

长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证 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：江苏银行股份有限公司

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。

基金托管人江苏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	5
2.4 信息披露方式	5
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	6
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
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	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 净资产（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大 序的所有股票投资明细	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	37
7.5 期末按债券品 分类的债券投资组合	38
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大 序的前 债券投资明细	38

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大 序的所有资产 持证券投资明细.....	38
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大 序的前 金 投资明细.....	38
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大 序的前 证投资明细.....	38
7.10 报告期末本基金投资的 债期 交易情况说明.....	38
7.11 投资组合报告附注.....	39
§ 8 基金份额 持有人信息	41
8.1 期末基金份额 持有人 数及持有人	41
8.2 期末基金管理人的 业人 持有本基金的情况.....	42
8.3 期末基金管理人的 业人 持有本开放式基金份额 情况.....	42
8.4 发起式基金发起资金持有份 情况.....	42
§ 9 开放式基金份额 变动	42
§ 10 重大事 示	42
10.1 基金份额 持有人大会决	42
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.....	43
10.3 及基金管理人、基金财产、基金托管业务的	43
10.4 基金投资策略的 变.....	43
10.5 基金 行审计的会计 事务所情况.....	43
10.6 管理人、托管人及其 管理人 或 等情况.....	43
10.7 基金 用证券公司交易 的有关情况.....	43
10.8 其他重大事	44
§ 11 投资者决策的其他重要信息	47
11.1 报告期内 一投资者持有基金份额 比例 或 过 20 的情况	47
11.2 投资者决策的其他重要信息.....	47
§ 12 目录	47
12.1 目录.....	47
12.2 存放	48
12.3 阅方式.....	48

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金	长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金
基金简	长信稳鑫三个月定期开放债券发起式
基金主代	005575
交易代	005575
基金运作方式	型、定期开放式
基金合同 日	2018 年 1 月 19 日
基金管理人	长信基金管理有限责任公司
基金托管人	江苏银行股份有限公司
报告期末基金份	982 872 660.43 份
基金合同存 期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金 过投资于债券品 ， 业绩比 基准的投资 报。
投资策略	本基金 在基金合同 定的投资 内， 过对宏观经济运行 况、 策和财 策、 产业 策及资本市场资金 的 ， 宏观经济发展 势、利 走势、债券市场相对 、 券 的 动性以及信用 平， 定 类金 的资产比例 配 。在有 风险的基 上， 整组合 期，以 基金 资产的稳定 值，提 基金 。
业绩比 基准	中债 合指数
风险	本基金 债券型基金，其预期 及预期风险 平 于股票型基金 和 合型基金， 于 市场基金

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
	长信基金管理有限责任公司	江苏银行股份有限公司
信息披露 负责人	021 61009999	宏 025 58588217
		1
务	4007005566	95319
真	021 61009800	025 58588155
注	中 (上)自由 易 银 中 68 9	市中 26
公	上 市 新 银 中 68 9	市中 26
	200120	210001
法定代表人		平

2.4 信息披露方式

本基金 定的信息披露报	证券 报
载基金中期报告 的管理人	

基金中期报告	上市新银中 68 9、江苏市中 26 25
--------	-----------------------

2.5 其他相关资料

项目	公	
注 记	长信基金管理有限责任公司	上市新银中 68 9

§ 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	18 582 533.75
本期利润	14 765 897.42
平 基金份 本期利润	0.0150
本期 平 净值利润	1.46
本期基金份 净值 长	1.47
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	5 507 729.64
期末 分配基金份 利润	0.0056
期末基金资产净值	1 002 223 692.24
期末基金份 净值	1.0197
3.1.3 计期末指标	报告期末 2022 年 6 月 30 日
基金份 计净值 长	19.46

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、开放式基金的、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。

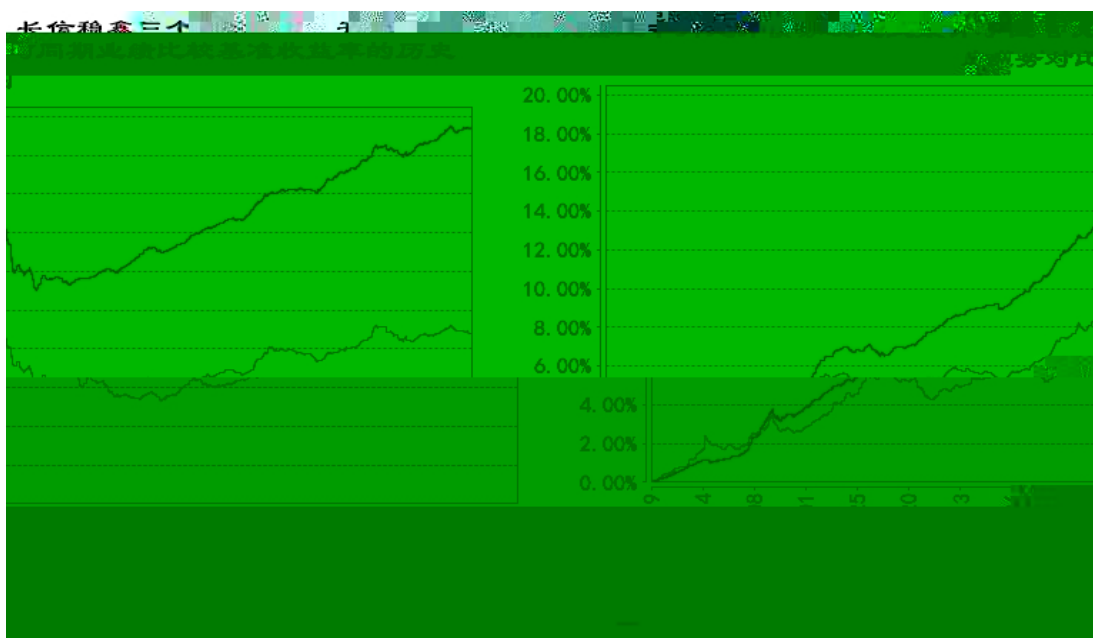
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份 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	0.10	0.04	0.24	0.03	0.34	0.01
过 三个月	0.92	0.04	0.29	0.04	0.63	0.00

过 个月	1.47	0.05	0.38	0.05	1.09	0.00
过 一年	3.87	0.05	1.83	0.05	2.04	0.00
过 三年	11.05	0.06	3.53	0.06	7.52	0.00
自基金合同起至	19.46	0.06	8.81	0.07	10.65	0.01

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



注：1、 示日期 2018 年 1 月 19 日至 2022 年 6 月 30 日。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同 之日起 6 个月内 期 期 ，本基金 项投资比例已 合基金合同中的 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，由长江证券股份有限公司、上 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 ：长江证券股份有限公司占 44.55 、上 股份有限公司占

31.21、 有限公司占 15.15、上 投资管理中（有限合）占 4.55、上 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 开放式基金，长信利息 开放式证券投资 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 信利鑫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 债一年定期开放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 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 债一年定期开放债 券型证券投资基金、长信 债一年定期开放债券型证券投资基金、长信利保债券型证券投资 基金、长信金 债一年定期开放债券型证券投资基金、长信 债一年定期开放债券型证券投资 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 债一年定期开放债券型证券投资基金、长 信 利半年定期开放 合型证券投资基金、长信 新 动股票型证券投资基金、长信稳 债债 券型证券投资基金、长信利信 配 合型证券投资基金、长信稳 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、长信稳势 债 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 稳 三个月定期开放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 一年定期开放 合型证券投资基金、长信 信 配 合型证券投资基金、长信 债券型证券投资基金、长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信 行业 股票型证券投资基金、长信 业 年定期开放 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 年定期开放 配 合型证券投资基金、长信稳 三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信稳 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 债半年定期开放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 年定期开放债券型证券投资基金、长信 平

目标三年持有期 混合型基金中基金（ ）、长信易 混合型证券投资基金、长信 混合型证券投资基金、长信稳 混合型证券投资基金、长信 87 个月定期开放债券型证券投资基金、长信稳利资产配置 一年持有期 混合型基金中基金（ ）、长信 混合型证券投资基金、长信 业 一年持有期 配 混合型证券投资基金、长信稳 6 个月持有期 混合型证券投资基金、长信 业 混合型证券投资基金、长信内 混合型证券投资基金、长信 30 动持有 债债券型证券投资基金、长信稳 债券型证券投资基金、长信稳 债券型证券投资基金、长信 三个月持有期 混合型证券投资基金、长信 和平 目标三年持有期 混合型基金中基金（ ）、长信 年平 目标三年持有期 混合型基金中基金（ ）、长信稳 长一年持有期 混合型证券投资基金、长信稳 长 混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理 组）及基金经理 理简介

职务	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		
长信利息 开放式证券投资基金、长信长金 市场基金、长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信 87 个月定期开放债券型证券投资基金和长信稳 债券型证券投资基金的基金经理、现金理财	2018 年 1 月 19 日		12 年	管理 ， 业于上 交 大 ， 有基金 业资 ， 中 。2010 年 7 月 长信基金管理有限责任公司， 任基金事务 基金会计，交易管理 债券交易 、 交易主管， 债券交易 、 、长信稳 三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信 债半年债券型证券投资基金、长信稳 三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信易 混合型证券投资基金、长信稳 债债券型证券投资基金、长信 年定期开放债券型证券投资基金和长信中债 1 3 年 策性金 债指数证券投资基金的基金经理。现任现金理财 、长信利息 开放式证券投资基金、长信长金 市场基金、长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信 87 个月定期开放债券型证券投资基金和长信稳 债券型证券投资基金的基金经理。

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 交易所公开 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

上半年，债券市场走势 以 主， 1 内债券 明 行，其他期限 基本 年 持平。1月 行 作 ，并 息 10 ，带动市场利 明 行，5 内债券 行 20 ，5 以上债券 行 10 。 金 信 数据 预期，市场对 信用 策信 ，债市 出现 ， 有 20 30 的上行。3月公 的 数据有所 ， 月 情 ，同 有 发 例出现，市场对 准 息的预期重新 ，债 券 。4月开 期限 走势出现分 ，1 开 资金利 的 行 由 未 20 ，在 2.1 了 至 5月中 ，3 以上利 债 上， 在 4月中 数据 预期、 行 准 25 策 有 之 ，中长期债券 有所 整，稳 长预期 。5月 期限的 长， 资金利 一 持 ，5年期 预期 15 ，1 开 一 行至 1.94 ，10 开 行至 2.93 ， 年 ，3 5 利 4 月中 平。6月1日上 ， 利 上行至 1.45 ，1 开利 至 2.05 附 ，3 以上利 10 15 ，之 债市整 走势平稳，在 5 内来 。在上半年中， 整组合 期，在风险 的情况 ， 利 债 作，保持了组合净值的稳定

长。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

至 2022 年 6 月 30 日，长信稳鑫三个月定开债券发起式份 净值 1.0197 ，份 计净值 1.1827 ，本报告期内长信稳鑫三个月定开债券发起式净值 长 1.47 ，同期业绩比基准 0.38 。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 半年，经济基本 有 复， 会 定 半年 稳 业稳 价，保持经济运行在合理 。 半年财 策主要 用 和用 专项债，不 动用专项债往年限 的 性， 策 保持合理 ， 大 度 持实 经济，用 策性银行 8000 新 信 、 3000 基 投资基金、3000 债券和新 1420 的 等。 半年基 投资和 业投资预计 对宏观经济起 动作用，整 意 有所 ， 复或 更 对 性 策 。 产 策用 用 策 ， 实 方 责任保交 稳 。未来 信用风险，合理配 类资产， 运用 ， 债券市场 整带来的投资 会， 投资者 更 的组合 。

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 定，对 基金持有的投资品 行估值。基金托管人根据法律法规要 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 的证券行业 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 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

本基金管理人根据相关法律法规和本基金基金合同约定已于 2022 年 6 月 13 日 行了利润分配， 10 份基金份额 发 利 0.200 。

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，在托管长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金的过程中，本基金托管人 江苏银行股份有限公司 遵守 中 人 共和 证券投资基金法 及其他有关法律法规的规定以及 长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金托管 的 定，尽 尽 责 行了托管人应尽的 务， 有 事任 基金份 持有人利 的行 。

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，本基金托管人 江苏银行股份有限公司未发现长信基金管理有限责任公司在长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额 价的计算、基金 用开 及利润分配等 上存在 基金份 持有人利 的行 ，或 中 人 共和 证券投资基金法 等有关法律法规、在 重要方 的运作 基金合同规定的情况。

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，由基金管理人所 和披露的长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金中期报告中的财务指标、净值表现、 分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现 基金持有人利 的行 。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主 ：长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金

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	1 614 432.77	168 655.74
算 金		263 716.83	1 514 576.83

存出保证金		26.15	
交易性金融资产	6.4.7.2	1 075 970 792.49	1 286 037 120.00
其中：股票投资			
基金投资			
债券投资		1 075 970 792.49	1 286 037 120.00
资产支持证券投资			
贵金属投资			
其他投资			
金融资产	6.4.7.3		
金融资产	6.4.7.4		86 000 282.50
债券投资	6.4.7.5		
其中：债券投资			
资产支持证券投资			
其他投资			
其他债券投资	6.4.7.6		
其他投资	6.4.7.7		
应算			4 964 901.22
应股利			
应			
所资产			
其他资产	6.4.7.8		21 497 794.31
资产合计		1 077 848 968.24	1 400 183 330.60
负债和净资产	附注	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
负债：			
期			
交易性金融负债			
金融负债	6.4.7.3		
卖出金融资产		75 125 334.22	387 384 148.37
应算			5 001 766.01
应			
应管理人报		248 970.64	255 672.17
应托管		82 990.22	85 224.05
应 务			
应投资			
应交			
应利润			
所 负债			
其他负债	6.4.7.9	167 980.92	340 248.69
负债合计		75 625 276.00	393 067 059.29
净资产：			
实基金	6.4.7.10	982 872 660.43	982 873 644.41
其他合	6.4.7.11		
未分配利润	6.4.7.12	19 351 031.81	24 242 626.90

净资产合计		1 002 223 692.24	1 007 116 271.31
负债和净资产 计		1 077 848 968.24	1 400 183 330.60

注：1、报告 止日 2022 年 6 月 30 日，基金份 净值 1.0197 ，基金份 982 872 660.43 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 ：长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

：人

项 目	附注	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
一、 业		18 745 450.11	22 521 790.00
1. 利息		32 818.55	20 314 304.67
其中：存 利息	6.4.7.13	13 690.14	14 963.63
债券利息			20 190 194.31
资产 持证券利息			
金 资产		19 128.41	109 146.73
证券出 利息			
其他利息			
2. 投资 （ 以 ）		22 529 267.89	2 187 579.73
其中：股票投资	6.4.7.14		
基金投资			
债券投资	6.4.7.15	22 529 267.89	2 187 579.73
资产 持证券投资	6.4.7.16		
金 投资	6.4.7.17		
	6.4.7.18		
股利	6.4.7.19		
以 本计 的金 资产 止确 产的			

其他投资			
3. 公允价值变动 以	6.4.7.20	3 816 636.33	4 395 065.06
4. (以			
5. 其他 (以	6.4.7.21		
：二、业 出		3 979 552.69	3 875 092.67
1 管理人报	6.4.10.2.1	1 506 591.21	1 503 731.50
2 托管	6.4.10.2.2	502 197.05	501 243.80
3 务			
4 投资			
5 利息 出		1 862 904.28	1 748 223.41
其中：出 金 资产 出		1 862 904.28	1 748 223.41
6 信用 值	6.4.7.22		
7 金及附			5 046.65
8 其他 用	6.4.7.23	107 860.15	116 847.31
三、利润 (以 -)		14 765 897.42	18 646 697.33
：所 用			
、净利润 (净以)		14 765 897.42	18 646 697.33
、其他 合 的 净			
、合		14 765 897.42	18 646 697.33

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 ：长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金

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)	982 873 644.41		24 242 626.90	1 007 116 271.31
：会计 策变 更				

前期更				
其他				
二、本期期末净资产(基金净值)	982 873 644.41		24 242 626.90	1 007 116 271.31
三、本期变动(以)	983.98		4 891 595.09	4 892 579.07
(一)、合			14 765 897.42	14 765 897.42
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值以)	983.98		39.26	1 023.24
其中: 1. 基金	0.04			0.04
2. 基金	984.02		39.26	1 023.28
(三)、本期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值以)			19 657 453.25	19 657 453.25
()、其他合				
存				
、本期期末净资产(基金净值)	982 872 660.43		19 351 031.81	1 002 223 692.24
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)	992 872 461.34		10 019 027.98	1 002 891 489.32
: 会计 策变更				
前期更				
其他				
二、本期期末净资产(基金净值)	992 872 461.34		10 019 027.98	1 002 891 489.32

三、本期变动（以）	1 183.05		2 760 731.23	2 761 914.28
（一）、合			18 646 697.33	18 646 697.33
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值以）	1 183.05		13.03	1 196.08
其中：1. 基金	1 183.05		13.03	1 196.08
2. 基金				
（三）、本期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值以）			15 885 979.13	15 885 979.13
（）、其他合存				
、本期期末净资产（基金净值）	992 873 644.39		12 779 759.21	1 005 653 403.60

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

长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金 以 简 本基金 ， 经中 证券管理 会（以 简 中 证 会 ）证 2017 2429 关于准 长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金注 的 复 的核准，由长信基金管理有限责任公司作 管理人 会公开募 ，基金合同于 2018 年 1 月 19 日 ， 立募 规 310 000 000.00 份基金份额 。本基金 型定期开放式，存 期限不定。本基金的基金管理人和注 记

长信基金管理有限责任公司，基金托管人 江苏银行股份有限公司。

本基金投资于 有 动性的金 ， 内 法发行上市的 债、 行票据、金 债、 方 债、公司债、 业债、中期票据、 期 资券、 期 资券、中 业 募债 券、 债券等债券资产，资产 持证券，债券 ， 银行存 （ 存 、定期存 及其 他银行存 ）， 市场 ， 债期 以及法律法规或中 证 会允 基金投资的其他金 。本基金不投资于股票、 证， 不投资于 债券、 交 债券。 法律法规或 管 以 允 基金投资其他品 ，基金管理人在 行 程序 ， 以 其 投资 。

基金的投资组合比例 ：本基金对债券的投资比例不 于基金资产的 80 但在 开放期 开 前 10 个 作日、开放期及开放期 10 个 作日的期 内，基金投资不 上述比例限 。在开放期内， 个交易日日 在 债期 合 的交易保证金 ，本基金持有现金（不 算 金、存出保证金、应 等）以及 期日在一年以内的 债券不 于基金资 产净值的 5 在 期， 个交易日日 在 债期 合 的交易保证金 ，应 保持 不 于交易保证金一 的现金（不 算 金、存出保证金、应 等）。 法律法规 或中 证 会变更投资品 的投资比例限 ，基金管理人在 行 程序 ， 以 整上述投资 品 的投资比例。

本基金的业绩比 基准 ：中债 合指数 。

6.4.2 会计报表的 基

本财务报表 按 财 的 业会计准则 基本准则 以及其 及 的 会计准则、应用指 、 以及其他相关规定（ 业会计准则 ） ，同 ，在信息披 露和估值方 ， 了中 证 会 的 中 证券 管理 会关于证券投资基金估值业 务的指导意见 、 公开募 证券投资基金信息披露管理 法 、 证券投资基金信息披露内 容 式准则 第 3 半年度报告的内容 式 、 证券投资基金信息披露 报规则 第 3 会计报表附注的 及披露 、 证券投资基金信息披露 第 3 年度报告和中期报告 以及中 证 会和中 证券投资基金业 会 的其他相关规定。

本财务报表以本基金持 经 基 报。

6.4.3 遵 业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表 合 业会计准则的要 ， 真实、完整 了本基金于 2022 年 6 月 30 日的财 务 况以及自 2022 年 1 月 1 日起至 2022 年 6 月 30 日止期 的经 和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所 用的会计 策、会计估计 一期年度报告相一 的说明

述变更 的会计 策 ， 本基金报告期所 用的其他会计 策、会计估计 一期年

度会计报表所 用的会计 策、会计估计一 。

6.4.4.1 金 资产和金 负债的分类

金 指形 本基金的金 资产（或负债），并形 其他 的金 负债（或资产）或 的合同。

1 金 资产分类

本基金的金 资产于 确 根据管理金 资产的业务 式和金 资产的合同现金 分类：以公允价值计 其变动计 期 的金 资产、以 本计 的金 资产

2 金 负债分类

本基金的金 负债于 确 分类：以公允价值计 其变动计 期 的金 负债、以 本计 的金 负债。

6.4.4.2 金 资产和金 负债的 确 、 计 和 止确

本基金于 金 合同的一方 确 一项金 资产或金 负债。

分 以公允价值计 其变动计 期 的金 资产和金 负债，以及不作 有 期 的 ，按 的公允价值作 确 金 ，相关的交易 用在发 计 期

分 以 本计 的金 资产和金 负债，按 的公允价值作 确 金 ， 相关交易 用计 其 确 金

对于以公允价值计 其变动计 期 的金 资产， 用公允价值 行 计 ，所有 公允价值变动计 期

对于以 本计 的金 资产， 用实 利 法确 利息 ，其 止确 、 或 值 产的利 或 ， 计 期

本基金以预期信用 基 ，对以 本计 的金 资产 行 值 理并确 准 。 对于不 重大 资 分的应 项，本基金运用简 计 方法，按 相 于整个存 期内的预期 信用 金 计 准 。 上述 用简 计 方法以 的金 资产，本基金在 个估值日 估其信用风险自 确 已经 ， 信用风险自 确 未 ， 于第 一 ，本基金按 相 于未来 12 个月内预期信用 的金 计 准 ，并按 和 实 利 计算利息 信用风险自 确 已 但未发 信用 值的， 于第 二 ，本基金按 相 于整个存 期内预期信用 的金 计 准 ，并按 和 实 利 计算利息 确 发 信用 值的， 于第三 ，本基金按 相 于整 个存 期内预期信用 的金 计 准 ，并按 本和实 利 计算利息

本基金在每个估值日估相关金融资产的信用风险自始至终已。本基金以项目金或者具有相信用风险的金融资产组合为基础，通过比金在估值日发的风险在确定日发的风险，以确定金预计存期内发风险的变情况

本基金计金预期信用的方法：过价一的确定平金、价值，以及在估值日出不要的本或的有过事项、前况以及未来经济况预的合理有据的信息

对金资产预期未来现金有不利的一项或项事发，金资产已发信用值的金资产

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：放了对金资产的，止确金资产并确产的资产和负债未放对金资产的，按其所金资产的程确定有关金资产，并相应确定有关负债。

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 （ ）的确和计

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

交易性金融资产的投资于交日确，并按交金交易性金融资产的
 的 用情况 的相关 的净，同 出已确 的公允价值变动
 3 金 资产，按实 利 法确 利息，在 期 内 日计提
 4 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
 5 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 日开 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 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 168 655.74，

自应利息的重分类金额 57.07，重新计预期信用准的金额人
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 168 712.81。

算金于 2021 年 12 月 31 日按原金准则示的价值人 1 514 576.83
，自应利息的重分类金额 681.60，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 1 515 258.43。

金资产于 2021 年 12 月 31 日按原金准则示的价值人
86 000 282.50，自应利息的重分类金额 6 329.51，重新计预期信用
准的金额人 0.00。经上述重分类和重新计，金资产于 2022 年 1 月 1
日按新金准则示的价值人 86 006 612.01。

应利息于 2021 年 12 月 31 日按原金准则示的价值人 21 497 794.31
，出至银行存的重分类金额 57.07，出至算金的重分类金额人
681.60，出至交易性金资产的重分类金额人 21 490 726.13，出至金
资产的重分类金额人 6 329.51。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
1 286 037 120.00，自应利息的重分类金额人 21 490 726.13。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
1 307 527 846.13。

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
387 384 148.37，自应利息的重分类金额人 138 789.54。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
387 522 937.91。

应利息于 2021 年 12 月 31 日按原金准则示的价值人 138 789.54，
出至出金资产的重分类金额人 138 789.54。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 值准 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 值

根据财 、 务 财 2016 36 关于 开 业 值 的 的规定，经 务 准，自 2016 年 5 月 1 日起在 内 开 业 值 ，金 业 ，由 业 值 。对证券投资基金（ 式证券投资基金，开 放式证券投资基金）管理人运用基金 股票、债券的 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 开 金 业 有关 策的 的规定，金 开展的 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 开展的 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 、 产开发、 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 值 应 中 。值 应 行的 根据财 、 务 财 2017 90 关于 定资产 项 等 值 策的 的规定确定。

6.4.6.2 市 、 附 、 方 附

合计	1 614 432.77
----	--------------

6.4.7.2 交易性金融资产

：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					
金 投资 金交 所 金合					
债券	交易所市 场	10 672 250.00	158 106.66	10 787 316.66	43 040.00
	银行市 场	1 038 407 673.94	17 699 475.83	1 065 183 475.83	9 076 326.06
	合计	1 049 079 923.94	17 857 582.49	1 075 970 792.49	9 033 286.06
资产 持证券					
基金					
其他					
合计	1 049 079 923.94	17 857 582.49	1 075 970 792.49	9 033 286.06	

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 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

本基金本报告期末未持有其他资产。

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	
应 证 券 出 金	
应 交 易 用	19 420.77
其中：交易所市场	
银行 市场	19 420.77
应 利 息	
预提	9 300.00
预提审计	79 752.78
预提信息披露	59 507.37
合 计	167 980.92

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	982 873 644.41	982 873 644.41
本期	0.04	0.04
本期 (以)	984.02	984.02
基金 分 份 算 前		
基金 分 份 算 整		
本期		
本期 (以)		
本期末	982 872 660.43	982 872 660.43

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	6 582 671.09	17 659 955.81	24 242 626.90
本期利润	18 582 533.75	3 816 636.33	14 765 897.42
本期基金份 交易 产 的 变 动 数	21.95	17.31	39.26

其中：基金			
基金	21.95	17.31	39.26
本期已分配利润	19 657 453.25		19 657 453.25
本期末	5 507 729.64	13 843 302.17	19 351 031.81

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		4 763.38
定期存 利息		
其他存 利息		
算 金利息		8 926.67
其他		0.09
合计		13 690.14

注：其他 保证金利息 。

6.4.7.14 股票投资

6.4.7.14.1 股票投资

股票 价

本基金本报告期 股票投资 。

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		19 997 540.01
债券投资 债券（债 股及债券 期 ） 价		2 531 727.88
债券投资 价		
债券投资 价		
合计		22 529 267.89

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		1 401 478 292.14
： 出债券（债 股及债券 期 ） 本		1 369 713 881.91
： 应计利息		29 218 107.35
： 交易 用		14 575.00

债券 价	2 531 727.88
------	--------------

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 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 证 价 。

6.4.7.18.2 其他投资

本基金本报告期 其他 投资 。

6.4.7.19 股利

本基金本报告期 股利 。

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 资产	3 816 636.33
股票投资	
债券投资	3 816 636.33
资产 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	3 816 636.33

6.4.7.21 其他

本基金本报告期 其他 。

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	29 752.78
信息披露	59 507.37
证券出 金	
	18 600.00
合计	107 860.15

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，本基金未发 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、注 记 、基金
江苏银行股份有限公司 江苏银行	基金托管人

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**

本基金本报告期及上年度 比期 未 过关 方交易 行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度 比期 未 过关 方交易 行债券交易。

6.4.10.1.3 债券 交易

本基金本报告期及上年度 比期 未 过关 方交易 行债券 交易。

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

本基金本报告期及上年度 比期 应 关 方交易 的 金。

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	1 506 591.21	1 503 731.50
其中: 的		

注：基金管理 按前一日的基金资产净值的 0.30 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	502 197.05	501 243.80

注：基金托管 按前一日的基金资产净值的 0.10 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

：人

本期 2022年1月1日至2022年6月30日						
银行 市场交易的 关 方	债券交易金		基金		基金	
	基金	基金 出	交易金	利息	交易金	利息 出
江苏银行					301 055 000.00	18 808.2 9

上年度 比期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日						
银行 市场交易的 关 方	债券交易金		基金		基金	
	基金	基金 出	交易金	利息	交易金	利息 出

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 业务的情况。

6.4.10.5 关 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 有资金投资本基金的情况

份 : 份

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
基金合同 日 (2018 年 1 月 19 日) 持有的基金份		
报告期 持有的基金份		10 000 000.00
报告期 份		0.00
报告期 分变动份		0.00
: 报告期 出 份		0.00
报告期末持有的基金份		10 000 000.00
报告期末持有的基金份 占基金 份 比例		1.01

注: 基金管理人运用 有资金投资本基金 按本基金招募说明书公 的 行。

6.4.10.5.2 报告期末 基金管理人之 的其他关 方投资本基金的情况

份 : 份

关 方	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日

	持有的 基金份	持有的基金份 占基金份 的比 例 ()	持有的 基金份	持有的基金份 占基金份 的比 例 ()
江苏银行	982 872 461.34	99.99	982 872 461.34	99.99

注：基金管理人及其他关联方投资本基金按本基金招募说明书的规定执行。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款及期产的利息

：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
江苏银行股份有限公司	1 614 432.77	4 763.38	1 855 013.41	6 780.46

注：本基金用于证券交易清算的资金通过本基金托管人的基金托管清算资金专用存款账户存放于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息。于2022年6月30日的相关数据在资产负债表中的清算资金项目中独立显示（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

：人

序	记日	息日		10 份基金 份 分 数	现金形式 发放	投资 形式 发放	本期利润分配 合计	注
		场内	场					
1	2022 年6 月13 日		2022 年6 月13 日	0.200	19 657 453.21	0.04	19 657 453.25	
合计				0.200	19 657 453.21	0.04	19 657 453.25	

6.4.12 期末 2022 年 6 月 30 日 本基金持有的 限证券

6.4.12.1 新发 发证券 于期末持有的 限证券

本基金本报告期末新发发证券持有的 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

至本报告期末 2022 年 6 月 30 日止，本基金 事银行 市场债券 交易形 的 出 证券 75 088 978.98 ， 以 债券作 ：

金 人

债券代	债券	期日	期末估值 价	数 ()	期末估值
160213	16 开 13	2022 年 7 月 1 日	103.36	834 000	86 202 582.74
合计				834 000	86 202 582.74

6.4.12.3.2 交易所市场债券

至本报告期末 2022 年 6 月 30 日止，基金 事证券交易所债券 交易形 的 出 证券 36 355.24 ，于 2022 年 7 年 1 日 期。 类交易要 本基金在 期内持有的证券 交易所交易的债券或在新 式 的债券，按证券交易所规定的比例 算 标准 券 ，不 于债券 交易的 。

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 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 存放在本基金的托管人江苏银行股份有限公司， 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 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	30 227 740.27	30 012 000.00
合计	30 227 740.27	30 012 000.00

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

：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		97 420 000.00
合计		97 420 000.00

注：本基金持有同业存 的主 AA 及以上 。

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	333 843 383.56	327 673 000.00

AAA 以	0.00	
未	711 899 668.66	830 932 120.00
合计	1 045 743 052.22	1 158 605 120.00

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 流动性风险

流动性风险 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 流动性风险来 于开放式基金 日 资金的 流动性风险，以及 分投资品 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 流动性风险分

本基金的基金管理人 按 公开募 证券投资基金运作管理 法 及 公开募 开放式证券投资基金 流动性风险管理规定 等有关法规的要 立 开放式基金 流动性管理的内 ，审 估 类资产的 动性， 对性 定 流动性风险管理 ，对本基金组合资产的 流动性风险 行管理。本基金 持组合管理、分 投资的原则开展投资 动，所持证券 在证券交易所或银行 同业市场交易，并 遵守基金管理人 动性相关交易限 。

本基金主要投资于基金合同 定的 有 动性的金 ，基金管理人对 动性指标 行持 的和分 ，定期开展 ， 估在不同的 情 资产变现情况的变 。

基金管理人持 本基金开放期内的 情况， 市场 或投资者 发 变 ，及 整投资组合资产 及比例，保持基金资产 变现规 和期限 负债 规 和期限的 配。 同 ， 对 资金的 动性风险，基金管理人在基金合同中 定了 ， 定了发 资金的 理 式， 开放 式 产的 动性风险。

6.4.13.4 市场风险

市场风险 指基金所持金 的公允价值或未来现金 所 市场 类价 的变动 发 动的风险， 利 风险、 风险和其他价 风险。

6.4.13.4.1 利 风险

利 风险 指金 的公允价值或现金 市场利 变动 发 动的风险。本基金的 息资产主要 银行存 、 算 金、存出保证金及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利 风险

：人

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	1 614 432.77					1 614 432.77
算 金	263 716.83					263 716.83
存出保证金	26.15					26.15
交易性金 资 产	131 184 914. 18	50 329 246.5 8	610 995 1 96.12	283 461 435 .61		1 075 970 79 2.49
资产 计	133 063 089. 93	50 329 246.5 8	610 995 1 96.12	283 461 435 .61		1 077 848 96 8.24
负债						
应 管理人报					248 970.64	248 970.64
应 托管					82 990.22	82 990.22
出 金 资产	75 125 334.2 2					75 125 334.2 2
其他负债					167 980.92	167 980.92
负债 计	75 125 334.2 2				499 941.78	75 625 276.0 0
利 度	57 937 755.7 1	50 329 246.58	610 995 1 96.12	283 461 435 .61	499 941.78	1 002 223 69 2.24
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	168 655.74					168 655.74
算 金	1 514 576.83					1 514 576.83
交易性金 资 产	372 180 000. 00	97 420 000.0 0	672 986 1 20.00	143 451 000 .00		1 286 037 12 0.00
金 资产	86 000 282.5 0					86 000 282.5 0
应 证券 算					4 964 901.2 2	4 964 901.22
其他资产					21 497 794. 31	21 497 794.3 1
资产 计	459 863 515. 07	97 420 000.0 0	672 986 1 20.00	143 451 000 .00	26 462 695. 53	1 400 183 33 0.60
负债						
出 金 资产	387 384 148. 37					387 384 148. 37
应 证券 算					5 001 766.0	5 001 766.01

						1	
应 管理人报						255 672.17	255 672.17
应 托管						85 224.05	85 224.05
其他负债						340 248.69	340 248.69
负 债 计	387 384 148.37					5 682 910.92	393 067 059.29
利 度	72 479 366.70	97 420 000.00	672 986 120.00	143 451 000.00	20 779 784.61	1 007 116 271.31	

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	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	6 836 787.78	7 234 694.69
	市场利 上 27 个基	6 836 787.78	7 234 694.69

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债券和银行 同 业市场交易的 定 品 ， 重大其他市场价 风险。

6.4.13.4.3.1 其他价 风险

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 ()

交易性金融资产 股票投资				
交易性金融资产 基金投资				
交易性金融资产 债券投资	1 075 970 792.49	107.36	1 286 037 120.00	127.69
交易性金融资产 金 投资				
金 资产 证投资				
其他				
合计	1 075 970 792.49	107.36	1 286 037 120.00	127.69

6.4.13.4.3.2 其他价 风险的 性分

本基金主要投资债券等 定 品 ， 重大其他价 风险， 未 行其他价 风险的 性分 。

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		
第二	1 075 970 792.49	1 286 037 120.00
第三		
合计	1 075 970 792.49	1 286 037 120.00

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 。本基金本报告期及上年度 比期 持有的持 以公允价值计 的金 的公允价值所 未发 重大变动。

6.4.14.3 持 的以公允价值计 的金 的说明

本基金本报告期末及上年度末 未持有 持 的以公允价值计 的金 。

6.4.14.4 不以公允价值计 的金 的相关说明

本基金持有的不以公允价值计 的金 以 本计 的金 资产和金 负债，金 其 期限 ，所以其 价值 公允价值相 。

6.4.15 有 于理 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**

金 人

序	项目	金	占基金 资产的比例 ()
1	投资		
	其中：股票		
2	基金投资		
3	定 投资	1 075 970 792.49	99.83
	其中：债券	1 075 970 792.49	99.83
	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	1 878 149.60	0.17
8	其他 项资产	26.15	0.00
9	合计	1 077 848 968.24	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**

本基金本报告期末未持有股票。

7.2.2 报告期末按行业分类的 股 投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大 序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期内未 股票。

7.4.2 计 出金 出期 基金资产净值 2 或前 20 的股票明细

本基金本报告期内未 出股票。

7.4.3 股票的 本 及 出股票的

本基金本报告期内未投资股票。

7.5 期末按债券品 分类的债券投资组合

金 : 人

序	债券品	公允价值	占基金资产净值比例 ()
1	债券		
2	行票据		
3	金 债券	1 045 743 052.22	104.34
	其中: 策性金 债	711 899 668.66	71.03
4	业债券		
5	业 期 资券	30 227 740.27	3.02
6	中期票据		
7	债 (交 债)		
8	同业存		
9	其他		
10	合计	1 075 970 792.49	107.36

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大 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	160213	16 开 13	1 000 000	103 360 410.96	10.31
2	210213	21 开 13	1 000 000	100 957 173.91	10.07
3	190208	19 开 08	900 000	94 824 567.12	9.46
4	1928009	19 业银行二 04	900 000	93 324 057.53	9.31
5	210202	21 开 02	900 000	92 178 542.47	9.20

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大 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 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 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 公开 责、 的情形

报告期内本基金投资的前 证券中 发行主 开发银行于 2022 年 3 月 21 日 中 银行保险 管理 会行 决定书（银保 决字 2022 8 ），根据 中 人 共和 银行业 管理法 第二 一 、第 和相关审 经 规则，经 ， 开发银行 管标 准 数据（A ） 数据 及数据报送存在以 法 规行 ：一、未报送 期 90 以上 A 数据 二、漏报 易 资业务 A 数据 三、漏报 核 业务 A 数据 、信 资产 业务 A 数据存在 、未报送债券投资业务 A 数据 、漏报 类投资 业务 A 数据 、漏报 信用证业务 A 数据 、漏报保 业务 A 数据 、A 理财产品 持 数据存在 、A 理财产品 标投 行业 数据存在 一、漏报分 A 数据 二、漏报 信信息 A 数据 三、A 表 信 业务 表 报 、A 对公信 业务 据 表 报 、A 关 关 表 漏报 、A 对公信 分 表漏报 、理财产品 记不规 。 上，中 银 行保险 管理 会决定对 开发银行 440 。

报告期内本基金投资的前 证券中 发行主 中 业发展银行于 2022 年 3 月 21 日 中 银行保险 管理 会行 决定书（银保 决字 2022 10 ），根据 中 人 共和 银行业 管理法 第二 一 、第 和相关审 经 规则，经 ，中 业发展 银行 管标准 数据（A ） 数据 及数据报送存在以 法 规行 ：一、漏报不 A 数据 二、 期 90 以上 A 数据存在 三、漏报 核 业务 A 数据 、漏报 价值 A 数据 、 报信 资产 业务 A 数据 、未报送债券 投资业务 A 数据 、未报送 类投资业务 A 数据 、银行承 票业务 A 数据存

在 、漏报 信用证业务 A 数据 、未报送 承诺业务 A 数据 一、未报送 托 业务 A 数据 二、A 分 比对不一 三、漏报对公 期存 明细 A 数据 、未在开 月 A 报送 信息 、A 表 信业务 表 报 、A 对公信 业务 据 表 报 、A 对公信 分 表漏报。上,中 银行保险 管理 会决定对中 业发展银行 480 。

报告期内本基金投资的前 证券中,发行主 中 银行股份有限公司于 2022 年 3 月 21 日 中 银行保险 管理 会行 信息公开表(银保 决字 2022 11),根据 中 人 共和 银行业 管理法 第二 一 、第 和相关审 经 规则,经 , 中 银行 管标准 数据 (A) 数据 及数据报送存在以 法 规行 : 一、 价值 A 数据存在 二、漏报信 资产 业务 A 数据 三、未报送公募基金投资 业务 A 数据 、漏报 信用证业务 A 数据 、漏报保 业务 A 数据 、A 理财产品 产品 数据核对不一 、A 理财产品 持 数据存在 、A 表 信业务 表 报 、A 对公信 业务 据 表 报 、 A 对公信 分 表漏报 一、理财产品 记不规 二、2018 年行 存在。上,中 银行保险 管理 会决定对中 银行股份有限公司 人 360 。

报告期内本基金投资的前 证券中 发行主 中 银行股份有限公司于 2022 年 3 月 21 日 中 银行保险 管理 会行 决定书(银保 决字 2022 14),根据 中 人 共和 银行业 管理法 第二 一 、第 和相关审 经 规则,经 , 中 银行 管标准 数据 (A) 数据 及数据报送存在以 法 规行 : 一、 易 资 业务 A 数据存在 二、 核 业务 A 数据存在 三、漏报 价值 A 数据 、漏报债券投资业务 A 数据 、未报送 类投资业务 A 数据 、漏报公募基金投资 业务 A 数据 、未报送投资资产管理产品业务 A 数据 、未报送 信用证业务 A 数据 、漏报保 业务 A 数据 、未报送其他担保类业务 A 数据 一、漏报 托 业务 A 数据 二、A 理财产品 持 数据存在 三、A 理财 产品 标投 行业 数据存在 、A 表 信业务 表 报 、A 对公信 业务 据 表 报 、A 关 关 表漏报 、2018 年行 存在。上,中 银行保险 管理 会决定对 银行 470 。

报告期内本基金投资的前 证券中,发行主 中 银行股份有限公司于 2022 年 3 月 21 日 中 银行保险 管理 会行 信息公开表(银保 决字 2022 16),

根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第三十二条和相关审慎经营规则，经本行审慎评估，认为本行在报告期内存在以下问题：一、90天以上大额存款余额占比超过10%；二、漏报大额业务数据；三、漏报大额价值A数据、漏报信资产业务A数据、未报送承诺业务A数据、A理财产品数据核对不一致、A理财产品持仓数据存在异常、A理财产品标投行业数据存在异常、A分行业占比对账不一致、A个人定期存款明细记录表报表一、A表信业务表报表二、A对公信业务据表报表三、2018年行内存在。上，中银保险资管会议决定对中银银行股份有限公司人370。

对上证券投资决策程序的说明：公司按照内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开责、的情形。

7.11.2 基金投资的前股票出基金合同规定的股票

本基金本报告期末未投资股票，不存在投资的前股票出基金合同规定的股票的情形。

7.11.3 期末其他项资产

：人

序		金
1	存出保证金	26.15
2	应算	
3	应股利	
4	应利息	
5	应	
6	其他应	
7	用	
8	其他	
9	合计	26.15

7.11.4 期末持有的于股期的债券明细

本基金本报告期末未持有于股期的债券。

7.11.5 期末前 股票中存在 限情况的说明

本基金本报告期末未投资股票。

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 ()
200	4 914 363.30	982 872 660.43	100.00	0.00	0.00

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 持有本开放式基金份 情况

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

8.4 发起式基金发起资金持有份 情况

项目	持有份 数	持有份 占基 金 份 比例 (%)	发 起 份 数	发 起 份 占 基 金 份 比例(%)	发起份 承诺持有 期限
基金管理人 有资金	0.00	0.00	0.00	0.00	
基金管理人 管理人	0.00	0.00	0.00	0.00	
基金经理等人	0.00	0.00	0.00	0.00	
基金管理人股	0.00	0.00	0.00	0.00	
其他	0.00	0.00	0.00	0.00	
合计	0.00	0.00	0.00	0.00	

§ 9 开放式基金份 变动

: 份

基金合同 日（2018 年 1 月 19 日）基金份	310 000 000.00
本报告期期 基金份	982 873 644.41
本报告期基金 份	0.04
：本报告期基金 份	984.02
本报告期基金 分变动份	
本报告期期末基金份	982 872 660.43

§ 10 重大事 示

10.1 基金份 持有人大会决

报告期内本基金未 开基金份 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 等情况。

本报告期内，上 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，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	
信证券	1					
证券	1					

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 券 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 交 的 比例
信证券						
证券			1 071 400 000. 00	100.00		

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	上证报、中 证 会 披	2022 年 1 月 13 日

	济财（）基金有限公司 分开放式基金代 并开 、定期定 投资业务及 （定投） 动的公 告	露、公司	
2	长信稳鑫三个月定期开放债券型发起 式证券投资基金 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、公司	2022 年 1 月 24 日
4	长信基金管理有限责任公司关于 银行股份有限公司 分开放式基金代 并开、 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 分开放式基金代 并开、 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 分开放式基金 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 开展基金 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长信 稳鑫三个月定期开放债券型发起式证 券投资基金开放、 业务的公 告	证券 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在 开展个人投资者基金 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
11	长信基金管理有限责任公司关于 财 证券股份有限公司 分开 放式基金代 并开、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 3 日
12	长信基金管理有限责任公司关于	上证报、中 证 会 披	2022 年 3 月 17 日

	中基金有限公司 分开放式基金代 并开 定期定 投资业务及 (定 投) 动的公告	露 、公司	
13	长信稳鑫三个月定期开放债券型发起 式证券投资基金 2021 年年度报告	中 证 会 披 露 、 公司	2022 年 3 月 31 日
14	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、中 证 会 披 露 、公司	2022 年 3 月 31 日
15	长信稳鑫三个月定期开放债券型发起 式证券投资基金 2022 年第 1 度报 告	中 证 会 披 露 、 公司	2022 年 4 月 22 日
16	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
17	长信基金管理有限责任公司关于 财证券股份有限公司 分开 开放式基金代 并开 、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
18	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
19	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
20	长信基金管理有限责任公司关于长信 稳鑫三个月定期开放债券型发起式证 券投资基金开放 、 业务的公 告	证 券 报、中 证 会 披 露 、公司	2022 年 5 月 24 日
21	长信基金管理有限责任公司关于 苏基金 有限公司 分开放式基金代 并开 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 分开放式基金代 并开 、定期定 投资业务及 (定 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 金 基金 有限公司 分开放式基金代 并开	上 证 报、中 证 会 披 露 、公司	2022 年 6 月 8 日

	、定期定 投资业务及 定投) 动的公告		
24	长信基金管理有限责任公司关于长信 稳鑫三个月定期开放债券型发起式证 券投资基金的分 公告	证券 报、中 证 会 披露 、公司	2022 年 6 月 9 日
25	长信基金管理有限责任公司关于 上 中 财 基金 有限公司 分开放式基金代 并开 、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 13 日
26	长信基金管理有限责任公司关于 上 基金 有限公司 分开放式基金代 并开 、 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 15 日
27	长信基金管理有限责任公司关于 信财 基金 有限公司 分开放式基金代 并开 、 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 15 日
28	长信基金管理有限责任公司关于 证券股份有限公司 分开 放式基金代 并开 、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 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 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	982 872 461. 34	0.00	0.00	982 872 461.34	99.99
产品 有风险							
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 性和稳定性， 变现 本。同 ， 按 净值计算 理规则 起基金份额 净值 上 或 。							

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 投 资
	者 分 期 理 的 情 况 。			
3、	基金投资策略 以 实现 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 。			

11.2 投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期末发 投资者决策的其他重要信息。

§ 12 目 录

12.1 目 录

- 1、中 证 会 准 立 基金 的
- 2、 长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同
- 3、 长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书
- 4、 长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金托管
- 5、报告期内在指定报 上披露的 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 存放

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