

长信利发债券型证券投资基金 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	6
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	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
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	12
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	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
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	14
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	43
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	43

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.....	43
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.....	43
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.....	43
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	43
7.11 投资组合报告附注.....	44
§ 8 基金份额持有人信息	46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	46
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	46
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.....	46
§ 9 开放式基金份额变动	46
§ 10 重大事件揭示	47
10.1 基金份额持有人大会决议.....	47
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.....	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	47
10.4 基金投资策略的改变.....	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	47
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.....	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	47
10.8 其他重大事件.....	49
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	52
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	52
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	52
§ 12 备查文件目录	52
12.1 备查文件目录.....	52
12.2 存放地点.....	53
12.3 查阅方式.....	53

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长信利发债券型证券投资基金
基金简称	长信利发债券
场内简称	长信利发
基金主代码	519933
交易代码	519933
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 6 月 28 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	252,280,351.43 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过积极主动的资产管理和严格的风险控制，在保持基金资产流动性和严格控制基金资产风险的前提下，力求为投资者提供稳定增长的投资收益。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金将利用全球信息平台、外部研究平台、行业信息平台以及自身的研究平台等信息资源，基于本基金的投资目标和投资理念，从宏观和微观两个角度进行研究，开展战略资产配置，之后通过战术资产配置再平衡基金资产组合，实现组合内各类别资产的优化配置，并对各类资产的配置比例进行定期或不定期调整。</p> <p>2、债券投资策略</p> <p>本基金主要采用积极管理型的投资策略，自上而下分为战略性策略和战术性策略两个层面，结合对各市场上不同投资品种的具体分析，共同构成本基金的投资策略结构。</p> <p>3、股票投资策略：</p> <p>在行业配置层面，本基金将运用“自上而下”的行业配置方法，通过对国内外宏观经济走势、经济结构转型的方向、国家经济与产业政策导向和经济周期调整的深入研究，采用价值理念与成长理念相结合的方法来对行业进行筛选。</p> <p>本基金将结合定性与定量分析，主要采取自下而上的选股策略。基金依据约定的投资范围，基于对上市公司的品质评估分析、风险因素分析和估值分析，筛选出基本面良好的股票进行投资，在有效控制风险前提下，争取实现基金资产的长期稳健增值。</p> <p>本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。</p> <p>4、其他类型资产投资策略</p> <p>在法律法规或监管机构允许的情况下，本基金将在严格控制投资风险的基础上适当参与权证、资产支持证券等金融工具的投资。</p>

业绩比较基准	中证全债指数×90%+中证 800 指数×10%
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险和收益低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金，属于证券投资基金产品中风险收益程度中等偏低的投资品种。

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 负责人	姓名	周永刚	胡波
	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	上海证券报
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	中国证券登记结算有限责任公司	北京西城区太平洋桥大街 17 号

§ 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)
本期已实现收益	-5,988,908.88
本期利润	-12,552,582.58
加权平均基金份额本期利润	-0.0453
本期加权平均净值利润率	-3.69%
本期基金份额净值增长率	-3.13%
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	43,325,424.56
期末可供分配基金份额利润	0.1717

期末基金资产净值	308,730,295.37
期末基金份额净值	1.2238
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	40.82%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用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。

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

3、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

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	0.73%	0.30%	0.85%	0.11%	-0.12%	0.19%
过去三个月	0.48%	0.22%	1.57%	0.14%	-1.09%	0.08%
过去六个月	-3.13%	0.26%	0.76%	0.15%	-3.89%	0.11%
过去一年	-2.66%	0.27%	3.51%	0.13%	-6.17%	0.14%
过去三年	16.66%	0.31%	15.28%	0.13%	1.38%	0.18%
自基金合同生效起至今	40.82%	0.36%	28.54%	0.13%	12.28%	0.23%

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



注：1、图示日期为 2016 年 6 月 28 日至 2022 年 6 月 30 日。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效日起 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		
程放	长信先优债券型证券投资基金和长信利发债券型证券投资基金的基金经理	2020 年 12 月 31 日	-	9 年	北京大学金融学硕士毕业，具有基金从业资格，中国国籍。曾任职于广发银行股份有限公司、兴银基金管理有限责任公司，2020 年 8 月加入长信基金管理有限责任公司，现任长信先优债券型证券投资基金和长信利发债券型证券投资基金的基金经理。
朱垚	曾任本基金的基金经理	2019 年 5 月 16 日	2022 年 2 月 25 日	9 年	曾任本基金的基金经理。

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合规守信情况的说明

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

我们的策略是“以最大回撤为风险控制目标、参考量化模型适度择时和行业轮动、参考基本面自下而上精选个股”。大类资产配置上，我们相对低频地采用股债性价比模型进行权益仓位的选择。在今年一季度判断整体市场利空因素偏多的情况下，降低权益仓位至偏低水平，行业配置上偏向低估值防御策略，在一季度市场整体下行中控制住了最大回撤。

二季度以来，从自上而下的角度来看，有一些宏大叙事的逻辑可能有边际弱化的趋势。比如美联储加息预期过了对市场冲击最大的阶段。我们认为宏观层面的波动可能相比一季度减弱，整体对股票市场的冲击减弱，但指数层面的波动性在反弹后结构性机会可能频现。我们在二季度逐步提升组合权益仓位，同时参考行业估值和景气度的量化模型，希望捕捉结构性行情中的行业轮动机会。

具体而言，在经济复苏初期，宽松的货币政策和市场对风险偏好的容忍度，也比较支持成长风格占优。我们在二季度延续一季度对海缆、养殖、检测服务等部分个股的配置之外，减持了部分价值风格个股，增持了部分上游资源品、光伏和新能源车方向的个股。我们在组合中保持股票和转债个券的分散度在合理水平，在优选行业景气度和估值优势的行业内，如果市场走弱适度提高分散度，如果机会明确考虑提升个股集中度。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2022 年 6 月 30 日，长信利发债券份额净值为 1.2238 元，份额累计净值为 1.3818 元，本报告期内长信利发债券净值增长率为-3.13%，同期业绩比较基准收益率为 0.76%。

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 年一季度宏观因素对市场冲击最大，后续来看，整体宏观波动率下降，对资本市场的扰动逐渐减弱。下半年大概率流动性仍会保持合理宽裕状态，居民和企业部门的融资需求恢复较慢，拐点仍需观察。在宏观层面相对利好的背景下，组合考虑维持权益中枢以上配置，聚焦中观行业景气度和个股结构性机会。

从行业动量层面，当前新能源板块仍具备较高胜率，但交易拥挤度相对较高。出于均衡风险和估值层面考虑，组合考虑配置部分新能源板块上游（包括硅料、锂矿和稀土）。此外作为碳中和能源转型的重要一环，电力系统的重要性后续也值得关注，组合在本季度增加了对电力板块的配置。

我们在组合管理中会更多关注的是过快上涨带来的风险，未来一个季度力争在控制净值回撤的基础上为持有人实现资产平稳增长。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金持有的投资品种进行估值。基金托管人根据法律法规要求对基金管理公司采用的估值政策和程序进行核查，并对估值结果及净值计算进行复核。

根据相关法律法规，本基金管理人制订了健全、有效的估值政策和估值程序，设立了估值委员会，估值委员会是公司基金估值的主要决策机构，其主要职责是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，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应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。对于基金的估值政策和估值原则，公司已与基金托管人充分沟通，并达成一致意见。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

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

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”）在对长信利发债券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合规守信、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，对长信利发债券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：长信利发债券型证券投资基金

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	4,180,390.68	4,516,950.23
结算备付金		-	928,941.15
存出保证金		87,435.81	119,285.88
交易性金融资产	6.4.7.2	301,970,086.58	398,848,343.52
其中：股票投资		40,320,900.12	54,419,095.56
基金投资		-	-
债券投资		261,649,186.46	344,429,247.96
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		3,329,889.79	1,354,502.58
应收股利		-	-

应收申购款		358.25	1,326.91
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	3,176,713.74
资产总计		309,568,161.11	408,946,064.01
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		8,320.68	5,000,000.00
应付清算款		-	-
应付赎回款		288,144.91	35,615.50
应付管理人报酬		178,109.53	243,290.81
应付托管费		50,888.44	69,511.64
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		9,200.03	14,943.42
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	303,202.15	263,920.03
负债合计		837,865.74	5,627,281.40
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	252,280,351.43	319,228,510.33
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	56,449,943.94	84,090,272.28
净资产合计		308,730,295.37	403,318,782.61
负债和净资产总计		309,568,161.11	408,946,064.01

注：1、报告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.2238 元，基金份额总额 252,280,351.43 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：长信利发债券型证券投资基金

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 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
一、营业总收入		-10,904,056.53	15,342,691.42
1. 利息收入		32,667.15	12,914,228.82
其中：存款利息收入	6.4.7.13	19,934.20	240,186.57
债券利息收入		-	12,610,581.64
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		12,732.95	63,460.61
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-4,374,348.14	52,914,433.76
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-9,456,409.57	56,946,294.31
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	4,857,321.94	-5,114,356.30
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-	-
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	224,739.49	1,082,495.75
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	-6,563,673.70	-50,863,176.17
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	1,298.16	377,205.01
减：二、营业总支出		1,648,526.05	6,103,603.56
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,186,790.70	3,718,929.08
2. 托管费	6.4.10.2.2	339,083.08	1,062,551.15
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		7,231.44	559,065.88
其中：卖出回购金融资产支出		7,231.44	559,065.88
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		9,631.74	31,186.35
8. 其他费用	6.4.7.23	105,789.09	731,871.10

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-12,552,582.58	9,239,087.86
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-12,552,582.58	9,239,087.86
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-12,552,582.58	9,239,087.86

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：长信利发债券型证券投资基金

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)	319,228,510.33	-	84,090,272.28	403,318,782.61
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)	319,228,510.33	-	84,090,272.28	403,318,782.61
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-66,948,158.90	-	-27,640,328.34	-94,588,487.24
（一）、综合收益总额	-	-	-12,552,582.58	-12,552,582.58
（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）	-66,948,158.90	-	-15,087,745.76	-82,035,904.66

其中: 1. 基金申购款	1, 185, 444. 03	-	274, 039. 50	1, 459, 483. 53
2. 基金赎回款	-68, 133, 602. 93	-	-15, 361, 785. 26	-83, 495, 388. 19
(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)	-	-	-	-
(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)	252, 280, 351. 43	-	56, 449, 943. 94	308, 730, 295. 37
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)	1, 085, 209, 958. 47	-	266, 388, 330. 48	1, 351, 598, 288. 95
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, 085, 209, 958. 47	-	266, 388, 330. 48	1, 351, 598, 288. 95
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-385, 898, 242. 77	-	-86, 522, 538. 90	-472, 420, 781. 67
(一)、综合收益总额	-	-	9, 239, 087. 86	9, 239, 087. 86
(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)	-385, 898, 242. 77	-	-95, 761, 626. 76	-481, 659, 869. 53
其中: 1. 基金申购款	316, 138, 318. 22	-	80, 698, 628. 61	396, 836, 946. 83
2. 基金赎回款	-702, 036, 560. 99	-	-176, 460, 255. 37	-878, 496, 816. 36

（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）	-	-	-	-
（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）	699,311,715.70	-	179,865,791.58	879,177,507.28

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：

<u>刘元瑞</u>	<u>覃波</u>	<u>孙红辉</u>
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

长信利发债券型证券投资基金(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[2016]886号《关于准予长信利发债券型证券投资基金注册的批复》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2016年6月28日生效,首次设立募集规模为345,062,697.59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。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、存托凭证、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围,其投资比例遵循届时有效的法律法规和相关规定。

本基金主要投资于具有良好流动性的固定收益类金融工具,包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、短期融资券、超级短期融资券、中期票据、资产支持证券、次级债券、可转债及分离交易可转债、中小企业私募债、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具

(但须符合中国证监会相关规定)。

本基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，投资于权益类资产的比例不超过基金资产的 20%，现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。

基金的业绩比较基准为：中证全债指数×90%+中证 800 指数×10%。

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《半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 4,516,950.23 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 731.83 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 4,517,682.06 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 928,941.15 元

，自应收利息转入的重分类金额为人民币 418.00 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 929,359.15 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 119,285.88 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 53.70 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 119,339.58 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 3,176,713.74 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 731.83 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 418.00 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 53.70 元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币 3,175,510.21 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 398,848,343.52 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 3,175,510.21 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 402,023,853.73 元。

以摊余成本计量的金融负债：

卖出回购金融资产款于 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 5,000,000.00 元，自应付利息转入的重分类金额为人民币 10,416.39 元。经上述重分类后，卖出回购金融资产款于 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 5,010,416.39 元。

应付利息于 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 10,416.39 元，转出至卖出回购金融资产款的重分类金额为人民币 10,416.39 元。经上述重分类后，应付利息不再作为财务报表项目单独列报。

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、营业税的单位和个体，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发展费附加的单位外）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	4,180,390.68
等于：本金	4,179,847.08
加：应计利息	543.60
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	4,180,390.68

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	42,291,479.49	-	40,320,900.12	-1,970,579.37	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	109,455,468.14	1,266,343.97	110,665,098.35	-56,713.76
	银行间市场	147,878,167.95	1,840,588.11	150,984,088.11	1,265,332.05
	合计	257,333,636.09	3,106,932.08	261,649,186.46	1,208,618.29
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	

合计	299,625,115.58	3,106,932.08	301,970,086.58	-761,961.08
----	----------------	--------------	----------------	-------------

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	23.40
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	159,576.19
其中：交易所市场	156,101.19
银行间市场	3,475.00
应付利息	-
预提账户维护费	9,300.00
预提审计费	74,795.19
预提信息披露费	59,507.37

合计	303,202.15
----	------------

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	319,228,510.33	319,228,510.33
本期申购	1,185,444.03	1,185,444.03
本期赎回（以“-”号填列）	-68,133,602.93	-68,133,602.93
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	252,280,351.43	252,280,351.43

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	61,169,496.39	22,920,775.89	84,090,272.28
本期利润	-5,988,908.88	-6,563,673.70	-12,552,582.58
本期基金份额交易产生的变动数	-11,855,162.95	-3,232,582.81	-15,087,745.76
其中：基金申购款	207,574.72	66,464.78	274,039.50
基金赎回款	-12,062,737.67	-3,299,047.59	-15,361,785.26
本期已分配利润	-	-	-
本期末	43,325,424.56	13,124,519.38	56,449,943.94

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	14,617.65
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	4,415.86	
其他	900.69	
合计	19,934.20	

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	238,421,933.10
减：卖出股票成本总额	247,231,971.06
减：交易费用	646,371.61
买卖股票差价收入	-9,456,409.57

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	4,105,802.16
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	751,519.78
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	4,857,321.94

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	457,578,789.74
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	452,881,005.78
减：应计利息总额	3,933,785.79
减：交易费用	12,478.39
买卖债券差价收入	751,519.78

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

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

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	224,739.49
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	224,739.49

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	-6,563,673.70
股票投资	-3,602,641.74
债券投资	-2,961,031.96
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	-6,563,673.70

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	1,298.16

合计	1,298.16
----	----------

注：赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，对持续持有期少于 7 日的投资者收取的赎回费全额计入基金财产；其他赎回费用的 25% 归基金财产。

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	24,795.19
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	2,886.53
合计	105,789.09

注：“其他费用”为划款手续费。

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	287,553,521.04	60.52	208,769,202.32	51.01

6.4.10.1.2 债券交易

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	占当期债券 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 (%)
长江证券	241,133,867.10	57.47	393,312,731.32	81.83

6.4.10.1.3 债券回购交易

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	占当期债券回购 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 (%)
长江证券	54,000,000.00	100.00	596,500,000.00	100.00

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	267,798.35	72.88	119,143.47	76.32
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	194,426.45	64.58	53,996.39	60.36

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	1,186,790.70	3,718,929.08
其中：支付销售机构的客户维护费	56,614.82	166,584.36

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.70% 的年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

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	339,083.08	1,062,551.15

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

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。

6.4.10.3 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

基金管理人在本报告期及上年度可比期间内均未运用自有资金投资本基金。

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

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	4,180,390.68	14,617.65	2,800,786.64	226,303.16

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6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

本基金本报告期末未进行利润分配。

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

本基金本报告期末未因认购新发/增发证券而持有流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时 等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时 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。

本基金在下文主要描述上述风险及其形成原因；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：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识别和分析一些风险，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：审议公司内部控制制度及：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、延迟支付到期本息，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较小；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收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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	39,374,092.61	22,015,000.00
合计	39,374,092.61	22,015,000.00

注：未评级债券为国债、央行票据、政策性金融债及超短期融资券等无信用评级债券。

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	152,236,059.35	162,830,000.00
AAA 以下	23,320,419.37	133,723,747.96
未评级	46,639,262.35	25,860,500.00
合计	222,195,741.07	322,414,247.96

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 而出现的变现风险和因投资集中而无法在市场出现 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 评估各类资产的流动性， 对性制定流动性风险管理 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，基金管理人对流动性指标进行持续的监测和分析，定期开展压力测试，评估在不同的市场情形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，为应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或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

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	4,180,390.68	-	-	-	-	4,180,390.68
存出保证金	87,435.81	-	-	-	-	87,435.81
交易性金融资产	32,296,113.90	31,714,378.06	176,751,951.33	20,886,743.17	40,320,900.12	301,970,086.58
应收申购款	-	-	-	-	358.25	358.25
应收清算款	-	-	-	-	3,329,889.79	3,329,889.79
资产总计	36,563,940.39	31,714,378.06	176,751,951.33	20,886,743.17	43,651,148.16	309,568,161.11
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	288,144.91	288,144.91
应付管理人报酬	-	-	-	-	178,109.53	178,109.53
应付托管费	-	-	-	-	50,888.44	50,888.44
卖出回购金融资产款	8,320.68	-	-	-	-	8,320.68
应交税费	-	-	-	-	9,200.03	9,200.03

其他负债	-	-	-	-	303,202.15	303,202.15
负债总计	8,320.68	-	-	-	829,545.06	837,865.74
利率 度	36,555,619.71	31,714,378.06	176,751,951.33	20,886,743.17	42,821,603.10	308,730,295.37
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	4,516,950.23	-	-	-	-	4,516,950.23
结算备付金	928,941.15	-	-	-	-	928,941.15
存出保证金	119,285.88	-	-	-	-	119,285.88
交易性金融资产	47,723,531.35	108,375,216.61	177,597,500.00	10,733,000.00	54,419,095.56	398,848,343.52
应收证券清算款	-	-	-	-	1,354,502.58	1,354,502.58
应收申购款	-	-	-	-	1,326.91	1,326.91
其他资产	-	-	-	-	3,176,713.74	3,176,713.74
资产总计	53,288,708.61	108,375,216.61	177,597,500.00	10,733,000.00	58,951,638.79	408,946,064.01
负债						
卖出回购金融资产款	5,000,000.00	-	-	-	-	5,000,000.00
应付赎回款	-	-	-	-	35,615.50	35,615.50
应付管理人报酬	-	-	-	-	243,290.81	243,290.81
应付托管费	-	-	-	-	69,511.64	69,511.64
应交税费	-	-	-	-	14,943.42	14,943.42
其他负债	-	-	-	-	263,920.03	263,920.03
负债总计	5,000,000.00	-	-	-	627,281.40	5,627,281.40
利率 度	48,288,708.61	108,375,216.61	177,597,500.00	10,733,000.00	58,324,357.39	403,318,782.61

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 者进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的 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	2,387,795.98	2,840,754.80

	市场利率上升 27 个基点	-2,387,795.98	-2,840,754.80
--	---------------	---------------	---------------

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 R (u R s) 等指标来测试本基金面临的价格风险，及时可地对风险进行和控制。

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

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	40,320,900.12	13.06	54,419,095.56	13.49
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	261,649,186.46	84.75	344,429,247.96	85.40
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	301,970,086.58	97.81	398,848,343.52	98.89

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	R 值为 0.81%(2021 年 12 月 31 日 R 值为 0.65%)	-2,503,683.91	-2,602,745.90

注：上述风险价值 R 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 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 入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活 市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次 入值外相关资产或负债直接或间接可观察的 入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察 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	62,873,388.24	142,693,343.52
第二层次	239,096,698.34	256,155,000.00
第三层次	-	-
合计	301,970,086.58	398,848,343.52

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 、交易不活 或非公开发行等情况，本基金不会于 日至交易恢复活 日期间、交易不活 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 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，
些金融工具因其 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	40,320,900.12	13.02
	其中：股票	40,320,900.12	13.02
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	261,649,186.46	84.52
	其中：债券	261,649,186.46	84.52
	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	4,180,390.68	1.35
8	其他各项资产	3,417,683.85	1.10
9	合计	309,568,161.11	100.00

注：本基金本报告期末未通过 股通交易机制投资 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 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、 、 业	1,632,390.00	0.53
B	采矿业	3,584,120.00	1.16
	制 业	33,192,075.20	10.75
	电力、 力、 气及水生产和供应业	-	-

	建 业	154,700.00	0.05
F	批发和 售业	-	-
	交通运 、仓储和邮政业	641,900.00	0.21
H	住 和 业	-	-
	信息传 、 件和信息技术服 务业	57,550.00	0.02
	金融业	736,200.00	0.24
	房地产业	-	-
L	租 和商务服务业	-	-
	科学研究和技术服务业	-	-
	水利、环 和公共设施管理业	321,964.92	0.10
0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
	教育	-	-
	生和社会工作	-	-
R	文化、体育和 乐业	-	-
	综合	-	-
	合计	40,320,900.12	13.06

7.2.2 报告期末按行业分类的 股通投资股票投资组合

本基金本报告期末通过 股通交易机制投资 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	601238	广 集团	130,000	1,981,200.00	0.64
2	600522	中天科技	78,000	1,801,800.00	0.58
3	002897	意华股份	38,000	1,675,800.00	0.54
4	601898	中 能源	140,000	1,453,200.00	0.47
5	601633	长城 车	35,000	1,296,400.00	0.42
6	600392	和资源	49,962	1,129,141.20	0.37
7	300733	西 动力	50,000	1,107,000.00	0.36
8	300751	为股份	2,200	1,079,980.00	0.35
9	000970	中科三环	55,000	1,032,900.00	0.33
10	002714	原股份	17,000	939,590.00	0.30
11	603606	东方电缆	12,000	919,200.00	0.30
12	300409	技术	35,000	909,300.00	0.29
13	300835	科技	23,000	877,910.00	0.28
14	688112	科技	14,000	855,960.00	0.28
15	600499	科达制	40,000	825,600.00	0.27
16	600089	特变电工	30,000	821,700.00	0.27
17	688599	天合光能	12,500	815,625.00	0.26
18	300394	天 通信	30,000	812,100.00	0.26

19	000983	山西焦	60,000	803,400.00	0.26
20	688155	先惠技术	7,500	781,500.00	0.25
21	002493	化	50,000	769,500.00	0.25
22	603997	继 股份	70,000	761,600.00	0.25
23	601966	轮	30,000	761,100.00	0.25
24	002996	合金	50,000	760,000.00	0.25
25	002484	江海股份	32,000	746,880.00	0.24
26	603995	金股份	22,150	745,569.00	0.24
27	603363	农生	40,000	740,400.00	0.24
28	002960	消防	27,000	739,530.00	0.24
29	601456	国联证券	60,000	736,200.00	0.24
30	300115	长盈精	70,000	721,700.00	0.23
31	300263	华科技	80,000	716,800.00	0.23
32	002840	华统股份	40,000	706,000.00	0.23
33	600975	新五丰	80,000	692,800.00	0.22
34	688077	大地	8,000	674,480.00	0.22
35	603609	丰股份	70,000	674,100.00	0.22
36	002594	比	2,000	666,980.00	0.22
37	601088	中国 华	20,000	666,000.00	0.22
38	603035	常熟	40,000	660,800.00	0.21
39	600596	新安股份	30,000	649,500.00	0.21
40	603197	保 科技	13,000	639,470.00	0.21
41	603396	金 股份	7,000	637,210.00	0.21
42	600256	广汇能源	60,000	632,400.00	0.20
43	300014	亿 锂能	6,000	585,000.00	0.19
44	601872	招商轮	100,000	576,000.00	0.19
45	002895	恒股份	13,000	439,530.00	0.14
46	300702	天 股份	10,000	284,100.00	0.09
47	002034	能环	10,000	205,300.00	0.07
48	002092	中泰化学	20,000	155,200.00	0.05
49	600989	丰能源	10,000	146,500.00	0.05
50	601668	中国建	20,000	106,400.00	0.03
51	603588	高能环	5,964	68,764.92	0.02
52	601006	大 铁路	10,000	65,900.00	0.02
53	600718	东 集团	5,000	57,550.00	0.02
54	002180	纳 达	1,000	50,620.00	0.02
55	000498	山东路桥	5,000	48,300.00	0.02
56	002266	富控股	10,000	47,900.00	0.02
57	002810	山东 达	1,000	36,390.00	0.01
58	600985	北矿业	2,000	29,120.00	0.01

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	600522	中天科技	8,180,425.36	2.03
2	600188	矿能源	4,510,587.00	1.12
3	603606	东方电缆	4,507,085.00	1.12
4	600116	三 水利	4,019,786.00	1.00
5	600499	科达制	3,752,383.56	0.93
6	600392	和资源	3,525,210.58	0.87
7	600383	金地集团	3,220,506.00	0.80
8	600096	天化	3,045,404.32	0.76
9	603363	农生	2,931,782.28	0.73
10	002897	意华股份	2,920,815.00	0.72
11	600745	泰科技	2,759,429.00	0.68
12	000002	科 A	2,758,694.00	0.68
13	002756	永兴 料	2,729,890.32	0.68
14	600718	东 集团	2,693,315.00	0.67
15	601666	平 股份	2,454,324.50	0.61
16	600975	新五丰	2,441,446.00	0.61
17	600018	上 集团	2,387,000.00	0.59
18	603995	金股份	2,360,657.00	0.59
19	600123	花科创	2,347,779.00	0.58
20	600487	通光电	2,331,929.00	0.58

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

7.4.2 累计卖出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	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000002	科 A	9,469,490.00	2.35
2	002415	海	7,353,164.13	1.82
3	600522	中天科技	6,807,066.00	1.69
4	603128	华贸 流	6,727,577.00	1.67
5	002372	新	5,703,660.00	1.41
6	000858	五	5,043,781.00	1.25
7	002120	达股份	5,029,965.00	1.25
8	600188	矿能源	4,256,433.00	1.06
9	000998	平高科	4,154,862.00	1.03
10	603606	东方电缆	3,868,177.00	0.96
11	600383	金地集团	3,836,108.00	0.95
12	600116	三 水利	3,670,740.00	0.91
13	600096	天化	3,392,687.00	0.84

14	600233	通 递	3,080,687.11	0.76
15	600499	科达制	2,745,924.00	0.68
16	002088	节能	2,739,125.00	0.68
17	600123	花科创	2,615,314.00	0.65
18	002756	永兴 料	2,595,013.00	0.64
19	600745	泰科技	2,497,071.00	0.62
20	600210	江企业	2,454,777.00	0.61

注：本项“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价 以成交数量）填列，不考虑其 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	236,736,417.36
卖出股票收入（成交）总额	238,421,933.10

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 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	50,411,162.36	16.33
2	央行票据	-	-
3	金融债券	19,975,873.97	6.47
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	67,114,151.78	21.74
5	企业短期融资券	20,121,720.00	6.52
6	中期票据	77,643,793.16	25.15
7	可转债（可交换债）	26,382,485.19	8.55
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	261,649,186.46	84.75

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（ ）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	102100073	21 交通 001	300,000	30,975,486.58	10.03
2	101901329	19 苏国信 004B	200,000	21,081,984.66	6.83
3	155835	19 国联 03	200,000	20,935,572.60	6.78
4	210014	21 付息国债 14	200,000	20,886,743.17	6.77
5	188482	21 招证 7	200,000	20,652,905.21	6.69

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 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.10.1 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

7.10.2 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

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 基金投资的前 名证券的发行主体本期是否出现 监管部门立 调查，或在报告编制日前一年内受到公开 责、处罚的情形

报告期内本基金投资的前 名证券中，发行主体招商证券股份有限公司于 2022 年 4 月 1 日收到深 证监局关于对招商证券股份有限公司采取责 改正 施的决定（行政监管 施决定书（2022）47 号），经查，招商证券在 2022 年 3 月 14 日的网 安全事件中，存在变更管理不完 ，应 处置不及时、不到位等问题。上述行为违反了《证券期货业信息安全保 管理办法》（证监会 第 82 号，以下简称《信息安全保 管理办法》）第二 二条、第三 二条第一款以及《证券投资基金经营机构信息技术管理办法》（证监会 第 179 号，以下简称《信息技术管理办法》）第二 二条第一款、第三 六条、第四 二条的相关规定。依据《信息安全保 管理办法》第五 条，《信息技术管理办法》第五 条，以及《证券期货业网 安全事件报告与调查处理办法》（证监会公告 2021 12 号）第二 条的规定，深 证监局决定对招商证券采取责 改正的行政监管 施，主要内容如下：公司应进一步加强重要信息系统建设的统筹规划，充分了解系统 构及内部运行机制，强化研发、测试、上 、升级变更及运维管理，完 应 处置机制，保 关 位人员的专业能力和数量配置，确保信息系统安全平稳运行；同时公司应对此次事件相关责任人员进行内部责任追究。

报告期内本基金投资的前 名证券中，发行主体广发银行股份有限公司于 2022 年 3 月 21 日收到中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表（银保监罚决字 2022 23 号），根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二 一条、第四 六条和相关审 经营规则，经查，广发银行监管标准化数据（A）系统数据质量及数据报送存在以下违法违规行为：一、 期 90 天以上

款余额 A 数据存在偏差 二、漏报 款核销业务 A 数据 三、漏报信 资产转让业务 A 数据；四、债券投资业务 A 数据存在偏差；五、漏报公募基金投资业务 A 数据；六、投资资产管理产品业务 A 数据存在偏差； 、 A 系统理财产品非标投向行业余额数据存在偏差； 、 A 系统分户账与总账比对不一致； 、漏报分户账 A 数据； 、漏报对公活期存款账户明细 A 数据； 一、未在开户当月向 A 系统报送账户信息； 二、 A 系统《表外 信业务》表错报； 三、 A 系统《对公信 业务借据》表错报； 四、 A 系统《关联关系》表漏报； 五、 A 系统《对公信 分户账》表漏报； 六、 A 系统《总账会计全科目表》漏报币种信息

综上，中国银行保险监督管理委员会决定对广发银行股份有限公司罚款人民币 420 元。

对如上证券投资决策程序的说明：公司研究部门按照内部研究工作规范对该证券进行分析后将其列入基金投资对 备选 。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 名证券中其余的发行主体未出现 监管部门立 调查或在报告编制日前一年内受到公开 责、处罚的情形。

7.11.2 基金投资的前 名股票是否超出基金合同规定的备选股票

报告期内本基金投资的前 名股票中，不存在超出基金合同规定备选股票 的情形。

7.11.3 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	87,435.81
2	应收清算款	3,329,889.79
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	358.25
6	其他应收款	-
7	摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,417,683.85

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位 人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	123120	华转债	1,930,384.05	0.63
2	127043	恒转债	1,913,374.96	0.62

3	127045	原转债	1,676,997.86	0.54
4	123107	转债	1,575,516.16	0.51
5	110075	南 转债	1,538,207.75	0.50
6	132018	三 B1	1,259,648.63	0.41
7	127049	希望转 2	1,228,156.44	0.40
8	123027	蓝 转债	1,125,233.01	0.36
9	113593	沪工转债	1,047,285.12	0.34
10	123119	泰转 2	1,045,807.15	0.34
11	123067	转债	969,516.16	0.31
12	113534	胜转债	966,128.63	0.31
13	123121	尔转债	886,195.89	0.29
14	127037	银轮转债	824,977.81	0.27
15	127041	转债	809,132.09	0.26
16	128076	金轮转债	762,299.18	0.25
17	128144	利民转债	715,942.19	0.23
18	127006	东转债	668,974.52	0.22
19	113630	转债	618,720.40	0.20

7.11.5 期末前 名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前 名股票中不存在流通受限情况。

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字 述部分

由于四 五入的原因，分项之和与合计项可能存在 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

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 (%)
3,512	71,833.81	231,916,769.45	91.93	20,363,581.98	8.07

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	0.00	0.00

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	持有基金份额总量的数量区间 (份)
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016 年 6 月 28 日）基金份额总额	345,062,697.59
本报告期期初基金份额总额	319,228,510.33
本报告期基金总申购份额	1,185,444.03
减：本报告期基金总赎回份额	68,133,602.93
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	252,280,351.43

§ 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，安先生不再担任公司总经理。

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	1	287,553,521.04	60.52	267,798.35	72.88	-
国泰君安	1	187,604,829.42	39.48	99,674.50	27.12	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东 证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国融证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银 证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
商证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	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》，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	241,133,867.10	57.47	54,000,000.00	100.00	-	-
国泰安	178,477,616.62	42.53	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东 证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国融证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银 证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
商证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

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 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、公司网	2022 年 1 月 13 日
2	长信利发债券型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	中国证监会电子披露网、公司网	2022 年 1 月 24 日
3	长信基金管理有限责任公司 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	2022 年 1 月 24 日

		网、公司网	
4	长信基金管理有限责任公司关于增加四 天府银行股份有限公司为 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、公司 网	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 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、公司 网	2022 年 2 月 8 日
6	长信基金管理有限责任公司关于增加 下 部分开放式基金参加“长金通“网上直销平 台及直销 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、公司网	2022 年 2 月 16 日
7	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、公司网	2022 年 2 月 16 日
8	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、公司 网	2022 年 2 月 23 日
9	长信基金管理有限责任公司关于在直销 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、公司 网	2022 年 2 月 23 日
10	长信基金管理有限责任公司关于长信利发 债券型证券投资基金基金经理变更的公告	上证报、中国证监会 电子披露网、公司 网	2022 年 2 月 26 日
11	长信利发债券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、公司网	2022 年 3 月 2 日
12	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 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、公司 网	2022 年 3 月 3 日
13	长信基金管理有限责任公司关于增加北京 中 基金销售有限公司为 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、公司 网	2022 年 3 月 17 日
14	长信利发债券型证券投资基金 2021 年年度 报告	中国证监会电子披露 网、公司网	2022 年 3 月 31 日
15	长信基金管理有限责任公司 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、	2022 年 3 月 31 日

		中国证监会电子披露网、公司网	
16	长信利发债券型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	中国证监会电子披露网、公司网	2022 年 4 月 22 日
17	长信基金管理有限责任公司 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、公司网	2022 年 4 月 22 日
18	长信基金管理有限责任公司关于增加 财证券股份有限公司为 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、公司网	2022 年 4 月 25 日
19	长信基金管理有限责任公司关于终止北京 华基金销售有限公司、北京 信基金销售有限公司办理 下基金相关销售业务的公告	上证报、中国证监会电子披露网、公司网	2022 年 5 月 7 日
20	长信基金管理有限责任公司关于 下基金持有的长期 股票调整估值方法的公告	上证报、中国证监会电子披露网、公司网	2022 年 5 月 11 日
21	长信基金管理有限责任公司关于增加南京 苏 基金销售有限公司为 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、公司网	2022 年 5 月 25 日
22	长信基金管理有限责任公司关于增加深 新华信通基金销售有限公司为 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、公司网	2022 年 5 月 26 日
23	长信基金管理有限责任公司关于长信利发债券型证券投资基金施赎回费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网、公司网	2022 年 5 月 27 日
24	长信利发债券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、公司网	2022 年 5 月 31 日
25	长信基金管理有限责任公司关于增加北京 创金 富基金销售有限公司为 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、公司网	2022 年 6 月 8 日
26	长信基金管理有限责任公司关于增加上海 中 财富基金销售有限公司为 下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投	上证报、中国证监会电子披露网、公司网	2022 年 6 月 13 日

	资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告		
27	长信基金管理有限责任公司关于增加上海基金销售有限公司为 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 、公司网	2022 年 6 月 15 日
28	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 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 、公司网	2022 年 6 月 15 日
29	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 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 、公司网	2022 年 6 月 30 日

§ 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	100,000,826.42	0.00	0.00	100,000,826.42	39.64

产品特有风险

1、基金净值大 波动的风险

单一持有基金比例过高的投资者连续大量赎回，可能会影响基金投资的持续性和稳定性，增加变现成本。同时，按照净值计算 差处理规则可能 起基金份额净值异常上涨或下 。

2、赎回申 延期办理的风险

单一持有基金比例过高的投资者大额赎回后可能 发本基金 额赎回条件，导致同期中小投资者小额赎回面 部分延期办理的情况。

3、基金投资策略 以实现的风险

单一持有基金比例过高的投资者大额赎回后，可能 起基金资产总净值显著降低，从而 基金在投资时受到限制，导致基金投资策略 以实现。

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、《长信利发债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长信利发债券型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《长信利发债券型证券投资基金托管协议》；
- 5、报告期内在指定报 上披露的各种公告的原 ；
- 6、长信基金管理有限责任公司营业执照、公司 程及相关资格批复文件。

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 ； 。

长信基金管理有限责任公司

2022 年 8 月 31 日