

# 长信利鑫债券型证券投资基金（LOF） 2023 年第 3 季度报告

2023 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：2023 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 2023 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 2023 年 7 月 1 日起至 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	265,418,162.49 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	255,163,322.57 份	10,254,839.92 份

注：表中的合同生效日为基金转型起始日，本基金合同生效日为 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（2023 年 7 月 1 日-2023 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	-3,881,176.27	-163,646.20
2. 本期利润	-1,234,139.26	-60,553.92
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0046	-0.0057
4. 期末基金资产净值	155,992,686.80	6,219,443.92
5. 期末基金份额净值	0.6113	0.6065

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	-0.88%	0.25%	0.68%	0.04%	-1.56%	0.21%
过去六个月	-1.21%	0.26%	2.36%	0.04%	-3.57%	0.22%
过去一年	-0.54%	0.27%	3.31%	0.05%	-3.85%	0.22%
过去三年	0.99%	0.28%	13.60%	0.05%	-12.61%	0.23%
过去五年	12.15%	0.24%	24.05%	0.06%	-11.90%	0.18%

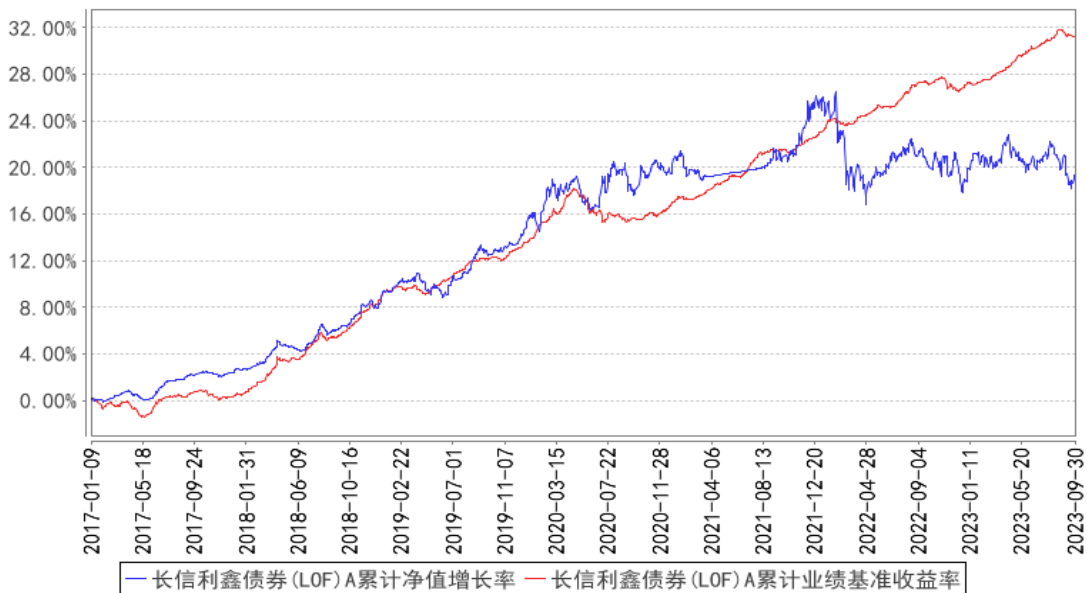
自份额增加 日起至今	19.40%	0.21%	31.29%	0.06%	-11.89%	0.15%
---------------	--------	-------	--------	-------	---------	-------

长信利鑫债券 (LOF) C

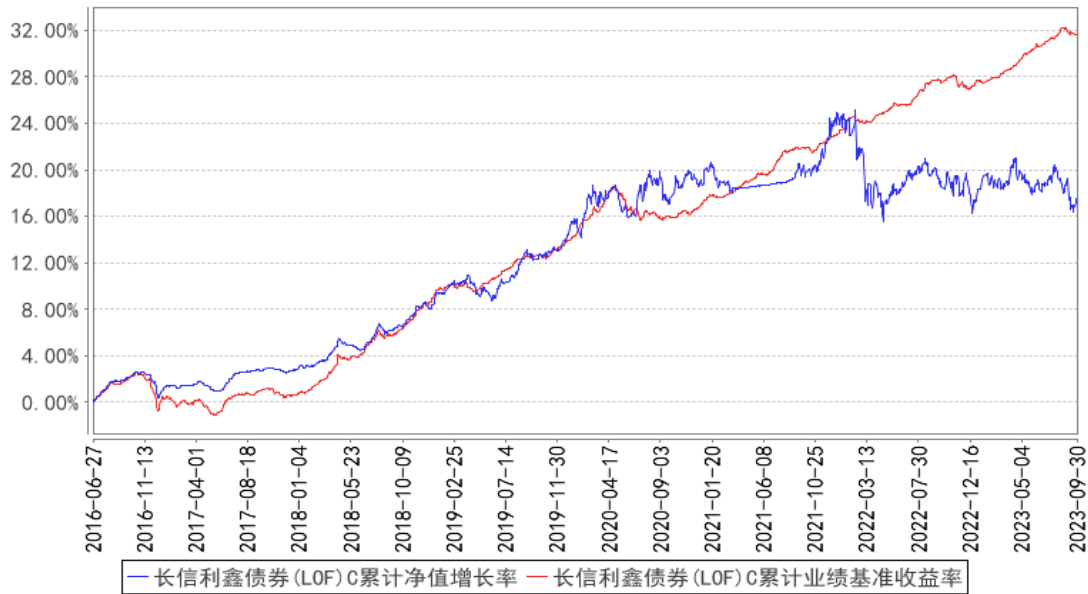
阶段	净值增长率①	净值增长率标准 差②	业绩比较基准 收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	-0.95%	0.25%	0.68%	0.04%	-1.63%	0.21%
过去六个月	-1.38%	0.26%	2.36%	0.04%	-3.74%	0.22%
过去一年	-0.87%	0.27%	3.31%	0.05%	-4.18%	0.22%
过去三年	-0.04%	0.28%	13.60%	0.05%	-13.64%	0.23%
过去五年	10.26%	0.24%	24.05%	0.06%	-13.79%	0.18%
自基金合同 生效起至今	17.52%	0.20%	31.69%	0.07%	-14.17%	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 2023 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 2023 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		
张文琍	长信纯债壹号债券型证券投资基金、长信利鑫债券型证券投资基金（LOF）、长信富平纯债一年定期开放债券型证券投资基金	2011 年 6 月 24 日	-	29 年	高级工商管理硕士，上海财经大学 EMBA 毕业，具有基金从业资格，中国国籍。曾任湖北证券公司交易一部交易员、长江证券有限责任公司资产管理事业部主管、债券事业总部投资部经理、固定收益总部交易部经理。2004 年 9 月加入长信基金管理有限责任公司，历任长信利息收益开放式证券投资基金交易员、基金经理助理、固定收益部副总监、固定收益部总监、长

	金、长信稳益纯债债券型证券投资基金、长信富海纯债一年定期开放债券型证券投资基金和长信富全纯债一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理、固收多策略部副总监			信中短债证券投资基金、长信利息收益开放式证券投资基金、长信长金货币市场基金、长信富民纯债一年定期开放债券型证券投资基金和长信稳势纯债债券型证券投资基金的基金经理。现任固收多策略部副总监、长信纯债壹号债券型证券投资基金、长信利鑫债券型证券投资基金（LOF）、长信富平纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信稳益纯债债券型证券投资基金、长信富海纯债一年定期开放债券型证券投资基金和长信富全纯债一年定期开放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

进入三季度，受经济数据及央行调整政策利率影响，债券收益率开始下行；8 月后债券收益率逐步反弹，央行超预期降息后资金面也由偏宽逐步收敛。

三季度，我们根据市场变化相应调整策略，选择相对灵活的久期，组合保持平稳。

从经济基本面来看，多项政策出台有助于促进消费潜力释放、地产销售企稳，拉动经济逐步回升。从货币政策来看，稳增长压力下预计仍然保持偏宽松的基调，但汇率贬值压力较大，对国内货币政策宽松的约束也较强。向后看，债券市场进入重要观察期。

我们将继续秉承谨慎原则，加强组合的流动性管理，加大对信用风险的审慎判断。适度调整组合久期，密切关注经济走势和政策动向，紧跟组合规模变动进行资产配置，争取在流动安全的前提下，为投资者获取更好的收益。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 9 月 30 日，长信利鑫债券(LOF)A 基金份额净值为 0.6113 元，份额累计净值为 1.1333 元，本报告期内长信利鑫债券(LOF)A 净值增长率为-0.88%；长信利鑫债券(LOF)C 基金份额净值为 0.6065 元，份额累计净值为 1.1125 元，本报告期内长信利鑫债券(LOF)C 净值增长率为-0.95%，同期业绩比较基准收益率为 0.68%。

#### 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	149,340,362.48	91.71
	其中：债券	149,340,362.48	91.71
	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	12,004,588.02	7.37
	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	1,485,215.10	0.91

8	其他资产	14,032.35	0.01
9	合计	162,844,197.95	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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,010,371.58	6.17
	其中：政策性金融债	10,010,371.58	6.17
4	企业债券	2,081,442.62	1.28
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	137,248,548.28	84.61
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	149,340,362.48	92.06

## 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	230411	23农发11	100,000	10,010,371.58	6.17
2	127044	蒙娜转债	75,210	8,273,161.82	5.10
3	127025	冀东转债	61,498	6,556,217.54	4.04
4	110076	华海转债	41,940	4,646,946.25	2.86
5	113648	巨星转债	35,200	4,639,680.18	2.86

## 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，发行主体浙江台华新材料股份有限公司于 2022 年 10 月 28 日收到上海证券交易所《关于对浙江台华新材料股份有限公司及有关责任人予以通报批评的决定》（（2022）157 号），经查，浙江台华新材料股份有限公司多期定期报告现金流量表的数据统计、项目列报均不准确，影响科目较多，导致公司多期定期报告披露的财务数据与实际不符，反映出公司财务管理存在缺陷。违反了《公开发行证券的公司信息披露编报规则第 15 号——财务报告的一般规定》《上海证券交易所股票上市规则（2020 年修订）》第 1.4 条、第 2.1 条、第 2.5 条和《上海证券交易所股票上市规则（2022 年修订）》第 2.1.1 条、第 2.1.4 条等有关规定。综上，上海交易所决定对浙江台华新材料股份有限公司和时任董事长施青岛、时任总经理沈卫锋、时任财务总监李增华予以通报批评。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体山鹰国际控股股份公司于 2023 年 7 月 13 日公告收到安徽证监局出具的关于对山鹰国际控股股份公司采取责令改正措施并对许云采取出具警示函措施的决定（（2023）21 号）及《关于对山鹰国际控股股份公司、严大林采取出具警示函措

施的决定》（〔2023〕21 号），经查，山鹰国际控股股份公司存在固定资产减值准备计提不审慎、商誉减值准备计提不审慎的问题。综上，根据《上市公司现场检查规则》第二十一条、《上市公司信息披露管理办法》第五十二条的相关规定，安徽证监局决定对山鹰国际控股股份公司采取责令改正的行政监管措施，并记入证券期货市场诚信档案。

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	10,711.05
2	应收证券清算款	3,200.00
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	121.30
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	14,032.35

#### 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	127044	蒙娜转债	8,273,161.82	5.10
2	127025	冀东转债	6,556,217.54	4.04
3	110076	华海转债	4,646,946.25	2.86
4	113648	巨星转债	4,639,680.18	2.86
5	113638	台 21 转债	3,979,900.06	2.45
6	127049	希望转 2	3,825,568.08	2.36
7	123107	温氏转债	3,228,619.45	1.99
8	110047	山鹰转债	2,841,497.07	1.75
9	127030	盛虹转债	2,314,857.31	1.43

10	128121	宏川转债	1,275,788.59	0.79
11	113621	彤程转债	695,217.81	0.43
12	123174	精锻转债	693,699.59	0.43
13	127038	国微转债	682,193.01	0.42
14	118019	金盘转债	664,732.19	0.41
15	113061	拓普转债	661,596.30	0.41
16	118009	华锐转债	658,992.47	0.41
17	127079	华亚转债	657,222.28	0.41
18	128132	交建转债	649,963.01	0.40
19	111008	沿浦转债	649,809.73	0.40
20	123071	天能转债	645,630.82	0.40
21	118017	深科转债	644,195.89	0.40
22	123121	帝尔转债	639,074.66	0.39
23	113530	大丰转债	636,500.68	0.39
24	127039	北港转债	635,930.14	0.39
25	123085	万顺转 2	631,521.92	0.39
26	110075	南航转债	631,507.95	0.39
27	127082	亚科转债	629,768.02	0.39
28	118033	华特转债	626,187.81	0.39
29	113563	柳药转债	626,141.10	0.39
30	113060	浙 22 转债	625,427.81	0.39
31	111005	富春转债	623,747.95	0.38
32	127007	湖广转债	622,532.19	0.38
33	128134	鸿路转债	620,762.33	0.38
34	127070	大中转债	620,346.58	0.38
35	118013	道通转债	619,565.75	0.38
36	110088	淮 22 转债	618,293.15	0.38
37	113639	华正转债	617,795.89	0.38
38	110062	烽火转债	617,680.82	0.38
39	113632	鹤 21 转债	616,942.47	0.38
40	113654	永 02 转债	616,654.25	0.38
41	123048	应急转债	616,510.27	0.38
42	123119	康泰转 2	614,454.79	0.38
43	123149	通裕转债	613,914.38	0.38
44	128090	汽模转 2	612,269.86	0.38
45	118014	高测转债	611,878.77	0.38
46	111000	起帆转债	611,474.66	0.38
47	113600	新星转债	611,155.48	0.38
48	127043	川恒转债	610,808.91	0.38
49	113602	景 20 转债	610,374.66	0.38
50	123172	漱玉转债	609,003.42	0.38
51	113051	节能转债	607,520.68	0.37

52	113643	风语转债	607,241.10	0.37
53	123143	胜蓝转债	607,109.86	0.37
54	123169	正海转债	606,483.84	0.37
55	113637	华翔转债	606,160.82	0.37
56	113667	春 23 转债	604,450.96	0.37
57	127076	中宠转 2	602,447.40	0.37
58	123120	隆华转债	601,718.79	0.37
59	113651	松霖转债	599,250.00	0.37
60	113655	欧 22 转债	599,062.33	0.37
61	118024	冠宇转债	598,974.38	0.37
62	113647	禾丰转债	598,837.67	0.37
63	128142	新乳转债	598,745.21	0.37
64	123090	三诺转债	598,162.33	0.37
65	113636	甬金转债	592,550.00	0.37
66	110085	通 22 转债	592,510.00	0.37
67	118011	银微转债	591,435.21	0.36
68	128109	楚江转债	589,156.16	0.36
69	113623	凤 21 转债	588,928.77	0.36
70	118025	奕瑞转债	588,849.59	0.36
71	123129	锦鸡转债	588,526.44	0.36
72	113062	常银转债	588,520.14	0.36
73	113659	莱克转债	587,807.26	0.36
74	110093	神马转债	587,786.16	0.36
75	127045	牧原转债	587,603.29	0.36
76	113627	太平转债	586,954.79	0.36
77	113045	环旭转债	584,537.40	0.36
78	113609	永安转债	584,408.22	0.36
79	123168	惠云转债	584,067.67	0.36
80	123142	申昊转债	583,679.45	0.36
81	113021	中信转债	582,449.45	0.36
82	110079	杭银转债	581,980.68	0.36
83	123179	立高转债	580,383.84	0.36
84	110067	华安转债	579,729.73	0.36
85	123082	北陆转债	578,541.75	0.36
86	118029	富淼转债	578,535.62	0.36
87	128097	奥佳转债	577,783.56	0.36
88	127046	百润转债	577,521.92	0.36
89	127062	垒知转债	577,521.78	0.36
90	110092	三房转债	575,031.10	0.35
91	113532	海环转债	573,690.14	0.35
92	127055	精装转债	572,760.96	0.35
93	123144	裕兴转债	572,147.95	0.35

94	113644	艾迪转债	570,126.03	0.35
95	127040	国泰转债	569,765.48	0.35
96	110082	宏发转债	569,702.05	0.35
97	127026	超声转债	568,827.17	0.35
98	113050	南银转债	568,578.49	0.35
99	128144	利民转债	568,576.16	0.35
100	113618	美诺转债	568,349.32	0.35
101	113610	灵康转债	568,135.58	0.35
102	127016	鲁泰转债	565,326.71	0.35
103	113059	福莱转债	564,134.25	0.35
104	123165	回天转债	563,014.52	0.35
105	123010	博世转债	562,128.77	0.35
106	127077	华宏转债	561,496.16	0.35
107	127042	嘉美转债	561,430.82	0.35
108	113657	再 22 转债	560,810.96	0.35
109	110073	国投转债	560,254.93	0.35
110	113665	汇通转债	558,103.42	0.34
111	110087	天业转债	553,038.36	0.34
112	111009	盛泰转债	550,728.36	0.34
113	127068	顺博转债	547,528.77	0.34
114	128037	岩土转债	545,533.56	0.34
115	113054	绿动转债	542,005.62	0.33
116	127075	百川转 2	541,790.82	0.33
117	127034	绿茵转债	540,037.67	0.33
118	113033	利群转债	536,508.22	0.33
119	123175	百畅转债	533,887.15	0.33
120	113601	塞力转债	530,573.97	0.33
121	127035	濮耐转债	530,494.85	0.33
122	113056	重银转债	519,041.64	0.32
123	113065	齐鲁转债	514,270.68	0.32
124	113605	大参转债	506,897.88	0.31
125	123146	中环转 2	451,771.70	0.28
126	113516	苏农转债	445,643.38	0.27
127	128123	国光转债	405,906.34	0.25
128	123151	康医转债	393,408.86	0.24
129	123163	金沃转债	392,998.24	0.24
130	118012	微芯转债	376,367.18	0.23
131	127052	西子转债	374,763.33	0.23
132	113646	永吉转债	350,690.75	0.22
133	123161	强联转债	350,262.27	0.22
134	123178	花园转债	338,110.90	0.21
135	128056	今飞转债	332,966.78	0.21

136	113561	正裕转债	321,077.47	0.20
137	113526	联泰转债	318,625.62	0.20
138	128143	锋龙转债	313,499.04	0.19
139	113606	荣泰转债	311,838.18	0.19
140	123157	科蓝转债	311,070.14	0.19
141	113566	翔港转债	306,695.55	0.19
142	110070	凌钢转债	302,524.18	0.19
143	113662	豪能转债	300,034.59	0.18
144	113030	东风转债	298,684.59	0.18
145	127081	中旗转债	292,748.49	0.18
146	128071	合兴转债	291,528.70	0.18
147	127059	永东转 2	289,303.63	0.18
148	123159	崧盛转债	289,085.96	0.18
149	113640	苏利转债	279,046.30	0.17
150	132026	G 三峡 EB2	274,465.51	0.17
151	123108	乐普转 2	216,749.58	0.13
152	123171	共同转债	60,439.16	0.04
153	127060	湘佳转债	51,467.84	0.03

#### 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	296,361,763.17	11,062,051.48
报告期期间基金总申购份额	35,352.99	339,130.67
减:报告期期间基金总赎回份额	41,233,793.59	1,146,342.23
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	255,163,322.57	10,254,839.92

### §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

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	2023 年 7 月 1 日至 9 月 30 日	122,497,555.01	0.00	16,000,000.00	106,497,555.01	40.12

#### 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

2023 年 10 月 25 日