

长信利富债券型证券投资基金 2021 年第 3 季度报告

2021 年 9 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

报告送出日期：2021 年 10 月 27 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金基金合同的规定，于 2021 年 10 月 25 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 7 月 1 日起至 2021 年 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长信利富债券
场内简称	长信利富
基金主代码	519967
交易代码	519967
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 5 月 6 日
报告期末基金份额总额	580,918,047.65 份
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和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	<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> <p>4、其他类型资产投资策略</p> <p>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。</p>	
业绩比较基准	中证全债指数收益率*80%+中证 800 指数收益率*20%	
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险和收益低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金，属于证券投资基金产品中风险收益程度中等偏低的投资品种。	
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	
下属分级基金的基金简称	长信利富债券 A	长信利富债券 C
下属分级基金的场内简称	长信利富	-
下属分级基金的交易代码	519967	013558
报告期末下属分级基金的份额总额	580,917,326.51 份	721.14 份

注：1、根据基金管理人于 2021 年 6 月 29 日发布的《长信基金管理有限责任公司关于长信旗下 6 只基金产品变更业绩比较基准并修改基金合同的公告》，本基金业绩比较基准自 2021 年 7 月 1 日起由“三年期银行定期存款利率(税后)+1.5%”变更为“中证全债指数收益率*80%+中证 800 指数收益率*20%”。

2、基金管理人决定自 2021 年 9 月 17 日起对长信利富债券型证券投资基金进行份额分类，原有基金份额为 A 类份额，增设 C 类份额，具体事宜可详见基金管理人于 2021 年 9 月 15 日发布的《长信基金管理有限责任公司关于长信利富债券型证券投资基金增设 C 类基金份额相关事项的公

告》。

§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7月1日—2021年9月30日）	
	长信利富债券 A	长信利富债券 C
1. 本期已实现收益	30,351,013.34	2.14
2. 本期利润	20,248,712.84	-16.38
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0435	-0.0303
4. 期末基金资产净值	792,484,016.88	983.62
5. 期末基金份额净值	1.3642	1.3640

注：1、长信利富债券型证券投资基金 C 类份额增加日为 2021 年 9 月 17 日，根据管理人于 2021 年 9 月 15 日发布的《长信基金管理有限责任公司关于长信利富债券型证券投资基金 C 类基金份额净值计算与披露方法的说明》，任何一个工作日 C 类基金份额为零时，本基金将停止计算 C 类基金份额净值，暂停计算期间的 C 类基金份额净值将按照 A 类基金份额净值披露，作为参考份额净值；截至本报告期末，长信利富债券型证券投资基金 C 类份额运作时间未满一个季度；

2、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；

3、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

长信利富债券 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	4.66%	0.76%	0.65%	0.23%	4.01%	0.53%
过去六个月	11.43%	0.66%	1.72%	0.16%	9.71%	0.50%
过去一年	13.12%	0.79%	3.90%	0.12%	9.22%	0.67%
过去三年	44.62%	0.76%	13.11%	0.07%	31.51%	0.69%
过去五年	40.24%	0.67%	23.14%	0.05%	17.10%	0.62%

自基金合同生效起至今	42.85%	0.67%	31.04%	0.05%	11.81%	0.62%
------------	--------	-------	--------	-------	--------	-------

长信利富债券 C

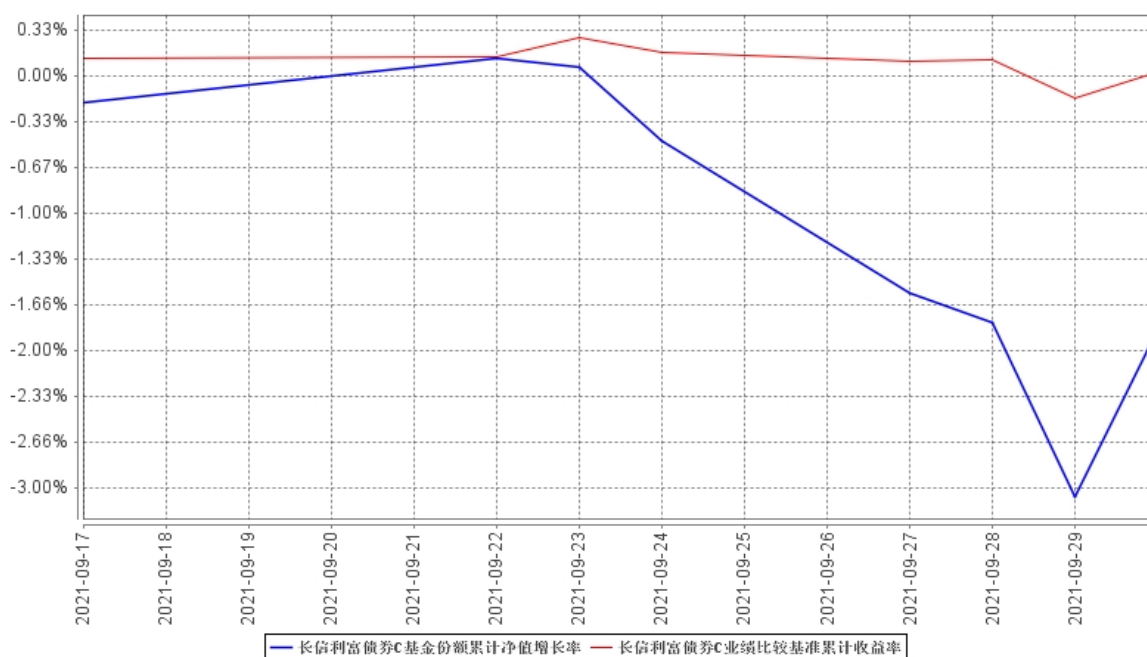
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
自份额增加日起至今 (2021年9月17日-2021年9月30日)	-1.64%	0.81%	-0.10%	0.15%	-1.54%	0.66%

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

长信利富债券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



长信利富债券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、基金管理人自 2021 年 9 月 17 日起对长信利富债券型证券投资基金进行份额分类，原有基金份额为 A 类份额，增设 C 类份额。

2、长信利富债券 A 图示日期为 2015 年 5 月 6 日至 2021 年 9 月 30 日，长信利富债券 C 图示日期为 2021 年 9 月 17 日（份额增加日）至 2021 年 9 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中的约定。

§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		
李家春	长信利丰债券型证券投资基金、长信可转债债券型证券投资基金、长信利广灵活配置混合型证券投资基金、长信利盈灵活配	2019 年 8 月 23 日	-	22 年	香港大学工商管理硕士，具有基金从业资格。曾任职于长江证券有限责任公司、汉唐证券有限责任公司、泰信基金管理有限公司、交银施罗德基金管理有限公司、富国基金管理有限公司和上海东方证券资产管理有限公司。2018 年 7 月加入长信

	置混合型证券投资基金、长信利富债券型证券投资基金、长信利尚一年定期开放混合型证券投资基金、长信稳健精选混合型证券投资基金和长信稳健均衡 6 个月持有期混合型证券投资基金的基金经理、总经理助理、投资决策委员会执行委员				基金管理有限责任公司，历任长信中证可转债及可交换债券 50 指数证券投资基金的基金经理。现任公司总经理助理、投资决策委员会执行委员兼长信利丰债券型证券投资基金、长信可转债债券型证券投资基金、长信利广灵活配置混合型证券投资基金、长信利盈灵活配置混合型证券投资基金、长信利富债券型证券投资基金、长信利尚一年定期开放混合型证券投资基金、长信稳健精选混合型证券投资基金和长信稳健均衡 6 个月持有期混合型证券投资基金的基金经理。
吴晖	长信价值优选混合型证券投资基金、长信先锐混合型证券投资基金、长信可转债债券型证券投资基金、长信利丰债券型证券投资基金、长信利广灵活配置混合型证券投资基金、长信利盈灵活配置混合型证券投资基金、长信利富债券型证券投资基金和长信稳健均衡 6 个月持有期混合型证券投资基金的基金经理	2019 年 8 月 23 日	-	6 年	清华大学管理科学与工程硕士，具有基金从业资格。曾任职于上海浦东发展银行股份有限公司和东方证券股份有限公司。2017 年 5 月加入长信基金管理有限责任公司，曾任公司基金经理助理、长信先锐债券型证券投资基金和长信先利半年定期开放混合型证券投资基金的基金经理，现任长信价值优选混合型证券投资基金、长信先锐混合型证券投资基金、长信可转债债券型证券投资基金、长信利丰债券型证券投资基金、长信利广灵活配置混合型证券投资基金、长信利盈灵活配置混合型证券投资基金、长信利富债券型证券投资基金和长信稳健均衡 6 个月持有期混合型证券投资基金的基金经理。

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

2、证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

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

4.3 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

三季度权益市场表现依然分化明显，整体沪市表现强于深市，沪指小幅回调 0.64%，深成指回调 5.62%，创业板指回调 6.69%。市场热点从科技成长逐步切换至周期板块，其中能源类和公用事业涨幅领先。同时市场表现活跃，单日成交量连续突破万亿，外资保持流入，两融余额稳步上行。债市方面，7 月在国常会提出全面降准后，收益率下行，10 年期国债收益率下行 20BP 至 2.88%，收益率绝对水平回落到历史低位，随后围绕 2.8-2.9% 范围窄幅波动。信用债下行幅度小于同期限国债，信用利差略微走阔。由于上半年信用利差压缩较多，三季度虽然总体债市走牛，但是多数信用利差未进一步缩窄。

三季度，我们具体操作上，跟踪行业高频数据，加大了周期板块的配置力度，积极挖掘符合政策导向的产业投资机会。纯债方面，维持中短久期和中高等级的持仓结构，获取确定性票息。

展望四季度，国内经济增长有望保持平稳，货币政策维持宽松格局，各项稳信用稳增长措施

开始推进，虽然近期商品价格有所扰动，但不会成为货币和信用的掣肘。后续随着政府债券发行加快，加上基数因素减弱，社融余额同比增速将有所回升，同时不排除有进一步的降准举动进行配合。海外方面，疫情恢复仍在进程中，美国居民部门充裕的超额储蓄和较低的杠杆水平有效支撑消费需求，就业方面的职位空缺情况以及薪资情况均有大幅好转。密切关注美国债务上限，新的基建计划和联储 taper 的动向。

四季度权益市场仍然有结构性机会，我们重点关注，受益于能源价格上行，新冠特效药上市后出行需求改善的油气板块值得关注。稳增长诉求下，新能源建设，信息建设和传统基建都有望发力，成为稳增长的主要方式。此前调整较为充分的消费医疗、互联网龙头、金融地产等，随着政策预期逐步稳定，也有望企稳回升。转债市场需要把握结构，对极高估值标的进行止盈，同时加强对估值相对较低、赛道次优标的挖掘。债券票息策略仍然占优，选择信用改善的产业债和区位较好的城投债，利率债方向等待货币政策和稳信用的进一步确认。

下一阶段我们将继续保持审慎严谨的态度，密切关注经济走势和政策动向，适度调整组合权益部分的行业分布和个股集中度、债券部分的久期和仓位，加强流动性管理，严格防范信用风险，进一步优化投资组合，力争为投资者获取更好的收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 9 月 30 日，长信利富债券 A 份额净值为 1.3642 元，份额累计净值为 1.4242 元，本报告期内长信利富债券 A 净值增长率为 4.66%，同期业绩比较基准收益率为 0.65%；长信利富债券 C 份额净值为 1.3640 元，份额累计净值为 1.3640 元，本报告期内长信利富债券 C 净值增长率为-1.64%，同期业绩比较基准收益率为-0.10%。

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	134,839,759.52	16.63
	其中：股票	134,839,759.52	16.63

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	642,300,168.74	79.22
	其中：债券	642,300,168.74	79.22
	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	28,238,603.44	3.48
8	其他资产	5,369,932.53	0.66
9	合计	810,748,464.23	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	-	-
B	采矿业	2,385,877.00	0.30
C	制造业	114,666,773.00	14.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	8,451,076.32	1.07
J	金融业	-	-
K	房地产业	3,935,470.00	0.50
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	5,400,563.20	0.68
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	134,839,759.52	17.01

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	002594	比亚迪	26,900	6,711,819.00	0.85
2	300014	亿纬锂能	61,100	6,050,733.00	0.76
3	600171	上海贝岭	153,600	5,495,808.00	0.69
4	603259	药明康德	35,344	5,400,563.20	0.68
5	002906	华阳集团	147,000	5,312,580.00	0.67
6	002460	赣锋锂业	32,126	5,234,610.44	0.66
7	605117	德业股份	22,700	5,102,960.00	0.64
8	300633	开立医疗	124,500	5,042,250.00	0.64
9	300751	迈为股份	7,900	4,815,287.00	0.61
10	688200	华峰测控	8,130	4,526,377.50	0.57

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	323,944,098.50	40.88
2	央行票据	-	-
3	金融债券	99,760,000.00	12.59
	其中：政策性金融债	99,760,000.00	12.59
4	企业债券	10,048,000.00	1.27
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	208,548,070.24	26.32
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	642,300,168.74	81.05

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	019649	21 国债 01	1,299,830	130,086,986.40	16.42
2	210211	21 国开 11	1,000,000	99,760,000.00	12.59
3	019658	21 国债 10	783,540	78,181,621.20	9.87
4	019645	20 国债 15	622,200	62,275,998.00	7.86
5	219920	21 贴现国债 20	500,000	49,515,000.00	6.25

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国债期货交易情况说明**5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.9.3 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。

5.10 投资组合报告附注**5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	130,325.44
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,201,059.95
5	应收申购款	38,547.14
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	5,369,932.53

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	113025	明泰转债	5,770,133.80	0.73
2	128095	恩捷转债	5,371,899.30	0.68
3	113614	健20转债	4,986,913.60	0.63
4	113615	金诚转债	4,935,903.60	0.62
5	113013	国君转债	4,674,295.60	0.59
6	113009	广汽转债	4,362,032.00	0.55
7	110053	苏银转债	4,317,784.80	0.54
8	128081	海亮转债	4,164,912.00	0.53
9	127030	盛虹转债	3,905,308.00	0.49
10	118000	嘉元转债	3,495,449.10	0.44
11	127017	万青转债	3,480,420.60	0.44
12	128046	利尔转债	3,473,194.20	0.44
13	127011	中鼎转2	3,385,443.75	0.43
14	128109	楚江转债	3,222,596.40	0.41
15	110070	凌钢转债	3,175,701.60	0.40
16	123070	鹏辉转债	3,111,204.90	0.39
17	123077	汉得转债	2,994,177.84	0.38
18	127020	中金转债	2,841,545.52	0.36
19	113043	财通转债	2,760,894.00	0.35
20	128140	润建转债	2,698,967.15	0.34
21	127026	超声转债	2,552,331.18	0.32
22	128121	宏川转债	2,432,600.10	0.31
23	128075	远东转债	2,348,981.60	0.30
24	127025	冀东转债	2,280,008.94	0.29
25	123075	贝斯转债	2,174,925.06	0.27
26	128137	洁美转债	2,109,721.50	0.27
27	123099	普利转债	1,830,718.50	0.23
28	113537	文灿转债	1,795,036.80	0.23
29	123101	拓斯转债	1,575,916.00	0.20
30	113593	沪工转债	1,491,346.50	0.19
31	123091	长海转债	1,479,398.40	0.19
32	123105	拓尔转债	1,056,654.20	0.13

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.10.6 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	长信利富债券 A	长信利富债券 C
报告期期初基金份额总额	472,853,314.54	-
报告期期间基金总申购份额	248,337,966.86	721.14
减：报告期期间基金总赎回份额	140,273,954.89	-
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	580,917,326.51	721.14

注：长信利富债券型证券投资基金 C 类份额增加日为 2021 年 9 月 17 日。

§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 7 月 2 日至 2021 年 7 月 20 日；	89,564,711.15	0.00	0.00	89,564,711.15	15.42%

		2021 年 7 月 22 日至 2021 年 8 月 30 日					
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>							

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、《长信利富债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长信利富债券型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《长信利富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。

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 10 月 27 日