

# 长信双利优选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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司（以下简称“中国农业银行”，下同）根据本基金基金合同的规定，于2022年3月28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>13</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>20</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>21</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>23</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>61</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>70</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>71</b>
<b>§ 11 重大事件揭示.....</b>	<b>72</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>79</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>80</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	长信双利优选混合型证券投资基金	
基金简称	长信双利优选混合	
基金主代码	519991	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019年9月4日	
基金管理人	长信基金管理有限责任公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	76,415,384.48份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	长信双利优选混合 A	长信双利优选混合 E
下属分级基金的场内简称:	CXSLA	-
下属分级基金的交易代码:	519991	006396
报告期末下属分级基金的份额总额	76,298,203.10份	117,181.38份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过对股票和债券等金融资产进行积极配置，并精选优质个股和券种，从而在保障基金资产流动性和安全性的前提下，谋求超越比较基准的投资回报，实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金为主动式混合型基金，以战略性资产配置（SAA）策略体系为基础决定基金资产在股票类、固定收益类等资产中的配置。将行业吸引力模型、股票价值优选模型和久期控制策略模型作为个股和债券的选择依据，投资于精选的优质股票和债券，构建动态平衡的投资组合，实现基金资产超越比较基准的稳健增值。
业绩比较基准	中证800指数收益率*60%+中证综合债券指数收益率*20%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）*20%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，其风险和收益高于债券基金和货币市场基金，低于股票型基金。 本基金除了投资A股外，还可根据法律法规规定投资香港联合交易所上市的股票。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

注：根据基金管理人于2021年6月29日发布的《长信基金管理有限责任公司关于长信旗下6只基金产品变更业绩比较基准并修改基金合同的公告》，本基金业绩比较基准自2021年7月1日起由“中证800指数收益率\*60%+中证综合债券指数收益率\*40%”变更为“中证800指数收益率\*60%+中证综合债券指数收益率\*20%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）\*20%”。

### 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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周永刚	秦一楠
	联系电话	021-61009999	010-66060069
	电子邮箱	zhouyg@cxfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4007005566	95599
传真		021-61009800	010-68121816
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区银城中路68号9楼	北京市东城区建国门内大街69号
办公地址		上海市浦东新区银城中路68号9楼	北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座9层
邮政编码		200120	100031
法定代表人		刘元瑞	谷澍

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
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,北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9

### 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）	上海浦东新区世纪大道100号50楼
注册登记机构	A类份额：中国证券登记结算有限责任公司、E类份额：长信基金管理有限责任公司	A类份额：北京市西城区太平桥大街17号、E类份额：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

期间数据和指标	2021年		2020年		2019年9月4日(基金合同生效日)-2019年12月31日	
	长信双利优选混合A	长信双利优选混合E	长信双利优选混合A	长信双利优选混合E	长信双利优选混合A	长信双利优选混合E
本期已实现收益	50,795,981.16	60,254.62	283,935,526.44	534,995.29	53,687,073.39	136,519.59
本期利润	-14,754,973.38	-31,182.44	280,824,925.85	307,291.48	48,657,215.47	113,972.36
加权平均基金份额本期利润	-0.1274	-0.1862	0.8351	0.5673	0.0904	0.0995
本期加权平	-5.68%	-8.37%	45.69%	32.23%	6.36%	6.78%

均 净 值 利 润 率						
本 期 基 金 份 额 净 值 增 长 率	-6.63%	-6.67%	59.86%	59.46%	6.83%	6.78%
期 末 数 据 和 指 标	2021 年末		2020 年末		2019 年末	
期 末 可 供 分 配 利 润	73,805,241.4 2	110,960.0 0	144,649,179. 85	160,804.9 5	40,407,795.0 3	493,897.11
期 末 可 供 分 配 基 金 份 额 利	0.9673	0.9469	0.9664	1.2654	0.0834	0.3622

润						
期						
末						
基	150,103,444.	228,141.3	356,578,355.	310,929.0	722,133,719.	2,092,201.4
金	52	8	40	4	39	3
资						
产						
净						
值						
期						
末						
基						
金						
份	1.9673	1.9469	2.3824	2.4468	1.4903	1.5344
额						
净						
值						
指						
标						
累						
计						
期						
末						
指						
标						
	2021 年末		2020 年末		2019 年末	
基						
金						
份						
额						
累						
计						
净	59.46%	58.92%	70.78%	70.27%	6.83%	6.78%
值						
增						
长						
率						

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

长信双利优选混合 A

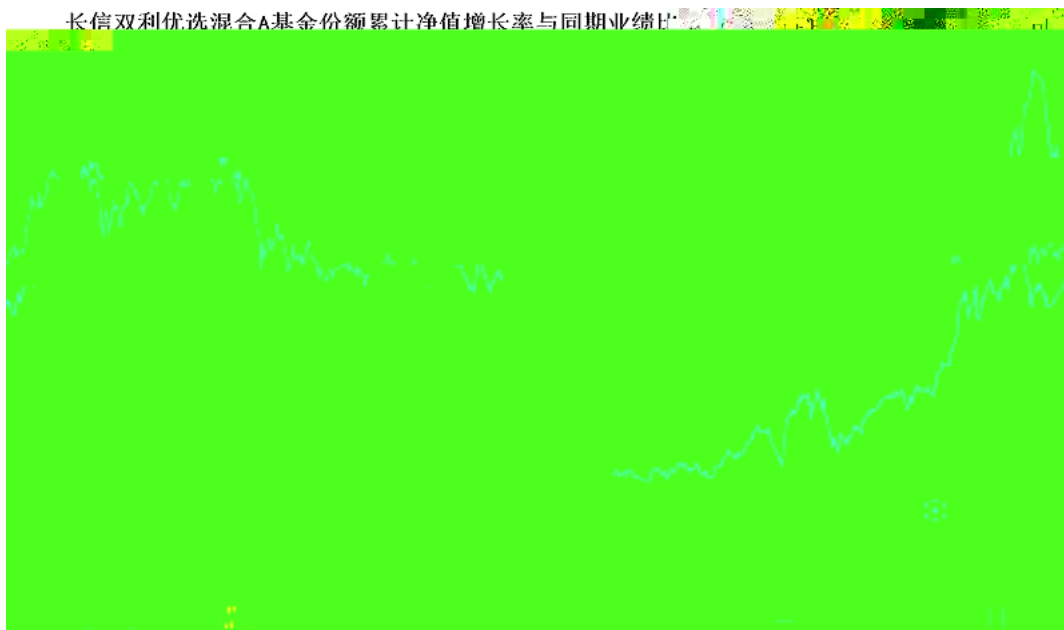
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.80%	0.97%	-0.77%	0.30%	-0.03%	0.67%
过去六个月	-15.56%	1.29%	-4.46%	0.40%	-11.10%	0.89%
过去一年	-6.63%	1.42%	-2.43%	0.58%	-4.20%	0.84%
自基金合同生效起至今	59.46%	1.39%	18.70%	0.70%	40.76%	0.69%

长信双利优选混合 E

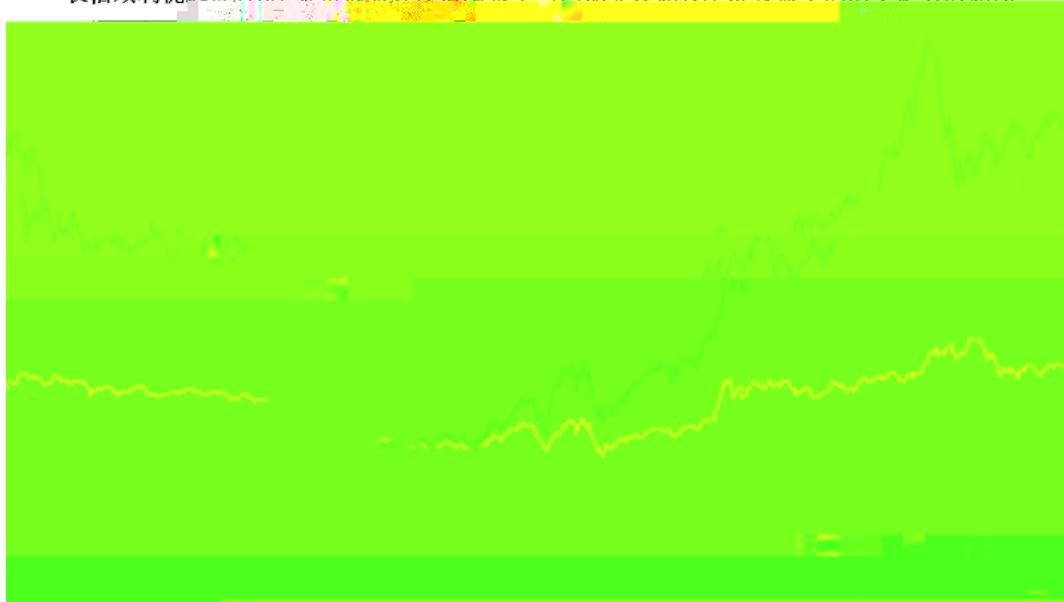
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.80%	0.97%	-0.77%	0.30%	-0.03%	0.67%
过去六个月	-15.56%	1.29%	-4.46%	0.40%	-11.10%	0.89%
过去一年	-6.67%	1.42%	-2.43%	0.58%	-4.24%	0.84%
自基金合同生效起至今	58.92%	1.39%	18.70%	0.70%	40.22%	0.69%

### 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

长信双利优选混合A基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较



长信双利优选混合E基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



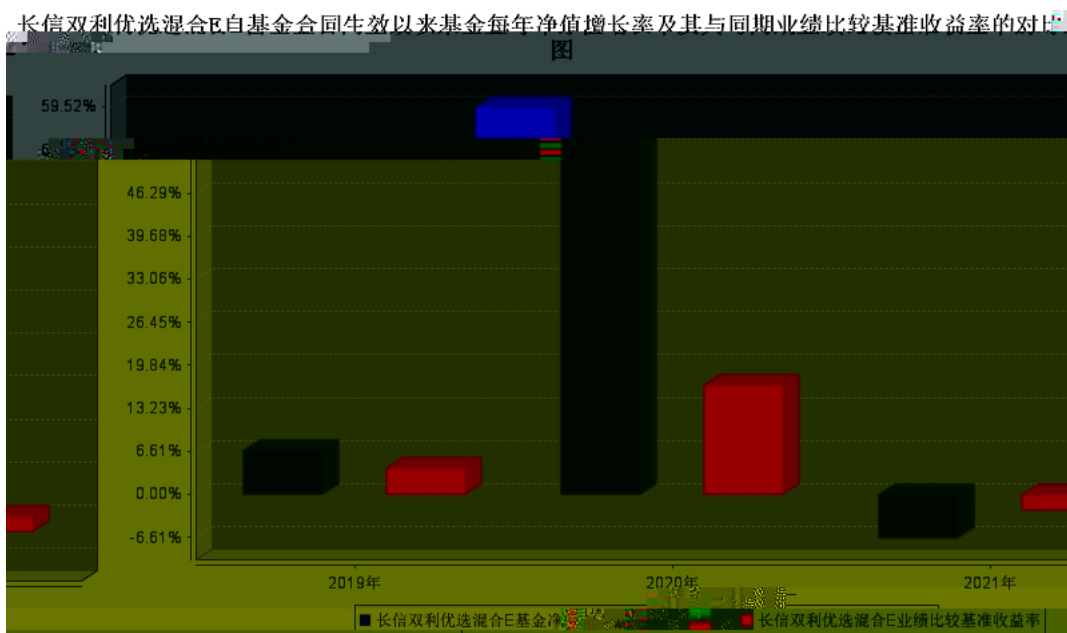
注：1、图示日期为 2019 年 9 月 4 日至 2021 年 12 月 31 日。

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 自基金合同生效以来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

长信双利优选混合A自基金合同生效以来基金行





注：本基金基金合同生效日为2019年9月4日，2019年净值增长率按当年实际存续期计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

长信双利优选混合 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	2.900	20,733,248.66	16,679,620.06	37,412,868.72	
2020	-	-	-	-	
2019	-	-	-	-	
合计	2.900	20,733,248.66	16,679,620.06	37,412,868.72	

单位：人民币元

长信双利优选混合 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	3.800	54,083.23	29,094.83	83,178.06	
2020	-	-	-	-	
2019	-	-	-	-	
合计	3.800	54,083.23	29,094.83	83,178.06	

注：本基金本报告期内进行的利润分配情况，详见4.8。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

长信基金管理有限责任公司是经中国证监会证监基金字【2003】63号文批准，由长江证券股份有限公司、上海海欣集团股份有限公司、武汉钢铁股份有限公司共同发起设立。注册资本1.65亿元人民币。目前股权结构为：长江证券股份有限公司占44.55%、上海海欣集团股份有限公司占31.21%、武汉钢铁有限公司占15.15%、上海彤胜投资管理中心（有限合伙）占4.55%、上海彤骏投资管理中心（有限合伙）占4.54%。

截至2021年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		
祝昱丰	长信双利优选混合型证券投资基金和长信创新驱动股票型证券投资基金的基金经理。	2019年9月4日	-	7年	金融学硕士，上海交通大学金融学硕士毕业，2014年至2015年在光大保德信基金管理有限公司投资研究部门担任初级研究员职务。2015年7月加入长信基金管理有限责任公司，曾担任研究发展部行业研究员、基金经理助理、长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金和长信创新驱动股票型证券投资基金的基金经理。现任长信双利优选混合型证券投资基金和长信创新驱动股票型证券投资基金的基金经理。

注：1、首任基金经理任职日期以本基金成立之日为准；新增或变更基金经理的日期根据对外披露

的公告日期填写；

2、证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律、法规、基金合同的规定，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

本基金将继续以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，努力为基金份额持有人谋求最大利益。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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委托指令；

(2) 对于多个投资组合在同一时点就同一证券下达的相同方向的投资指令，并且市价在限价范围内的，系统自动将交易员针对该证券下达的每笔委托自动按照指令数量比例分拆为各投资组合的委托指令。对于不同投资组合且不同投资经理针对交易所同一证券的同一方向竞价交易指令，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给不同交易员豁免公平交易。

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

4、对于不同投资组合均进行债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易的投资对象，交易部门必须严格独立接收各投资组合的投资指令，在申购结果产生前，不得以任何形式向任何人泄露各投资指令的内容，包括指令价格及数量等要素。

5、对于各投资组合以独立账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接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媒体上披露的申购结果对系统内分配数量进行核准，数量不符的，

应当第一时间告知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。确因特殊原因不能按照上述原则进行分配的，应启动异常交易识别流程，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、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，公司已通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

#### 4.3.3 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参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形，未发现异常交易行为。同时，对本年度同向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 年四季度的市场呈现出震荡的格局，沪深 300 比较平稳，创业板则相对强势，恒生指数则是延续了前两个季度的弱势。原因我们认为和三季度时比较相似。在这种时间窗口，以成长股为代表的创业板会更强势一些。

尽管疫情和经济等因素对于 EPS 的影响是相同的，但对于内地和香港市场的信心或者说估值水平，影响却大不相同。A 股的底层逻辑，尤其在流动性比较宽裕的时候，更呈现出“否极泰来”的思维方式，对于基本面表现不好的行业，会去预期何时能够触底反弹。而对于港股来说，可能更多的在基本面下行的阶段，会表现出“避而远之”的思维方式，股价也容易比较弱势，直到基本面确实见底，可能才会出现股价上的反转。

但无论市场风格或者逻辑如何，我们认为公司成长的底层逻辑还是相同的。真正能够决定公司长期价值的还是行业的竞争格局和公司的竞争优势，我们相信哪怕在经济和行业不景气的时候，这些公司的抗风险能力还是更强的，在下一波景气度上升的时候，整个竞争格局也会更加优化。所以我们会坚定持有这些长期优质的公司，当然前提是它所处的行业不是持续性的萎缩。对于 A 股和港股在这段时间表现，我们认为可能是港股的资产会出现更强的性价比，当然这种性价比的兑现，可能仍然需要一定的耐心去等待。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 12 月 31 日，长信双利优选混合 A 份额净值为 1.9673 元，份额累计净值为 3.0149 元，本报告期内长信双利优选混合 A 净值增长率为-6.63%；长信双利优选混合 E 份额净值为 1.9469 元，份额累计净值为 2.3459 元，本报告期内长信双利优选混合 E 净值增长率为-6.67%，同期业绩比较基准收益率为-2.43%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在新的一年里，我们仍然会坚持自己的投资策略。我们认为，2021 年 A 股消费板块以及港股的调整，主要是由于基本面和情绪的双重下行导致的。2021 年疫情在全国范围内反复，这些公司的盈利预期经历了不断的下修，同时一些行业情况的波动，也使得市场对于一些行业的未来愿景产生了担忧。

我们认为，无论是对于疫情还是对于行业的预期，都会呈现出周期性波动的特征。疫情对于基本面的影响可能会在 2022 年开始逐步减弱，尽管中间可能会出现不断的反复，但是终点仍然是清晰的。我们仍然相信，对于大多数消费和服务性行业来说，更重要的还是行业本身的属性以及公司管理能力的优劣。疫情以及政策，对于行业内的公司来说，都是公平的，是产生一致影响的。在这个过程中，准备的更充分的公司，更能抓住机会的公司，更有平常心的公司，可能会在下一轮的周期中迎来更好的发展。而我们的目标，就是找出这些行业，这些公司，为持有人创造持续的收益。

#### 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》及配套法律法规，时刻以合规运作、防范风险为核心，以维护基金持有人利益为宗旨，保证基金合同得到严格履行。公司监察稽核部独立地开展工作，对基金运作进行事前、事中与事后的监督检查，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梳理的工作，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探讨，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检测，

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面临的风险进行沟通、讨论，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，秉持风控优先、内控从严的理念，不断提高内部监察稽核工作的科学性和实效性、并完善内部控制体系，做好各项内控工作，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，本基金管理人制订了健全、有效的估值政策和估值程序，设立了估值委员会，估值委员会是公司基金估值的主要决策机构，其主要职责是负责拟定公司的估值政策、估值方法及采用的估值程序和技术，对公司现有程序和技术进行复核和审阅，当发生了影响估值程序和技术的有效性、适用性的情况及时修订估值程序；估值委员会成员由基金事务部、投资、研究、交易等相关业务部门负责人以及基金事务部至少一名业务骨干共同组成，相关参与人员都具有丰富的证券行业工作经验，熟悉相关法规和估值方法，均具备估值业务所需的专业胜任能力。对于基金的估值政策和估值原则，公司已与基金托管人充分沟通，并达成一致意见。审计本基金的会计师事务所认可公司基金估值政策和程序的适当性。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据以及流通受限股票的折扣率。参与估值流程各方不存在任何重大利益冲突。

#### 4.8 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：

长信双利优选混合 A：权益登记日 2021 年 3 月 31 日，除息日 2021 年 3 月 31 日，每 10 份基金份额分红 2.900 元，现金形式发放 20733248.66 元，再投资形式发放 16679620.06 元，利润分配合计 37,412,868.72 元。

长信双利优选混合 E：权益登记日 2021 年 3 月 31 日，除息日 2021 年 3 月 31 日，每 10 份基金份额分红 3.800 元，现金形式发放 54083.23 元，再投资形式发放 29094.83 元，利润分配合计

83,178.06 元。

本基金收益分配原则如下：

- (1) 同一类别每一基金份额享有同等分配权；
- (2) 基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；
- (3) 基金当年收益应先弥补上一年度亏损后，才可进行当年收益分配；
- (4) 基金收益分配后各类基金份额的份额净值在财务日不能低于面值；
- (5) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按除息日的基金份额净值自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；
- (6) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年至少分配 1 次，但若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；
- (7) 基金每年分红次数最多不超过 12 次，年度收益分配比例不低于基金年度已实现收益的 30%。若年度分红 12 次后，基金再次达到分红条件，则可分配收益滚存到下一年度进行分配；
- (8) 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

#### 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

无。

## §5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金管理人——长信基金管理有限责任公司 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本托管人认为，长信基金管理有限责任公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 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

本托管人认为，长信基金管理有限责任公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## §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_B04 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	长信双利优选混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了长信双利优选混合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>我们认为，后附的长信双利优选混合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，公允反映了长信双利优选混合型证券投资基金 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>我们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”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于长信双利优选混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们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>长信双利优选混合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涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也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，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</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、执行和维护必要的内部控制，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双利优选混合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>

	治理层负责监督长信双利优选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>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致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。错报可能由于舞弊或错误导致，如果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，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</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，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价管理层选用会计政策的恰当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营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对长信双利优选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。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致长信双利优选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（包括披露）、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>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们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	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	蒋燕华 夏秉雯
会计师事务所的地址	上海市浦东新区世纪大道 100 号 50 楼
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：长信双利优选混合型证券投资基金

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>			
银行存款		21,781,616.09	22,154,777.48
结算备付金		231,915.33	3,697,031.26
存出保证金		63,703.54	314,105.24
交易性金融资产		131,261,400.73	334,012,092.43
其中：股票投资		130,993,632.53	317,035,228.83
基金投资		-	-
债券投资		267,768.20	16,976,863.60
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		-	4,407,995.64
应收利息		5,127.56	153,979.08
应收股利		-	83,279.80
应收申购款		15,134.06	149,577.92
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		153,358,897.31	364,972,838.85
<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>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		2,247,375.63	5,788,320.78
应付赎回款		34,569.85	955,464.48
应付管理人报酬		190,586.40	440,059.08
应付托管费		31,764.41	73,343.18
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		179,999.01	492,971.66
应交税费		43,980.69	43,980.00
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		299,035.42	289,415.23
负债合计		3,027,311.41	8,083,554.41
<b>所有者权益：</b>			
实收基金		76,415,384.48	149,798,116.80
未分配利润		73,916,201.42	207,091,167.64
所有者权益合计		150,331,585.90	356,889,284.44
负债和所有者权益总计		153,358,897.31	364,972,838.85

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，长信双利优选混合 A 份额净值 1.9673 元，长信双利优选混合 E 份额净值 1.9469 元，基金份额总额为 76,415,384.48 份，其中长信双利优选混合 A 份额 76,298,203.10 份；长信双利优选混合 E 份额 117,181.38 份。

## 7.2 利润表

会计主体：长信双利优选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>		-7,326,124.86	298,445,393.77
利息收入		411,383.10	892,605.45
其中：存款利息收入		201,128.89	392,350.97
债券利息收入		210,254.21	500,254.48
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
投资收益（损失以“-”填列）		57,325,204.86	300,196,279.98
其中：股票投资收益		55,956,964.16	296,629,713.56
基金投资收益		-	-
债券投资收益		55,472.52	719,669.31
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		1,312,768.18	2,846,897.11
公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-65,642,391.60	-3,338,304.40
汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

其他收入（损失以“-”号填列）		579,678.78	694,812.74
<b>减：二、费用</b>		7,460,030.96	17,313,176.44
．管理人报酬		3,935,026.28	9,228,065.94
．托管费		655,837.71	1,538,010.99
．销售服务费		-	-
．交易费用		2,632,156.82	6,318,284.33
．利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
．税金及附加		0.32	4.33
．其他费用		237,009.83	228,810.85
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-14,786,155.82	281,132,217.33
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-14,786,155.82	281,132,217.33

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长信双利优选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、期初所有者权益（基金净值）	149,798,116.80	207,091,167.64	356,889,284.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-14,786,155.82	-14,786,155.82
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-73,382,732.32	-80,892,763.62	-154,275,495.94
其中：1. 基金申购款	90,989,681.15	142,287,593.30	233,277,274.45
2. 基金赎回款	-164,372,413.47	-223,180,356.92	-387,552,770.39
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-37,496,046.78	-37,496,046.78

五、期末所有者权益（基金净值）	76,415,384.48	73,916,201.42	150,331,585.90
项目	上年度可比期间 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、期初所有者权益（基金净值）	485,913,102.26	238,312,818.56	724,225,920.82
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	281,132,217.33	281,132,217.33
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-336,114,985.46	-312,353,868.25	-648,468,853.71
其中：1. 基金申购款	121,046,731.74	88,042,015.45	209,088,747.19
2. 基金赎回款	-457,161,717.20	-400,395,883.70	-857,557,600.90
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	149,798,116.80	207,091,167.64	356,889,284.44

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

刘元瑞	覃波	孙红辉
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

长信双利优选混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）由长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金转型而成，长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可〔2008〕357号文《关于核准长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人长信基金管理有限责任公司向社会公开发行募集，基金合同于2008年6月19日正式生效，首次设立募集规模为511,032,952.17份基金份额。根据《长信双利优选混合型证券投资基金基金合同》及《长信基金管理有限责任公司关于长信双

利优选灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会决议生效公告》，本基金自 2019 年 9 月 4 日起转型并更名为长信双利优选混合型证券投资基金。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为长信基金管理有限责任公司，各类份额的注册登记机构分别为中国证券登记结算有限责任公司和长信基金管理有限责任公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金根据注册登记机构的不同，将基金份额分为不同的类别。注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，且在投资者申购基金份额时收取申购费用而不计提销售服务费，在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额，称为 A 类基金份额；注册登记机构为长信基金管理有限责任公司，且在投资者申购基金份额时收取申购费用而不计提销售服务费，在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额，称为 E 类基金份额。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板和其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、地方政府债、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、现金、权证、国债期货、股指期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 50%-95%，投资于港股通标的股票的比例不高于股票资产的 50%；本基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货及股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券。股指期货、国债期货、股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

2021 年 7 月 1 日前，本基金股票投资部分的业绩比较基准为中证 800 指数，债券投资部分为中证综合债券指数，复合业绩比较基准为：中证 800 指数收益率×60%+中证综合债券指数收益率×40%；自 2021 年 7 月 1 日起，本基金股票投资部分的业绩比较基准为中证 800 指数收益率、恒生指数收益率（使用估值汇率折算），债券投资部分为中证综合债券指数收益率，复合业绩比较基准为：中证 800 指数收益率\*60%+中证综合债券指数收益率\*20%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）\*20%。

## 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和中期报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

## 7.4.3 遵循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采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

### 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、贷款和应收款项；

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资和衍生工具等；

## (2) 金融负债分类

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

### 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。

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

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

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

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

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

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

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

#### (1) 股票投资

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

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

#### (2) 债券投资

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

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直

线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

#### (3) 权证投资

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

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

#### (4) 股指期货投资

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

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

#### (5) 国债期货投资

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

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

#### (6) 分离交易可转债

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

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

#### (7) 回购协议

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

### 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，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

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

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

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

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

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

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### **7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

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

#### **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。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基

金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

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

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

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

(11) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公

司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

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

(13) 其他收入在本基金履行了基金合同中的履约义务，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**

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

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

#### **7.4.4.11 基金的收益分配政策**

(1) 同一类别每一基金份额享有同等分配权；

(2) 基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；

(3) 基金当年收益应先弥补上一年度亏损后，才可进行当年收益分配；

(4) 基金收益分配后各类基金份额的份额净值在财务日不能低于面值；

(5) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按除息日的基金份额净值自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(6) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年至少分配 1 次，但若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(7) 基金每年分红次数最多不超过 12 次，年度收益分配比例不低于基金年度可分配收益的 30%。若年度分红 12 次后，基金再次达到分红条件，则可分配收益滚存到下一年度进行分配；

(8) 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

#### **7.4.4.12 外币交易**

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

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

#### **7.4.4.13 分部报告**

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

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

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

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### **7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计**

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

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

(2) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，根据《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》(中国证监会公告[2017]13号)及《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》(中基协发[2013]13号)相关规定，本基金根据情况决定使用指数收益法、可比公司法、市场价格模型法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

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

### **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

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

## 7.4.6 税项

### 7.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

### 7.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，本基金的基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。

#### 7.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

#### 7.4.6.4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

#### 7.4.6.5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《关于上市公司股息红利差别

化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

#### 7.4.6.6 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 银行存款

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
活期存款	21,781,616.09	22,154,777.48
定期存款	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计：	21,781,616.09	22,154,777.48

#### 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	136,475,587.50	130,993,632.53	-5,481,954.97
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	267,768.20	74,768.20
	银行间市场	-	-
	合计	267,768.20	74,768.20
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	136,668,587.50	131,261,400.73	-5,407,186.77
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	256,811,429.60	317,035,228.83	60,223,799.23
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	7,018,863.60	18,975.60
	银行间市场	9,958,000.00	-7,570.00
	合计	16,976,863.60	11,405.60
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	273,776,887.60	334,012,092.43	60,235,204.83

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

### 7.4.7.4 买入返售金融资产

#### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末均无买断式逆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
应收活期存款利息	4,717.73	3,663.08
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	229.03	1,432.71
应收债券利息	116.75	148,726.68
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	10.72	0.01
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	53.33	156.60
合计	5,127.56	153,979.08

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均未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

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
交易所市场应付交易费用	179,824.01	492,771.66
银行间市场应付交易费用	175.00	200.00
合计	179,999.01	492,971.66

#### 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
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	35.42	415.23
应付证券出借违约金	-	-
预提账户维护费	9,000.00	9,000.00
预提审计费	70,000.00	60,000.00
预提信息披露费	220,000.00	220,000.00
合计	299,035.42	289,415.23

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

长信双利优选混合 A		
项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	149,671,042.55	149,671,042.55
本期申购	90,798,542.07	90,798,542.07
本期赎回（以“-”号填列）	-164,171,381.52	-164,171,381.52
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	76,298,203.10	76,298,203.10

金额单位：人民币元

长信双利优选混合 E		
项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	127,074.25	127,074.25
本期申购	191,139.08	191,139.08
本期赎回（以“-”号填列）	-201,031.95	-201,031.95
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	117,181.38	117,181.38

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

长信双利优选混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	144,649,179.85	62,258,133.00	206,907,312.85
本期利润	50,795,981.16	-65,550,954.54	-14,754,973.38
本期基金份额交易产生的变动数	-75,100,674.62	-5,833,554.71	-80,934,229.33
其中：基金申购款	113,572,463.37	28,433,734.38	142,006,197.75
基金赎回款	-188,673,137.99	-34,267,289.09	-222,940,427.08
本期已分配利润	-37,412,868.72	-	-37,412,868.72
本期末	82,931,617.67	-9,126,376.25	73,805,241.42

单位：人民币元

长信双利优选混合 E			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	160,804.95	23,049.84	183,854.79
本期利润	60,254.62	-91,437.06	-31,182.44
本期基金份额交易产生的变动数	15,168.73	26,296.98	41,465.71
其中：基金申购款	284,271.38	-2,875.83	281,395.55
基金赎回款	-269,102.65	29,172.81	-239,929.84
本期已分配利润	-83,178.06	-	-83,178.06
本期末	153,050.24	-42,090.24	110,960.00

#### 7.4.7.11 存款利息收入

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
活期存款利息收入	165,344.15	334,256.88
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	31,270.65	48,118.87

其他	4,514.09	9,975.22
合计	201,128.89	392,350.97

注：其他为结算保证金利息收入及申购款利息收入。

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

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
卖出股票成交总额	957,492,052.28	2,420,351,353.85
减：卖出股票成本总额	901,535,088.12	2,123,721,640.29
买卖股票差价收入	55,956,964.16	296,629,713.56

#### 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 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
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	55,472.52	719,669.31
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	55,472.52	719,669.31

##### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

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
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	27,394,797.42	60,870,173.54
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	26,973,663.48	58,994,735.28
减：应收利息总额	365,661.42	1,155,768.95
买卖债券差价收入	55,472.52	719,669.31

##### 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内无债券投资赎回差价收入。

**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内无债券投资申购差价收入。

**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无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无贵金属投资收益。

**7.4.7.15 衍生工具收益****7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

**7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

**7.4.7.16 股利收益**

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
股票投资产生的股利收益	1,312,768.18	2,846,897.11
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	1,312,768.18	2,846,897.11

**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 12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月 31日
1. 交易性金融资产	-65,642,391.60	-3,338,304.40
——股票投资	-65,705,754.20	-3,018,780.88
——债券投资	63,362.60	-319,523.52
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-

——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-65,642,391.60	-3,338,304.40

#### 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	391,385.78	553,078.83
转换费收入	188,293.00	141,733.91
合计	579,678.78	694,812.74

注：对持续持有期少于30日的基金份额所收取的赎回费，全额计入基金财产；对于持有期不少于30日但少于3个月的基金份额所收取的赎回费，其75%计入基金财产；对于持有期不少于3个月但少于6个月的基金份额所收取的赎回费，其50%计入基金财产；对于持有期不少于6个月的基金份额所收取的赎回费，其25%计入基金财产。

#### 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	2,631,981.82	6,317,859.33
银行间市场交易费用	175.00	425.00
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
期货交易费用	-	-
合计	2,632,156.82	6,318,284.33

#### 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年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
审计费用	70,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-

帐户维护费	36,000.00	36,000.00
其他费用	11,009.83	12,810.85
合计	237,009.83	228,810.85

注：其他费用为银行手续费和上交所查询费。

## 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，本基金无需要说明的重大或有事项。

### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

## 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、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（以下简称“农业银行”）	基金托管人、基金销售机构
长江证券股份有限公司（以下简称“长江证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
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般商业条款订立。

## 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：本基金在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股票交易。

#### 7.4.10.1.2 债券交易

注：本基金在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债券交易。

### 7.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金在本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进回购交易。

### 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的权证交易。

### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无应付关联方的佣金。

## 7.4.10.2 关联方报酬

### 7.4.10.2.1 基金管理费

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
当期发生的基金应支付的管理费	3,935,026.28	9,228,065.94
其中：支付销售机构的客户维护费	1,033,975.93	1,231,107.89

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{基金管理费率} / \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

### 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
当期发生的基金应支付的托管费	655,837.71	1,538,010.99

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{基金托管费率} / \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

**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**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

**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**

份额单位：份

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	
	长信双利优选混合 A	长信双利优选混合 E
基金合同生效日（2019年9月4日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	692,139.84	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	692,139.84	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.91%	-

项目	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日	
	长信双利优选混合 A	长信双利优选混合 E
基金合同生效日（2019年9月4日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-

报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

注：基金管理人运用固有资金投资本基金费率按本基金招募说明书公布的费率执行。

#### 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

单位：人民币元

关联方名称	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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
农业银行	21,781,616.09	165,344.15	22,154,777.48	334,256.88

注：本基金用于证券交易结算的资金通过本基金托管人的基金托管结算资金专用存款账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息。于2021年12月31日的相关余额在资产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示（2020年12月31日：同）。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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

#### 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

长信双利优选混合A

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		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	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2021年3月31日	-	2021年3月31日	2.900	20,733,248.66	16,679,620.06	37,412,868.72	
合计	-	-		2.900	20,733,248.66	16,679,620.06	37,412,868.72	

长信双利优选混合E

金额单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日		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	本期利润 分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2021 年 3 月 31 日	-	2021 年 3 月 31 日	3.800	54,083.23	29,094.83	83,178.06	
合计	-	-	-	3.800	54,083.23	29,094.83	83,178.06	

## 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 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	可流 通日	流通 受限 类型	认购 价格	期末估 值单价	数量 (单位:股)	期末 成本总额	期末估值总额	备注
601728	中国电信	2021 年 8 月 11 日	2022 年 2 月 21 日	新股 限售	4.53	4.27	394,011	1,784,869.83	1,682,426.97	-
688303	大全能源	2021 年 7 月 15 日	2022 年 1 月 24 日	新股 限售	21.49	60.51	5,156	110,802.44	311,989.56	-
688800	瑞可达	2021 年 7 月 14 日	2022 年 1 月 24 日	新股 限售	15.02	133.53	1,967	29,544.34	262,653.51	-
688187	时代电气	2021 年 8 月 30 日	2022 年 3 月 7 日	新股 限售	31.38	76.65	3,047	95,614.86	233,552.55	-
688230	芯导科技	2021 年 11 月 24 日	2022 年 6 月 1 日	新股 限售	134.81	130.31	622	83,851.82	81,052.82	-
688176	亚虹医药	2021 年 12 月 29 日	2022 年 1 月 7 日	认 购 新 发 证 券	22.98	22.98	3,527	81,050.46	81,050.46	-

688049	炬芯科技	2021年11月22日	2022年5月30日	新股限售	42.98	51.71	1,304	56,045.92	67,429.84	-
688151	华强科技	2021年11月29日	2022年6月6日	新股限售	35.09	33.82	1,860	65,267.40	62,905.20	-
688262	国芯科技	2021年12月28日	2022年1月6日	认购新发证券	41.98	41.98	1,322	55,497.56	55,497.56	-
688265	南模生物	2021年12月21日	2022年6月28日	新股限售	84.62	65.03	594	50,264.28	38,627.82	-
301018	申菱环境	2021年6月28日	2022年1月7日	新股限售	8.29	26.06	782	6,482.78	20,378.92	-
301050	雷电微力	2021年8月17日	2022年2月24日	新股限售	60.64	234.74	74	4,487.36	17,370.76	-
300994	久祺股份	2021年8月2日	2022年2月14日	新股限售	11.90	45.45	365	4,343.50	16,589.25	-
301039	中集车辆	2021年7月1日	2022年1月10日	新股限售	6.96	12.51	1,198	8,338.08	14,986.98	-
301046	能辉科技	2021年8月10日	2022年2月17日	新股限售	8.34	48.99	290	2,418.60	14,207.10	-
301111	粤万年青	2021年11月30日	2022年6月7日	新股限售	10.48	36.68	355	3,720.40	13,021.40	-
301020	密封科技	2021年6月28日	2022年1月6日	新股限售	10.64	30.44	421	4,479.44	12,815.24	-

301026	浩通科技	2021年7月8日	2022年1月17日	新股限售	18.03	62.73	203	3,660.09	12,734.19	-
301021	英诺激光	2021年6月28日	2022年1月6日	新股限售	9.46	41.43	290	2,743.40	12,014.70	-
301188	力诺特玻	2021年11月4日	2022年5月11日	新股限售	13.00	20.48	505	6,565.00	10,342.40	-
301048	金鹰重工	2021年8月11日	2022年2月28日	新股限售	4.13	12.96	787	3,250.31	10,199.52	-
301028	东亚机械	2021年7月12日	2022年1月20日	新股限售	5.31	13.50	733	3,892.23	9,895.50	-
301118	恒光股份	2021年11月9日	2022年5月18日	新股限售	22.70	49.02	199	4,517.30	9,754.98	-
301180	万祥科技	2021年11月9日	2022年5月16日	新股限售	12.20	22.72	409	4,989.80	9,292.48	-
301040	中环海陆	2021年7月26日	2022年2月7日	新股限售	13.57	38.51	241	3,270.37	9,280.91	-
301149	隆华新材	2021年11月3日	2022年5月10日	新股限售	10.07	16.76	536	5,397.52	8,983.36	-
301025	读客文化	2021年7月6日	2022年1月24日	新股限售	1.55	20.88	403	624.65	8,414.64	-
300814	中富电路	2021年8月4日	2022年2月14日	新股限售	8.40	23.88	328	2,755.20	7,832.64	-

301133	金钟股份	2021年11月19日	2022年5月26日	新股限售	14.33	26.95	286	4,098.38	7,707.70	-
301030	仕净科技	2021年7月15日	2022年1月24日	新股限售	6.10	31.52	242	1,476.20	7,627.84	-
301033	迈普医学	2021年7月15日	2022年1月26日	新股限售	15.14	59.97	108	1,635.12	6,476.76	-
301032	新柴股份	2021年7月15日	2022年1月24日	新股限售	4.97	12.51	513	2,549.61	6,417.63	-
301036	双乐股份	2021年7月21日	2022年2月16日	新股限售	23.38	29.93	205	4,792.90	6,135.65	-
301198	喜悦智行	2021年11月25日	2022年6月2日	新股限售	21.76	29.20	209	4,547.84	6,102.80	-
301041	金百泽	2021年8月2日	2022年2月11日	新股限售	7.31	28.21	215	1,571.65	6,065.15	-
301049	超越科技	2021年8月17日	2022年2月24日	新股限售	19.34	32.92	184	3,558.56	6,057.28	-
001234	泰慕士	2021年12月31日	2022年1月11日	认购新发证券	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-
301038	深水规院	2021年7月22日	2022年2月7日	新股限售	6.68	20.23	266	1,776.88	5,381.18	-
301168	通灵股份	2021年12月2日	2022年6月10日	新股限售	39.08	52.13	96	3,751.68	5,004.48	-

301093	华兰股份	2021年10月21日	2022年5月5日	新股限售	58.08	49.85	99	5,749.92	4,935.15	-
301027	华蓝集团	2021年7月8日	2022年1月19日	新股限售	11.45	16.65	286	3,274.70	4,761.90	-
301037	保立佳	2021年7月21日	2022年2月7日	新股限售	14.82	24.26	193	2,860.26	4,682.18	-
301199	迈赫股份	2021年11月30日	2022年6月7日	新股限售	29.28	32.00	143	4,187.04	4,576.00	-
301108	洁雅股份	2021年11月25日	2022年6月6日	新股限售	57.27	53.71	79	4,524.33	4,243.09	-
301179	泽宇智能	2021年12月1日	2022年6月8日	新股限售	43.99	50.77	66	2,903.34	3,350.82	-
301193	家联科技	2021年12月2日	2022年6月9日	新股限售	30.73	29.14	113	3,472.49	3,292.82	-

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

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：本基金本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的融出证券。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括：信用风险、流动性风险和市场风险。本基金在下文主要论述上述风险敞口及其形成原因、风险管理目标、政策和过程以及计量风险的方法等。

本基金的基金管理人从事风险管理的目标是使本基金在风险和收益之间取得适当的平衡，以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。基于该风险管理目标，本基金的基金管理人已制定了政策和程序来辨别和分析这些风险，设定适当的风险限额并设计相应的内部控制程序，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人奉行全面风险管理体系理念，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。在董事会下设立风险控制委员会，负责对公司经营管理和基金业务运作的合法性、合规性进行全面的检查和评估等；在管理层层面设立内部控制委员会，主要职责是讨论审议公司内部控制制度及针对公司在经营管理和投资组合运作中的风险进行识别、评估并研究制订有效的防范措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部负责协调并与各部门合作完成运作风险管理工作，战略与产品研发部负责进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部向督察长负责，并向总经理汇报日常行政事务。

#### 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手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国农业银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，本基金投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评

估并采用券款对付交割方式以控制相应的信用风险。

#### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年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
未评级	0.00	16,976,863.60
合计	0.00	16,976,863.60

注：未评级债券为国债、央行票据、政策性金融债及超短期融资券等无信用评级债券。

#### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

#### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	267,768.20	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	267,768.20	0.00

注：未评级债券为国债、央行票据及政策性金融债等无信用评级债券。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评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付投资者赎回款项的风险。本基金流动性风险来源于开放式基金每日兑付赎回资金的流动性风险，以及因部分投资品种交易不活跃而出现的变现风险和因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理价格变现投资的风险。

### 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，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金坚持组合管理、分散投资的原则开展投资活动，所持证券均在证券交易所或银行间同业市场交易，并严格遵守基金管理人流动性相关交易限制。

本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，定期开展压力测试，评估在不同的压力情境下资产变现情况的变化。

基金管理人持续监测本基金开放期内的赎回情况，当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模和期限与负债赎回规模和期限的匹配。

同时，针对兑付赎回资金的流动性风险，基金管理人在基金合同中约定了巨额赎回条款，制定了发生巨额赎回时资金的处理模式，控制因开放模式而产生的流动性风险。

### 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各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 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而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：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						
银行存款	21,781,616.09	-	-	-	-	21,781,616.09
结算备付金	231,915.33	-	-	-	-	231,915.33
存出保证金	63,703.54	-	-	-	-	63,703.54
交易性金融资产	-	267,768.20	-	-	130,993,632.53	131,261,400.73
应收利息	-	-	-	-	5,127.56	5,127.56
应收申购款	-	-	-	-	15,134.06	15,134.06
资产总计	22,077,234.96	267,768.20	-	-	131,013,894.15	153,358,897.31
负债						

应付证券清算款	-	-	-	-	2,247,375.63	2,247,375.63
应付赎回款	-	-	-	-	34,569.85	34,569.85
应付管理人报酬	-	-	-	-	190,586.40	190,586.40
应付托管费	-	-	-	-	31,764.41	31,764.41
应付交易费用	-	-	-	-	179,999.01	179,999.01
应交税费	-	-	-	-	43,980.69	43,980.69
其他负债	-	-	-	-	299,035.42	299,035.42
负债总计	-	-	-	-	3,027,311.41	3,027,311.41
利率敏感度缺口	22,077,234.96	267,768.20	-	-	127,986,582.74	150,331,585.90
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	22,154,777.48	-	-	-	-	22,154,777.48
结算备付金	3,697,031.26	-	-	-	-	3,697,031.26
存出保证金	314,105.24	-	-	-	-	314,105.24
交易性金融资产	9,958,000.00	7,018,863.60	-	-	317,035,228.83	334,012,092.43
应收证券清算款	-	-	-	-	4,407,995.64	4,407,995.64
应收利息	-	-	-	-	153,979.08	153,979.08
应收股利	-	-	-	-	83,279.80	83,279.80
应收申购款	-	-	-	-	149,577.92	149,577.92
资产总计	36,123,913.98	7,018,863.60	-	-	321,830,061.27	364,972,838.85
负债						
应付证券清算款	-	-	-	-	5,788,320.78	5,788,320.78
应付赎回款	-	-	-	-	955,464.48	955,464.48
应付管理人报酬	-	-	-	-	440,059.08	440,059.08
应付托管费	-	-	-	-	73,343.18	73,343.18
应付交易费用	-	-	-	-	492,971.66	492,971.66
应交税费	-	-	-	-	43,980.00	43,980.00
其他负债	-	-	-	-	289,415.23	289,415.23
负债总计	-	-	-	-	8,083,554.41	8,083,554.41
利率敏感度缺口	36,123,913.98	7,018,863.60	-	-	313,746,506.86	356,889,284.44

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021年12月31日）	上年度末（2020年12月31日）
	市场利率下降27个基点	4,180.87	18,070.03

	市场利率上升 27 个基点	-4,180.87	-18,070.03
--	---------------	-----------	------------

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	21,900,618.74	-	21,900,618.74
应收股利	-	-	-	-
资产合计	-	21,900,618.74	-	21,900,618.74
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	21,900,618.74	-	21,900,618.74
项目	上年度末 2020年12月31日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	74,981,005.08	-	74,981,005.08
应收股利	-	83,279.80	-	83,279.80
资产合计	-	75,064,284.88	-	75,064,284.88
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净	-	75,064,284.88	-	75,064,284.88

额				
---	--	--	--	--

#### 7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	假设本基金的单一外币汇率变化 5%，其他变量不变；		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021 年 12 月 31 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	港币对人民币升值 5%	1,095,030.94	3,753,214.24
	港币对人民币贬值 5%	-1,095,030.94	-3,753,214.24

#### 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除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券以及银行间同业市场交易的债券，所面临的最大其他价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR (Value at Risk) 等指标来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 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	130,993,632.53	87.14	317,035,228.83	88.83
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	267,768.20	0.18	16,976,863.60	4.76
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	131,261,400.73	87.31	334,012,092.43	93.59

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	在 95%的置信区间内，基金资产组合的市场价格风险		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021年12月31日）	上年度末（2020年12月31日）
	VaR 值为 4.69%（2020年12月31日 VaR 值为 5.87%）	-7,057,656.60	-20,947,319.90

注：上述风险价值 VaR 的分析是基于资产负债表日所持证券过去一年市场价格波动情况而有可能发生的最大损失，且此变动适用于本基金所有的衍生金融工具及非衍生金融工具。取 95%的置信度是基于本基金所持有的金融工具风险度量的要求。2020 年的分析同样基于该假设。

#### 7.4.14 有助于理解和分析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应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

###### 7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 128,067,776.55 元，属于第二层次的余额为人民币 142,052.51 元，属于第三层次的余额为人民币 3,051,571.67 元（于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 307,773,022.11 元，属于第二层次的余额为人民币 17,150,444.91 元，属于第三层次的余额为人民币 9,088,625.41 元）。

###### 7.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

###### 7.4.14.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层次公允价值本期变动

情况如下：

上年度末余额为人民币 9,088,625.41 元，本期转入第三层次金额为人民币 0 元，转出第三层次金额为人民币 8,462,304.20 元，当期计入损益的利得或损失总额为人民币 16,322.64 元，本期购买金额为人民币 2,408,927.82 元，出售金额为人民币 0 元，本期末余额为人民币 3,051,571.67 元，本期末持有的资产计入损益的当期未实现利得或损失的变动金额为人民币 642,643.85 元。

#### **7.4.14.2 承诺事项**

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

#### **7.4.14.3 其他事项**

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## §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	130,993,632.53	85.42
	其中：股票	130,993,632.53	85.42
2	基金投资	-	-
	固定收益投资	267,768.20	0.17
	其中：债券	267,768.20	0.17
	资产支持证券	-	-
	贵金属投资	-	-
	金融衍生品投资	-	-
	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
	银行存款和结算备付金合计	22,013,531.42	14.35
	其他各项资产	83,965.16	0.05
	合计	153,358,897.31	100.00

注：本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 21,900,618.74 元，占资产净值比例 14.57%。本基金本报告期末未参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

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	农、林、牧、渔业	3,092,532.16	2.06
B	采矿业	-	-
C	制造业	77,773,235.67	51.73
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	4,713.80	0.00
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	6,137,080.00	4.08
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,741,275.35	1.16
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	5,607,640.83	3.73

M	科学研究和技术服务业	11,070,340.46	7.36
N	水利、环境和公共设施管理业	6,057.28	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	3,651,723.60	2.43
R	文化、体育和娱乐业	8,414.64	0.01
S	综合	-	-
	合计	109,093,013.79	72.57

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
A 基础材料	-	-
B 消费者非必需品	7,893,931.11	5.25
C 消费者常用品	6,989,733.74	4.65
D 能源	-	-
E 金融	-	-
F 医疗保健	-	-
G 工业	-	-
H 信息技术	-	-
I 电信服务	2,091,486.21	1.39
J 公用事业	-	-
K 房地产	4,925,467.68	3.28
合计	21,900,618.74	14.57

### 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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300012	华测检测	330,658	8,884,780.46	5.91
2	603899	晨光文具	137,500	8,870,125.00	5.90
3	603517	绝味食品	128,940	8,810,470.20	5.86
4	002832	比音勒芬	261,456	6,654,055.20	4.43
5	603833	欧派家居	44,500	6,563,750.00	4.37
6	603816	顾家家居	83,900	6,473,724.00	4.31
7	605338	巴比食品	182,800	6,368,752.00	4.24
8	09922	九毛九	455,174	5,098,458.59	3.39
9	01458	周黑鸭	1,055,000	5,071,899.84	3.37
10	06098	碧桂园服务	129,000	4,925,467.68	3.28
11	600258	首旅酒店	164,000	4,285,320.00	2.85
12	600519	贵州茅台	1,823	3,737,150.00	2.49

13	000858	五粮液	16,600	3,696,156.00	2.46
14	300015	爱尔眼科	86,370	3,651,723.60	2.43
15	603589	口子窖	44,500	3,153,715.00	2.10
16	002027	分众传媒	377,600	3,092,544.00	2.06
17	002714	牧原股份	57,956	3,092,532.16	2.06
18	603486	科沃斯	18,700	2,822,765.00	1.88
19	601888	中国中免	11,463	2,515,096.83	1.67
20	002304	洋河股份	14,500	2,388,585.00	1.59
21	300791	仙乐健康	54,150	2,258,055.00	1.50
22	605337	李子园	45,000	2,236,500.00	1.49
23	600460	士兰微	40,406	2,190,005.20	1.46
24	603259	药明康德	17,900	2,122,582.00	1.41
25	00700	腾讯控股	5,600	2,091,486.21	1.39
26	688661	和林微纳	20,261	2,037,446.16	1.36
27	06969	思摩尔国际	59,011	1,917,833.90	1.28
28	600754	锦江酒店	31,600	1,851,760.00	1.23
29	688696	极米科技	3,313	1,828,776.00	1.22
30	002791	坚朗五金	9,300	1,688,787.00	1.12
31	601728	中国电信	394,011	1,682,426.97	1.12
32	002372	伟星新材	67,100	1,631,872.00	1.09
33	300750	宁德时代	2,700	1,587,600.00	1.06
34	09992	泡泡玛特	40,800	1,491,106.18	0.99
35	300973	立高食品	10,600	1,400,048.00	0.93
36	09869	海伦司	84,500	1,304,366.34	0.87
37	688303	大全能源	5,156	311,989.56	0.21
38	688800	瑞可达	1,967	262,653.51	0.17
39	688187	时代电气	3,047	233,552.55	0.16
40	688230	芯导科技	622	81,052.82	0.05
41	688176	亚虹医药	3,527	81,050.46	0.05
42	688049	炬芯科技	1,304	67,429.84	0.04
43	688151	华强科技	1,860	62,905.20	0.04
44	688262	国芯科技	1,322	55,497.56	0.04
45	688265	南模生物	594	38,627.82	0.03
46	301018	申菱环境	782	20,378.92	0.01
47	301050	雷电微力	74	17,370.76	0.01
48	300994	久祺股份	365	16,589.25	0.01
49	301039	中集车辆	1,198	14,986.98	0.01
50	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.01
51	301111	粤万年青	355	13,021.40	0.01

52	301020	密封科技	421	12,815.24	0.01
53	301026	浩通科技	203	12,734.19	0.01
54	301021	英诺激光	290	12,014.70	0.01
55	301188	力诺特玻	505	10,342.40	0.01
56	301048	金鹰重工	787	10,199.52	0.01
57	301028	东亚机械	733	9,895.50	0.01
58	301118	恒光股份	199	9,754.98	0.01
59	301180	万祥科技	409	9,292.48	0.01
60	301040	中环海陆	241	9,280.91	0.01
61	301149	隆华新材	536	8,983.36	0.01
62	301025	读客文化	403	8,414.64	0.01
63	300814	中富电路	328	7,832.64	0.01
64	301133	金钟股份	286	7,707.70	0.01
65	301030	仕净科技	242	7,627.84	0.01
66	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
67	301032	新柴股份	513	6,417.63	0.00
68	301036	双乐股份	205	6,135.65	0.00
69	301198	喜悦智行	209	6,102.80	0.00
70	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00
71	301049	超越科技	184	6,057.28	0.00
72	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
73	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00
74	301168	通灵股份	96	5,004.48	0.00
75	301093	华兰股份	99	4,935.15	0.00
76	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00
77	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
78	301037	保立佳	193	4,682.18	0.00
79	301199	迈赫股份	143	4,576.00	0.00
80	301108	洁雅股份	79	4,243.09	0.00
81	301179	泽宇智能	66	3,350.82	0.00
82	301193	家联科技	113	3,292.82	0.00

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	09922	九毛九	39,453,931.97	11.05

2	603816	顾家家居	34,188,553.60	9.58
3	03690	美团-W	30,622,450.33	8.58
4	603833	欧派家居	30,108,013.14	8.44
5	002372	伟星新材	27,460,286.00	7.69
6	00700	腾讯控股	24,589,996.58	6.89
7	02331	李宁	24,387,825.85	6.83
8	01999	敏华控股	23,819,898.97	6.67
9	601888	中国中免	21,305,387.90	5.97
10	01458	周黑鸭	21,098,862.49	5.91
11	002791	坚朗五金	19,053,595.00	5.34
12	300012	华测检测	18,583,592.09	5.21
13	02020	安踏体育	18,009,741.19	5.05
14	603517	绝味食品	16,620,728.00	4.66
15	01810	小米集团-W	16,618,906.46	4.66
16	300015	爱尔眼科	16,394,855.15	4.59
17	603899	晨光文具	15,985,759.00	4.48
18	002044	美年健康	15,961,620.80	4.47
19	300887	谱尼测试	15,118,334.00	4.24
20	06969	思摩尔国际	14,910,372.98	4.18
21	000858	五粮液	14,303,531.00	4.01
22	002027	分众传媒	13,300,780.00	3.73
23	603233	大参林	12,908,257.60	3.62
24	300750	宁德时代	12,627,896.00	3.54
25	300383	光环新网	11,869,834.13	3.33
26	002832	比音勒芬	11,191,647.20	3.14
27	09992	泡泡玛特	10,826,122.39	3.03
28	00520	呷哺呷哺	10,135,503.01	2.84
29	300973	立高食品	9,614,597.60	2.69
30	002714	牧原股份	9,279,481.24	2.60
31	002695	煌上煌	8,654,146.00	2.42
32	002847	盐津铺子	8,086,697.00	2.27
33	688696	极米科技	7,912,028.42	2.22
34	300791	仙乐健康	7,850,170.00	2.20
35	601689	拓普集团	7,674,102.96	2.15

注：本项“买入金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑其它交易费用。

**8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细**

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	00700	腾讯控股	43,701,746.03	12.25
2	603833	欧派家居	37,342,581.91	10.46
3	601888	中国中免	35,937,228.39	10.07
4	01999	敏华控股	35,871,433.53	10.05
5	02020	安踏体育	31,506,010.43	8.83
6	03690	美团-W	29,260,693.95	8.20
7	09922	九毛九	28,639,503.99	8.02
8	002372	伟星新材	28,206,452.28	7.90
9	603816	顾家家居	28,147,773.14	7.89
10	02331	李宁	26,249,250.94	7.36
11	06969	思摩尔国际	25,255,086.48	7.08
12	300012	华测检测	23,299,857.49	6.53
13	603517	绝味食品	22,063,070.53	6.18
14	002714	牧原股份	21,125,178.00	5.92
15	601689	拓普集团	20,870,473.79	5.85
16	002791	坚朗五金	19,117,569.00	5.36
17	603899	晨光文具	17,688,317.00	4.96
18	01810	小米集团-W	15,739,018.98	4.41
19	300383	光环新网	15,165,466.00	4.25
20	002695	煌上煌	14,751,749.00	4.13
21	300887	谱尼测试	14,118,312.08	3.96
22	600309	万华化学	14,048,178.73	3.94
23	002044	美年健康	13,486,500.00	3.78
24	01458	周黑鸭	12,126,589.21	3.40
25	603233	大参林	11,844,774.34	3.32
26	300750	宁德时代	11,177,959.00	3.13
27	000596	古井贡酒	11,118,125.00	3.12
28	300015	爱尔眼科	11,101,073.84	3.11
29	603568	伟明环保	10,732,326.80	3.01
30	300454	深信服	10,412,000.00	2.92
31	000858	五粮液	9,728,500.10	2.73
32	002027	分众传媒	9,463,143.00	2.65
33	00520	呷哺呷哺	9,134,880.82	2.56
34	300791	仙乐健康	8,953,541.00	2.51

35	300037	新宙邦	8,898,690.29	2.49
36	09992	泡泡玛特	8,709,505.79	2.44
37	600486	扬农化工	8,622,129.00	2.42
38	002847	盐津铺子	8,546,573.00	2.39
39	300973	立高食品	8,344,908.90	2.34
40	601012	隆基股份	8,153,498.00	2.28
41	603236	移远通信	8,108,278.62	2.27
42	688696	极米科技	7,827,415.63	2.19
43	601021	春秋航空	7,710,340.60	2.16
44	300188	美亚柏科	7,228,126.36	2.03

注：本项“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑其它交易费用。

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	781,199,246.02
卖出股票收入（成交）总额	957,492,052.28

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”和“卖出股票的收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 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	-	-
	央行票据	-	-
	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
	企业债券	-	-
	企业短期融资券	-	-
	中期票据	-	-
	可转债（可交换债）	267,768.20	0.18
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	267,768.20	0.18

### 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（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	127045	牧原转债	1,930	267,768.20	0.18

## 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仓和损益明细

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政策

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 本期国债期货投资政策

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 本期国债期货投资评价

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被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

**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库情况的说明**

报告期内本基金投资的前十名股票中，不存在超出基金合同规定备选股票库的情形。

**8.12.3 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	63,703.54
	应收证券清算款	-
	应收股利	-
	应收利息	5,127.56
	应收申购款	15,134.06
	其他应收款	-
	待摊费用	-
	其他	-
	合计	83,965.16

**8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

**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：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

## § 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
长信双利优选混合 A	11,252	6,780.86	10,089,048.38	13.22%	66,209,154.72	86.78%
长信双利优选混合 E	33	3,550.95	0.00	0.00%	117,181.38	100.00%
合计	11,285	6,771.41	10,089,048.38	13.20%	66,326,336.10	86.80%

注：对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采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	长信双利优选混合 A	712,315.70	0.93%
	长信双利优选混合 E	0.00	0.00%
	合计	712,315.70	0.93%

注：对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采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（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	长信双利优选混合 A	0
	长信双利优选混合 E	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	长信双利优选混合 A	50~100
	长信双利优选混合 E	0
	合计	50~100

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长信双利优选混合 A	长信双利优选混合 E
基金合同生效日（2019年9月4日）基金份额总额	638,114,638.68	867,301.59
本报告期期初基金份额总额	149,671,042.55	127,074.25
本报告期基金总申购份额	90,798,542.07	191,139.08
减 本报告期基金总赎回份额	164,171,381.52	201,031.95
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	76,298,203.10	117,181.38

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期未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，成善栋先生不再担任公司董事长，由总经理覃波先生代任董事长。

自 2021 年 4 月 28 日起，刘元瑞先生担任公司董事长，总经理覃波先生不再代任董事长。

自 2021 年 8 月 9 日起，程燕春先生不再担任公司副总经理。

自 2021 年 8 月 19 日起，邓挺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媒介发布相关公告。

#### 11.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2021 年 5 月，中国农业银行总行决定谭敦宇任托管业务部总裁。

2021 年 8 月，中国农业银行总行决定王霄勇任托管业务部副总裁。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、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；报告期应支付给安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）审计的报酬为人民币 70,000.00 元，该审计机构为本基金提供的审计服务的连续年限为 3 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

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

### 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付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中国国际金融有限公司	1	575,081,906.86	33.33%	295,303.45	25.45%	-
太平洋证券	1	337,702,443.49	19.57%	246,963.20	21.29%	-
国金证券	1	175,507,764.71	10.17%	145,900.49	12.58%	-
国泰君安	1	171,472,834.34	9.94%	142,545.55	12.29%	-
广发证券	1	163,936,876.08	9.50%	93,928.59	8.10%	-
国盛证券	1	117,109,676.68	6.79%	73,931.34	6.37%	-
中邮	1	91,319,966.14	5.29%	85,046.86	7.33%	-
银河证券	1	55,237,435.78	3.20%	45,918.87	3.96%	-
海通证券	1	26,316,177.63	1.53%	21,876.59	1.89%	-
信达证券	2	7,488,272.21	0.43%	4,727.39	0.41%	-
中信证券	1	4,238,000.00	0.25%	4,008.77	0.35%	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
北京高华证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-

注：1、本报告期内本基金退租华泰证券交易单元1个。

## 2、专用交易单元的选择标准和程序

根据中国证监会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》（证监基字<1998>29号）和《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，本公司制定了租用证券公司专用交易单元的选择标准和程序。

### （1）选择标准：

- a、券商基本面评价（财务状况、经营状况）；
- b、券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）；
- c、券商每日信息评价（及时性和有效性）；
- d、券商协作表现评价。

### （2）选择程序：

首先根据租用证券公司专用交易单元的选择标准形成《券商服务评价表》，然后根据评分高低进行选择基金专用交易单元。

## 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

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中国国际金融有限公司	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
中邮	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	7,024,486.00	100.00%	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
北京高华证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-

## 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旗下部分开放式基金在天风证券股份有限公司开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021年1月14日
2	长信双利优选混合型证券投资基金2020年第4季度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2021年1月22日
3	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金2020年第4季度报告提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021年1月22日
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站、公司网站	2021年1月26日
5	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旗下部分开	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国	2021年3月16日

	放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	证监会电子披露网站、公司网站	
6	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金参加国金证券股份有限公司申购费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021年3月26日
7	长信基金管理有限责任公司关于长信双利优选混合型证券投资基金的分红公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021年3月29日
8	长信基金管理有限责任公司关于长信双利优选混合型证券投资基金暂停大额申购（含转换转入、定期定额投资）业务的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021年3月29日
9	长信双利优选混合型证券投资基金2020年年度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2021年3月30日
10	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金2020年年度报告提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021年3月30日
11	长信基金管理有限责任公司关于长信双利优选混合型证券投资基金恢复大额申购（含转换转入、定期定额投资）业务的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021年3月30日
12	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金参加中国银行股份有限公司申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021年3月31日
13	长信双利优选混合型证券投资基金2021年第1季度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2021年4月21日
14	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金2021年第一季度报告提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021年4月21日
15	长信基金管理有限责任公司关于董事长变更公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021年4月30日
16	长信基金管理有限责任公司公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021年6月22日
17	长信基金管理有限责任公司关于旗下40只公募基金增加侧袋机制并相应修改法律文件的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021年6月29日
18	长信基金管理有限责任公司关于调整长信旗下6只基金产品变更业绩比较基准并修改基金合同的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021年6月29日
19	长信基金管理有限责任公司关于修订旗下公开募集证券投资基金法律文件并更新产品资料概要的提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021年6月29日
20	长信双利优选混合型证券投资基金更新的招募说明书及基金产品资料概要(更新)	中国证监会电子披露网站、公司网站	2021年6月29日
21	长信双利优选混合型证券投资基金基金	中国证监会电子披露	2021年6月29日

	合同	网站、公司网站	日
22	长信双利优选混合型证券投资基金托管协议	中国证监会电子披露网站、公司网站	2021年6月29日
23	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金参加招商银行股份有限公司申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021年7月5日
24	长信基金管理有限责任公司关于增加西部证券股份有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021年7月14日
25	长信双利优选混合型证券投资基金2021年第2季度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2021年7月21日
26	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金2021年第二季度报告提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021年7月21日
27	长信基金管理有限责任公司关于增加京东肯特瑞基金销售有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021年7月22日
28	长信基金管理有限责任公司关于增加招商证券股份有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021年7月29日
29	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旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021年8月5日
30	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旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021年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、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021年8月11日
32	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旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021年8月13日
33	长信基金管理有限责任公司关于设立沈阳分公司的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021年8月18日
34	长信基金管理有限责任公司关于增加上海利得基金销售有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021年8月18日

	优惠活动的公告		
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、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021年8月20日
36	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金参加中国工商银行股份有限公司申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021年8月26日
37	长信双利优选混合型证券投资基金2021年中期报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2021年8月31日
38	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金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站、公司网站	2021年8月31日
39	长信基金管理有限责任公司关于增加江苏银行股份有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021年9月16日
40	长信基金管理有限责任公司关于增加上海基煜基金销售有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（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站、公司网站	2021年10月21日
41	长信双利优选混合型证券投资基金2021年第3季度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2021年10月27日
42	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金2021年第三季度报告提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021年10月27日
43	长信基金管理有限责任公司关于增加国泰君安证券股份有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021年11月9日
44	长信基金管理有限责任公司关于增加万联证券股份有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021年11月16日
45	长信基金管理有限责任公司关于养老金客户通过直销中心申购（含转换转入）旗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站、公司网站	2021年11月23日
46	长信双利优选混合型证券投资基金更新的招募说明书（2021年第【1】号）及基金产品资料概要（更新）	中国证监会电子披露网站、公司网站	2021年11月30日
47	长信基金管理有限责任公司关于增加华龙证券股份有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021年12月2日
48	长信基金管理有限责任公司关于增加上	上证报、中国证监会电	2021年12月3

	海万得基金销售有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	子披露网站、公司网站	日
49	长信基金管理有限责任公司关于增加东莞证券股份有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021年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	期初份额	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 1 月 5 日	30,000,000.00	0.00	30,000,000.00	0.00	0.00%
	2	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 11 月 21 日	39,503,570.58	44,679,702.61	84,183,273.19	0.00	0.00%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>1、基金净值大幅波动的风险 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，按照净值计算尾差处理规则可能引起基金份额净值异常上涨或下跌。</p> <p>2、赎回申请延期办理的风险 单一持有基金比例过高的投资者大额赎回后可能触发本基金巨额赎回条件，导致同期中小投资者小额赎回面临部分延期办理的情况。</p> <p>3、基金投资策略难以实现的风险 单一持有基金比例过高的投资者大额赎回后，可能引起基金资产总净值显著降低，从而使基金在投资时受到限制，导致基金投资策略难以实现。</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、《长信双利优选混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长信双利优选混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《长信双利优选混合型证券投资基金托管协议》；
- 5、报告期内在指定报刊上披露的各种公告的原稿；
- 6、长信基金管理有限责任公司营业执照、公司章程及相关资格批复文件。

### 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站：

长信基金管理有限责任公司

2022年3月31日