

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 3 季度报告

2021 年 9 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

报告送出日期：2021 年 10 月 27 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。

基金托管人江苏银行股份有限公司根据本基金基金合同规定，于 2021 年 10 月 25 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 7 月 1 日起至 2021 年 9 月 30 日。

§2 基金产品概况

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 长信稳鑫三个月定开债券发起式 |
| 基金主代码 | 005575 |
| 交易代码 | 005575 |
| 基金运作方式 | 契约型、定期开放式 |
| 基金合同生效日 | 2018 年 1 月 19 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 982,873,644.39 份 |
| 投资目标 | 本基金通过投资于债券品种，追求超越业绩比较基准的投资回报。 |
| 投资策略 | 本基金将在基金合同约定的投资范围内，通过对宏观经济运行状况、国家货币政策和财政政策、国家产业政策及资本市场资金环境的研究，积极把握宏观经济发展趋势、利率走势、债券市场相对收益率、券种的流动性以及信用水平，优化固定收益类金融工具的资产比例配置。在有效控制风险的基础上，调整组合期，以基金资产的稳定增值，提高基金总收益率。 |
| 业绩比较基准 | 中债综合指数收益率 |
| 风险收益 | 本基金为债券型基金，其预期收益及预期风险水平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 | 江苏银行股份有限公司 |

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

：人 币

| 主要财务指标 | 报告期 | 2021 年 7 月 1 日 | 2021 年 9 月 30 日 |
|--------------|-----|----------------|------------------|
| 1. 本期 实现收益 | | | 7,685,954.12 |
| 2. 本期利 | | | 11,023,299.12 |
| 3. 平 基金份额本期利 | | | 0.0111 |
| 4. 期末基金资产净值 | | | 1,006,442,702.72 |
| 5. 期末基金份额净值 | | | 1.0240 |

：1、本期 实现收益指基金本期利 收 、投资收益、其 收 不 公 值 动收益相 用 的 额，本期利 本期 实现收益 上本期公 值 动收益

2、所述基金业绩指标不 有人 或交易基金的 用 例 ， 式基金交易 金、开放式基金的 回 、 利 投资 、基金 等 ，计 用 实 收益水平要 于所

。

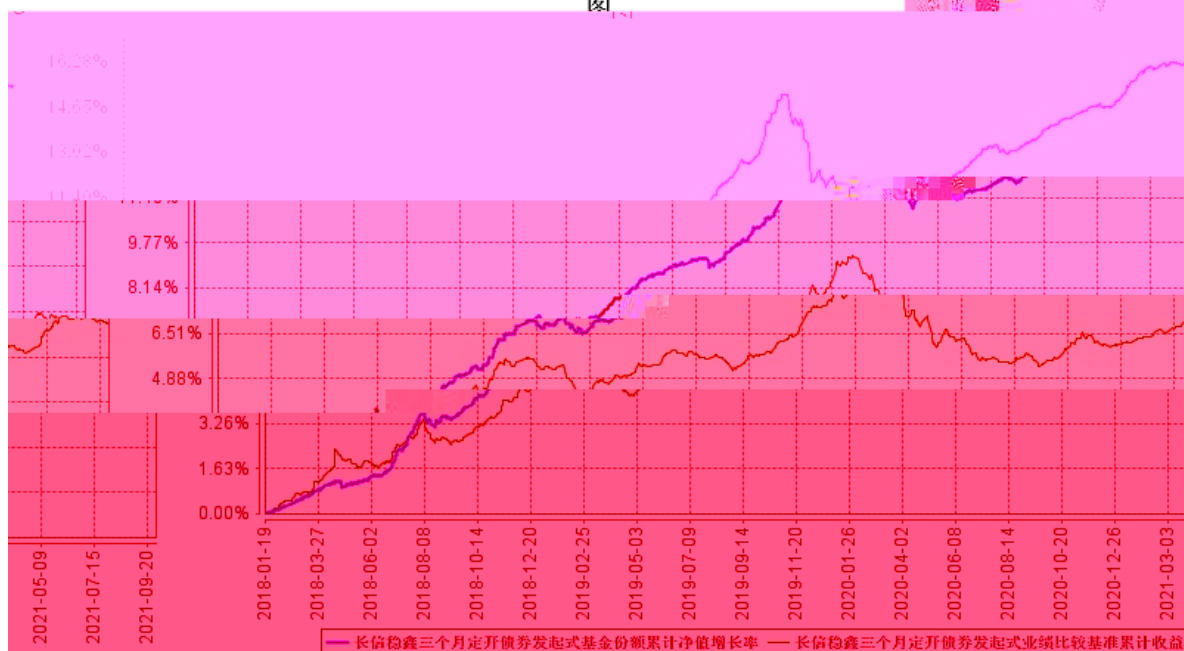
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值 长率及其 同期业绩比较基准收益率的比较

| | 净值 长率 | 净值 长率 标准 | 业绩比较基 准收益率 | 业绩比较基准 收益率标准 | | |
|---------------|-------|-------------|---------------|-----------------|------|------|
| 过 三个月 | 1.10 | 0.04 | 0.83 | 0.06 | 0.27 | 0.02 |
| 过 个月 | 2.07 | 0.03 | 1.28 | 0.05 | 0.79 | 0.02 |
| 过 一年 | 4.16 | 0.03 | 2.13 | 0.04 | 2.03 | 0.01 |
| 过 三年 | 11.98 | 0.06 | 4.80 | 0.07 | 7.18 | 0.01 |
| 自基金合同 生效起至 | 16.27 | 0.06 | 7.74 | 0.07 | 8.53 | 0.01 |

3.2.2 自基金合同生效以来基金 计净值 长率 动及其 同期业绩比较基准收益率 动的比较

长信稳鑫三个月定开债券发起式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中走势对比图



1、 示日期 2018 年 1 月 19 日至 2021 年 9 月 30 日。

2、 基金合同规定，本基金自基金合同生效 日起 6 个月内 期 期 ，本基 金 投资比例应 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 组 简

| 务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券 业年限 | 说明 |
|---|-----------------|-----|--------|--|
| | 任 日期 | 任日期 | | |
| 长信利 收益 开放式证券投 投资基金、长信易 合型证券 投资基金、长信 稳 债债券 型证券投资基 金、长信长金通 货币市场基金、 长信稳鑫三个 | 2018 年 1 月 19 日 | | 11 年 | 管理 ， 业于 上 交通大 ， 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 总 、 总 、长信稳 三个 月定期开放债券型发 |

| | | | | |
|--|---|--|--|--|
| | <p>月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信 年定期开放债券型证券投资基金、长信中债 1 3 年政策性金融债指 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 总</p> | | | <p>起式证券投资基金、长信 债 年债券型证券投资基金和长信稳通三个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。现任现金理财 总、长信利 收益开放式证券投资基金、长信易 合型证券投资基金、长信稳 债债券型证券投资基金、长信长金通货币市场基金、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 年定期开放债券型证券投资基金、长信中债 1 3 年政策性金融债指 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。</p> |
|--|---|--|--|--|

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

2、证券 业的 证券业 业人 资 管理 的相 规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作 规 信 况的说明

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

本基金将 以 信于市场、 信于 会投资公 ，承诺将一 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 控制投资风险的前提 ， 基 基金份额 有人 求 大利益。

4.3 公平交易 说明

4.3.1 公平交易制度的 行 况

本报告期内，公司 实行公平交易制度，并 公平交易制度 ， 投资决策 ， 交易 行环 的内 控制，并通过工作制度、流 和 保证公平交易原则的实现。同 ，公司 通过对投资交易行 的 控、 和信 来 对公平交易过 和 的 。

4.3.2 交易行 的 说明

本报告期内，完 有 指 的 比例 行投资的组合 ，其 投资组合未发生 交易所公开 同日 交易 交较 的 交易 超过 证券 日 交 的 5 的 ，未 发现 交易行 。

4.4 报告期内基金投资策略和运作

回 三季度，债券收益率 上，整 较 年末有所 行。7月 行超 期 准，债 券利率 行，至8月 期限利率债 行 30 。 融 据 一 放 ，工业生产、 走 ，经济复苏出现 ，但债市明 行动 不 ， 益市场 动 ， 方债发 行提 ，资金 有一定 动， 利率明 回 。9月 行相 人 表示有 工具平 于财 政收 、政 债券发行 等 对流动性产生的 性 动，实 资金 平 状 ，利 率稳中有 。货币政策 会三季度例会 指出，要 信 总 长的稳定性， 经济大 总 平稳， 经济发展 性， 性 信用政策 发 。出 、 超 期， 控导 品 ，通 据或超 期。债市 整，1年期国开债较 上行 20 ，3年期上行 10 ，5年以上期限 上行 2 3 。银行 债及 资本债有一定 度 整。在三季度中， 了中性的组合 期，在风险 控的 况 ，积极 利率债 作，保 了组合净值的 稳定 长。

展 季度， 行公开市场 作 况，10月 期 5000 、11月 期 1 及 方债 ， 有 准，或 利率 较 水平以 市场对于通 的担 。 年末， 利率 有一定上行 ， 通 一 ， 对长 利率 一定 ， 债市或 。 季度债券收益率 计 ，中 水平有所 ， 对债市 整 保 度，同 将 对信用风险的 别 。未来 将 控制信用风险，合理 配置 类资产， 运用 ，把握债券市场 整带来的投资 会， 投资者 的组合收 益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

至 2021 年 9 月 30 日，长信稳鑫三个月定开债券发起式份额净值 1.0240，份额累计净值 1.155，本报告期内长信稳鑫三个月定开债券发起式净值增长率 1.10，同期业绩比较基准收益率 0.83。

4.6 报告期内基金 有人 或基金资产净值 说明

。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合 况

| | 目 | 金额 | 基金总资产的比例 |
|---|------------------|------------------|----------|
| 1 | 益投资 | | |
| | 其中：股 | | |
| 2 | 基金投资 | | |
| 3 | 固定收益投资 | 1,162,881,000.00 | 98.80 |
| | 其中：债券 | 1,162,881,000.00 | 98.80 |
| | 资产 证券 | | |
| 4 | 金 投资 | | |
| 5 | 金融 生品投资 | | |
| 6 | 金融资产 | | |
| | 其中： 式回 的 金融资产 | | |
| 7 | 银行存 和 金合计 | 262,010.29 | 0.02 |
| 8 | 其 资产 | 13,899,302.10 | 1.18 |
| 9 | 合计 | 1,177,042,312.39 | 100.00 |

：本基金本报告期末未通过 股通交易 制投资 股。本基金本报告期末未 融通证券出 业务。

5.2 报告期末 行业 类的股 投资组合

5.2.1 报告期末 行业 类的境内股 投资组合

：本基金本报告期末未 有股 。

5.2.2 报告期末 行业 类的 股通投资股 投资组合

：本基金本报告期末通过 股通交易 制投资 股。

5.3 期末 公 值 基金资产净值比例大 的股 投资明细**5.3.1 报告期末 公 值 基金资产净值比例大 的前 股 投资明细**

：本基金本报告期末未 有股 。

5.3.2 期末 公 值 基金资产净值比例大 的 国中 业股份 股 投资明细

：本基金本报告期末未 有 国中 业股份 股 。

5.4 报告期末 债券品种 类的债券投资组合

| | 债券品种 | 公 值 | 基金资产净值比例 |
|----|-----------|------------------|----------|
| 1 | 国家债券 | 60,744,000.00 | 6.04 |
| 2 | 行 据 | | |
| 3 | 金融债券 | 1,102,137,000.00 | 109.51 |
| | 其中：政策性金融债 | 686,094,000.00 | 68.17 |
| 4 | 业债券 | | |
| 5 | 业 期融资券 | | |
| 6 | 中期 据 | | |
| 7 | 债 交 债 | | |
| 8 | 同业存 | | |
| 9 | 其 | | |
| 10 | 合计 | 1,162,881,000.00 | 115.54 |

5.5 报告期末 公 值 基金资产净值比例大 的前 债券投资明细

| | 债券代码 | 债券 称 | | 公 值 | 基金资产净值比 例 |
|---|---------|--------------|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 190208 | 19 国开 08 | 1,500,000 | 152,370,000.00 | 15.14 |
| 2 | 210213 | 21 国开 13 | 1,000,000 | 100,590,000.00 | 9.99 |
| 3 | 018082 | 发 1902 | 1,000,000 | 100,550,000.00 | 9.99 |
| 4 | 1928009 | 19 业银行 04 | 900,000 | 92,457,000.00 | 9.19 |
| 5 | 1920013 | 19 银行 01 | 900,000 | 90,684,000.00 | 9.01 |

5.6 报告期末 公 值 基金资产净值比例大 的前 资产 证券投资明 细

：本基金本报告期末未 有资产 证券。

5.7 报告期末 公 值 基金资产净值比例大 的前 金 投资明细

：本基金本报告期末未 有 金 。

5.8 报告期末 公 值 基金资产净值比例大 的前 证投资明细

：本基金本报告期末未 有 证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易 况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

：本基金本报告期末未投资国债期货。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货 和 益明细

：本基金本报告期末未投资国债期货。

5.9.3 本期国债期货投资

：本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10 投资组合报告

5.10.1 本基金投资的前 证券的发行主 本期 以及 的 况的说明

报告期内本基金投资的前 证券中，发行主 中国工 银行股份有限公司于 2020 年 12 月 25 日收 中国银行保险 管理 会行政 决定书 银保 决 2020 71 ，根据 中 人 共和国银行业 管理 第 一 、第三 三 、第 和相 审 经 规则， 经 ，中国工 银行股份有限公司存在未 规定将 风险事 确 并报送 信 确 报告 未 行实 性 人 日 业务存在资金用 管理的风险漏 同 业投资业务提 性担保 理财产品通过 回净值型理财产品 收益 标准化债 资产 限额 不准确 理财资金通过投资 合资金信托计 优 的方式 相放大 益人的 比例 重 业务未 管 真实 规的政 务 目提 融资 理财 资金 规用于 或置 通过 投实现不 资产虚假出表 理财资金投资本行 不 资产或不 资产收益 一 个人 发行的理财产品投资 益性资产 理财资金投资 行信 资产收益 或 标资产收益 托业务不规范 用其 资金 性存 收益

自承本行理财融资、用管理不尽理财资金承本行自式理财产品相交易收益动发行产品承风险资产，原交易收益净值定不审理财产品信不理财产品在国银行业理财信记中未记或超限记的情况。上，中国银行保险管理会决定对中国工商银行股份有限公司 5470。

报告期内本基金投资的前证券中，发行主国家开发银行于 2020 年 12 月 25 日收中国银行保险管理会决定书银保决 2020 67，根据中人民共和国银行业管理第一、第和相审经规则，经，国家开发银行一、规的政务目提融资、目资本金管理不，目存在资本金规回况三、规相发放、置不合理存核要求，以存，虚存、风险类不准确、资产管理公司以的主不信资产、规行信资产，信资产、业务代理行制收益理财产品、存、易三不尽，资金未真用于一、未实同业业务交易对制管要求、以方式金融公司提同业融资，未同业业务管理三、以定存方式收同业存，未同业存业务管理、风险不，规开展资金理财业务、未规定投资者理财产品投资标准化债资产况、期末整，，规业务、利用内交易行公司不资产净出表、规收业承诺、收财务不、利用银承诺利一、组提虚假整说明料、未实提信资产三、信报、报、对以往管中发现的国别风险管理整不。上，中国银行保险管理会决定对国家开发银行 4880。

发行主中国业银行股份有限公司于 2020 年 12 月 7 日收中国银行保险管理会行政信公开表银保决 2020 66，根据中人民共和国业银行第、于银行业金融务收的通第一和中人民共和国业银行第三，经，中国业银行股份有限公司存在收约开的代发工资、金、保、保、业保险、公积金的年和管理额管理。上，中国银行保险管理会决定对业银行以收所 49.59 和 148.77，金额合计 198.36。

发行主中国业银行股份有限公司于 2021 年 1 月 19 日收中国银行保险管理会

行政 决定书 银保 决 2021 1 ，根据 中 人 共和国银行业 管理 第 一 、第 第 和相 审 经 规则，经 ，中国 业银行股份有限公司存在发生重要信 发事 未报告 制 据 规明 存 生产 、 行 保 不 据 管理较 放，存在 据 风险 信 存在较 漏 信的 况。 上，中国银行保险 管理 会决定对 业银行 420 。

对 上证券投资决策 的说明：公司研究 内 研究工作规范对 证券 行 将其 基金投资对 。在 基础上本基金的基金经理根据具 市场 况 作出投资决 策。 事 发生 ，本基金管理人 对 证券的发行主 行了一 了 ， 事 未 对 证券投资 值 产生重大的实 性 。本基金投资于 证券的投资决策过 合制度规 定的投资 限范围 投资决策 。

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

5.10.2 基金投资的前 股 超出基金合同规定的 股 况的说明

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

5.10.3 其 资产

| | 称 | 金额 |
|---|-------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | |
| 2 | 应收证券 | |
| 3 | 应收股利 | |
| 4 | 应收利 | 13,899,302.10 |
| 5 | 应收 | |
| 6 | 其 应收 | |
| 7 | 其 | |
| 8 | 合计 | 13,899,302.10 |

5.10.4 报告期末 有的 于 股期的 债券明细

：本基金本报告期末未 有 于 股期的 债券。

5.10.5 报告期末前 股 中存在流通 限 况的说明

：本基金本报告期末前 股 中不存在流通 限 况。

5.10.6 投资组合报告 的其 述

： 于 的原 ， 和 合计 存在 。

§6 开放式基金份额 动

：份

| | |
|------------------|----------------|
| 报告期期 基金份额总额 | 992,873,644.39 |
| 报告期期 基金总 份额 | |
| 报告期期 基金总 回份额 | 10,000,000.00 |
| 报告期期 基金 动份额 份额 以 | |
| 报告期期末基金份额总额 | 982,873,644.39 |

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金 况

7.1 基金管理人 有本基金份额 动 况

：份

| | |
|-----------------------|---------------|
| 报告期期 管理人 有的本基金份额 | 10,000,000.00 |
| 报告期期 总份额 | 0.00 |
| 报告期期 出 回总份额 | 10,000,000.00 |
| 报告期期末管理人 有的本基金份额 | 0.00 |
| 报告期期末 有的本基金份额 基金总份额比例 | 0.00 |

：基金管理人运用固有资金投资本基金 率 本基金招募说明书中公 的 率 行。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

| | 交易方式 | 交易日期 | 交易份额 份 | 交易金额 | 适用 率 |
|----|------|------------|---------------|---------------|------|
| 1 | 回 | 2021年8月24日 | 10,000,000.00 | 10,234,000.00 | 0.00 |
| 合计 | | | 10,000,000.00 | 10,234,000.00 | |

：基金管理人运用固有资金投资本基金 率 本基金招募说明书中公 的 率 行。

§8 报告期末发起式基金发起资金 有份额 况

| 目 | 有份 额总 | 有份额 基金总份额 比例 | 发起份 额总 | 发起份额 基金总份额 比例 | 发起份额承诺 有期限 |
|-----------|----------|--------------------|-----------|---------------------|---------------|
| 基金管理人固有资金 | 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 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | |

| | | | | | |
|----|------|------|------|------|--|
| 合计 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | |
|----|------|------|------|------|--|

：本报告期基金管理人 回本基金。

§9 投资者决策的其 重要信

9.1 报告期内 一投资者 有基金份额比例 或超过 20%的 况

| 投资者类别 | 报告期内 有基金份额 化 况 | | | | | 报告期末 有基金 况 | |
|---|---------------------------------|----------------|------|------|----------------|------------|--|
| | 有基金份额比例 或者超过 20 的 | 期 份额 | 份额 | 回 份额 | 有份额 | 份额 比 | |
| 1 | 2021 年 7 月 1 日至 2021 年 9 月 30 日 | 982,872,461.34 | 0.00 | 0.00 | 982,872,461.34 | 99.99 | |
| 个人 | | | | | | | |
| 产品 有风险 | | | | | | | |
| <p>1、基金净值大 动的风险</p> <p>一 有基金比例过 的投资者连 大 回， 会 基金投资的 性和稳定性， 现本。同 ， 净值计 理规则 起基金份额净值 上 或 。</p> <p>2、 回 期 理的风险</p> <p>一 有基金比例过 的投资者大额 回 发本基金 额 回 ，导 同期中 投资者 额 回 期 理的 况。</p> <p>3、基金投资策略 以实现的 风险</p> <p>一 有基金比例过 的投资者大额 回 ， 起基金资产总净值 ， 基金在投资 限制，导 基金投资策略 以实现的 。</p> | | | | | | | |

9.2 投资者决策的其 重要信

：本基金本报告期未发生 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 的 种公告的原
- 6、长信基金管理有限责任公司 业 、公司 及相 资 复

10.2 存放

基金管理人的 公场所。

10.3 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

2021 年 10 月 27 日