

# 长信先优债券型证券投资基金 2021 年第 3 季度报告

2021 年 9 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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 10 月 27 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金基金合同的规定，于 2021 年 10 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 7 月 1 日起至 2021 年 9 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	长信先优债券
基金主代码	004885
交易代码	004885
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 8 月 1 日
报告期末基金份额总额	188,283,909.51 份
投资目标	通过积极主动的资产管理和严格的风险控制，在保持基金资产流动性的前提下，力争获取高于业绩比较基准的投资收益，为投资者提供稳定增长的投资收益。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <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，并对各类资产的配置比例进行定期或不定期调整。</p> <p>2、债券投资策略 本基金主要采用积极管理型的投资策略，自上而下分为战略性策略和战术性策略两个层面，结合对各市场上不同投资品种的具体分析，共同构成本基金的投资策略结构。</p> <p>3、股票投资策略</p> <p>（1）行业配置策略 在行业配置层面，本基金将运用“自上而下”的行业配置方法，通过对国内外宏观经济走势、经济结构转型的方向、国家经济与产业政策</p>

	<p>导向和经济周期调整的深入研究，采用价值理念与成长理念相结合的方法对行业进行筛选。</p> <p>(2) 个股投资策略 本基金将结合定性与定量分析，主要采取自下而上的选股策略。基金依据约定的投资范围，基于对上市公司的品质评估分析、风险因素分析和估值分析，筛选出基本面良好的股票进行投资，在有效控制风险前提下，争取实现基金资产的长期稳健增值。</p> <p>(3) 存托凭证投资策略 本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。</p> <p>4、其他类型资产投资策略 在法律法规或监管机构允许的情况下，本基金将在严格控制投资风险的基础上适当参与权证、资产支持证券等金融工具的投资。</p>
业绩比较基准	中债综合指数收益率*80%+中证 500 指数收益率*20%
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，其预期风险与收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。
基金管理人	长信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2021年7月1日—2021年9月30日）
1. 本期已实现收益	8,682,161.60
2. 本期利润	6,681,077.84
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0351
4. 期末基金资产净值	213,628,221.35
5. 期末基金份额净值	1.1346

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。

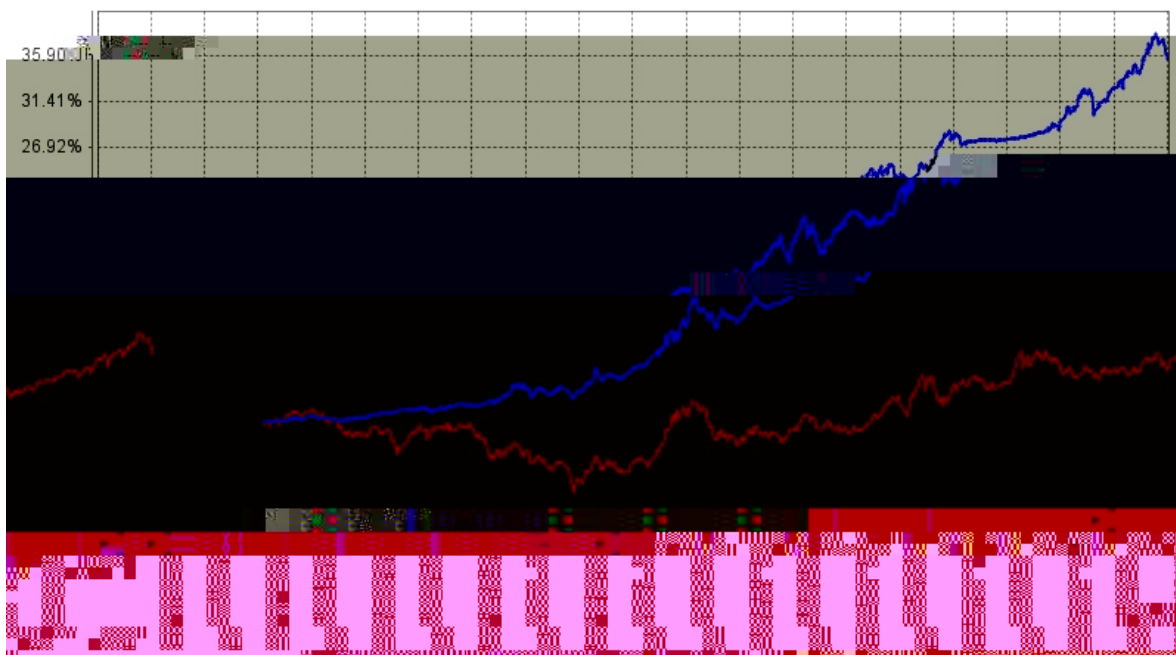
## 3.2 基金净值表现

### 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	净值增长率 ①	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
过去三个月	3.23%	0.24%	1.59%	0.23%	1.64%	0.01%
过去六个月	5.82%	0.25%	3.72%	0.19%	2.10%	0.06%
过去一年	9.72%	0.20%	4.76%	0.22%	4.96%	-0.02%
过去三年	31.22%	0.26%	13.75%	0.28%	17.47%	-0.02%
自基金合同 生效起至今	35.81%	0.23%	9.33%	0.27%	26.48%	-0.04%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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

长信先优债券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 2017 年 8 月 1 日至 2021 年 9 月 30 日。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效日起 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的约定。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
朱垚	长信先优债券型证券投资基金、长信乐信灵活配置混合型证券投资基金、长信利发债券型证券投资基金、长信合利混合型证券投资基金和长信添利安心收益混合型证券投资基金的基金经理。	2019 年 5 月 16 日	-	8 年	复旦大学金融学专业硕士毕业。具有基金从业资格，2013 年加入长信基金管理有限责任公司，曾任长信基金管理有限责任公司研究发展部基金经理助理兼研究员，现任长信先优债券型证券投资基金、长信乐信灵活配置混合型证券投资基金、长信利发债券型证券投资基金、长信合利混合型证券投资基金和长信添利安心收益混合型证券投资基金的基金经理。
黄韵	曾任本基金的基金经理	2018 年 12 月 8 日	2021 年 7 月 16 日	15 年	曾任本基金的基金经理
程放	长信先优债券型证券投资基金和长信利发债券型证券投资基金的基金经理	2020 年 12 月 31 日	-	8 年	北京大学金融学硕士毕业，具有基金从业资格。曾任职于广发银行股份有限公司、兴银基金管理有限责任公司，2020 年 8 月加入长信基金管理有限责任公司，现任长信先优债券型证券投资基金和长信利发债券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 公平交易专项说明

### 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且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 报告期内基金投资策略和运作分析

宏观环境上，第三季度全球宏观经济复苏进一步深化，国内 GDP 增速逐步回到潜在产出水平。社融增速预计在本季度达到年内低点后企稳，但由于国内延续对基建与地产行业相对严格的调控政策，我们对金融数据的反弹幅度并不抱以过高期待。国内外大宗商品价格在二季度的政策调控后，本季度上涨幅度加剧，部分品种在国内外中远期“碳中和”规划下演绎价值重估行情。

在通胀上行和流动性环境边际转紧的背景下，本季度来看，股债性价比指标持续在中位数附近震荡，超额收益更多依赖板块和个股机会。具体而言，周期和新能源板块受益于后疫情时代的高景气增长和低估值，陆续出现板块性超额收益。组合在本季度陆续增加了股票敞口，均衡分布在周期、新能源和金融等板块，积极把握权益市场的结构性行情。

纯债市场在 7 月份全面降准行情后持续低位震荡，收益率进一步下行需要更多利好因素。本

组合把握了 7 月份的利率债行情，8-9 月整体保持中性久期。转债市场则在第三季度进一步提升了估值，同时部分转债由于期初定位偏低，在本季度转债价格跟随正股出现超预期上行。出于平抑组合波动的考虑，组合减持了部分转债持仓，并在转债整体高估值的背景下，对部分高价转债进行了置换。

整体上，本基金力争在控制净值回撤的基础上，为持有人实现资产平稳增长。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 9 月 30 日，长信先优债券份额净值为 1.1346 元，份额累计净值为 1.3446 元，本报告期内长信先优债券净值增长率为 3.23%，同期业绩比较基准收益率为 1.59%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

## §5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	9,872,130.00	4.58
	其中：股票	9,872,130.00	4.58
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	185,825,173.86	86.27
	其中：债券	185,825,173.86	86.27
	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	10,000,000.00	4.64
	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	5,429,480.78	2.52
8	其他资产	4,281,185.45	1.99
9	合计	215,407,970.09	100.00

注：本基金本报告期末未通过港股通交易机制投资港股。本基金本报告期末未参与转融通证券出借业务。

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	364,320.00	0.17
C	制造业	4,538,530.00	2.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,041,500.00	0.49
E	建筑业	1,047,950.00	0.49
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	2,318,630.00	1.09
K	房地产业	561,200.00	0.26
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	9,872,130.00	4.62

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未通过港股通交易机制投资港股。

## 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

### 5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601669	中国电建	85,000	719,950.00	0.34
2	601128	常熟银行	100,000	641,000.00	0.30
3	000001	平安银行	35,000	627,550.00	0.29
4	600674	川投能源	40,000	574,800.00	0.27
5	601877	正泰电器	10,000	566,000.00	0.26
6	000776	广发证券	27,000	565,920.00	0.26
7	600048	保利发展	40,000	561,200.00	0.26

8	002832	比音勒芬	22,000	560,780.00	0.26
9	000902	新洋丰	30,000	531,000.00	0.25
10	000807	云铝股份	35,000	519,050.00	0.24

### 5.3.2 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的全国中小企业股份转让系统挂牌股票投资明细

注：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。

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	29,053,050.00	13.60
2	央行票据	-	-
3	金融债券	121,098,000.00	56.69
	其中：政策性金融债	40,584,000.00	19.00
4	企业债券	10,065,000.00	4.71
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	5,023,500.00	2.35
7	可转债（可交换债）	20,585,623.86	9.64
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	185,825,173.86	86.99

### 5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	190208	19 国开 08	200,000	20,316,000.00	9.51
2	210203	21 国开 03	200,000	20,268,000.00	9.49
3	200012	20 付息国债 12	100,000	10,628,000.00	4.97
4	2128012	21 浦发银行 01	100,000	10,157,000.00	4.75
5	2128007	21 华夏银行 01	100,000	10,150,000.00	4.75

### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

### 5.7 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。

## 5.8 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.9.1 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。

### 5.9.2 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。

### 5.9.3 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。

## 5.10 投资组合报告附注

### 5.10.1 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。

报告期内本基金投资的前十名证券中,发行主体上海浦东发展银行股份有限公司于 2021 年 4 月 23 日收到中国银行保险监督管理委员会上海监管局(沪银保监罚决字(2021)29 号),根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第(五)项、《中国银监会关于规范商业银行代理销售业务的通知》(银监发(2016)24 号),经查,上海浦东发展银行股份有限公司 2016 年 5 月至 2019 年 1 月,公司未按规定开展代销业务。综上,中国银行保险监督管理委员会上海监管局决定对上海浦东发展银行股份有限公司采取责令改正措施,并处罚款共计 760 万元。

报告期内本基金投资的前十名证券中,发行主体上海浦东发展银行股份有限公司于 2021 年 7 月 13 日收到中国银行保险监督管理委员会(银保监罚决字(2021)27 号),根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和关审慎经营规则,经查,一、监管发现的问题屡查屡犯;二、配合现场检查不力;三、内部控制制度修订不及时;四、信息系统管控有效性不足;五、未向监管部门真实反映业务数据;六、净值型理财产品估值方法使用不准确;七、未严格执行理财投资合作机构名单制管理;八、理财产品相互交易调节收益;九、使用理财资金偿还本行贷款;十、理财产品发行审批管理不到位;十一、权益类理财产品投资非权益类资产超比例;十二、公募理财产品持有单只证券市值超比例;十三、投资集合资金信托计划人数超限;十四、面向非机构投资者发行的理财产品投资不良资产支持证券;十五、出具与事实不符的理财产品投资清单;十六、私募理财产品销售文件未约定投资者冷静期;十七、投资者投资私募理财产品金额不符合监管要求;十八、理财产品资产配置与产品说明书约定不符;十九、理财产品信息披露不合规;二十、理财产品信息登记不规范;二十一、理财业务流动性风险管理不审慎;二十二、理财投资股票类业务管理不审慎;二十三、同业存款记入其他企业存款核算;二十四、同业投资投后检查流于形式;二十五、风险加权资产计量不准确;二十六、为无衍生品交易资格的机构发行结构性存款提供通道;二十七、结构性存款未实际嵌入金融衍生品;二十八、未落实委托贷款专户管理要求;二十九、借助通道违规发放委托贷款,承担实质性风险;三十、委托贷款投向不合规;三十一、违规向委托贷款借款人收取手续费。综上,中国银行保险监督管理委员会决定对上海浦东发展银行股份有限公司采取罚款 6920 万元。

报告期内本基金投资的前十名证券中,发行主体华夏银行股份有限公司于 2021 年 5 月 17 日收到中国银行保险监督管理委员会行政处罚决定书(银保监罚决字(2021)19 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、第四十七条和相关审慎经营规则,经查,华夏银行股份有限公司存在一、违规使用自营资金、理财资金购买本行转让的信贷资产;二、贷前审查及贷后管理不严;三、同业投资投前审查、投后管理不严;四、通过同业投资向企业提供融资用于收购银行股权;五、违规向土地储备项目提供融资;六、违规开立同业账户;七、通

过投资底层资产为本行信贷资产的信托计划，少计风险资产；八、同业资金协助他行增加一般性存款，且部分期限超过监管要求；九、会计核算不准确，将同业存款计入一般性存款；十、部分理财产品相互交易、风险隔离不到位；十一、违规销售无真实投资、无测算依据、无充分信息披露的理财产品；十二、策略保本型理财产品销售文件未充分揭示风险；十三、出具的理财投资清单与事实不符或未全面反映真实风险；十四、理财资金违规投资权益类资产；十五、理财资金违规投资信托次级类高风险资产；十六、理财资金投资非标准化债权资产超过监管要求；十七、非标资产非洁净转让；十八、自营业务与代客业务未有效分离；十九、部分理财产品信息披露不合规，对接本行信贷资产；二十、部分理财资金违规投向土地储备项目；二十一、部分理财资金投向不符合政府购买服务规定的项目；二十二、部分理财投资投前调查不尽职；二十三、委托贷款资金来源不合规；二十四、与未备案理财投资合作机构开展业务；二十五、漏报错报监管标准化数据且逾期未改正；二十六、提供与事实不符的材料；二十七、部分理财资金未托管。综上，中国银行保险监督管理委员会给予公司罚款 9830 万元。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体招商银行股份有限公司于 2021 年 5 月 17 日收到中国银行保险监督管理委员会行政处罚决定书（银保监罚决字（2021）16 号），根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十五条、第四十六条和相关审慎经营规则，经查，招商银行股份有限公司存在一、为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产；二、违规协助无衍生产品交易业务资格的银行发行结构性衍生产品；三、理财产品之间风险隔离不到位；四、理财资金投资非标准化债权资产认定不准确，实际余额超监管标准；五、同业投资接受第三方金融机构信用担保；六、理财资金池化运作；七、利用理财产品准备金调节收益；八、高净值客户认定不审慎；九、并表管理不到位，通过关联非银机构的内部交易，违规变相降低理财产品销售门槛；十、投资集合资金信托计划的理财产品未执行合格投资者标准；十一、投资集合资金信托计划人数超限；十二、面向不合格个人投资者销售投资高风险资产或权益性资产的理财产品；十三、信贷资产非真实转让；十四、全权委托业务不规范；十五、未按要求向监管机构报告理财投资合作机构，被监管否决后仍未及时停办业务；十六、通过关联机构引入非合格投资者，受让以本行信用卡债权设立的信托次级受益权；十七、“智能投资受托计划业务”通过其他方式规避整改，扩大业务规模，且业务数据和材料缺失；十八、票据转贴现假卖断屡查屡犯；十九、贷款、理财或同业投资资金违规投向土地储备项目；二十、理财资金违规提供棚改项目资本金融资，向地方政府提供融资并要求地方政府提供担保；二十一、同业投资、理财资金等违规投向地价款或四证不全的房地产项目；二十二、理财资金认购商业银行增发的股票；二十三、违规为企业发行短期融资券提供搭桥融资，并用理财产品投资

本行主承债券以承接表内类信贷资产；二十四、为定制公募基金提供投资顾问；二十五、为本行承销债券兑付提供资金支持；二十六、协助发行人以非市场化的价格发行债券；二十七、瞒报案件信息。综上，中国银行保险监督管理委员会给予公司罚款 7170 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六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。

### 5.10.2 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。

### 5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	20,357.40
2	应收证券清算款	1,892,674.29
3	应收股利	-
4	应收利息	1,751,803.59
5	应收申购款	616,350.17
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	4,281,185.45

### 5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	110077	洪城转债	1,560,360.00	0.73
2	127030	盛虹转债	1,044,200.00	0.49
3	113024	核建转债	1,039,860.00	0.49
4	113607	伟 20 转债	1,022,320.00	0.48
5	128081	海亮转债	995,200.00	0.47
6	110061	川投转债	799,250.00	0.37
7	118000	嘉元转债	718,120.00	0.34
8	113548	石英转债	694,100.00	0.32

9	123044	红相转债	685,080.00	0.32
10	128035	大族转债	684,000.00	0.32
11	127027	靖远转债	578,758.00	0.27
12	113603	东缆转债	565,880.00	0.26
13	123101	拓斯转债	554,900.00	0.26
14	110068	龙净转债	546,400.00	0.26
15	128142	新乳转债	532,845.00	0.25
16	113519	长久转债	527,800.00	0.25
17	110064	建工转债	527,550.00	0.25
18	110052	贵广转债	521,400.00	0.24
19	123099	普利转债	505,200.00	0.24
20	128130	景兴转债	495,560.00	0.23

#### 5.10.5 报告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。

#### 5.10.6 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。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	191,294,305.40
报告期期间基金总申购份额	52,720,286.94
减：报告期期间基金总赎回份额	55,730,682.83
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	188,283,909.51

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	27,592,899.19
报告期期间买入/申购总份额	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00

报告期期末管理人持有的本基金份额	27,592,899.19
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	14.65

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中公布的费率执行。

## 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 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。

### 8.2 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。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立基金的文件；
- 2、《长信先优债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长信先优债券型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《长信先优债券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。

### 9.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

### 9.3 查阅方式

长信基金管理有限公司网站：

。

长信基金管理有限公司

2021 年 10 月 27 日