

长信先优债券型证券投资基金 2024 年中期报告

2024 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 30 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司（以下简称“中国工商银行”，下同）根据本基金基金合同的规定，于 2024 年 8 月 28 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 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	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	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
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	40
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	41

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	41
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	41
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	41
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	41
7.11 投资组合报告附注	41
§8 基金份额持有人信息	45
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	45
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	46
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	46
§9 开放式基金份额变动	46
§10 重大事件揭示	47
10.1 基金份额持有人大会决议	47
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	47
10.4 基金投资策略的改变	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	47
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	47
10.8 其他重大事件	49
§11 影响投资者决策的其他重要信息	50
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	50
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	51
§12 备查文件目录	51
12.1 备查文件目录	51
12.2 存放地点	51
12.3 查阅方式	51

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长信先优债券型证券投资基金	
基金简称	长信先优债券	
基金主代码	004885	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 8 月 1 日	
基金管理人	长信基金管理有限责任公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	50,076,268.20 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	长信先优债券 A	长信先优债券 C
下属分级基金的交易代码	004885	016820
报告期末下属分级基金的份额总额	40,132,031.80 份	9,944,236.40 份

2.2 基金产品说明

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

	4、其他类型资产投资策略 在法律法规或监管机构允许的情况下,本基金将在严格控制投资风险的基础上适当参与权证、资产支持证券等金融工具的投资。
业绩比较基准	中债综合指数收益率*80%+中证 500 指数收益率*20%
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	周永刚
	联系电话	021-61009999
	电子邮箱	zhouyg@cxfund.com.cn
客户服务电话	4007005566	95588
传真	021-61009800	010-66105798
注册地址	中国(上海)自由贸易试验区银城中路 68 号 37 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址	上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼、37 楼、38 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	200120	100140
法定代表人	刘元瑞	廖林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.cxfund.com.cn
基金中期报告备置地点	上海市浦东新区银城中路 68 号 38 楼、北京市西城区复兴门内大街 55 号

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	A 类份额: 中国证券登记结算有限责任公司、C 类份额: 长信基金管理有限责任公司	A 类份额: 北京市西城区太平桥大街 17 号、C 类份额: 上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼、37 楼、38 楼

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位: 人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)	
	长信先优债券 A	长信先优债券 C
本期已实现收益	984,969.14	242,707.46
本期利润	1,422,378.28	337,194.53
加权平均基金份额本期利润	0.0337	0.0335

本期加权平均净值利润率	3.22%	3.21%
本期基金份额净值增长率	3.36%	3.26%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)	
期末可供分配利润	2,784,999.99	650,279.13
期末可供分配基金份额利润	0.0694	0.0654
期末基金资产净值	42,917,031.79	10,594,515.53
期末基金份额净值	1.0694	1.0654
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	38.34%	0.16%

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

长信先优债券 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	0.29%	0.16%	-0.89%	0.19%	1.18%	-0.03%
过去三个月	2.57%	0.18%	-0.43%	0.21%	3.00%	-0.03%
过去六个月	3.36%	0.19%	0.28%	0.31%	3.08%	-0.12%
过去一年	2.27%	0.16%	-0.97%	0.25%	3.24%	-0.09%
过去三年	5.16%	0.18%	-0.46%	0.24%	5.62%	-0.06%
自基金合同生效起至今	38.34%	0.21%	7.12%	0.26%	31.22%	-0.05%

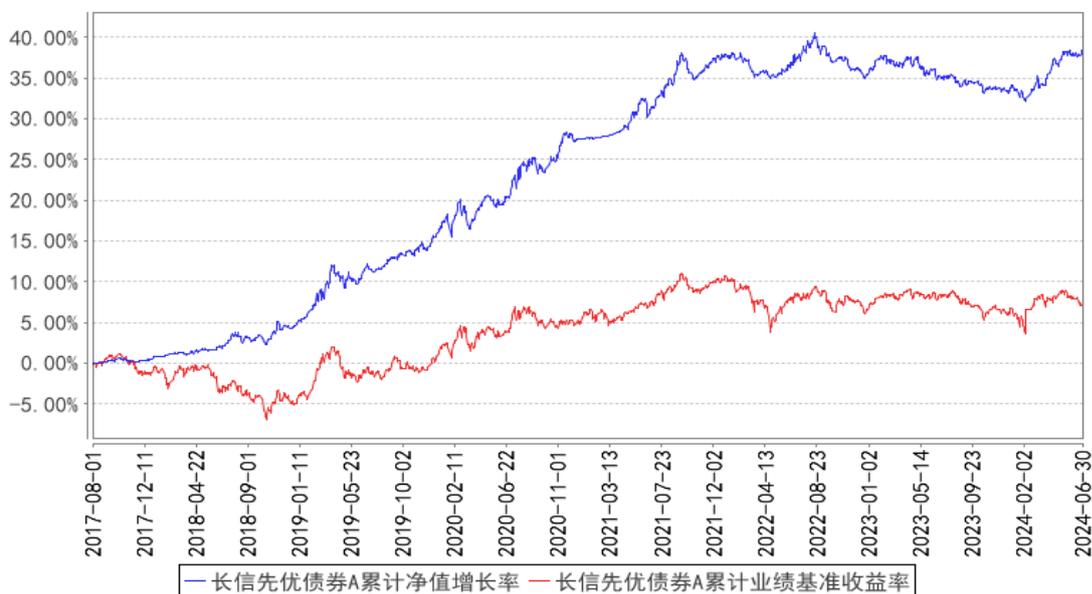
长信先优债券 C

阶段	份额净值增长	份额净值增长率标	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差	①—③	②—④
----	--------	----------	------------	--------------	-----	-----

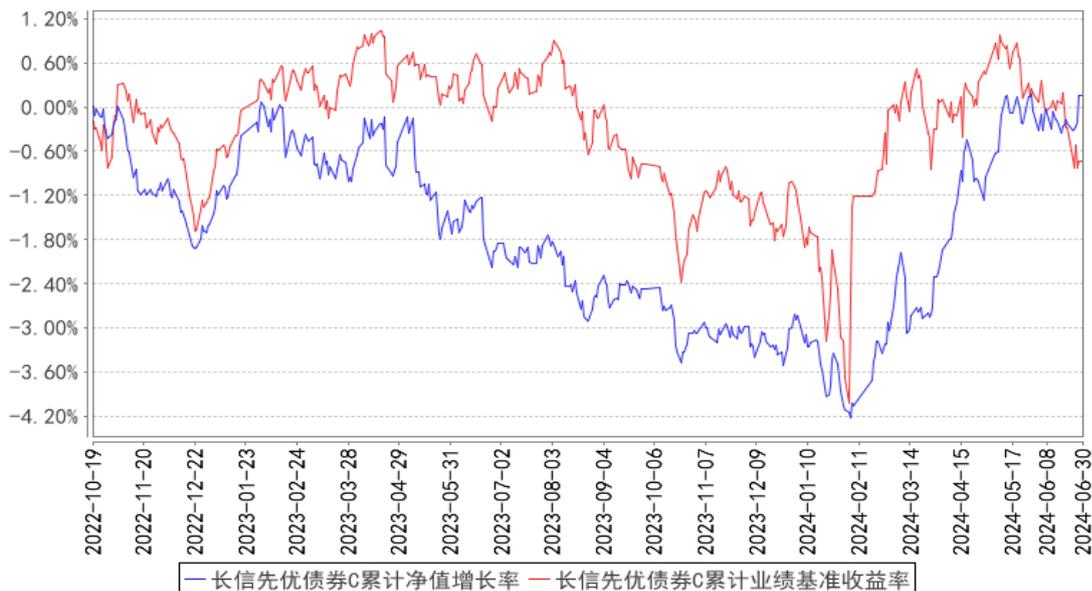
	率①	准差②		④		
过去一个月	0.27%	0.16%	-0.89%	0.19%	1.16%	-0.03%
过去三个月	2.52%	0.18%	-0.43%	0.21%	2.95%	-0.03%
过去六个月	3.26%	0.19%	0.28%	0.31%	2.98%	-0.12%
过去一年	2.05%	0.16%	-0.97%	0.25%	3.02%	-0.09%
自份额增加日起至 今	0.16%	0.17%	-0.73%	0.22%	0.89%	-0.05%

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

长信先优债券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



长信先优债券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、基金管理人自 2022 年 10 月 19 日起对长信先优债券进行份额分类，原有基金份额为 A 类份额，增设 C 类份额。

2、长信先优债券 A 图示日期为 2017 年 8 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日，长信先优债券 C 图示日期为 2022 年 10 月 19 日（份额增加日）至 2024 年 6 月 30 日。

3、按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内为建仓期；建仓期结束时，本基金的各项投资比例已符合基金合同的约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至 2024 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 88 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、长信创新驱动股票型证券投资基金、长信稳益纯债债券型证券投资基金、长信利信灵活配置混合型证券投资基金、长信稳健纯债债券

型证券投资基金、长信国防军工量化灵活配置混合型证券投资基金、长信先优债券型证券投资基金、长信稳势纯债债券型证券投资基金、长信中证 500 指数增强型证券投资基金、长信长金货币市场基金、长信稳通三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金、长信利尚一年定期开放混合型证券投资基金、长信乐信灵活配置混合型证券投资基金、长信全球债券证券投资基金、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、长信双利优选混合型证券投资基金、长信富瑞两年定期开放债券型证券投资基金、长信颐天平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、长信易进混合型证券投资基金、长信先锐混合型证券投资基金、长信稳健精选混合型证券投资基金、长信浦瑞 87 个月定期开放债券型证券投资基金、长信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、长信企业成长三年持有期混合型证券投资基金、长信稳兴三个月定期开放债券型证券投资基金、长信稳航 30 天持有期中短债债券型证券投资基金、长信稳恒债券型证券投资基金、长信中证科创创业 50 指数增强型证券投资基金、长信均衡策略一年持有期混合型证券投资基金、长信中证 1000 指数增强型证券投资基金、长信均衡优选混合型证券投资基金、长信 90 天滚动持有债券型证券投资基金、长信稳固 60 天滚动持有债券型证券投资基金、长信汇智量化选股混合型证券投资基金、长信 120 天滚动持有债券型证券投资基金、长信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、长信优势行业混合型证券投资基金、长信 180 天持有期债券型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
程放	长信先优债券型证券投资	2020 年 12 月 31	-	11 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

	资基金、长信利发债券型证券投资基金、长信先锐混合型证券投资基金和长信乐信灵活配置混合型证券投资基金的基金经理	日			有限公司、兴银基金管理有限责任公司，2020年8月加入长信基金管理有限责任公司，曾任长信合利混合型证券投资基金的基金经理，现任长信先优债券型证券投资基金、长信利发债券型证券投资基金、长信先锐混合型证券投资基金和长信乐信灵活配置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 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

回顾上半年，国内宏观经济整体复苏，经济数据读数低个位数上涨，金融数据逐步进入新常态

态区间，PMI 指数在 3 月份冲高至 50.8%后，回落至 50%区间以下。

对于风险资产来讲，我们整体淡化择时，延续一直以来的投资策略，组合管理中更关注行业的胜率而非赔率。根据投资框架定位，报告期继续关注大盘价值和低估值因子，并在个股投资层面适度集中。我们认为低估值、自由现金流优异、业绩稳定增长的行业，更加适合在复苏初期获得确定性收益。同时，存量资金环境中，内部分化和行业轮动加剧，我们认为当前位置权益市场下行空间有限，但跟随行业景气度和高频数据进行切换的难度加大，因此整体考虑坚持持有估值较低、基本面业绩有韧性的银行、行业景气度整体改善的电力和公用事业，以及部分公司治理良好且股息率稳定的资源品公司。

债券资产方面，预计后续货币政策或仍会保持相对宽松。我们认为虽然当前收益率水平处于相对低位，债券资产仍具备一定投资机会，组合管理中保持适度久期，维持中高等级信用债配置。可转债方面，市场在报告期内整体波动加大，在 6 月份市场调整后估值进一步降低。组合坚持对于可转债资产绝对收益增强思路，在转债市场整体回调过程中整体回撤较小，且在市场回调中逢低增持部分银行转债、债性转债品种，同时适度参与部分平衡型转债的投资机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2024 年 6 月 30 日，长信先优债券 A 基金份额净值为 1.0694 元，份额累计净值为 1.3644 元，本报告期内长信先优债券 A 净值增长率为 3.36%；长信先优债券 C 基金份额净值为 1.0654 元，份额累计净值为 1.1104 元，本报告期内长信先优债券 C 净值增长率为 3.26%，同期业绩比较基准收益率为 0.28%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为宏观经济仍在适应房地产投资增速变化后的新常态，预计未来一段时间仍将平稳运行。货币政策方面，流动性保持合理充裕，金融市场整体波动性降低。与之对应的，稳健是未来一段时间组合管理的主旋律。

展望 2024 年三季度，我们认为债券市场或呈现震荡偏强的格局。经济动能方面，鉴于出口保持韧性，政府债发行提速以拉动基建投资，经济有望延续回升向好态势，关注政策发力节奏对市场预期的影响。流动性方面，预计政策发力点仍在宽信用，流动性的主基调仍然是以稳为主，为债市提供一定的支撑。

权益市场方面，股票市场在上半年出现明显回调。在当前经济复苏且宏观流动性维持温和偏松的环境下，我们当前整体观点维持偏积极，组合持有的低估值、红利类资产在当前市场环境中仍然具备一定吸引力。

后续，我们会关注政策和新产业趋势共振的一些领域，整体延续关注高胜率资产稳健投资的

策略。我们认为高波动资产和高胜率资产可能天然存在一定风格层面的互斥，这对于持有人的风险偏好和预期收益需要有一定要求。对于上半年表现超出我们预期的一些资产，我们基于平抑波动的考虑会增加一些收益兑现频次，但我们整体认为稳健类资产整体估值尚未进入泡沫化，同时我们也会对一些估值进入合理区间的成长类资产予以关注，整体力图提高组合的夏普比和持有体验。

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、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。

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，本基金托管人在对长信先优债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益

行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，长信先优债券型证券投资基金的管理人—长信基金管理有限责任公司在长信先优债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人依法对长信基金管理有限责任公司编制和披露的长信先优债券型证券投资基金 2024 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、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：长信先优债券型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	2,801,464.38	474,941.48
结算备付金		88,609.46	202,907.22
存出保证金		15,264.80	22,469.97
交易性金融资产	6.4.7.2	52,079,696.79	58,316,630.17
其中：股票投资		6,984,961.00	7,946,804.41
基金投资		-	-
债券投资		45,094,735.79	50,369,825.76
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	-	3,001,254.90
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		2,308.14	467.92
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		54,987,343.57	62,018,671.66
负债和净资产	附注号	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		1,323,526.06	-
应付赎回款		50,492.73	35,764.89
应付管理人报酬		26,320.23	24,961.81
应付托管费		4,386.70	4,160.31
应付销售服务费		1,740.60	361.14
应付投资顾问费		-	-
应交税费		110.68	448.53
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	69,219.25	173,318.28
负债合计		1,475,796.25	239,014.96
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	50,076,268.20	59,752,912.75
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	3,435,279.12	2,026,743.95
净资产合计		53,511,547.32	61,779,656.70
负债和净资产总计		54,987,343.57	62,018,671.66

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，长信先优债券 A 份额净值 1.0694 元，长信先优债券 C 份额净值 1.0654 元，基金份额总额为 50,076,268.20 份，其中长信先优债券 A 份额 40,132,031.80 份。长信先优债券 C 份额 9,944,236.40 份。

6.2 利润表

会计主体：长信先优债券型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024年1月1日至2024 年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023 年6月30日
一、营业总收入		2,013,662.47	6,067,463.86

1. 利息收入		5,306.11	41,057.98
其中：存款利息收入	6.4.7.13	3,835.56	28,496.32
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,470.55	12,561.66
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,476,387.22	157,041.07
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-68,496.21	-2,672,150.36
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	1,405,685.68	2,485,966.98
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	139,197.75	343,224.45
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	531,896.21	5,734,565.16
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	72.93	134,799.65
减：二、营业总支出		254,089.66	1,453,963.06
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	163,018.05	1,125,158.68
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	27,169.70	187,526.39
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	10,422.31	2,734.47
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		4,598.49	26,460.38
其中：卖出回购金融资产支出		4,598.49	26,460.38
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		102.23	7,075.54
8. 其他费用	6.4.7.23	48,778.88	105,007.60
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,759,572.81	4,613,500.80
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”		1,759,572.81	4,613,500.80

号填列)			
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		1,759,572.81	4,613,500.80

6.3 净资产变动表

会计主体：长信先优债券型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	59,752,912.75	-	2,026,743.95	61,779,656.70
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	59,752,912.75	-	2,026,743.95	61,779,656.70
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-9,676,644.55	-	1,408,535.17	-8,268,109.38
（一）、综合收益总额	-	-	1,759,572.81	1,759,572.81
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-9,676,644.55	-	-351,037.64	-10,027,682.19
其中：1. 基金申购款	1,806,604.17	-	99,885.14	1,906,489.31
2. 基金赎回款	-11,483,248.72	-	-450,922.78	-11,934,171.50
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	50,076,268.20	-	3,435,279.12	53,511,547.32

项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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
	产			
一、上期期末净资产	729,745,174.07	-	34,481,097.01	764,226,271.08
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	729,745,174.07	-	34,481,097.01	764,226,271.08
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-547,722,962.61	-	-26,155,805.38	-573,878,767.99
（一）、综合收益总额	-	-	4,613,500.80	4,613,500.80
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-547,722,962.61	-	-30,769,306.18	-578,492,268.79
其中：1. 基金申购款	911,237.40	-	50,216.24	961,453.64
2. 基金赎回款	-548,634,200.01	-	-30,819,522.42	-579,453,722.43
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	182,022,211.46	-	8,325,291.63	190,347,503.09

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

长信先优债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)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》、《长信先优债券型证券投资基金基金合同》(以下简称“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[2017]1021 号文批准公开募集。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 200,118,348.27 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 1700023 号验资报告。基金合同于 2017 年 8 月 1 日正式生效。本基金的基金管理人为长信基金管理有限责任公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据 2022 年 10 月 17 日发布的《长信基金管理有限责任公司关于长信先优债券型证券投资基金增设 C 类基金份额相关事项的公告》,自 2022 年 10 月 19 日起,本基金增设 C 类份额(以下简称“长信先优债券 C”),长信先优债券 C 年销售服务费率为 0.20%。本基金分类后,原有基金份额将自动划归为本基金 A 类基金份额(以下简称“长信先优债券 A”),长信先优债券 A 不收取销售服务费。

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《长信先优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,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、存托凭证、权证,债券(包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、短期融资券、超级短期融资券、中期票据、次级债券、可转债及分离交易可转债、中小企业私募债等)、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)、货币市场工具、国债期货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:投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%,投资于股票资产的比例不高于基金资产的 20%,其中持有的全部权证市值不超过基金资产净值的 3%。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,本基金持有现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)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%。本基金的业绩比较基准为:中债综合指数收益率 \times 80%+中证 500 指数收益率 \times 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 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

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

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。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期内无需说明的会计差错更正。

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》、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[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]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]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》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》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；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，暂不计缴企业所得税。

(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。

(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；自 2023 年 8 月 28 日起，出让方减按 0.05%的税率缴纳证券(股票)交易印花税。

(5) 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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	2,801,464.38
等于：本金	2,801,295.29
加：应计利息	169.09
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	2,801,464.38

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	7,038,826.64	-	6,984,961.00	-53,865.64
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券 交易所市场	30,385,467.15	193,184.02	30,887,408.02	308,756.85

	银行间市场	13,949,337.52	104,427.77	14,207,327.77	153,562.48
	合计	44,334,804.67	297,611.79	45,094,735.79	462,319.33
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		51,373,631.31	297,611.79	52,079,696.79	408,453.69

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末无其他债权投资。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金本报告期末无其他权益投资工具。

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 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	31,308.29
其中：交易所市场	30,525.79

银行间市场	782.50
应付利息	-
预提账户维护费	9,300.00
预提审计费	9,944.48
预提信息披露费	18,666.48
合计	69,219.25

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

长信先优债券 A

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	45,125,268.67	45,125,268.67
本期申购	94,994.85	94,994.85
本期赎回（以“-”号填列）	-5,088,231.72	-5,088,231.72
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	40,132,031.80	40,132,031.80

长信先优债券 C

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	14,627,644.08	14,627,644.08
本期申购	1,711,609.32	1,711,609.32
本期赎回（以“-”号填列）	-6,395,017.00	-6,395,017.00
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	9,944,236.40	9,944,236.40

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

本基金本报告期无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

长信先优债券 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,503,887.15	-1,941,876.89	1,562,010.26
加：会计政策变更	-	-	-

前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	3,503,887.15	-1,941,876.89	1,562,010.26
本期利润	984,969.14	437,409.14	1,422,378.28
本期基金份额交易产生的变动数	-372,457.42	173,068.87	-199,388.55
其中：基金申购款	7,902.28	-3,235.90	4,666.38
基金赎回款	-380,359.70	176,304.77	-204,054.93
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,116,398.87	-1,331,398.88	2,784,999.99

长信先优债券 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,095,071.49	-630,337.80	464,733.69
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	1,095,071.49	-630,337.80	464,733.69
本期利润	242,707.46	94,487.07	337,194.53
本期基金份额交易产生的变动数	-356,649.38	205,000.29	-151,649.09
其中：基金申购款	141,852.40	-46,633.64	95,218.76
基金赎回款	-498,501.78	251,633.93	-246,867.85
本期已分配利润	-	-	-
本期末	981,129.57	-330,850.44	650,279.13

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	2,293.07
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	1,405.57
其他	136.92
合计	3,835.56

注：其他为申购款利息收入和保证金利息收入。

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

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	52,782,825.99
减：卖出股票成本总额	52,749,460.66

减：交易费用	101,861.54
买卖股票差价收入	-68,496.21

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 2024年1月1日至2024年6月 30日
债券投资收益——利息收入	522,886.45
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	882,799.23
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	1,405,685.68

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 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	119,069,419.14
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	117,014,599.75
减：应计利息总额	1,167,432.83
减：交易费用	4,587.33
买卖债券差价收入	882,799.23

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无债券投资赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无债券投资申购差价收入。

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

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	139,197.75
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	139,197.75

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	531,896.21
股票投资	107,628.02
债券投资	424,268.19
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	531,896.21

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	72.93
合计	72.93

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应全额计入基金财产，其余赎回费总额的25%应归基金财产。

6.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	9,944.48
信息披露费	18,666.48
证券出借违约金	-
账户维护费	18,600.00
其他费用	1,567.92
合计	48,778.88

注：其他费用为银行费用。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

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、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年6月30日	2023年1月1日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	163,018.05	1,125,158.68
其中：应支付销售机构的客户维护费	27,196.63	198,133.31
应支付基金管理人的净管理费	135,821.42	927,025.37

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×0.60%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：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×0.60%÷当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年6月30日	2023年1月1日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	27,169.70	187,526.39

注：支付基金托管人中国工商银行的基金托管费按前一日基金资产净值×0.10%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：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%÷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		
	2024年1月1日至2024年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长信先优债券 A	长信先优债券 C	合计
长信基金	-	1.82	1.82
合计	-	1.82	1.82
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2023年1月1日至2023年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长信先优债券 A	长信先优债券 C	合计
长信基金	-	2,690.95	2,690.95
合计	-	2,690.95	2,690.95

注：长信先优债券 A 不收取销售服务费，长信先优债券 C 的销售服务费按基金前一日资产净值×0.20%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：长信先优债券 C 的日销售服务费=前一日长信先优债券 C 资产净值×0.20%÷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

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。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

基金管理人在本报告期及上年度可比期间均未运用自有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末及上年度末均未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	2,801,464.38	2,293.07	665,414.43	19,657.47

注：本基金用于证券交易结算的资金通过本基金托管人的基金托管结算资金专用存款账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息。于2024年6月30日的相关余额在资产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示（2023年6月30日：同）。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期及上年度可比期间均未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2024 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

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而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

本基金本报告期末无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中国工商银行，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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	7,413,586.69	17,660,130.96
合计	7,413,586.69	17,660,130.96

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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	25,675,079.04	21,891,555.64
AAA 以下	2,607,793.89	2,161,898.88
未评级	9,398,276.17	8,656,240.28
合计	37,681,149.10	32,709,694.80

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 2024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						
货币资金	2,801,464.38	-	-	-	-	2,801,464.38
结算备付金	88,609.46	-	-	-	-	88,609.46
存出保证金	15,264.80	-	-	-	-	15,264.80
交易性金融资产	10,183,666.70	9,234,159.94	17,293,094.62	8,383,814.53	6,984,961.00	52,079,696.79
应收申购款	-	-	-	-	2,308.14	2,308.14
资产总计	13,089,005.34	9,234,159.94	17,293,094.62	8,383,814.53	6,987,269.14	54,987,343.57
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	50,492.73	50,492.73
应付管理人报酬	-	-	-	-	26,320.23	26,320.23
应付托管费	-	-	-	-	4,386.70	4,386.70
应付清算款	-	-	-	-	-1,323,526.06	1,323,526.06
应付销售服务费	-	-	-	-	1,740.60	1,740.60
应交税费	-	-	-	-	110.68	110.68
其他负债	-	-	-	-	69,219.25	69,219.25
负债总计	-	-	-	-	-1,475,796.25	1,475,796.25
利率敏感度缺口	13,089,005.34	9,234,159.94	17,293,094.62	8,383,814.53	5,511,472.89	53,511,547.32
上年度末 2023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						
货币资金	474,941.48	-	-	-	-	474,941.48
结算备付金	202,907.22	-	-	-	-	202,907.22
存出保证金	22,469.97	-	-	-	-	22,469.97
交易性金融资产	16,603,762.21	21,031,974.06	6,615,739.62	6,118,349.87	7,946,804.41	58,316,630.17
买入返售金融资产	3,001,254.90	-	-	-	-	3,001,254.90
应收申购款	-	-	-	-	467.92	467.92
资产总计	20,305,335.78	21,031,974.06	6,615,739.62	6,118,349.87	7,947,272.33	62,018,671.66
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	35,764.89	35,764.89
应付管理人报酬	-	-	-	-	24,961.81	24,961.81
应付托管费	-	-	-	-	4,160.31	4,160.31
应付销售服务费	-	-	-	-	361.14	361.14
应交税费	-	-	-	-	448.53	448.53
其他负债	-	-	-	-	173,318.28	173,318.28
负债总计	-	-	-	-	239,014.96	239,014.96
利率敏感度缺口	20,305,335.78	21,031,974.06	6,615,739.62	6,118,349.87	7,708,257.37	61,779,656.70

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	
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（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
市场利率上升 27 个基点	-460,187.94	-297,362.67
市场利率下降 27 个基点	460,187.94	297,362.67

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

于 6 月 30 日，本基金面临的其他市场价格风险列示如下：

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日		上年度末 2023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	6,984,961.00	13.05	7,946,804.41	12.86
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	45,094,735.79	84.27	50,369,825.76	81.53
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	52,079,696.79	97.32	58,316,630.17	94.39

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	在 95%的置信区间内，基金资产组合的市场价格风险		
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（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	VaR 值为 0.35% (2023 年 12 月 31 日 VaR 值为 0.42%)	-188,201.80	-258,320.93

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。2023 年的分析同样基于该假设。

6.4.14 公允价值**6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法**

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具**6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值**

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	14,943,971.80	14,251,058.76
第二层次	37,135,724.99	44,065,571.41
第三层次	-	-
合计	52,079,696.79	58,316,630.17

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，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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	6,984,961.00	12.70
	其中：股票	6,984,961.00	12.70
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	45,094,735.79	82.01
	其中：债券	45,094,735.79	82.01
	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	2,890,073.84	5.26
8	其他各项资产	17,572.94	0.03
9	合计	54,987,343.57	100.00

注：本基金本报告期末未通过港股通交易机制投资港股。本基金本报告期末未参与转融通证券出借业务。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,552,750.00	2.90
C	制造业	2,280,307.00	4.26

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,859,210.00	3.47
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	129,000.00	0.24
J	金融业	1,163,694.00	2.17
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	6,984,961.00	13.05

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通过港股通交易机制投资港股。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000400	许继电气	21,500	739,815.00	1.38
2	600900	长江电力	25,000	723,000.00	1.35
3	600938	中国海油	15,000	495,000.00	0.93
4	601088	中国神华	11,000	488,070.00	0.91
5	000333	美的集团	4,600	296,700.00	0.55
6	600585	海螺水泥	12,000	283,080.00	0.53
7	600919	江苏银行	35,000	260,050.00	0.49
8	601225	陕西煤业	10,000	257,700.00	0.48
9	003816	中国广核	55,000	254,650.00	0.48
10	601169	北京银行	40,000	233,600.00	0.44
11	601009	南京银行	20,000	207,800.00	0.39
12	600642	申能股份	20,000	176,600.00	0.33
13	600027	华电国际	25,000	173,500.00	0.32
14	002884	凌霄泵业	9,000	172,800.00	0.32
15	002270	华明装备	7,500	166,800.00	0.31
16	601001	晋控煤业	10,000	165,200.00	0.31
17	601985	中国核电	14,000	149,240.00	0.28
18	603556	海兴电力	3,000	140,490.00	0.26
19	605368	蓝天燃气	10,000	136,400.00	0.25

20	000598	兴蓉环境	18,000	135,360.00	0.25
21	601825	沪农商行	20,000	134,400.00	0.25
22	600941	中国移动	1,200	129,000.00	0.24
23	601838	成都银行	8,000	121,520.00	0.23
24	600282	南钢股份	24,000	119,520.00	0.22
25	600985	淮北矿业	7,000	117,180.00	0.22
26	688981	中芯国际	2,500	115,250.00	0.22
27	600908	无锡银行	20,000	106,400.00	0.20
28	603986	兆易创新	1,100	105,182.00	0.20
29	601128	常熟银行	13,200	99,924.00	0.19
30	000625	长安汽车	7,000	94,010.00	0.18
31	600886	国投电力	4,000	72,960.00	0.14
32	002318	久立特材	2,000	46,660.00	0.09
33	600674	川投能源	2,000	37,500.00	0.07
34	600489	中金黄金	2,000	29,600.00	0.06

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	600938	中国海油	1,491,793.00	2.41
2	600900	长江电力	1,213,368.25	1.96
3	603556	海兴电力	1,067,705.00	1.73
4	000400	许继电气	1,040,910.00	1.68
5	600642	申能股份	1,027,693.00	1.66
6	601985	中国核电	1,022,800.00	1.66
7	600985	淮北矿业	1,002,985.00	1.62
8	601088	中国神华	983,634.00	1.59
9	601225	陕西煤业	883,059.00	1.43
10	600886	国投电力	815,205.00	1.32
11	601825	沪农商行	803,280.00	1.30
12	605368	蓝天燃气	798,157.00	1.29
13	000933	神火股份	735,733.00	1.19
14	600188	兖矿能源	665,761.00	1.08
15	601918	新集能源	647,849.00	1.05
16	601009	南京银行	645,626.00	1.05
17	003816	中国广核	641,200.00	1.04
18	601899	紫金矿业	636,391.00	1.03
19	600795	国电电力	628,650.00	1.02
20	000921	海信家电	608,892.00	0.99

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	600938	中国海油	1,105,843.00	1.79
2	603556	海兴电力	1,100,110.00	1.78
3	601985	中国核电	1,019,740.00	1.65
4	600642	申能股份	899,050.00	1.46
5	600886	国投电力	895,776.00	1.45
6	600188	兖矿能源	850,465.00	1.38
7	600795	国电电力	849,250.00	1.37
8	600985	淮北矿业	848,641.00	1.37
9	601225	陕西煤业	839,765.00	1.36
10	000933	神火股份	739,740.00	1.20
11	601918	新集能源	693,269.00	1.12
12	600674	川投能源	688,032.00	1.11
13	605368	蓝天燃气	671,702.00	1.09
14	601088	中国神华	670,411.00	1.09
15	601899	紫金矿业	650,859.00	1.05
16	000921	海信家电	645,133.00	1.04
17	601825	沪农商行	641,806.00	1.04
18	600023	浙能电力	621,580.00	1.01
19	600025	华能水电	599,056.00	0.97
20	601699	潞安环能	552,657.00	0.89

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	51,679,989.23
卖出股票收入（成交）总额	52,782,825.99

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	16,811,862.86	31.42
2	央行票据	-	-
3	金融债券	14,207,327.77	26.55
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	4,045,229.15	7.56
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	10,030,316.01	18.74
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-

10	合计	45,094,735.79	84.27
----	----	---------------	-------

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	019727	23 国债 24	60,000	6,109,142.47	11.42
2	019729	23 国债 26	40,000	4,155,626.30	7.77
3	232480020	24 兴业银行二级资本债 01	40,000	4,054,767.12	7.58
4	115272	23 海通 07	40,000	4,045,229.15	7.56
5	2128039	21 中国银行二级 03	30,000	3,171,122.95	5.93

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持有国债期货。

7.10.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

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，发行主体海通证券股份有限公司于 2024 年 2 月 1 日收到中国证券监督管理委员会上海监管局关于对海通证券股份有限公司采取责令处分有关人员措施的决定（沪证监决〔2024〕37 号），经查，公司存在以下情形：场外期权业务相关内部控制不健全，未建立健全覆盖场外期权业务各环节的内部管理制度；未明确部门层级风险指标超限的报告路径和处理办法；场外衍生品业务相关风险指标体系不健全。根据《证券公司监督管理条例》（国务院令 第 653 号）第七十条第一款第三项、《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法》第三十二条第二款的规定，中国证券监督管理委员会上海监管局责令海通证券在收到决定之日起 10 个工作日内，根据公司内部管理规定，作出处分相关人员的决定，并在作出决定之日起 3 个工

作日之内向中国证券监督管理委员会上海监管局书面报告。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体海通证券股份有限公司于 2024 年 4 月 12 日收到中国证券监督管理委员会《立案告知书》（证监立案字 03720240050 号），因公司在相关主体违反限制性规定转让中核钛白 2023 年非公开发行股票过程中涉嫌违法违规，根据《中华人民共和国证券法》《中华人民共和国行政处罚法》等法律法规，中国证监会决定于 2024 年 3 月 13 日对海通证券股份有限公司进行立案。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体海通证券股份有限公司于 2024 年 4 月 19 日收到中国证券监督管理委员会《行政处罚事先告知书》（处罚字〔2024〕56 号），于 2024 年 4 月 30 日收到《中国证监会行政处罚决定书（王泽龙、洪浩炜、中信中证、中信证券、海通证券、韩雨辰）》（〔2024〕45 号），经查，海通证券存在以自己名义按照中信中证的报价指令认购中核钛白非公开发行股票，客观上帮助中信中证及其客户取得股票收益，使得定增套利行为得以实现的行为，依据《证券法》第一百八十六条及第一百九十七条第二款的规定，对海通证券股份有限公司违反限制性规定转让股票的违法行为，责令改正，给予警告，没收违法所得 789,445.21 元，并处以 6,975,000 元罚款。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体海通证券股份有限公司于 2024 年 4 月 29 日收到中国证券监督管理委员会上海监管局《关于对海通证券股份有限公司采取责令改正措施的决定》沪证监决〔2024〕180 号，经查，海通证券存在以下情形：一、未审慎评估个别股票质押合约标的证券的风险，股票质押业务风险管理不审慎，未审慎评估个别股票质押合约融资资金用途，不符合《证券公司股票质押式回购交易业务风险管理指引（试行）》（中证协发〔2015〕54 号）第十四条第三项、第五项，《证券公司参与股票质押式回购交易风险管理指引》（中证协发〔2018〕13 号）第五条、第三十五条的规定；二、未审慎开展收益互换业务，不符合《证券公司收益互换业务管理办法》（中证协发〔2021〕276 号）第三条的规定；与个别风险管理需求不足的客户开展场外期权业务，不符合《证券公司场外期权业务管理办法》（中证协发〔2020〕104 号）第四条的规定；三、个别风险债券投资内部控制程序不健全，不符合《证券公司内部控制指引》（证监机构字〔2003〕260 号）第七条第一项的规定；四、另类投资子公司投资的个别私募基金实际投资标的超出另类投资子公司业务范围，不符合《证券公司另类投资子公司管理规范》（中证协发〔2016〕253 号）第二条的规定。上述情形违反了《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法》（证监会令第 133 号）第六条、《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法》（证监会令第 166 号修正）第六条的规定。根据《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法》（证监会令第 133 号）第三十二条第一款、《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法》（证监会令第 166

号修正)第三十二条第一款的规定,中国证券监督管理委员会上海监管局决定对海通证券股份有限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,发行主体海通证券股份有限公司于 2024 年 4 月 12 日收到中国证券监督管理委员会广东监管局关于对海通证券股份有限公司采取责令改正监管措施的决定(2024)36 号,经查,海通证券股份有限公司作为格力地产股份有限公司债券“21 格地 02”“22 格地 02”的主承销商和受托管理人,未对个别存货周边楼盘开盘价格低于项目楼面价的情况予以审慎分析核查;在“22 格地 02”期后事项核查中,未对存货可变现净值的评估进行持续关注 and 尽职调查;未制作咨询审计机构工作底稿;未对发行人重大损失披露临时受托管理事务报告;对发行人差错更正事项披露临时受托管理事务报告不及时,不符合《公司债券承销业务尽职调查指引(2020 年)》第三条、第五条、第十一条、第二十一条,《证券公司投资银行类业务内部控制指引(证监会公告(2018)6 号)》第六十三条,《公司债券受托管理人执业行为准则(2022 年)》第十二条、第十八条等要求,违反了《公司债券发行与交易管理办法》(证监会令第 113 号)第七条、《公司债券发行与交易管理办法》(证监会令第 180 号)第六条第一款的规定。根据《公司债券发行与交易管理办法》(证监会令第 113 号)第五十八条、《公司债券发行与交易管理办法》(证监会令第 180 号)第六十八条的规定,中国证券监督管理委员会广东监管局决定对海通证券股份有限公司采取责令改正的行政监管措施。

报告期内本基金投资的前十名证券中,发行主体中国银行股份有限公司于 2023 年 12 月 28 日收到国家金融监督管理总局行政处罚信息公开表(金罚决字(2023)68 号),经查,中国银行股份有限公司存在以下情况:一、部分重要信息系统识别不全面,灾备建设和灾难恢复能力不符合监管要求;二、重要信息系统投产及变更未向监管部门报告,且投产及变更长期不规范引发重要信息系统较大及以上突发事件;三、信息系统运行风险识别不到位、处置不及时,引发重要信息系统重大突发事件;四、监管意见整改落实不到位,引发重要信息系统重大突发事件;五、信息科技外包管理不审慎;六、网络安全域未开展安全评估,网络架构重大变更未开展风险评估且未向监管部门报告;七、信息系统突发事件定级不准确,导致未按监管要求上报;八、迟报重要信息系统重大突发事件;九、错报漏报监管标准化(EAST)数据。综上,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,国家金融监督管理总局决定对中国银行处以罚款 430 万元。

报告期内本基金投资的前十名证券中,发行主体恒丰银行股份有限公司于 2023 年 7 月 5 日收到中国证券监督管理委员会山东监管局关于对恒丰银行股份有限公司采取责令改正监管措施的决定,经查,恒丰银行股份有限公司存在以下问题:一、负责基金销售业务的部门取得基金从业资

格的人员低于该部门员工人数的 1/2，部门负责人未取得基金从业资格；二、部分从事基金销售信息管理平台运营维护人员和合规风控人员未取得基金从业资格；三、部分未取得基金从业资格人员参与基金销售活动。综上，根据《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》第五十三条的规定，中国证券监督管理委员会山东监管局决定对恒丰银行采取责令改正的行政监督管理措施。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体中国民生银行股份有限公司于 2023 年 8 月 2 日收到国家金融监督管理总局行政处罚信息公开表（金罚决字〔2023〕7 号），经查，中国民生银行股份有限公司存在以下行为：一、规避委托贷款监管，违规利用委托债权投资业务向企业融资；二、违规贷款未整改收回情况下继续违规发放贷款；三、对政府平台公司融资行为监控不力，导致政府债务增加；四、股权质押管理问题未整改五、审计人员配备不足问题未整改；六、对相关案件未按照有关规定处置；七、未按监管要求将福费廷业务纳入表内核算；八、代销池业务模式整改不到位；九、违规开展综合财富管理代销业务整改不到位；十、个别贷款风险分类结果仍存在偏离，整改不到位；十一、发放违反国家宏观调控政策贷款仍未整改收回；十二、部分正常资产转让问题整改不到位；十三、部分不良资产转让问题整改不到位或未整改；十四、对部分违规问题未进行责任追究或追究不到位。综上，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，国家金融监督管理总局决定对民生银行处以罚款合计 4780 万元。其中，总行 4430 万元，分支机构 350 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

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。

7.11.3 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	15,264.80
2	应收清算款	-

3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,308.14
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,572.94

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	132026	G 三峡 EB2	2,071,305.21	3.87
2	113052	兴业转债	1,082,176.71	2.02
3	113056	重银转债	976,132.60	1.82
4	110059	浦发转债	661,652.22	1.24
5	113021	中信转债	590,766.44	1.10
6	113065	齐鲁转债	569,988.08	1.07
7	113046	金田转债	520,660.27	0.97
8	113044	大秦转债	444,980.85	0.83
9	113062	常银转债	428,236.79	0.80
10	113050	南银转债	401,318.66	0.75
11	113584	家悦转债	371,709.01	0.69
12	110075	南航转债	309,960.34	0.58
13	110083	苏租转债	288,328.66	0.54
14	113055	成银转债	251,888.22	0.47
15	113054	绿动转债	200,707.83	0.38
16	110079	杭银转债	181,150.85	0.34
17	113641	华友转债	172,493.92	0.32
18	127067	恒逸转 2	126,668.22	0.24
19	123113	仙乐转债	110,000.00	0.21
20	113037	紫银转债	109,803.21	0.21
21	113644	艾迪转债	107,658.77	0.20
22	123215	铭利转债	52,729.15	0.10

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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 (%)
长信先优债券 A	13,271	3,024.04	30,677,141.55	76.44	9,454,890.25	23.56
长信先优债券 C	42	236,767.53	9,742,790.34	97.97	201,446.06	2.03
合计	13,313	3,761.46	40,419,931.89	80.72	9,656,336.31	19.28

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	长信先优债券 A	29,067.27	0.07
	长信先优债券 C	910.11	0.01
	合计	29,977.38	0.06

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	长信先优债券 A	0
	长信先优债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	长信先优债券 A	0~10
	长信先优债券 C	0
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长信先优债券 A	长信先优债券 C
基金合同生效日 (2017 年 8 月 1 日) 基金份额总额	200,118,348.27	-
本报告期期初基金份额总额	45,125,268.67	14,627,644.08
本报告期基金总申购份额	94,994.85	1,711,609.32

减：本报告期基金总赎回份额	5,088,231.72	6,395,017.00
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	40,132,031.80	9,944,236.40

§ 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

本报告期基金管理人未发生重大人事变动。

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

本报告期本基金未更换会计师事务所。

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

10.6.1 管理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。

10.6.2 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托管人及高级管理人员受稽查或处罚等情形。

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 (%)	
天风证券	1	73,598,613.13	70.86	40,175.89	58.39	-
宏源证券	2	30,268,746.08	29.14	28,630.96	41.61	-

安信证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	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华鑫证券交易单元 1 个。

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(%)
天风证券	164,153,709.02	94.21	28,370,000.00	100.00	-	-
宏源证券	10,095,660.52	5.79	-	-	-	-

安信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长信基金管理有限责任公司关于提醒投资者防范不法分子假冒本公司工作人员名义从事诈骗活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2024-1-19
2	长信先优债券型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2024-1-22
3	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2023 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	2024-1-22
4	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金持有的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	2024-2-6
5	长信基金管理有限责任公司关于增加华西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	2024-3-6
6	长信先优债券型证券投资基金 2023 年年度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2024-3-29
7	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2023 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	2024-3-29
8	长信基金管理有限责任公司关于增加中航证券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	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2024-4-1

	告		
9	长信先优债券型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2024-4-22
10	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2024 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	2024-4-22
11	长信基金管理有限责任公司关于住所变更的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2024-6-15
12	长信基金管理有限责任公司关于暂停海银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	2024-6-15
13	长信基金管理有限责任公司关于增加德邦证券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	2024-6-20
14	长信基金管理有限责任公司关于增加麦高证券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	2024-6-24
15	长信基金管理有限责任公司关于增加信达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	2024-6-25
16	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汉口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	2024-6-26
17	长信先优债券型证券投资基金更新的招募说明书（2024 年第【1】号）及基金产品资料概要（更新）	中国证监会电子披露网站、公司网站	2024-6-28

§ 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	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6	26,117,882.64	0.00	0.00	26,117,882.64	52.16

		月 30 日				
产品特有风险						
<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</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、《长信先优债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长信先优债券型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《长信先优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：<https://www.cxfund.com.cn>。

长信基金管理有限责任公司

2024 年 8 月 30 日