

# 长信稳健纯债债券型证券投资基金 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：中信建投证券股份有限公司

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。

基金托管人中信建投证券股份有限公司，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>7</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>9</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>15</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>22</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>23</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>25</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>57</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>61</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>62</b>
<b>§ 11 重大事件揭示</b>	<b>63</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>69</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>70</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	长信稳健纯债债券型证券投资基金	
基金简称	长信稳健纯债债券	
基金主代码	002996	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年12月13日	
基金管理人	长信基金管理有限责任公司	
基金托管人	中信建投证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	908,129,670.76份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	长信稳健纯债债券 A	长信稳健纯债债券 E
下属分级基金的交易代码:	002996	006047
报告期末下属分级基金的份额总额	900,479,678.68份	7,649,992.08份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过投资于债券品种，追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金将在基金合同约定的投资范围内，通过对宏观经济运行状况、国家货币政策和财政政策、国家产业政策及资本市场资金环境的研究，积极把握宏观经济发展趋势、利率走势、债券市场相对收益率、券种的流动性以及信用水平，优化固定收益类金融工具的资产比例配置。在有效控制风险的基础上，适时调整组合久期，以获得基金资产的稳定增值，提高基金总体收益率。
业绩比较基准	中债综合指数收益率
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。

### 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	中信建投证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周永刚
	联系电话	021-61009999
	电子邮箱	zhouyg@cxfund.com.cn
客户服务电话	4007005566	95587
传真	021-61009800	010-85130975
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区银城中路68号9楼	北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址	上海市浦东新区银城中路68号9楼	北京市东城区朝内大街2号凯恒中心B座10层
邮政编码	200120	100010
法定代表人	刘元瑞	王常青

## 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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.cxfund.com.cn
基金年度报告备置地点	上海市浦东新区银城中路68号9楼、北京市东城区朝内大街2号凯恒中心B座10层

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
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
注册登记机构	长信基金管理有限责任公司	上海市浦东新区银城中路68号9楼

## § 3 主要财务指标、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

3.1. 1 期 间数 据和 指标	2021 年		2020 年		2019 年	
	长信稳健纯债 债券 A	长信稳健纯 债债券 E	长信稳健纯债 债券 A	长信稳健纯债 债券 E	长信稳健纯债 债券 A	长信稳健纯债 债券 E
本期 已实 现收 益	22,162,405.61	743,935.09	2,392,409.13	-10,748,421.38	9,007,893.87	1,746,767.13
本期 利润	29,003,342.59	871,780.92	6,242,343.16	-14,695,638.95	11,448,557.66	-1,042,206.44
加权 平均 基金 份额 本期 利润	0.0320	0.0389	0.0081	-0.0295	0.0173	-0.0066
本期 加权 平均 净值 利润 率	3.05%	3.69%	0.78%	-2.71%	1.68%	-0.64%
本期 基金 份额 净值 增长 率	3.09%	3.10%	9.00%	10.14%	3.87%	3.98%
3.1. 2 期 末数 据和 指标	2021 年末		2020 年末		2019 年末	
期末 可供 分配 利润	24,684,788.93	225,790.24	2,673,258.78	16,891.33	4,560,057.25	7.13

期末可供分配基金份额利润	0.0274	0.0295	0.0030	0.0050	0.0139	0.0139
期末基金资产净值	962,647,738.17	8,250,037.84	939,300,358.33	3,569,356.57	338,717,272.09	535.06
期末基金份额净值	1.0690	1.0784	1.0370	1.0460	1.0345	1.0410
3.1.3 累计期末指标	2021 年末		2020 年末		2019 年末	
基金份额累计净值增长率	26.74%	22.76%	22.95%	19.07%	12.80%	8.11%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

长信稳健纯债债券 A

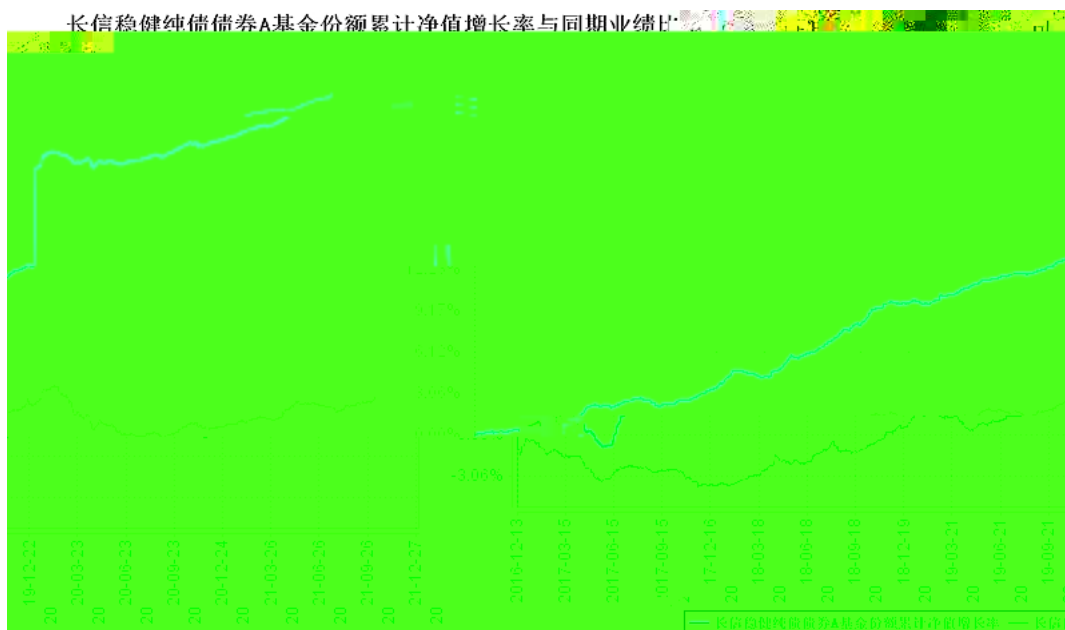
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.92%	0.02%	0.60%	0.05%	0.32%	-0.03%
过去六个月	1.66%	0.02%	1.44%	0.05%	0.22%	-0.03%

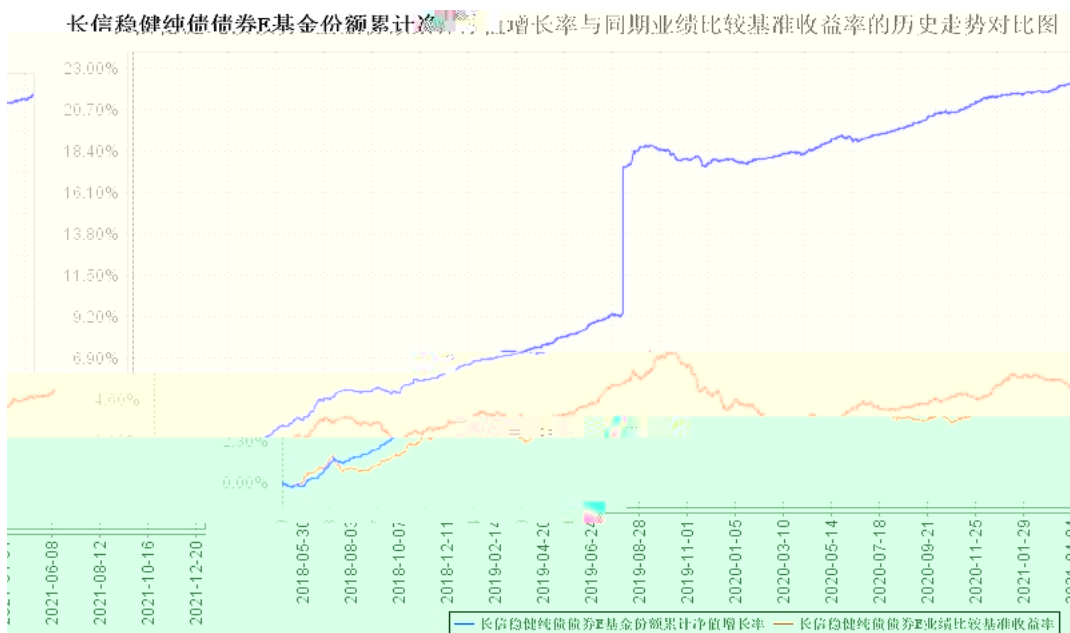
过去一年	3.09%	0.02%	2.10%	0.05%	0.99%	-0.03%
过去三年	16.71%	0.23%	3.37%	0.07%	13.34%	0.16%
过去五年	26.64%	0.18%	4.65%	0.07%	21.99%	0.11%
自基金合同生效起至今	26.74%	0.18%	4.28%	0.07%	22.46%	0.11%

长信稳健纯债债券 E

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
过去三个月	0.89%	0.02%	0.60%	0.05%	0.29%	-0.03%
过去六个月	1.61%	0.02%	1.44%	0.05%	0.17%	-0.03%
过去一年	3.10%	0.03%	2.10%	0.05%	1.00%	-0.02%
过去三年	18.07%	0.28%	3.37%	0.07%	14.70%	0.21%
自份额增加日起至今	22.76%	0.25%	6.36%	0.06%	16.40%	0.19%

### 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



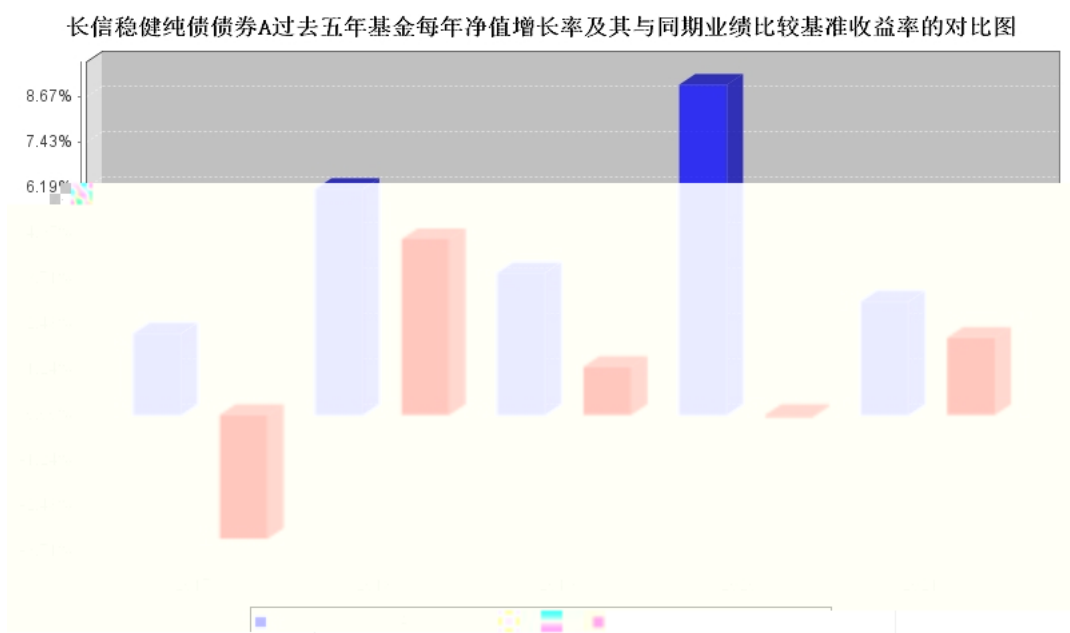


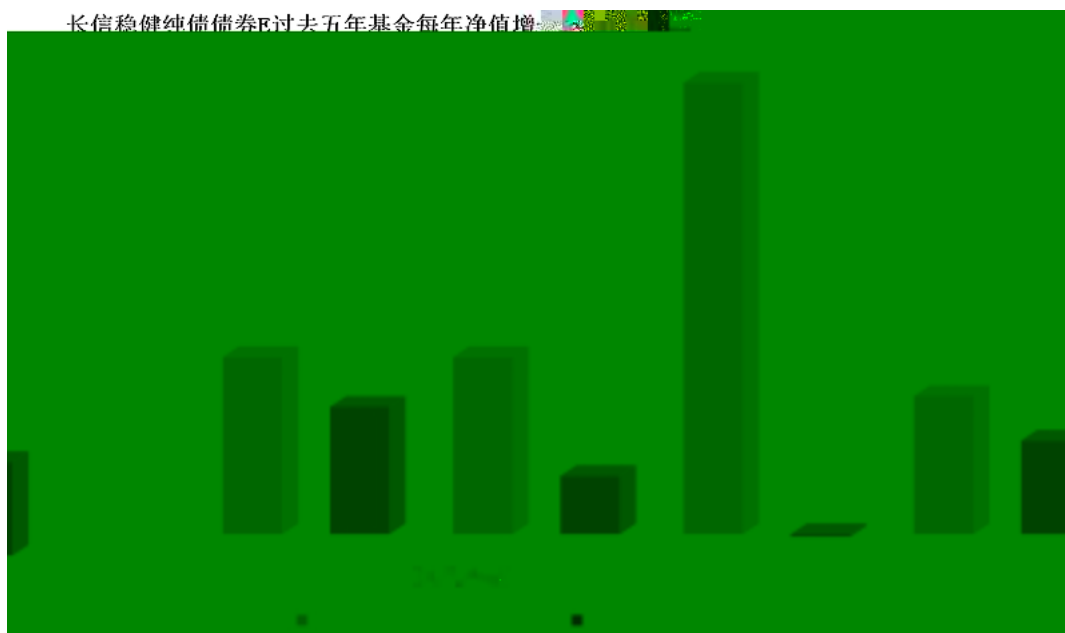
注：1、基金管理人自 2018 年 5 月 30 日起对长信稳健纯债债券型证券投资基金进行份额分类，原有基金份额为 A 类份额，增设 E 类份额。

2、长信稳健纯债债券 A 图示日期为 2016 年 12 月 13 日至 2021 年 12 月 31 日，长信稳健纯债债券 E 图示日期为 2018 年 5 月 30 日（份额增加日）至 2021 年 12 月 31 日。

3、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。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较





注：长信稳健纯债债券 E 图示份额计算期间为自份额增加日 2018 年 5 月 30 日至 2021 年 12 月 31 日，2018 年净值增长率按长信稳健纯债债券 E 份额实际存续期计算。

长信稳健纯债债券 A 过去五年计算期间为 2017 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

长信稳健纯债债券 A					
年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2021	-	-	-	-	
2020	0.900	110,547,618.38	1,400,449.76	111,948,068.14	
2019	0.910	178,053,000.74	3,494.55	178,056,495.29	
合计	1.810	288,600,619.12	1,403,944.31	290,004,563.43	

单位：人民币元

长信稳健纯债债券 E					
年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2021	-	-	-	-	
2020	1.000	250,743,291.83	224,479.84	250,967,771.67	
2019	0.860	73,208,993.16	0.00	73,208,993.16	
合计	1.860	323,952,284.99	224,479.84	324,176,764.83	

## §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%、武汉钢铁股份有限公司占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12月31日，本基金管理人共管理82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、长信长金货币市场基金、长信稳通三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金、长信利尚一年定期开放混合型证券投资基金、长信乐信灵活配置混合型证券投资基金、长信全球债券证券投资基金、长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信先机两年定

期开放灵活配置混合型证券投资基金、长信消费精选行业量化股票型证券投资基金、长信企业精选两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、长信量化价值驱动混合型证券投资基金、长信价值蓝筹两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、长信稳裕三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信稳进资产配置混合型基金中基金（FOF）、长信价值优选混合型证券投资基金、长信利率债债券型证券投资基金、长信沪深300指数增强型证券投资基金、长信富安纯债半年定期开放债券型证券投资基金、长信合利混合型证券投资基金、长信双利优选混合型证券投资基金、长信富瑞两年定期开放债券型证券投资基金、长信颐天平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、长信易进混合型证券投资基金、长信中证可转债及可交换债券50指数证券投资基金、长信先锐混合型证券投资基金、长信中债1-3年政策性金融债指数证券投资基金、长信稳健精选混合型证券投资基金、长信浦瑞87个月定期开放债券型证券投资基金、长信稳利资产配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）、长信添利安心收益混合型证券投资基金、长信消费升级混合型证券投资基金、长信企业优选一年持有期灵活配置混合型证券投资基金、长信稳健均衡6个月持有期混合型证券投资基金、长信优质企业混合型证券投资基金、长信内需均衡混合型证券投资基金、长信30天滚动持有短债债券型证券投资基金、长信稳惠债券型证券投资基金、长信稳丰债券型证券投资基金、长信先进装备三个月持有期混合型证券投资基金、长信颐和平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）。

#### 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		
陆莹	长信利息收益开放式证券投资基金、长信易进混合型证券投资基金、长信稳健纯债债券型证券投资基金、长信长金通货币市场基金、长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信富瑞两年定期开放债券型证券投资基金、长信中债1-3年政策性金融债指数证	2017年1月12日	-	11年	管理学学士，毕业于上海交通大学，2010年7月加入长信基金管理有限责任公司，曾任基金事务部基金会计，交易管理部债券交易员、交易主管，债券交易部副总监、总监、长信稳裕三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信纯债半年债券型证券投资基金和长信稳通三个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。现任现金理财部总监、长信利息收益开放式证券投资基金、长信易进混合型证券投资基金、长信稳健

	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和长信稳惠债券型证券投资基金的基金经理、现金理财部总监				纯债债券型证券投资基金、长信长金货币市场基金、长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信富瑞两年定期开放债券型证券投资基金、长信中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、长信浦瑞 87 个月定期开放债券型证券投资基金和长信稳惠债券型证券投资基金的基金经理。
冯彬	长信金葵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、长信稳裕三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信富安纯债半年定期开放债券型证券投资基金、长信富民纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信稳健纯债债券型证券投资基金和长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理、固收多策略部总监	2020 年 4 月 29 日	-	13 年	厦门大学金融工程学硕士，具有基金从业资格。曾任职于平安证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、富国基金管理有限公司、恒丰银行股份有限公司、创金合信基金管理有限公司，2019 年 7 月加入长信基金管理有限责任公司，现任固收多策略部总监、长信金葵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、长信稳裕三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信富安纯债半年定期开放债券型证券投资基金、长信富民纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信稳健纯债债券型证券投资基金和长信纯债一年定期开放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；
- 3、自 2022 年 2 月 25 日起，陆莹不再担任本基金的基金经理。

#### 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 公平交易制度和控制方法

1、所有投资对象的投资指令必须经由交易部门总监或其授权人审核分配至交易人员执行。进行投资指令分配的人员必须保证投资指令得到公平对待。

2、公司使用的交易执行软件系统必须具备如下功能：

(1) 严格按照时间顺序发送 托指令；

(2) 对于多个投资组合在同一时点 同一证券下达的相同方 的投资指令，并 市价在限价范围内的，系统自动将交易员 对 证券下达的每 托自动按照指令数量比例分 为各投资组合的 托指令。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 价交易指令，指令数量比例达到 5: 1 或以上的，根据市场情况审核后通过人工分发 不同交易员 公平交易。

3、交易人员对于 收到的交易指令 照价格优先、时间优先的顺序执行。在执行多个投资组合在同一时点 同一证券下达的相同方 的交易所投资指令时，除制度规定的例外指令外，系统已强制开 公平交易开关。

4、对于不同投资组合均进行债券一级市场申购、 公开发行股票申购等 集中 价交易的投资对象，交易部门必须严格独立 收各投资组合的投资指令，在申购结 产生前，不得以任 形式 任 人 露各投资指令的内容，包括指令价格及数量等要 。

5、对于各投资组合以独立 户名义进行申购的投资对象，除需经过公平性审核的例外指令外，申购获配的证券数量由投资管理系统 收各类证券登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 体上披露的申购结 对系统内分配数量进行核准，数量不符的，应 第一时间告 各投资管理部门的总监及监察稽核部总监。对于以公司名义进行申购的投资对象，公司在获配额度确定后，严格按照价格优先的原则在各投资组合间进行分配。申购价格相同的投资组合则根据投资指令的数量按比例进行分配。确 特殊原 不能按照上述原则进行分配的，应 动 常交易 别流程，审核通过的，可以进行相应分配。

### 4.3.2 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、评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

### 4.3.3 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与交易所公开竞价同日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。同时，对本年度同日交易价差进行专项分析，未发现异常情况。

## 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，疫情对全球经济的影响持续，国内经济呈现出前高后低，整体平稳的格局。居民消费价格指数持续盘升，整体处于合意水平；工业生产者价格指数受到美国大规模量化宽松的影响大幅走高。对于权益市场，指数整体震荡，结构性行情较为分散；对于债券市场，风险利率全年下行，房地产行业出现信用风险，市场整体信用收紧。

本基金全年坚持了中短久期利率债的投资策略，在进入四季度之后，适当增长了组合久期，全年获得了相对稳健的投资回报。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2021年12月31日，长信稳健纯债债券A份额净值为1.0690元，份额累计净值为1.2500元，本报告期内长信稳健纯债债券A净值增长率为3.09%；长信稳健纯债债券E份额净值为1.0784元，份额累计净值为1.2644元，本报告期内长信稳健纯债债券E净值增长率为3.10%，同期业绩比较基准收益率为2.10%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2022年，美国政策的后劲和中国稳增长政策的出台可能会同时出现。债券市场在经过两年的牛市之后，整体估值处于高位，机会应在收益率调整之后；权益市场今年收益的来可能更多的来自积极的时。

#### 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》及配套法律法规，坚持以合规运作、防范风险为核心，以基金持有人利益为宗旨，保证基金合同得到严格执行。公司监察稽核部独立地开展工作，对基金运作进行事前、事中与事后的监督，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向公司董事会和公司管理层出具监察稽核报告。

本年度内，为确保监管要求的有效实施，公司监察稽核部根据各项法律法规监管政策性要求以及公司内部控制执行情况，积极开展公司业务流程及风险管理的工作，适时组织召开内部控制委员会会议，对各项监管要求进行解读，并对各业务部门业务流程及制度规范的调整进行深入研究，加强对关键业务岗位合规传导及培训工作。

本年度内，监察稽核部以组合压力测试为主要方式，定期对投资组合的风险状况进行评估，对投资组合整体流动性情况进行分析，并适时召集各业务部门的沟通会议，就各项可能的风险进行沟通、预警，防范组合风险事件发生。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则，坚持风控优先、内控从严的理念，不断提高内部监察稽核工作的专业性和实效性、并完善内部控制体系，落实各项内控工作，努力防范和控制各种风险，确保基金资产的规范运作，充分保障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，本基金管理人制定了健全、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，其主要职责是负责制定公司的估值政策、估值方法及采用的估值程序和系统，对公司现有程序和系统进行复核和审阅，评估发生了影响估值程序和系统的有效性及适用性的情况并及时调整估值程序；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国国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签订服务协议，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。

与估值流程各方不存在任 重大利益 。

#### 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，本基金本报告期末进行利润分配。

本基金收益分配原则如下：

1、在符合有关基金分红 件的前提下，本基金每年收益分配 数最多为 12 ， 《基金合同》生效不 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选 现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资； 投资者不选 ，本基金 认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后各类基金份额的份额净值不能低于 值；即基金收益分配基准日的各类基金份额的份额净值 去每单位 类基金份额收益分配金额后不能低于 值；

4、同一类别每一基金份额 有同等分配权；

5、法律法规或监管机关 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

。

## §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

在本报告期内，本基金托管人在托管长信稳健纯债债券型证券投资基金过程中，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和基金合同的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务。

### 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

在本报告期内，本基金托管人按照相关法律法规、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的资产净值计算、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进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。本基金本报告期内未进行利润分配。

### 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

本报告中财务指标、净值收益表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告的数据真实、准确和完整（注：财务会计报告中的金融工具风险及管理部分，以及涉及关联方和基金份额持有人信息等相关数据未在托管人复核范围内）。

## §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
审计报告编号	安永华明（2022）审字第 61399737 B13 号

### 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	长信稳健纯债债券型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>审计了长信稳健纯债债券型证券投资基金的财务报表，包括 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）变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>认为，后附的长信稳健纯债债券型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了长信稳健纯债债券型证券投资基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和净值变动情况。</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执行了审计工作。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准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，独立于长信稳健纯债债券型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。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>长信稳健纯债债券型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中的信息，但不包括财务报表和审计报告。</p> <p>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，如确定其他信息存在重大错报，我们应报告事实。在另一方面，任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估长信稳健纯债债券型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p>

	理层负责监 长信稳健纯债债券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 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 一 重大 报存在时总能发现。 报可能由于 或 误导 ,如 合理预期 报单独或 总起来可能影响财务报表使用者 据财务报表作出的经济决策,则通常认为 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 ,并保持职业 。同时, 执行以下工作:</p> <p>(1) 别和 估由于 或 误导 的财务报表重大 报风险,设计和实 审计程序以应对 风险,并获取 分、适 的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于 可能涉及 通、 、 意遗漏、虚假陈述或 于内部控制之上,未能发现由于 导 的重大 报的风险高于未能发现由于 误导 的重大 报的风险。</p> <p>(2)了 与审计相关的内部控制,以设计 的审计程序,但目的 并对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 价管理层选用会计政策的 性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4)对管理层使用持续经 假设的 性得出结 。同时,根据获取的审计证据, 可能导 对长信稳健纯债债券型证券投资基金持续经 能力产生重大 的事项或情况是 存在重大不确定性得出结 。如 得出结 认为存在重大不确定性,审计准则要求 在审计报告中提 报表使用者注意财务报表中的相关披露,如 披露不 分, 应 发表 保 意见。 的结 基于截至审计报告日可获得的信息。 ,未来的事项或情况可能导 长信稳健纯债债券型证券投资基金不能持续经 。</p> <p>(5) 价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容,并 价财务报表是 公允 相关交易和事项。</p> <p>与 理层 计 的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行 通,包括 通 在审计中 别出的值得关注的内部控制 。</p>
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	华
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层
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：长信稳健纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2021年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	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		146,713.70	864,927.96
结算备 金		636,363.64	-
存出保证金		-	5,717.39
交易性金融资产		875,600,000.00	935,726,000.00
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		875,600,000.00	935,726,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
生金融资产		-	-
入 金融资产		81,100,387.66	10,000,000.00
应收证券 算		-	-
应收利息		15,878,792.62	15,043,063.19
应收股利		-	-
应收申购		66,790.31	122,408.53
所得 资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		973,429,047.93	961,762,117.07
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</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>			
短期		-	-
交易性金融负债		-	-
生金融负债		-	-
出回购金融资产		1,999,879.00	-
应 证券 算		-	-
应 赎回		16,276.03	18,357,667.73
应 管理人报		246,811.73	260,455.66
应 托管费		82,270.56	86,818.53
应 服务费		702.20	7,484.31
应 交易费用		6,144.28	950.00
应交 费		-	-
应 利息		183.68	-

应 利润		-	-
所得 负债		-	-
其他负债		179,004.44	179,025.94
负债合计		2,531,271.92	18,892,402.17
<b>所有者权益：</b>			
实收基金		908,129,670.76	909,185,105.67
未分配利润		62,768,105.25	33,684,609.23
所有者权益合计		970,897,776.01	942,869,714.90
负债和所有者权益总计		973,429,047.93	961,762,117.07

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，长信稳健纯债债券 A 份额净值 1.0690 元，长信稳健纯债债券 E 份额净值 1.0784 元，基金份额总额为 908,129,670.76 份，其中长信稳健纯债债券 A 份额 900,479,678.68 份；长信稳健纯债债券 E 份额 7,649,992.08 份。

## 7.2 利润表

会计主体：长信稳健纯债债券型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		34,656,730.81	-1,868,804.84
利息收入		25,645,116.88	33,732,250.47
其中：存 利息收入		60,339.12	325,664.34
债券利息收入		25,050,464.22	31,964,539.07
资产支持证券利息收入		-	-
入 金融资产收入		534,313.54	1,442,047.06
证券出 利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
投资收益（损 以 填列）		2,027,970.55	-35,954,510.52
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		2,027,970.55	-35,954,510.52
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		-	-
公允价值变动收益（损 以 号填列）		6,968,782.81	-97,283.54
收益（损 以 号填列）		-	-

其他收入（损益号填列）		14,860.57	450,738.75
<b>：二、费用</b>		4,781,607.30	6,584,490.95
管理人报		2,929,440.99	4,023,441.16
托管费		976,480.28	1,342,638.60
服务费		24,312.53	543,809.07
交易费用		12,900.00	54,121.56
利息支出		628,409.10	393,515.45
其中：  出回购金融资产支出		628,409.10	393,515.45
金及附加		2,864.40	19,765.11
其他费用		207,200.00	207,200.00
<b>三、利润总额（损益号填列）</b>		29,875,123.51	-8,453,295.79
：所得  费用		-	-
<b>、净利润（净损益号填列）</b>		29,875,123.51	-8,453,295.79

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长信稳健纯债债券型证券投资基金

本报告期：2021年1月1日至2021年12月31日

单位：人民币元

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）	909,185,105.67	33,684,609.23	942,869,714.90
二、本期经 活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	29,875,123.51	29,875,123.51
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值 以 - 号填列）	-1,055,434.91	-791,627.49	-1,847,062.40
其中：1. 基金申购	130,805,044.67	6,410,144.23	137,215,188.90
2. 基金赎回	-131,860,479.58	-7,201,771.72	-139,062,251.30
、本期 基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值 以 - 号填列）	-	-	-



经本基金的基金管理人和基金托管人 一 ，自 2018 年 5 月 30 日起，根据申购费用、服务费用收取方式的不同对本基金进行份额分类，原有基金份额 为 A 类份额，投资者申购基金时收取申购费用 不计提 服务费，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，同时增设 E 类份额，投资者申购基金份额时不收取申购费用 是从本类别基金资产中计提 服务费，在赎回时根据持有期限收取赎回费用。

本基金的投资范围为具有 流动性的金融工具，包括国内 法发行上市的国债、 行票据、金融债、地方政 债、公司债、企业债、中期票据、短期融资券、超级短期融资券、资产支持证券、 级债券、债券回购等固定收益品种，银行存 （包括 议存 、定期存 及其他银行存 ）、货币市场工具、国债期货以及法律法规或中国证监会允 基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允 基金投资其他品种，基金管理人在 行适 程序后，可以将其 入投资范围，其投资比例遵 时有效的法律法规和相关规定。

基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%。每个交易日 在扣除国债期货合约需 的交易保证金后，本基金持有现金（不包括结算备 金、存出保证金、应收申购 等）以及到期日在 1 年以内的政 债券不低于基金资产净值的 5%。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在 行适 程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

基金的业绩比较基准为：中债综合指数收益率。

## 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部 的《企业会计准则 基本准则》以及其后 及 的具体会计准则、应用指 、 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 ， 了中国证券投资基金业 会 并发 的《证券投资基金会计核算业务指 》、中国证监会制定的《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》、《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 B L 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 会 的相关规定。

本财务报表以本基金持续经 为基础列报。

### 7.4.3 遵 企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和净值变动情况。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 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。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所使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。

#### 7.4.4.3 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、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债券投资等；

##### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分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分为其他金融负债。

#### 7.4.4.4 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。

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债券等，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，应确认为当期收益。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；

收取金融资产现金流量的合同权利终止，或收取金融资产现金流量的权利已转移，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；

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，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：放弃了对金融资产控制的，终止确认金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对金融资产控制的，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) 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计入，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；

买入息票债券同到期一次性本息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按法算内含票利率后，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；

#### (2) 国债期货投资

买入或出国债期货投资于成交日确认为国债期货投资。国债期货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，国债期货的合约价值按移动加权平均法于成交日结转；

#### (3) 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（实际利率与合同利率差较小时，可以用合同利率）在实际持有期间内日计提利息。

### 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进入的交易市场。本基金用市场参与者在对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具有重要

意义的最低层 入值，确定所属的公允价值层：第一层 入值，在计量日能 取得的相同资产或负债在活 市场上未经调整的报价；第二层 入值，除第一层 入值外相关资产或负债 或间 可观察的 入值；第三层 入值，相关资产或负债的不可观察 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 估，以确定是 在公允价值计量层 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 市场的金融工具，按照估值日能 取得的相同资产或负债在活 市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日 报价 最 交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应用最 交易日的报价确定公允价值。有 证据表明估值日或最 交易日的报价不能真实公允价值的，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 中 不同特征 的影响。特征是指对资产出 或使用的限制等，如 限制是 对资产持有者的， 在估值 中不应将 限制作为特征 。 外，基金管理人不应 大量持有相关资产或负债所产生的 价或 价；

(2)不存在活 市场的金融工具，应 用在 前情况下适用并 有 可利用数据和其他信息支持的估值 确定公允价值。 用估值 确定公允价值时，应优先使用可观察 入值，只有在 法取得相关资产或负债可观察 入值或取得不 实可行的情况下， 使用不可观察 入值；

(3)如有确 证据表明按上述方法进行估值不能客观 其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人 定后，按最能 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。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的

本基金具有 已确认金融资产和金融负债的法定权利， 种法定权利现在是可执行的，同时本基金计 以净额结算或同时变现 金融资产和 金融负债时，金融资产和金融负债以相互 后的金额在资产负债表内列示。除 以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不 相互 。

#### 7.4.4.7 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 起的实收基金变动区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 起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金 。

#### 7.4.4.8 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 项中包含的按累计未分配的已实现收益（损）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 项中包含的按累计未实现利得（损）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 目中核算，并于期末全额转入未分配利润（累计 损）。

#### 7.4.4.9 收入/(损)的确认和计量

(1) 存 利息收入按存 的本金与适用的利率 日计提的金额入 。 提前支取定期存 ，按议规定的利率及持有期重新计算存 利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与已确认的利息收入的差额确认利息损 ，列入利息收入 项，存 利息收入以净额列示；

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

(3) 资产支持证券利息收入按证券票 价值与票 利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代 的个人所得 后的净额确认，在证券实际持有期内 日计提；

(4) 入 金融资产收入，按 入 金融资产的成本及实际利率（ 实际利率与合同利率差 较小时， 可以用合同利率），在回购期内 日计提；

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

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

(7) 国债期货投资收益（损）于平仓日确认，并按平仓成交金额与其 合约价值的差额入 ；

(8) 公允价值变动收益（损）系本基金持有的以公允价值计量 其变动计入 期损益的金融资产、以公允价值计量 其变动计入 期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入 期损益的利得或损 ；

(9) 其他收入在本基金 行了基金合同中的 约义务，即在客户取得服务控制权时确认收入。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报 和托管费等费用 期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法 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 法差 较小

的则按 法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1)在符合有关基金分红 件的前提下，本基金每年收益分配 数最多为 12 ， 《基金合同》生效不 3 个月可不进行收益分配；

(2)本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选 现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资； 投资者不选 ，本基金 认的收益分配方式是现金分红；

(3)基金收益分配后各类基金份额的份额净值不能低于 值；即基金收益分配基准日的各类基金份额的份额净值 去每单位 类基金份额收益分配金额后不能低于 值；

(4)同一类别每一基金份额 有同等分配权；

(5)法律法规或监管机关 有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 分部报告

经 分部是指本基金内同时 下列 件的组成部分：

- (1) 组成部分能 在日常活动中产生收入、发生费用；
- (2)能 定期 价 组成部分的经 成 ，以决定 其配置资 、 价其业绩；
- (3)能 取得 组成部分的财务状况、经 成 和现金流量等有关会计信息。

如 两个或多个经 分部具有相 的经济特征，并 一定 件的，则合并为一个经 分部。

本基金目前以一个经 分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 7.4.4.13 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 的基金行业估值实 作，本基金确定以下类别债券投资的公允价值时 用的估值方法及其关 假设如下：

根据《关于发 中国证券投资基金业 会估值核算工作小组关于 2015 年 1 度固定收益品种的估值处理标准 的通 》(中基 发 2014 24 号)，在上海证券交易所、深 证券交易所及银行间同业市场上市交易或 转 的固定收益品种(估值处理标准 有规定的除外)， 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 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 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 会计估计变更。

### 7.4.5.3 差 更正的说明

本基金本报告期 重大会计差 的内容和更正金额。

## 7.4.6 项

### 7.4.6.1 增值

根据财政部、国家 务总 财 2016 36 号文《关于全 开 业 改增值 试点的通 》的规定，经国务 批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全 开 业 改征增值 试点，金融业 入试点范围，由 业 改为 增值 。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 股票、债券的转 收入 征增值 ；国债、地方政 债利息收入以及金融同业往来利息收入 征增值 ；存 利息收入不征收增值 ；

根据财政部、国家 务总 财 2016 46 号文《关于进一 明确全 开 改增试点金融业有关政策的通 》的规定，金融机构开展的质 式 入 金融 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 务总 财 2016 70 号文《关于金融机构同业往来等增值 政策的通 》的规定，金融机构开展的 式 入 金融 品业务、同业存 、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 务总 财 2016 140 号文《关于明确金融、 地产开发、 助服务等增值 政策的通 》的规定，本基金运 过程中发生的增值 应 行为，以本基金的基金管理人 为增值 人；

根据财政部、国家 务总 财 2017 56 号文《关于资管产品增值 有关 的通 》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，本基金的基金管理人运 本基金过程中发生的增值 应 行为，适用简易计 方法，按照 3%的征收率 增值 。对本基金在 2018 年 1 月 1 日前运 过程中发生的增值 应 行为，未 增值 的，不再 ；已 增值 的，已 额从本基金的基金管理人以后月份的增值 应 额中 。

#### 7.4.6.2 城市 建设 、 费附加、地方 附加

根据《中华人民共和国城市 建设 行 例（2011年 ）》、《征收 费附加的 行 规定（2011年 ）》及相关地方 附加的征收规定， 消费 、增值 、 业 的单位和个人， 应 照规定 城市 建设 、 费附加（除按照相关规定 事业 费附加的单位外）及地方 费附加。

#### 7.4.6.3 企业所得

根据财政部、国家 务总 财 2004 78号文《关于证券投资基金 收政策的通 》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 股票、债券的差价收入，继续 征企业所得 ；

根据财政部、国家 务总 财 2008 1号文《关于企业所得 优惠政策的通 》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括 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， 不征收企业所得 。

#### 7.4.6.4 个人所得

根据财政部、国家 务总 财 2008 132号文《财政部、国家 务总 关于 存 利息所得有关个人所得 政策的通 》的规定，自2008年10月9日起，对 存 利息所得 征收个人所得 。

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 银行存

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
活期存	146,713.70	864,927.96
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：	146,713.70	864,927.96

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日

		成本	公允价值	公允价值变动
股票		-	-	-
贵金属投资-金交所金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	869,303,207.58	875,600,000.00	6,296,792.42
	合计	869,303,207.58	875,600,000.00	6,296,792.42
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		869,303,207.58	875,600,000.00	6,296,792.42
项目		上年度末 2020年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		-	-	-
贵金属投资-金交所金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	936,397,990.39	935,726,000.00	-671,990.39
	合计	936,397,990.39	935,726,000.00	-671,990.39
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		936,397,990.39	935,726,000.00	-671,990.39

#### 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均 生金融资产 负债余额。

#### 7.4.7.4 入 金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项 入 金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	
	余额	其中： 式 回购
交易所市场	36,000,000.00	-
银行间市场	45,100,387.66	-
合计	81,100,387.66	-
项目	上年度末 2020年12月31日	
	余额	其中： 式 回购
交易所市场	10,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	10,000,000.00	-

**7.4.7.4.2 期末 式 回购交易中取得的债券**

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有 式 回购交易中取得的债券。

**7.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应收活期存 利息	318.04	1,460.50
应收定期存 利息	-	-
应收其他存 利息	-	-
应收结算备 金利息	315.04	-
应收债券利息	15,789,578.09	15,039,150.51
应收资产支持证券利息	-	-
应 收 入 证券利息	88,581.45	2,449.32
应收申购 利息	-	-
应 收 金 合 约 息	-	-
应收出 证券利息	-	-
其他	-	2.86
合计	15,878,792.62	15,043,063.19

**7.4.7.6 其他资产**

注：本基金本报告期末及上年度末均 其他资产余额。

**7.4.7.7 应 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
交易所市场应 交易费用	-	-
银行间市场应 交易费用	6,144.28	950.00
合计	6,144.28	950.00

**7.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应 券 交易单元保证金	-	-
应 赎回费	4.44	25.94
应 证券出 约金	-	-
预提 户 费	9,000.00	9,000.00
预提审计费	50,000.00	50,000.00
预提信息披露费	120,000.00	120,000.00
合计	179,004.44	179,025.94

## 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

长信稳健纯债债券 A		
项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	
	基金份额（份）	金额
上年度末	905,772,563.90	905,772,563.90
本期申购	13,657,654.28	13,657,654.28
本期赎回（以 - 号填列）	-18,950,539.50	-18,950,539.50
- 基金分份额算前	-	-
基金分份额算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以 - 号填列）	-	-
本期末	900,479,678.68	900,479,678.68

金额单位：人民币元

长信稳健纯债债券 E		
项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	
	基金份额（份）	金额
上年度末	3,412,541.77	3,412,541.77
本期申购	117,147,390.39	117,147,390.39
本期赎回（以 - 号填列）	-112,909,940.08	-112,909,940.08
- 基金分份额算前	-	-
基金分份额算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以 - 号填列）	-	-
本期末	7,649,992.08	7,649,992.08

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

## 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

长信稳健纯债债券 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,673,258.78	30,854,535.65	33,527,794.43
本期利润	22,162,405.61	6,840,936.98	29,003,342.59
本期基金份额交易产生的变动数	-150,875.46	-212,202.07	-363,077.53
其中：基金申购	83,060.01	481,926.78	564,986.79
基金赎回	-233,935.47	-694,128.85	-928,064.32
本期已分配利润	-	-	-
本期末	24,684,788.93	37,483,270.56	62,168,059.49

单位：人民币元

长信稳健纯债债券 E			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	16,891.33	139,923.47	156,814.80
本期利润	743,935.09	127,845.83	871,780.92
本期基金份额交易产生的变动数	-535,036.18	106,486.22	-428,549.96
其中：基金申购	917,120.05	4,928,037.39	5,845,157.44
基金赎回	-1,452,156.23	-4,821,551.17	-6,273,707.40
本期已分配利润	-	-	-
本期末	225,790.24	374,255.52	600,045.76

#### 7.4.7.11 存 利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
活期存 利息收入	53,942.87	191,209.35
定期存 利息收入	-	-
其他存 利息收入	-	-
结算备 金利息收入	1,889.39	19,998.21
其他	4,506.86	114,456.78
合计	60,339.12	325,664.34

注：其他为保证金利息收入和在 申购 利息。

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益 股票差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均 股票投资收益。

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
债券投资收益 债券（、债转股及债券到期）差价收入	2,027,970.55	-35,954,510.52
债券投资收益 赎回差价收入	-	-
债券投资收益 申购差价收入	-	-
合计	2,027,970.55	-35,954,510.52

**7.4.7.13.2 债券投资收益 债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
出债券（、债转股及债券到期）成交总额	1,243,143,886.25	6,392,614,091.72
：出债券（、债转股及债券到期）成本总额	1,219,995,084.17	6,375,063,882.64
：应收利息总额	21,120,831.53	53,504,719.60
债券差价收入	2,027,970.55	-35,954,510.52

**7.4.7.13.3 债券投资收益 赎回差价收入**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均 债券投资收益 赎回差价收入。

**7.4.7.13.4 债券投资收益 申购差价收入**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均 债券投资收益 申购差价收入。

**7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均 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成**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均 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 权证差价收入**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均 生工具收益 权证差价收入。

**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可比期间均 生工具收益 其他投资收益。

**7.4.7.16 股利收益**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均 股利收益。

**7.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月
------	-----------------------	-------------------------------

	12月31日	31日
1. 交易性金融资产	6,968,782.81	-97,283.54
股票投资	-	-
债券投资	6,968,782.81	-97,283.54
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	6,968,782.81	-97,283.54

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
基金赎回费收入	14,687.15	430,556.33
转换费收入	173.42	20,182.42
合计	14,860.57	450,738.75

注：对持续持有期 于 7 日的投资者收取的赎回费全额计入基金财产；除 之外，赎回费总额的 25% 基金财产。

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
交易所市场交易费用	-	741.56
银行间市场交易费用	12,900.00	53,380.00
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	12,900.00	54,121.56

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021	2020年1月1日至2020年

	年 12 月 31 日	12 月 31 日
审计费用	50,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出 约金	-	-
户 费	36,000.00	36,000.00
其他	1,200.00	1,200.00
合计	207,200.00	207,200.00

注：其他为上 所查 费用。

## 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金 需要说明的重大或有事项。

### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金于资产负债表日之后、年度报告批准报出日之前批准、公告或实 的利润分配的情况如下：根据本基金管理人于 2022 年 3 月 7 日发 的分红公告，本基金 2022 年 3 月 9 日在本基金注册登记机构登记在册的 A 类基金份额持有人按每 10 份基金份额 发红利 0.319 元，E 类基金份额持有人按每 10 份基金份额 发红利 0.339 元。截至财务报表批准日，除上述利润分配事项外，本基金 其他需要披露的资产负债表日后事项。

## 7.4.9 关联方关系

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、基金机构
中信建投证券股份有限公司（以下简称 中信建投 ）	基金托管人、基金 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 机构
上海海欣集团股份有限公司（以下简称 海欣集团 ）	基金管理人的股东
武汉钢铁有限公司（以下简称 武钢有限 ）	基金管理人的股东
上海彤胜投资管理中心（有限合伙）（以下简称 彤胜投资 ）	基金管理人的股东
上海彤骏投资管理中心（有限合伙）（以下简称 彤骏投资 ）	基金管理人的股东
上海长江财富资产管理有限公司（以下简称 长江财富 ）	基金管理人的子公司
长江期货股份有限公司（以下简称 长江期货 ）	基金管理人的股东的子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一 业 立。

## 7.4.10 本报告期及上年度可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可比期间未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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日	
	成交金额	占 期债券 成交总额的 比例	成交金额	占 期债券 成交总额的 比例
中信建投	-	-	197,993,534.56	100.00%

#### 7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日	
	回购成交金额	占 期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占 期债券 回购 成交总额的 比例
中信建投	397,000,000.00	100.00%	2,537,670,000.00	100.00%

#### 7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 7.4.10.1.5 应支 关联方的佣金

注：本基金本报告期及上年度可比期间均 应支 关联方的佣金。

### 7.4.10.2 关联方报

#### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
期发生的基金应支的管理费	2,929,440.99	4,023,441.16

其中: 支 户 费	机构的客	32,989.47	113,091.93
--------------	------	-----------	------------

注: 基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.30% 的年费率计提。计算方法如下:

$E = \text{基金管理费年费率} \times \text{年天数}$

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, 日累计至每月月末, 按月支 。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位: 人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年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费	976,480.28	1,342,638.60

注: 基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。计算方法如下:

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

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, 日累计至每月月末, 按月支 。

#### 7.4.10.2.3 服务费

单位: 人民币元

获得 服务费的各关联方名称	本期		
	2021年1月1日至2021年12月31日		
	期发生的基金应支 的 服务费		
	长信稳健纯债债券 A	长信稳健纯债债券 E	合计
长信基金	-	16,251.43	16,251.43
合计	-	16,251.43	16,251.43
获得 服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2020年1月1日至2020年12月31日		
	期发生的基金应支 的 服务费		
	长信稳健纯债债券 A	长信稳健纯债债券 E	合计
长信基金	-	535,448.93	535,448.93
合计	-	535,448.93	535,448.93

注: 本基金 A 类基金份额不收取 服务费, E 类基金份额的基金 服务费按前一日 E 类基金

资产净值的 0.10% 年费率计提。计算方法如下：

$$E \times \text{E 类基金份额的} \times \text{服务费率} \times \text{年天数}$$

为 E 类基金份额每日应计提的 服务费

E 为 E 类基金份额前一日基金资产净值

基金 服务费每日计提， 日累计至每月月末，按月支 。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日						
银行间市场交 易的 各关联方名称	债券交易金额		基金 回购		基金正回购	
	基金 入	基金 出	交易金 额	利息收 入	交易金 额	利息支出
中信建投	29,959,923.70	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日						
银行间市场交 易的 各关联方名称	债券交易金额		基金 回购		基金正回购	
	基金 入	基金 出	交易金 额	利息收 入	交易金 额	利息支出
中信建投	205,461,312.08	50,407,193.72	-	-	-	-

#### 7.4.10.4 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

##### 7.4.10.4.1 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：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

##### 7.4.10.4.2 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：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 7.4.10.5 各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固有资金投资本基金的情况

注：基金管理人在本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

##### 7.4.10.5.2 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年末及上年度末均未持有本基金。

**7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

注：本基金本报告期末及上年度末均由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入。

**7.4.10.7 本基金在承购期内与关联方承购证券的情况**

注：本基金在本报告期及上年度可比期间均未在承购期内购入过由关联方承购的证券。

**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可比期间无其他关联交易事项。

**7.4.11 利润分配情况**

注：本报告期本基金未进行利润分配。

**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 认购新发/增发证券于期末持有的流通受限证券**

注：本基金无认购新发/增发证券于期末持有的流通受限证券。

**7.4.12.2 期末持有的时点等流通受限股票**

注：本基金本报告期末未持有时点等流通受限股票。

**7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为质押的债券****7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末2021年12月31日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券余额人民币1,999,879.00元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（）	期末估值总额
190202	19国开02	2022年1月4日	100.04	20,000	2,000,800.00
合计				20,000	2,000,800.00

**7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

截至本报告期末2021年12月31日止，本基金无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产余额。

**7.4.12.4 期末与转融通证券出借业务的证券**

注：本基金本报告期末无与转融通证券出借业务的融出证券。

## 7.4.13 金融工具风险及管理

### 7.4.13.1 风险管理政策和组 构

本基金在日常活动中 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 述上述风险 及其形成原 、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 的平衡，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政策和程序来 别和分 风险，设定适 的风险限额并设计相应的内部控制程序，通过可 的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人 行全 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成的风险管理 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、合规性进行全 的 查和 估等；在管理层层 设立内部控制 员会，主要职责是 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 有效的防范 ；在业务 作层 风险管理职责主要由监察稽核部负责 调并与各部门合作完成运作风险管理工作， 略与产品研发部负责进行投资风险分 与绩效 估。监察稽核部 察长负责，并 总经理 报日常行政事务。

### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中 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 基金资产损 和收益变化的风险。本基金的银行存 由本基金的托管人中信建投证券股份有限公司转存于招 银行股份有限公司，与 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 信用等级 的证券，通过分 化投资以分 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%， 本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家 公司发行的证券，不得超过 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 项 算，

约风险发生的可能性 小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对 进行信用

估并 用券 对 交 方式以控制相应的信用风险。

#### 7.4.13.2.1 按短期信用 级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用 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	0.00	478,691,000.00
合计	0.00	478,691,000.00

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

#### 7.4.13.2.2 按短期信用 级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末 按短期信用 级列示的资产支持证券投资。

#### 7.4.13.2.3 按短期信用 级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用 级	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	-	-
以下	-	-
未 级	-	48,535,000.00
合计	-	48,535,000.00

注：本基金持有同业存单的主体 级均为 AA 及以上 级。

#### 7.4.13.2.4 按长期信用 级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用 级	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未 级	875,600,000.00	408,500,000.00
合计	875,600,000.00	408,500,000.00

注：未 级债券为国债、 行票据及政策性金融债等 信用 级债券。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用 级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末 按长期信用 级列示的资产支持证券投资。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用 级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末 按长期信用 级列示的同业存单投资。

### 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时变现基金资产以支 投资者赎回 项的风险。本基金流动性风险来 于开放式基金每日 赎回资金的流动性风险，以及 部分投资品种交易不活 出现的变现风险和 投资集中 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 估各类资产的流动性， 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。

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

基金管理人持续监 本基金开放期内的赎回情况， 市场环境或投资者结构发生变化时，及时调整投资组合资产结构及比例，保持基金资产可变现规 和期限与负债赎回规 和期限的 配。

同时， 对 赎回资金的流动性风险，基金管理人在基金合同中约定了 额赎回 ，制定了发生 额赎回时资金的处理 式，控制 开放 式 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 所处市场各类价格 的变动发生 动的风险，包括利率风险、外 风险和其他价格风险。

#### 7.4.13.4.1 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 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 利率风险

单位：人民币元

本 期 末 2021 年 12 月	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
-------------------------------------	--------	----------	-------	-------	-----	----

31 日						
资产						
银行 存	146,713.70	-	-	-	-	146,713.70
结算 备 金	636,363.64	-	-	-	-	636,363.64
交易 性金 融资 产	120,015,000.00	100,350,000.00	533,074,000.00	122,161,000.00	-	875,600,000.00
入	81,100,387.66	-	-	-	-	81,100,387.66
金融 资产						
应收 利息	-	-	-	-	15,878,792.62	15,878,792.62
应收 申购	-	-	-	-	66,790.31	66,790.31
资产 总计	201,898,465.00	100,350,000.00	533,074,000.00	122,161,000.00	15,945,582.93	973,429,047.93
负债						
出 回购 金融 资产	1,999,879.00	-	-	-	-	1,999,879.00
应 赎回	-	-	-	-	16,276.03	16,276.03
应 管理 人报	-	-	-	-	246,811.73	246,811.73
应 托管 费	-	-	-	-	82,270.56	82,270.56
应 服务 费	-	-	-	-	702.20	702.20
应	-	-	-	-	6,144.28	6,144.28

交易费用						
应利息	-	-	-	-	183.68	183.68
其他负债	-	-	-	-	179,004.44	179,004.44
负债总计	1,999,879.00	-	-	-	531,392.92	2,531,271.92
利率度	199,898,586.00	100,350,000.00	533,074,000.00	122,161,000.00	15,414,190.01	970,897,776.01
上年度末 2020年 12月 31日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	864,927.96	-	-	-	-	864,927.96
存出保证金	5,717.39	-	-	-	-	5,717.39
交易性金融资产	527,226,000.00	-	408,500,000.00	-	-	935,726,000.00
金融资产 入	10,000,000.00	-	-	-	-	10,000,000.00
应收利息	-	-	-	-	15,043,063.19	15,043,063.19
应收申购	-	-	-	-	122,408.53	122,408.53
资产总计	538,096,645.35	-	408,500,000.00	-	15,165,471.72	961,762,117.07
负债						
应赎回	-	-	-	-	18,357,667.73	18,357,667.73

应 管理 人报	-	-	-	-	260,455.66	260,455.66
应 托管 费	-	-	-	-	86,818.53	86,818.53
应 服务 费	-	-	-	-	7,484.31	7,484.31
应 交易 费用	-	-	-	-	950.00	950.00
其他 负债	-	-	-	-	179,025.94	179,025.94
负债 总计	-	-	-	-	18,892,402.17	18,892,402.17
利率 度	538,096,645.35	-	408,500,000.00	-	-3,726,930.45	942,869,714.90

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 者进行了分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的 性分

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分	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12月31日）	上年度末（2020年12月31日）
	市场利率下 27 个 基点	4,996,812.68	2,506,719.05
	市场利率上升 27 个 基点	-4,996,812.68	-2,506,719.05

#### 7.4.13.4.2 外 风险

外 风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量 外 率变动 发生 动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价， 重大外 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 除市场利率和外 率以

外的市场价格变动发生动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的债券和银行间同业市场交易的固定收益品种，重大其他市场价格风险。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险

金额单位：人民币元

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	-	-	-	-
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	875,600,000.00	90.18	935,726,000.00	99.24
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	875,600,000.00	90.18	935,726,000.00	99.24

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的 性分

注：本基金主要投资债券等固定收益品种，重大其他价格风险，未进行其他价格风险的 性分。

### 7.4.14 有助于理 和分 会计报表需要说明的其他事项

#### 7.4.14.1 公允价值

##### 7.4.14.1.1 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 和应收 项以及其他金融负债，其 余期限不长，公允价值与 价值相。

##### 7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.1.2.1 各层 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 其变动计入 期损益的金融资产中属于第一层 的余额为人民币0.00元，属于第二层 的余额为人民币875,600,000.00元，属于第三层 的余额为人民币0.00元（于2020年12月31日，本基金持有的以公允价值计量 其变动计入 期损益的金融资产中属于第一层 的余额为人民币0.00元，属于第二层 的余额为人民币935,726,000.00元，属于第三层 的余额为人民币0.00元）。

###### 7.4.14.1.2.2 公允价值所属层 间的重大变动

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层 未发生重大变动。

#### 7.4.14.1.2.3 第三层 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 其变动计入 期损益的金融工具第三层 公允价值本期未发生变动。

#### 7.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金 需要说明的承诺事项。

#### 7.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金 需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

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
	固定收益投资	875,600,000.00	89.95
	其中：债券	875,600,000.00	89.95
	资产支持证券	-	-
	贵金属投资	-	-
	金融衍生品投资	-	-
	买入金融资产	81,100,387.66	8.33
	其中：买入式回购的买入金融资产	-	-
	银行存和结算备金合计	783,077.34	0.08
	其他各项资产	15,945,582.93	1.64
	合计	973,429,047.93	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 与转融通证券出借业务。

### 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

注：本基金本报告期末未持有股票。

#### 8.2.2 报告期末按行业分类的 股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有股票。

### 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

注：本基金本报告期末未持有股票。

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.4.1 累计 入金额超出期 基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：本基金本报告期内未 入股票。

#### 8.4.2 累计 出金额超出期 基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：本基金本报告期内未 出股票。

### 8.4.3 入股票的成本总额及 出股票的收入总额

注：本基金本报告期内未投资股票。

### 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

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
	国家债券	-	-
	行票据	-	-
	金融债券	875,600,000.00	90.18
	其中：政策性金融债	875,600,000.00	90.18
	企业债券	-	-
	企业短期融资券	-	-
	中期票据	-	-
	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	875,600,000.00	90.18

### 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

序号	债券代码	债券名称	数量（）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	200402	20 发 02	2,500,000	249,375,000.00	25.68
2	092018001	20 发 发 01	1,100,000	110,011,000.00	11.33
3	180408	18 发 08	1,000,000	102,450,000.00	10.55
4	200312	20 进出 12	1,000,000	100,350,000.00	10.34
5	210210	21 国开 10	500,000	51,080,000.00	5.26

### 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国债期货交易情况说明

### 8.10.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

### 8.10.2 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持有国债期货。

### 8.10.3 本期国债期货投资 价

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

## 8.11 投资组合报告附注

### 8.11.1 本基金投资的前 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 名证券中，发行主体中国进出口 银行于 2021 年 7 月 13 日收到中国银行保险监 管理 员会处罚决定书（银保监罚决字 2021 31 号），根据《中华人民共和国银行业监 管理法》第二 一 、第 五 、第 六 和相关审 经 规则，经查，中国进出口 银行存在：一、 规投资企业股权；二、个别高管人员未经核准实际 职；三、监管数据漏报 报； 四、 规 地方政 购 服务提供融资；五、 规变相发放 地 备 ；六、 用地未获国务 批准的项目发放 ； 七、 规开展租金保理业务变相支持地方政 债； 八、租金保理业务基础交易不真实； 九、 租 公司发放用 不合规的流动资金 ； 十、 规 个别医疗机构新增融资； 十一、个别并购 金额占比超出监管上限； 十二、 并购 之名 规发放股权收购 ； 十三、 规 未取得 证 的固定资产项目发放 ； 十四、 规发放流动资金 用于固定资产投资； 十五、授信额度核定不审 ； 十六、 实际用 需求的企业发放 导 损 ； 十七、 产能过 行业限额要求授信； 十八、项目 未按规定设定 质 担保； 十九、 风险分类不审 ； 二十、信 资产 业务 前调查不尽职； 二十一、 人转 估费用； 二十二、同业业务交易对 名单制管理 实不到位； 二十三、贸易 审查不审 ； 二十四、对以往监管通报 整改不到位。综上，中国银行保险监 管理 员会决定对中国进出口 银行罚 7345.6 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 证券进行分 后将其列入基金投资对象备选 。在 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。事件发生后，本基金管理人对 证券的发行主体进行了进一步了 与分 ，认为 事件未对 证券投资价值 产生重大的实质性影响。本基金投资于 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 名证券中其余 名的发行主体未出现 监管部门立 调查或在报告编制日前一年内受到公开 责、处罚的情形。

### 8.11.2 基金投资的前 名股票超出基金合同规定的备选股票 情况的说明

本基金本报告期末未投资股票，不存在投资的前 名股票超出基金合同规定的备选股票 的情形。

### 8.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
	存出保证金	-
	应收证券 算	-
	应收股利	-
	应收利息	15,878,792.62
	应收申购	66,790.31
	其他应收	-
	待 费用	-
	其他	-
	合计	15,945,582.93

### 8.11.4 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可转换债券。

### 8.11.5 期末前 名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有股票。

### 8.11.6 投资组合报告附注的其他文字 述部分

注：由于 五入的原 ，分项之和与合计项可能存在 差。

## § 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

份额单位：份

份额级别	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
长信稳健纯债债券 A	975	923,568.90	890,789,335.83	98.92%	9,690,342.85	1.08%
长信稳健纯债债券 E	11,769	650.01	0.00	0.00%	7,649,992.08	100.00%
合计	12,744	71,259.39	890,789,335.83	98.09%	17,340,334.93	1.91%

注：对下属分级基金，比例的分 用各自级别的份额，对合计数，比例的分 用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	长信稳健纯债债券 A	2,084.37	0.00%
	长信稳健纯债债券 E	6,572.07	0.09%
	合计	8,656.44	0.00%

注：对下属分级基金，比例的分 用各自级别的份额，对合计数，比例的分 用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 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	份额级别	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	长信稳健纯债债券 A	0
	长信稳健纯债债券 E	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	长信稳健纯债债券 A	0
	长信稳健纯债债券 E	0
	合计	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长信稳健纯债债券 A	长信稳健纯债债券 E
基金合同生效日（2016 年 12 月 13 日）基金份额总额	210,203,058.22	-
本报告期期 基金份额总额	905,772,563.90	3,412,541.77
本报告期基金总申购份额	13,657,654.28	117,147,390.39
本报告期基金总赎回份额	18,950,539.50	112,909,940.08
本报告期基金 分变动份额（份额 以填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	900,479,678.68	7,649,992.08

## § 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，成 先生不再担任公司董事长，由总经理 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 先生不再代任董事长。

自 2021 年 8 月 9 日起，程 先生不再担任公司副总经理。

自 2021 年 8 月 19 日起， 先生担任公司副总经理。

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 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

本报告期基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 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换会计师事务所；报告期支 安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）  
审计的报 为人民币 50,000.00 元， 审计机构为本基金提供的审计服务的连续年限为 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佣金支 情况

金额单位：人民币元

券 名称	交易单元 数量	股票交易		应支 券 的佣金		备注
		成交金额	占 期股票 成交总额的比 例	佣金	占 期佣金 总量的比例	
中信建投	2	-	-	-	-	-

注：1、本报告期租用证券公司交易单元 变化。

## 2、专用交易单元的选 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 的通 》（证监基字 1998 29 号）和《关于完 证券投资基金交易 位制度有关 的通 》（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 标准和程序。

### (1) 选 标准：

- a、券 基本 价（财务状况、经 状况）；
- b、券 研究机构 价（报告质量、及时性和数量）；
- c、券 每日信息 价（及时性和有效性）；
- d、券 作表现 价。

### (2) 选 程序：

首先根据租用证券公司专用交易单元的选 标准形成《券 服务 价表》， 后根据 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		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占 期债券 成交总额的比 例	成交金额	占 期债 券回购 成交总额 的比例	成交金额	占 期权证 成交总额 的比例
中信建投	-	-	397,000,000.00	100.00%	-	-

## 11.8 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 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 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 、公司网	2021 年 1 月 14 日
2	长信稳健纯债债券型证券投资基金 2020 年第 4 度报告	中国证监会电子披露网 、公司网	2021 年 1 月 22 日

3	长信基金管理有限责任公司 下全部基金 2020 年第 4 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 、公司 网	2021 年 1 月 22 日
4	长信基金管理有限责任公司关于基金行业高级 管理人员变更公告	上证报、中国证监 会电子披露网 、 公司网	2021 年 1 月 26 日
5	长信基金管理有限责任公司关于 下 28 只公募 基金增加 机制并相应 改法律文件的公告	上证报、中证报、 证券时报、证券日 报、中国证监会电 子披露网 、公司 网	2021 年 3 月 2 日
6	长信基金管理有限责任公司关于 下 28 只 公开募集证券投资基金基金合同和托管 议并 更新招募说明书及产品资料 要的提示性公告	上证报、中证报、 证券时报、证券日 报、中国证监会电 子披露网 、公司 网	2021 年 3 月 2 日
7	长信稳健纯债债券型证券投资基金更新的招募 说明书及基金产品资料 要（更新）	中国证监会电子 披露网 、公司网	2021 年 3 月 2 日
8	长信稳健纯债债券型证券投资基金基金合同	中国证监会电子 披露网 、公司网	2021 年 3 月 2 日
9	长信稳健纯债债券型证券投资基金托管 议	中国证监会电子 披露网 、公司网	2021 年 3 月 2 日
10	长信基金管理有限责任公司关于增加中信建投 证券股份有限公司为 下部分开放式基金代 机构并开通转换、定期定额投资业务及 加申购 （含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中证报、 证券时报、证券日 报、中国证监会电 子披露网 、公司 网	2021 年 3 月 16 日
11	长信基金管理有限责任公司关于 下部分开放 式基金 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 、 公司网	2021 年 3 月 26 日
12	长信稳健纯债债券型证券投资基金 2020 年年度 报告	中国证监会电子 披露网 、公司网	2021 年 3 月 30 日
13	长信基金管理有限责任公司 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 、公司 网	2021 年 3 月 30 日
14	长信基金管理有限责任公司关于 下部分开放	上证报、中国证监	2021 年 3 月 31

	式基金 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	会电子披露网 、公司网	日
15	长信稳健纯债债券型证券投资基金 2021 年第 1 度报告	中国证监会电子披露网 、公司网	2021 年 4 月 21 日
16	长信基金管理有限责任公司 下全部基金 2021 年第一 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 、公司网	2021 年 4 月 21 日
17	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 、公司网	2021 年 4 月 30 日
18	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 、公司网	2021 年 6 月 22 日
19	长信稳健纯债债券型证券投资基金更新的招募说明书(2021 年第【1】号)及基金产品资料要(更新)	中国证监会电子披露网 、公司网	2021 年 6 月 30 日
20	长信基金管理有限责任公司关于 下部分开放式基金 加招 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 、公司网	2021 年 7 月 5 日
21	长信基金管理有限责任公司关于增加 部证券股份有限公司为 下部分开放式基金代 机构并开通转换、定期定额投资业务及 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 、公司网	2021 年 7 月 14 日
22	长信稳健纯债债券型证券投资基金 2021 年第 2 度报告	中国证监会电子披露网 、公司网	2021 年 7 月 21 日
23	长信基金管理有限责任公司 下全部基金 2021 年第二 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 、公司网	2021 年 7 月 21 日
24	长信基金管理有限责任公司关于增加京东 特瑞基金 有限公司为 下部分开放式基金代 机构并开通转换、定期定额投资业务及 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 、公司网	2021 年 7 月 22 日
25	长信基金管理有限责任公司关于增加招 证券股份有限公司为 下部分开放式基金代 机构并开通转换、定期定额投资业务及 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 、公司网	2021 年 7 月 29 日
26	长信基金管理有限责任公司关于增加东方财富证券股份有限公司为 下部分开放式基金代	上证报、中国证监会电子披露网 、	2021 年 8 月 5 日

	机构并开通转换、定期定额投资业务及 加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	公司网	
27	长信基金管理有限责任公司关于增加国联证券股份有限公司为 下部分开放式基金代 机构并开通转换、定期定额投资业务及 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 、公司网	2021年8月6日
28	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 、公司网	2021年8月11日
29	长信基金管理有限责任公司关于增加民生证券股份有限公司为 下部分开放式基金代 机构并开通转换、定期定额投资业务及 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 、公司网	2021年8月13日
30	长信基金管理有限责任公司关于设立 阳分公司的公告	上证报、中国证监会电子披露网 、公司网	2021年8月18日
31	长信基金管理有限责任公司关于增加上海利得基金 有限公司为 下部分开放式基金代 机构并开通转换、定期定额投资业务及 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 、公司网	2021年8月18日
32	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 、公司网	2021年8月20日
33	长信基金管理有限责任公司关于 下部分开放式基金 加中国工 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 、公司网	2021年8月26日
34	长信稳健纯债债券型证券投资基金 2021 年中期报告	中国证监会电子披露网 、公司网	2021年8月31日
35	长信基金管理有限责任公司 下全部基金 2021 年中期报告提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网 、公司网	2021年8月31日
36	长信基金管理有限责任公司关于增加江 银行股份有限公司为 下部分开放式基金代 机构并开通转换、定期定额投资业务及 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 、公司网	2021年9月16日
37	长信基金管理有限责任公司关于增加上海基金 有限公司为 下部分开放式基金代 机构并开通转换、定期定额投资业务及 加申购（含定投申购）、赎回费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网 、公司网	2021年10月21日
38	长信稳健纯债债券型证券投资基金 2021 年第 3 度报告	中国证监会电子披露网 、公司网	2021年10月27日

39	长信基金管理有限责任公司 下全部基金 2021 年第三 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 、公司 网	2021 年 10 月 27 日
40	长信基金管理有限责任公司关于增加国泰 安 证券股份有限公司为 下部分开放式基金代 机构并开通转换、定期定额投资业务及 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 、 公司网	2021 年 11 月 9 日
41	长信基金管理有限责任公司关于增加 联证券 股份有限公司为 下部分开放式基金代 机构 并开通转换、定期定额投资业务及 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 、 公司网	2021 年 11 月 16 日
42	长信基金管理有限责任公司关于养老金客户通 过 中心申购(含转换转入) 下所有基金费 率优惠的公告	上证报、中国证监 会电子披露网 、 公司网	2021 年 11 月 23 日
43	长信基金管理有限责任公司关于增加华 证券 股份有限公司为 下部分开放式基金代 机构 并开通转换、定期定额投资业务及 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 、 公司网	2021 年 12 月 2 日
44	长信基金管理有限责任公司关于增加上海 得 基金 有限公司为 下部分开放式基金代 机构并开通转换、定期定额投资业务及 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 、 公司网	2021 年 12 月 3 日
45	长信基金管理有限责任公司关于增加东 证券 股份有限公司为 下部分开放式基金代 机构 并开通转换、定期定额投资业务及 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 、 公司网	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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期 份 额	申购 份 额	赎回 份 额	持有份额	份额占比
机构	1	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	890,789,239.27	0.00	0.00	890,789,239.27	98.09%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>1、基金净值大 动的风险 单一持有基金比例过高的投资者连续大量赎回，可能会影响基金投资的持续性和稳定性，增加变现成本。同时，按照净值计算 差处理规则可能 起基金份额净值 常上 或下 。</p> <p>2、赎回申 期办理的风险 单一持有基金比例过高的投资者大额赎回后可能 发本基金 额赎回 件，导 同期中小投资者小额赎回 部分 期办理的情况。</p> <p>3、基金投资策略 以实现的的风险 单一持有基金比例过高的投资者大额赎回后，可能 起基金资产总净值 低，从 使基金在投资时受到限制，导 基金投资策略 以实现。</p>							

### 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、中国证监会批准设立基金的文件；
- 2、《长信稳健纯债债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长信稳健纯债债券型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《长信稳健纯债债券型证券投资基金托管 议》；
- 5、报告期内在指定报 上披露的各种公告的原 ；
- 6、长信基金管理有限责任公司 业执照、公司 程及相关资格批复文件。

### 13.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

### 13.3 查阅方式

长信基金管理有限责任公司网 ；

长信基金管理有限责任公司

2022年3月31日