

长信可转债债券型证券投资基金 2021 年第 2 季度报告

2021 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：2021 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 2021 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 2021 年 4 月 1 日起至 2021 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 | 1,526,495,895.05 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 | 726,055,597.46 份 | 800,440,297.59 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（2021年4月1日—2021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 | 10,071,745.10 | 14,932,037.04 |
| 2. 本期利润 | 46,442,825.62 | 39,753,622.42 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0482 | 0.0407 |
| 4. 期末基金资产净值 | 1,227,830,142.59 | 1,308,606,054.72 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.6911 | 1.6349 |

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 | 2.95% | 0.56% | 3.96% | 0.31% | -1.01% | 0.25% |
| 过去六个月 | -1.18% | 0.92% | 3.74% | 0.45% | -4.92% | 0.47% |
| 过去一年 | 13.34% | 0.95% | 12.49% | 0.57% | 0.85% | 0.38% |
| 过去三年 | 40.22% | 0.85% | 37.54% | 0.57% | 2.68% | 0.28% |
| 过去五年 | 37.98% | 0.81% | 37.29% | 0.53% | 0.69% | 0.28% |
| 自基金合同生效起至今 | 227.27% | 1.16% | 59.80% | 0.96% | 167.47% | 0.20% |

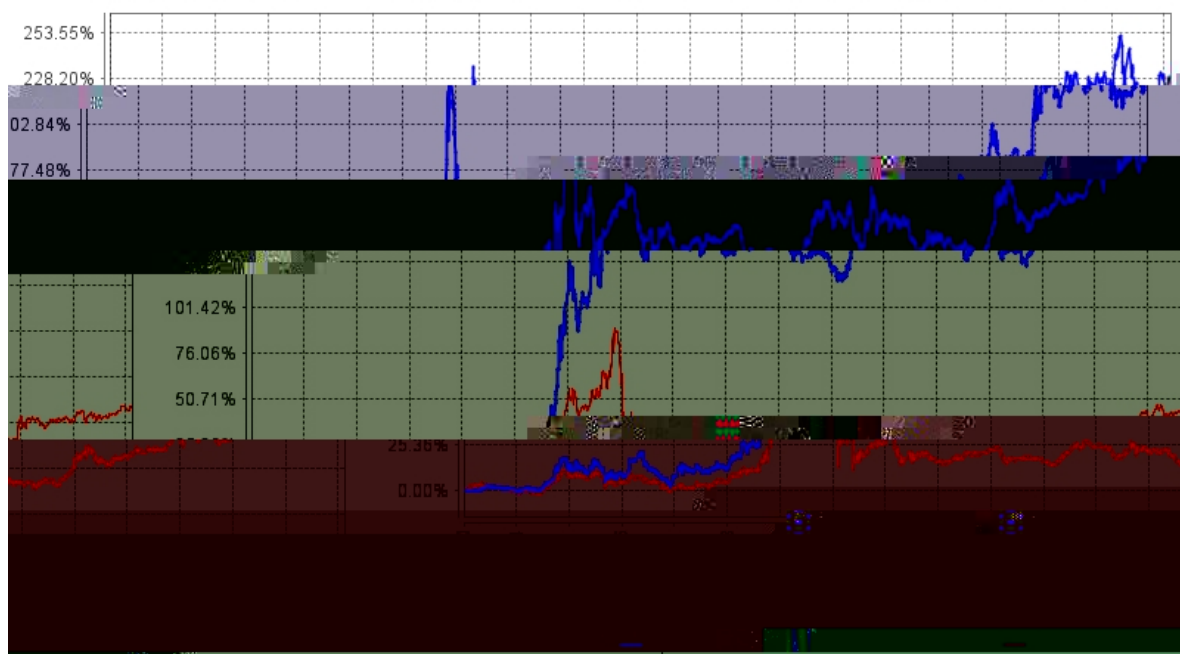
长信可转债债券 C

| 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 |
|----|--------|-----------|------------|---------------|-----|-----|
|----|--------|-----------|------------|---------------|-----|-----|

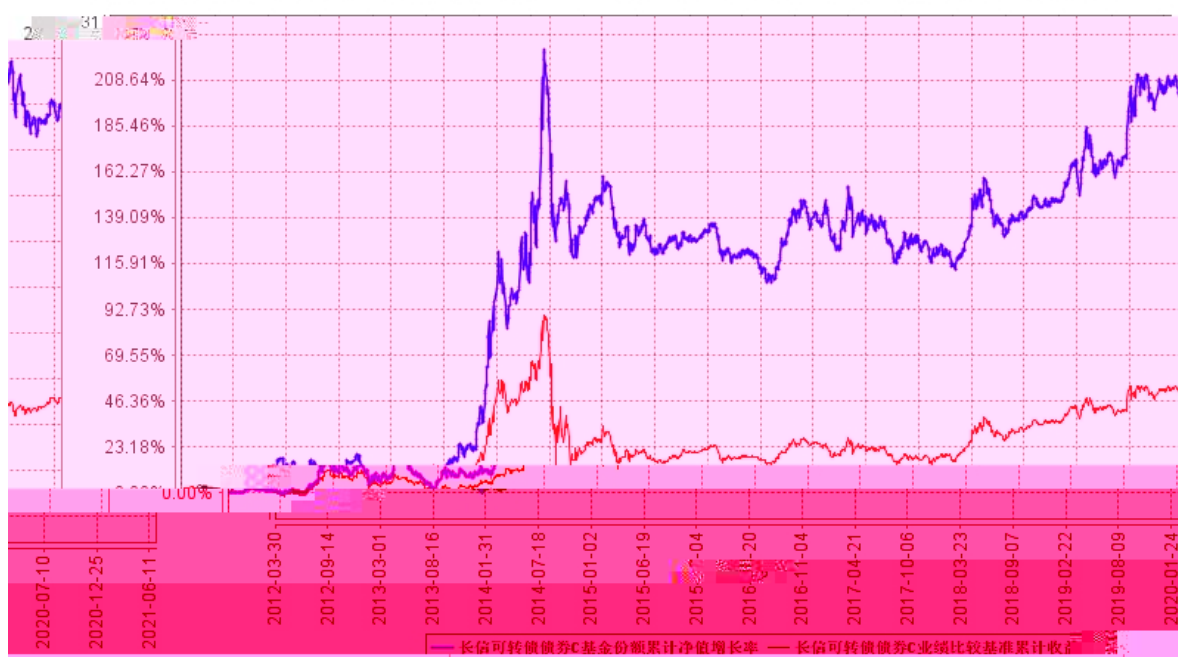
| | | 准差② | | | | |
|------------|---------|-------|--------|-------|---------|-------|
| 过去三个月 | 2.86% | 0.56% | 3.96% | 0.31% | -1.10% | 0.25% |
| 过去六个月 | -1.35% | 0.92% | 3.74% | 0.45% | -5.09% | 0.47% |
| 过去一年 | 12.95% | 0.95% | 12.49% | 0.57% | 0.46% | 0.38% |
| 过去三年 | 38.43% | 0.85% | 37.54% | 0.57% | 0.89% | 0.28% |
| 过去五年 | 35.06% | 0.81% | 37.29% | 0.53% | -2.23% | 0.28% |
| 自基金合同生效起至今 | 206.58% | 1.16% | 59.80% | 0.96% | 146.78% | 0.20% |

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基金份额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基金份额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 2021 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 | 2018 年 12 月 8 日 | - | 22 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，历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 |

| | | | | | |
|----|---|-----------------|---|-----|--|
| | 金、长信稳健精选混合型证券投资基金和长信稳健均衡 6 个月持有期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 | | | | 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金、长信稳健精选混合型证券投资基金和长信稳健均衡 6 个月持有期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、长信先利半年定期开放混合型证券投资基金和长信稳健均衡 6 个月持有期混合型证券投资基金的基金经理 | 2019 年 6 月 26 日 | - | 6 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和长信先锐债券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、长信先利半年定期开放混合型证券投资基金和长信稳健均衡 6 个月持有期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、长信中证可转债及可交换债券 50 指数证券投资基金、长信利众债券型证券投资基金 (LOF) 和长信利尚一年定期开放混合型证券投资基金的基金经理 | 2019 年 9 月 17 日 | - | 6 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，现任长信可转债债券型证券投资基金、长信中证可转债及可交换债券 50 指数证券投资基金、长信利众债券型证券投资基金 (LOF) 和长信利尚一年定期开放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 报告期内基金投资策略和运作分析

二季度国内流动性环境较为宽松，权益市场在前期调整后持续反弹，同时内部结构有所分化，部分周期和成长风格表现突出，包括国内供给主导的黑色系品种，景气度确定的新能源、医美、白酒。此前有分歧的半导体、光伏等也逐步跟上。债券收益率整体下行、信用利差压缩，部分受到事件冲击走扩的信用利差也有所缓和。

转债市场方面，二季度中证转债指数上涨 4.45%，在市场流动性有所超预期的情况下，出现了一波上涨行情。同时，市场风格上较为极致，以新能源、半导体为代表的小盘成长转债表现突出。

二季度，我们结合基本面和流动性，通过对各类资产的灵活配置来为投资者获取稳定的回报。具体操作上，调整部分股票仓位到长期产业趋势确定、短期景气度高的板块中，提高对业绩和估值匹配度的要求，同时对部分转债标的进行了止盈。

展望下半年，国内经济增长有望保持较强韧性，带动企业盈利向上。出口相关的产业链继续维持高景气，基建有望在专项债加速发行的推动之下逐步恢复。同时，预计 PPI 仍将保持较高水平，带动下半年名义经济持续增长，给企业盈利带来进一步的上行，这些都是对下半年市场最为有力的支撑。政策方面，我们预计货币政策仍然将保持平稳，企业融资压力最大的时候逐步过去。虽然专项债发行可能使得利率水平略有上行，但整体对市场的影响较为有限。此外，企业盈利上行推动的信用利差改善对估值有较强的支撑。海外方面，随着疫苗接种的加速，全球的货币政策将向中性回归，但在节奏、力度和结构上存在差异，密切关注美国政策的拐点。

三季度权益市场更多关注结构性机会，一方面坚持长期增长较为确定、业绩能够支撑估值的资产，包括汽车、电气设备、石油石化等。另外一方面，寻找在盈利上行期中业绩弹性较高的领域，例如电子、新能源、高端制造等。转债市场的估值，经过前期的低价修复和高价压缩，目前恢复到合理水平，需要自下而上结合公司本身的资质以及市场预期，精选优质标的进行配置。

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券集中度，加强流动性管理，进一步优化投资组合，力争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 2021 年 6 月 30 日，长信可转债债券 A 份额净值为 1.6911 元，份额累计净值为 2.6511 元，本报告期内长信可转债债券 A 净值增长率为 2.95%；长信可转债债券 C 份额净值为 1.6349 元，份额累计净值为 2.5419 元，本报告期内长信可转债债券 C 净值增长率为 2.86%，同期业绩比较基准收益率为 3.96%。

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 | 496,908,583.91 | 15.89 |
| | 其中：股票 | 496,908,583.91 | 15.89 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 2,471,390,785.53 | 79.01 |

| | | | |
|---|-------------------|------------------|--------|
| | 其中：债券 | 2,471,390,785.53 | 79.01 |
| | 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 | 72,406,138.95 | 2.31 |
| 8 | 其他资产 | 87,110,262.20 | 2.79 |
| 9 | 合计 | 3,127,815,770.59 | 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 | 16,558,950.30 | 0.65 |
| C | 制造业 | 374,771,840.81 | 14.78 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| 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 | 28,998,021.00 | 1.14 |
| J | 金融业 | 59,303,010.00 | 2.34 |
| K | 房地产业 | 2,507,193.00 | 0.10 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 14,769,568.80 | 0.58 |
| 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 | 496,908,583.91 | 19.59 |

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：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 | 002415 | 海康威视 | 1,490,395 | 96,130,477.50 | 3.79 |
| 2 | 300054 | 鼎龙股份 | 5,170,000 | 94,352,500.00 | 3.72 |
| 3 | 601233 | 桐昆股份 | 2,250,523 | 54,215,099.07 | 2.14 |
| 4 | 601166 | 兴业银行 | 2,008,200 | 41,268,510.00 | 1.63 |
| 5 | 600309 | 万华化学 | 377,169 | 41,043,530.58 | 1.62 |
| 6 | 300253 | 卫宁健康 | 1,782,300 | 28,998,021.00 | 1.14 |
| 7 | 300059 | 东方财富 | 550,000 | 18,034,500.00 | 0.71 |
| 8 | 601899 | 紫金矿业 | 1,708,870 | 16,558,950.30 | 0.65 |
| 9 | 002241 | 歌尔股份 | 368,000 | 15,728,320.00 | 0.62 |
| 10 | 603259 | 药明康德 | 94,320 | 14,769,568.80 | 0.58 |

5.3.2 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的全国中小企业股份转让系统挂牌股票投资明细

注：本基金本报告期末未持有全国中小企业股份转让系统挂牌股票。

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 | 106,030,800.00 | 4.18 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 39,088,675.80 | 1.54 |
| | 其中：政策性金融债 | 39,088,675.80 | 1.54 |
| 4 | 企业债券 | 9,615,000.00 | 0.38 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | 2,316,656,309.73 | 91.34 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 2,471,390,785.53 | 97.44 |

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 | 110079 | 杭银转债 | 2,164,140 | 246,430,621.80 | 9.72 |

| | | | | | |
|---|--------|----------|---------|----------------|------|
| 2 | 110063 | 鹰 19 转债 | 970,580 | 114,518,734.20 | 4.51 |
| 3 | 110047 | 山鹰转债 | 876,930 | 102,311,423.10 | 4.03 |
| 4 | 113602 | 景 20 转债 | 765,580 | 90,927,936.60 | 3.58 |
| 5 | 132021 | 19 中电 EB | 844,430 | 90,379,342.90 | 3.56 |

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

注：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

注：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

注：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

注：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

注：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

注：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受到调查以及处罚的情况的说明

报告期内本基金投资的前十名证券中,300054.SZ_鼎龙股份于 2020 年 11 月 17 日收到深圳证券交易所《关于对湖北鼎龙控股股份有限公司给予通报批评处分的决定》，具体内容如下：2019 年 5 月 28 日，鼎龙股份披露《关于回购公司股份的方案》，经公司董事会审议通过，拟以集中竞价交易等方式回购鼎龙股份的股份，回购资金总额不低于 1 亿元、不超过 2 亿元，回购价格不超过 14 元/股，回购期限自董事会审议通过本次回购股份方案之日起不超过十二个月。2020 年 5 月 30 日，鼎龙股份披露《关于第二期股份回购期限届满暨股份回购实施结果的公告》，截至 2020 年 5 月 28 日，回购实施期限已届满，鼎龙股份累计回购股份 94 万股，实际回购总成交金额为 976.93

万元。鼎龙股份实际回购金额与回购方案中披露的最低回购金额差异 9,023.07 万元，差异比例达 90.23%，未完成回购计划。鼎龙股份的上述行为违反了《创业板股票上市规则（2018 年 11 月修订）》第 1.4 条和《上市公司回购股份实施细则》第四条、第三十三条的规定。鉴于上述违规事实及情节，依据《创业板股票上市规则（2018 年 11 月修订）》第 16.2 条，《创业板股票上市规则（2020 年修订）》第 12.4 条和《上市公司纪律处分实施标准（试行）》第三十条的规定，经深交所纪律处分委员会审议通过，作出对湖北鼎龙控股股份有限公司给予通报批评的处分。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体杭州银行股份有限公司于 2021 年 5 月 18 日收到中国银保监会浙江监管局行政处罚决定书（浙银保监罚决字〔2021〕25 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、第四十八条第（二）项，经查，杭州银行存在：一、房地产项目融资业务不审慎；二、流动资金贷款管理不审慎，资金被挪用于支付土地出让金；三、授信投放不审慎，超额投放；四、理财资金管理不审慎，回流借款人母公司挪用于支付土地出让保证金；五、个人经营贷款管理不审慎，资金挪用于购房；六、个人消费贷款管理不审慎，资金挪用于购房。综上，中国银保监会浙江监管局给予公司罚款人民币 250 万元处罚。

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八名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超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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 | 1,247,674.64 |
| 2 | 应收证券清算款 | 78,036,600.46 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 7,253,978.47 |
| 5 | 应收申购款 | 572,008.63 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 87,110,262.20 |

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 | 110063 | 鹰 19 转债 | 114,518,734.20 | 4.51 |
| 2 | 110047 | 山鹰转债 | 102,311,423.10 | 4.03 |
| 3 | 113602 | 景 20 转债 | 90,927,936.60 | 3.58 |
| 4 | 110076 | 华海转债 | 88,262,565.30 | 3.48 |
| 5 | 128083 | 新北转债 | 83,763,062.74 | 3.30 |
| 6 | 128114 | 正邦转债 | 70,734,371.68 | 2.79 |
| 7 | 110067 | 华安转债 | 70,634,021.00 | 2.78 |
| 8 | 113563 | 柳药转债 | 70,009,394.70 | 2.76 |
| 9 | 113011 | 光大转债 | 64,498,263.20 | 2.54 |
| 10 | 123050 | 聚飞转债 | 63,106,953.58 | 2.49 |
| 11 | 113037 | 紫银转债 | 55,216,584.00 | 2.18 |
| 12 | 128109 | 楚江转债 | 54,089,402.78 | 2.13 |
| 13 | 110073 | 国投转债 | 53,242,130.10 | 2.10 |
| 14 | 123056 | 雪榕转债 | 43,740,121.20 | 1.72 |
| 15 | 128129 | 青农转债 | 40,515,114.12 | 1.60 |
| 16 | 110053 | 苏银转债 | 38,827,918.40 | 1.53 |
| 17 | 110034 | 九州转债 | 38,629,773.60 | 1.52 |
| 18 | 123053 | 宝通转债 | 35,500,662.15 | 1.40 |
| 19 | 123049 | 维尔转债 | 35,071,757.60 | 1.38 |
| 20 | 128121 | 宏川转债 | 34,604,376.66 | 1.36 |
| 21 | 128131 | 崇达转 2 | 32,745,089.60 | 1.29 |
| 22 | 113604 | 多伦转债 | 25,938,862.50 | 1.02 |
| 23 | 113013 | 国君转债 | 25,346,150.80 | 1.00 |
| 24 | 128022 | 众信转债 | 24,542,992.50 | 0.97 |
| 25 | 127022 | 恒逸转债 | 23,986,401.20 | 0.95 |
| 26 | 113593 | 沪工转债 | 23,792,833.00 | 0.94 |
| 27 | 110033 | 国贸转债 | 22,596,676.60 | 0.89 |
| 28 | 110045 | 海澜转债 | 21,188,490.30 | 0.84 |
| 29 | 123002 | 国祯转债 | 19,133,504.76 | 0.75 |
| 30 | 128123 | 国光转债 | 18,928,834.05 | 0.75 |
| 31 | 128139 | 祥鑫转债 | 17,938,811.01 | 0.71 |
| 32 | 113548 | 石英转债 | 17,087,063.40 | 0.67 |
| 33 | 128035 | 大族转债 | 15,463,870.80 | 0.61 |
| 34 | 128142 | 新乳转债 | 14,758,598.40 | 0.58 |
| 35 | 123081 | 精研转债 | 14,432,715.56 | 0.57 |
| 36 | 123076 | 强力转债 | 13,837,043.99 | 0.55 |
| 37 | 128048 | 张行转债 | 12,165,600.00 | 0.48 |

| | | | | |
|----|--------|-------|---------------|------|
| 38 | 123083 | 朗新转债 | 11,848,599.84 | 0.47 |
| 39 | 123073 | 同和转债 | 10,953,774.72 | 0.43 |
| 40 | 128141 | 旺能转债 | 10,772,805.96 | 0.42 |
| 41 | 113044 | 大秦转债 | 10,725,280.20 | 0.42 |
| 42 | 113594 | 淳中转债 | 10,041,248.90 | 0.40 |
| 43 | 113598 | 法兰转债 | 9,944,221.30 | 0.39 |
| 44 | 113565 | 宏辉转债 | 5,374,000.00 | 0.21 |
| 45 | 123090 | 三诺转债 | 3,879,958.55 | 0.15 |
| 46 | 110075 | 南航转债 | 3,122,634.90 | 0.12 |
| 47 | 128125 | 华阳转债 | 2,717,347.40 | 0.11 |
| 48 | 113012 | 骆驼转债 | 2,508,400.00 | 0.10 |
| 49 | 127011 | 中鼎转 2 | 1,212,500.00 | 0.05 |
| 50 | 123038 | 联得转债 | 1,162,100.00 | 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

注：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

注：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 | 1,155,933,685.22 | 942,964,527.33 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 229,710,744.99 | 563,330,200.88 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 659,588,832.75 | 705,854,430.62 |
| 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 | 726,055,597.46 | 800,440,297.59 |

§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

注：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

注：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

注：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

注：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：

长信基金管理有限责任公司

2021 年 7 月 21 日