

# 长信利信灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第 3 季度报告

2021 年 9 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：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 10 月 27 日

## §1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金基金合同规定，于 2021 年 10 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 7 月 1 日起至 2021 年 9 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	长信利信混合		
基金主代码	519949		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2016 年 11 月 10 日		
报告期末基金份额总额	272,633,838.81 份		
投资目标	本基金为混合型基金，通过积极灵活的资产配置，在有效控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。		
投资策略	本基金将通过跟踪考量通常的宏观经济变量（包括 GDP 增长率、CPI 走势、M2 的绝对水平和增长率、利率水平与走势等）以及各项国家政策（包括财政、税收、货币、汇率政策等），并结合美林时钟等科学严谨的资产配置模型，动态评估不同资产大类在不同时期的投资价值及其风险收益特征，追求股票、债券和货币等大类资产的灵活配置和稳健的绝对收益目标。		
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*50%+中证综合债指数收益率*50%		
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于中等风险、中等收益的基金品种，其预期风险和预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。		
基金管理人	长信基金管理有限责任公司		
基金托管人	招商银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	长信利信混合 A	长信利信混合 C	长信利信混合 E
下属分级基金的场内简称	CXLXA	-	-

下属分级基金的交易代码	519949	007293	007294
报告期末下属分级基金的份额总额	6,213,994.75 份	1,902,053.05 份	264,517,791.01 份

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2021年7月1日—2021年9月30日）		
	长信利信混合 A	长信利信混合 C	长信利信混合 E
1. 本期已实现收益	67,943.21	49,040.16	508,933.93
2. 本期利润	-209,910.20	-199,987.49	-4,476,847.83
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0107	-0.0176	-0.0154
4. 期末基金资产净值	8,575,278.39	2,586,049.63	361,357,888.17
5. 期末基金份额净值	1.380	1.360	1.366

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

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

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

长信利信混合 A

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-0.72%	0.42%	-2.55%	0.60%	1.83%	-0.18%
过去六个月	0.36%	0.36%	-0.20%	0.55%	0.56%	-0.19%
过去一年	7.39%	0.45%	6.10%	0.61%	1.29%	-0.16%
过去三年	40.39%	0.48%	29.72%	0.67%	10.67%	-0.19%
自基金合同生效起至今	46.21%	0.43%	34.50%	0.60%	11.71%	-0.17%

## 长信利信混合 C

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-0.87%	0.42%	-2.55%	0.60%	1.68%	-0.18%
过去六个月	0.15%	0.36%	-0.20%	0.55%	0.35%	-0.19%
过去一年	7.09%	0.45%	6.10%	0.61%	0.99%	-0.16%
自份额增加日起至今	31.78%	0.41%	17.42%	0.64%	14.36%	-0.23%

## 长信利信混合 E

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-0.73%	0.43%	-2.55%	0.60%	1.82%	-0.17%
过去六个月	0.29%	0.36%	-0.20%	0.55%	0.49%	-0.19%
过去一年	7.39%	0.45%	6.10%	0.61%	1.29%	-0.16%
自份额增加日起至今	32.36%	0.41%	17.42%	0.64%	14.94%	-0.23%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

长信利信混合A基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



长信利信混合C基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



长信利信混合E基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、自 2019 年 4 月 25 日起对长信利信灵活配置混合型证券投资基金进行份额分类，原有基金份额为 A 类份额，增设 C 类份额与 E 类份额。

2、长信利信混合 A 图示日期为 2016 年 11 月 10 日至 2021 年 9 月 30 日，长信利信混合 C 图示日期为 2019 年 4 月 25 日（份额增加日）至 2021 年 9 月 30 日，长信利信混合 E 图示日期为 2019 年 4 月 25 日（份额增加日）至 2021 年 9 月 30 日。

3、按基金合同规定，本基金自合同生效日起 6 个月内为建仓期，建仓期结束时，本基金的各项投资比例已符合基金合同的约定。

## §4 管理人报告

## 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
黄韵	曾任本基金的基金经理	2019 年 4 月 27 日	2021 年 7 月 16 日	15 年	曾任本基金的基金经理
叶松	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、长信睿进灵活配置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、长信新利灵活配置混合型证券投资基金、长信改革红利灵活配置混合型证券投资基金、长信利信灵活配置混合型证券投资基金、长信利泰灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、总经理助理兼绝对收益部总监	2021 年 7 月 6 日	-	14 年	经济学硕士，中南财经政法大学投资学专业研究生毕业。2007 年 7 月加入长信基金管理有限责任公司，担任行业研究员，从事行业和上市公司研究工作，曾任基金经理助理、绝对收益部总监、权益投资部总监、长信新利灵活配置混合型证券投资基金、长信创新驱动股票型证券投资基金、长信内需成长混合型证券投资基金、长信双利优选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、长信恒利优势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和长信增利动态策略混合型证券投资基金的基金经理。现任总经理助理兼绝对收益部总监、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、长信睿进灵活配置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、长信新利灵活配置混合型证券投资基金、长信改革红利灵活配置混合型证券投资基金、长信利信灵活配置混合型证券投资基金、长信利泰灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

陆晓锋	长信新利灵活配置混合型证券投资基金和长信利信灵活配置混合型证券投资基金的基金经理	2021 年 9 月 7 日	-	7 年	美国布兰戴斯大学国际经济与金融学硕士毕业，具有基金从业资格。曾任职于中国国际金融有限公司，2016 年 7 月加入长信基金管理有限责任公司，历任行业研究员、基金经理助理，现任长信利信灵活配置混合型证券投资基金和长信新利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
-----	--	----------------	---	-----	--

注：1、首任基金经理任职日期以本基金成立之日为准；新增或变更基金经理的日期根据对外披露的公告日期填写；

2、证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

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

## 4.3 公平交易专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

#### 4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

在此再聊一聊产品的目标与投资方法。我们立志为持有人提供解决方案型的产品。因此，我们的主要运行思路如下：

1、夏普优化。追求风险调整后收益的最大化，改善持有人体验，力争降低波动，以求最终帮助持有人实现其自身收益的最大化。

2、行业分散。我们将执行行业分散配置，结合景气度微调权重。

3、左侧思维。最大的预期差来自于视角的差异，要求我们不仅从个股，而是从全生命周期、全产业链的视角来寻找机会。在周期行业做成长，在成长行业做周期，这种类“左侧”的思路可以帮助我们找到高风险收益比的机会。

4、移动止损。较重的个股仓位必定带来对高回撤的担忧，我们将以移动止盈/止损的方式来应对。交易纪律是资金管理和风控手段，与基本面研究并不矛盾。我们会结合组合整体的 Calmar 比率目标，设置相应的止损水平。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 9 月 30 日，长信利信混合 A 份额净值为 1.380 元，份额累计净值为 1.440 元，本报告期内长信利信混合 A 净值增长率为-0.72%；长信利信混合 C 份额净值为 1.360 元，份额累计净值为 1.360 元，本报告期内长信利信混合 C 净值增长率为-0.87%；长信利信混合 E 份额净值为 1.366 元，份额累计净值为 1.366 元，本报告期内长信利信混合 E 净值增长率为-0.73%，同期业绩比较基准收益率为-2.55%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

## §5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	121,785,798.73	32.63
	其中：股票	121,785,798.73	32.63
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	231,892,040.00	62.14

	其中：债券	231,892,040.00	62.14
	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	15,009,875.39	4.02
8	其他资产	4,496,835.95	1.20
9	合计	373,184,550.07	100.00

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

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	12,350.52	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	63,225,443.11	16.97
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	633,577.75	0.17
E	建筑业	20,183.39	0.01
F	批发和零售业	18,400.20	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	33,093,739.00	8.88
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,203,328.35	1.40
J	金融业	4,783,057.42	1.28
K	房地产业	14,690,864.00	3.94
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	96,147.59	0.03
N	水利、环境和公共设施管理业	8,707.40	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	121,785,798.73	32.69

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未通过港股通交易机制投资港股。

### 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002120	韵达股份	868,000	16,709,000.00	4.49
2	603128	华贸物流	766,500	9,749,880.00	2.62
3	300750	宁德时代	15,500	8,148,815.00	2.19
4	002415	海康威视	147,687	8,122,785.00	2.18
5	002475	立讯精密	216,800	7,741,928.00	2.08
6	600519	贵州茅台	3,898	7,133,340.00	1.91
7	600233	圆通速递	476,300	6,634,859.00	1.78
8	600048	保利发展	470,700	6,603,921.00	1.77
9	603236	移远通信	27,200	4,414,288.00	1.18
10	000002	万科 A	202,100	4,306,751.00	1.16

#### 5.3.2 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的全国中小企业股份转让系统挂牌股票投资明细

注：本基金本报告期末未持有全国中小企业股份转让系统挂牌股票。

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	145,401,540.00	39.03
	其中：政策性金融债	74,785,540.00	20.08
4	企业债券	20,378,000.00	5.47
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	66,112,500.00	17.75
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-

10	合计	231,892,040.00	62.25
----	----	----------------	-------

### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	2128010	21 光大银行小微债	300,000	30,450,000.00	8.17
2	210203	21 国开 03	300,000	30,402,000.00	8.16
3	152255	19 浙资 01	200,000	20,378,000.00	5.47
4	190203	19 国开 03	200,000	20,250,000.00	5.44
5	1928034	19 交通银行 01	200,000	20,240,000.00	5.43

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

### 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

#### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 5.10.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

#### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

## 5.11 投资组合报告附注

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

报告期内本基金投资的前十名证券中，海通证券股份有限公司于 2021 年 3 月 30 日公告公司于近日收到中国证券监督管理委员会上海监管局出具的《关于对海通证券股份有限公司采取责令增加合规检查次数、责令暂停部分业务措施的决定》（沪证监决〔2021〕40 号）。经查，公司在业务开展过程中存在以下情况：一是公司在开展部分投资顾问、私募资产管理业务过程中，未按照审慎经营原则，有效控制和防范风险，未能审慎评估公司经营管理行为对证券市场的影响。二是公司未将相关业务行为纳入全面合规风控体系，合规风控机制存在缺失；三是公司投资银行业务内部控制存在漏洞，债券承销与资产管理等业务缺少有效隔离，利益冲突审查机制存在缺失。依据《证券公司监督管理条例》第七十条第一款第一项、第六项的规定，上海证监局决定对公司采取如下监督管理措施：一是责令你公司自本决定作出之日起 1 年内，每 3 个月开展一次内部合规检查，并在每次检查后 10 个工作日内，向上海证监局报送合规检查报告；二是责令公司自本决定作出之日起 12 个月内，暂停为机构投资者提供债券投资顾问业务。

报告期内本基金投资的前十名证券中，海通证券股份有限公司于 2021 年 9 月 7 日签收了中国证券监督管理委员会《立案告知书》（证监立案字 0152021022 号）和《调查通知书》（证监调查字 0152021061 号）。因公司在开展西南药业股份有限公司（现奥瑞德光电股份有限公司）财务顾问业务的持续督导工作期间未勤勉尽责，涉嫌违法违规，根据《中华人民共和国证券法》等法律法规，中国证监会决定对公司进行立案并调查相关情况。

报告期内本基金投资的前十名证券中，海通证券股份有限公司于 2021 年 9 月 28 日公告公司于当日收到中国证监会重庆监管局《行政处罚事先告知书》（处罚字〔2021〕5 号）。公司涉嫌奥瑞德光电股份有限公司持续督导未勤勉尽责一案，现已调查完毕，依法对公司及相关人员作出行政处罚。海通证券的行为违反 2005 年《证券法》第一百七十三条规定，构成 2005 年《证券法》第二百二十三条所述情形。时任奥瑞德持续督导期独立财务顾问主办人李春和贾文静为直接负责的主管人员。根据海通证券违法行为的事实、性质、情节与社会危害程度，依据 2005 年《证券法》第二百二十三条的规定，重庆证监局拟作出以下决定：“一、责令海通证券改正，没收财务顾问业务收入 100 万元，并处以 300 万元罚款；二、对李春、贾文静给予警告，并分别处以 5 万元罚款。”

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体交通银行股份有限公司于 2021 年 7 月 13 日收到中国银行保险监督管理委员会（银保监罚决字〔2021〕28 号），根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和关审慎经营规则，经查，一、理财业务和同业业务制度不健全；二、理财业务数据与事实不符；三、部分理财业务发展与监管导向不符；四、理财业务风险隔离不到位，利用本行表内自有资金为本行表外理财产品提供融资；五、理财资金违规投向土地储备项目；六、理财产品相互交易调节收益；七、面向非机构投资者发行的理财产品投资不良资产支持证券；八、公募理财产品投资单只证券超限额；九、理财资金违规投向交易所上市交易的股票；十、理财资金投资非标资产比照贷款管理不到位；十一、私募理财产品销售文件未约定冷静期；十二、开放式公募理财产品资产配置未达到流动性管理监管比例要求；十三、理财产品信息登记不及时；十四、理财产品信息披露不合规；十五、同业业务交易对手名单调整不及时；十六、将同业存款纳入一般性存款核算；十七、同业账户管理不规范；十八、违规增加政府性债务，且同业投资抵质押物风险管理有效性不足；十九、结构性存款产品衍生品交易无真实交易对手和交易行为；二十、未严格审查委托贷款资金来源；二十一、违规向委托贷款借款人收取手续费；二十二、利用理财资金与他行互投不良资产收益权，实现不良资产虚假出表；二十三、监管检查发现问题屡查屡犯。综上，中国银行保险监督管理委员会决定对交通银行股份有限公司采取罚款 4100 万元。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体国家开发银行于 2020 年 12 月 25 日收到中国银行保险监督管理委员会处罚决定书（银保监罚决字〔2020〕67 号），根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则，经查，国家开发银行：一、为违规的政府购买服务项目提供融资；二、项目资本金管理不到位，棚改贷款项目存在资本金违规抽回情况；三、违规变相发放土地储备贷款；四、设置不合理存款考核要求，以贷转存，虚增存款；五、贷款风险分类不准确；六、向资产管理公司以外的主体批量转让不良信贷资产；七、违规进行信贷资产拆分转让，隐匿信贷资产质量；八、向棚改业务代理结算行强制搭售低收益理财产品；九、扶贫贷款存贷挂钩；十、易地扶贫搬迁贷款“三查”不尽职，部分贷款资金未真正用于扶贫搬迁；十一、未落实同业业务交易对手名单制监管要求；十二、以贷款方式向金融租赁公司提供同业融资，未纳入同业借款业务管理；十三、以协定存款方式吸收同业存款，未纳入同业存款业务管理；十四、风险隔离不到位，违规开展资金池理财业务；十五、未按规定向投资者充分披露理财产品投资非标准化债权资产情况；十六、逾期未整改，屡查屡犯，违规新增业务；十七、利用集团内部交易进行子公司间不良资产非洁净出表；十八、违规收取小微企业贷款承诺费；十九、收取财务顾问费质价不符；二十、利用银团贷款承诺费浮利分费；二十一、向检查组提供虚假整

改说明材料；二十二、未如实提供信贷资产转让台账；二十三、案件信息迟报、瞒报；二十四、对以往监管检查中发现的国别风险管理问题整改不到位。综上，中国银行保险监督管理委员会决定对国家开发银行罚款 4880 万元。

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

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

#### 5.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

报告期内本基金投资的前十名股票中，不存在超出基金合同规定备选股票库的情形。

#### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	71,610.67
2	应收证券清算款	174,839.71
3	应收股利	-
4	应收利息	4,249,820.57
5	应收申购款	565.00
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	4,496,835.95

#### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长信利信混合 A	长信利信混合 C	长信利信混合 E
报告期期初基金份额总额	39,567,851.34	19,272,105.67	339,491,722.34

报告期期间基金总申购份额	58,100.57	126,424.17	-
减:报告期期间基金总赎回份额	33,411,957.16	17,496,476.79	74,973,931.33
报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-	-	-
报告期期末基金份额总额	6,213,994.75	1,902,053.05	264,517,791.01

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2021 年 7 月 1 日至 2021 年 9 月 30 日	130,026,813.56	0.00	18,772,703.48	111,254,110.08	40.81%
	2	2021 年 7	137,975,143.27	0.00	35,653,692.07	102,321,451.20	37.53%

		月 1 日至 2021 年 9 月 30 日					
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>1、基金净值大幅波动的风险</p> <p>单一持有基金比例过高的投资者连续大量赎回，可能会影响基金投资的持续性和稳定性，增加变现成本。同时，按照净值计算尾差处理规则可能引起基金份额净值异常上涨或下跌。</p> <p>2、赎回申请延期办理的风险</p> <p>单一持有基金比例过高的投资者大额赎回后可能触发本基金巨额赎回条件，导致同期中小投资者小额赎回面临部分延期办理的情况。</p> <p>3、基金投资策略难以实现的风险</p> <p>单一持有基金比例过高的投资者大额赎回后，可能引起基金资产总净值显著降低，从而使基金在投资时受到限制，导致基金投资策略难以实现。</p>							

## 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：本基金本报告期未发生影响投资者决策的其他重要信息。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

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

## 9.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

## 9.3 查阅方式

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

长信基金管理有限责任公司

2021 年 10 月 27 日