

长信颐天平衡养老目标三年持有期混合型
基金中基金（FOF）
2021 年第 1 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：中国民生银行股份有限公司

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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金基金合同的规定，于 2021 年 4 月 19 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
本基金的

本报告中财务资料未。

本报告期 2021 年 1 月 1 日 2021 年 3 月 31 日。

§2 基金产

基金	长信颐天养老三年持有混合（FOF）	
基金代	00 2	
基金运作	型	
基金合同生 日	2019 年 9 月 2 日	
报告期 基金份	30 2 3 份	
投资目标	在 风险的前提 ， 过 的资产 、基金 ， 基金资产 定 值。	
投资策	本产 定 中等风险、长期投资，以承担中等风险 长期 的 报。股 、股 型基金、混合型基金和 基金（ 期 基金和 金 F）的 合 不过 0 ， 以 目标风险的投资者 。	
业绩 基准	0 中证 指 0 中证 股型基金指	
风险	本基金 于 管理混合型 FOF 基金， 期风险 期 于股 型基金、 于 型基金 基金。	
基金管理人	长信基金管理有限责任公司	
基金托管人	中国民生银行股份有限公司	
基金的基金	长信颐天养老三年持有混合（FOF）A	长信颐天养老三年持有混合（FOF）
基金的代	00 2	00 3
报告期 基金的份	201 00 9 9 份	103 4 04 0 份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

：人民币

主要财务指标	报告期（2021年1月1日	2021年3月31日）
	长信颐天养老三年持有混合（FOF）A	长信颐天养老三年持有混合（FOF）
1 本期实现	2 1 12	2 3 2 03
2 本期利	3 1 90 14	2 9 1 0 9
3 平 基金份 本期利	0 0321	0 0499
4 期 基金资产净值	20 9 9 19	10 33 4 2 0
期 基金份 净值	1 03 0	1 0342

：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 持有人 或 基金的 用（ ， 基金 金、
基金的 、 利 投资 、基金 等）， 用 实 平要 于所

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值长 及其 同期业绩 基准 的

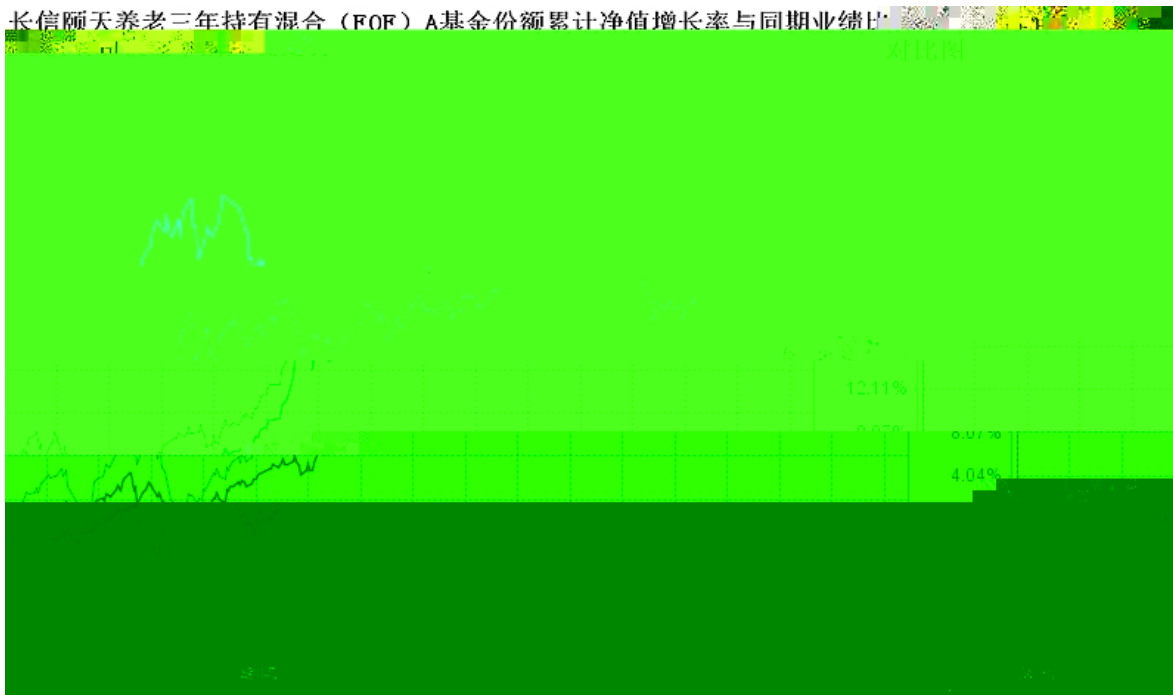
长信颐天养老三年持有混合（FOF）A

	净值 长	净值 长 标准	业绩 基 准	业绩 基 准 标准		
过 三个月	3	0 91	1 29	0	2 29	0 04
过 个月	2 1	0	2	0 3	3 1	0 0
过 一年	19 12	0	23 9	0 0	4	0 0
基金合同 生	22 09	0 1	29 0	0 1	9	0 00

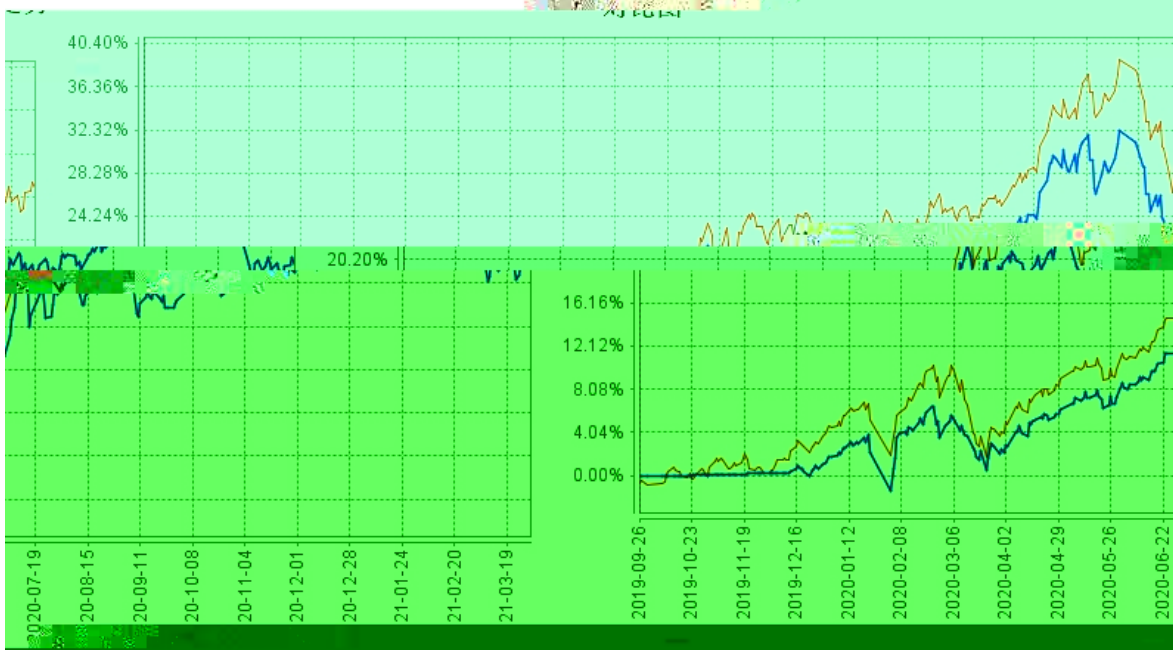
长信颐天养老三年持有混合（FOF）

	净值 长	净值 长 标准	业绩 基 准	业绩 基 准 标准		
过 三个月	3 0	0 91	1 29	0	2 31	0 04
过 个月	2	0	2	0 3	3	0 0
过 一年	19 00	0	23 9	0 0	4 9	0 0
基金合同 生	21 90	0 1	29 0	0 1	1	0 00

3.2.2 基金合同生效以来基金净值增长及其同期业绩基准的



长信颐天养老三年持有混合（FOF）C基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势图



：1、 示日期 2019 年 9 月 2 日 2021 年 3 月 31 日。

2、 基金合同规定，本基金 基金合同生效 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）

任本基金的基金 理期限	任 日期	任日期	证 业 年限	务
				长信 资 产 混 合 型 基 金 中 基 金（FOF）、长信颐天平 衡 养 老 目 标 三 年 持 有 期 混 合 型 基 金 中 基 金（FOF）和长信 利 资 产 一 年 持 有 期 混 合 型 基 金 中 基 金（FOF）的基金 理、养 老 FOF 投 资
	2020 年 月 日		1 年	管理 ， 大 管理 业， 在 投资 有限公司担任 、 和资产管理有限公司 担任 ， 201 年 3 月 长信基金管理有限责 任公司， 任国 业务 、 长信 一年定期 型证 投资基金、长信利 混合型证 投资 基金、长信 证 股 指 型 证 投资基金、长信 国标准 100 等 重 指 型证 投资基金和长信 证 投资基金的基 金 理。现任养老 FOF 投资 、长信 资 产 混 合 型 基 金 中 基 金（FOF）、长信颐 天平 衡 养 老 目 标 三 年 持 有 期 混 合 型 基 金 中 基 金（FOF）和 长信 利 资 产 一 年 持 有 期 混 合 型 基 金 中 基 金（FOF） 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 业的 证 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

本基金管理人 在 报 告 期 内， 了 中 人 民 共 和 国 证 投 资 基 金 及 其 有 规 范、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 、 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，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，最大限度地实现基金份额持有人的利益。

4.3 公平

4.3.1 公平对待不同类别基金份额持有人的合法权益

本报告期内，公司严格执行公平对待原则，并公平对待不同类别基金份额持有人的合法权益，在投资决策、基金估值、基金费用等方面，并过作度、和保证公平原则的实现。同时，公司通过对投资行的、和信来对公平过和的。

4.3.2 公平对待不同类别基金份额持有人的合法权益

本报告期内，完全有指的行投资的组合，其投资组合未生所公同日过的证日的的，未现行。

4.4 报告期内基金投资策略和运作

一季度，A股前，在风险提的，了年季度的风和，及、料等行业表现。以代表的重股出现整，期和值个股。要指表现来，证指、300、业指别0.90、3.13、00。行业、及公用事业、银行别了1.2、11.21、10。期，策及行期的，年期国前大行，整现。基金指表现来，中证股基金指一季度3.93，中证基金指0。

本基金以资产，基金要，过股和基金的组合投资，长期。对长期的和行衡，以性投资会。

本基金承勤勉尽责的度，在风险的前提下，实现的投资报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

2021年3月31日，长信颐天养老三年持有混合（FOF）A份净值1.030，份净值1.23，本报告期内长信颐天养老三年持有混合（FOF）A净值长3长信颐天养老三年持有混合（FOF）份净值1.0342，份净值1.2342，本报告期内长信颐天养老三年持有混合（FOF）净值长3.0，同期业绩基准

1 29 。

4.6 报告期内基金持有人 或基金资产净值

。

§5 投资组合报告

5.1 报告期 基金资产组合

	目	金 ()	基金 资产的 ()
1	投资	30 30 44 23	9 1
	其中：股	30 30 44 23	9 1
2	基金投资	231 244 9 1	2
3	定 投资	1 229 00	24
	其中：	1 229 00	24
	资产 持证		
4	金 投资		
	金 生 投资		
	金 资产		
	其中： 的 金 资产		
	银行存 和 金合	1 0 12 92	0 4
	其 资产	3 41 999 90	12 13
9	合	31 90 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

代	行业 别	公 值 ()	基金资产净值
A	、 、 、 业		
	业		
	业	2 09 9 3 1	94
	、 、 及 生产和 业	24 03 12	0 01
	业		
F	和 业		
	运 、 和 业		
	和 业		
	信 、 和信 务		

	业		
	金 业	1 1 3 42 93	0 3
	产业	4 00 000 00	1 2
	和 务 务业		
	和 务业		
	利、 和公共 管理业		
0	民 务、 理和其 务业		
	生和 会 作		
	、 和 业		
	合		
	合	30 30 44 23	9 9

5.2.2 报告期 行业 的 股 投资股 投资组合

：本基金本报告期末 过 股 投资 股。

5.3 报告期 公 值 基金资产净值 大 的前 股 投资

	股 代	股	(股)	公 值 ()	基金资产净 值 ()
1	000 2	A	90 00	9 1 00	1 0
2	00223	大 股份	221 00	4 1 0 00	1 3
3	000002	A	133 00	4 00 000 00	1 2
4	002493		13 00	3 31 0 00	1 1
	01233	股份	1 9 00	3 12 0 00	1 1
	300003		9 00	2 2 1 00	0 3
	000049		31 300	2 13 4 00	0
	00241		30 200	1 1 0 00	0 3
9	0199	中金公司	24 9 1	1 1 3 42 93	0 3
10	03 9	天股份	1 119	24 03 12	0 01

5.4 报告期 的 投资组合

		公 值 ()	基金资产净值 ()
1	国	43 0	2 04
2	行 据		
3	金	10 0 429 00	3 19
	其中： 策性金	10 0 429 00	3 19
4	业		
	业 期 资		
	中期 据		
	()	1 2 013 20	0 0
	同业存		
9	其		

10	合	1	229 00	2
----	---	---	--------	---

5.5 报告期 公 值 基金资产净值 大 的前 投资

	代		()	公 值 ()	基金资产净值 ()
1	200309	20 出 09	90 000	9 004 00 00	2
2	019 40	20 国 10	3 90	3 2 40	1 13
3	01010	21 国	2 4 0	2 0 214 40	0 91
4	10 04	国 1 0	10 0	1 0 3 929 00	0 34
	113044	大	1 0	1 2 013 20	0 0

5.6 报告期 公 值 基金资产净值 大 的前 资产 持证 投资

：本基金本报告期 未持有资产 持证 。

5.7 报告期 公 值 基金资产净值 大 的前 金 投资

：本基金本报告期 未持有 金 。

5.8 报告期 公 值 基金资产净值 大 的前 证投资

：本基金本报告期 未持有 证。

5.9 报告期 本基金投资的股指期货

5.9.1 报告期 本基金投资的股指期货 持 和

：本基金本报告期 未投资股指期货 。

5.9.2 本基金投资股指期货 的投资 策

：本基金本报告期 未投资股指期货 。

5.10 报告期 本基金投资的国 期

5.10.1 本期国 期 投资 策

：本基金本报告期 未投资国 期 。

5.10.2 报告期 本基金投资的国 期 持 和

：本基金本报告期 未投资国 期 。

5.10.3 本期国 期 投资

：本基金本报告期 未投资国 期 。

5.11 投资组合报告

5.11.1 本基金投资的前 证 的 行 本期 以及 的 的

报告期内本基金投资的前 证 的 行 未出现 管 ，或在报告 日 前一年内 公 责、 的 。

5.11.2 基金投资的前 股 出基金合同规定的 股 的

报告期内本基金投资的前 股 中，不存在 出基金合同规定 股 的 。

5.11.3 其 资产

		金 ()
1	存出保证金	123 9 4
2	证	1 99 01 33
3	股利	
4	利	2 0 11
		3 1 9 00 41
	其	09 1
	其	
	合	3 41 999 90

5.11.4 报告期 持有的 于 股期的

：本基金本报告期 未持有 于 股期的 。

5.11.5 报告期 前 股 中存在 限 的

	股 代	股	限 的公 值	基金资 产净值 ()	限
1	0199	中金公司	1 1 3 42 93	0 3	股 定

5.11.6 投资组合报告 的其 述

：于 的原 ， 和 合 存在 。

§6 基金中基金

6.1 报告期 公 值 基金资产净值 大 的前 基金投资

	基金代	基金	运作	持有份 (份)	公 值 ()	基金 资产净 值 ()	于基金 管理人 及管理 人 所管 理的基

							金
1	190 2	对 混 合	型	21 32 4 0	2 13 93 21	0	
2	003349	长信	型	21 00 3	22 4 0 1	11	
3	23300	大	型	12 10 29	1 9 9 3 34	00	
4	199	长信 混 合	型	19 9 1 30 9	1 3 24 14		
	19943	长信利 A	型	14 04 1 3	1 432 4 1	20	
	11003	A	型	12 3 2 9 99	13 3 193 2	4 31	
	199	长信 A	型	9 9 4 2 2 04	11 239 021 00	3	
	1999	长信银 利 混合	型	0 11 2	11 111 49	3 2	
9	19133	混 合	型	4 190 9	10 133	3 21	
10	00499	股	型	3 2 2 1 1 93	9 2 99	2 93	

6.2 期 及持有基金产生的 用

目	本期 用 2021 年 1 月 1 日 2021 年 3 月 31 日	其中： 及持有基金管理人 以及管理人 所管理基金 产生的 用
期 基金产生的 ()	000 00	
期 基金产生的	233 21 01	2 9 2

（ ）		
期持有基金产生的 务 （ ）	44 313 2	3 11 4
期持有基金产生的 管理 （ ）	1 4 9	20 3 9
期持有基金产生的 托管 （ ）	11 2 02	41 1 1
期 基金产生的 （ ）	30 4 0	42 449 21

： 期持有基金产生的 务 、 管理 、 托管 投资基金基金
合同 定 作 用 投资基金的基金份 净值， 表 示金 本基金对 投资基金
的实 持 根据 投资基金基金合同 定的 和 出。

根据 规及本基金合同的 定，基金管理人 对基金中基金财产中持有的 管
理的基金 基金中基金的管理 ，基金托管人 对基金中基金财产中持有的 托管的
基金 基金中基金的托管 。基金管理人运用本基金财产 管理的其 基金的（ F
）， 过 不 、 （ 规、基金 定
，并 基金资产的 用 ）、 务 等 用，其中 、 在实
、 述规定 行， 务 本基金管理人 投资基金 本基金基
金资产。

3 本报告期持有的基金 生的重大 事

： 本基金本报告期持有的基金未 生重大 事 。

§7 基金份

： 份

目	长信颐天养老三年持有混 合（FOF）A	长信颐天养老三年持有混 合（FOF）
报告期期 基金份	192 4	44 9 3 0 3
报告期期 基金 份	912 402 02	9 323
报告期期 基金 份		
报告期期 基金 份（份 以 ）		
报告期期 基金份	201 00 9 9	103 4 04 0

§8 基金管理人运用 有资金投资本基金

8.1 基金管理人持有本基金份

：本报告期内基金管理人未运用 有资金投资本基金。

8.2 基金管理人运用 有资金投资本基金

：本报告期内基金管理人未运用 有资金投资本基金。

§9 投资者决策的其 重要信

9.1 报告期内 一投资者持有基金份 或 过 20%的

：本基金本报告期内未有 一投资者持有基金份 或 过 20 的 。

9.2 投资者决策的其 重要信

：本基金本报告期末 生 投资者决策的其 重要信 。

§10 目

10.1 目

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

10.2 存

基金管理人的 公 所。

10.3

长信基金管理有限责任公司 :

长信基金管理有限责任公司

2021 年 4 月 21 日