

长信可转债债券型证券投资基金

2022 年第 3 季度报告

2022 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：平安银行股份有限公司

报告送出日期：2022 年 10 月 26 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 10 月 24 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 7 月 1 日起至 2022 年 9 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	750,470,929.99 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	372,526,868.39 份	377,944,061.60 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 7 月 1 日-2022 年 9 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	13,658,686.36	10,163,020.46
2. 本期利润	-38,340,952.10	-37,233,818.41
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.1014	-0.1088
4. 期末基金资产净值	629,669,857.58	614,896,231.75
5. 期末基金份额净值	1.6903	1.6270

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	-5.70%	0.54%	-3.99%	0.40%	-1.71%	0.14%
过去六个月	1.22%	0.79%	0.08%	0.47%	1.14%	0.32%
过去一年	-3.73%	0.88%	-1.77%	0.54%	-1.96%	0.34%
过去三年	26.34%	0.89%	21.97%	0.55%	4.37%	0.34%
过去五年	30.68%	0.87%	31.62%	0.56%	-0.94%	0.31%
自基金合同生效起至今	227.12%	1.13%	63.85%	0.92%	163.27%	0.21%

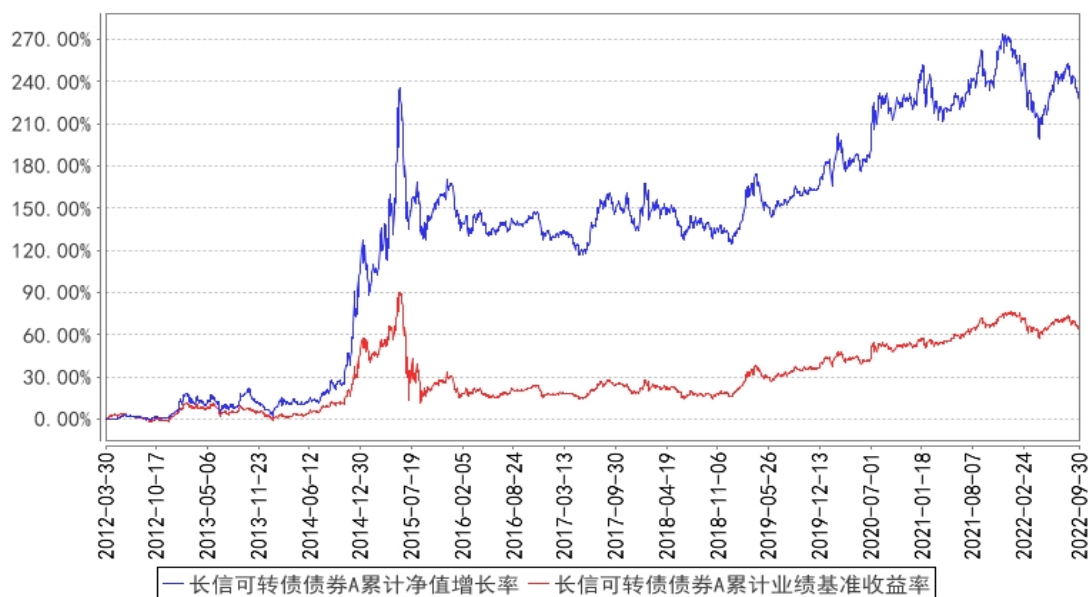
长信可转债债券 C

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
----	--------	-----------	------------	---------------	-----	-----

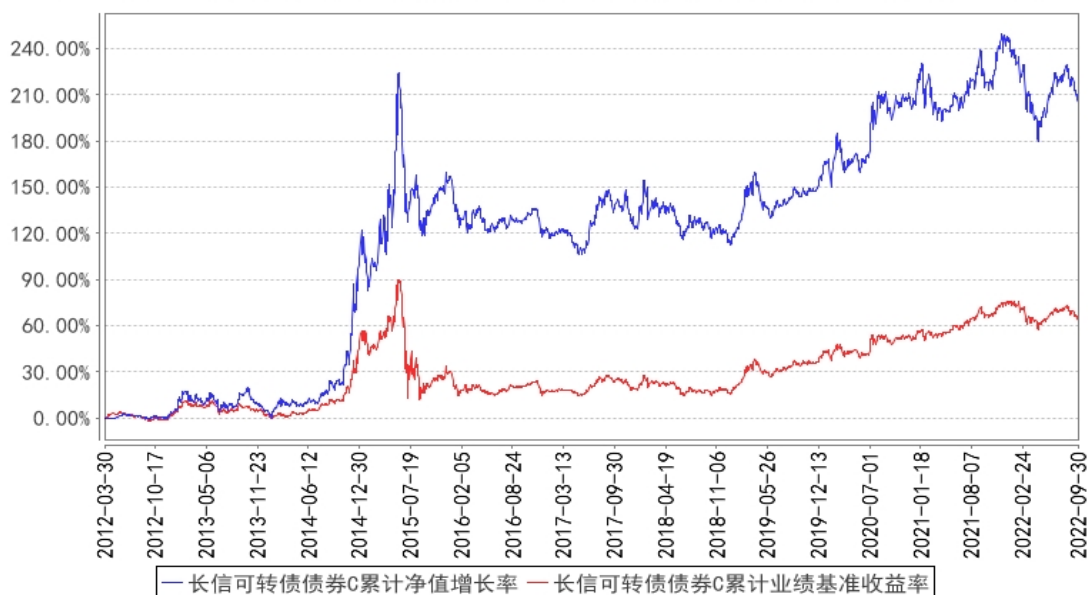
		准差②	收益率③	收益率标准差 ④		
过去三个月	-5.78%	0.54%	-3.99%	0.40%	-1.79%	0.14%
过去六个月	1.04%	0.79%	0.08%	0.47%	0.96%	0.32%
过去一年	-4.06%	0.88%	-1.77%	0.54%	-2.29%	0.34%
过去三年	24.98%	0.89%	21.97%	0.55%	3.01%	0.34%
过去五年	28.02%	0.87%	31.62%	0.56%	-3.60%	0.31%
自基金合同 生效起至今	205.10%	1.13%	63.85%	0.92%	141.25%	0.21%

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 9 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基金、长信稳健均衡 6 个月持有	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，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、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、长信利尚一年定期开放混合型证券投资基

	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				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，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证券投资基金和长信易进混合型	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，中国国籍。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、长信先利半年定期开放混合型证券投资基金

证券投资基金的 基金经理				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，股票市场整体趋势下行，8 月中旬前中小盘股票表现相对活跃，但结构把握难度较大。8 月中下旬转债加速下行基本确认行情拐点。

面对市场的分化和波动，我们在 7 月和 8 月持续降低股票和转债仓位，并调整持仓结构至偏防御性方向，在市场风险有所释放后，从 9 月中下旬开始逐步转向中性。

展望四季度，我们对国内经济和企业盈利的恢复充满信心，并且对市场的企稳回升保持乐观。目前市场底部特征比较明确，一是市场估值已经回到历次历史大底时的估值区间，二是市场情绪、

投资者仓位和交易热度均已降至历史中低位。行业配置方面重点关注中长期产业逻辑没有变化的景气赛道，例如新能源车、风电光伏等，业绩的绝对增速并不低，而股价经过调整后相较于其他板块估值性价比更高。转债市场经过近一个多月的调整，估值重回合理区间。后续随着正股企稳，有望出现反弹机会。

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 2022 年 9 月 30 日，长信可转债债券 A 基金份额净值为 1.6903 元，份额累计净值为 2.6503 元，本报告期内长信可转债债券 A 净值增长率为-5.70%；长信可转债债券 C 基金份额净值为 1.6270 元，份额累计净值为 2.5340 元，本报告期内长信可转债债券 C 净值增长率为-5.78%，同期业绩比较基准收益率为-3.99%。

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	213,812,652.29	15.44
	其中：股票	213,812,652.29	15.44
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,145,540,272.86	82.72
	其中：债券	1,145,540,272.86	82.72
	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	9,620,385.13	0.69
8	其他资产	15,805,411.64	1.14
9	合计	1,384,778,721.92	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	5,484,628.80	0.44
C	制造业	141,417,090.45	11.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	7,322,000.00	0.59
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	4,856,628.00	0.39
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,134,656.00	0.49
J	金融业	24,865,943.24	2.00
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	19,335,675.00	1.55
M	科学研究和技术服务业	4,396,030.80	0.35
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	213,812,652.29	17.18

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	300054	鼎龙股份	1,033,228	24,280,858.00	1.95
2	300059	东方财富	881,802	15,537,351.24	1.25
3	600519	贵州茅台	8,100	15,167,250.00	1.22
4	601888	中国中免	74,300	14,729,975.00	1.18
5	000733	振华科技	120,000	13,917,600.00	1.12
6	300274	阳光电源	105,398	11,659,126.76	0.94
7	300750	宁德时代	28,500	11,425,365.00	0.92
8	300033	同花顺	120,400	9,328,592.00	0.75
9	002475	立讯精密	296,200	8,708,280.00	0.70

10	601390	中国中铁	1,400,000	7,322,000.00	0.59
----	--------	------	-----------	--------------	------

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	76,553,682.96	6.15
2	央行票据	-	-
3	金融债券	56,709,290.96	4.56
	其中：政策性金融债	56,709,290.96	4.56
4	企业债券	10,366,301.37	0.83
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	1,001,910,997.57	80.50
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,145,540,272.86	92.04

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	110085	通 22 转债	969,130	123,947,850.48	9.96
2	113052	兴业转债	700,000	74,614,304.11	6.00
3	132026	G 三峡 EB2	531,530	60,539,534.07	4.86
4	113042	上银转债	529,470	56,466,176.75	4.54
5	113641	华友转债	449,840	53,529,160.64	4.30

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，发行主体上海银行股份有限公司于 2022 年 2 月 14 日收到中国银行保险监督管理委员会上海监管局行政处罚决定书（沪银保监罚决字（2022）13 号），根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第（五）项规定，经查，上海银行股份有限公司在 2015 年 3 月至 7 月，该行同业投资业务违规接受第三方金融机构担保。综上，中国银行保险监督管理委员会上海监管局要求公司责令改正，并处罚款 240 万元。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体上海银行股份有限公司于 2021 年 11 月 19 日收到中国银行保险监督管理委员会上海监管局行政处罚决定书（沪银保监罚决字（2021）174 号），根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十七条、《中华人民共和国商业银行法》第八十条、《银行业监管统计管理暂行办法》第三十六条规定，经查，上海银行股份有限公司存在未按规定报送统计报表情况。综上，中国银行保险监督管理委员会上海监管局给予公司罚款 20 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。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体中国进出口银行于 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）9 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，中国进出口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、漏报不良贷款余额 EAST 数据；二、漏报逾期 90 天以上贷款余额 EAST 数据；三、漏报贸易融资业务 EAST 数据；四、漏报贷款核销业务 EAST 数据；五、漏报抵押物价值 EAST 数据；六、漏报信贷资产转让业务 EAST 数据；七、漏报债券投资业务 EAST 数据；八、漏报权益类投资业务 EAST 数据；九、漏报投资资产管理产品业务 EAST 数据；十、漏报跟单信用证业务 EAST 数据；十一、漏报贷款承诺业务 EAST 数据；十二、未报送委托贷款业务 EAST 数据；十三、EAST 系统分户账与总账比对不一致；十四、漏报分户账 EAST 数据；十五、EAST 系统《对公活期存款分户账明细记录》表错报；十六、EAST 系统《关联关系》表漏报；十七、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中国进出口银行罚款 420 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	236,630.62
2	应收证券清算款	15,454,442.13
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	114,338.89
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	15,805,411.64

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	110085	通 22 转债	123,947,850.48	9.96
2	113052	兴业转债	74,614,304.11	6.00
3	113042	上银转债	56,466,176.75	4.54
4	113641	华友转债	53,529,160.64	4.30
5	113011	光大转债	43,537,892.16	3.50
6	110081	闻泰转债	37,735,531.65	3.03
7	110079	杭银转债	33,441,669.71	2.69
8	110063	鹰 19 转债	29,681,068.48	2.38
9	113050	南银转债	25,851,725.73	2.08
10	110059	浦发转债	23,661,271.23	1.90
11	123133	佩蒂转债	21,973,598.46	1.77
12	123067	斯莱转债	17,000,054.79	1.37
13	123108	乐普转 2	16,881,260.29	1.36
14	123124	晶瑞转 2	14,544,916.21	1.17
15	110047	山鹰转债	14,433,871.85	1.16
16	110053	苏银转债	13,908,758.63	1.12

17	113048	晶科转债	12,883,908.22	1.04
18	123076	强力转债	12,159,534.50	0.98
19	110073	国投转债	11,799,542.69	0.95
20	118005	天奈转债	10,756,482.96	0.86
21	128121	宏川转债	10,532,526.03	0.85
22	123060	苏试转债	9,683,515.09	0.78
23	113043	财通转债	9,240,960.58	0.74
24	113053	隆 22 转债	9,158,843.68	0.74
25	123002	国祯转债	9,050,693.82	0.73
26	113633	科沃转债	8,348,457.52	0.67
27	113636	甬金转债	7,867,777.00	0.63
28	110082	宏发转债	7,230,875.29	0.58
29	123139	铂科转债	6,538,168.94	0.53
30	113626	伯特转债	6,196,582.96	0.50
31	110084	贵燃转债	6,077,639.73	0.49
32	123142	申昊转债	5,966,717.81	0.48
33	113013	国君转债	5,380,349.32	0.43
34	118004	博瑞转债	5,272,350.20	0.42
35	110067	华安转债	4,759,026.76	0.38
36	123121	帝尔转债	4,100,123.97	0.33
37	113642	上 22 转债	3,894,802.03	0.31
38	127052	西子转债	3,673,643.01	0.30
39	113054	绿动转债	3,214,666.85	0.26
40	123119	康泰转 2	3,186,711.33	0.26
41	123105	拓尔转债	3,009,548.78	0.24
42	111001	山玻转债	2,806,033.09	0.23
43	110072	广汇转债	2,723,500.16	0.22
44	127045	牧原转债	2,337,845.92	0.19
45	127047	帝欧转债	1,997,084.38	0.16
46	123120	隆华转债	1,873,299.86	0.15
47	113045	环旭转债	1,604,422.41	0.13
48	127058	科伦转债	1,426,463.56	0.11
49	113602	景 20 转债	1,400,111.72	0.11
50	128144	利民转债	1,166,645.21	0.09
51	113639	华正转债	1,081,695.89	0.09
52	127017	万青转债	512,084.46	0.04

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	382,414,983.63	316,753,531.03
报告期期间基金总申购份额	2,621,777.68	134,199,044.51
减：报告期期间基金总赎回份额	12,509,892.92	73,008,513.94
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	372,526,868.39	377,944,061.60

§ 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 10 月 26 日