

# 长信恒利优势混合型证券投资基金 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：长信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2022 年 3 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。本年度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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”，下同）根据本基金基金合同的规定，于2022年3月29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。

本报告期自2021年1月1日起至2021年12月31日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
重要提示	
目录	
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
基金基本情况	
基金产品说明	
基金管理人和基金托管人	
信息披露方式	
其他相关资料	
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>7</b>
主要会计数据和财务指标	
基金净值表现	
过去三年基金的利润分配情况	
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
基金管理人及基金经理情况	
管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	
管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	
管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	
管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	
管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	
管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	
管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	
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	
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>17</b>
报告期内本基金托管人合规守信情况声明	
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	
托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>18</b>
审计报告基本信息	
审计报告的基本内容	
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>20</b>
资产负债表	
利润表	
所有者权益（基金净值）变动表	
报表附注	
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>46</b>
期末基金资产组合情况	
期末按行业分类的股票投资组合	
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	
报告期内股票投资组合的重大变动	
期末按债券品种分类的债券投资组合	
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	
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	

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	
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	
报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	
报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	
投资组合报告附注	
<b>§9 基金份额持有人信息.....</b>	<b>52</b>
期末基金份额持有人户数及持有人结构	
期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	
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	
<b>§10 开放式基金份额变动.....</b>	<b>53</b>
<b>§11 重大事件揭示.....</b>	<b>54</b>
基金份额持有人大会决议	
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	
涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	
基金投资策略的改变	
为基金进行审计的会计师事务所情况	
管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	
基金租用证券公司交易单元的有关情况	
其他重大事件	
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>61</b>
报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 的情况	
影响投资者决策的其他重要信息	
<b>§13 备查文件目录.....</b>	<b>62</b>
备查文件目录	
存放地点	
查阅方式	

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	长信恒利优势混合型证券投资基金
基金简称	长信恒利优势混合
场内简称	长信恒利
基金主代码	519987
交易代码	519987
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年7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	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	18,648,535.29份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	把握经济及产业发展趋势和市场运行特征，充分利用产业升级和产业机构调整的机会，挖掘在经济发展以及市场运行不同阶段中优势产业内所蕴含的投资机会，重点投向受益于产业增长和兼具优质品质的个股，力争获取基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金实行风险管理下的主动投资策略，即采用自上而下和自下而上相结合的投资策略，自上而下是以战略的角度强调资产配置和组合管理，自下而上是以战术的角度强调精选个股。具体而言，在资产配置和组合管理方面，利用组合管理技术和金融工程相结合的方法，严格控制及监测组合的风险和保持组合流动性。在股票组合方面，自上而下通过深入研究宏观经济环境、市场环境、产业特征等因素，优选增长前景良好和增长动力充分，具备价值增值优势的产业作为重点投资对象，并结合自下而上的对上市公司的深入分析，投资于精选出来的个股，为投资者获取优势产业增长所能带来的最佳投资收益。
业绩比较基准	沪深300指数*70%+上证国债指数*30%
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于中等风险、中等收益的基金品种，其预期风险和预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	长信基金管理有限责任公司	中国建设银行股份有限公司

信息披露负责人	姓名	周永刚	李申
	联系	021 61009999	021 60637102
户 务		4007005566	021 60637111
真		021 61009800	021 60635778
注 地		中国（上）自由 易 区银 中 68 9	市 区金融大 25
公地		上 市 新区银 中 68 9	市 区 市 大 1 1
码		200120	100033
法定代表人		元	国立

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报 名称	中国证券报
载基金年度报告 文的管理人 联	
基金年度报告备置地点	上 市 新区银 中 68 9 、 市 区 市 大 1 1

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	公地
会计师事务所	勤 永会计师事务所（特 通 合 ）	上 市 区 222 30
注 记机构	中国证券 记结算有限责任公司	市 区 平 大 17

### § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

期间数据和指标	2021年	2020年	2019年
本期已实现收益	4,897,551.91	12,960,677.27	3,732,110.02
本期利润	2,846,498.91	22,279,303.31	7,912,164.84
权平 基金份额本期利润	0.1422	0.9580	0.2893
本期 权平 净值利润	8.01%	62.86%	28.64%
本期基金份额净值增长	8.62%	85.13%	32.98%
期末数据和指标	2021年末	2020年末	2019年末
期末 分配利润	12,074,493.42	16,730,877.58	3,076,753.89
期末 分配基金份额利润	0.6475	0.7880	0.1293
期末基金资产净值	30,723,028.71	43,047,416.85	26,870,863.99
期末基金份额净值	1.647	2.027	1.129
计期末指标	2021年末	2020年末	2019年末
基金份额 计净值增长	156.20%	180.35%	51.44%

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）

相关 用 的 额，本期利润为本期已实现收益 上本期公允价值变动收益。

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、开放式基金的申 、 利 投资 、基金 等），计入 用 实 收益 平要低于所 数字。

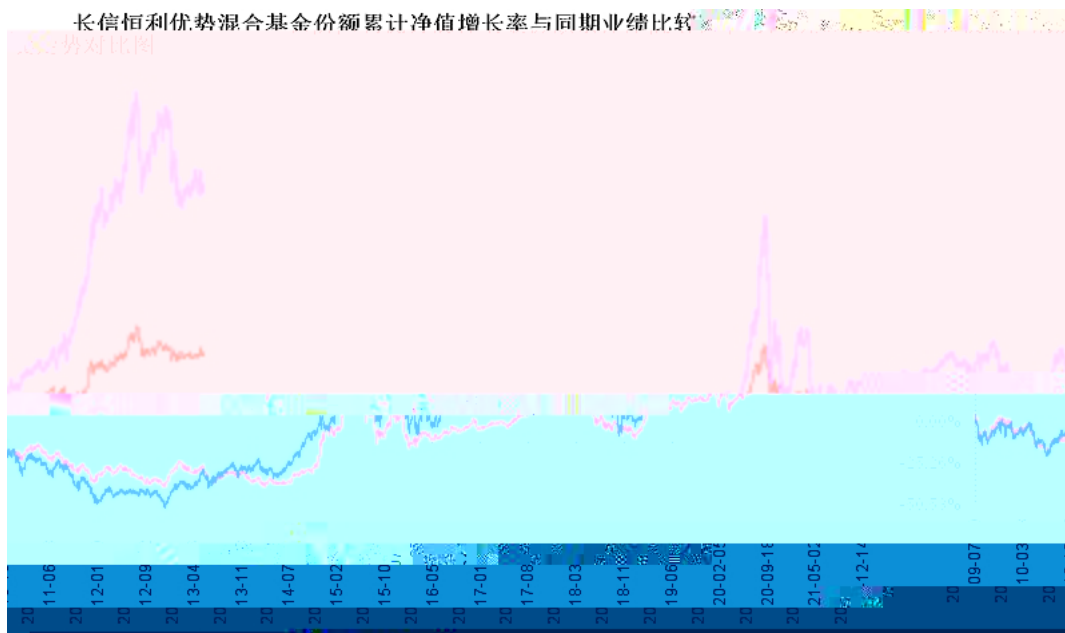
3、期末 分配利润为期末资产负债表中未分配利润 未分配利润中已实现部分的 低数。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长 及其 同期业绩比较基准收益 的比较

阶段	份额净值增长	份额净值增长 标准	业绩比较基准收益	业绩比较基准收益 标准		
过去三个月	0.73%	1.01%	1.41%	0.56%	0.68%	0.45%
过去 个月	15.93%	1.44%	2.98%	0.72%	12.95%	0.72%
过去一年	8.62%	1.48%	2.12%	0.82%	6.50%	0.66%
过去三年	124.97%	1.34%	48.54%	0.90%	76.43%	0.44%
过去五年	109.50%	1.26%	42.40%	0.84%	67.10%	0.42%
自基金合同生效起至	156.20%	1.49%	54.87%	1.02%	101.33%	0.47%

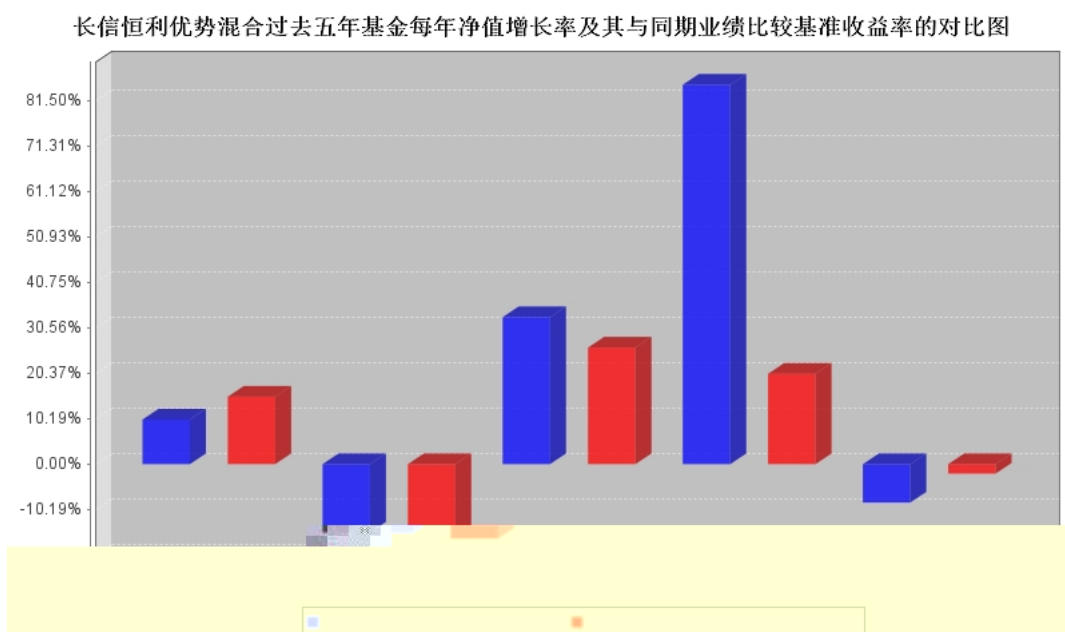
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额 计净值增长 变动及其 同期业绩比较基准收 益 变动的比较



注：1、 示日期为2009年7月30日至2021年12月31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 期。建 期结 ，本基金的 项投资比例已 合基金合同约定。

### 3.2.3 过去五年基金 年净值增长 及其 同期业绩比较基准收益 的比较



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单：人民币元

年度	10份基金份额 分 数	现金形式发放 总额	投资形式发 放总额	年度利润分配合 计	备注
2021	2.370	3,200,555.93	1,669,096.30	4,869,652.23	
2020	0.430	887,381.33	307,994.11	1,195,375.44	
2019					
合计	2.800	4,087,937.26	1,977,090.41	6,065,027.67	

注：本基金本报告期内进行的利润分配情况， 见 4.8。



期开放 配置混合型证券投资基金、长信 精选行业量 股票型证券投资基金、长信 业精  
 选 年定期开放 配置混合型证券投资基金、长信量 价值 动混合型证券投资基金、长信价  
 值 年定期开放 配置混合型证券投资基金、长信稳 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（ ）、长信价值优选混合型证券投资基金、长  
 信利 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 债 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 利优选混合型证券投资基金、  
 长信 年定期开放债券型证券投资基金、长信 平 目标三年持有期混合型基金中基  
 金（ ）、长信易进混合型证券投资基金、长信中证 债及 交 债券 50 指数证券投资基金、  
 长信 混合型证券投资基金、长信中债 1 3 年 策性金融债指数证券投资基金、长信稳 精选  
 混合型证券投资基金、长信 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（ ）、长信 利 收益混合型证券投资基金、长信 升级混合型证  
 券投资基金、长信 业优选一年持有期 配置混合型证券投资基金、长信稳 6 个月持有  
 期混合型证券投资基金、长信优质 业混合型证券投资基金、长信内 混合型证券投资基金、  
 长信 30 动持有 债债券型证券投资基金、长信稳 债券型证券投资基金、长信稳 债券型证  
 券投资基金、长信 进 备三个月持有期混合型证券投资基金、长信 和平 目标三年持有  
 期混合型基金中基金（ ）。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理 理简介

姓名	务	任本基金的基金经理（理）期 限		证券从业年 限	说明
		任 日期	任日期		
	长信恒利 优势混合 型证券投 资基金、 长信 升级混合 型证券投 资基金和 长信 利 配置 混合型证 券投资基 金的基金 经理	2019 年 8 月 8 日		8 年	复 大 金融 ， 具有基金从业资格。 于 2013 年 7 月 至 2015 年 5 月在长信基 金管理有限责任公司 担任研究员，2015 年 6 月至 2017 年 4 月期 间在上投 根基金管 理有限公司担任研究 员，2017 年 5 月重新 入长信基金管理有 限责任公司， 任研究 发展部基金经理 理， 现任长信恒利优势混 合型证券投资基金、长 信 升级混合型证

					券投资基金和长信利配置混合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为准 新增或变更基金经理的日期根据对披露的公告日期

2、证券从业的含 遵从 证券业从业人员资格管理法 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 人 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 利益，不存在 基金份额持有人利益的行为。

本基金 续以取信于市场、取信于 会投资公 为 ，承诺 一 往地本 诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，在规 基金运作和严格控制投资风险的前提下， 力为基金份额持有人 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 公平交易制度和控制方法

1、所有投资对象的投资指 经由交易部门总监或其 权人审核分配至交易人员 行。进行投资指 分配的人员 保证投资指 到公平对 。

2、公司 用的交易 行 件系 具备 下 能：

(1) 严格按 间 序发送 托指

(2) 对于 一个投资组合在同一点 同一证券下达的相同方向的投资指 ，并 市价在限价内的，系 自动 交易员 对 证券下达的 托自动按 指 数量比例分 为 投资组合的 托指 。对于不同投资组合 不同投资经理 对交易所同一证券的同一方向 价交易指 ，指 数量比例达到 5: 1 或以上的，根据市场情况审核 通过人工分发 不同交易员 公平交易。

3、交易人员对于 收到的交易指 价格优 、 间优 的 序 行。在 行 个投资组合在同一点 同一证券下达的相同方向的交易所投资指 ， 制度规定的例 指 ，系 已强制开 公平交易开关。

4、对于不同投资组合 进行债券一级市场申 、 公开发行股票申 等 中 价交易的投资对象，交易部门 严格独立 收 投资组合的投资指 ，在申 结 产生前，不 以任 形

式向任 人 露 投资指 的内容， 指 价格及数量等要素。

5、对于 投资组合以独立 户名 进行申 的投资对象， 经过公平性审核的例 指 ， 申 获配的证券数量由投资管理系 收 类证券 记结算机构发送的数据进行分配。交易部门根据证券发行人在指定公开披露 体上披露的申 结 对系 内分配数量进行核准，数量不 的， 应 第一 间告 投资管理部门的总监及监察稽核部总监。对于以公司名 进行申 的投资对象，公司在获配额度确定 ，严格按 价格优 的原则在 投资组合间进行分配。申 价格相同的投资组合则根据投资指 的数量按比例进行分配。确因特 原因不能按 上述原则进行分配的， 应 动 交易 别流程，审核通过的， 以进行相应分配。

#### 4.3.2 公平交易制度的 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， 强交易 行环 的内部控制，并通过工作制度、流程和技术 段保证公平交易原则的实现。同 ，公司已通过对投资交易行为的监控、分析 估和信息披露来 强对公平交易过程和结 的监 。

#### 4.3.3 交易行为的专项说明

本报告期内， 完 按 有关指数的构 比例进行投资的组合 ，其 投资组合未发生 交易所公开 价同日 向交易 交较 的单 交易量超过 证券 日 交量的5%的情形，未发现 交易行为。同 ，对本年度同向交易价 进行专项分析，未发现 情况。

### 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

2021年 上 年估值高 ， 进入了较长 间的调整通 。同 市场风格 面， 估值 价 ，市场在大 中小市值的 好上 。 好 作为长 的长期优质 ，在经 风调整期是 选股的好 机。在报告期内， 重点配置了 个细分 ：其一是实 向 务性支出的 升级，其重点 好 相关 ， 人 、 、 等，其二是人 结构变 带来的新 中产 趋势， 从 到一的新 品类。选股上 遵 自下而上精选个股， 基本面能 大趋势形 共 的优质标的。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

至2021年12月31日，长信恒利优势混合份额净值为1.647元，份额 计净值为2.243元，本报告期内长信恒利优势混合净值增长 为8.62%，同期业绩比较基准收益 为2.12%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

为 2022 年是 一部宏观环境不确定性的一年， 情至 经 了 2 年流动性充 的市场环境， 是高 或高 长 ， 估值 于合理 高 置，预计 要一定的 间来 估 值。对应到 ， 为市场信 不 主要来自 方面，一是 情 控对 经济 动的 影响，二是 情持续 复对支 能力以及 信 的 。但同 到一 向好的因 素，新 变 向 力下 的方向 进，国内 个新 小分 获 以及第三 种 动。 为 相关的出行 务 公司或 是 年较为明确的投资 ，同 一 长期增长 稳 、 对估值 低的细分 ， 年 度 能有超额收益。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本年度内，本基金管理人严格遵守 证券投资基金法 及配 法律法规， 以合规运作、 风险为核 ，以 基金持有人利益为 ，保证基金合同 到严格 行。公司监察稽核部 独立地开展工作，对基金运作进行事前、事中 事 的监 查，发现 及 提出改进建议并 业务部门进行整改，同 定期向公司董事会和公司管理 出具监察稽核报告。

本年度内，为确保监管要 的有效实 ，公司监察稽核部根据 项法律法规监管 策性要 以及公司内部控制 行情况， 开展公司业务流程及风险 理的工作， 组 开内部控制 员会会议，对 项监管要 进行 读，并对 业务部门业务流程及制度规 的调整进行深入 ， 强对关 业务 合规 导及 工作。

本年度内，监察稽核部以组合 力测 为主要方式，定期对投资组合的风险 况进行 测，对投资组合整体流动性情况进行分析，并 业务部门的 通会议 项 能面 的风险 进行 通、 ， 组合风险事件发生。

本基金管理人承诺 一 往地本 诚实信用、勤勉尽责的原则， 持风控优 、内控从严 的理 ，不 提高内部监察稽核工作的 性和实效性、并完 内部控制体系， 好 项内控工 作， 力 和控制 种风险，确保基金资产的规 运作，充分保 基金持有人的合法权益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人严格按 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 对基金管理公司采用的估值 策和 程序进行核查，并对估值结 及净值计算进行复核。

根据相关法律法规，本基金管理人制定了科学、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，其主要职责是负责制定公司的估值政策、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，评估发生了影响估值程序和技术的有效性及适用性的情况及完善估值程序。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人员共同组成，相关人员具有扎实的证券行业工作经历，熟悉相关法规和估值方法，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对公司基金估值政策和程序的独立性。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限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估值数据。估值流程各方不存在任何重大利益冲突。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规和本基金基金合同规定的基金收益分配原则以及基金实际运作情况，本基金本报告期进行了一次利润分配，具体情况如下：权益登记日2021年1月22日，除息日2021年1月22日，10份基金份额分派2.370元，现金形式发放3,200,555.93元，投资形式发放1,669,096.30元，利润分配合计4,869,652.23元。

本基金收益分配原则如下：

- 1、本基金的每份基金份额享有同等分配权
- 2、收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。投资人的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金注册登记机构将投资人的现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额
- 3、本基金收益每年最多分配12次，基金收益分配比例不低于期末可供分配利润的10%（期末可供分配利润是指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数），年度基金收益分配比例不低于期末可供分配利润的30%
- 4、基金合同生效不满3个月则不进行收益分配
- 5、本基金收益分配方式分为两种：现金分红和红利再投资，投资人可选择现金红利或红利再投资。按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。投资人不选择，本基金的收益分配方式是现金分红
- 6、基金红利发放日即收益分配基准日（即期末可供分配利润计算截止日）不得超过15个

工作日

- 7、基金收益分配基准日的基金份额净值 去 单 基金份额收益分配金额 不能低于面值
- 8、法律法规或监管机构 有规定的从其规定。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

自 2018 年 7 月 24 日至 2018 年 10 月 19 日,本基金资产净值已连续 个 工作日低于五元,本基金管理人已向中国证监会报送了 决方 。 至报告期末,本基金资产净值 低于五元。

## §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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金实际利润分配的金额为 4,869,652.23 元。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

## §6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告	师报审字 22 第 00071

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	长信恒利优势混合型证券投资基金 全体基金份额持有人
审计意见	<p>审计了长信恒利优势混合型证券投资基金的财务报表，2021 年 12 月 31 日的资产负债表，2021 年度的利润表、所有者权益 基金净值 变动表以及财务报表附注。</p> <p>我们认为，附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定 制，公允反映了长信恒利优势混合型证券投资基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况、2021 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>按照中国注册会计师审计准则的规定进行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了在审计准则下的责任。按照中国注册会计师行业守则，独立于长信恒利优势混合型证券投资基金，并履行了行业方面的其他责任。我们相信，获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	
其他事项	
其他信息	<p>长信基金管理有限责任公司以下简称“基金管理人”管理 对其其他信息负责。其他信息是指长信恒利优势混合型证券投资基金 2021 年度报告中除财务报表和审计报告以外的信息。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在过程中，其他信息是否与财务报表或在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，我们没有确定其他信息存在重大错报，我们应报告事实。在 方面，我们没有发现任何事项需要报告。</p>
基金管理人和被审计单位对财务报表的责任	<p>基金管理人管理 负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定 制财务报表，其实现公允反映，并设计、执行和维持必要的内部控制，以财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在 制财务报表 时，基金管理人管理 负责 估长信恒利优势混合型证券投资基金的持续经营能力，披露持续经营相关的事项</p>

	用，并运用持续经营假设，基金管理人管理计算长信恒利优势混合型证券投资基金、终止经营或其他现实的选基金管理人理负责监长信恒利优势混合型证券投资基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>的目标是对财务报表整体是不存在由于或误导的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于或误导，合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，执行以下工作：</p> <p>1 识别和评估由于或误导的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对评估的风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于审计的固有限制，未能发现由于或误导的重大错报的风险高于未能发现由于误导的重大错报的风险。</p> <p>2 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并不对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>3 评价基金管理人管理选用会计政策的恰当性和会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>4 对基金管理人管理运用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，能够导致对长信恒利优势混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果得出结论为存在重大不确定性，审计准则要求在审计报告中提醒报表使用者注意财务报表中的相关披露；披露不充分，应发表无法表示意见。结论基于截至审计报告日获取的信息。而，未来的事项或情况可能导致长信恒利优势混合型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>5 评价财务报表的总体列报、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>基金管理人理计的审计、沟通和重大审计发现等事项进行沟通，沟通在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	勤永会计师事务所（普通合伙）
注册会计师的姓名	
会计师事务所的地址	上市区 222 30
审计报告日期	2022年3月28日

## §7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：长信恒利优势混合型证券投资基金

报告 止日：2021 年 12 月 31 日

单 位：人 民 币 元

资 产	附注	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>			
银行存		340,699.17	1,251,901.81
结算备 金		26,473.94	29,695.01
存出保证金		5,268.57	11,033.68
交易性金融资产		30,170,133.16	41,244,113.60
其中：股票投资		28,513,636.36	39,199,318.10
基金投资			
债券投资		1,656,496.80	2,044,795.50
资产支持证券投资			
贵金属投资			
生金融资产			
入 金融资产			
应收证券 算		299,613.32	640,261.21
应收利息		27,278.72	45,171.47
应收股利			
应收申		9,362.62	148,754.92
所 资产			
其他资产			
资产总计		30,878,829.50	43,370,931.70
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注</b>	<b>本期末 2021 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2020 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>			
期			
交易性金融负债			
生金融负债			
出 金融资产			
应 证券 算			
应		22,944.00	211,654.70
应 管理人报		39,652.97	51,815.01
应 托管		6,608.82	8,635.82
应 务			
应 交易 用		6,537.45	20,856.42
应交			
应 利息			

应 利润			
所 负债			
其他负债		80,057.55	30,552.90
负债合计		155,800.79	323,514.85
<b>所有者权益:</b>			
实收基金		18,648,535.29	21,231,882.15
未分配利润		12,074,493.42	21,815,534.70
所有者权益合计		30,723,028.71	43,047,416.85
负债和所有者权益总计		30,878,829.50	43,370,931.70

注：报告 止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.647 元，基金份额总额 18,648,535.29 份。

## 7.2 利润表

会计主体：长信恒利优势混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单 位：人 币元

项 目	附注	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度 比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		2,029,593.25	23,174,795.40
1. 利息收入		64,338.26	65,372.36
其中：存 利息收入		5,675.96	16,058.54
债券利息收入		58,662.30	49,313.82
资产支持证券利息收入			
入 金融资产收入			
证券出 利息收入			
其他利息收入			
2. 投资收益（ 以 “ ” ）		5,624,678.87	13,750,078.86
其中：股票投资收益		5,361,500.34	13,285,777.48
基金投资收益			
债券投资收益		22,525.64	20,921.80
资产支持证券投资收益			
贵金属投资收益			
生工具收益			
股利收益		285,704.17	443,379.58
3. 公允价值变动收益（ 以 “ ” ）		7,744,050.82	9,318,626.04
收益（ 以 “ ” ）			
5. 其他收入（ 以 “ ” ）		25,440.44	40,718.14
<b>：二、 用</b>		816,905.66	895,492.09
1 管理人报		534,405.98	528,398.38
2 托管		89,067.71	88,066.48

3	务		
4	交易用	111,685.10	245,957.60
5	利息支出		
	其中：出 金融资产支出		
	金及附		3.20
7	其他用	81,746.87	33,066.43
	三、利润总额（ 总额以“ ”）	2,846,498.91	22,279,303.31
	：所 用		
	、净利润（净 以“ ”）	2,846,498.91	22,279,303.31

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长信恒利优势混合型证券投资基金

本报告期：2021年1月1日至2021年12月31日

单 位：人 币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期 所有者权益（基金净值）	21,231,882.15	21,815,534.70	43,047,416.85
二、本期经 动产生的基金净值变动数（本期利润）		2,846,498.91	2,846,498.91
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值 以“ ”）	2,583,346.86	2,024,890.14	4,608,237.00
其中：1. 基金申	9,648,048.24	8,076,441.07	17,724,489.31
2. 基金	12,231,395.10	10,101,331.21	22,332,726.31
、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 以“ ”）		4,869,652.23	4,869,652.23
五、期末所有者权益（基金净值）	18,648,535.29	12,074,493.42	30,723,028.71
项目	上年度 比期间 2020年1月1日至2020年12月31日		

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期 所有者权益（基金净值）	23,794,110.10	3,076,753.89	26,870,863.99
二、本期经 动产生的基金净值变动数（本期利润）		22,279,303.31	22,279,303.31
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值 以“ ” ）	2,562,227.95	2,345,147.06	4,907,375.01
其中：1. 基金申	20,071,819.27	10,500,532.47	30,572,351.74
2. 基金	22,634,047.22	12,845,679.53	35,479,726.75
、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 以“ ” ）		1,195,375.44	1,195,375.44
五、期末所有者权益（基金净值）	21,231,882.15	21,815,534.70	43,047,416.85

报表附注为财务报表的组 部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下 负责人签 ：

\_\_\_\_\_ 元 \_\_\_\_\_

基金管理人负责人                      主管会计工作负责人                      会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

长信恒利优势混合型证券投资基金 原名长信恒利优势股票型证券投资基金, 以下简称“本基金” 系由基金管理人长信基金管理有限责任公司 中 人 共和国证券投资基金法 、 长信恒利优势股票型证券投资基金基金合同 以下简称“基金合同” 及其他有关法律法规的规定, 经中国证券监 管理 员会 以下简称“中国证监会” 以证监 2009 439 文 准公开募 。 本基金为契约型开放式基金, 存续期限为不定期, 设立募 基金份额为 984,485,380.44 份, 经上 沪银会计师事务所有限公司 证, 并出具了 为沪 会字 2009 第 3646 资报告。 基金合同于 2009 年 7 月 30 日 式生效。本基金的基金管理人为长信基金管理有限责任公司, 基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据 中 人 共和国证券投资基金法 、 至报告期末最新公告的基金合同及 长信恒利

优势混合型证券投资基金招募说明书 的有关规定，本基金投资 为具有良好流动性的金融工具， 国内 法发行的股票、存托 证、债券、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允 基金投资的其他金融工具。 法律法规或监管机构以 允 基金投资其 品种，基金管理人在 行 程序 ， 以 其 入投资 。基金的投资组合比例为：本基金投资于股票资产的比例 是基金资产的 60% 95%，投资于现金、债券资产以及中国证监会允 基金投资的其他证券品种的比例 是基金资产的 5% 40%，现金不 结算备 金、存出保证金、应收申 等 及到期日在一年以内的 债券不低于基金资产净值的 5%。本基金投资优势产业的资产不低于股票资产的 80%。投资于权证、资产支持证券或其他 生金融工具的比例遵守法律法规或中国证监会的有关规定。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数 70%+上证国债指数 30%。

## 7.4.2 会计报表的 制基

本基金的财务报表按 财 部 的 业会计准则及相关规定 以下简称“ 业会计准则” 以及中国证监会发 的关于基金行业实 作的有关规定 制，同 在具体会计核算和信息披露方面 了中国证券投资基金业 会发 的 基金行业实 作。

## 7.4.3 遵 业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的 制 合 业会计准则和中国证监会发 的关于基金行业实 作的有关规定的要 ，真实、完整地 了本基金 2021 年 12 月 31 日的财务 况以及 2021 年度的经 和基金净值变动情况。

## 7.4.4 重要会计 策和会计估计

### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公 年度，即 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

### 7.4.4.2 记 本 币

本基金以人 币为记 本 币。

### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

#### 1 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要 ，本基金 所持有的金融资产在 确 分为以公允价值计量 其变动计入 期 益的金融资产和 及应收 项， 金融资产 分为 出

金融资产或持有至到期投资。生工具所产生的金融资产在资产负债表中以生金融资产示，其他以公允价值计量其公允价值变动计入益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产示。

本基金持有的类应收项、入金融资产等在市场中 有报价、收金额 定或确定的生金融资产分类为及应收项。

## 2 金融负债的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要，本基金持有的金融负债在确分为以公允价值计量其变动计入期益的金融负债和其他金融负债。本基金分类为以公允价值计量其变动计入期益的金融负债。

其他金融负债类应项、出金融资产等。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的确、续计量和止确

金融资产或金融负债于本基金为金融工具合同的一方，于交易日按公允价值在资产负债表内确。以公允价值计量其变动计入期益的金融资产，取发生的相关交易用计入期益支的价中含已告但未发放的现金股利或债券起息日或上息日至日止的利息，单独确为应收项目。及应收项和其他金融负债的相关交易用计入确金额。

以公允价值计量其变动计入期益的金融资产按公允价值进行续计量，及应收项和其他金融负债采用实利法，以本进行续计量。

收取项金融资产现金流量的合同权利已止或金融资产所有权上所有的风险和报已，止确金融资产。止确的金融资产的本按动权平法于交易日结。金融负债的现务部或部分已经的，能止确金融负债或其一部分。金融负债部或部分止确的，止确部分的面价值支的对价出的现金资产或承担的新金融负债之间的额，计入期益。

### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场者在计量日发生的有序交易中，出一项资产所能收到或者一项负债所支的价格。本基金对以公允价值进行续计量的金融资产金融负债根据对计量整体具有重大意的最低的入值确定公允价值计量。第一入值是在计量日能取的相同资产或负债在市场上未经调整的报价第二入值是第一入值相关资产或负债或间观察的入值第三入值是相关资产或负债的不观察入值。本

基金主要金融工具的估值方法如下：

- 1 对于银行间市场交易的固定收益品种，以及交易所上市交易或 的固定收益品种债券、资产支持证券和 募债券，按 第三方估值机构提 的估值确定公允价值。
- 2 对存在 市场的其他投资品种， 估值日有市价的，采用市价确定公允价值 估值日市价， 最 交易日 经济环境未发生重大变 证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最 交易市价确定公允价值 对于发行 明确一定期限限 期的股票， 但不限于公开发行业股票、 公开发行业 股票公司股 公开发 股份、通过大 交易取 的带限 期的股票等，按 监管机构或行业 会的有关规定确定公允价值。
- 3 对存在 市场的其他投资品种， 估值日 市价 最 交易日 经济环境发生了重大变 或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值 员会 为 要 ，应 类 投资品种的现行市价及重大变 等因素，调整最 交易市价，确定公允价值。
- 4 投资品种不 存在 市场，基金管理人估值 员会 为 要 ，采用市场 者 同 以往市场实 交易价格 证具有 性的估值技术，确定投资品种的公允价值。估值技术 情况并自 交易的 方最 进行的 市场交易中 用的价格、 实质上相同的其他金融工具 前公允价值、现金流量 现法和期权定价 型等。采用估值技术 ，尽 能最大程度 用市场 数， 用 本基金特定相关的 数。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的

本基金具有 已确 金融资产和金融负债的法定权利， 目前 行 种法定权利，同 本基金计 以净额结算或同 变现 金融资产和 金融负债 ，金融资产和金融负债以相 的金额在资产负债表内 示。 以 ，金融资产和金融负债在资产负债表内分别 示，不 相 。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对 发行基金份额所对应的金额。申 、 、 及 利 投资等 起的实收基金的变动分别于上述 交易确 日 。

#### 7.4.4.8 益平准金

益平准金指申 、 、 入、 出及 利 投资等事项导 基金份额变动 ，相关 项 中含的未分配利润。根据交易申 日利润分配 未分配利润 已实现 未实现部分 自占基金净值 的比例， 益平准金分为已实现 益平准金和未实现 益平准金。 益平准金于基金申 确 日或基金 确 日 ，并于期末 额 入利润分配 未分配利润 。

#### 7.4.4.9 收入/( )的确 和计量

利息收入

存 利息收入按存 的本金 用利 日计提。

息债 的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利 计算的利息 用情况下由债券发行 业代 代 的个人所 的净额， 日确 债券利息收入。 息债 同到期一 性 本 息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限 算内含票面利 ， 日确 债券利息收入。

入 金融资产收入按 入 金融资产的 本在 期内以实 利 法 日计提。

投资收益

股票投资收益为 出股票交易日的 交总额 应结 的股票投资 本的 额确 。

债券投资收益为 出债券交易日的 交总额 应结 的债券投资 本 应收利息 有 的 额确 。

生工具投资收益为交易日的 交总额 应结 的生工具投资 本的 额确 。

股利收入于 息日按上市公司 告的分 息比例计算的金额确 ，由上市公司代 代 的个人所 于 出交易日按实 代 代 金额确 。

公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量 其变动计入 期 益的金融资产的公允价值 变动形 的利 或 确 ，并于相关金融资产 出或到期 出计入投资收益。

#### 7.4.4.10 用的确 和计量

本基金的基金管理人报 按前一日基金资产净值 1.50%的年 日计提。

本基金的基金托管 按前一日基金资产净值 0.25%的年 日计提。

以公允价值计量 其变动计入 期 益的金融资产的交易 用发生 按 确定的金额计入交 易 用。

出 金融资产 支出按 出 金融资产的 本在 期内以实 利 日计提。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配 策

1 本基金的 份基金份额 有同等分配权

2 收益分配 所发生的银行 或其他 续 用由投资人自行承担。 投资人的现金 利小 于一定金额，不 以支 银行 或其他 续 用，基金注 记机构 投资人的现金 利 按 利发放日的基金份额净值自动 为基金份额

3 本基金收益 年最 分配 12 ， 基金收益分配比例不低于期末 分配利润的 10% 期末 分配利润是指期末资产负债表中未分配利润 未分配利润中已实现收益的 低数 ， 年 计基金收益分配比例不低于期末 分配利润的 30%

4 基金合同生效不 3 个月则 不进行收益分配

5 本基金收益分配方式分为 种：现金分 利 投资，投资人 选 现金 利或 现金 利按 利发放日的基金份额净值自动 为基金份额进行 投资 投资人不选 ， 本基金 的收益分配方式是现金分

6 基金 利发放日 收益分配基准日 即期末 分配利润计算 止日 不 超过 15 个工 作日

7 基金收益分配基准日的基金份额净值 去 单 基金份额收益分配金额 不能低于面值

8 法律法规或监管机构 有规定的从其规定。

#### 7.4.4.12 币交易

本基金本报告期内 币交易。

#### 7.4.4.13 分部报告

根据本基金的内部组 机构、管理要 及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部， 向 管理 报告 采用的会计 策及计量基 制财务报表 的会计 策 计量基 一 。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计 策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允 的基金行业估值实务 作，本基金确定以下类别股 票投资和债券投资的公允价值 采用的估值方法及其关 假设 下：

1 对于在发行 明确一定期限限 期的股票， 但不限于 公开发行股票、 公开发 行股票 公司股 公开发 股份、通过大 交易取 的带限 期的股票等，不 、新发行未 上市、 交易中的质 券等流通受限股票，根据 关于发 证券投资基金投资流通受限股票估 值指 行的通 中基 发 2017 6 ，在估值日按 通 规定的流通受限股票公允价 值计算 型进行估值。

2 对于证券交易所上市的股票， 出现重大事项 或交易不 的交易不 等情况，根据 中国证券监 管理 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 及 关于发 中基 A A 基金行业股票估值指数的通 中基 发 2013 13 相关规定，本基金根据情况决定 用指数收益法、 比公司法、市场价格 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报》（中基发〔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有规定的，采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无重大会计差错更正。

## 7.4.6 重要事项

根据财政部、国家税务总局财〔2008〕1号、财政部、国家税务总局关于营业税改征增值税的试点、2008年9月18日上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知、财〔2012〕85号关于实施上市公司股息红利差别个人所得税政策有关问题的通知、财政部、国家税务总局、证监会公告2019年第78号关于继续实施中小微股份转让所得个人所得税政策的公告、财〔2015〕101号关于上市公司股息红利差别个人所得税政策有关问题的通知、财〔2016〕36号关于全面推开营业税改征增值税试点的通知、财〔2016〕140号关于明确金融房地产开发等增值税政策的通知、财〔2017〕56号关于资管产品增值税有关问题的通知、财〔2017〕90号关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知及其他相关法规和业务操作，主要事项如下：

1 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 股票、债券 征增值税 公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务，以基金管理人为增值税 人， 用简易计 方法，按 3%的征收 增值税 。

2 对证券投资基金从证券市场中取得的收入， 股票、债券的 价收入，股权的股息、

利收入，债券的利息收入及其他收入，不 业所 。

3 对基金取得的股票股息、 利收入，由上市公司代 代 个人所 从公开发行和  
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 利所 额计入应  
所 额 持股期限在1个月以上至1年（含1年）的， 按50%计入应 所 额 持股期限  
超过1年的，股息 利所 征收个人所 。上述所 一 用20%的 计征个人所 。

4 对于基金从事A股 ，出 方按0.10%的 证券 股票 交易 ，对受 方不

。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存

单：人 币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
期存	340,699.17	1,251,901.81
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：	340,699.17	1,251,901.81

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单：人 币元

项目	本期末 2021年12月31日		
	本	公允价值	公允价值变动
股票	24,835,862.89	28,513,636.36	3,677,773.47
贵金属投资 金交所 金合约			
债券	交易所市场	1,663,120.80	1,656,496.80
	银行间市场		
	合计	1,663,120.80	1,656,496.80
资产支持证券			
基金			
其他			
合计	26,498,983.69	30,170,133.16	3,671,149.47
项目	上年度末 2020年12月31日		

		本	公允价值	公允价值变动
股票		27,781,868.31	39,199,318.10	11,417,449.79
贵金属投资 金交所 金合约				
债券	交易所市场	2,047,045.00	2,044,795.50	2,249.50
	银行间市场			
	合计	2,047,045.00	2,044,795.50	2,249.50
资产支持证券				
基金				
其他				
合计		29,828,913.31	41,244,113.60	11,415,200.29

#### 7.4.7.3 生金融资产/负债

注：本基金本报告期末及上年度末未持有 生金融工具。

#### 7.4.7.4 入 金融资产

##### 7.4.7.4.1 项 入 金融资产期末 额

注：本基金本报告期末及上年度末 入 金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末 式 交易中取 的债券

注：本基金本报告期末及上年度末 式 交易中取 的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单：人 币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应收 期存 利息	66.59	147.22
应收定期存 利息		
应收其他存 利息		
应收结算备 金利息	13.09	14.74
应收债券利息	27,196.51	45,004.01
应收资产支持证券利息		
应收 入 证券利息		
应收申 利息		
应收 金合约 息		
应收出 证券利息		
其他	2.53	5.50
合计	27,278.72	45,171.47

注：其他为应收结算保证金利息。

#### 7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末 未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应 交易 用

单：人 币元

项目	本期末	上年度末
	2021年12月31日	2020年12月31日
交易所市场应 交易 用	6,537.45	20,856.42
银行间市场应 交易 用		
合计	6,537.45	20,856.42

#### 7.4.7.8 其他负债

单：人 币元

项目	本期末	上年度末
	2021年12月31日	2020年12月31日
应 券 交易单元保证金		
应	57.55	552.90
应 证券出 约金		
预提 户		
预提审计	30,000.00	30,000.00
预提信息披露	50,000.00	
合计	80,057.55	30,552.90

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单：人 币元

项目	本期	
	2021年1月1日至2021年12月31日	
	基金份额（份）	面金额
上年度末	21,231,882.15	21,231,882.15
本期申	9,648,048.24	9,648,048.24
本期（以“ ”）	12,231,395.10	12,231,395.10
基金分份额算前		
基金分份额算变动份额		
本期申		
本期（以“ ”）		
本期末	18,648,535.29	18,648,535.29

注：本期申 含 利 投、 入份 金 额，本期 含 出份 金 额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单：人 币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	16,730,877.58	5,084,657.12	21,815,534.70

本期利润	4,897,551.91	7,744,050.82	2,846,498.91
本期基金份额交易产生的变动数	2,126,022.00	101,131.86	2,024,890.14
其中：基金申	7,275,087.80	801,353.27	8,076,441.07
基金	9,401,109.80	700,221.41	10,101,331.21
本期已分配利润	4,869,652.23		4,869,652.23
本期末	14,632,755.26	2,558,261.84	12,074,493.42

#### 7.4.7.11 存 利息收入

单：人 币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度 比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
期存 利息收入	4,973.05	14,653.69
定期存 利息收入		
其他存 利息收入		
结算备 金利息收入	567.14	1,176.95
其他	135.77	227.90
合计	5,675.96	16,058.54

注：其他为结算保证金利息收入、申 利息收入。

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益 股票 价收入

单：人 币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度 比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
出股票 交总额	49,008,484.29	94,020,353.84
： 出股票 本总额	43,646,983.95	80,734,576.36
股票 价收入	5,361,500.34	13,285,777.48

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构

单：人 币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度 比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
债券投资收益 债券（、债 股及债券到期 ） 价收入	22,525.64	20,921.80
债券投资收益 价收入		
债券投资收益 申 价收入		
合计	22,525.64	20,921.80

**7.4.7.13.2 债券投资收益 债券 价收入**

单：人 币元

项目	本期 2021年1月1日至2021 年12月31日	上年度 比期间 2020年1月1日至2020年 12月31日
出债券（、债 股及债券到期） 交总额	4,606,784.57	7,875,319.00
：出债券（、债 股及债券到 期）本总额	4,506,151.50	7,657,029.19
：应收利息总额	123,158.71	197,368.01
债券 价收入	22,525.64	20,921.80

**7.4.7.13.3 债券投资收益 价收入**

注：本基金本报告期及上年度 比期间 债券投资 价收入。

**7.4.7.13.4 债券投资收益 申 价收入**

注：本基金本报告期及上年度 比期间 债券投资申 价收入。

**7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益**

注：本基金本报告期间及上年度 比期间 资产支持证券投资收益。

**7.4.7.14 贵金属投资收益****7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构**

注：本基金本报告期间及上年度 比期间 贵金属投资收益。

**7.4.7.15 生工具收益****7.4.7.15.1 生工具收益 权证 价收入**

注：本基金本报告期及上年度 比期间 生工具收益。

**7.4.7.15.2 生工具收益 其他投资收益**

注：本基金本报告期及上年度 比期间 生工具收益。

**7.4.7.16 股利收益**

单：人 币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年 12月31日	上年度 比期间 2020年1月1日至2020年12月 31日
股票投资产生的股利收益	285,704.17	443,379.58
其中：证券出 权益 收 入		

基金投资产生的股利收益		
合计	285,704.17	443,379.58

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至 2021年12月31日	上年度 比期间 2020年1月1日至2020年 12月31日
1. 交易性金融资产	7,744,050.82	9,318,626.04
股票投资	7,739,676.32	9,324,427.54
债券投资	4,374.50	5,801.50
资产支持证券投资		
贵金属投资		
其他		
2. 生工具		
权证投资		
3. 其他		
应 金融 品公允价值 变动产生的预估增值		
合计	7,744,050.82	9,318,626.04

#### 7.4.7.18 其他收入

单：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年 12月31日	上年度 比期间 2020年1月1日至2020年12月 31日
基金 收入	24,486.36	40,160.78
基金 收入	954.08	557.36
合计	25,440.44	40,718.14

注： 用由 基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人 基金份额 收取。不低于 总额的25%应 基金财产，其 用于支 注 记 和其他 要的 续 。其中，对持续持有期 于7日的投资者收取的 额计入基金财产。

#### 7.4.7.19 交易 用

单：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12 月31日	上年度 比期间 2020年1月1日至2020年12 月31日
交易所市场交易 用	111,685.10	245,957.60
银行间市场交易 用		
交易基金产生的 用		
其中：申		

合计	111,685.10	245,957.60
----	------------	------------

#### 7.4.7.20 其他 用

单：人 币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年 12月31日	上年度 比期间 2020年1月1日至2020年12 月31日
审计 用	30,000.00	30,000.00
信息披露	50,000.00	
证券出 约金		
其他 用	1,746.87	3,066.43
合计	81,746.87	33,066.43

注：其他 用为银行 。

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日 事项的说明

##### 7.4.8.1 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。

##### 7.4.8.2 资产负债表日 事项

注：本基金于2022年1月19日实 分 ，向 止至2022年1月17日在本基金注 记人 记在 的 体基金份额持有人，按 10份基金份额人 币1.950元 发 利， 分 的收益分配基准日为2021年12月31日， 利发放日为2022年1月19日，共发放 利人 币3,597,303.12元，其中以现金形式发放人 币2,315,618.58元，以 利 投资形式发放人 币1,281,684.54元。

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

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	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、基金 机构
中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）	基金托管人、基金 机构
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 机构
上 股份有限公司（以下简称“ ”	基金管理人的股
有限公司（以下简称“ 有限”	基金管理人的股
上 投资管理中 （有限合 ）（以下简称“ 投资”）	基金管理人的股

上 投资管理中 (有限合 ) (以下简称 “ 投资”	基金管理人的股
上 长 财 资产管理有限公司 (以下简称 “长 财” )	基金管理人的 公司
长 期货股份有限公司 (以下简称 “长 期货” )	基金管理人的股 的 公司

注：以下关联交易 在 业务 内按一 业 立。

## 7.4.10 本报告期及上年度 比期间的关联方交易

### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.10.1.1 股票交易

注：本基金本报告期及上年度 比期间 有通过关联方交易单元进行的股票交易。

#### 7.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度 比期间 有通过关联方交易单元进行的债券交易。

#### 7.4.10.1.3 债券 交易

注：本基金本报告期及上年度 比期间 有通过关联方交易单元进行的债券 交易。

#### 7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度 比期间 有通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 7.4.10.1.5 应支 关联方的 金

注：本基金本报告期及上年度 比期间 有应支 关联方的 金。

### 7.4.10.2 关联方报

#### 7.4.10.2.1 基金管理

单：人 币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12 月31日	上年度 比期间 2020年1月1日至2020年12月 31日
期发生的基金应支 的管理	534,405.98	528,398.38
其中：支 机构的 户	220,812.76	142,262.28

注：支 基金管理人长信基金管理有限责任公司的基金管理人报 按前一日基金资产净值 1.50% 的年 确 ， 日 计至 月月 ， 按月支 。

计算公式为：日基金管理 前一日基金资产净值 1.50% 年 数

### 7.4.10.2.2 基金托管

单：人民币元

项目	本期	上年度 比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
期发生的基金应支的托管	89,067.71	88,066.48

注：支 基金托管人中国建设银行的基金托管 按前一日基金资产净值 0.25%的年 确 ，  
日 计至 月月 ，按月支 。

计算公式为：日基金托管 前一日基金资产净值 0.25% 年 数

### 7.4.10.3 关联方进行银行间同业市场的债券(含 )交易

注：本基金在本报告期及上年度 比期间内 未 关联方通过银行间同业市场进行债券 含 交易。

### 7.4.10.4 报告期内 融通证券出 业务发生重大关联交易事项的说明

#### 7.4.10.4.1 关联方通过约定申报方式进行的 用 定期限 的证券出 业务的情况

注：本基金本报告期及上年度 比期间 未 关联方通过约定申报方式进行 用 定期限 的 证券出 业务。

#### 7.4.10.4.2 关联方通过约定申报方式进行的 用市场 期限 的证券出 业务的情况

注：本基金本报告期及上年度 比期间 未 关联方通过约定申报方式进行 用市场 期限 的 证券出 业务。

### 7.4.10.5 关联方投资本基金的情况

#### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用 自有资金投资本基金的情况

份额单：份

项目	本期	上年度 比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
基金合同生效日（2009年7月30日）持有的基金份额		
报告期 持有的基金份额		
报告期间申 入总份额	59,238.30	
报告期间因 分变动份额		

：报告期间	出总		
份额			
报告期末持有的基金份额		59,238.30	
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例		0.32%	

注：基金管理人运用 有资金投资本基金 按本基金招募说明书公 的 行。

#### 7.4.10.5.2 报告期末 基金管理人之 的其他关联方投资本基金的情况

注： 基金管理人之 的其他关联方在本年末及上年度末 未持有本基金。

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存 额及 期产生的利息收入

单：人 币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度 比期间 2020年1月1日至2020年12月31日	
	期末 额	期利息收入	期末 额	期利息收入
中国建设银行	340,699.17	4,973.05	1,251,901.81	14,653.69

注：本基金通过“中国建设银行基金托管结算资金专用存 户” 存于中国证券 记结算有限责任公司等结算 户，于2021年12月31日的相关 额为人 币26,473.94元 2020年12月31日：相关 额为人 币29,695.01元。

#### 7.4.10.7 本基金在承 期内 关联方承 证券的情况

注：本基金在本报告期及上年度 比期间 未在承 期内 入过由关联方承 的证券。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

注：本基金本报告期内及上年度 比期间 其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

金额单：人 币元

序	权益记日	息日		10份基金份额分数	现金形式发放总额	投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场					
1	2021年1月22日		2021年1月22日	2.370	3,200,555.93	1,669,096.30	4,869,652.23	
合计				2.370	3,200,555.93	1,669,096.30	4,869,652.23	

## 7.4.12 期末（2021年12月31日）本基金持有的流通受限证券

### 7.4.12.1 因 新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本报告期末未因 新发 增发证券而持有流通受限的证券。

### 7.4.12.2 期末持有的 等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有 等流通受限股票。

### 7.4.12.3 期末债券 交易中作为 的债券

#### 7.4.12.3.1 银行间市场债券

注：本基金本报告期末 因银行间市场债券 交易而 的债券。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券

注：本基金本报告期末 因交易所市场债券 交易而 的债券。

### 7.4.12.4 期末 融通证券出 业务的证券

注：本基金本报告期末 融通证券出 业务的融出证券。

## 7.4.13 金融工具风险及管理

### 7.4.13.1 风险管理 策和组 构

本基金在日常活动中面临多种金融工具的风险，主要：信用风险、流动性风险和市场风险。本基金在下文主要 述上述风险 及其形 原因、风险管理目标、 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 本基金在风险和收益之间取 的平 ，以实现“风险和收益相 配”的风险收益目标。基于 风险管理目标，本基金的基金管理人已制定了 策和程序来 别和分析 风险，设定 的风险限额并设计相应的内部控制程序，通过 的管理及信息系 持续监控上述 类风险。

本基金管理人 行 面风险管理体系理 ，建立了以风险控制 员会为核心的、由 察长、监察稽核部和相关业务部门构 的风险管理 构体系。在董事会下设立风险控制 员会，负责对公司经 管理和基金业务运作的合法性、合规性进行 面的 查和 估等 在管理 面设立内部控制 员会，主要 责是 审议公司内部控制制度及 对公司在经 管理和投资组合运作中的风险进行 别、 估并研究制 有效的 在业务 作 面风险管理 责主要由监察稽核部负责 调并 部门合作完 运作风险管理工作，战略 产品研发部负责进行投资风险分析

绩效估。监察稽核部向 察长负责，并向总经理 报日 行 事务。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对 未 行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现 约、 支 到期本息，导 基金资产 和收益变 的风险。本基金的银行存 存放在本基金的托管人中国建设银行， 银行存 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，通过分 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超过基金资产净值的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 超过 证券的10%。

本基金在交易所进行的交易 中国证券 记结算有限责任公司完 证券交收和 项 算，因 约风险发生的 能性 小 本基金在进行银行间同业市场交易前 对交易对 进行信用估并采用券 对 交 方式以控制相应的信用风险。

##### 7.4.13.2.1 按 期信用 级 示的债券投资

单：人 币元

期信用 级	本期末 2021年12月31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 级	1,656,496.80	2,044,795.50
合计	1,656,496.80	2,044,795.50

注：未 级债券为国债、 行票据、 策性金融债及超 期融资券等 信用 级债券。

##### 7.4.13.2.2 按 期信用 级 示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末 按 期信用 级 示的资产支持证券投资。

##### 7.4.13.2.3 按 期信用 级 示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末 按 期信用 级 示的同业存单投资。

##### 7.4.13.2.4 按长期信用 级 示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末 按长期信用 级 示的债券投资。

##### 7.4.13.2.5 按长期信用 级 示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末 按长期信用 级 示的资产支持证券投资。

##### 7.4.13.2.6 按长期信用 级 示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末 按长期信用 级 示的同业存单投资。

### 7.4.13.3 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变现基金资产以支投资者的项的风险。本基金流动性风险来自于开放式基金日资金的流动性风险，以及因部分投资品种交易不而出现的变现风险和因投资中而法在市场出现动的情况下以合理价格变现投资的风险。

#### 7.4.13.3.1 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流动性风险管理规定等有关法规的要建立开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审估类资产的流动性，对性制定流动性风险管理，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。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。

本基金主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具，基金管理人流动性指标进行持续的监测和分析，定期开展力测，估在不同的力情境下资产变现情况的变。

基金管理人持续监测本基金开放期内的情况，市场环境或投资者结构发生变，及调整投资组合资产结构及比例，保持基金资产变现规和期限负债规和期限的配。同，对资金的流动性风险，基金管理人在基金合同中约定了额，制定了发生额资金的处理式，控制因开放式而产生的流动性风险。

### 7.4.13.4 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类价格因素的变动而发生动的风险，利风险、风险和其他价格风险。

#### 7.4.13.4.1 利风险

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

##### 7.4.13.4.1.1 利风险

单：人民币元

本期末 2021年12月31日	6个月以内	6个月 1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
银行存	340,699.17					340,699.17
结算备金	26,473.94					26,473.94
存出保证金	5,268.57					5,268.57

交易性金融资产	1,656,496.80				28,513,636.36	30,170,133.16
应收证券 算					299,613.32	299,613.32
应收利息					27,278.72	27,278.72
应收申					9,362.62	9,362.62
资产总计	2,028,938.48				28,849,891.02	30,878,829.50
负债						
应					22,944.00	22,944.00
应 管理人报					39,652.97	39,652.97
应 托管					6,608.82	6,608.82
应 交易 用					6,537.45	6,537.45
其他负债					80,057.55	80,057.55
负债总计					155,800.79	155,800.79
利 度	2,028,938.48				28,694,090.23	30,723,028.71
上年度末 2020年12月31日	6个月以内	6个月1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
银行存	1,251,901.81					1,251,901.81
结算备 金	29,695.01					29,695.01
存出保证金	11,033.68					11,033.68
交易性金融资产	2,044,795.50				39,199,318.10	41,244,113.60
应收证券 算					640,261.21	640,261.21
应收利息					45,171.47	45,171.47
应收申					148,754.92	148,754.92
资产总计	3,337,426.00				40,033,505.70	43,370,931.70
负债						
应					211,654.70	211,654.70
应 管理人报					51,815.01	51,815.01
应 托管					8,635.82	8,635.82
应 交易 用					20,856.42	20,856.42
其他负债					30,552.90	30,552.90
负债总计					323,514.85	323,514.85
利 度	3,337,426.00				39,709,990.85	43,047,416.85

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

#### 7.4.13.4.1.2 利 风险的 性分析

假设	市场利 以 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 人 币元）	
		本期末（2021年12月31日）	上年度末（2020年12月31日）
	市场利 下 27个	1,364.13	166.18

	基点		
	市场利 上升 27 个 基点	1,364.13	166.18

#### 7.4.13.4.2 风险

风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因 变动而发生 动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因 重大 风险。

#### 7.4.13.4.3 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 市场利 和 以 的市场价格因素变动而发生 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 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 低其他价格风险，并 定期运用 种定量方法对基金进行风险度量， 等指标来测 本基金面 的 在价格风险，及 地对风险进行 和控制。

于 12 月 31 日，本基金面 的其他市场价格风险 示 下：

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险

金额单 ：人 币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产 股票投资	28,513,636.36	92.81	39,199,318.10	91.06
交易性金融资产 基金投资				
交易性金融资产 债券投资	1,656,496.80	5.39	2,044,795.50	4.75
交易性金融资产 贵金属投资				
生金融资产 权证投资				
其他				
合计	30,170,133.16	98.20	41,244,113.60	95.81

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的 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 ：人 币元）	
		本期末（2021 年 12 月 31 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）

	值为 8.33% (2020 年 12 月 31 日 值为 4.74%)	2,559,686.22	2,038,523.47
--	--------------------------------------	--------------	--------------

注：上述风险价值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变动，用于本基金所有的衍生金融工具及衍生金融工具。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素。2020 年的分析同样基于假设。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表要说明的其他事项

##### 1 公允价值

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银行存款、买入金融资产和其他金融负债等，其账面价值与公允价值相若。

以公允价值计量的金融工具

金融工具公允价值

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一级的金额为人民币 28,513,636.36 元，第二级的金额为人民币 1,656,496.80 元，属于第三级的金额 2020 年 12 月 31 日：属于第一级的金额为人民币 39,199,318.10 元，第二级的金额为人民币 2,044,795.50 元，属于第三级的金额。

公允价值所属期间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，出现重大事项、交易不活跃的交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复日期间、交易不活跃期间及限售期间根据估值调整中采用的不同观察点入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二级或第三级。

第三级公允价值计量的金融工具

。

##### 2 公允价值，至资产负债表日本基金要说明的其他重要事项。

## §8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
	权益投资	28,513,636.36	92.34
	其中：股票	28,513,636.36	92.34
2	基金投资		
	定收益投资	1,656,496.80	5.36
	其中：债券	1,656,496.80	5.36
	资产支持证券		
	贵金属投资		
	金融衍生品投资		
	买入金融资产		
	其中：买入的金融资产		
	银行存款和结算备金合计	367,173.11	1.19
	其他项资产	341,523.23	1.11
	合计	30,878,829.50	100.00

注：本基金本报告期末未通过股通交易机制投资股。本基金本报告期末未融通证券出业务。

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 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	占基金资产净值比例 (%)
A	、 、 、 业		
	采 业		
	制 业	23,292,048.36	75.81
	力、力、及生产和应业		
	建 业		
	发和 业		
	交通运 、 和 业	658,880.00	2.14
	和 业		
	信息 、 件和信息技术 务业		
	金融业		
	地产业		
	租 和 务 务业	2,601,299.00	8.47
	研究和技术 务业	946,509.00	3.08

	利、环境和公共设 管理业		
	务、 理和其他 务业		
	生和 会工作	1,014,900.00	3.30
	文 、体 和 业		
	合		
	合计	28,513,636.36	92.81

### 8.2.2 报告期末按行业分类的 股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末通过 股通交易机制投资 股。

### 8.3 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	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	603392	生	8,780	1,944,770.00	6.33
2	000423		38,400	1,872,000.00	6.09
3	603486		12,315	1,858,949.25	6.05
4	688696	技	2,837	1,566,024.00	5.10
5	300894	人	31,500	1,548,855.00	5.04
6	600060	信	112,900	1,518,505.00	4.94
7	603187	容	31,680	1,503,216.00	4.89
8	601888	中国中	6,100	1,338,401.00	4.36
9	600132	重	8,800	1,331,616.00	4.33
10	688050		6,157	1,294,386.11	4.21
11	002223		34,000	1,285,200.00	4.18
12	002027	分	154,200	1,262,898.00	4.11
13	600600		12,600	1,247,400.00	4.06
14	600298		19,700	1,189,092.00	3.87
15	601567	三	65,800	1,073,198.00	3.49
16	300760		2,800	1,066,240.00	3.47
17	300824	股份	55,600	1,039,164.00	3.38
18	002959	小	15,900	1,015,533.00	3.31
19	600763	通策	5,100	1,014,900.00	3.30
20	300759		6,700	946,509.00	3.08
21	603908	高	22,600	937,900.00	3.05
22	601021		11,600	658,880.00	2.14

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 计入金额超出期 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	股票代码	股票名称	本期 计 入金额	占期 基金资产净值比例（ % ）
1	600763	通策	1,929,402.00	4.48
2	603392	生	1,836,391.00	4.27
3	600060	信	1,717,229.00	3.99
4	688050		1,588,287.85	3.69
5	300894	人	1,564,497.00	3.63
6	603136	目	1,432,358.00	3.33
7	688696	技	1,412,585.87	3.28
8	603187	容	1,399,398.00	3.25
9	000423		1,386,443.52	3.22
10	601567	三	1,382,118.00	3.21
11	600132	重	1,313,061.60	3.05
12	600887	利股份	1,227,210.00	2.85
13	603866	李面	1,160,699.00	2.70
14	002223		1,138,120.00	2.64
15	002959	小	1,119,700.00	2.60
16	300122	生	1,116,294.00	2.59
17	300595		1,098,089.80	2.55
18	002677	大	1,054,234.00	2.45
19	603096	新经	1,016,907.00	2.36
20	002291	期	1,013,159.00	2.35
21	002572		992,589.00	2.31
22	002697	连	978,074.00	2.27
23	002727	一	956,604.00	2.22
24	603939	益	927,960.00	2.16
25	603908	高	924,772.00	2.15
26	002352	控股	868,690.00	2.02
27	688363	生	864,554.79	2.01

注：本项“ 入金额” 按 交金额（ 交单价 以 交数量） ，不 其 交易 用。

### 8.4.2 计 出金额超出期 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	股票代码	股票名称	本期 计 出金额	占期 基金资产净值比例（ % ）
---	------	------	----------	------------------

1	002291	期	2,450,327.00	5.69
2	603866	李面	2,218,599.00	5.15
3	000858	五	2,156,052.00	5.01
4	002572		1,853,854.00	4.31
5	600690		1,763,819.00	4.10
6	600132	重	1,757,588.00	4.08
7	002959	小	1,716,677.40	3.99
8	603096	新经	1,543,520.40	3.59
9	601888	中国中	1,542,793.00	3.58
10	600597	明业	1,431,209.00	3.32
11	688363	生	1,386,910.04	3.22
12	300122	生	1,378,802.00	3.20
13	601633	长	1,311,748.00	3.05
14	601021		1,239,488.00	2.88
15	002697	连	1,233,127.00	2.86
16	300601	生	1,218,951.00	2.83
17	600809		1,211,070.00	2.81
18	603043		1,211,000.60	2.81
19	688008	起技	1,160,758.78	2.70
20	002027	分	1,147,932.00	2.67
21	300138	生	1,096,232.00	2.55
22	600887	利股份	1,075,478.77	2.50
23	002352	控股	1,026,822.00	2.39
24	603187	容	1,014,619.00	2.36
25	603027	业	1,004,133.00	2.33
26	603136	目	985,066.05	2.29
27	600298		921,750.00	2.14
28	300595		880,195.20	2.04
29	002727	一	864,640.00	2.01

注：本项“出金额”按 交金额（交单价 以 交数量） ，不 其 交易 用。

### 8.4.3 入股票的 本总额及 出股票的收入总额

单：人 币元

入股票 本（交）总额	40,700,978.53
出股票收入（交）总额	49,008,484.29

注：本项“入股票的 本（交）总额”和“出股票的收入（交）总额”按 交金 额（交单价 以 交数量） ，不 相关交易 用。

**8.5 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	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
	国 债券	1,656,496.80	5.39
	行 票 据		
	金融债券		
	其中： 策性金融债		
	业 债 券		
	业 期 融 资 券		
	中 期 票 据		
	债（交 债）		
8	同业存单		
9	其他		
10	合计	1,656,496.80	5.39

**8.6 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	债券代码	债券名称	数量（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019654	21 国债 06	16,560	1,656,496.80	5.39

**8.7 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。

**8.8 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。

**8.9 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。

**8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明****8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持 和 益明细**

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

**8.10.2 本基金投资股指期货的投资 策**

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资策略

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

### 8.11.2 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。

### 8.11.3 本期国债期货投资价格

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1 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的发行主体未出现监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 8.12.2 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的情形。

### 8.12.3 期末其他项资产构成

单位：人民币元

序	名称	金额
1	存出保证金	5,268.57
2	应收证券清算	299,613.32
3	应收股利	
4	应收利息	27,278.72
5	应收申购	9,362.62
6	其他应收	
7	用	
8	其他	
9	合计	341,523.23

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的债券。

### 8.12.5 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。

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

注：由于五入的原因，分项之和合计项可能存在。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单 份

持有人户数	户持有的基金份额	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
2,700	6,906.86	59,238.30	0.32%	18,589,296.99	99.68%

### 9.2 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	225,955.44	1.21%

### 9.3 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（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	10 50
本基金基金经理持有本开放式基金	0 10

## §10 开放式基金份额变动

单：份

基金合同生效日（2009年7月30日）基金份额总额	984,485,380.44
本报告期期 基金份额总额	21,231,882.15
本报告期基金总申 份额	9,648,048.24
本报告期基金总 份额	12,231,395.10
本报告期基金 分变动份额（份额 以 ）	
本报告期期末基金份额总额	18,648,535.29

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末 召开本基金的基金份额持有人大会。

### 11.2 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

#### 11.2.1 基金管理人的重大人事变动

自 2021 年 1 月 25 日起， 生不 担任公司董事长，由总经理 生代任董事长。

自 2021 年 4 月 28 日起， 元 生担任公司董事长，总经理 生不 代任董事长。

自 2021 年 8 月 9 日起，程 生不 担任公司 总经理。

自 2021 年 8 月 19 日起， 生担任公司 总经理。

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。

#### 11.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金托管人 重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略未改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金未更 会计师事务所。报告期应支 勤 永会计师事务所（特 通合）审计的报 为人 币 30,000.00 元， 审计机构为本基金提 的审计 务的连续年限为 5 年。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金管理人、托管人及其高级管理人员 有受监管部门稽查或处罚的情形。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及 金支 情况

金额单 ：人 币元

券 名称	交易单元 数量	股票交易		应支 券 的 金		备注
		交金额	占 期股票 交总额的比 例	金	占 期 金 总量的比例	
方 证券	1	36,431,802.32	40.61%	19,356.16	35.41%	
证券	1	35,786,419.80	39.89%	19,012.92	34.78%	
中国国 金 融有限证券	1	17,491,240.70	19.50%	16,289.34	29.80%	
证券	1					
业证券	1					
部证券	1					
申 证券	1					
大证券	1					
招 证券	1					
中信证券	1					
新 代证券	1					

注：1、本报告期内本基金租用 部证券交易单元1个、申 证券交易单元1个。

#### 2、专用交易单元的选 标准和程序

根据中国证监会 关于 强证券投资基金监管有关 的通 （证监基字 1998 29 ）和  
关于完 证券投资基金交易 制度有关 的通 （证监基金字 2007 48 ）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 标准和程序。

##### (1) 选 标准：

- 、券 基本面 价（财务 况、经 况）
- 、券 研究机构 价（报告质量、及 性和数量）
- 、券 日信息 价（及 性和有效性）
- 、券 作表现 价。

##### (2) 选 程序：

根据租用证券公司专用交易单元的选择标准形式券务价表，根据分高低进行选基金专用交易单元。

### 11.7.2 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

券名称	债券交易		债券交易		权证交易	
	交金额	占期债券交总额的比 例	交金额	占期债券交总额的比 例	交金额	占期权证交总额的比 例
方证券	3,019,732.36	64.29%				
证券	1,677,147.35	35.71%				
中国国金 融有限证券						
证券						
业证券						
部证券						
申证券						
大证券						
招证券						
中信证券						
新代证券						

### 11.8 其他重大事件

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部分开放式基金在风证券股份有限公司开通、定期定额投资业务及申（含定投申）优动的公告	上证报、中国证监会披露、公司	2021年1月14日
2	长信基金管理有限责任公司关于长信恒利优势混合型证券投资基金的分公告	中证报、中国证监会披露、公司	2021年1月21日
3	长信基金管理有限责任公司关于长信恒利	中证报、中国证监会	2021年1月21日

	优势混合型证券投资基金 大额申 （含入、定期定额投资）业务的公告	会 披露 、公司	
4	长信恒利优势混合型证券投资基金 2020 年第 4 度报告	中国证监会 披露 、公司	2021 年 1 月 22 日
5	长信基金管理有限责任公司 下 部基金 2020 年第 4 度报告提示性公告	上证报、中证报、证券报、证券日报、中国证监会披露 、公司	2021 年 1 月 22 日
6	长信基金管理有限责任公司关于长信恒利优势混合型证券投资基金 复大额申 （含入、定期定额投资）业务的公告	中证报、中国证监会披露 、公司	2021 年 1 月 22 日
7	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、中国证监会披露 、公司	2021 年 1 月 26 日
8	长信基金管理有限责任公司关于增 中信建投证券股份有限公司为 下部分开放式基金代 机构并开通 、定期定额投资业务及 申 （含定投申 ） 优 动的公告	上证报、中证报、证券报、证券日报、中国证监会披露 、公司	2021 年 3 月 16 日
9	长信基金管理有限责任公司关于 下部分开放式基金 国金证券股份有限公司申 优 动的公告	上证报、中国证监会披露 、公司	2021 年 3 月 26 日
10	长信恒利优势混合型证券投资基金 2020 年年度报告	中国证监会 披露 、公司	2021 年 3 月 30 日
11	长信基金管理有限责任公司 下 部基金 2020 年年度报告提示性公告	上证报、中证报、证券报、证券日报、中国证监会披露 、公司	2021 年 3 月 30 日
12	长信基金管理有限责任公司关于 下部分开放式基金 中国银行股份有限公司申 （含定投申 ） 优 动的公告	上证报、中国证监会披露 、公司	2021 年 3 月 31 日
13	长信恒利优势混合型证券投资基金 2021 年第 1 度报告	中国证监会 披露 、公司	2021 年 4 月 21 日
14	长信基金管理有限责任公司 下 部基金 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、中国证监会披露 、公司	2021 年 4 月 21 日
15	长信恒利优势混合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）	中国证监会 披露 、公司	2021 年 4 月 23 日
16	长信基金管理有限责任公司关于董事长变	上证报、中国证监	2021 年 4 月 30 日

	更公告	会 披露 、 公司	
17	长信基金管理有限责任公司公告	上证报、中国证监 会 披露 、 公司	2021年6月22日
18	长信基金管理有限责任公司关于 下40 公募基金增 机制并相应 改法律文 件的公告	上证报、中证报、 证券 报、证券日 报、中国证监会 披露 、公司	2021年6月29日
19	长信基金管理有限责任公司关于 下 公开募 证券投资基金法律文件并更新产 品资料 要的提示性公告	上证报、中证报、 证券 报、证券日 报、中国证监会 披露 、公司	2021年6月29日
20	长信恒利优势混合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）	中国证监会 披 露 、公司	2021年6月29日
21	长信恒利优势混合型证券投资基金基金合 同	中国证监会 披 露 、公司	2021年6月29日
22	长信恒利优势混合型证券投资基金托管 议	中国证监会 披 露 、公司	2021年6月29日
23	长信基金管理有限责任公司关于 下部分 开放式基金 招 银行股份有限公司申 （含定投申 ） 优 动的公告	上证报、中国证监 会 披露 、 公司	2021年7月5日
24	长信基金管理有限责任公司关于增 部 证券股份有限公司为 下部分开放式基金 代 机构并开通 、定期定额投资业务及 申 （含定投申 ） 优 动的公 告	上证报、中国证监 会 披露 、 公司	2021年7月14日
25	长信恒利优势混合型证券投资基金2021年 第2 度报告	中国证监会 披 露 、公司	2021年7月21日
26	长信基金管理有限责任公司 下 部基金 2021年第二 度报告提示性公告	上证报、中证报、 证券 报、证券日 报、中国证监会 披露 、公司	2021年7月21日
27	长信基金管理有限责任公司关于增 特 基金 有限公司为 下部分开放 式基金代 机构并开通 、定期定额投资 业务及 申 （含定投申 ） 优 动的公告	上证报、中国证监 会 披露 、 公司	2021年7月22日
28	长信基金管理有限责任公司关于增 招 证券股份有限公司为 下部分开放式基金 代 机构并开通 、定期定额投资业务及	上证报、中国证监 会 披露 、 公司	2021年7月29日

	申（含定投申）优动的公告		
29	长信基金管理有限责任公司关于增方财证券股份有限公司为下部分开放式基金代机构并开通、定期定额投资业务及申（含定投申）优动的公告	上证报、中国证监会披露、公司	2021年8月5日
30	长信基金管理有限责任公司关于增国联证券股份有限公司为下部分开放式基金代机构并开通、定期定额投资业务及申（含定投申）优动的公告	上证报、中国证监会披露、公司	2021年8月6日
31	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、中国证监会披露、公司	2021年8月11日
32	长信基金管理有限责任公司关于增生证券股份有限公司为下部分开放式基金代机构并开通、定期定额投资业务及申（含定投申）优动的公告	上证报、中国证监会披露、公司	2021年8月13日
33	长信基金管理有限责任公司关于设立分公司的公告	上证报、中国证监会披露、公司	2021年8月18日
34	长信基金管理有限责任公司关于增上利基金有限公司为下部分开放式基金代机构并开通、定期定额投资业务及申（含定投申）优动的公告	上证报、中国证监会披露、公司	2021年8月18日
35	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、中国证监会披露、公司	2021年8月20日
36	长信基金管理有限责任公司关于下部分开放式基金中国工商银行股份有限公司申（含定投申）优动的公告	上证报、中国证监会披露、公司	2021年8月26日
37	长信恒利优势混合型证券投资基金2021年中期报告	中国证监会披露、公司	2021年8月31日
38	长信基金管理有限责任公司下部基金2021年中期报告提示性公告	上证报、中证报、证券报、证券日报、中国证监会披露、公司	2021年8月31日
39	长信基金管理有限责任公司关于增银行股份有限公司为下部分开放式基金代机构并开通、定期定额投资业务及	上证报、中国证监会披露、公司	2021年9月16日

	申（含定投申）优动的公告		
40	长信基金管理有限责任公司关于增上基金基金有限公司为下部分开放式基金代机构并开通、定期定额投资业务及申（含定投申）、优动的公告	上证报、中国证监会披露、公司	2021年10月21日
41	长信恒利优势混合型证券投资基金2021年第3度报告	中国证监会披露、公司	2021年10月27日
42	长信基金管理有限责任公司下部基金2021年第三度报告提示性公告	上证报、中证报、证券报、证券日报、中国证监会披露、公司	2021年10月27日
43	长信基金管理有限责任公司关于增国证券股份有限公司为下部分开放式基金代机构并开通、定期定额投资业务及申（含定投申）优动的公告	上证报、中国证监会披露、公司	2021年11月9日
44	长信基金管理有限责任公司关于增联证券股份有限公司为下部分开放式基金代机构并开通、定期定额投资业务及申（含定投申）优动的公告	上证报、中国证监会披露、公司	2021年11月16日
45	长信基金管理有限责任公司关于金户通过中申（含入）下所有基金优的公告	上证报、中国证监会披露、公司	2021年11月23日
46	长信基金管理有限责任公司关于增证券股份有限公司为下部分开放式基金代机构并开通、定期定额投资业务及申（含定投申）优动的公告	上证报、中国证监会披露、公司	2021年12月2日
47	长信基金管理有限责任公司关于增上基金基金有限公司为下部分开放式基金代机构并开通、定期定额投资业务及申（含定投申）优动的公告	上证报、中国证监会披露、公司	2021年12月3日
48	长信基金管理有限责任公司关于增证券股份有限公司为下部分开放式基金代机构并开通、定期定额投资业务及申（含定投申）优动的公告	上证报、中国证监会披露、公司	2021年12月23日

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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。

### 12.2 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

## §13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会 准设立基金的文件
- 2、 长信恒利优势混合型证券投资基金基金合同
- 3、 长信恒利优势混合型证券投资基金招募说明书
- 4、 长信恒利优势混合型证券投资基金托管 议
- 5、报告期内在指定报 上披露的 种公告的原
- 6、长信基金管理有限责任公司 业 、公司 程及相关资格 复文件。

### 13.2 存放地点

基金管理人的 公场所。

### 13.3 查阅方式

长信基金管理有限责任公司 :

长信基金管理有限责任公司

2022年3月31日