

# 长江乐鑫纯债定期开放债券型发起式证券投资基金

## 2021 年中期报告

2021 年 06 月 30 日

基金管理人:长江证券(上海)资产管理有限公司

基金托管人:浙商银行股份有限公司

送出日期:2021 年 08 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 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的法律责任。本中期报告由董事长签发。

基金托管人浙商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年8月20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6月30日止。

## 1.2 目录

§ 1	重要提示及目录.....	2
1.1	重要提示.....	2
1.2	目录.....	3
§ 2	基金简介.....	5
2.1	基金基本情况.....	5
2.2	基金产品说明.....	5
2.3	基金管理人和基金托管人.....	5
2.4	信息披露方式.....	6
2.5	其他相关资料.....	6
§ 3	主要财务指标和基金净值表现.....	6
3.1	主要会计数据和财务指标.....	6
3.2	基金净值表现.....	7
§ 4	管理人报告.....	8
4.1	基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	10
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
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.....	13
§ 5	托管人报告.....	13
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
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.....	13
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.....	13
§ 6	中期财务会计报告(未经审计).....	13
6.1	资产负债表.....	13
6.2	利润表.....	15
6.3	所有者权益(基金净值)变动表.....	16
6.4	报表附注.....	18
§ 7	投资组合报告.....	38
7.1	期末基金资产组合情况.....	38
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合.....	39
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.....	39
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	39
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	39
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.....	40
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.....	40
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.....	40
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.....	41
7.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	41
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	41
7.12	投资组合报告附注.....	41
§ 8	基金份额持有人信息.....	42
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	42
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	42

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情况.....	42
8.4	发起式基金发起资金持有份额情况.....	43
§ 9	开放式基金份额变动.....	43
§ 10	重大事件揭示.....	43
10.1	基金份额持有人大会决议.....	43
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.....	43
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	44
10.4	基金投资策略的改变.....	44
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	44
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.....	44
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	44
10.8	其他重大事件.....	45
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息.....	46
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.....	47
11.2	影响投资者决策的其他重要信息.....	47
§ 12	备查文件目录.....	47
12.1	备查文件目录.....	47
12.2	存放地点.....	47
12.3	查阅方式.....	48

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	长江乐鑫纯债定期开放债券型发起式证券投资基金
基金简称	长江乐鑫定开债
基金主代码	006135
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年08月16日
基金管理人	长江证券（上海）资产管理有限公司
基金托管人	浙商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,595,994,624.19份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在控制组合净值波动率的前提下，力争长期内实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的研究优势，将宏观周期研究、行业周期研究、公司研究相结合，在分析和判断宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上，自上而下决定债券组合久期、期限结构、债券类别配置策略，在严谨深入的分析基础上，综合考量各类债券的流动性、供求关系和收益率水平等，深入挖掘价值被低估的标的券种。
业绩比较基准	中国债券综合财富指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	长江证券（上海）资产管理有限公司	浙商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	高杨
	联系电话	4001-166-866
	电子邮箱	zgxxpl@cjsc.com.cn
		朱巍
		0571-87659806
		zhuwei@czbank.com

客户服务电话	4001-166-866	95527
传真	021-80301393	0571-88268688
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道1198号世纪汇一座27层	浙江省杭州市萧山区鸿宁路1788号
办公地址	上海市浦东新区世纪大道1198号世纪汇一座27层	浙江省杭州市延安路368号
邮政编码	200122	310006
法定代表人	周纯	沈仁康

## 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.cjzcg1.com
基金中期报告备置地点	上海市浦东新区世纪大道1198号世纪汇一座27层

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	长江证券（上海）资产管理有限公司	上海市浦东新区世纪大道1198号世纪汇一座27层

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期
	(2021年01月01日- 2021年06月30日)
本期已实现收益	22,618,964.57
本期利润	31,011,718.69
加权平均基金份额本期利润	0.0236
本期加权平均净值利润率	2.33%
本期基金份额净值增长率	2.35%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末

	(2021年06月30日)
期末可供分配利润	17,033,789.10
期末可供分配基金份额利润	0.0107
期末基金资产净值	1,627,482,969.02
期末基金份额净值	1.0197
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	报告期末 (2021年06月30日)
基金份额累计净值增长率	11.98%

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）期末可供分配利润采用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；表中的“期末”均指报告期最后一日，即2021年6月30日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。（3）上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，计入费用后投资人的实际收益水平要低于所列数字。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	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	0.16%	0.01%	0.20%	0.03%	-0.04%	-0.02%
过去三个月	1.17%	0.02%	1.23%	0.03%	-0.06%	-0.01%
过去六个月	2.35%	0.02%	2.14%	0.04%	0.21%	-0.02%
过去一年	3.34%	0.04%	2.77%	0.06%	0.57%	-0.02%
自基金合同生效起至今	11.98%	0.04%	13.34%	0.07%	-1.36%	-0.03%

注：本基金基金合同于2018年8月16日生效，业绩比较基准为中国债券综合财富指数收益率。

### 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

长江乐鑫纯债定期开放债券型发起式证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2018年08月16日-2021年06月30日)



## § 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

长江证券（上海）资产管理有限公司于2014年9月16日正式成立，是长江证券股份有限公司旗下专门从事证券资产管理、公开募集证券投资基金管理业务的全资子公司。注册地上海，注册资本23亿元人民币。

公司秉承“专业至臻，追求卓越”的理念，致力于为广大投资者创造稳定而丰厚的回报。公司以“客户导向、研究驱动、技术领先、内控先行”为业务发展策略，全方位参与客户资产配置和资产增值全过程，通过深度挖掘客户的投融资需求，紧跟市场创新步伐，以满足客户差异化需求。在严格控制风险的前提下，挑选优质投资品种，丰富创新产品架构，为客户提供多元化资产配置方案。

截至本报告期末，本基金管理人管理的基金有长江收益增强债券型证券投资基金、长江乐享货币市场基金、长江乐丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、长江乐盈定期开放债券型发起式证券投资基金、长江乐越定期开放债券型发起式证券投资基金、长江乐鑫纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、长江可转债债券型证券投资基金、长江量化匠心甄选股票型证券投资基金、长江安盈中短债六个月定期开放债券型证券投资基金、长江添利混合型证券投资基金、长江安享纯债18个月定期开放债券型证券投资基金、长江均衡成长混合型发起式证券投资基金、长江量化消费精选股票型发起式证券



投资基金、长江新能源产业混合型发起式证券投资基金、长江沪深300指数增强型发起式证券投资基金和长江量化科技精选一个月滚动持有股票型发起式证券投资基金。

#### 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		
漆志伟	基金经理	2018-08-16	-	12年	国籍：中国。硕士研究生，具备基金从业资格。曾任东兴证券股份有限公司客服经理、华农财产保险股份有限公司投资经理。现任长江证券（上海）资产管理有限公司公募固定收益投资部副总经理（主持工作），长江收益增强债券型证券投资基金、长江乐享货币市场基金、长江乐盈定期开放债券型发起式证券投资基金、长江乐鑫定期开放债券型发起式证券投资基金、长江可转债债券型证券投资基金、长江安盈中短债六个月定期开放债券型证券投资基金、长江添利混合型证券投资基金、长江安享纯债18个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。

注：（1）此处的任职日期、离职日期均指公司做出决定之日，若该基金经理自基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日；

（2）证券从业的含义遵从行业协会《证券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

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《基金管理公司公平交易制度指导意见》等有关法律法规的规定，严格遵守基金合同和招募说明书约定，本着诚实信用、勤勉尽责、最大限度保护投资人合法权益等原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合法合规，未发生损害基金份额持有人利益的行为，未发生内幕交易、操纵市场和不当关联交易及其他违规行为，信息披露及时、准确、完整，本基金与本基金管理人所管理的其他基金资产、投资组合与公司资产之间严格分开、公平对待，基金管理保持独立运作，并通过科学决策、规范运作、精心管理和健全内控体系，有效保障投资人的合法权益。

### 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，本基金管理人严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关规定，通过严格的内部风险控制制度和流程，对各环节的投资风险和管理风险进行有效控制，确保公平对待所管理的所有基金和投资组合，切实防范利益输送行为。

##### （一）本基金管理人所管理的基金或组合间同向交易价差分析

根据证监会公平交易指导意见，我们计算了公司旗下基金、组合同日同向交易纪录配对。通过对这些配对的交易价差分析，我们发现有效配对溢价率均值大部分在1%数量级及以下，且大部分溢价率均值通过95%置信度下等于0的t检验。

##### （二）扩展时间窗口下的价差分析

本基金管理人选取T=3和T=5作为扩展时间窗口，将基金或组合交易情况分别在这两个时间窗口内作平均，并以此为依据，进行基金或组合间在扩展时间窗口中的同向交易价差分析。对于有足够多观测样本的基金配对（样本数=30），溢价率均值大部分在1%数量级及以下。

##### （三）基金或组合间模拟溢价金额分析

对于不能通过溢价率均值为零的t检验的基金组合配对、对于在时间窗口中溢价率均值过大的基金组合配对，已要求基金经理对价差作出了解释，根据基金经理解释公司旗下基金或组合间没有可能导致不公平交易和利益输送的行为。

本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况，公司旗下各基金不存在因非公平交易等导致的利益输送行为，公平交易制度的整体执行情况良好。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金与本基金管理人所管理的其他投资组合未发生大额同日反向交易。本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

### 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

债券市场方面，上半年资金面延续宽松状态，给债券收益率水平的下行带来了良好环境。在资金松、货币稳、债券供给少、配置强的大背景下，债券市场持续走强，收益率在二季度创下了今年以来的低点。同时，社融增速回落等二季度的热点事件也对债券市场产生了诸多利好作用。在此作用下，10年期国债收益率下行11BP至3.08%，收益率绝对水平回落到历史1/4分位数。10年期国开债震荡下行9BP，当前10年国开和国债利差41BP，靠近历史1/4分位数。信用债市场也延续了一季度的强势表现，信用利差继续收窄，AAA、AA和AA+信用利差在1/4分位数以下。与此同时，半年末资金面对债券收益率的扰动较小，市场较为平静。由于央行目前采取宏观审慎+传统货币政策双支柱框架，MPA+房地产三道红线+资管新规+地方政府隐性债务约束，传统货币政策承担的压力减轻，资金面大开大合的情况有所减少。在货币政策支持和精细化操作呵护下，半年末资金面仍保持宽松。

报告期内，本基金采取稳健的投资思路，通过配置中高等级信用债来获取稳定的票息收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为1.0197元，本报告期内，本基金份额净值增长率为2.35%，同期业绩比较基准收益率为2.14%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

站在当前时点，投资者对于债券市场未来的方向有很大分歧。一方面，当前债券市场资金面维持宽松，配置情绪较高，同时市场出现了结构性的“资产荒”；而另一方面，国债收益率从中长期来看最终会取决于经济基本面，这一债券市场的底层逻辑并不会发生变化，而我国经济处在疫情过后的恢复阶段，中国经济基本面向好的大方向并没有变，又似乎很难给收益率的下行提供充足的动力。

在3-5月，利率债持续下行，但未来方向并不明朗，机构投资者因担心债市由于某些原因导致上行，故普遍采用短久期、低杠杆的票息策略，随着短久期资产的逐步到期，就导致了资产欠配现象的存在。而这一现象演绎到了半年末，由于债券市场资金面维持宽松，交易情绪旺盛，投资者害怕踏空等种种因素，最终形成目前的结构性资产荒现象。

而上述的资产荒现象在货币宽松的条件下具有自我加强的效应。前期仓位越低的投资者，现在的压力越大，只能寄希望于加久期和加杠杆后市场继续下行，来挽回之前的踏空损失。市场上买了债券的人不愿意再卖，卖了的人不知道再买什么，于是只能抢夺有限的卖盘，结果就是，不需要特别驱动因素，收益率持续下行，越买越低。由于目前信用环境并不稳定，降低资质会产生不可控制的信用风险，因此在“资产荒”的情况下，

哪怕投资者对当前债券收益率并不满意，也只能通过“加杠杆+加久期”的方式来放大收益，这就又会导致债券收益率新一轮的下行。

我们曾多次认真思考此轮资产荒可能的终结因素，目前看来，最有可能的一个因素或是由于地方债供给冲击或其它某种原因导致的流动性收紧，因为上述“资产荒”的逻辑根基在于流动性充裕。此外，市场预料之外的信用风险，或者外资配置中债的行为发生变化，也可能会终结此次资产荒，但我们认为短期内出现上述后两种情况并且终结此次资产荒的可能性不如第一种情况的可能性大。

当然，央行也可以选择通过更加宽松的货币政策来对冲下半年的地方债供给和MLF大量到期，继续维持一个宽松的货币环境，以确保对小微经济的支持和减轻因大宗商品上涨对实体经济的伤害。若是如此，上述结构性的资产荒将会延续一段时间。若真的有上述情况发生，可能是因为新冠病毒将在未来相当长的一段时间内与人类共存于这个世界，导致了债券市场的某种运行环境或定价逻辑，也发生了不可逆的改变，届时，债券收益率也会相比2020年之前，半永久性的下了一个台阶。

不可否认，目前债市确实存在情绪过热等问题，但本轮资产荒由于流动性的改变而终结的可能性在下半年亦始终存在。对于债券基金管理人而言，盲目的预测点位和节奏的意义并不是很大。我们认为，出于对上述多种可能性的综合推演，一个攻守兼备的，积极但不激进的久期和杠杆率较为适宜。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证券监督管理委员会《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》和中国证券业协会基金估值工作小组《关于停牌股票估值的参考方法》等法律法规的有关规定，本基金管理人设立估值委员会并制定估值委员会制度。

估值委员会由公司领导、运营部、财务部、权益研究部、固定收益研究部、法律合规部、风险管理部等相关部门工作人员组成。估值委员会成员具有会计核算经验、行业分析经验、金融工具应用等丰富的证券投资基金行业从业经验和专业能力，且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理如果认为某证券有更能准确反应其公允价值的估值方法，可以向估值委员会申请对其进行专项评估。新的证券价格需经估值委员会和托管行同意后才能采纳，否则不改变用来进行证券估值的初始价格。

估值委员会职责：根据相关估值原则研究相关估值政策和估值模型，拟定公司的估值政策、估值方法和估值程序，确保公司各基金产品净值计算的公允性，以维护广大投资者的利益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《长江乐鑫纯债定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》规定，本基金本报告期实施利润分配的金额为 11,713,003.16 元。

#### 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

本基金为发起式基金，基金合同生效日为 2018 年 8 月 16 日，截至本报告期末生效未满足三年，暂不适用《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条第一款的规定。

### § 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

本报告期内，本基金托管人在对长江乐鑫纯债定期开放债券型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，长江乐鑫纯债定期开放债券型发起式证券投资基金的管理人——长江证券（上海）资产管理有限公司在长江乐鑫纯债定期开放债券型发起式证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

本报告期内，本基金实施利润分配的金额为 11,713,003.16 元。

#### 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

本托管人依法对长江证券（上海）资产管理有限公司编制和披露的长江乐鑫纯债定期开放债券型发起式证券投资基金 2021 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

### § 6 中期财务会计报告(未经审计)

#### 6.1 资产负债表

会计主体：长江乐鑫纯债定期开放债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2021 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末	上年度末
----	-----	-----	------

		2021年06月30日	2020年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	694,925.83	817,099.27
结算备付金		5,892,620.04	7,285,152.71
存出保证金		25,719.00	3,562.35
交易性金融资产	6.4.7.2	2,010,142,100.00	1,698,804,100.00
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,833,225,500.00	1,514,978,600.00
资产支持证券投资		176,916,600.00	183,825,500.00
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	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	23,147,396.53	25,782,759.37
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,039,902,761.40	1,732,692,673.70
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年06月30日</b>	<b>上年度末 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		411,526,274.45	423,619,212.06
应付证券清算款		2,172.60	78,204.79
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		346,599.86	329,854.86
应付托管费		115,533.28	109,951.63

应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	14,336.18	15,331.47
应交税费		77,849.18	91,630.92
应付利息		108,547.88	63,234.48
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	228,478.95	200,000.00
负债合计		412,419,792.38	424,507,420.21
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	1,595,994,624.19	1,301,444,796.01
未分配利润	6.4.7.10	31,488,344.83	6,740,457.48
所有者权益合计		1,627,482,969.02	1,308,185,253.49
负债和所有者权益总计		2,039,902,761.40	1,732,692,673.70

注：报告截止日2021年6月30日，基金份额净值1.0197元，基金份额总额1,595,994,624.19份。

## 6.2 利润表

会计主体：长江乐鑫纯债定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021年01月01日 至2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日 至2020年06月30日
<b>一、收入</b>		39,076,265.36	29,585,723.32
1. 利息收入		35,237,295.56	28,085,424.69
其中：存款利息收入	6.4.7.11	76,125.31	57,223.69
债券利息收入		31,376,383.69	24,637,463.65
资产支持证券利息收入		3,769,869.49	3,382,519.60
买入返售金融资产收入		14,917.07	8,217.75
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-

2. 投资收益（损失以“-”填列）		-4, 553, 784. 32	-544, 701. 10
其中：股票投资收益	6. 4. 7. 12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6. 4. 7. 13	-3, 153, 789. 78	-409, 249. 59
资产支持证券投资收益	6. 4. 7. 13. 5	-1, 399, 994. 54	-135, 451. 51
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6. 4. 7. 14	-	-
股利收益	6. 4. 7. 15	-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6. 4. 7. 16	8, 392, 754. 12	2, 044, 999. 73
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. 17	-	-
<b>减：二、费用</b>		8, 064, 546. 67	6, 367, 204. 96
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	1, 980, 278. 00	1, 536, 708. 01
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	660, 092. 67	512, 236. 01
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6. 4. 7. 18	4, 976. 82	726. 01
5. 利息支出		5, 231, 346. 27	4, 159, 084. 45
其中：卖出回购金融资产支出		5, 231, 346. 27	4, 159, 084. 45
6. 税金及附加		60, 773. 96	40, 396. 58
7. 其他费用	6. 4. 7. 19	127, 078. 95	118, 053. 90
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		31, 011, 718. 69	23, 218, 518. 36
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		31, 011, 718. 69	23, 218, 518. 36

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长江乐鑫纯债定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日



单位：人民币元

项 目	本期 2021年01月01日至2021年06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)	1,301,444,796.01	6,740,457.48	1,308,185,253.49
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期利润)	-	31,011,718.69	31,011,718.69
三、本期基金份额交易 产生的基金净值变动 数(净值减少以“-” 号填列)	294,549,828.18	5,449,171.82	299,999,000.00
其中：1. 基金申购款	294,549,828.18	5,449,171.82	299,999,000.00
2. 基金赎回款	-	-	-
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)	-	-11,713,003.16	-11,713,003.16
五、期末所有者权益 (基金净值)	1,595,994,624.19	31,488,344.83	1,627,482,969.02
项 目	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06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)	1,004,004,753.83	12,393,992.90	1,016,398,746.73
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期利润)	-	23,218,518.36	23,218,518.36
三、本期基金份额交易 产生的基金净值变动 数(净值减少以“-” 号填列)	-	-	-

其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
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)	-	-10,040,047.54	-10,040,047.54
五、期末所有者权益(基金净值)	1,004,004,753.83	25,572,463.72	1,029,577,217.55

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：

周纯

杨忠

何永生

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

长江乐鑫纯债定期开放债券型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2018]989号文《关于准予长江乐鑫纯债定期开放债券型发起式证券投资基金注册的批复》准予注册,由长江证券(上海)资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《长江乐鑫纯债定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。

本基金以定期开放方式运作,即采取在封闭期内封闭运作、封闭期与封闭期之间定期开放的运作方式。本基金以三个月为一个封闭期,在封闭期内,本基金不接受基金份额的申购和赎回。本基金的封闭期为自基金合同生效日(包括基金合同生效日)或每个开放期结束之日次日起(包括该日)至三个月后的对日的前一日止。如该对日不存在,则对日调整至该对应月度的最后一个工作日;如该对日为非工作日,则顺延至下一工作日。开放期为本基金开放申购、赎回等业务的期间。本基金自每个封闭期结束之日的下一个工作日起进入开放期。本基金的每个开放期不少于5个工作日、不超过20个工作日,开放期的具体时间以基金管理人届时公告为准,且基金管理人最迟应于开放期开始的2日前进行公告。本基金存续期限为不定期,首次设立募集资金为309,999,000.00元,认购资金在募集期间产生的利息0.00元,合计为309,999,000.00元,按照每份基金份额面值人民币1.00元计算,折合基金份额为309,999,000.00份,业经中审众环会计师事务所(特殊普通合伙)众环验字(2018)010057号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《长江乐鑫纯债定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》于2018年8月16

日正式生效。本基金的基金管理人为长江证券（上海）资产管理有限公司，基金托管人为浙商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长江乐鑫纯债定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》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国债、金融债、公司债、企业债、地方政府债、次级债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、资产支持证券、债券回购、央行票据、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款、通知存款）、货币市场工具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）。本基金不投资于股票、权证，也不投资于可转换债券、可交换债券。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。基金的投资组合比例为：本基金投资于债券的比例不低于基金资产的80%；但在每个开放期的前10个工作日和后10个工作日以及开放期间不受前述投资组合比例的限制。本基金在封闭期内持有现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不受限制，但在开放期本基金持有现金（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不低于基金资产净值的5%。当法律法规的相关规定变更时，基金管理人在履行适当程序后可对上述资产配置比例进行适当调整。

本基金的业绩比较基准为：中国债券综合财富指数收益率。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金根据实际发生的交易和事项，按照《长江乐鑫纯债定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会发布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金实务操作编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2021年中期报告的财务报表符合报表附注所列编制基础的要求，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日的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

#### 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 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]11号文《关于调整证券（股票）交易印花税税率的通知》、财税[2005]102号文《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税字[2005]107号文《关于利息红利个人所得税政策的补充通知》、财税[2007]84号文《关于调整证券（股票）交易印花税税率的通知》、财税[2012]85号文《财政部 国家税务总局 证监会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》、财税[2015]101号文《财政部 国家税务总局 证监会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号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财政部及国家税务总局“证券（股票）交易印花税税率2008年4月24日起由3‰调整为1‰”、财政部“证券交易印花税2008年9月19日起单边征收”及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

##### （1）所得税：

①对基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂免征收企业所得税。

②对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税。

③按照财税[2015]101号文规定，基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税；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；上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

④基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免予缴纳企业所得税和个人所得税。

⑤对投资者（包括个人和机构投资者）从基金分配中取得的收入，暂不征收个人所得税和企业所得税。

##### （2）增值税

①资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

②对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

## (3) 印花税

自2008年9月19日起，对基金卖出证券（股票）按0.1%的税率征收印花税，对基金买入证券（股票）不再征收印花税。

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体、纳税义务按上述税收法律法规执行。

## 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
	2021年06月30日
活期存款	694,925.83
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	694,925.83

## 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2021年06月30日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	-	-	-	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	518,346,667.65	521,224,000.00	2,877,332.35
	银行间市场	1,307,657,093.61	1,312,001,500.00	4,344,406.39
	合计	1,826,003,761.26	1,833,225,500.00	7,221,738.74
资产支持证券	175,516,117.99	176,916,600.00	1,400,482.01	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	

合计	2,001,519,879.25	2,010,142,100.00	8,622,220.75
----	------------------	------------------	--------------

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

#### 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

本基金本报告期末无买入返售金融资产余额。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应收活期存款利息	183.27
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	2,651.70
应收债券利息	22,706,371.48
应收资产支持证券利息	438,178.48
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	11.60
合计	23,147,396.53

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	14,336.18
合计	14,336.18

## 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	228,478.95
合计	228,478.95

## 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,301,444,796.01	1,301,444,796.01
本期申购	294,549,828.18	294,549,828.18
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,595,994,624.19	1,595,994,624.19

## 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,220,492.22	3,519,965.26	6,740,457.48
本期利润	22,618,964.57	8,392,754.12	31,011,718.69

本期基金份额交易产生的变动数	2,907,335.47	2,541,836.35	5,449,171.82
其中：基金申购款	2,907,335.47	2,541,836.35	5,449,171.82
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-11,713,003.16	-	-11,713,003.16
本期末	17,033,789.10	14,454,555.73	31,488,344.83

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2021年01月01日至2021年06月30日	
活期存款利息收入	7,710.41	
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	68,257.36	
其他	157.54	
合计	76,125.31	

#### 6.4.7.12 股票投资收益

本基金本报告期无股票投资收益。

#### 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	
	2021年01月01日至2021年06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	-3,153,789.78	
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	-3,153,789.78	

##### 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
	2021年01月01日至2021年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	378,906,054.38
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	373,367,252.65
减：应收利息总额	8,692,591.51
买卖债券差价收入	-3,153,789.78

**6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入**

本基金本报告期无债券投资收益——赎回差价收入。

**6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期无债券投资收益——申购差价收入。

**6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
卖出资产支持证券成交总额	58,792,020.64
减：卖出资产支持证券成本总额	59,130,817.34
减：应收利息总额	1,061,197.84
资产支持证券投资收益	-1,399,994.54

**6.4.7.14 衍生工具收益**

本基金本报告期无衍生工具收益。

**6.4.7.15 股利收益**

本基金本报告期无股利收益。

**6.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
1. 交易性金融资产	8,392,754.12
——股票投资	-
——债券投资	6,101,149.11
——资产支持证券投资	2,291,605.01
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	8,392,754.12

#### 6.4.7.17 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
交易所市场交易费用	1,451.82
银行间市场交易费用	3,525.00
合计	4,976.82

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
审计费用	39,671.58
信息披露费	59,507.37

证券出借违约金	-
账户维护费	27,900.00
合计	127,078.95

#### 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

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无须作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

本基金本报告期不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。

##### 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
长江证券（上海）资产管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
浙商银行股份有限公司	基金托管人
长江证券股份有限公司（以下简称“长江证券”）	基金管理人股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 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

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方	本期	上年度可比期间
-----	----	---------

名称	2021年01月01日至2021年06月30日		2020年01月01日至2020年06月30日	
	成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例	成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例
长江证券	49,900,000.00	35.92%	1,008,800.00	100.00%

#### 6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
长江证券	7,188,000,000.00	79.51%	6,619,600,000.00	90.03%

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间未产生应支付关联方的佣金。

#### 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 2021年01月01日 至2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日 至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,980,278.00	1,536,708.01
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：（1）本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.30%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

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

（2）基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前五个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日 至2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日 至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	660,092.67	512,236.01

注：（1）本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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

（2）基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前五个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

**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**

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券（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**

本基金本报告期及上年度可比期间未发生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。

**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**

本基金本报告期及上年度可比期间未发生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。

**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**

份额单位：份

项目	本期 2021年01月01日 至2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日 至2020年06月30日
报告期初持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
报告期末持有的基金份额占基金 总份额比例	0.63%	1.00%

#### 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

本基金本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 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 2021年01月01日至2021年06月30日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
浙商银行 股份有限 公司	694,925.83	7,710.41	1,260,150.92	5,318.03

注：本基金的银行存款由基金托管人浙商银行股份有限公司保管，按约定利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息 日	每10份基 金份额分 红数	现金形式 发放总额	再投资 形式发 放总额	本期利润 分配合计	备注
1	2021-03 -26	2021- 03-26	0.090	11,713,003. 16	-	11,713,003. 16	-
合计			0.090	11,713,003. 16	-	11,713,003. 16	-

#### 6.4.12 期末（2021年06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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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

截至本报告期末2021年6月30日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为137,026,274.45元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估 值单价	数量（张）	期末估值总额
101654044	16广物控股MTN 001	2021-07-07	101.17	500,000	50,585,000.00
112180753	21广东华兴银 行CD203	2021-07-07	96.66	500,000	48,330,000.00
1820064	18九江银行绿 色金融02	2021-07-07	100.97	85,000	8,582,450.00
1921034	19顺德农商双 创债01	2021-07-07	101.08	150,000	15,162,000.00
200216	20国开16	2021-07-01	100.17	201,000	20,134,170.00
合计				1,436,000	142,793,620.00

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2021年6月30日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为274,500,000.00元，于2021年7月1日和2021年7月2日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末2021年6月30日止，本基金未持有参与转融通证券出借业务的证券。

### 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

本基金为债券型基金，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。本基金投资的金融工具主要包括债券投资及货币市场工具等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全员与全程结合、风控与发展并重的风险管理理念。董事会主要负责公司的风险管理战略和控制政策、协调突发重大风险等事项。在公司经营管理层下设风险控制委员会，制定公司日常经营过程中各类风险的防范和管理措施；在业务操作层面，一线业务部门负责对各自业务领域风险的管控，公司具体的风险管理职责由法律合规部、风险管理部负责，组织、协调并与各业务部门共同完成对法律风险、投资风险、操作风险、合规风险等风险类别的管理，并定期向公司专门的风险控制委员会报告公司风险状况。法律合规部和风险管理部分别由合规总监和首席风险官分管，配置有合规、风控方面专业人员。本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 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、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算



有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，因此违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

#### 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 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	70,119,000.00	71,118,600.00
合计	70,119,000.00	71,118,600.00

注：（1）债券评级取自第三方评级机构的债项评级；（2）截止报告期末，本基金持有的未评级的债券包括债券期限在一年及一年以内的政策性金融债。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	164,223,000.00	86,996,000.00
合计	164,223,000.00	86,996,000.00

注：同业存单评级取自第三方评级机构的债项评级。

#### 6.4.13.2.3 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	924,168,500.00	794,244,000.00
AAA以下	654,843,000.00	512,445,000.00

未评级	19,872,000.00	50,175,000.00
合计	1,598,883,500.00	1,356,864,000.00

注：（1）债券评级取自第三方评级机构的债项评级；（2）截止报告期末，本基金持有的未评级的债券包括债券期限在一年以上的政策性金融债。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	126,486,600.00	133,825,500.00
AAA以下	-	-
未评级	50,430,000.00	50,000,000.00
合计	176,916,600.00	183,825,500.00

注：资产支持证券评级取自第三方评级机构的债项评级。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指在履行以交付现金或其他金融资产的方式结算的义务时发生资金短缺的风险。对于本基金而言，体现在所持金融工具变现的难易程度。

本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可在基金运作周期内的每个开放日要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每个开放日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的管理人严格按照《公开募集证券投资基金管理办法》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管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性置项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。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用头寸与之相匹

配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金主要投资于公开发行的、信用级别较好的债券资产，高流动性资产比例较高。当在基金运作过程中遇到流动性风险时，可通过交易所回购、交易所协议回购和银行间回购、债券资产变现等多种操作缓解流动性风险。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 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因市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，此外还持有银行存款、结算备付金等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年06 月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	694,925.83	-	-	-	694,925.83
结算备付金	5,892,620.04	-	-	-	5,892,620.04
存出保证金	25,719.00	-	-	-	25,719.00
交易性金融资产	1,067,063,500.00	879,685,000.00	63,393,600.00	-	2,010,142,100.00
应收利息	-	-	-	23,147,396.53	23,147,396.53
资产总计	1,073,676,764.87	879,685,000.00	63,393,600.00	23,147,396.53	2,039,902,761.40
负债					
卖出回购金融资产	411,526,274.45	-	-	-	411,526,274.45

款					
应付证券清算款	-	-	-	2,172.60	2,172.60
应付管理人报酬	-	-	-	346,599.86	346,599.86
应付托管费	-	-	-	115,533.28	115,533.28
应付交易费用	-	-	-	14,336.18	14,336.18
应交税费	-	-	-	77,849.18	77,849.18
应付利息	-	-	-	108,547.88	108,547.88
其他负债	-	-	-	228,478.95	228,478.95
负债总计	411,526,274.45	-	-	893,517.93	412,419,792.38
利率敏感度缺口	662,150,490.42	879,685,000.00	63,393,600.00	22,253,878.60	1,627,482,969.02
上年度末 2020年12 月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	817,099.27	-	-	-	817,099.27
结算备付金	7,285,152.71	-	-	-	7,285,152.71
存出保证金	3,562.35	-	-	-	3,562.35
交易性金融资产	816,137,200.00	838,039,500.00	44,627,400.00	-	1,698,804,100.00
应收利息	-	-	-	25,782,759.37	25,782,759.37
资产总计	824,243,014.33	838,039,500.00	44,627,400.00	25,782,759.37	1,732,692,673.70
负债					
卖出回购金融资产款	423,619,212.06	-	-	-	423,619,212.06
应付证券清算款	-	-	-	78,204.79	78,204.79
应付管理人报酬	-	-	-	329,854.86	329,854.86
应付托管费	-	-	-	109,951.63	109,951.63
应付交易费用	-	-	-	15,331.47	15,331.47
应交税费	-	-	-	91,630.92	91,630.92
应付利息	-	-	-	63,234.48	63,234.48
其他负债	-	-	-	200,000.00	200,000.00

负债总计	423,619,212.06	-	-	888,208.15	424,507,420.21
利率敏感度缺口	400,623,802.27	838,039,500.00	44,627,400.00	24,894,551.22	1,308,185,253.49

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况		
假设	除利率之外的其他市场变量保持不变		
假设	该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动		
假设	银行存款、结算备付金、存出保证金和部分应收申购款均以活期存款利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响；买入返售金融资产的利息收益和卖出回购金融资产款的利息支出在交易时已确定，不受利率变化影响		
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06月30日	上年度末 2020年12月31日
	市场利率上升25个基点	-6,788,557.15	-4,937,783.01
	市场利率下降25个基点	6,788,557.15	4,937,783.01

#### 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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 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。本基金主要投资于交易所及银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

#### 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) 金融工具公允价值计量的方法 公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：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：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的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无属于第一层次的余额，属于第二层次的余额为2,010,142,100.00元，无属于第三层次的余额。（于2020年12月31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无属于第一层次的余额，属于第二层次的余额为1,698,804,100.00元，无属于第三层次的余额。）

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2021年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 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。

(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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,010,142,100.00	98.54
	其中：债券	1,833,225,500.00	89.87
	资产支持证券	176,916,600.00	8.67
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	6,587,545.87	0.32
8	其他各项资产	23,173,115.53	1.14
9	合计	2,039,902,761.40	100.00

## 7.2 报告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

本基金本报告期末未持有股票。

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

## 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

本基金本报告期末未持有股票。

## 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

本基金本报告期末未持有股票。

### 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

本基金本报告期末未持有股票。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末未持有股票。

## 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	853,469,500.00	52.44
	其中：政策性金融债	89,991,000.00	5.53

4	企业债券	521,224,000.00	32.03
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	294,309,000.00	18.08
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	164,223,000.00	10.09
9	其他	-	-
10	合计	1,833,225,500.00	112.64

### 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	2122040	21重庆鈰渝租赁债01	1,000,000	99,870,000.00	6.14
2	1822036	18洛银租赁债	800,000	80,768,000.00	4.96
3	200216	20国开16	700,000	70,119,000.00	4.31
4	2122031	21浙江稠州租赁债	600,000	60,126,000.00	3.69
5	101800367	18越秀金融MTN003	500,000	51,535,000.00	3.17

### 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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	1989473	19创盈2A2	300,000	30,306,000.00	1.86
2	179884	21铁控A2	300,000	30,132,000.00	1.85
3	179034	橙安5A3	250,000	25,250,000.00	1.55
4	179033	橙安5A2	250,000	25,180,000.00	1.55
5	137100	中美5A1	250,000	25,140,000.00	1.54
6	137892	广物01优	200,000	20,124,000.00	1.24
7	1989405	19融享3A2	180,000	13,215,600.00	0.81
8	1989359	19兴渝1A	300,000	7,569,000.00	0.47

### 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



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

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据基金合同约定，本基金不得投资于股指期货。

## 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

根据基金合同约定，本基金不得投资于国债期货。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 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之一洛银金融租赁股份有限公司在报告编制日前一年内被中国银保监会河南监管局洛阳分局处以罚款。

本基金管理人对上述证券的投资决策符合相关法律法规和公司制度的要求。

7.12.2 根据基金合同约定，本基金不得投资于股票。本基金本报告期末未持有股票。

### 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	25,719.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	23,147,396.53
5	应收申购款	-

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	23,173,115.53

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

### § 8 基金份额持有人信息

#### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人 户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比 例	持有份额	占总份 额比 例
2	797,997,312.10	1,595,994,624.19	100.00%	0.00	0.00%

#### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	0.00	0.00%

#### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

#### 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份 额总数	持有份额占基 金总份额比例	发起份 额总数	发起份额占基 金总份额比例	发起份额承 诺持有期限
基金管理人固 有资金	10,000, 000.00	0.63%	10,000, 000.00	0.63%	3年
基金管理人高 级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人 员	-	-	-	-	-
基金管理人股 东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000, 000.00	0.63%	10,000, 000.00	0.63%	-

#### § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2018年08月16日)基金份额总额	309,999,000.00
本报告期期初基金份额总额	1,301,444,796.01
本报告期基金总申购份额	294,549,828.18
减：本报告期基金总赎回份额	-
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,595,994,624.19

#### § 10 重大事件揭示

##### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内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

1、本报告期内，自2021年1月22日起，吴迪先生担任本基金管理人首席风险官，董来富先生离任本基金管理人副总经理、首席风险官，范海蓉女士离任本基金管理人副总经理。

2、本报告期内，自2021年4月20日起，杨忠先生担任本基金管理人总经理，唐吟波女士离任本基金管理人总经理。

3、本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及对公司运营管理和基金运作产生重大影响的，与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内未改变投资策略。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内继续选聘中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务。

### 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

本报告期内，本基金管理人、托管人及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

### 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	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-

注：1、基金专用交易单元的选择标准如下：

- (1) 资历雄厚，信誉良好，注册资本不少于2亿元人民币；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金公司进行证

券交易的需要，并能为基金公司提供全面的信息服务；

(6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为基金提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析报告、个股分析报告及其他专门报告，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

2、基金专用交易单元的选择程序如下：

基金管理人根据上述标准，选定符合条件的证券公司作为租用交易单元的对象，并签订交易单元租用协议。基金管理人的投资和研究部门定期对所选证券公司的服务进行综合评比，评比内容包括：提供宏观、行业、策略、专题、公司等研究报告的质量和数量；组织相关研讨会议的数量和质量；协助安排上市公司调研的数量和质量；主动进行上门路演和反路演的数量和质量；以及其他及时性及提供研究服务主动性和质量等情况。最终公司统一依据评比结果确定交易单元交易的具体情况。

3、本基金本报告期内租用的券商交易单元未发生变更。

#### 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	
	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
长江证券	49,900,000.00	35.92%	7,188,000,000.00	79.51%
东方证券	89,004,500.00	64.08%	1,852,000,000.00	20.49%

#### 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	长江乐鑫纯债定期开放债券型发起式证券投资基金2020年第四季度报告	规定网站	2021-01-22
2	长江证券（上海）资产管理有限公司旗下部分基金2020年第四季度报告提示性公告	规定报刊	2021-01-22
3	长江证券（上海）资产管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	规定报刊、网站	2021-01-23
4	长江证券（上海）资产管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	规定报刊、网站	2021-01-23
5	长江乐鑫纯债定期开放债券型发起式证券投资基金2020年第四季度报告	规定网站	2021-01-22
6	长江证券（上海）资产管理有限公司旗下	规定报刊	2021-01-22

	部分基金2020年第四季度报告提示性公告		
7	长江证券（上海）资产管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	规定报刊、网站	2021-01-23
8	长江证券（上海）资产管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	规定报刊、网站	2021-01-23
9	长江证券（上海）资产管理有限公司关于长江乐鑫纯债定期开放债券型发起式证券投资基金第九个开放期开放申购与赎回业务的公告	规定报刊、网站	2021-03-03
10	长江证券（上海）资产管理有限公司关于公司董事变更的公告	规定报刊、网站	2021-03-17
11	长江乐鑫纯债定期开放债券型发起式证券投资基金分红公告	规定报刊、网站	2021-03-25
12	长江乐鑫纯债定期开放债券型发起式证券投资基金2020年年度报告	规定网站	2021-03-31
13	长江证券（上海）资产管理有限公司旗下部分基金2020年年度报告提示性公告	规定报刊	2021-03-31
14	长江证券（上海）资产管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	规定报刊、网站	2021-04-21
15	长江乐鑫纯债定期开放债券型发起式证券投资基金2021年第一季度报告	规定网站	2021-04-22
16	长江证券（上海）资产管理有限公司旗下全部基金2021年第一季度报告提示性公告	规定报刊	2021-04-22
17	长江证券（上海）资产管理有限公司关于网上交易系统升级维护的公告	规定报刊、网站	2021-04-27
18	长江证券（上海）资产管理有限公司关于开展网上服务系统应急演练的公告	规定报刊、网站	2021-05-20
19	长江证券（上海）资产管理有限公司关于长江乐鑫纯债定期开放债券型发起式证券投资基金第十个开放期开放申购与赎回业务的公告	规定报刊、网站	2021-06-10

## § 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

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	20210101-20210630	1,291,444,796.01	294,549,828.18	-	1,585,994,624.19	99.37%

#### 产品特有风险

报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险包括但不限于：当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；如个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定延缓支付赎回款项，可能影响投资者赎回业务办理；持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金单一投资者持有的基金份额或者构成一致行动人的多个投资者持有的基金份额可达到或者超过50%，本基金不向个人投资者销售。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予长江乐鑫纯债定期开放债券型发起式证券投资基金募集申请的注册文件
- 2、长江乐鑫纯债定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同
- 3、长江乐鑫纯债定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书
- 4、长江乐鑫纯债定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议
- 5、法律意见书
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 7、本报告期内按照规定披露的各项公告

### 12.2 存放地点

存放地点为基金管理人办公地址：上海市浦东新区世纪大道1198号世纪汇一座27层。

### 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间至基金管理人办公地点免费查阅，亦可通过基金管理人网站查阅，网址为[www.cjzcg1.com](http://www.cjzcg1.com)。

长江证券（上海）资产管理有限公司  
二〇二一年八月三十日