长信可转债债券型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告

2024年3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4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 4 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 1 月 1 日起至 2024 年 3 月 31 日止。

§2 基金产品概况

基金主代码 契约型开放式 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 712,643,281.17 份 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。 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。 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% 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	基金简称	长信可转债债券				
基金合同生效日 报告期末基金份额总额 712,643,281.17 份 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	基金主代码	519977				
报告期末基金份额总额 712,643,281.17 份 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。	基金运作方式	契约型开放式				
及资目标 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。 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。 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% 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	基金合同生效日	2012年3月30日				
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。 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。 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	报告期末基金份额总额	712, 643, 281. 17 份				
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	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),			
的基础上实现基金资产的长期稳定增值。 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		主要运用可转债品种兼具债	券和股票的特性,通过积极			
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。 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% 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。 长信基金管理有限责任公司		主动的可转债投资管理,力	争在锁定投资组合下方风险			
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。 长信基金管理有限责任公司		的基础上实现基金资产的长	期稳定增值。			
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。 长信基金管理人	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				
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% 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。 长信基金管理人	券特性,强调投资组合的安全性和稳定性,另一方					
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。 长信基金管理有限责任公司		用可转债的股票特性,分享股市上涨产生的较高收益。				
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	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				
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		率×20%+沪深 300 指数收益	率*10%			
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	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			
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		种,其预期收益和预期风险高于货币市场基金,低于混				
基金管理人 长信基金管理有限责任公司		合型基金和股票型基金。本基	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。			
基全托管人 平安银行股份有限公司	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	下属分级基金的基金简称	长信可转债债券 A 长信可转债债券				
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	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 233, 132, 203. 25 份 479, 511, 077. 92 份	报告期末下属分级基金的份额总额	233, 132, 203. 25 份	479, 511, 077. 92 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1月1日-2024年3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	-9, 037, 193. 25	-10, 236, 133. 85			
2. 本期利润	-2, 633, 959. 12	1, 271, 166. 05			
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0109	0.0034			
4. 期末基金资产净值	352, 748, 140. 46	697, 153, 163. 96			
5. 期末基金份额净值	1. 5131	1. 4539			

- 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

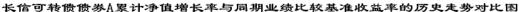
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准	业绩比较基准 收益率标准差 ④	1)-3	2-4
过去三个月	-0.57%	0.71%	0. 12%	0. 43%	-0.69%	0.28%
过去六个月	-5. 61%	0.63%	-2.57%	0.40%	-3.04%	0. 23%
过去一年	-11.00%	0. 57%	-3. 31%	0.36%	-7.69%	0. 21%
过去三年	-7. 88%	0.74%	4. 66%	0. 45%	-12.54%	0.29%
过去五年	10. 62%	0.80%	20. 18%	0.51%	-9.56%	0.29%
自基金合同 生效起至今	192.82%	1.08%	60. 88%	0.87%	131. 94%	0. 21%

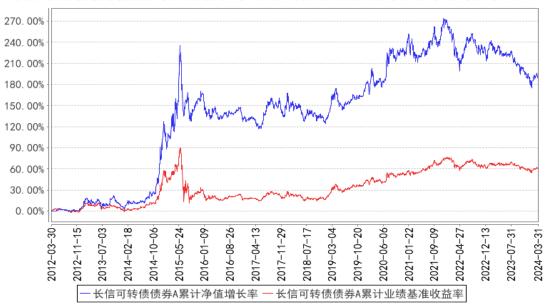
长信可转债债券 C

阶段	净值增长率①	净值增长率标	业绩比较基准	业绩比较基准	1)-3	2-4

		准差②	收益率③	收益率标准差		
				4		
过去三个月	-0. 57%	0.71%	0. 12%	0. 43%	-0.69%	0. 28%
过去六个月	-5. 62%	0.63%	-2. 57%	0.40%	-3.05%	0. 23%
过去一年	-11.03%	0. 57%	-3. 31%	0.36%	-7. 72%	0.21%
过去三年	-8.53%	0.74%	4. 66%	0. 45%	-13. 19%	0.29%
过去五年	8. 93%	0.80%	20. 18%	0.51%	-11. 25%	0.29%
自基金合同	172. 64%	1. 08%	60. 88%	0.87%	111.76%	0. 21%
生效起至今	172.04%	1,00%	00, 00%	0.01%	111.70%	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2024年3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	田本基金的基金经验 取务 期限		证券从业 年限	说明
		任职日期	离任日期	平败	
李家春	长型金债投信置投信证金精券长 6 混资信证、债资利混资利券、选投信个合基利券长券基广合基富投长混资稳月型金丰投信型金灵型金债投信合基健持证、债资可证、活证、券资稳型金均有券长券基转券长配券长型基健证、衡期投信	2018年 12月8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、交银施罗德基金和上海东方证券资产管理有限公司。2018年7月加经理和大信基金管理有限公司,曾任总经理为长信基金管理有限责任公司交换后利益。长信和监逻证券投资基金、长信利富强企业,现任固收投资基金、长信利富量证券投资基金、长信利富债券型证券投资基金、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

	稳健增长一年型 持有期沒基金 和长信急型 化光管型 化光度 人名				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	长混资可证金债资利混资利混资利券长 6 混资稳持证和长投金信合基转券、券基广合基盈合基富投信个合基健有券长混资经价型金债投 信证、活证、活证、券基健持证、长混资稳型金优券长券资利券长配券长配券长型金均有券长一合基健证的选投信型基丰投信置投信置投信证、衡期投信年型金成券基	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、长信利车债券型证券投资基金、长信利富人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	-		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

年初以来,由于各机构配置积极性较高,且高息资产供需格局变化持续,使得无风险利率下行,信用债收益率也进一步打开下行空间,信用利差被动略微走阔,大多信用债收益率创下 2015 年以来新低。权益市场经过 1 月份的调整后,市场于春节前开启大幅反弹,指数回升到 3000 点,市场成交额也站上万亿水平,3 月后逐步进入结构性行情。

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。权益部分,前期通过 较低仓位规避年初回撤,待市场企稳后逐步加大配置仓位,力争获得市场修复的投资收益。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。 两会后,国内经济进入发力期,消费以旧换新和设备更新行动、发展新质生产力等增长抓手将进一步对经济形成支持。叠加出口等积极的拉动因素,最新的 PMI 也有回升态势。因此,在国内外一系列有力的措施之下,市场对于经济下行风险的担忧会明显缓解。国外方面,美国经济数据强劲、通胀略超预期,美元降息节点可能晚于预期,但美元滥发正在引发全球投资者对美元信用的担忧。

对于债券市场而言,目前利率下行至历史低位,在资金面、消息面和机构行为等因素的相互 影响下,未来或以低位震荡行情为主。配置久期资产时,保持积极灵活,兼顾高流动性和信用评 级。相对看好优质区域城投、央国企产业债,以及各品种金融债。

对于权益市场而言,新政侧重打造公平的交易环境、增强企业对股东的回报,这些都将显著 改善市场当前的供需矛盾,驱动 A 股走向成熟化。投资者对企业内在价值的关注将显著增加,并 减少景气趋势的过度外推。此前由于多重因素被过度定价的阶段已经过去,市场步入分化震荡和 基本面驱动和观察期。后续关注领域包括,成长板块主要围绕有业绩支撑的方向,如 AI 驱动的算力、出海的电力、机械等。还有前期回调但业绩较为稳健的部分顺周期相关子板块,如造船、上游资源品等。以及可能位于出清阶段末期的部分板块,如猪周期、化工品等。

对于转债市场而言,目前转债市场整体仍处在赔率较优的配置区域。第一,经过前期震荡后,转债市场估值仍处于近三年来较低位置,在短期无负债端负面冲击以及信用风险事件迹象的情况下,整体估值趋于稳定;第二,权益市场风险偏好逐渐抬升;第三,年内新上转债标的总额较过往三年显著下滑,叠加部分较高流通规模转债逐步到期,新增转债供给对于市场冲击有所减少。

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3月31日,长信可转债债券 A 基金份额净值为1.5131元,份额累计净值为2.4731元,本报告期内长信可转债债券 A 净值增长率为-0.57%;长信可转债债券 C 基金份额净值为1.4539元,份额累计净值为2.3609元,本报告期内长信可转债债券 C 净值增长率为-0.57%,同期业绩比较基准收益率为0.12%。

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	153, 217, 945. 53	13. 22
	其中: 股票	153, 217, 945. 53	13. 22
2	基金投资	_	_
3	固定收益投资	974, 344, 612. 23	84. 07
	其中:债券	974, 344, 612. 23	84. 07
	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	25, 807, 605. 37	2. 23
8	其他资产	5, 593, 274. 64	0.48
9	合计	1, 158, 963, 437. 77	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	5, 173, 685. 00	0.49
В	采矿业	32, 024, 799. 00	3.05
С	制造业	76, 028, 214. 52	7. 24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应		
	业	7, 051, 721. 00	0.67
Е	建筑业	1, 391, 220. 00	0.13
F	批发和零售业	7, 249, 060. 00	0.69
G	交通运输、仓储和邮政业	1, 323, 115. 00	0. 13
Н	住宿和餐饮业	-	_
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7, 068, 254. 01	0.67
J	金融业	7, 623, 832. 00	0.73
K	房地产业	_	_
L	租赁和商务服务业	-	_
M	科学研究和技术服务业	2, 293, 813. 00	0. 22
N	水利、环境和公共设施管理业	_	_
0	居民服务、修理和其他服务业		
Р	教育	_	_

Q	卫生和社会工作	_	_
R	文化、体育和娱乐业	5, 990, 232. 00	0. 57
S	综合	_	=
	合计	153, 217, 945. 53	14. 59

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	414, 800	8, 843, 536. 00		0.84
2	600988	赤峰黄金	527, 500	8, 624, 625. 00		0.82
3	002475	立讯精密	271, 900	7, 996, 579. 00		0.76
4	603939	益丰药房	182,000	7, 249, 060. 00		0.69
5	300750	宁德时代	36, 400	6, 921, 824. 00		0.66
6	601088	中国神华	175, 100	6, 844, 659. 00		0.65
7	601899	紫金矿业	396, 500	6, 669, 130. 00		0.64
8	603993	洛阳钼业	798, 800	6, 646, 016. 00		0.63
9	002111	威海广泰	596, 300	6, 493, 707. 00		0.62
10	000933	神火股份	266, 900	5, 311, 310.00		0.51

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	28, 922, 469. 04	2.75
2	央行票据	_	_
3	金融债券	40, 431, 573. 77	3.85
	其中: 政策性金融债	40, 431, 573. 77	3. 85
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)	904, 990, 569. 42	86. 20
8	同业存单	_	_
9	其他	_	_
10	合计	974, 344, 612. 23	92. 80

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	467,000	56, 178, 526. 28		5.35
2	230211	23 国开 11	400,000	40, 431, 573. 77		3.85
3	110079	杭银转债	309, 270	34, 532, 435. 77		3. 29
4	113050	南银转债	292, 170	33, 297, 134. 04		3. 17

5	123213	天源转债	288, 021	32, 385, 775. 65	3.08
0	120210	7 (10) 1 1 193	200, 021	02, 000, 110.00	0.00

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	516, 518. 85
2	应收证券清算款	54, 678. 40
3	应收股利	_
4	应收利息	_

5	应收申购款	5, 022, 077. 39
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	5, 593, 274. 64

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

2 110079 杭银转债 34,532,435.77 3.25 3 113050 南银转债 33,297,134.04 3.17 4 123213 天源转债 32,385,775.65 3.08 5 113052 兴业转债 31,253,465.75 2.96 6 110062 烽火转债 23,529,175.81 2.24 7 123107 温氏转债 22,210,175.34 2.12 8 113637 华翔转债 22,168,971.51 2.11 9 128137 清美转债 18,875,785.45 1.80 10 111005 富幸转债 17,650,011.83 1.66 11 113061 拓普转债 15,967,417.26 1.52 12 113021 中信转债 15,792,213.62 1.50 13 118024 返字转债 15,701,817.56 1.50 14 113060 浙22转债 15,616,668.27 1.49 15 123156 博汇转债 15,362,954.23 1.46 16 113062 常银转债 13,574,371.23 1.33 17 113065 滿華转债 13,074,910.78 1.25					
2 110079 杭镍转债 34,532,435.77 3.25 3 113050 南银转债 33,297,134.04 3.17 4 123213 天源转债 32,385,775.65 3.08 5 113052 兴业转债 31,253,465.75 2.96 6 110062 烽火转债 23,529,175.81 2.24 7 123107 温氏转债 22,210,175.34 2.12 8 113637 华翔转债 22,116,871.51 2.11 9 128137 清美转债 18,875,785.45 1.80 10 111005 富春转债 17,650,011.83 1.66 11 113061 拓普转债 15,967,417.26 1.52 12 113021 中信转债 15,792,213.62 1.50 13 118024 巡字转债 15,701,817.56 1.50 14 113060 浙 22 转债 15,616.668.27 1.43 15 123156 博汇转债 15,362,954.23 1.46 16 113062 常银转债 14,574,371.23 1.33 17 113059 滿來转债 13,339,055.25 1.24	序号	债券代码	债券名称	公允价值 (元)	占基金资产净值比例(%)
3 113050 南银转债 33,297,134.04 3.17 4 123213 天源转债 32,385,775.65 3.08 5 113052 兴业转债 31,253,465.75 2.98 6 110062 烽火转債 23,529,175.81 2.24 7 123107 温氏转债 22,210,175.34 2.12 8 113637 华翔转债 22,168,971.51 2.11 9 128137 洁美转债 17,650,011.83 1.65 11 113061 拓普转债 15,967,417.26 1.52 12 113021 中信转债 15,792,213.62 1.56 13 118024 冠字转债 15,701,817.56 1.50 14 113060 浙 22 转债 15,701,817.56 1.50 14 113060 浙 22 转债 15,362,954.23 1.46 16 113062 常银转债 14,574,371.23 1.33 17 113059 福来转债 13,536,379.73 1.22 18 118012 微芯转债 13,074,910.78 1.25 19 113641 华友转债 13,039,055.25 1.24 20 118028 会通转债 12,896,666.55 1.23 21 127051 博杰转债 12,753,528.90 1.21 22 113053 隆 22 转债 12,753,528.90 1.21 23 127044 蒙娜转债 12,753,528.90 1.21 24 127061 美锦转债 12,399,657.41 1.18 25 127074 麦米转定 12,379,481.67 1.18 26 110073 国投转债 12,030,976.25 1.14 27 113044 大秦转债 12,030,976.25 1.15 27 113044 大秦转债 11,980,608.22 1.14 28 113024 核建转债 11,980,608.22 1.14 29 111008 沿浦转债 11,980,608.22 1.14 29 111008 沿浦转债 11,980,608.22 1.14 31 113045 死旭转债 11,980,608.22 1.14 31 113045 死旭转债 11,980,608.22 1.14 31 113045 死旭转债 11,980,608.21 1.19 32 127045 牧原转债 11,980,608.21 1.11 31 113045 死旭转债 11,196,431.37 1.07 33 113615 金减转债 11,196,431.37 1.07 33 113615 金减转债 11,196,431.37 1.07	1	132026	G 三峡 EB2	56, 178, 526. 28	5. 35
4 123213 天源转债 32,385,775.65 3.06 5 113052 兴业转债 31,253,465.75 2.98 6 110062 烽火转债 23,529,175.81 2.24 7 123107 温氏转债 22,210,175.34 2.12 8 113637 华翔转债 22,168,971.51 2.11 9 128137 洁美转债 18,875,785.45 1.86 10 111005 富春转债 17,650,011.83 1.68 11 113061 拓普转债 15,967,417.26 1.52 12 113021 中信转债 15,792,213.62 1.50 13 118024 冠字转债 15,701,817.56 1.50 14 113060 浙22转债 15,701,817.56 1.50 15 123156 博工转债 15,362,954.23 1.45 16 113062 常银转债 14,574,371.23 1.33 17 113059 福来转债 13,536,379.73 1.29 18 118012 微芯转债 13,074,910.78 1.25 20 118028 会通转债 12,896,666.55 1.23	2	110079	杭银转债	34, 532, 435. 77	3. 29
5 113052 兴业转债 31,253,465.75 2.98 6 110062 烽火转债 23,529,175.81 2.24 7 123107 温氏转债 22,210,175.34 2.12 8 113637 华翔转债 22,168,971.51 2.11 9 128137 洁美转债 18,875,785.45 1.80 10 111005 富春转债 17,650,011.83 1.68 11 113061 拓普转债 15,967,417.26 1.52 12 113021 中信转债 15,792,213.62 1.50 13 118024 冠字转债 15,701,817.56 1.50 14 113060 游22转债 15,616,668.27 1.49 15 123156 博江转债 15,362,954.23 1.46 16 113062 常银转债 13,536,379.73 1.22 17 113059 福菜转债 13,536,379.73 1.22 18 118012 微芯转债 13,074,910.78 1.25 19 113641 华友转债 13,074,910.78 1.25 20 118028 会通转债 12,896,666.55 1.23	3	113050	南银转债	33, 297, 134. 04	3. 17
6 110062 烽火转债 23,529,175.81 2.24 7 123107 温氏转债 22,210,175.34 2.12 8 113637 华翔转债 22,168,971.51 2.11 9 128137 洁美转债 18,875,785.45 1.86 10 111005 富春转债 17,650,011.83 1.68 11 113061 拓普转债 15,967,417.26 1.52 12 113021 中信转债 15,792,213.62 1.56 13 118024 冠字转债 15,701,817.56 1.56 14 113060 浙 22转债 15,616,668.27 1.46 15 123156 博江转债 15,362,954.23 1.46 16 113062 常银转债 14,574,371.23 1.38 17 113059 福莱转债 13,536,379.73 1.29 18 118012 微芯转债 13,074,910.78 1.25 19 113641 华友转债 13,039,055.25 1.24 20 118028 会通转债 12,753,528.90 1.21 127051 博杰转债 12,753,528.90 1.21 22 113053 隆 22转债 12,497,165.59 1.15 24 127061 美锦转债 12,389,657.41 1.18 25 127074 麦米转2 12,379,481.67 1.18 26 110073 国投转债 11,980,608.22 1.14 28 113024 核建转债 11,980,608.22 1.14 28 113024 核建转债 11,980,608.22 1.14 28 113044 大秦转债 11,980,608.22 1.14 28 113045 环旭转债 11,794,279.56 1.12 30 118025 突瑞转债 11,948,767.87 1.14 31 113045 环旭转债 11,794,279.56 1.15 31 113045 环旭转债 11,196,431.37 1.07 33 113615 金诚转债 10,427,481.73 0.95	4	123213	天源转债	32, 385, 775. 65	3.08
7 123107 温氏转债 22,210,175.34 2.12 8 113637 华翔转债 22,168,971.51 2.11 9 128137 洁美转债 18,875,785.45 1.80 10 111005 富春转债 17,650,011.83 1.68 11 113061 拓普转债 15,967,417.26 1.52 12 113021 中信转债 15,792,213.62 1.50 13 118024 冠字转债 15,701,817.56 1.50 14 113060 新22转债 15,616,668.27 1.48 15 123156 博工转债 15,362,954.23 1.46 16 113062 常敏转债 14,574,371.23 1.33 17 113059 福莱转债 13,536,379.73 1.22 18 118012 微芯转债 13,074,910.78 1.25 19 113641 华友转债 13,039,055.25 1.24 20 118028 会通转债 12,753,528.90 1.21 21 127051 博杰转债 12,753,528.90 1.21 22 113053 隆22转债 12,497,165.59 1.18 </td <td>5</td> <td>113052</td> <td>兴业转债</td> <td>31, 253, 465. 75</td> <td>2.98</td>	5	113052	兴业转债	31, 253, 465. 75	2.98
8 113637 华翔转债 22,168,971.51 2.11 9 128137 洁美转债 18,875,785.45 1.80 10 111005 富春转债 17,650,011.83 1.68 11 113061 拓普转债 15,967,417.26 1.52 12 113021 中信转债 15,792,213.62 1.50 13 118024 冠字转债 15,701,817.56 1.50 14 113060 浙 22 转债 15,616,668.27 1.49 15 123156 博汇转债 15,362,954.23 1.46 16 113062 常银转债 14,574,371.23 1.35 17 113059 福莱转债 13,536,379.73 1.25 18 118012 徽芯转债 13,074,910.78 1.25 19 113641 华友转债 13,074,910.78 1.25 20 118028 会通转债 12,896,666.55 1.23 21 127051 博杰转债 12,753,528.90 1.21 22 113053 隆 22 转债 12,753,528.90 1.21 23 127044 蒙娜转债 12,397,481.67 1	6	110062	烽火转债	23, 529, 175. 81	2. 24
9 128137 洁美转债 18,875,785.45 1.86 10 111005 富春转债 17,650,011.83 1.68 11 113061 拓普转债 15,967,417.26 1.52 12 113021 中信转债 15,792,213.62 1.56 13 118024 冠字转债 15,701,817.56 1.56 14 113060 浙22转债 15,616,668.27 1.49 15 123156 博汇转债 15,362,954.23 1.46 16 113062 常银转债 14,574,371.23 1.39 17 113059 福莱转债 13,536,379.73 1.29 18 118012 微芯转债 13,074,910.78 1.25 19 113641 华友转债 13,039,055.25 1.24 20 118028 会通转债 12,896,666.55 1.23 21 127051 博杰转债 12,753,528.90 1.21 22 113053 隆 22 转债 12,753,528.90 1.21 23 127044 蒙娜转债 12,497,165.59 1.19 24 127061 美锦转债 12,389,657.41 1.18 25 127074 麦米转 2 12,379,481.67 1.18 26 110073 国投转债 12,030,976.25 1.15 27 113044 大秦转债 11,980,608.22 1.14 28 113024 核建转债 11,980,608.22 1.14 29 111008 沿浦转债 11,794,279.56 1.12 30 118025 突瑞转债 11,948,767.87 1.14 31 113045 环旭转债 11,196,431.37 1.07 33 113615 金减转债 11,196,431.37 1.07 33 113615 金减转债 10,248,896.53 0.98	7	123107	温氏转债	22, 210, 175. 34	2. 12
10 111005 富春转债 17,650,011.83 1.66 11 113061 拓普转债 15,967,417.26 1.52 12 113021 中信转债 15,792,213.62 1.56 13 118024 冠宁转债 15,701,817.56 1.56 14 113060 浙 22 转债 15,616,668.27 1.46 15 123156 博汇转债 15,362,954.23 1.46 16 113062 常银转债 14,574,371.23 1.35 17 113059 福莱转债 13,536,379.73 1.25 18 118012 微芯转债 13,074,910.78 1.25 19 113641 华友转债 13,039,055.25 1.24 20 118028 会通转债 12,896,666.55 1.23 21 127051 博杰转债 12,753,528.90 1.21 22 113053 隆 22 转债 12,497,165.59 1.19 23 127044 蒙娜转债 12,497,165.59 1.19 24 127061 美锦转债 12,389,657.41 1.18 25 127074 麦米转2 12,379,481.67 <td< td=""><td>8</td><td>113637</td><td>华翔转债</td><td>22, 168, 971. 51</td><td>2. 11</td></td<>	8	113637	华翔转债	22, 168, 971. 51	2. 11
11 113061 拓普转债 15,967,417.26 1.52 12 113021 中信转债 15,792,213.62 1.56 13 118024 冠字转债 15,701,817.56 1.56 14 113060 游 22 转债 15,616,668.27 1.46 15 123156 博汇转债 15,362,954.23 1.46 16 113062 常银转债 14,574,371.23 1.35 17 113059 福莱转债 13,536,379.73 1.25 18 118012 微芯转债 13,074,910.78 1.25 19 113641 华友转债 13,039,055.25 1.24 20 118028 会通转债 12,896,666.55 1.23 21 127051 博杰转债 12,753,528.90 1.21 22 113053 隆 22 转债 12,555,245.49 1.26 23 127044 蒙娜转债 12,497,165.59 1.19 24 127061 美锦转债 12,389,657.41 1.18 25 127074 麦米转2 12,379,481.67 1.18 26 110073 国投转债 12,030,976.25 <td< td=""><td>9</td><td>128137</td><td>洁美转债</td><td>18, 875, 785. 45</td><td>1.80</td></td<>	9	128137	洁美转债	18, 875, 785. 45	1.80
12 113021 中信转债 15,792,213.62 1.50 13 118024 冠宇转债 15,701,817.56 1.50 14 113060 浙 22 转债 15,616,668.27 1.45 15 123156 博汇转债 15,362,954.23 1.46 16 113062 常银转债 14,574,371.23 1.39 17 113059 福莱转债 13,536,379.73 1.29 18 118012 微芯转债 13,074,910.78 1.25 19 113641 华友转债 13,039,055.25 1.24 20 118028 会通转债 12,896,666.55 1.23 21 127051 博杰转债 12,753,528.90 1.21 22 113053 隆 22 转债 12,555,245.49 1.20 23 127044 蒙娜转债 12,497,165.59 1.19 24 127061 美锦转债 12,389,657.41 1.18 25 127074 麦米转2 12,379,481.67 1.18 26 110073 国投转债 12,030,976.25 1.15 27 113044 大秦转债 11,948,767.87 <td< td=""><td>10</td><td>111005</td><td>富春转债</td><td>17, 650, 011. 83</td><td>1.68</td></td<>	10	111005	富春转债	17, 650, 011. 83	1.68
13 118024 冠宇转债 15,701,817.56 1.50 14 113060 斯 22 转债 15,616,668.27 1.49 15 123156 博汇转债 15,362,954.23 1.46 16 113062 常银转债 14,574,371.23 1.39 17 113059 福莱转债 13,536,379.73 1.29 18 118012 微芯转债 13,074,910.78 1.25 19 113641 华友转债 13,039,055.25 1.24 20 118028 会通转债 12,896,666.55 1.23 21 127051 博杰转债 12,753,528.90 1.21 22 113053 隆 22 转债 12,555,245.49 1.20 23 127044 蒙娜转债 12,497,165.59 1.19 24 127061 美锦转债 12,389,657.41 1.18 25 127074 麦米转2 12,379,481.67 1.18 26 110073 国投转债 12,030,976.25 1.15 27 113044 大秦转债 11,948,767.87 1.14 28 113024 核建转债 11,794,279.56 <td< td=""><td>11</td><td>113061</td><td>拓普转债</td><td>15, 967, 417. 26</td><td>1.52</td></td<>	11	113061	拓普转债	15, 967, 417. 26	1.52
14 113060 浙 22 转债 15,616,668.27 1.48 15 123156 博汇转债 15,362,954.23 1.46 16 113062 常银转债 14,574,371.23 1.35 17 113059 福莱转债 13,536,379.73 1.29 18 118012 微芯转债 13,074,910.78 1.25 19 113641 华友转债 13,039,055.25 1.24 20 118028 会通转债 12,896,666.55 1.23 21 127051 博杰转债 12,753,528.90 1.21 22 113053 隆 22 转债 12,555,245.49 1.20 23 127044 蒙娜转债 12,497,165.59 1.19 24 127061 美锦转债 12,389,657.41 1.18 25 127074 麦米转2 12,379,481.67 1.18 26 110073 国投转债 12,030,976.25 1.15 27 113044 大秦转债 11,980,608.22 1.14 28 113024 核建转债 11,948,767.87 1.14 29 111008 沿浦转债 11,698,166.68 <td< td=""><td>12</td><td>113021</td><td>中信转债</td><td>15, 792, 213. 62</td><td>1.50</td></td<>	12	113021	中信转债	15, 792, 213. 62	1.50
15 123156 博汇转债 15, 362, 954. 23 1. 46 16 113062 常银转债 14, 574, 371. 23 1. 38 17 113059 福莱转债 13, 536, 379. 73 1. 29 18 118012 微芯转债 13, 074, 910. 78 1. 25 19 113641 华友转债 13, 039, 055. 25 1. 24 20 118028 会通转债 12, 896, 666. 55 1. 23 21 127051 博杰转债 12, 753, 528. 90 1. 21 22 113053 隆 22 转债 12, 555, 245. 49 1. 20 23 127044 蒙娜转债 12, 497, 165. 59 1. 19 24 127061 美锦转债 12, 389, 657. 41 1. 18 25 127074 麦米转 2 12, 379, 481. 67 1. 18 26 110073 国投转债 12, 030, 976. 25 1. 15 27 113044 大秦转债 11, 980, 608. 22 1. 14 28 113024 核建转债 11, 948, 767. 87 1. 14 29 111008 沿浦转债 11, 794, 279. 56 1. 12 30 118025	13	118024	冠宇转债	15, 701, 817. 56	1.50
16 113062 常银转债 14,574,371.23 1.38 17 113059 福莱转债 13,536,379.73 1.29 18 118012 微芯转债 13,074,910.78 1.25 19 113641 华友转债 13,039,055.25 1.24 20 118028 会通转债 12,896,666.55 1.23 21 127051 博杰转债 12,753,528.90 1.21 22 113053 隆 22 转债 12,555,245.49 1.20 23 127044 蒙娜转债 12,497,165.59 1.19 24 127061 美锦转债 12,389,657.41 1.18 25 127074 麦米转2 12,379,481.67 1.18 26 110073 国投转债 12,030,976.25 1.15 27 113044 大秦转债 11,980,608.22 1.14 28 113024 核建转债 11,794,279.56 1.12 30 118025 突瑞转债 11,698,166.68 1.11 31 113045 环旭转债 11,698,166.68 1.11 32 127045 牧原转债 11,698,166.68 1.	14	113060	浙 22 转债	15, 616, 668. 27	1.49
17 113059 福莱转债 13,536,379.73 1.29 18 118012 微芯转债 13,074,910.78 1.25 19 113641 华友转债 13,039,055.25 1.24 20 118028 会通转债 12,896,666.55 1.23 21 127051 博杰转债 12,753,528.90 1.21 22 113053 隆 22 转债 12,555,245.49 1.20 23 127044 蒙娜转债 12,497,165.59 1.19 24 127061 美锦转债 12,389,657.41 1.18 25 127074 麦米转 2 12,379,481.67 1.18 26 110073 国投转债 12,030,976.25 1.15 27 113044 大秦转债 11,980,608.22 1.14 28 113024 核建转债 11,948,767.87 1.14 29 111008 沿浦转债 11,794,279.56 1.12 30 118025 突瑞转债 11,698,166.68 1.11 31 113045 环胞转债 11,196,431.37 1.07 33 113615 金城转债 10,427,481.73 0	15	123156	博汇转债	15, 362, 954. 23	1.46
18 118012 微芯转债 13,074,910.78 1.25 19 113641 华友转债 13,039,055.25 1.24 20 118028 会通转债 12,896,666.55 1.23 21 127051 博杰转债 12,753,528.90 1.21 22 113053 隆 22 转债 12,555,245.49 1.20 23 127044 蒙娜转债 12,497,165.59 1.19 24 127061 美锦转债 12,389,657.41 1.18 25 127074 麦米转 2 12,379,481.67 1.18 26 110073 国投转债 12,030,976.25 1.15 27 113044 大秦转债 11,980,608.22 1.14 28 113024 核建转债 11,948,767.87 1.14 29 111008 沿浦转债 11,794,279.56 1.12 30 118025 突瑞转债 11,698,166.68 1.11 31 113045 环旭转债 11,616,469.81 1.11 32 127045 牧原转债 11,196,431.37 1.07 33 113615 金诚转债 10,427,481.73 0	16	113062	常银转债	14, 574, 371. 23	1.39
19 113641 华友转债 13,039,055.25 1.24 20 118028 会通转债 12,896,666.55 1.23 21 127051 博杰转债 12,753,528.90 1.21 22 113053 隆 22 转债 12,555,245.49 1.20 23 127044 蒙娜转债 12,497,165.59 1.19 24 127061 美锦转债 12,389,657.41 1.18 25 127074 麦米转 2 12,379,481.67 1.18 26 110073 国投转债 12,030,976.25 1.15 27 113044 大秦转债 11,980,608.22 1.14 28 113024 核建转债 11,794,279.56 1.12 30 118025 突瑞转债 11,698,166.68 1.11 31 113045 环旭转债 11,698,166.68 1.11 32 127045 牧原转债 11,196,431.37 1.07 33 113615 金诚转债 10,427,481.73 0.98 34 113065 齐鲁转债 10,248,896.53 0.98	17	113059	福莱转债	13, 536, 379. 73	1.29
20 118028 会通转债 12,896,666.55 1.23 21 127051 博杰转债 12,753,528.90 1.21 22 113053 隆 22 转债 12,555,245.49 1.20 23 127044 蒙娜转债 12,497,165.59 1.19 24 127061 美锦转债 12,389,657.41 1.18 25 127074 麦米转 2 12,379,481.67 1.18 26 110073 国投转债 12,030,976.25 1.15 27 113044 大秦转债 11,980,608.22 1.14 28 113024 核建转债 11,948,767.87 1.14 29 111008 沿浦转债 11,794,279.56 1.12 30 118025 突瑞转债 11,698,166.68 1.11 31 113045 环地转债 11,616,469.81 1.11 32 127045 牧原转债 11,196,431.37 1.07 33 113615 金诚转债 10,427,481.73 0.98 34 113065 齐鲁转债 10,248,896.53 0.98	18	118012	微芯转债	13, 074, 910. 78	1.25
21 127051 博杰转债 12,753,528.90 1.21 22 113053 隆 22 转债 12,555,245.49 1.20 23 127044 蒙娜转债 12,497,165.59 1.19 24 127061 美锦转债 12,389,657.41 1.18 25 127074 麦米转 2 12,379,481.67 1.18 26 110073 国投转债 12,030,976.25 1.15 27 113044 大秦转债 11,980,608.22 1.14 28 113024 核建转债 11,948,767.87 1.14 29 111008 沿浦转债 11,794,279.56 1.12 30 118025 突瑞转债 11,698,166.68 1.11 31 113045 环旭转债 11,616,469.81 1.11 32 127045 牧原转债 11,196,431.37 1.07 33 113615 金诚转债 10,427,481.73 0.98 34 113065 齐鲁转债 10,248,896.53 0.98	19	113641	华友转债	13, 039, 055. 25	1.24
22 113053 隆 22 转债 12,555,245.49 1.20 23 127044 蒙娜转债 12,497,165.59 1.19 24 127061 美锦转债 12,389,657.41 1.18 25 127074 麦米转 2 12,379,481.67 1.18 26 110073 国投转债 12,030,976.25 1.15 27 113044 大秦转债 11,980,608.22 1.14 28 113024 核建转债 11,948,767.87 1.14 29 111008 沿浦转债 11,794,279.56 1.12 30 118025 突瑞转债 11,698,166.68 1.11 31 113045 环旭转债 11,616,469.81 1.11 32 127045 牧原转债 11,196,431.37 1.07 33 113615 金诚转债 10,427,481.73 0.99 34 113065 齐鲁转债 10,248,896.53 0.98	20	118028	会通转债	12, 896, 666. 55	1. 23
23 127044 蒙娜转债 12,497,165.59 1.19 24 127061 美锦转债 12,389,657.41 1.18 25 127074 麦米转2 12,379,481.67 1.18 26 110073 国投转债 12,030,976.25 1.15 27 113044 大秦转债 11,980,608.22 1.14 28 113024 核建转债 11,948,767.87 1.14 29 111008 沿浦转债 11,794,279.56 1.12 30 118025 突瑞转债 11,698,166.68 1.11 31 113045 环旭转债 11,616,469.81 1.11 32 127045 牧原转债 11,196,431.37 1.07 33 113615 金诚转债 10,427,481.73 0.98 34 113065 齐鲁转债 10,248,896.53 0.98	21	127051	博杰转债	12, 753, 528. 90	1.21
24 127061 美锦转债 12,389,657.41 1.18 25 127074 麦米转 2 12,379,481.67 1.18 26 110073 国投转债 12,030,976.25 1.15 27 113044 大秦转债 11,980,608.22 1.14 28 113024 核建转债 11,948,767.87 1.14 29 111008 沿浦转债 11,794,279.56 1.12 30 118025 突瑞转债 11,698,166.68 1.11 31 113045 环旭转债 11,616,469.81 1.11 32 127045 牧原转债 11,196,431.37 1.07 33 113615 金诚转债 10,427,481.73 0.99 34 113065 齐鲁转债 10,248,896.53 0.98	22	113053	隆 22 转债	12, 555, 245. 49	1.20
25 127074 麦米转 2 12, 379, 481. 67 1. 18 26 110073 国投转债 12, 030, 976. 25 1. 15 27 113044 大秦转债 11, 980, 608. 22 1. 14 28 113024 核建转债 11, 948, 767. 87 1. 14 29 111008 沿浦转债 11, 794, 279. 56 1. 12 30 118025 突瑞转债 11, 698, 166. 68 1. 11 31 113045 环旭转债 11, 616, 469. 81 1. 11 32 127045 牧原转债 11, 196, 431. 37 1. 07 33 113615 金诚转债 10, 427, 481. 73 0. 98 34 113065 齐鲁转债 10, 248, 896. 53 0. 98	23	127044	蒙娜转债	12, 497, 165. 59	1. 19
26 110073 国投转债 12,030,976.25 1.15 27 113044 大秦转债 11,980,608.22 1.14 28 113024 核建转债 11,948,767.87 1.14 29 111008 沿浦转债 11,794,279.56 1.12 30 118025 奕瑞转债 11,698,166.68 1.11 31 113045 环旭转债 11,616,469.81 1.11 32 127045 牧原转债 11,196,431.37 1.07 33 113615 金诚转债 10,427,481.73 0.98 34 113065 齐鲁转债 10,248,896.53 0.98	24	127061	美锦转债	12, 389, 657. 41	1.18
27 113044 大秦转债 11,980,608.22 1.14 28 113024 核建转债 11,948,767.87 1.14 29 111008 沿浦转债 11,794,279.56 1.12 30 118025 奕瑞转债 11,698,166.68 1.11 31 113045 环旭转债 11,616,469.81 1.11 32 127045 牧原转债 11,196,431.37 1.07 33 113615 金诚转债 10,427,481.73 0.98 34 113065 齐鲁转债 10,248,896.53 0.98	25	127074	麦米转 2	12, 379, 481. 67	1.18
28 113024 核建转债 11,948,767.87 1.14 29 111008 沿浦转债 11,794,279.56 1.12 30 118025 奕瑞转债 11,698,166.68 1.11 31 113045 环旭转债 11,616,469.81 1.11 32 127045 牧原转债 11,196,431.37 1.07 33 113615 金诚转债 10,427,481.73 0.98 34 113065 齐鲁转债 10,248,896.53 0.98	26	110073	国投转债	12, 030, 976. 25	1.15
29 111008 沿浦转债 11,794,279.56 1.12 30 118025 奕瑞转债 11,698,166.68 1.11 31 113045 环旭转债 11,616,469.81 1.11 32 127045 牧原转债 11,196,431.37 1.07 33 113615 金诚转债 10,427,481.73 0.98 34 113065 齐鲁转债 10,248,896.53 0.98	27	113044	大秦转债	11, 980, 608. 22	1.14
30 118025 奕瑞转债 11,698,166.68 1.11 31 113045 环旭转债 11,616,469.81 1.11 32 127045 牧原转债 11,196,431.37 1.07 33 113615 金诚转债 10,427,481.73 0.99 34 113065 齐鲁转债 10,248,896.53 0.98	28	113024	核建转债	11, 948, 767. 87	1.14
31 113045 环旭转债 11,616,469.81 1.11 32 127045 牧原转债 11,196,431.37 1.07 33 113615 金诚转债 10,427,481.73 0.99 34 113065 齐鲁转债 10,248,896.53 0.98	29	111008	沿浦转债	11, 794, 279. 56	1.12
32 127045 牧原转债 11,196,431.37 1.07 33 113615 金诚转债 10,427,481.73 0.99 34 113065 齐鲁转债 10,248,896.53 0.98	30	118025	奕瑞转债	11, 698, 166. 68	1.11
33 113615 金诚转债 10,427,481.73 0.99 34 113065 齐鲁转债 10,248,896.53 0.98	31	113045	环旭转债	11, 616, 469. 81	1.11
34 113065 齐鲁转债 10,248,896.53 0.98	32	127045	牧原转债	11, 196, 431. 37	1.07
- 	33	113615	金诚转债	10, 427, 481. 73	0.99
35 113054 绿动转债 10,075,730.17 0.96	34	113065	齐鲁转债	10, 248, 896. 53	0.98
	35	113054	绿动转债	10, 075, 730. 17	0.96

		1		
36	113675	新 23 转债	10, 021, 609. 40	0.95
37	127049	希望转 2	10, 009, 844. 29	0.95
38	127086	恒邦转债	9, 905, 714. 53	0.94
39	118034	晶能转债	9, 797, 000. 84	0.93
40	113623	凤 21 转债	9, 570, 857. 62	0.91
41	123133	佩蒂转债	9, 467, 386. 52	0.90
42	110082	宏发转债	9, 179, 194. 30	0.87
43	113055	成银转债	9, 104, 162. 95	0.87
44	113616	韦尔转债	8, 586, 905. 76	0.82
45	118015	芯海转债	8, 542, 146. 65	0.81
46	127088	赫达转债	8, 164, 485. 25	0.78
47	123132	回盛转债	7, 518, 259. 93	0.72
48	113545	金能转债	7, 253, 070. 88	0.69
49	123108	乐普转 2	7, 140, 764. 97	0.68
50	118043	福立转债	7, 099, 708. 38	0.68
51	113593	沪工转债	6, 035, 982. 25	0. 57
52	111010	立昂转债	5, 378, 127. 11	0.51
53	127041	弘亚转债	5, 210, 925. 56	0.50
54	123131	奥飞转债	4, 951, 410. 34	0. 47
55	110048	福能转债	4, 809, 193. 98	0.46
56	118041	星球转债	4, 464, 195. 12	0. 43
57	113654	永 02 转债	4, 345, 987. 98	0.41
58	128136	立讯转债	4, 305, 397. 77	0.41
59	118018	瑞科转债	4, 093, 486. 66	0. 39
60	123090	三诺转债	3, 931, 029. 97	0. 37
61	110077	洪城转债	3, 884, 004. 71	0. 37
62	118030	睿创转债	3, 810, 567. 25	0. 36
63	113657	再 22 转债	3, 774, 990. 25	0. 36
64	127076	中宠转 2	3, 693, 071. 55	0.35
65	118035	国力转债	3, 496, 556. 12	0. 33
66	127050	麒麟转债	3, 456, 227. 00	0. 33
67	110094	众和转债	3, 074, 734. 34	0. 29
68	113632	鹤 21 转债	2, 971, 235. 41	0. 28
69	113618	美诺转债	2, 843, 272. 70	0. 27
70	123118	惠城转债	2, 821, 184. 55	0. 27
71	127063	贵轮转债	2, 805, 845. 98	0.27
72	123222	博俊转债	2, 792, 217. 05	0.27
73	127083	山路转债	2, 587, 369. 18	0.25
74	118013	道通转债	2, 272, 549. 57	0.22
75	110086	精工转债	2, 093, 860. 87	0.20
76	110068	龙净转债	2, 086, 680. 36	0.20
77	123178	花园转债	1, 944, 888. 85	0.19

78	127037	银轮转债	1, 827, 052. 64	0.17
79	111017	蓝天转债	1, 797, 400. 37	0.17
80	113650	博 22 转债	1, 745, 374. 16	0.17
81	127089	晶澳转债	1, 685, 406. 39	0.16
82	123124	晶瑞转 2	1, 632, 582. 01	0.16
83	118014	高测转债	1, 441, 789. 56	0.14

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	268, 251, 793. 56	315, 321, 299. 40
报告期期间基金总申购份额	7, 493, 052. 06	293, 752, 228. 38
减:报告期期间基金总赎回份额	42, 612, 642. 37	129, 562, 449. 86
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	233, 132, 203. 25	479, 511, 077. 92

§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

		报告	前期内持有基金份	分额变化情况		报告期末持	有基金情况
投资者类别	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1 月1日至 2024年2 月22日; 2024年2 月26日至 2024年2

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4月22日