

长信先锐混合型证券投资基金 2021 年第 2 季度报告

2021 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：平安银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 7 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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金基金合同的规定，于 2021 年 7 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 4 月 1 日起至 2021 年 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

| | | |
|-----------------|---|----------------|
| 基金简称 | 长信先锐混合 | |
| 基金主代码 | 519937 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2020 年 1 月 23 日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 214,087,066.24 份 | |
| 投资目标 | 通过积极主动的资产管理，在严格控制基金资产风险的前提下，力争为投资者提供稳定增长的投资收益。 | |
| 投资策略 | 本基金将利用全球信息平台、外部研究平台、行业信息平台以及自身的研究平台等信息资源，基于本基金的投资目标和投资理念，从宏观和微观两个角度进行研究，开展战略资产配置，之后通过战术资产配置再平衡基金资产组合，实现组合内各类别资产的优化配置。 | |
| 业绩比较基准 | 中债综合指数收益率*70%+沪深 300 指数收益率*20%+恒生指数收益率*10% | |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。 | |
| 基金管理人 | 长信基金管理有限责任公司 | |
| 基金托管人 | 平安银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 长信先锐混合 A | 长信先锐混合 C |
| 下属分级基金的场内简称 | CXXRA | - |
| 下属分级基金的交易代码 | 519937 | 008918 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 207,102,495.72 份 | 6,984,570.52 份 |

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2021年4月1日—2021年6月30日） | |
|-----------------|---------------------------|--------------|
| | 长信先锐混合 A | 长信先锐混合 C |
| 1. 本期已实现收益 | 10,786,637.28 | 372,909.35 |
| 2. 本期利润 | 12,923,843.75 | 390,585.30 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0299 | 0.0226 |
| 4. 期末基金资产净值 | 271,161,613.93 | 9,063,730.02 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.3093 | 1.2977 |

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

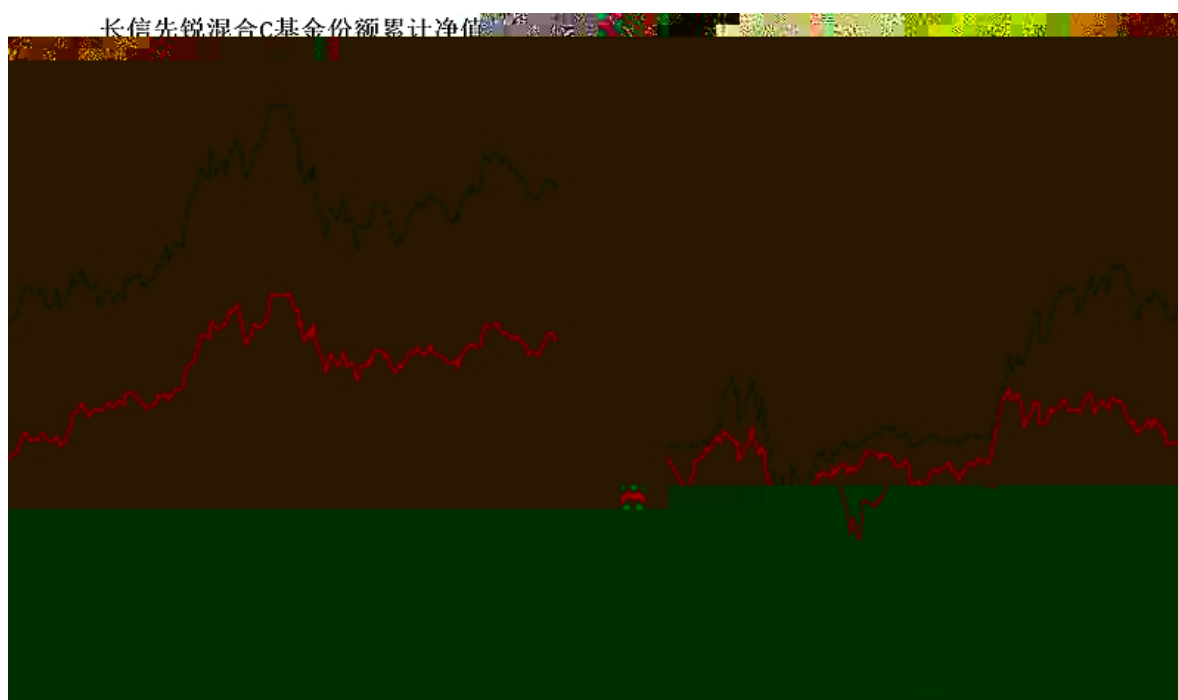
长信先锐混合 A

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|-------|-------|
| 过去三个月 | 2.15% | 0.36% | 1.22% | 0.26% | 0.93% | 0.10% |
| 过去六个月 | 1.54% | 0.48% | 1.30% | 0.35% | 0.24% | 0.13% |
| 过去一年 | 13.84% | 0.47% | 6.72% | 0.34% | 7.12% | 0.13% |
| 自基金合同生效起至今 | 14.50% | 0.48% | 6.02% | 0.38% | 8.48% | 0.10% |

长信先锐混合 C

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | 2.00% | 0.36% | 1.22% | 0.26% | 0.78% | 0.10% |
| 过去六个月 | 1.24% | 0.48% | 1.30% | 0.35% | -0.06% | 0.13% |
| 过去一年 | 13.15% | 0.47% | 6.72% | 0.34% | 6.43% | 0.13% |
| 自基金合同生效起至今 | 13.48% | 0.48% | 6.02% | 0.38% | 7.46% | 0.10% |

3.2.2 自基金转型以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、图示日期为 2020 年 1 月 23 日至 2021 年 6 月 30 日。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内为建仓期，报告期末已完成建仓但报告期末距建仓结束不满一年；建仓期结束时，本基金各项投资比例已符合基金合同中的约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|----|---|-----------------|------|--------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 吴晖 | 长信价值优选混合型证券投资基金、长信先锐混合型证券投资基金、长信可转债债券型证券投资基金、长信利丰债券型证券投资基金、长信利广灵活配置混合型证券投资基金、长信利盈灵活配置混合型证券投资基金、长信利富债券型证券投资基金、长信先利半年定期开放混合型证券投资基金和长信稳健均衡 6 个月持有期混合型证券投资基金的基金经理 | 2020 年 1 月 23 日 | - | 6 年 | 清华大学管理科学与工程硕士，具有基金从业资格。曾任职于上海浦东发展银行股份有限公司和东方证券股份有限公司。2017 年 5 月加入长信基金管理有限责任公司，曾任公司基金经理助理和长信先锐债券型证券投资基金的基金经理，现任长信价值优选混合型证券投资基金、长信先锐混合型证券投资基金、长信可转债债券型证券投资基金、长信利丰债券型证券投资基金、长信利广灵活配置混合型证券投资基金、长信利盈灵活配置混合型证券投资基金、长信利富债券型证券投资基金、长信先利半年定期开放混合型证券投资基金和长信稳健均衡 6 个月持有期混合型证券投资基金的基金经理。 |

注：1、首任基金经理任职日期以本基金成立之日为准；新增或变更基金经理的日期根据对外披露的公告日期填写；

2、证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》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，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

本基金将继续以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，承诺将一如既往地本着诚实信用、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，努力为基金份额持有人谋求最大利益。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司已实行公平交易制度，并建立公平交易制度体系，已建立投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，公司已通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，除完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合外，其余各投资组合未发生参与交易所公开竞价同日反向交易且成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形，未发现异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

二季度国内流动性环境较为宽松，权益市场在前期调整后持续反弹，同时内部结构有所分化，部分周期和成长风格表现突出，包括国内供给主导的黑色系品种，景气度确定的新能源、医美、白酒。此前有分歧的半导体、光伏等也逐步跟上。债券收益率整体下行、信用利差压缩，部分受到事件冲击走扩的信用利差也有所缓和。从结构上来看，中低等级和短融下行幅度更大，适度的久期和信用策略较为占优。

二季度，我们结合基本面和流动性，通过对各类资产的灵活配置来为投资者获取稳定的回报。具体操作上，调整仓位到长期产业趋势确定，短期景气度高的板块中，提高对业绩和估值匹配度的要求。纯债方面，维持中短久期和中高等级的持仓结构，获取确定性票息。

展望下半年，国内经济增长有望保持较强韧性，带动企业盈利向上。出口相关的产业链继续维持高景气，基建有望在专项债加速发行的推动之下逐步恢复。同时，预计 PPI 仍将保持较高水平，带动下半年名义经济持续增长，给企业盈利带来进一步的上行，这些都是对下半年市场最为有力的支撑。政策方面，我们预计货币政策仍然将保持平稳，企业融资压力最大的时候逐步过去。虽然专项债发行可能使得利率水平略有上行，但整体对市场的影响较为有限。此外，企业盈利上行推动的信用利差改善对估值有较强的支撑。海外方面，随着疫苗接种的加速，全球的货币政策将向中性回归，但在节奏、力度和结构上存在差异，密切关注美国政策的拐点。

三季度权益市场更多关注结构性机会，一方面坚持长期增长较为确定、业绩能够支撑估值的资产，包括汽车、电气设备、石油石化等。另外一方面，寻找在盈利上行期中业绩弹性较高的领域，例如电子、新能源、高端制造等。转债市场的估值，经过前期的低价修复和高价压缩，目前恢复到合理水平，需要自下而上结合公司本身的资质以及市场预期，精选优质标的进行配置。债券票息策略仍然占优，利率债维持震荡格局，重点选择信用改善的产业债和区位较好的城投债，维持适度的杠杆水平。如果因流动性扰动、供给增加、通胀短期偏高等因素导致利率上行，择机配置长久期资产。

下一阶段我们将继续保持审慎严谨的态度，密切关注经济走势和政策动向，适度调整组合权益部分的行业分布和个股集中度、债券部分的久期和仓位，加强流动性管理，严格防范信用风险，进一步优化投资组合，力争为投资者获取更好的收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 6 月 30 日，长信先锐混合 A 份额净值为 1.3093 元，份额累计净值为 1.3093 元，本报告期内长信先锐混合 A 净值增长率为 2.15%；长信先锐混合 C 份额净值为 1.2977 元，份额累计净值为 1.2977 元，本报告期内长信先锐混合 C 净值增长率为 2.00%，同期业绩比较基准收益率为 1.22%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|----|----------|----------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 69,569,620.34 | 21.19 |
| | 其中：股票 | 69,569,620.34 | 21.19 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 180,014,720.00 | 54.84 |
| | 其中：债券 | 180,014,720.00 | 54.84 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |

| | | | |
|---|--------------------|----------------|--------|
| | 其中: 买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 73,956,067.47 | 22.53 |
| 8 | 其他资产 | 4,712,459.90 | 1.44 |
| 9 | 合计 | 328,252,867.71 | 100.00 |

注: 本基金本报告期末未通过港股通交易机制投资港股。本基金本报告期末未参与转融通证券出借业务。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值 (元) | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|---------------|---------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | 5,850.78 | 0.00 |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 21,428,184.07 | 7.65 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 4,454,112.00 | 1.59 |
| E | 建筑业 | 25,371.37 | 0.01 |
| F | 批发和零售业 | 46,404.58 | 0.02 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 252,200.53 | 0.09 |
| J | 金融业 | 38,396,993.98 | 13.70 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 3,527,675.50 | 1.26 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 145,471.20 | 0.05 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 1,287,356.33 | 0.46 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 69,569,620.34 | 24.83 |

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注: 本基金本报告期末未持有港股通股票。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|-----------|--------------|--------------|
| 1 | 601166 | 兴业银行 | 474,900 | 9,759,195.00 | 3.48 |
| 2 | 600919 | 江苏银行 | 1,232,700 | 8,752,170.00 | 3.12 |
| 3 | 600036 | 招商银行 | 161,400 | 8,746,266.00 | 3.12 |
| 4 | 600030 | 中信证券 | 327,000 | 8,155,380.00 | 2.91 |
| 5 | 600900 | 长江电力 | 215,800 | 4,454,112.00 | 1.59 |
| 6 | 600309 | 万华化学 | 37,835 | 4,117,204.70 | 1.47 |
| 7 | 600519 | 贵州茅台 | 2,000 | 4,113,400.00 | 1.47 |
| 8 | 601888 | 中国中免 | 11,755 | 3,527,675.50 | 1.26 |
| 9 | 601601 | 中国太保 | 101,804 | 2,949,261.88 | 1.05 |
| 10 | 600104 | 上汽集团 | 98,600 | 2,166,242.00 | 0.77 |

5.3.2 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的全国中小企业股份转让系统挂牌股票投资明细

注：本基金本报告期末未持有全国中小企业股份转让系统挂牌股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | 93,558,000.00 | 33.39 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 2,807,560.00 | 1.00 |
| | 其中：政策性金融债 | 2,807,560.00 | 1.00 |
| 4 | 企业债券 | 43,431,160.00 | 15.50 |
| 5 | 企业短期融资券 | 20,064,000.00 | 7.16 |
| 6 | 中期票据 | 20,154,000.00 | 7.19 |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 180,014,720.00 | 64.24 |

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 019640 | 20 国债 10 | 535,180 | 53,518,000.00 | 19.10 |
| 2 | 019649 | 21 国债 01 | 350,000 | 35,024,500.00 | 12.50 |

| | | | | | |
|---|-----------|----------------|---------|---------------|------|
| 3 | 122723 | 12 石油 05 | 200,000 | 20,256,000.00 | 7.23 |
| 4 | 102000110 | 20 中山城建 MTN001 | 200,000 | 20,154,000.00 | 7.19 |
| 5 | 042100078 | 21 陕高速 CP001 | 200,000 | 20,064,000.00 | 7.16 |

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

报告期内本基金投资的前十名证券中，中信证券股份有限公司于 2021 年 1 月 23 日收到深圳证监局出具的《深圳证监局关于对中信证券股份有限公司采取责令改正措施的决定》（行政监管措

施决定书(2021)5号)。经查,公司在业务开展过程中存在以下情况:一、私募基金托管业务内部控制不够完善,个别项目履职不谨慎。一是业务准入管控不到位,部分项目业务准入未严格执行公司规定的标准和审批程序,未充分关注和核实管理人准入材料。二是投资监督业务流程存在薄弱环节,部分产品未及时调整系统中设定的监督内容,部分投资监督审核未按公司规定履行复核程序,对投资监督岗履职情况进行监督约束的内控流程不完善。三是信息披露复核工作存在不足,对个别产品季度报告的复核存在迟延。四是业务隔离不到位,托管部门与从事基金服务外包业务的子公司未严格执行业务隔离要求;二、个别首次公开发行保荐项目执业质量不高,存在对发行人现金交易等情况关注和披露不充分、不准确,对发行人收入确认依据、补贴可回收性等情况核查不充分等问题;三、公司个别资管产品未按《证券公司定向资产管理业务实施细则》(证监会公告(2012)30号)第二十九条第二款规定,根据合同约定的时间和方式向客户提供对账单,说明报告期内客户委托资产的配置状况、净值变动、交易记录等情况。以上情形反映了公司对相关业务的管控存在薄弱环节,内部控制不完善,违反了2013年《证券投资基金托管业务管理办法》(证监会令第92号)第二十六条第一款、《证券投资基金托管业务管理办法》(证监会令第172号)第三十三条、《私募投资基金监督管理暂行办法》(证监会令第105号)第四条第一款、2017年《证券发行上市保荐业务管理办法》(证监会令第137号)第三十四条等规定,依据《证券公司监督管理条例》第七十条第一款的规定,深圳局决定对公司采取责令改正的监督管理措施。

报告期内本基金投资的前十名证券中,发行主体江苏银行股份有限公司于2020年12月31日收到江苏银保监局行政处罚信息公开表(苏银保监罚决字(2020)88号),根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第(五)项,经查,江苏银行股份有限公司存在:1、个人贷款资金用途管控不严;2、发放流动资金贷款偿还银行承兑汇票垫款;3、理财投资和同业投资非标准化债权资产未严格比照自营贷款管理;4、个人理财资金对接项目资本金;5、理财业务未与自营业务相分离;6、理财资金投资非标准化债权资产的余额超监管比例要求。综上,江苏银保监局决定对江苏银行股份有限公司罚款240万元。

报告期内本基金投资的前十名证券中,发行主体兴业银行股份有限公司于2020年8月31日收到中国银保监会福建监管局行政处罚信息公开表(闽银保监罚决字(2020)24号),根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、四十六条、《中华人民共和国商业银行法》第七十四条,经查,兴业银行存在同业投资用途不合规、授信管理不尽职、采用不正当手段吸收存款、理财资金间接投资本行信贷资产收益权、非洁净转让信贷资产、违规接受地方财政部门担保。综上,中国银保监会福建监管局决定对兴业银行股份有限公司处以没收违法所得6,361,807.97元,并合计处以罚款15,961,807.97元。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体招商银行股份有限公司于 2021 年 5 月 17 日收到中国银行保险监督管理委员会行政处罚决定书（银保监罚决字〔2021〕16 号），根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十五条、第四十六条和相关审慎经营规则，经查，招商银行股份有限公司存在一、为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产；二、违规协助无衍生产品交易业务资格的银行发行结构性衍生产品；三、理财产品之间风险隔离不到位；四、理财资金投资非标准化债权资产认定不准确，实际余额超监管标准；五、同业投资接受第三方金融机构信用担保；六、理财资金池化运作；七、利用理财产品准备金调节收益；八、高净值客户认定不审慎；九、并表管理不到位，通过关联非银机构的内部交易，违规变相降低理财产品销售门槛；十、投资集合资金信托计划的理财产品未执行合格投资者标准；十一、投资集合资金信托计划人数超限；十二、面向不合格个人投资者销售投资高风险资产或权益性资产的理财产品；十三、信贷资产非真实转让；十四、全权委托业务不规范；十五、未按要求向监管机构报告理财投资合作机构，被监管否决后仍未及时停办业务；十六、通过关联机构引入非合格投资者，受让以本行信用卡债权设立的信托次级受益权；十七、“智能投资受托计划业务”通过其他方式规避整改，扩大业务规模，且业务数据和材料缺失；十八、票据转贴现假卖断屡查屡犯；十九、贷款、理财或同业投资资金违规投向土地储备项目；二十、理财资金违规提供棚改项目资本金融资，向地方政府提供融资并要求地方政府提供担保；二十一、同业投资、理财资金等违规投向地价款或四证不全的房地产项目；二十二、理财资金认购商业银行增发的股票；二十三、违规为企业发行短期融资券提供搭桥融资，并用理财产品投资本行主承债券以承接表内类信贷资产；二十四、为定制公募基金提供投资顾问；二十五、为本行承销债券兑付提供资金支持；二十六、协助发行人以非市场化的价格发行债券；二十七、瞒报案件信息。综上，中国银行保险监督管理委员会给予公司罚款 7170 万元。

对如上证券投资决策程序的说明：公司研究部门按照内部研究工作规范对该证券进行分析后将其列入基金投资对象备选库。在此基础上本基金的基金经理根据具体市场情况独立作出投资决策。该事件发生后，本基金管理人对该证券的发行主体进行了进一步了解与分析，认为此事件未对该证券投资价值判断产生重大的实质性影响。本基金投资于该证券的投资决策过程符合制度规定的投资权限范围与投资决策程序。

报告期内本基金投资的前十名证券中其余六名的发行主体未出现被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

报告期内本基金投资的前十名股票中，不存在超出基金合同规定备选股票库的情形。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 338,356.58 |
| 2 | 应收证券清算款 | 1,720,727.46 |
| 3 | 应收股利 | 3,024.53 |
| 4 | 应收利息 | 2,650,211.44 |
| 5 | 应收申购款 | 139.89 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 4,712,459.90 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 长信先锐混合 A | 长信先锐混合 C |
|---------------------------|----------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 505,433,517.52 | 21,427,254.72 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 18,229.07 | - |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 298,349,250.87 | 14,442,684.20 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 207,102,495.72 | 6,984,570.52 |

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况**7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况**

注：本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本基金本报告期内未有单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：本基金本报告期未发生影响投资者决策的其他重要信息。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立基金的文件；
- 2、《长信先锐混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长信先锐混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《长信先锐混合型证券投资基金托管协议》；
- 5、报告期内在指定报刊上披露的各种公告的原稿；
- 6、长信基金管理有限责任公司营业执照、公司章程及相关资格批复文件。

9.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

9.3 查阅方式

长信基金管理有限责任公司网站：

。

长信基金管理有限责任公司

2021 年 7 月 21 日