

长信金利趋势混合型证券投资基金 2022 年中期报告

2022 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：上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 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。本中期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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 2022 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 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	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 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	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
7.3 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	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	53
7.6 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	53

7.7 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支持证券投资明细.....	53
7.8 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贵金属投资明细.....	53
7.9 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.....	53
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	53
7.12 投资组合报告附注.....	54
§ 8 基金份额持有人信息	55
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	55
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	55
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	56
§ 9 开放式基金份额变动	56
§ 10 重大事件揭示	56
10.1 基金份额持有人大会决议.....	56
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	57
10.4 基金投资策略的改变.....	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	57
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	57
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	57
10.8 其他重大事件.....	59
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	62
11.1 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	62
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	62
§ 12 备查文件目录	62
12.1 备查文件目录.....	62
12.2 存放地点.....	62
12.3 查阅方式.....	63

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长信金利趋势混合型证券投资基金	
基金简称	长信金利趋势混合	
场内简称	长信金利	
基金主代码	519994	
前端交易代码	519995	
后端交易代码	519994	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2006 年 4 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	上海浦东发展银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	10,520,218,227.95 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	长信金利趋势混合 A	长信金利趋势混合 C
下属分级基金的交易代码	519994	015039
报告期末下属分级基金的份额总额	8,877,627,410.20 份	1,642,590,817.75 份

注：基金管理人决定自 2022 年 2 月 15 日起对长信金利趋势混合型证券投资基金进行份额分类，原有基金份额为 A 类份额，增设 C 类份额，具体事宜可详见基金管理人于 2022 年 2 月 11 日发布的《长信基金管理有限责任公司关于长信金利趋势混合型证券投资基金增设 C 类基金份额相关事项的公告》。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在有效控制风险的前提下精选受益于城市化、工业化和老龄化各个中国趋势点的持续增长的上市公司股票主动投资，谋求基金资产的长期稳定增值。本基金选择投资的上市公司股票包括价值股和成长股，股票选择是基于中国趋势点分析、品质分析和持续增长分析等方面的深入分析论证。
投资策略	本基金采用“自上而下”的主动投资管理策略，在充分研判中国经济增长趋势、中国趋势点和资本市场发展趋势的基础上，深入研究受益于中国趋势点的持续增长的上市公司证券，以期在风险可控的前提下实现投资组合的长期增值。
业绩比较基准	上证 A 股指数×70%+中证综合债指数×30%
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于中等风险、中等收益的基金品种，其预期风险和预期收益高于债券基金和货币市场基金，低于股票型基金。

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
名称	长信基金管理有限责任公司	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露 姓名	周永刚	胡波

负责人	联系电话	021-61009999	021-61618888
	电子邮箱	zhouyg@cxfund.com.cn	Hub5@spdb.com.cn
客户服务电话		4007005566	95528
传真		021-61009800	021-63602540
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 9 楼	上海市中山东一路 12 号
办公地址		上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼	上海市北京东路 689 号
邮政编码		200120	200001
法定代表人		刘元瑞	郑杨

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.cxfund.com.cn
基金中期报告备置地点	上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼、上海市中山东一路 12 号

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	A 类份额：中国证券登记结算有限责任公司； C 类份额：长信基金管理有限责任公司	A 类份额：北京市西城区太平桥大街 17 号；C 类份额：上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022 年 1 月 1 日 -2022 年 6 月 30 日)	2022 年 2 月 15 日（份额增加日）-2022 年 6 月 30 日
	长信金利趋势混合 A	长信金利趋势混合 C
本期已实现收益	-456,571,883.36	-59,770,101.48
本期利润	-236,730,271.55	18,744,339.59
加权平均基金份额本期利润	-0.0356	0.0168
本期加权平均净值利润率	-6.45%	3.31%
本期基金份额净值增长率	-4.48%	5.89%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	578,764,212.80	66,791,832.48
期末可供分配基金份额利润	0.0652	0.0407

期末基金资产净值	4,302,840,327.45	796,244,480.10
期末基金份额净值	0.4847	0.4847
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	558.60%	5.89%

注：1、长信金利趋势混合型证券投资基金 C 类份额增加日为 2022 年 2 月 15 日，根据管理人于 2022 年 2 月 11 日发布的《长信基金管理有限责任公司关于长信金利趋势混合型证券投资基金 C 类基金份额净值计算与披露方法的说明》，在任何一个工作日 C 类基金份额为零时，本基金将停止计算 C 类基金份额净值，暂停计算期间的 C 类基金份额净值将按照 A 类基金份额净值披露，作为参考净值；截至本报告期末，长信金利趋势混合型证券投资基金 C 类份额运作时间未满半年。

2、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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、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。

4、期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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

长信金利趋势混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	13.62%	1.32%	7.11%	0.84%	6.51%	0.48%
过去三个月	11.43%	1.61%	4.30%	1.18%	7.13%	0.43%
过去六个月	-4.48%	1.56%	-7.80%	1.17%	3.32%	0.39%
过去一年	21.48%	1.39%	-9.27%	0.97%	30.75%	0.42%

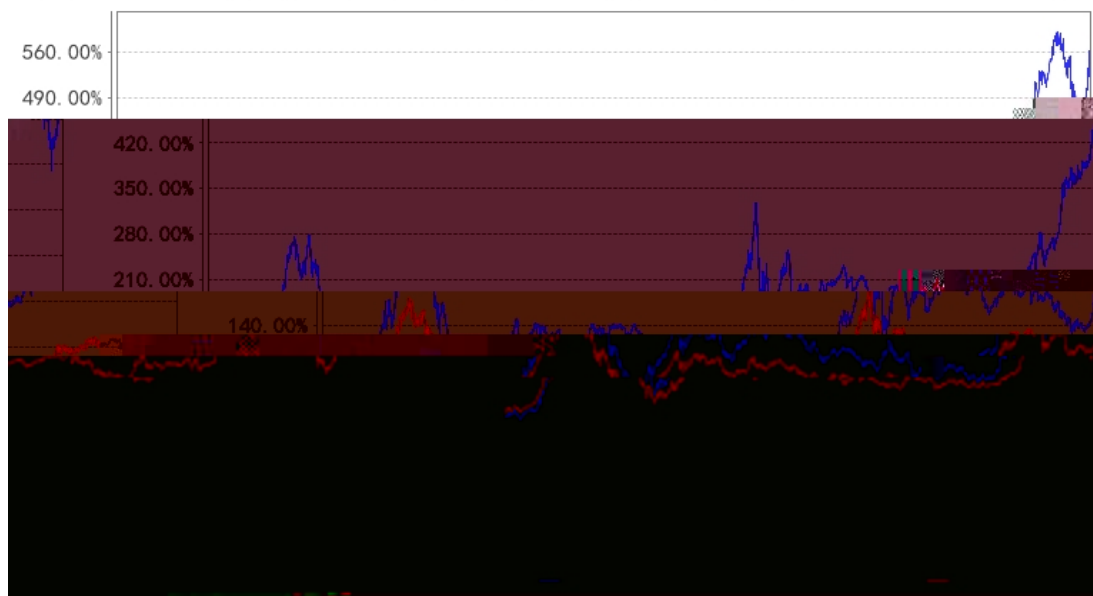
过去三年	130.29%	1.32%	6.58%	0.84%	123.71%	0.48%
自基金合同生效起 至今	558.60%	1.67%	127.66%	1.11%	430.94%	0.56%

长信金利趋势混合 C

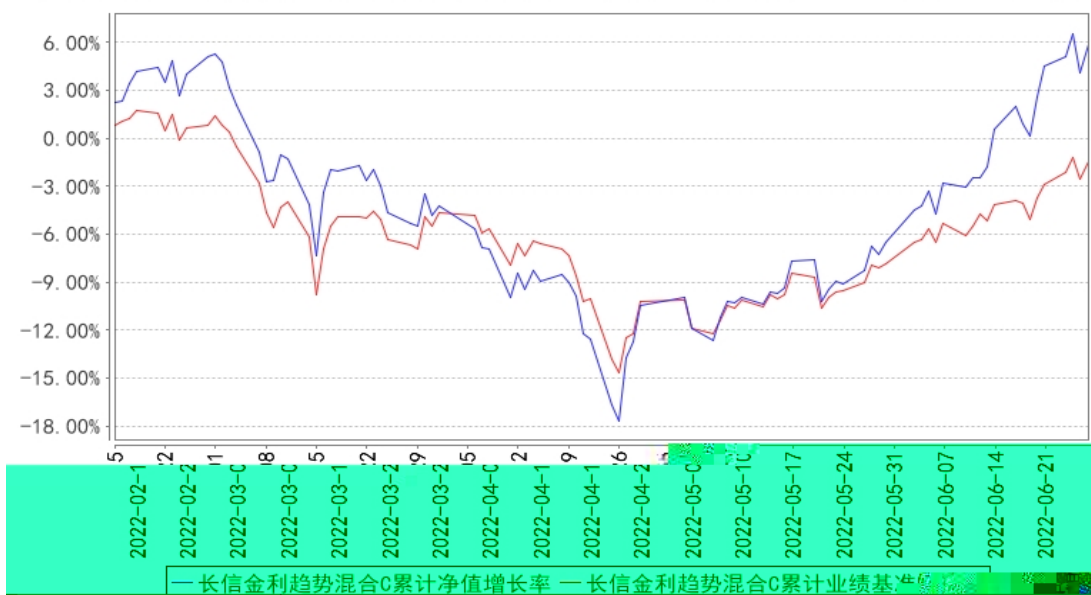
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	13.54%	1.32%	7.11%	0.84%	6.43%	0.48%
过去三个月	11.25%	1.61%	4.30%	1.18%	6.95%	0.43%
自份额增加日起至 今	5.89%	1.63%	-1.42%	1.25%	7.31%	0.38%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

长信金利趋势混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



长信金利趋势混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、基金管理人自 2022 年 2 月 15 日起对长信金利趋势混合型证券投资基金进行份额分类，原有基金份额为 A 类份额，增设 C 类份额。

2、长信金利趋势混合 A 图示日期为 2006 年 4 月 30 日至 2022 年 6 月 30 日，长信金利趋势混合 C 图示日期为 2022 年 2 月 15 日（份额增加日）至 2022 年 6 月 30 日。

3、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，本基金的各项投资比例已符合基金合同的约定。

§ 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验

长信基金管理有限责任公司是经中国证监会证监基金字【2003】63 号文批准，由长江证券股份有限公司、上海海欣集团股份有限公司、武汉钢铁股份有限公司共同发起设立。注册资本 1.65 亿元人民币。目前股权结构为：长江证券股份有限公司占 44.55%、上海海欣集团股份有限公司占 31.21%、武汉钢铁有限公司占 15.15%、上海彤胜投资管理中心（有限合伙）占 4.55%、上海彤骏投资管理中心（有限合伙）占 4.54%。

截至 2022 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 81 只开放式基金，即长信利息收益开放式证券投资基金、长信银利精选混合型证券投资基金、长信金利趋势混合型证券投资基金、长信增利动态策略混合型证券投资基金、长信利丰债券型证券投资基金、长信恒利优势混合型证券投资基金、长信量化先锋混合型证券投资基金、长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金、长信利鑫债券型证券投资基金 (LOF)、长信内需成长混合型证券投资基金、长信可转债债券型证券投资

资基金、长信利众债券型证券投资基金 (LOF)、长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信纯债壹号债券型证券投资基金、长信改革红利灵活配置混合型证券投资基金、长信量化中小盘股票型证券投资基金、长信新利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、长信利盈灵活配置混合型证券投资基金、长信利广灵活配置混合型证券投资基金、长信多利灵活配置混合型证券投资基金、长信睿进灵活配置混合型证券投资基金、长信量化多策略股票型证券投资基金、长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)、长信富民纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信富海纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信利保债券型证券投资基金、长信金葵纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信富全纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信利泰灵活配置混合型证券投资基金、长信利发债券型证券投资基金、长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金、长信富平纯债一年定期开放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、长信创新驱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、长信利信灵活配置混合型证券投资基金、长信稳健纯债债券型证券投资基金、长信国防军工量化灵活配置混合型证券投资基金、长信先优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 500 指数增强型证券投资基金、长信长金通货币市场基金、长信稳通三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金、长信利尚一年定期开放混合型证券投资基金、长信乐信灵活配置混合型证券投资基金、长信全球债券型证券投资基金、长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信消费精选行业量化股票型证券投资基金、长信企业精选两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、长信量化价值驱动混合型证券投资基金、长信价值蓝筹两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、长信稳裕三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信稳进资产配置混合型基金中基金 (FOF)、长信价值优选混合型证券投资基金、长信利率债债券型证券投资基金、长信沪深 300 指数增强型证券投资基金、长信富安纯债半年定期开放债券型证券投资基金、长信合利混合型证券投资基金、长信双利优选混合型证券投资基金、长信富瑞两年定期开放债券型证券投资基金、长信颐天平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金 (FOF)、长信易进混合型证券投资基金、长信先锐混合型证券投资基金、长信稳健精选混合型证券投资基金、长信浦瑞 87 个月定期开放债券型证券投资基金、长信稳利资产配置一年持有期混合型基金中基金 (FOF)、长信消费升级混合型证券投资基金、长信企业优选一年持有期灵活配置混合型证券投资基金、长信稳健均衡 6 个月持有期混合型证券投资基金、长信优质企业混合型证券投资基金、长信内需均衡混合型证券投资基金、长信 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金、长信稳惠债券型证券投资基金、长信稳丰债券型证券投资基金、长信先进装备三个月持有期混合型证券投资基金、长信颐和平衡养老目标三年持有期混合型

基金中基金（FOF）、长信颐年平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、长信稳健增长一年持有期混合型证券投资基金、长信稳健成长混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经 理（助理）期限		证券从 业年限	说明
		任职日 期	离任日期		
高远	长信金利趋势混合型证券投资基金的基金经理、研究发展部总监	2018年8月31日	-	12年	复旦大学经济学博士，具有基金从业资格，中国国籍。2014年加入长信基金管理有限责任公司，历任长信银利精选混合型证券投资基金的基金经理，现任研究发展部总监和长信金利趋势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 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 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析

整体看，2022 年上半年 A 股市场有所回调。期间上证指数下跌 6.63%，沪深 300 指数下跌 9.22%，中小板 100 指数下跌 11.56%，创业板指数下跌 15.41%，中小板和创业板跌幅高于沪深 300。2022 年上半年本基金股票持仓比例保持平稳。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2022 年 6 月 30 日，长信金利趋势混合 A 基金份额净值为 0.4847 元，份额累计净值为 3.8520 元，本报告期内长信金利趋势混合 A 净值增长率为-4.48%，同期业绩比较基准收益率为-7.80%；长信金利趋势混合 C 基金份额净值为 0.4847 元，份额累计净值为 0.6577 元，本报告期内长信金利趋势混合 C 净值增长率为 5.89%，同期业绩比较基准收益率为-1.42%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2022 年下半年经济有望回归到潜在增速的水平。我们看到二季度以来，货币政策先做了降息，对商业银行的信贷也做了鼓励。

随着经济恢复到正常水平，企业盈利的改善可能会比大家想的强硬一些。三季度的这个改善幅度应该会比较强，有点类似于 2020 年新冠疫情发生之后。今年下半年走势仍然可以期待，企业盈利改善有利于 A 股市场呈现上行趋势。

由于我们对市场略偏乐观，在配置上，我们会增加顺周期行业的配置，而对于成长板块，我们会考虑业绩增速和估值的匹配度来进行配置。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据相关法律法规，长信基金管理有限责任公司（以下简称“公司”）制订了健全、有效的估值政策和估值程序，成立了估值委员会，估值委员会是公司基金估值的主要决策机构，负责拟定公司的估值政策、估值方法及采用的估值程序和技术，健全公司估值决策体系，对公司现有程序和技术进行复核和审阅，当发生了影响估值程序和技术的有效性及其适用性的情况及时修订估值程序；估值委员会成员由基金事务部、投资、研究、交易等相关业务部门负责人以及基金事务部至少一名业务骨干共同组成。相关参与人员都具有丰富的证券行业工作经验，熟悉相关法规和估值方法，均具备估值业务所需的专业胜任能力。基金经理不直接参与估值决策，估值决策由与会估值工作小组成员 1/2 以上多数票通过。对于估值政策和估值原则，公司与基金托管人充分沟通，达成一致意见。审计本基金的会计师事务所认可公司基金估值政策和程序的适当性。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据以及流通受限股票的折扣率

。参与估值流程各方不存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人根据相关法律法规和本基金基金合同约定已于 2022 年 4 月 27 日进行了利润分配，A 类份额每 10 份基金份额派发红利 1.740 元，C 类份额每 10 份基金份额派发红利 1.730 元。

4.8 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

无。

§ 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

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对长信金利趋势混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《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、托管协议的规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人依照《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、托管协议的规定，对长信金利趋势混合型证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由长信基金管理有限责任公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在本托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：长信金利趋势混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	437,219,913.31	166,719,076.24

结算备付金		12,696,622.33	7,615,854.77
存出保证金		3,199,123.41	910,765.01
交易性金融资产	6.4.7.2	4,793,236,120.55	1,948,475,227.47
其中：股票投资		4,711,860,997.26	1,867,075,027.47
基金投资		-	-
债券投资		81,375,123.29	81,400,200.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		11,177,697.54	31,756,911.73
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	2,126,515.81
资产总计		5,257,529,477.14	2,157,604,351.03
负债和净资产	附注号	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		140,822,785.54	54,524,713.89
应付赎回款		1,571,050.23	1,043,994.30
应付管理人报酬		5,776,435.38	2,311,430.68
应付托管费		962,739.23	385,238.48
应付销售服务费		347,818.59	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	1.16
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	8,963,840.62	4,607,364.66
负债合计		158,444,669.59	62,872,743.17
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	4,338,229,198.77	1,163,960,742.47
其他综合收益	6.4.7.11	-	-

未分配利润	6.4.7.12	760,855,608.78	930,770,865.39
净资产合计		5,099,084,807.55	2,094,731,607.86
负债和净资产总计		5,257,529,477.14	2,157,604,351.03

注：1、报告截止日 2022 年 6 月 30 日，长信金利趋势混合 A 份额净值 0.4847 元，长信金利趋势混合 C 份额净值 0.4847 元，基金份额总额为 10,520,218,227.95 份，其中长信金利趋势混合 A 份额 8,877,627,410.20 份，长信金利趋势混合 C 份额 1,642,590,817.75 份。

2、以下比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的资产负债表格式的要求进行列示：2021 年年度报告资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在 2022 年中期报告资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，2021 年年度报告资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在 2022 年中期报告资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

6.2 利润表

会计主体：长信金利趋势混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-181,296,681.57	126,870,386.06
1. 利息收入		1,124,671.42	2,500,791.18
其中：存款利息收入	6.4.7.13	1,124,671.42	1,149,067.97
债券利息收入		-	1,351,723.21
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-481,077,661.24	219,908,160.28
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-500,317,283.62	208,307,618.29
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	1,415,008.81	1,645,008.72
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-

股利收益	6.4.7.19	17,824,613.57	9,955,533.27
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	298,356,052.88	-96,087,428.46
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	300,255.37	548,863.06
减：二、营业总支出		36,689,250.39	26,315,593.67
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	30,257,543.65	12,263,775.45
2. 托管费	6.4.10.2.2	5,042,924.00	2,043,962.61
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	1,262,954.31	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		1.45	18.33
8. 其他费用	6.4.7.23	125,826.98	12,007,837.28
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-217,985,931.96	100,554,792.39
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-217,985,931.96	100,554,792.39
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-217,985,931.96	100,554,792.39

注：以下比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的利润表格式的要求进行列示；2021 年中期报告利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在 2022 年中期报告利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：长信金利趋势混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计

一、上期期末净资产（基金净值）	1,163,960,742.47	-	930,770,865.39	2,094,731,607.86
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	1,163,960,742.47	-	930,770,865.39	2,094,731,607.86
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	3,174,268,456.30	-	-169,915,256.61	3,004,353,199.69
（一）、综合收益总额	-	-	-217,985,931.96	-217,985,931.96
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	3,174,268,456.30	-	1,588,359,838.96	4,762,628,295.26
其中：1. 基金申购款	3,374,106,699.07	-	1,672,407,645.02	5,046,514,344.09
2. 基金赎回款	-199,838,242.77	-	-84,047,806.06	-283,886,048.83
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-1,540,289,163.61	-1,540,289,163.61
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	4,338,229,198.77	-	760,855,608.78	5,099,084,807.55
项目	上年度可比期间			

	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	932,796,976.21	-	813,115,058.69	1,745,912,034.90
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	932,796,976.21	-	813,115,058.69	1,745,912,034.90
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	83,859,572.37	-	-391,265,049.07	-307,405,476.70
（一）、综合收益总额	-	-	100,554,792.39	100,554,792.39
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	83,859,572.37	-	43,160,128.61	127,019,700.98
其中：1. 基金申购款	357,281,795.14	-	213,253,864.85	570,535,659.99
2. 基金赎回款	-273,422,222.77	-	-170,093,736.24	-443,515,959.01
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-534,979,970.07	-534,979,970.07
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	1,016,656,548.58	-	421,850,009.62	1,438,506,558.20

净值)				
-----	--	--	--	--

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

刘元瑞	覃波	孙红辉
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

长信金利趋势混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2005]168号文《关于同意长信金利趋势价值股票型证券投资基金募集申请的批复》的核准，由基金管理人长信基金管理有限责任公司向社会公开发行募集，基金合同于2006年4月30日正式生效，首次设立募集规模为613,254,516.24份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为长信基金管理有限责任公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

根据自2014年8月8日起实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》的有关规定，经与基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案，自2015年8月7日起本基金更名为长信金利趋势混合型证券投资基金。

本基金的投资范围为：具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行、上市的股票、存托凭证、债券以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。其中债券包括国债、金融债、公司债券、企业债券、可转换债券等。

本基金投资组合的比例范围为：股票类资产投资比例为60-95%，债券类资产投资比例为0-35%，货币市场工具投资比例为5-15%。

2021年7月1日前，本基金的业绩比较基准为：上证A股指数×70%+中证综合债指数×30%；自2021年7月1日起，本基金业绩比较基准为：中证800指数收益率×80%+中债综合指数收益率×20%。

根据本基金管理人于2022年2月11日发布的《长信基金管理有限责任公司关于长信金利趋势混合型证券投资基金增设C类基金份额相关事项的公告》，从2022年2月15日起，本基金增设C类份额，长信金利趋势混合C的年销售服务费率为0.60%。本基金分类后，原有基金份额将自动划归为本基金A类基金份额，长信金利趋势混合A不收取销售服务费。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

除下述变更后的会计政策外，本基金报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

6.4.4.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期

损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；

保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

6.4.4.3 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 其他收入在本基金履行了基金合同中的履约义务，即在客户取得服务控制权时确认收入。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理，根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与现行准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

于首次执行日（2022 年 1 月 1 日），原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 166,719,076.24 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 37,633.21 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 166,756,709.45 元。

结算备付金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 7,615,854.77 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 3,427.20 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，结算备付金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 7,619,281.97 元。

存出保证金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 910,765.01 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 409.80 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，存出保证金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 911,174.81 元。

应收申购款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 31,756,911.73 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 3,958.11 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，应收申购款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 31,760,869.84 元。

应收利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 2,126,515.81 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 37,633.21 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 3,427.20 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 409.80 元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币 2,081,087.49 元，转出至应收申购款的重分类金额为人民币 3,958.11 元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产：

交易性金融资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 1,948,475,227.47 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 2,081,087.49 元。经上述重分类后，交易性金融资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 1,950,556,314.96 元。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产和金融负债项目无影响。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。

上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

6.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事

业费附加的单位外)及地方教育费附加。。

6.4.6.4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定,自2004年1月1日起,对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入,继续免征企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定,对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

6.4.6.5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定,自2008年10月9日起,对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税;

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定,自2013年1月1日起,证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税;

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定,自2015年9月8日起,证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限超过1年的,股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末
	2022 年 6 月 30 日
活期存款	437,219,913.31
等于：本金	437,173,420.93
加：应计利息	46,492.38
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	437,219,913.31

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末				
	2022 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	4,242,682,325.30	-	4,711,860,997.26	469,178,671.96	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	-	
	银行间市场	80,254,520.00	863,123.29	81,375,123.29	257,480.00
	合计	80,254,520.00	863,123.29	81,375,123.29	257,480.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	4,322,936,845.30	863,123.29	4,793,236,120.55	469,436,151.96	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末无其他债权投资。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金本报告期末无其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

本报告期末本基金未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	4,743.44
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	8,635,658.83
其中：交易所市场	8,635,658.83
银行间市场	-
应付利息	-
预提账户维护费	9,300.00
预提审计费	134,630.98
预提信息披露费	179,507.37
合计	8,963,840.62

注：应付赎回费中含应付转出费。

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

长信金利趋势混合 A

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,822,651,154.65	1,163,960,742.47
本期申购	6,435,641,420.07	2,653,845,791.21
本期赎回（以“-”号填列）	-380,665,164.52	-156,972,465.34
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	8,877,627,410.20	3,660,834,068.34

长信金利趋势混合 C

项目	本期 2022 年 2 月 15 日（份额增加日）至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	1,746,535,946.14	720,260,907.86
本期赎回（以“-”号填列）	-103,945,128.39	-42,865,777.43
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,642,590,817.75	677,395,130.43

注：1、申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

2、根据 2022 年 2 月 11 日发布的《长信基金管理有限责任公司关于长信金利趋势混合型证券投资基金增设 C 类基金份额相关事项的公告》，本基金于 2022 年 2 月 15 日进行份额分类，原有基金份额为 A 类份额，增设 C 类份额。

6.4.7.11 其他综合收益

本基金本报告期无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

长信金利趋势混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	873,939,093.58	56,831,771.81	930,770,865.39
本期利润	-456,571,883.36	219,841,611.81	-236,730,271.55
本期基金份额交易产生的变动数	1,480,784,596.66	-213,431,337.31	1,267,353,259.35
其中：基金申购款	1,570,174,131.34	-229,673,971.35	1,340,500,159.99
基金赎回款	-89,389,534.68	16,242,634.04	-73,146,900.64
本期已分配利润	-1,319,387,594.08	-	-1,319,387,594.08

本期末	578,764,212.80	63,242,046.31	642,006,259.11
-----	----------------	---------------	----------------

长信金利趋势混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-	-	-
本期利润	-59,770,101.48	78,514,441.07	18,744,339.59
本期基金份额交易产生的变动数	347,463,503.49	-26,456,923.88	321,006,579.61
其中：基金申购款	359,846,842.00	-27,939,356.97	331,907,485.03
基金赎回款	-12,383,338.51	1,482,433.09	-10,900,905.42
本期已分配利润	-220,901,569.53	-	-220,901,569.53
本期末	66,791,832.48	52,057,517.19	118,849,349.67

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
活期存款利息收入	863,095.50
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	126,181.28
其他	135,394.64
合计	1,124,671.42

注：“其他存款利息收入”项为存出保证金利息和申购款利息之和。

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	9,260,105,473.92
减：卖出股票成本总额	9,732,990,147.63
减：交易费用	27,432,609.91
买卖股票差价收入	-500,317,283.62

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	1,198,475.29
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	216,533.52
债券投资收益——赎回差价收入	-

债券投资收益——申购差价收入	-
合计	1,415,008.81

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,025,226.22
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	808,200.00
减：应计利息总额	451.71
减：交易费用	40.99
买卖债券差价收入	216,533.52

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无债券赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无债券申购差价收入。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期末无资产支持证券投资收益。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无买卖权证差价收入。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无其他衍生工具投资收益。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	17,824,613.57
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-

合计	17,824,613.57
----	---------------

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
1. 交易性金融资产	298,356,052.88
股票投资	298,436,052.88
债券投资	-80,000.00
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	298,356,052.88

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
基金赎回费收入	299,690.45
基金转换费收入	564.92
合计	300,255.37

注：本基金的赎回费用在投资人赎回本基金份额时收取，其中对持续持有期少于7日的投资者收取的赎回费应全额计入基金财产，其余赎回费扣除注册登记费和其他手续费后的余额为赎回费总额的25%，归入基金财产。

6.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
审计费用	44,630.98
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	18,600.00
其他费用	3,088.63
合计	125,826.98

注：“其他费用”为划款手续费和股东账户开户费。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方无变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
长信基金管理有限责任公司（“长信基金”）	基金管理人、基金销售机构
上海浦东发展银行股份有限公司（“浦发银行”）	基金托管人、基金销售机构
长江证券股份有限公司（“长江证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例(%)
长江证券	8,579,885,985.22	39.87	1,289,040,221.87	14.50

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
长江证券	7,990,419.67	49.00	4,776,891.64	55.32
关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
长江证券	1,200,484.30	18.75	758,755.17	24.69

注：上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6 月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021 年6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	30,257,543.65
其中：支付销售机构的客户维护费	3,721,141.78	2,668,364.26

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.5% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{基金管理费率} / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6 月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021 年6月30日
	当期发生的基金应支付的托管费	5,042,924.00

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{基金托管费率} / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长信金利趋势混合 A	长信金利趋势混合 C	合计
长信基金	-	1,034,269.18	1,034,269.18
合计	-	1,034,269.18	1,034,269.18
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长信金利趋势混合 A	长信金利趋势混合 C	合计
长信基金	-	-	-
合计	-	-	-

注：1、本基金于 2022 年 2 月 15 日起增设 C 类份额，原有基金份额将自动划归为本基金 A 类基金份额。

2、本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.6%。C 类基金份额的基金销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.6% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times C \text{ 类基金销售服务费年费率} / \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金在本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过银行间同业市场进行债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费

率的证券出借业务的情况

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月 30日	本期 2022年2月15日（份额增加 日）至2022年6月30日
	长信金利趋势混合 A	长信金利趋势混合 C
基金合同生效日（2006年4月30日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	0.00	-
报告期间申购/买入总份额	958,680.97	-
报告期间因拆分变动份额	0.00	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	-
报告期末持有的基金份额	958,680.97	-
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.01%	-
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月 30日	上年度可比期间 -
	长信金利趋势混合 A	长信金利趋势混合 C
基金合同生效日（2006年4月30日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	-

注：基金管理人运用自有资金投资本基金费率按本基金招募说明书中公布的费率执行。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末及上年度末均未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
浦发银行	437,219,913.31	863,095.50	40,103,213.05	1,076,265.22

注：本基金用于证券交易结算的资金通过本基金托管人的基金托管结算资金专用存款账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息。于2022年06月30日的相关余额在资产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示（2021年6月30日：同）。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期及上年度可比期间均未在承销期内购入由关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

长信金利趋势混合 A								
序号	权益 登记日	除息日		每 10 份基 金份额分红 数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润 分配合计	备注
		场内	场外					
1	2022年4月27日	-	2022年4月27日	1.740	1,032,338,897.21	287,048,696.87	1,319,387,594.08	-
合计	-	-	-	1.740	1,032,338,897.21	287,048,696.87	1,319,387,594.08	-
长信金利趋势混合 C								
序号	权益 登记日	除息日		每 10 份基 金份额分红 数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润 分配合计	备注
		场内	场外					
1	2022年4月27日	-	2022年4月27日	1.730	205,279,197.84	15,622,371.69	220,901,569.53	-
合计	-	-	-	1.730	205,279,197.84	15,622,371.69	220,901,569.53	-

6.4.12 期末(2022年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	受限期	流通受 限类型	认购 价格	期末估 值单价	数量 (单位: 股)	期末 成本总额	期末估值总 额	备注

300834	星辉环材	2022年1月6日	6个月	新股未上市	55.57	30.03	635	35,286.95	19,069.05	-
301097	天益医疗	2022年3月25日	6个月	新股未上市	52.37	47.83	249	13,040.13	11,909.67	-
301102	兆讯传媒	2022年3月15日	6个月	新股未上市	39.88	31.09	642	25,602.96	19,959.78	-
301103	何氏眼科	2022年3月14日	6个月	新股未上市	42.50	32.02	507	16,575.00	16,234.14	-
301110	青木股份	2022年3月4日	6个月	新股未上市	63.10	39.85	202	12,746.20	8,049.70	-
301116	益客食品	2022年1月10日	6个月	新股未上市	11.40	20.46	577	6,577.80	11,805.42	-
301122	采纳股份	2022年1月19日	6个月	新股未上市	50.31	70.37	301	15,143.31	21,181.37	-
301123	奕东电子	2022年1月14日	6个月	新股未上市	37.23	25.39	656	24,422.88	16,655.84	-
301130	西点药业	2022年2月16日	6个月	新股未上市	22.55	37.70	237	5,344.35	8,934.90	-
301158	德石股份	2022年1月7日	6个月	新股未上市	15.64	20.38	379	5,927.56	7,724.02	-
301181	标榜股份	2022年2月11日	6个月	新股未上市	40.25	30.59	257	10,344.25	7,861.63	-
301196	唯科科技	2022年1月4日	6个月	新股未上市	64.08	37.52	271	17,365.68	10,167.92	-
301201	诚达药业	2022年1月12日	6个月	新股未上市	72.69	71.54	353	25,659.57	25,253.62	-
301207	华兰疫苗	2022年2月10日	6个月	新股未上市	56.88	56.42	569	32,364.72	32,102.98	-
301217	铜冠铜箔	2022年1月	6个月	新股未上市	17.27	14.83	4,284	73,984.68	63,531.72	-

		20 日									
301219	腾远 钴业	2022 年 3 月 10 日	6 个月	新股未 上市	173.98	87.82	578	55,847.58	50,759.96		-
301222	浙江 恒威	2022 年 3 月 2 日	6 个月	新股未 上市	33.98	28.96	332	11,281.36	9,614.72		-
301228	实朴 检测	2022 年 1 月 21 日	6 个月	新股未 上市	20.08	20.34	373	7,489.84	7,586.82		-
301236	软通 动力	2022 年 3 月 8 日	6 个月	新股未 上市	72.88	31.38	2,076	100,865.92	65,144.88		-
301237	和顺 科技	2022 年 3 月 16 日	6 个月	新股未 上市	56.69	41.86	261	14,796.09	10,925.46		-
301258	富士 莱	2022 年 3 月 21 日	6 个月	新股未 上市	48.30	41.68	295	14,248.50	12,295.60		-
301263	泰恩 康	2022 年 3 月 22 日	6 个月	新股未 上市	19.93	31.38	682	13,592.26	21,401.16		-
688062	迈威 生物	2022 年 1 月 6 日	6 个月	新股未 上市	34.80	16.78	27,002	939,669.60	453,093.56		-
688171	纬德 信息	2022 年 1 月 20 日	6 个月	新股未 上市	28.68	22.77	2,821	80,906.28	64,234.17		-
688282	理工 导航	2022 年 3 月 10 日	6 个月	新股未 上市	65.21	45.37	3,185	207,693.85	144,503.45		-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有的暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的融出证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括：信用风险、流动性风险和市场风险。

本基金在下文主要论述上述风险敞口及其形成原因、风险管理目标、政策和过程以及计量风险的方法等。

本基金的基金管理人从事风险管理的目标是使本基金在风险和收益之间取得适当的平衡，以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。基于该风险管理目标，本基金的基金管理人已制定了政策和程序来辨别和分析这些风险，设定适当的风险限额并设计相应的内部控制程序，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人奉行全面风险管理体系理念，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。在董事会下设立风险控制委员会，负责对公司经营管理和基金业务运作的合法性、合规性进行全面的检查和评估等；在管理层层面设立内部控制委员会，主要职责是讨论审议公司内部控制制度及针对公司在经营管理和投资组合运作中的风险进行识别、评估并研究制订有效的防范措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部负责协调并与各部门合作完成运作风险管理工作，战略与产品研发部负责进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部向督察长负责，并向总经理汇报日常行政事务。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的银行存款存放在本基金的托管人上海浦东发展银行股份有限公司，与该银行存款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流程，本基金投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并采用券款对付交割方式以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	808,200.00
未评级	81,375,123.29	80,592,000.00
合计	81,375,123.29	81,400,200.00

注：未评级债券为国债、央行票据及政策性金融债等无信用评级债券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时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源于开放式基金每日兑付赎回资金的流动性风险，以及因部分投资品种交易不活跃而出现的变现风险和因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理价格变现投资的风险。

6.4.13.3.1 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严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式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控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，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，所持证券均在证券交易所或银行间同业市场交易，并严格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良好流动性的金融工具，基金管理人流动性指标进行持续的监测和分析，定期开展压力测试，评估在不同的压力情境下资产变现情况的变化。

基金管理人持续监测本基金开放期内的赎回情况，当市场环境或投资者结构发生变化时，及时调整投资组合资产结构及比例，保持基金资产可变现规模和期限与负债赎回规模和期限的匹配。

同时，针对兑付赎回资金的流动性风险，基金管理人在基金合同中约定了巨额赎回条款，制定了发生巨额赎回时资金的处理模式，控制因开放模式而产生的流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年6月30 日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	437,219,913.31	-	-	-	-	437,219,913.31
结算备付金	12,696,622.33	-	-	-	-	12,696,622.33
存出保证金	3,199,123.41	-	-	-	-	3,199,123.41
交易性金融资产	-	81,375,123.29	-	-	4,711,860,997.26	4,793,236,120.55
应收申购款	-	-	-	-	11,177,697.54	11,177,697.54
资产总计	453,115,659.05	81,375,123.29	-	-	4,723,038,694.80	5,257,529,477.14
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	1,571,050.23	1,571,050.23
应付管理人报酬	-	-	-	-	5,776,435.38	5,776,435.38
应付托管费	-	-	-	-	962,739.23	962,739.23
应付清算款	-	-	-	-	140,822,785.54	140,822,785.54
应付销售服务费	-	-	-	-	347,818.59	347,818.59
其他负债	-	-	-	-	8,963,840.62	8,963,840.62
负债总计	-	-	-	-	158,444,669.59	158,444,669.59
利率敏感度缺	453,115,659.05	81,375,123.29	-	-	-4,564,594.00	5,099,084.80

口	05				25.21	7.55
上年度末 2021 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	166,719,076.24	-	-	-	-	166,719,076.24
结算备付金	7,615,854.77	-	-	-	-	7,615,854.77
存出保证金	910,765.01	-	-	-	-	910,765.01
交易性金融资产	-	808,200.00	80,592,000.00	-	1,867,075,027.47	1,948,475,227.47
应收申购款	30,714,705.77	-	-	-	1,042,205.96	31,756,911.73
其他资产	-	-	-	-	2,126,515.81	2,126,515.81
资产总计	205,960,401.79	808,200.00	80,592,000.00	-	1,870,243,749.24	2,157,604,351.03
负债						
应付证券清算款	-	-	-	-	54,524,713.89	54,524,713.89
应付赎回款	-	-	-	-	1,043,994.30	1,043,994.30
应付管理人报酬	-	-	-	-	2,311,430.68	2,311,430.68
应付托管费	-	-	-	-	385,238.48	385,238.48
应交税费	-	-	-	-	1.16	1.16
其他负债	-	-	-	-	4,607,364.66	4,607,364.66
负债总计	-	-	-	-	62,872,743.17	62,872,743.17
利率敏感度缺口	205,960,401.79	808,200.00	80,592,000.00	-	1,807,371,006.07	2,094,731,607.86

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）		
	本期末（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）	
分析	市场利率下降 27 个基点	140,238.28	248,755.04

	市场利率上升 27 个基点	-140,238.28	-248,755.04
--	---------------	-------------	-------------

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券以及银行间同业市场交易的债券，所面临的最大其他价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 等指标来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

于 6 月 30 日，本基金面临的其他市场价格风险列示如下：

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 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 (%)
交易性金融资产—股票投资	4,711,860,997.26	92.41	1,867,075,027.47	89.13
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	81,375,123.29	1.60	81,400,200.00	3.89
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	4,793,236,120.55	94.00	1,948,475,227.47	93.02

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	在 95% 的置信区间内，基金资产组合的市场价格风险		
相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）		
	本期末（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月	

			31 日)
分析	VaR 值为 4.63%(2021 年 12 月 31 日 VaR 值为 5.52%)	-235,897,873.80	-115,668,894.43

注：上述风险价值 VaR 的分析是基于资产负债表日所持证券过去一年市场价格波动情况而有可能发生的最大损失，且此变动适用于本基金所有的衍生金融工具及非衍生金融工具。取 95%的置信度是基于本基金所持有的金融工具风险度量的要求。2021 年的分析同样基于该假设。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	4,710,740,995.72	1,788,185,393.84
第二层次	81,375,123.29	82,653,439.55
第三层次	1,120,001.54	77,636,394.08
合计	4,793,236,120.55	1,948,475,227.47

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	4,711,860,997.26	89.62
	其中：股票	4,711,860,997.26	89.62
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	81,375,123.29	1.55
	其中：债券	81,375,123.29	1.55
	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	449,916,535.64	8.56
8	其他各项资产	14,376,820.95	0.27
9	合计	5,257,529,477.14	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。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	3,455,773,549.60	67.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	96,480,000.00	1.89

E	建筑业	67,764,000.00	1.33
F	批发和零售业	95,059.14	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	113,464,834.91	2.23
H	住宿和餐饮业	74,399,305.60	1.46
I	信息传输、软件和信息技术服务业	168,334,648.81	3.30
J	金融业	492,157,794.82	9.65
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	94,435,459.78	1.85
M	科学研究和技术服务业	52,024,074.82	1.02
N	水利、环境和公共设施管理业	4,035.64	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	22,401,234.14	0.44
R	文化、体育和娱乐业	74,527,000.00	1.46
S	综合	-	-
	合计	4,711,860,997.26	92.41

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末通过港股通交易机制投资港股。

7.3 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

金额单位：人民币元

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	600519	贵州茅台	139,833	285,958,485.00	5.61
2	002180	纳思达	5,590,800	283,006,296.00	5.55
3	300316	晶盛机电	3,000,300	202,790,277.00	3.98
4	600438	通威股份	2,800,000	167,608,000.00	3.29
5	600030	中信证券	6,500,061	140,791,321.26	2.76
6	000776	广发证券	7,357,600	137,587,120.00	2.70
7	000568	泸州老窖	553,203	136,386,667.62	2.67
8	000858	五粮液	650,000	131,254,500.00	2.57
9	603019	中科曙光	4,008,796	116,335,259.92	2.28
10	300682	朗新科技	4,400,093	110,838,342.67	2.17
11	000902	新洋丰	5,985,332	101,092,257.48	1.98
12	603659	璞泰来	1,100,003	92,840,253.20	1.82
13	600521	华海药业	4,000,000	90,800,000.00	1.78
14	002709	天赐材料	1,400,030	86,885,861.80	1.70
15	601888	中国中免	350,000	81,525,500.00	1.60
16	300750	宁德时代	150,000	80,100,000.00	1.57
17	600905	三峡能源	12,000,000	75,480,000.00	1.48
18	600258	首旅酒店	2,999,972	74,399,305.60	1.46

19	601567	三星医疗	5,502,600	73,074,528.00	1.43
20	002705	新宝股份	3,301,000	72,588,990.00	1.42
21	600919	江苏银行	10,000,000	71,200,000.00	1.40
22	002006	精功科技	2,200,553	65,422,440.69	1.28
23	300820	英杰电气	1,000,000	64,550,000.00	1.27
24	601702	华峰铝业	4,805,400	63,431,280.00	1.24
25	600660	福耀玻璃	1,500,000	62,715,000.00	1.23
26	601717	郑煤机	4,205,900	60,607,019.00	1.19
27	000768	中航西飞	2,000,000	60,580,000.00	1.19
28	600456	宝钛股份	1,000,000	59,400,000.00	1.16
29	600999	XD 招商证	4,000,012	57,640,172.92	1.13
30	600009	上海机场	1,000,000	56,700,000.00	1.11
31	300122	智飞生物	500,000	55,505,000.00	1.09
32	002507	涪陵榨菜	1,600,011	55,232,379.72	1.08
33	601238	广汽集团	3,614,100	55,078,884.00	1.08
34	600690	海尔智家	2,000,000	54,920,000.00	1.08
35	603185	上机数控	349,860	54,574,661.40	1.07
36	300007	汉威科技	3,000,000	53,970,000.00	1.06
37	603259	药明康德	500,000	51,995,000.00	1.02
38	300059	东方财富	2,000,000	50,800,000.00	1.00
39	688122	西部超导	550,000	50,710,000.00	0.99
40	002466	天齐锂业	400,000	49,920,000.00	0.98
41	600409	三友化工	6,070,300	49,715,757.00	0.97
42	601668	中国建筑	9,200,000	48,944,000.00	0.96
43	002475	立讯精密	1,400,000	47,306,000.00	0.93
44	603456	九洲药业	900,000	46,530,000.00	0.91
45	000786	北新建材	1,300,000	45,006,000.00	0.88
46	600779	水井坊	483,500	44,743,090.00	0.88
47	600760	中航沈飞	725,798	43,874,489.10	0.86
48	603517	绝味食品	700,000	40,474,000.00	0.79
49	601878	浙商证券	2,999,928	34,139,180.64	0.67
50	601615	明阳智能	1,000,000	33,800,000.00	0.66
51	002850	科达利	200,000	31,800,000.00	0.62
52	300144	宋城演艺	2,000,000	30,700,000.00	0.60
53	600029	南方航空	4,000,000	29,240,000.00	0.57
54	600309	万华化学	300,000	29,097,000.00	0.57
55	002063	远光软件	4,000,013	28,120,091.39	0.55
56	601012	隆基绿能	420,000	27,984,600.00	0.55
57	002555	三七互娱	1,298,900	27,575,647.00	0.54
58	600104	上汽集团	1,500,000	26,715,000.00	0.52
59	300696	爱乐达	599,948	26,367,714.60	0.52
60	600487	亨通光电	1,800,000	26,172,000.00	0.51

61	600115	中国东航	4,589,959	25,198,874.91	0.49
62	300751	迈为股份	49,975	24,532,727.50	0.48
63	300413	芒果超媒	700,000	23,352,000.00	0.46
64	300015	爱尔眼科	500,000	22,385,000.00	0.44
65	600886	国投电力	2,000,000	21,000,000.00	0.41
66	002739	万达电影	1,500,000	20,475,000.00	0.40
67	601117	中国化学	2,000,000	18,820,000.00	0.37
68	600741	华域汽车	800,000	18,400,000.00	0.36
69	002304	洋河股份	100,000	18,315,000.00	0.36
70	002415	海康威视	500,000	18,100,000.00	0.35
71	605123	派克新材	100,000	14,072,000.00	0.28
72	300360	炬华科技	1,000,000	13,340,000.00	0.26
73	600138	中青旅	1,000,000	12,890,000.00	0.25
74	300337	银邦股份	1,000,000	11,030,000.00	0.22
75	300861	美畅股份	100,000	9,269,000.00	0.18
76	300855	图南股份	150,000	6,268,500.00	0.12
77	300775	三角防务	111,100	5,349,465.00	0.10
78	601966	玲珑轮胎	200,000	5,074,000.00	0.10
79	000970	中科三环	196,900	3,697,782.00	0.07
80	600004	白云机场	156,000	2,325,960.00	0.05
81	000997	新大陆	125,900	1,663,139.00	0.03
82	688062	迈威生物	27,002	453,093.56	0.01
83	688167	炬光科技	2,014	299,582.50	0.01
84	688282	理工导航	3,185	144,503.45	0.00
85	301236	软通动力	2,076	65,144.88	0.00
86	688171	纬德信息	2,821	64,234.17	0.00
87	301217	铜冠铜箔	4,284	63,531.72	0.00
88	301177	迪阿股份	792	58,766.40	0.00
89	301219	腾远钴业	578	50,759.96	0.00
90	301207	华兰疫苗	569	32,102.98	0.00
91	301201	诚达药业	353	25,253.62	0.00
92	301069	凯盛新材	539	24,853.29	0.00
93	301096	百诚医药	272	21,488.00	0.00
94	301263	泰恩康	682	21,401.16	0.00
95	605117	德业股份	76	21,271.64	0.00
96	301122	采纳股份	301	21,181.37	0.00
97	301102	兆讯传媒	642	19,959.78	0.00
98	300834	星辉环材	635	19,069.05	0.00
99	301101	明月镜片	371	19,043.43	0.00
100	301123	奕东电子	656	16,655.84	0.00
101	301103	何氏眼科	507	16,234.14	0.00
102	301166	优宁维	253	14,891.58	0.00

103	301168	通灵股份	329	14,831.32	0.00
104	301189	奥尼电子	435	14,489.85	0.00
105	301190	善水科技	575	13,644.75	0.00
106	301100	风光股份	599	12,926.42	0.00
107	301199	迈赫股份	402	12,880.08	0.00
108	301258	富士莱	295	12,295.60	0.00
109	301097	天益医疗	249	11,909.67	0.00
110	301116	益客食品	577	11,805.42	0.00
111	301237	和顺科技	261	10,925.46	0.00
112	301196	唯科科技	271	10,167.92	0.00
113	301222	浙江恒威	332	9,614.72	0.00
114	301130	西点药业	237	8,934.90	0.00
115	301138	华研精机	285	8,763.75	0.00
116	301193	家联科技	297	8,063.55	0.00
117	301110	青木股份	202	8,049.70	0.00
118	301181	标榜股份	257	7,861.63	0.00
119	301158	德石股份	379	7,724.02	0.00
120	301228	实朴检测	373	7,586.82	0.00
121	603150	万朗磁塑	250	7,442.50	0.00
122	301182	凯旺科技	294	6,985.44	0.00
123	300814	中富电路	328	6,002.40	0.00
124	301083	百胜智能	416	5,807.36	0.00
125	300854	中兰环保	203	4,035.64	0.00
126	603306	华懋科技	116	3,932.40	0.00
127	301079	邵阳液压	140	3,472.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600030	中信证券	364,390,669.78	17.40
2	600519	贵州茅台	263,519,964.43	12.58
3	002180	纳思达	253,846,068.54	12.12
4	000858	五粮液	249,304,219.08	11.90
5	300682	朗新科技	203,176,700.38	9.70
6	000997	新大陆	177,399,929.38	8.47
7	600438	通威股份	174,892,387.25	8.35
8	002555	三七互娱	174,617,643.32	8.34
9	300316	晶盛机电	174,275,816.85	8.32
10	000333	美的集团	173,130,519.35	8.27
11	000568	泸州老窖	172,589,303.80	8.24
12	601888	中国中免	172,240,321.23	8.22

13	603806	福斯特	171,408,878.50	8.18
14	600809	山西汾酒	170,726,718.94	8.15
15	300750	宁德时代	167,176,532.36	7.98
16	601117	中国化学	163,255,199.82	7.79
17	000776	广发证券	147,734,088.00	7.05
18	002738	中矿资源	147,667,391.85	7.05
19	605117	德业股份	143,173,235.28	6.83
20	601985	中国核电	142,038,704.27	6.78
21	300337	银邦股份	137,139,331.00	6.55
22	300531	优博讯	132,238,259.70	6.31
23	000988	华工科技	132,155,519.62	6.31
24	601012	隆基绿能	127,742,351.68	6.10
25	002756	永兴材料	127,042,337.82	6.06
26	300590	移为通信	124,808,123.00	5.96
27	300059	东方财富	119,547,422.72	5.71
28	600690	海尔智家	115,692,069.08	5.52
29	688122	西部超导	113,439,699.13	5.42
30	600409	三友化工	108,850,393.30	5.20
31	603260	合盛硅业	107,729,550.36	5.14
32	603019	中科曙光	106,986,559.55	5.11
33	000902	新洋丰	106,054,917.11	5.06
34	300144	宋城演艺	103,668,661.40	4.95
35	002540	亚太科技	103,030,851.52	4.92
36	002008	大族激光	98,548,356.25	4.70
37	002304	洋河股份	98,277,733.00	4.69
38	601211	国泰君安	97,812,993.07	4.67
39	600760	中航沈飞	96,180,100.69	4.59
40	603799	华友钴业	94,552,468.03	4.51
41	600521	华海药业	94,544,345.79	4.51
42	601717	郑煤机	94,317,302.94	4.50
43	601398	工商银行	93,488,929.00	4.46
44	300122	智飞生物	93,379,818.40	4.46
45	002063	远光软件	92,705,204.82	4.43
46	000977	浪潮信息	91,441,133.36	4.37
47	002466	天齐锂业	87,983,545.00	4.20
48	300015	爱尔眼科	84,329,720.95	4.03
49	300409	道氏技术	84,266,006.40	4.02
50	600258	首旅酒店	84,173,991.95	4.02
51	002568	百润股份	83,137,032.40	3.97
52	688599	天合光能	83,081,092.14	3.97
53	600905	三峡能源	82,632,013.24	3.94
54	300820	英杰电气	80,611,678.14	3.85

55	600104	上汽集团	80,182,753.00	3.83
56	603305	旭升股份	79,913,994.30	3.81
57	300502	新易盛	79,362,204.23	3.79
58	600741	华域汽车	78,467,097.58	3.75
59	002475	立讯精密	78,167,987.60	3.73
60	603659	璞泰来	78,073,957.52	3.73
61	300413	芒果超媒	77,892,687.69	3.72
62	000768	中航西飞	76,381,228.78	3.65
63	601668	中国建筑	74,599,463.00	3.56
64	300601	康泰生物	74,135,919.80	3.54
65	000792	盐湖股份	72,806,696.00	3.48
66	603259	药明康德	71,919,303.94	3.43
67	002120	韵达股份	71,110,303.50	3.39
68	600004	白云机场	70,707,546.00	3.38
69	600029	南方航空	70,542,149.20	3.37
70	601567	三星医疗	68,631,227.00	3.28
71	601658	邮储银行	68,382,371.00	3.26
72	601111	中国国航	67,778,016.00	3.24
73	600919	江苏银行	67,074,560.00	3.20
74	002352	顺丰控股	66,034,113.00	3.15
75	601702	华峰铝业	62,874,399.07	3.00
76	600660	福耀玻璃	62,377,639.17	2.98
77	002709	天赐材料	62,232,383.11	2.97
78	002705	新宝股份	62,222,808.00	2.97
79	601778	晶科科技	61,985,833.93	2.96
80	002006	精功科技	58,911,839.94	2.81
81	600309	万华化学	58,527,530.04	2.79
82	002493	荣盛石化	58,023,587.00	2.77
83	002142	宁波银行	57,873,625.72	2.76
84	300861	美畅股份	56,750,226.00	2.71
85	600999	XD 招商证	56,161,019.36	2.68
86	601628	中国人寿	55,970,793.00	2.67
87	002507	涪陵榨菜	54,852,849.62	2.62
88	601166	兴业银行	54,068,900.89	2.58
89	000938	紫光股份	52,164,034.66	2.49
90	601238	广汽集团	52,032,744.00	2.48
91	601009	南京银行	51,726,382.95	2.47
92	002739	万达电影	51,581,392.00	2.46
93	300007	汉威科技	51,512,390.00	2.46
94	300751	迈为股份	51,311,337.91	2.45
95	603185	上机数控	51,197,893.00	2.44
96	600456	宝钛股份	50,955,865.58	2.43

97	002081	金螳螂	50,700,155.50	2.42
98	600115	中国东航	49,921,064.30	2.38
99	002415	海康威视	49,743,255.38	2.37
100	600009	上海机场	49,599,583.00	2.37
101	002497	雅化集团	48,403,846.00	2.31
102	000895	双汇发展	48,138,398.32	2.30
103	600036	招商银行	47,195,351.00	2.25
104	600021	上海电力	46,726,870.86	2.23
105	601615	明阳智能	45,943,512.70	2.19
106	000786	北新建材	45,027,425.00	2.15
107	600585	海螺水泥	44,167,077.00	2.11
108	605123	派克新材	43,736,430.04	2.09
109	600938	中国海油	42,807,669.94	2.04
110	600985	淮北矿业	42,179,182.46	2.01

注：本项“买入金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑其它交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300337	银邦股份	259,531,711.60	12.39
2	600030	中信证券	249,664,887.69	11.92
3	002738	中矿资源	197,543,302.00	9.43
4	605117	德业股份	196,444,775.66	9.38
5	000997	新大陆	183,567,790.69	8.76
6	600809	山西汾酒	169,652,863.38	8.10
7	000858	五粮液	166,067,538.01	7.93
8	601985	中国核电	161,457,305.92	7.71
9	000333	美的集团	160,636,417.19	7.67
10	603806	福斯特	156,713,394.25	7.48
11	000988	华工科技	148,982,372.72	7.11
12	300590	移为通信	137,906,079.86	6.58
13	300531	优博讯	135,501,328.01	6.47
14	002555	三七互娱	133,397,170.00	6.37
15	601117	中国化学	131,053,340.34	6.26
16	002756	永兴材料	130,009,069.37	6.21
17	300682	朗新科技	127,797,105.91	6.10
18	601888	中国中免	112,070,391.18	5.35
19	601012	隆基绿能	110,816,950.51	5.29
20	000977	浪潮信息	109,275,015.83	5.22
21	000792	盐湖股份	104,891,240.08	5.01
22	300750	宁德时代	101,864,713.32	4.86
23	002540	亚太科技	101,524,077.00	4.85

24	600741	华域汽车	100,526,277.92	4.80
25	601211	国泰君安	97,640,168.29	4.66
26	603799	华友钴业	94,921,340.18	4.53
27	601398	工商银行	92,780,743.40	4.43
28	600004	白云机场	91,375,660.92	4.36
29	002466	天齐锂业	90,896,313.10	4.34
30	603260	合盛硅业	90,501,107.92	4.32
31	600519	贵州茅台	89,539,388.36	4.27
32	002008	大族激光	85,228,167.53	4.07
33	300409	道氏技术	84,819,131.20	4.05
34	688599	天合光能	83,570,287.78	3.99
35	000938	紫光股份	82,581,600.70	3.94
36	300502	新易盛	74,844,360.59	3.57
37	002304	洋河股份	74,822,096.00	3.57
38	600690	海尔智家	74,693,325.73	3.57
39	002568	百润股份	73,405,190.40	3.50
40	688122	西部超导	72,912,550.27	3.48
41	300059	东方财富	72,848,875.25	3.48
42	600029	南方航空	72,585,628.44	3.47
43	300015	爱尔眼科	71,889,436.88	3.43
44	601111	中国国航	70,577,761.00	3.37
45	002180	纳思达	69,869,424.58	3.34
46	603259	药明康德	69,402,812.00	3.31
47	601658	邮储银行	66,852,932.00	3.19
48	600346	恒力石化	66,843,648.28	3.19
49	600409	三友化工	66,315,073.00	3.17
50	300144	宋城演艺	65,180,236.66	3.11
51	002859	洁美科技	61,568,950.00	2.94
52	000568	泸州老窖	60,653,473.00	2.90
53	002120	韵达股份	58,985,746.95	2.82
54	600036	招商银行	56,901,452.00	2.72
55	002493	荣盛石化	56,436,807.43	2.69
56	601628	中国人寿	56,356,705.85	2.69
57	600938	中国海油	56,323,222.72	2.69
58	002352	顺丰控股	55,837,362.00	2.67
59	601009	南京银行	53,996,221.77	2.58
60	601166	兴业银行	53,186,850.00	2.54
61	300413	芒果超媒	53,084,276.86	2.53
62	300820	英杰电气	53,006,459.68	2.53
63	600438	通威股份	52,977,102.16	2.53
64	600104	上汽集团	52,413,166.06	2.50
65	002236	大华股份	52,406,864.00	2.50

66	300316	晶盛机电	50,932,860.58	2.43
67	002142	宁波银行	50,603,305.37	2.42
68	300861	美畅股份	49,754,685.00	2.38
69	300601	康泰生物	49,614,333.83	2.37
70	002497	雅化集团	49,492,418.24	2.36
71	605337	李子园	49,070,555.18	2.34
72	000895	双汇发展	49,034,343.52	2.34
73	000762	西藏矿业	49,007,281.00	2.34
74	002063	远光软件	48,766,863.68	2.33
75	002475	立讯精密	48,324,035.00	2.31
76	688077	大地熊	47,529,021.34	2.27
77	603305	旭升股份	47,514,243.74	2.27
78	600760	中航沈飞	45,190,488.03	2.16
79	002081	金螳螂	45,004,992.30	2.15
80	601778	晶科科技	44,125,699.00	2.11
81	600985	淮北矿业	43,274,125.28	2.07
82	603986	兆易创新	43,067,853.00	2.06

注：本项“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑其它交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	12,279,340,064.54
卖出股票收入（成交）总额	9,260,105,473.92

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”和“卖出股票的收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	81,375,123.29	1.60
	其中：政策性金融债	81,375,123.29	1.60
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	81,375,123.29	1.60

7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	210212	21 国开 12	400,000	40,708,000.00	0.80
2	210312	21 进出 12	400,000	40,667,123.29	0.80

7.7 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支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 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

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体中信证券股份有限公司于 2022 年 6 月 2 日收到中国证监会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（2022）29 号），经查，中信证券存在以下行为：一是 2015 年设立中信证券海外投资有限公司，未按照当时《证券法》第一百二十九条的规定报我会批准。二是未按期完成境外子公司股权架构调整工作，存在控股平台下设控股平台、专业子公司下设专业子公司、特殊目的实体（SPV）下设子公司、股权架构层级多达 8 层等问题。三是存在境外子公司从事房地产基金管理非金融相关业务和返程子公司从事咨询、研究等业务的问题。上述情况违反了《证券公司和证券投资基金管理公司境外设立、收购、参股经营机构管理办法》（以下简称《境外办法》）第十一条、第十二条、第十三条第一款、第二十七条、第三十七条第一款等规定，反映出公司合规管理、内部控制存在一定缺失。按照《证券公司监督管理条例》第七十条、《境外办法》第三十二条的规定，中国证监会做出以下决定：“责令中信证券改正，并于收到本决定之日起 3 个月内向深圳证监局提交整改报告。”

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。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	3,199,123.41
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	11,177,697.54
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,376,820.95

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

)		持有份额	占总 份额 比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
长信金利 趋势混合 A	82,450	107,672.86	6,752,554,990.35	76.06	2,125,072,419.85	23.94
长信金利 趋势混合 C	20,454	80,306.58	1,629,484,987.54	99.20	13,105,830.21	0.80
合计	102,904	102,233.33	8,382,039,977.89	79.68	2,138,178,250.06	20.32

注：对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	长信金利趋势混合 A	1,545,482.86	0.02
	长信金利趋势混合 C	317,276.71	0.02
	合计	1,862,759.57	0.02

注：对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	长信金利趋势混合 A	>100
	长信金利趋势混合 C	10~50
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	长信金利趋势混合 A	>100
	长信金利趋势混合 C	10~50
	合计	>100

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长信金利趋势混合 A	长信金利趋势混合 C
基金合同生效日（2006年4月30日）基金份额总额	613,254,516.24	-
本报告期期初基金份额总额	2,822,651,154.65	-

本报告期基金总申购份额	6,435,641,420.07	1,746,535,946.14
减：本报告期基金总赎回份额	380,665,164.52	103,945,128.39
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	8,877,627,410.20	1,642,590,817.75

注：长信金利趋势混合型证券投资基金 C 类份额增加日为 2022 年 2 月 15 日，C 类份额本报告期为 2022 年 2 月 15 日至 2022 年 6 月 30 日。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

10.2.1 基金管理人的重大人事变动

自 2022 年 2 月 21 日起，安响先生不再担任公司副总经理。

上述重大人事变动情况，本基金管理人已在规定信息披露媒介发布相关公告。

10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内未发生基金管理人及高级管理人员受稽查或处罚等情形。

本报告期内，上海证监局对我公司进行检查并对公司和相关人员出具了监管措施。我公司已按照法律法规和监管要求落实整改。

本报告期本基金托管人及其高级管理人员没有受监管部门稽查或处罚的情形。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
长江证券	3	8,579,885,985.22	39.87	7,990,419.67	49.00	-
中信建投	2	5,217,907,603.77	24.24	3,294,081.07	20.20	-
东方证券	2	3,993,231,536.74	18.55	2,121,586.77	13.01	-
国信证券	3	1,333,505,438.55	6.20	708,493.44	4.34	-
东吴证券	1	612,860,956.79	2.85	570,761.75	3.50	-
光大证券	1	545,760,671.27	2.54	508,268.19	3.12	-
国金证券	1	530,404,319.84	2.46	493,998.47	3.03	-
兴业证券	1	416,419,288.09	1.93	387,810.65	2.38	-
申银万国	1	190,822,838.00	0.89	177,714.16	1.09	-
东北证券	1	101,186,659.06	0.47	53,759.50	0.33	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
国融证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

注：1、本期租用证券公司交易单元的变更情况

本报告期内本基金租用证券公司交易单元没有变更。

2、专用交易单元的选择标准和程序

根据中国证监会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》（证监基字【1998】29号）和《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字【2007】48号）的有关规定，本公司制定了租用证券公司专用交易单元的选择标准和程序。

（1）选择标准：

- 1) 券商基本面评价（财务状况、经营状况）；
- 2) 券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）；
- 3) 券商每日信息评价（及时性和有效性）；

4) 券商协作表现评价。

(2) 选择程序：

首先根据租用证券公司专用交易单元的选择标准形成《券商服务评价表》，然后根据评分高低进行选择基金专用交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
长江证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
东方证券	1,025,226.22	100.00	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
国融证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	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增加济安财富（北京）基金销售有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2022 年 1 月 13 日
2	长信金利趋势混合型证券投资基金 2021 年	中国证监会电子披露	2022 年 1 月 24 日

	第 4 季度报告	网站、公司网站	
3	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2021 年第四季度报告提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2022 年 1 月 24 日
4	长信基金管理有限责任公司关于增加四川天府银行股份有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2022 年 1 月 26 日
5	长信基金管理有限责任公司关于增加第一创业证券股份有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2022 年 2 月 8 日
6	长信基金管理有限责任公司关于长信金利趋势混合型证券投资基金增设 C 类基金份额相关事项的公告	中证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2022 年 2 月 11 日
7	长信金利趋势混合型证券投资基金基金合同	中国证监会电子披露网站、公司网站	2022 年 2 月 11 日
8	长信金利趋势混合型证券投资基金托管协议	中国证监会电子披露网站、公司网站	2022 年 2 月 11 日
9	长信金利趋势混合型证券投资基金更新的招募说明书及基金产品资料概要（更新）	中国证监会电子披露网站、公司网站	2022 年 2 月 11 日
10	长信基金管理有限责任公司关于长信金利趋势混合型证券投资基金基金合同、托管协议和招募说明书提示性公告	中证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2022 年 2 月 11 日
11	长信基金管理有限责任公司关于长信金利趋势混合型证券投资基金 C 类基金份额净值计算与披露方法的说明	中证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2022 年 2 月 11 日
12	长信基金管理有限责任公司关于增加旗下部分开放式基金参加“长金通”网上直销平台及直销柜台基金转换业务的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2022 年 2 月 16 日
13	长信基金管理有限责任公司关于在“长金通”网上直销平台开展基金“转换补差费率”优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2022 年 2 月 16 日
14	长信基金管理有限责任公司关于基金行业高级管理人员变更公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2022 年 2 月 23 日
15	长信基金管理有限责任公司关于在直销柜台开展个人投资者基金申购及货币市场基金转换“转换补差费率”优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2022 年 2 月 23 日

16	长信基金管理有限责任公司关于增加财通证券股份有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2022年3月3日
17	长信基金管理有限责任公司关于增加北京中植基金销售有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2022年3月17日
18	长信基金管理有限责任公司关于长信金利趋势混合型证券投资基金暂停大额申购（含转换转入、定期定额投资）业务的公告	中证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2022年3月25日
19	长信金利趋势混合型证券投资基金 2021 年年度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2022年3月31日
20	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2021 年年度报告提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2022年3月31日
21	长信基金管理有限责任公司关于长信金利趋势混合型证券投资基金暂停大额申购（含转换转入、定期定额投资）业务的公告	中证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2022年4月12日
22	长信金利趋势混合型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2022年4月22日
23	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2022 年第一季度报告提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2022年4月22日
24	长信基金管理有限责任公司关于长信金利趋势混合型证券投资基金的分红公告	中证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2022年4月25日
25	长信基金管理有限责任公司关于长信金利趋势混合型证券投资基金暂停大额申购（含转换转入、定期定额投资）业务的公告	中证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2022年4月25日
26	长信基金管理有限责任公司关于增加湘财证券股份有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2022年4月25日
27	长信基金管理有限责任公司关于长信金利趋势混合型证券投资基金恢复大额申购（含转换转入、定期定额投资）业务的公告	中证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2022年4月26日
28	长信基金管理有限责任公司关于终止北京唐鼎耀华基金销售有限公司、北京植信基金	上证报、中国证监会电子披露网站、公司	2022年5月7日

	销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	网站	
29	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2022 年 5 月 11 日
30	长信基金管理有限责任公司关于增加南京苏宁基金销售有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2022 年 5 月 25 日
31	长信基金管理有限责任公司关于增加深圳新华信通基金销售有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2022 年 5 月 26 日
32	长信金利趋势混合型证券投资基金更新的招募说明书（2022 年第【1】号）及基金产品资料概要（更新）	中国证监会电子披露网站、公司网站	2022 年 5 月 31 日
33	长信基金管理有限责任公司关于增加北京创金启富基金销售有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2022 年 6 月 8 日
34	长信基金管理有限责任公司关于增加上海中欧财富基金销售有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2022 年 6 月 13 日
35	长信基金管理有限责任公司关于增加上海攀赢基金销售有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2022 年 6 月 15 日
36	长信基金管理有限责任公司关于增加泰信财富基金销售有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2022 年 6 月 15 日
37	长信基金管理有限责任公司关于长信金利趋势混合型证券投资基金暂停大额申购（含转换转入、定期定额投资）业务的公告	中证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2022 年 6 月 29 日
38	长信基金管理有限责任公司关于增加南京证券股份有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2022 年 6 月 30 日

	参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告		
--	----------------------	--	--

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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

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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期未发生影响投资者决策的其他重要信息。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立基金的文件；
- 2、《长信金利趋势混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长信金利趋势混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《长信金利趋势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、《上海浦东发展银行证券交易资金结算协议》；
- 7、长信基金管理有限责任公司营业执照、公司章程。

12.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

12.3 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

2022 年 8 月 31 日