

# 长信消费升级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：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通银行股份有限公司，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

|  |           |
|--|-----------|
| <b>§1 重要提示及目录</b> .....                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示.....                                | 2         |
| 1.2 目录.....                                  | 3         |
| <b>§2 基金简介</b> .....                         | <b>6</b>  |
| 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.....                         | 6         |
| 2.4 信息披露方式.....                              | 7         |
| 2.5 其他相关资料.....                              | 7         |
| <b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....                | <b>8</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标.....                         | 8         |
| 3.2 基金净值表现.....                              | 8         |
| <b>§4 管理人报告</b> .....                        | <b>11</b> |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况.....                        | 11        |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....              | 13        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....                 | 13        |
| 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.....             | 14        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....             | 14        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....                | 15        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....                 | 15        |
| 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.....       | 16        |
| <b>§5 托管人报告</b> .....                        | <b>17</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....                  | 17        |
| 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..... | 17        |
| 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.....      | 17        |
| <b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....              | <b>18</b> |
| 6.1 资产负债表.....                               | 18        |
| 6.2 利润表.....                                 | 19        |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....                      | 20        |

|  |           |
|--|-----------|
| 6.4 报表附注.....                              | 21        |
| <b>§7 投资组合报告.....</b>                      | <b>51</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况.....                        | 51        |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....                    | 51        |
| 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.....     | 52        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                   | 55        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                  | 56        |
| 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.....    | 57        |
| 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..... | 57        |
| 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..... | 57        |
| 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.....    | 57        |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....             | 57        |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....             | 57        |
| 7.12 投资组合报告附注.....                         | 58        |
| <b>§8 基金份额持有人信息.....</b>                   | <b>59</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....                 | 59        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....              | 59        |
| 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.....     | 59        |
| <b>§9 开放式基金份额变动.....</b>                   | <b>60</b> |
| <b>§10 重大事件揭示.....</b>                     | <b>61</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议.....                      | 61        |
| 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.....      | 61        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....           | 61        |
| 10.4 基金投资策略的改变.....                        | 61        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....                 | 61        |
| 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.....         | 61        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....                | 61        |
| 10.8 其他重大事件.....                           | 64        |
| <b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>             | <b>66</b> |
| 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.....    | 66        |

|                          |           |
|--------------------------|-----------|
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息..... | 66        |
| <b>§12 备查文件目录.....</b>   | <b>67</b> |
| 12.1 备查文件目录.....         | 67        |
| 12.2 存放地点.....           | 67        |
| 12.3 查阅方式.....           | 67        |

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                  |                  |
|-----------------|------------------|------------------|
| 基金名称            | 长信消费升级混合型证券投资基金  |                  |
| 基金简称            | 长信消费升级混合         |                  |
| 基金主代码           | 009778           |                  |
| 基金运作方式          | 契约型开放式           |                  |
| 基金合同生效日         | 2020 年 11 月 4 日  |                  |
| 基金管理人           | 长信基金管理有限责任公司     |                  |
| 基金托管人           | 交通银行股份有限公司       |                  |
| 报告期末基金份额总额      | 638,415,102.20 份 |                  |
| 基金合同存续期         | 不定期              |                  |
| 下属分级基金的基金简称:    | 长信消费升级混合 A       | 长信消费升级混合 C       |
| 下属分级基金的交易代码:    | 009778           | 009779           |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 484,938,389.80 份 | 153,476,712.40 份 |

### 2.2 基金产品说明

|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 本基金主要投资于大消费行业中具有持续增长潜力的优质上市公司，在严格控制基金资产风险的前提下，力争为投资者提供稳定增长的投资收益。  |
| 投资策略   | 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。 |
| 业绩比较基准 | 中证内地消费主题指数收益率*70%+中证综合债指数收益率*20%+恒生指数收益率(按估值汇率调整)*10%   |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，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。本基金可投资香港联合交易所上市的股票，将面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。                                     |

### 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               | 交通银行股份有限公司              |
| 信息披露负责人 | 姓名                         | 周永刚                     |
|         | 联系电话                       | 021-61009999            |
|         | 电子邮箱                       | zhouyg@cxfund.com.cn    |
| 客户服务电话  | 4007005566                 | 95559                   |
| 传真      | 021-61009800               | 021-62701216            |
| 注册地址    | 中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 9 楼 | 中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号 |
| 办公地址    | 上海市浦东新区银城中路 68             | 中国（上海）长宁区仙霞路 18         |

|       |        |        |
|-------|--------|--------|
|       | 号 9 楼  | 号      |
| 邮政编码  | 200120 | 200336 |
| 法定代表人 | 刘元瑞    | 任德奇    |

## 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 号时代金融中心 9 楼，<br>上海市仙霞路 18 号 |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称           | 办公地址                 |
|--------|--------------|----------------------|
| 注册登记机构 | 长信基金管理有限责任公司 | 上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼 |

### §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

| 基金级别          | 长信消费升级混合 A                  | 长信消费升级混合 C                  |
|---------------|-----------------------------|-----------------------------|
| 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) | 报告期(2021年1月1日 - 2021年6月30日) |
| 本期已实现收益       | 15,058,246.89               | 771,711.27                  |
| 本期利润          | -4,737,373.10               | -2,785,329.32               |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.0076                     | -0.0167                     |
| 本期加权平均净值利润率   | -0.74%                      | -1.65%                      |
| 本期基金份额净值增长率   | 5.34%                       | 5.03%                       |
| 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      | -16,012,500.15              | -5,680,340.23               |
| 期末可供分配基金份额利润  | -0.0330                     | -0.0370                     |
| 期末基金资产净值      | 517,498,816.06              | 163,129,539.80              |
| 期末基金份额净值      | 1.0671                      | 1.0629                      |
| 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   | 11.83%                      | 11.39%                      |

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

长信消费升级混合 A

| 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      | 0.83%    | 1.11%       | -3.35%     | 0.70%         | 4.18%  | 0.41% |
| 过去三个月      | 14.03%   | 1.37%       | 1.59%      | 0.98%         | 12.44% | 0.39% |
| 过去六个月      | 5.34%    | 1.91%       | -1.72%     | 1.35%         | 7.06%  | 0.56% |
| 自基金合同生效起至今 | 11.83%   | 1.65%       | 9.14%      | 1.24%         | 2.69%  | 0.41% |

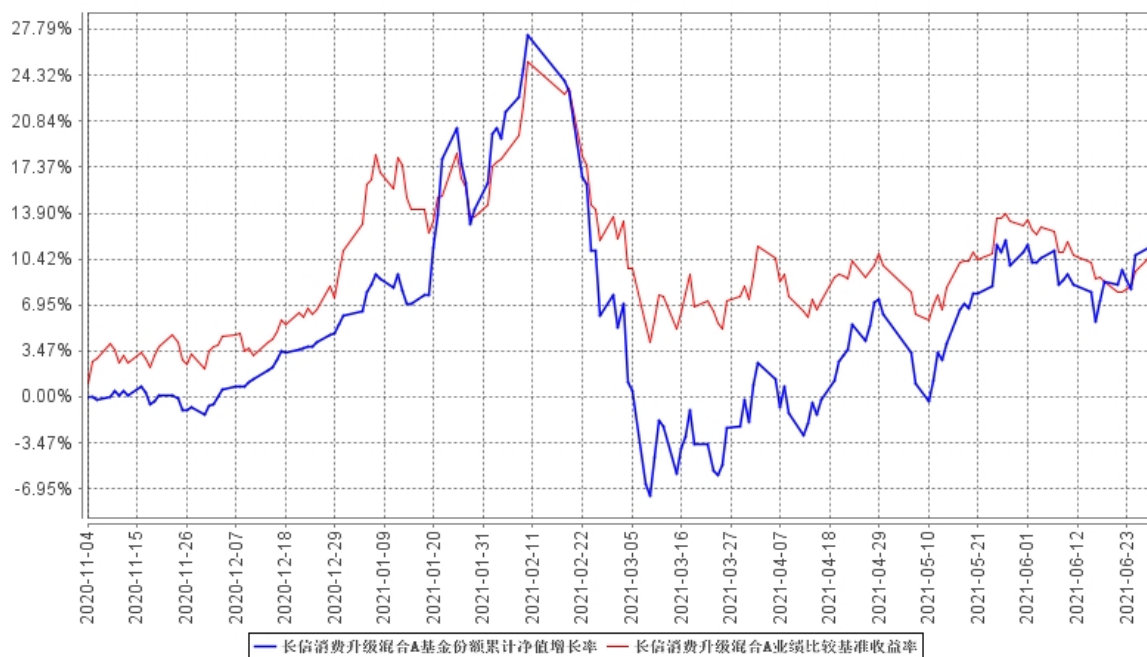


长信消费升级混合 C

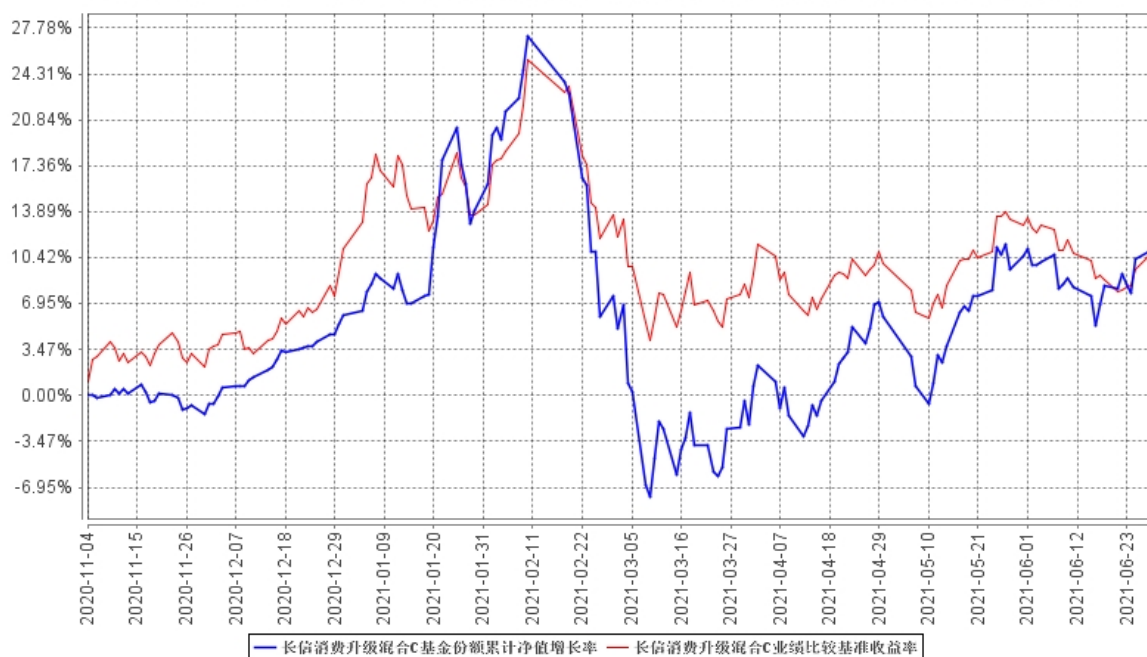
| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③    | ②—④   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月      | 0.78%    | 1.11%       | -3.35%     | 0.70%         | 4.13%  | 0.41% |
| 过去三个月      | 13.86%   | 1.37%       | 1.59%      | 0.98%         | 12.27% | 0.39% |
| 过去六个月      | 5.03%    | 1.91%       | -1.72%     | 1.35%         | 6.75%  | 0.56% |
| 自基金合同生效起至今 | 11.39%   | 1.65%       | 9.14%      | 1.24%         | 2.25%  | 0.41% |

### 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

长信消费升级混合A基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



长信消费升级混合C基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同生效日为 2020 年 11 月 4 日，基金合同生效日至本报告期末，本基金运作时间未满一年。图示日期为 2020 年 11 月 4 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，报告期末已完成建仓但报告期末距建仓结束不满一年；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 |        |   |
| 安昀 | 长信内需成长混合型证券投资基金、长信消费升级混合型证券投资基金和长信优质企业混合型证券投资基金的基金经理、副总经理、投资决策委员会执行委员 | 2020 年 11 月 4 日 | -    | 15 年   | 经济学硕士，复旦大学数量经济学研究生毕业，具有基金从业资格。曾任职于申银万国证券研究所，担任策略研究工作，2008 年 11 月加入长信基金管理有限责任公司，历任策略研究员、基金经理助理、研究发展部副总监、研究发展部总监和基金经理。2015 年 5 月 6 日至 2016 年 9 月 6 日在敦和资产管理有限公司股票投资部担任基金经理。2016 年 9 月 8 日重新加入长信基金管理有限责任公司，曾任总经理助理、国际业务部总监、长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金、长信双利优选混合型证券投资 |

|    |                             |                 |   |     |   |
|----|-----------------------------|-----------------|---|-----|---|
|    |                             |                 |   |     | 基金、长信先机两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。现任公司副总经理、投资决策委员会执行委员、长信内需成长混合型证券投资基金、长信消费升级混合型证券投资基金和长信优质企业混合型证券投资基金的基金经理。  |
| 刘亮 | 长信恒利优势混合型基金和长信消费升级混合型基金基金经理 | 2021 年 6 月 30 日 | - | 8 年 | 复旦大学金融学硕士，具有基金从业资格。曾于 2013 年 7 月至 2015 年 5 月在长信基金管理有限责任公司担任研究员，2015 年 6 月至 2017 年 4 月期间在上投摩根基金管理有限公司担任研究员，2017 年 5 月重新加入长信基金管理有限责任公司，曾任研究发展部基金经理助理，现任长信恒利优势混合型基金和长信消费升级混合型基金基金经理。 |

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 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

整个上半年消费板块呈现明显的震荡市特征，市场经历了一季度的大幅调整，在较为宽松的流动性下二季度逐步企稳。年初站在估值高位的核心资产均有所反弹，但走势亦出现分化：景气度维持高位的 CXO、医疗服务、医美、扫地机器人等板块创出历史新高，市场对成长因子明显偏好加强。在消费升级的长周期上，我们坚定看好实物消费向服务消费逐步转移，而医疗服务是这其中明确空间大、竞争有壁垒的长坡厚雪赛道，我们择机在这一优秀赛道研究和配置。同时我们观察到，持续 3 年的白马风格偏好出现了回摆，二季度开始不少中小市值成长股被市场所关注，我们在市值因子上考虑均衡配置。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 6 月 30 日，长信消费升级混合 A 份额净值为 1.0671 元，份额累计净值为 1.1171 元，本报告期内长信消费升级混合 A 净值增长率为 5.34%；长信消费升级混合 C 份额净值为 1.0629 元，份额累计净值为 1.1129 元，本报告期内长信消费升级混合 C 净值增长率为 5.03%，同期业绩比较基准收益率为-1.72%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前时点市场对整体消费有几点关注：

1) 消费力水平，从上半年的社零数据看，可选品的化妆品、服装、珠宝呈现较高景气度，日用品等必选消费维持稳健增速，地产链相关消费有回暖迹象。我们认为中国当前的消费体量已经足够大而稳定，无需过度关注总量数据波动，可以着眼于结构性变化。我们对中国消费市场的韧性充满信心。

2) 中报业绩，由于去年疫情的管控措施打乱了生活节奏，造成必需消费品第二季度高基数、可选消费第三季度高基数，市场在这两个季度的确很难看到亮眼的消费数据，但若用对比 2019 年，

不少优秀公司还是有 20%-30%复合增速，处于良好的经营状态，表观数据不好看并不等于实际状况不好。

3) 估值，站在年初时点，消费整体估值水位较高，透支的业绩增长或者以时间消化估值、或者直接调整，近期市场表现是选择了后者。我们认为当前时点大部分必选消费品或已经调整到了估值较低位，可选消费也在估值中枢偏下，等待 8 月中报确认业绩与估值的匹配度，消费板块的性价比会进一步得到确认，未来 1 个季度我们认为消费板块可能将迎来较好的配置窗口期。

#### 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、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：

长信消费升级混合 A：权益登记日 2021 年 1 月 13 日，除息日 2021 年 1 月 13 日，每 10 份基金份额分红 0.500 元，现金形式发放 34,784,798.13 元，再投资形式发放 1,083,124.82 元，利润分配合计 35,867,922.95 元。

长信消费升级混合 C：权益登记日 2021 年 1 月 13 日，除息日 2021 年 1 月 13 日，每 10 份基

金份额分红 0.500 元，现金形式发放 7,236,245.45 元，再投资形式发放 606,773.80 元，利润分配合计 7,843,019.25 元。

本基金收益分配原则如下：

1、本基金在符合基金法定分红条件的前提下可进行收益分配，具体分红方案见基金管理人根据基金运作情况届时不定期发布的相关分红公告，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各类别基金份额对应的可供分配利润将有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

3、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相应类别的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；

4、基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去该类每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

5、法律法规或监管机关另有规定的，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

2021 年上半年度，基金托管人在长信消费升级混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

### 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

2021 年上半年度，长信基金管理有限责任公司在长信消费升级混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金进行 1 次收益分配，分配金额为 43,710,942.20 元，符合基金合同的规定。

### 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

2021 年上半年度，由长信基金管理有限责任公司编制并经托管人复核审查的有关长信消费升级混合型证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## §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：长信消费升级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<br>2021 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>      |            |                                |                                  |
| 银行存款            | 6.4.7.1    | 7,561,462.58                   | 2,402,861.07                     |
| 结算备付金           |            | 68,035.00                      | 10,868,041.20                    |
| 存出保证金           |            | 259,610.97                     | 93,783.62                        |
| 交易性金融资产         | 6.4.7.2    | 677,841,349.62                 | 575,081,771.21                   |
| 其中：股票投资         |            | 639,815,032.42                 | 315,615,671.21                   |
| 基金投资            |            | -                              | -                                |
| 债券投资            |            | 38,026,317.20                  | 259,466,100.00                   |
| 资产支持证券投资        |            | -                              | -                                |
| 贵金属投资           |            | -                              | -                                |
| 衍生金融资产          | 6.4.7.3    | -                              | -                                |
| 买入返售金融资产        | 6.4.7.4    | -                              | 340,000,000.00                   |
| 应收证券清算款         |            | 4,973,117.30                   | -                                |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 750,195.82                     | 6,163,505.50                     |
| 应收股利            |            | 161,330.52                     | -                                |
| 应收申购款           |            | 1,430,504.23                   | -                                |
| 递延所得税资产         |            | -                              | -                                |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                              | -                                |
| 资产总计            |            | 693,045,606.04                 | 934,609,962.60                   |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2021 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>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          | 6.4.7.3    | -                              | -                                |
| 卖出回购金融资产款       |            | -                              | -                                |
| 应付证券清算款         |            | 1,728.42                       | 5,032,774.12                     |
| 应付赎回款           |            | 9,979,300.95                   | -                                |
| 应付管理人报酬         |            | 856,231.29                     | 1,135,560.35                     |
| 应付托管费           |            | 114,164.16                     | 151,408.07                       |
| 应付销售服务费         |            | 81,787.91                      | 81,456.00                        |
| 应付交易费用          | 6.4.7.7    | 1,271,144.12                   | 226,211.46                       |
| 应交税费            |            | 2.02                           | 1.22                             |

|               |          |                |                |
|---------------|----------|----------------|----------------|
| 应付利息          |          | -              | -              |
| 应付利润          |          | -              | -              |
| 递延所得税负债       |          | -              | -              |
| 其他负债          | 6.4.7.8  | 112,891.31     | 40,000.00      |
| 负债合计          |          | 12,417,250.18  | 6,667,411.22   |
| <b>所有者权益：</b> |          |                |                |
| 实收基金          | 6.4.7.9  | 638,415,102.20 | 874,218,866.49 |
| 未分配利润         | 6.4.7.10 | 42,213,253.66  | 53,723,684.89  |
| 所有者权益合计       |          | 680,628,355.86 | 927,942,551.38 |
| 负债和所有者权益总计    |          | 693,045,606.04 | 934,609,962.60 |

注：1、报告截止日 2021 年 6 月 30 日，长信消费升级混合 A 份额净值 1.0671 元，长信消费升级混合 C 份额净值 1.0629 元。基金份额总额为 638,415,102.20 份，其中长信消费升级混合 A 份额 484,938,389.80 份；长信消费升级混合 C 份额 153,476,712.40 份。

2、本基金本报告期为 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日，本基金基金合同于 2020 年 11 月 4 日正式生效，本报告期的财务报表和报表附注均无同期对比数据。

## 6.2 利润表

会计主体：长信消费升级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<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|------------------|------------|---------------------------------------|
| <b>一、收入</b>      |            | 2,506,145.49                          |
| 1.利息收入           |            | 744,702.69                            |
| 其中：存款利息收入        | 6.4.7.11   | 92,574.83                             |
| 债券利息收入           |            | 531,338.88                            |
| 资产支持证券利息收入       |            | -                                     |
| 买入返售金融资产收入       |            | 120,788.98                            |
| 证券出借利息收入         |            | -                                     |
| 其他利息收入           |            | -                                     |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） |            | 21,900,910.92                         |
| 其中：股票投资收益        | 6.4.7.12   | 19,715,219.86                         |
| 基金投资收益           |            | -                                     |
| 债券投资收益           | 6.4.7.13   | 272,919.44                            |
| 资产支持证券投资收益       | 6.4.7.13.5 | -                                     |
| 贵金属投资收益          | 6.4.7.14   | -                                     |
| 衍生工具收益           | 6.4.7.15   | -                                     |
| 股利收益             | 6.4.7.16   | 1,912,771.62                          |
| 3.公允价值变动收益（损失以   | 6.4.7.17   | -23,352,660.58                        |

|                            |            |               |
|----------------------------|------------|---------------|
| “-”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)          | 6.4.7.18   | 3,213,192.46  |
| <b>减:二、费用</b>              |            | 10,028,847.91 |
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2.1 | 6,067,191.26  |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2.2 | 808,958.80    |
| 3. 销售服务费                   | 6.4.10.2.3 | 508,814.90    |
| 4. 交易费用                    | 6.4.7.19   | 2,505,814.77  |
| 5. 利息支出                    |            | 26,375.85     |
| 其中: 卖出回购金融资产支出             |            | 26,375.85     |
| 6. 税金及附加                   |            | 1.33          |
| 7. 其他费用                    | 6.4.7.20   | 111,691.00    |
| <b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b> |            | -7,522,702.42 |
| 减: 所得税费用                   |            | -             |
| <b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>   |            | -7,522,702.42 |

注: 本基金本报告期为 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日, 本基金基金合同于 2020 年 11 月 4 日起正式生效, 本报告期的财务报表和报表附注均无同期对比数据。

### 6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 长信消费升级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<br>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)          | 874,218,866.49                        | 53,723,684.89 | 927,942,551.38  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | -                                     | -7,522,702.42 | -7,522,702.42   |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数     | -235,803,764.29                       | 39,723,213.39 | -196,080,550.90 |

|  |                 |                |                 |
|--|-----------------|----------------|-----------------|
| (净值减少以“-”号填列)                          |                 |                |                 |
| 其中：1.基金申购款                             | 663,220,663.49  | 74,025,362.49  | 737,246,025.98  |
| 2.基金赎回款                                | -899,024,427.78 | -34,302,149.10 | -933,326,576.88 |
| 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) | -               | -43,710,942.20 | -43,710,942.20  |
| 五、期末所有者权益(基金净值)                        | 638,415,102.20  | 42,213,253.66  | 680,628,355.86  |

注：本基金本报告期为 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日，本基金基金合同于 2020 年 11 月 4 日起正式生效，本报告期的财务报表和报表附注均无同期对比数据。

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：

|              |             |              |
|--------------|-------------|--------------|
| _____<br>刘元瑞 | _____<br>覃波 | _____<br>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

长信消费升级混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人长信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《长信消费升级混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关法律法规的规定,经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)以证监许可[2020]1121 号文批准公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限为不定期,本基金根据认购、申购费用、销售服务费用收取方式的不同,将基金份额分为 A 类基金份额和 C 类基金份额。本基金首次设立募集基金份额为 874,218,866.49 份,经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了编号为德师报(验)字(20)第 00619 号验资报告。基金合同于 2020 年 11 月 4 日生效。本基金的基金管理人为长信基金管理有限责任公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、截至报告期末最新公告的基金合同及《长信消费升级混合型证券投资基金招募说明书》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股票(包括中小板、创业板和其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、存托凭证、港股通标的股票、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债

券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、地方政府债、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具、国债期货、股指期货、股票期权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)。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,其投资比例遵循届时有效的法律法规和相关规定。基金的投资组合比例为:本基金股票资产占基金资产的 60%-95%,其中投资于港股通标的股票的比例不高于股票资产的 50%;投资于消费升级主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的 80%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货及股票期权合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值 5%的现金(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。国债期货、股指期货、股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。如果法律法规对该比例要求有变更的,在履行适当程序后,以变更后的比例为准,本基金的投资比例会做相应调整。

本基金的业绩比较基准为:中证内地消费主题指数收益率\*70%+中证综合债指数收益率\*20%+恒生指数收益率(按估值汇率调整)\*10%

#### 6.4.2 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”)以及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,同时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发布的若干基金行业实务操作。

#### 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 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度,即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 6.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

#### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### 1) 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，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，暂无金融资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中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及应收款项。

##### 2) 金融负债的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将持有的金融负债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负债和其他金融负债。本基金暂无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。贷款及应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，贷款及应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价（包括转出的非现金资产或承担的新金融负债）之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层次的输入值确定公允价值计量层次。第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值是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；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

1) 对于银行间市场交易的固定收益品种，以及交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照第三方估值机构提供的估值确定公允价值。

2) 对存在活跃市场的其他投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值；对于发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行时股票公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，按照监管机构或行业协会的有关规定确定公允价值。

3) 对存在活跃市场的其他投资品种，如估值日无市价且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

4) 当投资品种不再存在活跃市场，基金管理人估值委员会认为必要时，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收



基金的变动分别于上述各交易确认日认列。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

##### — 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

##### — 投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认。

债券投资收益为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额确认，由上市公司代扣代缴的个人所得税于卖出交易日按实际代扣代缴金额确认。

##### — 公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产卖出或到期时转出计入投资收益。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50%的年费率逐日计提。

本基金的基金托管费按前一日基金资产净值 0.2%的年费率逐日计提。

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值 0.60%的年费率逐日计提。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的交易费用发生时按照确定的金额计入交易费用。

卖出回购金融资产款支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率逐日计提。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

1、本基金在符合基金法定分红条件的前提下可进行收益分配，具体分红方案见基金管理人根据基金运作情况届时不定期发布的相关分红公告，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各类别基金份额对应的可供分配利润将有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

3、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相应类别的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；

4、基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去该类每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在符合法律法规及基金合同约定，并对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则和支付方式进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

#### 6.4.4.12 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。

#### 6.4.4.13 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股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

1) 对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》（中基协发[2017]6 号），在估值日按照该通知规定的流通受限股票公允价值计算模型进行估值。

2) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活

跃)等情况,根据《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》(中国证监会公告[2017]13号)及《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》(中基协发[2013]13号)相关规定,本基金根据情况决定使用指数收益法、可比公司法、市场价格模型法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

3)根据《关于发布〈中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准〉的通知》(中基协发[2014]24号),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。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无需说明的重大会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无需说明的重大会计估计变更。

### 6.4.5.3 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。

## 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008年9月18日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85号《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》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2015]101号《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》、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]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]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》及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

1)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、债券免征增值税;公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务,以基金管理人为增

值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。

2)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，暂不缴纳企业所得税。

3)对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司代扣代缴个人所得税；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，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

4)对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，对受让方不再缴纳印花税。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目             | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 7,561,462.58           |
| 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：            | 7,561,462.58           |

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |                |               |
|---------------|------------------------|----------------|---------------|
|               | 成本                     | 公允价值           | 公允价值变动        |
| 股票            | 609,654,070.62         | 639,815,032.42 | 30,160,961.80 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                      | -              | -             |
| 债券            | 交易所市场                  | 27,970,607.44  | 28,007,317.20 |
|               | 银行间市场                  | 10,001,990.00  | 10,019,000.00 |
|               | 合计                     | 37,972,597.44  | 38,026,317.20 |
| 资产支持证券        | -                      | -              | -             |
| 基金            | -                      | -              | -             |

|    |                |                |               |
|----|----------------|----------------|---------------|
| 其他 | -              | -              | -             |
| 合计 | 647,626,668.06 | 677,841,349.62 | 30,214,681.56 |

### 6.4.7.3 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。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 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。

#### 6.4.7.4.2 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因买断式逆回购交易而取得的债券。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2021年6月30日 |
|------------|-------------------|
| 应收活期存款利息   | 568.06            |
| 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  | 27.54             |
| 应收债券利息     | 749,495.01        |
| 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         | 105.21            |
| 合计         | 750,195.82        |

注：其他为应收结算保证金利息。

### 6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 1,271,009.42      |
| 银行间市场应付交易费用 | 134.70            |

|    |              |
|----|--------------|
| 合计 | 1,271,144.12 |
|----|--------------|

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                 |
| 应付赎回费       | 14,171.76         |
| 应付证券出借违约金   | -                 |
| 预提账户维护费     | 4,500.00          |
| 预提审计费       | 34,712.18         |
| 预提信息披露费     | 59,507.37         |
| 合计          | 112,891.31        |

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 长信消费升级混合 A    |                            |                 |
|---------------|----------------------------|-----------------|
| 项目            | 本期<br>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          | 717,358,484.80             | 717,358,484.80  |
| 本期申购          | 495,705,362.32             | 495,705,362.32  |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -728,125,457.32            | -728,125,457.32 |
| - 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           | 484,938,389.80             | 484,938,389.80  |

金额单位：人民币元

| 长信消费升级混合 C    |                            |                 |
|---------------|----------------------------|-----------------|
| 项目            | 本期<br>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          | 156,860,381.69             | 156,860,381.69  |
| 本期申购          | 167,515,301.17             | 167,515,301.17  |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -170,898,970.46            | -170,898,970.46 |
| - 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 | 153,476,712.40 | 153,476,712.40 |
|-----|----------------|----------------|

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 长信消费升级混合 A     |                |                |                |
|----------------|----------------|----------------|----------------|
| 项目             | 已实现部分          | 未实现部分          | 未分配利润合计        |
| 上年度末           | 250,023.60     | 43,961,560.02  | 44,211,583.62  |
| 本期利润           | 15,058,246.89  | -19,795,619.99 | -4,737,373.10  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 4,547,152.31   | 24,406,986.38  | 28,954,138.69  |
| 其中：基金申购款       | 1,122,353.06   | 54,743,767.91  | 55,866,120.97  |
| 基金赎回款          | 3,424,799.25   | -30,336,781.53 | -26,911,982.28 |
| 本期已分配利润        | -35,867,922.95 | -              | -35,867,922.95 |
| 本期末            | -16,012,500.15 | 48,572,926.41  | 32,560,426.26  |

单位：人民币元

| 长信消费升级混合 C     |               |               |               |
|----------------|---------------|---------------|---------------|
| 项目             | 已实现部分         | 未实现部分         | 未分配利润合计       |
| 上年度末           | -93,680.85    | 9,605,782.12  | 9,512,101.27  |
| 本期利润           | 771,711.27    | -3,557,040.59 | -2,785,329.32 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 1,484,648.60  | 9,284,426.10  | 10,769,074.70 |
| 其中：基金申购款       | 14,715.97     | 18,144,525.55 | 18,159,241.52 |
| 基金赎回款          | 1,469,932.63  | -8,860,099.45 | -7,390,166.82 |
| 本期已分配利润        | -7,843,019.25 | -             | -7,843,019.25 |
| 本期末            | -5,680,340.23 | 15,333,167.63 | 9,652,827.40  |

#### 6.4.7.11 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  | 42,994.76            |
| 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 | 41,541.42            |
| 其他        | 8,038.65             |
| 合计        | 92,574.83            |

注：其他为结算保证金利息收入和申购款利息收入。

**6.4.7.12 股票投资收益****6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 708,101,282.95             |
| 减：卖出股票成本总额 | 688,386,063.09             |
| 买卖股票差价收入   | 19,715,219.86              |

**6.4.7.13 债券投资收益****6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

| 项目                            | 本期<br>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 | 272,919.44                 |
| 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                            | 272,919.44                 |

**6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

| 项目                      | 本期<br>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   | 283,091,223.14             |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 276,719,373.56             |
| 减：应收利息总额                | 6,098,930.14               |
| 买卖债券差价收入                | 272,919.44                 |

**6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入**

注：本基金本报告期内无债券投资赎回差价收入。

**6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期内无债券投资申购差价收入。

**6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益**

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。



**6.4.7.14 贵金属投资收益****6.4.7.14.1 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。

**6.4.7.15 衍生工具收益****6.4.7.15.1 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。

**6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益**

注：本基金本报告期内无其他衍生工具收益。

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|---------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 1,912,771.62               |
| 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            | 1,912,771.62               |

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

| 项目名称                       | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|----------------------------|----------------------------|
| 1. 交易性金融资产                 | -23,352,660.58             |
| ——股票投资                     | -23,167,436.64             |
| ——债券投资                     | -185,223.94                |
| ——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<br>增值税 | -                          |
| 合计                         | -23,352,660.58             |

**6.4.7.18 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      | 3,208,411.34                    |
| 转换费收入 009778 | 178.34                          |
| 转换费收入 009779 | 4,602.78                        |
| 合计           | 3,213,192.46                    |

注：对于持有期少于 30 日的基金份额所收取的赎回费，全额计入基金财产；对于持有期不少于 30 日但少于 3 个月的基金份额所收取的赎回费，其 75% 计入基金财产；对于持有期不少于 3 个月但少于 6 个月的基金份额所收取的赎回费，其 50% 计入基金财产；对于持有期长于 6 个月的基金份额所收取的赎回费，其 25% 计入基金财产。

#### 6.4.7.19 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 | 2,505,639.77                    |
| 银行间市场交易费用 | 175.00                          |
| 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        | 2,505,814.77                    |

#### 6.4.7.20 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   | 59,507.37                       |
| 证券出借违约金 | -                               |
| 账户维护费   | 10,500.00                       |
| 其他费用    | 6,971.45                        |
| 合计      | 111,691.00                      |

注：其他费用为银行手续费。

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 6.4.8.1 或有事项

注：截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

注：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。

## 6.4.9 关联方关系

### 6.4.9.1 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。

### 6.4.9.2 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、注册登记机构、基金销售机构 |
| 交通银行股份有限公司（以下简称“交通银行”）   | 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     |

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |                  |
|-------|----------------------------|------------------|
|       | 成交金额                       | 占当期股票<br>成交总额的比例 |
| 长江证券  | 703,132,860.13             | 40.52%           |

注：本基金基金合同于2020年11月4日起正式生效，无上年度可比期间数据。

#### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |                  |
|-------|----------------------------|------------------|
|       | 成交金额                       | 占当期债券<br>成交总额的比例 |

|      |               |        |
|------|---------------|--------|
| 长江证券 | 39,962,924.90 | 62.98% |
|------|---------------|--------|

注：本基金基金合同于 2020 年 11 月 4 日起正式生效，无上年度可比期间数据。

### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |                    |
|-------|---------------------------------------|--------------------|
|       | 回购成交金额                                | 占当期债券回购<br>成交总额的比例 |
| 长江证券  | 27,000,000.00                         | 42.86%             |

注：本基金基金合同于 2020 年 11 月 4 日起正式生效，无上年度可比期间数据。

### 6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。

### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |                |          |                  |
|-------|---------------------------------------|----------------|----------|------------------|
|       | 当期佣金                                  | 占当期佣金总<br>量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金<br>总额的比例 |
| 长江证券  | 654,829.97                            | 51.52%         | -        | -                |

注：本基金基金合同于 2020 年 11 月 4 日起正式生效，无上年度可比期间数据。

## 6.4.10.2 关联方报酬

### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|-----------------|---------------------------------------|
|                 | 当期发生的基金应支付的管理费                        |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 2,350,584.75                          |

注：1、本基金基金合同于 2020 年 11 月 4 日起正式生效，无上年度可比期间数据。

2、本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

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

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

| 项目             | 本期                              |
|----------------|---------------------------------|
|                | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 808,958.80                      |

注：1、本基金基金合同于 2020 年 11 月 4 日起正式生效，无上年度可比期间数据。

2、本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.2% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

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

**6.4.10.2.3 销售服务费**

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期                              |               |           |
|----------------|---------------------------------|---------------|-----------|
|                | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |               |           |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                |               |           |
|                | 长信消费升级混合<br>A                   | 长信消费升级混合<br>C | 合计        |
| 长江证券           | -                               | 4,749.19      | 4,749.19  |
| 长信基金           | -                               | 24,984.72     | 24,984.72 |
| 交通银行           | -                               | 6,414.68      | 6,414.68  |
| 合计             | -                               | 36,148.59     | 36,148.59 |

注：1、本基金基金合同于 2020 年 11 月 4 日起正式生效，无上年度可比期间数据。

2、本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.60% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

**6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

注：本基金在本报告期末与关联方通过银行间同业市场进行债券(含回购)交易。

**6.4.10.4 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****6.4.10.4.1 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**

注：本基金本报告期末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。

**6.4.10.4.2 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**

注：本基金本报告期末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。

**6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况****6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

注：基金管理人在本报告期末运用固有资金投资本基金。

**6.4.10.5.2 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**

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。

**6.4.10.6 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<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |           |
|-------|----------------------------|-----------|
|       | 期末余额                       | 当期利息收入    |
| 交通银行  | 7,561,462.58               | 42,994.76 |

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。

**6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

注：本基金在本报告期末在承销期内购入由关联方承销的证券。

**6.4.10.8 其他关联交易事项的说明**

注：本基金本报告期无其他关联交易事项。

**6.4.11 利润分配情况**

长信消费升级混合 A

金额单位：人民币元

| 序 | 除息日 | 每 10 份 | 现金形式 | 再投资形式 | 本期利润分配 |
|---|-----|--------|------|-------|--------|
|---|-----|--------|------|-------|--------|

| 号  | 权益<br>登记日             | 场内 | 场外                    | 基金份额分<br>红数 | 发放总额          | 发放总额         | 合计            | 备注 |
|----|-----------------------|----|-----------------------|-------------|---------------|--------------|---------------|----|
| 1  | 2021 年<br>1 月 13<br>日 | -  | 2021 年<br>1 月 13<br>日 | 0.500       | 34,784,798.13 | 1,083,124.82 | 35,867,922.95 |    |
| 合计 | -                     | -  |                       | 0.500       | 34,784,798.13 | 1,083,124.82 | 35,867,922.95 |    |

长信消费升级混合 C

金额单位：人民币元

| 序号 | 权益<br>登记日             | 除息日 |                       | 每 10 份<br>基金份额分<br>红数 | 现金形式<br>发放总额 | 再投资形式<br>发放总额 | 本期利润分配<br>合计 | 备注 |
|----|-----------------------|-----|-----------------------|-----------------------|--------------|---------------|--------------|----|
|    |                       | 场内  | 场外                    |                       |              |               |              |    |
| 1  | 2021 年<br>1 月 13<br>日 | -   | 2021 年<br>1 月 13<br>日 | 0.500                 | 7,236,245.45 | 606,773.80    | 7,843,019.25 |    |
| 合计 | -                     | -   |                       | 0.500                 | 7,236,245.45 | 606,773.80    | 7,843,019.25 |    |

#### 6.4.12 期末（2021 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

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

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票 |          |                       |                        |            |          |            |              |            |            |    |
|----------------------|----------|-----------------------|------------------------|------------|----------|------------|--------------|------------|------------|----|
| 证券<br>代码             | 证券<br>名称 | 成功<br>认购日             | 可流<br>通日               | 流通受<br>限类型 | 认购<br>价格 | 期末估<br>值单价 | 数量<br>(单位:股) | 期末<br>成本总额 | 期末估值总<br>额 | 备注 |
| 688606               | 奥泰生物     | 2021<br>年 3 月<br>17 日 | 2021<br>年 9 月<br>27 日  | 新股锁<br>定   | 133.67   | 139.31     | 2,500        | 334,175.00 | 348,275.00 | -  |
| 300957               | 贝泰妮      | 2021<br>年 3 月<br>18 日 | 2021<br>年 9 月<br>27 日  | 新股锁<br>定   | 47.33    | 251.96     | 454          | 21,487.82  | 114,389.84 | -  |
| 688575               | 亚辉龙      | 2021<br>年 5 月<br>10 日 | 2021<br>年 11 月<br>17 日 | 新股锁<br>定   | 14.80    | 32.09      | 3,435        | 50,838.00  | 110,229.15 | -  |
| 688216               | 气派科技     | 2021<br>年 6 月<br>15 日 | 2021<br>年 12 月<br>23 日 | 新股锁<br>定   | 14.82    | 47.64      | 2,000        | 29,640.00  | 95,280.00  | -  |

|        |      |            |             |        |       |        |       |           |           |   |
|--------|------|------------|-------------|--------|-------|--------|-------|-----------|-----------|---|
| 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 | - |
| 688533 | 上声电子 | 2021年4月9日  | 2021年10月19日 | 新股锁定   | 7.72  | 19.11  | 3,493 | 26,965.96 | 66,751.23 | - |
| 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 | - |
| 300979 | 华利集团 | 2021年4月15日 | 2021年10月26日 | 新股锁定   | 33.22 | 87.50  | 685   | 22,755.70 | 59,937.50 | - |
| 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 | - |
| 688683 | 莱尔科技 | 2021年4月1日  | 2021年10月12日 | 新股锁定   | 9.51  | 14.73  | 3,296 | 31,344.96 | 48,550.08 | - |
| 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 | - |
| 300973 | 立高食品 | 2021年4月8日  | 2021年10月15日 | 新股锁定   | 28.28 | 115.71 | 360   | 10,180.80 | 41,655.60 | - |
| 688092 | 爱科科技 | 2021年3月12日 | 2021年9月22日  | 新股锁定   | 19.11 | 33.21  | 1,137 | 21,728.07 | 37,759.77 | - |
| 300981 | 中红医疗 | 2021年4月19日 | 2021年10月27日 | 新股锁定   | 48.59 | 90.39  | 361   | 17,540.99 | 32,630.79 | - |
| 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   | 28.77 | 99.85 | 240   | 6,904.80  | 23,964.00 | - |
| 301009 | 可靠股份 | 2021年6月8日  | 2021年12月17日 | 新股锁定   | 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   | 7.64  | 38.83 | 462   | 3,529.68  | 17,939.46 | - |
| 688226 | 威腾电气 | 2021年6月28日 | 2021年7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   | 15.83 | 45.29 | 317   | 5,018.11  | 14,356.93 | - |
| 300968 | 格林精密 | 2021年4月6日  | 2021年10月15日 | 新股锁定   | 6.87  | 12.07 | 1,162 | 7,982.94  | 14,025.34 | - |
| 300940 | 南极光  | 2021年1月27日 | 2021年8月3日   | 新股锁定   | 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   | 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   | 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29日 | 新股锁定   | 8.72  | 27.11 | 471   | 4,107.12  | 12,768.81 | - |
| 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 | - |
| 300962 | 中金辐照 | 2021年3月29日 | 2021年10月11日 | 新股锁定   | 3.40  | 16.37 | 576   | 1,958.40  | 9,429.12  | - |
| 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  | - |
| 300966 | 共同药业 | 2021年3月31日 | 2021年10月11日 | 新股锁定   | 8.24  | 31.54 | 286   | 2,356.64  | 9,020.44  | - |
| 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   | 8.67  | 27.42 | 324   | 2,808.00  | 8,884.08  | - |
| 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  | - |
| 300961 | 深水海纳 | 2021年3月23日 | 2021年9月30日  | 新股锁定   | 8.48  | 22.07 | 394   | 3,341.12  | 8,695.58  | - |

|        |      |             |             |      |       |       |     |          |          |   |
|--------|------|-------------|-------------|------|-------|-------|-----|----------|----------|---|
| 300986 | 志特新材 | 2021年4月21日  | 2021年11月1日  | 新股锁定 | 14.79 | 30.57 | 264 | 3,904.56 | 8,070.48 | - |
| 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 | - |
| 300978 | 东箭科技 | 2021年4月15日  | 2021年10月26日 | 新股锁定 | 8.42  | 13.60 | 593 | 4,993.06 | 8,064.80 | - |
| 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 | - |
| 300975 | 商络电子 | 2021年4月14日  | 2021年10月21日 | 新股锁定 | 5.48  | 13.03 | 492 | 2,696.16 | 6,410.76 | - |
| 300963 | 中洲特材 | 2021年3月30日  | 2021年10月11日 | 新股锁定 | 12.13 | 22.49 | 283 | 3,432.79 | 6,364.67 | - |
| 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 | - |
| 300967 | 晓鸣股份 | 2021年4月2日   | 2021年10月13日 | 新股锁定 | 4.54  | 11.54 | 507 | 2,301.78 | 5,850.78 | - |

|        |      |            |             |      |       |       |     |          |          |   |
|--------|------|------------|-------------|------|-------|-------|-----|----------|----------|---|
| 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 | - |
| 300960 | 通业科技 | 2021年3月22日 | 2021年9月29日  | 新股锁定 | 12.08 | 23.06 | 234 | 2,826.72 | 5,396.04 | - |
| 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22日 | 新股锁定 | 8.05  | 24.26 | 170 | 1,368.50 | 4,124.20 | - |
| 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：本基金对限售期内出现权益分配的股票认购价格进行调整，公式为：新认购价格=(原认购价格-股息金额+配股价×配股率)÷(1+配股率+送股率)。

#### 6.4.12.2 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。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 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。

##### 6.4.12.3.2 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。

#### 6.4.12.4 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。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 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。

#### 6.4.13.2 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，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交通银行，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。

#### 6.4.13.2.1 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<br>2021年6月30日 | 上年度末<br>2020年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| A-1    | 0.00              | 0.00                |
| A-1 以下 | 0.00              | 0.00                |
| 未评级    | 37,520,000.00     | 258,974,100.00      |
| 合计     | 37,520,000.00     | 258,974,100.00      |

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。

#### 6.4.13.2.2 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。

#### 6.4.13.2.3 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。

#### 6.4.13.2.4 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<br>2021年6月30日 | 上年度末<br>2020年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| AAA    | 506,317.20        | 492,000.00          |
| AAA 以下 | 0.00              | 0.00                |
| 未评级    | 0.00              | 0.00                |
| 合计     | 506,317.20        | 492,000.00          |

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。

#### 6.4.13.2.5 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。

#### 6.4.13.2.6 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。

### 6.4.13.3 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。

### 6.4.13.3.1 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。

### 6.4.13.4 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。

#### 6.4.13.4.1 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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2021年6月30<br>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                  | 7,561,462.58  | -      | -    | -    | -              | 7,561,462.58   |
| 结算备付金                 | 68,035.00     | -      | -    | -    | -              | 68,035.00      |
| 存出保证金                 | 259,610.97    | -      | -    | -    | -              | 259,610.97     |
| 交易性金融资产               | 38,026,317.20 | -      | -    | -    | 639,815,032.42 | 677,841,349.62 |
| 应收证券清算款               | -             | -      | -    | -    | 4,973,117.30   | 4,973,117.30   |
| 应收利息                  | -             | -      | -    | -    | 750,195.82     | 750,195.82     |
| 应收股利                  | -             | -      | -    | -    | 161,330.52     | 161,330.52     |

|                     |                |            |      |      |                |                |
|---------------------|----------------|------------|------|------|----------------|----------------|
| 应收申购款               | -              | -          | -    | -    | 1,430,504.23   | 1,430,504.23   |
| 资产总计                | 45,915,425.75  | -          | -    | -    | 647,130,180.29 | 693,045,606.04 |
| 负债                  |                |            |      |      |                |                |
| 应付证券清算款             | -              | -          | -    | -    | 1,728.42       | 1,728.42       |
| 应付赎回款               | -              | -          | -    | -    | 9,979,300.95   | 9,979,300.95   |
| 应付管理人报酬             | -              | -          | -    | -    | 856,231.29     | 856,231.29     |
| 应付托管费               | -              | -          | -    | -    | 114,164.16     | 114,164.16     |
| 应付销售服务费             | -              | -          | -    | -    | 81,787.91      | 81,787.91      |
| 应付交易费用              | -              | -          | -    | -    | 1,271,144.12   | 1,271,144.12   |
| 应交税费                | -              | -          | -    | -    | 2.02           | 2.02           |
| 其他负债                | -              | -          | -    | -    | 112,891.31     | 112,891.31     |
| 负债总计                | -              | -          | -    | -    | 12,417,250.18  | 12,417,250.18  |
| 利率敏感度缺口             | 45,915,425.75  | -          | -    | -    | 634,712,930.11 | 680,628,355.86 |
| 上年度末<br>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                | 2,402,861.07   | -          | -    | -    | -              | 2,402,861.07   |
| 结算备付金               | 10,868,041.20  | -          | -    | -    | -              | 10,868,041.20  |
| 存出保证金               | 76,911.40      | -          | -    | -    | 16,872.22      | 93,783.62      |
| 交易性金融资产             | 258,974,100.00 | 492,000.00 | -    | -    | 315,615,671.21 | 575,081,771.21 |
| 买入返售金融资产            | 340,000,000.00 | -          | -    | -    | -              | 340,000,000.00 |
| 应收利息                | -              | -          | -    | -    | 6,163,505.50   | 6,163,505.50   |
| 资产总计                | 612,321,913.67 | 492,000.00 | -    | -    | 321,796,048.93 | 934,609,962.60 |
| 负债                  |                |            |      |      |                |                |
| 应付证券清算款             | -              | -          | -    | -    | 5,032,774.12   | 5,032,774.12   |
| 应付管理人报酬             | -              | -          | -    | -    | 1,135,560.35   | 1,135,560.35   |
| 应付托管费               | -              | -          | -    | -    | 151,408.07     | 151,408.07     |
| 应付销售服务费             | -              | -          | -    | -    | 81,456.00      | 81,456.00      |
| 应付交易费用              | -              | -          | -    | -    | 226,211.46     | 226,211.46     |
| 应交税费                | -              | -          | -    | -    | 1.22           | 1.22           |
| 其他负债                | -              | -          | -    | -    | 40,000.00      | 40,000.00      |
| 负债总计                | -              | -          | -    | -    | 6,667,411.22   | 6,667,411.22   |
| 利率敏感度缺口             | 612,321,913.67 | 492,000.00 | -    | -    | 315,128,637.71 | 927,942,551.38 |

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

#### 6.4.13.4.1.2 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 | 19,113.63       | 28,635.36         |
| 市场利率上升 27 个基点 | -19,113.63      | -28,635.36        |

#### 6.4.13.4.2 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。本基金持有不以记账本位币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

截止于 2021 年 6 月 30 日，本基金所持有投资于香港股票市场的交易性金融资产，以港币计价，金额折合成人民币为 213,764,915.07 元（截止于 2020 年 12 月 31 日：45,211,343.76 元）。

#### 6.4.13.4.3 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：

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2021年6月30日 |                          | 上年度末<br>2020年12月31日 |                       |
|---------------|-------------------|--------------------------|---------------------|-----------------------|
|               | 公允价值              | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) | 公允价值                | 占基金资<br>产净值比<br>例 (%) |
| 交易性金融资产—股票投资  | 639,815,032.42    | 94.00                    | 315,615,671.21      | 34.01                 |
| 交易性金融资产—基金投资  | -                 | -                        | -                   | -                     |
| 交易性金融资产—债券投资  | 38,026,317.20     | 5.59                     | 259,466,100.00      | 27.96                 |
| 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 | 677,841,349.62 | 99.59 | 575,081,771.21 | 61.97 |

#### 6.4.13.4.3.2 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 5.24%（2020 年 12 月 31 日 VaR 值为 2.32%） | -35,681,036.22              | -21,555,095.12    |

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。

#### 6.4.14 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) 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。

##### (b) 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 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 638,701,895.07 元，属于第二层次的余额为人民币 37,822,983.52 元，属于第三层次的余额为人民币 1,316,471.03 元。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于本基金投资的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、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，确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。

##### (iii) 第三层次公允价值计量的金融工具

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 452,758.82 元，本期变动金额为人民币 863,712.21 元，本期末余额为人民币 1,316,471.03 元。

(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。

## §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              | 639,815,032.42 | 92.32         |
|    | 其中：股票             | 639,815,032.42 | 92.32         |
| 2  | 基金投资              | -              | -             |
| 3  | 固定收益投资            | 38,026,317.20  | 5.49          |
|    | 其中：债券             | 38,026,317.20  | 5.49          |
|    | 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      | 7,629,497.58   | 1.10          |
| 8  | 其他各项资产            | 7,574,758.84   | 1.09          |
| 9  | 合计                | 693,045,606.04 | 100.00        |

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 213,603,584.55 元，占资产净值比例为 31.38%。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         | 5,850.78       | 0.00          |
| B  | 采矿业              | -              | -             |
| C  | 制造业              | 334,359,504.22 | 49.13         |
| 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           | 279,580.90     | 0.04          |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | -              | -             |
| H  | 住宿和餐饮业           | -              | -             |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务   | 36,074.21      | 0.01          |

| 业 |               |                |       |
|---|---------------|----------------|-------|
| J | 金融业           | 34,721.10      | 0.01  |
| K | 房地产业          | -              | -     |
| L | 租赁和商务服务业      | 27,749,149.00  | 4.08  |
| M | 科学研究和技术服务业    | 33,698,168.00  | 4.95  |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 36,272.33      | 0.01  |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | -              | -     |
| P | 教育            | -              | -     |
| Q | 卫生和社会工作       | 29,982,093.96  | 4.41  |
| R | 文化、体育和娱乐业     | -              | -     |
| S | 综合            | -              | -     |
|   | 合计            | 426,211,447.87 | 62.62 |

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别      | 公允价值（人民币）      | 占基金资产净值比例（%） |
|-----------|----------------|--------------|
| A 基础材料    | -              | -            |
| B 消费者非必需品 | 55,534,931.82  | 8.16         |
| C 消费者常用品  | 73,024,767.06  | 10.73        |
| D 能源      | -              | -            |
| E 金融      | -              | -            |
| F 医疗保健    | 58,497,271.92  | 8.59         |
| G 工业      | -              | -            |
| H 信息技术    | -              | -            |
| I 电信服务    | 26,546,613.75  | 3.90         |
| J 公用事业    | -              | -            |
| K 房地产     | -              | -            |
| 合计        | 213,603,584.55 | 31.38        |

### 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  | 02269  | 药明生物 | 494,044   | 58,497,271.92 | 8.59         |
| 2  | 600132 | 重庆啤酒 | 214,800   | 42,519,660.00 | 6.25         |
| 3  | 300595 | 欧普康视 | 385,800   | 39,949,590.00 | 5.87         |
| 4  | 600809 | 山西汾酒 | 82,200    | 36,825,600.00 | 5.41         |
| 5  | 603259 | 药明康德 | 215,200   | 33,698,168.00 | 4.95         |
| 6  | 603345 | 安井食品 | 128,700   | 32,692,374.00 | 4.80         |
| 7  | 09922  | 九毛九  | 1,233,888 | 32,597,519.48 | 4.79         |

|    |        |      |           |               |      |
|----|--------|------|-----------|---------------|------|
| 8  | 603899 | 晨光文具 | 370,100   | 31,295,656.00 | 4.60 |
| 9  | 603369 | 今世缘  | 575,800   | 31,185,328.00 | 4.58 |
| 10 | 300760 | 迈瑞医疗 | 63,700    | 30,579,185.00 | 4.49 |
| 11 | 000858 | 五粮液  | 101,000   | 30,086,890.00 | 4.42 |
| 12 | 300015 | 爱尔眼科 | 422,402   | 29,982,093.96 | 4.41 |
| 13 | 00291  | 华润啤酒 | 508,593   | 29,517,506.92 | 4.34 |
| 14 | 600519 | 贵州茅台 | 14,100    | 28,999,470.00 | 4.26 |
| 15 | 002027 | 分众传媒 | 2,948,900 | 27,749,149.00 | 4.08 |
| 16 | 000596 | 古井贡酒 | 114,200   | 27,350,900.00 | 4.02 |
| 17 | 09633  | 农夫山泉 | 821,549   | 26,626,005.46 | 3.91 |
| 18 | 00700  | 腾讯控股 | 54,630    | 26,546,613.75 | 3.90 |
| 19 | 06862  | 海底捞  | 673,994   | 22,937,412.34 | 3.37 |
| 20 | 01579  | 颐海国际 | 389,032   | 16,881,254.68 | 2.48 |
| 21 | 688276 | 百克生物 | 3,486     | 364,565.88    | 0.05 |
| 22 | 688606 | 奥泰生物 | 2,500     | 348,275.00    | 0.05 |
| 23 | 688161 | 威高骨科 | 3,069     | 325,467.45    | 0.05 |
| 24 | 301015 | 百洋医药 | 4,614     | 251,115.78    | 0.04 |
| 25 | 688601 | 力芯微  | 1,174     | 216,133.40    | 0.03 |
| 26 | 301013 | 利和兴  | 4,704     | 168,966.51    | 0.02 |
| 27 | 301016 | 雷尔伟  | 2,747     | 115,711.58    | 0.02 |
| 28 | 300957 | 贝泰妮  | 454       | 114,389.84    | 0.02 |
| 29 | 688575 | 亚辉龙  | 3,435     | 110,229.15    | 0.02 |
| 30 | 688216 | 气派科技 | 2,000     | 95,280.00     | 0.01 |
| 31 | 688698 | 伟创电气 | 4,751     | 94,972.49     | 0.01 |
| 32 | 688499 | 利元亨  | 2,149     | 83,488.65     | 0.01 |
| 33 | 688533 | 上声电子 | 3,493     | 66,751.23     | 0.01 |
| 34 | 301018 | 申菱环境 | 7,811     | 64,753.19     | 0.01 |
| 35 | 300979 | 华利集团 | 685       | 59,937.50     | 0.01 |
| 36 | 688087 | 英科再生 | 2,469     | 54,219.24     | 0.01 |
| 37 | 688683 | 莱尔科技 | 3,296     | 48,550.08     | 0.01 |
| 38 | 301020 | 密封科技 | 4,210     | 44,794.40     | 0.01 |
| 39 | 300894 | 火星人  | 628       | 42,704.00     | 0.01 |
| 40 | 300973 | 立高食品 | 360       | 41,655.60     | 0.01 |
| 41 | 688092 | 爱科科技 | 1,137     | 37,759.77     | 0.01 |
| 42 | 688367 | 工大高科 | 1,717     | 37,035.69     | 0.01 |
| 43 | 601528 | 瑞丰银行 | 2,230     | 34,721.10     | 0.01 |
| 44 | 300981 | 中红医疗 | 361       | 32,630.79     | 0.00 |
| 45 | 301021 | 英诺激光 | 2,899     | 27,424.54     | 0.00 |
| 46 | 300953 | 震裕科技 | 240       | 23,964.00     | 0.00 |

|    |        |      |       |           |      |
|----|--------|------|-------|-----------|------|
| 47 | 001207 | 联科科技 | 682   | 22,581.02 | 0.00 |
| 48 | 301009 | 可靠股份 | 801   | 22,339.89 | 0.00 |
| 49 | 688226 | 威腾电气 | 2,693 | 17,289.06 | 0.00 |
| 50 | 300925 | 法本信息 | 600   | 15,774.00 | 0.00 |
| 51 | 300982 | 苏文电能 | 317   | 14,356.93 | 0.00 |
| 52 | 300968 | 格林精密 | 1,162 | 14,025.34 | 0.00 |
| 53 | 300940 | 南极光  | 307   | 13,317.66 | 0.00 |
| 54 | 300614 | 百川畅银 | 329   | 13,285.02 | 0.00 |
| 55 | 300937 | 药易购  | 244   | 13,105.24 | 0.00 |
| 56 | 300942 | 易瑞生物 | 443   | 12,634.36 | 0.00 |
| 57 | 603171 | 税友股份 | 637   | 12,230.40 | 0.00 |
| 58 | 300933 | 中辰股份 | 1,112 | 11,609.28 | 0.00 |
| 59 | 300918 | 南山智尚 | 1,063 | 11,065.83 | 0.00 |
| 60 | 605287 | 德才股份 | 349   | 11,014.44 | 0.00 |
| 61 | 300955 | 嘉亨家化 | 232   | 10,688.24 | 0.00 |
| 62 | 300962 | 中金辐照 | 576   | 9,429.12  | 0.00 |
| 63 | 300952 | 恒辉安防 | 340   | 9,207.20  | 0.00 |
| 64 | 300966 | 共同药业 | 286   | 9,020.44  | 0.00 |
| 65 | 300945 | 曼卡龙  | 474   | 8,949.12  | 0.00 |
| 66 | 300948 | 冠中生态 | 324   | 8,884.08  | 0.00 |
| 67 | 300931 | 通用电梯 | 672   | 8,809.92  | 0.00 |
| 68 | 300961 | 深水海纳 | 394   | 8,695.58  | 0.00 |
| 69 | 300986 | 志特新材 | 264   | 8,070.48  | 0.00 |
| 70 | 300987 | 川网传媒 | 301   | 8,069.81  | 0.00 |
| 71 | 300978 | 东箭科技 | 593   | 8,064.80  | 0.00 |
| 72 | 300926 | 博俊科技 | 359   | 7,969.80  | 0.00 |
| 73 | 300993 | 玉马遮阳 | 410   | 7,908.90  | 0.00 |
| 74 | 300927 | 江天化学 | 217   | 6,531.70  | 0.00 |
| 75 | 300975 | 商络电子 | 492   | 6,410.76  | 0.00 |
| 76 | 300963 | 中洲特材 | 283   | 6,364.67  | 0.00 |
| 77 | 301011 | 华立科技 | 175   | 5,922.00  | 0.00 |
| 78 | 300943 | 春晖智控 | 255   | 5,867.55  | 0.00 |
| 79 | 300967 | 晓鸣股份 | 507   | 5,850.78  | 0.00 |
| 80 | 300929 | 华骐环保 | 183   | 5,407.65  | 0.00 |
| 81 | 300960 | 通业科技 | 234   | 5,396.04  | 0.00 |
| 82 | 605011 | 杭州热电 | 525   | 4,662.00  | 0.00 |
| 83 | 300995 | 奇德新材 | 191   | 4,454.12  | 0.00 |
| 84 | 301007 | 德迈仕  | 303   | 4,375.32  | 0.00 |
| 85 | 300998 | 宁波方正 | 201   | 4,285.32  | 0.00 |

|    |        |      |     |          |      |
|----|--------|------|-----|----------|------|
| 86 | 301012 | 扬电科技 | 170 | 4,124.20 | 0.00 |
| 87 | 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  | 603369 | 今世缘   | 72,175,086.71 | 7.78           |
| 2  | 000858 | 五粮液   | 63,150,590.00 | 6.81           |
| 3  | 002027 | 分众传媒  | 60,701,332.25 | 6.54           |
| 4  | 600519 | 贵州茅台  | 58,002,068.00 | 6.25           |
| 5  | 000596 | 古井贡酒  | 57,830,065.00 | 6.23           |
| 6  | 600809 | 山西汾酒  | 57,213,845.00 | 6.17           |
| 7  | 01579  | 颐海国际  | 56,781,223.39 | 6.12           |
| 8  | 09633  | 农夫山泉  | 53,982,153.11 | 5.82           |
| 9  | 603317 | 天味食品  | 53,620,842.94 | 5.78           |
| 10 | 600276 | 恒瑞医药  | 48,043,927.60 | 5.18           |
| 11 | 06862  | 海底捞   | 44,014,797.07 | 4.74           |
| 12 | 02269  | 药明生物  | 41,617,221.85 | 4.48           |
| 13 | 600132 | 重庆啤酒  | 40,928,392.98 | 4.41           |
| 14 | 09922  | 九毛九   | 38,231,664.75 | 4.12           |
| 15 | 603899 | 晨光文具  | 37,415,263.40 | 4.03           |
| 16 | 00291  | 华润啤酒  | 32,112,136.35 | 3.46           |
| 17 | 00700  | 腾讯控股  | 31,852,100.87 | 3.43           |
| 18 | 300760 | 迈瑞医疗  | 30,240,992.84 | 3.26           |
| 19 | 603345 | 安井食品  | 29,981,377.00 | 3.23           |
| 20 | 06969  | 思摩尔国际 | 27,010,934.25 | 2.91           |

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  | 600809 | 山西汾酒 | 69,066,006.47 | 7.44           |
| 2  | 600519 | 贵州茅台 | 58,979,825.20 | 6.36           |
| 3  | 000596 | 古井贡酒 | 47,299,663.85 | 5.10           |



|    |        |       |               |      |
|----|--------|-------|---------------|------|
| 4  | 603369 | 今世缘   | 46,117,010.95 | 4.97 |
| 5  | 600309 | 万华化学  | 43,807,719.00 | 4.72 |
| 6  | 603317 | 天味食品  | 42,089,473.44 | 4.54 |
| 7  | 000858 | 五粮液   | 41,530,977.05 | 4.48 |
| 8  | 600276 | 恒瑞医药  | 35,873,016.00 | 3.87 |
| 9  | 06969  | 思摩尔国际 | 30,126,360.85 | 3.25 |
| 10 | 002027 | 分众传媒  | 26,812,071.78 | 2.89 |
| 11 | 600132 | 重庆啤酒  | 22,819,193.68 | 2.46 |
| 12 | 603288 | 海天味业  | 21,762,692.00 | 2.35 |
| 13 | 603899 | 晨光文具  | 21,371,214.20 | 2.30 |
| 14 | 300595 | 欧普康视  | 20,193,660.96 | 2.18 |
| 15 | 603345 | 安井食品  | 16,636,280.00 | 1.79 |
| 16 | 01951  | 锦欣生殖  | 16,140,873.78 | 1.74 |
| 17 | 603866 | 桃李面包  | 15,656,545.05 | 1.69 |
| 18 | 02269  | 药明生物  | 14,378,603.32 | 1.55 |
| 19 | 09922  | 九毛九   | 12,532,362.27 | 1.35 |
| 20 | 603259 | 药明康德  | 12,505,707.56 | 1.35 |

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 | 1,035,752,860.94 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 708,101,282.95   |

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      | 27,501,000.00 | 4.04         |
| 2  | 央行票据      | -             | -            |
| 3  | 金融债券      | 10,019,000.00 | 1.47         |
|    | 其中：政策性金融债 | 10,019,000.00 | 1.47         |
| 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） | 506,317.20    | 0.07         |

|    |      |               |      |
|----|------|---------------|------|
| 8  | 同业存单 | -             | -    |
| 9  | 其他   | -             | -    |
| 10 | 合计   | 38,026,317.20 | 5.59 |

## 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  | 019640 | 20 国债 10 | 275,010 | 27,501,000.00 | 4.04         |
| 2  | 200409 | 20 农发 09 | 100,000 | 10,019,000.00 | 1.47         |
| 3  | 113044 | 大秦转债     | 4,920   | 506,317.20    | 0.07         |

## 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持有贵金属。

## 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   | 259,610.97   |
| 2  | 应收证券清算款 | 4,973,117.30 |
| 3  | 应收股利    | 161,330.52   |
| 4  | 应收利息    | 750,195.82   |
| 5  | 应收申购款   | 1,430,504.23 |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 7,574,758.84 |

### 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  | 113044 | 大秦转债 | 506,317.20 | 0.07         |

### 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不存在流通受限的情况。

### 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

| 份额级别       | 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  |
| 长信消费升级混合 A | 7,288    | 66,539.30 | 1,785,047.93 | 0.37%  | 483,153,341.87 | 99.63%  |
| 长信消费升级混合 C | 10,204   | 15,040.84 | 0.00         | 0.00%  | 153,476,712.40 | 100.00% |
| 合计         | 17,492   | 36,497.55 | 1,785,047.93 | 0.28%  | 636,630,054.27 | 99.72%  |

注：对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 份额级别       | 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 | 长信消费升级混合 A | 2.90      | 0.00%    |
|                  | 长信消费升级混合 C | 8,546.42  | 0.01%    |
|                  | 合计         | 8,549.32  | 0.00%    |

注：对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 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                             | 份额级别       | 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 | 长信消费升级混合 A | 0                 |
|                                | 长信消费升级混合 C | 0                 |
|                                | 合计         | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 长信消费升级混合 A | 0                 |
|                                | 长信消费升级混合 C | 0                 |
|                                | 合计         | 0                 |

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                             | 长信消费升级混合 A     | 长信消费升级混合 C     |
|--------------------------------|----------------|----------------|
| 基金合同生效日（2020 年 11 月 4 日）基金份额总额 | 717,358,484.80 | 156,860,381.69 |
| 本报告期期初基金份额总额                   | 717,358,484.80 | 156,860,381.69 |
| 本报告期基金总申购份额                    | 495,705,362.32 | 167,515,301.17 |
| 减：本报告期基金总赎回份额                  | 728,125,457.32 | 170,898,970.46 |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）       | -              | -              |
| 本报告期末基金份额总额                    | 484,938,389.80 | 153,476,712.40 |

## §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

本报告期内，交通银行托管部负责人由袁庆伟变更为徐铁。

### 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，本基金管理人、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 |    |
| 长江证券 | 2      | 703,132,860.13 | 40.52%       | 654,829.97 | 51.52%     | -  |
| 华泰证券 | 2      | 306,845,501.74 | 17.68%       | 131,758.15 | 10.37%     | -  |
| 华创证券 | 1      | 224,503,851.12 | 12.94%       | 209,080.26 | 16.45%     | -  |

|           |   |                |        |           |       |   |
|-----------|---|----------------|--------|-----------|-------|---|
| 国泰君安      | 1 | 212,535,580.52 | 12.25% | 85,014.60 | 6.69% | - |
| 广发证券      | 1 | 76,684,921.33  | 4.42%  | 63,747.94 | 5.02% | - |
| 天风证券      | 1 | 71,897,808.49  | 4.14%  | 38,199.18 | 3.01% | - |
| 方正证券      | 1 | 52,414,761.70  | 3.02%  | 27,847.33 | 2.19% | - |
| 兴业证券      | 2 | 46,990,319.77  | 2.71%  | 39,065.34 | 3.07% | - |
| 安信证券      | 1 | 40,403,944.61  | 2.33%  | 21,466.65 | 1.69% | - |
| 中泰证券      | 1 | -              | -      | -         | -     | - |
| 平安证券      | 1 | -              | -      | -         | -     | - |
| 财信证券(已退租) | 1 | -              | -      | -         | -     | - |
| 国金证券      | 1 | -              | -      | -         | -     | - |
| 申银万国      | 1 | -              | -      | -         | -     | - |
| 金元证券      | 1 | -              | -      | -         | -     | - |
| 东方证券      | 1 | -              | -      | -         | -     | - |
| 光大证券      | 1 | -              | -      | -         | -     | - |
| 中银国际证券    | 1 | -              | -      | -         | -     | - |
| 野村东方国际证券  | 1 | -              | -      | -         | -     | - |
| 爱建证券(已退租) | 1 | -              | -      | -         | -     | - |
| 海通证券      | 1 | -              | -      | -         | -     | - |
| 东北证券      | 1 | -              | -      | -         | -     | - |
| 开源证券(已退租) | 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》（证监基金字【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 |
| 长江证券      | 39,962,924.90 | 62.98%       | 27,000,000.00 | 42.86%         | -    | -            |
| 华泰证券      | 23,492,192.80 | 37.02%       | 33,000,000.00 | 52.38%         | -    | -            |
| 华创证券      | -             | -            | -             | -              | -    | -            |
| 国泰君安      | -             | -            | -             | -              | -    | -            |
| 广发证券      | -             | -            | -             | -              | -    | -            |
| 天风证券      | -             | -            | -             | -              | -    | -            |
| 方正证券      | -             | -            | 3,000,000.00  | 4.76%          | -    | -            |
| 兴业证券      | -             | -            | -             | -              | -    | -            |
| 安信证券      | -             | -            | -             | -              | -    | -            |
| 中泰证券      | -             | -            | -             | -              | -    | -            |
| 平安证券      | -             | -            | -             | -              | -    | -            |
| 财信证券(已退租) | -             | -            | -             | -              | -    | -            |
| 国金证券      | -             | -            | -             | -              | -    | -            |
| 申银万国      | -             | -            | -             | -              | -    | -            |
| 金元证券      | -             | -            | -             | -              | -    | -            |
| 东方证券      | -             | -            | -             | -              | -    | -            |
| 光大证券      | -             | -            | -             | -              | -    | -            |
| 中银国际证券    | -             | -            | -             | -              | -    | -            |
| 野村东方国际证券  | -             | -            | -             | -              | -    | -            |
| 爱建证券(已退租) | -             | -            | -             | -              | -    | -            |
| 海通证券      | -             | -            | -             | -              | -    | -            |
| 东北证券      | -             | -            | -             | -              | -    | -            |
| 开源证券(已退租) | -             | -            | -             | -              | -    | -            |



## 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长信消费升级混合型证券投资基金的分红公告   | 上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站               | 2021年1月12日 |
| 2  | 长信基金管理有限责任公司关于长信消费升级混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定期定额投资等业务并参与部分销售机构申购（含定期定额投资申购）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13日 |
| 3  | 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 |
| 4  | 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 |
| 5  | 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 |
| 6  | 长信基金管理有限责任公司关于增加北京蛋卷基金销售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）费率优惠活动的公告      | 上证报、中证报、证券时报、中国证监会电子披露网站、公司网站      | 2021年1月27日 |
| 7  | 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3月16日 |
| 8  | 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 |
| 9  | 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 |
| 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 |

|    |   |                                    |                 |
|----|---|------------------------------------|-----------------|
| 11 | 长信消费升级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 |
| 12 | 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 |
| 13 | 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 |
| 14 | 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 |
| 15 | 长信消费升级混合型证券投资基金更新的招募说明书（2021 年第【1】号）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 30 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、《长信消费升级混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长信消费升级混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《长信消费升级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。

### 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