

# 长信价值优选混合型证券投资基金 2021 年中期报告

2021 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：2021 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 2021 年 8 月 27 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 2021 年 1 月 1 日起至 2021 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>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	14
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
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.....	15
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>16</b>
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18

6.4 报表附注.....	19
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>40</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	40
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.....	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	45
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.....	45
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.....	45
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.....	45
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.....	45
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	46
7.12 投资组合报告附注.....	46
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>49</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	49
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	49
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的情况.....	49
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>50</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>51</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	51
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.....	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	51
10.4 基金投资策略的改变.....	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	51
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.....	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	51
10.8 其他重大事件.....	52
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>55</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.....	55

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	55
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>56</b>
12.1 备查文件目录.....	56
12.2 存放地点.....	56
12.3 查阅方式.....	56

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	长信价值优选混合型证券投资基金
基金简称	长信价值优选混合
基金主代码	501002
交易代码	501002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 2 月 26 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	67,655,420.00 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制投资组合风险的前提下，通过精选具有估值优势和成长优势的上市公司股票和优质债券进行投资，力争以较低的风险获得中高水平的收益，实现基金资产的长期稳定增值。
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，并追求稳健的收益。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×75%+中证综合债券指数收益率×25%
风险收益特征	本基金属于混合型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。本基金除了投资 A 股外，还可根据法律法规规定投资香港联合交易所上市的股票。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

### 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
信息披露负责人	姓名	周永刚	胡凯
	联系电话	021-61009999	021-38037354
	电子邮箱	zhouyg@cxfund.com.cn	hukai@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	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.cxfund.com.cn
基金中期报告备置地点	上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼、上海市静安区新闻路 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(2021年1月1日 - 2021年6月30日)
本期已实现收益	7,026,517.44
本期利润	3,689,600.30
加权平均基金份额本期利润	0.0564
本期加权平均净值利润率	4.93%
本期基金份额净值增长率	4.19%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)
期末可供分配利润	9,571,934.47
期末可供分配基金份额利润	0.1415
期末基金资产净值	77,227,354.47
期末基金份额净值	1.1415
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)
基金份额累计净值增长率	65.20%

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

#### 3.2 基金净值表现

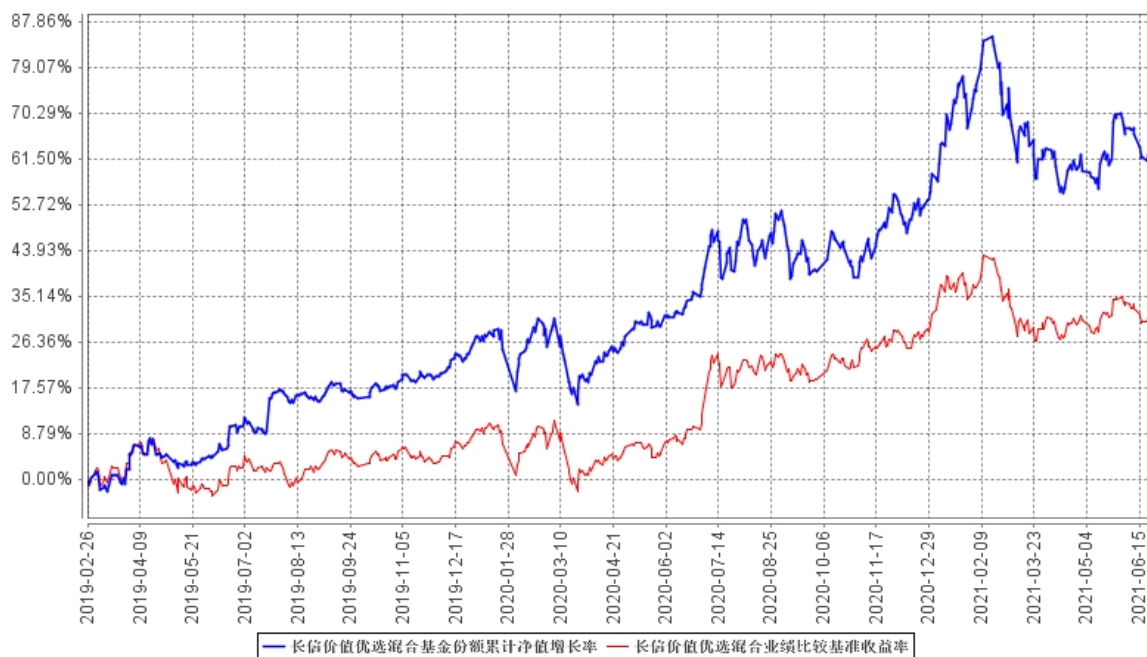
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-2.97%	0.76%	-1.46%	0.60%	-1.51%	0.16%
过去三个月	1.94%	1.09%	2.97%	0.73%	-1.03%	0.36%
过去六个月	4.19%	1.44%	0.92%	0.99%	3.27%	0.45%
过去一年	21.08%	1.37%	19.87%	1.00%	1.21%	0.37%
自基金合同生效起至今	65.20%	1.16%	32.82%	0.99%	32.38%	0.17%



### 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

长信价值优选混合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、图示日期为 2019 年 2 月 26 日至 2021 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，本基金的各项投资比例已符合基金合同约定。

## §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 2021 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 76 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、长信长金通货币市场基金、长信稳通三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金、长信利尚一年定期开放混合型证券投资基金、长信乐信灵活配置混合型证券投资基金、长信全球

债券证券投资基金、长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信先机两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、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、长信颐天平平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、长信易进混合型证券投资基金、长信中证可转债及可交换债券 50 指数证券投资基金、长信先锐混合型证券投资基金、长信中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、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）、长信添利安心收益混合型证券投资基金、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。

#### 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		
吴晖	长信价值优选混合型证券投资基金、长信先锐混合型证券投资基金、长信可转债债券型证券投资基金、长信利丰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、长信先利半年定期开放混合型证券投资基金和长信稳健均衡 6	2019 年 4 月 30 日	-	6 年	清华大学管理科学与工程硕士，具有基金从业资格。曾任职于上海浦东发展银行股份有限公司和东方证券股份有限公司。2017 年 5 月加入长信基金管理有限责任公司，曾任公司基金经理助理和长信先锐债券型证券投资基金的基金经理，现任长信价值优选混合型证券投资基金、长信先锐混合型证券投资基金、长信可转债债券型证券投资基金、长信利丰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

	个月持有期混合型证券投资基金的基金经理			资基金、长信利富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和长信稳健均衡 6 个月持有期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 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

上半年市场波动较大，年初各大指数同步上涨，二季度以来各个指数表现分化，其中代表成

长风格和中小市值的板块表现较好，细分行业包括新能源、半导体、军工，以及部分医药和周期品种。

对待组合管理，我们通过对各类资产的灵活配置来为投资者获取稳定的回报。具体操作上，调整仓位到长期产业趋势确定，短期景气度高的板块中，提高对业绩和估值匹配度的要求。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 6 月 30 日，长信价值优选混合份额净值为 1.1415 元，份额累计净值为 1.1415 元，本报告期内长信价值优选混合净值增长率为 4.19%，同期业绩比较基准收益率为 0.92%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对下半年宏观经济的判断上，预计国内经济将持续稳定恢复，但考虑到全球疫情仍在持续演变，经济恢复的过程或许会有一些不均衡和不充分。根据 7 月份政治局会议精神，政策层面将做好跨周期调节，保持宏观政策的连续性、稳定性和可持续性，统筹今明两年的政策衔接，保持经济运行在合理区间。财政政策提升政策效能，合理把握预算内投资和地方政府债券发行进度，推动未来的实物工作量。货币政策上，虽然大宗商品目前仍处于高位，但短期内不会出现明显收紧，会保持流动性合理充裕，助力中小企业和困难企业持续恢复。权益市场经过一段时间的调整，目前整体估值并不高，伴随着流动性顾虑的消除，以及未来经济活动的稳定恢复，我们有理由对后市保持乐观。结构上，此次政治局会议提出，要挖掘国内市场潜力，支持新能源汽车加快发展，加快贯通县乡村电子商务体系和快递物流配送体系，加快推进“十四五”规划重大工程项目建设，引导企业加大技术改造投资。强化科技创新和产业供应链韧性，加强基础研究，推动应用研究，开展补链强链专项行动，加快解决卡脖子难题，发展专精特新中小企业。因此，这也是未来中国资本市场中最主要的投资投资方向。

我们将继续秉承谨慎原则，加强组合的流动性管理，在做好风险控制的同时，积极寻找权益资产的机会。密切关注经济走势和政策动向，紧跟组合规模变动进行资产配置，争取在流动安全前提下，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

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

本基金收益分配原则如下：

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金可进行收益分配，具体分红方案见基金管理人根据基金运作情况届时不定期发布的相关分红公告，若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 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”）在长信价值优选混合型证券投资基金（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：长信价值优选混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.6.1	2,630,537.05	2,160,381.50
结算备付金		485,606.87	535,168.78
存出保证金		63,149.68	224,334.89
交易性金融资产	6.4.6.2	77,617,290.41	88,083,291.92
其中：股票投资		72,753,645.31	82,518,848.42
基金投资		-	-
债券投资		4,863,645.10	5,564,443.50
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.6.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.6.4	-	-
应收证券清算款		397,253.77	560,247.25
应收利息	6.4.6.5	96,278.57	124,159.56
应收股利		13,698.33	-
应收申购款		4,835.11	2,471.31
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.6.6	-	-
资产总计		81,308,649.79	91,690,055.21
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2020 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	6.4.6.3	-	-
卖出回购金融资产款		3,500,000.00	3,000,000.00
应付证券清算款		346,130.14	2.23
应付赎回款		2,679.15	1,133.80
应付管理人报酬		95,430.62	111,139.12
应付托管费		6,362.07	7,409.29
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.6.7	76,139.80	110,999.05
应交税费		-	0.26



应付利息		-	-904.11
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.6.8	54,553.54	150,000.26
负债合计		4,081,295.32	3,379,779.90
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.6.9	67,655,420.00	80,606,059.80
未分配利润	6.4.6.10	9,571,934.47	7,704,215.51
所有者权益合计		77,227,354.47	88,310,275.31
负债和所有者权益总计		81,308,649.79	91,690,055.21

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.1415 元，基金份额总额 67,655,420.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：长信价值优选混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		4,789,833.70	6,701,846.64
1.利息收入		84,852.44	754,963.39
其中：存款利息收入	6.4.6.11	28,933.71	88,918.71
债券利息收入		55,918.73	666,044.68
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		7,963,508.88	10,324,178.25
其中：股票投资收益	6.4.6.12	7,244,563.41	10,015,258.32
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.6.13	-12,144.41	219,595.76
资产支持证券投资收益	6.4.6.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.6.14	-	-
衍生工具收益	6.4.6.15	-	-
股利收益	6.4.6.16	731,089.88	89,324.17
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.6.17	-3,336,917.14	-4,483,645.02
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.6.18	78,389.52	106,350.02
<b>减：二、费用</b>		1,100,233.40	1,531,590.34

1. 管理人报酬	6.4.9.2.1	559,667.95	746,352.37
2. 托管费	6.4.9.2.2	37,311.26	49,756.84
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.6.19	409,910.15	491,903.36
5. 利息支出		38,796.07	168,986.89
其中：卖出回购金融资产支出		38,796.07	168,986.89
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.6.20	54,547.97	74,590.88
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		3,689,600.30	5,170,256.30
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		3,689,600.30	5,170,256.30

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长信价值优选混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	80,606,059.80	7,704,215.51	88,310,275.31
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,689,600.30	3,689,600.30
三、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）	-12,950,639.80	-1,821,881.34	-14,772,521.14
其中：1.基金申购款	18,388,563.44	3,295,077.41	21,683,640.85
2.基金赎回款	-31,339,203.24	-5,116,958.75	-36,456,161.99
四、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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	67,655,420.00	9,571,934.47	77,227,354.47

项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	148,388,615.98	-19,217,764.40	129,170,851.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	5,170,256.30	5,170,256.30
三、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)	-101,668,556.75	11,377,193.08	-90,291,363.67
其中：1.基金申购款	8,559,241.18	-1,077,318.92	7,481,922.26
2.基金赎回款	-110,227,797.93	12,454,512.00	-97,773,285.93
四、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)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	46,720,059.23	-2,670,315.02	44,049,744.21

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

长信价值优选混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)由长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金(LOF)(以下简称“长信中证能源互联网指数(LOF)”)转型而成。长信中证能源互联网指数(LOF)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》、《长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金(LOF)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]2703号文准予公开募集注册,于2016年1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,首次设立募集基金份额为242,530,801.91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 1600092 号验资报告。长信中证能源互联网指数 (LOF) 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。

本基金于 2019 年 1 月 2 日起至 2019 年 1 月 18 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《关于长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金 (LOF) 转型有关事项的议案》，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 1 月 21 日生效。长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金 (LOF) 变更为长信价值优选混合型证券投资基金，修订后的《长信价值优选混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)于 2019 年 2 月 26 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《长信价值优选混合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，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板和其他经中国证监会核准上市的股票)、存托凭证、港股通标的股票、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、地方政府债、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、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、权证、国债期货、股指期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。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。本基金的投资组合为：股票资产占基金资产的 50%-95%，投资于港股通标的股票的比例不高于股票资产的 50%；本基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货及股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者到期日在一年以内的政府债券。股指期货、国债期货、股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。当法律法规的相关规定变更时，基金管理人在履行适当程序后可对上述资产配置比例进行适当调整。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率 $\times$ 75%+中证综合债券指数收益率 $\times$ 25%。

#### 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。

### 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 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 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 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.4.1 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

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。

#### 6.4.4.2 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。

### 6.4.5 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》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、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]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]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股票、债券免征增值税；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) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。

3) 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司代扣代缴个人所得税；从公开发行和转让

市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。对基金通过沪港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

4) 对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，受让方不再缴纳印花税。对于基金通过沪港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

## 6.4.6 重要财务报表项目的说明

### 6.4.6.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	2,630,537.05
定期存款	-
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	-
合计：	2,630,537.05

### 6.4.6.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	66,689,328.13	72,753,645.31	6,064,317.18	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	4,868,538.80	4,863,645.10	-4,893.70
	银行间市场	-	-	-
	合计	4,868,538.80	4,863,645.10	-4,893.70
资产支持证券	-	-	-	

基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	71,557,866.93	77,617,290.41	6,059,423.48

#### 6.4.6.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融工具。

#### 6.4.6.4 买入返售金融资产

##### 6.4.6.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.6.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：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。

#### 6.4.6.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应收活期存款利息	1,074.60
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	256.80
应收债券利息	94,909.18
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	37.99
合计	96,278.57

注：其他为应收保证金利息。

#### 6.4.6.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.6.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	76,139.80

银行间市场应付交易费用	-
合计	76,139.80

#### 6.4.6.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	5.57
应付证券出借违约金	-
预提账户维护费	-
预提审计费	14,876.39
预提信息披露费	39,671.58
合计	54,553.54

#### 6.4.6.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	80,606,059.80	80,606,059.80
本期申购	18,388,563.44	18,388,563.44
本期赎回(以“-”号填列)	-31,339,203.24	-31,339,203.24
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	67,655,420.00	67,655,420.00

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。

#### 6.4.6.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	29,350,842.91	-21,646,627.40	7,704,215.51
本期利润	7,026,517.44	-3,336,917.14	3,689,600.30
本期基金份额交易产生的变动数	-4,460,071.92	2,638,190.58	-1,821,881.34
其中：基金申购款	8,455,012.53	-5,159,935.12	3,295,077.41
基金赎回款	-12,915,084.45	7,798,125.70	-5,116,958.75
本期已分配利润	-	-	-
本期末	31,917,288.43	-22,345,353.96	9,571,934.47



**6.4.6.11 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	21,787.50
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	5,128.92
其他	2,017.29
合计	28,933.71

注：其他中保证金利息收入为 1,217.39 元，申购款利息收入为 799.90 元。

**6.4.6.12 股票投资收益****6.4.6.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	148,700,250.23
减：卖出股票成本总额	141,455,686.82
买卖股票差价收入	7,244,563.41

**6.4.6.13 债券投资收益****6.4.6.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-12,144.41
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	-12,144.41

**6.4.6.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	7,508,928.76
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	7,375,082.51

减：应收利息总额	145,990.66
买卖债券差价收入	-12,144.41

#### 6.4.6.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——赎回差价收入。

#### 6.4.6.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——申购差价收入。

#### 6.4.6.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.6.14 贵金属投资收益

##### 6.4.6.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

#### 6.4.6.15 衍生工具收益

##### 6.4.6.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

##### 6.4.6.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 6.4.6.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	731,089.88
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	731,089.88

#### 6.4.6.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	-3,336,917.14
——股票投资	-3,340,322.45
——债券投资	3,405.31

——资产支持证券投资	-
——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	-3,336,917.14

#### 6.4.6.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	78,383.14
基金转换费收入	6.38
合计	78,389.52

注：赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担。对于持有期少于30日的基金份额所收取的赎回费，全额计入基金财产；对于持有期不少于30日但少于3个月的基金份额所收取的赎回费，其75%计入基金财产；对于持有期不少于3个月但少于6个月的基金份额所收取的赎回费，其50%计入基金财产；对持有期不少于6个月的基金份额所收取的赎回费，其25%计入基金财产。未计入基金财产部分用于支付登记费和必要的手续费。

#### 6.4.6.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	409,910.15
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	409,910.15

#### 6.4.6.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日

审计费用	14,876.39
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
合计	54,547.97

#### 6.4.7 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.7.1 或有事项

注：截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 6.4.7.2 资产负债表日后事项

注：截至本财务报告批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.8 关联方关系

##### 6.4.8.1 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

注：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。

##### 6.4.8.2 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（以下简称“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（以下简称“国泰君安”）	基金托管人、基金销售机构
上海长江财富资产管理有限公司（以下简称“长江财富”）	基金管理人的子公司

#### 6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.9.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
国泰君安	215,535,639.00	76.37%	306,944,990.86	100.00%

###### 6.4.9.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例	成交金额	占当期债券 成交总额的比例
国泰君安	5,716,026.20	61.19%	46,014,031.30	100.00%

#### 6.4.9.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的比例
国泰君安	319,600,000.00	82.01%	1,491,000,000.00	100.00%

#### 6.4.9.1.4 权证交易

注：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。

#### 6.4.9.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量 的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
国泰君安	169,780.10	77.68%	76,139.80	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量 的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
国泰君安	249,357.41	100.00%	75,072.60	100.00%

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2、根据《证券交易单元租用协议》，本基金管理人在租用国泰君安证券交易专用交易单元进行股票、债券、权证及回购交易的同时，还从国泰君安获得证券研究综合服务。

#### 6.4.9.2 关联方报酬

##### 6.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	559,667.95	746,352.37
其中：支付销售机构的客户维护费	5,323.02	12,288.71

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×1.50%的年费率确认，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×1.50%÷当年天数。

#### 6.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年6月30日	2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	37,311.26	49,756.84

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×0.10%的年费率确认，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%÷当年天数。

#### 6.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.9.4 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

##### 6.4.9.4.1 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

注：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。

##### 6.4.9.4.2 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

注：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。

#### 6.4.9.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.9.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：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。

**6.4.9.5.2 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**

份额单位：份

关联方名称	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金 份额 占基金总份 额的比例	持有的 基金份额	持有的基金 份额 占基金总份 额的比例
上海长江财富资产管理有限公司	15,860,854.05	23.44%	15,860,854.05	19.68%

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金费率按本基金招募说明书公布的费率执行。

**6.4.9.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

注：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。

**6.4.9.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

金额单位：人民币元

本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：份）	总金额
-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：份）	总金额
国泰君安	688233	神工股份	新股网下询价发行	5,218	113,074.06
国泰君安	601696	中银证券	新股网下询价发行	8,373	45,800.31

注：本基金在本报告期末在承销期内购入由关联方承销的证券。

**6.4.9.8 其他关联交易事项的说明**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

**6.4.10 利润分配情况**

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

### 6.4.11 期末（2021年6月30日）本基金持有的流通受限证券

#### 6.4.11.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.11.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688499	利元亨	2021年6月23日	2021年7月1日	新股流通受限	38.85	38.85	430	16,705.50	16,705.50	-
688226	威腾电气	2021年6月28日	2021年7月7日	新股流通受限	6.42	6.42	2,351	15,093.42	15,093.42	-
605287	德才股份	2021年6月28日	2021年7月6日	新股流通受限	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
688269	凯立新材	2021年6月1日	2021年12月9日	新股锁定	18.94	100.92	606	11,477.64	61,157.52	-
688161	威高骨科	2021年6月23日	2021年12月30日	新股锁定	36.22	82.27	472	17,095.84	38,831.44	-
688329	艾隆科技	2021年3月16日	2021年9月29日	新股锁定	16.81	50.04	739	12,422.59	36,979.56	-
688611	杭州柯林	2021年4月1日	2021年10月12日	新股锁定	33.44	42.34	448	14,981.12	18,968.32	-
688517	金冠电气	2021年6月10日	2021年12月20日	新股锁定	7.71	11.88	1,484	11,441.64	17,629.92	-

#### 6.4.11.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末无暂时停牌等流通受限股票。



### 6.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.11.3.1 银行间市场债券正回购

注：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。

#### 6.4.11.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 3,500,000.00 元，于 2021 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 6.4.11.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：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。

### 6.4.12 金融工具风险及管理

#### 6.4.12.1 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。

#### 6.4.12.2 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。本基金的银行存款由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，本基金均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。

#### 6.4.12.2.1 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 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	4,863,645.10	5,564,443.50
合计	4,863,645.10	5,564,443.50

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。

#### 6.4.12.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：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。

#### 6.4.12.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：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。

#### 6.4.12.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的债券投资。

#### 6.4.12.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：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。

#### 6.4.12.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：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。

### 6.4.12.3 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。

#### 6.4.12.3.1 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；本期末本基金未持有有重大流动性风险的投资品种。本基金可通过卖出回购金融资产方式融入短期资金应对流动性需求。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的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。本基金的基金管理人流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金本报告期末及上年度末均无重大流动性风险。

### 6.4.12.4 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。

#### 6.4.12.4.1 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。

##### 6.4.12.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年6月30日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	2,630,537.05	-	-	-	-	2,630,537.05
结算备付金	485,606.87	-	-	-	-	485,606.87

存出保证金	63,149.68	-	-	-	-	63,149.68
交易性金融资产	4,863,645.10	-	-	-	72,753,645.31	77,617,290.41
应收证券清算款	-	-	-	-	397,253.77	397,253.77
应收利息	-	-	-	-	96,278.57	96,278.57
应收股利	-	-	-	-	13,698.33	13,698.33
应收申购款	-	-	-	-	4,835.11	4,835.11
资产总计	8,042,938.70	-	-	-	73,265,711.09	81,308,649.79
负债	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	3,500,000.00	-	-	-	-	3,500,000.00
应付证券清算款	-	-	-	-	346,130.14	346,130.14
应付赎回款	-	-	-	-	2,679.15	2,679.15
应付管理人报酬	-	-	-	-	95,430.62	95,430.62
应付托管费	-	-	-	-	6,362.07	6,362.07
应付交易费用	-	-	-	-	76,139.80	76,139.80
其他负债	-	-	-	-	54,553.54	54,553.54
负债总计	3,500,000.00	-	-	-	581,295.32	4,081,295.32
利率敏感度缺口	4,542,938.70	-	-	-	72,684,415.77	77,227,354.47
上年度末 2020年12月31日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产	-	-	-	-	-	-
银行存款	2,160,381.50	-	-	-	-	2,160,381.50
结算备付金	535,168.78	-	-	-	-	535,168.78
存出保证金	224,334.89	-	-	-	-	224,334.89
交易性金融资产	5,564,443.50	-	-	-	82,518,848.42	88,083,291.92
应收证券清算款	-	-	-	-	560,247.25	560,247.25
应收利息	-	-	-	-	124,159.56	124,159.56
应收申购款	-	-	-	-	2,471.31	2,471.31
资产总计	8,484,328.67	-	-	-	83,205,726.54	91,690,055.21
负债	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	3,000,000.00	-	-	-	-	3,000,000.00
应付证券清算款	-	-	-	-	2.23	2.23
应付赎回款	-	-	-	-	1,133.80	1,133.80
应付管理人报酬	-	-	-	-	111,139.12	111,139.12
应付托管费	-	-	-	-	7,409.29	7,409.29
应付交易费用	-	-	-	-	110,999.05	110,999.05
应付利息	-	-	-	-	-904.11	-904.11
应交税费	-	-	-	-	0.26	0.26
其他负债	-	-	-	-	150,000.26	150,000.26
负债总计	3,000,000.00	-	-	-	379,779.90	3,379,779.90
利率敏感度缺口	5,484,328.67	-	-	-	82,825,946.64	88,310,275.31

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。

#### 6.4.12.4.1.2 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		
分析	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（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
	市场利率下降 27 个基点	2,262.89	452.22
市场利率上升 27 个基点	-2,262.89	-452.22	

#### 6.4.12.4.2 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。本基金持有不以记账本位币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

截止于 2021 年 6 月 30 日，本基金所持有投资于香港股票市场的交易性金融资产，以港币计价，金额折合成人民币为 8,974,334.56 元（截止于 2020 年 12 月 31 日，本基金所持有投资于香港股票市场的交易性金融资产及应收股利，以港币计价，金额折合成人民币为 5,536,299.50 元）。

#### 6.4.12.4.3 其他价格风险

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

于 6 月 30 日，本基金面临的其他市场价格风险列示如下：

##### 6.4.12.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日		上年度末 2020年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净	公允价值	占基金资 产净值比

		值比例 (%)		例 (%)
交易性金融资产-股票投资	72,753,645.31	94.21	82,518,848.42	93.44
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	4,863,645.10	6.30	5,564,443.50	6.30
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	77,617,290.41	100.50	88,083,291.92	99.74

#### 6.4.12.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	在 95%的置信区间内，基金资产组合的市场价格风险		
分析	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（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
	VaR 值为 4.25%（2020年12月31日 VaR 值为 4.11%）	-3,282,807.50	-3,626,332.18

注：上述风险价值 VaR 的分析是基于资产负债表日所持证券过去一年市场价格波动情况而有可能发生的最大损失，且此变动适用于本基金所有的衍生金融工具及非衍生金融工具。取 95%的置信度是基于本基金所持有的金融工具风险度量的要求。2020 年的分析同样基于该假设。

#### 6.4.13 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 不以公允价值计量的金融工具

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。

##### (b) 以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 72,537,265.19 元，属于第二层次的余额为人民币 4,906,458.46 元，属于第三层次的余额为人民币 173,566.76 元。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于本基金投资的证券，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，本基金分别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，确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。

(iii) 第三层次公允价值计量的金融工具

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层次公允价值本期变动情况如下：

上年度末余额为人民币 200,692.63 元，本期变动人民币-27,125.87 元，本期末余额为人民币 173,566.76 元。

(2) 除公允价值外，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	72,753,645.31	89.48
	其中：股票	72,753,645.31	89.48
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	4,863,645.10	5.98
	其中：债券	4,863,645.10	5.98
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	3,116,143.92	3.83
8	其他各项资产	575,215.46	0.71
9	合计	81,308,649.79	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 8,960,636.23 元，占资产净值比例为 11.60%。本基金本报告期末未参与转融通证券出借业务。本基金本报告期末未持有全国中小企业股份转让系统挂牌股票。

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	3,256,208.00	4.22
C	制造业	16,235,168.80	21.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,662.00	0.01
E	建筑业	11,014.44	0.01
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,062,748.00	1.38
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,496,562.76	1.94
J	金融业	35,173,152.28	45.54
K	房地产业	-	-



L	租赁和商务服务业	3,121,040.00	4.04
M	科学研究和技术服务业	3,432,452.80	4.44
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	63,793,009.08	82.60

### 7.2.2 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	2,014,723.62	2.61
C 消费者常用品	-	-
D 能源	198,376.19	0.26
E 金融	1,114,254.97	1.44
F 医疗保健	849,720.10	1.10
G 工业	316,023.98	0.41
H 信息技术	1,794,896.41	2.32
I 电信服务	2,672,640.96	3.46
J 公用事业	-	-
K 房地产	-	-
合计	8,960,636.23	11.60

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600036	招商银行	133,000	7,207,270.00	9.33
2	600030	中信证券	240,647	6,001,736.18	7.77
3	601166	兴业银行	246,500	5,065,575.00	6.56
4	600519	贵州茅台	1,700	3,496,390.00	4.53
5	601377	兴业证券	358,400	3,462,144.00	4.48
6	603259	药明康德	21,920	3,432,452.80	4.44
7	601888	中国中免	10,400	3,121,040.00	4.04
8	600309	万华化学	28,562	3,108,116.84	4.02
9	601601	中国太保	100,900	2,923,073.00	3.79
10	600660	福耀玻璃	50,100	2,798,085.00	3.62

11	600919	江苏银行	382,800	2,717,880.00	3.52
12	00700	腾讯控股	5,500	2,672,640.96	3.46
13	601012	隆基股份	29,540	2,624,333.60	3.40
14	601899	紫金矿业	213,100	2,064,939.00	2.67
15	601688	华泰证券	126,700	2,001,860.00	2.59
16	603323	苏农银行	355,900	1,558,842.00	2.02
17	603008	喜临门	46,700	1,541,567.00	2.00
18	002966	苏州银行	201,100	1,478,085.00	1.91
19	601099	太平洋	433,200	1,468,548.00	1.90
20	600570	恒生电子	14,700	1,370,775.00	1.77
21	603501	韦尔股份	4,200	1,352,400.00	1.75
22	03690	美团-W	4,800	1,279,672.47	1.66
23	600999	招商证券	65,900	1,253,418.00	1.62
24	601111	中国国航	136,600	1,062,748.00	1.38
25	601857	中国石油	141,600	749,064.00	0.97
26	600276	恒瑞医药	11,020	749,029.40	0.97
27	02382	舜宇光学科技	3,600	735,092.76	0.95
28	00388	香港交易所	1,900	731,664.59	0.95
29	00354	中国软件国际	48,000	565,548.13	0.73
30	01801	信达生物	7,000	527,413.91	0.68
31	01810	小米集团-W	22,000	494,255.52	0.64
32	600988	赤峰黄金	29,500	442,205.00	0.57
33	02313	申洲国际	2,400	391,610.13	0.51
34	03908	中金公司	22,000	382,590.38	0.50
35	09922	九毛九	13,000	343,441.02	0.44
36	00868	信义玻璃	12,000	316,023.98	0.41
37	688278	特宝生物	8,636	311,759.60	0.40
38	00883	中国海洋石油	27,000	198,376.19	0.26
39	02269	药明生物	1,500	177,607.48	0.23
40	06855	亚盛医药-B	3,700	144,698.71	0.19
41	688699	明微电子	398	113,557.36	0.15
42	688269	凯立新材	606	61,157.52	0.08
43	300896	爱美客	61	48,121.68	0.06
44	688161	威高骨科	472	38,831.44	0.05
45	688329	艾隆科技	739	36,979.56	0.05
46	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.04
47	688611	杭州柯林	448	18,968.32	0.02
48	688517	金冠电气	1,484	17,629.92	0.02
49	688499	利元亨	430	16,705.50	0.02

50	688226	威腾电气	2,351	15,093.42	0.02
51	603171	税友股份	637	12,230.40	0.02
52	605287	德才股份	349	11,014.44	0.01
53	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.01

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601688	华泰证券	8,422,143.00	9.54
2	601601	中国太保	8,052,198.00	9.12
3	300054	鼎龙股份	7,095,515.00	8.03
4	601318	中国平安	6,074,099.00	6.88
5	600900	长江电力	5,802,408.00	6.57
6	601377	兴业证券	4,965,873.00	5.62
7	600919	江苏银行	4,730,050.00	5.36
8	601939	建设银行	4,394,453.08	4.98
9	601888	中国中免	4,234,295.00	4.79
10	600030	中信证券	4,070,435.00	4.61
11	601995	中金公司	3,196,726.00	3.62
12	601111	中国国航	3,019,366.00	3.42
13	000001	平安银行	2,882,313.00	3.26
14	600570	恒生电子	2,807,179.00	3.18
15	603313	梦百合	2,769,045.50	3.14
16	601128	常熟银行	2,737,652.00	3.10
17	600999	招商证券	2,450,694.06	2.78
18	00700	腾讯控股	2,448,412.78	2.77
19	601818	光大银行	2,376,150.00	2.69
20	601009	南京银行	2,375,177.00	2.69
21	002966	苏州银行	2,266,300.00	2.57
22	600309	万华化学	1,797,171.00	2.04

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

**7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细**

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300054	鼎龙股份	15,942,850.63	18.05
2	601318	中国平安	13,556,102.22	15.35
3	601601	中国太保	10,387,629.00	11.76
4	000001	平安银行	7,510,562.34	8.50
5	600900	长江电力	6,016,439.00	6.81
6	601688	华泰证券	5,878,082.00	6.66
7	601939	建设银行	4,696,945.00	5.32
8	600030	中信证券	3,824,043.00	4.33
9	601111	中国国航	3,638,008.92	4.12
10	600176	中国巨石	3,378,528.00	3.83
11	600036	招商银行	3,312,366.00	3.75
12	600999	招商证券	3,231,027.00	3.66
13	601995	中金公司	3,034,945.00	3.44
14	603899	晨光文具	2,566,353.43	2.91
15	603313	梦百合	2,503,194.40	2.83
16	601009	南京银行	2,467,981.00	2.79
17	601336	新华保险	2,454,957.95	2.78
18	601128	常熟银行	2,405,709.00	2.72
19	601818	光大银行	2,248,000.00	2.55
20	603288	海天味业	2,190,215.00	2.48
21	601166	兴业银行	2,153,495.00	2.44
22	603658	安图生物	2,015,015.28	2.28
23	603337	杰克股份	1,958,331.00	2.22
24	002415	海康威视	1,865,606.00	2.11
25	600309	万华化学	1,840,481.00	2.08
26	600919	江苏银行	1,828,970.00	2.07
27	601838	成都银行	1,806,297.00	2.05

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

**7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额**

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	135,030,806.16
卖出股票收入（成交）总额	148,700,250.23

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

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	4,863,645.10	6.30
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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	4,863,645.10	6.30

## 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	019640	20 国债 10	30,370	3,037,000.00	3.93
2	019645	20 国债 15	18,210	1,826,645.10	2.37

## 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

注：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

注：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

注：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股指期货交易情况说明

### 7.10.1 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。

### 7.10.2 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。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

### 7.11.2 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。

### 7.11.3 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。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 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，中信证券股份有限公司于 2021 年 1 月 23 日收到深圳证监局出具的《深圳证监局关于对中信证券股份有限公司采取责令改正措施的决定》（行政监管措施决定书(2021)5 号）。经查，公司在业务开展过程中存在以下情况：一、私募基金托管业务内部控制不够完善，个别项目履职不谨慎。一是业务准入管控不到位，部分项目业务准入未严格执行公司规定的标准和审批程序，未充分关注和核实管理人准入材料。二是投资监督业务流程存在薄弱环节，部分产品未及时调整系统中设定的监督内容，部分投资监督审核未按公司规定履行复核程序，对投资监督岗履职情况进行监督约束的内控流程不完善。三是信息披露复核工作存在不足，对个别产品季度报告的复核存在迟延。四是业务隔离不到位，托管部门与从事基金服务外包业务的子公司未严格执行业务隔离要求；二、个别首次公开发行保荐项目执业质量不高，存在对发行人现金交易等情况关注和披露不充分、不准确，对发行人收入确认依据、补贴可回收性等情况核查不充分等问题；三、公司个别资管产品未按《证券公司定向资产管理业务实施细则》（证监会公告（2012）30 号）第二十九条第二款规定，根据合同约定的时间和方式向客户提供对账单，说明报告期内客户委托资产的配置状况、净值变动、交易记录等情况。以上情形反映了公司对相关业

务的管控存在薄弱环节，内部控制不完善，违反了 2013 年《证券投资基金托管业务管理办法》（证监会令第 92 号）第二十六条第一款、《证券投资基金托管业务管理办法》（证监会令第 172 号）第三十三条、《私募投资基金监督管理暂行办法》（证监会令第 105 号）第四条第一款、2017 年《证券发行上市保荐业务管理办法》（证监会令第 137 号）第三十四条等规定，依据《证券公司监督管理条例》第七十条第一款的规定，深圳局决定对公司采取责令改正的监督管理措施。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体兴业银行股份有限公司于 2020 年 8 月 31 日收到中国银保监会福建监管局行政处罚信息公开表（闽银保监罚决字〔2020〕24 号），根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、四十六条、《中华人民共和国商业银行法》第七十四条，经查，兴业银行存在同业投资用途不合规、授信管理不尽职、采用不正当手段吸收存款、理财资金间接投资本行信贷资产收益权、非洁净转让信贷资产、违规接受地方财政部门担保。综合，中国银保监会福建监管局决定对兴业银行股份有限公司处以没收违法所得 6,361,807.97 元，并合计处以罚款 15,961,807.97 元。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体招商银行股份有限公司于 2021 年 5 月 17 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〔2021〕16 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，招商银行股份有限公司存在一、为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产；二、违规协助无衍生产品交易业务资格的银行发行结构性衍生产品；三、理财产品之间风险隔离不到位；四、理财资金投资非标准化债权资产认定不准确，实际余额超监管标准；五、同业投资接受第三方金融机构信用担保；六、理财资金池化运作；七、利用理财产品准备金调节收益；八、高净值客户认定不审慎；九、并表管理不到位，通过关联非银机构的内部交易，违规变相降低理财产品销售门槛；十、投资集合资金信托计划的理财产品未执行合格投资者标准；十一、投资集合资金信托计划人数超限；十二、面向不合格个人投资者销售投资高风险资产或权益性资产的理财产品；十三、信贷资产非真实转让；十四、全权委托业务不规范；十五、未按要求向监管机构报告理财投资合作机构，被监管否决后仍未及时停办业务；十六、通过关联机构引入非合格投资者，受让以本行信用卡债权设立的信托次级受益权；十七、“智能投资受托计划业务”通过其他方式规避整改，扩大业务规模，且业务数据和材料缺失；十八、票据转贴现假卖断屡查屡犯；十九、贷款、理财或同业投资资金违规投向土地储备项目；二十、理财资金违规提供棚改项目资本金融资，向地方政府提供融资并要求地方政府提供担保；二十一、同业投资、理财资金等违规投向地价款或四证不全的房地产项目；二十二、理财资金认购商业银行增发的股票；二十三、违规为企业发行短期融资券提供搭桥融资，并用理财产品投资

本行主承债券以承接表内类信贷资产；二十四、为定制公募基金提供投资顾问；二十五、为本行承销债券兑付提供资金支持；二十六、协助发行人以非市场化的价格发行债券；二十七、瞒报案件信息。综上，中国银行保险监督管理委员会给予公司罚款 7170 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七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。

#### 7.12.2 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。

#### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	63,149.68
2	应收证券清算款	397,253.77
3	应收股利	13,698.33
4	应收利息	96,278.57
5	应收申购款	4,835.11
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	575,215.46

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 7.12.6 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。



## §8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
546	123,911.03	65,634,529.96	97.01%	2,020,890.04	2.99%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	109.09	0.00%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2019年2月26日）基金份额总额	7,624,198.80
本报告期期初基金份额总额	80,606,059.80
本报告期基金总申购份额	18,388,563.44
减：本报告期基金总赎回份额	31,339,203.24
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	67,655,420.00

## §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 2021 年 1 月 25 日起，成善栋先生不再担任公司董事长，由总经理覃波先生代任董事长。

自 2021 年 4 月 28 日起，刘元瑞先生担任公司董事长，总经理覃波先生不再代任董事长。

上述重大人事变动情况，本基金管理人均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，基金管理人、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	215,535,639.00	76.37%	169,780.10	77.68%	-
申港证券	1	66,704,358.64	23.63%	48,780.82	22.32%	-

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	5,716,026.20	61.19%	319,600,000.00	82.01%	-	-
申港证券	3,625,790.70	38.81%	70,100,000.00	17.99%	-	-

## 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旗下部分开放式基金在天风证券股份有限公司开通转换、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	2021年1月14日
2	长信价值优选混合型证券投资基金2020年第4季度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2021年1月22日
3	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金2020年第4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	2021年1月22日

		子披露网站、公司网站	
4	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	2021 年 1 月 26 日
5	长信基金管理有限责任公司关于长信价值优选混合型证券投资基金恢复大额申购（含转换转入、定期定额投资）业务的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021 年 3 月 4 日
6	长信基金管理有限责任公司关于增加中信建投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	2021 年 3 月 16 日
7	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金参加国金证券股份有限公司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	2021 年 3 月 26 日
8	长信价值优选混合型证券投资基金 2020 年年度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2021 年 3 月 30 日
9	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2020 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	2021 年 3 月 30 日
10	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金参加中国银行股份有限公司申购（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	2021 年 3 月 31 日
11	长信价值优选混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2021 年 4 月 21 日
12	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2021 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	2021 年 4 月 21 日
13	长信基金管理有限责任公司关于董事长变更公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021 年 4 月 30 日
14	长信基金管理有限责任公司公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021 年 6 月 22 日
15	长信基金管理有限责任公司关于旗下 40 只公募基金增加侧袋机制并相应修改法律文件的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电	2021 年 6 月 29 日

		子披露网站、公司网站	
16	长信基金管理有限责任公司关于修订旗下公开募集证券投资基金法律文件并更新产品资料概要的提示性公告	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	2021 年 6 月 29 日
17	长信价值优选混合型证券投资基金更新的招募说明书及基金产品资料概要（更新）	中国证监会电子披露网站、公司网站	2021 年 6 月 29 日
18	长信价值优选混合型证券投资基金基金合同	中国证监会电子披露网站、公司网站	2021 年 6 月 29 日
19	长信价值优选混合型证券投资基金托管协议	中国证监会电子披露网站、公司网站	2021 年 6 月 29 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	2021 年 1 月 4 日至 2021 年 6 月 30 日	15,860,854.05	0.00	0.00	15,860,854.05	23.44%
	2	2021 年 1 月 4 日至 2021 年 6 月 30 日	16,119,899.24	0.00	0.00	16,119,899.24	23.83%
	3	2021 年 2 月 5 日至 2021 年 4 月 19 日	5,164,789.75	8,291,732.32	0.00	13,456,522.07	19.89%
个人	-	-	-	-	-	-	-

#### 产品特有风险

##### 1、基金净值大幅波动的风险

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

##### 2、赎回申请延期办理的风险

单一持有基金比例过高的投资者大额赎回后可能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。

##### 3、基金投资策略难以实现的风险

单一持有基金比例过高的投资者大额赎回后，可能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。

### 11.2 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。

## §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、《长信价值优选混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长信价值优选混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《长信价值优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。

### 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：<https://www.cxfund.com.cn>。

长信基金管理有限责任公司

2021 年 8 月 31 日