

长信利鑫债券型证券投资基金（LOF） 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：中国邮政储蓄银行股份有限公司

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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金基金合同规定，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	长信利鑫债券（LOF）	
基金主代码	163003	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 6 月 25 日	
报告期末基金份额总额	1,273,897,805.41 份	
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。	
基金管理人	长信基金管理有限责任公司	
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	长信利鑫债券（LOF）A	长信利鑫债券（LOF）C
下属分级基金的场内简称	-	长信利鑫 LOF
下属分级基金的交易代码	163008	163003
报告期末下属分级基金的份额总额	344,918,622.35 份	928,979,183.06 份

注：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 2011 年 6 月 24 日。长信利鑫

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 5 年分级运作期届满进行转换，转换基准日为 2016 年 6 月 24 日，转换日日终，长信利鑫分级债 A、长信利鑫分级债 B 按照各自的基金份额净值转换成长信利鑫债券（LOF）份额。

§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）	
	长信利鑫债券 (LOF) A	长信利鑫债券 (LOF) C
1. 本期已实现收益	1,904,848.92	4,329,869.11
2. 本期利润	1,711,097.71	3,963,089.69
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0043	0.0042
4. 期末基金资产净值	217,896,208.46	580,747,533.97
5. 期末基金份额净值	0.6317	0.6251

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

长信利鑫债券 (LOF) 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	0.78%	0.08%	0.90%	0.10%	-0.12%	-0.02%
过去六个月	2.60%	0.08%	2.65%	0.09%	-0.05%	-0.01%
过去一年	3.34%	0.19%	6.16%	0.07%	-2.82%	0.12%
过去三年	2.10%	0.28%	14.70%	0.06%	-12.60%	0.22%
过去五年	9.60%	0.25%	24.24%	0.07%	-14.64%	0.18%
自份额增加	23.39%	0.21%	39.38%	0.06%	-15.99%	0.15%

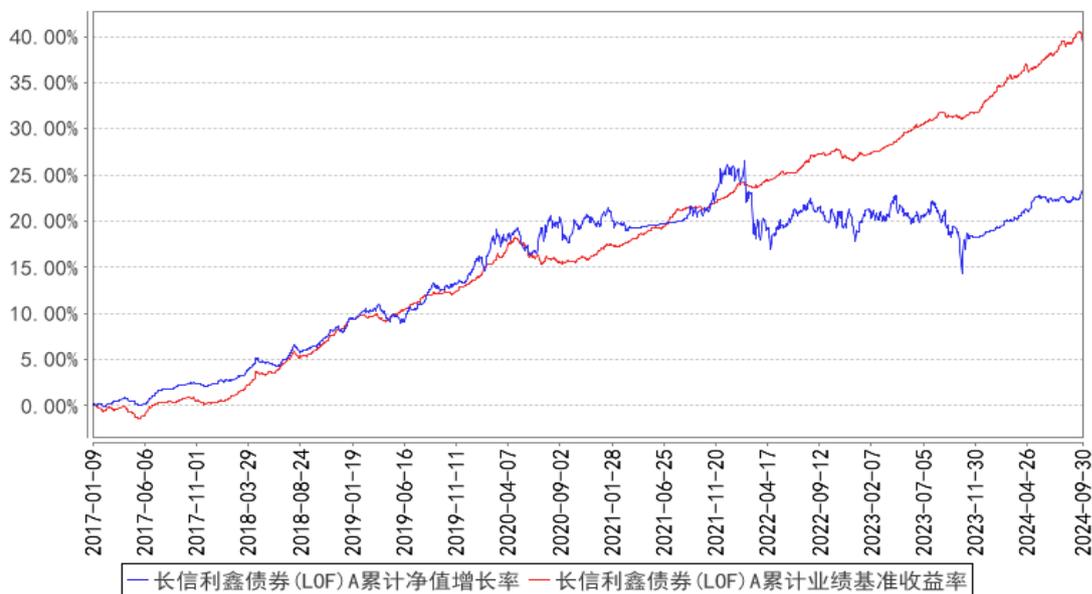
日起至今						
------	--	--	--	--	--	--

长信利鑫债券 (LOF) C

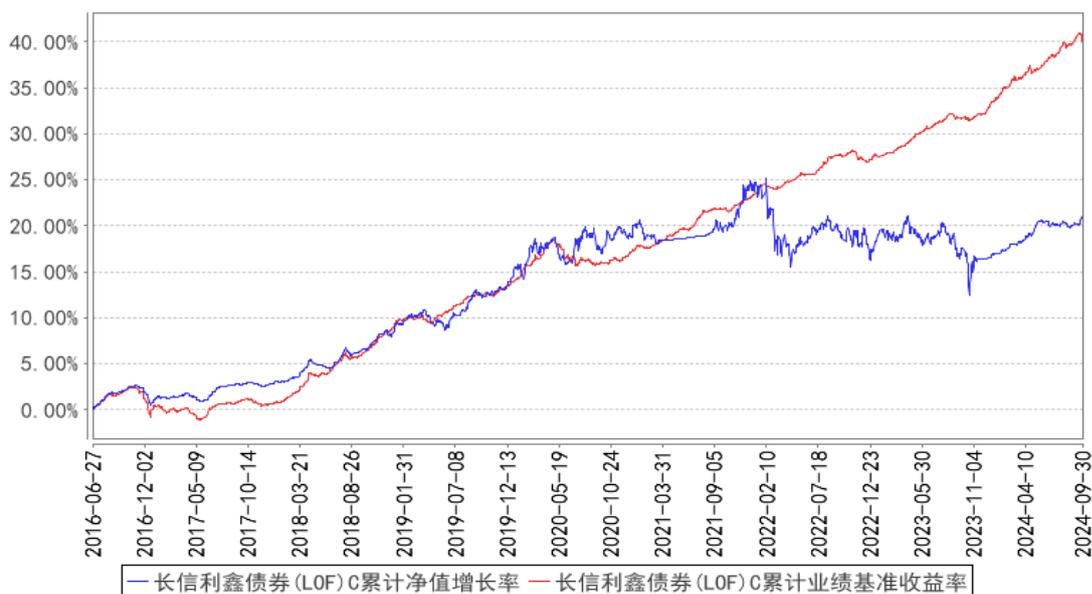
阶段	净值增长率①	净值增长率标准 差②	业绩比较基准 收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	0.71%	0.08%	0.90%	0.10%	-0.19%	-0.02%
过去六个月	2.44%	0.08%	2.65%	0.09%	-0.21%	-0.01%
过去一年	3.07%	0.19%	6.16%	0.07%	-3.09%	0.12%
过去三年	1.13%	0.28%	14.70%	0.06%	-13.57%	0.22%
过去五年	7.83%	0.25%	24.24%	0.07%	-16.41%	0.18%
自基金合同 生效起至今	21.13%	0.20%	39.80%	0.07%	-18.67%	0.13%

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

长信利鑫债券 (LOF) 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



长信利鑫债券（LOF）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、基金管理人自 2017 年 1 月 9 日起对长信利鑫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。

2、本基金转型起始日为 2016 年 6 月 25 日，长信利鑫债券（LOF）A 图示日期为 2017 年 1 月 9 日（份额增加日）至 2024 年 9 月 30 日，长信利鑫债券（LOF）C 图示日期为 2016 年 6 月 25 日至 2024 年 9 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 2011 年 6 月 24 日，转型起始日为 2016 年 6 月 25 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		
冯彬	长信金葵纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信利保债券型证券投资基金、长信稳裕三个月定期开放债券型发起	2023 年 12 月 21 日	-	16 年	厦门大学金融工程学硕士，具有基金从业资格，中国国籍。曾任职于平安证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、富国基金管理有限公司、恒丰银行股份有限公司、创金合信基金管理有限公司，2019 年 7 月加入长信基金管理有限责任公司，曾任长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信稳恒债券型证券投资基金、长信稳健纯债债券型证券投资基金、

<p>式证券投资基金、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 120 天滚动持有债券型证券投资基金、长信利鑫债券型证券投资基金 (LOF)、长信富安纯债 180 天持有期债券型证券投资基金、长信 180 天持有期债券型证券投资基金和长信易进混合型证券投资基金的基金经理、固收多策略部总监</p>				<p>长信富民纯债一年定期开放债券型证券投资基金和长信富安纯债半年定期开放债券型证券投资基金的基金经理，现任固收多策略部总监、长信金葵纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信利保债券型证券投资基金、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 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 120 天滚动持有债券型证券投资基金、长信利鑫债券型证券投资基金 (LOF)、长信富安纯债 180 天持有期债券型证券投资基金、长信 180 天持有期债券型证券投资基金和长信易进混合型证券投资基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	--

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 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

三季度，宏观经济处于较为平稳的状态，经济的刺激政策持续推出，债券市场走势偏震荡，权益市场底部大幅度反弹。

本基金在三季度调整了组合的仓位和久期。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2024 年 9 月 30 日，长信利鑫债券（LOF）A 基金份额净值为 0.6317 元，份额累计净值为 1.1537 元，本报告期内长信利鑫债券（LOF）A 净值增长率为 0.78%；长信利鑫债券（LOF）C 基金份额净值为 0.6251 元，份额累计净值为 1.1311 元，本报告期内长信利鑫债券（LOF）C 净值增长率为 0.71%，同期业绩比较基准收益率为 0.90%。

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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	716,288,259.30	86.13
	其中：债券	716,288,259.30	86.13

	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	80,701,744.21	9.70
	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	11,264,878.12	1.35
8	其他资产	23,384,738.11	2.81
9	合计	831,639,619.74	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

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股票。

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

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	43,780,314.64	5.48
2	央行票据	-	-
3	金融债券	185,211,644.40	23.19
	其中：政策性金融债	30,703,213.69	3.84
4	企业债券	107,084,062.09	13.41
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	96,773,306.35	12.12
7	可转债（可交换债）	283,438,931.82	35.49
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	716,288,259.30	89.69

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	110059	浦发转债	520,360	57,661,419.50	7.22

2	128129	青农转债	500,167	52,452,389.96	6.57
3	2028038	20 中国银行二级 01	500,000	51,006,027.40	6.39
4	230026	23 付息国债 26	300,000	31,543,785.33	3.95
5	2023001	20 人民财险	300,000	30,756,225.21	3.85

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，发行主体青岛农村商业银行股份有限公司于 2024 年 1 月 2 日收到国家金融监督管理总局青岛监管局行政处罚信息公开表（青国金罚决字（2024）1 号），经查，青岛农村商业银行股份有限公司存在监管标准化（EAST）数据错报漏报的问题，根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则，国家金融监督管理总局青岛监管局决定对青岛农村商业银行处以罚款人民币 30 万元。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体中国银行股份有限公司于 2023 年 12 月 28

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〔2023〕68 号），经查，中国银行股份有限公司存在以下情况：一、部分重要信息系统识别不全面，灾备建设和灾难恢复能力不符合监管要求；二、重要信息系统投产及变更未向监管部门报告，且投产及变更长期不规范引发重要信息系统较大及以上突发事件；三、信息系统运行风险识别不到位、处置不及时，引发重要信息系统重大突发事件；四、监管意见整改落实不到位，引发重要信息系统重大突发事件；五、信息科技外包管理不审慎；六、网络安全域未开展安全评估，网络架构重大变更未开展风险评估且未向监管部门报告；七、信息系统突发事件定级不准确，导致未按监管要求上报；八、迟报重要信息系统重大突发事件；九、错报漏报监管标准化（EAST）数据。综上，根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则，国家金融监督管理总局决定对中国银行处以罚款 430 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	48,517.08
2	应收证券清算款	23,334,151.03
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,070.00
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	23,384,738.11

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	57,661,419.50	7.22

2	128129	青农转债	52,452,389.96	6.57
3	113037	紫银转债	21,626,997.81	2.71
4	128074	游族转债	16,687,619.53	2.09
5	127024	盈峰转债	15,596,488.42	1.95
6	113609	永安转债	15,107,538.83	1.89
7	123108	乐普转 2	12,683,170.50	1.59
8	123151	康医转债	11,463,961.29	1.44
9	123122	富瀚转债	7,642,232.54	0.96
10	113056	重银转债	6,461,653.38	0.81
11	123121	帝尔转债	5,633,869.65	0.71
12	113606	荣泰转债	5,581,732.88	0.70
13	128097	奥佳转债	5,373,363.05	0.67
14	128063	未来转债	5,212,190.35	0.65
15	113054	绿动转债	4,956,836.90	0.62
16	123126	瑞丰转债	3,801,871.44	0.48
17	113650	博 22 转债	3,231,422.30	0.40
18	123093	金陵转债	3,217,748.80	0.40
19	123233	凯盛转债	3,080,136.97	0.39
20	123152	润禾转债	2,725,859.47	0.34
21	118025	奕瑞转债	2,254,596.71	0.28
22	128081	海亮转债	2,242,451.84	0.28
23	127017	万青转债	2,241,792.88	0.28
24	118006	阿拉转债	2,182,011.01	0.27
25	123154	火星转债	2,069,488.53	0.26
26	123109	昌红转债	2,045,200.33	0.26
27	123179	立高转债	2,042,087.17	0.26
28	113618	美诺转债	1,678,236.91	0.21
29	118005	天奈转债	1,202,296.44	0.15
30	123115	捷捷转债	1,140,080.82	0.14
31	127016	鲁泰转债	1,101,650.33	0.14
32	111014	李子转债	1,044,014.60	0.13
33	128134	鸿路转债	1,042,946.91	0.13
34	118010	洁特转债	830,986.08	0.10
35	123133	佩蒂转债	49,632.12	0.01
36	113052	兴业转债	42,689.13	0.01
37	123113	仙乐转债	19,539.44	0.00
38	127056	中特转债	10,727.00	0.00

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

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	长信利鑫债券 (LOF) A	长信利鑫债券 (LOF) C
报告期期初基金份额总额	413,944,610.88	980,117,192.60
报告期期间基金总申购份额	67,388,862.26	89,886,493.99
减：报告期期间基金总赎回份额	136,414,850.79	141,024,503.53
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	344,918,622.35	928,979,183.06

§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

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。

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、《长信利鑫债券型证券投资基金 (LOF) 基金合同》；
- 3、《长信利鑫债券型证券投资基金 (LOF) 招募说明书》；
- 4、《长信利鑫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。

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