

长信添利安心收益混合型证券投资基金 2021 年第 2 季度报告

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：中国民生银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 7 月 21 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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金基金合同的规定，于 2021 年 7 月 19 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 2021 年 4 月 1 日起至 2021 年 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长信添利安心收益混合
基金主代码	010199
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 10 月 19 日
报告期末基金份额总额	828,756,073.16 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。本基金可投资香港联合交易所上市的股票，将面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。
基金管理人	长信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国民生银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	长信添利安心收益混合 长信添利安心收益混

	A	合 C
下属分级基金的交易代码	010199	010200
报告期末下属分级基金的份额总额	809,326,196.06 份	19,429,877.10 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（2021年4月1日—2021年6月30日）	
	长信添利安心收益混合 A	长信添利安心收益混合 C
1. 本期已实现收益	141,263.82	-16,319.33
2. 本期利润	-4,118,093.93	-120,255.40
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0051	-0.0061
4. 期末基金资产净值	816,996,871.29	19,597,267.37
5. 期末基金份额净值	1.0095	1.0086

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

长信添利安心收益混合 A

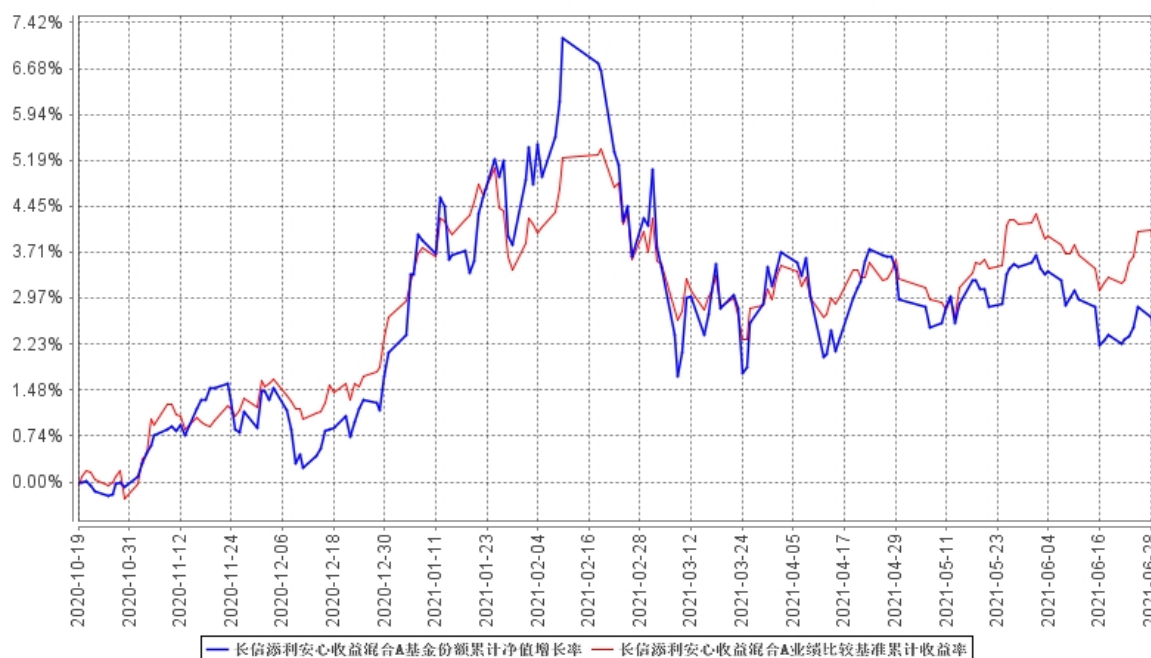
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-0.51%	0.28%	0.91%	0.21%	-1.42%	0.07%
过去六个月	0.55%	0.47%	1.18%	0.29%	-0.63%	0.18%
自基金合同生效起至今	2.65%	0.41%	3.87%	0.26%	-1.22%	0.15%

长信添利安心收益混合 C

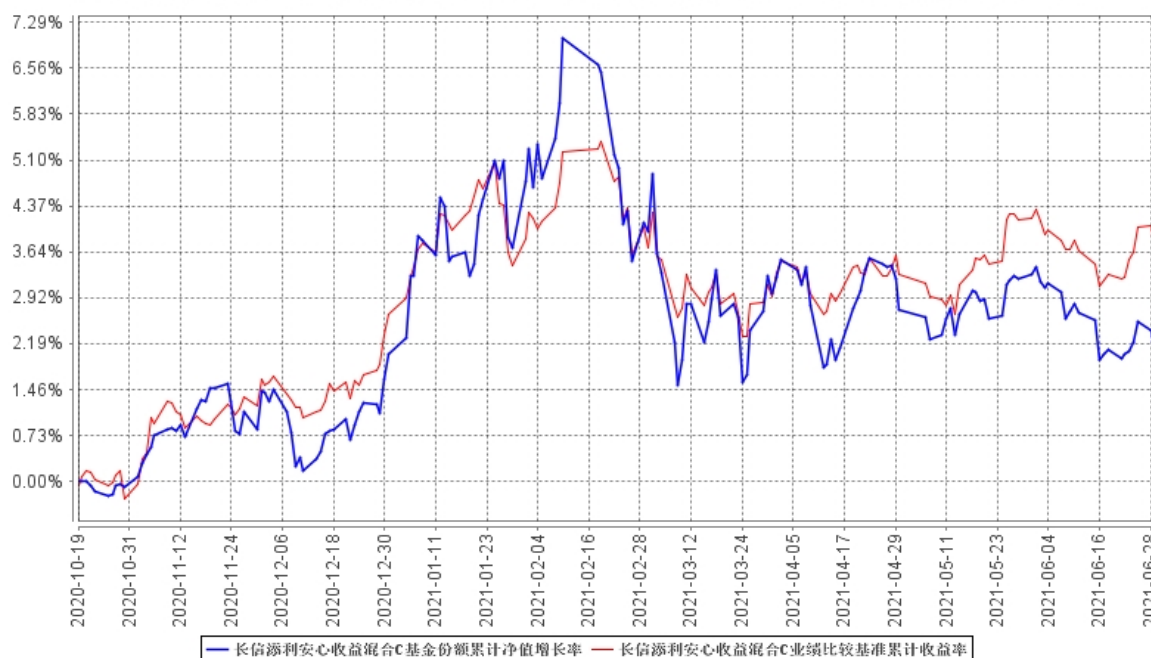
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-0.60%	0.28%	0.91%	0.21%	-1.51%	0.07%
过去六个月	0.33%	0.47%	1.18%	0.29%	-0.85%	0.18%
自基金合同生效起至今	2.36%	0.41%	3.87%	0.26%	-1.51%	0.15%

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

长信添利安心收益混合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



长信添利安心收益混合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 10 月 19 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 10 月 19 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，报告期末已完成建仓但报告期末距建仓结束不满一年，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		
朱垚	长信先优债券型证券投资基金、长信乐信灵活配置混合型证券投资基金、长信利发债券型证券投资基金、长信合利混合型证券投资基金和长信添利安心收益混合型证券投资基金的基金经理。	2020 年 10 月 19 日	-	8 年	复旦大学金融学专业硕士毕业。具有基金从业资格，2013 年加入长信基金管理有限责任公司，曾任长信基金管理有限责任公司研究发展部基金经理助理兼研究员，现任长信先优债券型证券投资基金、长信乐信灵活配置混合型证券投资基金、长信利发债券型证券投资基金、长信合利混合型证券投资基金和长信添利安心收益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遵规守信情况的说明

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

国内流动性保持充裕，国内 A 股迎来了反弹，尤其是中小市值和新兴成长板块。2021 年第二季度整体上经济延续复苏趋势，但外部宏观环境不确定性仍然较大。报告期内，本基金坚持自下而上选股，强调风险收益比，减持了部分低于预期的个股以及估值较高的个股。

债券方面，报告期内货币市场维持中性略宽松格局，债券收益率震荡下行，略超预期，久期策略优于票息策略。本基金纯债部分减持了部分信用债，增配了利率债和高等级 AAA 信用债，增加了组合久期，纯债市场整体对基本面数据有所钝化，后续组合仍会对经济高频数据保持关注。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 6 月 30 日，长信添利安心收益混合 A 份额净值为 1.0095 元，份额累计净值为 1.0265 元，本报告期内长信添利安心收益混合 A 净值增长率为-0.51%；长信添利安心收益混合 C 份额净值为 1.0086 元，份额累计净值为 1.0236 元，本报告期内长信添利安心收益混合 C 净值增长率为-0.60%，同期业绩比较基准收益率为 0.91%。

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	178,994,862.42	21.36
	其中：股票	178,994,862.42	21.36
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	614,672,694.80	73.37
	其中：债券	614,672,694.80	73.37
	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	23,000,000.00	2.75
	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	9,165,529.72	1.09
8	其他资产	11,980,224.58	1.43
9	合计	837,813,311.52	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。

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	5,850.78	0.00
B	采矿业	16,521,000.00	1.97
C	制造业	122,178,658.01	14.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,662.00	0.00
E	建筑业	25,371.37	0.00
F	批发和零售业	10,577,204.58	1.26
G	交通运输、仓储和邮政业	29,306,390.00	3.50
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	192,663.65	0.02
J	金融业	97,319.40	0.01
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	49,470.30	0.01
M	科学研究和技术服务业	-	-

N	水利、环境和公共设施管理业	36,272.33	0.00
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	178,994,862.42	21.40

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未通过港股通交易机制投资港股。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 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	002415	海康威视	500,000	32,250,000.00	3.85
2	000661	长春高新	57,000	22,059,000.00	2.64
3	603128	华贸物流	1,500,000	21,135,000.00	2.53
4	600519	贵州茅台	10,000	20,567,000.00	2.46
5	600660	福耀玻璃	359,937	20,102,481.45	2.40
6	002372	伟星新材	700,000	13,545,000.00	1.62
7	601225	陕西煤业	900,000	10,665,000.00	1.27
8	002311	海大集团	110,000	8,976,000.00	1.07
9	002352	顺丰控股	120,700	8,171,390.00	0.98
10	002727	一心堂	210,000	6,953,100.00	0.83

5.3.2 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的全国中小企业股份转让系统挂牌股票投资明细

注：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。

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	69,377,000.00	8.29
2	央行票据	-	-
3	金融债券	302,449,000.00	36.15
	其中：政策性金融债	60,374,000.00	7.22
4	企业债券	70,280,000.00	8.40
5	企业短期融资券	110,238,000.00	13.18
6	中期票据	61,309,000.00	7.33

7	可转债（可交换债）	1,019,694.80	0.12
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	614,672,694.80	73.47

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	2128003	21 建设银行小微债	600,000	60,372,000.00	7.22
2	2028054	20 华夏银行	500,000	50,595,000.00	6.05
3	2028046	20 招商银行小微债 01	500,000	50,555,000.00	6.04
4	2128013	21 交通银行小微债	500,000	50,310,000.00	6.01
5	012100793	21 河北高速 SCP002	400,000	40,076,000.00	4.79

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

发行主体中国建设银行股份有限公司于 2020 年 7 月 13 日收到中国银行保险监督管理委员会行政处罚决定书文号:银保监罚决字(2020)32 号,根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条第(五)项的规定和相关审慎经营规则,经查,中国建设银行股份有限公司内控管理不到位,支行原负责人擅自为同业投资违规提供担保并发生案件;理财资金违规投资房地产,用于缴交或置换土地出让金及提供土地储备融资;逆流程开展业务操作;本行理财产品之间风险隔离不到位;未做到理财业务与自营业务风险隔离;个人理财资金违规投资;违规为理财产品提供隐性担保;同业投资违规接受担保。综上,中国银行保险监督管理委员会决定对中国建设银行股份有限公司罚款合计 3920 万元。

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。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体华夏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）19 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、第四十七条和相关审慎经营规则，经查，华夏银行股份有限公司存在一、违规使用自营资金、理财资金购买本行转让的信贷资产；二、贷前审查及贷后管理不严；三、同业投资投前审查、投后管理不严；四、通过同业投资向企业提供融资用于收购银行股权；五、违规向土地储备项目提供融资；六、违规开立同业账户；七、通过投资底层资产为本行信贷资产的信托计划，少计风险资产；八、同业资金协助他行增加一般性存款，且部分期限超过监管要求；九、会计核算不准确，将同业存款计入一般性存款；十、部分理财产品相互交易、风险隔离不到位；十一、违规销售无真实投资、无测算依据、无充分信息披露的理财产品；十二、策略保本型理财产品销售文件未充分揭示风险；十三、出具的理财投资清单与事实不符或未全面反映真实风险；十四、理财资金违规投资权益类资产；十五、理财资金违规投资信托次级类高风险资产；十六、理财资金投资非标准化债权资产超过监管要求；十七、非标资产非洁净转让；十八、自营业务与代客业务未有效分离；十九、部分理财产品信息披露不合规，对接本行信贷资产；二十、部分理财资金违规投向土地储备项目；二十一、部分理财资金投向不符合政府购买服务规定的项目；二十二、部分理财投资投前调查不尽职；二十三、委托贷款资金来源不合规；二十四、与未备案理财投资合作机构开展业务；二十五、漏报错报监管标准化数据且逾期未改正；二十六、提供与事实不符的材料；二十七、部分理财资金未托管。综上，中国银行保险监督管理委员会给予公司罚款 9830 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。

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	297,515.94
2	应收证券清算款	3,336,647.95
3	应收股利	-
4	应收利息	8,346,060.69
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	11,980,224.58

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	002372	伟星新材	13,545,000.00	1.62	新股受限

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	长信添利安心收益混合 A	长信添利安心收益混合 C
报告期期初基金份额总额	822,629,317.99	19,779,520.34
报告期期间基金总申购份额	6,701,879.07	-
减：报告期期间基金总赎回份额	20,005,001.00	349,643.24
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	809,326,196.06	19,429,877.10

§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

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 4 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	179,032,225.98	3,014,309.04	0.00	182,046,535.02	21.97%
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。

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、《长信添利安心收益混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长信添利安心收益混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《长信添利安心收益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：<https://www.cxfund.com.cn>。

长信基金管理有限责任公司

2021 年 7 月 21 日