

# 长信先优债券型证券投资基金 2021 年第 2 季度报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：长信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 7 月 21 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国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 7 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 4 月 1 日起至 2021 年 6 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

|            |  |
|------------|--|
| 基金简称       | 长信先优债券   |
| 基金主代码      | 004885   |
| 交易代码       | 004885   |
| 基金运作方式     | 契约型开放式   |
| 基金合同生效日    | 2017 年 8 月 1 日   |
| 报告期末基金份额总额 | 191,294,305.40 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的前提下，力争获取高于业绩比较基准的投资收益，为投资者提供稳定增长的投资收益。  |
| 投资策略       | <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金将利用全球信息平台、外部研究平台、行业信息平台以及自身的研究平台等信息资源，基于本基金的投资目标和投资理念，从宏观和微观两个角度进行研究，开展战略资产配置，之后通过战术资产配置再平衡基金资产组合，实现组合内各类别资产的优化配置，并对各类资产的配置比例进行定期或不定期调整。</p> <p>2、债券投资策略 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 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</p> |

|        |   |
|--------|---|
|        | <p>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 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<br/>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 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 | 中债综合指数收益率*80%+中证 500 指数收益率*20%  |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，其预期风险与收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。  |
| 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  |

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标          | 报告期（2021年4月1日—2021年6月30日） |
|-----------------|---------------------------|
| 1. 本期已实现收益      | 1,196,951.73              |
| 2. 本期利润         | 1,513,614.44              |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0381                    |
| 4. 期末基金资产净值     | 210,247,335.77            |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.0991                    |

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

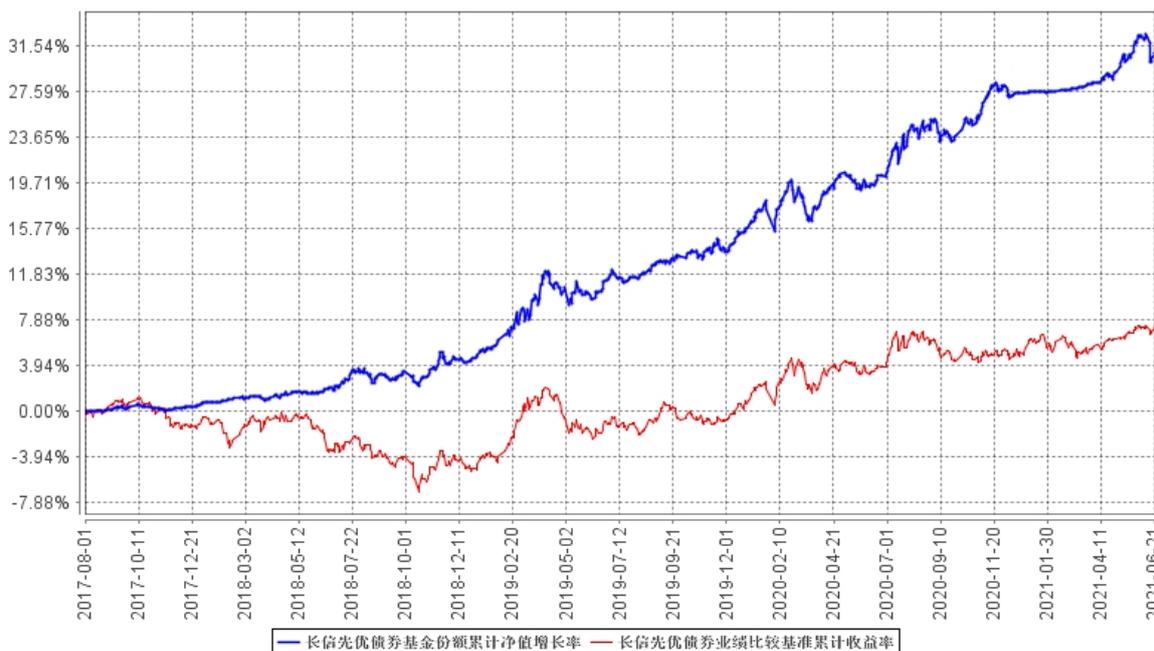
## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段             | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基准<br>收益率标准差<br>④ | ①—③    | ②—④    |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|--------|
| 过去三个月          | 2.51%      | 0.26%         | 2.10%          | 0.14%                 | 0.41%  | 0.12%  |
| 过去六个月          | 3.15%      | 0.19%         | 1.97%          | 0.20%                 | 1.18%  | -0.01% |
| 过去一年           | 9.20%      | 0.25%         | 3.18%          | 0.24%                 | 6.02%  | 0.01%  |
| 过去三年           | 28.73%     | 0.26%         | 10.72%         | 0.29%                 | 18.01% | -0.03% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 31.56%     | 0.23%         | 7.62%          | 0.28%                 | 23.94% | -0.05% |

### 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

长信先优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 2017 年 8 月 1 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日起 6 个月内为建仓期。建仓期结束时，本基金的各项投资比例已符合基金合同的约定。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务  | 任本基金的基金经理期限 |      | 证券从业年限 | 说明   |
|----|---|-------------|------|--------|--|
|    |   | 任职日期        | 离任日期 |        |  |
| 朱垚 | 长信先优债券型证券投资基金、长信乐信灵活配置混合型证券投资基金、长信利发债券型证券投资基金、长信合利混合型证券投资基金和长信添利安心收益混合型证券投资基金的基金经理。   | 2019年5月16日  | -    | 8年     | 复旦大学金融学专业硕士毕业。具有基金从业资格，2013年加入长信基金管理有限责任公司，曾任长信基金管理有限责任公司研究发展部基金经理助理兼研究员，现任长信先优债券型证券投资基金、长信乐信灵活配置混合型证券投资基金、长信利发债券型证券投资基金、长信合利混合型证券投资基金和长信添利安心收益混合型证券投资基金的基金经理。   |
| 黄韵 | 长信改革红利灵活配置混合型证券投资基金、长信新利灵活配置混合型证券投资基金、长信多利灵活配置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、长信利发债券型证券投资基金、长信先优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、长信合利混合型证券投资基金和长信利泰灵 | 2018年12月8日  | -    | 15年    | 经济学硕士，武汉大学金融学专业研究生毕业，具备基金从业资格。曾任职于三九企业集团；2006年加入长信基金管理有限责任公司，历任行业研究员、基金经理助理、长信恒利优势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和长信创新驱动股票型证券投资基金的基金经理。现任绝对收益部总监、长信改革红利灵活配置混合型证券投资基金、长信新利灵活配置混合型证券投资基金、长信多利灵活配置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、长信利发债券型证券投资基金、长信先优债券型证券投资基金、长信利 |

|    |                                  |                  |   |     |   |
|----|----------------------------------|------------------|---|-----|---|
|    | 活配置混合型证券投资基金的基金经理、绝对收益部总监        |                  |   |     | 信灵活配置混合型证券投资基金、长信合利混合型证券投资基金和长信利泰灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。  |
| 程放 | 长信先优债券型证券投资基金和长信利发债券型证券投资基金的基金经理 | 2020 年 12 月 31 日 | - | 8 年 | 北京大学金融学硕士毕业，具有基金从业资格。曾任职于广发银行股份有限公司、兴银基金管理有限责任公司，2020 年 8 月加入长信基金管理有限责任公司，现任长信先优债券型证券投资基金和长信利发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；
- 3、自 2021 年 7 月 16 日起，黄韵不再担任本基金的基金经理。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

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

## 4.3 公平交易专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

### 4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

债券方面，报告期内货币市场维持中性略宽松格局，债券收益率震荡下行，略超预期，久期策略优于票息策略。本基金纯债部分减持了部分信用债，增配了利率债和高等级 AAA 信用债，增加了组合久期。纯债市场整体对基本面数据有所钝化，后续组合仍会对经济高频数据保持关注。转债市场在报告期内整体超预期上涨，组合在季度初增配了顺周期和中低价品种，一方面看好转债市场估值的修复；另一方面认为中小盘股的估值会出现修复，可以借助转债进行参与。随着转债估值的上涨，本基金部分持仓中低价品种切换成了平衡型品种，整体看，组合在债券方面的策略获得了一定收益。

权益方面，过去两年优质赛道股的估值出现了明显抬升。经过上半年市场调整，后续组合考虑结合宏观基本面环境和行业修复情况，自下而上精选估值相对合理的个股建仓机会，但整体仍保持中低仓位。

### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 6 月 30 日，长信先优债券份额净值为 1.0991 元，份额累计净值为 1.3091 元，本报告期内长信先优债券净值增长率为 2.51%，同期业绩比较基准收益率为 2.10%。

### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

自 2021 年 4 月 7 日至 2021 年 5 月 6 日，本基金资产净值已连续二十个工作日低于五千万元。自 2021 年 6 月 17 日起至报告期末，本基金资产净值高于五千万元。

## §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 | -     | -            |

|   |                   |                |        |
|---|-------------------|----------------|--------|
|   | 其中：股票             | -              | -      |
| 2 | 基金投资              | -              | -      |
| 3 | 固定收益投资            | 176,191,886.82 | 80.27  |
|   | 其中：债券             | 176,191,886.82 | 80.27  |
|   | 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          | 22,000,125.00  | 10.02  |
|   | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -              | -      |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计      | 9,424,345.21   | 4.29   |
| 8 | 其他资产              | 11,870,930.82  | 5.41   |
| 9 | 合计                | 219,487,287.85 | 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

注：本基金本报告期末未持有股票。

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未通过港股通交易机制投资港股。

## 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

### 5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

注：本基金本报告期末未持有股票。

### 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      | 37,405,956.50 | 17.79        |
| 2  | 央行票据      | -             | -            |
| 3  | 金融债券      | 85,272,115.00 | 40.56        |
|    | 其中：政策性金融债 | 45,227,115.00 | 21.51        |

|    |           |                |       |
|----|-----------|----------------|-------|
| 4  | 企业债券      | 10,014,000.00  | 4.76  |
| 5  | 企业短期融资券   | -              | -     |
| 6  | 中期票据      | 4,983,500.00   | 2.37  |
| 7  | 可转债（可交换债） | 38,516,315.32  | 18.32 |
| 8  | 同业存单      | -              | -     |
| 9  | 其他        | -              | -     |
| 10 | 合计        | 176,191,886.82 | 83.80 |

### 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  | 190208  | 19 国开 08   | 200,000 | 20,226,000.00 | 9.62         |
| 2  | 210202  | 21 国开 02   | 200,000 | 20,018,000.00 | 9.52         |
| 3  | 2128012 | 21 浦发银行 01 | 100,000 | 10,088,000.00 | 4.80         |
| 4  | 2128003 | 21 建设银行小微债 | 100,000 | 10,062,000.00 | 4.79         |
| 5  | 188135  | 21 华能 01   | 100,000 | 10,014,000.00 | 4.76         |

### 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。

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

报告期内本基金投资的前十名证券中,发行主体上海浦东发展银行股份有限公司于 2020 年 8 月 10 日收到上海银保监局行政处罚信息公开表(沪银保监银罚决字(2020)12号),根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第(五)项等,经查,上海浦东发展银行股份有限公

司 2013 年至 2018 年存在下列违法违规事实：未按专营部门制规定开展同业业务；同业投资资金违规投向“四证”不全的房地产项目；延迟支付同业投资资金吸收存款；为银行理财资金投向非标准化债权资产违规提供担保；未按规定进行贷款资金支付管理与控制；个人消费贷款贷后管理未尽职；通过票据转贴现业务调节信贷规模；银行承兑汇票业务保证金来源审核未尽职；办理无真实贸易背景的贴现业务；委托贷款资金来源审查未尽职；未按权限和程序办理委托贷款业务；未按权限和程序办理非融资性保函业务。综上，中国银行保险监督管理委员会上海监管局决定对上海浦东发展银行股份有限公司采取责令改正措施，并处罚款共计 2100 万元。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体上海浦东发展银行股份有限公司于 2021 年 4 月 23 日收到中国银行保险监督管理委员会上海监管局（沪银保监罚决字（2021）29 号），根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第（五）项、《中国银监会关于规范商业银行代理销售业务的通知》（银监发〔2016〕24 号），经查，上海浦东发展银行股份有限公司 2016 年 5 月至 2019 年 1 月，公司未按规定开展代销业务。综上，中国银行保险监督管理委员会上海监管局决定对上海浦东发展银行股份有限公司采取责令改正措施，并处罚款共计 760 万元。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体招商银行股份有限公司于 2021 年 5 月 17 日收到中国银行保险监督管理委员会行政处罚决定书（银保监罚决字（2021）16 号），根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十五条、第四十六条和相关审慎经营规则，经查，招商银行股份有限公司存在一、为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产；二、违规协助无衍生产品交易业务资格的银行发行结构性衍生产品；三、理财产品之间风险隔离不到位；四、理财资金投资非标准化债权资产认定不准确，实际余额超监管标准；五、同业投资接受第三方金融机构信用担保；六、理财资金池化运作；七、利用理财产品准备金调节收益；八、高净值客户认定不审慎；九、并表管理不到位，通过关联非银机构的内部交易，违规变相降低理财产品销售门槛；十、投资集合资金信托计划的理财产品未执行合格投资者标准；十一、投资集合资金信托计划人数超限；十二、面向不合格个人投资者销售投资高风险资产或权益性资产的理财产品；十三、信贷资产非真实转让；十四、全权委托业务不规范；十五、未按要求向监管机构报告理财投资合作机构，被监管否决后仍未及时停办业务；十六、通过关联机构引入非合格投资者，受让以本行信用卡债权设立的信托次级受益权；十七、“智能投资受托计划业务”通过其他方式规避整改，扩大业务规模，且业务数据和材料缺失；十八、票据转贴现假卖断屡查屡犯；十九、贷款、理财或同业投资资金违规投向土地储备项目；二十、理财资金违规提供棚改项目资本金融资，向地方政府提供融资并要求地方政府提供担保；二十一、同业投资、理财资金等违规投向地价款或四证不全的房地产项目；二十二、理财资金认

购商业银行增发的股票；二十三、违规为企业发行短期融资券提供搭桥融资，并用理财产品投资本行主承债券以承接表内类信贷资产；二十四、为定制公募基金提供投资顾问；二十五、为本行承销债券兑付提供资金支持；二十六、协助发行人以非市场化的价格发行债券；二十七、瞒报案件信息。综上，中国银行保险监督管理委员会给予公司罚款 7170 万元。

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六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   | 10,957.47     |
| 2  | 应收证券清算款 | -             |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 1,799,442.35  |
| 5  | 应收申购款   | 10,060,531.00 |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 其他      | -             |
| 8  | 合计      | 11,870,930.82 |

### 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  | 113044 | 大秦转债     | 2,778,570.00 | 1.32         |
| 2  | 110053 | 苏银转债     | 2,305,840.00 | 1.10         |
| 3  | 110048 | 福能转债     | 2,011,714.80 | 0.96         |
| 4  | 113034 | 滨化转债     | 1,728,200.00 | 0.82         |
| 5  | 128113 | 比音转债     | 1,719,200.00 | 0.82         |
| 6  | 132018 | G 三峡 EB1 | 1,441,440.00 | 0.69         |
| 7  | 113550 | 常汽转债     | 1,394,160.00 | 0.66         |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 8  | 123067 | 斯莱转债 | 1,315,642.50 | 0.63 |
| 9  | 110072 | 广汇转债 | 1,192,490.00 | 0.57 |
| 10 | 113537 | 文灿转债 | 1,096,860.00 | 0.52 |
| 11 | 113516 | 苏农转债 | 1,059,500.00 | 0.50 |
| 12 | 128136 | 立讯转债 | 994,075.00   | 0.47 |
| 13 | 113548 | 石英转债 | 871,635.60   | 0.41 |
| 14 | 110074 | 精达转债 | 865,100.00   | 0.41 |
| 15 | 113504 | 艾华转债 | 627,640.00   | 0.30 |
| 16 | 113012 | 骆驼转债 | 627,100.00   | 0.30 |
| 17 | 123083 | 朗新转债 | 430,045.00   | 0.20 |

### 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：本基金本报告期末未持有股票。

### 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

|                           |                |
|---------------------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 93,740,046.73  |
| 报告期期间基金总申购份额              | 190,474,634.72 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 92,920,376.05  |
| 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               | 191,294,305.40 |

## §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

单位：份

|                          |               |
|--------------------------|---------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额         | 0.00          |
| 报告期期间买入/申购总份额            | 27,592,899.19 |
| 报告期期间卖出/赎回总份额            | 0.00          |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额         | 27,592,899.19 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 14.42         |

注：基金管理人运用固有资金投资本基金费率按本基金招募说明书中公布的费率执行。

## 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

| 序号 | 交易方式 | 交易日期            | 交易份额（份）       | 交易金额（元）       | 适用费率 |
|----|------|-----------------|---------------|---------------|------|
| 1  | 申购   | 2021 年 6 月 17 日 | 27,592,899.19 | 30,000,000.00 |      |
| 合计 |      |                 | 27,592,899.19 | 30,000,000.00 |      |

注：基金管理人运用固有资金投资本基金费率按本基金招募说明书中公布的费率执行。本报告期基金管理人运用固有资金投资本基金适用费率为每笔 1000 元。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 |                                 |               |               |               | 报告期末持有基金情况    |        |
|-------|----------------|---------------------------------|---------------|---------------|---------------|---------------|--------|
|       | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间         | 期初份额          | 申购份额          | 赎回份额          | 持有份额          | 份额占比   |
| 机构    | 1              | 2021 年 4 月 1 日至 2021 年 4 月 21 日 | 13,310,021.51 | 7,313,702.28  | 13,310,021.51 | 7,313,702.28  | 3.82%  |
|       | 2              | 2021 年 4 月 1 日至 2021 年 4 月 6 日  | 15,687,951.05 | 0.00          | 15,687,951.05 | 0.00          | 0.00%  |
|       | 3              | 2021 年 4 月 7 日至 2021 年 6 月 6 日  | 8,000,000.00  | 0.00          | 8,000,000.00  | 0.00          | 0.00%  |
|       | 4              | 2021 年                          | 0.00          | 27,592,899.19 | 0.00          | 27,592,899.19 | 14.42% |

|   |   |  |   |   |   |   |   |
|---|---|--|---|---|---|---|---|
|   |   | 6 月 17<br>日 至<br>2021 年<br>6 月 27<br>日 |   |   |   |   |   |
| 个人  | - | -                                      | - | - | - | - | - |
| 产品特有风险  |   |  |   |   |   |   |   |
| <p>1、基金净值大幅波动的风险<br/>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<br/>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<br/>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、《长信先优债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长信先优债券型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《长信先优债券型证券投资基金托管协议》；
- 5、报告期内在指定报刊上披露的各种公告的原稿；
- 6、长信基金管理有限责任公司营业执照、公司章程及相关资格批复文件。

### 9.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

### 9.3 查阅方式

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

长信基金管理有限责任公司

2021 年 7 月 21 日