

长信利丰债券型证券投资基金 2024 年第 3 季度报告

2024 年 9 月 30 日

基金管理人：长信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 10 月 25 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金基金合同的规定，于 2024 年 10 月 23 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 7 月 1 日起至 2024 年 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

| | | | |
|-----------------|---|----------|-----------------|
| 基金简称 | 长信利丰债券 | | |
| 基金主代码 | 519989 | | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | | |
| 基金合同生效日 | 2008 年 12 月 29 日 | | |
| 报告期末基金份额总额 | 227,271,871.02 份 | | |
| 投资目标 | 通过积极主动的资产管理和严格的风险控制，在保持基金资产流动性和严格控制基金资产风险的前提下，为投资者提供稳定增长的投资收益。 | | |
| 投资策略 | 本基金为债券型基金，基金资产主要投资于固定收益类品种，其中投资于以企业为主体发行的债券不低于基金债券资产的 20%，并通过投资国债、金融债和资产支持证券等，增加企业债投资组合的投资收益。 | | |
| 业绩比较基准 | 中证全债指数×90%+中证 800 指数×10% | | |
| 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低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金，属于证券投资基金产品中风险收益程度中等偏低的投资品种。 | | |
| 基金管理人 | 长信基金管理有限责任公司 | | |
| 基金托管人 | 中国农业银行股份有限公司 | | |
| 下属分级基金的基金简称 | 长信利丰债券 C | 长信利丰债券 E | 长信利丰债券 A |
| 下属分级基金的场内简称 | 长信 LFC | - | - |
| 下属分级基金的交易代码 | 519989 | 004651 | 005991 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 182,113,250.41 份 | 641.06 份 | 45,157,979.55 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 7 月 1 日-2024 年 9 月 30 日） | | |
|-----------------|-------------------------------------|----------|---------------|
| | 长信利丰债券 C | 长信利丰债券 E | 长信利丰债券 A |
| 1. 本期已实现收益 | -677,125.11 | -2.21 | -72,719.13 |
| 2. 本期利润 | -62,742.95 | -0.32 | 21,109.55 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0003 | -0.0005 | 0.0004 |
| 4. 期末基金资产净值 | 235,624,401.98 | 692.39 | 47,686,817.02 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.294 | 1.080 | 1.056 |

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

长信利丰债券 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 |
|------------|---------|-----------|------------|---------------|---------|--------|
| 过去三个月 | 0.00% | 0.12% | 2.73% | 0.15% | -2.73% | -0.03% |
| 过去六个月 | 1.41% | 0.17% | 4.18% | 0.12% | -2.77% | 0.05% |
| 过去一年 | 1.01% | 0.18% | 7.26% | 0.12% | -6.25% | 0.06% |
| 过去三年 | -3.70% | 0.29% | 13.02% | 0.11% | -16.72% | 0.18% |
| 过去五年 | 14.16% | 0.34% | 25.75% | 0.12% | -11.59% | 0.22% |
| 自基金合同生效起至今 | 147.32% | 0.43% | 104.20% | 0.71% | 43.12% | -0.28% |

长信利丰债券 E

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|----|--------|-----------|------------|---------------|-----|-----|
|----|--------|-----------|------------|---------------|-----|-----|

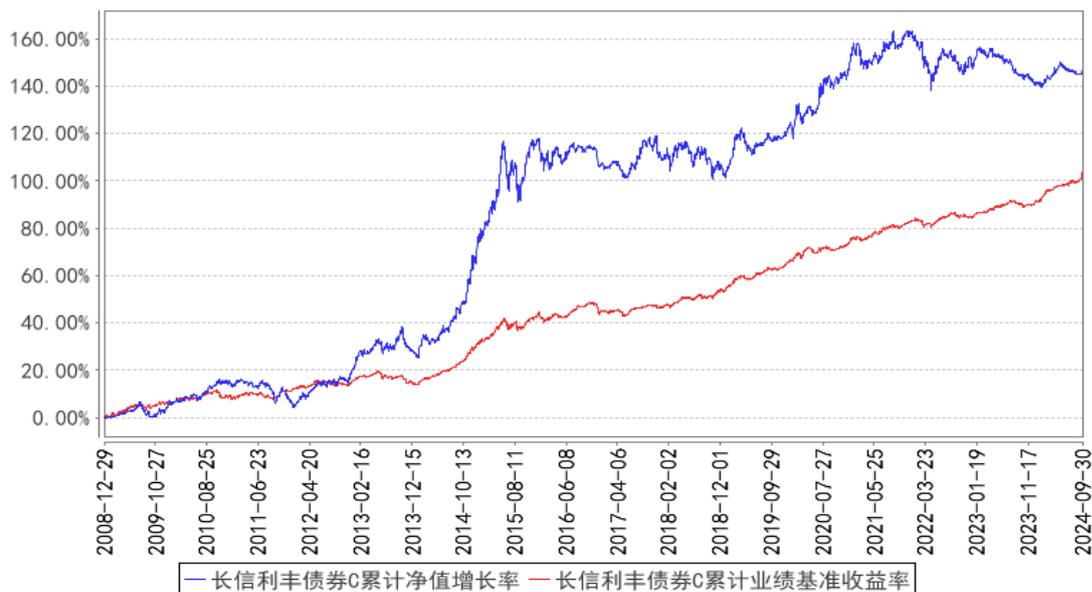
| | | | | | | |
|---------------|--------|-------|--------|-------|---------|--------|
| 过去三个月 | 0.00% | 0.13% | 2.73% | 0.15% | -2.73% | -0.02% |
| 过去六个月 | 1.69% | 0.18% | 4.18% | 0.12% | -2.49% | 0.06% |
| 过去一年 | 1.12% | 0.18% | 7.26% | 0.12% | -6.14% | 0.06% |
| 过去三年 | -3.09% | 0.29% | 13.02% | 0.11% | -16.11% | 0.18% |
| 过去五年 | 15.31% | 0.34% | 25.75% | 0.12% | -10.44% | 0.22% |
| 自份额增加 日起至今 | 23.26% | 0.37% | 42.74% | 0.12% | -19.48% | 0.25% |

长信利丰债券 A

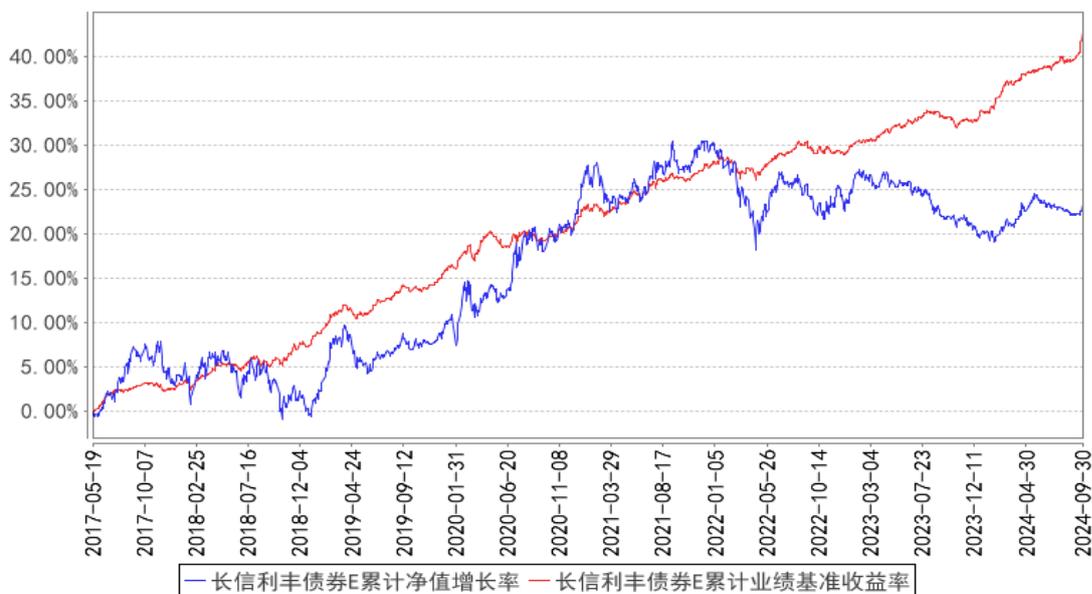
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准 差② | 业绩比较基准 收益率③ | 业绩比较基准 收益率标准差 ④ | ①-③ | ②-④ |
|---------------|--------|---------------|----------------|-----------------------|---------|--------|
| 过去三个月 | 0.09% | 0.12% | 2.73% | 0.15% | -2.64% | -0.03% |
| 过去六个月 | 1.64% | 0.17% | 4.18% | 0.12% | -2.54% | 0.05% |
| 过去一年 | 1.34% | 0.18% | 7.26% | 0.12% | -5.92% | 0.06% |
| 过去三年 | -2.51% | 0.29% | 13.02% | 0.11% | -15.53% | 0.18% |
| 自份额增加 日起至今 | 15.61% | 0.34% | 25.21% | 0.12% | -9.60% | 0.22% |

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

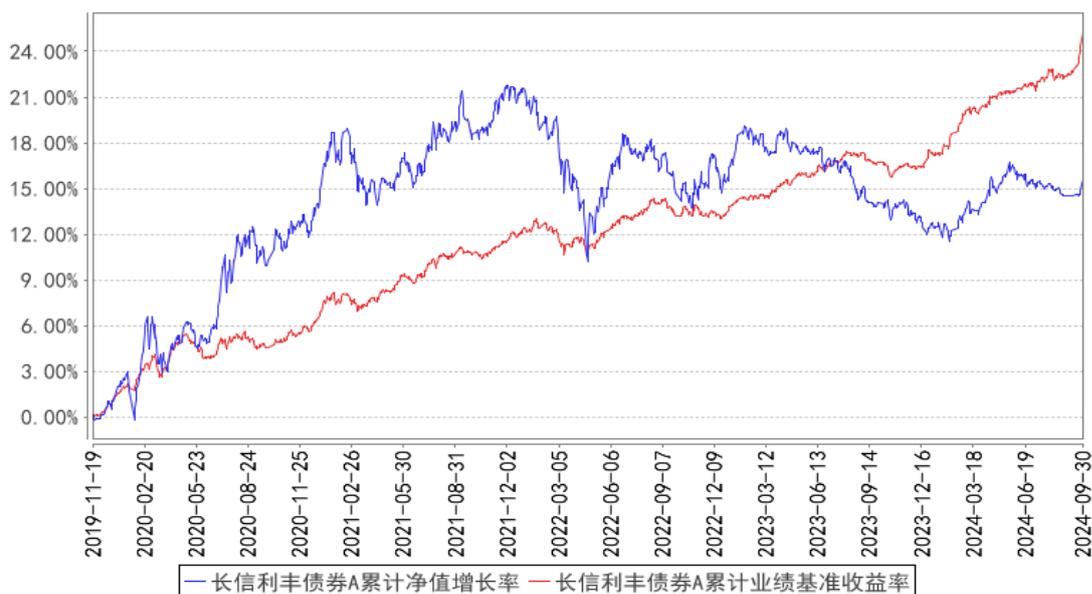
长信利丰债券C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



长信利丰债券E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



长信利丰债券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



注：1、基金管理人自 2017 年 5 月 19 日起对长信利丰债券型证券投资基金进行份额分类，原有基金份额为 C 类份额，增设 E 类份额；基金管理人自 2019 年 11 月 19 日起增设了长信利丰债券型证券投资基金 A 类份额。

2、长信利丰债券 A 图示日期为 2019 年 11 月 19 日（份额增加日）至 2024 年 9 月 30 日，长信利丰债券 C 图示日期为 2008 年 12 月 29 日至 2024 年 9 月 30 日，长信利丰债券 E 图示日期为 2017 年 5 月 19 日（份额增加日）至 2024 年 9 月 30 日。

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

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|---|-----------------|------|--------|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 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 | 2018 年 12 月 5 日 | - | 25 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和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 |

| | | | | | |
|----|---|-----------------|---|-----|--|
| | 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、固收投资管理中心总经理 | | | | 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 | 长信利丰债券型证券投资基金、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 | - | 9 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、长信先锐混合型证券投资基金、长信可转债债券型证券投资基金、长信利广灵活配置混合型证券投资基金和长信价值优选混合型证券投资基金的基金经理，现任长信利丰债券型证券投资基金、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。 |

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

回顾三季度，9 月下旬之前利率市场平稳下行，央行在临近季末的新闻发布会上宣布较大力度的货币政策调整，各期限利率均快速上行。信用债在 8 月之后随着利率波动和流动性冲击，信用溢价不断走扩。权益市场伴随着成交量萎缩不断下行，9 月底在政策端明确释放利好后，猛烈反弹。结构上，内需、非银等板块涨幅领先。

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，纯债维持中性久期和中高等级的持仓结构。权益部分，三季度前期保持中低仓位规避回撤，在 9 月末再次提升仓位参与反弹行情。

展望四季度，货币政策方面，降准降息落地，央行设立两个结构性货币政策工具支持股市，并有三项支持房地产市场的政策。1) 央行的政策切到了流动性陷阱的关键；2) 降准降息力度达到了 2020 年疫情初的力度，房地产政策超预期，提振了宏观预期；3) 宽松落地，利好兑现，利率多进入调整和盘整期；4) 支持股市的多项政策可能短期提振风险偏好。仅货币政策可能还不能

逆转方向，需要多部门综合行动，政府大力呵护有效需求。

海外方面，美国降息周期已经开启这有助于缓解内的汇率压力，对权益市场来说总量角度偏正面。国内方面，一系列货币政策及支持资本市场有助于改善的流动性，有助于提升市场的风险偏好。同时，全市场估值已经接近历史低位目前，中长期角度来说，市场已经具备足够的安全边际，分母端的积极改善有助于支撑市场估值提升。四季度，我们可以积极的把握结构性机会，同时跟踪政策端变化带来分子新景气趋势的产生，这也是系统性大行情关键。整体上，债券市场先转入防守，权益市场逐步回升，密切关注财政政策和预期变化，以及实际落地效果。

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 2024 年 9 月 30 日，长信利丰债券 C 基金份额净值为 1.294 元，份额累计净值为 2.133 元，本报告期内长信利丰债券 C 净值增长率为 0.00%；长信利丰债券 E 基金份额净值为 1.080 元，份额累计净值为 1.639 元，本报告期内长信利丰债券 E 净值增长率为 0.00%；长信利丰债券 A 基金份额净值为 1.056 元，份额累计净值为 1.548 元，本报告期内长信利丰债券 A 净值增长率为 0.09%，同期业绩比较基准收益率为 2.73%。

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 | 36,178,985.10 | 11.87 |
| | 其中：股票 | 36,178,985.10 | 11.87 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 260,475,014.02 | 85.45 |
| | 其中：债券 | 260,475,014.02 | 85.45 |
| | 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 | 7,067,800.82 | 2.32 |
| 8 | 其他资产 | 1,095,880.17 | 0.36 |
| 9 | 合计 | 304,817,680.11 | 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 | 1,169,482.00 | 0.41 |
| B | 采矿业 | 2,598,693.80 | 0.92 |
| C | 制造业 | 16,294,957.30 | 5.75 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 8,507,873.00 | 3.00 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | 2,603,026.00 | 0.92 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 1,965,881.00 | 0.69 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 2,639,443.00 | 0.93 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | 173,502.00 | 0.06 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 226,127.00 | 0.08 |
| 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 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 36,178,985.10 | 12.77 |

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 | 600795 | 国电电力 | 366,600 | 2,005,302.00 | 0.71 |
| 2 | 600273 | 嘉化能源 | 205,300 | 1,673,195.00 | 0.59 |

| | | | | | |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 3 | 600710 | 苏美达 | 158,900 | 1,460,291.00 | 0.52 |
| 4 | 002014 | 永新股份 | 144,600 | 1,448,892.00 | 0.51 |
| 5 | 600900 | 长江电力 | 46,600 | 1,400,330.00 | 0.49 |
| 6 | 600483 | 福能股份 | 129,500 | 1,344,210.00 | 0.47 |
| 7 | 601728 | 中国电信 | 199,500 | 1,338,645.00 | 0.47 |
| 8 | 600803 | 新奥股份 | 63,600 | 1,308,888.00 | 0.46 |
| 9 | 001207 | 联科科技 | 76,000 | 1,186,360.00 | 0.42 |
| 10 | 600598 | 北大荒 | 78,700 | 1,169,482.00 | 0.41 |

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 | 31,208,229.46 | 11.02 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 62,265,618.52 | 21.98 |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | 89,973,519.19 | 31.76 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | 51,142,369.53 | 18.05 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 25,885,277.32 | 9.14 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 260,475,014.02 | 91.94 |

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 | 2221006 | 22 上海农商二级 01 | 200,000 | 21,020,623.56 | 7.42 |
| 2 | 102380872 | 23 乌高新 MTN001 | 200,000 | 20,435,095.89 | 7.21 |
| 3 | 019733 | 24 国债 02 | 164,000 | 16,647,163.73 | 5.88 |
| 4 | 240384 | 23 宝租 01 | 150,000 | 15,437,940.00 | 5.45 |
| 5 | 115137 | 23 宏洋 02 | 150,000 | 15,431,626.03 | 5.45 |

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投资贵金属。

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，发行主体平安银行股份有限公司于 2023 年 12 月 12 日收到国家金融监督管理总局深圳监管局行政处罚信息公开表深金罚决字（2023）69 号，经查，平安银行股份有限公司存在考评机制不当，贷款业务操作不规范，小微企业划型不准确的问题，根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条及相关审慎经营规则，国家金融监督管理总局深圳监管局决定对平安银行处以罚款 170 万元。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体平安银行股份有限公司于 2024 年 5 月 14 日收到国家金融监督管理总局行政处罚信息公开表（金罚决字（2024）6 号），经查，平安银行股份有限公司存在以下问题：一、公司治理与内部控制方面。包括：个别高管人员未经任职资格核准实际履职，同一股东实质提名董事超比例，部分岗位绩效薪酬延期支付比例低于监管要求，未按监管规定审查审批重大关联交易等；二、信贷业务方面。包括：向关系人发放信用贷款，违规发放并购贷款、流动资金贷款、个人贷款，流动资金贷款、个人贷款用途不合规，授信责任认定后问责不到位等；三、同业业务方面。包括：违规接受第三方金融机构信用担保，分支机构承担非标投资信用风险，通过同业投资掩盖资产损失、延缓风险暴露、提供土地储备融资，违规垫付某产品赎回资金，同业非标投资业务未计足风险加权资产，以贵金属产业基金模式融出资金违规用于股权投资等；四、理财业务方面。包括：违规向理财产品提供融资、虚构风险缓释品、未计提风险加权资产，代客理财资金用于本行自营业务，理财产品相互交易，理财产品信息披露不合规，理财投资“名股实债”类资产未计入非标债权类资产投资统计，结构性存款业务实质是“假结构”等；五、其他方面。包括：部分非现场监管统计数据与事实不符，银行承兑汇票保证金来源于贷

款资金，未对投保人进行需求分析与风险承受能力测评等。依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十条、第二十一条、第三十四条、第四十六条，《中华人民共和国商业银行法》第四十条、第七十四条及相关审慎经营规则，国家金融监督管理总局深圳监管局决定对平安银行股份有限公司没收违法所得并处罚款合计 6723.98 万元。

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

报告期内本基金投资的前十名证券中其余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 | 59,249.18 |
| 2 | 应收证券清算款 | 1,034,481.79 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 2,149.20 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 1,095,880.17 |

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 | 110059 | 浦发转债 | 11,650,629.65 | 4.11 |
| 2 | 128129 | 青农转债 | 4,261,067.82 | 1.50 |
| 3 | 113037 | 紫银转债 | 2,883,815.48 | 1.02 |
| 4 | 113042 | 上银转债 | 2,866,457.05 | 1.01 |
| 5 | 113052 | 兴业转债 | 2,853,604.34 | 1.01 |
| 6 | 128063 | 未来转债 | 1,369,702.98 | 0.48 |

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 | 长信利丰债券 C | 长信利丰债券 E | 长信利丰债券 A |
|---------------------------|----------------|----------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 190,764,537.43 | 668.75 | 53,156,382.70 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 226,642.67 | 1.87 | 3,356.89 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 8,877,929.69 | 29.56 | 8,001,760.04 |
| 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 | 182,113,250.41 | 641.06 | 45,157,979.55 |

§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 (%) |
| 机构 | 1 | 2024 年 7 月 1 日至 2024 年 7 月 22 日 | 52,694,085.03 | 0.00 | 8,000,000.00 | 44,694,085.03 | 19.67 |
| | 2 | 2024 年 7 月 1 日至 2024 年 9 月 30 日 | 74,571,215.51 | 0.00 | 0.00 | 74,571,215.51 | 32.81 |
| 产品特有风险 | | | | | | | |

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。

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。

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。

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、《长信利丰债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长信利丰债券型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《长信利丰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 10 月 25 日