

长信可转债债券型证券投资基金 2022年第2季度报告

2022年6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：平安银行股份有限公司

报告送出日期：2022年7月21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 2022 年 7 月 19 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 2022 年 4 月 1 日起至 2022 年 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	长信可转债债券	
基金主代码	519977	
基金运作方式	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	699,168,514.66 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），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	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
报告期末下属分级基金的份额总额	382,414,983.63 份	316,753,531.03 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（2022 年 4 月 1 日-2022 年 6 月 30 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	-24,604,569.11	-15,335,843.45
2. 本期利润	46,672,055.09	35,909,498.19
3. 加权平均基金份额本期利润	0.1077	0.1241
4. 期末基金资产净值	685,453,193.24	546,974,938.49
5. 期末基金份额净值	1.7924	1.7268

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	7.33%	1.00%	4.23%	0.53%	3.10%	0.47%
过去六个月	-6.52%	1.06%	-3.01%	0.65%	-3.51%	0.41%
过去一年	5.99%	0.94%	6.79%	0.57%	-0.80%	0.37%
过去三年	37.60%	0.88%	30.54%	0.55%	7.06%	0.33%

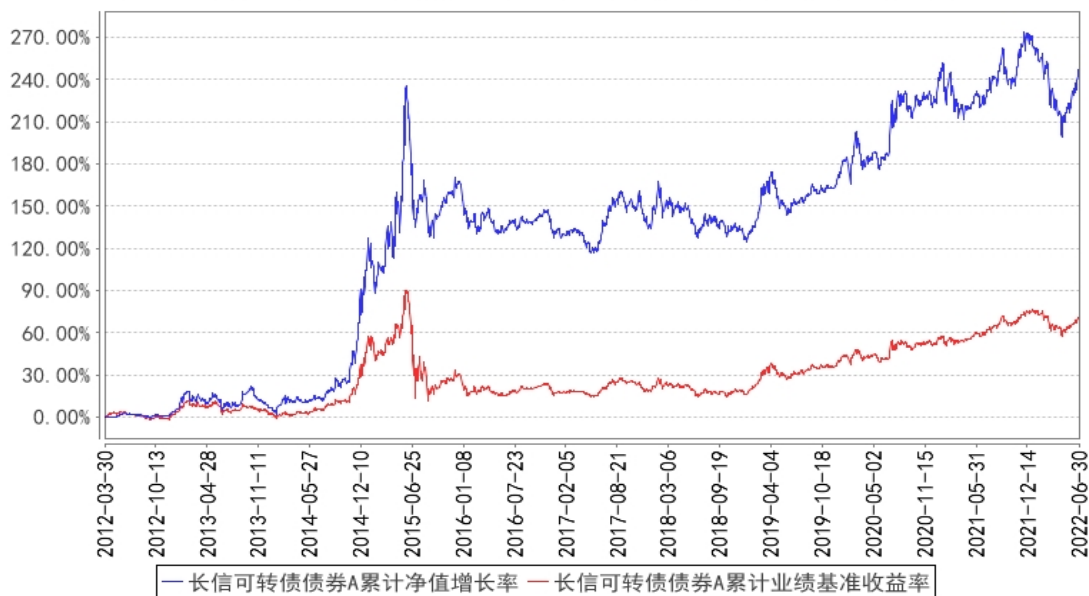
过去五年	46.46%	0.88%	41.98%	0.56%	4.48%	0.32%
自基金合同 生效起至今	246.88%	1.14%	70.65%	0.93%	176.23%	0.21%

长信可转债债券 C

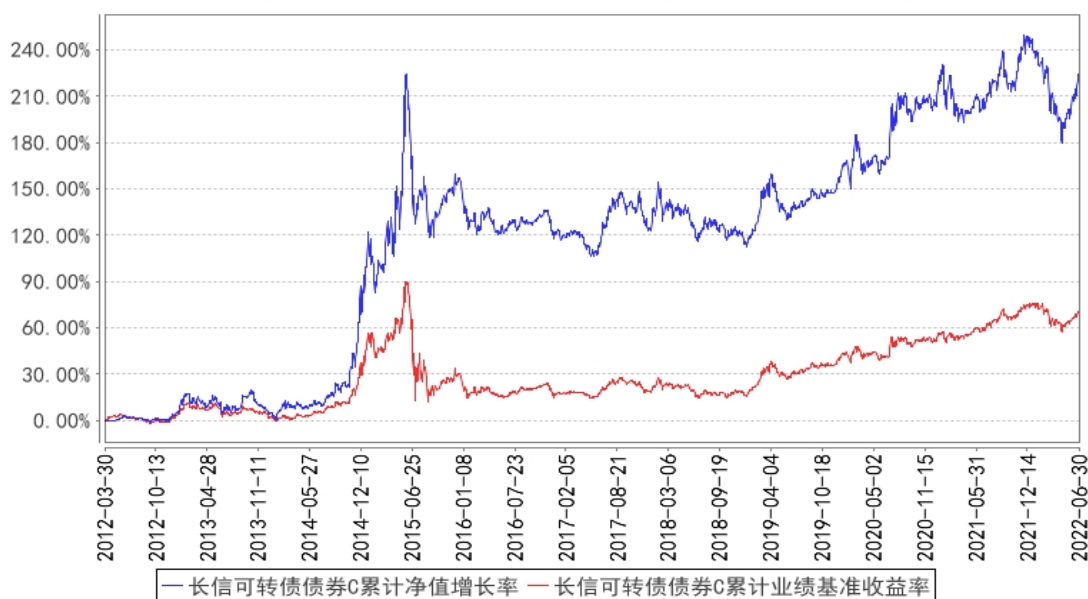
阶段	净值增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	7.24%	1.00%	4.23%	0.53%	3.01%	0.47%
过去六个月	-6.68%	1.06%	-3.01%	0.65%	-3.67%	0.41%
过去一年	5.62%	0.94%	6.79%	0.57%	-1.17%	0.37%
过去三年	36.05%	0.88%	30.54%	0.55%	5.51%	0.33%
过去五年	43.46%	0.88%	41.98%	0.56%	1.48%	0.32%
自基金合同 生效起至今	223.81%	1.14%	70.65%	0.93%	153.16%	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 2022 年 6 月 30 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	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、长信利尚一年定期开放混合型证券投资基金、长信稳健精选混合型证券投资	2018 年 12 月 8 日	-	23 年	香港大学工商管理硕士，具有基金从业资格。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、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，曾任长信中证可转债及可交换债券 50 指数证券投资基金的基金经理，现任公司总经理助理、投资决策委员会执行委员兼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、长信利尚一年定

	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、总经理助理、投资决策委员会执行委员				期开放混合型证券投资基金、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	长信价值优选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、长信利丰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	-	7 年	清华大学管理科学与工程硕士，具有基金从业资格。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和长信先利半年定期开放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、长信利丰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。
倪伟	长信可转债债券型证券投资基金、长信利众债券型证券投资基金 (LOF)、长信利尚一年定期开放混合型证券投资基金、长信先利半年定期开放混合型	2019 年 9 月 17 日	-	7 年	上海财经大学法律硕士，具有基金从业资格。曾任职于中国工商银行股份有限公司和中信证券股份有限公司，2019 年 7 月加入长信基金管理有限责任公司，曾任长信中证可转债及可交换债券 50 指数证券投资基金的基金经理，现任长信可转债债券型证券投资基金、长信利众债券型证券投资基金 (LOF)、长信利尚一年定期开放混合型证券投资基金、长信

	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				先利半年定期开放混合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。
--	---------------------------	--	--	--	---------------------------------------

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

二季度，尤其是 5-6 月之后，在国内疫情核心矛盾缓解，海外通胀等影响转弱的利好推动下，权益市场反弹超预期。一方面在分子端，企业盈利预期修复，未来经济或将回升；另一方面在分

母端，估值修复，剩余流动性宽裕，市场风险偏好也明显提升。转债随着股票市场反弹，估值有所抬升，二季度中证转债指数上涨 4.68%。在反弹过程中，光伏及新能源车相关标的表现抢眼。

二季度，在底部区域我们逐步加仓了部分高景气赛道成长龙头转债，后期随着反弹逐步兑现收益，把仓位控制在合理水平。

展望三季度，疫情防控已经取得阶段性成果，随着复工复产逐步推进、稳增长政策逐步落地，经济将继续向复苏过渡，三季度整体基本面也将进一步改善。海外方面，俄乌冲突导致能源价格飙升，叠加美国劳动力市场高企的薪资价格，共同推高海外通胀水平，联储年内加息步伐或许不会停止。

三季度，市场流动性有望保持充裕，驱动力更多转向经济基本面的实际改善，同时各项利好政策或会持续推进，市场有望保持交易活跃度，并且形成板块间的良性轮动。期间伴随业绩的验证，阶段性也会有所波动。关注的方向中，光伏、新能源车、军工依然是景气较好的行业。其它板块也有边际向好，例如经济复苏，需求修复的疫后出行餐饮等，以及上涨供给约束下的能源石化、生猪养殖等。转债市场估值目前又回到历史较高水平，市场存在结构性机会，后续需要密切跟踪可能出现的拐点，结构上重点关注：一是高景气赛道的趋势延续，二是景气反转且安全边际较高的方向，包括金融、基建、医药消费等。

下一阶段我们将继续保持审慎严谨的态度，密切关注经济走势和政策动向，适度调整组合股票和转债部分的行业分布和个股集中度，自下而上挖掘个券，加强流动性管理，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 2022 年 6 月 30 日，长信可转债债券 A 基金份额净值为 1.7924 元，份额累计净值为 2.7524 元，本报告期内长信可转债债券 A 净值增长率为 7.33%；长信可转债债券 C 基金份额净值为 1.7268 元，份额累计净值为 2.6338 元，本报告期内长信可转债债券 C 净值增长率为 7.24%，同期业绩比较基准收益率为 4.23%。

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	238,946,451.02	17.31
	其中：股票	238,946,451.02	17.31
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,104,170,397.63	79.98
	其中：债券	1,104,170,397.63	79.98
	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	25,388,798.20	1.84
8	其他资产	12,092,831.18	0.88
9	合计	1,380,598,478.03	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	6,526,988.10	0.53
C	制造业	152,930,700.32	12.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	8,596,000.00	0.70
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	3,932,758.00	0.32
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,425,372.00	0.85
J	金融业	24,025,050.80	1.95
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	23,402,915.00	1.90
M	科学研究和技术服务业	6,376,666.80	0.52
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	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	2,730,000.00	0.22
S	综合	-	-
	合计	238,946,451.02	19.39

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	2,000,028	42,340,592.76	3.44
2	601888	中国中免	74,300	17,306,699.00	1.40
3	000733	振华科技	120,000	16,316,400.00	1.32
4	000768	中航西飞	450,000	13,630,500.00	1.11
5	300059	东方财富	490,102	12,448,590.80	1.01
6	300033	同花顺	120,400	11,576,460.00	0.94
7	300253	卫宁健康	1,187,400	10,425,372.00	0.85
8	601012	隆基绿能	144,900	9,654,687.00	0.78
9	601390	中国中铁	1,400,000	8,596,000.00	0.70
10	600600	青岛啤酒	65,852	6,843,339.84	0.56

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	67,831,405.62	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	10,312,479.45	0.84
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	1,026,026,512.56	83.25
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,104,170,397.63	89.59

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	113641	华友转债	761,760	102,613,392.12	8.33
2	113052	兴业转债	700,000	78,170,073.98	6.34
3	113053	隆 22 转债	455,100	62,784,498.77	5.09
4	110085	通 22 转债	318,680	50,130,171.31	4.07
5	132026	G 三峡 EB2	441,530	49,471,924.41	4.01

**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, 发行主体兴业银行股份有限公司于 2022 年 3 月 21 日收到中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表(银保监罚决字(2022)22 号), 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, 经查, 兴业银行监管标准化数据(EAST)系统数据质量及数据报送存在以下违法违规行为: 一、漏报贸易融资业务 EAST 数据; 二、漏报贷款核销业务 EAST 数据; 三、漏报信贷资产转让业务 EAST 数据; 四、漏报权益类投资业务 EAST 数据; 五、漏报投资资产管理产品业务 EAST 数据; 六、未报送跟单信用证业务 EAST 数据; 七、漏报贷款承诺业务 EAST 数据; 八、未报送委托贷款业务 EAST 数据; 九、EAST 系统理财产品销售端与产品端数据核对不一致; 十、EAST 系统理财产品底层持仓余额数据存在偏差; 十一、EAST 系统理财产品非标投向行业余额数据存在偏差; 十二、漏报分户账 EAST 数据; 十三、EAST 系统《个人信贷业务借据》表错报; 十四、EAST 系统《对公信贷业务借据》表错报。综上, 中国银行保险监督管理委员会决定对兴业银行股份有限公司罚款人民币 350 万元。

报告期内本基金投资的前十名证券中, 发行主体中国光大银行股份有限公司于 2022 年 3 月 21 日收到中国银行保险监督管理委员会行政处罚决定书(银保监罚决字(2022)18 号), 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, 经查, 光大银行监管标准化数据(EAST)系统数据质量及数据报送存在以下违法违规行为: 一、逾期 90 天以上贷款余额 EAST 数据存在偏差; 二、漏报贷款核销业务 EAST 数据; 三、漏报抵押物价值 EAST 数据; 四、漏报信贷资产转让业务 EAST 数据; 五、漏报权益类投资业务 EAST 数据; 六、未报送其他担保类业务 EAST 数据; 七、漏报委托贷款业务 EAST 数据; 八、EAST 系统理财产品销售端与产品端数据核对不一致; 九、EAST 系统理财产品底层持仓余额数据存在偏差; 十、EAST 系统理财产品非标投向行业余额数据存在偏差; 十一、漏报分户账 EAST 数据; 十二、漏报对公活期存款账户明细 EAST 数据; 十三、未在开户当月向 EAST 系统报送账户信息; 十四、EAST 系统《个人活期存款分户账明细记录》表错报; 十五、EAST 系统《表外授信业务》表错报; 十六、EAST 系统《对公信贷业务借据》表错报; 十七、EAST 系统《个人信贷业务借据》表错报; 十八、2018 年行政处罚问题依然存在。综上, 中国银行保险监督管理委员会决定对光大银行罚款 490 万元。

报告期内本基金投资的前十名证券中, 发行主体中国光大银行股份有限公司于 2022 年 5 月 24 日收到中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表(银保监罚决字(2022)31 号), 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, 经查, 光大银行理财业务存在以下违法违规行为: 一、老产品规模在部分时点出现反弹; 二、托管机构未及时发现理财产品集中度超标; 三、托管

业务违反资产独立性要求，操作管理不到位。综上，中国银行保险监督管理委员会决定对光大银行罚款 400 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	476,533.32
2	应收证券清算款	9,736,944.11
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,879,353.75
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	12,092,831.18

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	113052	兴业转债	78,170,073.98	6.34
2	118001	金博转债	46,802,811.02	3.80
3	113011	光大转债	44,134,199.61	3.58
4	110081	闻泰转债	41,216,162.06	3.34
5	123133	佩蒂转债	38,887,998.35	3.16
6	110079	杭银转债	34,039,231.06	2.76
7	110063	鹰 19 转债	31,703,737.82	2.57
8	113636	甬金转债	29,662,088.19	2.41
9	113050	南银转债	26,389,334.29	2.14
10	110082	宏发转债	25,490,704.68	2.07
11	123124	晶瑞转 2	24,199,706.00	1.96
12	113045	环旭转债	23,693,859.65	1.92

13	128083	新北转债	19,225,715.55	1.56
14	123108	乐普转 2	16,406,822.49	1.33
15	128046	利尔转债	15,970,417.29	1.30
16	110047	山鹰转债	14,549,321.68	1.18
17	113048	晶科转债	14,057,517.81	1.14
18	110053	苏银转债	13,857,742.74	1.12
19	123076	强力转债	12,395,259.18	1.01
20	123002	国祯转债	12,229,524.80	0.99
21	110073	国投转债	12,104,891.40	0.98
22	113502	嘉澳转债	11,232,791.11	0.91
23	113043	财通转债	9,661,982.65	0.78
24	113594	淳中转债	9,497,818.24	0.77
25	113633	科沃转债	9,038,157.77	0.73
26	113602	景 20 转债	8,712,156.82	0.71
27	113013	国君转债	5,679,816.44	0.46
28	123120	隆华转债	4,825,960.14	0.39
29	110067	华安转债	4,808,308.20	0.39
30	113632	鹤 21 转债	4,161,892.71	0.34
31	111001	山玻转债	3,130,661.43	0.25
32	123119	康泰转 2	3,028,889.91	0.25
33	123105	拓尔转债	2,973,046.29	0.24
34	110072	广汇转债	2,780,621.70	0.23
35	127045	牧原转债	2,321,997.04	0.19
36	127047	帝欧转债	2,124,074.52	0.17
37	128137	洁美转债	780,260.36	0.06

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	458,765,998.56	283,381,195.43
报告期期间基金总申购份额	27,809,203.81	65,380,411.71
减：报告期期间基金总赎回份额	104,160,218.74	32,008,076.11
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	382,414,983.63	316,753,531.03

§ 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

2022 年 7 月 21 日