

长盛可转债债券型证券投资基金 2024 年第 2 季度报告

2024 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

报告送出日期：2024 年 7 月 19 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 2024 年 07 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 2024 年 04 月 01 日起至 06 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
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	100,572,483.11 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	<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>

	(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	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。	
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	41,496,055.26 份	59,076,427.85 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（2024 年 4 月 1 日-2024 年 6 月 30 日）	
	长盛可转债 A	长盛可转债 C
1. 本期已实现收益	-345,251.81	-541,075.83
2. 本期利润	591,753.20	790,884.95
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0140	0.0130
4. 期末基金资产净值	38,347,532.97	54,384,823.62
5. 期末基金份额净值	0.9241	0.9206

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、所列数据截止到 2024 年 06 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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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	①-③	②-④

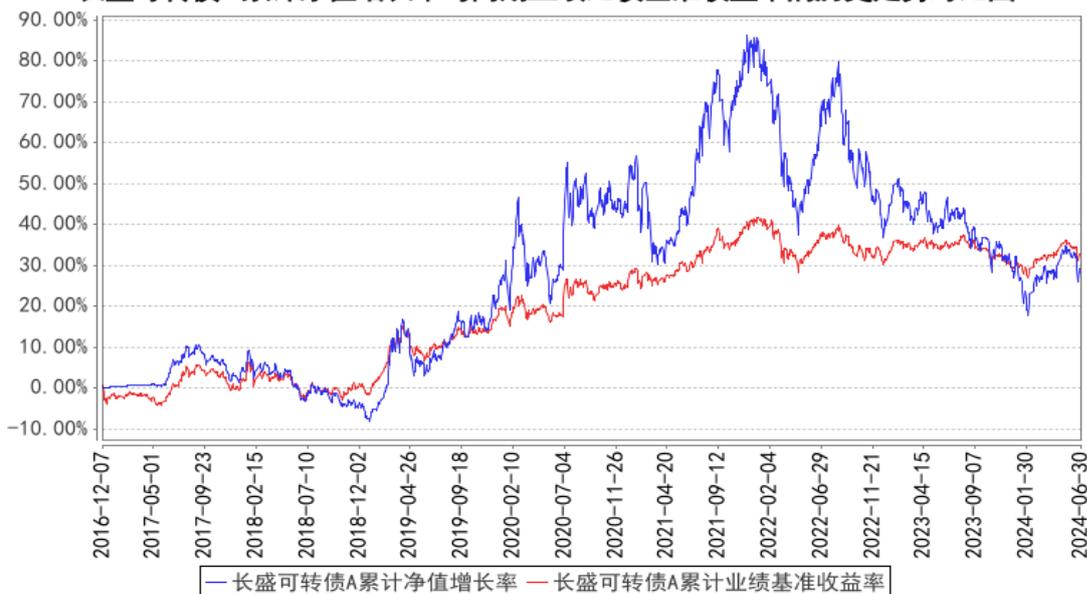
				④		
过去三个月	1.44%	0.72%	0.78%	0.32%	0.66%	0.40%
过去六个月	-2.27%	0.82%	1.25%	0.35%	-3.52%	0.47%
过去一年	-9.38%	0.79%	-1.51%	0.32%	-7.87%	0.47%
过去三年	-13.48%	1.12%	1.89%	0.40%	-15.37%	0.72%
过去五年	20.25%	1.19%	21.05%	0.43%	-0.80%	0.76%
自基金合同 生效起至今	29.18%	1.04%	32.86%	0.45%	-3.68%	0.59%

长盛可转债 C

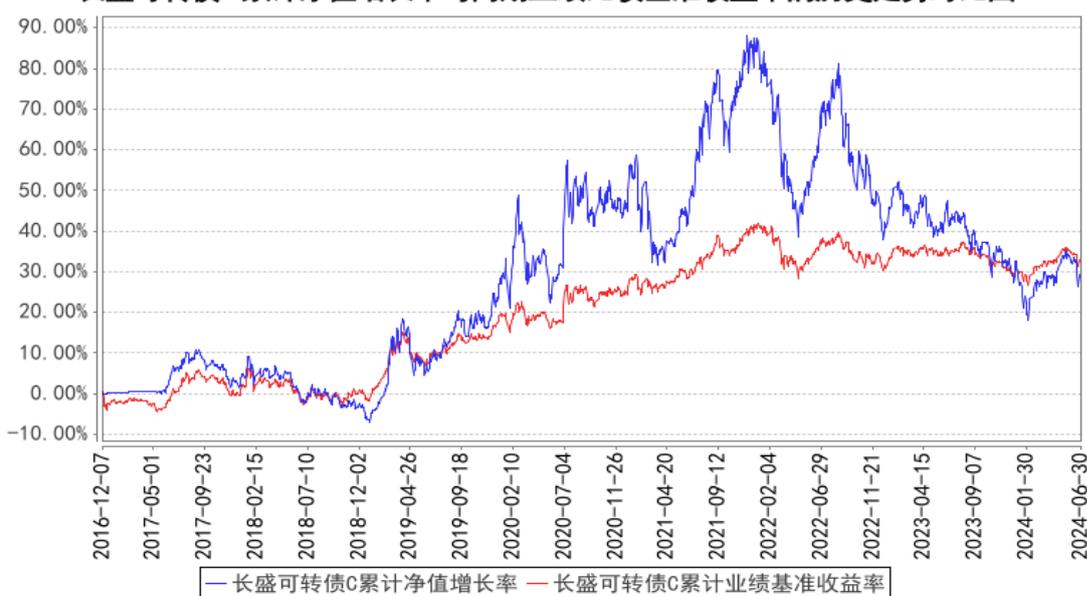
阶段	净值增长率①	净值增长率标准 差②	业绩比较基准 收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	1.37%	0.72%	0.78%	0.32%	0.59%	0.40%
过去六个月	-2.42%	0.82%	1.25%	0.35%	-3.67%	0.47%
过去一年	-9.65%	0.79%	-1.51%	0.32%	-8.14%	0.47%
过去三年	-14.26%	1.13%	1.89%	0.40%	-16.15%	0.73%
过去五年	18.73%	1.19%	21.05%	0.43%	-2.32%	0.76%
自基金合同 生效起至今	29.47%	1.04%	32.86%	0.45%	-3.39%	0.59%

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

长盛可转债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



长盛可转债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：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	本基金基金经理，	2018年6月11日	-	14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

长盛积极配置债券型证券投资基金基金经理，长盛安盈混合型证券投资基金基金经理，长盛稳怡添利债券型证券投资基金基金经理。				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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》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

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

1、报告期内行情回顾

报告期内，宏观经济继续转型，外需保持较强韧性，制造业投资较快增长，但房地产投资下滑、居民消费偏弱、基建投资增速较慢。5 月和 6 月 PMI 指数再度降至收缩区间，显示当前经济改善基础尚不稳固。4 月政治局会议提出加快财政支出、研究地产去库存等，其后相关政策陆续出台。

报告期内，债券市场整体延续牛市行情，利率整体继续下行。4 月下旬，央行提示长债风险，债市收益率显著上行，10 年期国债活跃券调整幅度达到 13bp；之后受经济修复较慢、资金宽松、配置力量较强等因素影响，债市收益率继续下行。

报告期内，A 股市场先涨后跌。从申万一级行业指数看，仅银行、公用事业、电子、煤炭、交运行业指数上涨，其余多数行业指数均为下跌，其中传媒、商贸、社服、计算机等行业指数跌幅较大。

可转债方面，转债市场整体跟随股市先涨后跌。4 月和 5 月理财、保险等增量资金抬升转债估值，叠加股市有所上涨，转债整体有所上涨；6 月，受评级下调、监管问询函等因素扰动，叠加股市震荡调整，转债市场有所调整，尤其是弱资质转债普遍出现较大跌幅。

2、报告期内本基金投资策略分析

报告期内，在经济动能切换、出口需求改善、财政政策适度发力局面下，可转债行业配置适度分散化，减持了部分弱资质个券、高价转债和高溢价率个券，主要配置均衡型和高性价比标的；同时，股票个股选择更重视盈利确定性和估值安全边际。

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 的基金份额净值为 0.9241 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.44%，同期业绩比较基准收益率为 0.78%；截至本报告期末长盛可转债 C 的基金份额净值为 0.9206 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.37%，同期业绩比较基准收益率为 0.78%。

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	7,683,817.40	6.69
	其中：股票	7,683,817.40	6.69
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	105,375,351.59	91.75
	其中：债券	105,375,351.59	91.75
	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	1,470,544.61	1.28
8	其他资产	326,946.63	0.28
9	合计	114,856,660.23	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	2,779,013.00	3.00
C	制造业	3,082,924.40	3.32
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	229,190.00	0.25
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	501,340.00	0.54
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	909,550.00	0.98
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	181,800.00	0.20
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	7,683,817.40	8.29

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	300442	润泽科技	29,000	694,550.00	0.75
2	601225	陕西煤业	20,000	515,400.00	0.56
3	601899	紫金矿业	24,900	437,493.00	0.47
4	603993	洛阳钼业	46,000	391,000.00	0.42
5	603296	华勤技术	7,000	386,610.00	0.42
6	600150	中国船舶	8,500	346,035.00	0.37
7	600028	中国石化	53,000	334,960.00	0.36
8	600547	山东黄金	12,000	328,560.00	0.35
9	300308	中际旭创	2,380	328,154.40	0.35
10	600489	中金黄金	22,000	325,600.00	0.35

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	5,318,118.74	5.73

2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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）	100,057,232.85	107.90
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	105,375,351.59	113.63

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	110062	烽火转债	45,500	5,346,360.95	5.77
2	019740	24 国债 09	53,000	5,318,118.74	5.73
3	113050	南银转债	38,000	4,765,659.12	5.14
4	127049	希望转 2	43,201	4,471,414.76	4.82
5	127045	牧原转债	25,002	2,958,970.26	3.19

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

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

一、南银转债

2023 年 8 月 25 日，国家外汇管理局江苏省分局下发的苏汇检罚（2023）4 号处罚函显示，南京银行因办理经常项目资金收付，未对交易单证的真实性及其与外汇收支的一致性进行合理性审查；未按规定报送财务会计报告、统计报表等资料；违反外汇登记管理规定三项违规事实，被国家外汇管理局江苏省分局警告并罚款 60 万元。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合法律法规、基金合同和公司投资制度的规定。

二、华正转债

经查明，浙江华正新材料股份有限公司（以下简称公司）于 2023 年 10 月 12 日在上证 e 互动回复投资者提问称，“公司具备用于 5.5G 的产品和技术，同时公司也正积极与国内领先的通信公司共同进行前沿技术布局与产品开发”。相关回复发布后，公司股价于 10 月 13 日和 10 月 16 日连续两个交易日涨停并触及异常波动。公司于 10 月 17 日披露公告澄清称，“公司高频产品 HC298 覆铜板可用于高频通信天线领域，因 5.5G 尚未形成行业技术标准，因此该产品目前未直接用于 5.5G 天线领域，后续开发和应用存在不确定性；5.5G 尚未正式商用，目前公司产品未产生相关销售额，未对公司的经营产生实质影响”。公司在上证 e 互动平台发布 5.5G 相关产品和技术信息，未能客观、完整地介绍和反映公司产品业务占比以及对公司业绩的影响等实际情况，相关信息不完整、不准确，可能对投资者产生误导。公司上述行为违反了《上海证券交易所股票上市规则》（以下简称《股票上市规则》）第 1.4 条和《上海证券交易所上市公司自律监管指引第 1 号——规范运作》第 7.5.3 条、第 7.5.4 条等有关规定。公司时任董事会秘书俞高作为信息披露事务的具体负责人，未能勤勉尽责，对上述违规行为负有责任，其行为违反了《股票上市规则》第 2.1.2 条、第 4.3.1 条、第 4.3.5 条、第 4.4.2 条等有关规定及其在《董事（监事、高级管理人员）声明及承诺书》中作出的承诺。予以监管警示。

三、杭银转债

2024 年 1 月 15 日，浙金罚决字（2024）1 号显示，杭州银行股份有限公司存在债券承销业务与债券交易/投资业务间“防火墙”建设不到位等 6 项违法违规事实，被处罚款 210 万元。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合法律法规、基金合同和公司投资制度的规定。

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是否超出基金合同规定的备选股票库

本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	12,777.44
2	应收证券清算款	302,652.76
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	11,516.43
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	326,946.63

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	110062	烽火转债	5,346,360.95	5.77
2	113050	南银转债	4,765,659.12	5.14
3	127049	希望转 2	4,471,414.76	4.82
4	127045	牧原转债	2,958,970.26	3.19
5	113639	华正转债	2,929,273.19	3.16
6	110079	杭银转债	2,165,356.49	2.34
7	113615	金诚转债	2,093,830.36	2.26
8	123076	强力转债	1,912,687.67	2.06
9	132026	G 三峡 EB2	1,553,478.90	1.68
10	123107	温氏转债	1,388,189.45	1.50
11	127068	顺博转债	1,300,526.74	1.40
12	111017	蓝天转债	1,285,245.48	1.39
13	113656	嘉诚转债	1,227,552.08	1.32
14	113049	长汽转债	1,118,068.22	1.21
15	118024	冠宇转债	1,096,539.73	1.18
16	110073	国投转债	1,082,396.71	1.17
17	113641	华友转债	1,014,670.14	1.09
18	113043	财通转债	1,000,394.38	1.08
19	127015	希望转债	884,293.86	0.95
20	111004	明新转债	850,110.68	0.92
21	127067	恒逸转 2	844,454.79	0.91
22	110083	苏租转债	763,222.93	0.82
23	123193	海能转债	738,266.03	0.80

24	113066	平煤转债	720,402.28	0.78
25	127091	科数转债	678,030.90	0.73
26	118033	华特转债	670,630.68	0.72
27	118030	睿创转债	664,263.29	0.72
28	113065	齐鲁转债	652,066.37	0.70
29	123190	道氏转 02	646,491.27	0.70
30	113679	芯能转债	637,338.41	0.69
31	111010	立昂转债	586,556.08	0.63
32	113667	春 23 转债	566,307.74	0.61
33	127075	百川转 2	550,797.04	0.59
34	123169	正海转债	540,514.38	0.58
35	110093	神马转债	535,943.47	0.58
36	123147	中辰转债	519,319.60	0.56
37	123085	万顺转 2	486,020.55	0.52
38	127074	麦米转 2	479,624.11	0.52
39	113045	环旭转债	475,156.27	0.51
40	123128	首华转债	474,094.75	0.51
41	127101	豪鹏转债	471,679.60	0.51
42	127056	中特转债	467,968.99	0.50
43	113653	永 22 转债	463,700.22	0.50
44	113652	伟 22 转债	452,446.36	0.49
45	127052	西子转债	452,056.99	0.49
46	128109	楚江转债	443,306.08	0.48
47	113052	兴业转债	440,445.92	0.47
48	113047	旗滨转债	438,607.67	0.47
49	113644	艾迪转债	430,635.07	0.46
50	123172	漱玉转债	425,907.95	0.46
51	113636	甬金转债	421,432.53	0.45
52	123133	佩蒂转债	398,885.16	0.43
53	123174	精锻转债	397,746.45	0.43
54	113638	台 21 转债	392,326.51	0.42
55	113064	东材转债	385,699.27	0.42
56	127031	洋丰转债	382,507.45	0.41
57	123159	崧盛转债	379,762.47	0.41
58	127100	神码转债	374,280.28	0.40
59	123191	智尚转债	364,175.67	0.39
60	123150	九强转债	359,136.58	0.39
61	113647	禾丰转债	354,427.64	0.38
62	127099	盛航转债	340,878.27	0.37
63	123121	帝尔转债	340,509.86	0.37
64	123117	健帆转债	340,338.90	0.37
65	113062	常银转债	340,142.37	0.37

66	123145	药石转债	339,593.42	0.37
67	127073	天赐转债	336,443.84	0.36
68	110067	华安转债	333,853.94	0.36
69	113024	核建转债	331,074.66	0.36
70	127085	韵达转债	330,303.04	0.36
71	127066	科利转债	327,276.99	0.35
72	123227	雅创转债	324,676.21	0.35
73	123234	中能转债	324,295.64	0.35
74	118015	芯海转债	321,687.95	0.35
75	118013	道通转债	319,766.52	0.34
76	127022	恒逸转债	317,868.67	0.34
77	123078	飞凯转债	317,548.38	0.34
78	118042	奥维转债	317,107.40	0.34
79	128137	洁美转债	316,536.53	0.34
80	118028	会通转债	311,247.49	0.34
81	111013	新港转债	309,077.67	0.33
82	127090	兴瑞转债	308,474.79	0.33
83	128105	长集转债	308,122.36	0.33
84	118003	华兴转债	304,847.60	0.33
85	123212	立中转债	299,632.41	0.32
86	128144	利民转债	295,072.19	0.32
87	113675	新 23 转债	289,832.60	0.31
88	127041	弘亚转债	288,014.73	0.31
89	123184	天阳转债	286,574.64	0.31
90	123178	花园转债	284,735.90	0.31
91	123170	南电转债	281,604.40	0.30
92	127032	苏行转债	280,946.24	0.30
93	127088	赫达转债	278,097.81	0.30
94	113069	博 23 转债	274,953.78	0.30
95	123213	天源转债	274,344.94	0.30
96	123217	富仕转债	272,101.53	0.29
97	113669	景 23 转债	264,652.88	0.29
98	118037	上声转债	262,452.77	0.28
99	113602	景 20 转债	262,413.68	0.28
100	113606	荣泰转债	261,842.15	0.28
101	113619	世运转债	259,745.21	0.28
102	123185	能辉转债	257,001.64	0.28
103	127084	柳工转 2	255,652.12	0.28
104	123101	拓斯转债	250,623.01	0.27
105	127086	恒邦转债	248,373.32	0.27
106	128121	宏川转债	248,026.01	0.27
107	110075	南航转债	247,968.27	0.27

108	113623	凤 21 转债	247,692.33	0.27
109	113067	燃 23 转债	247,157.21	0.27
110	127070	大中转债	246,407.85	0.27
111	123224	宇邦转债	245,728.85	0.26
112	127039	北港转债	241,853.15	0.26
113	113563	柳药转债	241,195.30	0.26
114	113051	节能转债	238,845.75	0.26
115	127076	中宠转 2	237,926.43	0.26
116	123176	精测转 2	233,974.95	0.25
117	123204	金丹转债	233,009.48	0.25
118	127077	华宏转债	231,728.08	0.25
119	113658	密卫转债	231,468.67	0.25
120	127020	中金转债	228,851.88	0.25
121	128136	立讯转债	228,398.08	0.25
122	113663	新化转债	227,731.23	0.25
123	127016	鲁泰转债	226,514.90	0.24
124	118012	微芯转债	226,049.48	0.24
125	113061	拓普转债	225,527.35	0.24
126	128083	新北转债	224,785.97	0.24
127	123059	银信转债	224,473.55	0.24
128	123091	长海转债	224,189.32	0.24
129	127026	超声转债	223,627.95	0.24
130	123071	天能转债	222,394.47	0.24
131	123211	阳谷转债	221,505.81	0.24
132	113058	友发转债	220,027.67	0.24
133	113674	华设转债	218,580.64	0.24
134	127027	能化转债	218,462.58	0.24
135	113621	彤程转债	218,394.38	0.24
136	123208	孩王转债	217,692.80	0.23
137	128129	青农转债	217,107.70	0.23
138	123048	应急转债	217,068.31	0.23
139	127071	天箭转债	216,896.04	0.23
140	128130	景兴转债	215,678.90	0.23
141	127040	国泰转债	215,654.01	0.23
142	113549	白电转债	215,279.11	0.23
143	113631	皖天转债	215,201.37	0.23
144	127030	盛虹转债	214,604.11	0.23
145	113643	风语转债	214,509.59	0.23
146	123235	亿田转债	213,815.24	0.23
147	113616	韦尔转债	213,309.62	0.23
148	127018	本钢转债	212,537.98	0.23
149	118038	金宏转债	211,906.01	0.23

150	110085	通 22 转债	211,534.03	0.23
151	113637	华翔转债	211,119.53	0.23
152	123115	捷捷转债	210,397.67	0.23
153	127043	川恒转债	209,878.51	0.23
154	113676	荣 23 转债	209,860.13	0.23
155	110084	贵燃转债	209,389.81	0.23
156	113648	巨星转债	208,314.96	0.22
157	127028	英特转债	206,689.26	0.22
158	128141	旺能转债	206,143.89	0.22
159	123233	凯盛转债	205,948.24	0.22
160	113666	爱玛转债	205,434.49	0.22
161	128133	奇正转债	203,774.11	0.22
162	113033	利群转债	203,318.03	0.22
163	113059	福莱转债	202,942.90	0.22
164	113634	珀莱转债	202,888.97	0.22
165	118025	奕瑞转债	202,349.60	0.22
166	110089	兴发转债	202,282.27	0.22
167	127082	亚科转债	202,138.38	0.22
168	123149	通裕转债	201,968.22	0.22
169	113659	莱克转债	201,896.88	0.22
170	123168	惠云转债	201,170.70	0.22
171	127042	嘉美转债	200,667.59	0.22
172	113660	寿 22 转债	200,657.29	0.22
173	113632	鹤 21 转债	200,609.08	0.22
174	127054	双箭转债	199,692.77	0.22
175	123132	回盛转债	199,119.18	0.21
176	113030	东风转债	198,960.59	0.21
177	113651	松霖转债	196,228.77	0.21
178	113671	武进转债	195,206.53	0.21
179	113677	华懋转债	194,761.23	0.21
180	123157	科蓝转债	194,554.79	0.21
181	128095	恩捷转债	194,530.19	0.21
182	127098	欧晶转债	194,392.80	0.21
183	113654	永 02 转债	193,762.36	0.21
184	118004	博瑞转债	191,880.21	0.21
185	111002	特纸转债	189,966.90	0.20
186	123236	家联转债	189,221.96	0.20
187	113055	成银转债	188,916.16	0.20
188	110094	众和转债	184,893.82	0.20
189	123119	康泰转 2	184,814.90	0.20
190	128142	新乳转债	183,261.86	0.20
191	123035	利德转债	182,855.49	0.20

192	110060	天路转债	182,308.73	0.20
193	127069	小熊转债	181,627.15	0.20
194	111014	李子转债	180,424.49	0.19
195	127072	博实转债	179,368.56	0.19
196	110082	宏发转债	177,633.49	0.19
197	123143	胜蓝转债	175,502.14	0.19
198	123090	三诺转债	175,231.85	0.19
199	111000	起帆转债	172,327.40	0.19
200	123216	科顺转债	171,661.76	0.19
201	127095	广泰转债	168,677.88	0.18
202	127053	豪美转债	166,216.82	0.18
203	110090	爱迪转债	165,253.12	0.18
204	113060	浙 22 转债	162,633.06	0.18
205	113545	金能转债	161,963.63	0.17
206	123158	宙邦转债	159,200.52	0.17
207	128132	交建转债	139,728.16	0.15
208	118041	星球转债	135,272.22	0.15
209	113582	火炬转债	133,048.08	0.14
210	127035	濮耐转债	131,881.72	0.14
211	127092	运机转债	131,539.24	0.14
212	111003	聚合转债	120,434.25	0.13
213	127038	国微转债	113,649.21	0.12
214	118035	国力转债	106,889.13	0.12
215	123219	宇瞳转债	104,765.12	0.11
216	128122	兴森转债	99,798.14	0.11
217	128128	齐翔转 2	73,953.37	0.08
218	110087	天业转债	70,826.36	0.08
219	118036	力合转债	67,507.97	0.07
220	113598	法兰转债	61,800.68	0.07
221	123194	百洋转债	59,287.74	0.06
222	113673	岱美转债	43,294.59	0.05
223	113056	重银转债	39,045.30	0.04
224	127050	麒麟转债	36,265.99	0.04
225	127083	山路转债	34,174.97	0.04
226	113542	好客转债	32,588.31	0.04
227	127064	杭氧转债	30,761.64	0.03
228	127025	冀东转债	10,348.60	0.01
229	123183	海顺转债	5,289.98	0.01
230	113579	健友转债	2,163.04	0.00
231	113584	家悦转债	2,124.05	0.00
232	128116	瑞达转债	2,108.17	0.00
233	113650	博 22 转债	2,057.00	0.00

234	118005	天奈转债	1,997.79	0.00
235	123192	科思转债	1,504.57	0.00
236	127014	北方转债	1,462.96	0.00
237	123104	卫宁转债	1,147.82	0.00
238	128135	洽洽转债	1,135.25	0.00
239	110064	建工转债	1,115.84	0.00
240	128117	道恩转债	1,110.07	0.00
241	128131	崇达转 2	1,108.26	0.00
242	127017	万青转债	1,107.13	0.00
243	127051	博杰转债	1,092.05	0.00
244	128125	华阳转债	1,088.25	0.00
245	110076	华海转债	1,086.02	0.00
246	111001	山玻转债	1,082.15	0.00
247	127046	百润转债	1,082.03	0.00
248	128101	联创转债	1,080.12	0.00
249	113655	欧 22 转债	1,080.12	0.00
250	113627	太平转债	1,080.09	0.00
251	113605	大参转债	1,073.58	0.00
252	128134	鸿路转债	1,070.91	0.00
253	127024	盈峰转债	1,066.66	0.00
254	113661	福 22 转债	1,063.55	0.00
255	123154	火星转债	1,062.12	0.00
256	113054	绿动转债	1,056.36	0.00
257	123215	铭利转债	1,054.58	0.00
258	110070	凌钢转债	1,054.56	0.00
259	123180	浙矿转债	1,043.10	0.00
260	123210	信服转债	1,036.03	0.00
261	123179	立高转债	1,022.02	0.00
262	113053	隆 22 转债	1,017.50	0.00
263	113657	再 22 转债	1,000.41	0.00
264	123161	强联转债	983.48	0.00
265	127044	蒙娜转债	981.09	0.00
266	128124	科华转债	981.09	0.00
267	127089	晶澳转债	973.03	0.00
268	118010	洁特转债	960.77	0.00
269	111009	盛泰转债	954.59	0.00
270	113048	晶科转债	945.07	0.00
271	118000	嘉元转债	931.71	0.00
272	118031	天 23 转债	928.51	0.00
273	123144	裕兴转债	924.08	0.00
274	113640	苏利转债	923.86	0.00
275	118008	海优转债	816.14	0.00

276	118023	广大转债	709.06	0.00
-----	--------	------	--------	------

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	43,347,571.25	62,738,011.67
报告期期间基金总申购份额	627,306.24	2,824,051.66
减：报告期期间基金总赎回份额	2,478,822.23	6,485,635.48
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	41,496,055.26	59,076,427.85

§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

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

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

2024 年 7 月 19 日