长信利众债券型证券投资基金(LOF)
2026 年中期报告

2026 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：上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期：2026 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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 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 2026 年 1 月 1 日起至 2026 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2

1.1 重要提示 2
1.2 目录 3

§2 基金简介 5

2.1 基金基本情况 5
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 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 10

4.1 基金管理人及基金经理情况 10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 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 13
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 14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 14

§5 托管人报告 14

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 14
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 15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 15

§6 半年度财务会计报告（未经审计） 15

6.1 资产负债表 15
6.2 利润表 16
6.3 净资产变动表 18
6.4 报表附注 20

§7 投资组合报告 42

7.1 期末基金资产组合情况 42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 42
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 42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 43
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 43

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 43
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 43
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 43
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 ..... **错误!未定义书签。**
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 43
7.12 投资组合报告附注 44

§8 基金份额持有人信息 45

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 45
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 45
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 45

§9 开放式基金份额变动 46

§10 重大事件揭示 46

10.1 基金份额持有人大会决议 46
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 46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 46
10.4 基金投资策略的改变 47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 47
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 47
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况 47
10.8 其他重大事件 49

§11 影响投资者决策的其他重要信息 50

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 50
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 50

§12 备查文件目录 50

12.1 备查文件目录 50
12.2 存放地点 50
12.3 查阅方式 50

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长信利众债券型证券投资基金(LOF)		
基金简称	长信利众债券(LOF)		
基金主代码	163005		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2016 年 2 月 5 日		
基金管理人	长信基金管理有限责任公司		
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	1,778,155,158.55 份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2016 年 3 月 16 日		
下属分级基金的基金简称	长信利众债券（LOF）A	长信利众债券（LOF）C	长信利众债券（LOF）E
下属分级基金的场内简称	-	长信利众 LOF	-
下属分级基金的交易代码	163007	163005	023574
报告期末下属分级基金的份额总额	284,807,499.07 份	991,534,805.64 份	501,812,853.84 份

注：1、表中的合同生效日为基金转型起始日，本基金的合同生效日为 2013 年 2 月 4 日。长信利众分级债券型证券投资基金根据《基金合同》的有关规定，《基金合同》生效后 3 年分级运作期届满进行转换，本基金转换基准日为 2016 年 2 月 4 日，转换日日终，长信利众分级债 A、长信利众分级债 B 按照各自的基金份额净值转换成长信利众债券（LOF）份额。

2、上市日期为长信利众债券（LOF）C 的上市日期。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金的投资目标是在严格控制投资风险与追求基金资产稳定增值的前提下，力争为各级投资者谋求与其风险公正匹配的投资回报。
投资策略	本基金根据对宏观经济、宏观调控政策走向以及各类资产市场风险收益特征及其演变趋势的综合分析、比较，首先采用类属配置策略进行大类资产的配置，在此基础上，再根据对各类资产风险收益特征的进一步分析预测，制定各自策略。
业绩比较基准	中债综合（全价）指数
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于较低风险的证券投资基金品种，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		长信基金管理有限责任公司	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周永刚	汪小敏
	联系电话	021-61009999	021-31888888
	电子邮箱	zhouyg@cxfund.com.cn	wangxm8@spdb.com.cn
客户服务电话		4007005566	95528
传真		021-61009800	021-63602540
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 37 层	上海市中山东一路 12 号
办公地址		上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼、37 楼、38 楼	上海市博成路 1388 号浦银中心 A 栋
邮政编码		200120	200126
法定代表人		肖剑	张为忠

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.cxfund.com.cn
基金中期报告置备地点	上海市浦东新区银城中路 68 号 38 楼、上海市中山东一路 12 号

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	A 类份额、C 类份额：中国证券登记结算有限责任公司；E 类份额：长信基金管理有限责任公司	A 类份额、C 类份额：北京市西城区太平桥大街 17 号；E 类份额：上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼、37 楼、38 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

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)

	长信利众债券（LOF）A	长信利众债券（LOF）C	长信利众债券（LOF）E
本期已实现收益	5,343,620.34	17,805,600.42	9,680,149.30
本期利润	8,450,172.55	26,857,649.06	15,573,359.91
加权平均基金份额本期利润	0.0261	0.0259	0.0261
本期加权平均净值利润率	2.57%	2.53%	2.57%
本期基金份额净值增长率	2.85%	2.67%	2.86%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)		
期末可供分配利润	53,049,825.53	167,577,366.67	93,399,271.04
期末可供分配基金份额利润	0.1863	0.1690	0.1861
期末基金资产净值	293,387,917.84	1,027,079,277.03	516,856,155.30
期末基金份额净值	1.0301	1.0358	1.0300
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)		
基金份额累计净值增长率	62.45%	50.47%	6.43%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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

长信利众债券（LOF）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
过去三个月	1.65%	0.14%	0.62%	0.04%	1.03%	0.10%
过去六个月	2.85%	0.15%	0.91%	0.04%	1.94%	0.11%
过去一年	4.70%	0.15%	-0.56%	0.06%	5.26%	0.09%
过去三年	12.49%	0.11%	5.12%	0.08%	7.37%	0.03%

过去五年	22.78%	0.11%	8.48%	0.07%	14.30%	0.04%
过去七年	40.06%	0.17%	10.29%	0.07%	29.77%	0.10%
过去十年	60.49%	0.16%	10.33%	0.07%	50.16%	0.09%
自份额增加日起至今	62.45%	0.17%	10.48%	0.07%	51.97%	0.10%

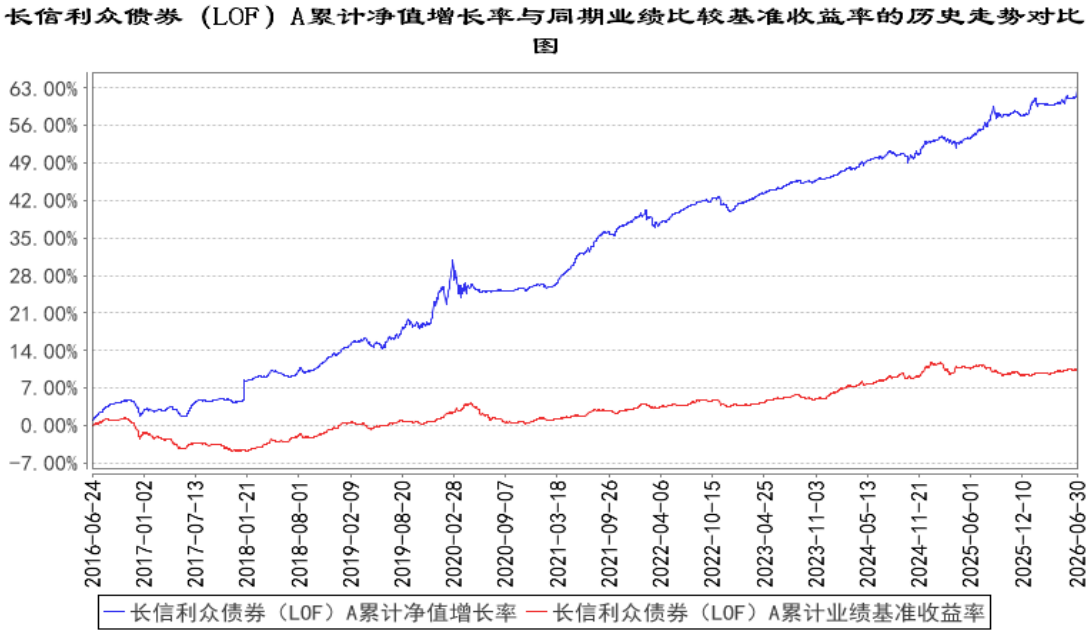
长信利众债券（LOF）C

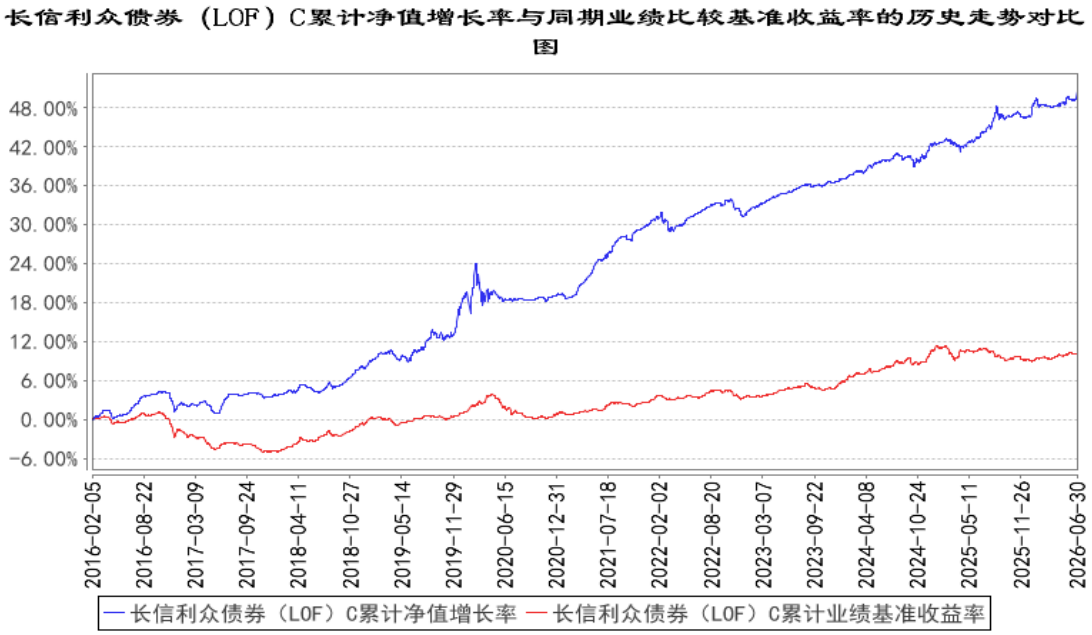
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	1.55%	0.14%	0.62%	0.04%	0.93%	0.10%
过去六个月	2.67%	0.15%	0.91%	0.04%	1.76%	0.11%
过去一年	4.32%	0.15%	-0.56%	0.06%	4.88%	0.09%
过去三年	11.30%	0.11%	5.12%	0.08%	6.18%	0.03%
过去五年	20.64%	0.11%	8.48%	0.07%	12.16%	0.04%
过去七年	36.45%	0.17%	10.29%	0.07%	26.16%	0.10%
过去十年	48.62%	0.15%	10.33%	0.07%	38.29%	0.08%
自基金合同生效起至今	50.47%	0.15%	10.17%	0.07%	40.30%	0.08%

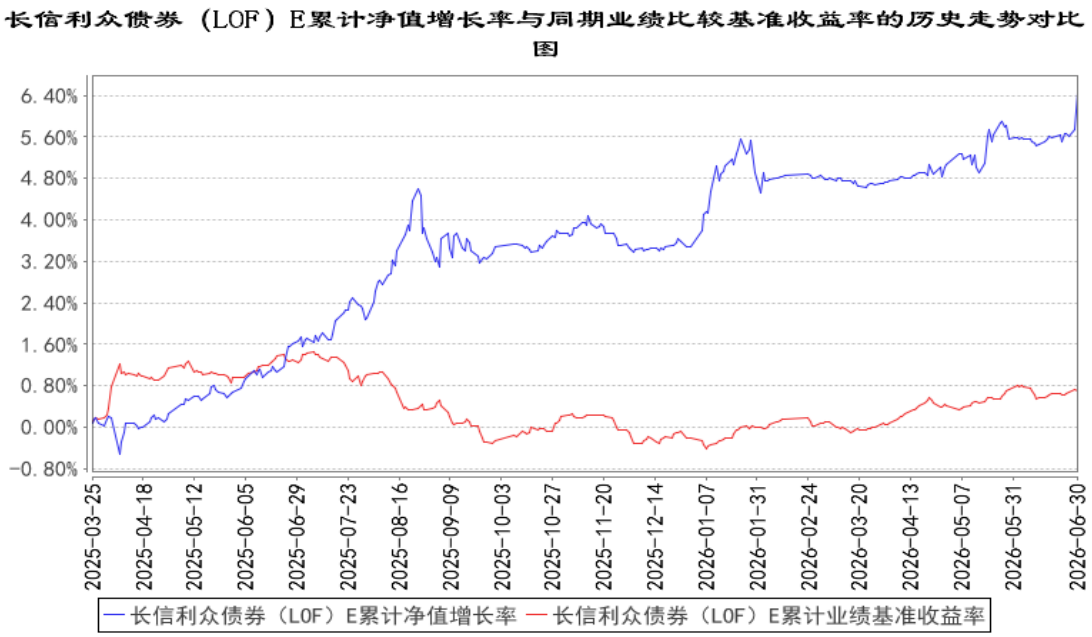
长信利众债券（LOF）E

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
过去三个月	1.65%	0.14%	0.62%	0.04%	1.03%	0.10%
过去六个月	2.86%	0.15%	0.91%	0.04%	1.95%	0.11%
过去一年	4.70%	0.15%	-0.56%	0.06%	5.26%	0.09%
自份额增加日起至今	6.43%	0.14%	0.69%	0.07%	5.74%	0.07%

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







注：1、自 2016 年 6 月 24 日起对长信利众债券型证券投资基金（LOF）进行份额分类，原有基金份额为 C 类份额，增设 A 类份额。自 2025 年 3 月 25 日起增设长信利众债券（LOF）E 类份额。

2、本基金转型起始日为 2016 年 2 月 5 日，长信利众债券（LOF）A 图示日期为 2016 年 6 月 24 日（份额增加日）至 2026 年 6 月 30 日，长信利众债券（LOF）C 图示日期为 2016 年 2 月 5 日至 2026 年 6 月 30 日，长信利众债券(LOF)E 图示日期为 2025 年 3 月 25 日(份额增加日)至 2026 年 6 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，本基金基金合同生效日为 2013 年 2 月 4 日，转型起始日为 2016 年 2 月 5 日，转型后的投资范围及投资比例与转型前一致，转型后本基金的各项投资比例符合基金合同约定的各项投资范围及比例要求。

§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 2026 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 92 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、长信利富债券型证券投资基金、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、长信先锐混合型证券投资基金、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、长信内需均衡混合型证券投资基金、长信 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金、长信稳惠债券型证券投资基金、长信稳丰债券型证券投资基金、长信先进装备三个月持有期混合型证券投资基金、长信颐和平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、长信颐年平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、长信稳健增长一年持有期混合型证券投资基金、长信稳健成长混合型证券投资基金、长信企业成长三年持有期混合型证券投资基金、长信稳兴三个月定期开放债券型证券投资

基金、长信稳航 30 天持有期中短债债券型证券投资基金、长信稳恒债券型证券投资基金、长信中证科创创业 50 指数增强型证券投资基金、长信中证 1000 指数增强型证券投资基金、长信均衡优选混合型证券投资基金、长信 90 天滚动持有债券型证券投资基金、长信稳固 60 天滚动持有债券型证券投资基金、长信汇智量化选股混合型证券投资基金、长信 120 天滚动持有债券型证券投资基金、长信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、长信优势行业混合型证券投资基金、长信 180 天持有期债券型证券投资基金、长信富安纯债 180 天持有期债券型证券投资基金、长信中证 A500 指数增强型证券投资基金、长信稳瑞纯债债券型证券投资基金、长信沪深 300 指数量化增强型证券投资基金、长信盈安资产配置三个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)、长信稳健添益债券型证券投资基金、长信上证科创板综合指数增强型证券投资基金、长信均衡配置混合型证券投资基金、长信稳健汇利 90 天持有期债券型证券投资基金、长信汇众量化选股混合型证券投资基金、长信北证 50 成份指数增强型证券投资基金。

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		
刘婧	长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信利众债券型证券投资基金(LOF)、长信稳健精选混合型证券投资基金和长信稳健添益债券型证券投资基金的基金经理	2020 年 7 月 9 日	-	13 年	北京大学软件工程硕士，具有基金从业资格，中国国籍。曾任职于工银安盛人寿保险有限公司资产管理部，2016 年 5 月加入长信基金管理有限责任公司，历任基金经理助理、投资经理助理、投资经理、长信利率债债券型证券投资基金、长信稳兴三个月定期开放债券型证券投资基金和长信稳瑞纯债债券型证券投资基金的基金经理。现任长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信利众债券型证券投资基金(LOF)、长信稳健精选混合型证券投资基金和长信稳健添益债券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 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

上半年宏观经济呈现分化格局，外需相关数据较为亮眼，内需面临较大压力。新动能快速成长，高技术制造业增速较高。债券利率震荡下行，利率债与信用债均有一定行情，信用利差有所收窄。转债市场上半年为高位震荡走势，中证转债指数录得正收益，高价转债表现优于低价转债。本基金上半年在严控信用风险的前提下，以信用债提供票息收益，对转债部分做了积极的仓位及结构调整，同时参与了利率债的波段交易。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2026 年 6 月 30 日，长信利众债券（LOF）A 基金份额净值为 1.0301 元，份额累计净值为 1.4341 元，本报告期内长信利众债券（LOF）A 净值增长率为 2.85%；长信利众债券（LOF）C 基金份额净值为 1.0358 元，份额累计净值为 1.3748 元，本报告期内长信利众债券（LOF）C 净值增长率为 2.67%；长信利众债券（LOF）E 基金份额净值为 1.0300 元，份额累计净值为 1.0300 元，本报告期内长信利众债券（LOF）E 净值增长率为 2.86%，同期业绩比较基准收益率为 0.91%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，预计货币政策或将保持流动性合理充裕，助力经济企稳回升，可积极把握长久期利率债的交易性机会，同时积极把握票息机会，优选未终止评级的信用债。转债方面，科技主线处于休整期，整体行情偏震荡，转债估值偏贵，波动较大，操作上控制仓位，聚焦个券的交易性机会。本基金将继续保持审慎严谨的态度，密切关注经济走势和政策动向，适度调整组合持仓债券的久期、结构和仓位，加强流动性管理，严格防范信用风险，精选转债个券，进一步优化投资组合，力争为投资者获取更好的收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金持有的投资品种进行估值。基金托管人根据法律法规要求对基金管理公司采用的估值政策和程序进行核查，并对估值结果及净值计算进行复核。

根据相关法律法规，本基金管理人制订了健全、有效的估值政策和估值程序，设立了估值委员会，估值委员会是公司基金估值的主要决策机构，其主要职责是负责拟定公司的估值政策、估值方法及采用的估值程序和技术，对公司现有程序和技术进行复核和审阅，当发生了影响估值程序和技术的有效性及适用性的情况及时修订估值程序；估值委员会成员由基金事务部、投资、研究、交易等相关业务部门负责人以及基金事务部至少一名业务骨干共同组成，相关参与人员都具有丰富的证券行业工作经验，熟悉相关法规和估值方法，均具备估值业务所需的专业胜任能力。对于基金的估值政策和估值原则，公司已与基金托管人充分沟通，并达成一致意见。审计本基金的会计师事务所认可公司基金估值政策和程序的适当性。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据以及流通受限股票的折扣率。参与估值流程各方不存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规和本基金基金合同规定的基金收益分配原则以及基金实际运作情况，本基金本报告期没有进行利润分配。

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

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对长信利众债券型

证券投资基金（LOF）的托管过程中，严格遵守《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、托管协议的规定，不存在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，本托管人依照《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、托管协议的规定，对长信利众债券型证券投资基金(LOF)的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支以及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告期内，由长信基金管理有限责任公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、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：长信利众债券型证券投资基金(LOF)

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	3,166,082.50	5,916,652.01
结算备付金		2,080,329.34	809,436.09
存出保证金		139,508.25	82,179.45
交易性金融资产	6.4.7.2	1,759,028,693.60	1,861,896,710.26
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,759,028,693.60	1,861,896,710.26
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	45,002,243.84	117,007,568.62
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-

其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	9,857,991.19
应收股利		-	-
应收申购款		32,393,368.84	489,459.19
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		1,841,810,226.37	1,996,059,996.81
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2026 年 6 月 30 日**	**上年度末 2025 年 12 月 31 日**
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		1,321,526.72	3,174,114.14
应付管理人报酬		1,036,840.64	1,320,292.67
应付托管费		222,180.15	282,919.86
应付销售服务费		297,357.32	352,742.55
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1,489,806.93	1,454,962.42
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	119,164.44	221,828.60
负债合计		4,486,876.20	6,806,860.24
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	1,349,072,292.95	1,501,729,700.48
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	488,251,057.22	487,523,436.09
净资产合计		1,837,323,350.17	1,989,253,136.57
负债和净资产总计		1,841,810,226.37	1,996,059,996.81

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，长信利众债券（LOF）A 份额净值 1.0301 元，长信利众债券（LOF）C 份额净值 1.0358 元，长信利众债券（LOF）E 份额净值 1.0300 元，基金份额总额为 1,778,155,158.55 份，其中长信利众债券（LOF）A 份额 284,807,499.07 份。长信利众债券（LOF）C 份额 991,534,805.64 份。长信利众债券（LOF）E 份额 501,812,853.84 份。

6.2 利润表

会计主体：长信利众债券型证券投资基金(LOF)

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间

		2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		61,376,617.13	41,188,133.51
1.利息收入		1,419,283.10	2,618,004.40
其中：存款利息收入	6.4.7.13	52,419.26	43,488.74
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,366,863.84	2,574,515.66
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		41,777,081.90	45,166,355.79
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	41,777,081.90	45,166,355.79
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	-	-
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	18,051,811.46	-6,923,826.22
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	128,440.67	327,599.54
减：二、营业总支出		10,495,435.61	13,507,659.70
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	6,942,005.20	8,273,812.39
其中：暂估管理人报酬		-	-
2．托管费	6.4.10.2.2	1,487,572.55	2,036,575.51
3．销售服务费	6.4.10.2.3	1,846,650.22	2,973,806.80
4．投资顾问费		-	-
5．利息支出		27,838.00	18,765.84
其中：卖出回购金融资产支出		27,838.00	18,765.84
6．信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7．税金及附加		64,087.72	74,365.91
8．其他费用	6.4.7.23	127,281.92	130,333.25
三、利润总额（亏损总额		50,881,181.52	27,680,473.81

以“-”号填列）			
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		50,881,181.52	27,680,473.81
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		50,881,181.52	27,680,473.81

6.3 净资产变动表

会计主体：长信利众债券型证券投资基金(LOF)

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1,501,729,700.48	-	487,523,436.09	1,989,253,136.57
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,501,729,700.48	-	487,523,436.09	1,989,253,136.57
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-152,657,407.53	-	727,621.13	-151,929,786.40
（一）、综合收益总额	-	-	50,881,181.52	50,881,181.52
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-152,657,407.53	-	-50,153,560.39	-202,810,967.92
其中：1.基金申购款	929,991,802.93	-	328,837,378.69	1,258,829,181.62
2.基金赎回款	-1,082,649,210.46	-	-378,990,939.08	-1,461,640,149.54
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以	-	-	-	-

“-”号填列）				
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	1,349,072,292.95	-	488,251,057.22	1,837,323,350.17
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1,517,543,132.37	-	449,318,952.71	1,966,862,085.08
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,517,543,132.37	-	449,318,952.71	1,966,862,085.08
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-124,136,336.72	-	-16,472,650.47	-140,608,987.19
（一）、综合收益总额	-	-	27,680,473.81	27,680,473.81
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-124,136,336.72	-	-44,153,124.28	-168,289,461.00
其中：1.基金申购款	1,813,981,235.37	-	542,591,041.59	2,356,572,276.96
2.基金赎回款	-1,938,117,572.09	-	-586,744,165.87	-2,524,861,737.96
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	1,393,406,795.65	-	432,846,302.24	1,826,253,097.89

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：

肖剑	覃波	孙红辉
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

长信利众债券型证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”）是由长信利众分级债券型证券投资基金转型而成，长信利众分级债券型证券投资基金系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2012]1708 号《关于核准长信利众分级债券型证券投资基金募集的批复》的核准，由长信基金管理有限责任公司向社会公开募集，基金合同于 2013 年 2 月 4 日生效，首次设立募集规模为 695,708,650.10 份基金份额。

2016 年 2 月 5 日，根据《长信利众分级债券型证券投资基金基金合同》的约定，基金合同生效后 3 年期届满，无需召开基金份额持有人大会，长信利众分级债券型证券投资基金自动转换为上市开放式基金（LOF），基金名称变更为“长信利众债券型证券投资基金（LOF）”。

本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为长信基金管理有限责任公司，A 类、C 类基金份额的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，E 类基金份额的注册登记机构为长信基金管理有限责任公司，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

2016 年 6 月 24 日，本基金在原基金份额基础之上对基金份额进行分类，原有长信利众债券型证券投资基金（LOF）份额归为 C 类份额，并增设 A 类份额。长信基金管理有限责任公司在与本基金的托管人上海浦东发展银行股份有限公司协商一致后，决定自 2025 年 3 月 25 日起对本基金增设 E 类基金份额，原有 A 类、C 类基金份额保留。

本基金的基金份额分为 A 类、C 类、E 类不同的类别，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，并在投资者申购基金时收取申购费用而不计提销售服务费，在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额，称为 A 类基金份额；注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，并在投资者申购基金份额时不收取申购费用而是从本类别基金资产中计提销售服务费，在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额，称为 C 类基金份额；注册登记机构为长信基金管理有限责任公司，并在投资者申购基金份额时收取申购费用而不计提销售服务费，在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额，称为 E 类基金份额。

本基金投资于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（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、中期票据、中小企业私募债券以及法律、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

监会的相关规定）。本基金主要投资于国内依法发行上市的国债、金融债、公司债、企业债、次级债、短期融资券、政府机构债、央行票据、银行同业存款、回购、可转债、资产证券化产品、中期票据、中小企业私募债券等固定收益类金融工具。本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产，但可以参与一级市场新股申购或增发新股，并可持有因可转债转股所形成的股票、因所持股票所派发的权证及因投资可分离债券而产生的权证等非固定收益类品种。

基金的投资组合比例为：投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产的 80%，投资于非固定收益类资产的比例不高于基金资产的 20%，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%。如出现法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金业绩比较基准：中债综合（全价）指数。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会发布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——定期报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号〈会计报表附注的编制及披露〉》，中国证券投资基金业协会发布的《公开募集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》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）

交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收；

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

6.4.6.2 增值税

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定，资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人；自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3%的规定征收率计算缴纳增值税，公募证券投资基金（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、债券取得的收入免征增值税；自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，金融同业往来利息收入免征增值税，金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入；取得存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税；本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为适用简易计税方法，按照 3%的征收率计算缴纳增值税；

根据财政部、税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》的规定，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

6.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

6.4.6.4 企业所得税

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

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

6.4.6.5 个人所得税

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	3,166,082.50
等于：本金	3,163,957.92
加：应计利息	2,124.58
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-

减：坏账准备	-
合计	3,166,082.50

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	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	716,374,766.13	6,312,940.66	741,865,204.86	19,177,498.07
	银行间市场	1,000,205,926.40	8,959,188.74	1,017,163,488.74	7,998,373.60
	合计	1,716,580,692.53	15,272,129.40	1,759,028,693.60	27,175,871.67
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,716,580,692.53	15,272,129.40	1,759,028,693.60	27,175,871.67

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

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

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	45,002,243.84	-
合计	45,002,243.84	-

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 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末无其他债权投资。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金本报告期末无其他权益投资工具。

6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	388.87
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	20,215.42
其中：交易所市场	-
银行间市场	20,215.42
应付利息	-
预提账户维护费	9,300.00
预提审计费	29,752.78
预提信息披露费	59,507.37
合计	119,164.44

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

长信利众债券（LOF）A

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	304,010,451.27	235,190,991.06
本期申购	109,984,490.77	85,086,860.58
本期赎回（以“-”号填列）	-129,187,442.97	-99,941,568.85
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	284,807,499.07	220,336,282.79

长信利众债券（LOF）C

项目	本期

	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,074,704,085.54	802,623,239.36
本期申购	866,852,489.31	647,388,048.70
本期赎回（以“-”号填列）	-950,021,769.21	-709,501,247.45
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	991,534,805.64	740,510,040.61

长信利众债券（LOF）E

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	599,647,145.85	463,915,470.06
本期申购	255,304,615.59	197,516,893.65
本期赎回（以“-”号填列）	-353,138,907.60	-273,206,394.16
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	501,812,853.84	388,225,969.55

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

本基金本报告期无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

长信利众债券（LOF）A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	51,190,539.89	18,105,607.64	69,296,147.53
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	51,190,539.89	18,105,607.64	69,296,147.53
本期利润	5,343,620.34	3,106,552.21	8,450,172.55
本期基金份额交易产生的变动数	-3,484,334.70	-1,210,350.33	-4,694,685.03
其中：基金申购款	19,855,456.85	6,862,774.09	26,718,230.94
基金赎回款	-23,339,791.55	-8,073,124.42	-31,412,915.97
本期已分配利润	-	-	-
本期末	53,049,825.53	20,001,809.52	73,051,635.05

长信利众债券（LOF）C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	164,202,991.30	117,435,484.56	281,638,475.86
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	164,202,991.30	117,435,484.56	281,638,475.86
本期利润	17,805,600.42	9,052,048.64	26,857,649.06
本期基金份额交易产生的变动数	-14,431,225.05	-7,495,663.45	-21,926,888.50
其中：基金申购款	140,810,402.78	99,100,132.53	239,910,535.31
基金赎回款	-155,241,627.83	-106,595,795.98	-261,837,423.81
本期已分配利润	-	-	-
本期末	167,577,366.67	118,991,869.75	286,569,236.42

长信利众债券（LOF）E

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	100,888,598.78	35,700,213.92	136,588,812.70
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	100,888,598.78	35,700,213.92	136,588,812.70
本期利润	9,680,149.30	5,893,210.61	15,573,359.91
本期基金份额交易产生的变动数	-17,169,477.04	-6,362,509.82	-23,531,986.86
其中：基金申购款	46,275,971.57	15,932,640.87	62,208,612.44
基金赎回款	-63,445,448.61	-22,295,150.69	-85,740,599.30
本期已分配利润	-	-	-
本期末	93,399,271.04	35,230,914.71	128,630,185.75

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	35,337.36
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	2,400.10
其他	14,681.80
合计	52,419.26

注：其他为申购款利息收入和保证金利息收入。

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

本基金本报告期无股票投资收益。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	21,467,746.98
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	20,309,334.92
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	41,777,081.90

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,733,146,010.63
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,698,370,897.19
减：应计利息总额	14,380,837.63
减：交易费用	84,940.89
买卖债券差价收入	20,309,334.92

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无债券投资赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无债券投资申购差价收入。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.19 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	18,051,811.46
股票投资	-
债券投资	18,051,811.46
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2.衍生工具	-
权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	18,051,811.46

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	128,440.67
合计	128,440.67

注：本基金的赎回费用在投资者赎回本基金份额时收取。其中，对持续持有期少于 7 日的投资者收取的赎回费全额计入基金财产；对其他投资者收取的赎回费扣除用于市场推广、注册登记费和其他手续费后的余额归基金财产，赎回费归入基金财产的比例不得低于赎回费总额的 25%。

6.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	18,600.00
其他费用	19,421.77
合计	127,281.92

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

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

截至本财务报告批准报出日，本基金未发生需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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
上海浦东发展银行股份有限公司(以下简称“浦发银行”)	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

注：以下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均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日

	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）
长江证券	1,577,166,934.76	67.21	723,619,184.95	64.05

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6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	461,080,000.00	100.00	357,500,000.00	100.00

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	6,942,005.20	8,273,812.39
其中：应支付销售机构的客户维护费	2,323,789.81	3,412,444.26
应支付基金管理人的净管理费	4,618,215.39	4,861,368.13

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.70%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×基金管理费年费率/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

基金管理费每日计提，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,487,572.55	2,036,575.51

注：根据《长信基金管理有限责任公司关于长信利众债券型证券投资基金（LOF）增份额及费率调整并修改基金合同等事宜的公告》，自 2025 年 3 月 25 日起，本基金的年托管费率由 0.20%调整为 0.15%。

计算方法如下：

H＝E×年托管费率÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	长信利众债券（LOF）A	长信利众债券（LOF）C	长信利众债券（LOF）E	合计
浦发银行	-	3,406.33	-	3,406.33
长信基金	-	50,122.69	-	50,122.69
长江证券	-	3,992.84	-	3,992.84
合计	-	57,521.86	-	57,521.86
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	长信利众债券（LOF）A	长信利众债券（LOF）C	长信利众债券（LOF）E	合计
浦发银行	-	5,545.48	-	5,545.48
长信基金	-	5,921.50	-	5,921.50
长江证券	-	204.62	-	204.62
合计	-	11,671.60	-	11,671.60

注：1、本基金于 2025 年 3 月 25 日新增份额，原有基金份额为 A 类份额，C 类份额，增设 E 类份额。

2、本基金利众（LOF）A 类、E 类基金份额不收取销售服务费，利众（LOF）C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.35%。

利众（LOF）C 类基金份额的基金销售服务费按前一日利众（LOF）C 类基金资产净值 0.35%的

年费率计提。基金销售服务费的计算方法如下：

H＝E×某类基金份额年销售服务费率÷当年天数

H 为该类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E 为该类基金份额前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间无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均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

6.4.10.4.2 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均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 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

基金管理人在本报告期及上年度可比期间均未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

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
浦发银行	3,166,082.50	35,337.36	881,183.05	38,129.48

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 2026 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（2025 年 6 月 30 日：同）。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期及上年度可比期间均未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期未进行利润分配。

6.4.12 期末（2026 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

本基金本报告期末未因认购新发/增发证券而持有流通受限证券。

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 2026 年 6 月 30 日止，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

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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上海浦东发展银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，本基金投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	219,218,854.46	130,679,772.60
合计	219,218,854.46	130,679,772.60

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

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

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
AAA	468,160,466.87	587,435,910.03
AAA 以下	203,334,090.87	320,508,178.29
未评级	868,315,281.40	823,272,849.34
合计	1,539,809,839.14	1,731,216,937.66

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

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

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。

本基金主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具，基金管理人对流动性指标进行持续的监测和分析，定期开展压力测试，评估在不同的压力情境下资产变现情况的变化。

基金管理人持续监测本基金开放期内的赎回情况，当市场环境或投资者结构发生变化时，及时调整投资组合资产结构及比例，保持基金资产可变现规模和期限与负债赎回规模和期限的匹配。

同时，针对兑付赎回资金的流动性风险，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。

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2026年6月30日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
货币资金	3,166,082.50	-	-	-	-	3,166,082.50
结算备付金	2,080,329.34	-	-	-	-	2,080,329.34
存出保证金	139,508.25	-	-	-	-	139,508.25
交易性金融资产	346,569,392.64	698,742,385.32	388,404,067.94	325,312,847.70	-	1,759,028,693.60
买入返售金融资产	45,002,243.84	-	-	-	-	45,002,243.84
应收申购款	-	-	-	-	32,393,368.84	32,393,368.84
资产总计	396,957,556.57	698,742,385.32	388,404,067.94	325,312,847.70	32,393,368.84	1,841,810,226.37
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	1,321,526.72	1,321,526.72
应付管理人报	-	-	-	-	1,036,840.64	1,036,840.64

酬						
应付托管费	-	-	-	-	222,180.15	222,180.15
应付销售服务费	-	-	-	-	297,357.32	297,357.32
应交税费	-	-	-	-	1,489,806.93	1,489,806.93
其他负债	-	-	-	-	119,164.44	119,164.44
负债总计	-	-	-	-	4,486,876.20	4,486,876.20
利率敏感缺口	396,957,556.57	698,742,385.32	388,404,067.94	325,312,847.70	27,906,492.64	1,837,323,350.17
上年度末2025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						
货币资金	5,916,652.01	-	-	-	-	5,916,652.01
结算备付金	809,436.09	-	-	-	-	809,436.09
存出保证金	82,179.45	-	-	-	-	82,179.45
交易性金融资产	477,527,943.46	364,948,193.66	900,505,414.23	118,915,158.91	-	1,861,896,710.26
买入返售金融资产	117,007,568.62	-	-	-	-	117,007,568.62
应收	-	-	-	-	489,459.19	489,459.19

申购款						
应收清算款	-	-	-	-	9,857,991.19	9,857,991.19
资产总计	601,343,779.63	364,948,193.66	900,505,414.23	118,915,158.91	10,347,450.38	1,996,059,996.81
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	3,174,114.14	3,174,114.14
应付管理人报酬	-	-	-	-	1,320,292.67	1,320,292.67
应付托管费	-	-	-	-	282,919.86	282,919.86
应付销售服务费	-	-	-	-	352,742.55	352,742.55
应交税费	-	-	-	-	1,454,962.42	1,454,962.42
其他负债	-	-	-	-	221,828.60	221,828.60
负债总计	-	-	-	-	6,806,860.24	6,806,860.24
利率敏感度缺口	601,343,779.63	364,948,193.66	900,505,414.23	118,915,158.91	3,540,590.14	1,989,253,136.57

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（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	市场利率上升 27 个基点	-16,658,505.64	-9,542,871.61

	市场利率下降 27 个基点	16,658,505.64	9,542,871.61

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，所面临的最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(ValueatRisk)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。

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 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产－股票投资	-	-	-	-
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	1,759,028,693.60	95.74	1,861,896,710.26	93.60
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	1,759,028,693.60	95.74	1,861,896,710.26	93.60

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2026 年 6 月 30 日及 2025 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性权益类投资，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	131,644,973.07	330,704,992.46
第二层次	1,627,383,720.53	1,531,191,717.80
第三层次	-	-
合计	1,759,028,693.60	1,861,896,710.26

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会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将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,759,028,693.60	95.51
	其中：债券	1,759,028,693.60	95.51
	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	45,002,243.84	2.44
	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	5,246,411.84	0.28
8	其他各项资产	32,532,877.09	1.77
9	合计	1,841,810,226.37	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。

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

本基金本报告期内未买入股票。

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

本基金本报告期内未卖出股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未投资股票。

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	212,963,743.59	11.59
2	央行票据	-	-
3	金融债券	296,842,793.15	16.16
	其中：政策性金融债	133,691,301.10	7.28
4	企业债券	539,285,197.82	29.35
5	企业短期融资券	168,694,238.02	9.18
6	中期票据	409,597,747.95	22.29
7	可转债（可交换债）	131,644,973.07	7.17
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,759,028,693.60	95.74

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	2600001	26 超长特别国债 01	1,000,000	100,242,732.24	5.46
2	240540	24 发展 01	800,000	81,251,506.85	4.42
3	102483257	24 京城建 MTN003	500,000	52,031,128.77	2.83
4	102481804	24 粤珠江 MTN004	500,000	50,808,630.14	2.77
5	240613	24 穗投 01	500,000	50,666,920.55	2.76

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

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

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国债期货交易情况说明

7.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.10.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

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。

7.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

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约定备选股票库的情形。

7.11.3 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	139,508.25
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	32,393,368.84
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	32,532,877.09

7.11.4 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	113667	春 23 转债	29,190,277.53	1.59
2	118059	颀中转债	18,916,168.65	1.03
3	118056	路维转债	18,452,959.48	1.00
4	123255	鼎龙转债	17,509,508.03	0.95
5	123176	精测转 2	11,529,981.76	0.63
6	123158	宙邦转债	9,193,114.05	0.50
7	118061	茂莱转债	6,305,950.83	0.34
8	118030	睿创转债	6,114,259.73	0.33

7.11.5 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。

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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（%）
长信利众债券（LOF）A	1,649	172,715.28	215,353,020.09	75.61	69,454,478.98	24.39
长信利众债券（LOF）C	15,445	64,197.79	125,314,781.16	12.64	866,220,024.48	87.36
长信利众债券（LOF）E	216	2,323,207.66	432,558,844.36	86.20	69,254,009.48	13.80
合计	17,310	102,724.16	773,226,645.61	43.48	1,004,928,512.94	56.52

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	长信利众债券（LOF）A	0.00	0.00
	长信利众债券（LOF）C	22,167.98	0.00
	长信利众债券（LOF）E	1,023.59	0.00
	合计	23,191.57	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	长信利众债券（LOF）A	0
	长信利众债券（LOF）C	0~10
	长信利众债券（LOF）E	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本	长信利众债券（LOF）A	0

开放式基金	长信利众债券（LOF）C	0
	长信利众债券（LOF）E	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长信利众债券（LOF）A	长信利众债券（LOF）C	长信利众债券（LOF）E
基金合同生效日（2016 年 2 月 5 日）基金份额总额	-	301,618,736.19	-
本报告期期初基金份额总额	304,010,451.27	1,074,704,085.54	599,647,145.85
本报告期基金总申购份额	109,984,490.77	866,852,489.31	255,304,615.59
减：本报告期基金总赎回份额	129,187,442.97	950,021,769.21	353,138,907.60
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	284,807,499.07	991,534,805.64	501,812,853.84

§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 2026 年 3 月 19 日起，刘元瑞先生不再担任公司董事长，由肖剑先生担任公司董事长。

自 2026 年 4 月 3 日起，经工商行政管理部门核准，公司法定代表人变更为肖剑先生。

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

报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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

本报告期本基金未更换会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

管理人受调查或处罚等情况	内容
受到调查或处罚等措施的主体	长信基金管理有限责任公司
受到调查或处罚等措施的时间	2026 年 4 月 30 日
采取调查或处罚等措施的机构	上海证券交易所
受到调查或处罚等措施类型	其他（自律监管措施）
受到的具体措施类型	警示
受到调查或处罚等措施的原因	其他问题 （新股网下询价）
受到处罚的依据	《上海证券交易所首次公开发行证券发行与承销业务实施细则（2025 年修订）》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司高度重视，已落实优化模型、完善机制等整改措施，完成整改工作。
其他	无

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期，基金管理人相关从业人员没有受监管部门调查或处罚的情形。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

报告期内，托管人无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

报告期内，托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-

国泰海通	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-

注：1、本期租用证券公司交易单元的变更情况

本报告期内本基金退租国金证券交易单元 1 个。

2、专用交易单元的选择标准和程序

根据中国证监会《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》（中国证券监督管理委员会公告〔2024〕3 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）财务状况良好；

2）经营行为规范；

3）合规风控能力较强；

4）交易能力较强；

5）研究能力较强。

（2）选择程序：

依照证券公司专用交易单元的选择标准，拟定备选证券公司，并根据公司要求提交准入评估报告，经证券公司准入审核流程审批通过后，签订相关协议。公司定期对各证券公司提供的服务质量进行综合评价。依照评价结果选择基金证券交易专用交易单元。

3、《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》自 2024 年 7 月 1 日起施行以来，本公司严格遵循法规及公司内部制度要求，未发现存在不符合法规及制度要求的情况。

10.7.2 基金租用或者通过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	1,577,166,934.76	67.21	461,080,000.00	100.00	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-

光大证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通	769,503,484.39	32.79	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金持有的停牌股票调整估值方法的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2026-1-13
2	长信利众债券型证券投资基金(LOF)2025 年第 4 季度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2026-1-22
3	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2025 年第四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	2026-1-22
4	长信基金管理有限责任公司关于董事长变更的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2026-3-21
5	长信基金管理有限责任公司关于董事变更情况的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2026-3-21
6	长信利众债券型证券投资基金(LOF)2025 年年度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2026-3-30
7	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2025 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	2026-3-30
8	长信基金管理有限责任公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）	中国证监会电子披露网站、公司网站	2026-3-31
9	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	2026-4-3
10	长信利众债券型证券投资基金(LOF)2026 年第 1 季度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2026-4-22
11	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2026 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	2026-4-22
12	2025 年度公募基金管理人以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	公司网站	2026-4-30
13	长信利众债券型证券投资基金(LOF)更新的招募说明书（2026 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	2026-5-29
14	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分基金调整业绩比较基准并修订基金合	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子	2026-6-27

	同等法律文件的公告	披露网站、公司网站	
15	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分基金的基金合同提示性公告	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	2026-6-27

§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

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

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、《长信利众债券型证券投资基金（LOF）基金合同》；

3、《长信利众债券型证券投资基金（LOF）招募说明书》；

4、《长信利众债券型证券投资基金（LOF）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

2026 年 8 月 31 日