

长信利发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：上海浦东发展银行股份有限公司

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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，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	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 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	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	43
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前 债券投资明细	43

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 持证券投资明细.....	43
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 金 投资明细.....	43
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前 证投资明细.....	43
7.10 报告期末本基金投资的 债期 交易情况说明.....	43
7.11 投资组合报告附注.....	44
§ 8 基金份 持有人信息	46
8.1 期末基金份 持有人 数及持有人	46
8.2 期末基金管理人的 业人 持有本基金的情况.....	46
8.3 期末基金管理人的 业人 持有本 式基金份 情况.....	46
§ 9 式基金份 变动	46
§ 10 重大事 示	47
10.1 基金份 持有人大会决	47
10.2 基金管理人、基金托管人的专 基金托管 的重大人事变动.....	47
10.3 及基金管理人、基金财产、基金托管业务的	47
10.4 基金投资策略的 变.....	47
10.5 基金 行审计的会计 事务所情况.....	47
10.6 管理人、托管人及其 管理人 或 等情况.....	47
10.7 基金 用证券公司交易 的有关情况.....	47
10.8 其他重大事	49
§ 11 投资者决策的其他重要信息	52
11.1 报告期内 一投资者持有基金份 比例 或 过 20 的情况	52
11.2 投资者决策的其他重要信息.....	52
§ 12 目录	52
12.1 目录.....	52
12.2 存	53
12.3 阅方式.....	53

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金	长信利发债券型证券投资基金
基金简	长信利发债券
场内简	长信利发
基金主代	519933
交易代	519933
基金运作方式	型 式
基金合同 日	2016 年 6 月 28 日
基金管理人	长信基金管理有限责任公司
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司
报告期末基金份	252 280 351.43 份
基金合同存 期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	过 主动的资产管理和 的风险 ，在保持基金资产 动性和 基金资产风险的前提 ， 投资者提 定 长的投资 。
投资策略	<p>1、资产配 策略</p> <p>本基金 利用 信息平 、 平 、行业信息平 以及自 的 平 等信息资 ，基于本基金的投资目标和投资理 ，宏观和 观 个 度 行 ， 展 略资产配 ，之 过 资产配 平 基金资产组合,实现组合内 类别资产的 配 ，并对 类资产的配 比例 行定期或不定期 整。</p> <p>2、债券投资策略</p> <p>本基金主要 用 管理型的投资策略,自上 分 略性策略和 性策略 个 ， 合对 市场上不同投资品种的 分 ，共同 本基金的投资策略 。</p> <p>3、股票投资策略：</p> <p>在行业配 ，本基金 运用 自上 的行业配 方法，过对 内 宏观经济走势、经济 型的方 、 经济 产业 策导 和经济 期 整的 ， 用价值理 长理 相 合的方法来对行业 行 。</p> <p>本基金 合定性 定 分 ，主要 自 上的 股策略。基 金 据 定的投资 ，基于对上市公司的品 估分 、风险 分 和估值分 ， 出基本 的股票 行投资，在有 风险前提 ， 实现基金资产的长期 值。</p> <p>本基金 根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基 证券 投资价值的 ， 行存托 证的投资。</p> <p>4、其他类型资产投资策略</p> <p>在法律法规或 管 允 的情况 ，本基金 在 投资风险 的基 上 证、资产 持证券等金 的投资。</p>

业绩比 基准	中证 债指数 90 中证 800 指数 10
风险	本基金 债券型基金，其预期风险和 于股票型基金和 合型基金， 于 市场基金， 于证券投资基金产品中风险 程度中等 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
	长信基金管理有限责任公司	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露 负责人	021 61009999	021 61618888
	.	5 . .
务	4007005566	95528
真	021 61009800	021 63602540
注	中 (上海) 自由 易 银 中 68 9	上海市中 东一 12
公	上海市浦东新 银 中 68 9	上海市 东 689
	200120	200001
法定代表人		

2.4 信息披露方式

本基金 定的信息披露报	上海证券报
载基金中期报告 的管理人	.
基金中期报告	上海市浦东新 银 中 68 9 , 上海市中 东一 12

2.5 其他相关资料

项目		公
注 记	中 证券 记 算有限责任公司	平 大 17

§ 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 : 人

3.1.1 期 数据和指标	报告期 2022 年 1 月 1 日 2022 年 6 月 30 日
本期已实现	5 988 908.88
本期利润	12 552 582.58
平 基金份 本期利润	0.0453
本期 平 净值利润	3.69
本期基金份 净值 长	3.13
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 2022 年 6 月 30 日
期末 分配利润	43 325 424.56
期末 分配基金份 利润	0.1717

期末基金资产净值	308 730 295.37
期末基金份额净值	1.2238
3.1.3 计期末指标	报告期末 2022 年 6 月 30 日
基金份额净值长	40.82

- 注：1、本期已实现 指基金本期利息 、投资 、其他 （不 公允价值变动 ） 相关 用和信用 值 的 ，本期利润 本期已实现 上本期公允价值变动 。
- 2、所述基金业绩指标不 持有人 或交易基金的 项 用（例 ， 式基金交易 金 、 式基金的 、 利 投资 、基金 等），计 用 实 平要 于 所 数字。
- 3、期末 分配利润 期末资产负债表中未分配利润 未分配利润中已实现 分的 数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值长 及其 同期业绩比 基准 的比

	份 净 值 长	份 净 值 长 标 准	业绩比 基 准	业绩比 基准 标准		
过 一个月	0.73	0.30	0.85	0.11	0.12	0.19
过 三个月	0.48	0.22	1.57	0.14	1.09	0.08
过 个月	3.13	0.26	0.76	0.15	3.89	0.11
过 一年	2.66	0.27	3.51	0.13	6.17	0.14
过 三年	16.66	0.31	15.28	0.13	1.38	0.18
自基金合同 起 至	40.82	0.36	28.54	0.13	12.28	0.23

3.2.2 自基金合同 以来基金份 计净值 长 变动及其 同期业绩比 基准 变动的比



注：1、 示日期 2016 年 6 月 28 日至 2022 年 6 月 30 日。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同 日起 6 个月内 期 期 ，本基金的 项投资比例已 合基金合同的 定。

§ 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 证 会证 基金字 2003 63 准，由长 证券股份 有限公司、上海海 股份有限公司、 股份有限公司共同发起 立。注 资本 1.65 人 。目前股 ：长 证券股份有限公司占 44.55 、上海海 股份有限公司占 31.21 、 有限公司占 15.15 、上海 投资管理中 （有限合 ）占 4.55 、上海 投资管理中 （有限合 ）占 4.54 。

至 2022 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 81 式基金， 长信利息 式证券 投资基金、长信银利 合型证券投资基金、长信金利 势 合型证券投资基金、长信 利动 策略 合型证券投资基金、长信利 债券型证券投资基金、长信 利 势 合型证券投资基金、长信 合型证券投资基金、长信 标准 100 等 重指数 型证券投资基金、长 信利 债券型证券投资基金 、长信内 长 合型证券投资基金、长信 债债券型证券 投资基金、长信利 债券型证券投资基金 、长信 债一年定期 债券型证券投资基金、长信

债 债券型证券投资基金、长信 利 配 合型证券投资基金、长信 中小 股
 票型证券投资基金、长信新利 配 合型证券投资基金、长信利 债券型证券投资基金、长
 信利盈 配 合型证券投资基金、长信利 配 合型证券投资基金、长信 利 配
 合型证券投资基金、长信 配 合型证券投资基金、长信 策略股票型证券投
 资基金、长信 保 行业 配 合型证券投资基金（ ）、长信 债一年定期 债
 券型证券投资基金、长信 海 债一年定期 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 债一年定期 债券型证券投资基金、长信 债一年定期 债券型证券
 投资基金、长信利 配 合型证券投资基金、长信利发债券型证券投资基金、长信 信
 息行业 配 合型证券投资基金、长信 平 债一年定期 债券型证券投资基金、长
 信 利半年定期 合型证券投资基金、长信 新 动股票型证券投资基金、长信 债
 券型证券投资基金、长信利信 配 合型证券投资基金、长信 债债券型证券投资基金、
 长信 配 合型证券投资基金、长信 债券型证券投资基金、长信 势 债
 券型证券投资基金、长信中证 500 指数 型证券投资基金、长信长金 市场基金、长信
 三个月定期 债券型发起式证券投资基金、长信 保行业 股票型证券投资基金、
 长信利 一年定期 合型证券投资基金、长信 信 配 合型证券投资基金、长信
 债券证券投资基金、长信 三个月定期 债券型发起式证券投资基金、长信 行业
 股票型证券投资基金、长信 业 年定期 配 合型证券投资基金、长信 价
 值 动 合型证券投资基金、长信价值 年定期 配 合型证券投资基金、长信
 三个月定期 债券型发起式证券投资基金、长信 资产配 合型基金中基金（ ）、长
 信价值 合型证券投资基金、长信利 债债券型证券投资基金、长信 300 指数 型证
 券投资基金、长信 债半年定期 债券型证券投资基金、长信合利 合型证券投资基金、
 长信 利 合型证券投资基金、长信 年定期 债券型证券投资基金、长信 平
 目标三年持有期 合型基金中基金（ ）、长信易 合型证券投资基金、长信 合型
 证券投资基金、长信 合型证券投资基金、长信浦 87 个月定期 债券型证券投资基
 金、长信 利资产配 一年持有期 合型基金中基金（ ）、长信 合型证券投资基金
 、长信 业 一年持有期 配 合型证券投资基金、长信 6 个月持有期 合型证
 券投资基金、长信 业 合型证券投资基金、长信内 合型证券投资基金、长信 30
 动持有 债债券型证券投资基金、长信 债券型证券投资基金、长信 债券型证券投资基
 金、长信 三个月持有期 合型证券投资基金、长信 和平 目标三年持有期 合型
 基金中基金（ ）、长信 年平 目标三年持有期 合型基金中基金（ ）、长信

长一年持有期 合型证券投资基金、长信 长 合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理 理简介

	务	任本基金的基金经理 (理)期限		证券 业年限	说明
		任 日期	任日期		
程	长信 债券型证 券投资基 金和长信 利发债券 型证券投 资基金的 基金经理	2020 年 12 月 31 日		9 年	大金 业，有基金 业 资，中。任于发银行股份 有限公司、银基金管理有限责任公 司，2020 年 8 月 长信基金管理有限 责任公司，现任长信 债券型证券 投资基金和长信利发债券型证券 投资基金的基金经理。
	任本基 金的基金 经理	2019 年 5 月 16 日	2022 年 2 月 25 日	9 年	任本基金的基金经理。

注：1、任基金经理任 日期以本基金 立之日 准 新 或变更基金经理的日期根据对 披露
的公告日期

2、证券 业的 遵 证券业 业人 资 管理法 的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在报告期内， 遵守了 中 人 共和 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 基金份 持有人 利，不存在 基金份 持有人利
的行。

本基金 以 信于市场、 信于 会投资公，承诺 一 往 本 诚实信用、
勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，在规 基金运作和 投资风险的前提， 基
金份 持有人 大利。

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 度的 行情况

本报告期内，公司已实行公平交易 度，并 立公平交易 度，已 立投资决策，
交易 行的内，并 过 作 度、 程和 保证公平交易原则的实现。同
，公司已 过对投资交易行的、分 估和信息披露来 对公平交易过程和 的
。

4.3.2 交易行 的专项说明

本报告期内，完 按 有关指数的 比例 行投资的组合，其 投资组合未发

交易所公 价同日 交易 交 的 交易 过 证券 日 交 的 5 的情形，未发
现 交易行 。

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

的策略 以 大 风险 目标、 型 度 和行业 动、 基本
自 上 个股。大类资产配 上， 相对 用股债性价比 型 行 的
。在 年一 度 整 市场利 的情况 ， 至 平，行业配 上
估值 策略，在一 度市场整 行中 了 大 。
二 度以来， 自上 的 度来 ，有一 宏大 事的 有 的 势。比
息预期过了对市场 大的 。 宏观 的 动 相比一 度 ，整
对股票市场的 ，但指数 的 动性在 性 会 现。 在二 度
提 组合 ，同 行业估值和 度的 型， 望 性行情中的行业
动 会。

，在经济复 期， 的 策和市场对风险 的容 度， 比 持 长
风 占 。 在二 度 一 度对海 、 、 务等 分个股的配 之 ， 持了
分价值风 个股， 持了 分上 资 品、 和新 方 的个股。 在组合中保持股票
和 债个券的分 度在合理 平，在 行业 度和估值 势的行业内， 市场走 度提
分 度， 会明确 提 个股 中度。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

至 2022 年 6 月 30 日，长信利发债券份 净值 1.2238 ，份 计净值 1.3818 ，
本报告期内长信利发债券净值 长 3.13 ，同期业绩比 基准 0.76 。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2022 年一 度宏观 对市场 大， 来 ，整 宏观 动 ，对资本市场的
动 。 半年大 动性 会保持合理 ， 和 业 的 资 复 ，
观 。在宏观 相对利 的 ，组合 持 中 以上配 ， 中观行业
度和个股 性 会。

行业动 ， 前新 ，但交易 度相对 。出于 风险
和估值 ，组合 配 分新 上（ 料、 和 ）。 作 中和
型的重要一 ， 的重要性 值 关注，组合在本 度 了对 的配
。

在组合管理中会更关注的过上带来的风险，未来一个度在净值的基上持有人实现资产平长。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按业会计准则、中证会相关规定和基金合同关于估值的规定，对基金持有的投资品种行估值。基金托管人根据法律法规对基金管理公司用的估值策和程序行核，并对估值及净值计算行复核。

根据相关法律法规，本基金管理人了、有的估值策和估值程序，立了估值会，估值会公司基金估值的主要决策，其主要责负责定公司的估值策、估值方法及用的估值程序和，对公司现有程序和行复核和审阅，发了估值程序和的有性及用性的情况及估值程序估值会由基金事务、投资、交易等相关业务负责人以及基金事务至一业务共同组，相关人有证券行业作经，相关法规和估值方法，估值业务所的专业任。对于基金的估值策和估值原则，公司已基金托管人分，并一意见。审计本基金的会计事务所公司基金估值策和程序的性。

本基金管理人已中债记算有限责任公司及中证指数有限公司签务，由其按定分别提银行同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据以及限股票的。估值程方不存在任重大利。

4.7 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分配原则以及基金实运作情况，本基金本报告期末行利润分配。

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

。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以简本托管人）在对长信利发债券型证券投资基金的托管过程中，遵守中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、托管的规定，不存在基金份持有人利的行，完尽尽责行了基金托管人应尽的务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人 中 人 共和 证券投资基金法 及其他有关法律法规、基金合同、托管 的规定，对长信利发债券型证券投资基金的投资运作 行了 ，对基金资产净值的计算、基金份额 价的计算以及基金 用 等方 行了 真的复核，未发现基金管理人存在 基金份额 持有人利 的行 。

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

本报告期内，由长信基金管理有限责任公司 本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、 分配情况、财务会计报告（财务会计报告中的 金 风险及管理 分未在托管人复核 内）、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主 ：长信利发债券型证券投资基金

报告 止日：2022 年 6 月 30 日

：人

资 产	附注	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存	6.4.7.1	4 180 390.68	4 516 950.23
算 金			928 941.15
存出保证金		87 435.81	119 285.88
交易性金 资产	6.4.7.2	301 970 086.58	398 848 343.52
其中：股票投资		40 320 900.12	54 419 095.56
基金投资			
债券投资		261 649 186.46	344 429 247.96
资产 持证券投资			
金 投资			
其他投资			
金 资产	6.4.7.3		
金 资产	6.4.7.4		
债 投资	6.4.7.5		
其中：债券投资			
资产 持证券投资			
其他投资			
其他债 投资	6.4.7.6		
其他 投资	6.4.7.7		
应 算		3 329 889.79	1 354 502.58
应 股利			

应		358.25	1 326.91
所 资产			
其他资产	6.4.7.8		3 176 713.74
资产 计		309 568 161.11	408 946 064.01
负债和净资产	附注	本期末	上年度末
		2022年6月30日	2021年12月31日
负 债：			
期			
交易性金 负债			
金 负债	6.4.7.3		
出 金 资产		8 320.68	5 000 000.00
应 算			
应		288 144.91	35 615.50
应 管理人报		178 109.53	243 290.81
应 托管		50 888.44	69 511.64
应 务			
应 投资			
应交		9 200.03	14 943.42
应 利润			
所 负债			
其他负债	6.4.7.9	303 202.15	263 920.03
负债合计		837 865.74	5 627 281.40
净资产：			
实 基金	6.4.7.10	252 280 351.43	319 228 510.33
其他 合	6.4.7.11		
未分配利润	6.4.7.12	56 449 943.94	84 090 272.28
净资产合计		308 730 295.37	403 318 782.61
负债和净资产 计		309 568 161.11	408 946 064.01

注：1、报告 止日 2022 年 6 月 30 日，基金份 净值 1.2238 ，基金份 252 280 351.43 份。

2、以 比 数据已根据本年 证券投资基金信息披露 第 3 年度报告和中期报告 中的资产负债表 式的要 行 示：2021 年年度报告资产负债表中 应 利息 其他 资产 项目的 本期末 合并 示在 2022 年中期报告资产负债表中 其他资产 项目的 上 年度末 ，2021 年年度报告资产负债表中 应 交易 用 、 应 利息 其他负债 目的 本期末 合并 示在 2022 年中期报告资产负债表 其他负债 项目的 上年度末 。

6.2 利润表

会计主 ：长信利发债券型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

三、利润（以）		12 552 582.58	9 239 087.86
：所用			
、净利润（净以）		12 552 582.58	9 239 087.86
、其他合的净			
、合		12 552 582.58	9 239 087.86

注：以比数据已根据本年 证券投资基金信息披露 第 3 年度报告和中期报告中的利润表式的要行示：2021 年中期报告利润表中 交易用项目 其他用项目的本期金合并示在 2022 年中期报告利润表中 其他用项目的上年度比期金。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主：长信利发债券型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

：人

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实基金	其他合	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	319 228 510.33		84 090 272.28	403 318 782.61
：会计策变更				
前期更				
其他				
二、本期期净资产(基金净值)	319 228 510.33		84 090 272.28	403 318 782.61
三、本期变动（以）	66 948 158.90		27 640 328.34	94 588 487.24
（一）、合			12 552 582.58	12 552 582.58
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值以）	66 948 158.90		15 087 745.76	82 035 904.66

其中: 1. 基金	1 185 444.03		274 039.50	1 459 483.53
2. 基金	68 133 602.93		15 361 785.26	83 495 388.19
(三)、本期基金份持有人分配利润产生的基金净值变动(净值以)				
()、其他合存				
、本期期末净资产(基金净值)	252 280 351.43		56 449 943.94	308 730 295.37
项目	上年度 比期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日			
	实 基金	其他 合	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	1 085 209 958.47		266 388 330.48	1 351 598 288.95
：会计 策变更				
前期更				
其他				
二、本期期 净资产(基金净值)	1 085 209 958.47		266 388 330.48	1 351 598 288.95
三、本期 变动 (以)	385 898 242.77		86 522 538.90	472 420 781.67
(一)、 合			9 239 087.86	9 239 087.86
(二)、本期基金份 交易产生的基金净值变动数 (净值 以)	385 898 242.77		95 761 626.76	481 659 869.53
其中: 1. 基金	316 138 318.22		80 698 628.61	396 836 946.83
2. 基金	702 036 560.99		176 460 255.37	878 496 816.36

（三）、本期基金份持有人分配利润产生的基金净值变动（净值以）				
（）、其他合存				
、本期期末净资产（基金净值）	699 311 715.70		179 865 791.58	879 177 507.28

报表附注 财务报表的组 分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由 负责人签 ：

基金管理人负责人

主管会计 作负责人

会计 负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

长信利发债券型证券投资基金以 简 本基金 ， 经中 证券 管理 会（以 简 中 证 会 ）证 2016 886 关于准 长信利发债券型证券投资基金注 的 复 的核准，由基金管理人长信基金管理有限责任公司 会公 发行募 ，基金合同于 2016 年 6 月 28 日 ， 立募 规 345 062 697.59 份基金份 。本基金 型 式， 存 期限不定。本基金的基金管理人 长信基金管理有限责任公司，注 记 中 证券 记 算有限责任公司，基金托管人 上海浦东发展银行股份有限公司。

本基金的投资 有 动性的金 ， 内 法发行上市的股票（ 中小 、 业 及其他经中 证 会核准上市的股票）、存托 证、债券、 市场 、 证、资 产 持证券以及法律法规或中 证 会允 基金投资的其他金 （但 合中 证 会的相 关规定）。 法律法规或 管 以 允 基金投资其他品种，基金管理人在 行 程序 ， 以 其 投资 ，其投资比例遵 有 的法律法规和相关规定。

本基金主要投资于 有 动性的 定 类金 ， 债、 行票据、金 债、 方 债、 业债、公司债、 期 资券、 期 资券、中期票据、资产 持证券、 债券、 债及分 交易 债、中小 业 募债、债券 、银行存 （ 存 、定期 存 及其他银行存 ）、 市场 以及法律法规或中 证 会允 基金投资的其他金

但符合中国证监会相关规定。

本基金的投资组合比例：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，投资于非固定收益类资产的比例不超过基金资产的 20%，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的投资比例不低于基金资产净值的 5%。

基金的业绩比较基准：中证债指数 90% 中证 800 指数 10%。

6.4.2 会计报表的编制

本财务报表按照财政部颁布的企业会计准则基本准则以及其制定和修订的企业会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（统称企业会计准则）编制，同时在信息披露和估值方面，遵循了中国证监会的《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 3 号——半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露规则》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第 3 号——年度报告和中期报告》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础编制。

6.4.3 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 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与上期年度报告相一致的说明

本报告期变更的会计政策，本基金报告期所采用的其他会计政策、会计估计与上期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

金融资产指形成本基金的金融资产（或负债），并形成本基金的其他金融资产（或资产）或金融负债。

金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产

金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

6.4.4.2 金融资产和金融负债的确认、计量和终止

本基金于金融合同的一方确认一项金融资产或金融负债。

分类以公允价值计量的其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有固定回收金额的，按摊余成本的公允价值作减值准备，相关的交易费用在发生时计入当期损益。

分类以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按摊余成本的公允价值作减值准备，相关交易费用计入其初始确认金额。

对于以公允价值计量的其变动计入当期损益的金融资产，用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益。

对于以摊余成本计量的金融资产，用实际利率法确认利息收入，其终止确认、或减值损失的利或损失，计入当期损益。

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不重大资产组合的应计项目，本基金运用简化计量方法，按相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。上述用简化计量方法计量的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，信用风险自初始确认后未显著增加的，于第一时点，本基金按相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按摊余成本和实际利率计算利息收入；信用风险自初始确认后已显著增加但未发生信用减值的，于第二时点，本基金按相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按摊余成本和实际利率计算利息收入；确已发生信用减值的，于第三时点，本基金按相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金在每个估值日评估相关金融资产的信用风险自初始确认后是否已经显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融资产组合为基础，通过比较金融资产在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融资产预计存续期内发生违约风险的变动情况。

本基金计量金融资产预期信用损失的方法包括：通过评价一系列可获得的、确定的、相关的历史信息、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息。

对金融资产预期未来现金流量有不利影响的一项或多项事件发生，金融资产已发生信用减值的金融资产

本基金不 合理预期 或 分 金 资产合同现金 ， 本基金 记 金 资产的

金 资产现金 的合同 利 止，或 金 资产现金 的 利已 ， 合金 资产 的 止确 的，金 资产 止确

本基金已 金 资产所有 上 所有的风险和报 方的， 止确 金 资产 保 了金 资产所有 上 所有的风险和报 的，不 止确 金 资产 本基金 有 有保 金 资产所有 上 所有的风险和报 的，分别 情况 理： 了对 金 资产 的， 止确 金 资产并确 产的资产和负债 未 对 金 资产 的，按 其 所 金 资产的程 度确 有关金 资产，并相应确 有关负债。

对于以公允价值计 其变动计 期 的金 负债（ 交易性金 负债和 金 负债） ，按 公允价值 行 计 ，所有公允价值变动 计 期 。对于以 本计 的金 负债， 用实 利 法，按 本 行 计 。 金 负债的责任已 行、 或 ， 则对金 负债 行 止确 。

6.4.4.3 收入/（损失）的确认和计量

1 存 利息 按存 的本金 用的利 日计提的金 。 提前 定期存 ， 按 规定的利 及持有期重新计算存 利息 ，并根据提前 所实 的利息 已确 的利息 的 确 利息 ， 利息 项，存 利息 以净 示

2 交易性金 资产在 出的 交日发 的交易 用，计 投资 债券投资和资产 持证券投资持有期 ，按证券票 价值 票 利 或内 票 利 或合同 利 计算的金 用情况 的相关 的净 确 投资 ，在证券实 持有期内 日 计提

交易性金 资产的投资 于 交日确 ，并按 交金 交易性金 资产的 的 用情况 的相关 的净 ，同 出已确 的公允价值变动

3 股利 于 息日确 ，并按发行人 告的分 息比例计算的金 用情况 的 相关 的净

4 的投资 于 交日确 ，并按 交金 其 本的 用情况 的相关 的净 ，同 出已确 的公允价值变动

5 金 资产 ，按实 利 法确 利息 ，在 期内 日计提

6 公允价值变动 本基金持有的以公允价值计 其变动计 期 的金 资产、

以公允价值计 其变动计 期 的金 负债等公允价值变动形 的应计 期 的利
或

7 其他 在本基金 行了基金合同中的 务， 在 务 确 。

6.4.5 会计 策和会计估计变更以及 更 的说明

6.4.5.1 会计 策变更的说明

根据 业会计准则第 22 金 确 和计 、 业会计准则第 23 金 资产 、 业会计准则第 24 期会计 、 业会计准则第 37 金 报 (新金 准则)、 关于 一 实新金 相关会计准则的 的 规定和相关法律法规的要 ，本基金自 2022 年 1 月 1 日 按 新金 准则 行会计 理， 根据 规定，对 比期 信息不 整， 日 行新金 准则 现行准则的 整 本报告期期 未分配利润。

新金 准则 变了金 资产 的分类和计 方式，确定了三个主要的计 类别： 本 以公允价值计 其变动计 其他 合 以公允价值计 其变动计 期 。本基金 自 业务 式，以及金 资产 的合同现金 行上述分类。

新金 准则要 金 资产 值计 由 已发 型 预期信用 型 ， 用于以 本计 的金 资产。金 资产 值计 的变更对于本基金的 不重大。

本基金 基于实 利 法计提的金 的利息 在相应金 的 中，并 在相关 银行存 、 算 金 、 存出保证金 、 金 资产 、 出 金 资产 等项目中，不 独 示 应 利息 项目或 应 利息 项目。

信用 值 项目， 本基金计提金 信用 准 所确 的信用 。本基金 分类 以 本计 的金 资产按 实 利 法计算的利息 在 利息 项目中， 其他项目的利息 利息 项目 整至 投资 项目 示。

于 行日 (2022 年 1 月 1 日)，原金 资产和金 负债 价值 整 按 金 确 和计 准则的规定 行分类和计 的新金 资产和金 负债 价值的 所述： 以 本计 的金 资产：

银行存 于 2021 年 12 月 31 日按原金 准则 示的 价值 人 4 516 950.23 ，自应 利息 的重分类金 人 731.83 ，重新计 预期信用 准 的金 人 0.00 。经上述重分类和重新计 ，银行存 于 2022 年 1 月 1 日按新金 准则 示的 价值 人 4 517 682.06 。

算 金 于 2021 年 12 月 31 日按原金 准则 示的 价值 人 928 941.15

，自应利息的重分类金额 418.00，重新计预期信用准的金额人 0.00。经上述重分类和重新计，算金于 2022 年 1 月 1 日按新金准则示的价值人 929 359.15。

存出保证金于 2021 年 12 月 31 日按原金准则示的价值人 119 285.88，自应利息的重分类金额 53.70，重新计预期信用准的金额人 0.00。经上述重分类和重新计，存出保证金于 2022 年 1 月 1 日按新金准则示的价值人 119 339.58。

应利息于 2021 年 12 月 31 日按原金准则示的价值人 3 176 713.74，出至银行存的重分类金额 731.83，出至算金的重分类金额人 418.00，出至存出保证金的重分类金额人 53.70，出至交易性金资产的重分类金额人 3 175 510.21。经上述重分类，应利息不作财务报表项目独报。

以公允价值计其变动计期的金资产：

交易性金资产于 2021 年 12 月 31 日按原金准则示的价值人 398 848 343.52，自应利息的重分类金额人 3 175 510.21。经上述重分类，交易性金资产于 2022 年 1 月 1 日按新金准则示的价值人 402 023 853.73。

以本计的金负债：

出金资产于 2021 年 12 月 31 日按原金准则示的价值人 5 000 000.00，自应利息的重分类金额人 10 416.39。经上述重分类，出金资产于 2022 年 1 月 1 日按新金准则示的价值人 5 010 416.39。

应利息于 2021 年 12 月 31 日按原金准则示的价值人 10 416.39，出至出金资产的重分类金额人 10 416.39。经上述重分类，应利息不作财务报表项目独报。

上述财务报表项目，于行日，新金准则的行对财务报表其他金资产和金负债项目。

于行日，新金准则的行对本基金金资产计提的准金重大。

上述会计策变更未导本基金本期期未分配利润的变。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期会计估计变更。

6.4.5.3 更 的说明

本基金本报告期 重大会计 的内容和更 金 。

6.4.6 项

6.4.6.1

经 务 准,财 、 务 决定,自 2008 年 4 月 24 日起, 整证券(股票) 交易 ,由原 的 3 整 1

经 务 准,财 、 务 决定,自 2008 年 9 月 19 日起, 整由出 方按证券(股票)交易 , 方不 , 不变

根据财 、 务 财 2005 103 关于股 分 有关 策 的 的规定,股 分 过程中 股股东 股股东 对价 发 的股 ,

6.4.6.2 值

根据财 、 务 财 2016 36 关于 业 值 的 的规定,经 务 准,自 2016 年 5 月 1 日起在 内 业 值 ,金 业 ,由 业 值 。对证券投资基金(式证券投资基金,

式证券投资基金)管理人运用基金 股票、债券的 值 债、方 债 利息 以及金 同业往来利息 值 存 利息 不 值

根据财 、 务 财 2016 46 关于 一 明确 金 业有关 策的 的规定,金 展的 式 金 品业务及持有 策性金 债券 的利息 于金 同业往来利息

根据财 、 务 财 2016 70 关于金 同业往来等 值 策的 的规定,金 展的 式 金 品业务、同业存 、同业存 以及持有金 债券 的利息 于金 同业往来利息

根据财 、 务 财 2016 140 关于明确金 、 产 发、 务等 值 策的 的规定,本基金运 过程中发 的 值 应 行 ,以本基金的基金管 理人 值 人

根据财 、 务 财 2017 56 关于资管产品 值 有关的 的规定, 证券投资基金的基金管理人运 证券投资基金过程中发 的 值 应 行 , 用简易计 方 法,按 3 的 值 。对证券投资基金在 2018 年 1 月 1 日前运 过程中发 的 值 应 行 ,未 值 的,不 已 值 的,已 证券投资基金的基金管

理人以月份的市值应中。市值应行的根据财、务财
2017 90 关于定资产项等值策的规定确定。

6.4.6.3 市、附、方附

根据中人民共和市行例（2011年）、附的行
行规定（2011年）及相关方附的规定，、值、业的
和个人，应规定市、附（按相关规定事
业附的）及方附。。

6.4.6.4 业所

根据财、务财 2004 78 关于证券投资基金策的规定
，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（式证券投资基金，式证券投资基金）管理人
运用基金股票、债券的价，业所

根据财、务财 2005 103 关于股分有关策
的规定，股分中股股东过对价方式股股东的股份、现金等
，股股东应的业所

根据财、务财 2008 1 关于业所策的规
定，对证券投资基金证券市场中的，股票、债券的价，股的股息、
利，债券的利息及其他，不业所。

6.4.6.5 个人所

根据财、务财 2005 103 关于股分有关策
的规定，股分中股股东过对价方式股股东的股份、现金等
，股股东应的个人所

根据财、务财 2008 132 财、务关于存利息
所有关个人所策的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对存利息所
个人所

根据财、务、中证会财 2012 85 关于实上市公司股息利
别个人所策有关的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金公发行
和市场上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（1 个月）的，其股息利所
计应所持股期限在 1 个月以上至 1 年（1 年）的，按 50 计应所
持股期限过 1 年的，按 25 计应所。上述所一用 20 的计个人所

根据财、务、中、证、会、财、2015、101、关于上市公司股息、利、别、个人所、策、有、关、的、的、规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金、公、发、行、和、市场、的、上、市、公、司、股、票、，、持、股、期、限、过、1、年、的、，、股、息、利、所、个人所、。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存

：人

项目	本期末 2022年6月30日
期存	4 180 390.68
等于：本金	4 179 847.08
：应计利息	543.60
：准	
定期存	
等于：本金	
：应计利息	
：准	
其中：存 期限 1 个月以内	
存 期限 1 3 个月	
存 期限 3 个月以上	
其他存	
等于：本金	
：应计利息	
：准	
合计	4 180 390.68

6.4.7.2 交易性金 资产

：人

项目	本期末 2022年6月30日				
	本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	42 291 479.49		40 320 900.12	1 970 579.37	
金 投资 金交 所 金合					
债券	交易所市 场	109 455 468.14	1 266 343.97	110 665 098.35	56 713.76
	银行 市 场	147 878 167.95	1 840 588.11	150 984 088.11	1 265 332.05
	合计	257 333 636.09	3 106 932.08	261 649 186.46	1 208 618.29
资产 持证券					
基金					
其他					

合计	299 625 115.58	3 106 932.08	301 970 086.58	761 961.08
----	----------------	--------------	----------------	------------

6.4.7.3 金 资产 负债

6.4.7.3.1 金 资产 负债期末

本基金本报告期末未持有 金 资产 负债。

6.4.7.4 金 资产

6.4.7.4.1 项 金 资产期末

本基金本报告期末未持有 金 资产。

6.4.7.4.2 期末 式 交易中 的债券

本基金本报告期末 式 交易中 的债券。

6.4.7.5 债 投资

6.4.7.5.1 债 投资情况

本基金本报告期末 债 投资。

6.4.7.6 其他债 投资

6.4.7.6.1 其他债 投资情况

本基金本报告期末 其他债 投资。

6.4.7.7 其他 投资

6.4.7.7.1 其他 投资情况

本基金本报告期末 其他 投资。

6.4.7.8 其他资产

本报告期末本基金未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

: 人

项目	本期末 2022年6月30日
应 券 交易 保证金	
应	23.40
应 证券出 金	
应 交易 用	159 576.19
其中：交易所市场	156 101.19
银行 市场	3 475.00
应 利息	
预提	9 300.00
预提审计	74 795.19
预提信息披露	59 507.37

合计	303 202.15
----	------------

6.4.7.10 实 基金

金：人

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份 (份)	金
上年度末	319 228 510.33	319 228 510.33
本期	1 185 444.03	1 185 444.03
本期 (以)	68 133 602.93	68 133 602.93
基金分份算前		
基金分份算整		
本期		
本期 (以)		
本期末	252 280 351.43	252 280 351.43

注：利投、份，出份。

6.4.7.11 其他合

本基金本报告期其他合。

6.4.7.12 未分配利润

：人

项目	已实现分	未实现分	未分配利润合计
本期期	61 169 496.39	22 920 775.89	84 090 272.28
本期利润	5 988 908.88	6 563 673.70	12 552 582.58
本期基金份额交易 产的变动数	11 855 162.95	3 232 582.81	15 087 745.76
其中：基金	207 574.72	66 464.78	274 039.50
基金	12 062 737.67	3 299 047.59	15 361 785.26
本期已分配利润			
本期末	43 325 424.56	13 124 519.38	56 449 943.94

6.4.7.13 存 利息

：人

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	期存利息	
定期存利息		
其他存利息		
算金利息		4 415.86
其他		900.69
合计		19 934.20

注：其他存利息项存出保证金利息和利息之和。

6.4.7.14 股票投资

6.4.7.14.1 股票投资

股票 价

：人

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
出股票 交	238 421 933.10
： 出股票 本	247 231 971.06
：交易 用	646 371.61
股票 价	9 456 409.57

6.4.7.15 债券投资

6.4.7.15.1 债券投资 项目

：人

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资 利息	4 105 802.16
债券投资 债券(债 股及债券 期) 价	751 519.78
债券投资 价	
债券投资 价	
合计	4 857 321.94

6.4.7.15.2 债券投资

债券 价

：人

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
出债券(债 股及债券 期) 交	457 578 789.74
： 出债券(债 股及债券 期) 本	452 881 005.78
：应计利息	3 933 785.79
：交易 用	12 478.39
债券 价	751 519.78

6.4.7.15.3 债券投资

价

本基金本报告期 债券 价 。

6.4.7.15.4 债券投资

价

本基金本报告期 债券 价 。

6.4.7.16 资产 持证券投资

6.4.7.16.1 资产 持证券投资 项目

本基金本报告期末 资产 持证券投资 。

6.4.7.17 金 投资**6.4.7.17.1 金 投资 项目**

本基金本报告期 金 投资 。

6.4.7.18**6.4.7.18.1 证 价**

本基金本报告期 。

6.4.7.18.2 其他投资

本基金本报告期 。

6.4.7.19 股利

：人

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利	224 739.49
其中：证券出	
基金投资产生的股利	
合计	224 739.49

6.4.7.20 公允价值变动

：人

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
1. 交易性金融资产	6 563 673.70
股票投资	3 602 641.74
债券投资	2 961 031.96
资产支持证券投资	
基金投资	
金 投资	
其他	
2.	
证投资	
3. 其他	
：应 金 品公允价值变动 产的预估 值	
合计	6 563 673.70

6.4.7.21 其他

：人

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
基金	1 298.16

合计	1 298.16
----	----------

注： 用由 基金份 的基金份 持有人承担，对持 持有期 于 7 日的投资者 的
计 基金财产 其他 用的 25 基金财产。

6.4.7.22 信用 值

本基金本报告期 信用 值 。

6.4.7.23 其他 用

： 人

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计 用	24 795.19
信息披露	59 507.37
证券出 金	18 600.00
其他 用	2 886.53
合计	105 789.09

注： 其他 用 。

6.4.8 或有事项、资产负债表日 事项的说明

6.4.8.1 或有事项

至资产负债表日，本基金 要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日 事项

至本财务报告 准报出日，本基金 要披露的资产负债表日 事项。

6.4.9 关 方关

6.4.9.1 本报告期存在 关 或其他重大利 关 的关 方发 变 的情况

本报告期存在 关 或其他重大利 关 的关 方 变 。

6.4.9.2 本报告期 基金发 关 交易的 关 方

关 方	本基金的关
长信基金管理有限责任公司 长信基金	基金管理人、基金
上海浦东发展银行股份有限公司 浦发银行	基金托管人、基金
长 证券股份有限公司 长 证券	基金管理人的股东、基金

6.4.10 本报告期及上年度 比期 的关 方交易

6.4.10.1 过关 方交易 行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金 ： 人

关 方	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度 比期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

	交金	占 期股票 交 的比例 ()	交金	占 期股票 交 的比例()
长 证券	287 553 521.04	60.52	208 769 202.32	51.01

6.4.10.1.2 债券交易

金 : 人

关 方	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度 比期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	交金	占 期债券 交 的比例 ()	交金	占 期债券 交 的比例 ()
长 证券	241 133 867.10	57.47	393 312 731.32	81.83

6.4.10.1.3 债券 交易

金 : 人

关 方	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度 比期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	交金	占 期债券 交 的比例 ()	交金	占 期债券 交 的比例 ()
长 证券	54 000 000.00	100.00	596 500 000.00	100.00

6.4.10.1.4 证交易

本基金本报告期及上年度 比期 未 过关 方交易 行 证交易。

6.4.10.1.5 应 关 方的 金

金 : 人

关 方	本期 2022年1月1日至2022年6月30日			
	期 金	占 期 金 的 比例 ()	期末应 金	占期末应 金 的 比例 ()
长 证券	267 798.35	72.88	119 143.47	76.32
关 方	上年度 比期 2021年1月1日至2021年6月30日			
	期 金	占 期 金 的 比例 ()	期末应 金	占期末应 金 的 比例 ()
长 证券	194 426.45	64.58	53 996.39	60.36

注：上述 金 市场价 经本基金的基金管理人 对方 确定，以 由中 证券 记 算
有限责任公司的证管和经 的净 示。类 金 的 务 金 方
本基金提 的证券投资 和市场信息 务。

6.4.10.2 关 方 报

6.4.10.2.1 基金管理

：人

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度 比期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
期发 的基金应 的管理	1 186 790.70	3 718 929.08
其中: 的	56 614.82	166 584.36

注：基金管理 按前一日的基金资产净值的 0.70 的年 计提。计算方法 ：

基金管理 年 年 数

日应计提的基金管理

前一日的基金资产净值

基金管理 日计提， 日 计至 月月末，按月 。

6.4.10.2.2 基金托管

：人

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度 比期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
期发 的基金应 的托管	339 083.08	1 062 551.15

注：基金托管 按前一日的基金资产净值的 0.20 的年 计提。计算方法 ：

基金托管 年 年 数

日应计提的基金托管

前一日的基金资产净值

基金托管 日计提， 日 计至 月月末，按月 。

6.4.10.3 关 方 行 银 行 同 业 市 场 的 债 券 交 易

本基金本报告期及上年度 比期 未 关 方 过 银 行 同 业 市 场 行 债 券 交 易 。

6.4.10.4 报告期内 证 券 出 业 务 发 重 大 关 交 易 事 项 的 说 明

6.4.10.4.1 关 方 过 定 报 方 式 行 的 用 定 期 限 的 证 券 出 业 务 的 情 况

本基金本报告期及上年度 比期 关 方 过 定 报 方 式 行 的 用 定 期 限 的 证 券 出 业 务 的 情 况 。

6.4.10.4.2 关 方 过 定 报 方 式 行 的 用 市 场 期 限 的 证 券 出 业 务 的 情 况

本基金本报告期及上年度 比期 关 方 过 定 报 方 式 行 的 用 市 场 期 限

的证券出借业务的情况。

6.4.10.5 关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

基金管理人在本报告期及上年度比期内未运用自有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末基金管理人及其他关联方投资本基金的情况

基金管理人及其他关联方在本报告期末及上年度末未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款及定期存款的利息

：人

关 方	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度比期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	期末	期利息	期末	期利息
浦发银行	4 180 390.68	14 617.65	2 800 786.64	226 303.16

注：本基金用于证券交易结算的资金过本基金托管人的基金托管人专用存款账户存放于中证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息。于2022年6月30日的相关数据在资产负债表中的结算科目中独立列示（2021年6月30日：同）。

6.4.10.7 本基金在承期内关联方承证券的情况

本基金在本报告期及上年度比期内未在承期内由关联方承的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度比期其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末2022年6月30日本基金持有的受限证券

6.4.12.1 新发债券于期末持有的受限证券

本基金本报告期末未新发债券持有受限证券。

6.4.12.2 期末持有的等限股票

本基金本报告期末未持有等限股票。

6.4.12.3 期末债券交易中作的债券

6.4.12.3.1 银行市场债券

本基金本报告期末银行市场债券交易的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券

本基金本报告期末交易所市场债券交易的债券。

6.4.12.4 期末 证券出 业务的证券

本基金本报告期末 证券出 业务的 出证券。

6.4.13 金 风险及管理

6.4.13.1 风险管理 策和组

本基金在日 动中 种金 的风险，主要 ：信用风险、 动性风险和市场风险。

本基金在 主要 述上述风险 及其形 原 风险管理目标、 策和过程以及计 风险的方法等。

本基金的基金管理人 事风险管理的目标 本基金在风险和 之 的平 ，以 实现 风险和 相 配 的风险 目标。基于 风险管理目标，本基金的基金管理人已 定了 策和程序来 别和分 风险， 定 的风险限 并 计相应的内 程序， 过 的管理及信息 持 上述 类风险。

本基金管理人 行 风险管理 理 ， 立了以风险 会 核 的、由 长、 核 和相关业务 的风险管理 。在董事会 立风险 会，负责对 公司经 管理和基金业务运作的合法性、合规性 行 的和 估等 在管理 立内 会，主要 责 审 公司内 度及 对公司在经 管理和投资组合运作中的风险 行 别、 估并 有的 在业务 作 风险管理 责主要由 核 负责 并 合作完 运作风险管理 作， 略 产品 发 负责 行投资风险分 绩 估。 核 长负责，并 经理 报日 行 事务。

6.4.13.2 信用风险

信用风险 指基金在交易过程中 交易对 未 行合 责任，或者基金所投资证券之发行人 出现 、 期本息，导 基金资产 和 变 的风险。本基金的银行存 存 在本基金的托管人上海浦东发展银行股份有限公司， 银行存 相关的信用风险不重大。

本基金的基金管理人 立了信用风险管理 程，本基金投资于 有 信用等 的证券， 过分 投资以分 信用风险。本基金投资于一 公司发行的证券市值不 过基金资产净值的 10 ， 本基金 由本基金管理人管理的其他基金共同持有一 公司发行的证券，不 过 证券的 10 。

本基金在交易所 行的交易 中 证券 记 算有限责任公司完 证券交 和 项 算， 风险发 的 性 小 本基金在 行银行 同业市场交易前 对交易对 行信用 估并 用券 对 交 方式以 相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按 期信用 示的债券投资

：人

期信用	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
A 1		
A 1 以		
未	39 374 092.61	22 015 000.00
合计	39 374 092.61	22 015 000.00

注：未 债券 债、 行票据、 策性金 债及 期 资券等 信用 债券。

6.4.13.2.2 按 期信用 示的资产 持证券投资

本基金本报告期末及上年度末 按 期信用 示的资产 持证券投资。

6.4.13.2.3 按 期信用 示的同业存 投资

本基金本报告期末及上年度末 按 期信用 示的同业存 投资。

6.4.13.2.4 按长期信用 示的债券投资

：人

长期信用	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
AAA	152 236 059.35	162 830 000.00
AAA 以	23 320 419.37	133 723 747.96
未	46 639 262.35	25 860 500.00
合计	222 195 741.07	322 414 247.96

注：未 债券 债、 行票据及 策性金 债等 信用 债券。

6.4.13.2.5 按长期信用 示的资产 持证券投资

本基金本报告期末及上年度末 按长期信用 示的资产 持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用 示的同业存 投资

本基金本报告期末及上年度末 按长期信用 示的同业存 投资。

6.4.13.3 动性风险

动性风险 指基金管理人未 以合理价 及 变现基金资产以 投资者 项的风险。本基金 动性风险来 于 式基金 日 资金的 动性风险，以及 分投资品种交易不 出现的变现风险和 投资 中 法在市场出现 动的情况 以合理价 变现投资的风险。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的 动性风险分

本基金的基金管理人 按 公 募 证券投资基金运作管理 法 及 公 募 式 证券投资基金 动性风险管理规定 等有关法规的要 立 式基金 动性风险管理的内 容，审 估 类资产的 动性， 对性 定 动性风险管理 方案，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，所持证券在证券交易所或银行间同业市场交易，并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有流动性的金融资产，基金管理人对流动性指标进行持续的监测和评估，定期开展流动性压力测试，评估在不同的市场情景下资产变现情况的变动。

基金管理人持续监测本基金在报告期内的流动性情况，市场或投资者发生突发事件，及时调整投资组合资产结构及比例，保持基金资产变现规模和期限与负债规模和期限的匹配。

同时，对基金资产的流动性风险，基金管理人在基金合同中定义了流动性风险，并制定了发生流动性风险的应急处置措施，明确了流动性风险的处置方式和程序。

6.4.13.4 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市场价格变动而发生波动的风险，包括利率风险、信用风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。本基金的投资资产主要集中于银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险

单位：人民币

本期末 2022年6月30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	4 180 390.68					4 180 390.68
存出保证金	87 435.81					87 435.81
交易性金融资产	32 296 113.90	31 714 378.06	176 751 951.33	20 886 743.17	40 320 900.12	301 970 086.58
应付					358.25	358.25
应算					3 329 889.79	3 329 889.79
资产总计	36 563 940.39	31 714 378.06	176 751 951.33	20 886 743.17	43 651 148.16	309 568 161.11
负债						
应付					288 144.91	288 144.91
应管理人报					178 109.53	178 109.53
应托管					50 888.44	50 888.44
出金	8 320.68					8 320.68
资产						
应交					9 200.03	9 200.03

其他负债					303 202.15	303 202.15
负债 计	8 320.68				829 545.06	837 865.74
利 度	36 555 619.71	31 714 378.06	176 751 951.33	20 886 743.17	42 821 603.10	308 730 295.37
上年度末 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	4 516 950.23					4 516 950.23
算 金	928 941.15					928 941.15
存出保证金	119 285.88					119 285.88
交易性金 资 产	47 723 531.35	108 375 216.61	177 597 500.00	10 733 000.00	54 419 095.56	398 848 343.52
应 证券 算					1 354 502.58	1 354 502.58
应					1 326.91	1 326.91
其他资产					3 176 713.74	3 176 713.74
资产 计	53 288 708.61	108 375 216.61	177 597 500.00	10 733 000.00	58 951 638.79	408 946 064.01
负债						
出 金 资产	5 000 000.00					5 000 000.00
应					35 615.50	35 615.50
应 管理人报					243 290.81	243 290.81
应 托管					69 511.64	69 511.64
应交					14 943.42	14 943.42
其他负债					263 920.03	263 920.03
负债 计	5 000 000.00				627 281.40	5 627 281.40
利 度	48 288 708.61	108 375 216.61	177 597 500.00	10 733 000.00	58 324 357.39	403 318 782.61

注：表中所示 本基金资产及交易形 负债的公允价值，并按 合 规定的利 重新定价日或
期日 者 行了分类。

6.4.13.4.1.2 利 风险的 性分

假	市场利 以 的其他市场变 保持不变		
	相关风险变 的变动	对资产负债表日基金资产净值的 金 (: 人)	
		本期末 (2022 年 6 月 30 日)	上年度末 (2021 年 12 月 31 日)
分	市场利 27 个基	2 387 795.98	2 840 754.80

	市场利 上 27 个基	2 387 795.98	2 840 754.80
--	-------------	--------------	--------------

6.4.13.4.2 风险

风险 指金 的公允价值或未来现金 变动 发 动的风险。本基金的所有资产及负债以人 计价， 重大 风险。

6.4.13.4.3 其他价 风险

其他价 风险 指基金所持金 的公允价值或未来现金 市场利 和 以 的市场价 变动 发 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 同业市场交易的债券，所 的 大其他价 风险由所持有的金 的公允价值决定。本基金 过投资组合的分 其他价 风险，并 定期运用 种定 方法对基金 行风险度 ， 等指标来 本基金 的 在价 风险，及 对风 险 行 和 。

于 6 月 30 日，本基金 的其他市场价 风险 示 ：

6.4.13.4.3.1 其他价 风险

金 ；人

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 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 资产 股票投资	40 320 900.12	13.06	54 419 095.56	13.49
交易性金 资产 基金投资				
交易性金 资产 债券投资	261 649 186.46	84.75	344 429 247.96	85.40
交易性金 资产 金 投资				
金 资产 证投资				
其他				
合计	301 970 086.58	97.81	398 848 343.52	98.89

6.4.13.4.3.2 其他价 风险的 性分

假	在 95 的 信 内，基金资产组合的市场价 风险		
	相关风险变 的变动	对资产负债表日基金资产净值的 金 （ ；人 ）	
		本期末（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月

			31 日)
分	值 0.81 2021 年 12 月 31 日 值 0.65	2 503 683.91	2 602 745.90

注：上述风险价值的分 基于资产负债表日所持证券过 一年市场价 动情况 有发的大，变动用于本基金所有的金 及 金。95 的信度 基于本基金所持有的金 风险度 的要。2021 年的分 同 基于 假。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金 公允价值计 的方法

公允价值计 所 的，由对公允价值计 整 有重要意的 值所 的 决定： 第一：相同资产或负债在 市场上未经 整的报价。 第二：第一 值 相关资产或负债 或 观 的 值。 第三：相关资产或负债的不 观 值。

6.4.14.2 持 的以公允价值计 的金

6.4.14.2.1 金 的公允价值

：人

公允价值计 所 的	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一	62 873 388.24	142 693 343.52
第二	239 096 698.34	256 155 000.00
第三		
合计	301 970 086.58	398 848 343.52

6.4.14.2.2 公允价值所 的重大变动

本基金以导 之 的事项发 日 确 之 的。对于公 市场交易的股票、债券等投资，出现重大事项、交易不 或 公 发行等情况，本基金不会于 日至交易 复 日期、交易不 期 及限 期 相关投资的公允价值 第一，并根据估值 整中 用的对公允价值计 整 有重要意的 值所 的，确定相关投资的公允价值应 第二 或第三。

6.4.14.3 持有的以公允价值计量的金融资产的说明

本基金本报告期末及上年度末未持有持有的以公允价值计量的金融资产。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融资产的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融资产以本基金的金融资产和金融负债，其期限，所以其价值与公允价值相。

6.4.15 有助于理解和分会计报表要说明的其他事项

至资产负债表日本基金要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

单位：人民币

序	项目	金额	占基金资产的比例（%）
1	投资	40 320 900.12	13.02
	其中：股票	40 320 900.12	13.02
2	基金投资		
3	定 投资	261 649 186.46	84.52
	其中：债券	261 649 186.46	84.52
	资产 持证券		
4	金 投资		
5	金 品投资		
6	金 资产		
	其中：式 的 金 资 产		
7	银行存 和 算 金合计	4 180 390.68	1.35
8	其他 项资产	3 417 683.85	1.10
9	合计	309 568 161.11	100.00

注：本基金本报告期末未过 股 交易 投资 股。本基金本报告期末未 证券出 业务。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的 内股票投资组合

单位：人民币

代	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	、 、 、 业	1 632 390.00	0.53
	业	3 584 120.00	1.16
	业	33 192 075.20	10.75
	、 、 及 产和 应业		

	业	154 700.00	0.05
	发和 业		
	交 运 、 和 业	641 900.00	0.21
	和 业		
	信息 、 和信息 务业	57 550.00	0.02
	金 业	736 200.00	0.24
	产业		
	和 务 务业		
	和 务业		
	利、 和公共 管理业	321 964.92	0.10
	务、 理和其他 务业		
	和 会 作		
	、 和 业		
	合		
	合计	40 320 900.12	13.06

7.2.2 报告期末按行业分类的 股 投资股票投资组合

本基金本报告期末 过 股 交易 投资 股。

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

金 : 人

序	股票代码	股票	数 (股)	公允价值 ()	占基金资产净值比例 ()
1	601238		130 000	1 981 200.00	0.64
2	600522	中	78 000	1 801 800.00	0.58
3	002897	意 股份	38 000	1 675 800.00	0.54
4	601898	中	140 000	1 453 200.00	0.47
5	601633	长	35 000	1 296 400.00	0.42
6	600392	和资	49 962	1 129 141.20	0.37
7	300733	动	50 000	1 107 000.00	0.36
8	300751	股份	2 200	1 079 980.00	0.35
9	000970	中 三	55 000	1 032 900.00	0.33
10	002714	原股份	17 000	939 590.00	0.30
11	603606	东方	12 000	919 200.00	0.30
12	300409		35 000	909 300.00	0.29
13	300835		23 000	877 910.00	0.28
14	688112		14 000	855 960.00	0.28
15	600499		40 000	825 600.00	0.27
16	600089	变	30 000	821 700.00	0.27
17	688599	合	12 500	815 625.00	0.26
18	300394	信	30 000	812 100.00	0.26

19	000983		60 000	803 400.00	0.26
20	688155		7 500	781 500.00	0.25
21	002493		50 000	769 500.00	0.25
22	603997	股份	70 000	761 600.00	0.25
23	601966		30 000	761 100.00	0.25
24	002996	合金	50 000	760 000.00	0.25
25	002484	海股份	32 000	746 880.00	0.24
26	603995	金股份	22 150	745 569.00	0.24
27	603363		40 000	740 400.00	0.24
28	002960		27 000	739 530.00	0.24
29	601456	证券	60 000	736 200.00	0.24
30	300115	长盈	70 000	721 700.00	0.23
31	300263		80 000	716 800.00	0.23
32	002840	股份	40 000	706 000.00	0.23
33	600975	新	80 000	692 800.00	0.22
34	688077	大	8 000	674 480.00	0.22
35	603609	股份	70 000	674 100.00	0.22
36	002594	比	2 000	666 980.00	0.22
37	601088	中	20 000	666 000.00	0.22
38	603035		40 000	660 800.00	0.21
39	600596	新 股份	30 000	649 500.00	0.21
40	603197	保	13 000	639 470.00	0.21
41	603396	金 股份	7 000	637 210.00	0.21
42	600256		60 000	632 400.00	0.20
43	300014		6 000	585 000.00	0.19
44	601872	招	100 000	576 000.00	0.19
45	002895	股份	13 000	439 530.00	0.14
46	300702	股份	10 000	284 100.00	0.09
47	002034		10 000	205 300.00	0.07
48	002092	中	20 000	155 200.00	0.05
49	600989		10 000	146 500.00	0.05
50	601668	中	20 000	106 400.00	0.03
51	603588		5 964	68 764.92	0.02
52	601006	大	10 000	65 900.00	0.02
53	600718	东	5 000	57 550.00	0.02
54	002180		1 000	50 620.00	0.02
55	000498	东	5 000	48 300.00	0.02
56	002266	股	10 000	47 900.00	0.02
57	002810	东	1 000	36 390.00	0.01
58	600985	业	2 000	29 120.00	0.01

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 计 金 出期 基金资产净值 2 或前 20 的股票明细

金 : 人

序	股票代码	股票	本期 计 金	占期 基金资产净值比例
1	600522	中	8 180 425.36	2.03
2	600188		4 510 587.00	1.12
3	603606	东方	4 507 085.00	1.12
4	600116	三 利	4 019 786.00	1.00
5	600499		3 752 383.56	0.93
6	600392	和资	3 525 210.58	0.87
7	600383	金	3 220 506.00	0.80
8	600096		3 045 404.32	0.76
9	603363		2 931 782.28	0.73
10	002897	意 股份	2 920 815.00	0.72
11	600745		2 759 429.00	0.68
12	000002	A	2 758 694.00	0.68
13	002756	料	2 729 890.32	0.68
14	600718	东	2 693 315.00	0.67
15	601666	平 股份	2 454 324.50	0.61
16	600975	新	2 441 446.00	0.61
17	600018	上	2 387 000.00	0.59
18	603995	金股份	2 360 657.00	0.59
19	600123		2 347 779.00	0.58
20	600487		2 331 929.00	0.58

注：本项 金 按 交金（交 价 以 交数），不 其 交易 用。

7.4.2 计 出金 出期 基金资产净值 2 或前 20 的股票明细

金 : 人

序	股票代码	股票	本期 计 出金	占期 基金资产净值比例
1	000002	A	9 469 490.00	2.35
2	002415	海	7 353 164.13	1.82
3	600522	中	6 807 066.00	1.69
4	603128		6 727 577.00	1.67
5	002372	新	5 703 660.00	1.41
6	000858		5 043 781.00	1.25
7	002120	股份	5 029 965.00	1.25
8	600188		4 256 433.00	1.06
9	000998	平	4 154 862.00	1.03
10	603606	东方	3 868 177.00	0.96
11	600383	金	3 836 108.00	0.95
12	600116	三 利	3 670 740.00	0.91
13	600096		3 392 687.00	0.84

14	600233		3 080 687.11	0.76
15	600499		2 745 924.00	0.68
16	002088		2 739 125.00	0.68
17	600123		2 615 314.00	0.65
18	002756	料	2 595 013.00	0.64
19	600745		2 497 071.00	0.62
20	600210	业	2 454 777.00	0.61

注：本项 出金 按 交金（交 价 以 交数），不 其 交易 用。

7.4.3 股票的本 及 出股票的

人

股票 本（交）	236 736 417.36
出股票 （交）	238 421 933.10

注：本项 股票的本（交） 和 出股票的（交） 按 交金（交 价 以 交数），不 相关交易 用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金：人

序	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	债券	50 411 162.36	16.33
2	行票据		
3	金 债券	19 975 873.97	6.47
	其中： 策性金 债		
4	业债券	67 114 151.78	21.74
5	业 期 资券	20 121 720.00	6.52
6	中期票据	77 643 793.16	25.15
7	债（交 债）	26 382 485.19	8.55
8	同业存		
9	其他		
10	合计	261 649 186.46	84.75

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前 债券投资明细

金：人

序	债券代	债券	数（）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	102100073	21 交 001	300 000	30 975 486.58	10.03
2	101901329	19 信 004	200 000	21 081 984.66	6.83
3	155835	19 03	200 000	20 935 572.60	6.78
4	210014	21 付息 债 14	200 000	20 886 743.17	6.77
5	188482	21 招证 7	200 000	20 652 905.21	6.69

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 持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产 持证券。

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 金 投资明细

本基金本报告期末未持有 金 。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前 证投资明细

本基金本报告期末未持有 证。

7.10 报告期末本基金投资的 债期 交易情况说明

7.10.1 本期 债期 投资 策

本基金本报告期末未投资 债期

7.10.2 本期 债期 投资 价

本基金本报告期末未投资 债期

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 基金投资的前 证券的发行主 本期 出现 管 立 ，或在 报告 日前一年内 公 责、 的情形

报告期内本基金投资的前 证券中，发行主 招 证券股份有限公司于 2022 年 4 月 1 日 证 关于对招 证券股份有限公司 责 的决定（行 管 决定书 2022 47 ），经 ，招 证券在 2022 年 3 月 14 日的 事 中，存在变更管理不完 ， 应 不及 、不 等 。上述行 了 证券期 业信息 保 管理法（证 会 第 82 ，以 简 信息 保 管理法）第二 二 、第三 二 第一 以及 证券基 金经 信息 管理法（证 会 第 179 ，以 简 信息 管理法）第二 二 第一 、第三 、第 二 的相关规定。 据 信息 保 管理法 第 ， 信息 管理法 第 ，以及 证券期 业 事 报告 理 法（证 会 公 告 2021 12 ）第二 的规定， 证 决定对招 证券 责 的行 管 ， 主要内容 ：公司应 一 重要信息 的 规 ， 分了 及内 运行 ， 发、 、上 、 变更及运 管理，完 应 ，保 关 人 的 专业 和数 配 ，确保信息 平 运行 同 公司应对 事 相关责任人 行内 责任 。

报告期内本基金投资的前 证券中，发行主 发银行股份有限公司于 2022 年 3 月 21 日 中 银行保险 管理 会行 信息公 表（银保 决字 2022 23 ），根据 中 人 共和 银行业 管理法 第二 一 、第 和相关审 经 规则，经 ， 发银 行 管标准 数据（A ） 数据 及数据报送存在以 法 规行 ：一、 期 90 以上

A 数据存在二、漏报核业务 A 数据三、漏报信资产业务 A 数据、债券投资业务 A 数据存在、漏报公募基金投资业务 A 数据、投资资产管理产品业务 A 数据存在、A 理财产品标投行业数据存在、A 分比对不一、漏报分 A 数据、漏报对公期存明细 A 数据一、未在月 A 报送信息二、A 表信业务表报三、A 对公信业务据表报、A 关关表漏报、A 对公信分表漏报、A 会计目表漏报种信息上,中银行保险管理会决定对发银行股份有限公司人 420。

对上证券投资决策程序的说明:公司按内作规对证券行分其基金投资对。在基上本基金的基金经理根据市场情况独立作出投资决策。事发,本基金管理人对证券的发行主行了一了分,事未对证券投资价值产重大的实性。本基金投资于证券的投资决策过程合度规定的投资限投资决策程序。

报告期内本基金投资的前证券中其的发行主未出现管立或在报告日前一年内公责、的情形。

7.11.2 基金投资的前股票出基金合同规定的股票

报告期内本基金投资的前股票中,不存在出基金合同规定股票的情形。

7.11.3 期末其他项资产

：人

序		金
1	存出保证金	87 435.81
2	应算	3 329 889.79
3	应股利	
4	应利息	
5	应	358.25
6	其他应	
7	用	
8	其他	
9	合计	3 417 683.85

7.11.4 期末持有的于股期的债券明细

金 人

序	债券代	债券	公允价值	占基金资产净值比例()
1	123120	债	1 930 384.05	0.63
2	127043	债	1 913 374.96	0.62

3	127045	原 债	1 676 997.86	0.54
4	123107	债	1 575 516.16	0.51
5	110075	债	1 538 207.75	0.50
6	132018	三 1	1 259 648.63	0.41
7	127049	望 2	1 228 156.44	0.40
8	123027	债	1 125 233.01	0.36
9	113593	债	1 047 285.12	0.34
10	123119	2	1 045 807.15	0.34
11	123067	债	969 516.16	0.31
12	113534	债	966 128.63	0.31
13	123121	债	886 195.89	0.29
14	127037	银 债	824 977.81	0.27
15	127041	债	809 132.09	0.26
16	128076	金 债	762 299.18	0.25
17	128144	利 债	715 942.19	0.23
18	127006	东 债	668 974.52	0.22
19	113630	债	618 720.40	0.20

7.11.5 期末前 股票中存在 限情况的说明

本基金本报告期末前 股票中不存在 限情况。

7.11.6 投资组合报告附注的其他 字 述 分

由于 的原 ，分项之和 合计项 存在 。

§ 8 基金份 持有人信息

8.1 期末基金份 持有人 数及持有人

份 : 份

持有人 数 ()	持有的 基金份	持有人			
		投资者		个人投资者	
		持有份	占 份 比 例 ()	持有份	占 份 比 例 ()
3 512	71 833.81	231 916 769.45	91.93	20 363 581.98	8.07

8.2 期末基金管理人的 业人 持有本基金的情况

项目	持有份 数 (份)	占基金 份 比例 ()
基金管理人所有 业人 持有本基金	0.00	0.00

8.3 期末基金管理人的 业人 持有本 式基金份 情况

项目	持有基金份 的数 (份)
本公司 管理人 、基金投资和 负责人持有本 式基金	0
本基金基金经理持有本 式基金	0

§ 9 式基金份 变动

：份

基金合同 日（2016 年 6 月 28 日）基金份	345 062 697.59
本报告期期 基金份	319 228 510.33
本报告期基金 份	1 185 444.03
：本报告期基金 份	68 133 602.93
本报告期基金 分变动份	
本报告期期末基金份	252 280 351.43

§ 10 重大事 示

10.1 基金份 持有人大会决

报告期内本基金未 基金份 持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专 基金托管 的重大人事变动

10.2.1 基金管理人的重大人事变动

自 2022 年 2 月 21 日起， 不 担任公司 经理。

上述重大人事变动情况，本基金管理人已在规定信息披露 介发 相关公告。

10.2.2 基金托管人的专 基金托管 的重大人事变动

本报告期基金托管人的专 基金托管 未发 重大人事变动。

10.3 及基金管理人、基金财产、基金托管业务的

本报告期 及基金管理人、基金财产、基金托管业务的 。

10.4 基金投资策略的 变

本报告期本基金投资策略未 变。

10.5 基金 行审计的会计 事务所情况

本报告期本基金未 会计 事务所。

10.6 管理人、托管人及其 管理人 或 等情况

本报告期内未发 基金管理人及 管理人 或 等情形。

本报告期内，上海证 对 公司 行 并对公司和相关人 出 了 管 。 公司

已按 法律法规和 管要 实整 。

本报告期本基金托管人及其 管理人 有 管 或 的情形。

10.7 基金 用证券公司交易 的有关情况

10.7.1 基金 用证券公司交易 行股票投资及 金 情况

金 : 人

券	交易数	股票交易		应 券 的 金		注
		交金	占 期股票交 的比例	金	占 期 金 的比例	
长 证券	1	287 553 521.04	60.52	267 798.35	72.88	
	1	187 604 829.42	39.48	99 674.50	27.12	
东 证券	1					
东方证券	2					
东 证券	1					
东 证券	2					
大证券	1					
金证券	1					
证券	1					
信证券	1					
证券	1					
业证券	1					
银 证券	1					
招 证券	2					
证券	1					
中信 投	2					

注：1、本期 用证券公司交易 的变更情况

本报告期内本基金 用证券公司交易 有变更。

2、专用交易 的 标准和程序

根据中 证 会 关于 证券投资基金 管有关 的 (证 基字 1998 29) 和 关于完 证券投资基金交易 度有关 的 (证 基金字 2007 48) 的有关 规定, 本公司 定了 用证券公司专用交易 的 标准和程序。

(1) 标准:

- 1) 券 基本 价 (财务 况、经 况)
- 2) 券 价 (报告 、及 性和数)
- 3) 券 日信息 价 (及 性和有 性)
- 4) 券 作表现 价。

(2) 程序:

根据《用证券公司专用交易的标准形式债券业务价表》，根据分行基金专用交易。

10.7.2 基金用证券公司交易 行其他证券投资的情况

金：人

券	债券交易		债券交易		证交易	
	交金	占期债券交的比例	交金	占期债券交的比例	交金	占期证的交的比例
长 证券	241 133 867.10	57.47	54 000 000.00	100.00		
	178 477 616.62	42.53				
东 证券						
东方证券						
东 证券						
东 证券						
大证券						
金证券						
证券						
信证券						
证券						
业证券						
银 证券						
招 证券						
证券						
中信 投						

10.8 其他重大事

序	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长信基金管理有限责任公司关于 济财（ ）基金 有限公司 分式基金代 并 、定期定投资业务及 （ 定投 ） 动的公告	上证报、中 证 会披露 、公司	2022 年 1 月 13 日
2	长信利发债券型证券投资基金 2021 年第 4 度报告	中 证 会 披露 、公司	2022 年 1 月 24 日
3	长信基金管理有限责任公司 基金 2021 年第 度报告提示性公告	上证报、中证报、证券报、证券日报、中 证 会 披露	2022 年 1 月 24 日

		、公司	
4	长信基金管理有限责任公司关于 银行股份有限公司 分 式 基金代 并 、定期定 投资业 务及 (定投) 动 的公告	上证报、中 证 会 披露 、公司	2022 年 1 月 26 日
5	长信基金管理有限责任公司关于 第一 业证券股份有限公司 分 式 基金代 并 、定期定 投资业 务及 (定投) 动 的公告	上证报、中 证 会 披露 、公司	2022 年 2 月 8 日
6	长信基金管理有限责任公司关于 分 式基金 长金 上 平 及 基金 业务的公告	上证报、中证报、证 券 报、证券日报、 中 证 会 披露 、公司	2022 年 2 月 16 日
7	长信基金管理有限责任公司关于在 长金 上 平 展基金 动的公告	上证报、中证报、证 券 报、证券日报、 中 证 会 披露 、公司	2022 年 2 月 16 日
8	长信基金管理有限责任公司关于基金行业 管理人 变更公告	上证报、中 证 会 披露 、公司	2022 年 2 月 23 日
9	长信基金管理有限责任公司关于在 展个人投资者基金 及 市场基 金 动的公告	上证报、中 证 会 披露 、公司	2022 年 2 月 23 日
10	长信基金管理有限责任公司关于长信利发 债券型证券投资基金基金经理变更的公告	上证报、中 证 会 披露 、公司	2022 年 2 月 26 日
11	长信利发债券型证券投资基金更新的招募 说明书及基金产品资料 要(更新)	中 证 会 披露 、公司	2022 年 3 月 2 日
12	长信基金管理有限责任公司关于 财 证券股份有限公司 分 式基金 代 并 、定期定 投资业务及 (定投) 动 告	上证报、中 证 会 披露 、公司	2022 年 3 月 3 日
13	长信基金管理有限责任公司关于 中 基金 有限公司 分 式 基金代 并 、定期定 投资业 务及 (定投) 动 的公告	上证报、中 证 会 披露 、公司	2022 年 3 月 17 日
14	长信利发债券型证券投资基金 2021 年年度 报告	中 证 会 披露 、公司	2022 年 3 月 31 日
15	长信基金管理有限责任公司 基金 2021 年年度报告提示性公告	上证报、中证报、证 券 报、证券日报、	2022 年 3 月 31 日

		中 证 会 披 露 、 公 司	
16	长信利发债券型证券投资基金 2022 年第 1 度报告	中 证 会 披 露 、 公 司	2022 年 4 月 22 日
17	长信基金管理有限责任公司 基金 2022 年第一 度报告提示性公告	上证报、中证报、证 券 报、证券日报、 中 证 会 披 露 、 公 司	2022 年 4 月 22 日
18	长信基金管理有限责任公司关于 财 证券股份有限公司 分 式基金 代 并 、定期定 投资业务及 (定投) 动的公 告	上证报、中 证 会 披 露 、 公 司	2022 年 4 月 25 日
19	长信基金管理有限责任公司关于 止 基金 有限公司、 信基金 有限公司 理 基金相关 业务 的公告	上证报、中 证 会 披 露 、 公 司	2022 年 5 月 7 日
20	长信基金管理有限责任公司关于 基金 持有的长期 股票 整估值方法的公告	上证报、中 证 会 披 露 、 公 司	2022 年 5 月 11 日
21	长信基金管理有限责任公司关于 基金 有限公司 分 式 基金代 并 、定期定 投资业 务及 (定投) 动的 公告	上证报、中 证 会 披 露 、 公 司	2022 年 5 月 25 日
22	长信基金管理有限责任公司关于 新 信 基金 有限公司 分 式基金代 并 、定期定 投 资业务及 (定投) 动的公告	上证报、中 证 会 披 露 、 公 司	2022 年 5 月 26 日
23	长信基金管理有限责任公司关于长信利发 债券型证券投资基金 动 的公告	上证报、中 证 会 披 露 、 公 司	2022 年 5 月 27 日
24	长信利发债券型证券投资基金更新的招募 说明书 (2022 年第 1) 及基金产品资 料 要 (更新)	中 证 会 披 露 、 公 司	2022 年 5 月 31 日
25	长信基金管理有限责任公司关于 金 基金 有限公司 分 式基金代 并 、定期定 投 资业务及 (定投) 动的公告	上证报、中 证 会 披 露 、 公 司	2022 年 6 月 8 日
26	长信基金管理有限责任公司关于 上海 中 财 基金 有限公司 分 式基金代 并 、定期定 投	上证报、中 证 会 披 露 、 公 司	2022 年 6 月 13 日

	资业务及 动的公告	(定投)		
27	长信基金管理有限责任公司关于 基金代 并 、定期定 投资业 务及 动的公告	上海 基金 有限公司 分 式 基金代 并 、定期定 投资业 务及 动的公告	上证报、中 证 会 披露 、公司	2022 年 6 月 15 日
28	长信基金管理有限责任公司关于 财 基金 有限公司 分 式 基金代 并 、定期定 投资业 务及 动的公告	信 财 基金 有限公司 分 式 基金代 并 、定期定 投资业 务及 动的公告	上证报、中 证 会 披露 、公司	2022 年 6 月 15 日
29	长信基金管理有限责任公司关于 证券股份有限公司 分 式基金 代 并 、定期定 投资业务及 告 动的公告	证 券 股 份 有 限 公 司 分 式 基 金 代 并 、定期定 投资业务及 告 动的公告	上证报、中 证 会 披露 、公司	2022 年 6 月 30 日

§ 11 投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内 一投资者持有基金份额 比例 或 过 20 的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额 变 情况					报告期末持有基金情况	
	序	持有基金份额 比例 或者 过 20 的	期 份	份	份	持有份	份 占比 ()
	1	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	100 000 826. 42	0.00	0.00	100 000 826.42	39.64
产品 有风险							
<p>1、基金净值大 动的风险 一持有基金比例过 的投资者连 大 ， 会 基金投资的持 性和 定性， 变现 本。同 ， 按 净值计算 理规则 起基金份 净值 上 或 。</p> <p>2、 期 理的风险 一持有基金比例过 的投资者大 发本基金 ， 导 同期中小投资 者小 分 期 理的情况。</p> <p>3、基金投资策略 以实现的的风险 一持有基金比例过 的投资者大 ， 起基金资产 净值 ， 基金 在投资 限 ， 导 基金投资策略 以实现的。</p>							

11.2 投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期末未发生影响投资者决策的其他重要信息。

§ 12 目录

12.1 目录

- 1、中国证监会准予立基金的
- 2、长信利发债券型证券投资基金基金合同
- 3、长信利发债券型证券投资基金招募说明书
- 4、长信利发债券型证券投资基金托管
- 5、报告期内在指定报 上披露的 种公告的原
- 6、长信基金管理有限责任公司 业 、公司 程及相关资 复 。

12.2 存

基金管理人的 公场所。

12.3 阅方式

长信基金管理有限责任公司 ； 。

长信基金管理有限责任公司

2022 年 8 月 31 日