

# 长信利率债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：国泰君安证券股份有限公司

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。

基金托管人国泰君安证券股份有限公司根据本基金基金合同的规定，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

|   |           |
|---|-----------|
| <b>§ 1 重要提示及目录</b>                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| 1.2 目录                                  | 3         |
| <b>§ 2 基金简介</b>                         | <b>5</b>  |
| 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         |
| <b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>                | <b>6</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 6         |
| 3.2 基金净值表现                              | 7         |
| <b>§ 4 管理人报告</b>                        | <b>9</b>  |
| 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             | 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             | 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        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>13</b> |
| 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        |
| <b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>              | <b>13</b> |
| 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                                | 20        |
| <b>§ 7 投资组合报告</b>                       | <b>38</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 38        |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 38        |
| 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       | 38        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 39        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 39        |
| 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      | 39        |

|  |           |
|--|-----------|
| 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..... | 39        |
| 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..... | 39        |
| 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.....    | 39        |
| 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....             | 40        |
| 7.11 投资组合报告附注.....                         | 40        |
| <b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>                 | <b>42</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....                 | 42        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....              | 43        |
| 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.....      | 43        |
| <b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>                 | <b>43</b> |
| <b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>                   | <b>44</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议.....                      | 44        |
| 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.....      | 44        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....           | 44        |
| 10.4 基金投资策略的改变.....                        | 44        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....                 | 44        |
| 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.....         | 44        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....                | 44        |
| 10.8 其他重大事件.....                           | 45        |
| <b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>           | <b>49</b> |
| 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 .....   | 49        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....                   | 50        |
| <b>§ 12 备查文件目录 .....</b>                   | <b>50</b> |
| 12.1 备查文件目录.....                           | 50        |
| 12.2 存放地点.....                             | 50        |
| 12.3 查阅方式.....                             | 50        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                     |                    |                  |
|---------------------|--------------------|------------------|
| 基金名称                | 长信利率债债券型证券投资基金     |                  |
| 基金简称                | 长信利率债债券            |                  |
| 基金主代码               | 519943             |                  |
| 基金运作方式              | 契约型开放式             |                  |
| 基金合同生效日             | 2019 年 5 月 14 日    |                  |
| 基金管理人               | 长信基金管理有限责任公司       |                  |
| 基金托管人               | 国泰君安证券股份有限公司       |                  |
| 报告期末基金份额总额          | 1,663,438,044.06 份 |                  |
| 基金合同存续期             | 不定期                |                  |
| 下属分级基金的基金简称         | 长信利率债债券 A          | 长信利率债债券 C        |
| 下属分级基金的场内简称         | CXLLZA             | CXLLZC           |
| 下属分级基金的交易代码         | 519943             | 519942           |
| 报告期末下属分级基金的<br>份额总额 | 1,452,130,934.58 份 | 211,307,109.48 份 |

### 2.2 基金产品说明

|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 本基金以利率债券为主要投资对象，合理控制风险，在追求本金安全的基础上谨慎投资，力争实现基金资产的长期稳定增值。   |
| 投资策略   | 本基金将在基金合同约定的投资范围内，通过对宏观经济运行状况、国家货币政策和财政政策、国家产业政策及资本市场资金环境的研究，积极把握宏观经济发展趋势、利率走势、债券市场相对收益率、券种的流动性以及信用水平，优化固定收益类金融工具的资产比例配置。在有效控制风险的基础上，适时调整组合久期，以获得基金资产的稳定增值，提高基金总体收益率。 |
| 业绩比较基准 | 中债国开行债券指数收益率*80%+银行一年期定存利率（税后）*20%  |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，其预期风险与收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。   |

### 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               | 国泰君安证券股份有限公司             |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 周永刚                        | 帅芳                       |
|             | 联系电话 | 021-61009999               | 021-38031815             |
|             | 电子邮箱 | zhouyg@cxfund.com.cn       | shuaifang@gtjas.com      |
| 客户服务电话      |      | 4007005566                 | 021-38917599-5           |
| 传真          |      | 021-61009800               | 021-38677819             |
| 注册地址        |      | 中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 9 楼 | 中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号   |
| 办公地址        |      | 上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼       | 上海市静安区新闻路 669 号博华广场 19 楼 |
| 邮政编码        |      | 200120                     | 200041                   |

|       |     |    |
|-------|-----|----|
| 法定代表人 | 刘元瑞 | 贺青 |
|-------|-----|----|

## 2.4 信息披露方式

|                     |   |
|---------------------|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 证券时报  |
| 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、上海市静安区新闻路 669 号博华广场 19 楼 |

## 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 | 北京市西城区太平桥大街 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) |                |
|---------------|-------------------------------------|----------------|
|               | 长信利率债债券 A                           | 长信利率债债券 C      |
| 本期已实现收益       | 30,393,051.02                       | 5,039,855.66   |
| 本期利润          | 23,199,839.06                       | 4,354,661.19   |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0139                              | 0.0134         |
| 本期加权平均净值利润率   | 1.21%                               | 1.17%          |
| 本期基金份额净值增长率   | 0.99%                               | 0.80%          |
| 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      | 70,752,010.43                       | 5,369,031.59   |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0487                              | 0.0254         |
| 期末基金资产净值      | 1,618,850,769.55                    | 230,604,002.66 |
| 期末基金份额净值      | 1.1148                              | 1.0913         |
| 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   | 11.59%                              | 10.23%         |

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

长信利率债债券 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      | 0.04%    | 0.04%       | 0.05%      | 0.03%         | -0.01% | 0.01% |
| 过去三个月      | 0.61%    | 0.04%       | 0.79%      | 0.04%         | -0.18% | 0.00% |
| 过去六个月      | 0.99%    | 0.06%       | 1.31%      | 0.05%         | -0.32% | 0.01% |
| 过去一年       | 3.19%    | 0.07%       | 4.06%      | 0.05%         | -0.87% | 0.02% |
| 过去三年       | 10.89%   | 0.08%       | 11.36%     | 0.07%         | -0.47% | 0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 11.59%   | 0.07%       | 12.08%     | 0.07%         | -0.49% | 0.00% |

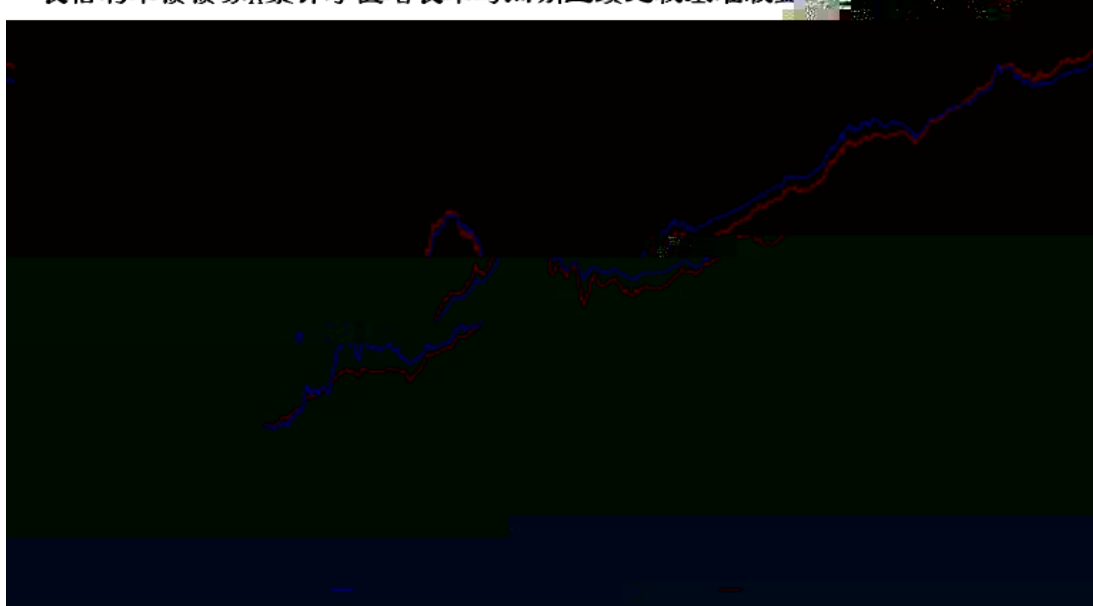
长信利率债债券 C

| 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 | 0.01%    | 0.04%       | 0.05%      | 0.03%         | -0.04% | 0.01% |
| 过去三个月 | 0.52%    | 0.04%       | 0.79%      | 0.04%         | -0.27% | 0.00% |
| 过去六个月 | 0.80%    | 0.06%       | 1.31%      | 0.05%         | -0.51% | 0.01% |

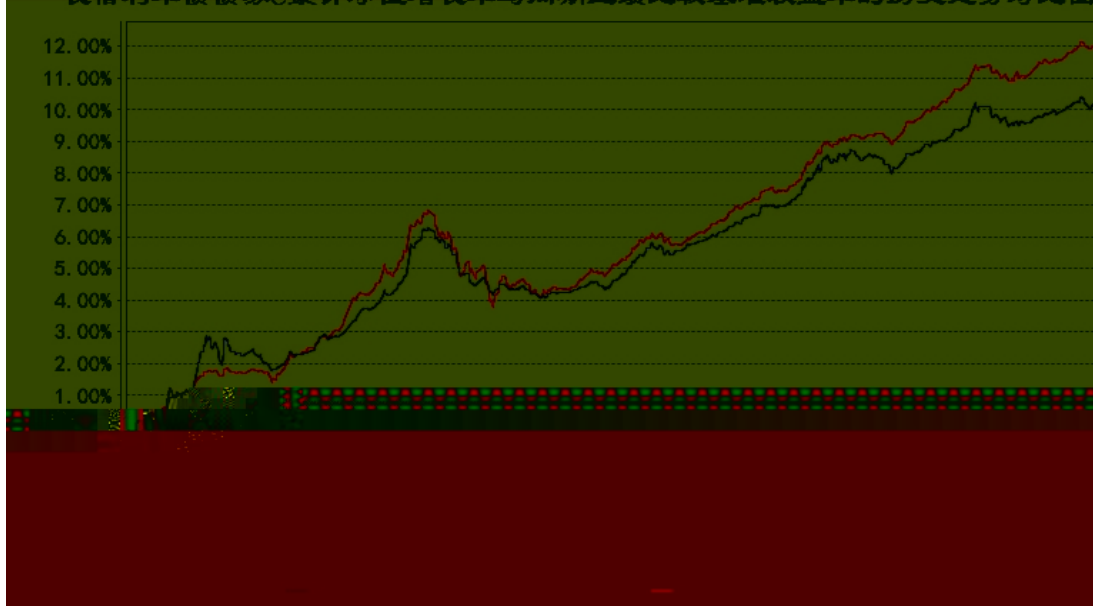
|            |        |       |        |       |        |       |
|------------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 过去一年       | 2.78%  | 0.07% | 4.06%  | 0.05% | -1.28% | 0.02% |
| 过去三年       | 9.59%  | 0.08% | 11.36% | 0.07% | -1.77% | 0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 10.23% | 0.07% | 12.08% | 0.07% | -1.85% | 0.00% |

### 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

长信利率债债券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



长信利率债债券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、图示日期为 2019 年 5 月 14 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之日起 6 个月内为建仓期；建仓期结束时，本基金各项投资比例已符合基金合同中的约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金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、长信长金通货市场基金、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 |        |  |
| 刘婧 | 长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信利众债券型证券投资基金（LOF）、长信稳健精选混合型证券投资基金和长信利率债债券型证券投资基金 | 2021 年 4 月 6 日  | -    | 9 年    | 北京大学工程硕士，具有基金从业资格，中国国籍。曾任职于工银安盛人寿保险有限公司资产管理部，2016 年 5 月加入长信基金管理有限责任公司，历任基金经理助理、投资经理助理和投资经理，现任长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信利众债券型证券投资基金（LOF）、长信稳健精选混合型证券投资基金和长信利率债债券型证券投资基金的基金经理。 |

|    |                                     |                |   |     |   |
|----|-------------------------------------|----------------|---|-----|---|
|    | 的基金经理                               |                |   |     |   |
| 钱进 | 长信利息收益开放式证券投资基金和长信利率债债券型证券投资基金的基金经理 | 2022 年 3 月 8 日 | - | 7 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金融市场部, 从事债券相关投资和交易工作, 2021 年 7 月加入长信基金管理有限责任公司, 现担任长信利息收益开放式证券投资基金和长信利率债债券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

上半年国内经济增速面临压力, 政策及时进行逆周期调节推动宽信用落地, 但二季度遭遇疫情扰动影响经济修复进程, 造成了上半年利率债行情的反复, 震荡区间约在 2.7-2.85% 之间。本

基金上半年通过研判经济基本面、资金面，以及紧密跟踪央行货币政策变化，积极把握利率债的波段交易机会，灵活调整组合的久期。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2022 年 6 月 30 日，长信利率债债券 A 基金份额净值为 1.1148 元，份额累计净值为 1.2514 元，本报告期内长信利率债债券 A 净值增长率为 0.99%；长信利率债债券 C 基金份额净值为 1.0913 元，份额累计净值为 1.2230 元，本报告期内长信利率债债券 C 净值增长率为 0.80%，同期业绩比较基准收益率为 1.31%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，在疫情影响逐渐弱化和稳增长政策扶持下，疫后经济有望逐步修复，但压力影响仍在，经济引擎发力重点仍在基建，地产能否好转是下半年基本面的较大不确定性所在；政策方面仍将为基本面修复保驾护航，货币政策关注通胀和就业，财政政策更强调前期政策加快落实。整体来看，利率债上行风险不大，但趋势性下行的空间或也有限，震荡格局仍未打破，中短端锚定资金价格、长端锚定基本面修复进程，下半年仍有较多机会可以把握，本基金将继续保持审慎严谨的态度，密切关注经济走势和政策动向，灵活调整组合久期、结构和仓位，加强流动性管理，进一步优化投资组合，力争为投资者获取更好的收益。

#### 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。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

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 1 月 25 日、2022 年 4 月 22 日进行了利润分配，A 类份额每 10 份基金份额分别派发红利 0.540 元、0.520 元，C 类份额每 10 份基金份额分别派发红利 0.540 元、0.510 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，国泰君安证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在长信利率债债券型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，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，未发现本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

本托管人复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况（如有）、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整。

### § 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：长信利率债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<br>2022 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|------------|---------|------------------------|--------------------------|
| <b>资产：</b> |         |                        |                          |
| 银行存款       | 6.4.7.1 | 4,213,996.50           | 2,309,609.04             |
| 结算备付金      |         | 1,605.10               | 1,589.99                 |
| 存出保证金      |         | -                      | -                        |

|               |            |                           |                             |
|---------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| 交易性金融资产       | 6.4.7.2    | 1,665,850,628.50          | 1,638,629,000.00            |
| 其中：股票投资       |            | -                         | -                           |
| 基金投资          |            | -                         | -                           |
| 债券投资          |            | 1,665,850,628.50          | 1,638,629,000.00            |
| 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    | 180,034,520.55            | -                           |
| 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         |            | 20,318.07                 | 48,190.47                   |
| 递延所得税资产       |            | -                         | -                           |
| 其他资产          | 6.4.7.8    | -                         | 29,516,823.56               |
| 资产总计          |            | 1,850,121,068.72          | 1,670,505,213.06            |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2022年6月30日</b> | <b>上年度末<br/>2021年12月31日</b> |
| <b>负 债：</b>   |            |                           |                             |
| 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     |            | -                         | 264,099,403.85              |
| 应付清算款         |            | -                         | -                           |
| 应付赎回款         |            | 20,242.38                 | 896.99                      |
| 应付管理人报酬       |            | 372,243.32                | 305,821.54                  |
| 应付托管费         |            | 53,177.60                 | 43,688.78                   |
| 应付销售服务费       |            | 50,798.91                 | 2,700.79                    |
| 应付投资顾问费       |            | -                         | -                           |
| 应交税费          |            | -                         | -                           |
| 应付利润          |            | -                         | -                           |
| 递延所得税负债       |            | -                         | -                           |
| 其他负债          | 6.4.7.9    | 169,834.30                | 215,740.44                  |
| 负债合计          |            | 666,296.51                | 264,668,252.39              |
| <b>净资产：</b>   |            |                           |                             |
| 实收基金          | 6.4.7.10   | 1,663,438,044.06          | 1,162,791,815.63            |
| 其他综合收益        | 6.4.7.11   | -                         | -                           |
| 未分配利润         | 6.4.7.12   | 186,016,728.15            | 243,045,145.04              |
| 净资产合计         |            | 1,849,454,772.21          | 1,405,836,960.67            |

|          |  |                  |                  |
|----------|--|------------------|------------------|
| 负债和净资产总计 |  | 1,850,121,068.72 | 1,670,505,213.06 |
|----------|--|------------------|------------------|

注 1、报告截止日 2022 年 6 月 30 日，长信利率债债券 A 份额净值 1.1148 元，长信利率债债券 C 份额净值 1.0913 元，基金份额总额为 1,663,438,044.06 份，其中长信利率债债券 A 份额 1,452,130,934.58 份。长信利率债债券 C 份额 211,307,109.48 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：长信利率债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<br>2022 年 1 月 1 日至 2022<br>年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2021 年 1 月 1 日至 2021<br>年 6 月 30 日 |
|-------------------|----------|--|---|
| <b>一、营业总收入</b>    |          | 34,393,890.30                            | 19,121,208.26                                 |
| 1. 利息收入           |          | 1,578,799.91                             | 14,860,751.66                                 |
| 其中：存款利息收入         | 6.4.7.13 | 418,225.41                               | 73,538.38                                     |
| 债券利息收入            |          | -  | 14,528,832.12                                 |
| 资产支持证券利息收入        |          | -  | -   |
| 买入返售金融资产收入        |          | 1,160,574.50                             | 258,381.16                                    |
| 证券出借利息收入          |          | -  | -   |
| 其他利息收入            |          | -  | -   |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） |          | 40,691,840.24                            | 3,476,982.75                                  |
| 其中：股票投资收益         | 6.4.7.14 | -  | -   |
| 基金投资收益            |          | -  | -   |
| 债券投资收益            | 6.4.7.15 | 40,691,840.24                            | 3,476,982.75                                  |
| 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 | -  | -   |
| 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   | -7,878,406.43 | 782,567.25    |
| 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   | 1,656.58      | 906.60        |
| <b>减：二、营业总支出</b>           |            | 6,839,390.05  | 3,257,882.25  |
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2.1 | 4,041,402.01  | 1,523,225.67  |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2.2 | 577,343.01    | 217,603.64    |
| 3. 销售服务费                   | 6.4.10.2.3 | 751,853.78    | 37,761.05     |
| 4. 投资顾问费                   |            |               | -             |
| 5. 利息支出                    |            | 1,360,631.10  | 1,341,208.13  |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | 1,360,631.10  | 1,341,208.13  |
| 6. 信用减值损失                  | 6.4.7.22   |               | -             |
| 7. 税金及附加                   |            |               | -             |
| 8. 其他费用                    | 6.4.7.23   | 108,160.15    | 138,083.76    |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | 27,554,500.25 | 15,863,326.01 |
| 减：所得税费用                    |            |               | -             |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | 27,554,500.25 | 15,863,326.01 |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>       |            |               | -             |
| <b>六、综合收益总额</b>            |            | 27,554,500.25 | 15,863,326.01 |

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：长信利率债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<br>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) | 1,162,791,815.63                      | -      | 243,045,145.04 | 1,405,836,960.67 |

|  |  |        |                 |                   |
|--|--|--------|-----------------|-------------------|
| 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)                          | 1,162,791,815.63                           | -      | 243,045,145.04  | 1,405,836,960.67  |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | 500,646,228.43                             | -      | -57,028,416.89  | 443,617,811.54    |
| (一)、综合收益总额                               | -  | -      | 27,554,500.25   | 27,554,500.25     |
| (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)      | 500,646,228.43                             | -      | 185,764,202.39  | 686,410,430.82    |
| 其中：1. 基金申购款                              | 3,394,083,623.28                           | -      | 558,688,589.30  | 3,952,772,212.58  |
| 2. 基金赎回款                                 | -2,893,437,394.85                          | -      | -372,924,386.91 | -3,266,361,781.76 |
| (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) | -  | -      | -270,347,119.53 | -270,347,119.53   |
| (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)                          | 1,663,438,044.06                           | -      | 186,016,728.15  | 1,849,454,772.21  |
| 项目                                       | 上年度可比期间<br>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)                          | 887,739,582.33                             | -      | 143,093,070.17  | 1,030,832,652.50  |
| 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)                          | 887,739,582.33  | - | 143,093,070.17  | 1,030,832,652.50 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | -340,731,086.48 | - | -42,845,713.71  | -383,576,800.19  |
| (一)、综合收益总额                               | -               | - | 15,863,326.01   | 15,863,326.01    |
| (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)      | -340,731,086.48 | - | -58,709,039.72  | -399,440,126.20  |
| 其中: 1. 基金申购款                             | 260,668,607.83  | - | 42,453,254.72   | 303,121,862.55   |
| 2. 基金赎回款                                 | -601,399,694.31 | - | -101,162,294.44 | -702,561,988.75  |
| (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)                          | 547,008,495.85  | - | 100,247,356.46  | 647,255,852.31   |

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

长信利率债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)由长信富泰纯债一年定期开放债券型证券投资基金(以下简称“长信富泰纯债一年定开债券”)转型而成。长信富泰纯债一年定开债券系由基金管理人长信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《长信富

泰纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规的规定，经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）以证监许可[2015]2617 号文及机构部函[2016]1344 号文批准公开募集，于 2016 年 7 月 21 日募集成立。本基金为契约型开放式基金，存续期限为不定期。本基金根据认购、申购费用、赎回费用收取方式的不同，将基金份额分为 A 类基金份额和 C 类基金份额。本基金首次设立募集规模为 1,073,054,293.32 份，经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)验证，并出具了编号为毕马威华振验字第 1600546 号验资报告。长信富泰纯债一年定开债券的基金管理人为长信基金管理有限责任公司，基金托管人为国泰君安证券股份有限公司。

长信富泰纯债一年定开债券于 2019 年 3 月 11 日起至 2019 年 4 月 4 日止期间以通讯方式召开了基金份额持有人大会，大会审议了《关于长信富泰纯债一年定期开放债券型证券投资基金修改法律文件的议案》，并由参加大会的基金份额持有人及代理人对本次会议议案表决通过，决议于 2019 年 4 月 8 日生效。长信富泰纯债一年定期开放债券型证券投资基金变更为长信利率债债券型证券投资基金，修订后的《长信利率债债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）于 2019 年 5 月 14 日生效。本基金的基金管理人和基金托管人保持不变。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、截至报告期末最新公告的基金合同及《长信利率债债券型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超级短期融资券、资产支持证券、次级债券、可分离交易可转债的纯债部分、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）、同业存单、货币市场工具、国债期货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。本基金不参与权证、股票等权益类资产投资，可转债仅投资二级市场可分离交易可转债的纯债部分。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法律法规或相关规定。基金的投资组合比例为：本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%，投资于利率债券的比例不低于非现金基金资产的 80%，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款。本基金所界定的利率债券是指国债、政策性金融债和央行票据。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为：中债国开行债券指数收益率×80%+银行一年期定存利率（税后）×20%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定（以下简称“企业会计准则”）

以及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，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

###### (1) 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将所持有的金融资产在初始确认时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以摊余成本计量的金融资产，暂无金融资产划分为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

金融资产的合同条款规定在特定日期产生的现金流量仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付，且本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标，则本基金将该金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产。此类金融资产主要包括货币资金、各类应收款项、买入返售金融资产等。

不符合分类为以摊余成本计量的金融资产以及公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产条件的金融资产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。除衍生工具所产生的金融资产计入“衍生金融资产”外，其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产计入“交易性金融资产”。

###### (2) 金融负债的分类

本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无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。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

##### 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。对于以常规方式购买或出售金融资产的，在交易日确认将收到的资产和为此将承担的负债，或者在交易日终止确认已出售

的资产。金融资产和金融负债在初始确认时以公允价值计量。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券或资产支持证券已到付息期但尚未领取的利息，单独确认为应收项目。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，公允价值变动形成的利得或损失以及与该金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益。以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，发生减值或终止确认产生的利得或损失，计入当期损益。

本基金对分类为以摊余成本计量的金融资产以预期信用损失为基础确认损失准备。除购买或源生的已发生信用减值的金融资产外，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的变动情况。若该金融工具的信用风险自初始确认后已显著增加，本基金按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备；若该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加，本基金按照相当于该金融工具未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备。信用损失准备的增加或转回金额，作为减值损失或利得计入当期损益。

本基金在上一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形，本基金在当期资产负债表日按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

本基金利用可获得的合理且有依据的前瞻性信息，通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止、该金融资产已转移且其所有权上几乎所有的风险和报酬已转移或虽然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，但是未保留对该金融资产的控制，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。若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风险和报酬，且保留了对该金融资产控制的，则按照其继续涉入被转移金融资产的程度继续确认该被转移金融资产，并相应确认相关负债。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价(包括转出的非现金资产或承担的新金融负债)之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.4.3 收入/（损失）的确认和计量

### (1) 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

### (2) 投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本与相关交易费用的差额确认。

基金投资收益于卖出基金成交日确认，并按卖出基金成交金额扣除应结转的基金投资成本、相关交易费用与税费后的差额入账。

债券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖债券价差收入。除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。买卖债券价差收入为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

资产支持证券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖资产支持证券价差收入。资产支持证券利息收入在持有期内，按资产支持证券的票面价值和预计收益率计算的利息逐日确认资产支持证券利息收入。在收到资产支持证券支付的款项时，其中属于证券投资收益的部分冲减应计利息(若有)后的差额，确认资产支持证券利息收入。买卖资产支持证券价差收入为卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本、相关交易费用与税费后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额确认，由上市公司代扣代缴的个人所得税于卖出交易日按实际代扣代缴金额确认。

基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。

### (3) 公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产卖出或到期时转出计入投资收益。

### (4) 信用减值损失

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认信用损失准备。本基金

所计提的信用减值损失计入当期损益。

#### 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

根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认计量》、《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》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关规定,以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》,公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。本基金在编制本中期财务报表时已采用该准则,并采用准则允许的实务简便方法,调整期初基金净值,2021 年的比较数据将不作重述。

于首次执行日,本基金因执行新金融工具准则调减期初基金净值人民币 0.00 元,本基金执行新金融工具准则的影响如下:

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融工具包括银行存款、结算备付金、应收申购款、应收利息、卖出回购金融资产款和应付利息,金额分别为人民币 2,309,609.04 元、人民币 1,589.99 元、人民币 48,190.47 元、人民币 29,516,823.56 元、人民币 264,099,403.85 元和人民币 18,246.56 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融工具包括银行存款、结算备付金、应收申购款、其他资产-应收利息、卖出回购金融资产款和其他负债-应付利息。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,并反映在银行存款、结算备付金、应收申购款和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。新金融工具准则下,银行存款、结算备付金、应收申购款、其他资产-应收利息、卖出回购金融资产款和其他负债-应付利息的金额分别为人民币 2,310,616.17 元、人民币 1,590.87 元、人民币 60,190.43 元、人民币 0.00 元、人民币 264,117,650.41 元和人民币 0.00 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融工具为交易性金融资产,金额为人民币 1,638,629,000.00 元,归属于交易性金融资产的应收利息金额为人民币 29,503,815.59 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融工具为交易性金融资产,金额为人民币 1,668,132,815.59 元。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内未发生重大会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需说明的重大会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《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》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《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》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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债券免征增值税;2018年1月1日起,公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务,以基金管理人作为增值税纳税人,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖债券的差价收入,债券的利息收入及其他收入,暂不缴纳企业所得税。

(3) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 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<br>2022年6月30日 |
|--------------|-------------------|
| 活期存款         | 4,213,996.50      |
| 等于：本金        | 4,196,295.14      |
| 加：应计利息       | 17,701.36         |
| 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           | 4,213,996.50      |

## 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2022年6月30日 |                  |                  |                  |            |
|---------------|-------------------|------------------|------------------|------------------|------------|
|               | 成本                | 应计利息             | 公允价值             | 公允价值变动           |            |
| 股票            | -                 | -                | -                | -                |            |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                 | -                | -                | -                |            |
| 债券            | 交易所市场             | -                | -                | -                |            |
|               | 银行间市场             | 1,644,337,532.48 | 20,757,628.50    | 1,665,850,628.50 | 755,467.52 |
|               | 合计                | 1,644,337,532.48 | 20,757,628.50    | 1,665,850,628.50 | 755,467.52 |
| 资产支持证券        | -                 | -                | -                | -                |            |
| 基金            | -                 | -                | -                | -                |            |
| 其他            | -                 | -                | -                | -                |            |
| 合计            | 1,644,337,532.48  | 20,757,628.50    | 1,665,850,628.50 | 755,467.52       |            |

## 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工具。

## 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

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2022年6月30日 |           |
|-------|-------------------|-----------|
|       | 账面余额              | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | -                 | -         |
| 银行间市场 | 180,034,520.55    | -         |
| 合计    | 180,034,520.55    | -         |

## 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有因买断式逆回购交易而取得的债券。

## 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

本基金本报告期末未持有其他资产。

## 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2022年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                 |
| 应付赎回费       | 5.07              |
| 应付证券出借违约金   | -                 |
| 应付交易费用      | 71,269.08         |
| 其中：交易所市场    | -                 |
| 银行间市场       | 71,269.08         |
| 应付利息        | -                 |
| 预提账户维护费     | 9,300.00          |
| 预提审计费       | 29,752.78         |
| 预提信息披露费     | 59,507.37         |
| 合计          | 169,834.30        |

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

## 长信利率债债券 A

| 项目            | 本期<br>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          | 1,155,975,202.69           | 1,155,975,202.69  |
| 本期申购          | 2,419,156,926.34           | 2,419,156,926.34  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -2,123,001,194.45          | -2,123,001,194.45 |
| 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           | 1,452,130,934.58           | 1,452,130,934.58  |

## 长信利率债债券 C

| 项目   | 本期<br>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 | 6,816,612.94               | 6,816,612.94   |
| 本期申购 | 974,926,696.94             | 974,926,696.94 |

|               |                 |                 |
|---------------|-----------------|-----------------|
| 本期赎回（以“-”号填列） | -770,436,200.40 | -770,436,200.40 |
| 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           | 211,307,109.48  | 211,307,109.48  |

注：本期申购含红利再投、转换入份(金)额，本期赎回含转换出份(金)额。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

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

##### 长信利率债债券 A

| 项目             | 已实现部分           | 未实现部分           | 未分配利润合计         |
|----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 本期期初           | 157,958,029.24  | 83,812,310.34   | 241,770,339.58  |
| 本期利润           | 30,393,051.02   | -7,193,211.96   | 23,199,839.06   |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 101,098,771.28  | 19,348,726.16   | 120,447,497.44  |
| 其中：基金申购款       | 226,940,455.47  | 169,347,581.71  | 396,288,037.18  |
| 基金赎回款          | -125,841,684.19 | -149,998,855.55 | -275,840,539.74 |
| 本期已分配利润        | -218,697,841.11 | -               | -218,697,841.11 |
| 本期末            | 70,752,010.43   | 95,967,824.54   | 166,719,834.97  |

##### 长信利率债债券 C

| 项目             | 已实现部分          | 未实现部分          | 未分配利润合计        |
|----------------|----------------|----------------|----------------|
| 本期期初           | 782,796.43     | 492,009.03     | 1,274,805.46   |
| 本期利润           | 5,039,855.66   | -685,194.47    | 4,354,661.19   |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 51,195,657.92  | 14,121,047.03  | 65,316,704.95  |
| 其中：基金申购款       | 93,685,206.75  | 68,715,345.37  | 162,400,552.12 |
| 基金赎回款          | -42,489,548.83 | -54,594,298.34 | -97,083,847.17 |
| 本期已分配利润        | -51,649,278.42 | -              | -51,649,278.42 |
| 本期末            | 5,369,031.59   | 13,927,861.59  | 19,296,893.18  |

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 活期存款利息收入  | 369,744.26                 |
| 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 | 14.23                      |
| 其他        | 48,466.92                  |
| 合计        | 418,225.41                 |

注：其他为申购款利息收入。

#### 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

本基金本报告期无股票投资收益。

#### 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<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |
|------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——利息收入                 | 33,827,293.84              |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 6,864,546.40               |
| 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                           | 40,691,840.24              |

##### 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<br>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   | 6,801,356,911.90           |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 6,704,058,313.57           |
| 减：应计利息总额               | 90,350,901.93              |
| 减：交易费用                 | 83,150.00                  |
| 买卖债券差价收入               | 6,864,546.40               |

##### 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益——赎回差价收入。

##### 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益——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

本基金本报告期内无衍生工具收益。

##### 6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 6.4.7.19 股利收益

本基金本报告期内无股利收益。

#### 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             | -7,878,406.43        |
| 股票投资                   | -                    |
| 债券投资                   | -7,878,406.43        |
| 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                     | -7,878,406.43        |

#### 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 | 1,656.58             |
| 合计      | 1,656.58             |

注：赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，其中，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，除此之外赎回费用的25%归基金财产，其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

#### 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<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 审计费用    | 29,752.78                             |
| 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    | 300.00                                |
| 合计      | 108,160.15                            |

注：其他费用为银行间账户查询费。

#### 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

资产负债表日至本财务报告批准报出日，本基金已进行一次利润分配，A 类份额每 10 份基金份额派发红利 0.500 元，C 类份额每 10 份基金份额派发红利 0.260 元。

除上述情况外，截至本财务报告批准报出日，本基金无其他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 |
| 国泰君安证券股份有限公司（“国泰君安”） | 基金托管人、基金销售机构 |
| 长江期货股份有限公司（“长江期货”）   | 基金管理人的股东的子公司 |

#### 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

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券交易。

### 6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无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

本基金本报告期内及上年度可比期间无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

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

## 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<br>2022年1月1日至2022年6<br>月30日 | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021<br>年6月30日 |
|-----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 4,041,402.01                   | 1,523,225.67                        |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 381,678.29                     | 10,780.74                           |

注：支付基金管理人长信基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值×0.35%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：每日应计提的基金管理费=前一日基金资产净值×0.35%÷当年天数。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2022年1月1日至2022年6<br>月30日 | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021<br>年6月30日 |
|----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 577,343.01                     | 217,603.64                          |

注：支付基金托管人国泰君安的基金托管费按前一日基金资产净值×0.05%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：每日应计提的基金托管费=前一日基金资产净值×0.05%÷当年天数。

### 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<br>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           |           |           |
|                | 长信利率债债券 A                  | 长信利率债债券 C | 合计        |
| 长信基金           | -                          | 36,190.42 | 36,190.42 |
| 合计             | -                          | 36,190.42 | 36,190.42 |
| 获得销售服务费的各关联    | 上年度可比期间                    |           |           |

| 方名称  | 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                |           |           |
|      | 长信利率债债券 A                       | 长信利率债债券 C | 合计        |
| 长信基金 | -                               | 23,655.96 | 23,655.96 |
| 国泰君安 | -                               | 0.21      | 0.21      |
| 合计   | -                               | 23,656.17 | 23,656.17 |

注：根据基金合同的规定，长信利率债债券 A 不收取销售服务费，长信利率债债券 C 的销售服务费按基金前一日资产净值×0.40%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：长信利率债债券 C 的日销售服务费=前一日长信利率债债券 C 资产净值×0.40%÷当年天数。

#### 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

单位：人民币元

| 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日      |               |      |                |          |       |      |
|--|---------------|------|----------------|----------|-------|------|
| 银行间市场交易<br>的各关联方名称                         | 债券交易金额        |      | 基金逆回购          |          | 基金正回购 |      |
|  | 基金买入          | 基金卖出 | 交易金额           | 利息收入     | 交易金额  | 利息支出 |
| -  | -             | -    | -              | -        | -     | -    |
| 上年度可比期间<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |               |      |                |          |       |      |
| 银行间市场交易<br>的各关联方名称                         | 债券交易金额        |      | 基金逆回购          |          | 基金正回购 |      |
|  | 基金买入          | 基金卖出 | 交易金额           | 利息收入     | 交易金额  | 利息支出 |
| 国泰君安                                       | 51,945,485.25 | -    | 164,000,000.00 | 8,660.55 | -     | -    |

#### 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

本基金本报告期内及上年度可比期间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

本基金本报告期内及上年度可比期间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固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固有资金投资本基金。

#### 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

本基金的银行存款存放在托管人国泰君安在中国工商银行股份有限公司开立的托管账户中；本基金本报告期内及上年度可比期间无源自本基金托管人国泰君安的银行存款及利息收入。

#### 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

本基金本报告期末存放于长江期货的结算备付金金额为人民币 1,605.10 元(2021 年 6 月 30 日：人民币 1,575.74 元)。本基金本报告期无通过长江期货买卖期货成交额(2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日：无)，当期未发生应支付给长江期货的交易费用(2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日：无)，本报告期末无应付长江期货的交易费用余额(2021 年 6 月 30 日：无)。

#### 6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

| 长信利率债债券 A |                    |     |                    |                       |                    |                  |                    |    |
|-----------|--------------------|-----|--------------------|-----------------------|--------------------|------------------|--------------------|----|
| 序号        | 权益<br>登记日          | 除息日 |                    | 每 10 份基<br>金份额分红<br>数 | 现金形式<br>发放总额       | 再投资形式<br>发放总额    | 本期利润<br>分配合计       | 备注 |
|           |                    | 场内  | 场外                 |                       |                    |                  |                    |    |
| 1         | 2022 年 1<br>月 25 日 | -   | 2022 年 1<br>月 25 日 | 0.540                 | 100,585,<br>844.09 | 336,595.73       | 100,922,<br>439.82 | -  |
| 2         | 2022 年 4<br>月 22 日 | -   | 2022 年 4<br>月 22 日 | 0.520                 | 108,826,<br>573.27 | 8,948,828.<br>02 | 117,775,<br>401.29 | -  |
| 合计        | -                  | -   | -                  | 1.060                 | 209,412,<br>417.36 | 9,285,423.<br>75 | 218,697,<br>841.11 | -  |
| 长信利率债债券 C |                    |     |                    |                       |                    |                  |                    |    |
| 序号        | 权益<br>登记日          | 除息日 |                    | 每 10 份基<br>金份额分红<br>数 | 现金形式<br>发放总额       | 再投资形式<br>发放总额    | 本期利润<br>分配合计       | 备注 |
|           |                    | 场内  | 场外                 |                       |                    |                  |                    |    |
| 1         | 2022 年 1<br>月 25 日 | -   | 2022 年 1<br>月 25 日 | 0.540                 | 41,361,9<br>11.23  | 22,145.11        | 41,384,0<br>56.34  | -  |
| 2         | 2022 年 4<br>月 22 日 | -   | 2022 年 4<br>月 22 日 | 0.510                 | 10,250,1<br>62.19  | 15,059.89        | 10,265,2<br>22.08  | -  |
| 合计        | -                  | -   | -                  | 1.050                 | 51,612,0<br>73.42  | 37,205.00        | 51,649,2<br>78.42  | -  |

注：资产负债表日至本财务报告批准报出日，本基金已进行一次利润分配，A 类份额每 10 份基金份额派发红利 0.500 元，C 类份额每 10 份基金份额派发红利 0.260 元。

#### 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/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 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因参与转融通证券出借业务而出借的证券。

#### 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国泰君安转存于中国工商银行股份有限公司，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

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2022 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| A-1    | -                      | -                        |
| A-1 以下 | -                      | -                        |
| 未评级    | 30,175,684.93          | 99,910,000.00            |
| 合计     | 30,175,684.93          | 99,910,000.00            |

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<br>2022 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| AAA    | -                      | -                        |
| AAA 以下 | -                      | -                        |
| 未评级    | 1,635,674,943.57       | 1,538,719,000.00         |
| 合计     | 1,635,674,943.57       | 1,538,719,000.00         |

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 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2022年6月30<br>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                  | 4,213,996.50 | -      | -    | -    | -   | 4,213,996.50 |

|                         |                |                |                  |                |               |                  |
|-------------------------|----------------|----------------|------------------|----------------|---------------|------------------|
| 结算备付金                   | 1,605.10       | -              | -                | -              | -             | 1,605.10         |
| 交易性金融资产                 | -              | 172,649,273.98 | 1,371,961,030.14 | 121,240,324.38 | -             | 1,665,850,628.50 |
| 买入返售金融资产                | 180,034,520.55 | -              | -                | -              | -             | 180,034,520.55   |
| 应收申购款                   | -              | -              | -                | -              | 20,318.07     | 20,318.07        |
| 资产总计                    | 184,250,122.15 | 172,649,273.98 | 1,371,961,030.14 | 121,240,324.38 | 20,318.07     | 1,850,121,068.72 |
| 负债                      | -              | -              | -                | -              | -             | -                |
| 应付赎回款                   | -              | -              | -                | -              | 20,242.38     | 20,242.38        |
| 应付管理人报酬                 | -              | -              | -                | -              | 372,243.32    | 372,243.32       |
| 应付托管费                   | -              | -              | -                | -              | 53,177.60     | 53,177.60        |
| 应付销售服务费                 | -              | -              | -                | -              | 50,798.91     | 50,798.91        |
| 其他负债                    | -              | -              | -                | -              | 169,834.30    | 169,834.30       |
| 负债总计                    | -              | -              | -                | -              | 666,296.51    | 666,296.51       |
| 利率敏感度缺口                 | 184,250,122.15 | 172,649,273.98 | 1,371,961,030.14 | 121,240,324.38 | -645,978.44   | 1,849,454,772.21 |
| 上年度末<br>2021年12月<br>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                    | 2,309,609.04   | -              | -                | -              | -             | 2,309,609.04     |
| 结算备付金                   | 1,589.99       | -              | -                | -              | -             | 1,589.99         |
| 交易性金融资产                 | -              | 200,400,000.00 | 940,625,000.00   | 497,604,000.00 | -             | 1,638,629,000.00 |
| 应收申购款                   | -              | -              | -                | -              | 48,190.47     | 48,190.47        |
| 其他资产                    | -              | -              | -                | -              | 29,516,823.56 | 29,516,823.56    |
| 资产总计                    | 2,311,199.03   | 200,400,000.00 | 940,625,000.00   | 497,604,000.00 | 29,565,014.03 | 1,670,505,213.06 |
| 负债                      | -              | -              | -                | -              | -             | -                |
| 卖出回购金融资产款               | 264,099,403.85 | -              | -                | -              | -             | 264,099,403.85   |
| 应付赎回款                   | -              | -              | -                | -              | 896.99        | 896.99           |
| 应付管理人报酬                 | -              | -              | -                | -              | 305,821.54    | 305,821.54       |
| 应付托管费                   | -              | -              | -                | -              | 43,688.78     | 43,688.78        |
| 应付销售服务费                 | -              | -              | -                | -              | 2,700.79      | 2,700.79         |
| 其他负债                    | -              | -              | -                | -              | 215,740.44    | 215,740.44       |
| 负债总计                    | 264,099,403.85 | -              | -                | -              | 568,848.54    | 264,668,252.39   |

|         |                 |                |                |                |               |                  |
|---------|-----------------|----------------|----------------|----------------|---------------|------------------|
| 利率敏感度缺口 | -261,788,204.82 | 200,400,000.00 | 940,625,000.00 | 497,604,000.00 | 28,996,165.49 | 1,405,836,960.67 |
|---------|-----------------|----------------|----------------|----------------|---------------|------------------|

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               | 10,185,504.38     | 15,777,341.70  |
|           | 市场利率上升 27 个基点               | -10,185,504.38    | -15,777,341.70 |

#### 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<br>2022年6月30日 |               | 上年度末<br>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 | -                 | -             | -                   | -             |
| 交易性金融资产—基金投资 | -                 | -             | -                   | -             |

|               |                  |       |                  |        |
|---------------|------------------|-------|------------------|--------|
| 交易性金融资产—债券投资  | 1,665,850,628.50 | 90.07 | 1,638,629,000.00 | 116.56 |
| 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            | 1,665,850,628.50 | 90.07 | 1,638,629,000.00 | 116.56 |

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金主要投资债券等固定收益品种，无重大其他价格风险，因此未进行其他价格风险的敏感性分析。

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，被划分为三个层次：

第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值是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；

第三层次输入值是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<br>2022年6月30日 | 上年度末<br>2021年12月31日 |
|---------------|-------------------|---------------------|
| 第一层次          | -                 | -                   |
| 第二层次          | 1,665,850,628.50  | 1,638,629,000.00    |
| 第三层次          | -                 | -                   |
| 合计            | 1,665,850,628.50  | 1,638,629,000.00    |

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，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股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的

不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产 (2021 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 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              | -                | -             |
|    | 其中：股票             | -                | -             |
| 2  | 基金投资              | -                | -             |
| 3  | 固定收益投资            | 1,665,850,628.50 | 90.04         |
|    | 其中：债券             | 1,665,850,628.50 | 90.04         |
|    | 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          | 180,034,520.55   | 9.73          |
|    | 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      | 4,215,601.60     | 0.23          |
| 8  | 其他各项资产            | 20,318.07        | 0.00          |
| 9  | 合计                | 1,850,121,068.72 | 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

本基金本报告期末未持有股票。

**7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合**

本基金本报告期末未持有股票。

**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**

本基金本报告期末未持有股票。

**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**

本基金本报告期内未买入股票。

**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**

本基金本报告期内未卖出股票。

**7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额**

本基金本报告期内未投资股票。

**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      | 120,952,836.71   | 6.54          |
| 2  | 央行票据      | -                | -             |
| 3  | 金融债券      | 1,544,897,791.79 | 83.53         |
|    | 其中：政策性金融债 | 1,544,897,791.79 | 83.53         |
| 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        | 1,665,850,628.50 | 90.07         |

**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  | 210207 | 21 国开 07 | 2,400,000 | 242,964,164.38 | 13.14         |
| 2  | 210202 | 21 国开 02 | 1,900,000 | 194,599,145.21 | 10.52         |
| 3  | 220202 | 22 国开 02 | 1,600,000 | 161,331,463.01 | 8.72          |
| 4  | 190208 | 19 国开 08 | 1,500,000 | 158,040,945.21 | 8.55          |
| 5  | 200407 | 20 农发 07 | 1,000,000 | 103,756,575.34 | 5.61          |

**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, 发行主体国家开发银行于 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决定书(银保监罚决字(2022)8号), 根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则, 经查, 国家开发银行监管标准化数据(EAST)系统数据质量及数据报送存在以下违法违规行为: 一、未报送逾期 90 天以上贷款余额 EAST 数据; 二、漏报贸易融资业务 EAST 数据; 三、漏报贷款核销业务 EAST 数据; 四、信贷资产转让业务 EAST 数据存在偏差; 五、未报送债券投资业务 EAST 数据; 六、漏报权益类投资业务 EAST 数据; 七、漏报跟单信用证业务 EAST 数据; 八、漏报保函业务 EAST 数据; 九、EAST 系统理财产品底层持仓余额数据存在偏差; 十、EAST 系统理财产品非标投向行业余额数据存在偏差; 十一、漏报分户账 EAST 数据; 十二、漏报授信信息 EAST 数据; 十三、EAST 系统《表外授信业务》表错报; 十四、EAST 系统《对公信贷业务借据》表错报; 十五、EAST 系统《关联关系》表漏报; 十六、EAST 系统《对公信贷分户账》表漏报; 十七、理财产品登记不规范。综上, 中国银行保险监督管理委员会决定对国家开发银行罚款 440 万元。

报告期内本基金投资的前十名证券中, 发行主体中国进出口银行于 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决定书(银保监罚决字(2022)9号), 根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则, 经查, 中国进出口银行监管标准化数据(EAST)系统数据质量及数据报送存在以下违法违规行为: 一、漏报不良贷款余额 EAST 数据; 二、漏报逾期 90 天以上贷款余额 EAST 数据; 三、漏报贸易融资业务 EAST 数据; 四、漏报贷款核销业务 EAST 数据; 五、漏报抵押物价值 EAST 数据; 六、漏报信贷资产转让业务 EAST 数据; 七、漏报债券投资业务 EAST 数据; 八、漏报权益类投资业务 EAST 数据; 九、漏报投资资

产管理产品业务 EAST 数据；十、漏报跟单信用证业务 EAST 数据；十一、漏报贷款承诺业务 EAST 数据；十二、未报送委托贷款业务 EAST 数据；十三、EAST 系统分户账与总账比对不一致；十四、漏报分户账 EAST 数据；十五、EAST 系统《对公活期存款分户账明细记录》表错报；十六、EAST 系统《关联关系》表漏报；十七、EAST 系统《对公信贷业务借据》表错报。综上，中国银行保险监督管理委员会决定对中国进出口银行罚款 420 万元。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体中国进出口银行于 2021 年 7 月 13 日收到中国银行保险监督管理委员会处罚决定书（银保监罚决字（2021）31 号），根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十五条、第四十六条和相关审慎经营规则，经查，中国进出口银行存在：一、违规投资企业股权；二、个别高管人员未经核准实际履职；三、监管数据漏报错报；四、违规向地方政府购买服务提供融资；五、违规变相发放土地储备贷款；六、向用地未获国务院批准的项目发放贷款；七、违规开展租金保理业务变相支持地方政府举债；八、租金保理业务基础交易不真实；九、向租赁公司发放用途不合规的流动资金贷款；十、违规向个别医疗机构新增融资；十一、个别并购贷款金额占比超出监管上限；十二、借并购贷款之名违规发放股权收购贷款；十三、违规向未取得“四证”的固定资产项目发放贷款；十四、违规发放流动资金贷款用于固定资产投资；十五、授信额度核定不审慎；十六、向无实际用款需求的企业发放贷款导致损失；十七、突破产能过剩行业限额要求授信；十八、项目贷款未按规定设定抵质押担保；十九、贷款风险分类不审慎；二十、信贷资产买断业务贷前调查不尽职；二十一、向借款人转嫁评估费用；二十二、同业业务交易对手名单制管理落实不到位；二十三、贸易背景审查不审慎；二十四、对以往监管通报问题整改不到位。综上，中国银行保险监督管理委员会决定对中国进出口银行罚没 7345.6 万元。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体中国农业发展银行于 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决定书（银保监罚决字（2022）10 号），根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则，经查，中国农业发展银行监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在以下违法违规行为：一、漏报不良贷款余额 EAST 数据；二、逾期 90 天以上贷款余额 EAST 数据存在偏差；三、漏报贷款核销业务 EAST 数据；四、漏报抵押物价值 EAST 数据；五、错报信贷资产转让业务 EAST 数据；六、未报送债券投资业务 EAST 数据；七、未报送权益类投资业务 EAST 数据；八、银行承兑汇票业务 EAST 数据存在偏差；九、漏报跟单信用证业务 EAST 数据；十、未报送贷款承诺业务 EAST 数据；十一、未报送委托贷款业务 EAST 数据；十二、EAST 系统分户账与总账比对不一致；十三、漏报对公活期存款账户明细 EAST 数据；十四、未在开户当月向 EAST 系统报送账户信息；十五、EAST 系统《表外

授信业务》表错报；十六、EAST 系统《对公信贷业务借据》表错报；十七、EAST 系统《对公信贷分户账》表漏报。综上，中国银行保险监督管理委员会决定对中国农业发展银行罚款 480 万元。

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。

### 7.11.2 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

本基金本报告期末未投资股票，不存在投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情形。

### 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 | -         |
| 2  | 应收清算款 | -         |
| 3  | 应收股利  | -         |
| 4  | 应收利息  | -         |
| 5  | 应收申购款 | 20,318.07 |
| 6  | 其他应收款 | -         |
| 7  | 待摊费用  | -         |
| 8  | 其他    | -         |
| 9  | 合计    | 20,318.07 |

### 7.11.4 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。

### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

### 7.11.6 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（%） |
| 长信利率债债券 A | 11,934   | 121,680.15 | 1,444,218,939.73 | 99.46     | 7,911,994.85 | 0.54      |
| 长信利率债债券 C | 758      | 278,769.27 | 209,278,617.85   | 99.04     | 2,028,491.63 | 0.96      |
| 合计        | 12,692   | 131,061.93 | 1,653,497,557.58 | 99.40     | 9,940,486.48 | 0.60      |

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 | 长信利率债债券 A | 29,385.63  | 0.00        |
|                  | 长信利率债债券 C | 86,080.92  | 0.04        |
|                  | 合计        | 115,466.55 | 0.01        |

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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 长信利率债债券 A | 0                 |
|                                | 长信利率债债券 C | 0~10              |
|                                | 合计        | 0~10              |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 长信利率债债券 A | 0~10              |
|                                | 长信利率债债券 C | 0                 |
|                                | 合计        | 0~10              |

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                                 | 长信利率债债券 A        | 长信利率债债券 C      |
|------------------------------------|------------------|----------------|
| 基金合同生效日（2019 年 5 月 14 日）<br>基金份额总额 | 4,128,623.59     | 2,320,352.04   |
| 本报告期期初基金份额总额                       | 1,155,975,202.69 | 6,816,612.94   |
| 本报告期基金总申购份额                        | 2,419,156,926.34 | 974,926,696.94 |
| 减：本报告期基金总赎回份额                      | 2,123,001,194.45 | 770,436,200.40 |
| 本报告期基金拆分变动份额                       | -                | -              |
| 本报告期期末基金份额总额                       | 1,452,130,934.58 | 211,307,109.48 |

## § 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，安昀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。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 (%) |    |
| 国泰君安 | 2      | -    | -                | -         | -              | -  |
| 申港证券 | 1      | -    | -                | -         | -              | -  |

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 (%) |
|------|------|------------------|------|--------------------|------|------------------|
| 国泰君安 | -    | -                | -    | -                  | -    | -                |
| 申港证券 | -    | -                | -    | -                  | -    | -                |

### 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  | 长信利率债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站、公司网站                   | 2022 年 1 月 24 日 |
| 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长信利率债债券型证券投资基金的分红公告   | 证券时报、中国证监会电子披露网站、公司网站              | 2022 年 1 月 24 日 |
| 5  | 长信基金管理有限责任公司关于长信利率债债券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                             | 证券时报、中国证监会电子披露网站、公司网站              | 2022 年 1 月 24 日 |
| 6  | 长信基金管理有限责任公司关于长信利率债债券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                             | 证券时报、中国证监会电子披露网站、公司网站              | 2022 年 1 月 25 日 |
| 7  | 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 |
| 8  | 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  |
| 9  | 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 |

|    |   |                                    |                 |
|----|---|------------------------------------|-----------------|
| 10 | 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 |
| 11 | 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 |
| 12 | 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 |
| 13 | 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  |
| 14 | 长信基金管理有限责任公司关于增聘长信利率债债券型证券投资基金基金经理的公告   | 证券时报、中国证监会电子披露网站、公司网站              | 2022 年 3 月 9 日  |
| 15 | 长信利率债债券型证券投资基金更新的招募说明书及基金产品资料概要（更新）   | 中国证监会电子披露网站、公司网站                   | 2022 年 3 月 11 日 |
| 16 | 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 |
| 17 | 长信基金管理有限责任公司关于长信利率债债券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                         | 证券时报、中国证监会电子披露网站、公司网站              | 2022 年 3 月 25 日 |
| 18 | 长信利率债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站、公司网站                   | 2022 年 3 月 31 日 |
| 19 | 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 |
| 20 | 长信基金管理有限责任公司关于长信利率债债券型证券投资基金的分红公告   | 证券时报、中国证监会电子披露网站、公司网站              | 2022 年 4 月 20 日 |
| 21 | 长信基金管理有限责任公司关于长信利率债债券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                         | 证券时报、中国证监会电子披露网站、公司网站              | 2022 年 4 月 20 日 |
| 22 | 长信基金管理有限责任公司关于长信利率债债券型证券投资基金恢复大额申购  | 证券时报、中国证监会电子披露网站、公司网站              | 2022 年 4 月 21 日 |

|    |   |                                    |                 |
|----|---|------------------------------------|-----------------|
|    | (含转换转入、定期定额投资)业务的公告   | 站                                  |                 |
| 23 | 长信利率债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站、公司网站                   | 2022 年 4 月 22 日 |
| 24 | 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 |
| 25 | 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 |
| 26 | 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、北京植信基金销售有限公司办理旗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站、公司网站               | 2022 年 5 月 7 日  |
| 27 | 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 |
| 28 | 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 |
| 29 | 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 |
| 30 | 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  |
| 31 | 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 |
| 32 | 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)            | 上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站               | 2022 年 6 月 15 日 |

|    |   |                       |                 |
|----|---|-----------------------|-----------------|
|    | 费率优惠活动的公告   |                       |                 |
| 33 | 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 |
| 34 | 长信基金管理有限责任公司关于长信利率债债券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                         | 证券时报、中国证监会电子披露网站、公司网站 | 2022 年 6 月 28 日 |
| 35 | 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 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 1 月 5 日  | 250,103,376.41 | 0.00             | 250,103,376.41 | 0.00           | 0.00     |
|       | 2              | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 1 月 6 日; 2022 年 3 月 2 日至 2022 年 3 月 22 日; 2022 年 5 月 26 日至 2022 年 6 月 28 日 | 331,481,727.17 | 0.00             | 0.00           | 331,481,727.17 | 19.93    |
|       | 3              | 2022 年 1 月 6 日至 2022 年 2 月 23 日   | 0.00           | 950,902,493.36   | 758,424,667.77 | 192,477,825.59 | 11.57    |
|       | 4              | 2022 年 3 月 25 日至 2022   | 0.00           | 1,139,200,621.09 | 690,368,484.64 | 448,832,136.45 | 26.98    |

|   |   |  |  |  |  |
|---|---|--|--|--|--|
|   | 年 5 月 23 日；<br>2022 年 6 月<br>29 日至 2022<br>年 6 月 30 日 |  |  |  |  |
| 产品特有风险  |   |  |  |  |  |
| <p>1、基金净值大幅波动的风险<br/>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，按照净值计算尾差处理规则可能引起基金份额净值异常上涨或下跌。</p> <p>2、赎回申请延期办理的风险<br/>单一持有基金比例过高的投资者大额赎回后可能触发本基金巨额赎回条件，导致同期中小投资者小额赎回面临部分延期办理的情况。</p> <p>3、基金投资策略难以实现的风险<br/>单一持有基金比例过高的投资者大额赎回后，可能引起基金资产总净值显著降低，从而使基金在投资时受到限制，导致基金投资策略难以实现。</p> |   |  |  |  |  |

## 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、《长信利率债债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长信利率债债券型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《长信利率债债券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、长信基金管理有限责任公司营业执照、公司章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站：

长信基金管理有限责任公司

2022 年 8 月 31 日