

长信颐天平衡养老目标三年持有期混合型 基金中基金（FOF） 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：中国民生银行股份有限公司

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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司（以下简称“中国民生银行”，下同）根据本基金基金合同的规定，于 2022 年 3 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。基金的业绩并不表示其表现。投资有风险，投资者在做出投资决定前，应仔细阅读本基金的招募说明书及其基金合同。

本报告期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§ 2 基金简	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信	6
2.5 其 资料.....	6
§ 3 要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 要会计 据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 三年基金的利润分配情况.....	11
§ 4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金 规 信情况的	14
4.3 管理人对报告期内公平 情况的	14
4.4 管理人对报告期内基金的投资 和 表现的	16
4.5 管理人对 经 、证 及行 的简要	16
4.6 管理人内 有 本基金的 核 情况.....	17
4.7 管理人对报告期内基金 值 等事 的	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的	18
4.9 报告期内管理人对本基金持有人 或基金资 净值 情 的	18
§ 5 托管人报告	19
5.1 报告期内本基金托管人 规 信情况	19
5.2 托管人对报告期内本基金投资 规 信、净值计 、利润分配等情况的	19
5.3 托管人对本年度报告中财务信 等内容的真实、准确和完整发表意	19
§ 6 计报告	20
6.1 计报告基本信	20
6.2 计报告的基本内容.....	20
§ 7 年度财务报表	22
7.1 资 表.....	22
7.2 利润表.....	23
7.3 所有者 （基金净值） 表.....	24
7.4 报表	25
§ 8 投资组合报告	55
8.1 期 基金资 组合情况.....	55
8.2 期 行 分 的股 投资组合.....	55
8.3 期 公 值 基金资 净值 大 的所有股 投资	56
8.4 报告期内股 投资组合的重大	56
8.5 期 分 的 投资组合.....	59
8.6 期 公 值 基金资 净值 大 的 投资	60
8.7 期 公 值 基金资 净值 大 的所有资 持证 投资	60

8.8 报告期 公 值 基金资 净值 大 的 金 投资	60
8.9 期 公 值 基金资 净值 大 的 证投资	60
8.10 报告期 本基金投资的股指期货 情况	60
8.11 报告期 本基金投资的国 期 情况	60
8.12 本报告期投资基金情况	61
8.13 投资组合报告	63
§ 9 基金份 持有人信	65
9.1 期 基金份 持有人 及持有人	65
9.2 期 基金管理人的 人 持有本基金的情况	65
9.3 期 基金管理人的 人 持有本 基金份 的情况	65
§ 10 基金份	67
§ 11 重大事 示	68
11.1 基金份 持有人大会	68
11.2 基金管理人、基金托管人的 基金托管 的重大人事	68
11.3 及基金管理人、基金财 、基金托管 务的	68
11.4 基金投资 的	68
11.5 本报告持有的基金发生的重大 事	68
11.6 基金 行 计的会计 事务所情况	68
11.7 管理人、托管人及其 管理人 或 等情况	68
11.8 基金 用证 公司 的有 情况	69
11.9 其 重大事	72
§ 12 投资者 的其 重要信	77
12.1 报告期内 投资者持有基金份 或 20%的情况	77
12.2 投资者 的其 重要信	77
§ 13 目录	78
13.1 目录	78
13.2 存	78
13.3	78

§2 基金简

2.1 基金基本情况

基金 称	长信颐天平养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）	
基金简称	长信颐天养老三年持有混合（FOF）	
基金	00 2	
基金	型	
基金合同生 日	2019 年 9 月 2 日	
基金管理人	长信基金管理有限责任公司	
基金托管人	中国民生银行股份有限公司	
报告期 基金份	39 0 0 1 份	
基金合同存 期	不定期	
下 分 基金的基金简称:	长信颐天养老三年持有混合（FOF）A	长信颐天养老三年持有混合（FOF）
下 分 基金的 :	00 2	00 3
报告期 下 分 基金的份	20 20 0 1 份	192 299 32 份

2.2 基金

投资目标	在 的 提下， 的资 配 、基金 ， 基金资 定 值。	
投资	本 定 中等 、长期投资，以承担中等 长期 的 报。股 、 股 型基金、混合型基金和 基金（ 期 基金和 金 F）的 合 计不 0 ， 以 目标 的投资者 。	
基准	0 中证 指 0 中证 股型基金指	
	本基金 于 管理混合型 FOF 基金， 期 期 于股 型基金、 于 型基金 基金。	

2.3 基金管理人和基金托管人

目	基金管理人	基金托管人
称	长信基金管理有限责任公司	中国民生银行股份有限公司
信 责人	021 1009999	010 0
务	00 00	9
真	021 1009 00	010 0933 2
公	中国（上 ） 由 银 中 9	复 内大 2
公	上 银 中 9	复 内大 2
	200120	100031

法定 表人		
-------	--	--

2.4 信

本基金 定的信 报 称	中国证 报
载基金年度报告 的管理人	
基金年度报告	上 银 中 9 , 复 内大 2

2.5 其 资料

目	称	公
会计 事务所	会计 事务所 (合)	上 222 30
记	长信基金管理有限责任公司	上 银 中 9

§ 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 币：人民

3.1.1 期 据 和指 标	2021 年		2020 年		2019 年 9 月 2 日 基金合同生 日 2019 年 12 月 31 日	
	长信颐天养老 三年持有混合 (FOF) A	长信颐天养老 三年持有混合 (FOF)	长信颐天养老 三年持有混合 (FOF) A	长信颐天养老 三年持有混合 (FOF)	长信颐天养老 三年持有混合 (FOF) A	长信颐天养老 三年持有混合 (FOF)
本期 已实 现	21 90	12 33 3 0	3 92 02 12	3 0 91 1	0 39	3 91
本期 利润	12 3 31	10 1 2	322	11 322 1 2	2 19 09	3 9
平 基金 份 本期 利润	0 0 1	0 0 21	0 2 3	0 2 23	0 012	0 01 1
本期 平 净值 利润	3		22 2	22 31	1 2	1 0
本期 基金 份 净值 长	0	9	2 0	2 91	1 2	1 2
3.1.2 期 据 和指 标	2021 年		2020 年		2019 年	
期 分 配	3 900 2 02	3 101 30 9	3 19 0 0	3 1	0 03	101 1 9

利润						
期						
分配 基金份 利润	0 01 9	0 01 1	0 1 9	0 1 1	0 002	0 0023
期 基金 资 净值	21 2 0 922 2	201 13 1 9	2 3 0 2 1	0	19 031 9 9	13 1 9 2 3
期 基金 份 净值	1 0	1 0 9	1 2 2	1 2	1 012	1 012
3.1.3 计 期 指标	2021 年		2020 年		2019 年	
基金 份 计 净值 长	33 03	32 3	2 2	2	1 2	1 2

：1、本期已实现 指基金本期利 、投资 、其 （不 公 值 ）

用的 ，本期利润 本期已实现 上本期公 值 。

2、所述基金 指标不 持有人 或 基金的 用（ ， 基金 金、基金的 、 利 投资 、基金 等），计 用 实 平要 于所 字。

3、期 分配利润 期 资 表中 分配利润 分配利润中已实现 分的 。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份 净值 长 及其 同期 基准 的

长信颐天养老三年持有混合（FOF）A

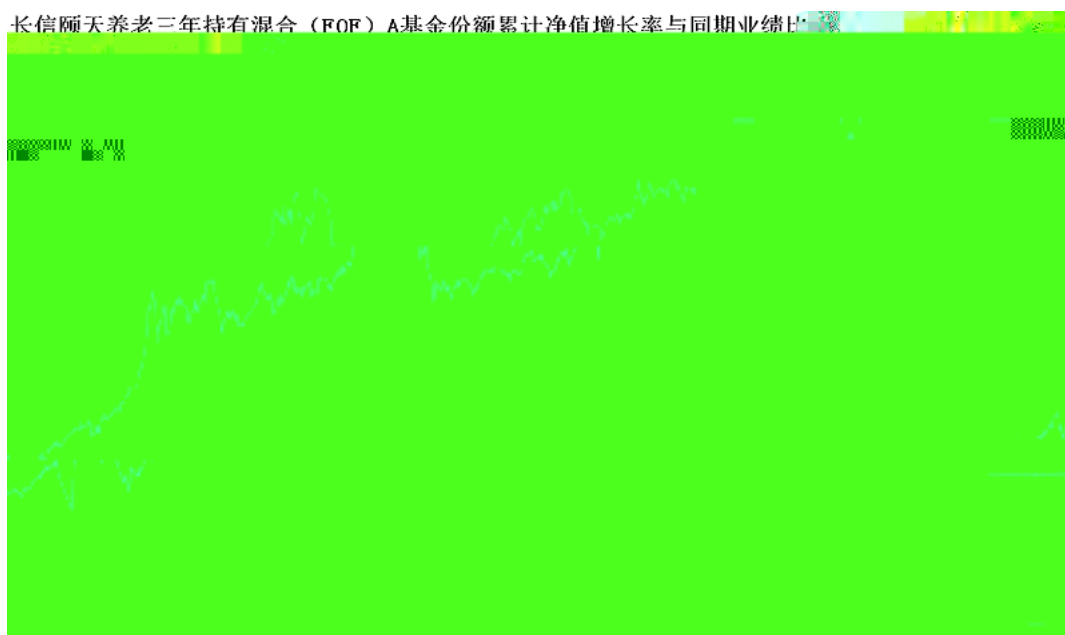
	份 净值 长	份 净值 长 标 准	基准	基准 标准		
三个月	3 39	0 2	1	0 0	1	0 12
个月		0 0	0 23	0	1	0 0

年	0	0	3	0 3	0 29	0 02
基金合同 生	33 03	0	3	0	1	0 01

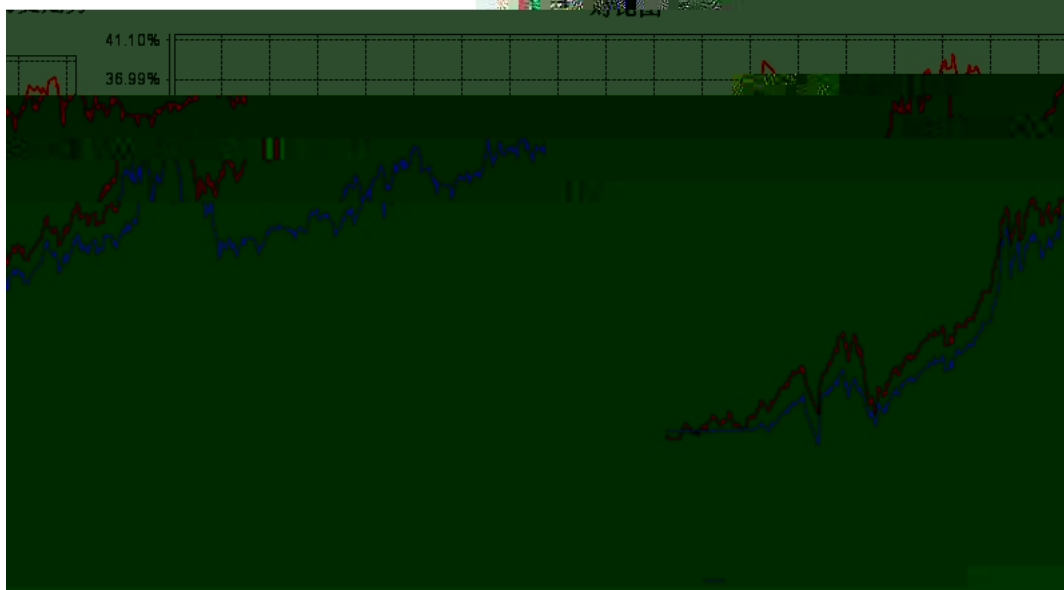
长信颐天养老三年持有混合（FOF）

	份 净值 长	份 净值 长 标 准	基准	基准 标准		
三个月	3 3	0 2	1	0 0	1 1	0 12
个月	2	0 0	0 23	0		0 0
年	9	0	3	0 3	0 39	0 02
基金合同 生	32 3	0	3	0	01	0 01

3.2.2 基金合同生 以 基金份 计净值 长 及其 同期 基准 的



长信颐天养老三年持有混合（FOF）C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

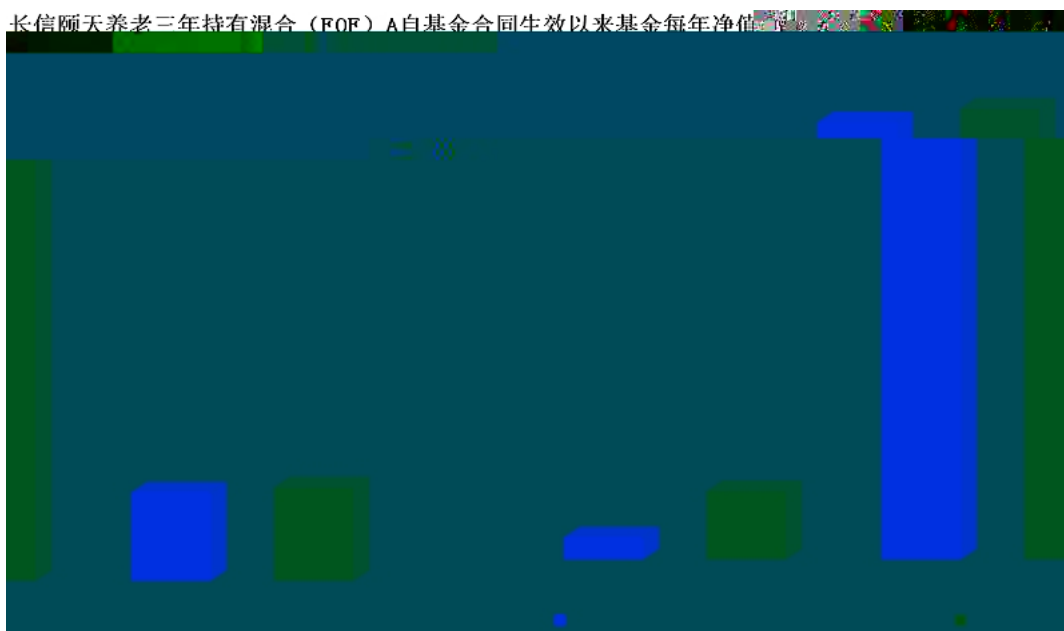


：1、 示日期 2019年9月2日 2021年12月31日。

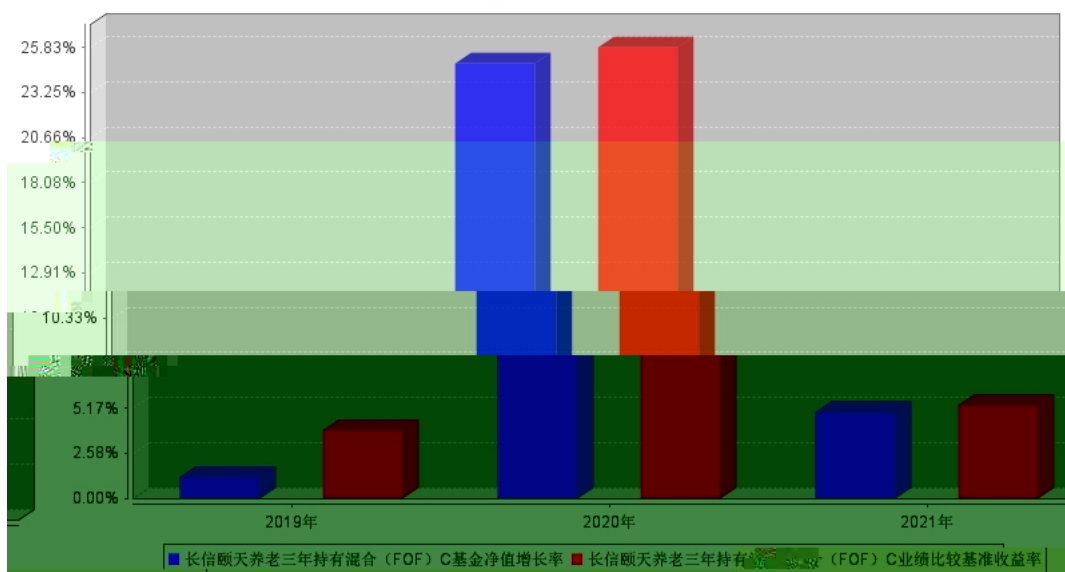
2、 基金合同规定，本基金 基金合同生 之日 个月内 期。 期 ，本基金的 投资 已 合基金合同 定。

3.2.3 基金合同生 以 基金 年净值 长 及其 同期 基准 的

长信颐天养老三年持有混合（FOF）A自基金合同生效以来基金每年净值



长信颐天养老三年持有混合（FOF）C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对比图



：本基金基金合同生效日 2019年9月2日，2019年净值增长率为5.17%，2020年实际存续期为10.33%，2021年实际存续期为18.08%。

3.3 三年基金的利润分配情况

：人民币

年度	10份基金份额	现金 发	投资 发	年度利润分配合计
2021	2 00	3 03 012 22	11 3	0
2020				
2019				
合计	2 00	3 03 012 22	11 3	0

：人民币

年度	10份基金份额	现金 发	投资 发	年度利润分配合计
2021	2 00	1 03 129 1	9 32 2	2 03 9
2020				
2019				
合计	2 00	1 03 129 1	9 32 2	2 03 9

：本基金本报告期的利润分配情况，。

§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

长信基金管理有限责任公司 经中国证 会证 基金字 2003 3 准，由长 证 股 份有限公司、上 份有限公司、 份有限公司共同发 立。 资本 1 人民 。目 股 : 长 证 份有限公司 、上 份有限公司 31 21 、 有限公司 1 1 、上 投资管理中 (有限合) 、上 投资管理中 (有限合) 。

2021 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理 2 基金， 长信利 证 投资基金、长信银利 混合型证 投资基金、长信金利 混合型证 投资基金、长信 利 混合型证 投资基金、长信利 型证 投资基金、长信 利 混合型证 投资基 金、长信 混合型证 投资基金、长信 国标准 100 等 重指 型证 投资基金、 长信利 型证 投资基金 OF 、长信内 长混合型证 投资基金、长信 型证 投资基金、长信利 型证 投资基金 OF 、长信 年定期 型证 投资基金、长 信 型证 投资基金、长信 利 配 混合型证 投资基金、长信 中 股 型证 投资基金、长信 利 配 混合型证 投资基金、长信利 型证 投资基金、 长信利 配 混合型证 投资基金、长信利 配 混合型证 投资基金、长信 利 配 混合型证 投资基金、长信 配 混合型证 投资基金、长信 股 型证 投资基金、长信 保 行 配 混合型证 投资基金 (OF)、长信 民 年定期 型证 投资基金、长信 年定期 型证 投资基金、长信利保 型证 投 投资基金、长信金 年定期 型证 投资基金、长信 年定期 型证 投资基金、长信利 配 混合型证 投资基金、长信利发 型证 投资基金、长信 信 行 配 混合型证 投资基金、长信 平 年定期 型证 投资基金、 长信 利 年定期 混合型证 投资基金、长信 股 型证 投资基金、长信 型证 投资基金、长信利信 配 混合型证 投资基金、长信 型证 投资基 金、长信国 配 混合型证 投资基金、长信 型证 投资基金、长信 型证 投资基金、长信中证 00 指 型证 投资基金、长信长金 基金、 长信 三个月定期 型发 证 投资基金、长信 保行 股 型证 投资基 金、长信利 年定期 混合型证 投资基金、长信 信 配 混合型证 投资基金、长信 证 投资基金、长信 三个月定期 型发 证 投资基金、长信 年定

期 配 混合型证 投资基金、长信 行 股 型证 投资基金、长信
 年定期 配 混合型证 投资基金、长信 值 混合型证 投资基金、长信
 值 年定期 配 混合型证 投资基金、长信 三个月定期 型发 证
 投资基金、长信 资 配 混合型基金中基金（FOF）、长信 值 混合型证 投资基金、长
 信利 型证 投资基金、长信 300 指 型证 投资基金、长信 年定期
 型证 投资基金、长信合利混合型证 投资基金、长信 利 混合型证 投资基金、
 长信 年定期 型证 投资基金、长信颐天平养老目标三年持有期混合型基金中基
 金（FOF）、长信 混合型证 投资基金、长信中证 及 0 指 证 投资基金、
 长信 混合型证 投资基金、长信中 1 3 年 性金 指 证 投资基金、长信
 混合型证 投资基金、长信 个月定期 型证 投资基金、长信 利资 配 年持
 有期混合型基金中基金（FOF）、长信 利 混合型证 投资基金、长信 混合型证
 投资基金、长信 年持有期 配 混合型证 投资基金、长信 衡 个月持有
 期混合型证 投资基金、长信 混合型证 投资基金、长信内 衡混合型证 投资基金、
 长信 30 天 持有 型证 投资基金、长信 型证 投资基金、长信 型证
 投资基金、长信 三个月持有期混合型证 投资基金、长信颐和平养老目标三年持有
 期混合型基金中基金（FOF）。

4.1.2 基金经理（或基金经理 组）及基金经理 理简

	务	任本基金的基金经理（理） 期限		证 年 限	
		任 日期	任日期		
	长信 资 配 混合 型基金中基 金（FOF）、长 信颐天平 养老目标三 年持有期混 合型基金中 基金（FOF）、 长信 利资 配 年 持有期混合 型基金中基 金（FOF）和 长信颐和平 养老目标	2020 年 月 日		1 年	管理 ， 大 管理 ， 在 投资发 有限公 司担任 、 和 资 管理有限公司 担任 ， 201 年 3 月 长 信基金管理有限 责任公司， 任国 务 、长信 年定期 型证 投资基 金、长信利 配 混合型证 投资 基金、长信上证 股

	<p>三年持有期 混合型基金 中基金（FOF） 的基金经理、 养老 FOF 投 资</p>				<p>指 型发 证 投资基金、长信 国标准 100 等 重指 型证 投资基金和长信 证 投资 基金的基金经理。现 任养老 FOF 投资 、长信 资 配 混合型基金中 基金（FOF）、长信颐 天平平衡养老目标三 年持有期混合型基金 中基金（FOF）、长 信 利资 配 年持有期混合型基金 中基金（FOF）和 长信颐和平衡养老 目标三年持有期混 合型基金中基金 （FOF）的基金经理。</p>
--	---	--	--	--	--

：1、任基金经理任 日期以本基金 立之日 准 或 基金经理的日期根据对
的公告日期

2、证 的 证 人 资 管 理 法 的 规 定。

4.2 管理人对报告期内本基金 规 信情况的

本基金管理人在报告期内， 了 中 人民共和国证 投资基金法 及其 有 法律
法规、基金合同的规定， 责 基金份 持有人 利 ，不存在 基金份 持有人利
的行 。

本基金 以 信于 、 信于 会投资公 ，承诺 本 诚实信用、
责的 管理和 用基金财 ，在规 基金 和 投资 的 提下， 基
金份 持有人 大利 。

4.3 管理人对报告期内公平 情况的

4.3.1 公平 度和 法

1、所有投资对 的投资指 经由 或其 人 核分配 人 行。
行投资指 分配的人 保证投资指 公平对 。

2、公司用的行下：

(1) 发送托指

(2) 对于一个投资组合在同同证下的同的投资指，并在限内的，对证下的托指分投资组合的托指。对于不同投资组合不同投资经理对所同证的同指，指：1 或以上的，根据情况核人分发不同公平。

3、人对于的指、的行。在行个投资组合在同同证下的同的所投资指，度规定的指，已公平。

、对于不同投资组合行、公发行股等中的投资对，独立投资组合的投资指，在生，不以任人投资指的内容，指及等要。

、对于投资组合以独立行的投资对，经公平性核的指，配的证由投资管理证记发送的据行分配。根据证发行人在指定公上的对内分配行核准，不的，第告投资管理及核。对于以公司行的投资对，公司在配度确定，的在投资组合行分配。同的投资组合根据投资指的行分配。确不上述行分配的，别，核的，以行分配。

4.3.2 公平的行情况

本报告期内，公司已实行公平度，并立公平度，已立投资，行的内，并度、和保证公平的实现。同，公司已对投资行的、分和信对公平和的。

4.3.3 行的

本报告期内，完有指的行投资的组合，其投资组合发生所公同日的证日的情，发现行。同，对本年度同行分，发现情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资和表现的

4.4.1 报告期内基金投资 和 分

2021年，经济和资本发生大的年。经济，大出现了的上，中国的大分其国和，出现了的，年的重大，长性的，期性行和表现，并定程度上了其表现的行，分中个股的表现年有。

分表现，上期中年，金下表现。分度，上期和中在3度表现，在度出现。值，现出的分，中值公司大值公司。股基金行配情况，公基金在配1度，下行，在、期的配提，配2020年年中以现下的。

股，利的上行，以及、据、等的管，生指及中指表现。度以，期的提，指持上行，对股值。

中，指的表现分，要基指。年，值平，指的股。

报告期内，本基金持中性的资配，出重的配。资上，以利和等信用基金的配，组合对于信用的。本基金承责的度，持分，在的基上对定的。

4.4.2 报告期内基金的表现

2021年12月31日，长信颐天养老三年持有混合（FOF）A份净值10，份计净值132，本报告期内长信颐天养老三年持有混合（FOF）A净值长0长信颐天养老三年持有混合（FOF）份净值109，份计净值1329，本报告期内长信颐天养老三年持有混合（FOF）净值长9，同期基准3。

4.5 管理人对经济、证及行的简要

2022年，期的有利于性，期在个度或有性。对于国内有利的在于国内“长”期的确和性，的确性在2022年确。在，

定保持 定，在保持整 配 对 衡的 提下，对 长，同 值 平合理的 行配。

4.6 管理人内 有 本基金的 核 情况

本年度内，本基金管理人 证 投资基金法 及配 法律法规， 以合规 、核，以 基金持有人利，保证基金合同 行。公司 核独立，对基金 行事、事中 事的，发现 及 提出 并 务 行整，同 定期 公司董事会和公司管理 出 核报告。

本年度内， 确保 管要 的有 实，公司 核 根据 法律法规 管 性要 以及公司内 行情况， 公司 务 及 理的， 组 内 会会，对 管要 行，并对 务 务 及 度规 的 整 行， 对 务 合规 导及。

本年度内， 核 以组合 要，定期对投资组合的 况 行，对投资组合整 性情况 行分，并 务 的 会 的行、， 组合 事 发生。

本基金管理人承诺 本 诚实信用、 责的， 持、内 的理，不 提 内 核 的 性和实 性、并完 内， 内， 和， 确保基金资 的规， 分保 基金持有人的合法。

4.7 管理人对报告期内基金 值 等事 的

本基金管理人 会计准、中国证 会 规定和基金合同 于 值的 定，对 基金持有的投资 行 值。基金托管人根据法律法规要 对基金管理公司 用的 值 和 行核，并对 值 及净值计 行复核。

根据 法律法规，本基金管理人 了、有 的 值 和 值， 立了 值 会， 值 会 公司基金 值的 要，其 要 责 责 定公司的 值、 值 法及 用的 值 和，对公司现有 和 行复核和， 发生了 值 和 的有 性及 用性的情况及 值 值 会 由基金事务、投资、 等 务 责人以及基金事务 务 共同组， 人 有的证 行 经， 法规 和 值 法， 值 务所 的 任。 对于基金的 值 和 值，公司已 基金托管人 分，并 意。 计本基金

的会计师事务所 公司基金 值 和 的 性。

本基金管理人已 中 国 记 有 限 责 任 公 司 及 中 证 指 有 限 公 司 签 务 ， 由 其 定 分 别 提 银 行 同 及 所 的 的 值 据 以 及 限 股 的 。 值 不 存 在 任 重 大 利 。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的

根据 法律法规和本基金基金合同规定的基金 分配 以及基金实 情况，本基 金本报告期 行了 利润分配， 情况 下：

长信颐天养老三年持有混合（FOF）A： 记日 2021 年 1 月 2 日， 日 2021 年 1 月 2 日， 10 份基金份 分 2 000 ， 现 金 发 29 92 ， 投 资 发 1 2 2 ， 利 润 分 配 合 计 3 1 1 39 。

记日 2021 年 12 月 1 日， 日 2021 年 12 月 1 日， 10 份基金份 分 0 00 ， 现 金 发 13 109 323 ， 投 资 发 3 03 2 ， 利 润 分 配 合 计 1 1 1 9 2 。

长信颐天养老三年持有混合（FOF）： 记日 2021 年 1 月 2 日， 日 2021 年 1 月 2 日， 10 份基金份 分 2 000 ， 现 金 发 3 3 31 ， 投 资 发 29 0 0 ， 利 润 分 配 合 计 9 9 202 0 。

记日 2021 年 12 月 1 日， 日 2021 年 12 月 1 日， 10 份基金份 分 0 00 ， 现 金 发 10 19 9 9 ， 投 资 发 23 22 ， 利 润 分 配 合 计 1 0 3 3 91 。

本基金 分配 下：

根据 法律法规和本基金基金合同规定的基金 分配 以及基金实 情况，本基 金本报告期 有 行利润分配。本基金 分配 下：

1、本基金在 合有 基金分 的 提下 行 分配， 分 基金管理人根 据基金 情况 不定期发 的 分 公告， 基金合同 生 不 3 个月 不 行 分配

2、本基金 分配 分 ： 现 金 分 利 投 资 ， 投 资 者 现 金 利 或 现 金 利 基 金 份 行 投 资 投 资 者 不 ， 本 基 金 的 分 配 现 金 分

3、基金 分配 基金份 净值不 于 值 基金 分配基准日的基金份 净值 基金份 分配金 不 于 值。

- 、 基金份 有同等分配
- 、法律法规或 管 有规定的， 其规定。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人 或基金资 净值 情 的

。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人 规 信情况

本报告期内，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管 中， 证 投资基金法 及其 法律法规和基金合同、托管 的有 规定， 法 保管了基金财 ，不存在基金份 持有人利 的行 ， 责 行了基金托管人 的 务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资 规 信、净值计 、利润分配等情况的

本报告期内， 法律法规和基金合同、托管 的有 规定，本托管人对本基金的投资 行了 ，对基金资 净值计 、基金份 的计 、基金 用 及利润分配等 行了 真的复核， 发现基金管理人 有 基金份 持有人利 的行 ，在重要 的 基金合同的规定 行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信 等内容的真实、准确和完整发表意

本托管人复核 的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确和完整。

§6 计报告

6.1 计报告基本信

财务报表 经 计	
计意 型	标准 保 意
计报告	报 字 22 第 00111

6.2 计报告的基本内容

计报告标	计报告
计报告 人	长信颐天平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金 FOF 持 有人
计意	<p>计了长信颐天平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金 FOF 的财务报表， 2021 年 12 月 31 日的资 表， 2021 年度的利润表、所有者 基金净值 表以及 财务报表。</p> <p>， 的财务报表在所有重大 会计准 和中国证 管理 会发 的 于基金行 实务 的有 规定 ，公 了长信颐天平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金 FOF 2021 年 12 月 31 日的财务 况以及 2021 年度的经 和基金净值 情况。</p>
计意 的基	<p>中国 会计 计准 的规定 行了 计 。计报告 的“ 会计 对财务报表 计的责任” 分 述了 在 准 下的责任。 中国 会计 ， 独 立于长信颐天平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金 FOF ， 并 行了 的其 责任。 信， 的 计证 据 分、 的， 发表 计意 提 了基 。</p>
事	
其 事	
其 信	<p>长信基金管理有限责任公司 以下简称“基金管理人” 管理 对其 信 责。其 信 长信颐天平衡养老目标三年持有期混合 型基金中基金 FOF 2021 年度报告中 的信 ， 不 财务报 表和 的 计报告。</p> <p>对财务报表发表的 计意 不 其 信 ， 不对其 信 发表任 的 证 。</p> <p>合 对财务报表的 计， 的责任 其 信 ，在 中， 其 信 财务报表或 在 计 中了 的情况存在重大不 或者 存在重大 报。</p> <p>基于 已 行的 ， 确定其 信 存在重大 报， 报告 事实。在 ， 任 事 要报告。</p>
管理 和 理 对财务报表的 责任	<p>基金管理人管理 责 会计准 和中国证 管理 会发 的 于基金行 实务 的有 规定 财务报表， 其 实现公 ， 并 计、 行和 要的内 ， 以 财务报</p>

	<p>表不存在由于 或 误导 的重大 报。</p> <p>在 财务报表 ，基金管理人管理 责 长信颐天平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金 FOF 的持 经 ，持 经 的事 用，并 用持 经 假 ， 基金管理人管理 计 长信颐天平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金 FOF 、 经 或别 其 现实的 。</p> <p>基金管理人 理 责 长信颐天平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金 FOF 的财务报告 。</p>
<p>会计 对财务报表 计的 责任</p>	<p>的目标 对财务报表整 不存在由于 或 误导 的重大 报 合理保证，并出 计意 的 计报告。合理保证 平的保证，并不 保证 计准 行的 计在 重大 报存在 发现。报 由于 或 误导 ， 合理 期 报 独或 财务报表 用者 据财务报表 出的经 ， 报 重大的。</p> <p>在 计准 行 计 的 中， 用 ，并保持 。同 ， 行以下 ：</p> <p>1 别和 由于 或 误导 的财务报表重大 报 ， 计和实 计 以 对 ，并 分、 的 计证据， 发表 计意 的基 。由于 及 、 、 意 漏、虚假陈述或 于内 之上， 发现由于 导 的重大 报的 于 发现由于 误导 的重大 报的 。</p> <p>2 了 计 的内 ，以 计 的 计 ， 目的 并 对内 的有 性发表意 。</p> <p>3 基金管理人管理 用会计 的 性和 出会计 计 及 的合理性。</p> <p>对基金管理人管理 用持 经 假 的 性 出 。同 ，根据 的 计证据， 导 对长信颐天平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金 FOF 持 经 生重大 的事 或情况 存在重大不确定性 出 。 出 存在重大不确定性， 计准 要 在 计报告中提 报表 用者 意财务报表中的 不分， 发表 保 意 。 的 基于 计报告日 的信 。 ， 的事 或情况 导 长信颐天平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金 FOF 不 持 经 。</p> <p>财务报表的 报 、 和内容，并 财 务报表 公 和事 。</p> <p>基金管理人 理 计 的 计 、 和重大 计 发现等事 行 ， 在 计中 别出的值 的内 。</p>
<p>会计 事务所的 称</p>	<p>会计 事务所 合</p>
<p>会计 的</p>	
<p>会计 事务所的</p>	<p>上 222 30</p>
<p>计报告日期</p>	<p>2022 年 3 月 2 日</p>

§7 年度财务报表

7.1 资 表

会计：长信颐天平养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）

报告日：2021 年 12 月 31 日

：人民

资		本期 2021 年 12 月 31 日	上年度 2020 年 12 月 31 日
资：			
银行存	7.4.7.1	2 12 90	92 0
金		1 1 9 0 2 09	0 1
存出保证金		1 1	112 1
性金 资	7.4.7.2	01 21 92 1	299 933 011
其中：股 投资		3 3 9 1	3 3 1 92
基金投资		3 3 0 0 9	2 9 9 1 3 9
投资		21 31 3 20	1 312 0 00
资 持证 投资			
金 投资			
生金 资	7.4.7.3		
金 资	7.4.7.4	13 100 000 00	
证			
利	7.4.7.5	9 9 39	19 3
股利		2 0 00	
		1 3 9 9	1 3 2
所 资			
其 资	7.4.7.6	2 9 90	3 2 13
资 计		23 01 1	301 20 91
和所有者		本期 2021 年 12 月 31 日	上年度 2020 年 12 月 31 日
：			
期			
性金			
生金	7.4.7.3		
出 金 资			
证		1 2 9 09	
管理人报		223 23 3	1 3 13
托管		1 201 9	9 0 2
务		1 23 9	0
用	7.4.7.7	29 12 0	1 3 3 2
		3 3	3 93 3
利			

利润			
所			
其	7.4.7.8	1 9 000 00	1 9 000 00
合计		192 23 9	22 3
所有者：			
实 基金	7.4.7.9	39 0 0 1	23 3 30
分配利润	7.4.7.10	1 0 22	3 1 3 320 9
所有者 合计		1 3 0	300 3 1 9 09
和所有者 计		23 01 1	301 20 91

：报告 日2021年12月31日，长信颐天平养老 FOF A 份 净值人民 1 0 ，基金份 20 20 0 1 份 长信颐天平养老 FOF 份 净值人民 1 0 9 ，基金份 192 299 32 份 份 合计 39 0 0 1 份。

7.2 利润表

会计：长信颐天平养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）

本报告期：2021年1月1日 2021年12月31日

：人民

目		本期	上年度 期
		2021年1月1日 2021年12月31日	2020年1月1日 2020年12月31日
、		29 91 1 9	2 0 0 1 0
1.利		13 9 3 3	2 11
其中：存 利	7.4.7.11	39 1 23	0 1 2 91
利		092	3 10
资 持证 利			
金 资		9 2	11 22 0
证 出 利			
其 利			
2.投资（以“-”）		0 3 320 3	9 911 99 3
其中：股 投资	7.4.7.12	10 01 0 99	1 0 2
基金投资	7.4.7.13	1 9 1	2 2 0 3
投资	7.4.7.14	22 0 3	3 01 0
资 持证 投资	7.4.7.14.5		
金 投资	7.4.7.15		
生	7.4.7.16		
股利	7.4.7.17	1 222 9 3 2	3
3.公 值（以“-”）	7.4.7.18	11 21 02 0	1 0 21 3
4.（以“-”）			

5.其他（以“-”）	7.4.7.19	1 2 9 3	1 9 1 99
：二、用		91	2 3 333 9
1 管理人报	7.4.10.2.1	2 1 3 9	1 1 22
2 托管	7.4.10.2.2	19 0 3 3	31 9 3 2
3 务	7.4.10.2.3	1 0 321 1	0 90 92
4 用	7.4.7.20	3 2 11	3 0 3 0
5 利 出			
其中：出 金 资 出			
6 金及		03	20 3 1 03
7 其 用	7.4.7.21	19 0 00	19 1 1 09
三、利润（以“ ”）		23 023 9 3	0 00 3 91
：所 用			
、净利润（净 以“ ”）		23 023 9 3	0 00 3 91

7.3 所有者（基金净值）表

会计：长信颐天平养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）

本报告期：2021年1月1日 2021年12月31日

：人民

目	本期 2021年1月1日 2021年12月31日		
	实 基金	分配利润	所有者 合计
、期 所有者（基金净值）	23 3 30	3 1 3 320 9	300 3 1 9 09
二、本期经 生的基金净值（本期利润）		23 023 9 3	23 023 9 3
三、本期基金份额生的基金净值（净值以“ ”）	1 1 022 001	11 2 3 19	1 2 9 3 0
其中：1 基金	1 1 022 001	11 2 3 19	1 2 9 3 0
2 基金			
、本期 基金份额 持有人分配利润 生的基金净值（净值以“ ”）		2 32	2 32

、期所有者（基金净值）	39 0 0 1	1 0 22	1 3 0
目	上年度 期 2020 年 1 月 1 日 2020 年 12 月 31 日		
	实 基金	分配利润	所有者 合计
、期所有者（基金净值）	23 0 0	2 9 1 2 12	239 19 19
二、本期经生的基金净值（本期利润）		0 00 3 91	0 00 3 91
三、本期基金份额生的基金净值（净值以“ ”）	1 013 1 1 23	1 2 0	1 1 11 99
其中：1 基金	1 013 1 1 23	1 2 0	1 1 11 99
2 基金			
、本期基金份额持有人分配利润生的基金净值（净值以“ ”）			
、期所有者（基金净值）	23 3 30	3 1 3 320 9	300 3 1 9 09

报表 财务报表的组 分。

本报告 1 财务报表由下 责人签 ：

基金管理人 责人 管会计 责人 会计 责人

7.4 报表

7.4.1 基金基本情况

长信颐天平养老目标三年持有期混合型基金中基金 FOF 以下简称“本基金” 由基金管理人长信基金管理有限责任公司 中 人民共和国证 投资基金法 、 长信颐天平养老目标三年持有期混合型基金中基金 FOF 基金合同 以下简称“基金合同” 及其 有 法律法规的规定，经中国证 管理 会 以下简称“中国证 会” 以证 201 2200 准公 。本基金 型 基金，存 期限 不定期。本基金根据 、 用、 用、 务 用 的不同， 基金份 分 A 基金份 和 基金份 。本基金

立 基金份 20 3 0 2 份，经 会计 事务所 合 证，并出
了 报 字 19 第 0001 资报告。基金合同于 2019 年 9 月 2 日 生 。本基
金的基金管理人 长信基金管理有限责任公司，基金托管人 中国民生银行股份有限公司。

根据 中 人民共和国证 投资基金法 、 报告期 公告的基金合同及 长信颐天平
衡养老目标三年持有期混合型基金中基金 FOF 的有 规定，本基金的投资
有 性的金 ， 要 中国证 会 法核准或 的公 的基金份 基
金、 基金、 基金 期 基金和 金 F ， 基金中基金 、国内 法发行
上 的股 中 、 和其 经中国证 会核准上 的股 、存托 证、国内 法发
行上 的国 、 行 据、金 、 、公司 、 、 分
的 分 、 、中期 据、 期 资 、 期 资 、资 持证 、公
发行的 、 、同 存 、 以及法律法规或中国证 会 基金投资
的其 金 合中国证 会 规定 。 法律法规或 管 以 基金投资其
，基金管理人在 行 ， 以 其 投资 。基金的投资组合 ：本基金
投资经中国证 会 法核准或 的公 的基金的 不 于本基金资 的 0 ，投资于
资 的 中 0 ，其中 资 股 、股 型基金以及 合以下 情况之 的
混合型基金： 基金合同 定股 资 投资 不 于基金资 的 0 ，二 个 度 ，
度定期报告 的股 资 基金资 的 不 于 0 。基金经理 以在 合本基金投资
目标和投资 的 提下，对 资 、 资 行 整， 资 的 上、 下的
整 度分别不 配 的 、10 ， 资 基金资 的 在 0 之 。现
金或 期日在 年以内的 不 于基金资 净值的 ，其中，现金不 金、存
出保证金、 等。其 金 的投资 法律法规或 管 的规定 行。 法
律法规或中国证 会 投资 的投资 限 ，基金管理人在 行 ， 以 整上
述投资 的投资 。本基金的 基准 ：中证 指 0 中证 股型基金
指 0 。

7.4.2 会计报表的 基

本基金的财务报表 财 的 会计准 及 规定 以下简称 “ 会计准 ”
以及中国证 会发 的基金行 实务 的有 规定 ，同 在 会计核 和信
了中国证 投资基金 会发 的 基金行 实务 。

7.4.3 会计准则及其有规定的

本基金财务报表的合 会计准则和中国证 会发的 于基金行 实务 的有规定的要 ， 真实、完整 了本基金 2021 年 12 月 31 日的财务 况以及 2021 年度的经和基金净值 情况。

7.4.4 重要会计 和会计 计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度 公 年度， 年 1 月 1 日 12 月 31 日 。

7.4.4.2 记 本

本基金以人民 记 本 。

7.4.4.3 金 资 和金 的分

1 金 资 的分

根据本基金的 务 和 管理要 ， 本基金 所持有的金 资 在 确 分 以公 值计 其 计 期 的金 资 和 及 ， 金 资 分 出金 资 或持有 期投资。 生 所 生的金 资 在资 表中以 生金 资示 ， 其 以公 值计 其公 值 计 的金 资 在资 表中以 性金 资 示。

本基金持有的 、 金 资 等在 中 有报 、 金 定或确定的 生金 资 分 及 。

2 金 的分

根据本基金的 务 和 管理要 ， 本基金 持有的金 在 确 分 以公 值计 其 计 期 的金 和其 金 。 本基金 分 以公 值计其 计 期 的金 。

其 金 、 出 金 资 等。

7.4.4.4 金 资 和金 的 确 、 计 和 确

金 资 或金 于本基金 金 合同的 ， 于 日 公 值在资 表内确 。 以公 值计 其 计 期 的金 资 ， 发生的 用计 期 的 中 已 告 发 的现金股利或 日或上 日 日 的利 ， 独确 目。 及 和其 金 的 用计 确

金。

以公允价值计其计期的金融资产公允价值行计，及和其金用实利法，以本行计。

金融资产现金的合同利已或金融资产所有上所有的和报已，确金资。确的金资的本平法于日。金的现务或分已经的，确金或其分。金或分确的，确分的值的对出的现金资或承担的金之的，计期。

7.4.4.5 金融资产和金的值

公允价值指者在计日发生的有中，出资所或者所的。本基金对以公允价值行计的金资金根据对计整有重大意的值的确定公允价值计。第值在计日的同资或在上经整的报第二值第值资或或的值第三值资或的不值。本基金要金的值法下：

1 对于银行的规定，以及所上或的规定、资持证和，第三值提的值确定公允价值。

2 对于基金投资，下法值：

内上基金值：对于内基金，所投资基金值日的份净值值。对于内基金，所投资基金值日值日期假日的份计提值日基金

内上基金值：对于型指基金，所投资基金值日的值。对于内上基金，所投资基金值日的份净值值。对于内上定期基金及基金，所投资基金值日的值。对于内上型基金基金，所投资基金份净值，所投资基金值日的份净值值所投资基金份份，所投资基金值日值日期假日的份份计提值日基金。

情的值理所投资基金不公基金份净值、行或分、值日等情况，基金管理人根据以下行值：以所投资基金的基金份净值值的，本基金所投资基金公值日基金份净值，日发生重大，其公的基金份净值值日发生了重大的，投资

的现行 及重大 等 ，合理 整所投资基金 值日的份 净值以确定其公 值
公 基金份 净值的， 本 值。 以所投资基金的 值的， 值日 ，
日 发生重大 ， 日的 值 日
发生了重大 的， 用 的基金份 净值 基 或 投资 的现行 及重大
整 ，确定公 值。 所投资基金 值日 值日期 发生
分 、 或 分，基金管理人 根据基金份 净值或 、 基金份 分 金 、
分 、持 份 等 合理确定公 值。

3 对存在 的其 投资 ， 值日有 的， 用 确定公 值 值日
， 日 经 发生重大 证 发行 发生 证 的重大事
的， 用 确定公 值 对于发行 确 定期限限 期的股 ， 不限于
公 发行股 、 公 发行 股 公司股 公 发 股份、 大 的带限 期的股
等， 管 或行 会的有 规定确定公 值。

对存在 的其 投资 ， 值日 日 经 发生了重大
或证 发行 发生了 证 的重大事 或基金管理人 值 会 要 ，
投资 的现行 及重大 等 ， 整 ，确定公 值。

投资 不 存在 ，基金管理人 值 会 要 ， 用 者
同， 以 实 证 有 性的 值 ，确定投资 的公 值。 值
情况并 的 行的 中 用的 、 实 上 同的
其 金 的 公 值、现金 现法和期 定 型等。 用 值 ，
大 度 用 ， 用 本基金 定 的 。

7.4.4.6 金 资 和 金 的

本基金 有 已确 金 资 和 金 的法定 利， 目 行 法定 利，同
本基金计 以净 或同 现 金 资 和 金 ，金 资 和 金 以
的金 在资 表内 示。 以 ，金 资 和 金 在资 表内分别 示，
不 。

7.4.4.7 实 基金

实 基金 对 发行基金份 所对 的金 。 、 、 及 利 投资等 的实
基金的 分别于上述 确 日 。

7.4.4.8 平准金

平准金指 、 、 、 出及 利 投资等事 导 基金份 ， 中的 分配利润。根据 日利润分配 分配利润 已实现 实现 分 基金净值的 ， 平准金分 已实现 平准金和 实现 平准金。 平准金于基金 确 日或基金 确 日 ， 并于期 利润分配 分配利润 。

7.4.4.9 /()的确 和计

利

存 利 存 的本金 用利 日计提。

的 利 在持有 期内， 的 值和 利 计的利 用情况下由 发行 的个人所 的净 ， 日确 利 。 同期 性 本 的 ， 根据其发行 、 期 和发行期限 内 利 ， 日确 利 。

金 资 金 资 的 本在 期内以实 利 法 日计提。

投资

基金投资 出基金 日的 的基金投资 本的 确 。

股 投资 出股 日的 的股 投资 本的 确 。

投资 出 日的 的 投资 本 利 有 的 确 。

生 投资 日的 的生 投资 本的 确 。

股利 于 日 上 公司 告的分 计 的金 确 ， 由上 公司 的 个人所 于 出 日 实 金 确 。

公 值

公 值 于 值日 以公 值计 其 计 期 的金 资 的公 值 的利 或 确 ， 并于 金 资 出或 期 出计 投资 。

7.4.4.10 用的确 和计

本基金的基金管理人报 日基金资 净值 所持有本基金管理人管理的基金份 分基金资 的 ， 0 的 0 0 的年 日计提。

本基金的基金托管 日基金资 净值 所持有本基金托管人托管的基金份 分基 金资 的 ， 0 的 0 20 的年 日计提。

本基金 A 基金份 不 务 ， 基金份 的 务 日 基金份

资净值 0.10 的年度计提。

以公允价值计其计提期间的基金资产的用发生确定的金计用。

出基金资产出出基金资产的本在期内以实利日计提。

7.4.4.11 基金的分配

1 本基金在符合基金合同的提下行分配，分基金管理人根据基金情况不定期发的分公告，基金合同生不 3 个月不行分配

2 本基金分配分：现金分利投资，投资者现金利或现金利别的基金份额行投资投资者不，本基金的分配现金分

3 基金分配基金份额净值不于值基金分配基准日的基金份额净值基金份额分配金不于值

A 基金份额和基金份额之由于用上不同导在分配利润上有所不同 本基金同基金份额别内的基金份额有同等分配

法律法规或管有规定的，其规定。在对基金份额持有人利实不利的提下，基金管理人 在法律法规的内整基金的分配和，不基金份额持有人大会。

7.4.4.12 分报告

根据本基金的内组、管理要及内报告度，本基金整个报告分，管理报告用的会计及计基财务报表的会计计基。

7.4.4.13 其重要的会计和会计计

根据本基金的值和中国证会的基金行值实务，本基金确定以下别股投资、投资和基金投资的公值用的值法及其假下：

1 对于基金投资，根据中基发 2013 于发基金中基金值务指行的之基金中基金值务指行的规定在值日对上基金和上基金行值。

2 对于在发行确定期限限期的股，不限于公发行股、公发行股公司股公发股份、大的带期限的股等，不、发行上、中的等限股，根据于发证投资基金投资限股

值指 行 的 中基 发 201 ， 在 值日 规定的 限股 公
值计 型 行 值。

3 对于证 所上 的股 ， 出现重大事 或 不 的 不
等情况，根据 中国证 管理 会 于证 投资基金 值 务的指导意 中国证
会公告 201 13 及 于发 中基 A A 基金行 股 值指 的 中基 发
2013 13 规定，本基金根据情况 定 用指 法、 公司法、 型法、
法、现金 现法等 值 行 值。

根据 于发 中国证 投资基金 会 值核 组 于 201 年 1 度 定
的 值 理标准 的 中基 发 201 2 ， 在上 证 所、 证 所及
银行 同 上 或 的 定 值 理标准 有规定的 ， 用第三
值 提 的 据 行 值。

7.4.5 会计 和会计 计 以及 的

7.4.5.1 会计 的

本基金本报告期内 的重大会计 。

7.4.5.2 会计 计 的

本基金本报告期内 的重大会计 计 。

7.4.5.3 的

本基金本报告期内 的重大会计 。

7.4.6

根据财 、国 务 财 200 103 根据财 、国 务 财 200 103
于股 分 有 的 、财 200 1 财 、国 务
于 所 的 、200 年 9 月 1 日 上 、 证 所 于 证
整 的 、财 2012 于实 上 公司股 利 别 个
人所 有 的 、财 、 务 、证 会公告 2019 年第 于 实
国中 股份 公司股 利 别 个人所 的公告 、财 201 101
于上 公司股 利 别 个人所 有 的 、财 201 3 于
值 的 、财 201 1 0 于 确金 发 务

等值的、财 201 于资管 值有的、财 201 90
于定资 等值的及其 务法规和实务，本
基金同 型基金 及的要 下，本基金本期 法用：

1 证 投资基金 证 投资基金， 证 投资基金 管理人 用基金 股、
值 201 年 1 月 1 日，公 证 投资基金 中发生的资管 务，
以基金管理人 值 人， 用简 计 法， 3 的 值。

2 对证 投资基金 证 中的， 股、 的，股 的股、
利， 的利 及其， 不 所。

3 对基金 的股 股、 利，由上 公司在 月的法定 报期内
管 务 报 公 发行和 的上 公司股， 持股期限在 1 个月以内
1 个月的，其股 利所 计 所 持股期限在 1 个月以上 1 年 1 年
的， 0 计 所 持股期限 1 年的，股 利所 个人所。
上述所 用 20 的 计 个人所。

对于基金 事 A 股，出 0 10 的 证 股，对 不。

7.4.7 重要财务报表 目的

7.4.7.1 银行存

：人民

目	本期 2021 年 12 月 31 日	上年度 2020 年 12 月 31 日
期存	2 12 90	92 0
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 存		
合计：	2 12 90	92 0

7.4.7.2 性金 资

：人民

目	本期 2021 年 12 月 31 日		
	本	公 值	公 值

股		3 1 0	3 3 9 1	1 0 90
金 投资 金 所				
金合				
	所	21 2 02	21 31 3 20	121 1
	银行			
	合计	21 2 02	21 31 3 20	121 1
资 持证				
基金		33 0 319	3 3 0 0 9	9 3 2
其				
	合计	39 0 03 1	01 21 92 1	91 9 9 00
目	上年度 2020年12月31日			
		本	公 值	公 值
股		31 1 1 0	3 3 1 92	3 9 2
金 投资 金 所				
金合				
	所	339 1 00	31 0 00	2 9 00
	银行	9 91 00	99 200 00	23 09 00
	合计	1 31 3 2 00	1 312 0 00	1 3 00
资 持证				
基金		23 331 210 13	2 9 9 1 3 9	1 0 1 9 2
其				
	合计	2 1 9 20 3	299 933 011	1 13 91 0

7.4.7.3 生金 资 /

：本基金本报告期 及上年度 持有 生金 。

7.4.7.4 金 资

7.4.7.4.1 金 资 期

：人民

目	本期 2021年12月31日	
		其中
所	13 100 000 00	
银行		
合计	13 100 000 00	
目	上年度 2020年12月31日	
		其中
所		
银行		
合计		

7.4.7.4.2 期 中 的

：本基金本报告期 及上年度 持有 的 。

7.4.7.5 利

：人民币

目	本期 2021年12月31日	上年度 2020年12月31日
期存 利		2 9 3
定期存 利		
其 存 利		
金 利	0	3 1
利	9 20	19 1 9
资 持 证 利		
证 利	92	
利	29 2	3 02
金 合		
出 证 利		
其	1 0	
合计	9 9 39	19 3

：其 保证金利 。

7.4.7.6 其 资

：人民币

目	本期 2021年12月31日	上年度 2020年12月31日
其	2 9 90	3 2 13
用		
合计	2 9 90	3 2 13

7.4.7.7 用

：人民币

目	本期 2021年12月31日	上年度 2020年12月31日
所 用	29 12 0	1 3 3 2
银行 用		
合计	29 12 0	1 3 3 2

7.4.7.8 其

：人民币

目	本期 2021年12月31日	上年度 2020年12月31日
保证金		

证 出 金		
提	9 000 00	9 000 00
提 计	0 000 00	30 000 00
提信	120 000 00	120 000 00
合计	1 9 000 00	1 9 000 00

7.4.7.9 实 基金

金：人民

长信颐天养老三年持有混合（FOF）A		
目	本期	
	2021年1月1日	2021年12月31日
	基金份（份）	金
上年度	192	192
本期	13 1 0 09	13 1 0 09
本期（以“ ”）		
基金分份		
基金分份份		
本期		
本期（以“ ”）		
本期	20 20 0 1	20 20 0 1

金：人民

长信颐天养老三年持有混合（FOF）		
目	本期	
	2021年1月1日	2021年12月31日
	基金份（份）	金
上年度	9 3 0 3	9 3 0 3
本期	1 0 39 9	1 0 39 9
本期（以“ ”）		
基金分份		
基金分份份		
本期		
本期（以“ ”）		
本期	192 299 32	192 299 32

：本期 利投、份金，本期 出份金。

7.4.7.10 分配利润

：人民

长信颐天养老三年持有混合（FOF）A			
目	已实现分	实现分	分配利润合计
上年度	3 19 0 0	1 2 1 9	1 2 2 19
本期利润	21 90	9 1 3 1 30	12 3 31
本期基金份	1 3 3 1	932 90	1 09 090

生的			
其中：基金	1 3 3 1	932 90	1 09 090
基金			
本期已分配利润	0		0
本期	3 900 2 02	1 122 39	10 0 0 1

： 人民

长信颐天养老三年持有混合（FOF）			
目	已实现 分	实现 分	分配利润合计
上年度	3 1	3 3 9 9	11 1 12 9
本期利润	12 33 3 0	1 2 0	10 1 2
本期基金份额 生的	3 0 0 1	3 9 3 3	10 331
其中：基金	3 0 0 1	3 9 3 3	10 331
基金			
本期已分配利润	2 03 9		2 03 9
本期	3 101 30 9	3 0 2	3 3 2

7.4.7.11 存 利

： 人民

目	本期		上年度 期	
	2021 年 1 月 1 日	2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日	2020 年 12 月 31 日
期存 利		1 01 20		30 9 20
定期存 利				
其 存 利				
金利		1 2		1 02
其		90		2 1
合计		39 1 23		0 1 2 91

： 其 存出保证金的利 。

7.4.7.12 股 投资**7.4.7.12.1 股 投资 股**

： 人民

目	本期		上年度 期	
	2021 年 1 月 1 日	2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日	2020 年 12 月 31 日
出股		01 3 233 2		2 29 9 3 9
： 出股 本		90 3 1 2		3 3 1
股		10 01 0 99		1 0 2

7.4.7.13 基金投资

： 人民

目	本期		上年度 期	
	2021年1月1日	2021年12月31日	2020年1月1日	2020年12月31日
出 基金	1 300	9 11	1 12	09
: 出 基金 本	1 2	23 0 11	1 103	3 2 30 9
基金投资	1	9 1	2 2	0 3

7.4.7.14 投资

7.4.7.14.1 投资 目

: 人民

目	本期		上年度 期	
	2021年1月1日	2021年12月31日	2020年1月1日	2020年12月31日
投资 (、 股及 期)		22 0 3		3 01 0
投资				
投资				
合计		22 0 3		3 01 0

7.4.7.14.2 投资

: 人民

目	本期		上年度 期	
	2021年1月1日	2021年12月31日	2020年1月1日	2020年12月31日
出 (、 股及 期)		22 0 33		13 133 22 91
: 出 (、 股及 期) 本		22 2 99 3		12 3 90 00
: 利		21 9 32		3 30 1
		22 0 3		3 01 0

7.4.7.14.3 投资

: 本基金本报告期及上年度 期 投资 。

7.4.7.14.4 投资

: 本基金本报告期及上年度 期 投资 。

7.4.7.14.5 资 持证 投资

: 本基金本报告期及上年度 期 资 持证 投资 。

7.4.7.15 金 投资**7.4.7.15.1 金 投资 目**

：本基金本报告期及上年度 期 行 金 投资 。

7.4.7.16 生**7.4.7.16.1 生 证**

：本基金本报告期及上年度 期 生 。

7.4.7.16.2 生 其 投资

：本基金本报告期及上年度 期 生 。

7.4.7.17 股利

：人民

目	本期		上年度 期	
	2021年1月1日	2021年12月31日	2020年1月1日	2020年12月31日
股 投资 生的股利		3 19 2		23 032 30
其中：证 出				
基金投资 生的股利		1 0		3 1 1 2
合计		1 222 9 3 2		3

7.4.7.18 公 值

：人民

目 称	本期		上年度 期	
	2021年1月1日	2021年12月31日	2020年1月1日	2020年12月31日
1 性金 资		11 21 02 0		1 0 21 3
股 投资		2 22		2 1 30 2
投资		119 31		29 0 00
资 持证 投资				
基金投资		13 0		13 03 19 39
金 投资				
其				
2 生				
证投资				
3 其				
金 公 值 生的 值				
合计		11 21 02 0		1 0 21 3

7.4.7.19 其

： 人民

目	本期		上年度 期	
	2021年1月1日	2021年12月31日	2020年1月1日	2020年12月31日
基金				
务		1 2 9 3		1 9 1 99
合计		1 2 9 3		1 9 1 99

7.4.7.20 用

： 人民

目	本期		上年度 期	
	2021年1月1日	2021年12月31日	2020年1月1日	2020年12月31日
所 用		1 9 3 3		1 29
银行 用				1 2 0
基金 生的 用		1 3 9		2 131 1
其中：		3 9		1 99 00
		2 9		21 2 32
		1 0 3 1 9		1 9 1
		1 0 1 92		2 9 9 9
合计		3 2 11		3 0 3 0

7.4.7.20.1 持有基金 生的 用

： 人民

目	本期 用		上年度 期	
	2021年1月1日	2021年12月31日	2020年1月1日	2020年12月31日
期持有基金 生的 务 ()		1 2 0		19 2 2 90
期持有基金 生的 管理 ()		2 991 2		2 2 313
期持有基金 生的 托管 ()		2 2 1		3 99 0

： 上述 用 根据所投资基金的 的计 法对 务 、管理 、托管 等 行的 上述 用已在本基金所持有基金的净值中 现，不 本基金的 用 目。

7.4.7.21 其 用

： 人民

目	本期		上年度 期	
	2021年1月1日	2021年12月31日	2020年1月1日	2020年12月31日

计 用	0 000 00	30 000 00
信	120 000 00	120 000 00
证 出 金		
	3 000 00	2 000 00
其 用	2 0 00	1 1 09
合计	19 0 00	19 1 1 09

：其 用 。

7.4.8 或有事 、资 表日 事 的

7.4.8.1 或有事

资 表日，本基金 要 的重大或有事 。

7.4.8.2 资 表日 事

本财务报告 准报出日，本基金 要 的资 表日 事 。

7.4.9

称	本基金的
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、 记 、基金
中国民生银行股份有限公司（以下简称“中国民生银行”）	基金托管人、基金
长 证 股份有限公司（以下简称“长 证 ”）	基金管理人的股 、基金
上 股份有限公司（以下简称“ ”	基金管理人的股
有限公司（以下简称“ 有限”	基金管理人的股
上 投资管理中 （有限合 ）（以下简称“ 投资”）	基金管理人的股
上 投资管理中 （有限合 ）（以下简称“ 投资”	基金管理人的股
上 长 财 资 管理有限公司（以下简称“长 财 ”）	基金管理人的 公司
长 期 股份有限公司（以下简称“长 期 ”）	基金管理人的股 的 公司

：以下 在 务 内 立。

7.4.10 本报告期及上年度 期 的

7.4.10.1 行的

7.4.10.1.1 股

金 ：人民

称	本期 2021年1月1日 2021年12月31日		上年度 期 2020年1月1日 2020年12月31日	
	金	期股 的	金	期股 的
长 证	3 92 3 39	23	90 12 192 9	9

7.4.10.1.2

金：人民

称	本期 2021年1月1日 2021年12月31日		上年度 期 2020年1月1日 2020年12月31日	
	金	期 的	金	期 的
长 证	32 3 0 0	9 1	2	9 1

7.4.10.1.3

金：人民

称	本期 2021年1月1日 2021年12月31日		上年度 期 2020年1月1日 2020年12月31日	
	金	期 的	金	期 的
长 证	000 000 00	100 00	1 100 000 00	100 00

7.4.10.1.4 基金

金：人民

称	本期 2021年1月1日 2021年12月31日		上年度 期 2020年1月1日 2020年12月31日	
	金	期基金 的	金	期基金 的
长 证	1 020 2 2	9 10	2 013 9 3 2	32

7.4.10.1.5 证

：本基金本报告期内及上年度 期 行的 证 。

7.4.10.1.6 的 金

金：人民

称	本期			
	2021年1月1日		2021年12月31日	
	期金	期的金	期金	期的金
长证	99 2	92	1 2 111	2
称	上年度 期			
	2020年1月1日		2020年12月31日	
	期金	期的金	期金	期的金
长证	9 1		10 2	0

：1、上述 金 经本基金的基金管理人 对 确定，以 由中国证 记 有限责任公司 的证管 和经 的净 示。

2、根据 证 用 ，本基金管理人在 用长 证 证 用 行股 、 、 证及 的同 ， 长 证 证 合 务。

7.4.10.2 报

7.4.10.2.1 基金管理

：人民

目	本期		上年度 期	
	2021年1月1日	2021年12月31日	2020年1月1日	2020年12月31日
期发生的基金的管理		2 1 3 9		1 1 22
其中: 的		1 30 1 0		1 1 9 12 29

： 基金管理人长信基金的基金管理人报 日基金资 净值 所持有本基金管理人管理的基金份 分基金资 的 ， 0 0 0 的年 计提， 日 计 月月 ， 月 。其计 公：日基金管理人报 日基金资 净值 所持有本基金管理人管理的基金份 分基金资 的 ， 0 0 0 年天 。

7.4.10.2.2 基金托管

：人民

目	本期		上年度 期	
	2021年1月1日	2021年12月31日	2020年1月1日	2020年12月31日
期发生的基金		19 0 3 3		31 9 3 2

的托管		
-----	--	--

： 基金托管人中国民生银行的基金托管 日基金资 净值 所持有本基金托管人
 托管的基金份 分基金资 的 ， 0 0 20 的年 计提， 日 计
 月月 ， 月 。其计 公 ：日基金托管 日基金资 净值 所持有本基金托管人
 托管的基金份 分基金资 的 ， 0 0 20 年天 。

7.4.10.2.3 务

： 人民

务 的 称	本期		
	2021 年 1 月 1 日 2021 年 12 月 31 日		
	期发生的基金 的 务		
	长信颐天养老三年持有混合（FOF）A	长信颐天养老三年持有混合（FOF）	合计
长信基金		9 9	9 9
中国民生银行		13 9 9	13 9 9
合计		13 90 3	13 90 3
务 的 称	上年度 期		
	2020 年 1 月 1 日 2020 年 12 月 31 日		
	期发生的基金 的 务		
	长信颐天养老三年持有混合（FOF）A	长信颐天养老三年持有混合（FOF）	合计
长信基金		3 99	3 99
中国民生银行		0 3 0	0 3 0
合计		0 0 9	0 0 9

： 根据基金合同的规定，长信颐天养老三年持有混合 FOF A 不 务 ， 长信颐天养老
 三年持有混合 FOF 的 务 日的资 净值 0 10 的年 日计提， 日 计
 月月 ， 月 。其计 公 ： 长信颐天养老三年持有混合 FOF 的日 务 日
 长信颐天养老三年持有混合 FOF 资 净值 0 10 年天 。

7.4.10.3 行银行 同 的 ()

： 本基金本报告期内及上年度 期 行银行 同 的 。

7.4.10.4 报告期内 证 出 务发生重大 事 的

7.4.10.4.1 定 报 行的 用 定期限 的证 出 务的情况

： 本基金本报告期内及上年度 期 定 报 行的 用 定期限
 的证 出 务的情况。

7.4.10.4.2 定期报告的用期限的证出的情况

：本基金本报告期内及上年度 期 定期报告的用期限的证出的情况。

7.4.10.5 投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人用自有资金投资本基金的情况

：基金管理人在本报告期及上年度 期 用自有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 报告期基金管理人之一的其投资本基金的情况

：基金管理人之一的其 在本年 及上年度 持有本基金。

7.4.10.6 由 保管的银行存 及 期 生的利

：人民

称	本期		上年度 期	
	2021 年 1 月 1 日	2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日	2020 年 12 月 31 日
	期	期利	期	期利
中国民生银行	2 12 90	1 01 20	92 0	30 9 20

：本基金 “中国民生银行基金托管 资金 用存 ” 存于中国证 记 有 限 责任公司等 ，于 2021 年 12 月 31 日的 人民 1 1 9 0 2 09 2020 年 12 月 31 日： 人民 0 1 。

7.4.10.7 本基金在承 期内 承 证 的情况

：本基金在本报告期及上年度 期 在承 期内 由 承 的证 。

7.4.10.8 其 事 的

7.4.10.8.1 其 事 的

本报告期 ， 本基金持有基金管理人长信基金所管理的基金合计 90 13 0 ， 本 基金 资 净值的 21 0 上年度 ， 本基金持有基金管理人长信基金所管理的基金合计 3 0 0 333 9 ， 本基金 资 净值的 2 3 。

7.4.10.8.2 期 及持有基金管理人以及管理人 所管理基金 生的 用

：人民

目	本期 用		上年度 期	
	2021 年 1 月 1 日	2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日	2020 年 12 月 31 日
期 基金 生的				

（ ）		
期 基金 生的 （ ）	2 1 2	
期持有基金 生的 务 （ ）	1 2 1	1 0 32 3
期持有基金 生的 管理 （ ）	9 2 12	3 3 9 2
期持有基金 生的 托管 （ ）	1 3 33 23	1 3 39 09
期 基金 生的	1 0 00 2	93 2 02

：本基金、本基金的基金管理人管理的其基金 F，基金管理人的
不、规定并记投资基金其分的
、务等用。、由基金管理人，期基金生
的和期基金生的。务已用计投资基金的基金
份净值，由基金管理人投资基金本基金，期持有基金生的
务管理人期本基金的务，金根据本基金对投资基金的实
持、投资基金的基金合同定的和法。期持有基金生的管理、期
持有基金生的托管已用计投资基金的基金份净值，金根据本
基金对投资基金的实持、投资基金的基金合同定的和法。

7.4.11 利润分配情况

长信颐天养老三年持有混合（FOF）A

金：人民

	记日	日		10份 基金份分	现金 发	投资 发	本期利润分配 合计	
		内						
1	2021年 12月1 日		2021年 12月1 日	0 00	13 109 323	3 03	21 1 1 9 2	
2	2021年 1月2 日		2021年 1月2 日	2 000	29 92	1 2 23	1 1 39	
合计				2 00	3 03 012 2211	3	0	

长信颐天养老三年持有混合（FOF）

金：人民

	记日	日		10份 基金份 分	现金 发	投资 发	本期利润分配 合计	
		内						
1	2021年 12月1 日		2021年 12月1 日	0 00	10 19 9 9	23 22	1 0 3 3 91	
2	2021年 1月2 日		2021年 1月2 日	2 000	3 3 31	29 0 0	9 9 202 0	
合计				2 00	1 03 129 1 9	32 22	03 9	

7.4.12 期 （2021年12月31日）本基金持有的 限证

7.4.12.1 发/ 发证 于期 持有的 限证

金 ； 人民

12 1 1 限证 别：股										
证	证 称	日	日	限 型	期 值	(: 股)	期 本	期 值		
01 2	中国 信	2021 年 月 11 日	2022 年 2 月 21 日	股 定	3 2	39 011	1 9 31	2 2 9		
00123		2021 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 11 日	股 限	1 3	1 3 333	0 9	0 9		

7.4.12.2 期 持有的 等 限股

：本基金本报告期 等 限股 。

7.4.12.3 期 中 的

7.4.12.3.1 银行

：本基金本报告期 银行 的 。

7.4.12.3.2 所

：本基金本报告期 所 的 。

7.4.12.4 期 证 出 务的证

：本基金本报告期 证 出 务 出 的证 。

7.4.13 基金及管理

7.4.13.1 管理和组

本基金在日 中 金 的 ， 要 ：信用 、 性 和 。本基金在下 要 述上述 及其 、 管理目标、 和 以及计 的 法等。

本基金的基金管理人 事 管理的目标 本基金在 和 之 的平衡，以 实现“ 和 配”的 目标。基于 管理目标，本基金的基金管理人已 定 了 和 别和分 ， 定 的 限 并 计 的内 ， 的管理及信 持 上述 。

本基金管理人 行 管理 理 ， 立了以 会 核 的、由 长、 核 和 务 的 管理 。在董事会下 立 会， 责对 公司经 管理和基金 务 的合法性、合规性 行 的 和 等 在管理 立内 会， 要 责 公司内 度及 对公司在经 管理和投资组合 中 的 行 别、 并 有 的 在 务 管理 责 要由 核 责 并 合 完 管理 ， 发 责 行投资 分 。 核 长 责，并 经理 报日 行 事务。

7.4.13.2 信用

信用 指基金在 中 对 行合 责任，或者基金所投资证 之发行人 出现 、 期本 ，导 基金资 和 的 。本基金的银行存 存 在 本基金的托管人中国民生银行， 银行存 的信用 不重大。

本基金的基金管理人 立了信用 管理 ， 本基金投资于 有 信用等 的证 ， 分 投资以分 信用 。本基金投资于 公司发行的证 值不 基金资 净值的 10 ， 本基金 由本基金管理人管理的其 基金共同持有 公司发行的证 ，不 证 的 10 。

本基金在 所 行的 中国证 记 有限责任公司完 证 和 ， 发生的 性 本基金在 行银行 同 对 对 行信用 并 用 对 以 的信用 。

7.4.13.2.1 短期信用示的投资

：人民币

短期信用	本期 2021年12月31日	上年度 2020年12月31日
A 1	0 00	0 00
A 1 以下	0 00	0 00
	000 0 00	12 9 209 10
合计	000 0 00	12 9 209 10

： 国、行据、性金及期资等信用。

7.4.13.2.2 短期信用示的资持证投资

：本基金本报告期及上年度短期信用示的资持证投资。

7.4.13.2.3 短期信用示的同存投资

：本基金本报告期及上年度短期信用示的同存投资。

7.4.13.2.4 长期信用示的投资

：人民币

长期信用	本期 2021年12月31日	上年度 2020年12月31日
AAA	1 2 91 20	1 000 00
AAA 以下	0 00	0 00
	13 0 0 00	2 1 9 90
合计	13 30 9 20	2 33 9 90

： 的投资 国、行据及性金等信用。

7.4.13.2.5 长期信用示的资持证投资

：本基金本报告期及上年度长期信用示的资持证投资。

7.4.13.2.6 长期信用示的同存投资

：本基金本报告期及上年度长期信用示的同存投资。

7.4.13.3 性

性指基金管理人以合理及现基金资以投资者的。本基金性于基金日资金的性，以及分投资不出现的现和投资中法在出现的情况下以合理现投资的。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资的性分

本基金的基金管理人 公 证 投资基金 管理法 及 公

证 投资基金 性 管理规定 等有 法规的要 立 基金 性 管理的内
 ， 资 的 性， 对性 定 性 管理 ， 对本基金组合资
 的 性 行管理。本基金 持组合管理、分 投资的 投资 ， 所持证 在证
 所或银行 同 ， 并 基金管理人 性 限 。

本基金 要投资于基金合同 定的 有 性的金 ， 基金管理人 对 性指标
 行持 的 和分 ， 定期 ， 在不同的 情 下资 现情况的 。

基金管理人持 本基金 期内的 情况， 或投资者 发生 ， 及
 整投资组合资 及 ， 保持基金资 现规 和期限 规 和期限 的 配。

同 ， 对 资金的 性 ， 基金管理人在基金合同中 定了 ，
 定了发生 资金的 理 ， 生的 性 。

7.4.13.4

指基金所持金 的公 值或 现金 所 的
 发生 的 ， 利 、 和其 。

7.4.13.4.1 利

利 指金 的公 值或现金 利 发生 的 。本基金的
 生 资 要 银行存 、 金、存出保证金及 投资等。

7.4.13.4.1.1 利

： 人民

本期 2021 年 12 月 31 日	个月以内	个月 1 年	1 年	年以上	不计	合计
资						
银行存	2 12 90					2 12 90
金	1 1 9 0 2 09					1 1 9 0 2 09
存出保证金	1 1					1 1
性金 资	20 0 9 3 0 00	1 2 1 20			3 9 9 9 21	01 21 92 1
金 资	13 100 000 00					13 100 000 00
利					9 9 39	9 9 39
股利					2 0 00	2 0 00
	1 991 01				2 39 9	1 3 9 9
其 资					2 9 90	2 9 90

资 计	1 9 2 1	1 2 1 20			3 0 10	23 01 1
证					1 2 9 09	1 2 9 09
管理人报					223 23 3	223 23 3
托管					1 201 9	1 201 9
务					1 23 9	1 23 9
用					29 12 0	29 12 0
					3 3	3 3
其					1 9 000 00	1 9 000 00
计					192 23 9	192 23 9
利 度	1 9 2 1	1 2 1 20			3 21 20 2	1 3 0
上年度 2020年12月 31日	个月以内	个月 1年	1 年	年以上	不计	合计
资						
银行存	92 0					92 0
金	0 1					0 1
存出保证金	112 1					112 1
性金 资	2 101 0	13 211 3 1 0			2 20 20	299 933 011
利					19 3	19 3
	1 1 093				2 93 0	1 3 2
其 资					3 2 13	3 2 13
资 计	3 13 111 99	13 211 3 1 0			2 32	301 20 91
管理人报					1 3 13	1 3 13
托管					9 0 2	9 0 2
务					0	0
用					1 3 3 2	1 3 3 2
					3 93 3	3 93 3
其					1 9 000 00	1 9 000 00
计					22 3	22 3
利 度	3 13 111 99	13 211 3 1 0			2 2 9 0 0	300 3 1 9 09

：表中所示 本基金资 及 的公 值，并 合 规定的利 重 定 日或 期日 者 以分 。

7.4.13.4.1.2 利 的 性分

假	利 以 的其	保持不	
分	的	对资 表日基金资 净值的 金 (: 人民)	
		本期 (2021年12月31日)	上年度 (2020年12月31日)
	利 下 2 个 基	1 22 1	22 92 30
	利 上 2 个 基	1 22 1	22 92 30

7.4.13.4.2

指金 的公 值或 现金 发生 的 。本基
金的所有资 及 以人民 计 ， 重大 。

7.4.13.4.3 其

其 指基金所持金 的公 值或 现金 利 和 以
的 发生 的 。本基金 要投资于证 所上 的股 和 以及
银行 同 的 ，所 的 大其 由所持有的金 的公 值 定。
本基金 投资组合的分 其 ，并 定期 用 定 法对基金 行 度
， 等指标 本基金 的 在 ，及 对 行
和 。

于12月31日，本基金 的其 示 下：

7.4.13.4.3.1 其

金 : 人民

目	本期 2021年12月31日		上年度 2020年12月31日	
	公 值	基金资 净值 ()	公 值	基金资 净值 ()
性金 资 股 投资	3 3 9 1	0	3 3 1 92	11 2
性金 资 基金投资	3 3 0 0 9	2 19	2 9 9 1 3 9	3 1
性金 资 投资	21 31 3 20	21	1 312 0 00	09
性金 资 金 投 资				
生金 资 证投资				
其				
合计	01 21 92 1	9 20	299 933 011	99

7.4.13.4.3.2 其 的 性分

假	在 9 的 信 内，基金资 组合的		
分	的	对资 表日基金资 净值的 金（：人民）	
		本期（2021 年 12 月 31 日）	上年度（2020 年 12 月 31 日）
	值 1 9（2020 年 12 月 31 日 值 1 9	0 3 1 2	3

：上述 值 的分 基于资 表日所持证 年 情况 有发生的 大 ， 用于本基金所有的 生金 及 生金 。 9 的 信 度 基于本基金所持有的金 度 的要 。2020 年的分 同 基于 假 。

7.4.14 有 于理 和分 会计报表 要 的其 事**1 公 值**

不以公 值计 的金

不以公 值计 的金 资 和 要 银行存 、 金 资 和其 金 等，其 值 公 值 。

以公 值计 的金

金 公 值

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的以公 值计 的金 中 于第 的 人 民 3 2 9 0 9 ，第二 的 人 民 21 12 9 ，第三 的 人 民 1 2 2 9 2020 年 12 月 31 日： 于第 的 人 民 2 2 92 2 ， 于第二 的 人 民 1 32 001 9 ， 于第三 的 人 民 1 1 3 3 21 。

公 值所 的重大

对于证 所上 的股 和 ， 出现重大事 、 不 的 不 、或 于 公 发行等情况，本基金分别于 日 复 日期 、 不 期 及限 期 根据 值 整中 用的不 值对于公 值的 度，确定 股 和 公 值 第二 或第三 。

第三 公 值计 的金

本基金持有的以公 值计 其 计 期 的金 第三 公 值本期 情况 下：

上年度 人 民 1 1 3 3 21 ， 本期 第三 金 人 民 0 00 ， 出第

三 金 人民 1 239 ， 期计 的利 或 人民 2 0 39 ，
本期 金 人民 1 9 3 ， 出 金 人民 0 00 ， 本期 人民
1 2 2 9 ， 本期 持有的资 计 的 期 实现利 或 的 金 人民
102 2 。

2 公 值 ， 资 表日本基金 要 的其 重要事 。

§8 投资组合报告

8.1 期 基金资 组合情况

金 币：人民

	目	金	基金资 的 ()
1	投资	3 3 9 1	
	其中：股	3 3 9 1	
2	基金投资	3 3 0 0 9	0 99
3	定 投资	21 31 3 20	13
	其中：	21 31 3 20	13
	资 持证		
4	金 投资		
5	金 生 投资		
6	金 资	13 100 000 00	3 09
	其中： 的 金 资		
7	银行存 和 金合计	1 99	1 9
8	其 资	2 2 1 1	0 3
9	合计	23 01 1	100 00

：本基金本报告期 股 投资 股。本基金本报告期 证 出 务。

8.2 期 行 分 的股 投资组合

8.2.1 报告期 行 分 的内股 投资组合

金 币：人民

	行 别	公 值	基金资 净值 ()
A	、 、 、	10 932 200 00	2 2
		10 3 1 29	2
	、 、 及 生 和	0 00 00	0 9
		13 0	0 00
F	发和		
	、 和	1 22 00 00	0 29
	和	100 300 00	1 9
	信 、 和信 务	1 2 2 9	0 0
	金	9 9	0 02

	和 务 务		
	和 务		
	利、 和公共 管理		
0	民 务、 理和其 务		
	生和 会		
	、 和		
	合		
	合计	3 3 9 1	0

8.2.2 报告期 行 分 的 股 投资股 投资组合

：本基金本报告期内 股 投资 股。

8.3 期 公 值 基金资 净值 大 的所有股 投资

金 ； 人民

	股	股 称	(股)	公 值	基金资 净值 ()
1	00099	平	0 000	10 932 200 00	2 2
2	002		310 000	100 300 00	1 9
3	00223	大 股份	110 000	2 2 00 00	0 2
	01 00	中国	20 000	2 00 00	0 1
	000 9		120 000	2 0 00 00	0 1
	0090	三	2 0 000	2 102 00 00	0 0
	00 3	股份	120 000	1 9 3 00 00	0
	01 2	中国 信	39 011	1 2 2 9	0 0
9	0 33		33 000	1 0 100 00	0 39
10	000 30	有	3 0 000	1 322 00 00	0 32
11	00029		1 0 000	1 22 00 00	0 29
12	0092	期	1 9	9 9	0 02
13	00129	长 料	310	1 3 0	0 00
1	00123		333	0 9	0 00
1	031		1 92	13 0	0 00

8.4 报告期内股 投资组合的重大

8.4.1 计 金 出期 基金资 净值 2%或 20 的股

金 ； 人民

	股	股 称	本期 计 金	期 基金资 净值 ()
1	00099	平	23 0 3 03	

2	00 09	三	22 3 099 0	
3	00033		1 1 9 00	3
	0020	年	13 0 00	9
	00223	大 股份	12 3 0 00	12
	01233	股份	12 30 3 00	09
	0000 9	A	12 223 22 00	0
	002		11 1 93 00	3 90
9	300 3		11 9 0 00	3 1
10	0031	上	11 3 2 00	3
11	000 3		11 2 3 00	3
12	03 01	股份	10 91 3	3
13	002 0	利	10 0 00	3
1	00	容	10 31 0 2 9	3 3
1	01	证	10 1 0 91 00	3 3
1	002 9		10 020 909 00	3 33
1	000 2	A	9 21 1 00	3 20
1	0090	三	9 3 2 1 00	3 12
19	00		19 029 00	2
20	000	中	91 120 00	2 2
21	000002	A	3 1 00	2 2
22	3000 3		1 9 00	2 0
23	002 93		921 3 00	2
2	000 33		2 0 1 00	2 2
2	00919	银行	100 00	2 2
2	300122	生	30 3 00	2
2	0021 9	中	1	2 3
2	00	股份	3 10 19	2 2
29	300003		2 9 1	2
30	000 2		3 2 3 00	2
31	01		3 0 0	2
32	000 30	有	093 99 00	2 3
33	000 0	信	9 0 90 00	2 31
3	01 99		0 2 2 00	2 21
3	01		0 0 3	2 20
3	01		0 91 00	2 1
3	0100	大	3 0 00	2 1

3	000		13 911 00	2 13
39	032		3 9 20 00	2 12
0	300 9		2 2 30 00	2 0
1	0000 9		191 2 1 00	2 0
2	03113	金	191 0	2 0
3	3002		122 0 00	2 0

：本 “ 金 ” 金 （ 以 ） ， 不 其 用。

8.4.2 计 出金 出期 基金资 净值 2%或 20 的股

金 ； 人 民

	股	股 称	本 期 计 出 金	期 基 金 资 净 值 （ ）
1	00 09	三	2 312 032	2
2	00033		1 1 93 00	20
3	00099	平	1 1 0	1
	002 0	利	13 1 0 00	3
	000 3		12 0 9 00	2
	01233	股份	12 1 2 00	1
	0000 9	A	12 332 291 00	10
	0020	年	12 2 2	0
9	300 3		11 9 00	3
10	0031	上	10 0 32 0	3 1
11	00	容	10 3 2	3
12	01	证	10 3 00	3 1
13	000 2	A	10 9 00	3 9
1	002 9		10 30 1 2 00	3 3
1	03 01	股份	10 02 3	3 3
1	00223	大 股份	9 00	3 2
1	3000 3		9 2 1 00	3 0
1	000	中	39 903 00	2
19	002 93		39 22 00	2
20	002 1		11 0	2 1
21	000 33		31 113 00	2
22	0090	三	912 2 3 00	2 3
23	0021 9	中	2 1 00	2 1
2	01		1 92	2 9
2	00		2 99 00	2
2	000002	A	2 00	2 0
2	300003		1 2 2	2 0

2	00	股份	2 13	2 9
29	01 99		32 0 0	2
30	300122	生	1 20 01	2 39
31	000 2		033 00	2 3
32	001	中国	9 9 10	2 32
33	00919	银行	3 923 00	2 29
3	0023 2	股	0 1 00	2 2
3	000		3 0 2	2 22
3	3002		01 2 1 00	2 20
3	0100	大	2 00	2 1
3	01		21 91	2 1
39	01		1 00	2 13
0	03113	金	30 910 10	2 10
1	002 0		29 19 00	2 09
2	032		1 0 00	2 0
3	002		110 1 0 00	2 03
	300 9		101 9 1	2 03
	000 0	信	0 302 00	2 02

：本 “ 出金 ” 金 （ 以 ） ，不 其 用。

8.4.3 股 的 本 及 出 股 的

：人民

股 本 （ ）	9 3 9 93
出 股 （ ）	01 3 233 2

：本 “ 股 的 本 （ ） ” 和 “ 出 股 的 （ ） ” 金
（ 以 ） ，不 用。

8.5 期 分 的 投 资 组 合

金 ：人民

		公 值	基金资 净值 （ ）
1	国	000 0 00	1 92
2	行 据		
3	金	13 0 0 00	3 2
	其中： 性金	13 0 0 00	3 2
4			
5	期 资		
6	中 期 据		
7	（ ）	1 2 91 20	0 0

	同 存		
9	其		
10	合计	21 31 3 20	21

8.6 期 公 值 基金资 净值 大 的 投资

金 : 人民

		称	()	公 值	基金资 净值 ()
1	01 00	国 1 02	13 000	13 0 0 00	3 2
2	019 9	21 国 01	000	01 300 00	1
3	019	21 国 1	000	00 320 00	0 19
	019	21 国 10	000	9 9 0 00	0 1
	1130	大	1 0	1 2 91 20	0 0

8.7 期 公 值 基金资 净值 大 的所有资 持证 投资

: 本基金本报告期 持有资 持证 。

8.8 报告期 公 值 基金资 净值 大 的 金 投资

: 本基金本报告期 持有 金 。

8.9 期 公 值 基金资 净值 大 的 证投资

: 本基金本报告期 持有 证。

8.10 报告期 本基金投资的股指期货 情况

8.10.1 报告期 本基金投资的股指期货 持 和

: 本基金本报告期 投资股指期货

8.10.2 本基金投资股指期货 的投资

: 本基金本报告期 投资股指期货 。

8.11 报告期 本基金投资的国 期 情况

8.11.1 本期国 期 投资

: 本基金本报告期 投资国 期 。

8.11.2 报告期 本基金投资的国 期 持 和

：本基金本报告期 投资国 期 。

8.11.3 本期国 期 投资

：本基金本报告期 投资国 期 。

8.12 本报告期投资基金情况

8.12.1 投资 及

本基金 于养老 FOF 基金， 目标 的 性， 期 期 于 股 型基金、 于 型基金 基金。本基金 要投资于公 的基金 ， 定和 的 资 配 分 ， 以及 基金 资 内的 ， 在 投资 和保 资 性的基 上， 提 持 定的 报。其中 资 （A 股、股 型基金、 合 资 的混合型基金等）的投资 0 ， 混合型基金的 不 0 ， 其 投资 资 （ 、 基金、 基金等）。

8.12.2 报告期 公 值 基金资 净值 大 的基金投资

	基金	基金 称		持有份 (份)	公 值 ()	基金资 净值 ()	于基金 管理人及管理 人所管 理的基金
1	0029 3	发 配 混合	型	9 21 39 3	3 301 3 02		
2	1999	长信银利 混合	型	21 930	212 1 00 9	91	
3	1919	生 配 混合	型	91 391 39	2 21 90	2	
	199	长信 A	型	20 2 1 9	23 31 921 2	1	
	0019	用 信 A	型	1 1 3	22 201 0	32	
	000	国 A	型	1 110 292 2	20 03 1 21	0	
	11000		型	13 0 1 9 2 32	1 3 3 2	2	
	1 0	金 F	型	00 000 00	1 00 00	19	

9	0033 9	长信	型	1 9 9 3	1 22 2 2 1	03	
10	1 99 0	大 有 金 期 F	型	000 000 00	11 93 000 00	2	
11	0010 1	混 合	型	3 1 9	11 1 19 1	2 3	
12	190 2	法对 混合	型	9 1 2 3 0	10 2 0 3	2 9	
13	00 991	长信利 A	型	2 9 2 9 10	10 00 1	2	
1	199 9	长信利	型	0 00	10 3 0 3	2	
1	001 0	国 长 股	型	132 2	10 319 1	2	
1	00002	大 利 A	型	9 9 09 0	9 1 12	1	
1	19133	配 混 合	型	2 13 9 00	2 9 13	1	
1	11001	报 A	型	000 000 00	0 000 00	1	
19	1900	股 混合	型	00 000 33	1 1 0 0	1 3	
20	12010	300 生 F	型	10 000 000 00	330 000 00	1 2	
21	0092	配 混 合	型	2 020 2	23 12	1 9	
22	0009	信 股	型	3 1 0	0 0 9 1 1	1	
23	00 9	生 混 合	型	2 22 03	1 1 9	1 39	
2	12 00	中 证 有	型	3 00 000 00	00 00	1 1	

		金 F					
2	00 09	混合	型	1 129 010 0	3 0 01 9	0 2	
2	000	国	型	2 20 0 3	3 009 9 3	0 2	
2	11 0	银 日利 FA	型	30 000 00	3 003 330 00	0 2	

8.13 投资组合报告

8.13.1 本基金投资的 证 的发行 本期 以及 的情况的

报告期内本基金投资的 证 的发行 出现 管 立 ，或在报告 日
年内 公 责、 的情 。

8.13.2 基金投资的 股 出基金合同规定的 股 情况的

报告期内本基金投资的 股 中，不存在 出基金合同规定 股 的情 。

8.13.3 期 其 资

：人民

	称	金
1	存出保证金	1 1
2	证	
3	股利	2 0 00
4	利	9 9 39
5		1 3 9 9
6	其	2 9 90
7	用	
8	其	
9	合计	2 2 1 1

8.13.4 期 持有的 于 股期的

金 ：人民

	称	公 值	基金资 净值 ()
1	1130 大	1 2 91 20	0 0

8.13.5 期 股 中存在 限情况的

金 ：人民

	股	股 称	限 分的公 值	基金资 净值 ()	限情况
1	01 2	中国 信	1 2 2 9	0 0	股 定

8.13.6 投资组合报告 的其 字 述 分

: 由于 的 , 分 之和 合计 存在 。

§9 基金份额持有人信

9.1 期 基金份额持有人 及持有人

份 : 份

份 别	持有人	持有的 基金份	持有人			
			投资者		个人投资者	
			持有份	份	持有份	份
长信颐天养老 三年持有混合 (FOF) A	1 0	1 2	1 21 2 2 0	0 9	20 99 2	99 31
长信颐天养老 三年持有混合 (FOF)	1 1	12 2	0 00	0 00	192 299 32	100 00
合计	2 923	13 33	1 21 2 2 0	0 3	39 0 1	99

: 对下 分 基金, 的分 用 别的份 , 对合计 , 的分 用下 分 基
基金份 的合计 (期 基金份)。

9.2 期 基金管理人的 人 持有本基金的情况

目	份 别	持有份 (份)	基金 份
基金管理 人所有 人 持 有本基金	长信颐天养老三年持有混合 (FOF) A	1 1 011	0
	长信颐天养老三年持有混合 (FOF)	1 02	0 00
	合计	1 1 03 1	0 1

: 对下 分 基金, 的分 用 别的份 , 对合计 , 的分 用下 分 基
基金份 的合计 (期 基金份)。

9.3 期 基金管理人的 人 持有本 基金份 的情况

目	份 别	持有基金份 的 (份)
本公司 管理 人、基金投资 和 责 人持有本 基金	长信颐天养老三年持有混合 (FOF) A	0 100
	长信颐天养老三年持有混合 (FOF)	0
	合计	0 100
本基金基金经理 持有本 基 金	长信颐天养老三年持有混合 (FOF) A	0 100
	长信颐天养老三年持有混合 (FOF)	0
	合计	0 100

§ 10 基金份

：份

目	长信颐天养老三年持有混合（FOF）A	长信颐天养老三年持有混合（FOF）
基金合同生 日（2019 年 9 月 2 日）基金份	191 0 9 9	1 1 22 2
本报告期期 基金份	192	9 3 0 3
本报告期基金 份	13 1 0 09	1 0 39 9
:本报告期基金 份		
本报告期基金 分 份 （份 以 "-")		
本报告期期 基金份	20 20 0 1	192 299 32

§ 11 重大事 示

11.1 基金份 持有人大会

本报告期 本基金的基金份 持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的 基金托管 的重大人事

11.2.1 基金管理人的重大人事

2021 年 1 月 2 日 ， 生不 担任公司董事长，由 经理 生 任董事长。

2021 年 月 2 日 ， 生担任公司董事长， 经理 生不 任董事长。

2021 年 月 9 日 ， 生不 担任公司 经理。

2021 年 月 19 日 ， 生担任公司 经理。

上述重大人事 情况，本基金管理人 已在规定信 发 公告。

11.2.2 基金托管人的 基金托管 的重大人事

本基金托管人中国民生银行股份有限公司于 2021 年 11 月 19 日公告，根据 要，任

担任本公司资 托管 经理， 责资 托管 。

11.3 及基金管理人、基金财 、基金托管 务的

本报告期 及基金管理人、基金财 、基金托管 务的 。

11.4 基金投资 的

本报告期本基金投资 。

11.5 本报告持有的基金发生的重大 事

本基金本报告期内持有基金 发生重大 事 。

11.6 基金 行 计的会计 事务所情况

本报告期本基金 会计 事务所，报告期 会计 事务所（ 合
） 计的报 人民 0 000 00 ， 计 本基金提 计 务的连 年限 3 年。

11.7 管理人、托管人及其 管理人 或 等情况

本报告期内，基金管理人及其 管理人 有 管 或 的情 。

本报告期内，托管人及其 管理人 在 基金托管 务 中 管

或。

11.8 基金用证公司的有关情况

11.8.1 基金用证公司行股投资及金情况

金：人民币

称		股		的金		
		金	期股的	金	期的金	
证	2	02 11 9	3	2 22 23	0	
长证	2	3 92 3 39	23	99 2	92	
国证（已）	1					
长证	1					
民生证	1					
国信证	1					
民证（已）	1					
证	1					
国证	1					
信证	2					
大证	1					
证	1					
证	2					
中证（已）	1					
中金公司	2					
财信证（已）	1					
国金证（已）	1					
证	2					
中银国	1					

：1、本报告期内本基金用信证 1 个。

2、用的标准和

根据中国证监会于证投资基金管有的（证基字 199 29）和

于完证投资基金度有的（证基金字 200）的有规定，

本公司定了用证公司用的标准和。

(1) 标准：

- 、 基本 （财务 况、经 况）
- 、 （报告 、及 性和 ）
- 、 日信 （及 性和有 性）
- 、 表现 。

(2) :

根据 用证 公司 用 的 标准 务 表， 根据 分 行 基金 用 。

11.8.2 基金 用证 公司 行其 证 投资的情况

金 : 人民

称	期 的 金		期 的 金		证 期 证 金 的		基金 金 的	
	金	的	金	的	金	的	金	的
证	1 299 3	3					9 213 32 39	3 90
长 证	32 3 0 0	9 1	000 000 00	100 00			1 020 2 2	9 10
国 证 (已								
长 证								
民生证								
国信证								
民 证 (已								

证								
国证								
信证								
大证								
证								
证								
中证 (已								
中金公司								
财信证 (已								
国金证 (已								
证								
中银国								

11.9 其 重大事

	公告事	法定	法定 日期
1	长信基金管理有限责任公司 于 下 分 基金在天 证 股份有限公司 、定期定 投资 务及 (定 投) 的公告	上证报、中国证 会 、公司	2021 年 1 月 1 日
2	长信颐天平养老目标三年持有期混合型 基金中基金 (FOF) 2020 年第 度报告	中国证 会 、公司	2021 年 1 月 22 日
3	长信基金管理有限责任公司 下 基金 2020 年第 度报告提示性公告	上证报、中证报、证 报、证 日报、中国 证 会 、 公司	2021 年 1 月 22 日
	长信基金管理有限责任公司 于长信颐天 平衡养老目标三年持有期混合型基金中基 金 (FOF) 的分 公告	中证报、中国证 会 、公司	2021 年 1 月 2 日
	长信基金管理有限责任公司 于长信颐天 平衡养老目标三年持有期混合型基金中基 金 (FOF) 大 (定期定 投资) 务的公告	中证报、中国证 会 、公司	2021 年 1 月 2 日
	长信基金管理有限责任公司 于基金行	上证报、中国证 会	2021 年 1 月 2

	管理人 公告	、公司	日
	长信基金管理有限责任公司 于长信颐天平 衡养老目标三年持有期混合型基金中基 金（FOF） 复大 （ 定期定 投资） 务的公告	中证报、中国证 会 、公司	2021年1月2 日
	长信基金管理有限责任公司 于 下 分 基金 国金证 股份有限公司 的公告	上证报、中国证 会 、公司	2021年3月2 日
9	长信颐天平衡养老目标三年持有期混合型 基金中基金（FOF）2020年年度报告	中国证 会 、公司	2021年3月30 日
10	长信基金管理有限责任公司 下 基金 2020年年度报告提示性公告	上证报、中证报、证 报、证 日报、中国 证 会 、 公司	2021年3月30 日
11	长信基金管理有限责任公司 于 下 分 基金 中国银行股份有限公司 （ 定投 ） 的公告	上证报、中国证 会 、公司	2021年3月31 日
12	长信颐天平衡养老目标三年持有期混合型 基金中基金（FOF）2021年第1 度报告	中国证 会 、公司	2021年 月21 日
13	长信基金管理有限责任公司 下 基金 2021年第 度报告提示性公告	上证报、中证报、证 报、证 日报、中国 证 会 、 公司	2021年 月21 日
1	长信基金管理有限责任公司 于董事长 公告	上证报、中国证 会 、公司	2021年 月30 日
1	长信基金管理有限责任公司公告	上证报、中国证 会 、公司	2021年 月22 日
1	长信基金管理有限责任公司 于 下 0 公 基金 并 法律 的公告	上证报、中证报、证 报、证 日报、中国 证 会 、 公司	2021年 月29 日
1	长信基金管理有限责任公司 于 下 公 证 投资基金法律 并 资料 要的提示性公告	上证报、中证报、证 报、证 日报、中国 证 会 、 公司	2021年 月29 日
1	长信颐天平衡养老目标三年持有期混合型 基金中基金（FOF） 的 及基 金 资料 要（ ）	中国证 会 、公司	2021年 月29 日
19	长信颐天平衡养老目标三年持有期混合型 基金中基金（FOF）基金合同	中国证 会 、公司	2021年 月29 日
20	长信颐天平衡养老目标三年持有期混合型 基金中基金（FOF）托管	中国证 会 、公司	2021年 月29 日
21	长信基金管理有限责任公司 于 下 分 基金 银行股份有限公司	上证报、中国证 会 、公司	2021年 月 日

	（ 定投 ） 的公告		
22	长信基金管理有限责任公司 于 证 股份有限公司 下 分 基金 并 、定期定 投资 务及 （ 定投 ） 的公 告	上证报、中国证 会 、公司	2021年 月 1 日
23	长信颐天平平衡养老目标三年持有期混合型 基金中基金（FOF）2021年第2 度报告	中国证 会 、公司	2021年 月 21 日
2	长信基金管理有限责任公司 下 基金 2021年第二 度报告提示性公告	上证报、中证报、证 报、证 日报、中国 证 会 、 公司	2021年 月 21 日
2	长信基金管理有限责任公司 于 基金 有限公司 下 分 基金 并 、定期定 投资 务及 （ 定投 ） 的公告	上证报、中国证 会 、公司	2021年 月 22 日
2	长信基金管理有限责任公司 于 证 股份有限公司 下 分 基金 并 、定期定 投资 务及 （ 定投 ） 的公 告	上证报、中国证 会 、公司	2021年 月 29 日
2	长信基金管理有限责任公司 于 财 证 股份有限公司 下 分 基金 并 、定期定 投资 务及 （ 定投 ） 的公告	上证报、中国证 会 、公司	2021年 月 日
2	长信基金管理有限责任公司 于 国 证 股份有限公司 下 分 基金 并 、定期定 投资 务及 （ 定投 ） 的公 告	上证报、中国证 会 、公司	2021年 月 日
29	长信基金管理有限责任公司 于基金行 管理人 公告	上证报、中国证 会 、公司	2021年 月 11 日
30	长信基金管理有限责任公司 于 民生 证 股份有限公司 下 分 基金 并 、定期定 投资 务及 （ 定投 ） 的公 告	上证报、中国证 会 、公司	2021年 月 13 日
31	长信基金管理有限责任公司 于 立 分公司的公告	上证报、中国证 会 、公司	2021年 月 1 日
32	长信基金管理有限责任公司 于 上 利 基金 有限公司 下 分 基金 并 、定期定 投资	上证报、中国证 会 、公司	2021年 月 1 日

	务及（定投）的公告		
33	长信基金管理有限责任公司于基金行 管理人公告	上证报、中国证 会 、公司	2021 年 月 20 日
3	长信基金管理有限责任公司于下分 基金中国 银行股份有限公司 （定投）的公告	上证报、中国证 会 、公司	2021 年 月 2 日
3	长信颐天平衡养老目标三年持有期混合型 基金中基金（FOF）2021 年中期报告	中国证 会 、公司	2021 年 月 31 日
3	长信基金管理有限责任公司下基金 2021 年中期报告提示性公告	上证报、中证报、证 报、证 日报、中国 证 会 、 公司	2021 年 月 31 日
3	长信基金管理有限责任公司于 银行股份有限公司下分基金 并、定期定 投资 务及 （定投）的公告	上证报、中国证 会 、公司	2021 年 9 月 1 日
3	长信颐天平衡养老目标三年持有期混合型 基金中基金（FOF）的（2021 年第 1）及基金 资料 要（）	中国证 会 、公司	2021 年 9 月 30 日
39	长信基金管理有限责任公司于上 基基金 有限公司下分 基金并、定期定 投资 务及（定投）、 的公告	上证报、中国证 会 、公司	2021 年 10 月 21 日
0	长信颐天平衡养老目标三年持有期混合型 基金中基金（FOF）2021 年第 3 度报告	中国证 会 、公司	2021 年 10 月 2 日
1	长信基金管理有限责任公司下基金 2021 年第三 度报告提示性公告	上证报、中证报、证 报、证 日报、中国 证 会 、 公司	2021 年 10 月 2 日
2	长信基金管理有限责任公司于国 证 股份有限公司下分 基金并、定期定 投资 务及（定投） 的公告	上证报、中国证 会 、公司	2021 年 11 月 9 日
3	长信基金管理有限责任公司于 证 股份有限公司下分基金 并、定期定 投资 务及 （定投）的公告	上证报、中国证 会 、公司	2021 年 11 月 1 日
	长信基金管理有限责任公司于养老金 中（）下所	上证报、中国证 会 、公司	2021 年 11 月 23 日

	有基金的公告		
	长信基金管理有限责任公司于证 股份有限公司下分基金 并、定期定投资 （定投）务及 的公告	上证报、中国证 会 、公司	2021年12月2 日
	长信基金管理有限责任公司于上 基金有限公司下分 基金并、定期定投资 务及（定投） 的公告	上证报、中国证 会 、公司	2021年12月3 日
	长信基金管理有限责任公司于长信颐天 平衡养老目标三年持有期混合型基金中基 金（FOF）的分公告	中证报、中国证 会 、公司	2021年12月 1日
	长信基金管理有限责任公司于长信颐天 平衡养老目标三年持有期混合型基金中基 金（FOF）大（定期定投资） 务的公告	中证报、中国证 会 、公司	2021年12月 1日
9	长信基金管理有限责任公司于长信颐天 平衡养老目标三年持有期混合型基金中基 金（FOF）复大（定期定投资） 务的公告	中证报、中国证 会 、公司	2021年12月 1日
0	长信基金管理有限责任公司于证 股份有限公司下分基金 并、定期定投资 （定投）务及 的公告	上证报、中国证 会 、公司	2021年12月 23日

§12 投资者的其他重要信

12.1 报告期内 投资者持有基金份额 或 20%的情况

：本基金本报告期内 有 投资者持有基金份额 或 20 的情况。

12.2 投资者的其他重要信

：本基金本报告期 发生 投资者的其他重要信 。

§13 目录

13.1 目录

- 1、中国证监会核准立基金的
- 2、长信颐天平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同
- 3、长信颐天平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）
 - 、长信颐天平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）托管
 - 、报告期内在指定报 上 的 公告的
 - 、长信基金管理有限责任公司 、公司 及 资 复 。

13.2 存

基金管理人的 公 所。

13.3

长信基金管理有限责任公司 ： 。

长信基金管理有限责任公司

2022 年 3 月 31 日