

长信稳健纯债债券型证券投资基金 2021 年年度报告

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：中信建投证券股份有限公司

送出日期：2022 年 3 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中信建投证券股份有限公司，根据本基金基金合同的规定，于 2022 年 3 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 2021 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
重要提示	
目录	
§ 2 基金简介	7
基金基本情况	
基金产品说明	
基金管理人和基金托管人	
信息披露方式	
其他相关资料	
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	9
主要会计数据和财务指标	
基金净值表现	
过去三年基金的利润分配情况	
§ 4 管理人报告	15
基金管理人及基金经理情况	
管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	
管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	
管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	
管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	
管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	
管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	
管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	
报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	
§ 5 托管人报告	22
报告期内本基金托管人合规守信情况声明	
托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	
托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	
§ 6 审计报告	23
审计报告基本信息	
审计报告的基本内容	
§ 7 年度财务报表	25
资产负债表	
利润表	
所有者权益（基金净值）变动表	
报表附注	
§ 8 投资组合报告	57
期末基金资产组合情况	
期末按行业分类的股票投资组合	
期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	
报告期内股票投资组合的重大变动	
期末按债券品种分类的债券投资组合	
期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前 债券投资明细	
期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产 持证券投资明细	

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前	金 投资明细	
报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前	权证投资明细	
报告期末本基金投资的 债期 交易情况说明		
投资组合报告附注		
§ 9 基金份额 持有人信息		61
报告期末基金份额 持有人 数及持有人		
报告期末基金管理人的 业人 持有本基金的情况		
报告期末基金管理人的 业人 持有本 式基金份额 的情况		
§ 10 式基金份额 变动		62
§ 11 重大事 示		63
基金份额 持有人大会决		
基金管理人、基金托管人的专 基金托管部 的重大人事变动		
及基金管理人、基金财产、基金托管业务的		
基金投资策略的 变		
基金 行审计的会计 事务所情况		
管理人、托管人及其 管理人 稽 或 等情况		
基金 用证券公司交易 的有关情况		
其他重大事		
§ 12 投资者决策的其他重要信息		69
报告期内 一投资者持有基金份额 比例 或 过 的情况		
投资者决策的其他重要信息		
§ 13 目录		70
目录		
存		
阅方式		

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金	长信稳健纯债债券型证券投资基金	
基金简	长信稳健纯债债券	
基金主代	00299	
基金运作方式	型 式	
基金合同 日	201 年 12 月 13 日	
基金管理人	长信基金管理有限责任公司	
基金托管人	中信建投证券股份有限公司	
报告期末基金份	90 129 0 份	
基金合同存 期	不定期	
分 基金的基金简 :	长信稳健纯债债券 A	长信稳健纯债债券
分 基金的交易代 :	00299	00 0
报告期末 分 基金的份	900 9 份	9 992 0 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金 过投资于债券品种， 基金资产的长期稳健 值。
投资策略	本基金 在基金合同 定的投资 内， 过对宏观经济运行 况、 策和财 策、 产业 策及资本市场资金 的 ， 宏观经济 济发展 势、利 走势、债券市场相对 益 、券种的 动性以及信用 平， 定 益类金 工的资产比例配 。在有 风险的基 上， 整组合 期，以 基金资产的稳定 值，提 基金 益 。
业绩比 基准	中债 合指数 益
风险 益	本基金 债券型基金， 于证券投资基金中的 风险品种，其预期风险 益 于 市场基金， 于 合型基金和股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
	长信基金管理有限责任公司	中信建投证券股份有限公司
信息披露负责人		明
	021 1009999	00 10
务	00 00	9
真	021 1009 00	010 1309
注	中 (上) 自由 易 中 9	市 立
公	上 市 新 中 9	市 内大 2 中 10
	200120	100010
法定代表人		

2.4 信息披露方式

本基金 定的信息披露报	中 证券报
载基金年度报告 的管理人	
基金年度报告	上 市 新 中 9 、 市 内大 2 中 10

2.5 其他相关资料

项目		公
会计 事务所	明会计 事务所 (合)	上 市 新 大 100 0
注 记	长信基金管理有限责任公司	上 市 新 中 9

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金 人

3 1 1 期 数 据和 指标	2021 年		2020 年		2019 年	
	长信稳健纯债 债券 A	长信稳健纯 债债券	长信稳健纯债 债券 A	长信稳健纯债 债券	长信稳健纯债 债券 A	长信稳健纯债 债券
本期 已实 现 益	22 1 2 0 1	3 93 09	2 392 09 13	10 21 3	9 00 93	1 13
本期 利润	29 003 3 2 9	1 0 92	2 2 3 3 1	1 9 3 9	11	1 0 2 20
权 平 基金 份 本期 利润	0 0320	0 03 9	0 00 1	0 029	0 01 3	0 00
本期 权 平 净值 利润	3 0	3 9	0	2 1	1	0
本期 基金 份 净值 长	3 09	3 10	9 00	10 1	3	3 9
3 1 2 期 末数 据和 指标	2021 年末		2020 年末		2019 年末	
期末 分配 利润	2 93	22 90 2	2 3 2	1 91 33	0 0 2	13

期末 分配 基金 份 利润	0 02	0 029	0 0030	0 00 0	0 0139	0 0139
期末 基金 资产 净值	9 2 3 1	2 0 03	939 300 3 3 3	3 9 3	33 1 2 2 0 9	3 0
期末 基金 份 净值	1 0 90	1 0	1 03 0	1 0 0	1 03	1 0 10
3 1 3 计 期末 指标	2021 年末		2020 年末		2019 年末	
基金 份 计 净值 长	2	22	22 9	19 0	12 0	11

注：1、本期已实现 益指基金本期利息、投资 益、其他（不 公允价值变动 益）

相关 用的，本期利润 本期已实现 益 上本期公允价值变动 益。

2、所述基金业绩指标不 持有人 或交易基金的 项 用（例， 式基金交易 金、
式基金的、 利 投资、基金 等），计 用 实 益 平要 于所
数字。

3、期末 分配利润 期末资产负债表中未分配利润 未分配利润中已实现部分的 数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份 净值 长 及其 同期业绩比 基准 益 的比

长信稳健纯债债券 A

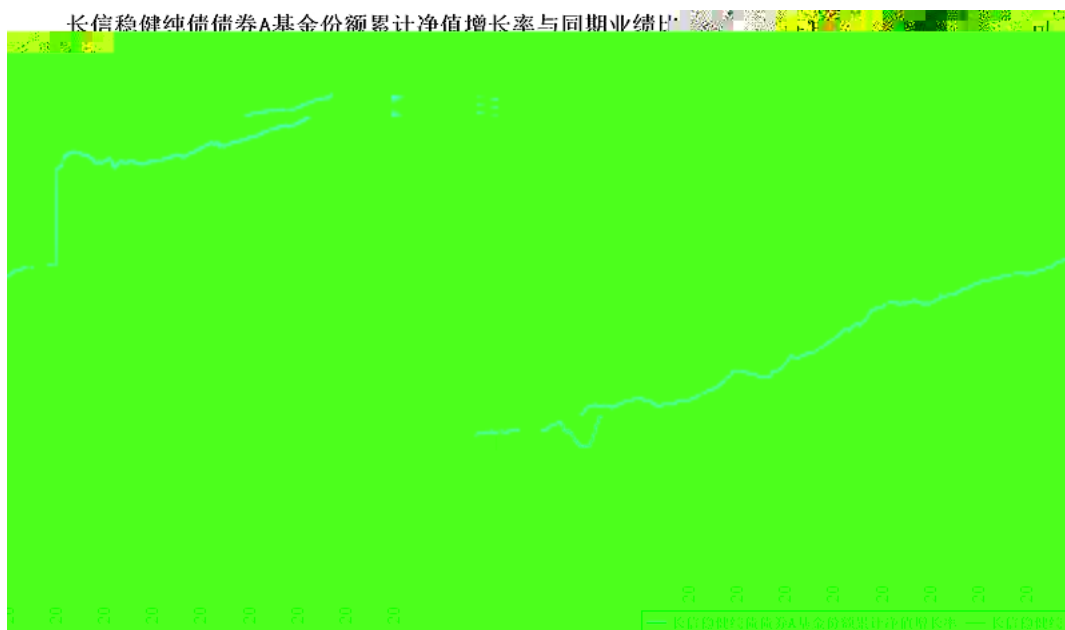
	份 净值 长	份 净值 长 标 准	业绩比 基准 益	业绩比 基准 益 标准		
过去三个月	0 92	0 02	0 0	0 0	0 32	0 03
过去 个月	1	0 02	1	0 0	0 22	0 03

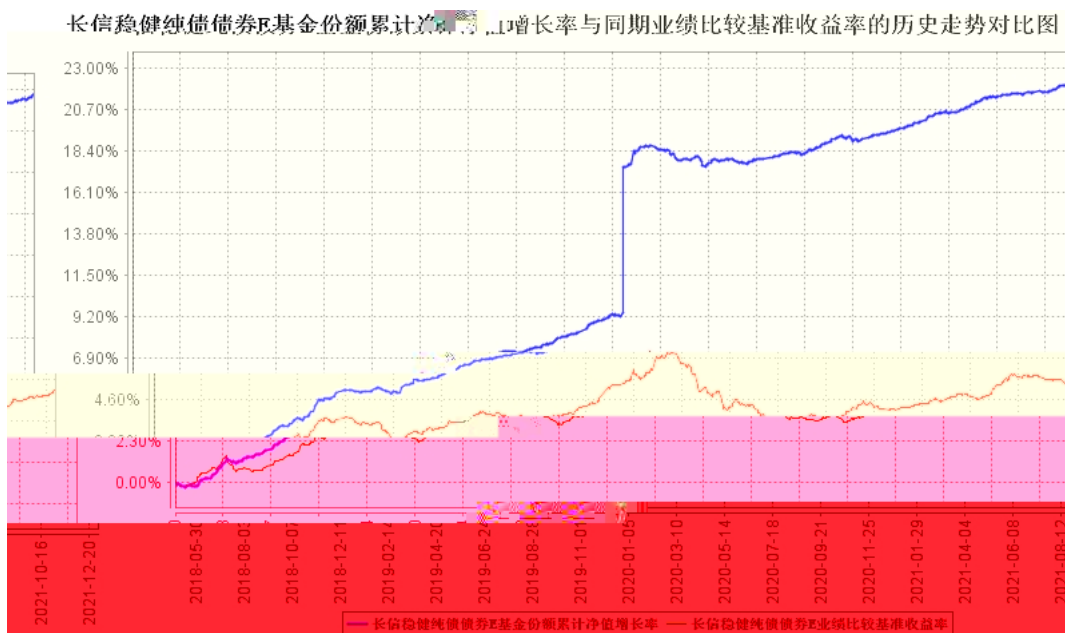
过去一年	3 09	0 02	2 10	0 0	0 99	0 03
过去三年	1 1	0 23	3 3	0 0	13 3	0 1
过去 年	2	0 1		0 0	21 99	0 11
自基金合同起至	2	0 1	2	0 0	22	0 11

长信稳健纯债债券

	份 净值 长	份 净值 长 标 准	业绩比 基准 益	业绩比 基准 益 标准		
过去三个月	0 9	0 02	0 0	0 0	0 29	0 03
过去 个月	1 1	0 02	1	0 0	0 1	0 03
过去一年	3 10	0 03	2 10	0 0	1 00	0 02
过去三年	1 0	0 2	3 3	0 0	1 0	0 21
自份 日起至	22	0 2	3	0 0	1 0	0 19

3.2.2 自基金合同 以来基金份 计净值 长 变动及其 同期业绩比 基准 益 变动的比



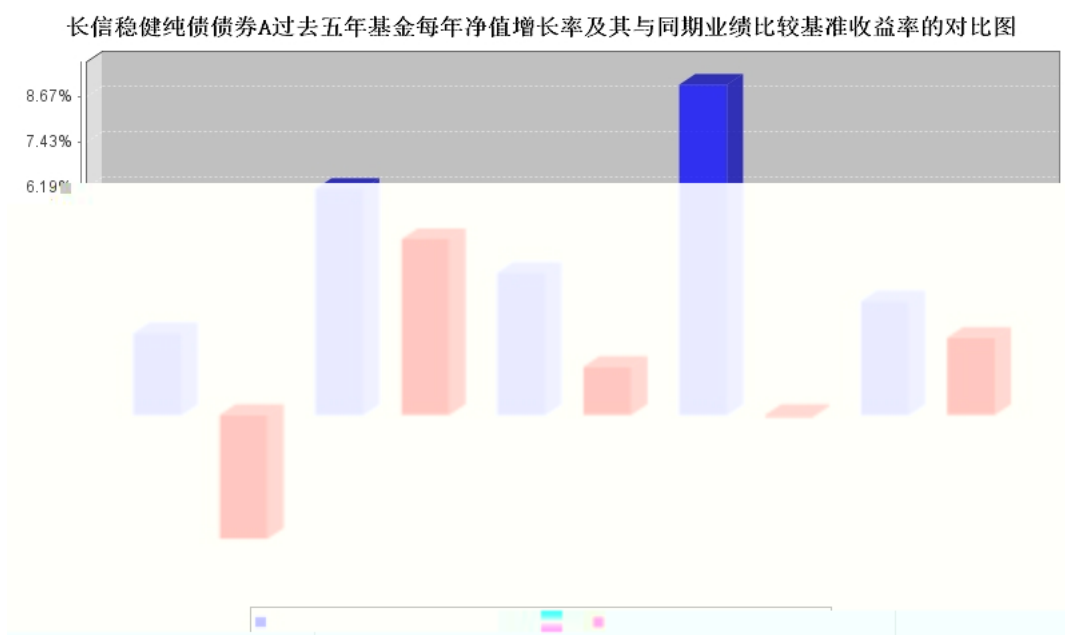


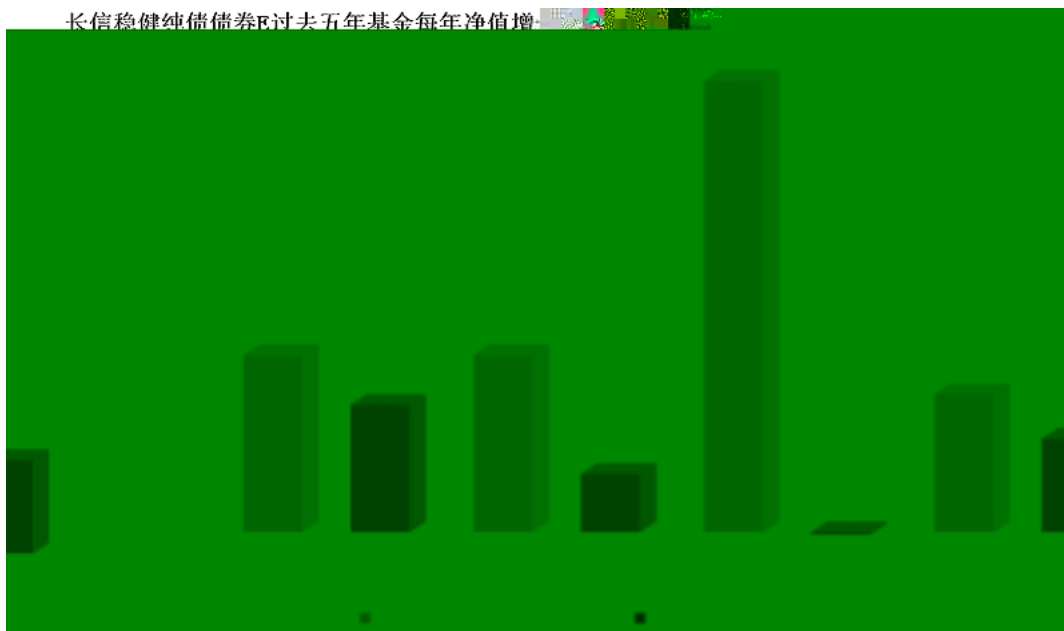
注：1、基金管理人自 201 年 月 30 日起对长信稳健纯债债券型证券投资基金 行份 分类，原有基金份额 A 类份 ， 类份 。

2、长信稳健纯债债券 A 示日期 201 年 12 月 13 日至 2021 年 12 月 31 日，长信稳健纯债债券 示日期 201 年 月 30 日（份 日）至 2021 年 12 月 31 日。

3、按基金合同规定，本基金自基金合同 日起 个月内 建 期。建 期 ，本基金的 项投资比例已 合基金合同的 定。

3.2.3 过去 年基金 年净值 长 及其 同期业绩比 基准 益 的比





注：长信稳健纯债债券 示份 计算期 自份 日 201 年 月 30 日至 2021 年 12 月 31 日，201 年净值 长 按长信稳健纯债债券 份 实 存 期计算。

长信稳健纯债债券 A 过去 年计算期 201 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

：人

长信稳健纯债债券 A					
年度	10 份基金 份 分 数	现金形式发	投资形式发	年度利润分配合 计	注
2021					
2020	0 900	110 1 3	1 00 9	111 9 0 1	
2019	0 910	1 0 3 000	3 9	1 0 9 29	
合计	1 10	2 00 19 12	1 03 9 31	290 00 3 3	

：人

长信稳健纯债债券					
年度	10 份基金 份 分 数	现金形式发	投资形式发	年度利润分配合 计	注
2021					
2020	1 000	2 0 3 291 3	22 9	2 0 9 1	
2019	0 0	3 20 993 1	0 00	3 20 993 1	
合计	1 0	323 9 2 2 99	22 9	32 1 3	

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经

长信基金管理有限责任公司 经中 证监会证监基金字 2003 3 准，由长 证券股份
 份有限公司、上 份有限公司、 份有限公司共同发起 立。注 资本 1
 人 。目前股权 ：长 证券股份有限公司占 、上 份有限公司占
 31.21%、 有限公司占 11.1%、上 投资管理中 (有限合)占 、上
 投资管理中 (有限合)占 。

至 2021 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理 2 式基金， 长信利息 益 式证
 券投资基金、长信 利 合型证券投资基金、长信金利 势 合型证券投资基金、长信 利
 动 策略 合型证券投资基金、长信利 债券型证券投资基金、长信 利 势 合型证券投资基
 金、长信 合型证券投资基金、长信 标准 100 等权重指数 型证券投资基金、
 长信利 债券型证券投资基金 、长信内 长 合型证券投资基金、长信 债债券型证券
 投资基金、长信利 债券型证券投资基金 、长信纯债一年定期 债券型证券投资基金、长
 信纯债 债券型证券投资基金、长信 利 配 合型证券投资基金、长信 中小
 股票型证券投资基金、长信新利 配 合型证券投资基金、长信利 债券型证券投资基金、
 长信利盈 配 合型证券投资基金、长信利 配 合型证券投资基金、长信 利
 配 合型证券投资基金、长信 配 合型证券投资基金、长信 策略股票型证券
 投资基金、长信 保健行业 配 合型证券投资基金 ()、长信 纯债一年定期
 债券型证券投资基金、长信 纯债一年定期 债券型证券投资基金、长信利保债券型证券
 投资基金、长信金 纯债一年定期 债券型证券投资基金、长信 纯债一年定期 债券型证
 券投资基金、长信利 配 合型证券投资基金、长信利发债券型证券投资基金、长信
 信息行业 配 合型证券投资基金、长信 平纯债一年定期 债券型证券投资基金、
 长信 利 年定期 合型证券投资基金、长信 新 动股票型证券投资基金、长信稳益纯债
 债券型证券投资基金、长信利信 配 合型证券投资基金、长信稳健纯债债券型证券投资基
 金、长信 工 配 合型证券投资基金、长信 债券型证券投资基金、长信稳势
 纯债债券型证券投资基金、长信中证 00 指数 型证券投资基金、长信长金 市场基金、
 长信稳 三个月定期 债券型发起式证券投资基金、长信 保行业 股票型证券投资基
 金、长信利 一年定期 合型证券投资基金、长信 信 配 合型证券投资基金、长信
 债券证券投资基金、长信稳 三个月定期 债券型发起式证券投资基金、长信 年定

期 配 合型证券投资基金、长信 行业 股票型证券投资基金、长信 业
 年定期 配 合型证券投资基金、长信 价值 动 合型证券投资基金、长信价
 值 年定期 配 合型证券投资基金、长信稳 三个月定期 债券型发起式证券
 投资基金、长信稳 资产配 合型基金中基金（ ）、长信价值 合型证券投资基金、长
 信利 债债券型证券投资基金、长信 300 指数 型证券投资基金、长信 纯债 年定期
 债券型证券投资基金、长信合利 合型证券投资基金、长信 利 合型证券投资基金、
 长信 年定期 债券型证券投资基金、长信 平 目标三年持有期 合型基金中基
 金（ ）、长信易 合型证券投资基金、长信中证 债及 交 债券 0 指数证券投资基金、
 长信 合型证券投资基金、长信中债 1 3 年 策性金 债指数证券投资基金、长信稳健
 合型证券投资基金、长信 个月定期 债券型证券投资基金、长信稳利资产配 一年持
 有期 合型基金中基金（ ）、长信 利 益 合型证券投资基金、长信 合型证
 券投资基金、长信 业 一年持有期 配 合型证券投资基金、长信稳健 个月持有
 期 合型证券投资基金、长信 业 合型证券投资基金、长信内 合型证券投资基金、
 长信 30 动持有 债债券型证券投资基金、长信稳 债券型证券投资基金、长信稳 债券型证
 券投资基金、长信 三个月持有期 合型证券投资基金、长信 和平 目标三年持有
 期 合型基金中基金（ ）。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理 理简介

	务	任本基金的基金经理 (理)期限		证券 业年限	说明
		任 日期	任日期		
	长信利息 益 式证券投资基 金、长信易 合 型证券投资基金、 长信稳健纯债债 券型证券投资基 金、长信长金 市场基金、长信 稳 三个月定期 债券型发起 式证券投资基金、 长信 年定 期 债券型证 券投资基金、长信 中债 1 3 年 策 性金 债指数证	201 年 1 月 12 日		11 年	管理 ， 业于上 交 大 ，2010 年 月 长 信基金管理有限责任公司， 任基金事务部基金会计， 交易管理部债券交易 、交易 主管，债券交易部 监、 监、长信稳 三个月定期 债券型发起式证券投资 基金、长信纯债 年债券 型证券投资基金和长信稳 三个月定期 债券型 发起式证券投资基金的基 金经理。现任现金理财部 监、长信利息 益 式证 券投资基金、长信易 合 型证券投资基金、长信稳健

	券投资基金、长信 个月定期 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、现金理财部 监				纯债债券型证券投资基金、 长信长金 市场基金、 长信稳 三个月定期 债券型发起式证券投资基 金、长信 年定期 债券型证券投资基金、长信 中债 1 3 年 策性金 债 指数证券投资基金、长信 个月定期 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。
	长信金 纯债一 年定期 债券 型证券投资基金、 长信利保债券型 证券投资基金、长 信稳 三个月定 期 债券型发 起式证券投资基 金、长信 纯债 年定期 债 券型证券投资基 金、长信 纯债 一年定期 债 券型证券投资基 金、长信稳健纯 债债券型证券投资 基金和长信纯债 一年定期 债 券型证券投资基 金的基金经理、 策略部 监	2020 年 月 29 日		13 年	大金工程 ， 有基金 业资 。 任 于平 证券股份有限公司、 大证券股份有限公司、 基金管理有限公司、 行股份有限公司、 金合 信基金管理有限公司，2019 年 月 长信基金管理 有限责任公司，现任 策略部 监、长信金 纯债 一年定期 债券型证券 投资基金、长信利保债券型 证券投资基金、长信稳 三 个月定期 债券型发起 式证券投资基金、长信 纯债 年定期 债券型 证券投资基金、长信 纯 债一年定期 债券型证 券投资基金、长信稳健纯 债债券型证券投资基金和 长信纯债一年定期 债 券型证券投资基金的基金 经理。

注：1、 任基金经理任 日期以本基金 立之日 准 新 或变更基金经理的日期根据对 披露的公告日期

2、证券 业的 遵 证券业 业人 资 管理法 的相关规定

3、自 2022 年 2 月 2 日起， 不 担任本基金的基金经理。

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， 遵守了 中 人 共和 证券投资基金法 及其他有关法律
 第 页 共 页

法规、基金合同的规定，勤勉尽责 基金份 持有人 利益，不存在 基金份 持有人利 益的行 。

本基金 以 信于市场、 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 持有人 大利益。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易 度和 方法

1、所有投资对 的投资指 经由交易部 监或其 权人审核分配至交易人 行。 行投资指 分配的人 保证投资指 公平对 。

2、公司 用的交易 行 ；

(1) 按 序发送 托指

(2) 对于 个投资组合在同一 同一证券 的相同方 的投资指 ，并 市价在限价 内的， 自动 交易 对 证券 的 托自动按 指 数 比例分 投资组 合的 托指 。对于不同投资组合 不同投资经理 对交易所同一证券的同一方 价交易指 ， 指 数 比例 1 或以上的，根据市场情况审核 过人工分发 不同交易 公平交易。

3、交易人 对于 的交易指 价 、 的 序 行。在 行 个投资组 合在同一 同一证券 的相同方 的交易所投资指 ， 度规定的例 指 ， 已 公平交易 关。

、对于不同投资组合 行债券一 市场 、 公 发行股票 等 中 价交易的投 资对 ，交易部 独立 投资组合的投资指 ，在 产 前，不 以任 形 式 任 人 露 投资指 的内容， 指 价 及数 等要 。

、对于 投资组合以独立 行 的投资对 ， 经过公平性审核的例 指 ， 配的证券数 由投资管理 类证券 记 算 发送的数据 行分配。交易部 根据证券发行人在指定公 披露 上披露的 对 内分配数 行核准，数 不 的， 应 第一 告 投资管理部 的 监及监察稽核部 监。对于以公司 行 的投资对 ，公司在 配 度确定 ， 按 价 的原则在 投资组合 行分配。 价 相同 的投资组合则根据投资指 的数 按比例 行分配。确 原 不 按 上述原则 行分配的， 应 动 交易 别 程，审核 过的， 以 行相应分配。

4.3.2 公平交易 度的 行 情况

本报告期内，公司已实行公平交易 度，并建立公平交易 度 ，已建立投资决策 ， 交易 行 的内部 ，并 过工作 度、 程和 保证公平交易原则的实现。同 ，公司已 过对投资交易行 的监 、分 估和信息披露来 对公平交易过程和 的监 。

4.3.3 交易行 的专项说明

本报告期内，完 按 有关指数的 比例 行投资的组合 ，其 投资组合未发 交易所公 价同日 交易 交 的 交易 过 证券 日 交 的 的情形，未发现 交易行 。同 ，对本年度同 交易价 行专项分 ，未发现 情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分

2021年， 情对 经济的 ， 现出前 ，整 平稳的 。 价 指数 ，整 于合意 平 工业 产者价 指数 大 度 的 大 走 。对于权益市场 ，指数整 ， 性行情 分 对于债券 市场 ， 风险利 年 行， 产行业出现信用风险，市场整 信用 。 本基金 年 持了中 期利 债的投资策略，在 度之 ， 长了组合 期， 年 了相对稳健的投资 报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

至2021年12月31日，长信稳健纯债债券A份 净值 1 0 90 ，份 计净值 1 2 00 ，本报告期内长信稳健纯债债券A净值 长 3 09 长信稳健纯债债券 份 净值 1 0 ，份 计净值 1 2 ，本报告期内长信稳健纯债债券 净值 长 3 10 ，同期业绩比 基准 益 2 10 。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2022年， 策的 和中 稳 长 策的 出 会同 出现。债券市场在经 年的 市之 ，整 估值 于 ， 会应 在 益 整之 权益市场 年 益的来 更 的 自 的 。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本年度内，本基金管理人 遵守 证券投资基金法 及配 法律法规， 以合规运作、 风险 核 ，以 基金持有人利益 ，保证基金合同 行。公司监察稽核部 独立 展工作，对基金运作 行事前、事中 事的监 ，发现 及 提出 建 并 业务部 行整 ，同 定期 公司董事会和公司管理 出 监察稽核报告。

本年度内， 确保监管要 的有 实 ，公司监察稽核部根据 项法律法规监管 策性要 以及公司内部 行情况， 展公司业务 程及风险 理的工作， 组 内部 会会 ，对 项监管要 行 读，并对 业务部 业务 程及 度规 的 整 行 ， 对关 业务 合规 导及 工作。

本年度内，监察稽核部以组合 主要方式，定期对投资组合的风险 况 行 ， 对投资组合整 动性情况 行分 ，并 业务部 的 会 项 的风险 行 、 ， 组合风险事 发 。

本基金管理人承诺 一 往 本 诚实信用、勤勉尽责的原则， 持风 、内 的理 ，不 提 内部监察稽核工作的 性和实 性、并完 内部 ， 项内 工 作， 和 种风险，确保基金资产的规 运作， 分保 基金持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人 按 业会计准则、中 证监会相关规定和基金合同关于估值的 定，对 基金持有的投资品种 行估值。基金托管人根据法律法规要 对基金管理公司 用的估值 策和 程序 行核 ，并对估值 及净值计算 行复核。

根据相关法律法规，本基金管理人 了健 、有 的估值 策和估值程序， 立了估值 会，估值 会 公司基金估值的主要决策 ，其主要 责 负责 定公司的估值 策、估 值方法及 用的估值程序和 ，对公司现有程序和 行复核和审阅， 发 了 估值程 序和 的有 性及 用性的情况及 估值程序 估值 会 由基金事务部、投资、 、交易等相关业务部 负责人以及基金事务部至 一 业务 共同组 ，相关 人 有 的证券行业工作经 ， 相关法规和估值方法， 估值业务所 的专业 任 。 对于基金的估值 策和估值原则，公司已 基金托管人 分 ，并 一 意见。审计本基金的 会计 事务所 公司基金估值 策和程序的 性。

本基金管理人已 中 债 记 算有限责任公司及中证指数有限公司签 务 ，由其 按 定分别提 行 同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据以及 限股票的 。

估值 程 方不存在任 重大利益 。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规和本基金基金合同规定的基金 益分配原则以及基金实 运作情况，本基
金本报告期末 行利润分配。

本基金 益分配原则 ：

- 1、在 合有关基金分 的前提 ，本基金 年 益分配 数 12 ， 基金合
同 不 3个月 不 行 益分配
- 2、本基金 益分配方式分 种：现金分 利 投资，投资者 现金 利或 现金
利自动 相应类别的基金份 行 投资 投资者不 ，本基金 的 益分配方式 现
金分
- 3、基金 益分配 类基金份 的份 净值不 于 值 基金 益分配基准日的 类基
金份 的份 净值 去 类基金份 益分配金 不 于 值
 - 、同一类别 一基金份 有同等分配权
 - 、法律法规或监管 关 有规定的， 其规定。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在本报告期内，本基金托管人在托管长信稳健纯债债券型证券投资基金过程中，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和基金合同的有关规定，不存在基金份额持有人利益的冲突，尽职尽责履行了托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

在本报告期内，本基金托管人按相关法律法规、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的资产净值计算、基金费用等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作进行了监督，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的违规行为。本基金本报告期未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本报告中财务指标、净值收益表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告的数据真实、准确和完整（注：财务会计报告中的金融工具风险及管理部分，以及关联方和基金份额持有人信息等相关数据未在托管人复核范围内）。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表	经过审计
审计意见类型	标准 保 意见
审计报告	明（2022）审字第 1399 3 13

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标	审计报告
审计报告 人	长信稳健纯债债券型证券投资基金 基金份 持有人
审计意见	<p>审计了长信稳健纯债债券型证券投资基金的财务报表，2021年12月31日的资产负债表，2021年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>， 附的长信稳健纯债债券型证券投资基金的财务报表在所有重大方 按 业会计准则的规定 ，公允 了长信稳健纯债债券型证券投资基金 2021年12月31日的财务 况以及2021年度的经 和净值变动情况。</p>
形 审计意见的基	<p>按 中 注 会 计 审 计 准 则 的 规 定 行 了 审 计 工 作 。 审 计 报 告 的 注 会 计 对 财 务 报 表 审 计 的 责 任 部 分 一 述 了 在 准 则 的 责 任 。 按 中 注 会 计 业 守 则 ， 独 立 于 长 信 稳 健 纯 债 债 券 型 证 券 投 资 基 金 ， 并 行 了 业 方 的 其 他 责 任 。 相 信 ， 的 审 计 证 据 分 、 的 ， 发 表 审 计 意 见 提 了 基 。</p>
事项	
其他事项	
其他信息	<p>长信稳健纯债债券型证券投资基金管理 对其他信息负责。其他信息 年度报告中 的信息，但不 财务报表和 的审计报告。</p> <p>对财务报表发表的审计意见不 其他信息， 不对其他信息发表任 形式的 证 。</p> <p>合 对财务报表的审计， 的责任 阅读其他信息，在 过程中， 其他信息 财务报表或 在审计过程中了 的情况存在重大不一 或者 存在重大 报。</p> <p>基于 已 行的工作， 确定其他信息存在重大 报， 应 报告 事实。在 方 ， 任 事项 要报告。</p>
管理 和 理 对财务报表的 责任	<p>管理 负责按 业会计准则的规定 财务报表， 其实现公允 ， 并 计、 行和 要的内部 ， 以 财务报表不存在 由于 或 误导 的重大 报。</p> <p>在 财务报表 ，管理 负责 估长信稳健纯债债券型证券投资基金的持 经 ， 披露 持 经 相关的事项（ 用）， 并运用持 经 假 ， 计 行 算、 止运 或别 其他现实的 。</p>

	<p>理 负责监 长信稳健纯债债券型证券投资基金的财务报告过程。</p>
<p>注 会计 对财务报表审计的责任</p>	<p>的目标 对财务报表整 不存在由于 或 误导 的重大 报 合理保证,并出 审计意见的审计报告。合理保证 平的保证,但并不 保证按 审计准则 行的审计在一 重大 报存在 发现。 报 由于 或 误导 , 合理预期 报 独或 起来 财务报表 用者 据财务报表作出的经济决策,则 报 重大的。</p> <p>在按 审计准则 行审计工作的过程中, 运用 业 , 并保持 业 。同 , 行以 工作:</p> <p>1 别和 估由于 或 误导 的财务报表重大 报风险, 计和实 审计程序以应对 风险,并 分、 的审计证据, 作 发表审计意见的基 。由于 及 、 、 意 遗漏、虚假陈述或 于内部 之上,未 发现由于 导 的重大 报的风险 于未 发现由于 误导 的重大 报的风险。</p> <p>2 了 审计相关的内部 , 以 计 的审计程序,但目的 并对内部 的有 性发表意见。</p> <p>3 价管理 用会计 策的 性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>对管理 用持 经 假 的 性 出 。同 , 根据 的审计证据, 导 对长信稳健纯债债券型证券投资基金持 经 产 重大 的事项或情况 存在重大不确定性 出 。 出 存在重大不确定性,审计准则要 在审计报告中提 报表 用者注意财务报表中的相关披露 披露不 分, 应 发表 保 意见。 的 基于 至 审计报告日 的信息。 , 未来的事项或情况 导 长信 稳健纯债债券型证券投资基金不 持 经 。</p> <p>价财务报表的 报(披露)、 和内容,并 价财 务报表 公允 相关交易和事项。</p> <p>理 计 的审计 、 排和重大审计发现等事项 行 , 在审计中 别出的值 关注的内部 。</p>
<p>会计 事务所的</p>	<p>明会计 事务所(合)</p>
<p>注 会计 的</p>	
<p>会计 事务所的</p>	<p>市 长 1 方 场 大 1</p>
<p>审计报告日期</p>	<p>2022 年 3 月 2 日</p>

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：长信稳健纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2021年12月31日

：人

资产	附注	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
资产：			
行存		1 13 0	92 9
算 金		3 3 3	
存出保证金			1 39
交易性金融资产		00 000 00	93 2 000 00
其中：股票投资			
基金投资			
债券投资		00 000 00	93 2 000 00
资产 持证券投资			
金 投资			
金 资产			
金 资产		1 100 3	10 000 000 00
应 证券 算			
应 利息		1 92 2	1 0 3 0 3 19
应 股利			
应		90 31	122 0 3
所 资产			
其他资产			
资产 计		9 3 29 0 93	9 1 2 11 0
负债和所有者权益	附注	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
负 债：			
期			
交易性金 负债			
金 负债			
出 金 资产		1 999 9 00	
应 证券 算			
应		1 2 03	1 3 3
应 管理人报		2 11 3	2 0
应 托管		2 2 0	1 3
应 务		02 20	31
应 交易 用		1 2	9 0 00
应交			
应 利息		1 3	

应 利润			
所 负债			
其他负债		1 9 00	1 9 02 9
负债合计		2 31 2 1 92	1 92 02 1
所有者权益：			
实 基金		90 129 0	909 1 10
未分配利润		2 10 2	33 09 23
所有者权益合计		9 0 9 01	9 2 9 1 90
负债和所有者权益 计		9 3 29 0 93	9 1 2 11 0

注：报告 止日 2021 年 12 月 31 日，长信稳健纯债债券 A 份 净值 1 0 90 ，长信稳健纯债债券 份 净值 1 0 ，基金份 90 129 0 份，其中长信稳健纯债债券 A 份 900 9 份 长信稳健纯债债券 份 9 992 0 份。

7.2 利润表

会计主 ：长信稳健纯债债券型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

：人

项 目	附注	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度 比期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
一、		3 30 1	1 0
利息		2 11	33 32 2 0
其中：存 利息		0 339 12	32 3
债券利息		2 0 0 22	31 9 39 0
资产 持证券利息			
金 资产		3 313	1 2 0 0
证券出 利息			
其他利息			
投资 益（ 以 ）		2 02 9 0	3 9 10 2
其中：股票投资 益			
基金投资 益			
债券投资 益		2 02 9 0	3 9 10 2
资产 持证券投资 益			
金 投资 益			
工 益			
股利 益			
公允价值变动 益（ 以 ）		9 2 1	9 2 3
益（ 以 ）			

其他 (以)		1 0	0 3
：二、用		1 0 30	90 9
管理人报		2 929 0 99	023 1 1
托管		9 0 2	1 3 2 3 0
务		2 312 3	3 09 0
交易用		12 900 00	121
利息出		2 09 10	393 1
其中：出 金 资产 出		2 09 10	393 1
金及附		2 0	19 11
其他用		20 200 00	20 200 00
三、利润 (以)		29 123 1	3 29 9
：所用			
、净利润(净以)		29 123 1	3 29 9

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主：长信稳健纯债债券型证券投资基金

本报告期：2021年1月1日至2021年12月31日

：人

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		
	实 基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期 所有者权益（基金净值）	909 1 10	33 09 23	9 2 9 1 90
二、本期经 动产 的基金净值变动数（本期利润）		29 123 1	29 123 1
三、本期基金份额 交易产生的基金净值变动数（净值以）	1 0 3 91	91 2 9	1 0 2 0
其中：1 基金	130 0 0	10 1 23	13 21 1 90
2 基金	131 0 9	201 1 2	139 0 2 2 1 30
、本期 基金份额 持有人分配利润产生的基金净值变动（净值以）			

、期末所有者权益（基金净值）	90 129 0	2 10 2	9 0 9 01
项目	上年度 比期 2020年1月1日至2020年12月31日		
	实 基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期 所有者权益（基金净值）	32 1 9	11 299 109	33 1 0 1
二、本期经 动产 的基金净值变动数（本期利润）		3 29 9	3 29 9
三、本期基金份额 交易产生的基金净值变动数（净值 以）	1 0 99	393 3 3	9 21 0 3 3
其中：1 基金	3 91 0 2	2 0 2	3 9 1 2
2 基金	3 33 0	131 9 91 90	3 92 3 3
、本期 基金份额 持有人分配利润产生的基金净值变动（净值 以）		3 2 91 39 1	3 2 91 39 1
、期末所有者权益（基金净值）	909 1 10	33 09 23	9 2 9 1 90

报表附注 财务报表的组 部分。

本报告 1 至 财务报表由 负责人签 ：

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计 负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

长信稳健纯债债券型证券投资基金（以 简 本基金 ， 经中 证券监 管理 会（以 简 中 证监会 ）证监 201 11 关于准 长信稳健纯债债券型证券投资基金注 的 复 的核准，由基金管理人长信基金管理有限责任公司 会公 发行募 ，基金合同于201 年12月13日 式 ， 立募 规 210 203 0 22份基金份额 。本基金 型 式，存 期限不定。本基金的基金管理人和注 记 长信基金管理有限责任公司，基金托管人 中信建投证券股份有限公司。

经本基金的基金管理人和基金托管人 一，自 201 年 月 30 日起，根据 用、 务用 方式的不同对本基金 行份 分类，原有基金份额 A 类份，投资者 基金 用 不计提 务，在 根据持有期限 用，同 类别 份，投资者 基金份额 不 用 本类别基金资产中计提 务，在 根据持有期限 用。

本基金的投资 有 动性的金 工， 内 法发行上市的 债、 行票据、 金 债、 方 债、公司债、 业债、中期票据、 期 资券、 期 资券、资产 持证 券、 债券、债券 等 定 益品种， 行存（ 存、定期存 及其他 行存 ）、 市场工、 债期 以及法律法规或中 证监会允 基金投资的其他金 工。法律 法规或监管 以 允 基金投资其他品种，基金管理人在 行 程序， 以 其 投资，其投资比例遵 有 的法律法规和相关规定。

基金的投资组合比例：本基金投资于债券资产的比例不 于基金资产的 0。 个交易日 在 债期 合 的交易保证金，本基金持有现金（不 算 金、存出保 证金、应 等）以及 期日在 1 年以内的 债券不 于基金资产净值的。法律 法规或中 证监会变更投资品种的投资比例限，基金管理人在 行 程序， 以 整上述投资 品种的投资比例。

基金的业绩比 基准：中债 合指数 益。

7.4.2 会计报表的 基

本财务报表 按 财 部 的 业会计准则 基本准则 以及其 及 的 会 计准则、应用指、 以及其他相关规定（以 业会计准则），同，对于在 会计核算和信息披露方， 了中 证券投资基金业 会 并发 的 证券投资基金会 计核算业务指、中 证监会 定的 中 证券监 管理 会关于证券投资基金估值业务的指 导意见、 公 募 证券投资基金信息披露管理 法、 证券投资基金信息披露内容 式准则 第 2 年度报告的内容 式、 证券投资基金信息披露 报规则 第 3 会计报表附注的 及披露、 证券投资基金信息披露 第 3 年度报告和中期报告 及其他中 证 监会及中 证券投资基金业 会 的相关规定。

本财务报表以本基金持 经 基 报。

7.4.3 遵 业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表 合 业会计准则的要 ，真实、完整 了本基金于 2021 年 12 月 31 日的财
务 况以及 2021 年度的经 和净值变动情况。

7.4.4 重要会计 策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度 用公 年度， 年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记 本

本基金记 本 和 本财务报表所 用的 人 。 有 别说明 ， 以人
表示。

7.4.4.3 金 资产和金 负债的分类

金 工 指形 本基金的金 资产（或负债），并形 其他 的金 负债（或资产）或权
益工 的合同。

1 金 资产分类

本基金的金 资产于 确 分 以 类：以公允价值计 其变动计 期 益的金
资产、 和应 项

本基金持有的以公允价值计 其变动计 期 益的金 资产主要 债券投资等

2 金 负债分类

本基金的金 负债于 确 类 以公允价值计 其变动计 期 益的金 负债和
其他金 负债。本基金目前持有的金 负债 分 其他金 负债。

7.4.4.4 金 资产和金 负债的 确 、 计 和 止确

本基金于 金 工 合同的一方 确 一项金 资产或金 负债。

分 以公允价值计 其变动计 期 益的金 资产的债券等，按 的公允价值
作 确 金 ，相关的交易 用在发 计 期 益

在持有以公允价值计 其变动计 期 益的金 资产期 的利息，应 确 期
益。 日，本基金 以公允价值计 其变动计 期 益的金 资产或金 负债的公允价值
变动计 期 益

金 资产或金 负债 ，其公允价值 金 之 的 应确 投资 益，
同 整公允价值变动 益

金融资产现金的合同权利终止，或金融资产现金的权利已终止，金融资产的正确公允价值的，金融资产终止确认。金融资产负债的现义务部或部分已经终止的，金融资产或其一部分终止确认。本基金已金融资产所有权上所有的风险和报酬转移的，终止确认金融资产。保留了金融资产所有权上所有的风险和报酬的，不终止确认金融资产。本基金有保留金融资产所有权上所有的风险和报酬的，分别情况处理：对于金融资产出售的，终止确认金融资产并确认出售的资产和负债未对金融资产出售的，按其出售金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

本基金主要金融工具的本计价方法如下：

1 债券投资

债券于交易日确认债券投资。债券投资成本按交易日应计的票面交易金额，其中所应计的利息单独核算，不纳入债券投资成本。对于分期付息、到期一次还本的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按实际利率法计算内票利息，按上述会计处理方法核算。

出售债券于交易日确认债券投资收益，出售债券的成本按公允价值法

2 债期投资

或出售债期投资于交易日确认债期投资。债期公允价值按交易金额确认。

债期公允价值于交易日确认投资收益，债期的公允价值按公允价值法于交易日

3

本基金持有的（式），以本示，按实际利率（实际利率合同利率）小，以用合同利率在实持有期内日计提利息。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所收到的或者清偿一项负债所支付的金额。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者清偿负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行。不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日的活跃市场。本基金用市场参与者在对资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量的输入值具有重要影响

意的 值，确定所 的公允价值：第一 值，在计 日 的相同资产或负债在 市场上未经 整的报价 第二 值， 第一 值 相关资产或负债 或 观察的 值 第三 值，相关资产或负债的不 观察 值。

个资产负债表日，本基金对在财务报表中确 的持 以公允价值计 的资产和负债 行重新 估，以确定 在公允价值计 之 发 。

本基金持有的金 工 按 原则确定公允价值并 行估值：

1 存在 市场的金 工 ，按 估值日 的相同资产或负债在 市场上未经 整的报价作 公允价值 估值日 报价 交易日 未发 公允价值计 的重大事 的，应用 交易日的报价确定公允价值。有 证据表明估值日或 交易日的报价不 真实公允价值的，应对报价 行 整，确定公允价值。

上述投资品种相同，但 有不同 的，应以相同资产或负债的公允价值 基 ，并在估值 中 不同 的 。 指对资产出 或 用的限 等， 限 对资产持有者的， 在估值 中不应 限 作 。 ，基金管理人不应 大持有相关资产或负债所产 的 价或 价

2 不存在 市场的金 工 ，应用 在前情况 用并 有 利用数据和其他信息 持的估值 确定公允价值。 用估值 确定公允价值 ，应 用 观察 值， 有在 法 相关资产或负债 观察 值或 不 实 行的情况 ， 用不 观察 值

3 有确 证据表明按上述方法 行估值不 观 其公允价值的，基金管理人 根据情况 基金托管人 定 ，按 公允价值的方法估值

有新 事项，按 新规定估值。

7.4.4.6 金 资产和金 负债的

本基金 有 已确 金 资产和金 负债的法定权利， 种法定权利现在 行的，同 本基金计 以净 算或同 变现 金 资产和 金 负债 ，金 资产和金 负债以相 的金 在资产负债表内 示。 以 ，金 资产和金 负债在资产负债表内分别 示，不 相 。

7.4.4.7 实 基金

实 基金 对 发行的基金份额 所对应的金 。由于 和 起的实 基金变动区别于基金 确 日及基金 确 日确 。上述 和 分别 基金 所 起的 基金的实 基金 和 出基金的实 基金 。

7.4.4.8 益平准金

益平准金 已实现 益平准金和未实现 益平准金。已实现 益平准金指在 或 基金份 ， 或 项中 的按 计未分配的已实现 益（ ）占基金净值比例计算的 的金 。未实现 益平准金指在 或 基金份 ， 或 项中 的按 计未实现 利 （ ）占基金净值比例计算的 的金 。 益平准金于基金 确 日或基金 确 日确 。 未实现 益平准金 已实现 益平准金 在 益平准金 目中核算，并于期末 未分配利润（ 计 ）。

7.4.4.9 /()的确 和计

1 存 利息 按存 的本金 用的利 日计提的金 。 提前 定期存 ， 按 规定的利 及持有期重新计算存 利息 ， 并根据提前 所实 的利息 已确 的利息 的 确 利息 ， 利息 项，存 利息 以净 示

2 债券利息 按债券票 价值 票 利 或内 票 利 计算的金 应由债券发行 业代 代 的个人所 的净 确 ， 在债券实 持有期内 日计提

3 资产 持证券利息 按证券票 价值 票 利 计算的金 ， 应由资产 持证券发 行 业代 代 的个人所 的净 确 ， 在证券实 持有期内 日计提

金 资产 ， 按 金 资产的本及实 利（ 实 利 合同利 小 ， 以用合同利 ）， 在 期内 日计提

债券投资 益（ ）于 交日确 ， 并按 交 其 本、应 利息的

资产 持证券投资 益 于 交日确 ， 并按 交 其 本、应 利息的

债期 投资 益 于平 日确 ， 并按平 交金 其 合 价值的

公允价值变动 益（ ） 本基金持有的以公允价值计 其变动计 期 益的金 资产、以公允价值计 其变动计 期 益的金 负债等公允价值变动形 的应计 期 益的利 或

9 其他 在本基金 行了基金合同中的 务， 在 务 权 确 。

7.4.4.10 用的确 和计

本基金的管理人报 和托管 等在 用 期 按基金合同或相关公告 定的 和计算方 法 日确 。

其他金 负债在持有期 确 的利息 出按实 利 法计算，实 利 法 法 小

的则按 法计算。

7.4.4.11 基金的 益分配 策

1 在 合有关基金分 的前提 ，本基金 年 益分配 数 12 ， 基金合 同 不 3个月 不 行 益分配

2 本基金 益分配方式分 种：现金分 利 投资，投资者 现金 利或 现金 利自动 相应类别的基金份 行 投资 投资者不 ，本基金 的 益分配方式 现 金分

3 基金 益分配 类基金份 的份 净值不 于 值 基金 益分配基准日的 类基 金份 的份 净值 去 类基金份 益分配金 不 于 值

同一类别 一基金份 有同等分配权

法律法规或监管 关 有规定的， 其规定。

7.4.4.12 分部报告

经 分部 指本基金内同 的组 部分：

1 组 部分 在日 动中产 、发 用

2 定期 价 组 部分的经 ，以决定 其配 资 、 价其业绩

3 组 部分的财务 况、经 和现金 等有关会计信息。

个或 个经 分部 有相 的经济 ，并 一定 的，则合并 一个经 分 部。

本基金目前以一个经 分部运作，不 要 行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计 策和会计估计

根据本基金的估值原则和中 证监会允 的基金行业估值实 务 作，本基金确定以 类别债 券投资的公允价值 用的估值方法及其关 假 ；

根据 关于发 中 证券投资基金业 会估值核算工作小组关于201 年1 度 定 益品 种的估值 理标准 的 中基 发 201 2 ，在上 证券交易所、 证券交易所及 行 同业市场上市交易或 的 定 益品种 估值 理标准 有规定的 ， 用第三方 估值 提 的价 数据 行估值。

7.4.5 会计 策和会计估计变更以及 更 的说明

7.4.5.1 会计 策变更的说明

本基金本报告期 会计 策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期 会计估计变更。

7.4.5.3 更 的说明

本基金本报告期 重大会计 的内容和更 金 。

7.4.6 项

1 值

根据财 部、 务 财 201 3 关于 业 值 的 的规定，经 务 准，自 201 年 月 1 日起在 内 业 值 ，金 业 ，由 业 值 。对证券投资基金（ 式证券投资基金， 式证券投资基金）管理人运用基金 股票、债券的 值 债、 方 债 利息 以及金 同业往来利息 值 存 利息 不 值

根据财 部、 务 财 201 关于 一 明确 金 业 有关 策的 的规定，金 展的 式 金 品业务及持有 策性金 债券 的利息 于金 同业往来利息

根据财 部、 务 财 201 0 关于金 同业往来等 值 策的 的规定，金 展的 式 金 品业务、同业存 、同业存 以及持有金 债券 的利息 于金 同业往来利息

根据财 部、 务 财 201 1 0 关于明确金 、 产 发、 务等 值 策的 的规定，本基金运 过程中发 的 值 应 行 ，以本基金的基金管 理人 值 人

根据财 部、 务 财 201 关于资管产品 值 有关的 的规定，自 201 年 1 月 1 日起，本基金的基金管理人运 本基金过程中发 的 值 应 行 ， 用简易计 方法，按 3 的 值 。对本基金在 201 年 1 月 1 日前运 过程中发 的 值 应 行 ，未 值的，不 已 值的，已 本基金的基金管 理人以 月份的 值 应 中 。

2 市 建 、 附 、 方 附

根据中 人 共和 市 建 行 例（2011年 ）、 附 的 行 规定（2011年 ）及相关 方 附 的 规定， 、 值 、 业 的 和个人， 应 规定 市 建 、 附 （ 按 相关规定 事业 附 的 ）及 方 附 。

3 业所

根据财 部、 务 财 200 关于证券投资基金 策的 的规定， 自 200 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（ 式证券投资基金， 式证券投资基金）管理人运 用基金 股票、债券的 价 ， 业所

根据财 部、 务 财 200 1 关于 业所 策的 的规定，对证券投资基金 证券市场中 的 ， 股票、债券的 价 ， 股权的股息、 利 ， 债券的利息 及其他 ， 不 业所 。

个人所

根据财 部、 务 财 200 132 财 部、 务 关于 存 利息 所 有关个人所 策的 的规定，自 200 年 10 月 9 日起，对 存 利息所 个人所 。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 行存

： 人

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
期存	1 13 0	92 9
定期存		
其中：存 期限 1 个月以内		
存 期限 1 3 个月		
存 期限 3 个月以上		
其他存		
合计：	1 13 0	92 9

7.4.7.2 交易性金 资产

： 人

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日

		本	公允价值	公允价值变动
股票				
金 投资 金交所 金合				
债券	交易所市场			
	行 市场	9 303 20	00 000 00	29 92 2
	合计	9 303 20	00 000 00	29 92 2
资产 持证券				
基金				
其他				
合计		9 303 20	00 000 00	29 92 2
项目		上年度末 2020年12月31日		
		本	公允价值	公允价值变动
股票				
金 投资 金交所 金合				
债券	交易所市场			
	行 市场	93 39 990 39	93 2 000 00	1 990 39
	合计	93 39 990 39	93 2 000 00	1 990 39
资产 持证券				
基金				
其他				
合计		93 39 990 39	93 2 000 00	1 990 39

7.4.7.3 金 资产/负债

注：本基金本报告期末及上年度末 金 资产 负债 。

7.4.7.4 金 资产

7.4.7.4.1 项 金 资产期末

：人

项目	本期末 2021年12月31日	
		其中 式
交易所市场	3 000 000 00	
行 市场	100 3	
合计	1 100 3	
项目	上年度末 2020年12月31日	
		其中 式
交易所市场	10 000 000 00	
行 市场		
合计	10 000 000 00	

7.4.7.4.2 期末 式 交易中 的债券

注：本基金本报告期末及上年度末 未持有 式 交易中 的债券。

7.4.7.5 应 利息

：人

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应 期存 利息	31 0	1 0 0
应 定期存 利息		
应 其他存 利息		
应 算 金利息	31 0	
应 债券利息	1 9 09	1 039 1 0 1
应 资产 持证券利息		
应 证券利息	1	2 9 32
应 利息		
应 金合 息		
应 出 证券利息		
其他		2
合计	1 92 2	1 0 3 0 3 19

7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末 其他资产 。

7.4.7.7 应 交易 用

：人

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
交易所市场应 交易 用		
行 市场应 交易 用	1 2	9 0 00
合计	1 2	9 0 00

7.4.7.8 其他负债

：人

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应 券 交易 保证金		
应		2 9
应 证券出 金		
预提	9 000 00	9 000 00
预提审计	0 000 00	0 000 00
预提信息披露	120 000 00	120 000 00
合计	1 9 00	1 9 02 9

7.4.7.9 实 基金

金 : 人

长信稳健纯债债券 A		
项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	
	基金份额 (份)	金
上年度末	90 2 3 90	90 2 3 90
本期	13 2	13 2
本期 (以)	1 9 0 39 0	1 9 0 39 0
基金分份算前		
基金分份算变动份		
本期		
本期 (以)		
本期末	900 9	900 9

金 : 人

长信稳健纯债债券		
项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	
	基金份额 (份)	金
上年度末	3 12 1	3 12 1
本期	11 1 390 39	11 1 390 39
本期 (以)	112 909 9 0 0	112 909 9 0 0
基金分份算前		
基金分份算变动份		
本期		
本期 (以)		
本期末	9 992 0	9 992 0

注: 利投、份, 出份。

7.4.7.10 未分配利润

: 人

长信稳健纯债债券 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2 3 2	30 3	33 2 9 3
本期利润	22 1 2 0 1	0 93 9	29 003 3 2 9
本期基金份额交易 产的变动数	1 0	212 202 0	3 3 0 3
其中: 基金	3 0 0 01	1 92	9 9
基金	233 93	9 12	92 0 32
本期已分配利润			
本期末	2 93	3 3 2 0	2 1 0 9 9

：人

长信稳健纯债债券			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1 91 33	139 923	1 1 0
本期利润	3 93 09	12 3	1 0 92
本期基金份额交易产生的变动数	3 03 1	10 22	2 9 9
其中：基金	91 120 0	92 03 39	1
基金	1 2 1 23	21 1 1	2 3 0 0
本期已分配利润			
本期末	22 90 2	3 2 2	00 0

7.4.7.11 存 利息

：人

项目	本期	上年度 比期
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
期存 利息	3 9 2	191 209 3
定期存 利息		
其他存 利息		
算 金利息	1 9 39	19 99 21
其他	0	11
合计	0 339 12	32 3

注：其他 保证金利息 和在 利息。

7.4.7.12 股票投资 益

7.4.7.12.1 股票投资 益 股票 价

注：本基金本报告期及上年度 比期 股票投资 益。

7.4.7.13 债券投资 益

7.4.7.13.1 债券投资 益项目

：人

项目	本期	上年度 比期
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
债券投资 益 债券（、债 股及债券 期 ） 价	2 02 9 0	3 9 10 2
债券投资 益 价		
债券投资 益 价		
合计	2 02 9 0	3 9 10 2

7.4.7.13.2 债券投资 益 债券 价

：人

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度 比期 2020年1月1日至2020年12月31日
出债券（、债 股及债券 期） 交	1 2 3 1 3 2	392 1 091 2
： 出债券（、债 股及债券 期） 本	1 219 99 0 1	3 0 3 2
： 应 利息	21 120 31 3	3 0 19 0
债券 价	2 02 9 0	3 9 10 2

7.4.7.13.3 债券投资 益 价

注：本基金本报告期及上年度 比期 债券投资 益 价 。

7.4.7.13.4 债券投资 益 价

注：本基金本报告期及上年度 比期 债券投资 益 价 。

7.4.7.13.5 资产 持证券投资 益

注：本基金本报告期及上年度 比期 资产 持证券投资 益。

7.4.7.14 金 投资 益

7.4.7.14.1 金 投资 益项目

注：本基金本报告期及上年度 比期 金 投资 益。

7.4.7.15 工 益

7.4.7.15.1 工 益 权证 价

注：本基金本报告期及上年度 比期 工 益 权证 价 。

7.4.7.15.2 工 益 其他投资 益

注：本基金本报告期及上年度 比期 工 益 其他投资 益。

7.4.7.16 股利 益

注：本基金本报告期及上年度 比期 股利 益。

7.4.7.17 公允价值变动 益

：人

项目	本期 2021年1月1日至2021年	上年度 比期 2020年1月1日至2020年12月
----	-----------------------	------------------------------

	12月31日	31日
1 交易性金融资产	9 2 1	9 2 3
股票投资		
债券投资	9 2 1	9 2 3
资产支持证券投资		
基金投资		
其他		
2 工		
权证投资		
3 其他		
应计金融资产公允价值变动资产的预估值		
合计	9 2 1	9 2 3

7.4.7.18 其他

: 人

项目	本期	上年度 比期
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
基金	1 1	30 33
	1 3 2	20 1 2 2
合计	1 0	0 3

注: 对持有期于日的投资者的计基金财产之, 的2基金财产。

7.4.7.19 交易 用

: 人

项目	本期	上年度 比期
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
交易所市场交易 用		1
行 市场交易 用	12 900 00	3 3 0 00
交易基金产的 用		
其中:		
合计	12 900 00	121

7.4.7.20 其他 用

: 人

项目	本期	上年度 比期
	2021年1月1日至2021	2020年1月1日至2020年

	年 12 月 31 日	12 月 31 日
审计 用	0 000 00	0 000 00
信息披露	120 000 00	120 000 00
证券出 金		
	3 000 00	3 000 00
其他	1 200 00	1 200 00
合计	20 200 00	20 200 00

注：其他 上 所 用。

7.4.8 或有事项、资产负债表日 事项的说明

7.4.8.1 或有事项

至资产负债表日，本基金 要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日 事项

本基金于资产负债表日之 、年度报告 准报出日之前 准、公告或实 的利润分配的情况：
根据本基金管理人于 2022 年 3 月 日发 的分 公告，本基金 2022 年 3 月 9 日在本基金注 记 记在 的 A 类基金份额 持有人按 10 份基金份额 发 利 0.319 类基金份额 持有人按 10 份基金份额 发 利 0.339 。至财务报表 准日，上述利润分配事项 ，本基金 其他 要披露的资产负债表日 事项。

7.4.9 关 方关

关 方	本基金的关
长信基金管理有限责任公司（以 简 长信基金）	基金管理人、注 记 、基金
中信建投证券股份有限公司（以 简 中信建投）	基金托管人、基金
长 证券股份有限公司（以 简 长 证券）	基金管理人的股 、基金
上 股份有限公司（以 简	基金管理人的股
有限公司（以 简 有限	基金管理人的股
上 投资管理中 （有限合 ）（以 简 投 资）	基金管理人的股
上 投资管理中 （有限合 ）（以 简 投 资	基金管理人的股
上 长 财 资产管理有限公司（以 简 长 财）	基金管理人的 公司
长 期 股份有限公司（以 简 长 期）	基金管理人的股 的 公司

注：以 关 交易 在 业务 内按一 业 立。

7.4.10 本报告期及上年度 比期 的关 方交易

7.4.10.1 过关 方交易 行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

注：本基金本报告期及上年度 比期 未 过关 方交易 行的股票交易。

7.4.10.1.2 债券交易

金：人

关 方	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度 比期 2020年1月1日至2020年12月31日	
	交金	占 期债券 交 的 比例	交金	占 期债券 交 的 比例
中信建投			19 993 3	100 00

7.4.10.1.3 债券 交易

金：人

关 方	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度 比期 2020年1月1日至2020年12月31日	
	交金	占 期债券 交 的 比例	交金	占 期债券 交 的 比例
中信建投	39 000 000 00	100 00	2 3 0 000 00	100 00

7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度 比期 未 过关 方交易 行权证交易。

7.4.10.1.5 应 关 方的 金

注：本基金本报告期及上年度 比期 应 关 方的 金。

7.4.10.2 关 方报

7.4.10.2.1 基金管理

：人

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度 比期 2020年1月1日至2020年12月31日
期发 的基金应 的管理	2 929 0 99	023 1 1

其中:	的	32 9 9	113 091 93
-----	---	--------	------------

注：基金管理 按前一日的基金资产净值的 0.30% 的年 计提。计算方法：

$$\text{基金管理 年 年 数} \times \text{日应计提的基金管理} \times \text{前一日的基金资产净值}$$
 基金管理 日计提， 日 计至 月月末，按月 。

7.4.10.2.2 基金托管

：人

项目	本期	上年度 比期
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
期发 的基金应 的托管	9 0 2	1 3 2 3 0

注：基金托管 按前一日的基金资产净值的 0.10% 的年 计提。计算方法：

$$\text{基金托管 年 年 数} \times \text{日应计提的基金托管} \times \text{前一日的基金资产净值}$$
 基金托管 日计提， 日 计至 月月末，按月 。

7.4.10.2.3 务

：人

务 的 关 方	本期		
	2021年1月1日至2021年12月31日		
	期发 的基金应 的 务		
	长信稳健纯债债券 A	长信稳健纯债债券	合计
长信基金		1 2 1 3	1 2 1 3
合计		1 2 1 3	1 2 1 3
务 的 关 方	上年度 比期		
	2020年1月1日至2020年12月31日		
	期发 的基金应 的 务		
	长信稳健纯债债券 A	长信稳健纯债债券	合计
长信基金		3 93	3 93
合计		3 93	3 93

注：本基金 A 类基金份额 不 务 ， 类基金份额 的基金 务 按前一日 类基金

资产净值的 0.10 年 计提。计算方法 ：

类基金份额 的 务 年 年 数

类基金份额 日应计提的 务

类基金份额 前一日的基金资产净值

基金 务 日计提， 日 计至 月月末，按月 。

7.4.10.3 关 方 行 行 同业市场的债券()交易

：人

本期 2021年1月1日至2021年12月31日						
行 市场交 易的 关 方	债券交易金		基金		基金	
	基金	基金 出	交易金	利息	交易金	利息 出
中信建投	29 9 9 923 0					
上年度 比期 2020年1月1日至2020年12月31日						
行 市场交 易的 关 方	债券交易金		基金		基金	
	基金	基金 出	交易金	利息	交易金	利息 出
中信建投	20 1 312 0	0 0 193 2				

7.4.10.4 报告期内 证券出 业务发 重大关 交易事项的说明

7.4.10.4.1 关 方 过 定 报方式 行的 用 定期限 的证券出 业务的情况

注：本基金本报告期及上年度 比期 未 关 方 过 定 报方式 行 用 定期限 的 证券出 业务。

7.4.10.4.2 关 方 过 定 报方式 行的 用市场 期限 的证券出 业务的情况

注：本基金本报告期及上年度 比期 未 关 方 过 定 报方式 行 用市场 期限 的 证券出 业务。

7.4.10.5 关 方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用 有资金投资本基金的情况

注：基金管理人在本报告期及上年度 比期 未运用 有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 报告期末 基金管理人 之 的其他关 方投资本基金的情况

注： 基金管理人 之 的其他关 方在本年末及上年度末 未持有本基金。

7.4.10.6 由关 方保管的 行存 及 期产 的利息

注：本基金本报告期末及上年度末 由关 方保管的 行存 及 期产 的利息 。

7.4.10.7 本基金在承 期内 关 方承 证券的情况

注：本基金在本报告期及上年度 比期 未在承 期内 过由关 方承 的证券。

7.4.10.8 其他关 交易事项的说明

注：本基金本报告期内及上年度 比期 其他关 交易事项。

7.4.11 利润分配情况

注：本报告期本基金未 行利润分配。

7.4.12 期末（2021年12月31日）本基金持有的 限证券**7.4.12.1 新发/ 发证券 于期末持有的 限证券**

注：本基金 新发 发证券 于期末持有的 限证券。

7.4.12.2 期末持有的 等 限股票

注：本基金本报告期末未持有 等 限股票。

7.4.12.3 期末债券 交易中作 的债券**7.4.12.3.1 行 市场债券**

至本报告期末 2021 年 12 月 31 日止，本基金 事 行 市场债券 交易形 的 出 证券 人 1 999 9 00 ， 以 债券作 ；

金 ； 人

债券代	债券	期日	期末估值 价	数 ()	期末估值
190202	19 02	2022 年 1 月 日	100 0	20 000	2 000 00 00
合计				20 000	2 000 00 00

7.4.12.3.2 交易所市场债券

至本报告期末 2021 年 12 月 31 日止，本基金 事交易所市场债券 交易形 的 出 金 资产 。

7.4.12.4 期末 证券出 业务的证券

注：本基金本报告期末 证券出 业务的 出证券。

13 金 工 风险及管理

7.4.13.1 风险管理 策和组

本基金在日常运动中 种金 工 的风险，主要 ；信用风险、 动性风险和市场风险。

本基金在 主要 述上述风险 及其形 原 、风险管理目标、 策和过程以及计 风险的方法等。

本基金的基金管理人 事风险管理的目标 本基金在风险和 益之 的平 ，以实现 风险和 益相 配 的风险 益目标。基于 风险管理目标，本基金的基金管理人已 定了 策和程序来 别和分 风险， 定 的风险限 并 计相应的内部 程序， 过 的管理及信息 持 监 上述 类风险。

本基金管理人 行 风险管理 理 ，建立了以风险 会 核 的、由 察长、监察稽核部和相关业务部 的风险管理 。在董事会 立风险 会，负责对公司经 管理和基金业务运作的合法性、合规性 行 的 和 估等 在管理 立内部 会，主要 责 审 公司内部 度及 对公司在经 管理和投资组合运作中的风险 行 别、 估并 有 的 在业务 作 风险管理 责主要由监察稽核部负责 并 部 合作完 运作风险管理工作， 略 产品 发部负责 行投资风险分 绩 估。监察稽核部 察长负责，并 经理 报日 行 事务。

7.4.13.2 信用风险

信用风险 指基金在交易过程中 交易对 未 行合 责任，或者基金所投资证券之发行人出现 、 期本息，导 基金资产 和 益变 的风险。本基金的 行存 由本基金的托管人中信建投证券股份有限公司 存于招 行股份有限公司， 行存 相关的信用风险不重大。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理 程，本基金投资于 有 信用等 的证券， 过分 投资以分 信用风险。本基金投资于一 公司发行的证券市值不 过基金资产净值的 10 ， 本基金 由本基金管理人管理的其他基金共同持有一 公司发行的证券，不 过 证券的 10 。

本基金在交易所 行的交易 中 证券 记 算有限责任公司完 证券交 和 项 算， 风险发 的 性 小 本基金在 行 行 同业市场交易前 对交易对 行信用

估并用券对交方式以相应的信用风险。

7.4.13.2.1 按期信用 示的债券投资

：人

期信用	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
A 1	0 00	0 00
A 1 以	0 00	0 00
未	0 00	91 000 00
合计	0 00	91 000 00

注：未 债券 债、行票据、策性金 债及 期 资券等 信用 债券。

7.4.13.2.2 按期信用 示的资产 持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末 按期信用 示的资产 持证券投资。

13 2 3 按期信用 示的同业存 投资

：人

期信用	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
以		
未		3 000 00
合计		3 000 00

注：本基金持有同业存 的主 AA 及以上 。

7.4.13.2.4 按长期信用 示的债券投资

：人

长期信用	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
AAA	0 00	0 00
AAA 以	0 00	0 00
未	00 000 00	0 00 000 00
合计	00 000 00	0 00 000 00

注：未 债券 债、行票据及 策性金 债等 信用 债券。

7.4.13.2.5 按长期信用 示的资产 持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末 按长期信用 示的资产 持证券投资。

7.4.13.2.6 按长期信用 示的同业存 投资

注：本基金本报告期末及上年度末 按长期信用 示的同业存 投资。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险指基金管理人未以合理价格变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金流动性风险来自于开放式基金日常赎回资金的流动性风险，以及部分投资品种交易不活跃出现的变现风险和债券投资中采用公允价值计量的债券资产在市场价格下跌时无法以合理价格变现投资的风险。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求，建立健全开放式基金流动性风险管理的内部制度，审慎评估各类资产的流动性，对特定流动性风险管理事项，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金坚持组合管理、分散投资的原则开展投资活动，所持证券在证券交易所或银行间同业市场交易，并遵守基金管理人流动性相关交易限制。

本基金主要投资于基金合同约定的具有流动性的金融工具，基金管理人会对流动性指标进行持续的监测和分析，定期开展流动性风险评估，评估在不同的市场条件下资产变现情况的变动。

基金管理人持续监测本基金在报告期内的流动性情况，市场利率或投资者行为发生较大变化，及调整投资组合资产结构及比例，保持基金资产变现能力和期限与负债结构和期限的匹配。同时，对开放式基金的流动性风险，基金管理人在基金合同中明确了流动性风险管理措施，制定了开放式基金流动性风险的应急预案，评估流动性风险的潜在影响。

7.4.13.4 市场风险

市场风险指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因市场价格变动而发生波动的风险，包括利率风险、信用风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险指金融工具的公允价值或现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。本基金的息资产主要存放于银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

7.4.13.4.1.1 利率风险

单位：人

本期末 2021年 12月	3个月以内	3个月-1年	1-3年	3年以上	不计息	合计
---------------------	-------	--------	------	------	-----	----

31 日						
资产						
行 存	1 13 0					1 13 0
算 金	3 3 3					3 3 3
交易 性金 资产	120 01 000 00	100 3 0 000 00	33 0 000 00	122 1 1 000 00		00 000 00
金 资产	1 100 3					1 100 3
应 利息					1 92 2	1 92 2
应					90 31	90 31
资产 计	201 9 00	100 3 0 000 00	33 0 000 00	122 1 1 000 00	1 9 2 93	9 3 29 0 93
负债						
出 金 资产	1 999 9 00					1 999 9 00
应					1 2 03	1 2 03
应 管理 人报					2 11 3	2 11 3
应 托管					2 2 0	2 2 0
应 务					02 20	02 20
应					1 2	1 2

交易用						
应利息					1 3	1 3
其他负债					1 9 00	1 9 00
负债计	1 999 9 00				31 392 92	2 31 2 1 92
利度	199 9 00	100 3 0 000 00	33 0 000 00	122 1 1 000 00	1 1 190 01	9 0 9 01
上年度末 2020年 12月 31日	个月以内	个月 1年	1 年	年以上	不计息	合计
资产						
行存	92 9					92 9
存出 保证金	1 39					1 39
交易性金 资产	2 22 000 00		0 00 000 00			93 2 000 00
金 资产	10 000 000 00					10 000 000 00
应 利息					1 0 3 0 3 19	1 0 3 0 3 19
应					122 0 3	122 0 3
资产 计	3 09 3		0 00 000 00		1 1 1 2	9 1 2 11 0
负债						
应					1 3 3	1 3 3

应 管理 人报					2 0	2 0
应 托 管					1 3	1 3
应 务					31	31
应 交 易 用					9 0 00	9 0 00
其 他 负 债					1 9 02 9	1 9 02 9
负 债 计					1 92 02 1	1 92 02 1
利 度	3 09 3		0 00 000 00		3 2 930	9 2 9 1 90

注：表中所示 本基金资产及交易形 负债的公允价值，并按 合 规定的利 重新定价日或 期日 者 行了分类。

7.4.13.4.1.2 利 风险的 性分

假	市场利 以 的其他市场变 保持不变		
分	相关风险变 的变动	对资产负债表日基金资产净值的 金 (: 人)	
		本期末(2021 年 12 月 31 日)	上年度末(2020 年 12 月 31 日)
	市场利 2 个 基	99 12	2 0 19 0
市场利 上 2 个 基	99 12	2 0 19 0	

7.4.13.4.2 风险

风险 指金 工 的公允价值或未来现金 变动 发 动的风险。本基 金的所有资产及负债以人 计价， 重大 风险。

7.4.13.4.3 其他价 风险

其他价 风险 指基金所持金 工 的公允价值或未来现金 市场利 和 以

的市场价 变动 发 动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的债券和 行 同 业市场交易的 定 益品种， 重大其他市场价 风险。

7.4.13.4.3.1 其他价 风险

金 : 人

项目	本期末 2021年12月31日		上年度末 2020年12月31日	
	公允价值	占基金资产 净值比例(%)	公允价值	占基金资 产净值比 例(%)
交易性金 资产 股票投资				
交易性金 资产 基金投资				
交易性金 资产 债券投资	00 000 00	90 1	93 2 000 00	99 2
交易性金 资产 金 投资				
金 资产 权证投资				
其他				
合计	00 000 00	90 1	93 2 000 00	99 2

7.4.13.4.3.2 其他价 风险的 性分

注：本基金主要投资债券等 定 益品种， 重大其他价 风险， 未 行其他价 风险的 性分 。

7.4.14 有 于理 和分 会计报表 要说明的其他事项

1 1 公允价值

1 1 1 不以公允价值计 的金 工

不以公允价值计 的金 资产和负债主要 和应 项以及其他金 负债，其 期限不长，公允价值 价值相 。

1 1 2 以公允价值计 的金 工

1 1 2 1 金 工 公允价值

于2021年12月31日，本基金持有的以公允价值计 其变动计 期 益的金 资产中 于第一 的 人 0 00 ， 于第二 的 人 00 000 00 ， 于第 三 的 人 0 00 （于2020年12月31日，本基金持有的以公允价值计 其变动 计 期 益的金 资产中 于第一 的 人 0 00 ， 于第二 的 人 93 2 000 00 ， 于第三 的 人 0 00 ）。

1 1 2 2 公允价值所 的重大变动

本基金本期持有的以公允价值计 的金 工 的公允价值所 未发 重大变动。

1 1 2 3 第三 公允价值 和本期变动金

本基金持有的以公允价值计 其变动计 期 益的金 工 第三 公允价值本期未发 变动。

1 2 承诺事项

至资产负债表日，本基金 要说明的承诺事项。

1 3 其他事项

至资产负债表日，本基金 要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金 人

序	项目	金	占基金资产的比例(%)
	权益投资		
	其中：股票		
2	基金投资		
	定 益投资	00 000 00	9 9
	其中：债券	00 000 00	9 9
	资产 持证券		
	金 投资		
	金 品投资		
	金 资产	1 100 3	33
	其中： 式 的 金 资产		
	行存 和 算 金合计	3 0 3	0 0
	其他 项资产	1 9 2 93	1
	合计	9 3 29 0 93	100 00

注：本基金本报告期末未 过 股 交易 投资 股。本基金本报告期末未 证券出 业务。

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的 内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有股票。

8.2.2 报告期末按行业分类的 股 投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

注：本基金本报告期末未持有股票。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 计 金 出期 基金资产净值 2%或前 20 的股票明细

注：本基金本报告期内未 股票。

8.4.2 计 出金 出期 基金资产净值 2%或前 20 的股票明细

注：本基金本报告期内未 出股票。

8.4.3 股票的本 及 出股票的

注：本基金本报告期内未投资股票。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金 人

序	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
	债券		
	行票据		
	金 债券	00 000 00	90 1
	其中： 策性金 债	00 000 00	90 1
	业债券		
	业 期 资券		
	中期票据		
	债（交 债）		
	同业存		
9	其他		
10	合计	00 000 00	90 1

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前 债券投资明细

金 人

序	债券代	债券	数（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	200 02	20 发 02	2 00 000	2 9 3 000 00	2
2	09201 001	20 发 发 01	1 100 000	110 011 000 00	11 33
3	1 0 0	1 发 0	1 000 000	102 0 000 00	10
	200312	20 出 12	1 000 000	100 3 0 000 00	10 3
	210210	21 10	00 000	1 0 0 000 00	2

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产 持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产 持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前 金 投资明细

注：本基金本报告期末未持有 金 。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前 权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的 债期 交易情况说明

8.10.1 本期 债期 投资 策

注：本基金本报告期末未持有 债期 。

8.10.2 报告期末本基金投资的 债期 持 和 益明细

注：本基金本报告期末未持有 债期 。

8.10.3 本期 债期 投资 价

注：本基金本报告期末未持有 债期 。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1 本基金投资的前 证券的发行主 本期 以及 的情况的说明

报告期内本基金投资的前 证券中，发行主 中 出 行于2021年 月13日 中 行保险监 管理 会 决定书（ 保监 决字 2021 31 ），根据 中 人 共和 行业监 管理法 第二 一 、第 、第 和相关审 经 规则，经 ，中 出 行存在：一、 规投资 业股权 二、个别 管人 未经核准实 三、监管数据漏 报 报 、 规 方 务提 资 、 规变相发 、 用 未 务 准的项目发 、 规 展 金保理业务变相 持 方 债 、 金 保理业务基 交易不真实 、 公司发 用 不合规的 动资金 、 规 个别 新 资 一、个别并 金 占比 出监管上限 二、 并 之 规发 股权 三、 规 未 证 的 定资产项目发 、 规发 动资 金 用于 定资产投资 、 信 度核定不审 、 实 用 的 业发 导 、 产 过 行业限 要 信 、项目 未按规定 定 担保 、 风险分类不审 二 、信 资产 业务 前 不尽 二 一、 人 估 用 二 二、同业业务交易对 管理 实不 二 三、 易 审 不审 二 、对以往监管 报 整 不 。上，中 行保险监 管理 会决定对中 出 行 3 。

对 上证券投资决策程序的说明：公司 部 按 内部 工作规 对 证券 行分 其 基金投资对 。在 基 上本基金的基金经理根据 市场情况独立作出投资决

策。事发，本基金管理人对 证券的发行主 行了一了分， 事未对 证券投资价值 产重大的实 性。本基金投资于 证券的投资决策过程 合 度规定的投资权限 投资决策程序。

报告期内本基金投资的前 证券中其 的发行主 未出现 监管部 立 或在报告 日前一年内 公 责、 的情形。

8.11.2 基金投资的前 股票 出基金合同规定的 股票 情况的说明

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

8.11.3 期末其他 项资产

：人

序		金
	存出保证金	
	应 证券 算	
	应 股利	
	应 利息	1 92 2
	应	90 31
	其他应	
	用	
	其他	
	合计	1 9 2 93

8.11.4 期末持有的 于 股期的 债券明细

注：本基金本报告期末未持有 债券。

8.11.5 期末前 股票中存在 限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有股票。

8.11.6 投资组合报告附注的其他 字 述部分

注：由于 的原，分项之和 合计项 存在。

§ 9 基金份额 持有人信息

9.1 期末基金份额 持有人 数及持有人

份 : 份

份 别	持有人 数	持有的 基金份	持有人			
			投资者		个人投资者	
			持有份	占 份 比 例	持有份	占 份 比例
长信稳健纯债债券 A	9	923 90	90 9 33 3	9 92	9 90 3 2	1 0
长信稳健纯债债券	11 9	0 01	0 00	0 00	9 992 0	100 00
合计	12	1 2 9 39	90 9 33 3	9 09	1 3 0 33 93	1 91

注：对 分 基金，比例的分 用 自 别的份 ，对合计数，比例的分 用 分 基金份 的合计数（ 期末基金份 ）。

9.2 期末基金管理人的 业人 持有本基金的情况

项目	份 别	持有份 数（份）	占基金 份 比例
基金管理人所有 业人 持有本基金	长信稳健纯债债券 A	2 0 3	0 00
	长信稳健纯债债券	2 0	0 09
	合计		0 00

注：对 分 基金，比例的分 用 自 别的份 ，对合计数，比例的分 用 分 基金份 的合计数（ 期末基金份 ）。

9.3 期末基金管理人的 业人 持有本 式基金份 的情况

项目	份 别	持有基金份 的数 （ 份）
本公司 管理人 、基金 投资和 部 负责人持 有本 式基金	长信稳健纯债债券 A	0
	长信稳健纯债债券	0
	合计	0
本基金基金经理持有本 式基金	长信稳健纯债债券 A	0
	长信稳健纯债债券	0
	合计	0

§ 10 式基金份 变动

: 份

项目	长信稳健纯债债券 A	长信稳健纯债债券
基金合同 日 (201 年 12 月 13 日) 基金份	210 203 0 22	
本报告期期 基金份	90 2 3 90	3 12 1
本报告期基金 份	13 2	11 1 390 39
本报告期基金 份	1 9 0 39 0	112 909 9 0 0
本报告期基金 分变动份 (份 以)		
本报告期期末基金份	900 9	9 992 0

§ 11 重大事 示

11.1 基金份 持有人大会决

本报告期末 本基金的基金份 持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专 基金托管部 的重大人事变动

11.2.1 基金管理人的重大人事变动

自 2021 年 1 月 2 日起, 不 担任公司董事长, 由 经理 代任董事长。

自 2021 年 月 2 日起, 担任公司董事长, 经理 不 代任董事长。

自 2021 年 月 9 日起, 程 不 担任公司 经理。

自 2021 年 月 19 日起, 担任公司 经理。

上述重大人事变动情况, 本基金管理人 已在规定信息披露 介发 相关公告。

11.2.2 基金托管人的专 基金托管部 的重大人事变动

本报告期基金托管人的专 基金托管部 未发 重大人事变动。

11.3 及基金管理人、基金财产、基金托管业务的

本报告期 及基金管理人、基金财产、基金托管业务的 。

11.4 基金投资策略的 变

本报告期本基金投资策略未 变。

11.5 基金 行审计的会计 事务所情况

本报告期本基金未更 会计 事务所 报告期 明会计 事务所 (合)
 审计的报 人 0 000 00 , 审计 本基金提 的审计 务的连 年限 年。

11.6 管理人、托管人及其 管理人 稽 或 等情况

本报告期基金管理人、托管人及其 管理人 有 监管部 稽 或 的情形。

11.7 基金 用证券公司交易 的有关情况

11.7.1 基金 用证券公司交易 行股票投资及 金 情况

金 : 人

券	交易数	股票交易		应 券 的 金		注
		交金	占 期股票 交 的比 例	金	占 期金 的比例	
中信建投	2					

注：1、本报告期 用证券公司交易 变 。

2、专用交易 的 标准和程序

根据中 证监会 关于 证券投资基金监管有关 的 （证监基字 199 29 ）和
关于完 证券投资基金交易 度有关 的 （证监基金字 200 ）的有关规定，
本公司 定了 用证券公司专用交易 的 标准和程序。

(1) 标准：

- 、券 基本 价（财务 况、经 况）
- 、券 价（报告 、及 性和数 ）
- 、券 日信息 价（及 性和有 性）
- 、券 作表现 价。

(2) 程序：

根据 用证券公司专用交易 的 标准形 券 务 价表 ， 根据 分
行 基金专用交易 。

11.7.2 基金 用证券公司交易 行其他证券投资的情况

金 ： 人

券	债券交易		债券 交易		权证交易	
	交金	占 期债券 交 的比 例	交金	占 期债 券 交 的比例	交金	占 期权证 交 的比 例
中信建投			39 000 000 00	100 00		

11.8 其他重大事

序	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长信基金管理有限责任公司关于 部分 式基金在 风证券股份有限公司 、定期 定 投资业务及 （ 定投 ） 动的公告	上证报、中 证监 会 披露 、 公司	2021 年 1 月 1 日
2	长信稳健纯债债券型证券投资基金 2020 年第 度报告	中 证监会 披露 、公司	2021 年 1 月 22 日

3	长信基金管理有限责任公司 部基金 2020 年第一 度报告提示性公告	上证报、中证报、证券报、证券日报、中国证监会披露、公司	2021 年 1 月 22 日
	长信基金管理有限责任公司关于基金行业管理人 变更公告	上证报、中国证监会披露、公司	2021 年 1 月 2 日
	长信基金管理有限责任公司关于 2 公募 基金 并相应 法律 的公告	上证报、中证报、证券报、证券日报、中国证监会披露、公司	2021 年 3 月 2 日
	长信基金管理有限责任公司关于 2 公 募 证 券 投 资 基 金 基 金 合 同 和 托 管 并 更新招募说明书及产品资料 要的提示性公告	上证报、中证报、证券报、证券日报、中国证监会披露、公司	2021 年 3 月 2 日
	长信稳健纯债债券型证券投资基金更新的招募说明书及基金产品资料 要（更新）	中国证监会披露、公司	2021 年 3 月 2 日
	长信稳健纯债债券型证券投资基金基金合同	中国证监会披露、公司	2021 年 3 月 2 日
9	长信稳健纯债债券型证券投资基金托管	中国证监会披露、公司	2021 年 3 月 2 日
10	长信基金管理有限责任公司关于 中信建投 证券股份有限公司 部分 式基金代 并 、定期定 投资业务及 （定投 ） 动的公告	上证报、中证报、证券报、证券日报、中国证监会披露、公司	2021 年 3 月 1 日
11	长信基金管理有限责任公司关于 部分 式基金 金证券股份有限公司 动的公告	上证报、中国证监会披露、公司	2021 年 3 月 2 日
12	长信稳健纯债债券型证券投资基金 2020 年年度 报告	中国证监会披露、公司	2021 年 3 月 30 日
13	长信基金管理有限责任公司 部基金 2020 年年度报告提示性公告	上证报、中证报、证券报、证券日报、中国证监会披露、公司	2021 年 3 月 30 日
1	长信基金管理有限责任公司关于 部分	上证报、中 证监	2021 年 3 月 31

	式基金 中 行股份有限公司 (定投) 动的公告	会 披露 、 公司	日
1	长信稳健纯债债券型证券投资基金 2021 年第 1 度报告	中 证监会 披露 、公司	2021 年 月 21 日
1	长信基金管理有限责任公司 部基金 2021 年第一 度报告提示性公告	上证报、中证报、 证券 报、证券日 报、中 证监会 披露 、公司	2021 年 月 21 日
1	长信基金管理有限责任公司关于董事长变更公 告	上证报、中 证监会 披露 、 公司	2021 年 月 30 日
1	长信基金管理有限责任公司公告	上证报、中 证监会 披露 、 公司	2021 年 月 22 日
19	长信稳健纯债债券型证券投资基金更新的招募 说明书 (2021 年第 1) 及基金产品资料 要 (更新)	中 证监会 披露 、公司	2021 年 月 30 日
20	长信基金管理有限责任公司关于 部分 式基金 招 行股份有限公司 (定投) 动的公告	上证报、中 证监会 披露 、 公司	2021 年 月 日
21	长信基金管理有限责任公司关于 部证券 股份有限公司 部分 式基金代 并 、定期定 投资业务及 (定投) 动的公告	上证报、中 证监会 披露 、 公司	2021 年 月 1 日
22	长信稳健纯债债券型证券投资基金 2021 年第 2 度报告	中 证监会 披露 、公司	2021 年 月 21 日
23	长信基金管理有限责任公司 部基金 2021 年第二 度报告提示性公告	上证报、中证报、 证券 报、证券日 报、中 证监会 披露 、公司	2021 年 月 21 日
2	长信基金管理有限责任公司关于 基金 有限公司 部分 式基金代 并 、定期定 投资业务及 (定投) 动的公告	上证报、中 证监会 披露 、 公司	2021 年 月 22 日
2	长信基金管理有限责任公司关于 招 证券 股份有限公司 部分 式基金代 并 、定期定 投资业务及 (定投) 动的公告	上证报、中 证监会 披露 、 公司	2021 年 月 29 日
2	长信基金管理有限责任公司关于 方财 证券股份有限公司 部分 式基金代	上证报、中 证监会 披露 、	2021 年 月 日

	并、定期定 投资业务及 (定投) 动的公告	公司	
2	长信基金管理有限责任公司关于 证券 股份有限公司 部分 式基金代 并、定期定 投资业务及 (定投) 动的公告	上证报、中 证监 会 披露 、 公司	2021年 月 日
2	长信基金管理有限责任公司关于基金行业 管理人 变更公告	上证报、中 证监 会 披露 、 公司	2021年 月 11 日
29	长信基金管理有限责任公司关于 证券 股份有限公司 部分 式基金代 并、定期定 投资业务及 (定投) 动的公告	上证报、中 证监 会 披露 、 公司	2021年 月 13 日
30	长信基金管理有限责任公司关于 立 分公 司的公告	上证报、中 证监 会 披露 、 公司	2021年 月 1 日
31	长信基金管理有限责任公司关于 上 利 基金 有限公司 部分 式基金代 并、定期定 投资业务及 (定投) 动的公告	上证报、中 证监 会 披露 、 公司	2021年 月 1 日
32	长信基金管理有限责任公司关于基金行业 管理人 变更公告	上证报、中 证监 会 披露 、 公司	2021年 月 20 日
33	长信基金管理有限责任公司关于 部分 式基金 中 工 行股份有限公司 (定投) 动的公告	上证报、中 证监 会 披露 、 公司	2021年 月 2 日
3	长信稳健纯债债券型证券投资基金 2021 年中期 报告	中 证监会 披露 、公司	2021年 月 31 日
3	长信基金管理有限责任公司 部基金 2021 年中期报告提示性公告	上证报、中证报、 证券 报、证券日 报、中 证监会 披露 、公司	2021年 月 31 日
3	长信基金管理有限责任公司关于 行 股份有限公司 部分 式基金代 并、定期定 投资业务及 (定投) 动的公告	上证报、中 证监 会 披露 、 公司	2021年 9 月 1 日
3	长信基金管理有限责任公司关于 上 基 基金 有限公司 部分 式基金代 并、定期定 投资业务及 (定投)、 动的公告	上证报、中 证监 会 披露 、 公司	2021年 10 月 21 日
3	长信稳健纯债债券型证券投资基金 2021 年第 3 度报告	中 证监会 披露 、公司	2021年 10 月 2 日

39	长信基金管理有限责任公司 部基金 2021 年第三 度报告提示性公告	上证报、中证报、 证券 报、证券日 报、中 证监会 披露 、公司	2021 年 10 月 2 日
0	长信基金管理有限责任公司关于 证券股份有限公司 部分 式基金代 并 、定期定 投资业务及 (定投) 动的公告	上证报、中 证监 会 披露 、 公司	2021 年 11 月 9 日
1	长信基金管理有限责任公司关于 证券 股份有限公司 部分 式基金代 并 、定期定 投资业务及 (证 定投) 动的公告	上证报、中 证监 会 披露 、 公司	2021 年 11 月 1 日
2	长信基金管理有限责任公司关于 金 过 中 () 所有基金 的公告	上证报、中 证监 会 披露 、 公司	2021 年 11 月 23 日
3	长信基金管理有限责任公司关于 证券 股份有限公司 部分 式基金代 并 、定期定 投资业务及 (证 定投) 动的公告	上证报、中 证监 会 披露 、 公司	2021 年 12 月 2 日
	长信基金管理有限责任公司关于 上 基金 有限公司 部分 式基金代 并 、定期定 投资业务及 (定投) 动的公告	上证报、中 证监 会 披露 、 公司	2021 年 12 月 3 日
	长信基金管理有限责任公司关于 证券 股份有限公司 部分 式基金代 并 、定期定 投资业务及 (证 定投) 动的公告	上证报、中 证监 会 披露 、 公司	2021 年 12 月 23 日

§12 投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内 一投资者持有基金份额 比例 或 过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额 变 情况					报告期末持有基金情况	
	序	持有基金份额 比例 或者 过 20 的	期 份	份	份	持有份	份 占比
	1	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	90 9 239 2	0 00	0 00	90 9 239 2	9 09
个人							
产品 有风险							
<p>1、基金净值大 动的风险 一持有基金比例过 的投资者连 大 ， 会 基金投资的持 性和稳定性， 变现 本。同 ， 按 净值计算 理规则 起基金份 净值 上 或 。</p> <p>2、 期 理的风险 一持有基金比例过 的投资者大 发本基金 ， 导 同期中小投资者小 部分 期 理的情况。</p> <p>3、基金投资策略 以实现的的风险 一持有基金比例过 的投资者大 ， 起基金资产 净值 ， 基金在投资 限 ， 导 基金投资策略 以实现。</p>							

12.2 投资者决策的其他重要信息

注：本基金本报告期未发 投资者决策的其他重要信息。

§13 目录

13.1 目录

- 1、中国证监会 准 立基金的
- 2、长信稳健纯债债券型证券投资基金基金合同
- 3、长信稳健纯债债券型证券投资基金招募说明书
 - 、长信稳健纯债债券型证券投资基金托管
 - 、报告期内在指定报 上披露的 种公告的原
 - 、长信基金管理有限责任公司 业 、公司 程及相关资 复 。

13.2 存

基金管理人的 公场所。

13.3 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

2022年3月31日