

# 长信企业优选一年持有期灵活配置混合型 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 3 月 10 日（本基金合同生效日）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.....	7
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>10</b>
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.....	14
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
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
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>16</b>
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
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>48</b>
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.....	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	53
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.....	53
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.....	54
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.....	54
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.....	54
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	54
7.12 投资组合报告附注.....	55
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>57</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	57
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	57
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.....	57
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>58</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>59</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	59
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.....	59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	59
10.4 基金投资策略的改变.....	59
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	59
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.....	59
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	59
10.8 其他重大事件.....	60
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>62</b>
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.....	62

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	62
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>63</b>
12.1 备查文件目录.....	63
12.2 存放地点.....	63
12.3 查阅方式.....	63

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	长信企业优选一年持有期灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	长信企业优选一年持有混合
基金主代码	010861
交易代码	010861
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 3 月 10 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	1,184,098,812.87 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	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，优选各个行业的优质企业进行投资，追求长期稳健的投资回报。
投资策略	<p>本基金将利用全球信息平台、外部研究平台、行业信息平台以及自身的研究平台等信息资源，基于本基金的投资目标和投资理念，从宏观和微观两个角度进行研究，开展战略资产配置，之后通过战术资产配置再平衡基金资产组合，实现组合内各类别资产的优化配置，并追求稳健的投资收益。</p> <p>本基金投资股票时，根据市场整体估值水平评估系统性风险，进而决定股票资产的投资比例。具体而言，本基金将采用 Wind 全 A 指数作为市场代表性指数，根据指数的估值（PE）所处的历史水平位置来调整股票资产比例配置。</p> <p>（1）当 Wind 全 A 指数的整体估值水平处于历史后 20%分位，同时未来一年上市公司预测盈利增速、资产回报率能够提高，我们将提高股票资产配置比例，股票资产占基金资产的比例为 50%-95%。本阶段，市场大部分股票将处于未被充分定价的低估状态，我们将维持较高的股票资产配置比例，力争获取更多的投资收益。</p> <p>同时我们也将审慎判断后续市场环境变化，当市场情绪过于乐观、股票指数快速上涨时，我们将适度调低股票资产配置比例，保留部分估值处于合理水平、盈利能力稳定的优质个股。</p> <p>（2）当 Wind 全 A 指数的整体估值水平处于历史前 20%分位，同时未来一年上市公司预测整体盈利增速、资产回报率将出现下滑，我们将降低股票资产配置比例，股票资产占基金资产的比例为 0%-45%。本阶段，我们需要维持较低的股票资产配置比例，重点防范市场因估值水平过高、盈利能力下滑而造成的系统性风险。同时，我们将紧密跟踪宏观环境的变化，若宏观经济政策、资本市场环境发生重大调整，我们将及时调提升股票资产配置比例。</p> <p>（3）除上述两种情况以外，本基金股票资产占基金资产的比例</p>

	为 30%-85%，本阶段本基金股票资产配置的重点是行业配置和个股选择。我们将遵循本基金的选择标准，寻找估值合理、盈利趋势向好的公司。
业绩比较基准	中债综合指数收益率*50%+中证 800 指数收益率*40%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）*10%
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。本基金可投资香港联合交易所上市的股票，将面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

### 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	zhouyg@cxfund.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
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市浦东新区世纪大道 100 号 50 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3月10日 - 2021年6月30日)
本期已实现收益	-34,222,307.86
本期利润	-19,374,831.74
加权平均基金份额本期利润	-0.0164
本期加权平均净值利润率	-1.66%
本期基金份额净值增长率	-1.64%
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	-34,239,389.96
期末可供分配基金份额利润	-0.0289
期末基金资产净值	1,164,707,932.50
期末基金份额净值	0.9836
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	-1.64%

注 1、本基金基金合同生效日为 2021 年 3 月 10 日，截至本报告期末，本基金运作时间未满半年；

2、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。

3、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。

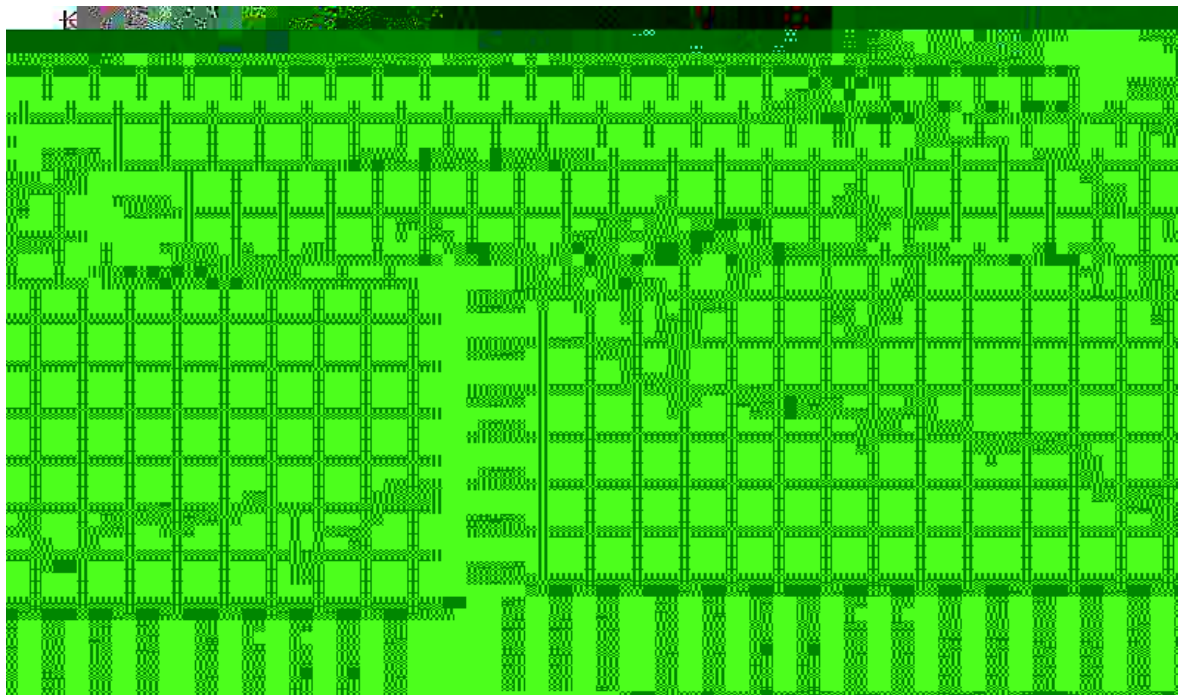
4、期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

#### 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	0.57%	0.33%	-0.50%	0.36%	1.07%	-0.03%
过去三个月	-0.88%	0.26%	2.14%	0.41%	-3.02%	-0.15%
自基金合同生效起至今	-1.64%	0.25%	2.90%	0.45%	-4.54%	-0.20%

### 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、本基金基金合同生效日为 2021 年 3 月 10 日，基金合同生效日至本报告期末，本基金运作时间未满一年。图示日期为 2021 年 3 月 10 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，本基金各项投资比例应符合基金合同中的约定：本基金股票资产占基金资产的 0%-95%，投资于港股通标的股票的比例不高于股票资产的 50%。本基金投资于同业存单的比例不高于基金资产的 20%。每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约及股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

截至本报告期末，本基金尚未完成建仓。

## §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	2021 年 3 月 10 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遵规守信情况的说明

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，长信企业优选一年持有混合份额净值为 0.9836 元，份额累计净值为 0.9836 元，本报告期内长信企业优选一年持有混合净值增长率为-1.64%，同期业绩比较基准收益率为 2.90%。

## 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  $\alpha$  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，本基金本报告期末进行利润分配，本基金收益分配原则如下：

1、本基金在符合基金有关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、每一基金份额享有同等分配权；

3、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；

4、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；

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优选一年持有期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，诚实信用、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《长信企业优选一年持有期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：长信企业优选一年持有期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
<b>资产：</b>		
银行存款	6.4.7.1	73,423,307.14
结算备付金		65,067,856.52
存出保证金		-
交易性金融资产	6.4.7.2	722,404,684.26
其中：股票投资		420,911,684.26
基金投资		-
债券投资		301,493,000.00
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	300,000,300.00
应收证券清算款		-
应收利息	6.4.7.5	5,131,223.07
应收股利		370,696.99
应收申购款		4,182.37
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		1,166,402,250.35
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 6 月 30 日</b>
<b>负 债：</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		1,428,677.53
应付托管费		190,490.34
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	2,100.00
应交税费		-

应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	73,049.98
负债合计		1,694,317.85
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	6.4.7.9	1,184,098,812.87
未分配利润	6.4.7.10	-19,390,880.37
所有者权益合计		1,164,707,932.50
负债和所有者权益总计		1,166,402,250.35

注：1、报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.9836 元，基金份额总额 1,184,098,812.87 份。

2、本基金本报告期为 2021 年 3 月 10 日至 2021 年 6 月 30 日，本基金基金合同于 2021 年 3 月 10 日正式生效，为报告期内合同生效的基金，本报告期的财务报表和报表附注均无同期对比数据。

## 6.2 利润表

会计主体：长信企业优选一年持有期灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 3 月 10 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021 年 3 月 10 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		-11,456,463.67
1.利息收入		3,895,776.63
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,313,110.11
债券利息收入		2,060,383.57
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		522,282.95
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-30,199,716.42
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-33,263,539.31
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	3,063,822.89

3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	14,847,476.12
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-
<b>减：二、费用</b>		7,918,368.07
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	5,365,456.90
2. 托管费	6.4.10.2.2	715,394.26
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.19	1,764,066.93
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	6.4.7.20	73,449.98
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-19,374,831.74
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-19,374,831.74

注 本基金本报告期为 2021 年 3 月 10 日至 2021 年 6 月 30 日，本基金基金合同于 2021 年 3 月 10 日正式生效，为报告期内合同生效的基金，本报告期的财务报表和报表附注均无同期对比数据。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长信企业优选一年持有期灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 3 月 10 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 3 月 10 日(基金合同生效日)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)	1,183,283,083.72	-	1,183,283,083.72
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-19,374,831.74	-19,374,831.74
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)	815,729.15	-16,048.63	799,680.52

其中：1.基金申购款	815,729.15	-16,048.63	799,680.52
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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,184,098,812.87	-19,390,880.37	1,164,707,932.50

注：本基金本报告期为 2021 年 3 月 10 日至 2021 年 6 月 30 日，本基金基金合同于 2021 年 3 月 10 日正式生效，为报告期内合同生效的基金，本报告期的财务报表和报表附注均无同期对比数据。

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

长信企业优选一年持有期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[2020]3074号《关于准予长信企业优选一年持有期灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》的准予注册，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 2021 年 3 月 10 日生效，首次设立募集规模为 1,183,283,083.72 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，包括国内依法发行或上市的股票（包括中小板、创业板和其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、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、地方政府债券、政府支持机构债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债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、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：本基金股票资产占基金资产的 0%-95%，投资于港股通标的股票的比例不高于股票资产的 50%。本基金投资于同业存单的比例不高于基金资产的 20%。每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约及股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如果法律法规或中国证监会对该比例要求有变更的，在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金的业绩比较基准为：中债综合指数收益率\*50%+中证 800 指数收益率\*40%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）\*10%。

#### 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 3 月 10 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表的实际编

制期间为 2021 年 3 月 10 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日止期间。

#### 6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

#### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

##### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

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主要包括股票投资、债券投资和衍生工具等；

##### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；

保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转

(4) 股指期货投资

买入或卖出股指期货投资于成交日确认为股指期货投资。股指期货初始合约价值按成交金额确认；

股指期货平仓于成交日确认衍生工具投资收益，股指期货的初始合约价值按移动加权平均法于成交日结转；

(5) 国债期货投资

买入或卖出国债期货投资于成交日确认为国债期货投资。国债期货初始合约价值按成交金额确认；

国债期货平仓于成交日确认衍生工具投资收益，国债期货的初始合约价值按移动加权平均法于成交日结转；

(6) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

#### (7) 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### **6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### **6.4.4.7 实收基金**

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### **6.4.4.8 损益平准金**

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### **6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量**

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发

行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 资产支持证券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(8) 股指期货投资收益/（损失）于平仓日确认，并按平仓成交金额与其初始合约价值的差额入账；

(9) 国债期货投资收益/（损失）于平仓日确认，并按平仓成交金额与其初始合约价值的差额入账；

(10) 权证收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(11) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(12) 公允价值变动收益/（损失）系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、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(13) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

1、本基金在符合基金有关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、每一基金份额享有同等分配权；

3、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；

4、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；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在符合法律法规及基金合同约定，并对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则和支付方式进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

#### 6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，与所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 6.4.4.13 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- (2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- (3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》（中基协发[2017]6号），在估值日按照该通知规定的流通受限股票公允价值计算模型进行估值。

(2) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，根据《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》（中国

证监会公告[2017]13 号)及《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》(中基协发[2013]13 号)相关规定,本基金根据情况决定使用指数收益法、可比公司法、市场价格模型法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(3) 根据《关于发布〈中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准〉的通知》(中基协发[2014]24 号),在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外),采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内无需说明的重大会计差错更正。

## 6.4.6 税项

### 6.4.6.1 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。

### 6.4.6.2 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、地方政府债券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。

#### **6.4.6.3 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。

#### **6.4.6.4 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。

#### 6.4.6.5 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。

#### 6.4.6.6 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。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 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	73,423,307.14
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：	73,423,307.14

#### 6.4.7.2 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	407,009,428.14	420,911,684.26	13,902,256.12
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	300,547,780.00	301,493,000.00
	合计	300,547,780.00	301,493,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	707,557,208.14	722,404,684.26	14,847,476.12

#### 6.4.7.3 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。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 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	300,000,300.00	-
银行间市场	-	-
合计	300,000,300.00	-

##### 6.4.7.4.2 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。

#### 6.4.7.5 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	14,721.36
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	88,715.41
应收债券利息	5,027,786.30
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	5,131,223.07

#### 6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

#### 6.4.7.7 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	2,100.00
合计	2,100.00

#### 6.4.7.8 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	-
预提审计费	27,393.46
预提信息披露费	45,656.52
合计	73,049.98

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2021 年 3 月 10 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	1,183,283,083.72	1,183,283,083.72
本期申购	815,729.15	815,729.15
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	1,184,098,812.87	1,184,098,812.87

注：1、申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

2、本基金基金合同于 2021 年 3 月 10 日生效。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 1,183,165,246.34 元，在募集期间产生的存款利息为人民币 117,837.38 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 1,183,283,083.72 元，折合 1,183,283,083.72 份基金份额。

#### 6.4.7.10 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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-34,222,307.86	14,847,476.12	-19,374,831.74
本期基金份额交易产生的变动数	-17,082.10	1,033.47	-16,048.63
其中：基金申购款	-17,082.10	1,033.47	-16,048.63
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-34,239,389.96	14,848,509.59	-19,390,880.37

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 3 月 10 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	338,293.56
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	974,816.55
合计	1,313,110.11

注：其他为券商结算保证金利息收入。

## 6.4.7.12 股票投资收益

### 6.4.7.12.1 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3月10日(基金合同生效日)至2021 年6月30日
卖出股票成交总额	690,599,601.11
减：卖出股票成本总额	723,863,140.42
买卖股票差价收入	-33,263,539.31

## 6.4.7.13 债券投资收益

### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无债券投资收益。

### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期无债券投资收益——买卖债券差价收入。

### 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期无债券投资收益——赎回差价收入。

### 6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无债券投资收益——申购差价收入。

### 6.4.7.13.5 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。

## 6.4.7.14 贵金属投资收益

### 6.4.7.14.1 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。

## 6.4.7.15 衍生工具收益

### 6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

### 6.4.7.15.2 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收益——其他投资收益。

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2021年3月10日(基金合同生效日)至2021年 6月30日
股票投资产生的股利收益	3,063,822.89
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	3,063,822.89

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年3月10日(基金合同生效日)至 2021年6月30日
1. 交易性金融资产	14,847,476.12
——股票投资	13,902,256.12
——债券投资	945,220.00
——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	14,847,476.12

**6.4.7.18 其他收入**

注：本基金本报告期无其他收入。

**6.4.7.19 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2021年3月10日(基金合同生效日)至2021 年6月30日
交易所市场交易费用	1,761,966.93
银行间市场交易费用	2,100.00
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	1,764,066.93

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年3月10日(基金合同生效日)至2021年 6月30日
审计费用	27,393.46
信息披露费	45,656.52
证券出借违约金	-
其他费用	400.00
合计	73,449.98

注：其他费用为证券账户开户费。

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 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。

#### 6.4.8.2 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。

### 6.4.9 关联方关系

#### 6.4.9.1 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。

#### 6.4.9.2 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
长江证券股份有限公司（以下简称“长江证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

**6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易****6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.10.1.1 股票交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年3月10日(基金合同生效日)至2021年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
长江证券	1,818,480,552.29	100.00%

**6.4.10.1.2 债券交易**

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

**6.4.10.1.3 债券回购交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年3月10日(基金合同生效日)至2021年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例
长江证券	2,630,000,000.00	100.00%

注：本基金基金合同于 2021 年 3 月 10 日起正式生效，无上年度可比期间数据。

**6.4.10.1.4 权证交易**

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

**6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年3月10日(基金合同生效日)至2021年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量 的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
长江证券	887,310.48	100.00%	-	-

注：本基金基金合同于 2021 年 3 月 10 日起正式生效，无上年度可比期间数据。

**6.4.10.2 关联方报酬****6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 3 月 10 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	5,365,456.90
其中:支付销售机构的客户维护费	2,554,183.64

注: 1、本基金基金合同于 2021 年 3 月 10 日起正式生效, 无上年度可比期间数据。

2、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。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位: 人民币元

项目	本期
	2021年3月10日(基金合同生效日)至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	715,394.26

注: 1、本基金基金合同于 2021 年 3 月 10 日起正式生效, 无上年度可比期间数据。

2、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。

#### 6.4.10.3 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。

#### 6.4.10.4 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

##### 6.4.10.4.1 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: 本基金本报告期末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。

#### 6.4.10.4.2 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：本基金本报告期末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。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 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末未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.10.5.2 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未投资本基金。

#### 6.4.10.6 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3月10日(基金合同生效日)至2021年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
光大银行	73,423,307.14	338,293.56

注：1、本基金基金合同于2021年3月10日起正式生效，无上年度可比期间数据。

2、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。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在本报告期末在承销期内购入由关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

注：本基金本报告期末存放于长江证券的券商保证金金额为人民币65,067,856.52元。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末未进行利润分配。

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

##### 6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 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
688690	纳微科技	2021年6月16日	2021年12月23日	新股锁定	8.07	79.89	3,477	28,059.39	277,777.53	-
688161	威高骨科	2021年6月23日	2021年12月30日	新股锁定	36.22	82.27	3,069	111,159.18	252,486.63	-
688269	凯立新材	2021年6月1日	2021年12月9日	新股锁定	18.94	100.92	1,941	36,762.54	195,885.72	-
688499	利元亨	2021年6月23日	2022年1月1日	新股流通受限	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	-
688314	康拓医疗	2021年5月11日	2021年11月18日	新股锁定	17.34	74.48	1,085	18,813.90	80,810.80	-
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	-
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	-
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	-
688517	金冠电气	2021年6月10日	2021年12月20日	新股锁定	7.71	11.88	2,892	22,297.32	34,356.96	-
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	-
301009	可靠	2021	2021	新股锁	12.54	27.89	801	10,044.54	22,339.89	-

	股份	年 6 月 8 日	年 12 月 17 日	定							
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		-
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		-
301013	利和兴	2021 年 6 月 21 日	2021 年 12 月 29 日	新股锁定	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81		-
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		-
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		-
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		-
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		-
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	2021	2021	新股锁	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32		-

	方正	年 5 月 25 日	年 12 月 2 日	定						
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	-

注：以上“可流通日”是根据上市公司公告估算的流通日期，最终日期以上上市公司公告为准。

#### 6.4.12.2 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。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 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。

##### 6.4.12.3.2 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。

#### 6.4.12.4 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。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 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。

#### 6.4.13.2 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。

##### 6.4.13.2.1 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
A-1	0.00
A-1 以下	0.00
未评级	50,060,000.00
合计	50,060,000.00

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。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

**6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

注：本基金本报告期末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

**6.4.13.2.4 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
AAA	0.00
AAA 以下	0.00
未评级	251,433,000.00
合计	251,433,000.00

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。

**6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

注：本基金本报告期末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

**6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

注：本基金本报告期末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

**6.4.13.3 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。

**6.4.13.3.1 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。

本基金本报告期末无重大流动性风险。

#### 6.4.13.4 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。

##### 6.4.13.4.1 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。

##### 6.4.13.4.1.1 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	73,423,307.14	-	-	-	-	73,423,307.14
结算备付金	65,067,856.52	-	-	-	-	65,067,856.52
交易性金融资产	-	50,060,000.00	231,183,000.00	20,250,000.00	420,911,684.26	722,404,684.26
买入返售金融资产	300,000,000.00	-	-	-	-	300,000,000.00
应收利息	-	-	-	-	5,131,223.07	5,131,223.07
应收股利	-	-	-	-	370,696.99	370,696.99
应收申购款	-	-	-	-	4,182.37	4,182.37
其他资产	-	-	-	-	300.00	300.00
资产总计	438,491,163.66	50,060,000.00	231,183,000.00	20,250,000.00	426,418,086.69	1,166,402,250.35
负债						
应付管理人报酬	-	-	-	-	1,428,677.53	1,428,677.53
应付托管费	-	-	-	-	190,490.34	190,490.34
应付交易费用	-	-	-	-	2,100.00	2,100.00
其他负债	-	-	-	-	73,049.98	73,049.98
负债总计	-	-	-	-	1,694,317.85	1,694,317.85
利率敏感度缺口	438,491,163.66	50,060,000.00	231,183,000.00	20,250,000.00	424,723,768.84	1,164,707,932.50

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。

**6.4.13.4.1.2 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）
	市场利率下降 27 个基点	2,653,947.54
市场利率上升 27 个基点	-2,653,947.54	

**6.4.13.4.2 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。

**6.4.13.4.2.1 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	-	95,546,498.28	-	95,546,498.28
应收股利	-	370,696.99	-	370,696.99
资产合计	-	95,917,195.27	-	95,917,195.27
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	-	95,917,195.27	-	95,917,195.27

**6.4.13.4.2.2 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%	
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）

	港币对人民币升值 5%	4,795,859.76
	港币对人民币贬值 5%	-4,795,859.76

#### 6.4.13.4.3 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：

##### 6.4.13.4.3.1 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	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	420,911,684.26	36.14
交易性金融资产-基金投资	-	-
交易性金融资产-债券投资	301,493,000.00	25.89
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	722,404,684.26	62.02

##### 6.4.13.4.3.2 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）
	VaR 值为 2.56%	-29,872,463.98

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。

## 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

### 6.4.14.1 公允价值

#### 6.4.14.1.1 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。

#### 6.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.14.1.2.1 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 419,660,016.21 元，属于第二层次的余额为人民币 301,784,969.08 元，属于第三层次的余额为人民币 959,698.97 元。

##### 6.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于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。

##### 6.4.14.1.2.3 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变动情况如下：

本期变动人民币 959,698.97 元，本期末人民币 959,698.97 元。

### 6.4.14.2 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。

### 6.4.14.3 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	420,911,684.26	36.09
	其中：股票	420,911,684.26	36.09
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	301,493,000.00	25.85
	其中：债券	301,493,000.00	25.85
	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	300,000,300.00	25.72
	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	138,491,163.66	11.87
8	其他各项资产	5,506,102.43	0.47
9	合计	1,166,402,250.35	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 95,546,498.28 元，占资产净值比例 8.20%。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	26,856.80	0.00
B	采矿业	35,136,000.00	3.02
C	制造业	232,321,412.31	19.95
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	39,988.90	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	251,115.78	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	33,816,000.00	2.90
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	125,609.09	0.01
J	金融业	97,319.40	0.01
K	房地产业	-	-

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	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	23,485,419.34	2.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	325,365,185.98	27.94

### 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	33,697,991.88	2.89
D 能源	-	-
E 金融	-	-
F 医疗保健	-	-
G 工业	-	-
H 信息技术	-	-
I 电信服务	34,015,430.40	2.92
J 公用事业	27,833,076.00	2.39
K 房地产	-	-
合计	95,546,498.28	8.20

### 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	601088	中国神华	1,800,000	35,136,000.00	3.02
2	00700	腾讯控股	70,000	34,015,430.40	2.92
3	603128	华贸物流	2,400,000	33,816,000.00	2.90
4	01458	周黑鸭	4,350,000	33,697,991.88	2.89
5	600409	三友化工	2,800,000	28,308,000.00	2.43
6	00916	龙源电力	2,500,000	27,833,076.00	2.39
7	603906	龙蟠科技	738,300	25,840,500.00	2.22
8	603517	绝味食品	306,500	25,834,885.00	2.22
9	002648	卫星石化	649,940	25,471,148.60	2.19
10	002738	中矿资源	550,000	24,420,000.00	2.10
11	603228	景旺电子	899,909	23,577,615.80	2.02
12	300816	艾可蓝	272,480	23,264,342.40	2.00

13	002414	高德红外	811,690	22,386,410.20	1.92
14	002675	东诚药业	1,040,700	21,927,549.00	1.88
15	600596	新安股份	849,910	15,060,405.20	1.29
16	300258	精锻科技	1,000,000	13,370,000.00	1.15
17	688538	和辉光电	262,984	1,001,969.04	0.09
18	688660	电气风电	51,238	450,894.40	0.04
19	688276	百克生物	3,486	364,565.88	0.03
20	688076	诺泰生物	4,984	339,958.64	0.03
21	688690	纳微科技	3,477	277,777.53	0.02
22	301009	可靠股份	8,007	265,037.97	0.02
23	688161	威高骨科	3,069	252,486.63	0.02
24	301015	百洋医药	4,614	251,115.78	0.02
25	688269	凯立新材	1,941	195,885.72	0.02
26	300614	百川畅银	3,283	176,700.30	0.02
27	688345	博力威	2,332	171,518.60	0.01
28	301013	利和兴	4,704	168,966.51	0.01
29	688700	东威科技	3,049	162,755.62	0.01
30	688575	亚辉龙	3,435	152,514.00	0.01
31	688625	呈和科技	2,672	142,764.96	0.01
32	688216	气派科技	2,000	133,400.00	0.01
33	688097	博众精工	3,983	132,235.60	0.01
34	688319	欧林生物	3,412	127,642.92	0.01
35	301016	雷尔伟	2,747	115,711.58	0.01
36	300987	川网传媒	3,004	113,378.69	0.01
37	300993	玉马遮阳	4,097	99,899.55	0.01
38	688217	睿昂基因	1,040	86,736.00	0.01
39	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.01
40	688117	圣诺生物	1,672	80,924.80	0.01
41	688314	康拓医疗	1,085	80,810.80	0.01
42	301011	华立科技	1,750	79,474.50	0.01
43	688359	三孚新科	2,213	78,561.50	0.01
44	688355	明志科技	2,710	72,384.10	0.01
45	688685	迈信林	2,612	67,781.40	0.01
46	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.01
47	688655	迅捷兴	3,083	62,893.20	0.01
48	601665	齐鲁银行	6,731	62,598.30	0.01
49	301007	德迈仕	3,022	60,305.15	0.01
50	300998	宁波方正	2,003	60,075.24	0.01
51	603529	爱玛科技	1,019	59,224.28	0.01

52	300995	奇德新材	1,909	57,368.52	0.00
53	301012	扬电科技	1,691	56,994.16	0.00
54	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
55	301010	晶雪节能	2,172	50,480.96	0.00
56	601156	东航物流	2,090	49,470.30	0.00
57	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.00
58	688565	力源科技	2,464	44,376.64	0.00
59	688067	爱威科技	1,259	39,520.01	0.00
60	605339	南侨食品	864	37,307.52	0.00
61	688367	工大高科	1,717	37,035.69	0.00
62	605090	九丰能源	1,090	35,326.90	0.00
63	688681	科汇股份	1,899	34,903.62	0.00
64	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
65	688517	金冠电气	2,892	34,356.96	0.00
66	605089	味知香	370	32,197.40	0.00
67	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
68	605296	神农集团	569	26,856.80	0.00
69	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
70	001206	依依股份	321	20,389.92	0.00
71	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
72	605196	华通线缆	1,172	16,079.84	0.00
73	603836	海程邦达	733	15,994.06	0.00
74	605319	无锡振华	764	13,706.16	0.00
75	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
76	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
77	605488	福莱新材	416	11,103.04	0.00
78	605189	富春染织	423	10,190.07	0.00
79	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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	002081	金螳螂	58,204,294.00	5.00
2	601877	正泰电器	48,779,809.87	4.19
3	603228	景旺电子	44,573,526.88	3.83
4	600409	三友化工	41,407,300.99	3.56

5	601668	中国建筑	36,930,542.73	3.17
6	00700	腾讯控股	36,285,228.00	3.12
7	603128	华贸物流	36,005,475.25	3.09
8	601088	中国神华	35,866,869.00	3.08
9	01458	周黑鸭	33,244,967.31	2.85
10	002597	金禾实业	31,264,519.21	2.68
11	000725	京东方 A	29,597,000.00	2.54
12	601628	中国人寿	25,433,107.31	2.18
13	600660	福耀玻璃	25,384,325.70	2.18
14	000002	万科 A	24,618,599.00	2.11
15	603313	梦百合	24,560,280.26	2.11
16	600596	新安股份	24,449,062.40	2.10
17	603612	索通发展	24,374,588.08	2.09
18	002212	天融信	24,358,930.00	2.09
19	600219	南山铝业	24,351,600.00	2.09
20	601225	陕西煤业	24,277,173.08	2.08
21	601689	拓普集团	23,817,404.00	2.04
22	002738	中矿资源	23,317,071.00	2.00

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	002081	金螳螂	52,246,925.18	4.49
2	601877	正泰电器	44,484,549.68	3.82
3	601668	中国建筑	34,605,000.00	2.97
4	605117	德业股份	31,473,362.80	2.70
5	002597	金禾实业	29,188,355.57	2.51
6	000725	京东方 A	29,185,000.00	2.51
7	600660	福耀玻璃	27,839,953.00	2.39
8	601628	中国人寿	24,611,233.10	2.11
9	002212	天融信	23,198,050.60	1.99
10	601689	拓普集团	23,070,058.97	1.98
11	601225	陕西煤业	22,602,499.38	1.94
12	002064	华峰化学	22,438,099.00	1.93

13	603612	索通发展	22,237,925.20	1.91
14	000002	万科 A	21,918,667.00	1.88
15	603313	梦百合	21,585,749.15	1.85
16	600219	南山铝业	21,393,868.00	1.84
17	01658	邮储银行	20,996,743.98	1.80
18	603505	金石资源	20,976,457.02	1.80
19	300319	麦捷科技	20,382,426.00	1.75
20	600570	恒生电子	20,346,588.72	1.75

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	1,130,872,568.56
卖出股票收入（成交）总额	690,599,601.11

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	301,493,000.00	25.89
	其中：政策性金融债	301,493,000.00	25.89
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	301,493,000.00	25.89

### 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	190208	19 国开 08	500,000	50,565,000.00	4.34
2	200203	20 国开 03	500,000	50,165,000.00	4.31
3	210203	21 国开 03	500,000	50,145,000.00	4.31
4	210301	21 进出 01	500,000	50,060,000.00	4.30
5	160210	16 国开 10	500,000	49,780,000.00	4.27

## 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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	370,696.99
4	应收利息	5,131,223.07
5	应收申购款	4,182.37
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,506,102.43

#### 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
14,661	80,765.21	10,700,942.09	0.90%	1,173,397,870.78	99.10%

### 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	1,005,728.38	0.08%

### 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	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	>100

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2021年3月10日）基金份额总额	1,183,283,083.72
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	815,729.15
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	1,184,098,812.87

注：本基金基金合同于2021年3月10日正式生效，本报告期为2021年3月10日至2021年6月30日。

## §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

本报告期本基金管理人、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	
长江证券	2	1,818,480,552.29	100.00%	887,310.48	100.00%	-

注：1、本期租用证券公司交易单元的变更情况

本报告期内本基金新增租用长江证券交易单元 2 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
长江证券	-	-	2,630,000,000.00	100.00%	-	-

## 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
3	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
4	长信企业优选一年持有期灵活配置混合型证券投资基金基金份额发售公告	中证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021年2月1日

		网站	
5	长信企业优选一年持有期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2月1日
6	长信企业优选一年持有期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2月1日
7	长信企业优选一年持有期灵活配置混合型证券投资基金招募说明书及基金产品资料概要	中国证监会电子披露网站、公司网站	2021年2月1日
8	长信基金管理有限责任公司关于长信企业优选一年持有期灵活配置混合型证券投资基金基金合同、托管协议和招募说明书提示性公告	中证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021年2月1日
9	长信基金管理有限责任公司关于长信企业优选一年持有期灵活配置混合型证券投资基金基金合同生效公告	中证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021年3月11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
11	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
12	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
13	长信基金管理有限责任公司关于长信企业优选一年持有期灵活配置混合型证券投资基金开放日常申购、转换转入及定期定额投资等业务并参与部分销售机构申购(含定期定额投资申购)费率优惠活动的公告	中证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021年4月8日
14	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
15	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
16	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

## **§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、《长信企业优选一年持有期灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长信企业优选一年持有期灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《长信企业优选一年持有期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