00
合计	3	1 228 100 81	80 28	8	2 168 2 2 66	16

注：对下 分 基金，比例的分 用 自 别的份 ，对合计数，比例的分 用下 分 基 金份 的合计数（ 期末基金份 ）。

### 8.2 期末基金管理人的 业人 持有本基金的情况

项目	份 别	持有份 数(份)	占基金 份 比例
基金管理人所有 业人 持有本基金	长信富瑞两年定开债券 A	0 00	0 00
	长信富瑞两年定开债券	0 00	0 00
	合计	0 00	0 00

注：对下 分 基金，比例的分 用 自 别的份 ，对合计数，比例的分 用下 分 基 金份 的合计数（ 期末基金份 ）。

### 8.3 期末基金管理人的 业人 持有本开放式基金份 的情况

项目	份 别	持有基金份 的数 (份)
本公司 管理人 、基金 投资和 负责人持 有本开放式基金	长信富瑞两年定开债券 A	0
	长信富瑞两年定开债券	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开 放式基金	长信富瑞两年定开债券 A	0
	长信富瑞两年定开债券	0
	合计	0

## 开放式基金份额 变动

：份

项目	长信富瑞两年定开债券 A	长信富瑞两年定开债券
基金合同 日（201 年 月 日）基金份	83 862 8 3	21 0 8 2
本报告期期 基金份	83 862 8 3	21 0 8 2
本报告期基金 份		
本报告期基金 份		
本报告期基金 分变动份 （份 以 ）		
本报告期期末基金份	83 862 8 3	21 0 8 2

## §10 重大事 示

### 10.1 基金份 持有人大会决

报告期内本基金未 开基金份 持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专 基金托管 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 2 日起, 不 担任公司董事长, 由 经理 代任董事长。

自 2021 年 月 28 日起, 瑞 担任公司董事长, 经理 不 代任董事长。

上述重大人事变动情况, 本基金管理人 已在规定信息披露 介发 相关公告。

#### 10 2 2 基金托管人的专 基金托管 的重大人事变动

本报告期基金托管人的专 基金托管 未发 重大人事变动。

### 10.3 及基金管理人、基金财产、基金托管业务的

本报告期 及基金管理人、基金财产、基金托管业务的 。

### 10.4 基金投资策略的 变

本报告期本基金投资策略未 变。

### 10.5 基金 行审计的会计 事务所情况

本报告期本基金未 会计 事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其 管理人 或 等情况

本报告期本基金管理人、托管人及其 管理人 有 管 或 的情形。

### 10.7 基金 用证券公司交易 的有关情况

#### 10.7.1 基金 用证券公司交易 行股票投资及 金 情况

金 : 人

券商 称	交易 数	股票交易		应 券商的 金		注
		交金	占 期股票 交 的比例	金	占 期 金的 比例	
长 证券	2					
信证券	1					
开 证券	1					

注：1、本期 用证券公司交易 的变更情况

本报告期内本基金 用 信证券交易 1 个、开 证券交易 1 个。

2、专用交易 的 标准和程序

根据中 证 会 关于 证券投资基金 管有关 的 （证 基字 1 8 2 ）和 关于完 证券投资基金交易 度有关 的 （证 基金字 200 8 ）的有关 规定，本公司 定了 用证券公司专用交易 的 标准和程序。

（1） 标准：

- 1) 券商基本 价（财务 况、经 况）
- 2) 券商 价（报告 、及 性和数 ）
- 3) 券商 日信息 价（及 性和有 性）
- ）券商 作表现 价。

（2） 程序：

根据 用证券公司专用交易 的 标准形 券商 务 价表 ， 根据 分 行 基金专用交易 。

## 10.7.2 基金 用证券公司交易 行其他证券投资的情况

金 人

券商 称	债券交易		债券 交易		权证交易	
	交金	占 期债券 交 的比例	交金	占 期债券 交 的比例	交金	占 期权 证 交 的比例
长 证券			6 0 00 000 00	100 00		
信证券						
开 证券						

## 10.8 其他重大事

序	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 下 分开放式基金在 风证券股份有限公司开 、定期定 投资业务及 （定投 ） 动的公告	上证报、中 证 会 披露 、 公司	2021 年 1 月 1 日
2	长信富瑞两年定期开放债券型证券投资基金 2020 年第 度报告	中 证 会 披露 、公司	2021 年 1 月 22 日
3	长信基金管理有限责任公司 下 基金	上证报、中证报、	2021 年 1 月 22

	2020 年 度报告提示性公告	证券报、证券日报、中证会披露、公司	日
	长信基金管理有限责任公司关于基金行业管理人变更公告	上证报、中证会披露、公司	2021 年 1 月 26 日
	长信基金管理有限责任公司关于 下 28 公募基金 并相应 法律 的公告	上证报、中证报、证券报、证券日报、中证会披露、公司	2021 年 3 月 2 日
6	长信基金管理有限责任公司关于 下 28 公开募 证券投资基金基金合同和托管 并更新招募说明书及产品资料 要的提示性公告	上证报、中证报、证券报、证券日报、中证会披露、公司	2021 年 3 月 2 日
	长信富瑞两年定期开放债券型证券投资基金更新的招募说明书及基金产品资料 要（更新）	中证会披露、公司	2021 年 3 月 2 日
8	长信富瑞两年定期开放债券型证券投资基金基金合同	中证会披露、公司	2021 年 3 月 2 日
	长信富瑞两年定期开放债券型证券投资基金托管	中证会披露、公司	2021 年 3 月 2 日
10	长信基金管理有限责任公司关于 中信 投证券股份有限公司 下 分开放式基金代 并开 、定期定 投资业务及 （定投 ） 动的公告	上证报、中证报、证券报、证券日报、中证会披露、公司	2021 年 3 月 16 日
11	长信基金管理有限责任公司关于 下 分开放式基金 金证券股份有限公司 动的公告	上证报、中证会披露、公司	2021 年 3 月 26 日
12	长信富瑞两年定期开放债券型证券投资基金 2020 年年度报告	中证会披露、公司	2021 年 3 月 30 日
13	长信基金管理有限责任公司 下 基金 2020 年年度报告提示性公告	上证报、中证报、证券报、证券日报、中证会披露、公司	2021 年 3 月 30 日
1	长信基金管理有限责任公司关于 下 分开放式基金 中 银行股份有限公司	上证报、中证会披露、	2021 年 3 月 31 日

	（ 定投 ） 动的公告	公司	
1	长信富瑞两年定期开放债券型证券投资基金 2021 年第 1 度报告	中 证 会 披露 、公司	2021 年 月 21 日
16	长信基金管理有限责任公司 下 基金 2021 年第一 度报告提示性公告	上证报、中证报、 证券 报、证券日 报、中 证 会 披露 、公司	2021 年 月 21 日
1	长信富瑞两年定期开放债券型证券投资基金 更新的招募说明书（2021 年第 1 ）及 基金产品资料 要（更新）	中 证 会 披露 、公司	2021 年 月 23 日
18	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 证 会 披露 、 公司	2021 年 月 30 日
1	长信基金管理有限责任公司关于长信富瑞两 年定期开放债券型证券投资基金的分 公告	证券 报、中 证 会 披露 、公司	2021 年 6 月 21 日
20	长信基金管理有限责任公司公告	上证报、中 证 会 披露 、 公司	2021 年 6 月 22 日

## §11 投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内 一投资者持有基金份额 比例 或 过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额 变 情况					报告期末持有基金情况	
	序	持有基金份额 或者 过 20 的	期 份	份	份	持有份	份 占比
	1	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	180 0 3 000 00	0 00	0 00	180 0 3 000 00	2
	2	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	300 182 333 33	0 00	0 00	300 182 333 33	8
个人							
产品 有风险							
<p>1、基金净值大 动的风险 一持有基金比例过 的投资者连 大 ， 会 基金投资的持 性和 定性， 变现 本。同 ， 按 净值计算 理规则 起基金份 净值 上 或下 。</p> <p>2、 期 理的风险 一持有基金比例过 的投资者大 发本基金 ，导 同期中小投资者小 分 期 理的情况。</p> <p>3、基金投资策略 以实现的的风险 一持有基金比例过 的投资者大 ， 起基金资产 净值 ， 基金在投资 限 ，导 基金投资策略 以实现。</p>							

### 11.2 投资者决策的其他重要信息

注：本基金本报告期未发 投资者决策的其他重要信息。

## §12 目录

### 12.1 目录

- 1、中 证 会 准 立基金的
- 2、长信富瑞两年定期开放债券型证券投资基金基金合同
- 3、长信富瑞两年定期开放债券型证券投资基金招募说明书  
、长信富瑞两年定期开放债券型证券投资基金托管  
、报告期内在指定报 上披露的 公告的原
- 6、长信基金管理有限责任公司 业 、公司 程及相关资 复 。

### 12.2 存放

基金管理人的 公场所。

### 12.3 阅方式

长信基金管理有限责任公司 :

长信基金管理有限责任公司

2021 年 8 月 31 日