

长信可转债债券型证券投资基金

2024 年第 2 季度报告

2024 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：2024 年 7 月 19 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 7 月 17 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 4 月 1 日起至 2024 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	894,374,872.38 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	224,749,463.17 份	669,625,409.21 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 4 月 1 日-2024 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	-6,377,753.50	-13,196,716.82
2. 本期利润	5,157,138.19	74,537.57
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0235	0.0001
4. 期末基金资产净值	345,127,489.78	987,980,817.33
5. 期末基金份额净值	1.5356	1.4754

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	1.49%	0.59%	0.72%	0.37%	0.77%	0.22%
过去六个月	0.91%	0.65%	0.84%	0.40%	0.07%	0.25%
过去一年	-8.08%	0.59%	-2.51%	0.37%	-5.57%	0.22%
过去三年	-9.20%	0.74%	1.41%	0.45%	-10.61%	0.29%
过去五年	17.89%	0.78%	23.95%	0.49%	-6.06%	0.29%
自基金合同生效起至今	197.18%	1.08%	62.04%	0.87%	135.14%	0.21%

长信可转债债券 C

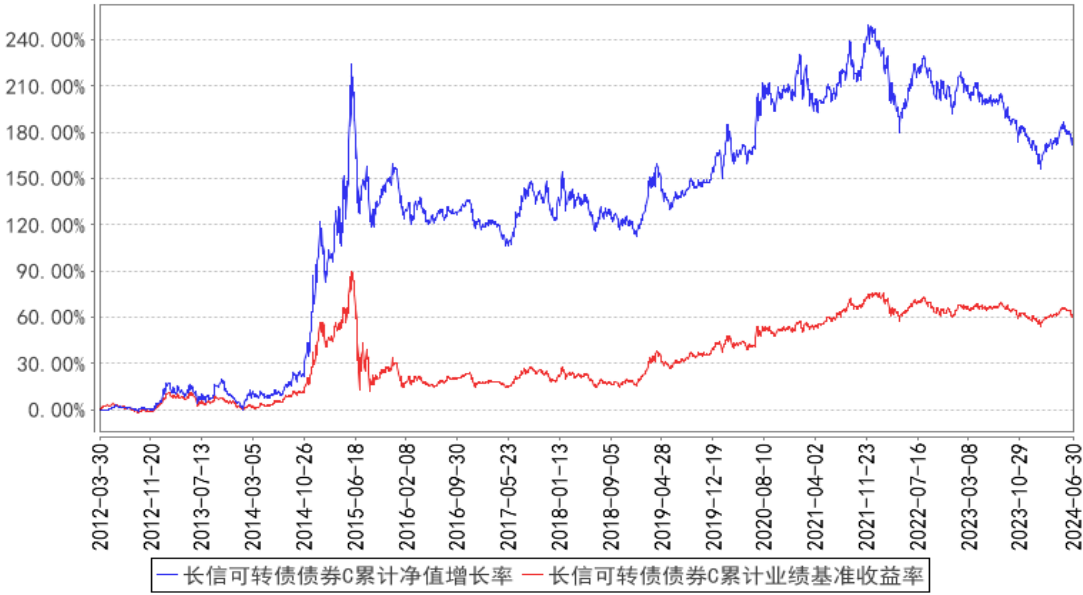
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
----	--------	-----------	------------	---------------	-----	-----

		准差②	收益率③	收益率标准差 ④		
过去三个月	1.48%	0.59%	0.72%	0.37%	0.76%	0.22%
过去六个月	0.90%	0.65%	0.84%	0.40%	0.06%	0.25%
过去一年	-8.10%	0.59%	-2.51%	0.37%	-5.59%	0.22%
过去三年	-9.76%	0.74%	1.41%	0.45%	-11.17%	0.29%
过去五年	16.25%	0.78%	23.95%	0.49%	-7.70%	0.29%
自基金合同 生效起至今	176.67%	1.08%	62.04%	0.87%	114.63%	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 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、长信利富债券型证券投资基金、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	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 月加入长信基金有限责任公司，曾任总经理助理、长信中证可转债及可交换债券 50 指数证券投资基金、长信利尚一年定期开放混合型证券投资基金和长信利盈灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，现任固收投资管理中心总经理、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、长信利富债券型证券投资基金、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、固 收 投 资 管 理 中 心 总 经 理				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 月 3 日	-	8 年	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。
吴晖	曾任本基金的基金经理。	2019 年 6 月 26 日	2024 年 6 月 17 日	9 年	曾任本基金的基金经理。

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

上半年市场盈利预期有所下调，海外美联储降息预期反复，加之其他海外冲击事件扰动，权益市场在 2 月开启大幅反弹之后逐步转入震荡，机构对于防守型资产的配置有所提升，二季度红利资产表现占优，小微盘以及部分成长赛道相对回落，市场成交额逐步缩量。此外，伴随资本市场改革深化、地产政策加码，部分板块博弈尚在延续。

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，期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，在一季报盈利预期出现回调后，对成长相关仓位有所控制。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，年初 PMI 也出现回升态势，但 5 月以来内外需出现背离，第二产业靠外需拉动，而第三产业仍有待进一步复苏。国外方面，全球制造业强势复苏，拉动中国出口景气。美国经济数据强劲、通胀略超预期，美元降息节点预期多次变化，但美元滥发正在引发全球投资者对美元信用的担忧。

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。目前市场较为关注整体盈利复苏情况以及海外周期的回落风险，上半年红利资产相对占优。后续关注年内风格的再平衡。在前期红利资产显著上涨后，股息吸引力有所减弱，前期调整过多的处于低位的核心资产同样值得关注，其中包括前期回调较多但业绩稳健的部分顺周期相关子板块，如上游资源品、造船等，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，此外有业绩支撑的成长板块部分领域同样值得持续跟踪，比如消费电子、AI 驱动的算力、出海电力、机械等等。

对于转债市场而言，二季度市场出现较大波动，尤其是低价转债。转债市场后续预计会延续分化，一方面历史上转债大幅调整后回暖的核心仍是正股市场的快速复苏，另一方面低价转债在出现巨大波动后，高 YTM 转债历史上低波动低回报的预期有所变化，转债市场整体策略框架或步

入新的阶段。转债市场目前估值和价格分布相对今年 2 月初以及近 3 年的阶段性底部仍然较高，但结构显著分化，跌破债底标的数目显著增多，6 月以来机构配置资金存在一定的负反馈效应。后续需要关注：第一，权益市场是否筑底回升，部分中低价格转债在市场冲击下出现快速调整，部分业绩较优、估值处于较低区域的转债在此轮被动冲击中或提供较好的投资机会；第二，部分被“误杀”的高 YTM 相关标的，即使部分低信用评级的转债出现快速调整，仍有部分低价转债值得关注，其公司处于正常运营状态，对债务的偿还能力仍有所保障。

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 6 月 30 日,长信可转债债券 A 基金份额净值为 1.5356 元,份额累计净值为 2.4956 元,本报告期内长信可转债债券 A 净值增长率为 1.49%;长信可转债债券 C 基金份额净值为 1.4754 元,份额累计净值为 2.3824 元,本报告期内长信可转债债券 C 净值增长率为 1.48%,同期业绩比较基准收益率为 0.72%。

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	198,926,631.04	13.46
	其中：股票	198,926,631.04	13.46
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,197,690,971.01	81.06
	其中：债券	1,197,690,971.01	81.06
	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	80,273,958.85	5.43
8	其他资产	571,590.16	0.04
9	合计	1,477,463,151.06	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	8,092,160.00	0.61
B	采矿业	58,152,358.00	4.36
C	制造业	105,769,397.94	7.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,189,425.00	0.54
E	建筑业	7,836,240.00	0.59
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	3,251,852.10	0.24
J	金融业	8,635,198.00	0.65
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	198,926,631.04	14.92

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	300054	鼎龙股份	544,400	12,346,992.00	0.93
2	002475	立讯精密	252,400	9,921,844.00	0.74
3	601899	紫金矿业	555,200	9,754,864.00	0.73
4	601088	中国神华	209,900	9,313,263.00	0.70
5	601600	中国铝业	1,209,000	9,224,670.00	0.69

6	300750	宁德时代	50,500	9,091,515.00	0.68
7	603986	兆易创新	90,500	8,653,610.00	0.65
8	002714	牧原股份	185,600	8,092,160.00	0.61
9	601117	中国化学	951,000	7,836,240.00	0.59
10	000333	美的集团	109,600	7,069,200.00	0.53

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	31,110,166.67	2.33
2	央行票据	-	-
3	金融债券	40,639,540.98	3.05
	其中：政策性金融债	40,639,540.98	3.05
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）	1,125,941,263.36	84.46
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,197,690,971.01	89.84

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	436,350	56,488,376.65	4.24
2	230211	23 国开 11	400,000	40,639,540.98	3.05
3	110079	杭银转债	324,820	39,227,612.58	2.94
4	123107	温氏转债	279,140	35,227,200.33	2.64
5	113050	南银转债	275,620	34,566,078.09	2.59

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	541,171.82
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	30,418.34
6	其他应收款	—
7	其他	—
8	合计	571,590.16

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	132026	G 三峡 EB2	56,488,376.65	4.24
2	110079	杭银转债	39,227,612.58	2.94
3	123107	温氏转债	35,227,200.33	2.64
4	113050	南银转债	34,566,078.09	2.59
5	113052	兴业转债	34,044,197.19	2.55
6	110062	烽火转债	27,462,669.89	2.06
7	123213	天源转债	24,465,957.27	1.84
8	113061	拓普转债	21,642,316.24	1.62
9	113637	华翔转债	21,419,249.64	1.61

10	128137	洁美转债	21,295,874.61	1.60
11	113045	环旭转债	20,952,015.90	1.57
12	127088	赫达转债	18,751,022.82	1.41
13	113024	核建转债	18,595,359.93	1.39
14	127045	牧原转债	18,403,322.75	1.38
15	118028	会通转债	17,841,397.97	1.34
16	127074	麦米转 2	16,208,896.78	1.22
17	123231	信测转债	15,592,527.97	1.17
18	127084	柳工转 2	15,526,007.47	1.16
19	113062	常银转债	15,519,301.43	1.16
20	110075	南航转债	15,269,886.31	1.15
21	113615	金诚转债	15,245,702.28	1.14
22	127049	希望转 2	15,051,344.51	1.13
23	127050	麒麟转债	14,742,797.81	1.11
24	113060	浙 22 转债	14,563,165.28	1.09
25	118012	微芯转债	13,733,636.12	1.03
26	127078	优彩转债	13,701,786.96	1.03
27	111003	聚合转债	13,636,769.74	1.02
28	113021	中信转债	13,452,933.33	1.01
29	110073	国投转债	13,377,340.97	1.00
30	113053	隆 22 转债	12,638,411.74	0.95
31	113669	景 23 转债	12,463,827.23	0.93
32	118025	奕瑞转债	12,408,791.81	0.93
33	118043	福立转债	12,404,136.31	0.93
34	123190	道氏转 02	12,160,940.10	0.91
35	127090	兴瑞转债	12,105,784.84	0.91
36	113651	松霖转债	11,276,613.15	0.85
37	111005	富春转债	11,253,119.61	0.84
38	113066	平煤转债	11,070,181.69	0.83
39	113065	齐鲁转债	11,058,908.77	0.83
40	118004	博瑞转债	10,848,906.82	0.81
41	123114	三角转债	10,445,896.20	0.78
42	127043	川恒转债	10,314,911.32	0.77
43	110083	苏租转债	9,940,554.67	0.75
44	113516	苏农转债	9,724,407.38	0.73
45	113055	成银转债	9,702,734.20	0.73
46	113639	华正转债	9,655,910.76	0.72
47	113632	鹤 21 转债	8,752,456.25	0.66
48	118046	诺泰转债	8,675,462.53	0.65
49	127035	濮耐转债	8,649,449.84	0.65
50	127051	博杰转债	8,413,179.58	0.63
51	113674	华设转债	8,131,199.95	0.61

52	123191	智尚转债	7,849,199.63	0.59
53	123229	艾录转债	7,744,294.83	0.58
54	123157	科蓝转债	7,651,840.07	0.57
55	113675	新 23 转债	7,527,532.36	0.56
56	123132	回盛转债	7,427,145.34	0.56
57	127086	恒邦转债	7,409,969.48	0.56
58	110094	众和转债	6,733,832.99	0.51
59	118015	芯海转债	6,714,699.71	0.50
60	113582	火炬转债	6,609,828.72	0.50
61	123224	宇邦转债	6,467,136.53	0.49
62	110077	洪城转债	6,312,591.86	0.47
63	123090	三诺转债	6,171,432.09	0.46
64	113598	法兰转债	5,894,549.33	0.44
65	111017	蓝天转债	5,887,617.60	0.44
66	113623	凤 21 转债	5,703,115.87	0.43
67	110068	龙净转债	5,497,713.59	0.41
68	113044	大秦转债	5,450,414.15	0.41
69	111011	冠盛转债	5,339,368.76	0.40
70	127092	运机转债	5,299,387.29	0.40
71	127101	豪鹏转债	5,181,888.95	0.39
72	113647	禾丰转债	5,176,728.47	0.39
73	113654	永 02 转债	5,171,415.53	0.39
74	118006	阿拉转债	5,167,023.99	0.39
75	118035	国力转债	5,026,964.04	0.38
76	113593	沪工转债	4,840,172.87	0.36
77	113616	韦尔转债	4,829,778.79	0.36
78	110093	神马转债	4,785,919.93	0.36
79	123168	惠云转债	4,317,758.47	0.32
80	128106	华统转债	4,154,014.53	0.31
81	113618	美诺转债	3,925,927.52	0.29
82	118021	新致转债	3,879,764.63	0.29
83	110089	兴发转债	3,864,715.22	0.29
84	123212	立中转债	3,762,442.99	0.28
85	110048	福能转债	3,463,662.73	0.26
86	113662	豪能转债	2,651,176.26	0.20
87	118029	富淼转债	2,565,671.41	0.19
88	118009	华锐转债	2,392,390.60	0.18
89	127044	蒙娜转债	2,285,943.85	0.17
90	123127	耐普转债	2,074,647.77	0.16
91	118013	道通转债	1,984,836.47	0.15
92	113545	金能转债	1,849,624.66	0.14
93	118022	锂科转债	1,247,047.32	0.09

94	113638	台 21 转债	669,196.93	0.05
95	127091	科数转债	662,210.18	0.05

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	233,132,203.25	479,511,077.92
报告期期间基金总申购份额	33,068,696.72	567,132,727.07
减：报告期期间基金总赎回份额	41,451,436.80	377,018,395.78
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	224,749,463.17	669,625,409.21

§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 4 月 11 日至 2024 年 4 月 29 日	123,469,705.17	0.00	0.00	123,469,705.17	13.81

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

本基金本报告期末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 7 月 19 日