# 长信全球债券证券投资基金
# 2021 年第 4 季度报告

2021 年 12 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：2022 年 1 月 24 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的规定，于 2022 年 1 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 10 月 1 日起至 2021 年 12 月 31 日止。

# §2 基金产品概况

## 2.1 基金基本情况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 长信全球债券（QDII） |
| 基金主代码 | 004998 |
| 交易代码 | 004998 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2017 年 12 月 11 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 100,530,958.28 份 |
| 投资目标 | 本基金通过积极主动的资产管理，在严格控制信用、利率和流动性风险的前提下追求本金长期安全的基础上，通过积极和深入的研究力争为投资者创造较高的当期收益和长期资产增值。 |
| 投资策略 | 本基金将通过对相关市场的宏观经济状况、市场利率走势、债券利差、证券市场走势、信用风险情况、以及各类资产的不同的风险和回报的综合分析，在整体资产之间进行动态配置，确定资产的最优配置比例和相应的风险水平。 |
| 业绩比较基准 | 巴克莱全球债券指数(Barclay Global Aggregate Index)*70%+中债综合指数收益率*30% |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，其预期风险与收益高于货币市场基金，低于 |

| | |
|---|---|
| | 混合型基金和股票型基金。 |
| 基金管理人 | 长信基金管理有限责任公司 |
| 基金托管人 | 招商银行股份有限公司 |
| 境外资产托管人 | 英文名称：Brown Brothers Harriman & Co. |
| | 中文名称：布朗兄弟哈里曼银行 |

注：1、本基金另设美元份额，基金代码 004999，与人民币份额并表披露；

2、截止本报告期末，本基金人民币份额净值 1.0997 元，人民币总份额 60,115,917.94 份；本基金美元份额净值 0.1725 美元，美元总份额 40,415,040.34 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 10 月 1 日 － 2021 年 12 月 31 日 ） |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | -7,938,769.47 |
| 2.本期利润 | -21,400,605.50 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.1368 |
| 4.期末基金资产净值 | 110,558,135.17 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.0997 |

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。

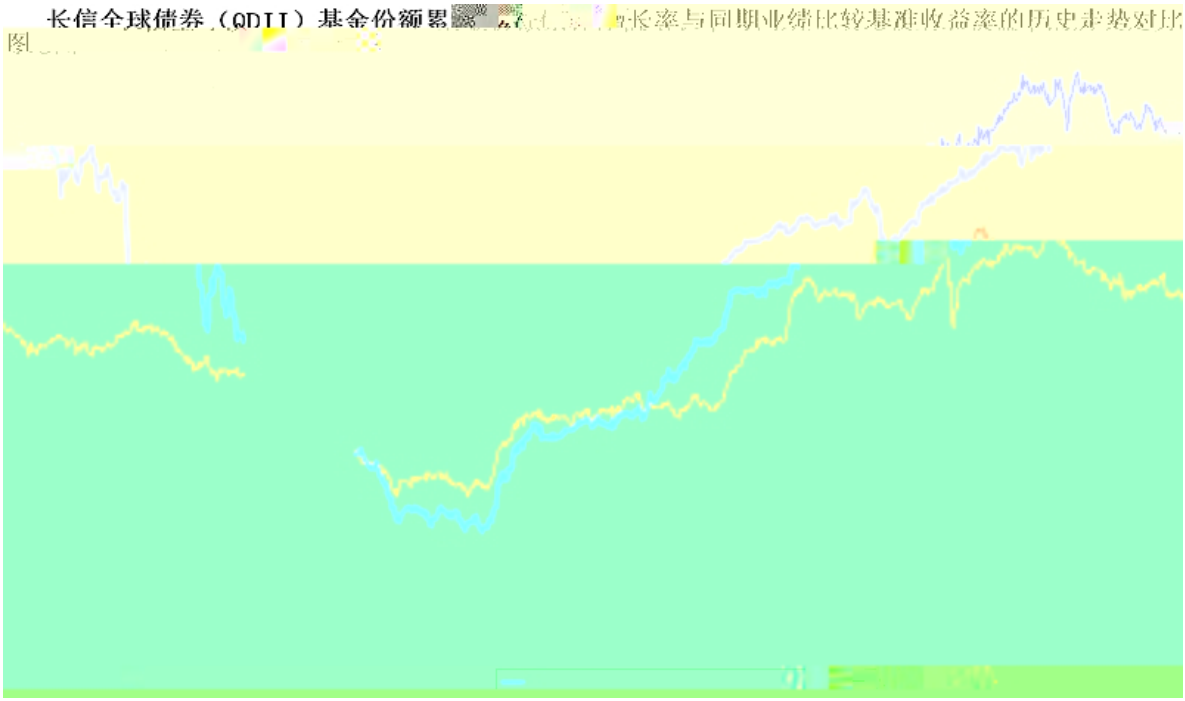
## 3.2 基金净值表现

### 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

| 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 | -9.24% | 0.66% | -1.47% | 0.24% | -7.77% | 0.42% |
| 过去六个月 | -10.80% | 0.56% | -1.56% | 0.22% | -9.24% | 0.34% |
| 过去一年 | -11.55% | 0.47% | -4.25% | 0.22% | -7.30% | 0.25% |
| 过去三年 | 7.31% | 0.34% | 3.39% | 0.24% | 3.92% | 0.10% |
| 自基金合同 | 9.97% | 0.31% | 7.15% | 0.23% | 2.82% | 0.08% |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 生效起至今 | | | | | | |

### 3.2.2 自基金合同生效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 2017 年 12 月 11 日至 2021 年 12 月 31 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，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 | | |
| 傅瑶纯 | 长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金和长信全球债券证 | 2020 年 1 月 2 日 | - | 6 年 | 华威大学金融与经济学硕士，具有基金从业资格。曾任职于中国农业银行、易唯思商务咨询有限公司，2016 年 4 月加入长信基金管理有限责任公司，现任国际业务部总监、长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资 |