

# 长信稳健成长混合型证券投资基金

## 2024 年第 1 季度报告

2024 年 3 月 31 日

基金管理人：长信基金管理有限责任公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 4 月 22 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金基金合同规定，于 2024 年 4 月 18 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 1 月 1 日起至 2024 年 3 月 31 日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	长信稳健成长混合	
基金主代码	014850	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 6 月 2 日	
报告期末基金份额总额	253,425,319.92 份	
投资目标	通过积极主动的资产管理，在严格控制基金资产风险的前提下，力争为投资者提供稳定增长的投资收益。	
投资策略	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。	
业绩比较基准	中债综合指数收益率*70%+沪深 300 指数收益率*20%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）*10%	
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。本基金可投资香港联合交易所上市的股票，将面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。	
基金管理人	长信基金管理有限责任公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	长信稳健成长混合 A	长信稳健成长混合 C
下属分级基金的交易代码	014850	014851
报告期末下属分级基金的份额总额	147,123,374.58 份	106,301,945.34 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 1 月 1 日-2024 年 3 月 31 日）	
	长信稳健成长混合 A	长信稳健成长混合 C
1. 本期已实现收益	640,739.38	206,039.15
2. 本期利润	1,105,084.70	494,913.03
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0072	0.0045
4. 期末基金资产净值	130,019,945.40	92,601,840.83
5. 期末基金份额净值	0.8837	0.8711

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

长信稳健成长混合 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	0.87%	0.27%	1.36%	0.32%	-0.49%	-0.05%
过去六个月	-3.87%	0.38%	-0.02%	0.29%	-3.85%	0.09%
过去一年	-11.09%	0.44%	-1.94%	0.28%	-9.15%	0.16%
自基金合同 生效起至今	-7.73%	0.45%	-1.69%	0.31%	-6.04%	0.14%

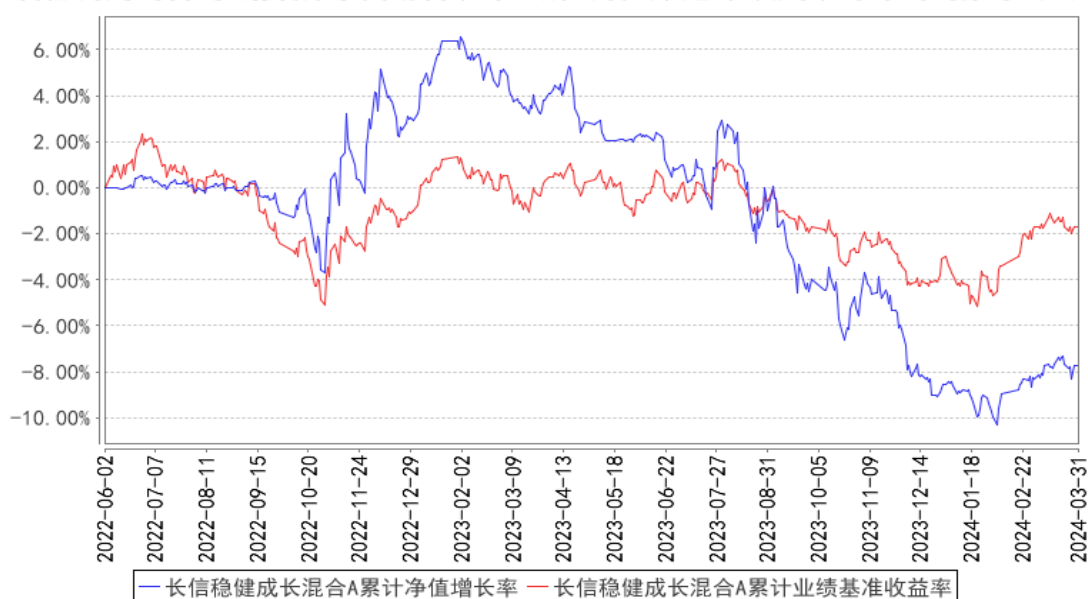
长信稳健成长混合 C

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

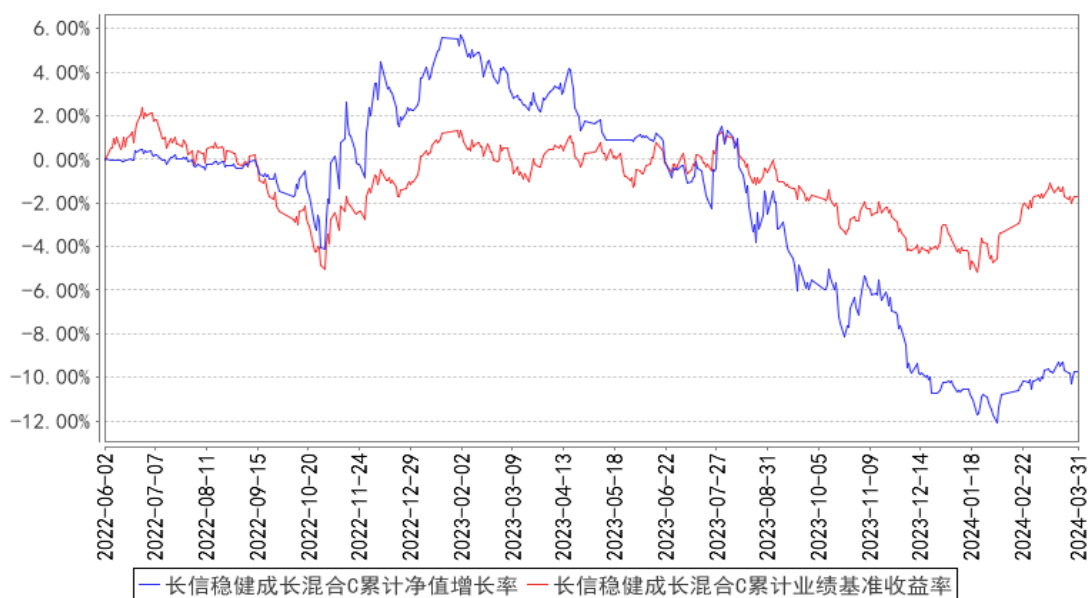
过去三个月	0.58%	0.27%	1.36%	0.32%	-0.78%	-0.05%
过去六个月	-4.45%	0.38%	-0.02%	0.29%	-4.43%	0.09%
过去一年	-12.15%	0.44%	-1.94%	0.28%	-10.21%	0.16%
自基金合同生效起至今	-9.73%	0.45%	-1.69%	0.31%	-8.04%	0.14%

### 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

长信稳健成长混合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



长信稳健成长混合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 2022 年 6 月 2 日至 2024 年 3 月 31 日。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 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中的约定。

## §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		
吴晖	长信价值优选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	2022 年 6 月 2 日	-	9 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、长信先利半年定期开放混合型证券投资基金和长信先锐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。
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	2022 年 6 月 2 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 月加入长信基金管理有限责任公司，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

	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			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。
--	---	--	--	--

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

年初以来，由于各机构配置积极性较高，且高息资产供需格局变化持续，使得无风险利率大幅下行，信用债收益率也进一步打开下行空间，信用利差被动略微走阔，大多信用债收益率创下 2015 年以来新低。权益市场经过 1 月份的调整后，市场于春节前开启大幅反弹，指数回升到 3000 点，市场成交额也站上万亿水平，3 月后逐步进入结构性行情。

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。具体操作上，纯债维持中等久期和中高等级的持仓结构。权益部分，前期通过较低仓位规避年初大幅回撤，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。

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。叠加出口等积极的拉动因素，最新的 PMI 也有回升态势。因此，在国内外一系列有力的措施之下，市场对于经济下行风险的担忧会有所缓解。国外方面，美国经济数据强劲、通胀略超预期，美元降息节点可能晚于预期。

对于债券市场而言，目前利率下行至历史低位，在资金面、消息面和机构行为等因素的相互影响下，未来或以低位震荡行情为主。配置久期资产时，保持积极灵活，兼顾高流动性和信用评级。相对看好优质区域城投、央国企产业债，以及各品种金融债。

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。投资者对企业内在价值的关注将显著增加，并减少景气趋势的过度外推。此前由于多重因素被过度定价的阶段已经过去，市场步入分化震荡和基本面驱动和观察期。后续关注领域包括，成长板块主要围绕有业绩支撑的方向，如 AI 驱动的算力、出海的电力、机械等。还有前期回调但业绩较为稳健的部分顺周期相关子板块，如造船、上游资源品等。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。

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 3 月 31 日，长信稳健成长混合 A 基金份额净值为 0.8837 元，份额累计净值为 0.9287 元，本报告期内长信稳健成长混合 A 净值增长率为 0.87%；长信稳健成长混合 C 基金份额净值为 0.8711 元，份额累计净值为 0.9081 元，本报告期内长信稳健成长混合 C 净值增长率为

0.58%，同期业绩比较基准收益率为 1.36%。

#### 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	70,215,165.90	24.14
	其中：股票	70,215,165.90	24.14
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	215,209,539.28	73.99
	其中：债券	215,209,539.28	73.99
	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	5,434,044.77	1.87
8	其他资产	141.52	0.00
9	合计	290,858,891.47	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 13,051,011.99 元，占资产净值比例为 5.86%。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	2,462,774.60	1.11
B	采矿业	900,990.00	0.40
C	制造业	33,563,054.31	15.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	851,208.00	0.38
E	建筑业	2,495,544.00	1.12
F	批发和零售业	1,201,430.00	0.54
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	3,743,003.00	1.68



K	房地产业	956,722.00	0.43
L	租赁和商务服务业	3,215,744.00	1.44
M	科学研究和技术服务业	1,659,900.00	0.75
N	水利、环境和公共设施管理业	2,671,917.00	1.20
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	3,441,867.00	1.55
S	综合	-	-
	合计	57,164,153.91	25.68

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
原材料	-	-
非日常生活消费品	-	-
日常消费品	-	-
能源	4,611,642.51	2.07
金融	1,989,478.37	0.89
医疗保健	1,014,973.38	0.46
工业	-	-
信息技术	-	-
通信服务	2,153,010.92	0.97
公用事业	3,281,906.81	1.47
房地产	-	-
合计	13,051,011.99	5.86

### 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	002818	富森美	236,800	3,215,744.00	1.44
2	600398	海澜之家	336,800	3,031,200.00	1.36
3	000895	双汇发展	110,000	2,887,500.00	1.30
4	603013	亚普股份	149,900	2,408,893.00	1.08
5	601098	中南传媒	190,100	2,400,963.00	1.08
6	603365	水星家纺	141,000	2,381,490.00	1.07
7	301109	军信股份	153,600	2,353,152.00	1.06
8	002833	弘亚数控	119,700	2,334,150.00	1.05
9	603515	欧普照明	140,200	2,261,426.00	1.02
10	603279	景津装备	109,500	2,209,710.00	0.99

#### 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	14,087,876.71	6.33
2	央行票据	-	-
3	金融债券	26,095,154.10	11.72
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	81,688,557.26	36.69
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	48,894,297.70	21.96
7	可转债（可交换债）	44,443,653.51	19.96
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	215,209,539.28	96.67

### 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	149220	20 荣盛 G2	200,000	20,393,101.37	9.16
2	2028024	20 中信银行二级	150,000	15,659,104.92	7.03
3	110059	浦发转债	131,190	14,299,332.60	6.42
4	102380955	23 赣州建投 MTN001	100,000	10,668,508.20	4.79
5	102381987	23 豫航空港 MTN010	100,000	10,444,914.75	4.69

### 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股指期货交易情况说明

#### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

#### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 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。

### 5.10.2 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。

### 5.10.3 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。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1 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，发行主体中信银行股份有限公司于 2023 年 11 月 16 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〕15 号），经查，中信银行股份有限公司存在以下问题：一、违反高管准入管理相关规定；二、关联贷款管理不合规；三、绩效考核不符合规定；四、重大关联交易信息披露不充分；五、统一授信管理不符合要求；六、内审人员配置不足；七、案件防控工作落实不到位；八、贷款风险分类不准确；九、并购贷款“三查”失职；十、违规发放并购贷款收购保险公司股权；十一、发放大量贷款代持本行不良；十二、流动资金贷款业务未严格执行贷款“三查”要求；十三、贷款资金用作归还本行理财融资；十四、固定资产贷款第一还款来源调查不实；十五、贴现资金直接转回出票人账户；十六、发放贷款偿还银行相关垫款；十七、批量转让不良资产未严格遵守真实转让原则；十八、通过同业业务投资已出表的不良资产；十九、利用空存空取规避信贷资金监控；二十、以贷转存；二十一、贷款用途监控及支付管理不到位；二十二、股票质押贷款管控不到位；二十三、部分个人贷款业务品种设计存在缺陷；二十四、承担委托贷款实质性风险；二十五、违规向非融资性担保公司提供授信；二十六、票据贸易背景审查不到位；二十七、未严格审查国内信用证业务贸易背景真实性；二十八、不良债权批量转让对象不合规；二十九、部分业务不符合国家政策要求；三十、资产证券化信息披露不准确；三十一、为企业入股金融机构提供融资；三十二、非标债权资产比例超监管标准；三十三、理财产品承接违约资产；三十四、利用管理费弥补投资损失；三十五、违规用于项目资本金；三十六、面向一般客户销售的理财产品投资权益类资产；三十七、通过同业投资归还本行不良贷款；三十八、未为每只理财产品开设独立的托管账户；三十九、改变资产交易价格，调节产品收益；四十、行长办公会有关决议不符合服务实体经济要求；四十一、理财业务与其他业务相互承接；四十二、超比例向并购项目提供理财融资；四十三、未严格落实授信批复条件；

四十四、理财资金被挪用；四十五、同业理财未按产品说明书进行投资；四十六、理财产品信息披露不合规；四十七、部分结构性存款业务不符合监管要求；四十八、代销信托产品审慎性不足；四十九、以同业返存模式吸收存款；五十、变更还款计划，分类不准确；五十一、同业投资业务风险审查和资金投向合规性审查不到位；五十二、部分新产品时点指标不符合新规监管标准；五十三、理财业务风险隔离不符合监管规定；五十四、理财与自营业务未严格分离；五十五、部分信用卡业务不合规；五十六、违反集团授信相关规定，形成不良。综上，根据《中华人民共和国商业银行法》第四十条、第七十三条、第七十四条，《中华人民共和国银行业监督管理法》第十九条、第二十条、第二十一条、第四十五条、第四十六条及相关审慎经营规则，国家金融监督管理总局决定对中信银行总行罚款 15242.59 万元、没收违法所得 462.59 万元，对分支机构罚款 6770 万元；罚没合计 22475.18 万元。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体中信银行股份有限公司于 2023 年 12 月 29 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〕69 号），经查，中信银行股份有限公司存在以下问题：一、部分重要信息系统应认定未认定，相关系统未建灾备或灾难恢复能力不符合监管要求；二、同城数据中心长期存在基础设施风险隐患未得到整改；三、对外包数据中心的准入前尽职调查和日常管理不符合监管要求，部分数据中心存在风险隐患；四、数据中心机房演练流于形式，部分演练为虚假演练，实际未开展；五、数据中心重大变更事项未向监管部门报告；六、运营中断事件报告不符合监管要求。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信银行处以罚款 400 万元。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体民生银行股份有限公司于 2023 年 8 月 2 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〕7 号），经查，民生银行股份有限公司存在以下行为：一、规避委托贷款监管，违规利用委托债权投资业务向企业融资；二、违规贷款未整改收回情况下继续违规发放贷款；三、对政府平台公司融资行为监控不力，导致政府债务增加；四、股权质押管理问题未整改五、审计人员配备不足问题未整改；六、对相关案件未按照有关规定处置；七、未按监管要求将福费廷业务纳入表内核算；八、代销池业务模式整改不到位；九、违规开展综合财富管理代销业务整改不到位；十、个别贷款风险分类结果仍存在偏离，整改不到位；十一、发放违反国家宏观调控政策贷款仍未整改收回；十二、部分正常资产转让问题整改不到位；十三、部分不良资产转让问题整改不到位或未整改；十四、对部分违规问题未进行责任追究或追究不到位。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民生银行处以罚款合计 4780 万元。其

中，总行 4430 万元，分支机构 350 万元。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体北京首都开发股份有限公司于 2023 年 7 月 12 日收到中国证券监督管理委员会下发的《立案告知书》（证监立案字 0142023014 号），因涉嫌信息披露违法违规，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，中国证监会决定对公司立案；公司于 2023 年 11 月 20 日收到中国证监会北京监管局下发的《行政处罚事先告知书》（〔2023〕12 号）；公司于 2023 年 11 月 30 日收到中国证监会北京监管局下发的《行政处罚决定书》（〔2023〕6 号）。经查明，首开股份存在以下违法事实：首开股份在 2021 年存货减值测试中，高估下属子公司存货可变现净值，少计提存货跌价准备 4.05 亿元，少计资产减值损失 4.05 亿元。上述事项导致首开股份 2021 年年度报告存在错报，并导致首开股份 2022 年 5 月至 2023 年 5 月期间发行的公司债券和债务融资工具的募集说明书等发行文件，以及在银行间债券市场披露的 2021 年年度报告存在错报。2023 年 4 月 29 日，首开股份发布《关于前期差错更正的公告》，主动进行更正，采用追溯重述法补提存货跌价准备 4.05 亿元。综上，依据《人民银行、证监会、发展改革委关于进一步加强债券市场执法工作的意见》（银发〔2018〕296 号）和《证券法》第一百九十七条第二款的规定，中国证监会北京监管局决定：一、对北京首都开发股份有限公司给予警告，并处以 150 万元的罚款；二、对相关责任人给予警告，并分别处以 60 万元的罚款。

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。

### 5.11.2 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。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	141.52

6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	141.52

#### 5.11.4 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	110059	浦发转债	14,299,332.60	6.42
2	113042	上银转债	7,500,075.08	3.37
3	113056	重银转债	7,348,847.96	3.30
4	113052	兴业转债	7,292,475.34	3.28
5	113065	齐鲁转债	2,798,611.17	1.26
6	128129	青农转债	2,382,149.16	1.07
7	113037	紫银转债	1,988,717.27	0.89
8	127025	冀东转债	600,539.92	0.27
9	127022	恒逸转债	232,905.01	0.10

#### 5.11.5 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。

#### 5.11.6 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	长信稳健成长混合 A	长信稳健成长混合 C
报告期期初基金份额总额	159,806,534.42	113,918,334.61
报告期期间基金总申购份额	17,723.77	30,855.21
减：报告期期间基金总赎回份额	12,700,883.61	7,647,244.48
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	147,123,374.58	106,301,945.34

## §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、《长信稳健成长混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长信稳健成长混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《长信稳健成长混合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 4 月 22 日