

# 长信富瑞两年定期开放债券型证券投资基金

## 2021 年第 1 季度报告

2021 年 3 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：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 4 月 21 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金基金合同规定，于 2021 年 4 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 2021 年 3 月 31 日止。

## §2 基金资产

基金名称	长信富瑞两年定开债券
基金代码	001111
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日期	2017 年 12 月 4 日
报告期基金份额	0.43 亿份
投资目标	本基金采用有效策略，基金资产投资于到期日或期限在开放前的固定收益资产，实现基金资产的保值增值。
投资策略	本基金在开放期，债券、银行存款、债券回购等固定收益资产的配置比例在 80% 以上。在封闭期内，本基金采用有效策略配置固定收益资产，基本保证本金的安全。本基金资产投资于到期日或期限在开放前的债券资产、债券回购和银行存款，基金资产在开放前完全实现。开放期内，本基金组合原则保持现金。基金管理人通过有效管理，保持基金运作的稳定性，控制流动性风险，开放期性的波动。
业绩基准	一个封闭期的业绩基准为开放期日的两年期定期存款利率 + 1%
风险	本基金为债券型基金，其风险及预期收益低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。

基金管理人	长信基金管理有限责任公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
基金的基金	长信富瑞两年定开债券 A	长信富瑞两年定开债券
基金的代	00 1	00 42
报告期 基金的份	3 2 44 3 份	21 0 2 份

### §3 要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 要财务指标

：人

要财务指标	报告期 2021 年 1 月 1 日	2021 年 3 月 31 日
	长信富瑞两年定开债券 A	长信富瑞两年定开债券
1 本期 实现	3 1 0 4	102 203
2 本期利	3 1 0 4	102 203
3 基金份 本期利	0 00 4	0 004
4 期 基金资产净值	12 4 302 4	22 0 3
期 基金份 净值	1 04 3	1 04 2

：1、本期 实现 指基金本期利 、投资 、其 不 公 值

用的 ，本期利 本期 实现 本期公 值

2、所述基金业绩指标不 有人 或 基金的 用 ， 基金 金、  
开放 基金的 、 利 投资 、基金 等 ， 用 实 要 于所  
。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份 净值 长 及其 同期业绩 基准 的

长信富瑞两年定开债券 A

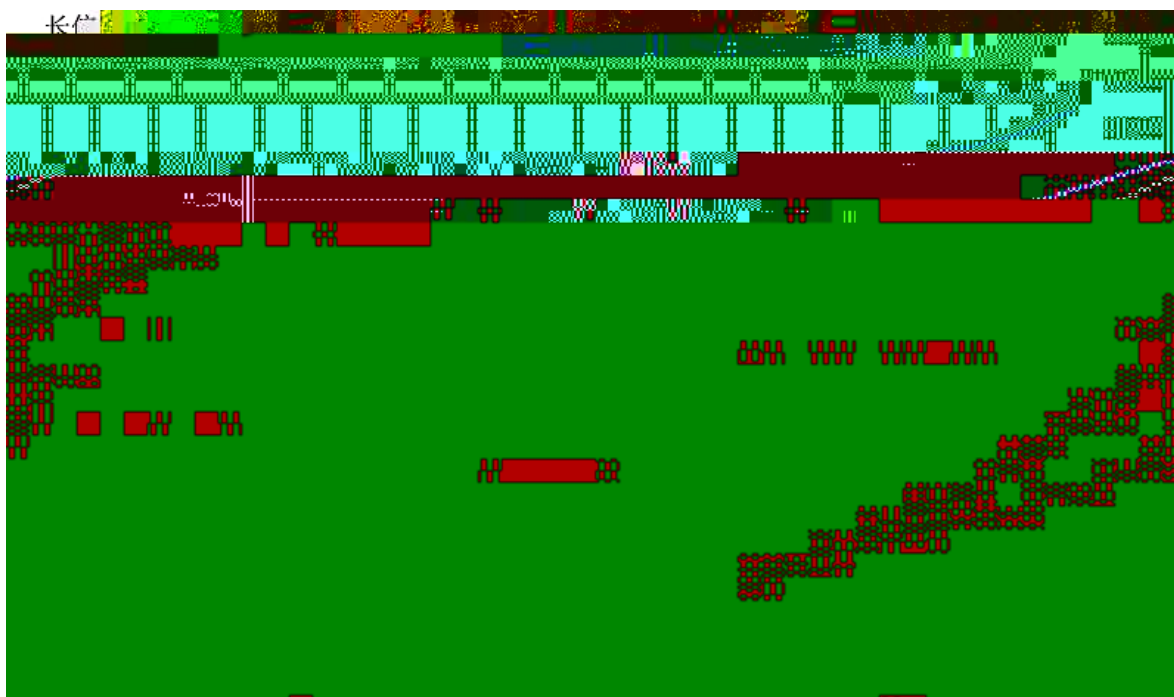
	净值 长	净值 长 标准	业绩 基 准	业绩 基 标 准		
过 个月	0 2	0 01	0	0 01	0 2	0 00
过 个月	1 0	0 01	1	0 01	0 4	0 00
过 一年	3	0 02	3 1	0 01	0 4	0 01
基金合同	4 3	0 02	00	0 01	0 0	0 01

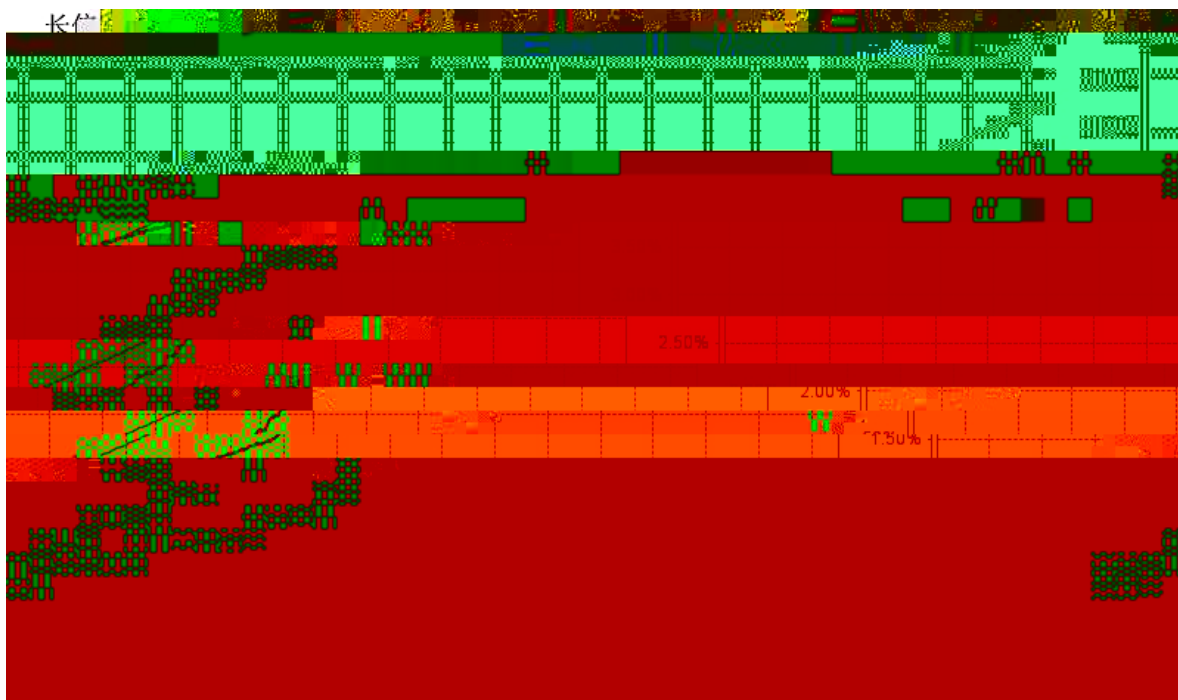
长信富瑞两年定开债券

	净值 长	净值 长	业绩 基	业绩 基		
--	------	------	------	------	--	--

		标准	准	准 标		
过 个月	0 4	0 01	0	0 01	0 32	0 00
过 个月	0	0 01	1	0 01	0	0 00
过 一年	3 43	0 02	3 1	0 01	0 2	0 01
基金合同	4 2	0 02	00	0 01	0 4	0 01

### 3.2.2 基金合同 以来基金 净值 长 及其 同期业绩 基准 的





- 1、 示日期 201 年 月 4 日 2021 年 3 月 31 日。
- 2、 基金合同规定，本基金 基金合同 日 个月内 期。 期 ，本基金的 投资 合基金合同的 定。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金 理 或基金 理 组

务	任本基金的基金 理期限		证券 业年限	说
	任 日期	任日期		
长信利 开 放 证 券 投 资 基 金、长信 合 型 证 券 投 资 基 金、长信 债 券 型 证 券 投 资 基 金、长信长 金 基 金、长信 个 月 定 期 开 放 债 券 型 证 券 投 资 基 金、长信 富 瑞 两 年 定 期 开 放 债 券 型 证 券 投	201 年 月 1 日		11 年	管理 ， 业于 大 ， 2010 年 月 长信基金管理有限 责任 公司， 任基金事务 基 金会 ， 管理 债券 、 管， 债券 、 、长 信 个 月 定 期 开 放 债 券 型 证 券 投 资 基 金、长信 债 年 债 券 型 证 券 投 资 基 金 和 长 信 个 月 定 期 开 放 债 券 型 证 券 投 资 基 金 的 基 金 理。 现 任 现 金 理 财 、 长

	资基金、长信中 债 1 3 年 策性 金 债指 证券 投资基金和长信 瑞 个月定 期开放债券型证 券投资基金的基 金 理、现金理 财			信利 开 放 证 券 投 资 基 金、长 信 合 型 证 券 投 资 基 金、长 信 债 券 型 证 券 投 资 基 金、 长 信 长 金 基 金、 长 信 个 月 定 期 开 放 债 券 型 证 券 投 资 基 金、 长 信 富 瑞 两 年 定 期 开 放 债 券 型 证 券 投 资 基 金、 长 信 中 债 1 3 年 策 性 金 债 指 证 券 投 资 基 金 和 长 信 瑞 个 月 定 期 开 放 债 券 型 证 券 投 资 基 金 的 基 金 理。
	长信长金 基金、长信 富瑞两年定期开 放债券型证券投 资基金、长信 个月定期开 放债券型 证券投资基金、 长信 合型 证券投资基金和 长信 债 券型证券投资基 金的基金 理	2020 年 3 月 2 日	年	财 大 ， 有 基 金 业 资 。 任 于 勤 会 事 务 所 合 ， 2014 年 月 长 信 基 金 管 理 有 限 责 任 公 司 ， 任 基 金 会 、 债 券 和 基 金 理 理 ， 现 任 长 信 长 金 基 金、长 信 富 瑞 两 年 定 期 开 放 债 券 型 证 券 投 资 基 金、长 信 个 月 定 期 开 放 债 券 型 证 券 投 资 基 金、长 信 合 型 证 券 投 资 基 金 和 长 信 债 券 型 证 券 投 资 基 金 的 基 金 理。

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

2、证券 业的 证券业 业人 资 管理 的 规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作 规 信 的说

本基金管理人在报告期内， 了 中 人 共和 证券投资基金 及其 有  
 规、基金合同的规定，勤勉尽责 基金份 有人 利 ，不存在 基金份 有人利  
 的行 。

本基金 以 信于 、 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 有人 大利 。

### 4.3 公 说

#### 4.3.1 公 度的 行

本报告期内，公司 实行公 度，并 公 度 ， 投资决策 ， 行的内 ，并 过 作 度、 和 保证公 原则的实现。同 ，公司 过对投资 行的 、 和信 来 对公 过 和 的 。

#### 4.3.2 行的 说

本报告期内，完 有 指 的 行投资的组合 ，其 投资组合未 所公开 同日 的 过 证券 日 的 的 ，未 现 行 。

### 4.4 报告期内基金投资策略 和运作

一季度以来， 、 ， 带 内出 保 。

年 导 基 应， 内 业 值同 长 于 年份， 运行。

， 保 和 行 ， 或于 季度 。2月 、信 同期 ，实 资 。 业投资和 复， 产投资 性，基 投资 。1 月份财 投放 导 月 资金 ， 基本 ，债 来一 行 整。 但 财 出 ，资金 季，同 策及 期， 年 债 、 ，债 有所 ，整 来 ， 年 债 行 ，1 期同业存 行 1 。

在一季度中， 了 ， 中 等 信用债，在风险 的 组合 的 。

季度， 复 ， 内基本 复 ，两会定 财 3 2 ， 年 标 以 ， 重要 标， 行 策中性 度， 公开 作 利 指标 ， 资金 整 料 合理 ， 但 大。 季度债券 、 、 行和 据 等，债 或 一定的 ， 但 一 的 期和 债 的 行 。

未来 信用风险， 信用 和 ，合理 资产，

债券 整带来的投资 会， 投资者 的组合 。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期，长信富瑞两年定开债券 A 份 净值 1 04 3 ，份 净值 1 04 3 ，长信富瑞两年定开债券 A 份 净值 长 0 2 长信富瑞两年定开债券 份 净值 1 04 2 ，份 净值 1 04 2 ，长信富瑞两年定开债券 份 净值 长 0 4 ，同期业绩 基准 0 。

#### 4.6 报告期内基金 有人 或基金资产净值 说

。

## §5 投资组合报告

### 5.1 报告期 基金资产组合

		金	基金 资产的
1	投资		
	其中：股		
2	基金投资		
3	定 投资	1 0 0 3 22 30	21
	其中：债券	1 0 0 3 22 30	21
	资产 证券		
4	金 投资		
	金 投资		
	金 资产		
	其中： 的		
	金 资产		
	银行存 和 金合	4	0 44
	其 资产	2 34 21 30	2 3
	合	1 11 2 30 4	100 00

：本基金本报告期末 过 股 投资 股。

### 5.2 报告期 行业 的股 投资组合

#### 5.2.1 报告期 行业 的 内股 投资组合

：本基金本报告期 未 有股 。

**5.2.2 报告期 行业 的 股 投资股 投资组合**

：本基金本报告期 未 有股 。

**5.3 报告期 公 值 基金资产净值 大 的前 股 投资 细**

：本基金本报告期 未 有股 。

**5.4 报告期 债券 的债券投资组合**

	债券	本	基金资产净值
1	债券		
2	行 据		
3	金 债券		
	其中： 策性金 债		
4	业债券	44 1 1 1	0 0
	业 期 资券	1 0	1 2
	中期 据	4 1 1 3 1	3
	债 债		
	同业存	3 0 43 3	3
	其		
10	合	1 0 0 3 22 30	1 0

**5.5 报告期 本 基金资产净值 大 的前 债券投资 细**

	债券代	债券	本	基金资产净值	
1	13 12	1 不 产	00 000	4	44
2	1122 3	1 金 01	0 000	32 12	1
3	101 00 3	1 001	00 000	0 2 3 0	2
4	112432	1 中 02	00 000	0 1 1 2	0
	101 00	1 资 003	00 000	0 1 1 2 4 00	0

**5.6 报告期 本 基金资产净值 大 的前 资产 证券投资 细**

：本基金本报告期 未 有资产 证券。

**5.7 报告期 公 值 基金资产净值 大 的前 金 投资 细**

：本基金本报告期 未 有金 。

## 5.8 报告期 公 值 基金资产净值 大 的前 证投资 细

：本基金本报告期 未 有 证。

## 5.9 报告期 本基金投资的 债期 说

### 5.9.1 本期 债期 投资 策

：本基金本报告期 未投资 债期 。

### 5.9.2 报告期 本基金投资的 债期 和 细

：本基金本报告期 未投资 债期 。

### 5.9.3 本期 债期 投资

：本基金本报告期 未投资 债期 。

## 5.10 投资组合报告

### 5.10.1 本基金投资的前 证券的 行 本期 以及 的 的说

报告期内本基金投资的前 证券中， 行 证券股份有限公司于 2020 年 月 20 日， 公司 证 于对 证券股份有限公司 责 、限 业务 、责 限 管理人 利 管 的决定 中 证券 管理 会 管 行 管 决定 2020 ， 内容 ： ，公司在 业股份有限公司 2014 年 公开 行 股 、201 年公司债券 、201 年 公开 行 股 、201 年公司债券 、 实业投资 股有限公司 201 年 公司债券 中未勤勉尽责，尽 基本 ， 应 有的 业 ，内 于 ，未 规定 行 导 托管理 务。 述行 了 证券 行 保 业务管理 第 、第 、第 ， 公司债券 行 管理 第 、第 、第 、第 的规定。 证券公司 管理 第 ， 保 管理 第 、第 ， 债券管理 第 、第 的规定， 证 决定对公司 以 管 ：一、责 。公司应对投行业务 行 整 ， 和 行投行业务内 度、 作 和 作规 ，诚实 信、勤勉尽责， 实提 投资银行业务 、2020 年 月 20 日 2021 年 1 月 1 日期 ， 公司保 资 、责 限 管理人 利，限 任 管 投行业务的 理 2014 年度、201 年度、201 年度基本 资以 的 利，限 任 管 投行业务的 理 201 年度、201 年度基本 资以 的 利， 应 公司。 对 证券投资决策 的说 ：公司 内 作规 对 证券 行

其 基金投资对 。在 基 本基金的基金 理根据 作出投资决 策。 事 ，本基金管理人 对 证券的 行 行了一了 ， 事 未 对 证券投资 值 产 重大的实 性 。本基金投资于 证券的投资决策过 合 度规 定的投资 限 投资决策 。

报告期内本基金投资的前 证券中其 的行 未出现 管 或在报 告 日前一年内 公开 责、 的 。

### 5.10.2 基金投资的前 股 出基金合同规定的 股 的说

本基金本报告期 未投资股 ，不存在投资的前 股 出基金合同规定的 股 的 。

### 5.10.3 其 资产

		金
1	存出保证金	
2	应 证券	
3	应 股利	
4	应 利	2 34 21 30
	应	
	其 应	
	其	
	合	2 34 21 30

### 5.10.4 报告期 有的 于 股期的 债券 细

：本基金本报告期 未 有 于 股期的 债券。

### 5.10.5 报告期 前 股 中存在 限 的说

：本基金本报告期 未 有股 。

### 5.10.6 投资组合报告 的其 述

： 于 的原 ， 和 合 存在 。

## §6 开放 基金份

： 份

	长信富瑞两年定开债券 A	长信富瑞两年定开债券
报告期期 基金份	3 2 44 3	21 0 2
报告期期 基金 份		
报告期期 基金 份		
报告期期 基金 份 份 以		
报告期期 基金份	3 2 44 3	21 0 2

## §7 基金管理人运用 有资金投资本基金

### 7.1 基金管理人 有本基金份

：本报告期内基金管理人未运用 有资金投资本基金。

### 7.2 基金管理人运用 有资金投资本基金 细

：本报告期内基金管理人未运用 有资金投资本基金。

## §8 投资者决策的其 重要信

### 8.1 报告期内 一投资者 有基金份 或 过 20%的

投资者 别	报告期内 有基金份					报告期 有基金	
		有基金份 或者 过 20 的	期 份	份	份	有份	份
	1	2021 年 1 月 1 日 2021 年 3 月 31 日	1 0 043 000 00	0 00	0 00	1 0 043 000 00	2 4
	2	2021 年 1 月 1 日 2021 年 3 月 31 日	300 1 2 333 33	0 00	0 00	300 1 2 333 33	4
个人							
产 有风险							
<p>1、基金净值大 的风险 一 有基金 过 的投资者连 大 ， 会 基金投资的 性和 定性， 现 本。同 ， 净值 理规则 基金份 净值 或 。</p> <p>2、 期 理的风险 一 有基金 过 的投资者大 本基金 ， 导 同期中 投资者 期 理的 。</p> <p>3、基金投资策 以实现的 风险</p>							

一 有基金 过 的投资者大 ， 基金资产 净值 ， 基金在投  
资 限 ， 导 基金投资策 以实现。

## 8.2 投资者决策的其 重要信

：本基金本报告期末 投资者决策的其 重要信 。

## §9

### 9.1

- 1、中 证 会 准 基金的
- 2、 长信富瑞两年定期开放债券型证券投资基金基金合同
- 3、 长信富瑞两年定期开放债券型证券投资基金招募说
- 4、 长信富瑞两年定期开放债券型证券投资基金托管  
、报告期内在指定报 的 公告的原  
、长信基金管理有限责任公司 业 、公司 及 资 复 。

### 9.2 存放

基金管理人的 公 所。

### 9.3 阅

长信基金管理有限责任公司 ： 。

长信基金管理有限责任公司

2021 年 4 月 21 日