

长信银利精选混合型证券投资基金 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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金基金合同的规定，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.....	7
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.....	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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
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.....	14
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
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.....	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18

6.4 报表附注.....	19
§7 投资组合报告.....	44
7.1 期末基金资产组合情况.....	44
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	44
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.....	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	52
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.....	52
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.....	52
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.....	52
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.....	52
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	53
7.12 投资组合报告附注.....	53
§8 基金份额持有人信息.....	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	56
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.....	56
§9 开放式基金份额变动.....	57
§10 重大事件揭示.....	58
10.1 基金份额持有人大会决议.....	58
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.....	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	58
10.4 基金投资策略的改变.....	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	58
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.....	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	58
10.8 其他重大事件.....	61
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	64
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.....	64

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	64
§12 备查文件目录.....	65
12.1 备查文件目录.....	65
12.2 存放地点.....	65
12.3 查阅方式.....	65

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长信银利精选混合型证券投资基金
基金简称	长信银利精选混合
场内简称	长信银利
基金主代码	519996
前端交易代码	519997
后端交易代码	519996
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005 年 1 月 17 日
基金管理人	长信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	607,994,905.24 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于大盘、价值型股票，并在保持基金财产安全性和流动性的前提下，谋求基金财产的长期稳定增值。
投资策略	<p>1、复合型投资策略</p> <p>“由上至下”的资产配置流程与“由下至上”的选股流程相结合的投资策略。其中，“由上至下”的资产配置流程表现为：从宏观层面出发，在控制风险前提下优化资产的配置比例；“由下至上”的选股流程表现为：从微观层面出发，通过对投资对象深入系统的分析来挖掘上市公司的内在价值，积极寻求价值被低估的证券进行投资。</p> <p>2、适度分散投资策略</p> <p>在确保基金财产的安全性和流动性的前提下，在对宏观经济、行业、公司和证券市场等因素深入分析的基础上，适度分散投资于个股，谋求基金财产的长期稳定增值。</p> <p>3、动态调整策略</p> <p>体现为投资组合中个股的动态调整策略和股票仓位的动态调整策略两方面。投资组合中个股的动态调整策略是指：基于对各种影响因素变化的深入分析，定期或临时调整投资组合中的个股投资比例。股票仓位的动态调整策略是指：基于对股票市场趋势的研判，动态调整股票仓位。</p> <p>4、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</p>

	证的投资。
业绩比较基准	标普中国 A 股 100 指数×80%+中证综合债指数×20%
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。

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周永刚	秦一楠
	联系电话	021-61009999	010-66060069
	电子邮箱	zhouyg@cxfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4007005566	95599
传真		021-61009800	010-68121816
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 9 楼	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 9 层
邮政编码		200120	100031
法定代表人		刘元瑞	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
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、北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 9 层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京西城区太平桥大街 17 号

§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	165,527,679.21
本期利润	92,393,632.56
加权平均基金份额本期利润	0.2074
本期加权平均净值利润率	13.22%
本期基金份额净值增长率	11.56%
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	97,704,499.25
期末可供分配基金份额利润	0.1607
期末基金资产净值	705,699,404.49
期末基金份额净值	1.1607
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	816.00%

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。

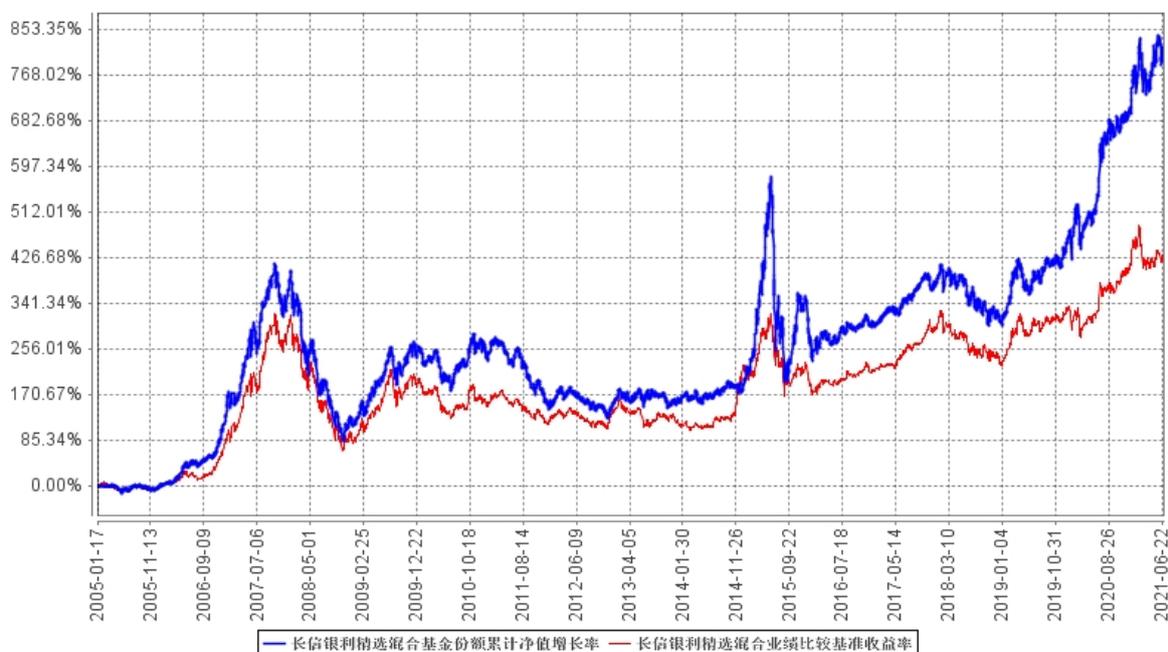
3.2 基金净值表现

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	-2.66%	1.21%	-1.79%	0.65%	-0.87%	0.56%
过去三个月	8.30%	1.16%	2.92%	0.85%	5.38%	0.31%
过去六个月	11.56%	1.43%	0.49%	1.14%	11.07%	0.29%
过去一年	40.85%	1.30%	23.42%	1.09%	17.43%	0.21%
过去三年	101.72%	1.29%	47.73%	1.08%	53.99%	0.21%
自基金合同生效起至今	816.00%	1.54%	430.49%	1.35%	385.51%	0.19%

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

长信银利精选混合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 2005 年 1 月 17 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的约定。

§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		
高远	曾任本基金的基金经理	2017 年 1 月 5 日	2021 年 1 月 12 日	11 年	曾任本基金的基金经理。
许望伟	长信银利精选混合型证券投资基金的基金经理	2020 年 12 月 31 日	-	11 年	复旦大学经济学硕士毕业，具有基金从业资格。曾任职于国泰君安证券股份有限公司、上海红象投资管理有限公司、上海弘象投资管理中心（有限合伙）及深圳市弈方资本投资管理有限公司，在 2011 年 9 月至 2013 年 3 月在长信基金管理有限责任公司担任研究员。2019 年 1 月重新加入我公司，历任专户投资部投资经理，现任长信银利精选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 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

报告期内，市场波动较大，风格分化明显且变化较快。在权益资产部分，本基金主要依据大盘价值风格进行配置，关注受益于顺周期复苏的金融和周期类行业，以及其他行业中质地优秀、估值合理的公司。公司业绩的复苏和现金流改善带来的股东回报提升是我们的稳健盈利来源。报告期内，组合呈现持仓行业较为集中、个股选择行业龙头的特征。在非权益资产部分，本基金主要配置流动性良好、波动性较低的国债、利率债品种和流动性较好且同样受益于基本面复苏的可

转债品种。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 6 月 30 日，长信银利精选混合份额净值为 1.1607 元，份额累计净值为 3.8593 元，本报告期内长信银利精选混合净值增长率为 11.56%，同期业绩比较基准收益率为 0.49%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，我们认为市场有两条主线，一条是全球通胀中枢的不断抬升和碳中和带来的上游资源与中上游产能的价值重估，另一条是国内以新能源等为代表的科技制造产业链。在全球经济复苏周期的后期，复苏节奏、政策博弈和疫情反复是我们观察经济动能和把握周期类行业投资节奏的主要落脚点；同时，必须防范潜在的滞胀风险，并对通胀中枢处在较高位置的持续时间做好更充分的准备。而重资产、制造类的主导产业，将会在下一轮周期上行中扮演重要的角色。在此过程中，证券市场波动必然会加大，但国内的整体利率环境和风险偏好仍有利于权益市场缓慢上行。我们会继续在结构性行情中寻找节奏合适的布局机会。

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及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，本基金本报告期进行了一次利润分配，具体情况如下：长信银利精选混合：权益登记日 2021 年 6 月 11 日，现金红利发放日 2021 年 6 月 16 日，每 10 份基金份额分红 5.500 元，现金形式发放 246,694,278.72 元，再投资形式发放 55,833,052.07 元，利润分配合计 302,527,330.79 元。

本基金收益分配原则如下：

1、基金收益分配采用现金方式，投资者可选择获取现金红利或者将现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资（下称“再投资方式”）；如果投资者没有明示选择，则视为选择现金红利方式；

2、每一基金份额享有同等分配权；

3、基金当期收益先弥补上期亏损后，方可进行当期收益分配；

4、基金收益分配后每基金份额净值不能低于面值；

5、如果基金投资当期出现亏损，则不进行收益分配；

6、基金收益分配比例不低于基金会计年度净收益的 90%；

7、在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年至少一次，每年至多分配 4 次。基金合同生效不满 3 个月，收益可不分配；

8、法律、法规或监管机构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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—长信基金管理有限责任公司 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，长信基金管理有限责任公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，长信基金管理有限责任公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§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：长信银利精选混合型证券投资基金

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	20,701,850.99	51,725,853.18
结算备付金		6,151,643.96	2,120,271.86
存出保证金		774,221.72	627,156.92
交易性金融资产	6.4.6.2	693,867,048.60	749,471,182.76
其中：股票投资		563,536,848.60	628,693,504.96
基金投资		-	-
债券投资		130,330,200.00	120,777,677.80
资产支持证券投资		-	-
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	-	-
应收证券清算款		139,012.83	-
应收利息	6.4.6.5	1,017,663.31	803,832.72
应收股利		-	-
应收申购款		136,896.79	5,179.73
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.6.6	-	-
资产总计		722,788,338.20	804,753,477.17
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		-	-
应付证券清算款		10,476,457.04	7,412,123.70
应付赎回款		932,577.98	1,700,150.68
应付管理人报酬		963,424.26	985,921.08
应付托管费		160,570.71	164,320.17
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.6.7	4,109,689.08	1,141,840.87
应交税费		2,105.69	3,845.99

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.6.8	444,108.95	539,592.75
负债合计		17,088,933.71	11,947,795.24
所有者权益：			
实收基金	6.4.6.9	607,994,905.24	520,831,116.64
未分配利润	6.4.6.10	97,704,499.25	271,974,565.29
所有者权益合计		705,699,404.49	792,805,681.93
负债和所有者权益总计		722,788,338.20	804,753,477.17

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.1607 元，基金份额总额 607,994,905.24 份。

6.2 利润表

会计主体：长信银利精选混合型证券投资基金

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		105,930,278.17	143,720,538.89
1.利息收入		1,131,226.74	1,067,619.91
其中：存款利息收入	6.4.6.11	144,167.07	149,165.80
债券利息收入		987,059.67	918,454.11
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		177,716,949.97	129,448,619.83
其中：股票投资收益	6.4.6.12	175,596,305.43	124,078,693.93
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.6.13	-1,120,062.20	1,989,951.48
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	3,240,706.74	3,379,974.42
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.6.17	-73,134,046.65	12,960,986.04
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	216,148.11	243,313.11
减：二、费用		13,536,645.61	11,427,374.38

1. 管理人报酬	6.4.9.2.1	5,174,059.22	5,683,772.92
2. 托管费	6.4.9.2.2	862,343.26	947,295.43
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.6.19	7,376,836.15	4,673,208.86
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		185.75	1,126.80
7. 其他费用	6.4.6.20	123,221.23	121,970.37
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		92,393,632.56	132,293,164.51
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		92,393,632.56	132,293,164.51

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长信银利精选混合型证券投资基金

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）	520,831,116.64	271,974,565.29	792,805,681.93
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	92,393,632.56	92,393,632.56
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）	87,163,788.60	35,863,632.19	123,027,420.79
其中：1.基金申购款	310,459,529.86	167,654,628.23	478,114,158.09
2.基金赎回款	-223,295,741.26	-131,790,996.04	-355,086,737.30
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）	-	-302,527,330.79	-302,527,330.79
五、期末所有者权益（基金净值）	607,994,905.24	97,704,499.25	705,699,404.49

项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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)	724,388,092.09	33,132,706.07	757,520,798.16
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	132,293,164.51	132,293,164.51
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)	-107,584,866.48	-17,495,693.21	-125,080,559.69
其中：1.基金申购款	93,868,701.14	8,509,854.30	102,378,555.44
2.基金赎回款	-201,453,567.62	-26,005,547.51	-227,459,115.13
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)	-	-21,037,178.45	-21,037,178.45
五、期末所有者权益(基金净值)	616,803,225.61	126,892,998.92	743,696,224.53

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 刘元瑞	_____ 覃波	_____ 孙红辉
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

长信银利精选混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系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[2004]98号文《关于同意长信银利精选开放式证券投资基金设立的批复》的核准，由基金管理人长信基金管理有限责任公司向社会公开发行募集，基金合同于 2005 年 1 月 17 日正式生效，首次设立募集规模为 1,182,530,117.97 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为长信基金管理有限责任公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据自 2014 年 8 月 8 日起实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》的有关规定，经与

基金托管人中国农业银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案，自 2015 年 8 月 7 日起本基金更名为长信银利精选混合型证券投资基金。

本基金的投资对象包括国内依法公开发行、上市的股票和债券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金投资组合的比例范围为：股票资产 60%-80%；债券资产 15%-35%；现金类资产 5%-15%。其中，投资于股票、债券的比重不低于本基金资产总值的 80%，投资于大盘价值股的比例不低于本基金股票资产的 80%。如果法律法规有最新规定的，本基金从其规定。

本基金业绩比较基准为：标普中国 A 股 100 指数×80%+中证综合债指数×20%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于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修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

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

6.4.5.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

6.4.5.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（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股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，本基金的基金管理人运营本基金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。对本基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生

的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从本基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

6.4.5.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

6.4.5.4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（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股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

6.4.5.5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

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	20,701,850.99
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：	20,701,850.99

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	528,687,663.68	563,536,848.60	34,849,184.92
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	100,318,200.00	4,737,552.89
	银行间市场	30,012,000.00	82,200.00
	合计	130,330,200.00	4,819,752.89
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	654,198,110.79	693,867,048.60	39,668,937.81

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：本基金本报告期末未持有买断式逆回购。

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	3,228.77
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	2,768.30
应收债券利息	1,011,317.81
应收资产支持证券利息	-
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	348.43
合计	1,017,663.31

注：其他为保证金利息等。

6.4.6.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

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	4,108,889.08
银行间市场应付交易费用	800.00
合计	4,109,689.08

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	889.40
应付证券出借违约金	-
预提账户维护费	9,000.00
预提审计费	34,712.18
预提信息披露费	399,507.37
合计	444,108.95

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	520,831,116.64	520,831,116.64
本期申购	310,459,529.86	310,459,529.86
本期赎回(以“-”号填列)	-223,295,741.26	-223,295,741.26
- 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	607,994,905.24	607,994,905.24

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

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	389,888,752.99	-117,914,187.70	271,974,565.29
本期利润	165,527,679.21	-73,134,046.65	92,393,632.56
本期基金份额交易产生的变动数	79,462,001.34	-43,598,369.15	35,863,632.19
其中：基金申购款	284,261,055.70	-116,606,427.47	167,654,628.23
基金赎回款	-204,799,054.36	73,008,058.32	-131,790,996.04
本期已分配利润	-302,527,330.79	-	-302,527,330.79
本期末	332,351,102.75	-234,646,603.50	97,704,499.25

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
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	30,732.71
其他	15,162.79
合计	144,167.07

注：此处其他为存出保证金和其他存款利息收入为基金申购款的利息收入。

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

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	2,764,612,494.57
减：卖出股票成本总额	2,589,016,189.14
买卖股票差价收入	175,596,305.43

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	-1,120,062.20
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	-1,120,062.20

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）成交总额	190,040,081.10
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	190,168,048.14
减：应收利息总额	992,095.16
买卖债券差价收入	-1,120,062.20

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

注：本基金本报告期无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

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	3,240,706.74
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	3,240,706.74

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	-73,134,046.65
——股票投资	-73,761,327.21
——债券投资	627,280.56
——资产支持证券投资	-
——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	-73,134,046.65

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	200,855.30
转换费收入	15,292.81
合计	216,148.11

注：本基金对持续持有期少于7日的投资者收取的赎回费全额计入基金财产；除此之外赎回费用的25%归基金财产所有，其余75%用于支付注册登记费和相关手续费。

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	7,376,036.15
银行间市场交易费用	800.00
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
期货交易费用	-
合计	7,376,836.15

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	34,712.18
信息披露费	-
证券出借违约金	-
信息批露费	59,507.37
账户维护费	18,000.00
其他费用	11,001.68
合计	123,221.23

注：其他费用为银行划汇费。

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

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

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、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（以下简称“农业银行”）	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

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	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
长江证券	723,904,925.57	13.56%	217,813,161.95	6.93%

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	80,188,013.00	27.52%	15,070,765.00	42.19%

6.4.9.1.3 债券回购交易

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债券回购交易。

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

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			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
长江证券	674,170.84	16.41%	674,170.84	16.41%
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
长江证券	186,787.79	6.97%	74,273.21	7.13%

注：上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

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	5,174,059.22
其中：支付销售机构的客户维护费	807,464.82	854,885.90

注：支付基金管理人长信基金管理有限责任公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×1.5%/当年天数

6.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年6月30日	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	862,343.26	947,295.43

注：支付基金托管人中国农业银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%/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通过银行间同业市场进行债券(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：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

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：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

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自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自有资金投资本基金。

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		上年度可比期间	
	2021年1月1日至2021年6月30日		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
中国农业银	20,701,850.99	98,271.57	40,114,619.84	122,598.34

行股份有限 公司				
-------------	--	--	--	--

注：本基金用于证券交易结算的资金通过本基金托管人的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，按银行同业利率计息。于 2021 年 6 月 30 日的相关余额在资产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示（2020 年 6 月 30 日：同）。

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一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

金额单位：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
		场内	场外					
1	2021 年 6 月 11 日	-	2021 年 6 月 11 日	5.500	246,694,278.72	55,833,052.07	302,527,330.79	
合计	-	-		5.500	246,694,278.72	55,833,052.07	302,527,330.79	

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

金额单位：人民币元

6.4.11.1.1 受限证券类别：股票										
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： 股)	期末 成本总额	期末估值总额	备注
688819	天能股 份	2021 年 1 月 7 日	2021 年 7 月 19 日	新股 锁定	41.79	43.69	8,727	364,701.33	381,282.63	-
688317	之江生 物	2021 年 1 月 8 日	2021 年 7	新股 锁定	43.22	63.82	4,551	196,694.22	290,444.82	-

			月 19 日							
688690	纳微科技	2021 年 6 月 16 日	2021 年 12 月 23 日	新股锁定	8.07	79.89	3,477	28,059.39	277,777.53	-
688660	电气风电	2021 年 5 月 11 日	2021 年 11 月 19 日	新股锁定	5.44	7.26	28,420	154,604.80	206,329.20	-
688079	美迪凯	2021 年 2 月 23 日	2021 年 9 月 2 日	新股锁定	10.19	18.40	10,622	108,238.18	195,444.80	-
688661	和林微纳	2021 年 3 月 19 日	2021 年 9 月 29 日	新股锁定	17.71	84.01	1,452	25,714.92	121,982.52	-
688607	康众医疗	2021 年 1 月 25 日	2021 年 8 月 2 日	新股锁定	23.21	44.50	1,890	43,866.90	84,105.00	-
688499	利元亨	2021 年 6 月 23 日	2021 年 7 月 1 日	新股流通受限	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	-
688070	纵横股份	2021 年 2 月 2 日	2021 年 8 月 10 日	新股锁定	23.16	34.47	2,407	55,746.12	82,969.29	-
301018	申菱环境	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 7 日	新股流通受限	8.29	8.29	7,811	64,753.19	64,753.19	-
688087	英科再生	2021 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 9 日	新股流通受限	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
301020	密封科技	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股流通受限	10.64	10.64	4,210	44,794.40	44,794.40	-
300979	华利集团	2021 年 4 月 15 日	2021 年 10 月	新股锁定	33.22	87.50	504	16,742.88	44,100.00	-

		日	月 26 日							
301021	英诺激 光	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股 流通 受限	9.46	9.46	2,899	27,424.54	27,424.54	-
300953	震裕科 技	2021 年 3 月 11 日	2021 年 9 月 22 日	新股 锁定 日	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	-
300981	中红医 疗	2021 年 4 月 19 日	2021 年 10 月 27 日	新股 锁定 日	48.59	90.39	262	12,730.58	23,682.18	-
301009	可靠股 份	2021 年 6 月 8 日	2021 年 12 月 17 日	新股 锁定 日	12.54	27.89	801	10,044.54	22,339.89	-
301015	百洋医 药	2021 年 6 月 22 日	2021 年 12 月 30 日	新股 锁定 日	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
688226	威腾电 气	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 7 日	新股 流通 受限	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
300982	苏文电 能	2021 年 4 月 19 日	2021 年 10 月 27 日	新股 锁定 日	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300940	南极光	2021 年 1 月 27 日	2021 年 8 月 3 日	新股 锁定 日	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-
300614	百川畅 银	2021 年 5 月 18 日	2021 年 11 月 25 日	新股 锁定 日	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300937	药易购	2021 年 1 月 20 日	2021 年 7 月 27 日	新股 锁定 日	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
301013	利和兴	2021 年 6 月 21 日	2021 年 12 月 21 日	新股 锁定 日	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81	-

		日	月 29 日							
300942	易瑞生物	2021 年 2 月 2 日	2021 年 8 月 9 日	新股 锁定	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-
300933	中辰股份	2021 年 1 月 15 日	2021 年 7 月 22 日	新股 锁定	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
605287	德才股份	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股 流通 受限	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
300955	嘉亨家化	2021 年 3 月 16 日	2021 年 9 月 24 日	新股 锁定	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300952	恒辉安防	2021 年 3 月 3 日	2021 年 9 月 13 日	新股 锁定	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-
301016	雷尔伟	2021 年 6 月 23 日	2021 年 12 月 30 日	新股 锁定	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
300945	曼卡龙	2021 年 2 月 3 日	2021 年 8 月 10 日	新股 锁定	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中生态	2021 年 2 月 18 日	2021 年 8 月 25 日	新股 锁定	13.00	27.42	216	2,808.00	5,922.72	-
300948	冠中生态	2021 年 6 月 4 日	2021 年 8 月 25 日	新股 锁定 -送 股	-	27.42	108	-	2,961.36	-
300931	通用电梯	2021 年 1 月 13 日	2021 年 7 月 21 日	新股 锁定	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
300986	志特新材	2021 年 4 月 21	2021 年 11	新股 锁定	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-

		日	月 1 日							
300987	川网传媒	2021 年 4 月 28 日	2021 年 11 月 11 日	新股 锁定	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-
300926	博俊科技	2020 年 12 月 29 日	2021 年 7 月 7 日	新股 锁定	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-
300993	玉马遮阳	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 24 日	新股 锁定	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-
300927	江天化学	2020 年 12 月 29 日	2021 年 7 月 7 日	新股 锁定	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
301011	华立科技	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 17 日	新股 锁定	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
300943	春晖智控	2021 年 2 月 3 日	2021 年 8 月 10 日	新股 锁定	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300929	华骐环保	2021 年 1 月 12 日	2021 年 7 月 20 日	新股 锁定	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
300995	奇德新材	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 26 日	新股 锁定	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
301007	德迈仕	2021 年 6 月 4 日	2021 年 12 月 16 日	新股 锁定	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
300998	宁波方正	2021 年 5 月 25 日	2021 年 12 月 2 日	新股 锁定	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301012	扬电科技	2021 年 6 月 15 日	2021 年 12 月 15 日	新股 锁定	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-

		日	月 22 日							
301010	晶雪节能	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 20 日	新股 锁定	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-

注：以上“可流通日”是根据上市公司公告估算的流通日期，最终日期以上上市公司公告为准。

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

注：本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

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参与转融通证券出借业务的融出证券。

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中国农业银行股份有限公司，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	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	50,026,000.00	29,994,000.00
合计	50,026,000.00	29,994,000.00

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

注：本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.12.2.3 按短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短期信用评级列示的同业存单投资。

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	42,267,200.00	66,635,477.80
AAA 以下	38,037,000.00	24,148,200.00
未评级	0.00	0.00
合计	80,304,200.00	90,783,677.80

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对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	20,701,850.99	-	-	-	-	20,701,850.99
结算备付金	6,151,643.96	-	-	-	-	6,151,643.96
存出保证金	774,221.72	-	-	-	-	774,221.72
交易性金融资产	30,012,000.00	100,318,200.00	-	-	-563,536,848.60	693,867,048.60
应收证券清算款	-	-	-	-	139,012.83	139,012.83
应收利息	-	-	-	-	1,017,663.31	1,017,663.31
应收申购款	-	-	-	-	136,896.79	136,896.79
资产总计	57,639,716.67	100,318,200.00	-	-	-564,830,421.53	722,788,338.20
负债						
应付证券清算款	-	-	-	-	10,476,457.04	10,476,457.04
应付赎回款	-	-	-	-	932,577.98	932,577.98
应付管理人报酬	-	-	-	-	963,424.26	963,424.26
应付托管费	-	-	-	-	160,570.71	160,570.71
应付交易费用	-	-	-	-	4,109,689.08	4,109,689.08
应交税费	-	-	-	-	2,105.69	2,105.69
其他负债	-	-	-	-	444,108.95	444,108.95
负债总计	-	-	-	-	17,088,933.71	17,088,933.71
利率敏感度缺口	57,639,716.67	100,318,200.00	-	-	-547,741,487.82	705,699,404.49
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	51,725,853.18	-	-	-	-	51,725,853.18
结算备付金	2,120,271.86	-	-	-	-	2,120,271.86
存出保证金	627,156.92	-	-	-	-	627,156.92
交易性金融资	67,587,777.80	53,189,900.00	-	-	-628,693,504.96	749,471,182.76

产						
应收利息	-	-	-	-	803,832.72	803,832.72
应收申购款	-	-	-	-	5,179.73	5,179.73
资产总计	122,061,059.76	53,189,900.00	-	-	-629,502,517.41	804,753,477.17
负债						
应付证券清算款	-	-	-	-	7,412,123.70	7,412,123.70
应付赎回款	-	-	-	-	1,700,150.68	1,700,150.68
应付管理人报酬	-	-	-	-	985,921.08	985,921.08
应付托管费	-	-	-	-	164,320.17	164,320.17
应付交易费用	-	-	-	-	1,141,840.87	1,141,840.87
应交税费	-	-	-	-	3,845.99	3,845.99
其他负债	-	-	-	-	539,592.75	539,592.75
负债总计	-	-	-	-	11,947,795.24	11,947,795.24
利率敏感度缺口	122,061,059.76	53,189,900.00	-	-	-617,554,722.17	792,805,681.93

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

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	1,121,847.12	775,773.74
	市场利率上升 27 个基点	-1,121,847.12	-775,773.74

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股票和债券以及银行间同业市场交易的债券，所面临的重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	563,536,848.60	79.86	628,693,504.96	79.30
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	130,330,200.00	18.47	120,777,677.80	15.23
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	693,867,048.60	98.32	749,471,182.76	94.53

6.4.12.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	在 95% 的置信区间内，基金资产组合的市场价格风险		
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）
	VaR 值为 4.63%（2020 年 12 月 31 日 VaR 值为 4.55%）	-32,669,363.20	-36,095,655.52

注：上述风险价值 VaR 的分析是基于资产负债表日所持证券过去一年市场价格波动情况而有可能发生的最大损失，且此变动适用于本基金所有的衍生金融工具及非衍生金融工具。取 95% 的置信度是基于本基金所持有的金融工具风险度量的要求。2020 年的分析同样基于该假设。

6.4.13 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.13.1 公允价值

6.4.13.1.1 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贷款和应收款项以及其他金融负债，其因剩余

期限不长，公允价值与账面价值相若。

6.4.13.1.2 以公允价值计量的金融工具

6.4.13.1.2.1 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一层次的余额为人民币 641,542,192.57 元，属于第二层次的余额为人民币 50,328,983.52 元，属于第三层次余额为人民币 1,995,872.51 元。

6.4.13.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券，若出现重大事项停牌、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不将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次；并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，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.13.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

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 4,422,140.85 元，本期变动人民币 -2,426,268.34 元，本期末余额为人民币 1,995,872.51 元。

6.4.13.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.13.3 其他事项

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	563,536,848.60	77.97
	其中：股票	563,536,848.60	77.97
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	130,330,200.00	18.03
	其中：债券	130,330,200.00	18.03
	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	26,853,494.95	3.72
8	其他各项资产	2,067,794.65	0.29
9	合计	722,788,338.20	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

金额单位：人民币元

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	98,804,026.85	14.00
C	制造业	231,224,237.62	32.77
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	273,170.14	0.04
G	交通运输、仓储和邮政业	36,648,000.00	5.19
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,114,959.21	2.00
J	金融业	182,404,721.10	25.85
K	房地产业	10,123.56	0.00
L	租赁和商务服务业	-	-

M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	27,576.75	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	563,536,848.60	79.86

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：本基金本报告期内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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601919	中远海控	1,200,000	36,648,000.00	5.19
2	600036	招商银行	600,000	32,514,000.00	4.61
3	000807	云铝股份	2,700,000	32,130,000.00	4.55
4	600030	中信证券	1,200,000	29,928,000.00	4.24
5	601899	紫金矿业	3,000,000	29,070,000.00	4.12
6	601377	兴业证券	3,000,000	28,980,000.00	4.11
7	000983	山西焦煤	3,400,000	28,254,000.00	4.00
8	601600	中国铝业	5,300,000	28,090,000.00	3.98
9	601857	中国石油	5,300,000	28,037,000.00	3.97
10	601838	成都银行	2,200,000	27,808,000.00	3.94
11	002326	永太科技	1,300,000	25,987,000.00	3.68
12	002648	卫星石化	600,000	23,514,000.00	3.33
13	000001	平安银行	1,000,000	22,620,000.00	3.21
14	601688	华泰证券	1,300,000	20,540,000.00	2.91
15	600958	东方证券	2,000,000	19,980,000.00	2.83
16	603501	韦尔股份	50,000	16,100,000.00	2.28
17	600111	北方稀土	700,000	14,490,000.00	2.05
18	600499	科达制造	1,000,000	14,400,000.00	2.04
19	002001	新和成	500,000	14,340,000.00	2.03
20	600570	恒生电子	150,980	14,078,885.00	2.00
21	002371	北方华创	50,000	13,869,000.00	1.97
22	600985	淮北矿业	1,100,985	13,443,026.85	1.90

23	002353	杰瑞股份	300,000	13,410,000.00	1.90
24	600438	通威股份	300,000	12,981,000.00	1.84
25	002738	中矿资源	250,000	11,100,000.00	1.57
26	000933	神火股份	800,000	7,560,000.00	1.07
27	688819	天能股份	8,727	381,282.63	0.05
28	688161	威高骨科	3,069	325,467.45	0.05
29	688317	之江生物	4,551	290,444.82	0.04
30	688690	纳微科技	3,477	277,777.53	0.04
31	301015	百洋医药	4,614	251,115.78	0.04
32	688601	力芯微	1,174	216,133.40	0.03
33	688660	电气风电	28,420	206,329.20	0.03
34	688079	美迪凯	10,622	195,444.80	0.03
35	301013	利和兴	4,704	168,966.51	0.02
36	688661	和林微纳	1,452	121,982.52	0.02
37	301016	雷尔伟	2,747	115,711.58	0.02
38	688607	康众医疗	1,890	84,105.00	0.01
39	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.01
40	688070	纵横股份	2,407	82,969.29	0.01
41	688571	杭华股份	8,200	73,882.00	0.01
42	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.01
43	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.01
44	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.01
45	300979	华利集团	504	44,100.00	0.01
46	300894	火星人	628	42,704.00	0.01
47	688367	工大高科	1,717	37,035.69	0.01
48	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
49	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
50	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
51	300981	中红医疗	262	23,682.18	0.00
52	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
53	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.00
54	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
55	300908	仲景食品	285	16,983.15	0.00
56	300909	汇创达	386	16,636.60	0.00
57	300913	兆龙互连	630	16,506.00	0.00
58	300925	法本信息	600	15,774.00	0.00
59	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
60	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
61	300940	南极光	307	13,317.66	0.00

62	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
63	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
64	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
65	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
66	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
67	300918	南山智尚	1,063	11,065.83	0.00
68	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
69	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
70	300917	特发服务	366	10,123.56	0.00
71	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
72	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
73	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
74	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
75	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
76	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
77	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
78	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
79	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
80	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
81	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
82	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
83	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
84	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
85	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
86	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
87	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
88	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601688	华泰证券	114,622,706.00	14.46
2	300059	东方财富	84,058,452.00	10.60
3	603501	韦尔股份	77,076,408.25	9.72
4	000001	平安银行	72,898,836.12	9.20

5	601995	中金公司	65,877,510.93	8.31
6	600111	北方稀土	59,179,151.90	7.46
7	000983	山西焦煤	56,739,640.54	7.16
8	601088	中国神华	54,660,304.00	6.89
9	600030	中信证券	53,878,184.09	6.80
10	601919	中远海控	52,237,951.60	6.59
11	601838	成都银行	51,629,232.00	6.51
12	000807	云铝股份	49,679,713.50	6.27
13	000932	华菱钢铁	46,327,072.06	5.84
14	000933	神火股份	46,077,391.31	5.81
15	002555	三七互娱	42,281,271.33	5.33
16	002738	中矿资源	40,550,783.00	5.11
17	601168	西部矿业	39,085,039.50	4.93
18	600958	东方证券	38,603,462.00	4.87
19	601377	兴业证券	38,121,455.00	4.81
20	601899	紫金矿业	36,314,745.50	4.58
21	601211	国泰君安	36,005,434.00	4.54
22	600000	浦发银行	35,923,216.70	4.53
23	601390	中国中铁	35,432,916.79	4.47
24	002493	荣盛石化	33,294,296.68	4.20
25	300207	欣旺达	32,423,180.00	4.09
26	601658	邮储银行	31,948,626.00	4.03
27	600919	江苏银行	31,741,684.70	4.00
28	600036	招商银行	30,937,444.00	3.90
29	600309	万华化学	30,083,045.96	3.79
30	002497	雅化集团	29,231,218.00	3.69
31	601600	中国铝业	28,998,417.74	3.66
32	002001	新和成	28,676,547.60	3.62
33	002444	巨星科技	28,549,653.00	3.60
34	600660	福耀玻璃	28,234,754.00	3.56
35	603986	兆易创新	27,807,257.20	3.51
36	601857	中国石油	26,955,997.00	3.40
37	603565	中谷物流	26,760,801.59	3.38
38	600426	华鲁恒升	26,414,677.00	3.33
39	601225	陕西煤业	26,327,558.03	3.32
40	601166	兴业银行	25,665,007.00	3.24

41	002044	美年健康	24,814,874.33	3.13
42	002466	天齐锂业	24,596,071.37	3.10
43	002326	永太科技	24,267,339.00	3.06
44	600926	杭州银行	23,725,764.84	2.99
45	600985	淮北矿业	22,905,511.25	2.89
46	002648	卫星石化	21,753,280.20	2.74
47	600346	恒力石化	21,576,355.35	2.72
48	601318	中国平安	21,208,620.00	2.68
49	000895	双汇发展	20,779,403.00	2.62
50	600123	兰花科创	20,509,629.00	2.59
51	601066	中信建投	20,192,588.24	2.55
52	000630	铜陵有色	19,096,975.00	2.41
53	601872	招商轮船	18,725,649.00	2.36
54	601456	国联证券	18,588,817.00	2.34
55	000776	广发证券	18,133,515.00	2.29
56	600989	宝丰能源	17,849,397.00	2.25
57	600066	宇通客车	17,755,317.92	2.24
58	600737	中粮糖业	17,531,456.00	2.21
59	601952	苏垦农发	17,270,512.20	2.18
60	600999	招商证券	16,948,530.24	2.14
61	002142	宁波银行	16,717,140.45	2.11
62	000651	格力电器	16,422,712.00	2.07
63	000066	中国长城	16,299,294.00	2.06

注：本项“买入金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑其它交易费用。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601688	华泰证券	90,606,580.78	11.43
2	300059	东方财富	85,696,173.17	10.81
3	601995	中金公司	75,028,805.58	9.46
4	603501	韦尔股份	59,939,994.00	7.56
5	601088	中国神华	54,644,257.00	6.89
6	600660	福耀玻璃	54,190,118.35	6.84

7	000001	平安银行	51,281,705.86	6.47
8	000858	五粮液	47,105,921.56	5.94
9	000932	华菱钢铁	45,674,652.40	5.76
10	002555	三七互娱	43,578,791.65	5.50
11	000933	神火股份	42,729,331.00	5.39
12	600111	北方稀土	42,033,756.00	5.30
13	601919	中远海控	41,965,756.76	5.29
14	000651	格力电器	40,360,646.00	5.09
15	002738	中矿资源	38,337,829.15	4.84
16	601211	国泰君安	37,386,872.00	4.72
17	600000	浦发银行	35,726,944.00	4.51
18	601168	西部矿业	35,586,802.24	4.49
19	600919	江苏银行	35,241,910.00	4.45
20	000983	山西焦煤	35,165,489.62	4.44
21	300207	欣旺达	33,885,295.00	4.27
22	601390	中国中铁	33,726,271.00	4.25
23	002493	荣盛石化	33,566,513.00	4.23
24	600309	万华化学	33,310,513.80	4.20
25	601601	中国太保	33,176,026.68	4.18
26	601658	邮储银行	32,593,782.00	4.11
27	300682	朗新科技	32,268,569.47	4.07
28	601012	隆基股份	31,775,933.00	4.01
29	601398	工商银行	30,984,235.00	3.91
30	601225	陕西煤业	30,756,158.00	3.88
31	002332	仙琚制药	29,912,091.18	3.77
32	603565	中谷物流	29,396,410.00	3.71
33	002497	雅化集团	29,254,871.20	3.69
34	002444	巨星科技	28,819,590.19	3.64
35	601838	成都银行	27,245,879.00	3.44
36	600926	杭州银行	26,479,156.00	3.34
37	600426	华鲁恒升	26,437,808.00	3.33
38	601166	兴业银行	26,301,269.70	3.32
39	600030	中信证券	25,378,246.00	3.20
40	600036	招商银行	25,177,617.51	3.18
41	603986	兆易创新	25,092,651.67	3.17
42	600486	扬农化工	24,933,705.10	3.14
43	600519	贵州茅台	24,052,394.85	3.03
44	000333	美的集团	24,040,133.00	3.03

45	600346	恒力石化	24,039,220.40	3.03
46	002044	美年健康	23,773,666.15	3.00
47	601888	中国中免	22,914,971.20	2.89
48	600989	宝丰能源	22,407,300.00	2.83
49	300760	迈瑞医疗	21,475,131.12	2.71
50	600123	兰花科创	21,226,056.00	2.68
51	601318	中国平安	20,777,436.00	2.62
52	002466	天齐锂业	20,088,617.64	2.53
53	601066	中信建投	19,839,069.54	2.50
54	000895	双汇发展	19,094,285.64	2.41
55	002236	大华股份	18,928,327.31	2.39
56	000630	铜陵有色	18,612,000.00	2.35
57	601456	国联证券	18,406,246.00	2.32
58	601872	招商轮船	18,128,187.70	2.29
59	600958	东方证券	18,063,476.00	2.28
60	000776	广发证券	18,055,348.00	2.28
61	000100	TCL 科技	18,037,830.00	2.28
62	688006	杭可科技	17,886,334.41	2.26
63	600999	招商证券	17,059,007.00	2.15
64	000923	河钢资源	16,774,983.30	2.12
65	601952	苏垦农发	16,384,554.54	2.07
66	002142	宁波银行	16,234,089.00	2.05
67	600066	宇通客车	16,178,557.68	2.04
68	601666	平煤股份	16,041,472.00	2.02
69	600737	中粮糖业	15,983,277.00	2.02
70	000066	中国长城	15,948,759.00	2.01

注：本项“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑其它交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,580,238,580.64
卖出股票收入（成交）总额	2,764,612,494.57

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”和“卖出股票的收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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	20,014,000.00	2.84
2	央行票据	-	-
3	金融债券	30,012,000.00	4.25
	其中：政策性金融债	30,012,000.00	4.25
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	80,304,200.00	11.38
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	130,330,200.00	18.47

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	200309	20 进出 09	300,000	30,012,000.00	4.25
2	110053	苏银转债	200,000	24,272,000.00	3.44
3	019649	21 国债 01	200,000	20,014,000.00	2.84
4	123111	东财转 3	130,000	19,026,800.00	2.70
5	113034	滨化转债	110,000	19,010,200.00	2.69

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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投资贵金属。

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股指期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.11.3 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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，中信证券股份有限公司于 2021 年 1 月 23 日收到深圳证监局出具的《深圳证监局关于对中信证券股份有限公司采取责令改正措施的决定》（行政监管措施决定书(2021)5 号）。经查，公司在业务开展过程中存在以下情况：一、私募基金托管业务内部控制不够完善，个别项目履职不谨慎。一是业务准入管控不到位，部分项目业务准入未严格执行公司规定的标准和审批程序，未充分关注和核实管理人准入材料。二是投资监督业务流程存在薄弱环节，部分产品未及时调整系统中设定的监督内容，部分投资监督审核未按公司规定履行复核程序，对投资监督岗履职情况进行监督约束的内控流程不完善。三是信息披露复核工作存在不足，对个别产品季度报告的复核存在迟延。四是业务隔离不到位，托管部门与从事基金服务外包业务的子公司未严格执行业务隔离要求；二、个别首次公开发行保荐项目执业质量不高，存在对发行人现金交易等情况关注和披露不充分、不准确，对发行人收入确认依据、补贴可回收性等情况核查不充分等问题；三、公司个别资管产品未按《证券公司定向资产管理业务实施细则》（证监会公告（2012）30 号）第二十九条第二款规定，根据合同约定的时间和方式向客户提供对账单，说明报告期内客户委托资产的配置状况、净值变动、交易记录等情况。以上情形反映了公司对相关业

务的管控存在薄弱环节，内部控制不完善，违反了 2013 年《证券投资基金托管业务管理办法》（证监会令第 92 号）第二十六条第一款、《证券投资基金托管业务管理办法》（证监会令第 172 号）第三十三条、《私募投资基金监督管理暂行办法》（证监会令第 105 号）第四条第一款、2017 年《证券发行上市保荐业务管理办法》（证监会令第 137 号）第三十四条等规定，依据《证券公司监督管理条例》第七十条第一款的规定，深圳局决定对公司采取责令改正的监督管理措施。

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八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。

7.12.2 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。

7.12.3 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	774,221.72
2	应收证券清算款	139,012.83
3	应收股利	-
4	应收利息	1,017,663.31
5	应收申购款	136,896.79
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,067,794.65

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110053	苏银转债	24,272,000.00	3.44
2	113034	滨化转债	19,010,200.00	2.69

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

7.12.6 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
17,991	33,794.39	300,173,966.86	49.37%	307,820,938.38	50.63%

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	3,158.42	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（2005年1月17日）基金份额总额	1,182,530,117.97
本报告期期初基金份额总额	520,831,116.64
本报告期基金总申购份额	310,459,529.86
减：本报告期基金总赎回份额	223,295,741.26
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	607,994,905.24

§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

2021 年 5 月，中国农业银行总行决定谭敦宇任托管业务部总裁。

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	
齐鲁证券	1	1,986,230,622.77	37.21%	1,253,911.51	30.52%	-
长江证券	2	723,904,925.57	13.56%	674,170.84	16.41%	-
中信建投	1	692,844,382.14	12.98%	645,245.96	15.70%	-

国盛证券	1	373,970,016.60	7.01%	236,087.41	5.75%	-
申银万国	1	334,211,479.60	6.26%	311,251.46	7.58%	-
西藏东方财富	1	302,270,759.62	5.66%	221,050.88	5.38%	-
东方证券	1	253,918,308.74	4.76%	211,082.46	5.14%	-
西部证券	1	229,072,710.14	4.29%	167,520.82	4.08%	-
安信证券	1	221,802,319.95	4.16%	184,385.61	4.49%	-
招商证券	1	219,244,086.81	4.11%	204,182.13	4.97%	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
广发证券(已退租)	2	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
国都证券(已退租)	1	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
川财证券(已退租)	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
方正证券(已退租)	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
川财证券	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
齐鲁证券	100,484,965.90	34.48%	-	-	-	-
长江证券	80,188,013.00	27.52%	-	-	-	-
中信建投	58,083,098.51	19.93%	-	-	-	-
国盛证券	12,130,088.77	4.16%	-	-	-	-
申银万国	3,015,898.70	1.03%	-	-	-	-
西藏东方财富	1,400,889.84	0.48%	-	-	-	-
东方证券	8,715,452.39	2.99%	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	27,408,613.06	9.40%	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
广发证券（已退租）	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
国都证券（已退租）	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-

瑞银证券	-	-	-	-	-	-
川财证券（已 退租）	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
方正证券（已 退租）	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-

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增聘长信银利精选混合型证券投资基金基金经理的公告	证券时报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021年1月4日
2	长信银利精选混合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1月6日
3	长信基金管理有限责任公司关于长信银利精选混合型证券投资基金基金经理变更的公告	证券时报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021年1月13日
4	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
5	长信银利精选混合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1月15日
6	长信银利精选混合型证券投资基金 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
7	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
8	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
9	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	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

	的公告		
10	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
11	长信银利精选混合型证券投资基金 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
12	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
13	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
14	长信银利精选混合型证券投资基金 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
15	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
16	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
17	长信基金管理有限责任公司关于长信银利精选混合型证券投资基金暂停大额申购（含转换转入、定期定额投资）业务的公告	证券时报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021年5月18日
18	长信基金管理有限责任公司关于长信银利精选混合型证券投资基金的分红公告	证券时报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021年6月10日
19	长信基金管理有限责任公司关于长信银利精选混合型证券投资基金暂停大额申购（含转换转入、定期定额投资）业务的公告	证券时报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021年6月10日
20	长信基金管理有限责任公司关于长信银利精选混合型证券投资基金恢复大额申购（含转换转入、定期定额投资）业务的公告	证券时报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021年6月11日
21	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
22	长信基金管理有限责任公司关于旗下 40 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6月29日
23	长信基金管理有限责任公司关于调整长信旗下 6 只基金产品变更业绩比较基准并修改基金合同的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露	2021年6月29日

		网站、公司网站	
24	长信基金管理有限责任公司关于修订旗下公开募集证券投资基金法律文件并更新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6月29日
25	长信银利精选混合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6月29日
26	长信银利精选混合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6月29日
27	长信银利精选混合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

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。

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、《长信银利精选混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长信银利精选混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《长信银利精选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、《中国农业银行证券交易资金结算协议》；
- 7、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