

长盛可转债债券型证券投资基金 2018 年年度报告 摘要

2018 年 12 月 31 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：2019 年 3 月 29 日

§ 1 重要提示

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。本年度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 2019 年 3 月 28 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本年度报告财务资料已经审计，安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2018 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

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	
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	16,235,097.93 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	11,269,677.75 份	4,965,420.18 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>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>本基金主要投资于可转换债券等固定收益类品种，在有效控制风险的基础上，以可转换债券为主要投资标的，力求取得超越基金业绩比较基准的收益。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。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> <p>本基金股票投资以精选个股为主，发挥基金管理人专业研究团队的研究能力，从定量和定性两方面考察上市公司的增值潜力。</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
		王永民

	联系电话	010-86497608	010-66594896
	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

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.csfunds.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人的办公地址及基金托管人住所

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018 年		2017 年		2016 年 12 月 7 日(基金合同生效日)-2016 年 12 月 31 日	
	长盛可转债 A	长盛可转债 C	长盛可转债 A	长盛可转债 C	长盛可转债 A	长盛可转债 C
本期已实现收益	-506,417.87	-486,279.35	2,951,588.44	612,648.87	376,123.41	240,767.63
本期利润	-982,620.69	1,669,884.31	3,105,163.29	-1,690,784.30	376,123.41	240,767.63
加权平均基金份额本期利润	-0.0735	0.1316	0.0589	-0.1037	0.0021	0.0019
本期基金份额净值增长率	-9.12%	-8.10%	1.63%	1.80%	0.21%	0.19%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末		2017 年末		2016 年末	
	长盛可转债 A	长盛可转债 C	长盛可转债 A	长盛可转债 C	长盛可转债 A	长盛可转债 C
期末可供分配基金份额利润	-0.0834	-0.0717	0.0184	0.0199	0.0021	0.0019
期末基金资产净值	10,330,289.67	4,609,352.93	18,026,319.47	31,960,247.62	179,290,274.49	126,617,527.18
期末基金份额净值	0.9166	0.9283	1.0184	1.0199	1.0021	1.0019

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 12 月 31 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	业绩比较基准收益	业绩比较基准收益率标准差	①—③	②—④
----	----------	----------	----------	--------------	-----	-----

		准差②	率③	④		
过去三个月	-6.22%	0.50%	-1.47%	0.44%	-4.75%	0.06%
过去六个月	-5.21%	0.51%	0.35%	0.42%	-5.56%	0.09%
过去一年	-9.12%	0.57%	-1.05%	0.49%	-8.07%	0.08%
自基金合同生效起至今	-7.45%	0.46%	-1.33%	0.43%	-6.12%	0.03%

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
过去三个月	-6.00%	0.50%	-1.47%	0.44%	-4.53%	0.06%
过去六个月	-4.95%	0.51%	0.35%	0.42%	-5.30%	0.09%
过去一年	-8.10%	0.57%	-1.05%	0.49%	-7.05%	0.08%
自基金合同生效起至今	-6.27%	0.46%	-1.33%	0.43%	-4.94%	0.03%

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。

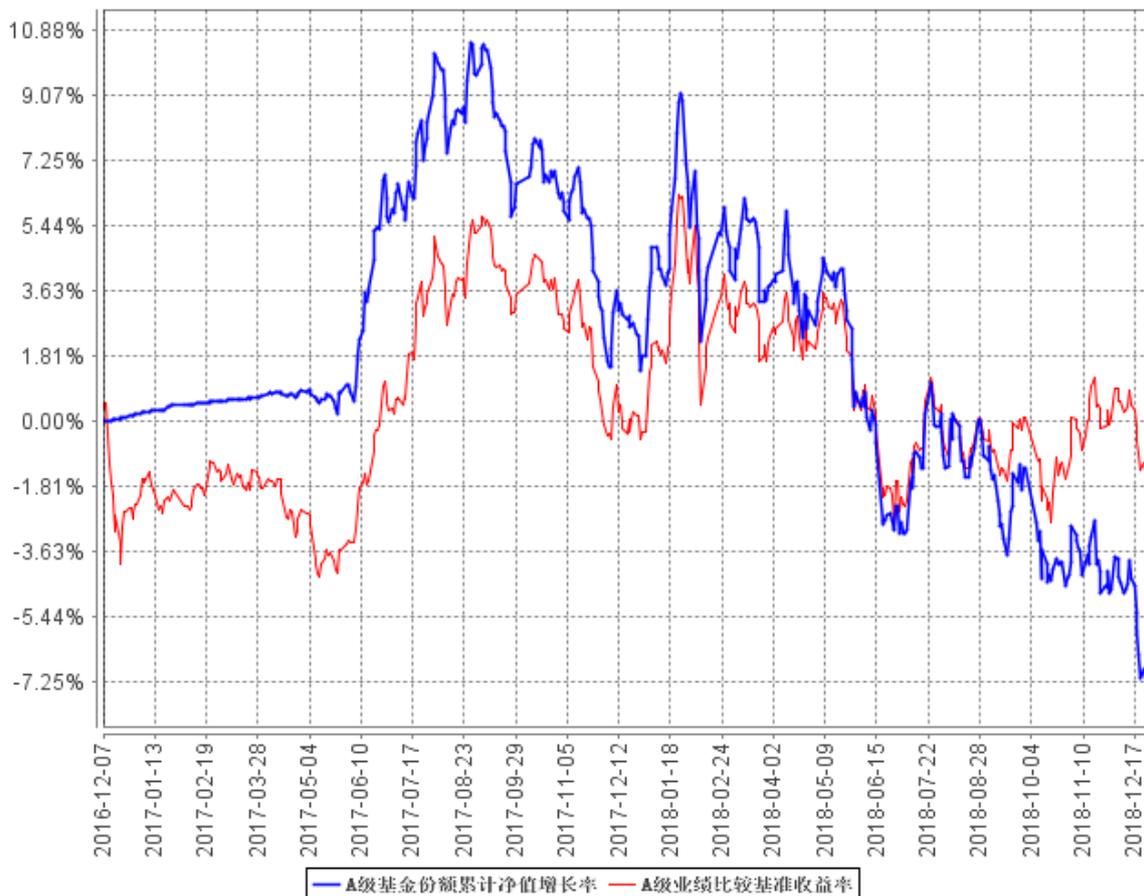
中证综合债券指数是综合反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央票及短融整体走势的跨市场债券指数，其选样是在中证全债指数样本的基础上，增加了央行票据、短期融资券以及一年期以下的国债、金融债和企业债，更全面地反映我国债券市场的整体价格变动趋势，为债券投资者提供更切合的市场基准。

沪深 300 指数是由上海和深圳证券市场中选取 300 只 A 股作为样本编制而成的成份股指数，样本覆盖了沪深市场六成左右的市值，具有良好的市场代表性。沪深 300 指数是沪深证券交易所第一次联合发布的反映 A 股市场整体走势的指数。它的推出，丰富了市场现有的指数体系，增加了一项用于观察市场走势的指标，有利于投资者全面把握市场运行状况，也进一步为指数投资产品的创新和发展提供了基础条件。

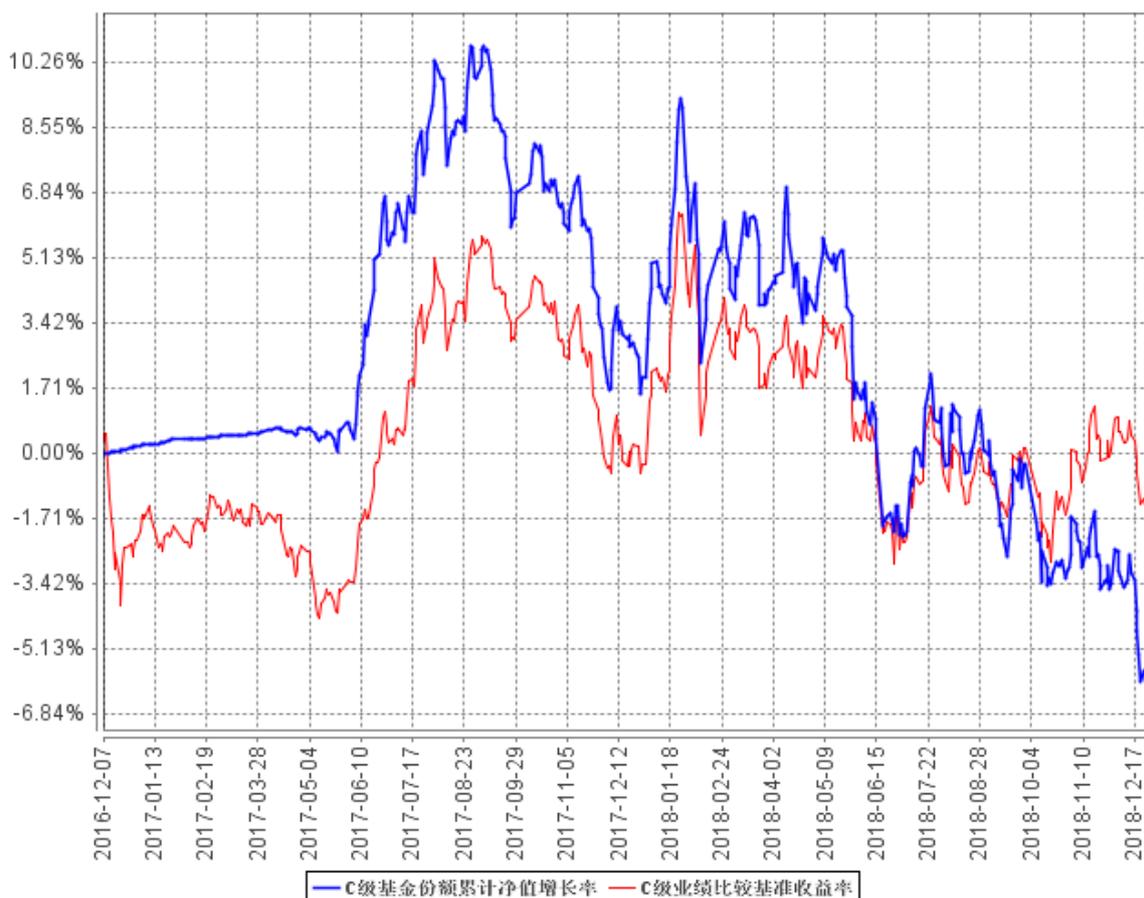
由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照 60%、30%、10%的比例采取再平衡，再用连锁计算的方式得到基准指数的时间序列。

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



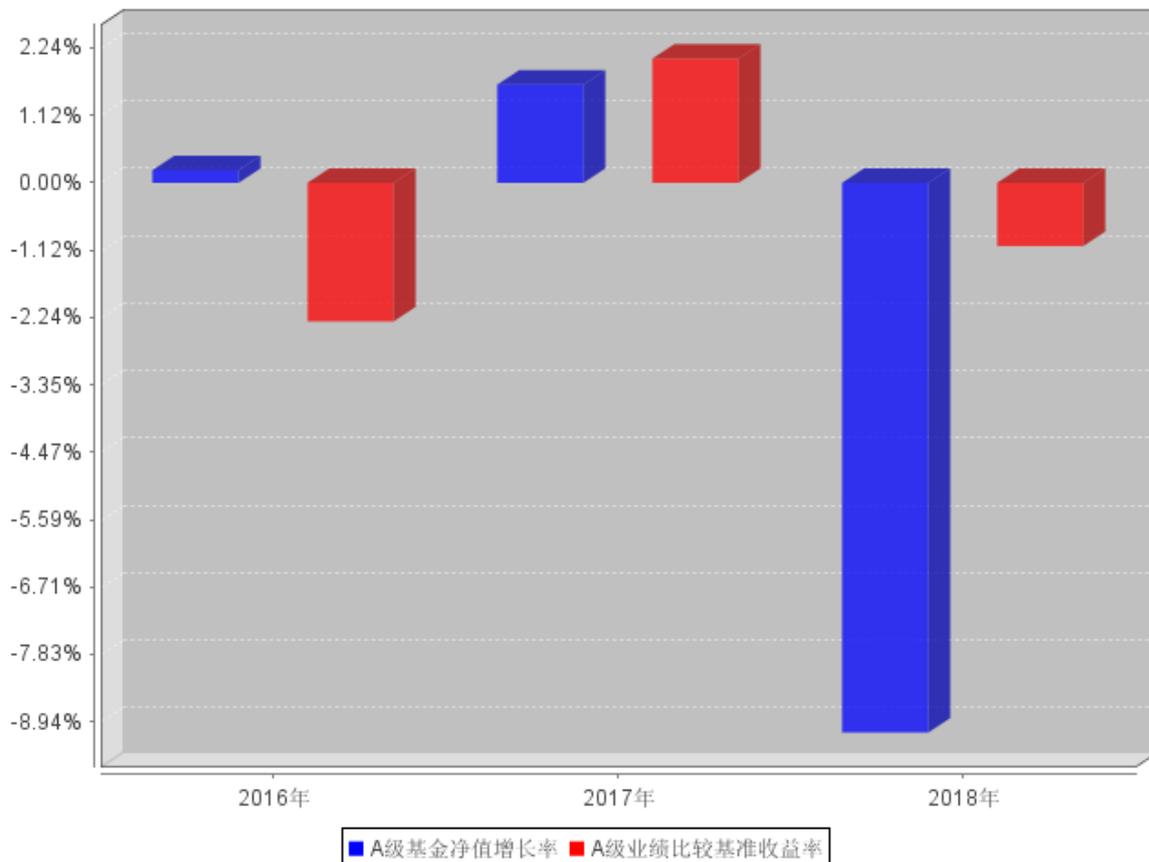
C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



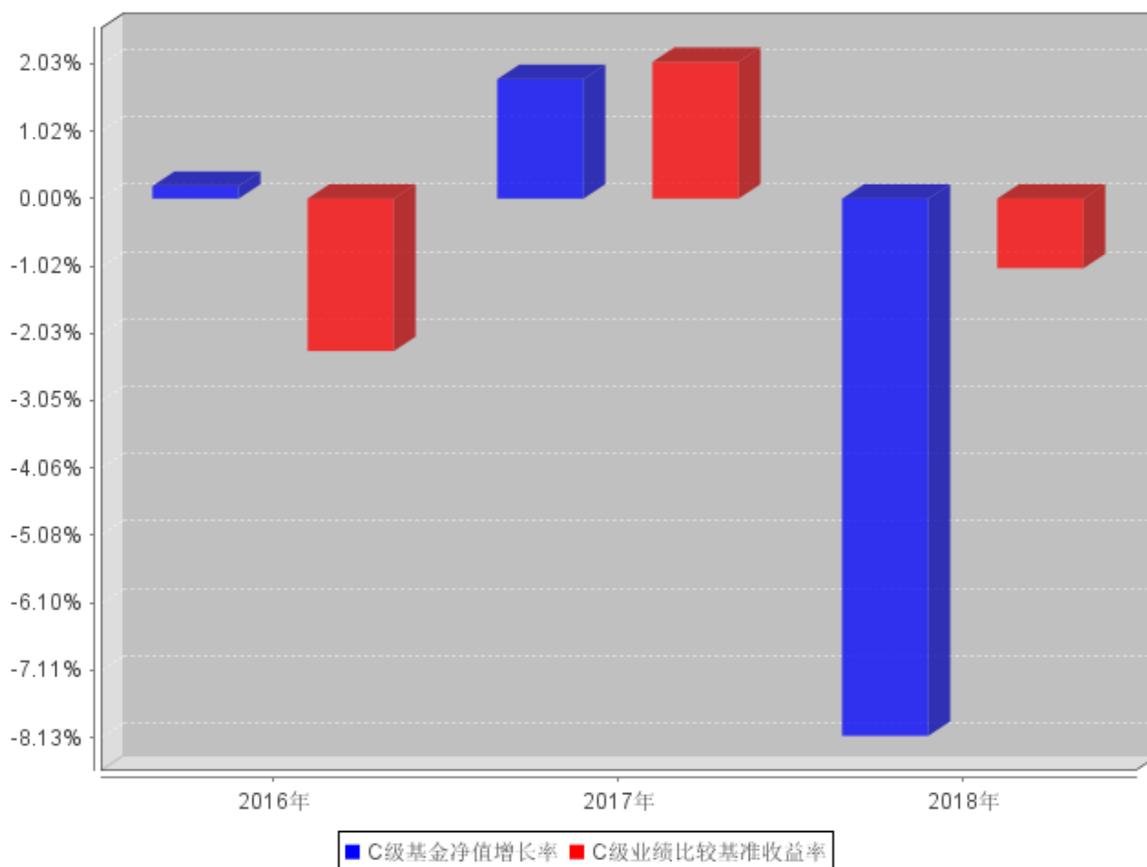
注：按照本基金合同规定，本基金基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。截至报告日，本基金的各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

A级自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



C级自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同生效日为2016年12月7日，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

长盛可转债 A					
年度	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	年度利润分配合计	备注
2018	0.1000	155,925.76	7,644.94	163,570.70	
2017	-	-	-	-	
2016	-	-	-	-	
合计	0.1000	155,925.76	7,644.94	163,570.70	

单位：人民币元

长盛可转债 C					
年度	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	年度利润分配合计	备注
2018	0.1000	192,803.58	11,096.20	203,899.78	
2017	-	-	-	-	
2016	-	-	-	-	
合计	0.1000	192,803.58	11,096.20	203,899.78	

§ 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 18900 万元。公司注册地在深圳，总部设在北京，并在北京、上海、成都设有分公司，在深圳设有营销中心，并拥有长盛基金（香港）有限公司、长盛创富资产管理有限公司两家全资子公司。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、特定客户资产管理、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 2018 年 12 月 31 日，基金管理人共管理五十八只开放式基金，并管理多个全国社保基金组合和专户产品。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		
李琪	本基金基金经理，长盛双月红 1 年期定期开放债券型投资基金基金经理，长盛盛辉混合型证券投资基金基金经理，长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛全债指数增强型债券投资基金基金经理，长盛同禧债券型证券投资基金基金经理。	2018 年 6 月 29 日	-	10 年	李琪先生，1975 年 2 月出生。天津大学管理学博士。历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，泰康资产管理有限责任公司信用研究员。2011 年 3 月加入长盛基金管理有限公司，曾任信用研究员、基金经理助理等职务。
杨哲	本基金基金经理，长盛全债指数增强型债券投资基金基金经理，长盛同禧债券型证券投资基金基金经理，长盛盛杰	2018 年 6 月 11 日	-	8 年	杨哲先生，1984 年 2 月出生，经济学硕士。曾任大公国际资信评估有限公司信用分析师、

	一年期定期开放混合型证券投资基金基金经理。				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。
马文祥	本基金基金经理。	2016 年 12 月 7 日	2018 年 6 月 29 日	15 年	马文祥先生，1977 年 7 月出生。清华大学经济管理学院经济学硕士。历任中国农业银行主任科员，工银瑞信企业年金基金经理、工银瑞信信用纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金经理，2013 年 8 月加入长盛基金管理有限公司。目前已离任该职务。

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”的含义遵从行业协会《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 公平交易制度和控制方法

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度等规定，从投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格把关，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行，确保公平对待不同投资组合，包括公募基金、社保组合、特定客户资产管理组合等，切实防范利益输送，保护投资者的合法权益。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。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度等规定，从投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格把关，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行，确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送，保护投资者的合法权益。

4.3.3 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，本基金未发生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

回顾 2018 年，国内经济增速有所放缓，固定资产投资和消费增速总体呈下行趋势，进口增速放缓显示内需增长动能不足。外需方面，则受贸易摩擦影响，进出口增速波动增大。受金融去杠杆、资管新规及规范地方举债等因素影响，5 月以来社融增速出现明显下滑，宽信贷政策效果尚需等待。货币政策方面，央行实施四次定向降准，且 9 月份未跟随美联储加息，流动性合理充裕，资金面整体相对宽松。

报告期内，受经济放缓、贸易摩擦升级、融资收缩、货币政策边际放松、股市下跌等多重因素影响，债券市场走出牛市行情，各品种债券收益率均大幅下行。

报告期内，A 股市场整体呈下跌走势。一月份，市场在以银行、地产、周期为主的大盘股拉动下走出一波上涨行情，二月以来 A 股市场呈震荡下跌走势，尤其是 5 月中旬以来至年末，受中

美贸易摩擦升级、股权质押平仓等因素影响，A 股市场震荡下跌。行业上，食品饮料和休闲服务行业跌幅较小，电子、有色金属、传媒、综合等行业跌幅较大。

可转债方面，受股市大跌影响，可转债整体下跌，但受益于债底支撑及部分个券下修转股价等因素，转债跌幅小于 A 股。可转债市场规模持续扩大，受市场超预期下跌影响，一级市场出现部分个券上市破发情况，但四季度以来，随着股权质押风险缓释、中美贸易摩擦暂缓等因素，一级市场破发情况大幅减少，转债发行上市平均价格逐渐提升。

2、报告期内本基金投资策略分析

报告期内，本基金坚持稳健操作思路，在股市下跌背景下，精选正股业绩增长确定、估值水平合理、流动性高的转债，在优化底层资产结构的基础上，把握市场交易时机，择机进行波段操作。

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 0.9166 元，本报告期基金份额净值增长率为 -9.12%；截至本报告期末长盛可转债 C 基金份额净值为 0.9283 元，本报告期基金份额净值增长率为 -8.10%；同期业绩比较基准收益率为 -1.05%。

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，内外需承压、企业盈利放缓，经济仍面临下行压力；积极财政政策预计将加大力度，出台基建投资、减税降费、刺激消费等措施以托底经济；货币政策方面，将保持流动性合理充裕，预计资金利率将继续维持较低水平。

债券市场方面，经济基本面和货币政策等因素仍有利于债券市场，操作上需重视流动性充裕局面下信用债的配置机会；同时，把握经济数据不及预期、财政托底效果不及预期、中美贸易摩擦反复等因素带来的利率债的交易性机会。

股票市场方面，对经济前景的隐忧使得市场风险偏好难以显著回升，但经过前期大幅调整，目前 A 股估值已处于历史较低水平，随着稳增长、扩消费等政策效果显现和利率水平的下行，市场将出现阶段性机会和结构性机会。转债方面，受益于股票相对价值的提升和债底的支撑，转债迎来中长期配置窗口；同时，积极把握可转债一级市场的收益机会。

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并出具报告。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 367,470.48 元。

本基金截至 2018 年 12 月 31 日，期末可供分配利润为-1,295,455.33 元，其中：长盛可转债 A 期末可供分配利润为-939,388.08 元（未分配利润已实现部分为 181,581.50 元，未分配利润未实现部分为-1,120,969.58 元），长盛可转债 C 期末可供分配利润为-356,067.25 元（未分配利润已实现部分为 143,727.59 元，未分配利润未实现部分为-499,794.84 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

本基金自 2018 年 01 月 03 日至 2018 年 03 月 13 日、2018 年 04 月 10 日至 2018 年 06 月 25 日、2018 年 07 月 26 日至 2018 年 10 月 17 日、2018 年 10 月 23 日至 2018 年 12 月 31 日止期间出现连续 20 个工作日基金资产净值低于 5000 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 托管人对本年度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”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 审计报告

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）注册会计师王珊珊、马剑英 2019 年 3 月 27 日对本基金 2018 年 12 月 31 日的资产负债表、2018 年度的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注出具了安永华明（2019）审字第 60468688_A21 号标准无保留意见的审计报告。投资者欲查看审计报告全文，应阅读本年度报告正文。

§ 7 年度财务报表

7.1 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：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	1,160,576.33	557,522.71
结算备付金	7,314.64	923,479.05
存出保证金	2,219.04	2,355.58
交易性金融资产	12,677,589.56	42,941,280.77
其中：股票投资	411,750.00	-
基金投资	-	-
债券投资	12,265,839.56	42,941,280.77
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	2,900,000.00
应收证券清算款	1,177,939.19	106,246.58
应收利息	61,711.59	127,421.83
应收股利	-	-
应收申购款	7,738.82	3,020,116.43
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	15,095,089.17	50,578,422.95
负债和所有者权益	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
负 债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	3,902.07	221,735.60
应付管理人报酬	10,487.14	31,444.89
应付托管费	2,621.78	7,861.23
应付销售服务费	1,221.95	6,892.49
应付交易费用	2,614.87	3,826.03
应交税费	98.21	-

应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	134,500.55	320,095.62
负债合计	155,446.57	591,855.86
所有者权益：		
实收基金	16,235,097.93	49,036,093.76
未分配利润	-1,295,455.33	950,473.33
所有者权益合计	14,939,642.60	49,986,567.09
负债和所有者权益总计	15,095,089.17	50,578,422.95

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，长盛可转债 A 类基金份额净值人民币 0.9166 元，长盛可转债 C 类基金份额净值人民币 0.9283 元；基金份额总额 16,235,097.93 份，其中长盛可转债 A 类基金份额 11,269,677.75 份，长盛可转债 C 类基金份额 4,965,420.18 份。

7.2 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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
一、收入	1,149,398.81	2,543,733.71
1.利息收入	215,631.44	1,482,786.02
其中：存款利息收入	34,052.62	73,911.50
债券利息收入	136,864.80	299,079.54
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	44,714.02	1,109,794.98
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-860,510.19	3,095,695.46
其中：股票投资收益	-238,920.99	62,253.72
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-621,589.20	3,033,441.74
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	1,679,960.84	-2,149,858.32
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	114,316.72	115,110.55
减：二、费用	462,135.19	1,129,354.72

1. 管理人报酬	205,920.58	571,746.02
2. 托管费	51,480.24	142,936.52
3. 销售服务费	37,042.32	49,848.63
4. 交易费用	9,876.97	15,170.16
5. 利息支出	310.99	9,912.89
其中：卖出回购金融资产支出	310.99	9,912.89
6. 税金及附加	223.29	-
7. 其他费用	157,280.80	339,740.50
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	687,263.62	1,414,378.99
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	687,263.62	1,414,378.99

7.3 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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 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）	49,036,093.76	950,473.33	49,986,567.09
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	687,263.62	687,263.62
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）	-32,800,995.83	-2,565,721.80	-35,366,717.63
其中：1. 基金申购款	148,149,927.86	61,196.03	148,211,123.89
2. 基金赎回款	-180,950,923.69	-2,626,917.83	-183,577,841.52
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）	-	-367,470.48	-367,470.48
五、期末所有者权益（基金净值）	16,235,097.93	-1,295,455.33	14,939,642.60
项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		

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%。

7.4.2 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》、《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〈年度报告和半年度报告〉》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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 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。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 税项

7.4.6.1 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。

7.4.6.2 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。

7.4.6.3 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。

7.4.6.4 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。

7.4.7 关联方关系

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
新加坡星展银行有限公司	基金管理人股东
安徽省信用担保集团有限公司	基金管理人股东
安徽省投资集团控股有限公司	基金管理人股东
长盛创富资产管理有限公司	基金管理人子公司
长盛基金（香港）有限公司	基金管理人子公司

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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

注：无。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	205,920.58	571,746.02
其中：支付销售机构的客户维护费	53,314.74	273,424.59

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 0.8% 的年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.8\% / \text{当年天数}$$

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

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	51,480.24	142,936.52

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

7.4.8.2.3 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		
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 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	-	3,560.75	3,560.75
中国银行	-	638.42	638.42
国元证券	-	2.53	2.53
合计	-	4,201.70	4,201.70
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 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	-	2,124.89	2,124.89
中国银行	-	1,366.21	1,366.21
国元证券	-	-	-
合计	-	3,491.10	3,491.10

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

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 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。

7.4.8.4.2 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。

7.4.8.5 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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 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	1,160,576.33	28,930.18	557,522.71	26,367.18

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。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.9 期末（2018 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：无。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.10.1 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 11,304,999.56 元，属于第二层次的余额为人民币 1,372,590.00 元，无属于第三层次的余额（2017 年 12 月 31 日：第一层次 40,345,000.77 元，第二层次 2,596,280.00 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（2017 年：无）。

7.4.10.2 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。

7.4.10.3 其他事项

于本报告期内，本基金存在连续二十个工作日基金资产净值低于人民币 5,000 万元的情况，出现该情况的时间范围为 2018 年 1 月 3 日至 2018 年 3 月 13 日、2018 年 4 月 10 日至 2018 年 6 月 25 日、2018 年 7 月 26 日至 2018 年 10 月 17 日、2018 年 10 月 23 日至 2018 年 12 月 31 日。

7.4.10.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2019 年 3 月 27 日经本基金的基金管理人批准。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	411,750.00	2.73
	其中：股票	411,750.00	2.73
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	12,265,839.56	81.26
	其中：债券	12,265,839.56	81.26
	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	1,167,890.97	7.74
8	其他各项资产	1,249,608.64	8.28
9	合计	15,095,089.17	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	293,850.00	1.97
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	117,900.00	0.79
L	租赁和商务服务业	-	-
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	411,750.00	2.76

8.2.2 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。

8.3 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

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	000063	中兴通讯	15,000	293,850.00	1.97
2	600048	保利地产	10,000	117,900.00	0.79

注：本基金本报告期末仅持有上述二只股票。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	603019	中科曙光	385,525.00	0.77
2	600048	保利地产	357,920.00	0.72
3	000063	中兴通讯	296,550.00	0.59
4	600019	宝钢股份	254,300.00	0.51
5	601611	中国核建	195,628.00	0.39
6	600566	济川药业	183,918.00	0.37
7	002475	立讯精密	181,050.00	0.36
8	601857	中国石油	180,031.00	0.36
9	300433	蓝思科技	135,000.00	0.27
10	000852	石化机械	116,317.00	0.23
11	600498	烽火通信	109,720.00	0.22
12	601390	中国中铁	108,450.00	0.22
13	002078	太阳纸业	94,062.00	0.19
14	002353	杰瑞股份	91,476.00	0.18
15	600028	中国石化	60,100.00	0.12

8.4.2 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	603019	中科曙光	328,960.00	0.66
2	600019	宝钢股份	234,408.00	0.47
3	600048	保利地产	212,819.38	0.43
4	601611	中国核建	194,068.00	0.39
5	601857	中国石油	163,000.00	0.33
6	002475	立讯精密	149,808.00	0.30
7	600566	济川药业	144,449.06	0.29
8	300433	蓝思科技	135,042.00	0.27
9	600498	烽火通信	111,323.00	0.22
10	601390	中国中铁	107,550.00	0.22
11	002353	杰瑞股份	88,700.00	0.18
12	000852	石化机械	84,700.00	0.17
13	002078	太阳纸业	75,920.00	0.15
14	600028	中国石化	56,000.00	0.11

8.4.3 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	2,750,047.00
卖出股票收入（成交）总额	2,086,747.44

注：本项中 8.4.1、8.4.2、8.4.3 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。

8.5 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	418,410.00	2.80
2	央行票据	-	-
3	金融债券	954,180.00	6.39
	其中：政策性金融债	954,180.00	6.39
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）	10,893,249.56	72.92
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	12,265,839.56	82.10

8.6 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	113011	光大转债	13,560	1,425,427.20	9.54
2	110032	三一转债	11,820	1,409,180.40	9.43
3	128027	崇达转债	9,780	1,028,758.20	6.89
4	128024	宁行转债	9,567	1,013,910.66	6.79
5	113018	常熟转债	9,240	1,008,730.80	6.75

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**8.10.1 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。

8.10.2 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。

8.10.3 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。

8.11 投资组合报告附注**8.11.1****（一）中兴通讯**

根据中兴通讯公告，美国商务部工业与安全局（BIS）于美国时间6月8日通过《关于中兴通讯的替代命令》，批准《替代的和解协议》立即生效。根据协议，中兴通讯将支付合计14亿美元民事罚款，包括在6月8日后60日内一次性支付10亿美元，以及在6月8日后90日内支付至由中兴通讯选择、经BIS批准的美国银行托管账户并在为期十年的监察期内暂缓执行的额外4亿美元罚款。监察期内，若中兴通讯遵守协议约定的监察条件和2018年6月8日命令，监察期届满后4亿美元罚款将被豁免支付。在中兴通讯支付罚款后，BIS于7月13日终止了其于4月15日激活

的拒绝令，将中兴通讯及中兴康讯从《禁止出口人员清单》移除。

中兴通讯是全球四大通信设备商之一，具备全球竞争力，未来将受益于 5G 大规模建设。基于相关研究，本基金判断，公司从禁止出口名单移除后，公司经营已逐步恢复正常。今后，我们将继续加强与该公司的沟通，密切关注其业务合规性以及企业的经营状况。

（二）常熟转债

根据苏州银监局于 2018 年 1 月 15 日发布的苏州银监罚决字（2017）11 号行政处罚决定书显示，江苏常熟农村商业银行股份有限公司通过交易所转标和借通道等方式，规避非标准化债权资产业务监管指标要求，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第（五）项，被处以罚款人民币四十万元。对以上事件，本基金判断，上述处罚对公司影响小。后续将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）光大转债

根据许银罚字【2018】5 号，中国光大银行股份有限公司（以下简称“光大银行”）因涉及信息披露虚假或严重误导性陈述，被中国人民银行许昌市中心支行警告并罚款 4 万元。根据银保监银罚决字（2018）10 号，光大银行因内控管理严重违反审慎经营规则、以误导方式违规销售理财产品以及以修改理财合同文本或误导方式违规销售理财产品等行为被银保监会没收违法所得 100 万元，罚款 1020 万元，合计 1120 万元。光大银行作为浙江古纤道新材料股份有限公司（以下简称“古纤道”）债务融资工具主承销商，在债务融资工具承销及后续管理工作中存在违反银行间市场相关自律规则指引的行为，依据相关自律规定，经 2018 年第 6 次自律处分会议审议，中国银行间交易商协会给予光大银行诫勉谈话处分，责令其针对本次事件中暴露出的问题进行全面深入的整改。对以上事件，本基金判断，上述处罚对公司影响小。后续将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）宁行转债

根据宁波银监局 2018 年 6 月 7 日的行政处罚信息公开表，公司因以不正当手段违规吸收存款，被宁波银监局罚款人民币六十万元；根据宁波银监局 2018 年 12 月 13 日的行政处罚信息公开表，公司因个人贷款资金违规流入房市、购买理财，被宁波银监局罚款二十万元。对以上事件，本基金判断，宁波银行作为一家在宁波及长三角地区较为有影响力的上市银行，上述处罚对公司影响小。后续将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。

8.11.2

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股票。

8.11.3 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	2,219.04
2	应收证券清算款	1,177,939.19
3	应收股利	-
4	应收利息	61,711.59
5	应收申购款	7,738.82
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,249,608.64

8.11.4 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	113011	光大转债	1,425,427.20	9.54
2	110032	三一转债	1,409,180.40	9.43
3	128027	崇达转债	1,028,758.20	6.89
4	128024	宁行转债	1,013,910.66	6.79
5	113018	常熟转债	1,008,730.80	6.75
6	110033	国贸转债	948,202.20	6.35
7	113508	新风转债	737,964.40	4.94
8	123006	东财转债	695,940.00	4.66
9	113019	玲珑转债	497,500.00	3.33
10	127005	长证转债	472,176.00	3.16
11	110034	九州转债	202,480.00	1.36
12	113014	林洋转债	174,671.20	1.17
13	110041	蒙电转债	50,653.20	0.34

8.11.5 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。

8.11.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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	1,777	6,341.97	0.00	0.00%	11,269,677.75	100.00%
长盛 可转 债 C	347	14,309.57	0.00	0.00%	4,965,420.18	100.00%
合计	2,124	7,643.64	0.00	0.00%	16,235,097.93	100.00%

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。

9.2 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	0.00	0.0000%
	长盛可转债 C	0.00	0.0000%
	合计	0.00	0.0000%

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。

9.3 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 投资和研究部门负责人持 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

§ 10 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	17,700,837.28	31,335,256.48
本报告期期间基金总申购份额	3,350,730.60	144,799,197.26
减:本报告期期间基金总赎回份额	9,781,890.13	171,169,033.56
本报告期期末基金份额总额	11,269,677.75	4,965,420.18

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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

11.2.1 本基金管理人的高级管理人员重大人事变动情况

原督察长叶金松先生因退休离任，由张利宁女士担任本公司督察长。

上述变更事项已经公司第七届董事会第七次会议审议通过，并按规定向相关监管机构备案。

2018 年 4 月 27 日，中国证券监督管理委员会北京监管局作出《关于对长盛基金管理有限公司拟任合规负责人任职资格的意见》（京证监发〔2018〕136 号），对张利宁女士担任本公司督察长无异议。

11.2.2 基金经理的变动情况

报经中国证券投资基金业协会同意，自 2018 年 6 月 11 日起，杨哲同志担任长盛可转债债券型证券投资基金基金经理。自 2018 年 6 月 29 日起，李琪同志担任长盛可转债债券型证券投资基金基金经理。自 2018 年 6 月 29 日起，马文祥同志不再担任长盛可转债债券型证券投资基金基金经理。

11.2.3 本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动情况

报告期内，2018 年 8 月，刘连舸先生担任中国银行股份有限公司行长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 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，报告期内共支付安永华明会计师事务所审计费用 50,000.00 元。该审计机构已提供审计服务的连续年限为 2 年。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
银河证券	1	3,388,169.44	70.05%	3,155.52	70.05%	-
光大证券	1	1,313,625.00	27.16%	1,223.40	27.16%	-
安信证券	1	135,000.00	2.79%	125.73	2.79%	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-

11.7.2 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
银河证券	81,277,212.62	39.43%	160,700,000.00	61.50%	-	-
光大证券	43,340,171.53	21.03%	1,800,000.00	0.69%	-	-
安信证券	23,422,996.90	11.36%	3,900,000.00	1.49%	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	58,067,040.59	28.17%	94,900,000.00	36.32%	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-

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) 资力雄厚，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：

序号	证券公司名称	交易单元所属市场	数量
1	国信证券	上海	1
2	国信证券	深圳	1

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	20181025~20181025	0.00	14,160,490.06	14,160,490.06	0.00	0.00%
	2	20180314~20180315	0.00	20,954,376.61	20,954,376.61	0.00	0.00%
	3	20180330~20180409	0.00	19,362,958.66	19,362,958.66	0.00	0.00%
	4	20180726~20180801	0.00	10,257,462.30	10,257,462.30	0.00	0.00%
个人	1	20180802~20180807	2,953,628.04	6,949,270.33	9,902,898.37	0.00	0.00%
	2	20181018~20181024、 20181026~20181028	0.00	18,791,105.54	18,791,105.54	0.00	0.00%
	3	20181016~20181017	0.00	9,573,361.08	9,573,361.08	0.00	0.00%
产品特有风险							
<p>本基金本报告期存在单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况，当该基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致的风险包括：巨额赎回风险、流动性风险、基金资产净值持续低于 5000 万元的基金资产净值大幅波动风险以及基金收益水平波动风险。本基金管理人将对申购赎回进行审慎的应对，保护中小投资者利益。</p>							

12.2 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。

长盛基金管理有限公司

2019 年 3 月 29 日