

长江可转债债券型证券投资基金

2024年第一季度报告

2024年03月31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:上海银行股份有限公司

报告送出日期:2024年04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。

基金托管人上海银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年04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2024年01月01日起至03月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长江可转债债券
基金主代码	006618
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年12月25日
报告期末基金份额总额	152,865,975.72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），力求在控制投资组合下方风险的基础上实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金的投资策略主要包括： （1）资产配置策略； （2）债券投资策略； （3）股票投资策略； （4）资产支持证券投资策略； （5）衍生品投资策略。
业绩比较基准	中证可转换债券指数收益率*60%+中证综合债券指数收益率*40%
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。
基金管理人	长江证券（上海）资产管理有限公司

基金托管人	上海银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	长江可转债债券A	长江可转债债券C
下属分级基金的交易代码	006618	006619
报告期末下属分级基金的份额总额	147,690,906.91份	5,175,068.81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（2024年01月01日 - 2024年03月31日）	
	长江可转债债券A	长江可转债债券C
1.本期已实现收益	-191,876.79	-13,467.32
2.本期利润	-3,143,363.21	-118,314.93
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0212	-0.0230
4.期末基金资产净值	204,520,851.79	7,019,401.19
5.期末基金份额净值	1.3848	1.3564

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）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

长江可转债债券A净值表现

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	-1.50%	0.64%	0.36%	0.30%	-1.86%	0.34%
过去六个月	-5.58%	0.57%	-1.06%	0.27%	-4.52%	0.30%
过去一年	-7.34%	0.54%	-0.46%	0.24%	-6.88%	0.30%
过去三年	9.59%	0.69%	9.67%	0.32%	-0.08%	0.37%
过去五年	30.93%	0.78%	20.88%	0.35%	10.05%	0.43%
自基金合同	38.48%	0.77%	33.90%	0.37%	4.58%	0.40%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

长江可转债债券C净值表现

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	-1.60%	0.64%	0.36%	0.30%	-1.96%	0.34%
过去六个月	-5.77%	0.57%	-1.06%	0.27%	-4.71%	0.30%
过去一年	-7.71%	0.54%	-0.46%	0.24%	-7.25%	0.30%
过去三年	8.29%	0.69%	9.67%	0.32%	-1.38%	0.37%
过去五年	28.45%	0.78%	20.88%	0.35%	7.57%	0.43%
自基金合同生效起至今	35.64%	0.77%	33.90%	0.37%	1.74%	0.40%

注：（1）本基金业绩比较基准为中证可转换债券指数收益率*60%+中证综合债券指数收益率*40%；（2）本基金基金合同生效日为2018年12月25日。

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

长江可转债债券A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12月25日-2024年03月31日)



长江可转债债券C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12月25日-2024年03月31日)



§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		
漆志伟	基金经理	2018-12-25	-	15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总经理，长江收益增强债券型证券投资基金、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、长江致惠30天滚动持有短债债券型发起式证券投资基金、长江丰瑞3个月持有期债券型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---

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中国证监会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》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》、《证券投资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 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，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、组合同日同向交易记录配对。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 报告期内基金的投资策略和运作分析

进入2024年以后，债券市场表现强势，整体而言曲线长端表现大幅好于短端、低资质信用债表现好于高资质信用债，债券市场收益率平坦化的程度有所提高。市场参与主体逐步形成了对于未来货币政策出现宽松迹象的一致预期，行情从长端向短端逐步展开。其中超长端利率债显示出了非常强劲的势头，带动10年期国债收益率进一步逼近历史低点，整体长端收益率曲线受到经济基本面以及供需关系的影响而大幅下行，长端资产成为1-2月表现最强势的品种。而在去年12月下旬银行同业存单收益率水平见顶之后，中短端的银行二永债等信用品种也开始出现了收益率的显著下探。而在权益市场方面，节前市场震荡剧烈，而在监管层出台了一系列行之有效的政策后，信心得到了明显修复，股票指数中枢起稳回升，高股息板块和顺周期品种表现较好。

一季度，国务院常务会议指出，要进一步优化房地产政策，持续抓好保交楼、保民生、保稳定工作，进一步推动城市房地产融资协调机制落地见效，系统谋划相关支持政策，有效激发潜在需求，加大高品质住房供给，促进房地产市场平稳健康发展。同日，国务院召开防范化解地方债务风险工作视频会议，强调进一步强化责任意识和系统观念，持续推进地方债务风险防范化解工作。利率债方面，“房地产市场供求关系发生重大变化”定调下，托举政策将持续发力。“有效激发潜在需求”也表明更宽松的政策组合拳有望加码，基本面复苏可期。但从高频数据上看，全面复苏尚需时日，利率债在供需关系和基本面两大强支撑下表现强势。而在信用债方面，我们认为财政化债仍有空间，重点省份融资平台“统借统还”的尝试也为化债打开新的思路。总体而言，在稳增长和防系统性风险的背景下，这些对于城投类债券来讲构成了实质性的支撑。

报告期内，本基金主要配置于红利类型品种和消费、TMT等中大盘白马品种，同时继续利用“平衡型”品种“进可攻、退可守”的特点进行底仓布局。后续，我们也会适时加强对股性品种的配置力度，利用好权益市场回暖的进攻性机会。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金A类基金份额净值为1.3848元，C类基金份额净值为1.3564元。本报告期内，A类基金份额净值增长率为-1.50%，同期业绩比较基准收益率为0.36%；C类基金份额净值增长率为-1.60%，同期业绩比较基准收益率为0.36%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	209,405,770.98	97.35
	其中：债券	209,405,770.98	97.35
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	5,635,749.38	2.62
8	其他资产	64,717.55	0.03
9	合计	215,106,237.91	100.00

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

本基金本报告期末未持有股票。

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持有港股通股票。

5.3 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

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	11,641,191.78	5.50
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	197,764,579.20	93.49
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	209,405,770.98	98.99

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	019709	23国债16	100,000	10,112,013.70	4.78
2	127020	中金转债	23,000	2,813,104.79	1.33
3	110079	杭银转债	25,000	2,791,447.26	1.32
4	113052	兴业转债	25,000	2,604,455.48	1.23
5	123107	温氏转债	20,000	2,467,797.26	1.17

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股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据基金合同约定，本基金不得参与股指期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本着审慎性原则、在风险可控的前提下，以套期保值策略为目的，适度参与国债期货的投资。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未进行国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体之一杭州银行股份有限公司在报告编制日前一年内被国家金融监督管理总局浙江监管局处以罚款。

本基金管理人对上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

5.11.2 本基金投资的前十名股票，没有超出基金合同规定备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	48,838.23
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	13,600.00
5	应收申购款	2,279.32
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	64,717.55

5.11.4 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	127020	中金转债	2,813,104.79	1.33
2	110079	杭银转债	2,791,447.26	1.32
3	113052	兴业转债	2,604,455.48	1.23
4	123107	温氏转债	2,467,797.26	1.17
5	127039	北港转债	2,451,496.45	1.16
6	127032	苏行转债	2,449,117.81	1.16
7	113044	大秦转债	2,396,121.64	1.13
8	113055	成银转债	2,363,489.86	1.12
9	113623	凤21转债	2,330,093.15	1.10
10	113050	南银转债	2,279,298.63	1.08
11	123119	康泰转2	2,206,847.40	1.04
12	110055	伊力转债	2,186,917.81	1.03
13	127086	恒邦转债	2,170,651.29	1.03
14	113037	紫银转债	2,146,483.84	1.01
15	110091	合力转债	2,138,483.42	1.01
16	110067	华安转债	2,097,519.31	0.99
17	113043	财通转债	2,071,674.11	0.98
18	127027	能化转债	2,053,947.95	0.97
19	128081	海亮转债	2,046,722.79	0.97
20	110085	通22转债	1,945,032.16	0.92
21	113060	浙22转债	1,867,426.85	0.88
22	110090	爱迪转债	1,837,473.29	0.87
23	128134	鸿路转债	1,799,314.93	0.85
24	110075	南航转债	1,791,968.63	0.85
25	127018	本钢转债	1,791,214.52	0.85
26	118019	金盘转债	1,775,422.47	0.84
27	127050	麒麟转债	1,771,126.58	0.84
28	113602	景20转债	1,732,549.32	0.82
29	113021	中信转债	1,731,982.19	0.82
30	123158	宙邦转债	1,725,073.97	0.82
31	113062	常银转债	1,723,553.84	0.81
32	110062	烽火转债	1,719,801.37	0.81
33	127045	牧原转债	1,717,946.71	0.81

34	110083	苏租转债	1,716,785.10	0.81
35	113051	节能转债	1,702,102.19	0.80
36	128141	旺能转债	1,695,828.08	0.80
37	123078	飞凯转债	1,694,714.38	0.80
38	110092	三房转债	1,687,736.71	0.80
39	128130	景兴转债	1,679,104.11	0.79
40	127063	贵轮转债	1,654,354.29	0.78
41	127083	山路转债	1,652,822.23	0.78
42	111017	蓝天转债	1,638,966.90	0.77
43	113045	环旭转债	1,632,596.71	0.77
44	113634	珀莱转债	1,622,918.22	0.77
45	113024	核建转债	1,604,435.75	0.76
46	127085	韵达转债	1,593,805.37	0.75
47	127056	中特转债	1,584,735.62	0.75
48	113065	齐鲁转债	1,584,717.53	0.75
49	113058	友发转债	1,582,481.37	0.75
50	113048	晶科转债	1,575,026.71	0.74
51	113655	欧22转债	1,573,528.77	0.74
52	113056	重银转债	1,569,595.89	0.74
53	113039	嘉泽转债	1,563,162.74	0.74
54	111002	特纸转债	1,540,238.22	0.73
55	128083	新北转债	1,527,031.64	0.72
56	123035	利德转债	1,526,257.70	0.72
57	113651	松霖转债	1,520,153.42	0.72
58	113053	隆22转债	1,516,211.92	0.72
59	113549	白电转债	1,494,616.41	0.71
60	110084	贵燃转债	1,494,139.12	0.71
61	118025	奕瑞转债	1,478,752.77	0.70
62	113619	世运转债	1,477,001.10	0.70
63	113631	皖天转债	1,476,592.44	0.70
64	113049	长汽转债	1,461,431.23	0.69
65	113066	平煤转债	1,441,540.27	0.68
66	113582	火炬转债	1,441,510.68	0.68

67	113047	旗滨转债	1,403,773.26	0.66
68	128109	楚江转债	1,403,035.07	0.66
69	110073	国投转债	1,399,451.42	0.66
70	123149	通裕转债	1,328,427.95	0.63
71	127030	盛虹转债	1,325,194.52	0.63
72	127035	濮耐转债	1,318,430.14	0.62
73	123216	科顺转债	1,317,433.18	0.62
74	113647	禾丰转债	1,265,003.84	0.60
75	127028	英特转债	1,257,427.40	0.59
76	113674	华设转债	1,245,170.14	0.59
77	128133	奇正转债	1,240,079.45	0.59
78	127070	大中转债	1,224,829.44	0.58
79	118003	华兴转债	1,197,195.89	0.57
80	113061	拓普转债	1,192,488.22	0.56
81	113673	岱美转债	1,183,789.86	0.56
82	113068	金铜转债	1,173,572.15	0.55
83	123091	长海转债	1,163,110.52	0.55
84	113632	鹤21转债	1,149,858.90	0.54
85	123130	设研转债	1,146,590.41	0.54
86	110086	精工转债	1,124,723.84	0.53
87	113064	东材转债	1,121,290.41	0.53
88	113616	韦尔转债	1,119,690.41	0.53
89	113669	景23转债	1,117,280.27	0.53
90	113666	爱玛转债	1,104,405.48	0.52
91	110093	神马转债	1,092,240.27	0.52
92	127040	国泰转债	1,084,824.38	0.51
93	128131	崇达转2	1,070,772.60	0.51
94	111010	立昂转债	1,067,512.33	0.50
95	128142	新乳转债	1,060,719.18	0.50
96	110089	兴发转债	1,060,093.15	0.50
97	113545	金能转债	1,056,067.40	0.50
98	118024	冠宇转债	1,055,442.47	0.50
99	118034	晶能转债	1,050,616.71	0.50

100	123108	乐普转2	1,044,765.75	0.49
101	110095	双良转债	1,031,534.52	0.49
102	127037	银轮转债	1,023,558.90	0.48
103	127064	杭氧转债	1,018,943.34	0.48
104	110077	洪城转债	1,015,868.71	0.48
105	128122	兴森转债	1,004,867.95	0.48
106	127067	恒逸转2	999,970.14	0.47
107	128136	立讯转债	999,486.74	0.47
108	127084	柳工转2	996,035.07	0.47
109	118022	锂科转债	981,284.93	0.46
110	113067	燃23转债	967,989.70	0.46
111	113563	柳药转债	954,127.12	0.45
112	128135	洽洽转债	905,167.12	0.43
113	127038	国微转债	885,583.56	0.42
114	113659	莱克转债	873,481.64	0.41
115	127026	超声转债	852,598.43	0.40
116	113588	润达转债	850,534.25	0.40
117	123090	三诺转债	843,549.66	0.40
118	110081	闻泰转债	824,099.29	0.39
119	113519	长久转债	812,739.32	0.38
120	118031	天23转债	809,612.05	0.38
121	127071	天箭转债	683,855.84	0.32
122	110068	龙净转债	668,807.81	0.32
123	118013	道通转债	638,655.62	0.30
124	113605	大参转债	637,795.89	0.30
125	127072	博实转债	633,346.58	0.30
126	127082	亚科转债	598,526.03	0.28
127	113030	东风转债	585,033.15	0.28
128	127073	天赐转债	563,491.10	0.27
129	128095	恩捷转债	560,466.58	0.26
130	123048	应急转债	558,502.05	0.26
131	113059	福莱转债	558,431.51	0.26
132	110070	凌钢转债	550,639.59	0.26

133	127016	鲁泰转债	546,018.49	0.26
134	113661	福22转债	541,327.40	0.26
135	127024	盈峰转债	532,432.88	0.25
136	110076	华海转债	530,265.75	0.25
137	113033	利群转债	529,300.00	0.25
138	113046	金田转债	525,614.38	0.25
139	113652	伟22转债	520,009.04	0.25
140	127089	晶澳转债	518,363.29	0.25
141	127052	西子转债	516,023.97	0.24
142	127025	冀东转债	511,533.15	0.24
143	111009	盛泰转债	509,594.52	0.24
144	127022	恒逸转债	499,796.16	0.24
145	110087	天业转债	497,486.16	0.24
146	110063	鹰19转债	401,271.23	0.19
147	110082	宏发转债	323,819.18	0.15
148	113670	金23转债	314,398.44	0.15
149	127031	洋丰转债	181,754.79	0.09

5.11.5 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。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

	长江可转债债券A	长江可转债债券C
报告期期初基金份额总额	148,253,038.13	5,243,612.86
报告期期间基金总申购份额	91,809.17	251,065.94
减：报告期期间基金总赎回份额	653,940.39	319,609.99
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	147,690,906.91	5,175,068.81

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§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，基金管理人未持有本基金份额。

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，基金管理人不存在运用固有资金投资本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20240101-20240331	76,821,731.44	-	-	76,821,731.44	50.25%
	2	20240101-20240331	41,948,683.21	-	-	41,948,683.21	27.44%
产品特有风险							
<p>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部分延期赎回、暂停赎回或延期办理赎回申请，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。</p>							

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予长江可转债债券型证券投资基金募集申请的注册文件
- 2、长江可转债债券型证券投资基金基金合同

- 3、长江可转债债券型证券投资基金招募说明书
- 4、长江可转债债券型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

9.2 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。

9.3 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.cjzcgf.com。

长江证券（上海）资产管理有限公司

2024年04月22日