

长信稳健精选混合型证券投资基金

2020 年第 4 季度报告

2020 年 12 月 31 日

基金管理人：长信基金管理有限责任公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 1 月 22 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金基金合同规定，于 2021 年 1 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 10 月 1 日起至 2020 年 12 月 31 日止。

§2 基金产品概况

| | | |
|-----------------|---|------------------|
| 基金简称 | 长信稳健精选混合 | |
| 基金主代码 | 009606 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2020 年 7 月 16 日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 631,869,998.61 份 | |
| 投资目标 | 通过积极主动的资产管理，在严格控制基金资产风险的前提下，力争为投资者提供稳定增长的投资收益。 | |
| 投资策略 | 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。 | |
| 业绩比较基准 | 中债综合指数收益率*75%+沪深 300 指数收益率*15%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）*10% | |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。 | |
| 基金管理人 | 长信基金管理有限责任公司 | |
| 基金托管人 | 招商银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 长信稳健精选混合 A | 长信稳健精选混合 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 009606 | 009607 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 460,542,608.02 份 | 171,327,390.59 份 |

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2020年10月1日—2020年12月31日） | |
|-----------------|-----------------------------|----------------|
| | 长信稳健精选混合 A | 长信稳健精选混合 C |
| 1. 本期已实现收益 | 15,635,103.65 | 6,971,301.48 |
| 2. 本期利润 | 37,832,358.23 | 15,936,151.38 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0794 | 0.0690 |
| 4. 期末基金资产净值 | 501,698,060.53 | 186,296,393.36 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.0894 | 1.0874 |

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

长信稳健精选混合 A

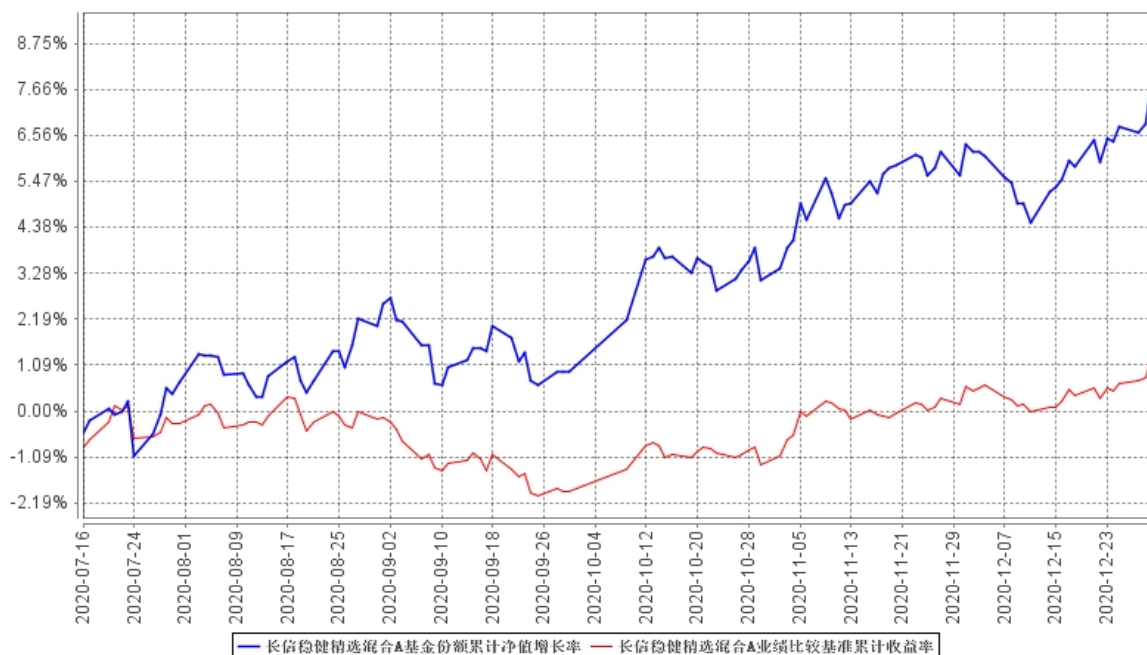
| 阶段 | 净值增长率 ① | 净值增长率 标准差② | 业绩比较基 准收益率③ | 业绩比较基 准收益率标 准差④ | ①—③ | ②—④ |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|-------|-------|
| 过去三个月 | 7.93% | 0.46% | 3.57% | 0.21% | 4.36% | 0.25% |
| 自基金合同 生效起至今 | 8.94% | 0.44% | 1.60% | 0.25% | 7.34% | 0.19% |

长信稳健精选混合 C

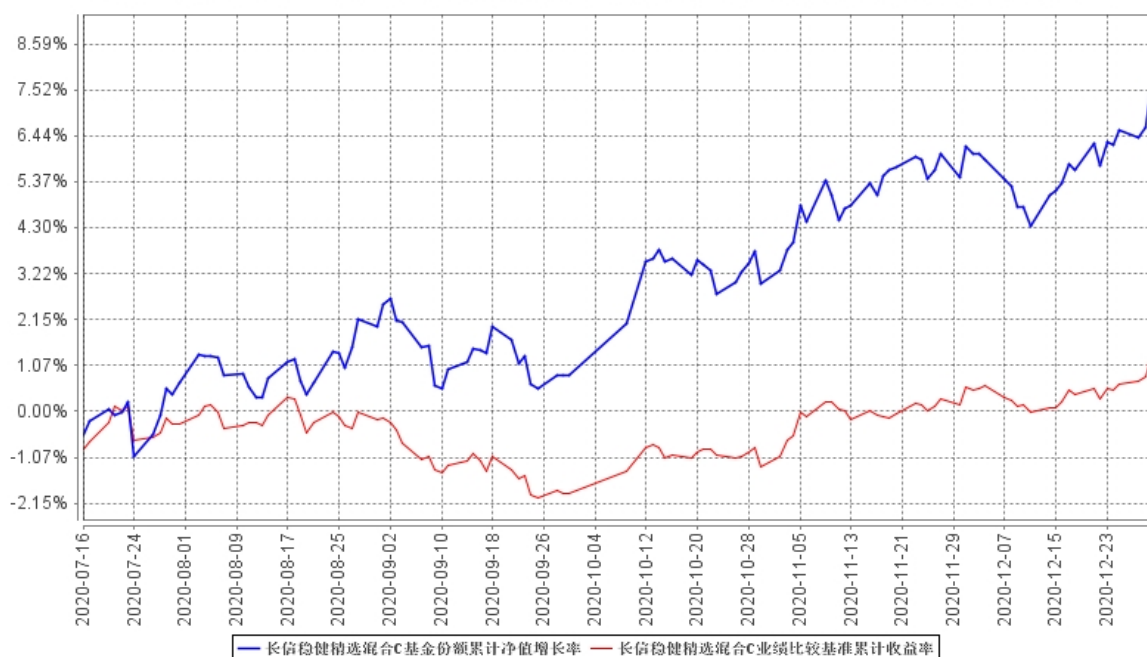
| 阶段 | 净值增长率 ① | 净值增长率 标准差② | 业绩比较基 准收益率③ | 业绩比较基 准收益率标 准差④ | ①—③ | ②—④ |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|-------|-------|
| 过去三个月 | 7.81% | 0.46% | 3.57% | 0.21% | 4.24% | 0.25% |
| 自基金合同 生效起至今 | 8.74% | 0.44% | 1.60% | 0.25% | 7.14% | 0.19% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

长信稳健精选混合A基金份额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



长信稳健精选混合C基金份额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、本基金基金合同生效日为 2020 年 7 月 16 日，基金合同生效日至本报告期末，本基金运作时间未满一年。图示日期为 2020 年 7 月 16 日至 2020 年 12 月 31 日。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内为建仓期，建仓期结束时，本基金各项投资比例应符合基金合同中的约定：本基金投资于股票资产的比例不高于基金资产的 40%，投资于港股通标的股票的比例不高于股票资产的 50%。本基金投资于同业存单的比例不高于基金

资产的 20%。每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约及股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金或者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、应收申购款等。

截至本报告期末，本基金尚未完成建仓。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|---|------------------|------|--------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 李家春 | 长信利丰债券型证券投资基金、长信可转债债券型证券投资基金、长信利广灵活配置混合型证券投资基金、长信利盈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、长信中证可转债及可交换债券 50 指数证券投资基金、长信利尚一年定期开放混合型证券投资基金和长信稳健精选混合型证券投资基金的基金经理、总经理助理、投资决策委员会执行委员 | 2020 年 7 月 16 日 | - | 21 年 | 香港大学工商管理硕士，具有基金从业资格。曾任职于长江证券有限责任公司、汉唐证券有限责任公司、泰信基金管理有限公司、交银施罗德基金管理有限公司、富国基金管理有限公司和上海东方证券资产管理有限公司。2018 年 7 月加入长信基金管理有限责任公司，现任公司总经理助理、投资决策委员会执行委员兼长信利丰债券型证券投资基金、长信可转债债券型证券投资基金、长信利广灵活配置混合型证券投资基金、长信利盈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、长信中证可转债及可交换债券 50 指数证券投资基金、长信利尚一年定期开放混合型证券投资基金和长信稳健精选混合型证券投资基金的基金经理。 |
| 刘婧 | 长信纯债一年定期开放债券 | 2020 年 12 月 14 日 | - | 7 年 | 北京大学工程硕士，具有基金从业资格。曾任职于工银 |

| | | | | |
|--|---|--|--|---|
| | 型证券投资基金、长信利众债券型证券投资基金 (LOF) 和长信稳健精选混合型证券投资基金的基金经理 | | | 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) 和长信稳健精选混合型证券投资基金的基金经理。 |
|--|---|--|--|---|

注: 1、首任基金经理任职日期以本基金成立之日为准; 新增或变更基金经理的日期根据对外披露的公告日期填写;

2、证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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 公平交易专项说明

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且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 报告期内基金投资策略和运作分析

2020 年四季度宏观经济仍延续修复态势，10 月份社融同比增速上行到 13.7%，到达本轮社融扩张高点，后趋于稳定，环比略有走弱。PPI 同比仍处于负值区间，但上行趋势较为明确，11 月 PPI 已回升至-1.5%，说明经济活动基本上已完全恢复疫情前的水平。权益类资产表现较好，截至 12 月 31 日，沪深 300 指数较 9 月 30 日上涨 13.6%。债券市场受到违约事件的冲击，出现了波动，债券利率先上后下，信用利差走阔。截至 12 月 31 日，1 年国债、3 年国债、5 年国债、10 年国债分别较 9 月 30 日下行 12BP、下行 4BP、下行 0.41BP 和上行 0.27BP，中证转债指数较 9 月 30 日上涨 2.53%。

四季度组合保持了较高的权益仓位，顺应了市场环境，同时增持了高等级中短久期信用债，并参与了利率债的波段交易。

展望一季度，经济仍在渐进修复，因本轮经济复苏对基建和地产的刺激力度较弱，经济的修复更多源于自身的韧性，复苏方向确定，幅度可能趋于平缓。央行货币政策主基调以稳为主，短端资金利率预计将维持稳定，中短久期债券仍较为安全。从绝对点位看，当前处于债券可以左侧布局的点位。1-2 月是经济数据真空期，若资金成本在春节前后维持较低水平，利率曲线可能回归平坦化。投资策略方面，结合宏观环境及资金面，信用债以中短久期加杠杆获取票息收益仍然是纯债操作中较为可取的策略，中长久期利率债的交易价值逐渐显现，可适当参与交易性机会。转债方面，由于从大类资产配置的角度来看，转债是目前固收类资产中与宏观环境较为贴合的品种，可适度博取权益市场的收益，组合仍会保持一定的转债仓位，立足绝对收益精选个券。股票方面，重点是跟踪业绩兑现情况及行业趋势，寻找高景气度板块及优秀个股进行配置。

下一阶段我们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，适度调整组合权益部分的行业分布和个股集中度、债券部分的久期和仓位，加强流动性管理，严格防范信用风险，进一步优化投资组合，力争为投资者获取更好的收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，长信稳健精选混合 A 份额净值为 1.0894 元，份额累计单位净值为 1.0894 元，长信稳健精选混合 A 份额净值增长率为 7.93%；长信稳健精选混合 C 份额净值为 1.0874 元，份额累计单位净值为 1.0874 元，长信稳健精选混合 C 份额净值增长率为 7.81%，同期业绩比较基准收益率为 3.57%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 223,890,374.85 | 29.16 |
| | 其中：股票 | 223,890,374.85 | 29.16 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 413,388,215.08 | 53.84 |
| | 其中：债券 | 413,388,215.08 | 53.84 |
| | 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 | 50,000,000.00 | 6.51 |
| | 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 | 47,901,407.76 | 6.24 |
| 8 | 其他资产 | 32,689,445.36 | 4.26 |
| 9 | 合计 | 767,869,443.05 | 100.00 |

注：本基金通过沪港通交易机制投资的港股公允价值为 77,978,703.47 元，占资产净值比例 11.33%；本基金通过深港通交易机制投资的港股公允价值为 4,409,688.62 元，占资产净值比例 0.64%。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|----------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 101,750,547.18 | 14.79 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | 16,322.72 | 0.00 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 5,796,198.88 | 0.84 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 5,277,733.27 | 0.77 |

| | | | |
|---|---------------|----------------|-------|
| J | 金融业 | 22,159,560.21 | 3.22 |
| K | 房地产业 | 2,017,975.14 | 0.29 |
| L | 租赁和商务服务业 | 1,527,064.00 | 0.22 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 15,649.20 | 0.00 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 2,940,932.16 | 0.43 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 141,501,982.76 | 20.57 |

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别 | 公允价值（人民币） | 占基金资产净值比例（%） |
|-----------|---------------|--------------|
| A 基础材料 | - | - |
| B 消费者非必需品 | 15,195,473.55 | 2.21 |
| C 消费者常用品 | 6,009,309.60 | 0.87 |
| D 能源 | - | - |
| E 金融 | 13,747,852.74 | 2.00 |
| F 医疗保健 | - | - |
| G 工业 | - | - |
| H 信息技术 | 40,838,056.08 | 5.94 |
| I 电信服务 | - | - |
| J 公用事业 | 6,597,700.12 | 0.96 |
| K 房地产 | - | - |
| 合计 | 82,388,392.09 | 11.98 |

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 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 | 300054 | 鼎龙股份 | 1,080,000 | 20,422,800.00 | 2.97 |
| 2 | 00700 | 腾讯控股 | 37,000 | 17,563,343.52 | 2.55 |
| 3 | 002415 | 海康威视 | 327,500 | 15,887,025.00 | 2.31 |
| 4 | 601233 | 桐昆股份 | 623,083 | 12,829,278.97 | 1.86 |
| 5 | 02382 | 舜宇光学科技 | 80,000 | 11,426,104.64 | 1.66 |
| 6 | 00175 | 吉利汽车 | 450,000 | 10,036,557.00 | 1.46 |
| 7 | 01810 | 小米集团-W | 300,000 | 8,382,734.40 | 1.22 |
| 8 | 600309 | 万华化学 | 90,000 | 8,193,600.00 | 1.19 |
| 9 | 600519 | 贵州茅台 | 3,900 | 7,792,200.00 | 1.13 |
| 10 | 600887 | 伊利股份 | 170,000 | 7,542,900.00 | 1.10 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------|---------|--------------|
|----|------|---------|--------------|

| | | | |
|----|-----------|----------------|-------|
| 1 | 国家债券 | 90,243,000.00 | 13.12 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 70,952,000.00 | 10.31 |
| | 其中：政策性金融债 | 70,952,000.00 | 10.31 |
| 4 | 企业债券 | 189,313,000.00 | 27.52 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | 62,880,215.08 | 9.14 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 413,388,215.08 | 60.09 |

5.5 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债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 200215 | 20 国开 15 | 700,000 | 70,952,000.00 | 10.31 |
| 2 | 019640 | 20 国债 10 | 600,000 | 59,922,000.00 | 8.71 |
| 3 | 200016 | 20 付息国债 16 | 300,000 | 30,321,000.00 | 4.41 |
| 4 | 155462 | 19 中船 03 | 300,000 | 30,027,000.00 | 4.36 |
| 5 | 136465 | 16 国投 01 | 200,000 | 20,190,000.00 | 2.93 |

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

报告期内本基金投资的前十名证券中, 300054.SZ_鼎龙股份于 2020 年 11 月 17 日收到深圳证券交易所《关于对湖北鼎龙控股股份有限公司给予通报批评处分的决定》，具体内容如下：2019 年 5 月 28 日，鼎龙股份披露《关于回购公司股份的方案》，经公司董事会审议通过，拟以集中竞价交易等方式回购鼎龙股份的股份，回购资金总额不低于 1 亿元、不超过 2 亿元，回购价格不超过 14 元/股，回购期限自董事会审议通过本次回购股份方案之日起不超过十二个月。2020 年 5 月 30 日，鼎龙股份披露《关于第二期股份回购期限届满暨股份回购实施结果的公告》，截至 2020 年 5 月 28 日，回购实施期限已届满，鼎龙股份累计回购股份 94 万股，实际回购总成交金额为 976.93 万元。鼎龙股份实际回购金额与回购方案中披露的最低回购金额差异 9,023.07 万元，差异比例达 90.23%，未完成回购计划。鼎龙股份的上述行为违反了《创业板股票上市规则（2018 年 11 月修订）》第 1.4 条和《上市公司回购股份实施细则》第四条、第三十三条的规定。鉴于上述违规事实及情节，依据《创业板股票上市规则（2018 年 11 月修订）》第 16.2 条，《创业板股票上市规则（2020 年修订）》第 12.4 条和《上市公司纪律处分实施标准（试行）》第三十条的规定，经深交所纪律处分委员会审议通过，作出对湖北鼎龙控股股份有限公司给予通报批评的处分。

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 2020 年 12 月 25 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〔2020〕67 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：一、为违规的政府购买服务项目提供融资；二、项目资本金管理不到位，棚改贷款项目存在资本金违规抽回情况；三、违规变相发放土地储备贷款；四、设置不合理存款考核要求，以贷转存，虚增存款；五、贷款风险分类不准确；六、向资产管理公司以外的主体批量转让不良信贷资产；七、违规进行信贷资产拆分转让，隐匿信贷资产质量；八、向棚改业务代理结算行强制搭售低收益理财产品；

九、扶贫贷款存贷挂钩；十、易地扶贫搬迁贷款“三查”不尽职，部分贷款资金未真正用于扶贫搬迁；十一、未落实同业业务交易对手名单制监管要求；十二、以贷款方式向金融租赁公司提供同业融资，未纳入同业借款业务管理；十三、以协定存款方式吸收同业存款，未纳入同业存款业务管理；十四、风险隔离不到位，违规开展资金池理财业务；十五、未按规定向投资者充分披露理财产品投资非标准化债权资产情况；十六、逾期未整改，屡查屡犯，违规新增业务；十七、利用集团内部交易进行子公司间不良资产非洁净出表；十八、违规收取小微企业贷款承诺费；十九、收取财务顾问费质价不符；二十、利用银团贷款承诺费浮利分费；二十一、向检查组提供虚假整改说明材料；二十二、未如实提供信贷资产转让台账；二十三、案件信息迟报、瞒报；二十四、对以往监管检查中发现的国别风险管理问题整改不到位。综上，中国银行保险监督管理委员会决定对国家开发银行罚款 4880 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八名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。

5.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

报告期内本基金投资的前十名股票中，不存在超出基金合同规定备选股票库的情形。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | 1,082,185.87 |
| 2 | 应收证券清算款 | 27,190,061.54 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 4,067,606.90 |
| 5 | 应收申购款 | 349,591.05 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 32,689,445.36 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|-------|--------------|--------------|
| 1 | 128034 | 江银转债 | 5,408,000.00 | 0.79 |
| 2 | 128112 | 歌尔转 2 | 4,797,900.00 | 0.70 |

| | | | | |
|----|--------|---------|--------------|------|
| 3 | 110069 | 瀚蓝转债 | 2,673,000.00 | 0.39 |
| 4 | 113519 | 长久转债 | 2,527,677.90 | 0.37 |
| 5 | 123049 | 维尔转债 | 2,222,999.20 | 0.32 |
| 6 | 113504 | 艾华转债 | 1,382,300.00 | 0.20 |
| 7 | 110047 | 山鹰转债 | 1,314,009.00 | 0.19 |
| 8 | 113011 | 光大转债 | 1,238,800.00 | 0.18 |
| 9 | 110063 | 鹰 19 转债 | 1,070,700.00 | 0.16 |
| 10 | 128075 | 远东转债 | 782,732.02 | 0.11 |

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 长信稳健精选混合 A | 长信稳健精选混合 C |
|---------------------------|----------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 465,224,214.71 | 194,304,344.79 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 106,400,013.81 | 138,919,342.61 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 111,081,620.50 | 161,896,296.81 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 460,542,608.02 | 171,327,390.59 |

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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

注：本基金本报告期内未有单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：本基金本报告期未发生影响投资者决策的其他重要信息。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立基金的文件；
- 2、《长信稳健精选混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长信稳健精选混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《长信稳健精选混合型证券投资基金托管协议》；
- 5、报告期内在指定报刊上披露的各种公告的原稿；
- 6、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。

9.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

9.3 查阅方式

长信基金管理有限责任公司网站：<http://www.cxfund.com.cn>。

长信基金管理有限责任公司

2021 年 1 月 22 日