

长信利发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：上海浦东发展银行股份有限公司

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。

基金托管人上海浦东发展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	长信利发债券
场内简称	长信利发
基金主代码	519933
前端交易代码	519933
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 6 月 28 日
报告期末基金份额总额	65,297,387.40 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，力求为投资者提供稳定增长的投资收益。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金将利用全球信息平台、外部研究平台、行业信息平台以及自身的研究平台等信息资源，基于本基金的投资目标和投资理念，从宏观和微观两个角度进行研究，开展战略资产配置，之后通过战术资产配置再平衡基金资产组合，实现组合内各类别资产的优化配置，并对各类资产的配置比例进行定期或不定期调整。</p> <p>2、债券投资策略</p> <p>本基金主要采用积极管理型的投资策略，自上而下分为战略性策略和战术性策略两个层面，结合对各市场上不同投资品种的具体分析，共同构成本基金的投资策略结构。</p> <p>3、股票投资策略：</p> <p>在行业配置层面，本基金将运用“自上而下”的行业配置方法，通过对国内外宏观经济走势、经济结构转型的方向、国家经济与产业政策导向和经济周期调整的深入研究，采用价值理念与成长理念相结</p>

	<p>合的方法来对行业进行筛选。</p> <p>本基金将结合定性与定量分析，主要采取自下而上的选股策略。基金依据约定的投资范围，基于对上市公司的品质评估分析、风险因素分析和估值分析，筛选出基本面良好的股票进行投资，在有效控制风险前提下，争取实现基金资产的长期稳健增值。</p> <p>本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。</p> <p>4、其他类型资产投资策略</p> <p>在法律法规或监管机构允许的情况下，本基金将在严格控制投资风险的基础上适当参与权证、资产支持证券等金融工具的投资。</p>
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，其预期风险和收益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	上海浦东发展银行股份有限公司

§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）
1. 本期已实现收益	221,280.73
2. 本期利润	150,332.41
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0023
4. 期末基金资产净值	72,530,993.40
5. 期末基金份额净值	1.1108

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

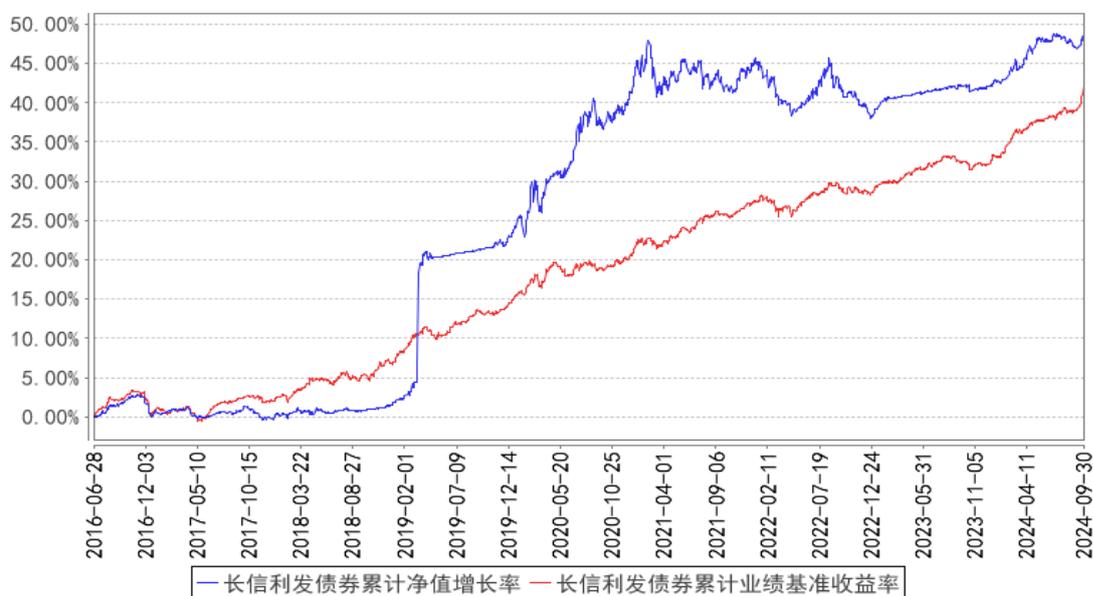
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.22%	0.14%	2.73%	0.15%	-2.51%	-0.01%
过去六个月	2.65%	0.15%	4.18%	0.12%	-1.53%	0.03%
过去一年	4.63%	0.14%	7.26%	0.12%	-2.63%	0.02%
过去三年	4.86%	0.18%	13.02%	0.11%	-8.16%	0.07%
过去五年	22.48%	0.26%	25.75%	0.12%	-3.27%	0.14%
自基金合同 生效起至今	48.74%	0.32%	42.12%	0.12%	6.62%	0.20%

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

长信利发债券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 2016 年 6 月 28 日至 2024 年 9 月 30 日。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效日起 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		
程放	长信先优债券型证券投资基金、长信利发	2020 年 12 月 31 日	-	11 年	北京大学金融学硕士毕业，具有基金从业资格，中国国籍。曾任职于广发银行股份有限公司、兴银基金管理有限责任公司，

债券型证券投资基金、长信先锐混合型证券投资基金和长信乐信灵活配置混合型证券投资基金的基金经理				2020 年 8 月加入长信基金管理有限责任公司, 曾任长信合利混合型证券投资基金的基金经理, 现任长信先优债券型证券投资基金、长信利发债券型证券投资基金、长信先锐混合型证券投资基金和长信乐信灵活配置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

报告期内，国内宏观经济整体复苏，金融数据逐步进入新常态区间，PMI 指数仍在 50% 区间以下，整体国内经济仍在走高质量发展道路，“量增价弱”的情况仍比较明显。9 月末，高层会议

直面宏观经济中面临的各项问题，有效的提振了市场参与者信心，整体看，权益市场出现较大幅度上涨，债券市场宽幅震荡后出现一定调整。

组合管理层面，我们整体淡化大幅择时，更关注行业的胜率而非赔率。根据投资框架定位，报告期整体关注大盘价值和低估值因子，同时逐步根据市场情况加仓了一些我们认为估值已经调整幅度较大的行业龙头个股。我们认为低估值、自由现金流优异、业绩稳定增长的行业，更加适合在复苏初期获得确定性收益。在权益市场中，部分成长风格个股估值调整至较低水平，我们看好估值回到相对正常的状态。当前位置权益市场下行空间有限，但跟随行业景气度和高频数据进行切换的难度加大。

债券资产方面，后续货币政策或仍会保持相对宽松。我们认为虽然当前收益率水平处于相对低位，债券资产仍具备一定投资机会，组合管理中保持中性偏高久期，维持中高等级信用债配置。可转债方面，市场在报告期内转股溢价率已经压缩至相对偏低水平。组合坚持对于可转债资产绝对收益增强思路，在转债市场整体回调过程中整体回撤较小，在市场下行过程中逐步加仓偏债型品种，同时适度参与部分平衡型转债的投资机会。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2024 年 9 月 30 日，长信利发债券份额净值为 1.1108 元，份额累计净值为 1.4399 元，本报告期内长信利发债券净值增长率为 0.22%，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	8,643,049.00	11.42
	其中：股票	8,643,049.00	11.42
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	61,112,800.26	80.78
	其中：债券	61,112,800.26	80.78
	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	3,612,637.77	4.78
8	其他资产	2,286,945.54	3.02
9	合计	75,655,432.57	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	1,318,140.00	1.82
C	制造业	5,114,424.00	7.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,130,100.00	1.56
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	1,080,385.00	1.49
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	-	-
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	8,643,049.00	11.92

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	600900	长江电力	20,000	601,000.00	0.83
2	601985	中国核电	45,000	501,750.00	0.69
3	601899	紫金矿业	27,000	489,780.00	0.68

4	601058	赛轮轮胎	27,000	433,080.00	0.60
5	601601	中国太保	10,000	391,000.00	0.54
6	000951	中国重汽	20,000	347,600.00	0.48
7	600036	招商银行	9,000	338,490.00	0.47
8	002415	海康威视	10,000	322,900.00	0.45
9	603279	景津装备	14,000	292,320.00	0.40
10	600309	万华化学	3,000	273,960.00	0.38

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	14,586,395.89	20.11
2	央行票据	-	-
3	金融债券	27,799,006.25	38.33
	其中：政策性金融债	5,146,754.10	7.10
4	企业债券	6,087,808.77	8.39
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	8,076,958.85	11.14
7	可转债（可交换债）	4,562,630.50	6.29
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	61,112,800.26	84.26

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	019727	23 国债 24	70,000	7,154,613.70	9.86
2	115272	23 海通 07	60,000	6,087,808.77	8.39
3	092280134	22 工行二级资本 债 04A	50,000	5,231,885.25	7.21
4	232480003	24 恒丰银行二级 资本债 01	50,000	5,181,860.66	7.14
5	240203	24 国开 03	50,000	5,146,754.10	7.10

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持有国债期货。

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持有国债期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

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，发行主体海通证券股份有限公司于 2024 年 2 月 1 日收到中国证券监督管理委员会上海监管局关于对海通证券股份有限公司采取责令处分有关人员措施的决定（沪证监决〔2024〕37 号），经查，公司存在以下情形：场外期权业务相关内部控制不健全，未建立健全覆盖场外期权业务各环节的内部管理制度；未明确部门层级风险指标超限额的报告路径和处理办法；场外衍生品业务相关风险指标体系不健全。根据《证券公司监督管理条例》（国务院令 第 653 号）第七十条第一款第三项、《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法》第三十二条第二款的规定，中国证券监督管理委员会上海监管局责令海通证券在收到决定之日起 10 个工作日内，根据公司内部管理规定，作出处分相关人员的决定，并在作出决定之日起 3 个工作日之内向中国证券监督管理委员会上海监管局书面报告。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体海通证券股份有限公司于 2024 年 4 月 12 日收到中国证券监督管理委员会《立案告知书》（证监立案字 03720240050 号），因公司在相关主体违反限制性规定转让中核钛白 2023 年非公开发行股票过程中涉嫌违法违规，根据《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国行政处罚法》等法律法规，中国证监会决定于 2024 年 3 月 13 日对海通证券股份有限公司进行立案。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体海通证券股份有限公司于 2024 年 4 月 19 日收到中国证券监督管理委员会《行政处罚事先告知书》（处罚字〔2024〕56 号），于 2024 年 4 月 30 日收到《中国证监会行政处罚决定书（王泽龙、洪浩炜、中信中证、中信证券、海通证券、韩雨辰）》（〔2024〕45 号），经查，海通证券存在以自己名义按照中信中证的报价指令认购中核钛白

非公开发行股票，客观上帮助中信中证及其客户取得股票收益，使得定增套利行为得以实现的行为，依据《证券法》第一百八十六条及第一百九十七条第二款的规定，对海通证券股份有限公司违反限制性规定转让股票的违法行为，责令改正，给予警告，没收违法所得 789,445.21 元，并处以 6,975,000 元罚款。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体海通证券股份有限公司于 2024 年 4 月 29 日收到中国证券监督管理委员会上海监管局《关于对海通证券股份有限公司采取责令改正措施的决定》沪证监决〔2024〕180 号，经查，海通证券存在以下情形：一、未审慎评估个别股票质押合约标的证券的风险，股票质押业务风险管理不审慎，未审慎评估个别股票质押合约融资资金用途，不符合《证券公司股票质押式回购交易业务风险管理指引（试行）》（中证协发〔2015〕54 号）第十四条第三项、第五项，《证券公司参与股票质押式回购交易风险管理指引》（中证协发〔2018〕13 号）第五条、第三十五条的规定；二、未审慎开展收益互换业务，不符合《证券公司收益互换业务管理办法》（中证协发〔2021〕276 号）第三条的规定；与个别风险管理需求不足的客户开展场外期权业务，不符合《证券公司场外期权业务管理办法》（中证协发〔2020〕104 号）第四条的规定；三、个别风险债券投资内部控制程序不健全，不符合《证券公司内部控制指引》（证监机构字〔2003〕260 号）第七条第一项的规定；四、另类投资子公司投资的个别私募基金实际投资标的超出另类投资子公司业务范围，不符合《证券公司另类投资子公司管理规范》（中证协发〔2016〕253 号）第二条的规定。上述情形违反了《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法》（证监会令第 133 号）第六条、《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法》（证监会令第 166 号修正）第六条的规定。根据《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法》（证监会令第 133 号）第三十二条第一款、《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法》（证监会令第 166 号修正）第三十二条第一款的规定，中国证券监督管理委员会上海监管局决定对海通证券股份有限公司采取责令改正的监督管理措施。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体海通证券股份有限公司于 2024 年 4 月 12 日收到中国证券监督管理委员会广东监管局关于对海通证券股份有限公司采取责令改正监管措施的决定（〔2024〕36 号），经查，海通证券股份有限公司作为格力地产股份有限公司债券“21 格地 02”“22 格地 02”的主承销商和受托管理人，未对个别存货周边楼盘开盘价格低于项目楼面价的情况予以审慎分析核查；在“22 格地 02”期后事项核查中，未对存货可变现净值的评估进行持续关注 and 尽职调查；未制作咨询审计机构工作底稿；未对发行人重大损失披露临时受托管理事务报告；对发行人差错更正事项披露临时受托管理事务报告不及时，不符合《公司债券承销业务尽职调查指引（2020 年）》第三条、第五条、第十一条、第二十一条，《证券公司投资银行类业务内部

控制指引（证监会公告〔2018〕6号）》第六十三条，《公司债券受托管理人执业行为准则（2022年）》第十二条、第十八条等要求，违反了《公司债券发行与交易管理办法》（证监会令第113号）第七条、《公司债券发行与交易管理办法》（证监会令第180号）第六条第一款的规定。根据《公司债券发行与交易管理办法》（证监会令第113号）第五十八条、《公司债券发行与交易管理办法》（证监会令第180号）第六十八条的规定，中国证券监督管理委员会广东监管局决定对海通证券股份有限公司采取责令改正的行政监管措施。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体中国建设银行股份有限公司于2023年11月22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〕29号），经查，中国建设银行股份有限公司存在以下情况：一、单个网点在同一会计年度内与超过3家保险公司开展保险业务合作；二、违规通过储蓄柜台销售投资连结型保险产品；三、代销利益不确定的保险产品未按规定提供完整合同材料；四、未将超过规定年龄客户的保单材料转至保险公司核保并出单，且销售的部分保险产品属于保单利益不确定型；五、向客户销售高于其风险承受能力的保险产品；六、代销公募基金产品违规采用低风险评级；七、无资格人员销售基金产品；八、违规代销非持牌机构发行的私募基金产品；九、违规代销开发商或其控股股东不具备二级及以上房地产开发资质的房地产信托产品；十、资金用途监控不到位，信贷资金违规购买建设银行代销的基金、信托、资管及自营理财产品；十一、违规为风险承受能力不达标的客户办理代理上海金交所交易业务；十二、未按规定提前公示即调高代理上海金交所现货延期业务手续费；十三、个人账户贵金属业务不符合客户适当性要求；十四、违规收取个人客户唯一账户年费和小额账户管理费；十五、对分支机构执行小微企业查询与补单费优惠政策管控不到位；十六、内部控制不力，导致部分分支机构对总行减免优惠措施执行不到位；十七、对部分分支机构违规收取小微企业财务顾问费管控不到位；十八、违反质价相符原则收取财务顾问费。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，《中华人民共和国商业银行法》第五十条、第七十三条及相关审慎经营规则，国家金融监督管理总局决定对中国建设银行没收违法所得并处罚款合计3791.879382万元。其中，总行2041.879382万元，分支机构1750万元。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体中国建设银行股份有限公司于2023年12月27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〕41号），经查，中国建设银行股份有限公司存在以下情况：一、并表管理内部审计存在不足；二、母行对境外机构案件管理不到位；三、未及时报告境外子行高级管理人员任职情况；四、监管检查发现问题整改不力。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建设银行处罚款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。

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 2024 年 7 月 17 日收到国家金融监督管理总局福建监管局行政处罚信息公开表（闽金罚决字〔2024〕12 号），经查，兴业银行股份有限公司存在以下情况：一、未严格按照公布的收费价目名录收费；二、向小微企业贷款客户转嫁抵押评估费；三、企业划型管理不到位。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、第四十八条及相关审慎经营规则，以及《中华人民共和国商业银行法》第七十三条，国家金融监督管理总局福建监管局决定对兴业银行股份有限公司合计处以 190 万元罚款并对相关人员进行警告。

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	21,382.08

2	应收证券清算款	2,265,333.64
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	229.82
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	2,286,945.54

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	113056	重银转债	322,652.47	0.44
2	123152	润禾转债	186,542.99	0.26
3	113623	凤 21 转债	170,652.95	0.24
4	118028	会通转债	168,671.51	0.23
5	118044	赛特转债	168,206.30	0.23
6	123219	宇瞳转债	159,595.07	0.22
7	127082	亚科转债	142,446.90	0.20
8	123147	中辰转债	139,374.81	0.19
9	123199	山河转债	136,597.97	0.19
10	128144	利民转债	132,802.85	0.18
11	128083	新北转债	128,405.95	0.18
12	110052	贵广转债	126,972.60	0.18
13	123229	艾录转债	124,695.53	0.17
14	111008	沿浦转债	124,197.92	0.17
15	118037	上声转债	121,375.34	0.17
16	113058	友发转债	120,575.48	0.17
17	113666	爱玛转债	119,381.10	0.16
18	127041	弘亚转债	119,296.30	0.16
19	123237	佳禾转债	118,498.36	0.16
20	123076	强力转债	116,378.90	0.16
21	127076	中宠转 2	115,468.96	0.16
22	110090	爱迪转债	115,037.53	0.16
23	127090	兴瑞转债	114,960.49	0.16
24	110093	神马转债	114,564.47	0.16
25	118012	微芯转债	111,971.45	0.15
26	128081	海亮转债	111,898.79	0.15
27	127101	豪鹏转债	111,796.08	0.15
28	123218	宏昌转债	110,496.99	0.15
29	118033	华特转债	110,002.60	0.15
30	123169	正海转债	107,223.53	0.15
31	113654	永 02 转债	104,087.12	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

报告期期初基金份额总额	66,139,915.17
报告期期间基金总申购份额	324,486.20
减：报告期期间基金总赎回份额	1,167,013.97
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	65,297,387.40

§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 (%)
机构	1	2024 年 7 月 1 日至 2024 年 9 月 30 日	53,355,132.67	0.00	0.00	53,355,132.67	81.71
产品特有风险							
<p>1、基金净值大幅波动的风险</p> <p>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>							

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、《长信利发债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长信利发债券型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《长信利发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