

长信稳益纯债债券型证券投资基金 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：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金基金合同规定，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

| | |
|--|-----------|
| §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 | 6 |
| 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 |
| §3 主要财务指标和基金净值表现 | 8 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 8 |
| 3.2 基金净值表现..... | 8 |
| §4 管理人报告 | 10 |
| 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..... | 13 |
| 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..... | 14 |
| 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..... | 15 |
| §5 托管人报告 | 16 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... | 16 |
| 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..... | 16 |
| 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..... | 16 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计） | 17 |
| 6.1 资产负债表..... | 17 |
| 6.2 利润表..... | 18 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表..... | 19 |

| | |
|--|-----------|
| 6.4 报表附注..... | 20 |
| §7 投资组合报告..... | 40 |
| 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..... | 40 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 40 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 41 |
| 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..... | 42 |
| 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..... | 42 |
| 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 42 |
| 7.11 投资组合报告附注..... | 42 |
| §8 基金份额持有人信息..... | 44 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 44 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 44 |
| 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..... | 44 |
| §9 开放式基金份额变动..... | 45 |
| §10 重大事件揭示..... | 46 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 46 |
| 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..... | 46 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 46 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 46 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 46 |
| 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..... | 46 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 46 |
| 10.8 其他重大事件..... | 49 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息..... | 51 |
| 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..... | 51 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息..... | 51 |

| | |
|-------------------------|-----------|
| §12 备查文件目录 | 52 |
| 12.1 备查文件目录..... | 52 |
| 12.2 存放地点..... | 52 |
| 12.3 查阅方式..... | 52 |

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|--------------------|
| 基金名称 | 长信稳益纯债债券型证券投资基金 |
| 基金简称 | 长信稳益纯债债券 |
| 基金主代码 | 003349 |
| 交易代码 | 003349 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2016 年 10 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 | 交通银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 2,059,418,177.21 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|---|
| 投资目标 | 本基金通过投资于债券品种，力争实现长期超越业绩比较基准的投资回报。 |
| 投资策略 | 本基金将在基金合同约定的投资范围内，通过对宏观经济运行状况、国家货币政策和财政政策、国家产业政策及资本市场资金环境的研究，积极把握宏观经济发展趋势、利率走势、债券市场相对收益率、券种的流动性以及信用水平，优化固定收益类金融工具的资产比例配置。在有效控制风险的基础上，适时调整组合久期，以获得基金资产的稳定增值，提高基金总体收益率。 |
| 业绩比较基准 | 中债综合指数收益率 |
| 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 | 交通银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 周永刚 | 陆志俊 |
| | 联系电话 | 021-61009999 | 95559 |
| | 电子邮箱 | zhouyg@cxfund.com.cn | luzj@bankcomm.com |
| 客户服务电话 | | 4007005566 | 95559 |
| 传真 | | 021-61009800 | 021-62701216 |
| 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）自由贸易试验区银城中路 188 号 |
| 办公地址 | | 上海市浦东新区银城中路 68 | 中国（上海）长宁区仙霞路 18 |

| | | |
|-------|--------|--------|
| | 号 9 楼 | 号 |
| 邮政编码 | 200120 | 200336 |
| 法定代表人 | 刘元瑞 | 任德奇 |

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, 上海市仙霞路 18 号 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|--------------|----------------------|
| 注册登记机构 | 长信基金管理有限责任公司 | 上海市浦东新区银城中路 68 号 9 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(2021年1月1日 - 2021年6月30日) |
|---------------|-----------------------------|
| 本期已实现收益 | 27,668,923.97 |
| 本期利润 | 31,862,359.91 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0172 |
| 本期加权平均净值利润率 | 1.61% |
| 本期基金份额净值增长率 | 1.62% |
| 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 | 140,092,003.45 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0680 |
| 期末基金资产净值 | 2,222,073,644.20 |
| 期末基金份额净值 | 1.0790 |
| 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 | 37.41% |

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。

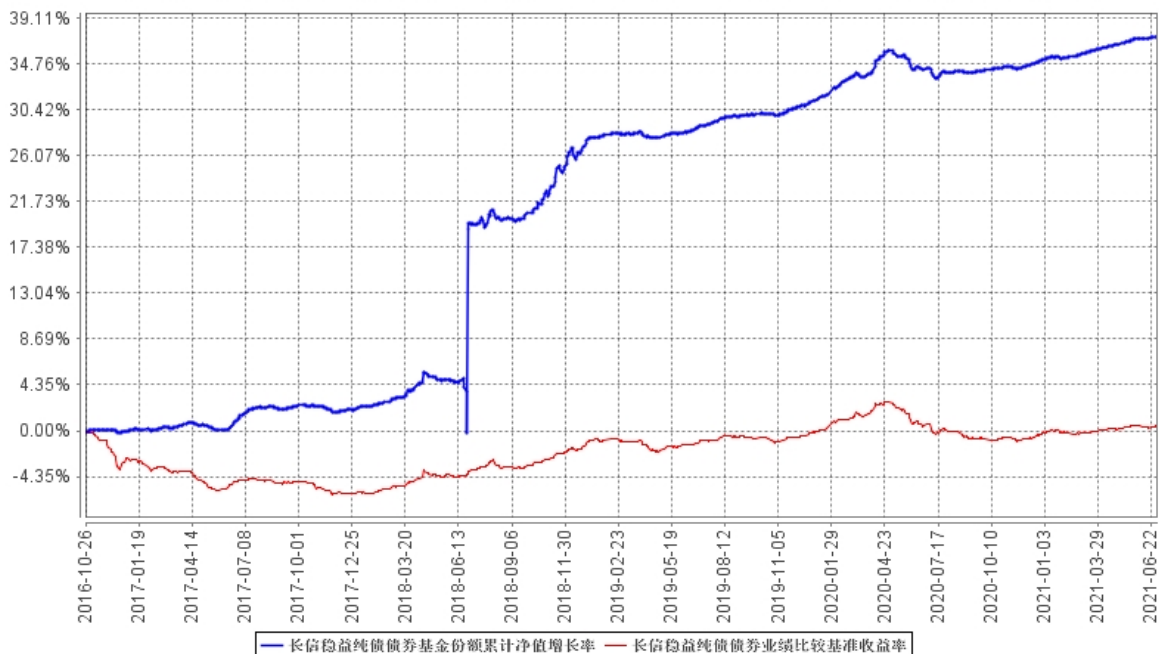
3.2 基金净值表现

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 | 0.17% | 0.01% | -0.04% | 0.03% | 0.21% | -0.02% |
| 过去三个月 | 0.88% | 0.01% | 0.45% | 0.03% | 0.43% | -0.02% |
| 过去六个月 | 1.62% | 0.02% | 0.65% | 0.04% | 0.97% | -0.02% |
| 过去一年 | 2.29% | 0.03% | -0.20% | 0.06% | 2.49% | -0.03% |
| 过去三年 | 14.83% | 0.08% | 4.53% | 0.07% | 10.30% | 0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 37.41% | 0.59% | 0.45% | 0.07% | 36.96% | 0.52% |

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

长信稳益纯债债券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 2016 年 10 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 | | |
| 张文琍 | 长信纯债壹号债券型证券投资基金、长信利鑫债券型证券投资基金（LOF）、长信富平纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信稳益纯债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、长信稳势纯债债券型证券投资基金和长信富全纯债一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理、固 | 2016 年 11 月 11 日 | - | 27 年 | 高级工商管理硕士，上海财经大学 EMBA 毕业，具有基金从业资格。曾任湖北证券公司交易一部交易员、长江证券有限责任公司资产管理事业部主管、债券事业总部投资部经理、固定收益总部交易部经理。2004 年 9 月加入长信基金管理有限责任公司，历任长信利息收益开放式证券投资基金交易员、基金经理助理、固定收益部副总监、长信中短债证券投资基金、长信利息收益开放式证券投资基金、长信长金通货币市场基金和长 |

| | | | | |
|--|--------|--|--|---|
| | 定收益部总监 | | | 信富民纯债一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理职务。现任固定收益部总监、长信纯债壹号债券型证券投资基金、长信利鑫债券型证券投资基金 (LOF)、长信富平纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信稳益纯债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、长信稳势纯债债券型证券投资基金和长信富全纯债一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理。 |
|--|--------|--|--|---|

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

2、证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

本基金将继续以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，努力为基金份额持有人谋求最大利益。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司已实行公平交易制度，并建立公平交易制度体系，已建立投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，公司已通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，除完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合外，其余各投资组合未发生参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形，未发现异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年以来，债券收益率走势整体维持窄幅震荡。一季度临近春节期间，受资金面趋紧影响，收益率上行幅度较大，10Y 国债收益率从 3.10% 上行至 3.27%，10Y 国开收益率从 3.50% 上行至 3.75%，随后逐步回落。二季度收益率呈现缓慢下行的走势。尽管经济基本面继续复苏、通胀上行，但由于上半年地方债发行节奏慢于市场预期，同时信用收缩，配置需求带动收益率下行。截止 6 月底，10Y 国债收益率再度下行至 3.10% 的低位，10Y 国开收益率下行至 3.50% 附近。低等级信用债品种下行幅度更大，信用利差被压缩至历史低位，出现机构在欠配压力下通过下沉风险偏好寻求收益的操作。

一季度，我们采用中等杠杆低久期操作，组合相对平稳；二季度，我们相应调整策略，增加了中长端利率债和信用债的仓位。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 6 月 30 日，长信稳益纯债债券份额净值为 1.0790 元，份额累计净值为 1.355 元，本报告期内长信稳益纯债债券净值增长率为 1.62%，同期业绩比较基准收益率为 0.65%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2021 年以来，发达经济体疫苗接种继续领先，海外新冠疫情先大幅恶化后持续好转，全球经济恢复的确定性进一步增强。我国经济整体呈现内需稳定、外需较强、房地产有韧性、生产旺盛的局面。一季度货币政策提出把好货币供应总闸门，社融和 M2 增速在二季度下行，政府降杠杆持续推进，广义信用扩张明显收紧，反映了货币政策的常态化回归加快推进。同时局部疫情时有发生，出口也已显示出走弱迹象，5 月金融稳定委员会明确表态政策不会急转弯，因而也难以大幅收紧。物价方面猪肉价格进入下行周期，CPI 涨幅有限，PPI 或随着供需关系缓解见顶回落，基本面对债券市场的利空在逐步解除。预计三季度政策仍以稳为主，政策利率预计继续保持不变。在此背景下，后续债券收益率预计维持震荡走势的概率较高，投资操作上将择机选择交易。

我们将继续秉承谨慎原则，加强组合的流动性管理，加大对信用风险的审慎判断。适度调整组合久期，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，争取在流动安全的前提下，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、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，本基金本报告期末未进行利润分配。

本基金收益分配原则如下：

1、本基金在符合基金法定分红条件的前提下可进行收益分配，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

2021 年上半年度，基金托管人在长信稳益纯债债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2021 年上半年度，长信基金管理有限责任公司在长信稳益纯债债券型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

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

2021 年上半年度，由长信基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关长信稳益纯债债券型证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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：长信稳益纯债债券型证券投资基金

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 |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.6.1 | 7,569,868.70 | 1,384,511.39 |
| 结算备付金 | | - | 2,382.28 |
| 存出保证金 | | 5,393.32 | 4,686.65 |
| 交易性金融资产 | 6.4.6.2 | 2,643,902,700.00 | 2,214,529,025.00 |
| 其中：股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 2,623,871,700.00 | 2,184,510,025.00 |
| 资产支持证券投资 | | 20,031,000.00 | 30,019,000.00 |
| 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 | - | 10,000,135.00 |
| 应收证券清算款 | | - | - |
| 应收利息 | 6.4.6.5 | 30,053,539.18 | 29,820,649.20 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 200,025,870.35 | 33,210.06 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.6.6 | - | - |
| 资产总计 | | 2,881,557,371.55 | 2,255,774,599.58 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2021 年 6 月 30 日 | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 |
| 负债： | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.6.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | 658,094,052.86 | 181,634,407.54 |
| 应付证券清算款 | | - | - |
| 应付赎回款 | | 3,684.97 | 1,158.89 |
| 应付管理人报酬 | | 830,413.55 | 767,570.02 |
| 应付托管费 | | 166,082.71 | 153,513.99 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 6.4.6.7 | 41,363.63 | 19,165.86 |
| 应交税费 | | 168,232.83 | 72,419.03 |

| | | | |
|---------------|----------|------------------|------------------|
| 应付利息 | | 81,635.97 | 30,427.58 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.6.8 | 98,260.83 | 189,000.30 |
| 负债合计 | | 659,483,727.35 | 182,867,663.21 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 6.4.6.9 | 2,059,418,177.21 | 1,952,337,690.16 |
| 未分配利润 | 6.4.6.10 | 162,655,466.99 | 120,569,246.21 |
| 所有者权益合计 | | 2,222,073,644.20 | 2,072,906,936.37 |
| 负债和所有者权益总计 | | 2,881,557,371.55 | 2,255,774,599.58 |

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0790 元，基金份额总额 2,059,418,177.21 份。

6.2 利润表

会计主体：长信稳益纯债债券型证券投资基金

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 |
|-----------------------|------------|--|---|
| 一、收入 | | 40,047,450.56 | 49,424,246.55 |
| 1.利息收入 | | 34,400,806.90 | 37,107,543.90 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.6.11 | 45,436.67 | 134,464.97 |
| 债券利息收入 | | 33,329,101.90 | 36,562,508.65 |
| 资产支持证券利息收入 | | 376,034.35 | 143,677.86 |
| 买入返售金融资产收入 | | 650,233.98 | 266,892.42 |
| 证券出借利息收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 1,389,425.74 | 10,536,624.41 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.6.12 | - | - |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.6.13 | 1,389,425.74 | 10,536,624.41 |
| 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 | - | - |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.6.17 | 4,193,435.94 | 1,721,617.01 |
| 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 | 63,781.98 | 58,461.23 |

| | | | |
|----------------------------|-----------|---------------|---------------|
| 减：二、费用 | | 8,185,090.65 | 9,449,372.70 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.9.2.1 | 4,911,041.44 | 4,333,387.31 |
| 2. 托管费 | 6.4.9.2.2 | 982,208.33 | 866,677.50 |
| 3. 销售服务费 | | - | - |
| 4. 交易费用 | 6.4.6.19 | 41,442.76 | 20,374.10 |
| 5. 利息支出 | | 2,032,907.07 | 4,024,450.23 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 2,032,907.07 | 4,024,450.23 |
| 6. 税金及附加 | | 90,916.89 | 88,606.08 |
| 7. 其他费用 | 6.4.6.20 | 126,574.16 | 115,877.48 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 31,862,359.91 | 39,974,873.85 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 31,862,359.91 | 39,974,873.85 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长信稳益纯债债券型证券投资基金

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） | 1,952,337,690.16 | 120,569,246.21 | 2,072,906,936.37 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 31,862,359.91 | 31,862,359.91 |
| 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） | 107,080,487.05 | 10,223,860.87 | 117,304,347.92 |
| 其中：1. 基金申购款 | 356,384,864.83 | 26,020,562.45 | 382,405,427.28 |
| 2. 基金赎回款 | -249,304,377.78 | -15,796,701.58 | -265,101,079.36 |
| 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 | 2,059,418,177.21 | 162,655,466.99 | 2,222,073,644.20 |

日生效。本基金的基金管理人为长信基金管理有限责任公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

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《长信稳益纯债债券型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围主要为具有良好流动性的固定收益类品种，包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、中小企业私募债券、资产支持证券、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、债券回购、银行存款等法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金不投资于股票、权证等权益类资产，也不投资于可转换债券(可分离交易可转债的纯债部分除外)、可交换债券。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，其投资比例遵循届时有效的法律法规和相关规定。本基金的投资组合比例为：本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%；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)或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为：中债综合指数收益率。

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

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 | 7,569,868.70 |
| 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： | 7,569,868.70 |

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 | - | - | - |

| | | | |
|---------------|------------------|------------------|------------------|
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 38,117,092.11 | 38,138,000.00 |
| | 银行间市场 | 2,579,602,149.39 | 2,585,733,700.00 |
| | 合计 | 2,617,719,241.50 | 2,623,871,700.00 |
| 资产支持证券 | 20,000,000.00 | 20,031,000.00 | 31,000.00 |
| 基金 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 合计 | 2,637,719,241.50 | 2,643,902,700.00 | 6,183,458.50 |

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资产/负债。

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：本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

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 | 517.76 |
| 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 | - |
| 应收债券利息 | 29,667,949.67 |
| 应收资产支持证券利息 | 385,069.59 |
| 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 | 2.16 |
| 合计 | 30,053,539.18 |

注：其他为应收结算保证金的利息。

6.4.6.6 其他资产

注：本报告期末本基金未持有其他资产。

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 | - |
| 银行间市场应付交易费用 | 41,363.63 |
| 合计 | 41,363.63 |

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 | 0.68 |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 预提账户维护费 | 9,000.00 |
| 预提审计费 | 29,752.78 |
| 预提信息披露费 | 59,507.37 |
| 合计 | 98,260.83 |

注：应付赎回费中含应付转出费。

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 | 1,952,337,690.16 | 1,952,337,690.16 |
| 本期申购 | 356,384,864.83 | 356,384,864.83 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -249,304,377.78 | -249,304,377.78 |
| - 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 | 2,059,418,177.21 | 2,059,418,177.21 |

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 | 103,729,406.96 | 16,839,839.25 | 120,569,246.21 |

| | | | |
|----------------|----------------|---------------|----------------|
| 本期利润 | 27,668,923.97 | 4,193,435.94 | 31,862,359.91 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 8,693,672.52 | 1,530,188.35 | 10,223,860.87 |
| 其中：基金申购款 | 22,415,966.77 | 3,604,595.68 | 26,020,562.45 |
| 基金赎回款 | -13,722,294.25 | -2,074,407.33 | -15,796,701.58 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 140,092,003.45 | 22,563,463.54 | 162,655,466.99 |

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 | 36,961.91 |
| 定期存款利息收入 | - |
| 其他存款利息收入 | 6,689.81 |
| 结算备付金利息收入 | 1,784.95 |
| 其他 | - |
| 合计 | 45,436.67 |

注：“其他存款利息收入”项为存出保证金利息和申购款利息。

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

注：本基金本报告期无股票投资收益。

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 | 1,389,425.74 |
| 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 | 1,389,425.74 |

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 | 2,950,867,706.18 |

| | |
|-------------------------|------------------|
| 总额 | |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 2,906,554,005.95 |
| 减：应收利息总额 | 42,924,274.49 |
| 买卖债券差价收入 | 1,389,425.74 |

6.4.6.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期无债券赎回差价收入。

6.4.6.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无债券申购差价收入。

6.4.6.13.5 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年1月1日至2021年6月30日 |
|----------------|----------------------------|
| 卖出资产支持证券成交总额 | 10,225,000.00 |
| 减：卖出资产支持证券成本总额 | 10,000,000.00 |
| 减：应收利息总额 | 225,000.00 |
| 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：本基金本报告期无买卖权证差价收入。

6.4.6.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无其他衍生工具投资收益。

6.4.6.16 股利收益

注：本基金本报告期无股利收益。

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 | 4,193,435.94 |
| ——股票投资 | - |
| ——债券投资 | 4,181,435.94 |
| ——资产支持证券投资 | 12,000.00 |
| ——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 | 4,193,435.94 |

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 | 63,763.35 |
| 转换费收入 | 18.63 |
| 合计 | 63,781.98 |

注：赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，对持续持有期少于7日的投资者收取的赎回费将全额计入基金财产；对持续持有期不少于7日的投资者收取的赎回费，赎回费总额的25%应归基金财产。

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 | 80.01 |
| 银行间市场交易费用 | 41,362.75 |
| 交易基金产生的费用 | - |
| 其中：申购费 | - |
| 赎回费 | - |
| 合计 | 41,442.76 |

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 | 29,752.78 |
| 信息披露费 | 59,507.37 |
| 证券出借违约金 | - |
| 账户维护费 | 17,730.00 |
| 其他费用 | 19,584.01 |
| 合计 | 126,574.16 |

注：“其他费用”为划款手续费、转托管费用和上清所查询费。

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

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、注册登记机构、基金销售机构 |
| 交通银行股份有限公司(以下简称“交通银行”) | 基金托管人、基金销售机构 |
| 长江证券股份有限公司(以下简称“长江证券”) | 基金管理人的股东、基金销售机构 |

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

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

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 |
|------|---------------|------------------|----------------|------------------|
| 长江证券 | 78,556,369.54 | 100.00% | 186,230,391.55 | 82.72% |

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 |
| 长江证券 | 280,000,000.00 | 100.00% | 5,074,000,000.00 | 100.00% |

6.4.9.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.9.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无应付关联方交易单元的佣金。

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 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 |
|-----------------|--------------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 4,911,041.44 | 4,333,387.31 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 176,471.91 | 70,736.63 |

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×0.50%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：日基金管理费=前一日基金资产净值×0.50%÷当年天数。

6.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 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 |
|----------------|----------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 982,208.33 | 866,677.50 |

注：支付基金托管人交通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

6.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金在本报告期及上年度可比期间均未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

注：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。

6.4.9.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

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 | |
|-------|----------------------------|-----------|---------------------------------|-----------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 交通银行 | 7,569,868.70 | 36,961.91 | 1,129,742.28 | 54,012.39 |

注：本基金通过“交通银行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等结算账户，于2021年6月30日的相关余额为人民币0元(2020年6月30日：相关余额为人民币1,683,949.96元)。

6.4.9.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在本报告期及上年度可比期间均未在承销期内购入由关联方承销的证券。

6.4.9.8 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：本基金本报告期末未进行利润分配。

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**

| 6.4.11.1.2 受限证券类别：债券 | | | | | | | | | | |
|----------------------|--------------|------------|-----------|--------|--------|--------|----------|---------------|---------------|----|
| 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：张） | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| 012102383 | 21常州滨投SCP001 | 2021年6月30日 | 2021年7月1日 | 认购新发债券 | 100.00 | 100.00 | 200,000 | 20,000,000.00 | 20,000,000.00 | - |

6.4.11.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有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**

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 658,094,052.86 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

| 债券代码 | 债券名称 | 回购到期日 | 期末估值单价 | 数量（张） | 期末估值总额 |
|-----------|----------------|----------------|--------|---------|---------------|
| 190203 | 19 国开 03 | 2021 年 7 月 6 日 | 100.78 | 260,000 | 26,202,800.00 |
| 101901061 | 19 外高桥 MTN003 | 2021 年 7 月 7 日 | 101.04 | 200,000 | 20,208,000.00 |
| 102100672 | 21 广核电力 MTN001 | 2021 年 7 月 7 日 | 100.47 | 251,000 | 25,217,970.00 |

| | | | | | |
|-----------|-------------------|-------------------|--------|-----------|----------------|
| 091900018 | 19 华泰证券金 融债 01 | 2021 年 7 月 7 日 | 101.04 | 300,000 | 30,312,000.00 |
| 012004327 | 20 江宁经开 SCP005 | 2021 年 7 月 7 日 | 100.44 | 200,000 | 20,088,000.00 |
| 042000483 | 20 徐州交通 CP001 | 2021 年 7 月 7 日 | 100.58 | 200,000 | 20,116,000.00 |
| 210201 | 21 国开 01 | 2021 年 7 月 7 日 | 100.06 | 1,100,000 | 110,066,000.00 |
| 012100296 | 21 江苏港口 SCP001 | 2021 年 7 月 7 日 | 100.36 | 300,000 | 30,108,000.00 |
| 210202 | 21 国开 02 | 2021 年 7 月 6 日 | 100.09 | 1,000,000 | 100,090,000.00 |
| 101901088 | 19 成都环境 MTN001 | 2021 年 7 月 7 日 | 101.09 | 300,000 | 30,327,000.00 |
| 101900712 | 19 沪杭甬 MTN001 | 2021 年 7 月 7 日 | 100.81 | 200,000 | 20,162,000.00 |
| 210210 | 21 国开 10 | 2021 年 7 月 2 日 | 99.36 | 741,000 | 73,625,760.00 |
| 101800398 | 18 广州地铁 MTN002 | 2021 年 7 月 7 日 | 103.17 | 300,000 | 30,951,000.00 |
| 101800871 | 18 金隅 MTN003 | 2021 年 7 月 7 日 | 103.57 | 200,000 | 20,714,000.00 |
| 012100208 | 21 福州城投 SCP002 | 2021 年 7 月 7 日 | 100.28 | 300,000 | 30,084,000.00 |
| 101900298 | 19 金隅 MTN001 | 2021 年 7 月 7 日 | 102.46 | 210,000 | 21,516,600.00 |
| 190404 | 19 农发 04 | 2021 年 7 月 6 日 | 101.32 | 500,000 | 50,660,000.00 |
| 101900773 | 19 外高桥 MTN002 | 2021 年 7 月 7 日 | 100.78 | 300,000 | 30,234,000.00 |
| 091900022 | 19 海通证券金 融债 01 | 2021 年 7 月 7 日 | 100.96 | 300,000 | 30,288,000.00 |
| 012100834 | 21 大唐租赁 SCP001 | 2021 年 7 月 7 日 | 100.28 | 300,000 | 30,084,000.00 |
| 合计 | | | | 7,462,000 | 751,055,130.00 |

6.4.11.3.2 交易所市场债券正回购

注：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。

6.4.11.4 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。本基金的银行存款存放在本基金的托管人交通银行，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。

6.4.12.2.1 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 | 397,260,500.00 | 101,061,400.00 |
| A-1 以下 | 0.00 | 0.00 |
| 未评级 | 973,093,200.00 | 670,637,020.00 |
| 合计 | 1,370,353,700.00 | 771,698,420.00 |

注：未评级债券为国债、央行票据、政策性金融债及超短期融资券等无信用评级债券。

6.4.12.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

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 | 20,031,000.00 | 30,019,000.00 |
| A-1 以下 | 0.00 | 0.00 |
| 未评级 | 0.00 | 0.00 |
| 合计 | 20,031,000.00 | 30,019,000.00 |

注：短期信用评级 A-1 所填列的资产支持证券投资均为 AAA 级的短期资产支持证券。

6.4.12.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

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 | 0.00 | 276,097,000.00 |
| 合计 | 0.00 | 276,097,000.00 |

注：本基金持有同业存单的主体评级均为 AA+ 及以上评级。

6.4.12.2.4 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 2021 年 6 月 30 日 | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| AAA | 549,795,500.00 | 509,963,545.00 |
| AAA 以下 | 261,468,500.00 | 114,650,000.00 |
| 未评级 | 442,254,000.00 | 512,101,060.00 |
| 合计 | 1,253,518,000.00 | 1,136,714,605.00 |

注：未评级债券为国债、央行票据及政策性金融债等无信用评级债券。

6.4.12.2.5 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 | 7,569,868.70 | - | - | - | - | 7,569,868.70 |
| 存出保证 金 | 5,393.32 | - | - | - | - | 5,393.32 |
| 交易性金 融资产 | 741,857,000.00 | 863,195,200.00 | 777,580,500.00 | 261,270,000.00 | - | 2,643,902,700.00 |
| 应收利息 | - | - | - | - | 30,053,539.18 | 30,053,539.18 |
| 应收申购 款 | - | - | - | - | 200,025,870.35 | 200,025,870.35 |
| 资产总计 | 749,432,262.02 | 863,195,200.00 | 777,580,500.00 | 261,270,000.00 | 230,079,409.53 | 2,881,557,371.55 |
| 负债 | | | | | | |
| 卖出回购 金融资产 款 | 658,094,052.86 | - | - | - | - | 658,094,052.86 |
| 应付赎回 款 | - | - | - | - | 3,684.97 | 3,684.97 |
| 应付管理 人报酬 | - | - | - | - | 830,413.55 | 830,413.55 |
| 应付托管 费 | - | - | - | - | 166,082.71 | 166,082.71 |
| 应付交易 费用 | - | - | - | - | 41,363.63 | 41,363.63 |
| 应付利息 | - | - | - | - | 81,635.97 | 81,635.97 |
| 应交税费 | - | - | - | - | 168,232.83 | 168,232.83 |
| 其他负债 | - | - | - | - | 98,260.83 | 98,260.83 |
| 负债总计 | 658,094,052.86 | - | - | - | 1,389,674.49 | 659,483,727.35 |
| 利率敏感 度缺口 | 91,338,209.16 | 863,195,200.00 | 777,580,500.00 | 261,270,000.00 | 228,689,735.04 | 2,222,073,644.20 |
| 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 | 1,384,511.39 | - | - | - | - | 1,384,511.39 |
| 结算备付 金 | 2,382.28 | - | - | - | - | 2,382.28 |
| 存出保证 金 | 4,686.65 | - | - | - | - | 4,686.65 |
| 交易性金 | 939,948,660.00 | 371,069,400.00 | 690,237,965.00 | 213,273,000.00 | - | 2,214,529,025.00 |

| | | | | | | |
|-----------|----------------|----------------|----------------|----------------|---------------|------------------|
| 融资产 | | | | | | |
| 买入返售金融资产 | 10,000,135.00 | - | - | - | - | 10,000,135.00 |
| 应收利息 | - | - | - | - | 29,820,649.20 | 29,820,649.20 |
| 应收申购款 | - | - | - | - | 33,210.06 | 33,210.06 |
| 资产总计 | 951,340,375.32 | 371,069,400.00 | 690,237,965.00 | 213,273,000.00 | 29,853,859.26 | 2,255,774,599.58 |
| 负债 | | | | | | |
| 卖出回购金融资产款 | 181,634,407.54 | - | - | - | - | 181,634,407.54 |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | 1,158.89 | 1,158.89 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | 767,570.02 | 767,570.02 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | 153,513.99 | 153,513.99 |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | 19,165.86 | 19,165.86 |
| 应付利息 | - | - | - | - | 30,427.58 | 30,427.58 |
| 应交税费 | - | - | - | - | 72,419.03 | 72,419.03 |
| 其他负债 | - | - | - | - | 189,000.30 | 189,000.30 |
| 负债总计 | 181,634,407.54 | - | - | - | 1,233,255.67 | 182,867,663.21 |
| 利率敏感度缺口 | 769,705,967.78 | 371,069,400.00 | 690,237,965.00 | 213,273,000.00 | 28,620,603.59 | 2,072,906,936.37 |

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 | 11,741,807.16 | 10,165,138.68 |
| 市场利率上升 27 个基点 | -11,741,807.16 | -10,165,138.68 | |

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。

6.4.12.4.3 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 | 占基金资产净值比例 (%) | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
| 交易性金融资产—股票投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产—基金投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产—债券投资 | 2,623,871,700.00 | 118.08 | 2,184,510,025.00 | 105.38 |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | - | - | - | - |
| 衍生金融资产—权证投资 | - | - | - | - |
| 其他 | 20,031,000.00 | 0.90 | 30,019,000.00 | 1.45 |
| 合计 | 2,643,902,700.00 | 118.98 | 2,214,529,025.00 | 106.83 |

注：其他为资产支持证券投资。

6.4.12.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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

6.4.13 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二层次的余额为人民币 2,623,902,700.00 元，属于第三层次的余额为人民币 20,000,000.00 元，无属于第一层次的余额。

(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 0 元，本期变动人民币 20,000,000.00 元，本期末余额为人民币 20,000,000.00 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 | - | - |
| | 其中：股票 | - | - |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 2,643,902,700.00 | 91.75 |
| | 其中：债券 | 2,623,871,700.00 | 91.06 |
| | 资产支持证券 | 20,031,000.00 | 0.70 |
| 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 | 7,569,868.70 | 0.26 |
| 8 | 其他各项资产 | 230,084,802.85 | 7.98 |
| 9 | 合计 | 2,881,557,371.55 | 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。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

注：本基金本报告期末未持有股票。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：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

注：本基金本报告期末未持有股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：本基金本报告期内未买入股票。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：本基金本报告期内未卖出股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注：本基金本报告期内未投资股票。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|------------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | 91,224,000.00 | 4.11 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 652,876,000.00 | 29.38 |
| | 其中：政策性金融债 | 461,096,000.00 | 20.75 |
| 4 | 企业债券 | 53,396,500.00 | 2.40 |
| 5 | 企业短期融资券 | 1,250,269,700.00 | 56.27 |
| 6 | 中期票据 | 576,105,500.00 | 25.93 |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 2,623,871,700.00 | 118.08 |

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 | 210201 | 21 国开 01 | 1,100,000 | 110,066,000.00 | 4.95 |
| 2 | 210210 | 21 国开 10 | 1,100,000 | 109,296,000.00 | 4.92 |
| 3 | 210202 | 21 国开 02 | 1,000,000 | 100,090,000.00 | 4.50 |
| 4 | 200016 | 20 付息国债 16 | 900,000 | 91,224,000.00 | 4.11 |
| 5 | 210205 | 21 国开 05 | 600,000 | 60,750,000.00 | 2.73 |

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 证券代码 | 证券名称 | 数量（份） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 169813 | 20 二航 5A | 100,000 | 10,023,000.00 | 0.45 |
| 2 | 169206 | 20 二航 4A | 100,000 | 10,008,000.00 | 0.45 |

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

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国债期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.10.3 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。

7.11 投资组合报告附注

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

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体国家开发银行于 2020 年 12 月 25 日收到中国银行保险监督管理委员会处罚决定书（银保监罚决字〔2020〕67 号），根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则，经查，国家开发银行：一、为违规的政府购买服务项目提供融资；二、项目资本金管理不到位，棚改贷款项目存在资本金违规抽回情况；三、违规变相发放土地储备贷款；四、设置不合理存款考核要求，以贷转存，虚增存款；五、贷款风险分类不准确；六、向资产管理公司以外的主体批量转让不良信贷资产；七、违规进行信贷资产拆分转让，隐匿信贷资产质量；八、向棚改业务代理结算行强制搭售低收益理财产品；九、扶贫贷款存贷挂钩；十、易地扶贫搬迁贷款“三查”不尽职，部分贷款资金未真正用于扶贫搬迁；十一、未落实同业业务交易对手名单制监管要求；十二、以贷款方式向金融租赁公司提供同业融资，未纳入同业借款业务管理；十三、以协定存款方式吸收同业存款，未纳入同业存款业务管理；十四、风险隔离不到位，违规开展资金池理财业务；十五、未按规定向投资者充分披露理财产品投资非标准化债权资产情况；十六、逾期未整改，屡查屡犯，违规新增业务；十七、利用集团内部交易进行子公司间不良资产非洁净出表；十八、违规收取小微企业贷款承诺费；十九、收取财务顾问费质价不符；二十、利用银团贷款承诺费浮利分费；二十一、向检查组提供虚假整

改说明材料；二十二、未如实提供信贷资产转让台账；二十三、案件信息迟报、瞒报；二十四、对以往监管检查中发现的国别风险管理问题整改不到位。综上，中国银行保险监督管理委员会决定对国家开发银行罚款 4880 万元。

对如上证券投资决策程序的说明：公司研究部门按照内部研究工作规范对该证券进行分析后将其列入基金投资对象备选库。在此基础上本基金的基金经理根据具体市场情况独立作出投资决策。该事件发生后，本基金管理人对该证券的发行主体进行了进一步了解与分析，认为此事件未对该证券投资价值判断产生重大的实质性影响。本基金投资于该证券的投资决策过程符合制度规定的投资权限范围与投资决策程序。

报告期内本基金投资的前十名证券中其余九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。

7.11.2 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

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

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|---------|----------------|
| 1 | 存出保证金 | 5,393.32 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 30,053,539.18 |
| 5 | 应收申购款 | 200,025,870.35 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 230,084,802.85 |

7.11.4 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。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未投资股票。

7.11.6 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。

§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 |
| 1,886 | 1,091,950.25 | 2,041,421,309.83 | 99.13% | 17,996,867.38 | 0.87% |

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 | 0.00 | 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（2016年10月26日）基金份额总额 | 203,547,549.55 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 1,952,337,690.16 |
| 本报告期基金总申购份额 | 356,384,864.83 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 249,304,377.78 |
| 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 | 2,059,418,177.21 |

§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

本报告期内，交通银行托管部负责人由袁庆伟变更为徐铁。

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 | |
| 长江证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 爱建证券（已退租） | 1 | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|-----------|---|---|---|---|---|---|
| 海通证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 | 1 | - | - | - | - | - |
| 开源证券（已退租） | 1 | - | - | - | - | - |
| 野村东方国际证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 广发证券（已退租） | 1 | - | - | - | - | - |
| 中银国际证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 安信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 方正证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 金元证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 申银万国 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 平安证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 财信证券（已退租） | 1 | - | - | - | - | - |
| 天风证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华创证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东北证券 | 1 | - | - | - | - | - |

注：1、本期租用证券公司交易单元的变更情况

本报告期内本基金租用证券公司交易单元没有变更。

2、专用交易单元的选择标准和程序

根据中国证监会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》（证监基字【1998】29号）和《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字【2007】48号）的有关规定，本公司制定了租用证券公司专用交易单元的选择标准和程序。

（1）选择标准：

- 1) 券商基本面评价（财务状况、经营状况）；
- 2) 券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）；

3) 券商每日信息评价 (及时性和有效性);

4) 券商协作表现评价。

(2) 选择程序:

首先根据租用证券公司专用交易单元的选择标准形成《券商服务评价表》，然后根据评分高低进行选择基金专用交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | |
|---------------|---------------|--------------|----------------|----------------|------|--------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 长江证券 | 78,556,369.54 | 100.00% | 280,000,000.00 | 100.00% | - | - |
| 爱建证券 (已退租) | - | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 | - | - | - | - | - | - |
| 开源证券 (已退租) | - | - | - | - | - | - |
| 野村东方国际 证券 | - | - | - | - | - | - |
| 广发证券 (已退租) | - | - | - | - | - | - |
| 中银国际证 券 | - | - | - | - | - | - |
| 安信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 方正证券 | - | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | - | - | - | - | - | - |
| 金元证券 | - | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | - | - | - | - | - | - |
| 申银万国 | - | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | - | - | - | - | - | - |
| 平安证券 | - | - | - | - | - | - |
| 财信证券 (已退租) | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 天风证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华创证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东北证券 | - | - | - | - | - | - |

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 | 长信稳益纯债债券型证券投资基金 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、中国证监会电子披露网站、公司网站 | 2021 年 1 月 22 日 |
| 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旗下 28 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、中国证监会电子披露网站、公司网站 | 2021 年 3 月 2 日 |
| 6 | 长信基金管理有限责任公司关于修订旗下 28 只公开募集证券投资基金基金合同和托管协议并更新招募说明书及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 3 月 2 日 |
| 7 | 长信稳益纯债债券型证券投资基金更新的招募说明书及基金产品资料概要（更新） | 中国证监会电子披露网站、公司网站 | 2021 年 3 月 2 日 |
| 8 | 长信稳益纯债债券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 3 月 2 日 |
| 9 | 长信稳益纯债债券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 3 月 2 日 |
| 10 | 长信基金管理有限责任公司关于旗下基金参 | 上证报、中国证监 | 2021 年 3 月 13 日 |

| | | | |
|----|--|--|-----------------|
| | 与托管人承销证券事宜的公告 | 会电子披露网站、 公司网站 | |
| 11 | 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 |
| 12 | 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 |
| 13 | 长信稳益纯债债券型证券投资基金 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 |
| 14 | 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 |
| 15 | 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 |
| 16 | 长信稳益纯债债券型证券投资基金 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 |
| 17 | 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 |
| 18 | 长信稳益纯债债券型证券投资基金更新的招募说明书（2021 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 | 2021 年 4 月 28 日 |
| 19 | 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 |
| 20 | 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 |
| 21 | 长信基金管理有限责任公司关于增加浙江同花顺基金销售有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告 | 上证报、证券时报、 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 1 日至 2021 年 6 月 30 日 | 1,530,841,963.08 | 0.00 | 0.00 | 1,530,841,963.08 | 74.33% |
| 个人 | - | - | - | - | - | - | - |
| 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

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、《长信稳益纯债债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长信稳益纯债债券型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《长信稳益纯债债券型证券投资基金托管协议》；
- 5、报告期内在指定报刊上披露的各种公告的原稿；
- 6、长信基金管理有限责任公司营业执照、公司章程及相关资格批复文件。

12.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

12.3 查阅方式

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

长信基金管理有限责任公司

2021 年 8 月 31 日