

# 长盛可转债债券型证券投资基金 2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：长盛基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 28 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>12</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	16
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>17</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	17
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	17
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>18</b>
6.1 资产负债表.....	18
6.2 利润表.....	19
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	20

6.4 报表附注.....	21
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>42</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	42
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	42
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	45
7.6 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.....	45
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	46
7.8 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贵金属投资明细.....	46
7.9 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.....	46
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	46
7.11 投资组合报告附注.....	46
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>50</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	50
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	50
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>51</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>52</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	52
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	52
10.4 基金投资策略的改变.....	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	52
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	52
10.8 其他重大事件.....	54
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>56</b>
11.1 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.....	56
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	56

<b>§12 备查文件目录</b> .....	<b>57</b>
12.1 备查文件目录.....	57
12.2 存放地点.....	57
12.3 查阅方式.....	57

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	长盛可转债债券型证券投资基金	
基金简称	长盛可转债	
基金主代码	003510	
交易代码	003510	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 12 月 7 日	
基金管理人	长盛基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	169,936,327.82 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	长盛可转债 A	长盛可转债 C
下属分级基金的交易代码:	003510	003511
报告期末下属分级基金的份额总额	104,642,037.77 份	65,294,290.05 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在合理控制信用风险、保持适当流动性的基础上，以可转债为主要投资标的，力争取得超越基金业绩比较基准的收益。
投资策略	<p>1、大类资产配置</p> <p>本基金综合运用定性和定量的分析手段，在对宏观经济因素进行充分研究的基础上，判断宏观经济周期所处阶段。基金将依据经济周期理论，结合对证券市场的系统性风险以及未来一段时期内各大类资产风险和预期收益率的评估，制定本基金在股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例、调整原则。</p> <p>2、固定收益类资产投资策略</p> <p>(1) 可转债投资策略：本基金可投资可转债、分离交易可转债或含赎回或回售权的债券等，这类债券赋予债权人或债务人某种期权，比普通的债券更为灵活。本基金将采用专业的分析和计算方法，综合考虑可转债的久期、票面利率、风险等债券因素以及期权价格，力求选择被市场低估的品种，获得超额收益。分离交易可转债与传统可转债的不同点主要体现在分离交易可转债在上市后分离为债券部分跟权证部分分别独自进行交易。</p> <p>(2) 普通债券投资策略：本基金的债券投资将主要采取久期策略、类属配置策略、收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略、债券选择策略等积极投资策略。</p>
业绩比较基准	中证可转换债券指数收益率×60%+中证综合债券指数收益率×30%+沪深300 指数收益率×10%
风险收益特征	本基金为债券型基金，属证券投资基金中的较低风险品种，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。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。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	长盛基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张利宁
		许俊

	联系电话	010-86497608	010-66594319
	电子邮箱	zhangln@csfunds.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-888-2666、 010-86497888	95566
传真		010-86497999	010-66594942
注册地址		深圳市福田区中心区福中三路诺德金融中心主楼 10D	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		北京市朝阳区安定路 5 号院 3 号楼中建财富国际中心 3-5 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		100029	100818
法定代表人		周兵	刘连舸

注：长盛基金管理有限公司法定代表人已于 2021 年 7 月 21 日变更为高民和。

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.csfunds.com.cn">http://www.csfunds.com.cn</a>
基金中期报告备置地点	基金管理人的办公地址及基金托管人的住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	长盛基金管理有限公司	北京市朝阳区安定路 5 号院 3 号楼 中建财富国际中心 3-5 层

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	长盛可转债 A	长盛可转债 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021年1月1日 - 2021年6月30日)	报告期(2021年1月1日 - 2021年6月30日)
本期已实现收益	4,835,183.67	5,058,658.95
本期利润	340,567.61	7,677,188.09
加权平均基金份额本期利润	0.0019	0.0849
本期加权平均净值利润率	0.15%	6.75%
本期基金份额净值增长率	1.02%	0.88%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)	
期末可供分配利润	4,794,777.27	2,882,842.65
期末可供分配基金份额利润	0.0458	0.0442
期末基金资产净值	134,751,706.85	84,163,071.89
期末基金份额净值	1.2877	1.2890
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	49.30%	50.99%

注：1、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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、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。

3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。表中的“期末”均指本报告期最后一日，即6月30日。

#### 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

长盛可转债 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	3.93%	0.86%	-0.15%	0.30%	4.08%	0.56%
过去三个月	12.48%	0.79%	3.41%	0.28%	9.07%	0.51%
过去六个月	1.02%	1.31%	3.20%	0.41%	-2.18%	0.90%
过去一年	13.78%	1.36%	10.40%	0.51%	3.38%	0.85%
过去三年	52.92%	1.17%	32.61%	0.51%	20.31%	0.66%
自基金合同生效起至今	49.30%	0.98%	30.39%	0.48%	18.91%	0.50%



## 长盛可转债 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	3.91%	0.86%	-0.15%	0.30%	4.06%	0.56%
过去三个月	12.39%	0.80%	3.41%	0.28%	8.98%	0.52%
过去六个月	0.88%	1.31%	3.20%	0.41%	-2.32%	0.90%
过去一年	13.44%	1.36%	10.40%	0.51%	3.04%	0.85%
过去三年	53.13%	1.17%	32.61%	0.51%	20.52%	0.66%
自基金合同生效起至今	50.99%	0.98%	30.39%	0.48%	20.60%	0.50%

注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

本基金业绩比较基准：中证可转换债券指数收益率\*60%+中证综合债券指数收益率\*30%+沪深 300 指数收益率\*10%。

中证可转换债券指数的样本由在沪深证券交易所上市的可转换债券组成，以反映国内市场可转换债券的总体表现，样本券由交易所市场上面值余额大于 3000 万元的可转换债券组成。

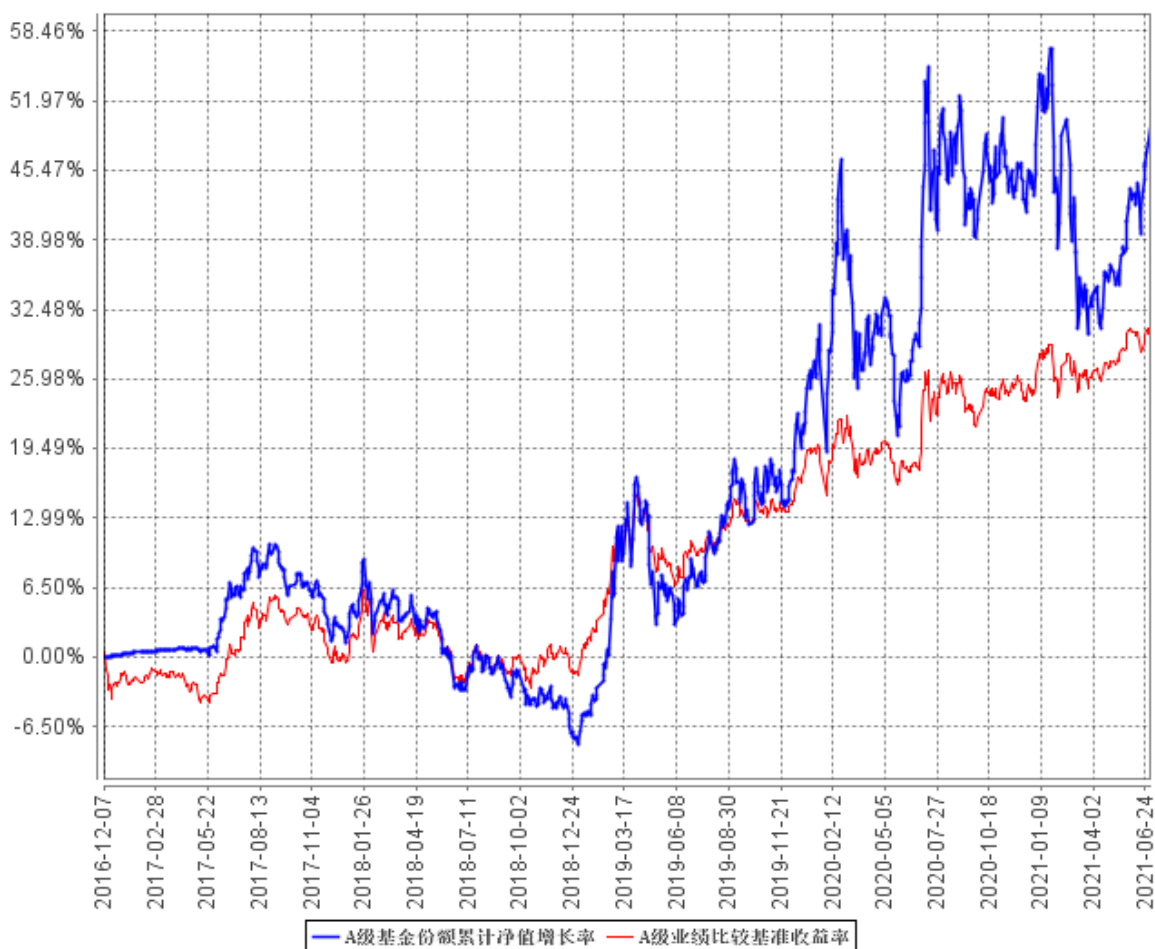
中证综合债券指数是综合反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央行票据及短融整体走势的跨市场债券指数，其选样是在中证全债指数样本的基础上，增加了央行票据、短期融资券以及一年期以下的国债、金融债和企业债，更全面地反映我国债券市场的整体价格变动趋势，为债券投资者提供更切合的市场基准。

沪深 300 指数是中证指数公司编制的包含上海、深圳两个证券交易所流动性好、规模最大的 300 只 A 股为样本的成分股指数，是目前中国证券市场中市值覆盖率高、代表性强、流动性好，同时公信力较好的股票指数，适合作为本基金股票投资的比较基准。

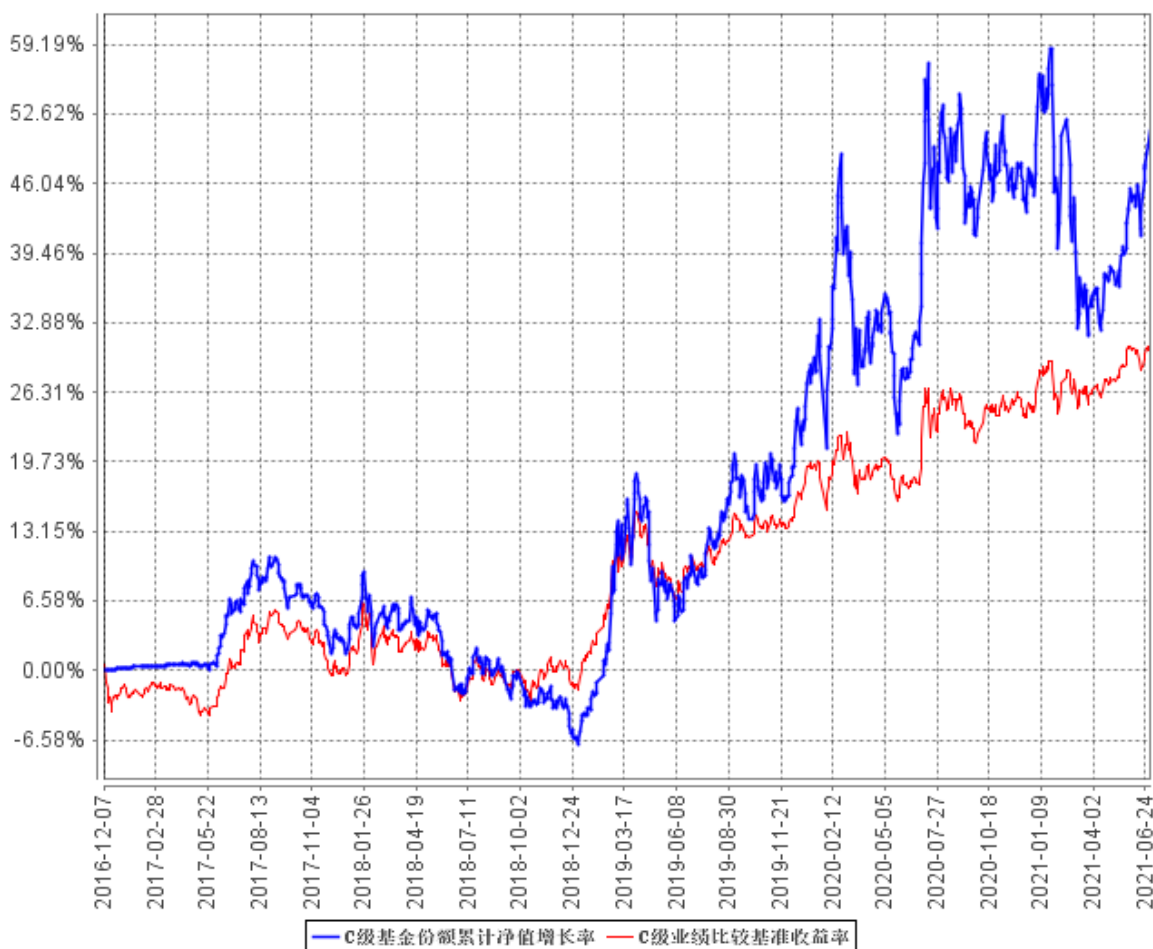
由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照 60%、30%、10%的比例采取再平衡，再用连锁计算的方式得到基准指数的时间序列。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

A级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



C级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：按照本基金合同规定，本基金基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。截至报告日，本基金的各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为长盛基金管理有限公司（以下简称公司），成立于 1999 年 3 月 26 日，是国内最早成立的十家基金管理公司之一，公司注册资本为人民币 2.06 亿元。长盛基金总部办公地位于北京，在北京、上海、成都、深圳等地设有分支机构，并拥有全资子公司长盛基金（香港）有限公司和长盛创富资产管理有限公司。目前，公司股东及其出资比例为：国元证券股份有限公司占注册资本的 41%，新加坡星展银行有限公司占注册资本的 33%，安徽省信用担保集团有限公司占注册资本的 13%，安徽省投资集团控股有限公司占注册资本的 13%。公司拥有公募基金、全国社保基金、私募资产管理、合格境内机构投资者（QDII）、合格境外机构投资者（QFII）、保险资产管理人等业务资格。截至 2021 年 6 月 30 日，基金管理人共管理六十七只开放式基金，并管理多个全国社保基金组合和私募资产管理计划。公司同时兼任境外 QFII 基金和专户理财产品的投资顾问。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨哲	本基金经理，长盛全债指数增强型债券投资基金基金经理，长盛盛杰混合型证券投资基金基金经理，固定收益部副总监。	2018 年 6 月 11 日	-	11 年	杨哲先生硕士。曾任大公国际资信评估有限公司信用分析师、信用评审委员会委员。2013 年 9 月加入长盛基金管理有限公司，曾任信用研究员等职务。

注：1、上表基金经理的任职日期和离任日期均指公司决定确定的聘任日期和解聘日期；

2、“证券从业年限”中“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。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：本基金本报告期内无基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施准则、本基金的基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行《公司公平交易细则》各项规定，在研究、投资授权与决策、交易执行等各个环节，公平对待旗下所有投资组合，包括公募基金、社保组合、私募资产管理计划等。具体如下：

研究支持，公司旗下所有投资组合共享公司研究部门研究成果，所有投资组合经理在公司研究平台上拥有同等权限。

投资授权与决策，公司实行投资决策委员会领导下的投资组合经理负责制，各投资组合经理在投资决策委员会的授权范围内，独立完成投资组合的管理工作。各投资组合经理遵守投资信息隔离墙制度。

交易执行，公司实行集中交易制度，所有投资组合的投资指令均由交易部统一执行委托交易。交易部依照《公司公平交易细则》的规定，场内交易，强制开启恒生交易系统公平交易程序；场外交易，严格遵守相关工作流程，保证交易执行的公平性。

投资管理行为的监控与分析评估，公司风险管理部、监察稽核部，依照《公司公平交易细则》的规定，持续、动态监督公司投资管理全过程，并进行分析评估，及时向公司管理层报告发现问题，保障公司旗下所有投资组合均被公平对待。

公司对过去 4 个季度的同向交易行为进行数量分析，计算溢价率、贡献率、占优比等指标，使用双边 90%置信水平对 1 日、3 日、5 日的交易片段进行 T 检验，未发现违反公平交易及利益输送的行为。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未发现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

##### 1、报告期内行情回顾

报告期内，宏观经济延续复苏，疫情散发和汽车缺芯等因素对内需有一定拖累，外需保持较好韧性。物价方面，大宗商品涨价叠加基数效应推动 PPI 快速上行，CPI 整体保持在温和区间。央行强调服务实体经济，稳健中性的市场操作叠加地方债发行后置，市场流动性相对充裕。

报告期内，债券收益率经历了年初的短暂上行之，转为波动下行走势。年初受资金面偏紧

影响，利率有所上行；之后，随着资金面紧张局面缓解，叠加央行连续中性的市场操作、地方债发行后置等因素影响，市场流动性宽松超预期，同时开始管控大宗商品价格的过快上涨，债券收益率整体波动下行。

权益市场方面，A 股大幅振荡。一季度股市先涨后跌，春节前 A 股延续上涨走势，春节后，受国际国内通胀预期上升、美债利率快速上行及部分 A 股估值偏高等因素影响，权益市场出现较大回撤，尤其是部分涨幅较大、估值过高的基金重仓股跌幅较大；二季度股市开启反弹上涨行情，其中科创板和创业板指数涨幅较大。从行业结构来看，申万一级行业中，电气设备、钢铁、化工、采掘、有色等行业涨幅较大，家电、非银、军工、房地产、农林牧渔等行业跌幅较大。

可转债方面，转债指数振荡抬升。1 月下旬，受股市调整、转股溢价率较高、短期涨幅较大等因素影响，转债经历了正股下跌和转股溢价率压缩的双重冲击；2 月和 3 月，转股溢价率大幅压缩后，安全边际提升，转债市场反弹后进入振荡格局；4 月以来，受流动性宽松超预期及一季报业绩催化等因素影响，转债市场整体有所上涨，其中新能源汽车、光伏、周期等行业个券表现相对活跃。

## 2、报告期内本基金投资策略分析

在报告期内，多空因素交织局面下，市场波动明显增大，本基金坚持相对稳健的投资策略。一季度在市场大幅振荡局面下，适度降低了股票和可转债资产仓位；二季度，随着流动性宽松超预期和市场风险偏好提升，适度提升了股票和可转债资产仓位，精选配置盈利增长确定、估值水平相对合理的个股和转债，减持部分估值偏高、波动较大的品种；同时，积极参与可转债新券的发行申购，增厚组合收益。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末长盛可转债 A 基金份额净值为 1.2877 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.02%；截至本报告期末长盛可转债 C 基金份额净值为 1.2890 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.88%；同期业绩比较基准收益率为 3.20%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，在国内经济恢复不均衡和通胀风险整体可控的背景下，预计宏观政策重心将放在支持实体经济和防风险上。预计货币政策继续维持稳健中性，对宏观经济的影响也偏中性；财政政策注重保障民生，维持对经济的适度支持，缓解地方政府债务压力。

债券市场方面，在经济高点已过和货币政策稳健中性环境下，PPI 维持高位、地方债发行加速、美联储政策转向等因素仍对债市行情形成制约，利率债预计表现为振荡走势；重点关注中短久期债券的票息价值，长久期债券可结合震荡市特点适度参与波段操作。

股票市场方面，经济发展更重视高质量发展目标，引导消费升级和产业升级。在政策正常化和 A 股估值偏高环境下，A 股市场投资机会或以阶段性机会和结构性机会为主，更重视盈利改善确定性和估值的匹配。转债方面，市场波动有所增大，投资操作在把握结构化机会的同时，需更重视择券的安全边际。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及本基金合同约定，本基金管理人严格按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持投资品种进行估值。本基金管理人制订了证券投资基金估值政策与估值程序，设立基金估值小组，参考行业协会估值意见和独立第三方机构估值数据，确保基金估值的公平、合理。

本基金管理人制订的证券投资基金估值政策与估值程序确定了估值目的、估值日、估值对象、估值程序、估值方法以及估值差错处理、暂停估值和特殊情形处理等事项。本基金管理人设立了由公司总经理（担任估值工作小组组长）、公司督察长（担任估值工作小组副组长）、公司相关投资、研究部门分管领导、公司运营部分管领导、相关研究部门、相关投资部门、监察稽核部、风险管理部、信息技术部及业务运营部总监或指定人员组成的估值工作小组，负责研究、指导并执行基金估值业务。小组成员均具有多年证券、基金从业经验，具备基金估值运作、行业研究、风险管理或法律合规等领域的专业胜任能力。

基金经理参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管人有责任要求基金管理公司作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已分别与中债金融估值中心有限公司和中证指数有限公司签署服务协议，由其分别按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种和在交易所市场交易或挂牌的部分债券品种的估值数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同对基金利润分配原则的约定，本基金于本报告期内进行了利润分配，分配金额为 23,263,074.28 元。

本基金截至 2021 年 6 月 30 日，期末可供分配利润为 7,677,619.92 元，其中：长盛可转债 A 期末可供分配利润为 4,794,777.27 元（长盛可转债 A 的未分配利润已实现部分为 4,794,777.27

元，未分配利润未实现部分为 25,314,891.81 元)，长盛可转债 C 期末可供分配利润为 2,882,842.65 元（长盛可转债 C 的未分配利润已实现部分为 2,882,842.65 元，未分配利润未实现部分为 15,985,939.19 元）。

#### **4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

本基金本报告期内不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。



## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在长盛可转债债券型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：长盛可转债债券型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	899,381.07	5,714,299.88
结算备付金		2,516,872.86	6,134,628.66
存出保证金		109,654.48	81,773.22
交易性金融资产	6.4.7.2	272,682,373.77	829,096,508.68
其中：股票投资		34,456,222.01	125,090,402.58
基金投资		-	-
债券投资		238,226,151.76	704,006,106.10
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		2,265,682.48	607,322.52
应收利息	6.4.7.5	677,376.34	1,605,821.03
应收股利		-	-
应收申购款		398,342.35	334,136.23
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		279,549,683.35	843,574,490.22
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2020 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		56,600,000.00	169,348,000.00
应付证券清算款		1,064,898.17	2,640,576.05
应付赎回款		2,575,608.05	3,756,845.86
应付管理人报酬		171,599.95	462,520.75
应付托管费		42,899.99	115,630.21
应付销售服务费		20,913.38	71,719.10
应付交易费用	6.4.7.7	51,060.94	195,331.77
应交税费		2,425.00	4,663.49

应付利息		6,423.63	9,015.57
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	99,075.50	145,425.69
负债合计		60,634,904.61	176,749,728.49
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	169,936,327.82	496,589,225.67
未分配利润	6.4.7.10	48,978,450.92	170,235,536.06
所有者权益合计		218,914,778.74	666,824,761.73
负债和所有者权益总计		279,549,683.35	843,574,490.22

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，长盛可转债 A 基金份额净值 1.2877 元，基金份额总额 104,642,037.77 份；长盛可转债 C 基金份额净值 1.2890 元，基金份额总额 65,294,290.05 份。

长盛可转债份额总额合计为 169,936,327.82 份。

## 6.2 利润表

会计主体：长盛可转债债券型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		11,387,752.09	-29,637,416.43
1.利息收入		967,200.62	1,260,057.19
其中：存款利息收入	6.4.7.11	40,986.33	78,935.63
债券利息收入		925,218.12	1,181,121.56
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		996.17	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		12,178,058.12	-32,417,468.09
其中：股票投资收益	6.4.7.12	28,654,533.57	-12,563,226.02
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-16,580,579.51	-20,526,399.86
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	104,104.06	672,157.79
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-1,876,086.92	886,871.23
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	118,580.27	633,123.24
<b>减：二、费用</b>		3,369,996.39	4,523,584.93
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,337,618.15	1,959,953.07
2. 托管费	6.4.10.2.2	334,404.46	489,988.25
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	169,551.40	395,211.73
4. 交易费用	6.4.7.19	371,239.38	563,036.11
5. 利息支出		1,044,192.30	1,027,526.09
其中：卖出回购金融资产支出		1,044,192.30	1,027,526.09
6. 税金及附加		1,775.04	1,905.88
7. 其他费用	6.4.7.20	111,215.66	85,963.80
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		8,017,755.70	-34,161,001.36
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		8,017,755.70	-34,161,001.36

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长盛可转债债券型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	496,589,225.67	170,235,536.06	666,824,761.73
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	8,017,755.70	8,017,755.70
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-326,652,897.85	-106,011,766.56	-432,664,664.41
其中：1.基金申购款	143,698,627.66	35,420,644.39	179,119,272.05
2.基金赎回款	-470,351,525.51	-141,432,410.95	-611,783,936.46
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-23,263,074.28	-23,263,074.28

五、期末所有者权益 (基金净值)	169,936,327.82	48,978,450.92	218,914,778.74
项目	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	52,760,435.98	10,007,167.91	62,767,603.89
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本期 利润)	-	-34,161,001.36	-34,161,001.36
三、本期基金份额交易 产生的基金净值变动 数 (净值减少以“-”号 填列)	654,089,908.46	189,900,614.58	843,990,523.04
其中：1.基金申购款	1,229,312,328.71	315,280,297.81	1,544,592,626.52
2.基金赎回款	-575,222,420.25	-125,379,683.23	-700,602,103.48
四、本期向基金份额持 有人分配利润产生的 基金净值变动(净值减 少以“-”号填列)	-	-7,293,998.24	-7,293,998.24
五、期末所有者权益 (基金净值)	706,850,344.44	158,452,782.89	865,303,127.33

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>周兵</u>	<u>刁俊东</u>	<u>龚珉</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

长盛可转债债券型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2016]1562号《关于准予长盛可转债债券型证券投资基金注册的批复》的注册，由长盛基金管理有限公司向社会公开募集。基金合同于2016年12月7日生效，于基金合同生效日，本基金规模为305,290,910.63份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构均为长盛基金管理有限公司，基金托管人在中国银行股份有限公司。

A类基金份额在投资人认购、申购时收取前端认购、申购费用，赎回时收取赎回费用；C类基

基金份额在投资人认购、申购时不收取前端或后端认购、申购费，而是从该类别基金资产中计提销售服务费，本基金管理人对持有 C 类基金份额期限少于 30 日的该类别基金份额的赎回收取赎回费，对于持有期限不少于 30 日的该类别基金份额不收取赎回费。

本基金的投资范围主要为依法发行的固定收益类品种，包括国内依法发行交易的国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、地方政府债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、同业存单、资产支持证券、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、中小企业私募债、债券回购、银行存款、国债期货等。本基金同时投资于国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证等权益类品种以及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为：本基金的投资组合比例为：本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%，投资于可转换债券（含分离交易可转债）的比例合计不低于非现金基金资产的 80%，股票等权益类品种的投资比例不超过基金资产的 20%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为：中证可转换债券指数收益率×60%+中证综合债券指数收益×30%+沪深 300 指数收益率×10%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定及参考意见。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期

间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

无。

#### 6.4.6 税项

##### 6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3%调整为 1%；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变。

##### 6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入免征增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入免征增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理

人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

#### 6.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

#### 6.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号《财政部国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差



别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	899,381.07
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计：	899,381.07

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	26,759,559.36	34,456,222.01	7,696,662.65
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	224,734,641.93	238,226,151.76
	银行间市场	-	-
	合计	224,734,641.93	238,226,151.76
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	251,494,201.29	272,682,373.77	21,188,172.48

**6.4.7.3 衍生金融资产/负债**

注：无。

**6.4.7.4 买入返售金融资产**

注：无。

**6.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应收活期存款利息	273.96
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1,019.34
应收债券利息	676,038.58
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	44.46
合计	677,376.34

**6.4.7.6 其他资产**

注：无。

**6.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	51,060.94
银行间市场应付交易费用	-
合计	51,060.94

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	355.95
应付证券出借违约金	-

预提费用	98,719.55
预提信息披露费用	-
预提审计费用	-
预提账户维护费	-
合计	99,075.50

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

长盛可转债 A		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	291,984,618.11	291,984,618.11
本期申购	116,544,937.65	116,544,937.65
本期赎回(以“-”号填列)	-303,887,517.99	-303,887,517.99
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	104,642,037.77	104,642,037.77

金额单位：人民币元

长盛可转债 C		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	204,604,607.56	204,604,607.56
本期申购	27,153,690.01	27,153,690.01
本期赎回(以“-”号填列)	-166,464,007.52	-166,464,007.52
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	65,294,290.05	65,294,290.05

注：申购含转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

长盛可转债 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	26,056,562.26	73,810,276.78	99,866,839.04
本期利润	4,835,183.67	-4,494,616.06	340,567.61

本期基金份额交易产生的变动数	-12,657,489.40	-44,000,768.91	-56,658,258.31
其中：基金申购款	4,926,394.14	23,397,963.71	28,324,357.85
基金赎回款	-17,583,883.54	-67,398,732.62	-84,982,616.16
本期已分配利润	-13,439,479.26	-	-13,439,479.26
本期末	4,794,777.27	25,314,891.81	30,109,669.08

单位：人民币元

长盛可转债 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	18,045,617.28	52,323,079.74	70,368,697.02
本期利润	5,058,658.95	2,618,529.14	7,677,188.09
本期基金份额交易产生的变动数	-10,397,838.56	-38,955,669.69	-49,353,508.25
其中：基金申购款	1,480,148.64	5,616,137.90	7,096,286.54
基金赎回款	-11,877,987.20	-44,571,807.59	-56,449,794.79
本期已分配利润	-9,823,595.02	-	-9,823,595.02
本期末	2,882,842.65	15,985,939.19	18,868,781.84

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	7,090.16
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	33,047.89
其他	848.28
合计	40,986.33

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	157,370,667.58
减：卖出股票成本总额	128,716,134.01
买卖股票差价收入	28,654,533.57

**6.4.7.13 债券投资收益****6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-16,580,579.51
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	-16,580,579.51

**6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	788,235,711.46
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	802,978,247.48
减：应收利息总额	1,838,043.49
买卖债券差价收入	-16,580,579.51

**6.4.7.14 贵金属投资收益**

注：无。

**6.4.7.15 衍生工具收益**

注：无。

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	104,104.06
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	104,104.06

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期
------	----

	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-1,876,086.92
——股票投资	-20,922,836.40
——债券投资	19,046,749.48
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	-1,876,086.92

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	118,161.02
基金转换费收入	419.25
合计	118,580.27

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	371,239.38
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	371,239.38

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	34,712.18
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-

银行汇划费	7,996.11
银行间账户维护费	9,000.00
合计	111,215.66

#### 6.4.7.21 分部报告

无。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

无。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金的管理人于 2021 年 7 月 8 日发布分红公告，向截至 2021 年 7 月 9 日止本基金登记注册的份额持有人进行利润分配，长盛可转债 A 类按每 10 份基金份额分配红利人民币 0.2300 元；长盛可转债 C 类按每 10 份基金份额分配红利人民币 0.2220 元。

除以上情况外，无其他需要说明的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内，未存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
长盛基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金代销机构
国元证券股份有限公司（“国元证券”）	基金管理人股东、基金代销机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

注：无。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

	月 30 日	日
当期发生的基金应支付的管理费	1,337,618.15	1,959,953.07
其中：支付销售机构的客户维护费	292,328.38	567,815.58

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.80% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	334,404.46	489,988.25

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长盛可转债 A	长盛可转债 C	合计
长盛基金管理有限公司	-	1,113.40	1,113.40
中国银行	-	6,413.64	6,413.64
国元证券	-	588.52	588.52
合计	-	8,115.56	8,115.56
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		



	长盛可转债 A	长盛可转债 C	合计
长盛基金管理有限公司	-	5,278.96	5,278.96
中国银行	-	9,780.46	9,780.46
国元证券	-	11,510.41	11,510.41
合计	-	26,569.83	26,569.83

注：基金销售服务费每日计提，按月支付。基金销售服务费可用于本基金的市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。本基金分为不同的类别，适用不同的销售服务费率。其中，本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.30% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% / \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：无。

##### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：无。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无。

##### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：无。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	899,381.07	7,090.16	40,624,573.06	44,409.56

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

##### 长盛可转债 A

金额单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日		每 10 份 基金份额分红 数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2021 年 4 月 14 日	-	2021 年 4 月 14 日	0.2120	2,616,356.27	333,325.40	2,949,681.67	
2	2021 年 1 月 11 日	-	2021 年 1 月 11 日	0.4500	7,119,564.49	3,370,233.10	10,489,797.59	
合计	-	-	-	0.6620	9,735,920.76	3,703,558.50	13,439,479.26	

##### 长盛可转债 C

金额单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日		每 10 份 基金份额分红 数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2021 年 4 月 14 日	-	2021 年 4 月 14 日	0.2050	1,081,624.52	410,943.41	1,492,567.93	
2	2021 年 1 月 11 日	-	2021 年 1 月 11 日	0.4450	3,428,550.70	4,902,476.39	8,331,027.09	
合计	-	-	-	0.6500	4,510,175.22	5,313,419.80	9,823,595.02	

注：本基金的管理人于 2021 年 7 月 8 日发布分红公告，向截至 2021 年 7 月 9 日止本基金登记注册的份额持有人进行利润分配，长盛可转债 A 类按每 10 份基金份额分配红利人民币 0.2300 元；

长盛可转债 C 类按每 10 份基金份额分配红利人民币 0.2220 元。

#### 6.4.12 期末（2021 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113050	南银转债	2021 年 6 月 17 日	2021 年 7 月 1 日	新债未上市	100.00	100.00	870	87,000.00	87,000.00	

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 56,600,000.00 元，分别于 2021 年 7 月 1 日、2021 年 7 月 2 日、2021 年 7 月 5 日、2021 年 7 月 6 日和 2021 年 7 月 7 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以董事会风险控制委员会为核心的，由董事会风险控制委员会、经营管理层及各具体业务部门组成的三道风险监控防线；并在后两道监控防线中，由独立于公司管理层

和其他业务部门的督察长和监察稽核部对公司合规风险状况及各部门风险控制措施进行检查、监督及报告。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	3,498,600.00
合计	-	3,498,600.00

注：表中所列示的未评级的债券投资为政策性金融债。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

##### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

##### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	70,888,196.30	276,663,328.31
AAA 以下	156,141,925.46	393,184,799.69
未评级	11,196,030.00	30,659,378.10
合计	238,226,151.76	700,507,506.10

注：长期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由债券发行人在中国人民银行指

定的国内有关媒体上公告。表中所列示的债券投资为除短期融资券、超短期融资券以外的债券，其中国债及政策性金融债无信用评级。

#### **6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

注：无。

#### **6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

注：无。

### **6.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

#### **6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析**

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控流动性受限资产比例、流动性资产比例及压力测试等方式防范流动性风险，并对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易。因此，除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

### **6.4.13.4 市场风险**

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的公允价值和未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	899,381.07	-	-	-	899,381.07
结算备付金	2,516,872.86	-	-	-	2,516,872.86
存出保证金	109,654.48	-	-	-	109,654.48
交易性金融资产	13,394,723.10	96,129,469.08	128,701,959.58	34,456,222.01	272,682,373.77
应收证券清算款	-	-	-	2,265,682.48	2,265,682.48
应收利息	-	-	-	677,376.34	677,376.34
应收申购款	-	-	-	398,342.35	398,342.35
资产总计	16,920,631.51	96,129,469.08	128,701,959.58	37,797,623.18	279,549,683.35
负债					
卖出回购金融资产款	56,600,000.00	-	-	-	56,600,000.00
应付证券清算款	-	-	-	1,064,898.17	1,064,898.17
应付赎回款	-	-	-	2,575,608.05	2,575,608.05
应付管理人报酬	-	-	-	171,599.95	171,599.95
应付托管费	-	-	-	42,899.99	42,899.99
应付销售服务费	-	-	-	20,913.38	20,913.38
应付交易费用	-	-	-	51,060.94	51,060.94
应付利息	-	-	-	6,423.63	6,423.63
应交税费	-	-	-	2,425.00	2,425.00
其他负债	-	-	-	99,075.50	99,075.50
负债总计	56,600,000.00	-	-	4,034,904.61	60,634,904.61
利率敏感度缺口	-39,679,368.49	96,129,469.08	128,701,959.58	33,762,718.57	218,914,778.74
上年度末 2020年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	5,714,299.88	-	-	-	5,714,299.88
结算备付金	6,134,628.66	-	-	-	6,134,628.66
存出保证金	81,773.22	-	-	-	81,773.22

交易性金融资产	34,157,978.10	301,353,485.35	368,494,642.65	125,090,402.58	829,096,508.68
应收证券清算款	-	-	-	607,322.52	607,322.52
应收利息	-	-	-	1,605,821.03	1,605,821.03
应收申购款	-	-	-	334,136.23	334,136.23
资产总计	46,088,679.86	301,353,485.35	368,494,642.65	127,637,682.36	843,574,490.22
负债					
卖出回购金融资产款	169,348,000.00	-	-	-	169,348,000.00
应付证券清算款	-	-	-	2,640,576.05	2,640,576.05
应付赎回款	-	-	-	3,756,845.86	3,756,845.86
应付管理人报酬	-	-	-	462,520.75	462,520.75
应付托管费	-	-	-	115,630.21	115,630.21
应付销售服务费	-	-	-	71,719.10	71,719.10
应付交易费用	-	-	-	195,331.77	195,331.77
应付利息	-	-	-	9,015.57	9,015.57
应交税费	-	-	-	4,663.49	4,663.49
其他负债	-	-	-	145,425.69	145,425.69
负债总计	169,348,000.00	-	-	7,401,728.49	176,749,728.49
利率敏感度缺口	-123,259,320.14	301,353,485.35	368,494,642.65	120,235,953.87	666,824,761.73

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析基于本基金报表日的利率风险状况；		
	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他变量不变；		
	此项影响并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	下降 25 个基准点	2,483,313.18	7,447,735.16
	上升 25 个基准点	-2,483,313.18	-7,447,735.16

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资

于上市交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。并且，基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，动态、及时地跟踪和控制其他价格风险。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日		上年度末 2020年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	34,456,222.01	15.74	125,090,402.58	18.76
合计	34,456,222.01	15.74	125,090,402.58	18.76

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：本基金于本报告期末及上年度末持有的非固定收益类投资占比并不重大，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 6.4.14.1 公允价值

本基金非以公允价值计量的金融工具，因其剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

##### (1) 各层次金融工具公允价值

本基金本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 253,231,183.77 元，属于第二层次的余额为人民币 19,451,190.00 元，无属于第三层次的余额（2020年12月31日：第一层次 726,171,958.98 元，第二层次 102,924,549.70 元，无属于第三层次的余额）。

##### (2) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券等，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。本基金



持有的以公允价值计量的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动（2020 年上半年度：无）。

#### 6.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

#### 6.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	34,456,222.01	12.33
	其中：股票	34,456,222.01	12.33
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	238,226,151.76	85.22
	其中：债券	238,226,151.76	85.22
	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	3,416,253.93	1.22
8	其他各项资产	3,451,055.65	1.23
9	合计	279,549,683.35	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	28,354,126.81	12.95
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	1,020,890.00	0.47
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	3,437,010.20	1.57
M	科学研究和技术服务业	1,644,195.00	0.75
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	34,456,222.01	15.74

### 7.2.2 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持有港股通投资股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601012	隆基股份	38,000	3,375,920.00	1.54
2	000858	五粮液	9,500	2,829,955.00	1.29
3	002415	海康威视	43,000	2,773,500.00	1.27
4	002460	赣锋锂业	20,001	2,421,921.09	1.11
5	601888	中国中免	7,502	2,251,350.20	1.03
6	002271	东方雨虹	39,058	2,160,688.56	0.99
7	300122	智飞生物	11,000	2,054,030.00	0.94
8	300124	汇川技术	22,500	1,670,850.00	0.76
9	603259	药明康德	10,500	1,644,195.00	0.75
10	300750	宁德时代	3,000	1,604,400.00	0.73
11	300207	欣旺达	47,236	1,538,004.16	0.70
12	300274	阳光电源	13,000	1,495,780.00	0.68
13	600276	恒瑞医药	18,000	1,223,460.00	0.56
14	002241	歌尔股份	28,000	1,196,720.00	0.55
15	002027	分众传媒	126,000	1,185,660.00	0.54
16	300496	中科创达	6,500	1,020,890.00	0.47
17	002475	立讯精密	19,200	883,200.00	0.40
18	300896	爱美客	1,100	867,768.00	0.40
19	600600	青岛啤酒	7,500	867,375.00	0.40
20	600660	福耀玻璃	10,500	586,425.00	0.27
21	300760	迈瑞医疗	800	384,040.00	0.18
22	002594	比亚迪	1,500	376,500.00	0.17
23	601633	长城汽车	1,000	43,590.00	0.02

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300122	智飞生物	5,997,910.00	0.90
2	002415	海康威视	4,859,893.00	0.73
3	601012	隆基股份	4,280,407.00	0.64
4	600031	三一重工	3,961,049.00	0.59
5	002460	赣锋锂业	3,739,521.44	0.56
6	000661	长春高新	3,217,991.00	0.48
7	603501	韦尔股份	2,044,555.00	0.31
8	300274	阳光电源	1,873,148.00	0.28
9	600872	中炬高新	1,860,691.00	0.28
10	300750	宁德时代	1,650,597.00	0.25
11	000858	五粮液	1,619,328.00	0.24
12	300207	欣旺达	1,476,125.00	0.22
13	600600	青岛啤酒	1,444,261.00	0.22
14	600352	浙江龙盛	1,378,865.00	0.21
15	600438	通威股份	1,368,431.00	0.21
16	300285	国瓷材料	1,366,803.00	0.20
17	300496	中科创达	1,300,959.00	0.20
18	600519	贵州茅台	1,231,104.00	0.18
19	000651	格力电器	1,227,449.00	0.18
20	300896	爱美客	1,210,277.40	0.18

### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600438	通威股份	11,842,369.00	1.78
2	601012	隆基股份	9,466,830.00	1.42
3	000858	五粮液	9,041,648.00	1.36
4	002475	立讯精密	8,355,377.81	1.25
5	600309	万华化学	8,336,149.00	1.25
6	002271	东方雨虹	7,728,503.76	1.16
7	000333	美的集团	7,367,895.55	1.10

8	002027	分众传媒	6,721,648.00	1.01
9	002938	鹏鼎控股	6,707,193.37	1.01
10	600519	贵州茅台	6,689,339.00	1.00
11	600276	恒瑞医药	6,492,360.72	0.97
12	601888	中国中免	5,839,607.00	0.88
13	300122	智飞生物	5,532,865.00	0.83
14	601633	长城汽车	4,867,315.00	0.73
15	300274	阳光电源	4,729,390.41	0.71
16	002050	三花智控	3,247,842.00	0.49
17	603259	药明康德	3,224,566.60	0.48
18	600486	扬农化工	3,155,721.00	0.47
19	600031	三一重工	2,783,766.00	0.42
20	000725	京东方 A	2,781,678.00	0.42

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	59,004,789.84
卖出股票收入（成交）总额	157,370,667.58

注：本项中 7.4.1、7.4.2、7.4.3 表中的“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	11,196,030.00	5.11
	其中：政策性金融债	11,196,030.00	5.11
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）	227,030,121.76	103.71
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	238,226,151.76	108.82

### 7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110053	苏银转债	115,000	13,956,400.00	6.38
2	113044	大秦转债	129,000	13,275,390.00	6.06
3	113042	上银转债	101,540	10,385,511.20	4.74
4	108604	国开 1805	94,000	9,425,380.00	4.31
5	123079	运达转债	70,002	9,090,459.72	4.15

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

### 7.8 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贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

### 7.9 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。

### 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

#### 7.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末无国债期货投资。

#### 7.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

### 7.11 投资组合报告附注

#### 7.11.1 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

（一）苏银转债：2020 年 12 月 31 日，江苏银保监局行政处罚信息公开表显示，江苏银行股份有限公司存在个人贷款资金用途管控不严等 6 项违法违规事实，被处以罚款人民币 240 万元。对以上事件，本基金判断，江苏银行作为规模较大的城商行，经营稳健，上述处罚对公司影响小。后续关注其制度建设与执行等公司基础性建设问题的合规性以及企业的经营状况。

（二）上银转债：2020 年 8 月 14 日，上海银保监局沪银保监银罚决字（2020）14 号显示，上海银行股份有限公司存在违规向资本金不足、“四证”不全的房地产项目发放贷款，以其他贷款科目发放房地产开发贷款等 23 项违法违规事实，被处责令改正，没收违法所得 27.155092 万元，罚款 1625 万元，罚没合计 1652.155092 万元。2020 年 11 月 15 日，上海银保监局沪银保监银罚决字（2020）25 号显示，上海银行股份有限公司存在 2014 年至 2018 年绩效考评管理严重违反审慎经营规则等两项违法违规事实，被处责令改正，并处罚款共计 80 万元。2021 年 4 月 30 日，上

海银保监局沪银保监罚决字〔2021〕31号显示，上海银行股份有限公司未按照规定进行信息披露，被处责令改正，并处罚款30万元。对以上事件，本基金判断，上海银行作为规模较大的城商行，经营稳健，上述处罚对公司影响小。后续关注其制度建设与执行等公司基础性建设问题的合规性以及企业的经营状况。

（三）星源转2：公司于2020年12月30日收到关于对深圳市星源材质科技股份有限公司控股股东、实际控制人陈秀峰、陈良的监管函，公司控股股东、实际控制人所持公司股份比例累计减少达5%，但未能按照《证券法》《上市公司收购管理办法》的规定及时履行报告和公告义务，直至2020年11月27日才披露《简式权益变动报告书》，同时陈秀峰未按规定停止交易，于11月4日至11月23日期间继续减持公司股票，减持比例为0.675%。上述行为违反了本所《创业板股票上市规则（2020年修订）》第1.4条、第2.3.1条、第2.3.10条、第5.1.1条的规定。后续关注其制度建设与执行等公司基础性建设问题的合规性以及企业的经营状况。

（四）苏行转债：2020年12月31日，苏州银保监局苏州银保监罚决字〔2020〕48号显示，苏州银行股份有限公司因存在差别化住房信贷政策执行不到位和个人经营性贷款资金用途管控不到位等2项违法违规事实，被处以50万元罚款。对以上事件，本基金判断，苏州银行规模一般，经营稳健，上述处罚对公司影响小。后续关注其制度建设与执行等公司基础性建设问题的合规性以及企业的经营状况。

（五）国开1805：2021年1月8日，银保监会银保监罚决字〔2020〕67号显示，国家开发银行存在为违规的政府购买服务项目提供融资等24项违法违规事实，对其处以罚款4880万元。对以上事件，本基金判断，国家开发银行经营稳健，上述处罚对公司影响可控。后续关注其制度建设与执行等公司基础性建设问题的合规性以及企业的经营状况。

除上述事项外，本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查记录，无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

### 7.11.2 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

基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

### 7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	109,654.48
2	应收证券清算款	2,265,682.48
3	应收股利	-
4	应收利息	677,376.34

5	应收申购款	398,342.35
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,451,055.65

#### 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	110053	苏银转债	13,956,400.00	6.38
2	113044	大秦转债	13,275,390.00	6.06
3	123079	运达转债	9,090,459.72	4.15
4	132018	G 三峡 EB1	8,168,160.00	3.73
5	123075	贝斯转债	8,136,750.00	3.72
6	113611	福 20 转债	7,916,140.00	3.62
7	123035	利德转债	7,423,007.97	3.39
8	128035	大族转债	7,299,600.00	3.33
9	113012	骆驼转债	7,274,360.00	3.32
10	127018	本钢转债	7,205,760.00	3.29
11	128137	洁美转债	6,773,508.95	3.09
12	128095	恩捷转债	6,491,160.00	2.97
13	113550	常汽转债	6,273,720.00	2.87
14	123060	苏试转债	6,231,049.00	2.85
15	113604	多伦转债	6,211,855.00	2.84
16	123033	金力转债	6,142,005.72	2.81
17	110051	中天转债	5,626,670.00	2.57
18	128101	联创转债	5,513,219.00	2.52
19	123025	精测转债	5,231,571.39	2.39
20	113548	石英转债	4,675,440.00	2.14
21	128142	新乳转债	4,203,064.32	1.92
22	110061	川投转债	4,191,680.00	1.91
23	128017	金禾转债	3,592,820.00	1.64
24	113602	景 20 转债	3,563,100.00	1.63
25	113519	长久转债	3,381,180.00	1.54
26	113606	荣泰转债	2,754,400.00	1.26
27	123090	三诺转债	2,738,150.00	1.25
28	113603	东缆转债	2,394,840.00	1.09
29	113009	广汽转债	2,198,693.10	1.00
30	113040	星宇转债	1,983,380.00	0.91
31	123058	欣旺转债	765,500.00	0.35



32	127015	希望转债	468,012.00	0.21
33	113537	文灿转债	420,463.00	0.19

#### 7.11.5 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。

#### 7.11.6 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，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
长盛可转债 A	4,587	22,812.74	59,174,735.45	56.55%	45,467,302.32	43.45%
长盛可转债 C	6,487	10,065.41	8,297,965.83	12.71%	56,996,324.22	87.29%
合计	11,074	15,345.52	67,472,701.28	39.70%	102,463,626.54	60.30%

注：对于分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对于合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数。

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	长盛可转债 A	61,039.90	0.0583%
	长盛可转债 C	5,069.36	0.0078%
	合计	66,109.26	0.0389%

注：对于分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对于合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	长盛可转债 A	0
	长盛可转债 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	长盛可转债 A	0
	长盛可转债 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长盛可转债 A	长盛可转债 C
基金合同生效日（2016 年 12 月 7 日）基金份额总额	178,914,151.08	126,376,759.55
本报告期期初基金份额总额	291,984,618.11	204,604,607.56
本报告期基金总申购份额	116,544,937.65	27,153,690.01
减：本报告期基金总赎回份额	303,887,517.99	166,464,007.52
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	104,642,037.77	65,294,290.05

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 10.2.1 本基金管理人的高级管理人员重大人事变动情况

我公司第七届董事会任期已满，根据《公司法》和《公司章程》的有关规定，2021年6月6日，我公司召开了2021年第一次临时股东会会议。会议选举俞仕新、高民和、毕功兵、杜愚为新任董事，蔡咏、陈翔、李伟强、朱慈蕴不再担任董事。公司已按规定向相关监管机构报备。

根据公司第八届董事会第二次会议决议，聘任周兵同志担任公司总经理，林培富同志不再担任公司总经理。公司已按规定向相关监管机构报备。

原董事会秘书孙杰同志退休，根据公司第八届董事会第二次会议决议，聘任刁俊东同志担任财务负责人兼董事会秘书。

#### 10.2.2 基金经理变动情况

本报告期内本基金基金经理未曾变动。

#### 10.2.3 本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动情况

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略没有改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的会计师事务所为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），本报告期内本基金未更换会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
光大证券	1	115,347,285.30	55.92%	107,422.78	61.77%	-

华创证券	1	90,917,050.68	44.08%	66,487.27	38.23%	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
光大证券	539,759,778.69	49.29%	668,240,000.00	19.18%	-	-
华创证券	555,340,835.17	50.71%	2,815,000,000.00	80.82%	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

注：1、本公司选择证券经营机构的标准

(1) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为本公司提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告等，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

(2) 财力雄厚，信誉良好。

(3) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。

(4) 经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚。

(5) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。

(6) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本公司基金进行证券交易的需要，并能为本公司基金提供全面的信息服务。

2、本公司租用券商交易单元的程序

- (1) 研究机构提出服务意向，并提供相关研究报告；
- (2) 研究机构的研究报告需要有一定的试用期。试用期视服务情况和研究服务评价结果而定；
- (3) 研究发展部、投资管理等部门试用研究机构的研究报告后，按照研究服务评价规定，对研究机构进行综合评价；
- (4) 试用期满后，评价结果符合条件，双方认为有必要继续合作，经公司领导审批后，我司与研究机构签定《研究服务协议》、《券商交易单元租用协议》，并办理基金专用交易单元租用手续。评价结果如不符合条件则终止试用；
- (5) 本公司每两个月对签约机构的服务进行一次综合评价。经过评价，若本公司认为签约机构的服务不能满足要求，或签约机构违规受到国家有关部门的处罚，本公司有权终止签署的协议，并撤销租用的交易单元；
- (6) 交易单元租用协议期限为一年，到期后若双方没有异议可自动延期一年。

3、本基金租用证券公司交易单元均为共用交易单元。

4、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

- (1) 本基金报告期内新增租用交易单元：无。
- (2) 本基金报告期内停止租用交易单元：无。

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长盛基金管理有限公司关于增加华西证券为旗下部分开放式基金代销机构及开通基金定投和转换业务的公告	上海证券报、本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021年6月29日
2	长盛基金管理有限公司高级管理人员总经理变更的公告	上海证券报、本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021年6月18日
3	长盛基金管理有限公司关于旗下基金增加销售机构并开通定投和转换业务及参加费率优惠活动的公告	上海证券报、本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021年6月10日
4	长盛基金管理有限公司关于增加中金财富证券为旗下部分开放式基金代销机构及开通基金定投和转换业务的公告	上海证券报、本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021年5月31日
5	长盛基金管理有限公司旗下全部基金 2021 年 1 季度报告提示性公告	上海证券报、本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021年4月22日

6	长盛可转债债券型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021 年 4 月 22 日
7	长盛可转债债券型证券投资基金恢复大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告	上海证券报、本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021 年 4 月 15 日
8	长盛可转债债券型证券投资基金收益分配公告	上海证券报、本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021 年 4 月 13 日
9	长盛可转债债券型证券投资基金暂停大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告	上海证券报、本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021 年 4 月 12 日
10	长盛基金管理有限公司关于旗下部分基金增加江苏江南农村商业银行代销机构的公告	上海证券报、本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021 年 4 月 9 日
11	长盛基金管理有限公司关于旗下基金增加销售机构并开通定投和转换业务及参加费率优惠活动的公告	上海证券报、本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021 年 4 月 6 日
12	长盛基金管理有限公司旗下全部基金 2020 年年度报告提示性公告	上海证券报、本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021 年 3 月 31 日
13	长盛可转债债券型证券投资基金 2020 年年度报告	本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021 年 3 月 31 日
14	长盛基金管理有限公司关于旗下基金增加销售机构并开通定投和转换业务及参加费率优惠活动的公告	上海证券报、本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021 年 3 月 18 日
15	长盛可转债债券型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021 年 1 月 22 日
16	长盛可转债债券型证券投资基金恢复大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告	上海证券报、本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021 年 1 月 12 日
17	长盛可转债债券型证券投资基金收益分配公告	上海证券报、本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021 年 1 月 8 日
18	长盛可转债债券型证券投资基金暂停大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告	上海证券报、本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021 年 1 月 6 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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：本基金报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。



## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、长盛可转债债券型证券投资基金相关批准文件；
- 2、《长盛可转债债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长盛可转债债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、《长盛可转债债券型证券投资基金招募说明书》；
- 5、法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照。

### 12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公地址和/或基金托管人的住所。

### 12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公地址和/或基金托管人的住所和/或基金管理人互联网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人长盛基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-888-2666、010-86497888。

网址：<http://www.csfunds.com.cn>。

长盛基金管理有限公司

2021 年 8 月 28 日