# 长信利保债券型证券投资基金
# 2022 年中期报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：长信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金基金合同规定，于 2022 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 2022 年 6 月 30 日止。

## 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 基金简介 ..... 5**

2.1 基金基本情况 ..... 5
2.2 基金产品说明 ..... 5
2.3 基金管理人和基金托管人 ..... 6
2.4 信息披露方式 ..... 6
2.5 其他相关资料 ..... 6

**§3 主要财务指标和基金净值表现 ..... 6**

3.1 主要会计数据和财务指标 ..... 6
3.2 基金净值表现 ..... 7

**§4 管理人报告 ..... 9**

4.1 基金管理人及基金经理情况 ..... 9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 ..... 11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 ..... 12
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 ..... 12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 ..... 12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 ..... 13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 ..... 13
4.8 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 ..... 13

**§5 托管人报告 ..... 13**

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 ..... 13
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 ..... 13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 ..... 14

**§6 半年度财务会计报告（未经审计） ..... 14**

6.1 资产负债表 ..... 14
6.2 利润表 ..... 15
6.3 净资产（基金净值）变动表 ..... 17
6.4 报表附注 ..... 19

**§7 投资组合报告 ..... 38**

7.1 期末基金资产组合情况 ..... 38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 ..... 38
7.3 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 ..... 39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 ..... 39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 ..... 41
7.6 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 ..... 41

7.7 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.....41
7.8 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.....41
7.9 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.....41
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....42
7.11 投资组合报告附注.....42

**§8 基金份额持有人信息.....44**

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....44
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....44
8.3 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情况.....44

**§9 开放式基金份额变动.....44**

**§10 重大事件揭示.....45**

10.1 基金份额持有人大会决议.....45
10.2 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.....45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....45
10.4 基金投资策略的改变.....45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....45
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....45
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....46
10.8 其他重大事件.....47

**§11 影响投资者决策的其他重要信息.....50**

11.1 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.....50
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....50

**§12 备查文件目录.....50**

12.1 备查文件目录.....50
12.2 存放地点.....50
12.3 查阅方式.....50

# §2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

| | | |
|---|---|---|
| 基金名称 | 长信利保债券型证券投资基金 | |
| 基金简称 | 长信利保债券 | |
| 场内简称 | 长信利保 | |
| 基金主代码 | 519947 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2015 年 11 月 16 日 | |
| 基金管理人 | 长信基金管理有限责任公司 | |
| 基金托管人 | 中国建设银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 84,708,907.73 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 长信利保债券 A | 长信利保债券 C |
| 下属分级基金的场内简称 | CXLBA | - |
| 下属分级基金的交易代码 | 519947 | 008176 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 3,392,047.19 份 | 81,316,860.54 份 |

## 2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 通过积极主动的资产管理和严格的风险控制，在保持基金资产流动性和有效控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。 |
| 投资策略 | 1、资产配置策略<br>本基金将利用全球信息平台、外部研究平台、行业信息平台以及自身的研究平台等信息资源，基于本基金的投资目标和投资理念，从宏观和微观两个角度进行研究，开展战略资产配置，之后通过战术资产配置再平衡基金资产组合,实现组合内各类别资产的优化配置，并对各类资产的配置比例进行定期或不定期调整。<br>2、债券投资策略<br>本基金主要采用积极管理型的投资策略，自上而下分为战略性策略和战术性策略两个层面,结合对各市场上不同投资品种的具体分析，共同构成本基金的投资策略结构。<br>3、股票投资策略<br>（1）行业配置策略；<br>（2）个股投资策略;<br>（3）存托凭证投资策略。<br>4、其他类型资产投资策略<br>在法律法规或监管机构允许的情况下，本基金将在严格控制投资风险的基础上适当参与权证、资产支持证券等金融工具的投资。 |
| 业绩比较基准 | 三年期银行定期存款利率(税后)+1.5% |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，其预期风险和收益低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金，属于证券投资基金产品中风险收益程度中等偏低的投资品种。 |

## 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---|---|---|---|
| 名称 | | 长信基金管理有限责任公司 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 周永刚 | 李申 |
| | 联系电话 | 021-61009999 | 021-60637102 |
| | 电子邮箱 | zhouyg@cxfund.com.cn | lishen.zh@ccb.com |
| 客户服务电话 | | 4007005566 | 021-60637111 |
| 传真 | | 021-61009800 | 021-60635778 |
| 注册地址 | | 中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 9 楼 | 北京市西城区金融大街 25 号 |
| 办公地址 | | 上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼 | 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼 |
| 邮政编码 | | 200120 | 100033 |
| 法定代表人 | | 刘元瑞 | 田国立 |

## 2.4 信息披露方式

| | |
|---|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 证券时报 |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | www.cxfund.com.cn |
| 基金中期报告备置地点 | 上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼、北京西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼 |

## 2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|---|---|---|
| 注册登记机构 | A 类份额：中国证券登记结算有限责任公司、C 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、C 类份额：上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼 |

# §3 主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2022 年 1 月 1 日-2022 年 6 月 30 日) | |
|---|---|---|
| | 长信利保债券 A | 长信利保债券 C |
| 本期已实现收益 | 55,621.34 | 1,297,275.77 |
| 本期利润 | 27,780.76 | 481,445.41 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0072 | 0.0047 |
| 本期加权平均净值利润率 | 0.70% | 0.46% |
| 本期基金份额净值增长率 | 1.14% | 1.14% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2022 年 6 月 30 日) | |

| | | |
|---|---|---|
| 期末可供分配利润 | -308,544.23 | 4,327,717.81 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.0910 | 0.0532 |
| 期末基金资产净值 | 3,573,238.33 | 85,679,881.65 |
| 期末基金份额净值 | 1.0534 | 1.0537 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2022 年 6 月 30 日) | |
| 基金份额累计净值增长率 | 5.34% | 6.86% |

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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

长信利保债券 A

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③ | ②－④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去一个月 | 2.72% | 0.28% | 0.35% | 0.01% | 2.37% | 0.27% |
| 过去三个月 | 3.11% | 0.20% | 1.07% | 0.01% | 2.04% | 0.19% |
| 过去六个月 | 1.14% | 0.19% | 2.13% | 0.01% | -0.99% | 0.18% |
| 过去一年 | 3.88% | 0.15% | 4.34% | 0.01% | -0.46% | 0.14% |
| 过去三年 | 8.15% | 0.12% | 13.61% | 0.01% | -5.46% | 0.11% |
| 自基金合同生效起至今 | 5.34% | 0.42% | 32.53% | 0.01% | -27.19% | 0.41% |

长信利保债券 C

| 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去一个月 | 2.73% | 0.28% | 0.35% | 0.01% | 2.38% | 0.27% |
| 过去三个月 | 3.12% | 0.20% | 1.07% | 0.01% | 2.05% | 0.19% |
| 过去六个月 | 1.14% | 0.19% | 2.13% | 0.01% | -0.99% | 0.18% |
| 过去一年 | 3.87% | 0.15% | 4.34% | 0.01% | -0.47% | 0.14% |
| 自份额增加日起至今 | 6.86% | 0.11% | 11.86% | 0.01% | -5.00% | 0.10% |

### 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