

# 长信可转债债券型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告

2022 年 12 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：平安银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 1 月 20 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 2023 年 1 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 2022 年 10 月 1 日起至 2022 年 12 月 31 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	830,791,689.26 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	418,628,816.96 份	412,162,872.30 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 10 月 1 日-2022 年 12 月 31 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	-12,887,675.07	-11,343,325.26
2. 本期利润	-24,139,503.60	-20,934,030.73
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0530	-0.0520
4. 期末基金资产净值	687,429,392.45	650,884,468.40
5. 期末基金份额净值	1.6421	1.5792

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	-2.85%	0.83%	-1.55%	0.50%	-1.30%	0.33%
过去六个月	-8.39%	0.69%	-5.48%	0.45%	-2.91%	0.24%
过去一年	-14.36%	0.89%	-8.32%	0.55%	-6.04%	0.34%
过去三年	14.80%	0.91%	13.66%	0.56%	1.14%	0.35%
过去五年	35.17%	0.87%	35.82%	0.56%	-0.65%	0.31%
自基金合同	217.79%	1.13%	61.31%	0.91%	156.48%	0.22%

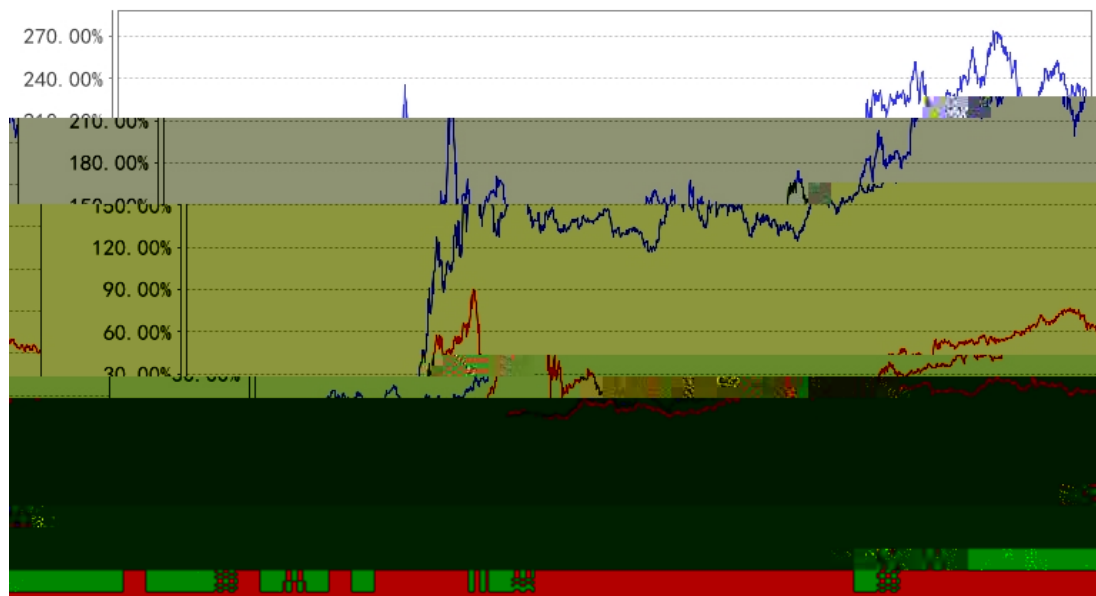
生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

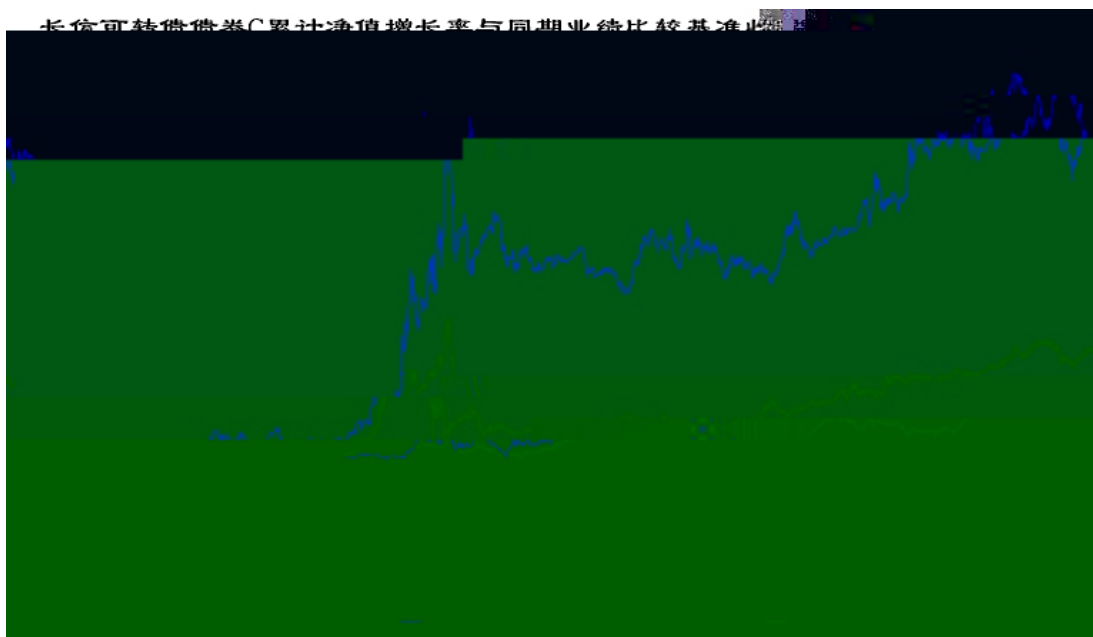
长信可转债债券 C

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
过去三个月	-2.94%	0.83%	-1.55%	0.50%	-1.39%	0.33%
过去六个月	-8.55%	0.69%	-5.48%	0.45%	-3.07%	0.24%
过去一年	-14.66%	0.89%	-8.32%	0.55%	-6.34%	0.34%
过去三年	13.60%	0.91%	13.66%	0.56%	-0.06%	0.35%
过去五年	32.46%	0.87%	35.82%	0.56%	-3.36%	0.31%
自基金合同生效起至今	196.14%	1.13%	61.31%	0.91%	134.83%	0.22%

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





注：1、图示日期为 2012 年 3 月 30 日至 2022 年 12 月 31 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	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金

	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、总经理助理、投资决策委员会执行委员				、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	曾任本基金的基金经理	2019 年 9 月 17 日	2022 年 12 月 2 日	7 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

四季度，股票市场呈现底部震荡行情。10 月份受到北上资金大幅流出的影响，A 股和港股市场快速调整，但是随着国内地产和疫情防控政策的调整，市场迎来了一波猛烈的修复上涨行情，尤其以恒生科技、A50 为代表的板块标的表现强势。四季度，转债市场在正股结构性因素等的冲击下，指数和估值均出现显著调整。以平衡型转债为例，其对应估值较 8 月高点下降 10 个百分点左右。从绝对位置来看，转股溢价率和转债价格情况再次接近上半年的底部位置。

面对市场的分化和波动，我们通过资产结构调整，努力控制组合波动。具体操作上减仓景气弱化和过高估值的标的，规避市场调整带来的回撤风险。市场经过调整后，再积极加仓被错杀的优质标的，期待后续的修复行情。

展望 2023 年，在最近的重要经济工作会议上，明确指出恢复市场信心，稳增长，促内需等政策进行的主观定调。因此，明年经济逐步复苏回暖是大概率事件，与此同时企业和居民的信心也将同步恢复，无风险利率可能偏震荡，权益市场有望引来逐级向上的行情。流动性方面，货币政

策将延续和财政政策联动，配合提供合理充裕的流动性环境。

经济复苏作为重要主线所包括的行业和细分领域非常丰富。我们看好（1）和宏观经济有强相关性而且估值很低的公司，大多是在港股，尤其互联网公司面临的是政策环境改善，宏观经济和业绩改善，也就是估值和利润的双击。（2）目前市场预期不高的地产链条，后续政策的推进和终端数据随着疫情政策调整有超预期的可能性。其中建材，家居等细分领域估值便宜，行业还有供给侧出清的逻辑。（3）成长股也有和宏观经济关联度比较高的公司。消费电子受到产品周期下行，全球经济下行需求不好影响；计算机板块则是经济下行周期里企业缩减 IT 支出。一旦经济复苏，这些负面因素都会得到修正。经过前期较为充分的调整，目前转债市场的高性价比标的可选性增强，在结构上可通过精选个券做出积极调整，尤其需要关注部分上市初期定价偏低的龙头新券。

下一阶段我们将积极关注经济走势和政策动向，动态调整组合的行业分布和标的集中度，加强流动性管理，进一步优化投资组合，力争为投资者获取较好的收益。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2022 年 12 月 31 日，长信可转债债券 A 基金份额净值为 1.6421 元，份额累计净值为 2.6021 元，本报告期内长信可转债债券 A 净值增长率为-2.85%；长信可转债债券 C 基金份额净值为 1.5792 元，份额累计净值为 2.4862 元，本报告期内长信可转债债券 C 净值增长率为-2.94%，同期业绩比较基准收益率为-1.55%。

#### 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	260,038,602.42	16.03
	其中：股票	260,038,602.42	16.03
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,229,133,003.03	75.79
	其中：债券	1,229,133,003.03	75.79
	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	-	-

	产		
7	银行存款和结算备付金合计	128,200,465.98	7.91
8	其他资产	4,368,383.15	0.27
9	合计	1,621,740,454.58	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	6,995,700.00	0.52
C	制造业	160,350,723.04	11.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	5,794,076.00	0.43
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	3,837,484.00	0.29
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	21,747,766.58	1.63
J	金融业	52,542,034.80	3.93
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	8,770,818.00	0.66
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	260,038,602.42	19.43

### 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	600519	贵州茅台	12,800	22,105,600.00	1.65
2	300054	鼎龙股份	1,033,228	21,997,424.12	1.64
3	000776	广发证券	1,410,800	21,853,292.00	1.63
4	300750	宁德时代	48,900	19,238,238.00	1.44
5	300059	东方财富	969,902	18,816,098.80	1.41
6	000733	振华科技	120,000	13,707,600.00	1.02
7	300033	同花顺	120,400	11,872,644.00	0.89
8	600570	恒生电子	272,484	11,024,702.64	0.82
9	002475	立讯精密	341,600	10,845,800.00	0.81
10	688266	泽璟制药	250,000	10,425,000.00	0.78

#### 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	61,423,713.40	4.59
2	央行票据	-	-
3	金融债券	26,551,618.08	1.98
	其中：政策性金融债	26,551,618.08	1.98
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）	1,091,365,828.79	81.55
8	同业存单	49,791,842.76	3.72
9	其他	-	-
10	合计	1,229,133,003.03	91.84

#### 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	110085	通 22 转债	1,133,670	135,117,965.34	10.10
2	118023	广大转债	652,830	73,307,979.85	5.48
3	123158	宙邦转债	547,441	67,857,381.73	5.07
4	113641	华友转债	599,080	66,303,975.04	4.95
5	127073	天赐转债	386,721	47,081,639.51	3.52

#### 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，发行主体兴业银行股份有限公司于 2022 年 9 月 9 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）41 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，兴业银行存在债券承销业务严重违反审慎经营规则的行为，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 150 万元。

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 9 月 28 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〕50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、未按规定开展理财业务内部审计；三、同业理财产品未持续压降；四、单独使用区间数值展示业绩比较基准；五、理财托管业务违反资产独立性原则要求。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 450 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。

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	276,650.82
2	应收证券清算款	4,000,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	91,732.33
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	4,368,383.15

### 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	135,117,965.34	10.10
2	113641	华友转债	66,303,975.04	4.95
3	113052	兴业转债	45,816,472.60	3.42
4	110081	闻泰转债	33,726,763.14	2.52
5	110079	杭银转债	31,572,552.36	2.36
6	113011	光大转债	31,383,369.86	2.34
7	123144	裕兴转债	27,131,210.20	2.03
8	113050	南银转债	25,266,795.17	1.89
9	110082	宏发转债	18,563,444.21	1.39
10	118005	天奈转债	18,527,382.92	1.38
11	113053	隆 22 转债	14,198,227.31	1.06
12	110053	苏银转债	13,608,874.52	1.02
13	113048	晶科转债	13,400,998.63	1.00
14	110086	精工转债	12,344,447.79	0.92
15	123133	佩蒂转债	12,027,047.72	0.90
16	123124	晶瑞转 2	11,287,737.23	0.84
17	110063	鹰 19 转债	11,143,788.27	0.83
18	118008	海优转债	10,260,030.96	0.77
19	123076	强力转债	9,760,369.28	0.73
20	113043	财通转债	9,424,936.65	0.70

21	127052	西子转债	8,877,863.84	0.66
22	110073	国投转债	8,732,118.68	0.65
23	123149	通裕转债	8,607,909.98	0.64
24	113636	甬金转债	8,592,004.88	0.64
25	113045	环旭转债	8,424,478.26	0.63
26	113013	国君转债	5,255,513.70	0.39
27	113042	上银转债	5,249,895.89	0.39
28	110059	浦发转债	5,246,458.90	0.39
29	113060	浙 22 转债	4,831,924.38	0.36
30	123142	申昊转债	4,745,209.89	0.35
31	113054	绿动转债	3,082,976.71	0.23
32	110072	广汇转债	2,612,367.78	0.20
33	110067	华安转债	2,550,840.40	0.19
34	123002	国祯转债	2,531,632.77	0.19
35	127045	牧原转债	2,172,617.75	0.16
36	127047	帝欧转债	1,920,090.41	0.14
37	111001	山玻转债	1,831,298.45	0.14
38	113644	艾迪转债	1,065,316.16	0.08

#### 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	372,526,868.39	377,944,061.60
报告期期间基金总申购份额	177,856,351.57	138,549,495.38
减：报告期期间基金总赎回份额	131,754,403.00	104,330,684.68
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	418,628,816.96	412,162,872.30

### § 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：

长信基金管理有限责任公司

2023 年 1 月 20 日