

# 长信可转债债券型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：长信基金管理有限责任公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 1 月 22 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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金基金合同的规定，于 2024 年 1 月 18 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 2023 年 10 月 1 日起至 2023 年 12 月 31 日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	长信可转债债券	
基金主代码	519977	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012 年 3 月 30 日	
报告期末基金份额总额	583,573,092.96 份	
投资目标	本基金重点投资于可转换债券（含可分离交易可转债），主要运用可转债品种兼具债券和股票的特性，通过积极主动的可转债投资管理，力争在锁定投资组合下方风险的基础上实现基金资产的长期稳定增值。	
投资策略	本基金主要投资于可转债品种，一方面利用可转债的债券特性，强调投资组合的安全性和稳定性，另一方面利用可转债的股票特性，分享股市上涨产生的较高收益。	
业绩比较基准	中信标普可转债指数收益率×70%+中证综合债指数收益率×20%+沪深 300 指数收益率*10%	
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。本基金主要投资于可转换债券，在债券型基金中属于风险水平相对较高的投资产品。	
基金管理人	长信基金管理有限责任公司	
基金托管人	平安银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	长信可转债债券 A	长信可转债债券 C
下属分级基金的场内简称	CX 转债 A	CX 转债 C
下属分级基金的交易代码	519977	519976
报告期末下属分级基金的份额总额	268,251,793.56 份	315,321,299.40 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（2023 年 10 月 1 日-2023 年 12 月 31 日）	
	长信可转债债券 A	长信可转债债券 C
1. 本期已实现收益	-24,679,222.81	-27,808,257.93
2. 本期利润	-25,879,353.45	-30,478,001.63
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0901	-0.0827
4. 期末基金资产净值	408,208,999.52	461,098,084.04
5. 期末基金份额净值	1.5217	1.4623

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

长信可转债债券 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	-5.07%	0.54%	-2.68%	0.36%	-2.39%	0.18%
过去六个月	-8.91%	0.52%	-3.32%	0.33%	-5.59%	0.19%
过去一年	-7.33%	0.56%	-0.38%	0.34%	-6.95%	0.22%
过去三年	-11.08%	0.78%	4.32%	0.46%	-15.40%	0.32%
过去五年	29.79%	0.82%	38.07%	0.53%	-8.28%	0.29%
自基金合同生效起至今	194.49%	1.09%	60.70%	0.88%	133.79%	0.21%

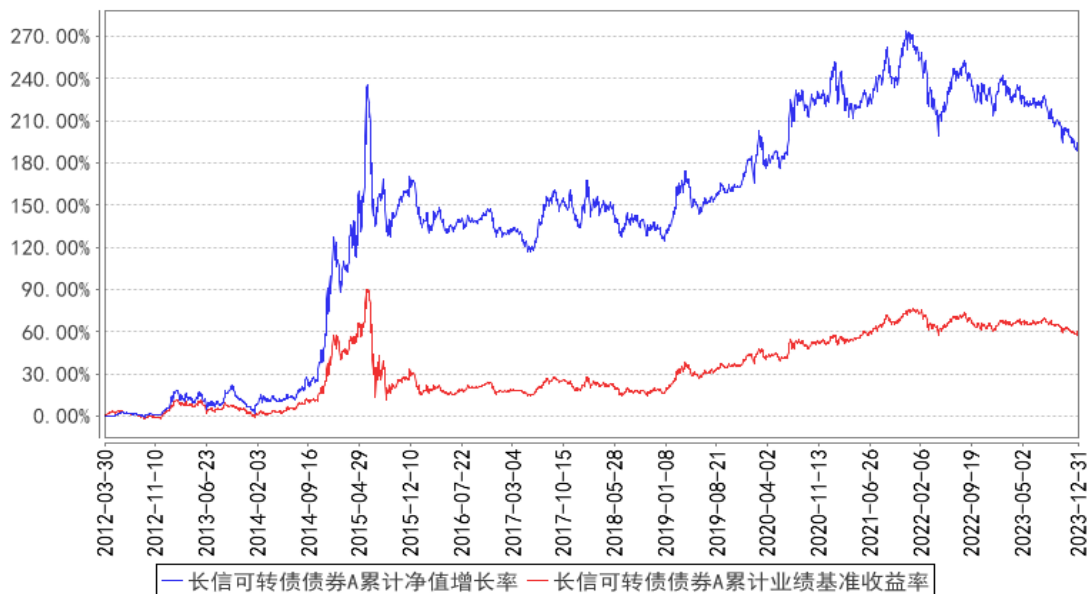
长信可转债债券 C

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
----	--------	-----------	------------	---------------	-----	-----

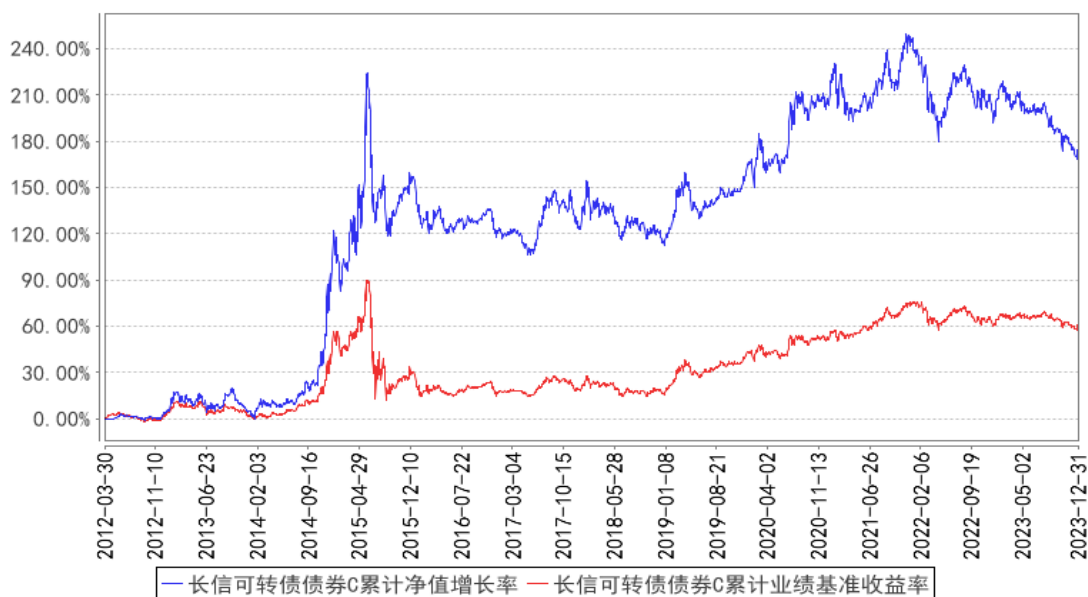
		准差②	收益率③	收益率标准差 ④		
过去三个月	-5.08%	0.54%	-2.68%	0.36%	-2.40%	0.18%
过去六个月	-8.92%	0.52%	-3.32%	0.33%	-5.60%	0.19%
过去一年	-7.40%	0.56%	-0.38%	0.34%	-7.02%	0.22%
过去三年	-11.77%	0.78%	4.32%	0.46%	-16.09%	0.32%
过去五年	27.63%	0.81%	38.07%	0.53%	-10.44%	0.28%
自基金合同 生效起至今	174.21%	1.09%	60.70%	0.88%	113.51%	0.21%

### 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

长信可转债债券A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



长信可转债债券C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、图示日期为 2012 年 3 月 30 日至 2023 年 12 月 31 日。

2、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		
李家春	长信利丰债券型证券投资基金、长信可转债债券型证券投资基金、长信利广灵活配置混合型证券投资基金、长信利富债券型证券投资基金、长信稳健精选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、长信稳健增长一年持有期	2018 年 12 月 8 日	-	24 年	香港大学工商管理硕士，具有基金从业资格，中国国籍。曾任职于长江证券有限责任公司、汉唐证券有限责任公司、泰信基金管理有限公司、交银施罗德基金管理有限公司、富国基金管理有限公司和上海东方证券资产管理有限公司。2018 年 7 月加入长信基金管理有限责任公司，曾任总经理助理、长信中证可转债及可交换债券 50 指数证券投资基金、长信利尚一年定期开放混合型证券投资基金和长信利盈灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，现任固收投资管理中心总经理、长信利丰债券型证券投资基金、长信可转债债券型证券投资基金、长信利广灵活配置混合型证券投资基金、长信利富债券型证券投资基金、长信稳健精选混合型证券投资

	混合型证券投资基金和长信稳健成长混合型证券投资基金的基金经理、固收投资管理中心总经理				基金、长信稳健均衡 6 个月持有期混合型证券投资基金、长信稳健增长一年持有期混合型证券投资基金和长信稳健成长混合型证券投资基金的基金经理。
吴晖	长信价值优选混合型证券投资基金、长信可转债债券型证券投资基金、长信利丰债券型证券投资基金、长信利广灵活配置混合型证券投资基金、长信利盈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、长信稳健均衡 6 个月持有期混合型证券投资基金、长信稳健增长一年持有期混合型证券投资基金和长信稳健成长混合型证券投资基金的基金经理	2019 年 6 月 26 日	-	8 年	清华大学管理科学与工程硕士，具有基金从业资格，中国国籍。曾任职于上海浦东发展银行股份有限公司和东方证券股份有限公司。2017 年 5 月加入长信基金管理有限责任公司，曾任公司基金经理助理、长信先锐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和长信先锐混合型证券投资基金的基金经理，现任长信价值优选混合型证券投资基金、长信可转债债券型证券投资基金、长信利丰债券型证券投资基金、长信利广灵活配置混合型证券投资基金、长信利盈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、长信稳健均衡 6 个月持有期混合型证券投资基金、长信稳健增长一年持有期混合型证券投资基金和长信稳健成长混合型证券投资基金的基金经理。
肖文劲	长信可转债债券型证券投资基金的基金经理	2023 年 3 月 3 日	-	7 年	澳大利亚墨尔本大学金融学硕士研究生毕业，具有基金从业资格，中国国籍。曾任建信期货有限责任公司研究员、天风证券股份有限公司研究所研究员，2021 年 7 月加入长信基金管理有限责任公司，曾任固收研究部研究员，现任长信可转债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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2023 年四季度，债券市场呈现横盘震荡、中枢下移的特征，整体呈“M”型走势。季度初，由于特殊再融资债供给冲击引发的债市供需格局失衡，利率不断上行。随着 1 万亿国债增发落地与跨月后资金面改善，利率震荡下行。下半季度，稳增长预期、增发国债发行供给和金融防空转监管基调，利率再次上行调整。临近年底，中央经济工作会议落地叠加银行存款利率下调，利率再次震荡下行。权益市场方面，在消化了国内刺激政策后，市场整体处于磨底过程中，但阶段性不乏投资机会。例如华为智能驾驶、机器人、AI 应用和数据要素、创新药等几大科技板块。

面对市场的分化和波动，我们通过资产结构调整，努力实现组合回报。具体操作上，纯债维持中短久期和中高等级的持仓结构。权益部分，在市场磨底过程中，寻找具有性价比的板块，捕捉超预期改善带来的投资机会。转债部分，适当降低转债持仓整体价格和转股溢价率水平，提升整体安全边际，在相关板块内精选估值与业绩匹配度较高的相关标的。

2024 年中国经济大概率继续向上修复，推动 GDP 增速上升，动能包括：（1）经济结构转型持续推进，新经济发展动能充足；（2）房地产对 GDP 的影响幅度或有所收窄；（3）就业稳定推动居民消费信心回暖；（4）海外补库存将拉动中国出口增速回升。

预计经济数据和企业盈利情况将会环比持续改善，对应到风格和行业配置层面，此前偏向防御价值的风格将会更加均衡，权重和成长板块有望迎来反弹。具体来看，智能化大趋势下的泛科技链，出口链和政府开支链有望成为行业布局的重要线索。持续关注 AI 科技创新和出口改善叠加电子、汽车及零部件；政府开支增加和三大工程启动带来的计算机、工业金属、建材、家电等领域的投资机会。转债方面，一是配置低价偏平衡型标的作为防守，二是积极挖掘溢价率调整到位的偏股型标的，主要是低位的周期，有产业催化的电子、汽车、机器人等行业。债券仍然以票息策略为主，同时关注利率调整后的性价比和金融机构资本债的投资机会。转债市场在磨底过程中，高性价比转债的可选性开始增强，关注业绩较好、估值合理的相关标的。纯债方面，维持中短久期策略，获取稳健的票息收益。

下一阶段我们将积极关注经济走势和政策动向，动态调整组合权益部分的行业分布和个股集中度、债券部分的久期和仓位，加强流动性管理，严格防范信用风险，进一步优化投资组合，力争为投资者获取较好的收益。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 12 月 31 日，长信可转债债券 A 基金份额净值为 1.5217 元，份额累计净值为 2.4817 元，本报告期内长信可转债债券 A 净值增长率为-5.07%；长信可转债债券 C 基金份额净值为 1.4623 元，份额累计净值为 2.3693 元，本报告期内长信可转债债券 C 净值增长率为-5.08%，同期业绩比较基准收益率为-2.68%。

#### 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	157,197,259.09	15.01
	其中：股票	157,197,259.09	15.01
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	833,491,191.22	79.58
	其中：债券	833,491,191.22	79.58
	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	-	-



	产		
7	银行存款和结算备付金合计	50,954,366.29	4.86
8	其他资产	5,735,038.09	0.55
9	合计	1,047,377,854.69	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	-	-
B	采矿业	16,869,336.00	1.94
C	制造业	90,293,331.09	10.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,599,446.00	1.91
E	建筑业	3,658,245.00	0.42
F	批发和零售业	3,101,875.00	0.36
G	交通运输、仓储和邮政业	10,447,171.00	1.20
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,535,280.00	0.29
J	金融业	6,312,846.00	0.73
K	房地产业	2,594,226.00	0.30
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	4,785,503.00	0.55
S	综合	-	-
	合计	157,197,259.09	18.08

### 5.2.2 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	300054	鼎龙股份	359,600	8,702,320.00	1.00
2	600674	川投能源	542,000	8,195,040.00	0.94

3	600519	贵州茅台	4,700	8,112,200.00	0.93
4	688526	科前生物	376,560	7,674,292.80	0.88
5	603700	宁水集团	496,100	7,079,347.00	0.81
6	688566	吉贝尔	137,111	4,303,914.29	0.50
7	605183	确成股份	277,000	4,052,510.00	0.47
8	600461	洪城环境	436,500	3,989,610.00	0.46
9	002540	亚太科技	593,200	3,921,052.00	0.45
10	603043	广州酒家	198,800	3,882,564.00	0.45

#### 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	52,869,432.99	6.08
2	央行票据	-	-
3	金融债券	17,706,588.00	2.04
	其中：政策性金融债	17,706,588.00	2.04
4	企业债券	20,253,471.78	2.33
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	742,661,698.45	85.43
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	833,491,191.22	95.88

#### 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	132026	G 三峡 EB2	430,000	49,151,968.77	5.65
2	113052	兴业转债	344,980	35,157,242.60	4.04
3	110079	杭银转债	300,000	32,477,235.62	3.74
4	118024	冠宇转债	243,720	29,469,554.04	3.39
5	113044	大秦转债	250,000	29,082,753.43	3.35

#### 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

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

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

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国债期货交易情况说明

### 5.9.1 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。

### 5.9.2 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投资国债期货。

### 5.9.3 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。

## 5.10 投资组合报告附注

### 5.10.1 本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中，发行主体兴业银行股份有限公司于 2023 年 5 月 8 日收到中国证券监督管理委员会福建监管局《关于对兴业银行股份有限公司采取责令改正措施的决定》（〔2023〕18 号），经查，兴业银行股份有限公司基金销售业务在销售产品准入集中统一管理、基金销售业务数据统计质量等方面存在不足。上述行为违反了《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》第二十七条第一款、第四十二条第一款的相关规定，根据《基金销售办法》第五十三条规定，中国证券监督管理委员会福建监管局决定对兴业银行股份有限公司采取责令改正的措施。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体杭州银行股份有限公司于 2023 年 6 月 30 日收到浙江证监局关于对杭州银行股份有限公司采取责令改正措施的决定，经查，杭州银行股份有限公司存在以下行为：一、基金销售业务部门负责人、部分分支机构基金销售业务负责人、部分基金销售合规风控人员未取得基金从业资格，违反了《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》（以下简称《销售办法》）第八条第四项、第二十六条第一款和《关于实施〈公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法〉的规定》第十七条第一款的规定；二、未在每一年度结束之日起 3 个月内完成上年度监察稽核报告，未将投资人长期投资收益等纳入分支机构和基金销售人员考核评价指标体系，违反了《销售办法》第二十六条第三款、第三十条第一款的规定；三、未建立基金销售业务部门负责人离任审计或离任审查制度，未及时向我局报备基金销售业务部门负责人离任审计报告，违反了《销售办法》第三十条第三款和《基金行业人员离任审计及审查报告内容准则》第十条的规定；四、采用问卷方式了解投资者信息，未涵盖其收入来源、投资相关的学习和工作经历，违反了《证券期货投资者适当性管理办法》第六条第二项、第三项的规定；五、未每半年对基金销售业务开展一次适当性自查并形成自查报告，违反了《证券期货投资者适当性

管理办法》第三十条的规定；六、未按要求报备反洗钱工作相关材料，违反了《证券期货业反洗钱工作实施办法》第二条、第十条、第十二条的规定。综上，浙江证监局决定对杭州银行采取责令改正的行政监管措施，并记入证券期货市场诚信档案。

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。

### 5.10.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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规定备选股票库的情形。

### 5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	518,688.72
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	5,216,349.37
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	5,735,038.09

### 5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	132026	G 三峡 EB2	49,151,968.77	5.65
2	113052	兴业转债	35,157,242.60	4.04
3	110079	杭银转债	32,477,235.62	3.74
4	118024	冠宇转债	29,469,554.04	3.39
5	113044	大秦转债	29,082,753.43	3.35
6	123107	温氏转债	28,305,666.44	3.26
7	113050	南银转债	26,504,212.33	3.05
8	127061	美锦转债	18,869,389.66	2.17
9	113637	华翔转债	16,882,833.77	1.94
10	118023	广大转债	16,826,483.70	1.94
11	123158	宙邦转债	14,831,211.40	1.71

12	113060	浙 22 转债	14,792,559.36	1.70
13	113059	福莱转债	14,601,489.25	1.68
14	113021	中信转债	14,568,473.46	1.68
15	127074	麦米转 2	13,558,957.84	1.56
16	113641	华友转债	13,333,520.63	1.53
17	113053	隆 22 转债	12,778,289.21	1.47
18	127051	博杰转债	12,770,607.70	1.47
19	111010	立昂转债	12,286,842.44	1.41
20	127044	蒙娜转债	11,939,916.55	1.37
21	113062	常银转债	11,194,914.03	1.29
22	113662	豪能转债	10,551,581.65	1.21
23	113065	齐鲁转债	9,733,879.75	1.12
24	127082	亚科转债	9,727,078.85	1.12
25	113623	凤 21 转债	9,616,612.05	1.11
26	113054	绿动转债	9,292,802.51	1.07
27	110082	宏发转债	9,136,907.29	1.05
28	127049	希望转 2	9,073,506.10	1.04
29	110062	烽火转债	8,869,467.03	1.02
30	113616	韦尔转债	8,662,377.13	1.00
31	118009	华锐转债	8,153,478.03	0.94
32	118027	宏图转债	8,001,990.76	0.92
33	123108	乐普转 2	7,518,766.86	0.86
34	118003	华兴转债	7,032,163.32	0.81
35	123133	佩蒂转债	6,991,523.38	0.80
36	113667	春 23 转债	6,949,847.89	0.80
37	113061	拓普转债	6,678,757.64	0.77
38	128137	洁美转债	6,531,978.97	0.75
39	113618	美诺转债	6,345,829.42	0.73
40	113545	金能转债	6,074,717.31	0.70
41	110073	国投转债	5,752,155.89	0.66
42	113647	禾丰转债	5,647,217.31	0.65
43	118015	芯海转债	5,584,551.49	0.64
44	127083	山路转债	5,214,202.74	0.60
45	127076	中宠转 2	5,211,117.54	0.60
46	118018	瑞科转债	4,678,209.13	0.54
47	113663	新化转债	4,504,322.78	0.52
48	113055	成银转债	4,303,175.73	0.50
49	123131	奥飞转债	4,253,775.47	0.49
50	128066	亚泰转债	4,202,581.64	0.48
51	132018	G 三峡 EB1	4,173,190.27	0.48
52	113657	再 22 转债	3,997,160.97	0.46
53	113639	华正转债	3,605,397.04	0.41

54	123192	科思转债	3,502,304.64	0.40
55	127063	贵轮转债	2,606,706.25	0.30
56	113064	东材转债	1,947,009.46	0.22
57	113650	博 22 转债	1,751,220.95	0.20
58	123199	山河转债	1,725,136.92	0.20
59	123150	九强转债	999,550.90	0.11

### 5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 5.10.6 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。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长信可转债债券 A	长信可转债债券 C
报告期期初基金份额总额	435,805,253.91	404,718,617.35
报告期期间基金总申购份额	1,197,959.70	174,563,099.65
减：报告期期间基金总赎回份额	168,751,420.05	263,960,417.60
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	268,251,793.56	315,321,299.40

## §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

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

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	1	2023 年 11 月 8	123,469,705.17	0.00	0.00	123,469,705.17	21.16

构		日至 2023 年 11 月 9 日；2023 年 12 月 4 日至 2023 年 12 月 31 日				
产品特有风险						
<p>1、基金净值大幅波动的风险 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 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 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

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、《长信可转债债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长信可转债债券型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《长信可转债债券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

2024 年 1 月 22 日