

长信利泰灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第 2 季度报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：长信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国民生银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 7 月 21 日

§ 1 重要提示

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

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金基金合同的规定，于 2021 年 7 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

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

§ 2 基金产品概况

基金简称	长信利泰混合
基金主代码	519951
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 3 月 23 日
报告期末基金份额总额	976,785,198.02 份
投资目标	本基金在有效控制组合风险并保持良好流动性的前提下，通过专业化研究分析，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金将通过跟踪考量通常的宏观经济变量（包括 GDP 增长率、CPI 走势、M2 的绝对水平和增长率、利率水平与走势等）以及各项国家政策（包括财政、税收、货币、汇率政策等），并结合美林时钟等科学严谨的资产配置模型，动态评估不同资产大类在不同时期的投资价值及其风险收益特征，追求股票、债券和货币等大类资产的灵活配置和稳健的绝对收益目标。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>（1）行业配置策略</p> <p>（2）个股投资策略</p> <p>（3）存托凭证投资策略</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>（1）久期策略</p> <p>（2）收益率曲线策略</p> <p>（3）骑乘策略</p> <p>（4）息差策略</p>

	(5) 个券选择策略 (6) 信用策略 (7) 中小企业私募债投资策略 4、其他类型资产投资策略 (1) 权证投资策略 (2) 资产支持证券投资策略 (3) 股指期货投资策略		
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*50%+中证综合债指数收益率*50%		
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于中等风险、中等收益的基金品种，其预期风险和预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。		
基金管理人	长信基金管理有限责任公司		
基金托管人	中国民生银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	长信利泰混合 A	长信利泰混合 C	长信利泰混合 E
下属分级基金的场内简称	CXLTA	-	-
下属分级基金的交易代码	519951	007863	008071
报告期末下属分级基金的份额总额	67,637,127.38 份	29,600,137.20 份	879,547,933.44 份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2021年4月1日—2021年6月30日）		
	长信利泰混合 A	长信利泰混合 C	长信利泰混合 E
1. 本期已实现收益	318,161.86	83,947.75	-3,367,513.60
2. 本期利润	2,154,193.83	818,571.11	5,523,365.76
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0204	0.0200	0.0063
4. 期末基金资产净值	103,993,866.92	45,232,167.51	1,313,985,929.17
5. 期末基金份额净值	1.5375	1.5281	1.4939

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

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

数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

长信利泰混合 A

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.79%	0.29%	2.42%	0.49%	-1.63%	-0.20%
过去六个月	0.56%	0.44%	1.47%	0.66%	-0.91%	-0.22%
过去一年	11.60%	0.41%	14.21%	0.66%	-2.61%	-0.25%
过去三年	49.85%	0.55%	32.81%	0.68%	17.04%	-0.13%
过去五年	55.44%	0.46%	44.11%	0.59%	11.33%	-0.13%
自基金合同生效起至今	56.68%	0.45%	42.99%	0.58%	13.69%	-0.13%

长信利泰混合 C

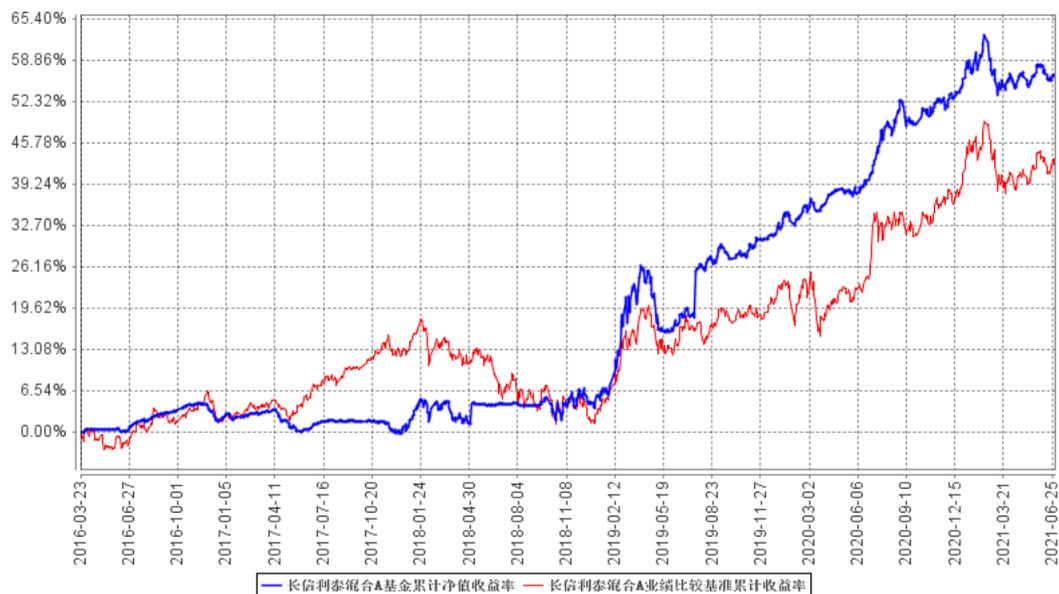
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.77%	0.29%	2.42%	0.49%	-1.65%	-0.20%
过去六个月	0.51%	0.44%	1.47%	0.66%	-0.96%	-0.22%
过去一年	11.48%	0.41%	14.21%	0.66%	-2.73%	-0.25%
自份额增加日起至今	22.28%	0.35%	22.38%	0.64%	-0.10%	-0.29%

长信利泰混合 E

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.42%	0.29%	2.42%	0.49%	-2.00%	-0.20%
过去六个月	-0.19%	0.44%	1.47%	0.66%	-1.66%	-0.22%
过去一年	9.97%	0.41%	14.21%	0.66%	-4.24%	-0.25%
自份额增加日起至今	18.73%	0.35%	20.18%	0.66%	-1.45%	-0.31%

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

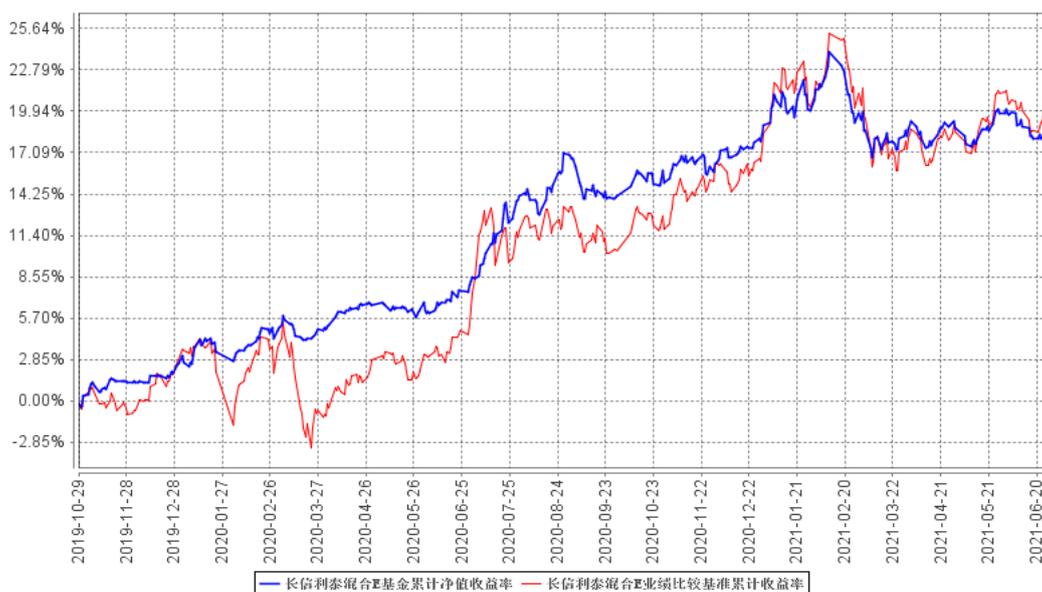
长信利泰混合A基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



长信利泰混合C基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



长信利泰混合E基金累计净值收益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 2019 年 8 月 23 日起对长信利泰灵活配置混合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，基金管理人自 2019 年 10 月 29 日起增设了长信利泰灵活配置混合型证券投资基金 E 类份额。

2、长信利泰混合 A 图示日期为 2016 年 3 月 23 日至 2021 年 6 月 30 日，长信利泰混合 C 图示日期为 2019 年 8 月 23 日（份额增加日）至 2021 年 6 月 30 日，长信利泰混合 E 图示日期为 2019 年 10 月 29 日（份额增加日）至 2021 年 6 月 30 日。

3、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		
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	2019年12月9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

	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活配置混合型证券投资基金的基金经理、绝对收益部总监				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。
朱昊	长信利泰灵活配置混合型证券投资基金的基金经理	2020 年 12 月 31 日	-	6 年	复旦大学公共管理硕士毕业，具有基金从业资格。曾任职于宁波银行股份有限公司、天风证券股份有限公司等，2015 年 4 月加入长信基金管理有限责任公司，历任股票交易员、专户投资经理、基金经理助理，现任长信利泰灵活配置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；
- 3、自 2021 年 7 月 6 日，叶松开始担任本基金的基金经理；
- 4、自 2021 年 7 月 16 日，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

整体来看，市场在二季度整体呈上涨趋势。期间上证指数涨幅为 4.34%，沪深 300 指数涨幅为 3.48%，中小板指数涨幅为 11.29%，创业板指数涨幅为 26.05%。

从申万标准划分的行业结构看，二季度电气设备、电子、汽车、综合等行业指数涨幅靠前。家用电器、农林牧渔、房地产、公用事业等行业指数涨幅靠后。整体看，中小市值公司的涨幅相对显著。

二季度基金的权益持仓相对一季度而言做了一些调整，主要是依据基本面的变化进行了个股的调整。债券持仓则增加了债券组合久期。

回顾 2021 年二季度的情况，随着国内低基数效应的减弱，国内经济同比增速趋于下行。市场对于经济增长的预期也出现了向下的修正。年初市场普遍担忧的美债收益率和通胀预期的影响在二季度的出现了显著的缓解。展望未来一个季度，从总量上看国内下半年可能还会出现信用和杠杆的收紧，经济增速整体边际趋缓，更加关注经济的增长质量。从权益市场看，二季度传统经济板块和新兴经济板块出现了分化，市场对高景气和高成长行业给予了较高的估值和预期，一些传

统周期板块的估值则出现了下行，反映的是投资者对未来可能出现的经济结构的预期变化。随着权益市场分化的加大以及估值水平的提升，对于权益而言更重要的还是寻找到质地优秀和盈利置信度较好的公司，历史上看优质企业才是穿越牛熊的根本所在。从债券市场看，二季度长债收益率出现了显著的下行，未来仍将保持对于经济数据的跟踪。

展望未来一个季度，从宏观角度看，国内经济的边际变化和全球流动性的退出情况是重要的跟踪指标。权益方面，基金仍将继续持有那些质地优秀，行业发展向好，业绩增长确定性较高，估值相对合理的公司。同时，继续挑选那些盈利可能出现改善的优质公司，等待合适的买入时机。债券方面，二季度已经拉长了组合久期，未来继续跟踪经济数据变化情况。

整体看，基金将以稳定收益的回报作为主要的目标，积极通过各类型的资产配置来为投资者获取稳定的回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 6 月 30 日，长信利泰混合 A 份额净值为 1.5375 元，份额累计净值为 1.5565 元，本报告期内长信利泰混合 A 净值增长率为 0.79%；长信利泰混合 C 份额净值为 1.5281 元，份额累计净值为 1.5281 元，本报告期内长信利泰混合 C 净值增长率为 0.77%；长信利泰混合 E 份额净值为 1.4939 元，份额累计净值为 1.4939 元，本报告期内长信利泰混合 E 净值增长率为 0.42%，同期业绩比较基准收益率为 2.42%。

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	247,483,993.72	16.88
	其中：股票	247,483,993.72	16.88
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,167,603,308.30	79.64
	其中：债券	1,167,603,308.30	79.64
	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	20,000,130.00	1.36
	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	15,263,186.78	1.04
8	其他资产	15,741,153.59	1.07
9	合计	1,466,091,772.39	100.00

注：本基金本报告期末未通过港股通交易机制投资港股。本基金本报告期末未参与转融通证券出借业务。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	5,850.78	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	187,364,285.63	12.80
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,662.00	0.00
E	建筑业	25,371.37	0.00
F	批发和零售业	46,404.58	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	6,634,276.50	0.45
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,152,272.71	0.63
J	金融业	20,110,265.60	1.37
K	房地产业	10,095.90	0.00
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	24,059,740.32	1.64
N	水利、环境和公共设施管理业	70,768.33	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	247,483,993.72	16.91

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未通过港股通交易机制投资港股。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	22,761	46,812,548.70	3.20
2	000858	五粮液	120,313	35,840,039.57	2.45
3	002415	海康威视	374,200	24,135,900.00	1.65
4	603259	药明康德	153,648	24,059,740.32	1.64
5	000596	古井贡酒	78,800	18,872,600.00	1.29
6	600036	招商银行	212,800	11,531,632.00	0.79
7	600690	海尔智家	421,000	10,908,110.00	0.75
8	002372	伟星新材	494,931	9,900,223.77	0.68
9	600570	恒生电子	97,930	9,131,972.50	0.62
10	603369	今世缘	155,200	8,405,632.00	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	30,123,000.00	2.06
2	央行票据	-	-
3	金融债券	642,745,000.00	43.93
	其中：政策性金融债	371,000,000.00	25.36
4	企业债券	110,865,000.00	7.58
5	企业短期融资券	160,594,000.00	10.98
6	中期票据	221,476,700.00	15.14
7	可转债（可交换债）	1,799,608.30	0.12
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,167,603,308.30	79.80

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	210203	21 国开 03	1,100,000	110,319,000.00	7.54
2	2128012	21 浦发银行 01	800,000	80,704,000.00	5.52
3	190203	19 国开 03	600,000	60,468,000.00	4.13
4	190208	19 国开 08	500,000	50,565,000.00	3.46
5	2128013	21 交通银行小微债	500,000	50,310,000.00	3.44

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**5.10.1 本期国债期货投资政策**

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

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

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。

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，海通证券股份有限公司于 2021 年 3 月 30 日公告公司于近日收到中国证券监督管理委员会上海监管局出具的《关于对海通证券股份有限公司采取责令增加合规检查次数、责令暂停部分业务措施的决定》（沪证监决〔2021〕40 号）。经查，公司在业务开展过程中存在以下情况：一是公司在开展部分投资顾问、私募资产管理业务过程中，未按照审慎经营原则，有效控制和防范风险，未能审慎评估公司经营管理行为对证券市场的影响。二是公司未将相关业务行为纳入全面合规风控体系，合规风控机制存在缺失；三是公司投资银行业务内部控制存在漏洞，债券承销与资产管理等业务缺少有效隔离，利益冲突审查机制存在缺失。依据《证券公司监督管理条例》第七十条第一款第一项、第六项的规定，上海证监局决定对公司采取如下监督管理措施：一是责令你公司自本决定作出之日起 1 年内，每 3 个月开展一次内部合规检查，并在每次检查后 10 个工作日内，向上海证监局报送合规检查报告；二是责令公司自本决定作出之日起 12 个月内，暂停为机构投资者提供债券投资顾问业务。

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

报告期内本基金投资的前十名证券中其余七名的发行主体未出现被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

报告期内本基金投资的前十名股票中，不存在超出基金合同规定备选股票库的情形。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	257,073.57
2	应收证券清算款	861,376.42
3	应收股利	-

4	应收利息	14,614,664.05
5	应收申购款	8,039.55
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	15,741,153.59

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002372	伟星新材	4,837,500.00	0.33	大宗交易

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长信利泰混合 A	长信利泰混合 C	长信利泰混合 E
报告期期初基金份额总额	145,449,578.20	50,626,001.73	880,017,155.40
报告期期间基金总申购份额	1,744,715.41	13,236.22	-
减：报告期期间基金总赎回份额	79,557,166.23	21,039,100.75	469,221.96
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	67,637,127.38	29,600,137.20	879,547,933.44

§ 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

注：本基金本报告期内未有单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

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

9.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

9.3 查阅方式

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

长信基金管理有限责任公司

2021 年 7 月 21 日