

# 长江乐鑫纯债定期开放债券型发起式证券投资基金

## 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人:长江证券(上海)资产管理有限公司

基金托管人:浙商银行股份有限公司

送出日期:2022 年 03 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。本年度报告由董事长签发。

基金托管人浙商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年3月25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。

本报告期自2021年1月1日起至12月31日止。

## 1.2 目录

§ 1 重要提示及目录.....	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§ 2 基金简介.....	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	8
§ 4 管理人报告.....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	14
§ 5 托管人报告.....	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	15
§ 6 审计报告.....	15
6.1 审计报告基本信息.....	15
6.2 审计报告的基本内容.....	15
§ 7 年度财务报表.....	17
7.1 资产负债表.....	17
7.2 利润表.....	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	20
7.4 报表附注.....	22
§ 8 投资组合报告.....	48
8.1 期末基金资产组合情况.....	48
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	48
8.3 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.....	49
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	49
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	49
8.6 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.....	49
8.7 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.....	50
8.8 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.....	50
8.9 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.....	50
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	50
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	51

8.12 投资组合报告附注.....	51
§ 9 基金份额持有人信息.....	52
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	52
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	52
9.3 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.....	52
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	52
§ 10 开放式基金份额变动.....	53
§ 11 重大事件揭示.....	53
11.1 基金份额持有人大会决议.....	53
11.2 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.....	53
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	53
11.4 基金投资策略的改变.....	54
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	54
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	54
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	54
11.8 其他重大事件.....	55
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息.....	58
12.1 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.....	58
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	58
§ 13 备查文件目录.....	58
13.1 备查文件目录.....	58
13.2 存放地点.....	59
13.3 查阅方式.....	59

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	长江乐鑫纯债定期开放债券型发起式证券投资基金
基金简称	长江乐鑫定开债
基金主代码	006135
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年08月16日
基金管理人	长江证券（上海）资产管理有限公司
基金托管人	浙商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,743,704,126.90份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在控制组合净值波动率的前提下，力争长期内实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的研究优势，将宏观周期研究、行业周期研究、公司研究相结合，在分析和判断宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上，自上而下决定债券组合久期、期限结构、债券类别配置策略，在严谨深入的分析基础上，综合考量各类债券的流动性、供求关系和收益率水平等，深入挖掘价值被低估的标的券种。
业绩比较基准	中国债券综合财富指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期收益和预期风险高于货币市场基金，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		长江证券（上海）资产管理有限公司	浙商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	高杨	朱巍
	联系电话	4001-166-866	0571-87659806
	电子邮箱	zgxxpl@cjsc.com.cn	zhuwei@czbank.com

客户服务电话	4001-166-866	95527
传真	021-80301393	0571-88268688
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道1198号世纪汇一座27层	杭州市萧山区鸿宁路1788号
办公地址	上海市浦东新区世纪大道1198号世纪汇一座27层	杭州市拱墅区延安路368号
邮政编码	200122	310006
法定代表人	周纯	张荣森(代为履行法定代表人职责)

注：因原法定代表人辞任，浙商银行股份有限公司于 2022 年 1 月 14 日以书面传签方式召开第六届董事会 2022 年第一次临时会议，审议通过了《关于推举董事代为履行董事长职责的议案》。经全体董事一致表决同意，由执行董事、行长张荣森先生代为履行董事长、董事会战略委员会主任委员、董事会普惠金融发展委员会主任委员及法定代表人职责，直至选举产生新任董事长且其任职资格获银保监会核准之日止。

## 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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.cjzcgl.com
基金年度报告备置地点	上海市浦东新区世纪大道1198号世纪汇一座27层

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）	武汉市武昌区东湖路169号众环大厦
注册登记机构	长江证券（上海）资产管理有限公司	上海市浦东新区世纪大道1198号世纪汇一座27层

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2021年	2020年	2019年
本期已实现收益	52,484,090.21	41,031,958.85	32,465,248.07

本期利润	68,069,478.86	34,923,097.34	38,626,433.88
加权平均基金份额本期利润	0.0466	0.0339	0.0444
本期加权平均净值利润率	4.59%	3.32%	4.38%
本期基金份额净值增长率	4.71%	3.29%	4.62%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	2021年末	2020年末	2019年末
期末可供分配利润	4,146,702.71	3,220,492.22	2,580,274.49
期末可供分配基金份额利润	0.0024	0.0025	0.0026
期末基金资产净值	1,771,447,874.34	1,308,185,253.49	1,016,398,746.73
期末基金份额净值	1.0159	1.0052	1.0123
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	2021年末	2020年末	2019年末
基金份额累计净值增长率	14.56%	9.41%	5.93%

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）期末可供分配利润采用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；表中的“期末”均指报告期最后一日，即2021年12月31日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。（3）上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，计入费用后投资人的实际收益水平要低于所列数字。

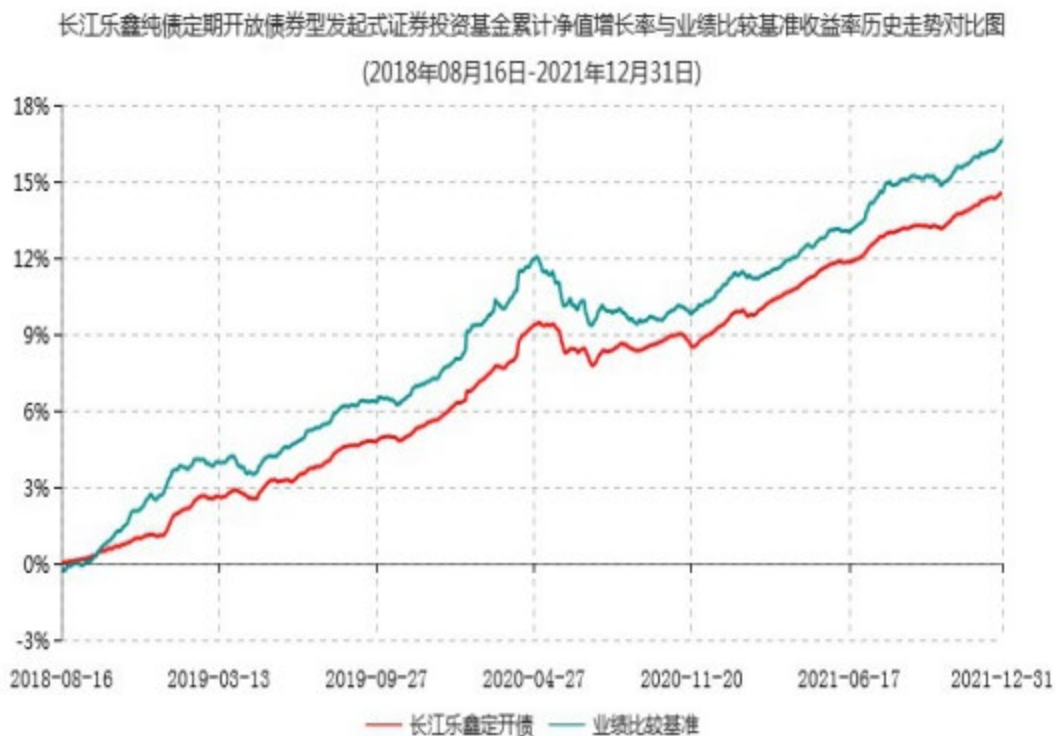
## 3.2 基金净值表现

### 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

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
过去三个月	1.18%	0.02%	1.22%	0.05%	-0.04%	-0.03%
过去六个月	2.30%	0.02%	2.89%	0.05%	-0.59%	-0.03%
过去一年	4.71%	0.02%	5.09%	0.05%	-0.38%	-0.03%
过去三年	13.15%	0.04%	13.19%	0.07%	-0.04%	-0.03%
自基金合同生效起至今	14.56%	0.04%	16.62%	0.07%	-2.06%	-0.03%

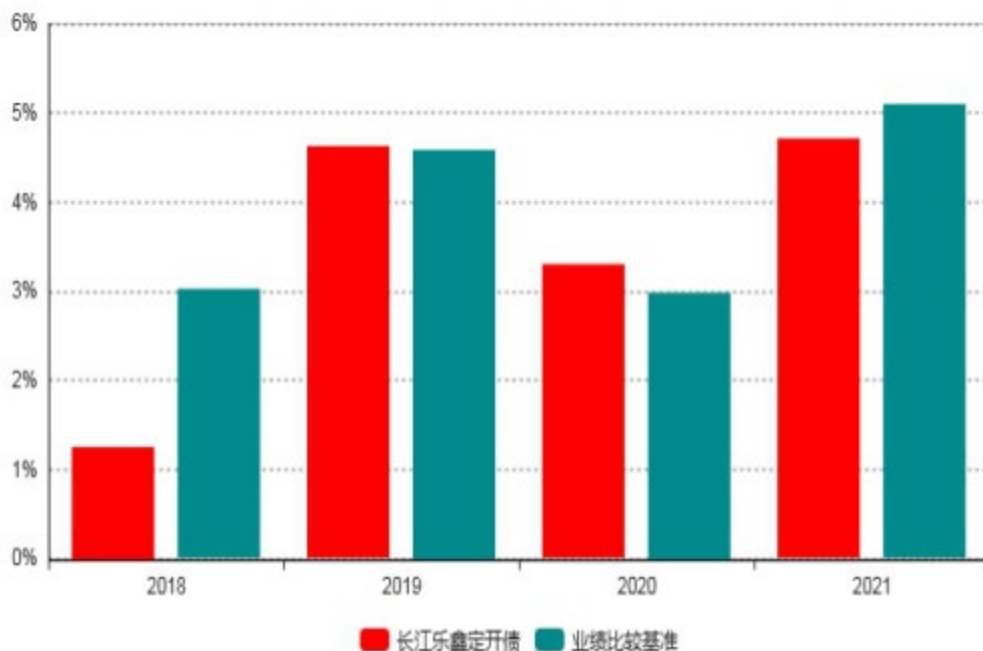
注：本基金基金合同于2018年8月16日生效，业绩比较基准为中国债券综合财富指数收益率。

### 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



### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较





注：本基金基金合同于 2018 年 8 月 16 日生效，2018 年基金净值增长率及同期业绩比较基准收益率按当年实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2021年	0.360	54,804,858.01	-	54,804,858.01	-
2020年	0.400	43,134,590.58	-	43,134,590.58	-
2019年	0.400	34,717,350.96	-	34,717,350.96	-
合计	1.160	132,656,799.55	-	132,656,799.55	-

## § 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

长江证券（上海）资产管理有限公司于2014年9月16日正式成立，是长江证券股份有限公司旗下专门从事证券资产管理、公开募集证券投资基金管理业务的全资子公司。注册地上海，注册资本23亿元人民币。

公司秉承“专业至臻，追求卓越”的理念，致力于为广大投资者创造稳定而丰厚的回报。公司以“客户导向、研究驱动、技术领先、内控先行”为业务发展策略，全方位参与客户资产配置和资产增值全过程，通过深度挖掘客户的投融资需求，紧跟市场创新步伐，以满足客户差异化需求。在严格控制风险的前提下，挑选优质投资品种，丰富创新产品架构，为客户提供多元化资产配置方案。

截至本报告期末，本基金管理人管理的基金有长江收益增强债券型证券投资基金、长江乐享货币市场基金、长江乐丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、长江乐盈定期开放债券型发起式证券投资基金、长江乐越定期开放债券型发起式证券投资基金、长江乐鑫纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、长江可转债债券型证券投资基金、长江量化匠心甄选股票型证券投资基金、长江安盈中短债六个月定期开放债券型证券投资基金、长江添利混合型证券投资基金、长江安享纯债18个月定期开放债券型证券投资基金、长江均衡成长混合型发起式证券投资基金、长江量化消费精选股票型发起式证券投资基金、长江新能源产业混合型发起式证券投资基金、长江沪深300指数增强型发起式证券投资基金、长江量化科技精选一个月滚动持有股票型发起式证券投资基金、长江双盈6个月持有期债券型发起式证券投资基金、长江红利回报混合型发起式证券投资基金、长江致惠30天滚动持有短债债券型发起式证券投资基金、长江鑫选3个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、长江智能制造混合型发起式证券投资基金、长江尊利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		
漆志伟	基金经理	2018-08-16	-	12年	国籍：中国。硕士研究生，具备基金从业资格。曾任东兴证券股份有限公司客服经理、华农财产保险股份有限公司投资经理。现任长江证券（上海）资产管理有限公司公募固定收益投资部总经理，长江收益增强债券型证券投资基金、长江乐享货币市场基金、长江乐盈定期开放债券型发起式证券投资基

					金、长江乐鑫定期开放债券型发起式证券投资基金、长江可转债债券型证券投资基金、长江安盈中短债六个月定期开放债券型证券投资基金、长江添利混合型证券投资基金、长江安享纯债18个月定期开放债券型证券投资基金、长江双盈6个月持有期债券型发起式证券投资基金、长江致惠30天滚动持有短债债券型发起式证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：（1）此处的任职日期、离职日期均指公司做出决定之日，若该基金经理自基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日；

（2）证券从业的含义遵从行业协会《证券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

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《基金管理公司公平交易制度指导意见》等有关法律法规的规定，严格遵守基金合同和招募说明书约定，本着诚实信用、勤勉尽责、最大限度保护投资人合法权益等原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合法合规，未发生损害基金份额持有人利益的行为，未发生内幕交易、操纵市场和不当关联交易及其他违规行为，信息披露及时、准确、完整，本基金与本基金管理人管理的其他基金资产、投资组合与公司资产之间严格分开、公平对待，基金管理保持独立运作，并通过科学决策、规范运作、精心管理和健全内控体系，有效保障投资人的合法权益。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据相关法规要求，制定了《长江证券(上海)资产管理有限公司公平交易管理办法》，制度规范了公司各部门相关岗位职责，适用的范围涵盖境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等各类投资管理活动，同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资和交易管理活动相关的各个业务环节，旨在规范交易行为，严禁利益输送，保证公平交易，保护投资者合法权益。

(一) 公司不断完善研究方法和投资决策流程, 提高投资决策的科学性和客观性, 建立研究与投资的业务交流机制, 保持通畅的交流渠道, 确保各投资组合享有公平的投资决策机会, 创建公平交易的制度环境。

(二) 公司建立客观的研究方法, 任何投资分析和建议均应有充分的事实和数据支持, 避免主观臆断, 严禁利用内幕信息作为投资依据。

(三) 公司健全投资授权机制, 明确基金投资决策委员会、基金经理等各投资决策主体的职责和权限划分。其他人员不得对基金经理在授权范围内的投资活动进行干预。基金经理在授权范围内自主决策, 超过投资权限的操作需要经过审批程序。

(四) 公司建立适用全公司的证券备选池和交易对手库, 明确证券备选池和交易对手库的建立和维护程序, 并根据不同投资组合各自的投资目标、投资风格、投资范围和关联交易限制等, 建立相应的证券备选池和交易对手库, 基金经理在此基础上构建具体的投资组合。

(五) 公司建立投资组合投资信息的管理及保密机制, 不同基金经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息应相互隔离。

(六) 公司严格贯彻投资管理职能和交易执行职能相隔离原则, 实行集中交易制度, 确保各投资组合享有公平的交易执行机会。

(七) 公司严格控制不同投资组合之间的同日反向交易, 严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。公司原则上严格禁止同一基金、资产管理计划在同一交易日内进行反向交易, 及其他可能导致不公平交易和利益输送的交易行为。

(八) 公司相关部门如果发现涉嫌违背公平交易原则的行为, 应及时向经营管理层汇报并采取相关控制和改进措施。

(九) 公司相关部门定期对管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异、不同时间窗下同向交易和反向交易的交易价差等进行分析, 并评估是否符合公平交易原则。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内, 本基金管理人严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关规定, 通过严格的内部风险控制制度和流程, 对各环节的投资风险和管理风险进行有效控制, 确保公平对待所管理的所有基金和投资组合, 切实防范利益输送行为。

##### (一) 本基金管理人所管理的基金或组合间同向交易价差分析

根据证监会公平交易指导意见, 我们计算了公司旗下基金、组合同日同向交易纪录配对。通过对这些配对的交易价差分析, 我们发现有效配对溢价率均值大部分在1%数量级及以下, 且大部分溢价率均值通过95%置信度下等于0的t检验。

##### (二) 扩展时间窗口下的价差分析

本基金管理人选取T=3和T=5作为扩展时间窗口，将基金或组合交易情况分别在这两个时间窗口内作平均，并以此为依据，进行基金或组合间在扩展时间窗口中的同向交易价差分析。对于有足够多观测样本的基金配对（样本数=30），溢价率均值大部分在1%数量级及以下。

### （三）基金或组合间模拟溢价金额分析

对于不能通过溢价率均值为零的t检验的基金组合配对、对于在时间窗口中溢价率均值过大的基金组合配对，已要求基金经理对价差作出了解释，根据基金经理解释公司旗下基金或组合间没有可能导致不公平交易和利益输送的行为。

本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况，公司旗下各基金不存在因非公平交易等导致的利益输送行为，公平交易制度的整体执行情况良好。

## 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金与本基金管理人所管理的其他投资组合未发生大额同日反向交易。本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

## 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年经济的几条主线是：出口高位景气、财政节奏后置、地产调控趋紧、通胀冲高回落、社融筑底回升。这几条主线之间存在相互的关联。在社融的收缩期，由于出口对社融数据敏感度低，因此在外需景气的大环境下依然单边走强。出口强则就业压力小，又进一步为财政后置、地产调控、供给收缩创造了条件。财政后置带来狭义流动性宽松，供给收缩助推上游价格上行，导致通胀开始上升。年内经济的几大特征由此形成。

一季度，在社融同比增速处于高位，信用环境偏稳，全市场回购杠杆率处于高位等多重因素影响下，流动性出现波动，债券市场收益率开始上行。但很快随着经济的逐步走弱和信用的持续收缩，社融数据出现向下拐点，地产和城投融资政策收紧约束了实体信贷扩张的空间，资金面也随之由紧转松，货币与信用环境都向对债券市场利多的方向调整，债券市场供需关系优化，债券市场表现强势，收益率和信用利差同时下行，金融机构平均久期开始上升，债券资产的资产荒格局开始逐步形成。在下半年，连续降准预期被阶段性证伪，同时10月份社融同比增速触底，投资者对市场的预期由乐观转向中性，情绪出现分歧，债券市场处于震荡行情。表现为中期限的资产波动加大，而更为稳定的中短期资产的资产荒继续演绎，表现较好。全年来看，整体债券市场表现较好。十年国开债收益率下行约45BP，十年国债收益率下行约37BP。信用利差方面，随着资产荒的进一步演绎，信用利差也出现了大幅下行。

报告期内，本基金适度提高了组合的久期，采用了积极的杠杆策略，在判断货币环境相对宽松的基础上，我们在二季度后进一步加大了对中期票据的配置力度，并且利用了部分银行二级资本债来提升组合的整体票息收益，获得了不错的资本利得。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为1.0159元，本报告期内，基金份额净值增长率为4.71%，同期业绩比较基准收益率为5.09%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，目前国内市场的关注重心还是在于“稳增长、宽信用”的节奏和落实情况，从目前来看地产投资短期可能还将对经济形成拖累，制造业正在逐步从不库存转向主动去库存，投资增速或还将继续回落；另一方面，居民消费支出受到收入增速限制，可能还将处于中枢下移的过程中；加上出口增速大概率见顶，整体经济下行的压力较大。积极的财政政策可能将会成为2022年主导经济企稳反弹的主要助力，从中美利差和人民币汇率目前的情况来看，我国央行在美联储步入加息周期的情况下仍有一定的操作空间，在财政前置的预期下，仍能期待货币政策保持稳健偏宽松，利率上行空间可能仍将较为有限，甚至不排除进一步下行的可能。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人从合规运作、维护基金份额持有人合法利益的角度出发，完善内部控制制度和流程，加强日常监察力度，推动内控体系和制度措施的落实；在对基金投资运作和公司经营管理的合规性监察方面，通过实时监控、报表揭示、定期检查、专项检查等方式，及时发现情况、提出改进建议并跟踪改进落实情况。本期内重点开展的监察稽核工作包括：

1、全面开展对公司各项业务的稽核监察，对公司内控缺失、薄弱环节和风险隐患做到及时发现，提前防范，确保投资管理、基金销售和后台运营等业务领域的稳健合规运作。

2、根据基金监管法律法规的相关要求及业务发展变化，优化公司内控和风险管理，更新完善内控制度和业务流程，推动全员全过程风险管理和风险控制责任制，并进行持续监督，跟踪检查执行情况。

3、注重对员工行为规范和职业素养的教育与监察，并通过开展法规培训、业务学习等形式，提升员工的诚信规范和风险责任意识。今后本基金管理人将继续以“诚信勤勉为投资人服务”为宗旨，不断提高内部监察稽核和风险控制工作的科学性和实效性，在完善内部控制体系、有效防范风险的基础上，确保基金资产的规范运作，维护基金份额持有人的合法利益，争取以更好的收益回报基金份额持有人。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证券监督管理委员会《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》和中国证券业协会基金估值工作小组《关于停牌股票估值的参考方法》等法律法规的有关规定，本基金管理人设立估值委员会并制定估值委员会制度。

估值委员会由公司领导、运营部、财务部、权益研究部、固定收益研究部、法律合规部、风险管理部等相关部门工作人员组成。估值委员会成员具有会计核算经验、行业分析经验、金融工具应用等丰富的证券投资基金行业从业经验和专业能力，且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理如果认为某证券有更能准确反应其公允价值的估值方法，可以向估值委员会申请对其进行专项评估。新的证券价格需经估值委员会和托管行同意后才能采纳，否则不改变用来进行证券估值的初始价格。

估值委员会职责：根据相关估值原则研究相关估值政策和估值模型，拟定公司的估值政策、估值方法和估值程序，确保公司各基金产品净值计算的公允性，以维护广大投资者的利益。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《长江乐鑫纯债定期开放债券型发起式证券投资基金》规定，本基金本报告期实施利润分配的金额为54,804,858.01元。

#### 4.9 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

本基金为发起式基金，基金合同生效日为2018年8月16日，基金合同生效满三年后继续存续。

本报告期内，本基金存在连续六十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形；本基金不存在连续二十个工作日出现资产净值低于五千万的情形。基金管理人已向中国证监会报告并提交了解决方案。

### § 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，本基金托管人在对本基金的托管过程中，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的行为，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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，长江乐鑫纯债定期开放债券型发起式证券投资基金的管理人——长江证券（上海）资产管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支

及利润分配等问题上，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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对长江证券（上海）资产管理有限公司编制和披露的长江乐鑫纯债定期开放债券型发起式证券投资基金2021年年度报告中财务指标、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 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	众环审字（2022）0110461号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	长江乐鑫纯债定期开放债券型发起式证券投资基金全体持有人
审计意见	<p>我们审计了后附的长江乐鑫纯债定期开放债券型发起式证券投资基金（以下简称“长江乐鑫定开债”）财务报表，包括2021年12月31日的资产负债表、2021年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。</p> <p>我们认为，长江乐鑫定开债财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会、中国证券投资基金业协会发布的相关规定以及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了长江乐鑫定开债2021年12月31日的财务状况、2021年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于管理人长江证券（上海）资产管理有限公司，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适</p>



	当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	<p>管理人长江证券（上海）资产管理有限公司对其他信息负责。我们在审计报告日前已获取的其他信息包括长江乐鑫定开债2021年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理人负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会、中国证券投资基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（一）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风</p>

	险。（二）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。（三）评价管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。（四）评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与管理人就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	余宝玉	郭和珍
会计师事务所的地址	武汉市武昌区东湖路169号众环大厦	
审计报告日期	2022-03-22	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：长江乐鑫纯债定期开放债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2021年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	50,847,429.69	817,099.27
结算备付金		9,646,767.03	7,285,152.71
存出保证金		55,755.32	3,562.35
交易性金融资产	7.4.7.2	2,173,934,900.00	1,698,804,100.00
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,953,244,800.00	1,514,978,600.00
资产支持证券投资		220,690,100.00	183,825,500.00
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-

买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	33,441,135.81	25,782,759.37
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		2,267,925,987.85	1,732,692,673.70
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年12月31日</b>	<b>上年度末 2020年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		495,369,902.38	423,619,212.06
应付证券清算款		155,418.53	78,204.79
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		413,613.85	329,854.86
应付托管费		137,871.32	109,951.63
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	27,326.42	15,331.47
应交税费		100,151.74	91,630.92
应付利息		-55,470.73	63,234.48
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	329,300.00	200,000.00
负债合计		496,478,113.51	424,507,420.21
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7.4.7.9	1,743,704,126.90	1,301,444,796.01
未分配利润	7.4.7.10	27,743,747.44	6,740,457.48
所有者权益合计		1,771,447,874.34	1,308,185,253.49

负债和所有者权益总计		2,267,925,987.85	1,732,692,673.70
------------	--	------------------	------------------

注：报告截止日2021年12月31日，基金份额净值1.0159元，基金份额总额1,743,704,126.90份。

## 7.2 利润表

会计主体：长江乐鑫纯债定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021年01月01日 至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日 至2020年12月31日
<b>一、收入</b>		88,269,363.92	48,463,775.04
1. 利息收入		77,390,350.58	56,335,733.33
其中：存款利息收入	7.4.7.11	156,625.32	109,739.71
债券利息收入		69,515,961.73	49,501,015.48
资产支持证券利息收入		7,686,449.26	6,694,957.53
买入返售金融资产收入		31,314.27	30,020.61
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-4,706,375.31	-1,763,096.78
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-3,317,182.80	-1,624,086.94
资产支持证券投资	7.4.7.13.5	-1,389,192.51	-139,009.84
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	-	-
3. 公允价值变动收益（损	7.4.7.16	15,585,388.65	-6,108,861.51

失以“-”号填列)			
4. 汇兑收益 (损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入 (损失以“-”号填列)	7.4.7.17	-	-
<b>减：二、费用</b>		20,199,885.06	13,540,677.70
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	4,439,490.49	3,148,058.39
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,479,830.19	1,049,352.79
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	11,672.44	5,248.43
5. 利息支出		13,908,532.52	9,019,728.58
其中：卖出回购金融资产支出		13,908,532.52	9,019,728.58
6. 税金及附加		113,859.42	81,089.51
7. 其他费用	7.4.7.19	246,500.00	237,200.00
<b>三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)</b>		68,069,478.86	34,923,097.34
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润 (净亏损以“-”号填列)</b>		68,069,478.86	34,923,097.34

### 7.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体：长江乐鑫纯债定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期		
	2021年01月01日至2021年12月31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)	1,301,444,796.01	6,740,457.48	1,308,185,253.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本	-	68,069,478.86	68,069,478.86

期利润)			
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)	442,259,330.89	7,738,669.11	449,998,000.00
其中: 1. 基金申购款	442,259,330.89	7,738,669.11	449,998,000.00
2. 基金赎回款	-	-	-
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)	-	-54,804,858.01	-54,804,858.01
五、期末所有者权益(基金净值)	1,743,704,126.90	27,743,747.44	1,771,447,874.34
项 目	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31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)	1,004,004,753.83	12,393,992.90	1,016,398,746.73
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	34,923,097.34	34,923,097.34
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)	297,440,042.18	2,557,957.82	299,998,000.00
其中: 1. 基金申购款	297,440,042.18	2,557,957.82	299,998,000.00
2. 基金赎回款	-	-	-
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)	-	-43,134,590.58	-43,134,590.58
五、期末所有者权益(基金净值)	1,301,444,796.01	6,740,457.48	1,308,185,253.49

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

周纯

杨忠

何永生

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

长江乐鑫纯债定期开放债券型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2018]989号文《关于准予长江乐鑫纯债定期开放债券型发起式证券投资基金注册的批复》准予注册,由长江证券(上海)资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《长江乐鑫纯债定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。

本基金以定期开放方式运作,即采取在封闭期内封闭运作、封闭期与封闭期之间定期开放的运作方式。本基金以三个月为一个封闭期,在封闭期内,本基金不接受基金份额的申购和赎回。本基金的封闭期为自基金合同生效日(包括基金合同生效日)或每个开放期结束之日次日起(包括该日)至三个月后的对日的前一日止。如该对日不存在,则对日调整至该对应月度的最后一个工作日;如该对日为非工作日,则顺延至下一工作日。开放期为本基金开放申购、赎回等业务的期间。本基金自每个封闭期结束之日的下一个工作日起进入开放期。本基金的每个开放期不少于 5 个工作日、不超过 20 个工作日,开放期的具体时间以基金管理人届时公告为准,且基金管理人最迟应于开放期开始的2日前进行公告。本基金存续期限为不定期,首次设立募集资金为309,999,000.00元,认购资金在募集期间产生的利息0.00元,合计为309,999,000.00元,按照每份基金份额面值人民币1.00元计算,折合基金份额为309,999,000.00份,业经中审众环会计师事务所(特殊普通合伙)众环验字(2018)010057号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《长江乐鑫纯债定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》于2018年8月16日正式生效。本基金的基金管理人为长江证券(上海)资产管理有限公司,基金托管人为浙商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长江乐鑫纯债定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》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国债、金融债、公司债、企业债、地方政府债、次级债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、资产支持证券、债券回购、央行票据、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款、通知存款)、货币市场工具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)。本基金不投资于股票、权证,也不投资于可转换债券、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。基金的投资组合比例为：本基金投资于债券的比例不低于基金资产的80%；但在每个开放期的前10个工作日和后10个工作日以及开放期间不受前述投资组合比例的限制。本基金在封闭期内持有现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不受限制，但在开放期本基金持有现金（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不低于基金资产净值的5%。当法律法规的相关规定变更时，基金管理人在履行适当程序后可对上述资产配置比例进行适当调整。

本基金的业绩比较基准为：中国债券综合财富指数收益率。

#### 7.4.2 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”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《长江乐鑫纯债定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的其他有关规定以及允许的基金行业实务操作编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2021年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2021年12月31日的财务状况以及2021年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历年度，即每年1月1日至12月31日。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

当本基金成为金融工具合同条款中的一方时，确认相应的金融资产或金融负债。

###### (1) 金融资产的分类

本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和贷款及应收款项。

本基金持有的债券投资、资产支持证券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，以交易性金融资产列示。



本基金持有的各类应收款项、买入返售金融资产等在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产分类为贷款与应收款项。

#### (2) 金融负债的分类

本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债在资产负债表中以交易性金融负债列示。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

#### (1) 债券投资

买入债券于交易日确认为债券投资。债券投资成本于交易日按债券的公允价值（不含应收利息）入账，按支付价款中包含的应收利息计入“应收利息”科目，应支付的相关交易费用直接计入当期损益。

配售及认购新发行的分离交易可转债，于实际取得日按照估值方法对分离交易可转债的认购成本进行分摊，确认应归属于债券部分的成本。

卖出债券于交易日确认债券投资收益（损失）。卖出债券按移动加权平均法逐日结转成本。

#### (2) 资产支持证券投资

对非货币市场基金，本科目核算资产支持证券投资的实际成本和价值变动（估值增值或减值）；对货币市场基金或中国证监会规定的特定基金品种，本科目核算实际利率摊余成本估算的公允价值。

对非货币市场基金，本科目可按资产支持证券投资的种类，分别“成本”和“估值增值”进行明细核算；对货币市场基金，本科目可按资产支持证券投资的种类，分别“面值”和“折溢价”进行明细核算。

基金取得资产支持证券支付的款项时，应当区分属于资产支持证券投资本金部分和证券投资收益部分。对非货币市场基金，将收到的本金部分冲减本科目（成本），对货币市场基金，将收到的本金部分冲减本科目（面值），并相应结转本科目（折溢价）。将收到的收益部分冲减应计利息（若有）后的差额，记入资产支持证券利息收入。对资产支持证券的付息延期，在确定其付息的可能性仍很大的情况下，可不调整已确认的利息收入。其他与资产支持证券投资相关业务的账务处理比照债券投资。

本科目期末借方余额，反映持有各项资产支持证券投资的公允价值。

#### (3) 买入返售金融资产

本科目核算按照返售协议约定先买入再按固定价格返售的证券等金融资产所融出的资金。

根据返售协议买入证券等金融资产，按应付或实际支付的金额入账，相关交易费用计入初始成本。于返售日按账面余额结转。

返售前，按实际利率逐日计提利息计入当期损益。

#### (4) 卖出回购金融资产款

卖出回购金融资产款为本基金按照回购协议先卖出再按固定价格买入票据、证券等金融资产所融入的资金。

卖出回购金融资产款于交易日按照应收或实际收到的金额入账，相关交易费用计入初始成本。于回购日按账面余额结转。

本基金持有的金融资产和金融负债的后续计量与其分类相关联。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，按照公允价值后续计量，公允价值变动计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，采用实际利率法，按摊余成本计量。

### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金目前金融资产和金融负债的估值原则和方法如下：

#### (1) 证券交易所上市的有价证券的估值

①交易所发行实行净价交易的债券按估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

②交易所发行未实行净价交易的债券按估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价减去估值全价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价减去估值全价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

③交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

#### (2) 处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理

①首次公开发行未上市的债券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

②对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的固定收益品种，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

#### (3) 银行间市场交易的固定收益品种的估值

①银行间市场交易的固定收益品种，以第三方估值机构提供的价格数据估值；

②对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的固定收益品种，按成本估值。

(4) 同一证券同时在两个或两个以上市场交易的，按证券所处的市场分别估值。

(5) 持有的银行定期存款或通知存款以本金列示，按相应利率逐日计提利息。

(6) 当发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以对本基金采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性，具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。

(7) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

(8) 相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵消。但是同时满足下列条件时，以相互抵消后的净额在资产负债表内列示：

(1) 本基金具有抵消已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的。

(2) 本基金以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认，并于期末全额转入未分配利润/（累计亏损）。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 债券投资收益于卖出债券成交日确认，并按卖出债券成交金额与其成本、应收利息的差额入账；

(6) 公允价值变动收益系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的0.30%年费率计提，每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的0.10%年费率计提，每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付；

(3) 基金管理人和基金托管人可协商一致并履行适当程序后，调整基金管理费率和基金托管费率。基金管理人须按规定进行公告。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

##### (1) 基金利润构成

基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额，基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

##### (2) 基金可供分配利润

基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

##### (3) 基金收益分配原则

①在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，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；选择红利再投资的，基金份额的现金红利将按除息后的基金份额净值折算成基金份额，红利再投资的份额免收申购费；

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法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

#### (4) 收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

#### 7.4.4.12 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策与计量基础一致。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金报告期无会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《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]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]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(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，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

(4) 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。

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体、纳税义务按上述税收法律法规执行。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
活期存款	50,847,429.69	817,099.27
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	50,847,429.69	817,099.27

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31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	581,464,396.11	584,400,600.00	2,936,203.89
	银行间市场	1,357,934,612.15	1,368,844,200.00	10,909,587.85
	合计	1,939,399,008.26	1,953,244,800.00	13,845,791.74
资产支持证券		218,721,036.46	220,690,100.00	1,969,063.54
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		2,158,120,044.72	2,173,934,900.00	15,814,855.28
项目		上年度末 2020年12月31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	419,977,674.51	422,339,600.00	2,361,925.49
	银行间市场	1,093,880,335.86	1,092,639,000.00	-1,241,335.86
	合计	1,513,858,010.37	1,514,978,600.00	1,120,589.63
资产支持证券		184,716,623.00	183,825,500.00	-891,123.00
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		1,698,574,633.37	1,698,804,100.00	229,466.63

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融资产/负债余额。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末无买入返售金融资产余额。

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应收活期存款利息	2,940.17	311.45
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	4,775.21	3,606.13
应收债券利息	32,111,214.32	24,930,640.51
应收资产支持证券利息	1,322,178.50	848,199.52
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	27.61	1.76
合计	33,441,135.81	25,782,759.37

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产余额。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
交易所市场应付交易费用	-	-
银行间市场应付交易费用	27,326.42	15,331.47
合计	27,326.42	15,331.47

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元



项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31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	-	-
预提费用	329,300.00	200,000.00
合计	329,300.00	200,000.00

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,301,444,796.01	1,301,444,796.01
本期申购	442,259,330.89	442,259,330.89
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,743,704,126.90	1,743,704,126.90

注：上述申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.10 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	3,220,492.22	3,519,965.26	6,740,457.48
本期利润	52,484,090.21	15,585,388.65	68,069,478.86
本期基金份额交易产生的变动数	3,246,978.29	4,491,690.82	7,738,669.11
其中：基金申购款	3,246,978.29	4,491,690.82	7,738,669.11
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-54,804,858.01	-	-54,804,858.01
本期末	4,146,702.71	23,597,044.73	27,743,747.44

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日 至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日 至2020年12月31日
活期存款利息收入	21,752.49	12,318.65
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	134,341.54	97,406.50
其他	531.29	14.56
合计	156,625.32	109,739.71

#### 7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无股票投资收益。

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日 至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日 至2020年12月31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	-3,317,182.80	-1,624,086.94
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	-3,317,182.80	-1,624,086.94

##### 7.4.7.13.2 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01月01日 至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日 至2020年12月31日
卖出债券（、债转股及债券	1,249,630,726.40	407,783,359.34

到期兑付) 成交总额		
减: 卖出债券(、债转股及债券到期兑付) 成本总额	1, 221, 718, 684. 71	396, 673, 434. 80
减: 应收利息总额	31, 229, 224. 49	12, 734, 011. 48
买卖债券差价收入	-3, 317, 182. 80	-1, 624, 086. 94

#### 7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无债券投资收益—赎回差价收入。

#### 7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无债券投资收益—申购差价收入。

#### 7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

单位: 人民币元

项目	本期 2021年01月01日 至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日 至2020年12月31日
卖出资产支持证券成交总额	93, 061, 443. 91	42, 758, 889. 40
减: 卖出资产支持证券成本总额	92, 504, 515. 31	39, 511, 809. 84
减: 应收利息总额	1, 946, 121. 11	3, 386, 089. 40
资产支持证券投资收益	-1, 389, 192. 51	-139, 009. 84

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

##### 7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益—买卖权证差价收入。

##### 7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益—其他投资收益。

#### 7.4.7.15 股利收益

本基金本报告期及上年度可比期间无股利收益。

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位: 人民币元

项目名称	本期 2021年01月01日 至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日 至2020年12月31日
1. 交易性金融资产	15,585,388.65	-6,108,861.51
——股票投资	-	-
——债券投资	12,725,202.11	-5,568,467.24
——资产支持证券投资	2,860,186.54	-540,394.27
——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	15,585,388.65	-6,108,861.51

#### 7.4.7.17 其他收入

本基金本报告期及上年度可比期间无其他收入。

#### 7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日 至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日 至2020年12月31日
交易所市场交易费用	2,087.44	407.13
银行间市场交易费用	9,585.00	4,841.30
合计	11,672.44	5,248.43

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日	上年度可比期间 2020年01月01日
----	-------------------	------------------------

	至2021年12月31日	至2020年12月31日
审计费用	80,000.00	80,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
账户维护费	46,500.00	37,200.00
合计	246,500.00	237,200.00

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
长江证券（上海）资产管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
浙商银行股份有限公司	基金托管人
长江证券股份有限公司（以下简称“长江证券”）	基金管理人股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方	本期	上年度可比期间
-----	----	---------

名称	2021年01月01日至2021年12月31日		2020年01月01日至2020年12月31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	332,766,188.20	75.33%	20,534,000.00	45.02%

#### 7.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
长江证券	15,013,500,000.00	69.98%	13,892,400,000.00	91.97%

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间未产生应支付关联方的佣金。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日 至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日 至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	4,439,490.49	3,148,058.39
其中：支付销售机构的客户维护费	0.00	0.00

注：（1）本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.30%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

（2）基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前五个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021 年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020 年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,479,830.19	1,049,352.79

注：（1）本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

（2）基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前五个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 7.4.10.4 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

##### 7.4.10.4.1 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未发生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。

##### 7.4.10.4.2 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未发生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。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

项目	本期 2021年01月01日 至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日 至2020年12月31日
报告期初持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
报告期末持有的基金份额占基金 总份额比例	0.57%	0.77%

#### 7.4.10.5.2 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

本基金本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 7.4.10.6 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 2021年01月01日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
浙商银行 股份有限公司	50,847,429.69	21,752.49	817,099.27	12,318.65

注：上述银行存款由基金托管人浙商银行股份有限公司保管，按约定利率计息。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况—按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

单位：人民币元



序号	权益 登记日	除息日	每10份基 金份额分 红数	现金形式 发放总额	再投资形 式发放总 额	本期利润 分配合计	备注
1	2021-03 -26	2021-03 -26	0.090	11,713,00 3.16	-	11,713,00 3.16	-
2	2021-07 -26	2021-07 -26	0.100	15,959,94 6.24	-	15,959,94 6.24	-
3	2021-10 -18	2021-10 -18	0.100	15,959,94 6.24	-	15,959,94 6.24	-
4	2021-12 -16	2021-12 -16	0.070	11,171,96 2.37	-	11,171,96 2.37	-
合计			0.360	54,804,85 8.01	-	54,804,85 8.01	-

#### 7.4.12 期末（2021年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2021年12月31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为178,369,902.38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
092018003	20农发清发03	2022-01-05	100.63	297,000	29,887,110.00
101800366	18越秀金融MTN 002	2022-01-05	103.28	26,000	2,685,280.00
101800366	18越秀金融MTN 002	2022-01-06	103.28	174,000	17,970,720.00

101800367	18越秀金融MTN003	2022-01-04	103.28	107,000	11,050,960.00
101800367	18越秀金融MTN003	2022-01-05	103.28	148,000	15,285,440.00
101800367	18越秀金融MTN003	2022-01-06	103.28	39,000	4,027,920.00
102001041	20佛公用MTN002	2022-01-06	100.69	400,000	40,276,000.00
102101215	21华发集团MTN007	2022-01-05	100.88	200,000	20,176,000.00
1921034	19顺德农商双创债01	2022-01-05	100.74	150,000	15,111,000.00
210210	21国开10	2022-01-05	102.16	48,000	4,903,680.00
210210	21国开10	2022-01-06	102.16	105,000	10,726,800.00
2122038	21招联消费金融债03	2022-01-05	101.73	184,000	18,718,320.00
合计				1,878,000	190,819,230.00

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2021年12月31日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为317,000,000.00元，于2022年1月7日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末2021年12月31日止，本基金未持有参与转融通证券出借业务的证券。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为债券型基金，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。本基金投资的金融工具主要包括债券投资及货币市场工具等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的

范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全员与全程结合、风控与发展并重的风险管理理念。董事会主要负责公司的风险管理战略和控制政策、协调突发重大风险等事项。在公司经营管理层下设风险控制委员会，制定公司日常经营过程中各类风险的防范和管理措施；在业务操作层面，一线业务部门负责对各自业务领域风险的管控，公司具体的风险管理职责由法律合规部、风险管理部负责，组织、协调并与各业务部门共同完成对法律风险、投资风险、操作风险、合规风险等风险类别的管理，并定期向公司专门的风险控制委员会报告公司风险状况。法律合规部和风险管理部分别由合规总监和首席风险官分管，配置有合规、风控方面专业人员。本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 7.4.13.2 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、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，因此违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

##### 7.4.13.2.1 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 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	2,000,600.00	71,118,600.00

合计	2,000,600.00	71,118,600.00
----	--------------	---------------

注：（1）债券评级取自第三方评级机构的债项评级；（2）截止报告期末，本基金持有的未评级的债券包括债券期限在一年及一年以内的国债。

#### 7.4.13.2.2 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12月31日	上年度末 2020年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	125,894,000.00	86,996,000.00
合计	125,894,000.00	86,996,000.00

注：同业存单评级取自第三方评级机构的债项评级。

#### 7.4.13.2.3 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12月31日	上年度末 2020年12月31日
AAA	951,738,000.00	794,244,000.00
AAA以下	772,720,200.00	512,445,000.00
未评级	100,892,000.00	50,175,000.00
合计	1,825,350,200.00	1,356,864,000.00

注：（1）债券评级取自第三方评级机构的债项评级；（2）截止报告期末，本基金持有的未评级的债券包括债券期限在一年以上的政策性金融债。

#### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
AAA	148,792,600.00	133,825,500.00
AAA以下	-	-
未评级	71,897,500.00	50,000,000.00

合计	220,690,100.00	183,825,500.00
----	----------------	----------------

注：资产支持证券评级取自第三方评级机构的债项评级。

### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指在履行以交付现金或其他金融资产的方式结算的义务时发生资金短缺的风险。对于本基金而言，体现在所持金融工具变现的难易程度。

本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可在基金运作周期内的每个开放日要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每个开放日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

#### 7.4.13.3.1 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管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性置顶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。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金主要投资于公开发行的、信用级别较好的债券资产，高流动性资产比例较高。当在基金运作过程中遇到流动性风险时，可通过交易所回购、交易所协议回购和银行间回购、债券资产变现等多种操作缓解流动性风险。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

### 7.4.13.4 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。

#### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，此外还持有银行存款、结算备付金等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年12 月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	50,847,429.69	-	-	-	50,847,429.69
结算备付金	9,646,767.03	-	-	-	9,646,767.03
存出保证金	55,755.32	-	-	-	55,755.32
交易性金融资产	626,237,600.00	1,484,130,700.00	63,566,600.00	-	2,173,934,900.00
应收利息	-	-	-	33,441,135.81	33,441,135.81
资产总计	686,787,552.04	1,484,130,700.00	63,566,600.00	33,441,135.81	2,267,925,987.85
负债					
卖出回购金融资产款	495,369,902.38	-	-	-	495,369,902.38
应付证券清算款	-	-	-	155,418.53	155,418.53
应付管理人报酬	-	-	-	413,613.85	413,613.85
应付托管费	-	-	-	137,871.32	137,871.32
应付交易费用	-	-	-	27,326.42	27,326.42
应交税费	-	-	-	100,151.74	100,151.74
应付利息	-	-	-	-55,470.73	-55,470.73
其他负债	-	-	-	329,300.00	329,300.00
负债总计	495,369,902.38	-	-	1,108,211.13	496,478,113.51
利率敏感度缺口	191,417,649.66	1,484,130,700.00	63,566,600.00	32,332,924.68	1,771,447,874.34

上年度末 2020年12 月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	817,099.27	-	-	-	817,099.27
结算备付金	7,285,152.71	-	-	-	7,285,152.71
存出保证金	3,562.35	-	-	-	3,562.35
交易性金融资产	816,137,200.00	838,039,500.00	44,627,400.00	-	1,698,804,100.00
应收利息	-	-	-	25,782,759.37	25,782,759.37
资产总计	824,243,014.33	838,039,500.00	44,627,400.00	25,782,759.37	1,732,692,673.70
负债					
卖出回购金融资产款	423,619,212.06	-	-	-	423,619,212.06
应付证券清算款	-	-	-	78,204.79	78,204.79
应付管理人报酬	-	-	-	329,854.86	329,854.86
应付托管费	-	-	-	109,951.63	109,951.63
应付交易费用	-	-	-	15,331.47	15,331.47
应交税费	-	-	-	91,630.92	91,630.92
应付利息	-	-	-	63,234.48	63,234.48
其他负债	-	-	-	200,000.00	200,000.00
负债总计	423,619,212.06	-	-	888,208.15	424,507,420.21
利率敏感度缺口	400,623,802.27	838,039,500.00	44,627,400.00	24,894,551.22	1,308,185,253.49

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况
假设	除利率之外的其他市场变量保持不变
假设	该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动
假设	银行存款、结算备付金、存出保证金和部分应收申购款均以活期存款利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响；买入返售金融资产的利息收益和卖出回购金融资产款的利息支出在交易时已确

定，不受利率变化影响			
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12月31日	上年度末 2020年12月31日
	市场利率上升25个基点	-9,682,767.60	-4,937,783.01
市场利率下降25个基点	9,682,767.60	4,937,783.01	

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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。本基金主要投资于交易所及银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

#### 7.4.14 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) 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。

##### (b) 持续的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12月31日，本基金持有的交易性金融资产中无属于第一层次的余额，属于第二层次的余额为2,173,934,900.00元，无属于第三层次的余额。（于2020年12月31日，本基金持有的交易性金融资产中无属于第一层次的余额，属于第二层次的余额为1,698,804,100.00元，无属于第三层次的余额。）

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

##### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额



无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2021年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 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。

(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。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	2,173,934,900.00	95.86
	其中：债券	1,953,244,800.00	86.12
	资产支持证券	220,690,100.00	9.73
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	60,494,196.72	2.67
8	其他各项资产	33,496,891.13	1.48
9	合计	2,267,925,987.85	100.00

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

#### 8.2.2 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持有港股通股票。

### 8.3 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

本基金本报告期末未持有股票。

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.4.1 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

本基金本报告期末未买入股票。

#### 8.4.2 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

本基金本报告期末未卖出股票。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期无买入股票成本及卖出股票收入。

### 8.5 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	2,000,600.00	0.11
2	央行票据	-	-
3	金融债券	999,469,200.00	56.42
	其中：政策性金融债	60,684,000.00	3.43
4	企业债券	601,129,000.00	33.93
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	224,752,000.00	12.69
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	125,894,000.00	7.11
9	其他	-	-
10	合计	1,953,244,800.00	110.26

### 8.6 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	2122040	21重庆鈰渝租赁债01	1,000,000	101,080,000.00	5.71
2	2128014	21渤海银行01	800,000	80,808,000.00	4.56
3	2120061	21汉口银行小微债02	800,000	80,768,000.00	4.56
4	188350	21万联G1	800,000	80,312,000.00	4.53
5	2121043	21惠州农商小微债	800,000	80,240,000.00	4.53

### 8.7 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	193158	嘉诚2优	465,000	46,500,000.00	2.62
2	1989473	19创盈2A2	300,000	30,558,000.00	1.73
3	179884	21铁控A2	300,000	30,318,000.00	1.71
4	193508	信州1优	300,000	30,012,000.00	1.69
5	179034	橙安5A3	250,000	25,397,500.00	1.43
6	137892	广物01优	200,000	20,328,000.00	1.15
7	137100	中美5A1	250,000	15,105,000.00	0.85
8	1989405	19融享3A2	180,000	12,576,600.00	0.71
9	179033	PR5A2	250,000	9,895,000.00	0.56

### 8.8 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。

### 8.9 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。

### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据基金合同约定，本基金不得投资于股指期货。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.11.1 本期国债期货投资政策

根据基金合同约定，本基金不得投资于国债期货。

#### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体之一汉口银行股份有限公司在报告编制日前一年内被中国银行保险监督管理委员会湖北监管局处以罚款； 本基金投资的前十名证券的发行主体之一渤海银行股份有限公司在报告编制日前一年内被中国银行保险监督管理委员会处以罚款； 本基金投资的前十名证券的发行主体之一万联证券股份有限公司本期被中国证券监督管理委员会采取监管谈话措施。 本基金管理人对上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

8.12.2 根据基金合同约定，本基金不得投资于股票。本基金本报告期末未持有股票。

#### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	55,755.32
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	33,441,135.81
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	33,496,891.13

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

#### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

### §9 基金份额持有人信息

#### 9.1 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
2	871,852,063.45	1,743,704,126.90	100.00%	0.00	0.00%

#### 9.2 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%

#### 9.3 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	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

#### 9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份 额占基 金总份 额比例	发起份 额总数	发起份 额占基 金总份 额比例	发起份额承 诺持有期限
基金管理人固有	10,000,000.00	0.57%	10,000,000.00	0.57%	3年

资金					
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,000.00	0.57%	10,000,000.00	0.57%	-

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2018年08月16日)基金份额总额	309,999,000.00
本报告期期初基金份额总额	1,301,444,796.01
本报告期基金总申购份额	442,259,330.89
减：本报告期基金总赎回份额	-
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,743,704,126.90

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 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

1、本报告期内，自2021年1月22日起，吴迪先生担任本基金管理人首席风险官；董来富先生离任本基金管理人副总经理、首席风险官；范海蓉女士离任本基金管理人副总经理。

2、本报告期内，自2021年4月20日起，杨忠先生担任本基金管理人总经理；唐吟波女士离任本基金管理人总经理。

3、本报告期内，自2021年12月27日起，谷松女士离任本基金管理人副总经理。

4、本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及对公司运营管理和基金运作产生重大影响的，与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

#### 11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内未改变投资策略。

#### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期应支付给中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 80,000.00 元人民币。本基金本报告期内继续选聘中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务，该审计机构自基金合同生效日起为本基金提供审计服务。

#### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

1、本报告期内，中国证券监督管理委员会对本基金管理人采取责令改正的监管措施，并对相关高级管理人员采取监管谈话措施。截至本报告披露日，本基金管理人已按要求完成整改。

2、本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员未受到监管部门的稽查或处罚。

#### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

##### 11.7.1 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	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-

注：1、基金专用交易单元的选择标准如下：

- (1) 资历雄厚，信誉良好，注册资本不少于2亿元人民币；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金公司进行证券交易的需要，并能为基金公司提供全面的信息服务；
- (6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为基金提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析报告、个股分析报告及其他专

门报告，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

2、基金专用交易单元的选择程序如下：

我司根据上述标准，选定符合条件的证券公司作为租用交易单元的对象，并签订交易单元租用协议。公司的投资和研究部门定期对所选证券公司的服务进行综合评比，评比内容包括：提供宏观、行业、策略、专题、公司等研究报告的质量和数量；组织相关研讨会议的数量和质量；协助安排上市公司调研的质量和数量；主动进行上门路演和反路演的数量和质量；以及其他及时性及提供研究服务主动性和质量等情况。最终公司统一依据评比结果确定交易单元交易的具体情况。

3、本报告期内，本基金租用的券商交易单元未发生变更。

### 11.7.2 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	
	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
长江证券	332,766,188.20	75.33%	15,013,500,000.00	69.98%
东方证券	109,004,500.00	24.67%	6,439,875,000.00	30.02%

### 11.8 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	长江乐鑫纯债定期开放债券型发起式证券投资基金2020年第四季度报告	规定网站	2021-01-22
2	长江证券（上海）资产管理有限公司旗下部分基金2020年第四季度报告提示性公告	规定报刊	2021-01-22
3	长江证券（上海）资产管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	规定报刊、网站	2021-01-23
4	长江证券（上海）资产管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	规定报刊、网站	2021-01-23
5	长江证券（上海）资产管理有限公司关于长江乐鑫纯债定期开放债券型发起式证券投资基金第九个开放期开放申购与赎回业务的公告	规定报刊、网站	2021-03-03
6	长江证券（上海）资产管理有限公司关于	规定报刊、网站	2021-03-17



	公司董事变更的公告		
7	长江乐鑫纯债定期开放债券型发起式证券投资基金分红公告	规定报刊、网站	2021-03-25
8	长江乐鑫纯债定期开放债券型发起式证券投资基金2020年年度报告	规定网站	2021-03-31
9	长江证券（上海）资产管理有限公司旗下部分基金2020年年度报告提示性公告	规定报刊	2021-03-31
10	长江证券（上海）资产管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	规定报刊、网站	2021-04-21
11	长江乐鑫纯债定期开放债券型发起式证券投资基金2021年第一季度报告	规定网站	2021-04-22
12	长江证券（上海）资产管理有限公司旗下全部基金2021年第一季度报告提示性公告	规定报刊	2021-04-22
13	长江证券（上海）资产管理有限公司关于网上交易系统升级维护的公告	规定报刊、网站	2021-04-27
14	长江证券（上海）资产管理有限公司关于开展网上服务系统应急演练的公告	规定报刊、网站	2021-05-20
15	长江证券（上海）资产管理有限公司关于长江乐鑫纯债定期开放债券型发起式证券投资基金第十个开放期开放申购与赎回业务的公告	规定报刊、网站	2021-06-10
16	长江证券（上海）资产管理有限公司关于网上服务系统升级维护的公告	规定报刊、网站	2021-07-15
17	长江乐鑫纯债定期开放债券型发起式证券投资基金2021年第二季度报告	规定网站	2021-07-21
18	长江证券（上海）资产管理有限公司旗下部分基金2021年第二季度报告提示性公告	规定报刊	2021-07-21
19	长江乐鑫纯债定期开放债券型发起式证券投资基金分红公告	规定报刊、网站	2021-07-23
20	长江证券（上海）资产管理有限公司关于修改长江乐鑫纯债定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同和托管协议的公告	规定报刊、网站	2021-07-27
21	长江乐鑫纯债定期开放债券型发起式证券	规定网站	2021-07-27

	投资基金基金合同		
22	长江乐鑫纯债定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议	规定网站	2021-07-27
23	长江证券（上海）资产管理有限公司关于网上服务系统升级维护的公告	规定报刊、网站	2021-07-30
24	长江乐鑫纯债定期开放债券型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新	规定网站	2021-07-30
25	长江乐鑫纯债定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书（更新）（2021年7月30日更新）	规定网站	2021-07-30
26	长江乐鑫纯债定期开放债券型发起式证券投资基金2021年中期报告	规定网站	2021-08-30
27	长江证券（上海）资产管理有限公司旗下部分基金2020年中期报告提示性公告	规定报刊	2021-08-30
28	长江证券（上海）资产管理有限公司关于长江乐鑫纯债定期开放债券型发起式证券投资基金第十一个开放期开放申购与赎回业务的公告	规定报刊、网站	2021-09-16
29	长江证券（上海）资产管理有限公司关于网上交易系统暂停服务的公告	规定报刊、网站	2021-10-14
30	长江乐鑫纯债定期开放债券型发起式证券投资基金分红公告	规定报刊、网站	2021-10-16
31	长江乐鑫纯债定期开放债券型发起式证券投资基金2021年第三季度报告	规定网站	2021-10-27
32	长江证券（上海）资产管理有限公司旗下部分基金2021年第三季度报告提示性公告	规定报刊	2021-10-27
33	长江证券（上海）资产管理有限公司关于开展网上服务系统应急演练的公告	规定报刊、网站	2021-11-11
34	长江证券（上海）资产管理有限公司关于网上服务系统升级维护的公告	规定报刊、网站	2021-12-02
35	长江证券（上海）资产管理有限公司关于网上交易系统升级维护的公告	规定报刊、网站	2021-12-13
36	长江乐鑫纯债定期开放债券型发起式证券	规定报刊、网站	2021-12-16

	投资基金分红公告		
37	长江证券（上海）资产管理有限公司关于长江乐鑫纯债定期开放债券型发起式证券投资基金第十二个开放期开放申购与赎回业务的公告	规定报刊、网站	2021-12-27
38	长江证券（上海）资产管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	规定报刊、网站	2021-12-29

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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	20210101-20211231	1,291,444,796.01	442,259,330.89	-	1,733,704,126.90	99.43%
产品特有风险							
<p>报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过 20%的情况，由此可能导致的特有风险包括但不限于：当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；如个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定延缓支付赎回款项或延期办理赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理；持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。</p>							

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金单一投资者持有的基金份额或者构成一致行动人的多个投资者持有的基金份额可达到或者超过50%，本基金不向个人投资者销售。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

1、中国证监会准予长江乐鑫纯债定期开放债券型发起式证券投资基金募集申请的注册文件

- 2、长江乐鑫纯债定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同
- 3、长江乐鑫纯债定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书
- 4、长江乐鑫纯债定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议
- 5、法律意见书
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 7、本报告期内按照规定披露的各项公告

### 13.2 存放地点

存放地点为基金管理人办公地址：上海市浦东新区世纪大道1198号世纪汇一座27层。

### 13.3 查阅方式

投资者可在营业时间至基金管理人办公地点免费查阅，亦可通过基金管理人网站查阅，网址为[www.cjzcg1.com](http://www.cjzcg1.com)。

长江证券（上海）资产管理有限公司  
二〇二二年三月三十一日