

长盛可转债债券型证券投资基金

2021 年第 3 季度报告

2021 年 9 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

报告送出日期：2021 年 10 月 27 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 10 月 26 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 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	120,465,306.83 份
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	1、大类资产配置 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。 2、固定收益类资产投资策略 （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。 （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。	
业绩比较基准	$\text{中证可转换债券指数收益率} \times 60\% + \text{中证综合债券指数收益率} \times 30\% + \text{沪深 300 指数收益率} \times 10\%$	
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。	
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	
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	57,395,533.25 份	63,069,773.58 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 7 月 1 日 — 2021 年 9 月 30 日）	
	长盛可转债 A	长盛可转债 C
1. 本期已实现收益	15,968,352.94	11,239,436.85
2. 本期利润	13,697,789.70	8,677,926.37
3. 加权平均基金份额本期利润	0.1514	0.1357
4. 期末基金资产净值	80,333,687.52	88,349,796.42
5. 期末基金份额净值	1.3997	1.4008

注：1、所述基金业绩指标不包括基金份额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、所列数据截止到 2021 年 9 月 30 日。

3、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。

3.2 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

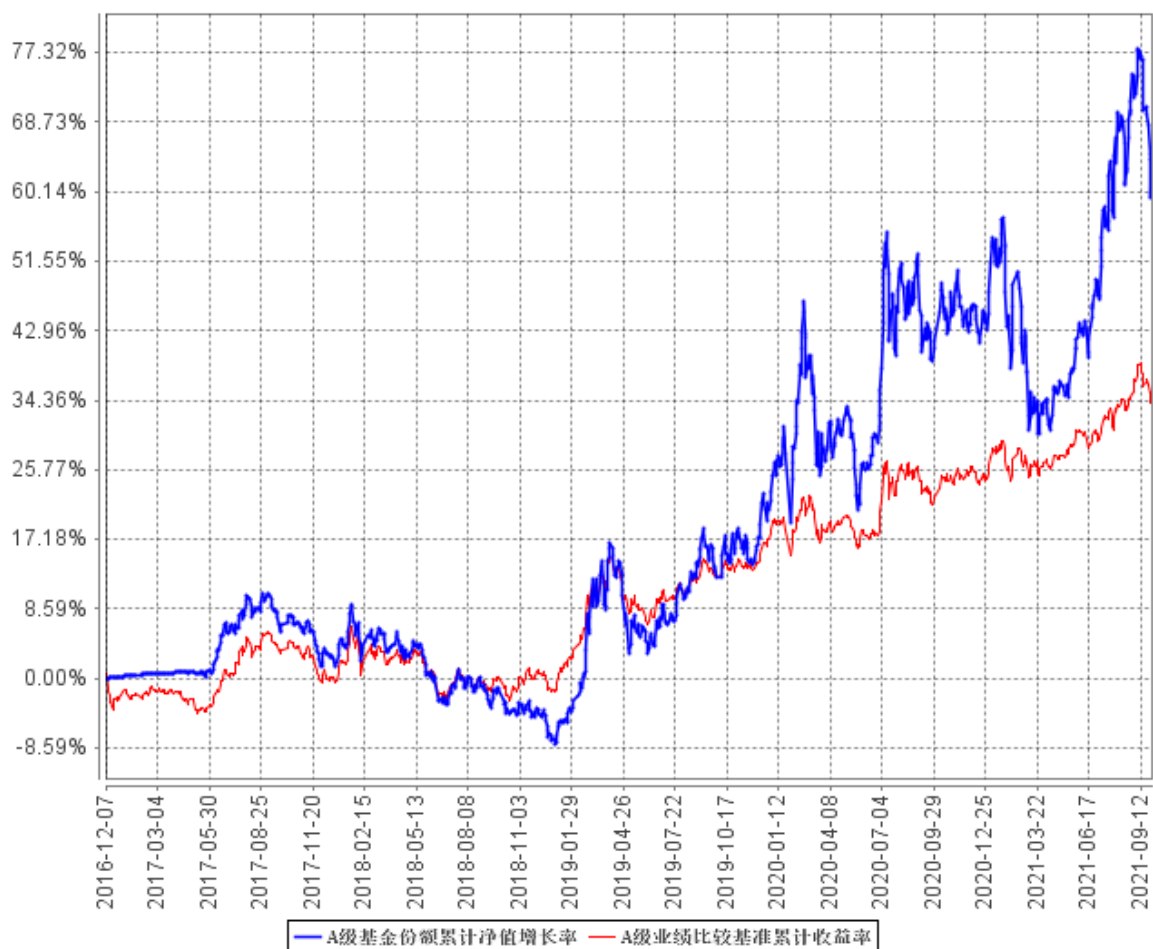
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	10.63%	1.58%	3.63%	0.48%	7.00%	1.10%
过去六个月	24.43%	1.26%	7.16%	0.40%	17.27%	0.86%
过去一年	16.52%	1.31%	10.39%	0.43%	6.13%	0.88%
过去三年	67.37%	1.25%	34.95%	0.51%	32.42%	0.74%
自基金合同生效起至今	65.17%	1.02%	35.13%	0.48%	30.04%	0.54%

长盛可转债 C

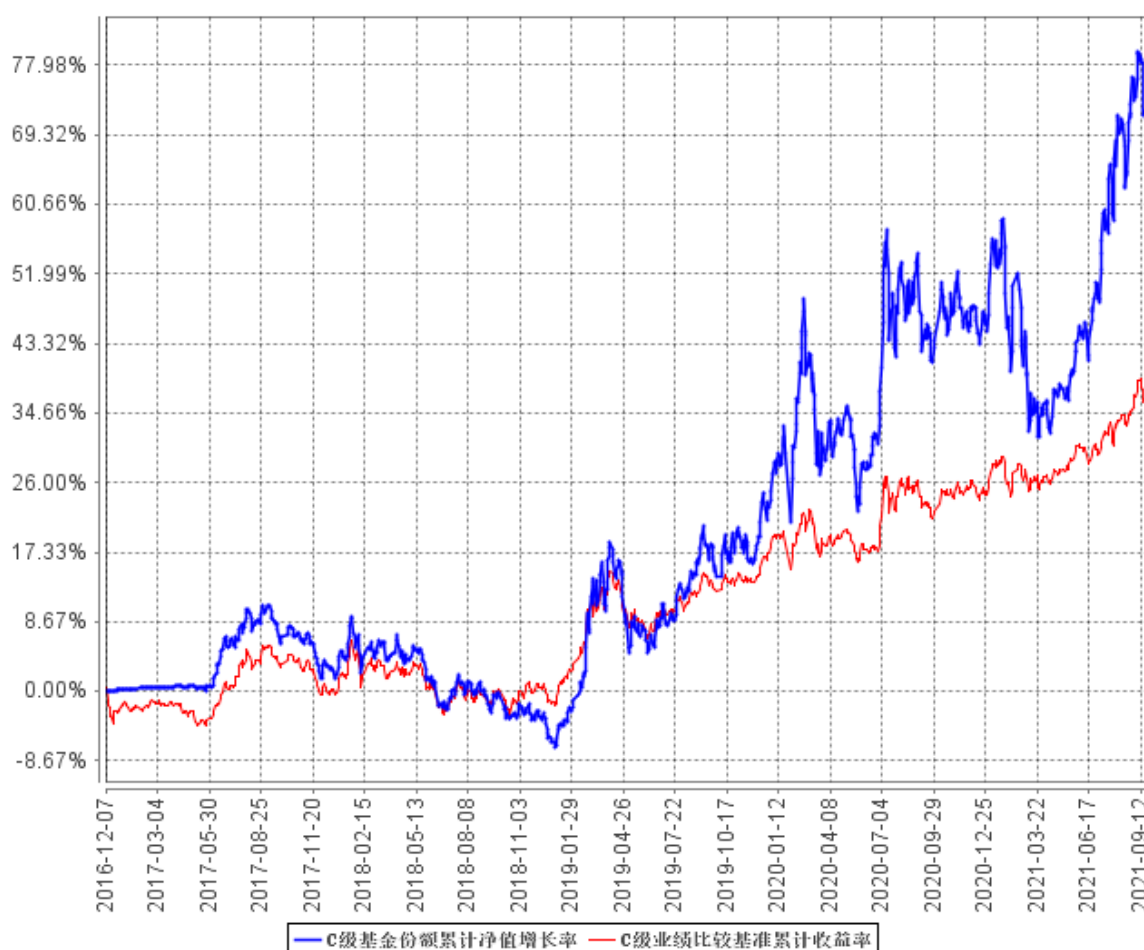
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	10.53%	1.58%	3.63%	0.48%	6.90%	1.10%
过去六个月	24.23%	1.26%	7.16%	0.40%	17.07%	0.86%
过去一年	16.17%	1.31%	10.39%	0.43%	5.78%	0.88%
过去三年	67.38%	1.25%	34.95%	0.51%	32.43%	0.74%
自基金合同生效起至今	66.90%	1.02%	35.13%	0.48%	31.77%	0.54%

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

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		
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。	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。

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。

4.1.1 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 公平交易专项说明

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 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，受疫情反复、极端天气及限电等因素影响，宏观经济增速趋缓，工业增加值同比有所下滑；物价方面，上游大宗商品涨价继续推动 PPI 快速上行，而 CPI 受食品价格影响有所回落。央行通过降准、续作 MLF 以及逆回购等方式稳定市场流动性，资金面整体合理充裕。

报告期内，债券收益率快速下行后进入振荡走势。7 月央行超预期宣布降准，推动各期限债券收益率快速下行，之后通胀和宽信用预期发酵，降低了货币政策进一步宽松的预期，债市进入振荡态势。

权益市场方面，A 股市场仅中证 500 指数上涨，上证指数、深证综指、沪深 300、创业板指数等均为下跌。从行业结构来看，申万一级行业中，受上游大宗商品涨价影响，采掘、公用、有色金属、钢铁、化工等行业涨幅较大，医药生物、休闲服务、食品饮料、传媒等行业跌幅较大。

可转债方面，转债市场整体表现较好。报告期内，受转债市场供给偏少、正股活跃等因素影响，转债转股溢价率整体有所抬升，中证转债涨幅好于多数权益指数和债券指数。

2、报告期内本基金投资策略分析

在报告期内，本基金继续坚持积极稳健投资策略，在流动性宽松超预期和市场风险偏好提升背景下，适度优化了可转债和股票资产的持仓结构，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。

4.5 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 1.3997 元，本报告期基金份额净值增长率为 10.63%；截至本报告期末长盛可转债 C 基金份额净值为 1.4008 元，本报告期基金份额净值增长率为 10.53%；同期业绩比较基准收益率为 3.63%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 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	27,023,154.61	12.11
	其中：股票	27,023,154.61	12.11
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	179,559,125.98	80.47
	其中：债券	179,559,125.98	80.47
	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	3,503,672.47	1.57
8	其他资产	13,038,596.80	5.84
9	合计	223,124,549.86	100.00

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	22,965,834.61	13.61
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	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,612,520.00	0.96
M	科学研究和技术服务业	2,444,800.00	1.45
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	27,023,154.61	16.02

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持有港股通投资股票。

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	603259	药明康德	16,000	2,444,800.00	1.45
2	000858	五粮液	11,034	2,420,749.26	1.44
3	002241	歌尔股份	45,000	1,939,500.00	1.15
4	300274	阳光电源	12,000	1,780,560.00	1.06
5	002812	恩捷股份	6,000	1,680,720.00	1.00
6	601888	中国中免	6,202	1,612,520.00	0.96
7	300750	宁德时代	3,000	1,577,190.00	0.93
8	002594	比亚迪	6,000	1,497,060.00	0.89
9	002460	赣锋锂业	9,001	1,466,622.94	0.87
10	603606	东方电缆	45,000	1,341,000.00	0.79

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	6,202,420.00	3.68
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,520,250.00	1.49
	其中：政策性金融债	2,520,250.00	1.49
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）	170,836,455.98	101.28
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	179,559,125.98	106.45

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	110053	苏银转债	109,000	12,726,840.00	7.54
2	128095	恩捷转债	20,004	9,795,758.76	5.81
3	127030	盛虹转债	42,000	8,771,280.00	5.20
4	113050	南银转债	75,000	8,652,000.00	5.13
5	123075	贝斯转债	74,060	8,358,411.60	4.96

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**

本基金本报告期内未投资国债期货。

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：本基金本报告期末无国债期货投资。

5.9.3 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。

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**

（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）南银转债：2021 年 7 月 7 日，国家市场监督管理总局行政处罚决定书国市监处（2021）62 号显示，其于 2021 年 3 月 19 日对南京银行参股设立苏宁消费金融有限公司涉嫌违法实施经营者集中案进行立案调查，经查，该案构成违法实施的经营者集中，但不具有排除、限制竞争的效果，给予南京银行 50 万元罚款的行政处罚。2020 年 12 月 31 日，人民银行南京分行（南银）罚字（2020）第 30 号显示，南京银行因存在未按规定履行客户身份识别义务等 7 项违法违规行为，对其处以警告，并处罚款 736 万元，没收违法所得 20.877802 万元。对以上事件，本基金判断，南京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。

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。

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

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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	50,823.32
2	应收证券清算款	11,587,069.30
3	应收股利	-
4	应收利息	368,079.24
5	应收申购款	1,032,624.94
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	13,038,596.80

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	110053	苏银转债	12,726,840.00	7.54
2	128095	恩捷转债	9,795,758.76	5.81
3	127030	盛虹转债	8,771,280.00	5.20
4	123075	贝斯转债	8,358,411.60	4.96
5	127018	本钢转债	7,738,900.00	4.59
6	113548	石英转债	6,663,360.00	3.95
7	128137	洁美转债	6,538,869.55	3.88
8	128035	大族转债	6,042,000.00	3.58
9	128101	联创转债	5,022,493.83	2.98
10	123025	精测转债	4,483,515.86	2.66
11	132018	G 三峡 EB1	3,925,200.00	2.33
12	123060	苏试转债	3,710,216.95	2.20
13	128142	新乳转债	3,552,773.64	2.11
14	123035	利德转债	3,367,999.21	2.00
15	113025	明泰转债	3,289,700.00	1.95
16	113606	荣泰转债	3,230,162.00	1.91
17	110073	国投转债	3,106,350.00	1.84
18	110061	川投转债	2,749,420.00	1.63
19	113009	广汽转债	2,178,614.00	1.29
20	127005	长证转债	1,882,800.00	1.12
21	118000	嘉元转债	1,795,300.00	1.06
22	113550	常汽转债	1,790,880.00	1.06
23	110048	福能转债	1,603,210.00	0.95
24	113621	彤程转债	1,142,960.00	0.68

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

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。

§ 6 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
报告期期初基金份额总额	104,642,037.77	65,294,290.05
报告期期间基金总申购份额	22,395,634.90	32,590,680.99
减：报告期期间基金总赎回份额	69,642,139.42	34,815,197.46
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	57,395,533.25	63,069,773.58

§ 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：本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§ 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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金报告期内无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、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。

9.2 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。

9.3 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 10 月 27 日