

长信利富债券型证券投资基金

2023 年第 1 季度报告

2023 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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 4 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金基金合同的规定于 2023 年 4 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 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 3 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称 | 长信利富债券 |
| 场内简称 | 长信利富 |
| 基金主代码 | 519967 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2015 年 5 月 6 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 489,668,349.69 份 |
| 投资目标 | 通过积极主动的资产管理和严格的风险控制，在保持基金资产流动性和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 | <p>1、资产配置策略</p> <p>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，并对各类资产的配置比例进行定期或不定期调整。</p> <p>2、债券投资策略</p> <p>本基金主要采用积极管理型的投资策略，自上而下分为战略性策略和战术性策略两个层面，结合对各市场上不同投资品种的具体分析，共同构成本基金的投资策略结构。</p> <p>3、股票投资策略</p> <p>（1）行业配置策略</p> <p>在行业配置层面，本基金将运用“自上而下”的行业配</p> |

| | | |
|-----------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|
| | <p>置方法，通过对国内外宏观经济走势、经济结构转型的方向、国家经济与产业政策导向和经济周期调整的深入研究，采用价值理念与成长理念相结合的方法对行业进行筛选。</p> <p>(2) 个股投资策略</p> <p>本基金将结合定性与定量分析，主要采取自下而上的选股策略。基金依据约定的投资范围，基于对上市公司的品质评估分析、风险因素分析和估值分析，筛选出基本面良好的股票进行投资，在有效控制风险前提下，争取实现基金资产的长期稳健增值。</p> <p>(3) 存托凭证投资策略</p> <p>本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。</p> <p>4、其他类型资产投资策略</p> <p>在法律法规或监管机构允许的情况下，本基金将在严格控制投资风险的基础上适当参与权证、资产支持证券等金融工具的投资。</p> | |
| 业绩比较基准 | 中证全债指数收益率*80%+中证 800 指数收益率*20% | |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，其预期风险和收益低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金，属于证券投资基金产品中风险收益程度中等偏低的投资品种。 | |
| 基金管理人 | 长信基金管理有限责任公司 | |
| 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 长信利富债券 A | 长信利富债券 C |
| 下属分级基金的场内简称 | 长信利富 | - |
| 下属分级基金的交易代码 | 519967 | 013558 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 360,794,188.57 份 | 128,874,161.12 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（2023 年 1 月 1 日-2023 年 3 月 31 日） | |
|-----------------|-------------------------------------|----------------|
| | 长信利富债券 A | 长信利富债券 C |
| 1. 本期已实现收益 | 4,801,235.02 | 1,208,614.46 |
| 2. 本期利润 | 15,403,755.97 | -1,019,718.99 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0512 | -0.0127 |
| 4. 期末基金资产净值 | 449,189,704.31 | 159,401,001.13 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.2450 | 1.2369 |

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

长信利富债券 A

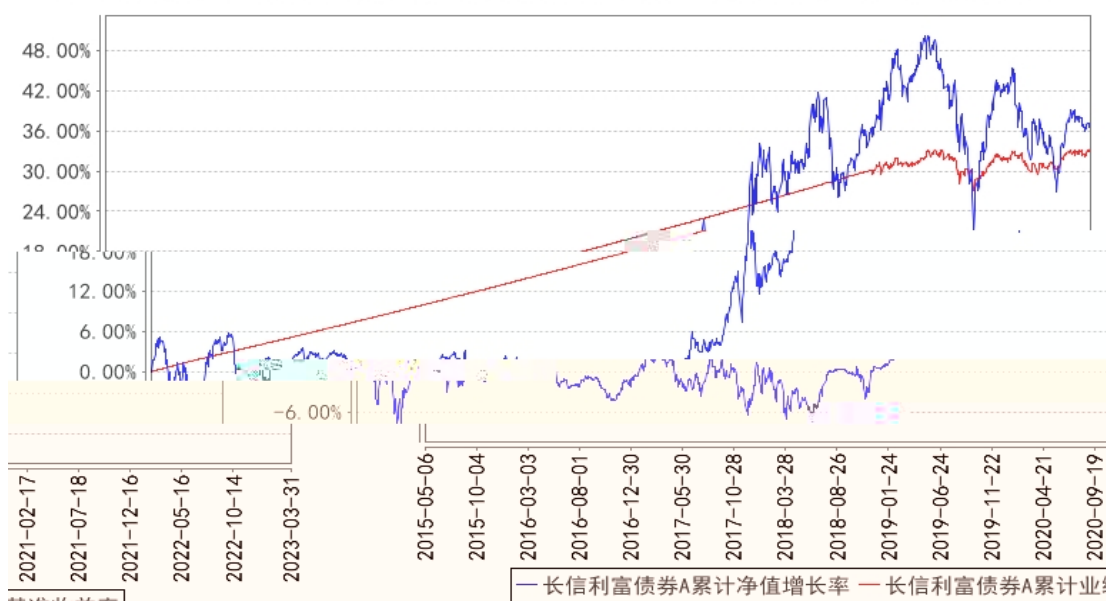
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | 5.67% | 0.41% | 1.90% | 0.16% | 3.77% | 0.25% |
| 过去六个月 | 2.85% | 0.59% | 2.25% | 0.20% | 0.60% | 0.39% |
| 过去一年 | 2.57% | 0.74% | 2.57% | 0.22% | 0.00% | 0.52% |
| 过去三年 | 21.54% | 0.79% | 7.92% | 0.17% | 13.62% | 0.62% |
| 过去五年 | 37.24% | 0.76% | 17.48% | 0.13% | 19.76% | 0.63% |
| 自基金合同生效起至今 | 37.16% | 0.68% | 33.23% | 0.11% | 3.93% | 0.57% |

长信利富债券 C

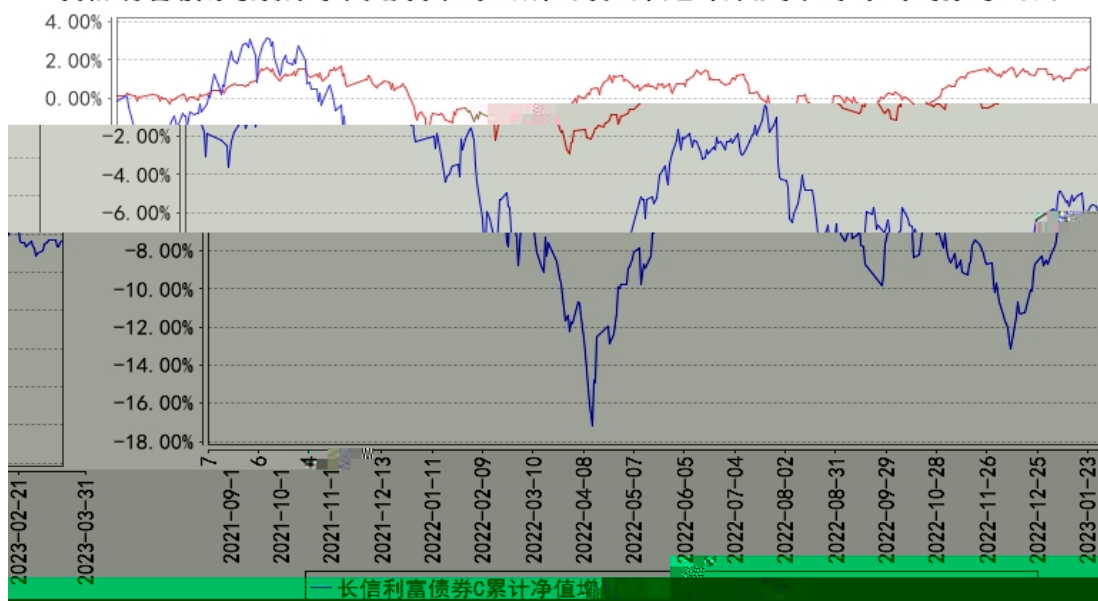
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|-----------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | 5.58% | 0.41% | 1.90% | 0.16% | 3.68% | 0.25% |
| 过去六个月 | 2.59% | 0.59% | 2.25% | 0.20% | 0.34% | 0.39% |
| 过去一年 | 2.13% | 0.74% | 2.57% | 0.22% | -0.44% | 0.52% |
| 自份额增加日起至今 | -6.33% | 0.75% | 1.71% | 0.22% | -8.04% | 0.53% |

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

长信利富债券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



长信利富债券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、基金管理人自 2021 年 9 月 17 日起对长信利富债券型证券投资基金进行份额分类，原有基金份额为 A 类份额，增设 C 类份额。

2、长信利富债券 A 图示日期为 2015 年 5 月 6 日至 2023 年 3 月 31 日，长信利富债券 C 图示日期为 2021 年 9 月 17 日（份额增加日）至 2023 年 3 月 31 日。

3、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，本基金的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

| | | | | |
|----------------------------------------------------|--|--|--|----------------------------------|
| 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 | | | | 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遵规守信情况的说明

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

一季度，市场流动性环境较去年下半年边际收敛，在信贷持续投放、地方债靠前发行的背景下，货币市场波动放大。同时，央行为维护资金面稳定，保持较高的公开市场逆回购余额，并于 3

月 27 日降准 0.25 个百分点。整体上，10 年国债收益率呈现区间震荡，利率债收益率曲线趋于平坦化，信用利差在配置盘的作用下压缩较快。权益市场方面，年初延续了去年四季度以来的上行趋势，春节后受海外银行风险事件的影响，上证指数进入震荡调整，但是 TMT 板块在人工智能的产业催化下表现突出。

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，纯债维持中短久期和中高等级的持仓结构。权益部分，为控制回撤在市场预期变化时及时灵活调整了整体仓位，并在 AI 引领的 TMT 板块，适度配置了有实际受益且业绩估值匹配的标的。

随着防疫政策优化和春节后经济活动逐渐恢复，一季度国内经济表现较好，制造业生产经营持续回暖，PMI 明显好转。此外，金融数据也超预期，并且结构上企业与中长期信贷恢复明显，居民信贷同比也有大幅改善。预计二季度经济将延续回升态势，工业生产、消费、地产数据仍有改善空间，内需动力将继续增强。流动性方面，预计央行将在继续做好支持实体经济工作的同时，更注重资金使用效率，货币工具调节更加合理适度。海外方面，美联储加息进程接近尾声，流动性回流压力将逐渐放缓。

4 月将进入季报验证的重要窗口期，重点寻找业绩确定性高且有持续成长性方向，比如消费和医药板块，二季度低基数效应下，随着居民信心逐步恢复，带动相关需求朝着积极方向恢复。成长板块从新能源过渡到以数字经济为代表的产业投资方向，计算机领域重点信创和 AI 相关，半导体的算力芯片，通信领域的运营商，应用端的游戏广告均有望从中受益。另外，从中期维度上看，顺周期板块和国央企改革也是重要关注方向。转债市场在磨底过程中，高性价比转债的可选性开始增强，关注业绩较好、估值合理的相关标的。纯债方面，维持中短久期策略，力争获取稳健的票息收益。

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 2023 年 3 月 31 日，长信利富债券 A 基金份额净值为 1.2450 元，份额累计净值为 1.3710 元，本报告期内长信利富债券 A 净值增长率为 5.67%；长信利富债券 C 基金份额净值为 1.2369 元，份额累计净值为 1.3029 元，本报告期内长信利富债券 C 净值增长率为 5.58%，同期业绩比较基准收益率为 1.90%。

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 | 113,509,016.06 | 17.25 |
| | 其中：股票 | 113,509,016.06 | 17.25 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 502,394,742.05 | 76.34 |
| | 其中：债券 | 502,394,742.05 | 76.34 |
| | 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 | 11,162,180.44 | 1.70 |
| 8 | 其他资产 | 30,999,286.21 | 4.71 |
| 9 | 合计 | 658,065,224.76 | 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 | - | - |
| C | 制造业 | 74,912,180.22 | 12.31 |
| 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 | 2,905,518.00 | 0.48 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 9,490,932.00 | 1.56 |
| H | 住宿和餐饮业 | 3,454,320.00 | 0.57 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 16,268,925.84 | 2.67 |
| J | 金融业 | 2,195,856.00 | 0.36 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 1,137,920.00 | 0.19 |
| 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 | 3,143,364.00 | 0.52 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 113,509,016.06 | 18.65 |

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 | 000568 | 泸州老窖 | 16,800 | 4,280,472.00 | 0.70 |
| 2 | 600004 | 白云机场 | 239,100 | 3,737,133.00 | 0.61 |
| 3 | 603198 | 迎驾贡酒 | 53,600 | 3,570,296.00 | 0.59 |
| 4 | 601126 | 四方股份 | 244,500 | 3,547,695.00 | 0.58 |
| 5 | 300659 | 中孚信息 | 117,200 | 3,539,440.00 | 0.58 |
| 6 | 300092 | 科新机电 | 232,200 | 3,529,440.00 | 0.58 |
| 7 | 600258 | 首旅酒店 | 148,000 | 3,454,320.00 | 0.57 |
| 8 | 300737 | 科顺股份 | 288,736 | 3,398,422.72 | 0.56 |
| 9 | 688697 | 纽威数控 | 136,790 | 3,396,495.70 | 0.56 |
| 10 | 300144 | 宋城演艺 | 193,200 | 3,143,364.00 | 0.52 |

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 | 314,004,404.49 | 51.60 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 11,346,111.23 | 1.86 |
| | 其中：政策性金融债 | 11,346,111.23 | 1.86 |
| 4 | 企业债券 | 10,012,953.43 | 1.65 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | 167,031,272.90 | 27.45 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 502,394,742.05 | 82.55 |

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 | 019663 | 21 国债 15 | 818,000 | 82,901,207.29 | 13.62 |

| | | | | | |
|---|--------|----------|---------|---------------|------|
| 2 | 019679 | 22 国债 14 | 571,000 | 57,813,280.68 | 9.50 |
| 3 | 019674 | 22 国债 09 | 563,000 | 57,320,402.80 | 9.42 |
| 4 | 019656 | 21 国债 08 | 537,000 | 54,927,037.64 | 9.03 |
| 5 | 019688 | 22 国债 23 | 414,000 | 41,595,782.30 | 6.83 |

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，发行主体新潮中宝股份有限公司于 2023 年 3 月 16 日收到上海证券交易所出具的《关于对新潮中宝股份有限公司及有关责任人予以通报批评的决定》（〔2023〕24 号），经查，新潮中宝股份有限公司在信息披露、规范运作方面，有关责任人在职责履行方面，存在以下违规行为：一、向关联方提供财务资助未履行决议程序及披露义务；二、对外投资事项未履行董事会决议程序及披露义务；三、未披露关联交易相关情况。综上，上海证券交易所作出如下纪律处分决定：对新潮中宝股份有限公司和时任董事长林俊波、时任总裁赵伟卿、时任财务总监潘孝娜、时任董事会秘书虞迪锋予以通报批评。

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 | 93,535.77 |
| 2 | 应收证券清算款 | 3,906,768.75 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 26,998,981.69 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 30,999,286.21 |

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 | 113060 | 浙 22 转债 | 8,739,360.98 | 1.44 |
| 2 | 113648 | 巨星转债 | 6,777,865.84 | 1.11 |
| 3 | 123108 | 乐普转 2 | 6,123,685.51 | 1.01 |
| 4 | 123122 | 富瀚转债 | 5,690,638.01 | 0.94 |
| 5 | 118015 | 芯海转债 | 4,039,000.22 | 0.66 |
| 6 | 127019 | 国城转债 | 3,647,882.14 | 0.60 |
| 7 | 118004 | 博瑞转债 | 3,484,586.00 | 0.57 |
| 8 | 128140 | 润建转债 | 3,477,533.39 | 0.57 |
| 9 | 113530 | 大丰转债 | 3,454,085.90 | 0.57 |
| 10 | 111005 | 富春转债 | 3,267,747.72 | 0.54 |
| 11 | 113047 | 旗滨转债 | 3,105,490.19 | 0.51 |
| 12 | 118013 | 道通转债 | 3,078,132.59 | 0.51 |
| 13 | 127018 | 本钢转债 | 2,912,382.94 | 0.48 |
| 14 | 127041 | 弘亚转债 | 2,752,735.55 | 0.45 |
| 15 | 111001 | 山玻转债 | 2,663,965.48 | 0.44 |

| | | | | |
|----|--------|---------|--------------|------|
| 16 | 113644 | 艾迪转债 | 2,627,134.68 | 0.43 |
| 17 | 118018 | 瑞科转债 | 2,626,530.14 | 0.43 |
| 18 | 113650 | 博 22 转债 | 2,624,103.16 | 0.43 |
| 19 | 113636 | 甬金转债 | 2,494,164.91 | 0.41 |
| 20 | 113058 | 友发转债 | 2,484,490.20 | 0.41 |
| 21 | 127058 | 科伦转债 | 2,471,151.31 | 0.41 |
| 22 | 128142 | 新乳转债 | 2,348,609.86 | 0.39 |
| 23 | 123107 | 温氏转债 | 2,343,608.47 | 0.39 |
| 24 | 123150 | 九强转债 | 2,214,494.79 | 0.36 |
| 25 | 127063 | 贵轮转债 | 1,968,153.72 | 0.32 |
| 26 | 113639 | 华正转债 | 1,830,188.77 | 0.30 |
| 27 | 113598 | 法兰转债 | 1,817,814.28 | 0.30 |
| 28 | 123142 | 申昊转债 | 1,749,448.05 | 0.29 |
| 29 | 123145 | 药石转债 | 1,732,353.62 | 0.28 |
| 30 | 118006 | 阿拉转债 | 1,726,158.09 | 0.28 |
| 31 | 110062 | 烽火转债 | 1,552,858.50 | 0.26 |
| 32 | 118007 | 山石转债 | 1,451,620.59 | 0.24 |
| 33 | 110060 | 天路转债 | 1,407,141.47 | 0.23 |
| 34 | 113632 | 鹤 21 转债 | 1,406,374.78 | 0.23 |
| 35 | 113545 | 金能转债 | 1,346,266.59 | 0.22 |
| 36 | 110068 | 龙净转债 | 1,269,819.92 | 0.21 |
| 37 | 128014 | 永东转债 | 1,210,883.66 | 0.20 |
| 38 | 127068 | 顺博转债 | 1,208,505.07 | 0.20 |
| 39 | 118012 | 微芯转债 | 1,188,054.66 | 0.20 |
| 40 | 128044 | 岭南转债 | 1,180,783.68 | 0.19 |
| 41 | 123101 | 拓斯转债 | 1,173,083.84 | 0.19 |
| 42 | 127046 | 百润转债 | 1,169,335.50 | 0.19 |
| 43 | 113658 | 密卫转债 | 1,040,027.36 | 0.17 |
| 44 | 127073 | 天赐转债 | 1,034,420.22 | 0.17 |
| 45 | 118019 | 金盘转债 | 821,385.98 | 0.13 |
| 46 | 123154 | 火星转债 | 767,869.42 | 0.13 |
| 47 | 123152 | 润禾转债 | 637,731.87 | 0.10 |
| 48 | 123156 | 博汇转债 | 635,406.99 | 0.10 |
| 49 | 113653 | 永 22 转债 | 517,357.50 | 0.09 |
| 50 | 118020 | 芳源转债 | 117,630.04 | 0.02 |
| 51 | 113643 | 风语转债 | 55,003.07 | 0.01 |
| 52 | 123077 | 汉得转债 | 51,948.99 | 0.01 |

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 | 长信利富债券 A | 长信利富债券 C |
|---------------------------|----------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 223,128,923.16 | 126,208.29 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 165,227,507.72 | 136,904,928.82 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 27,562,242.31 | 8,156,975.99 |
| 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 | 360,794,188.57 | 128,874,161.12 |

§ 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 2 月 2 日至 2023 年 2 月 2 日 | 0.00 | 79,904,115.06 | 0.00 | 79,904,115.06 | 16.32 |
| | 2 | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 3 月 31 日 | 78,358,964.37 | 33,086,661.37 | 0.00 | 111,445,625.74 | 22.76 |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| <p>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。</p> <p>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。</p> | | | | | | | |

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、《长信利富债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长信利富债券型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《长信利富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 4 月 21 日