

长盛可转债债券型证券投资基金 2019 年半年度报告 摘要

2019 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：2019 年 8 月 27 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。本半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 8 月 26 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 01 月 01 日起至 06 月 30 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	
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	37,895,188.97 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	18,617,110.29 份	19,278,078.68 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

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

§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(2019年1月1日 - 2019年6月30日)	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	386,331.41	499,610.62
本期利润	1,459,149.57	266,282.71
加权平均基金份额本期利润	0.1133	0.0157
本期基金份额净值增长率	16.07%	16.34%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)	
期末可供分配基金份额利润	0.0454	0.0608
期末基金资产净值	19,806,212.54	20,820,667.53
期末基金份额净值	1.0639	1.0800

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	1.25%	0.80%	1.46%	0.50%	-0.21%	0.30%
过去三个月	-3.25%	1.14%	-2.01%	0.61%	-1.24%	0.53%
过去六个月	16.07%	1.17%	11.23%	0.68%	4.84%	0.49%
过去一年	10.02%	0.90%	11.62%	0.56%	-1.60%	0.34%
自基金合同生效起至今	7.42%	0.66%	9.75%	0.49%	-2.33%	0.17%

长盛可转债 C

阶段	份额净值增	份额净值	业绩比较	业绩比较基准	①-③	②-④
----	-------	------	------	--------	-----	-----

	长率①	增长率标准差②	基准收益率③	收益率标准差④		
过去一个月	1.22%	0.80%	1.46%	0.50%	-0.24%	0.30%
过去三个月	-3.23%	1.14%	-2.01%	0.61%	-1.22%	0.53%
过去六个月	16.34%	1.17%	11.23%	0.68%	5.11%	0.49%
过去一年	10.59%	0.89%	11.62%	0.56%	-1.03%	0.33%
自基金合同生效起至今	9.04%	0.66%	9.75%	0.49%	-0.71%	0.17%

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。

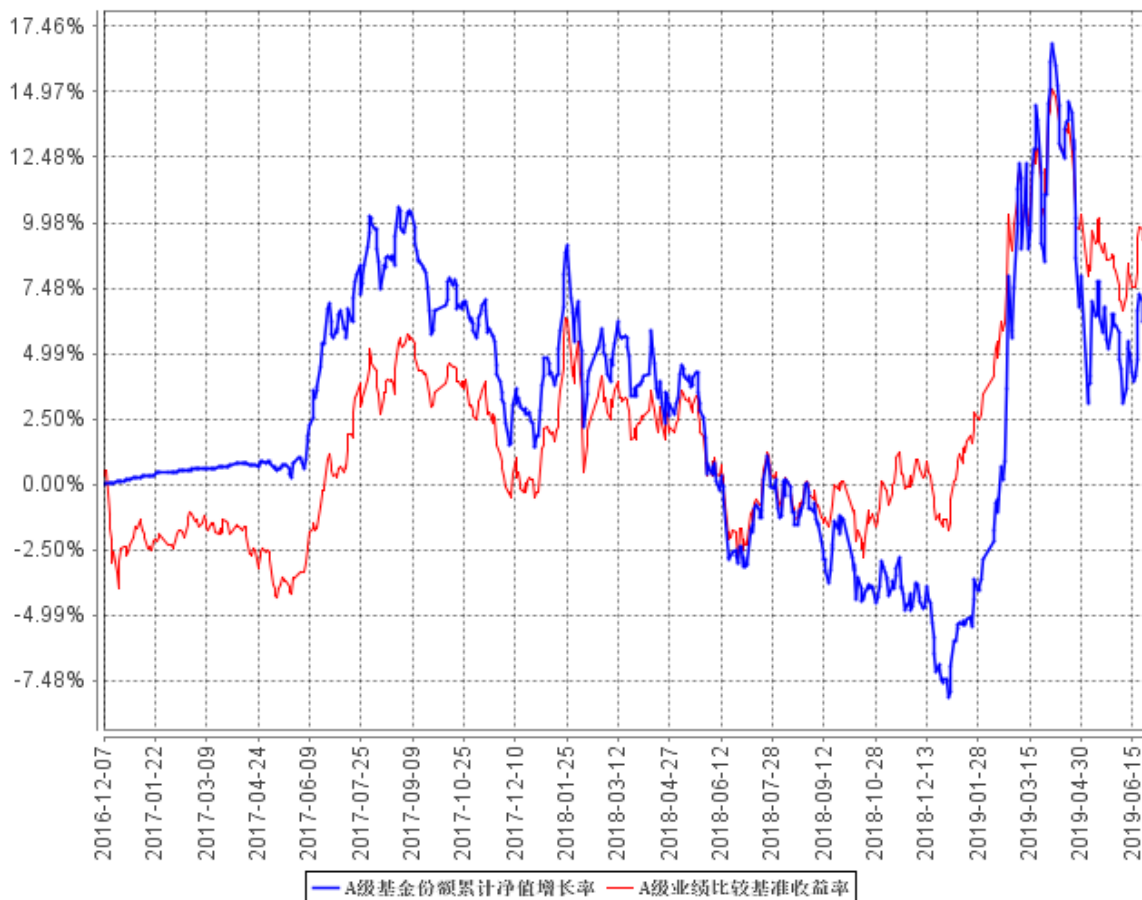
中证综合债券指数是综合反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央票及短融整体走势的跨市场债券指数，其选样是在中证全债指数样本的基础上，增加了央行票据、短期融资券以及一年期以下的国债、金融债和企业债，更全面地反映我国债券市场的整体价格变动趋势，为债券投资者提供更切合的市场基准。

沪深 300 指数是由上海和深圳证券交易所中选取 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。

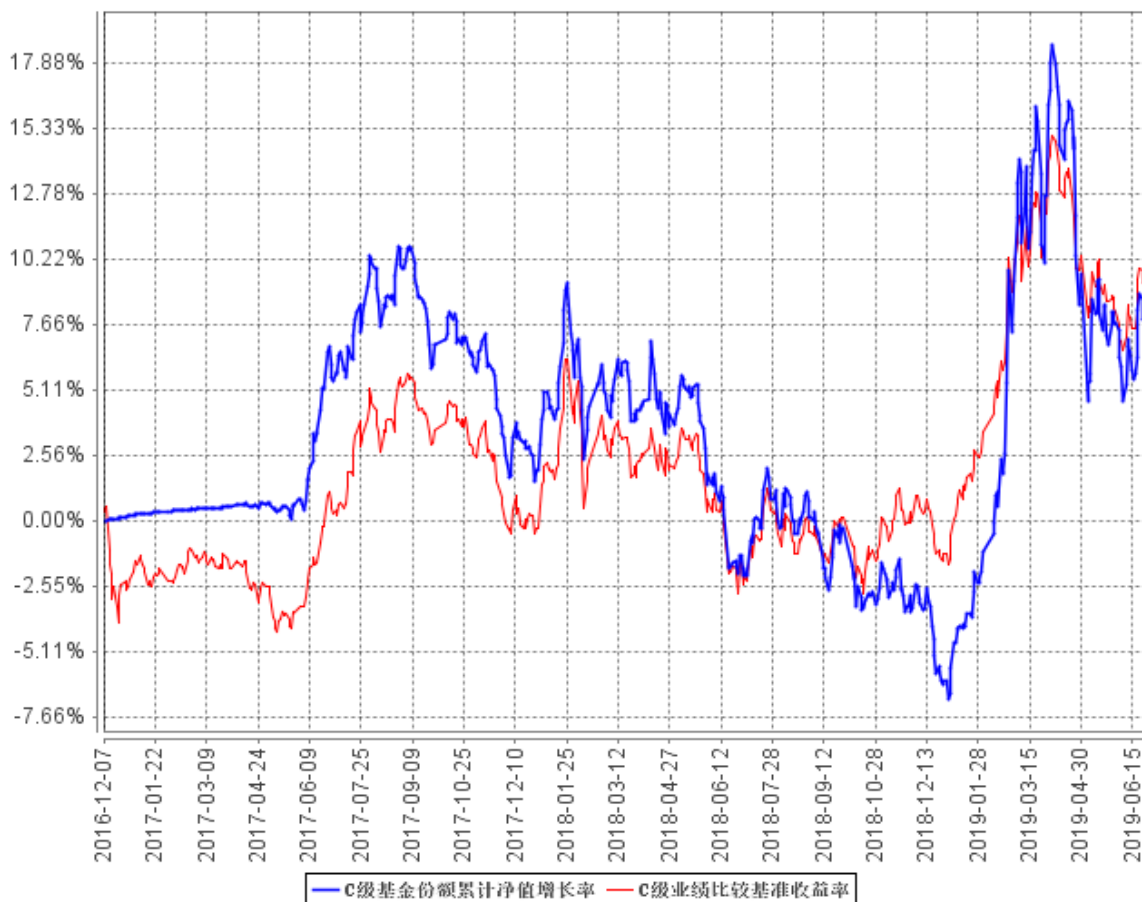
由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照 60%、30%、10%的比例采取再平衡，再用连锁计算的方式得到基准指数的时间序列。

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。

§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址位于北京，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、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 2019 年 6 月 30 日，基金管理人共管理五十七只开放式基金，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，长盛信息安全量化策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2018 年 6 月 29 日	-	11 年	李琪先生，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，长盛盛杰一年	2018 年 6 月 11 日	-	9 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。

	期定期开放混合型证券投资基金基金经理。			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遵规守信情况的说明

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、特定客户资产管理组合等。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，未发生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

回顾上半年，宏观经济仍面临下行压力，一季度经济增长动能有所改善，但二季度经济再次显现疲弱态势，五月和六月制造业 PMI 连续低于荣枯线，制造业投资增速和工业增加值累计增速同比均有所下滑。货币政策方面，央行两次宣布实施定向降准，并通过逆回购和 MLF 释放资金，市场流动性总体充裕，资金面较宽松。

报告期内，债券市场利率呈现先上行后下行的震荡走势。年初至 4 月中上旬，受经济动能持续改善、股市快速上涨等因素影响，债券收益率快速上行；4 月下旬以来，受经济托底政策放缓、经济数据走弱、中美贸易摩擦升级、股市调整以及央行释放流动性等多重因素影响，各期限债券收益率均呈现波动下行走势。

权益市场方面，年初至四月中旬，受中美贸易谈判向好预期、经济增长动能边际改善等因素影响，市场风险偏好显著回升，A 股呈现快速上涨走势；四月中旬以来，受中美贸易摩擦反复、经济数据走弱、托底政策放缓等多因素影响，A 股整体呈现震荡调整走势。从申万一级行业看，各行业均实现上涨，其中食品饮料、非银金融、农林牧渔、家电、计算机等行业涨幅较大，汽车、纺织、传媒、钢铁、建筑涨幅较小。

可转债方面，年初至四月中旬，可转债个券跟随股市快速上涨，成交量和活跃度大幅提升，偏股型转债转股溢价率水平有所抬升；四月中旬以来，随着股市震荡调整，转债整体有所调整。可转债一级市场，发行大幅加速，二级市场规模持续扩容，投资者积极参与新券发行申购。

2、报告期内本基金投资策略分析

在经济增长动能偏弱、资金面相对宽松、中美贸易谈判不确定局面下，灵活调整可转债和股票资产仓位，把握阶段性机会和结构性机会，减持了部分前期涨幅过高的个券，并精选配置盈利增长确定性高、估值水平合理的转债和个股；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 1.0639 元，本报告期基金份额净值增长率为

16.07%；截至本报告期末长盛可转债 C 基金份额净值为 1.0800 元，本报告期基金份额净值增长率为 16.34%；同期业绩比较基准收益率为 11.23%。

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，经济仍处在震荡寻底过程；积极财政政策预计将加力增效，减税降费、刺激消费、基建投资等措施有望托底经济，并有利于企业盈利的改善；货币政策方面，预计保持流动性合理充裕，资金利率将继续维持较低水平。

债券市场方面，宏观经济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、基建托底效果不及预期、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，在经济内生增长动力较弱和中美摩擦不确定性局面下，市场风险偏好难以大幅回升，但经过前期调整，目前 A 股估值已具备一定安全边际，随着减税降费、稳增长、扩消费等政策效果显现和利率水平的下行，市场或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整体价格水平较低的支撑，可转债正处于中长期较好的配置时期；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，本报告期内未实施利润分配。

本基金截至 2019 年 6 月 30 日，期末可供分配利润为 2,015,843.26 元，其中：长盛可转债 A 期末可供分配利润为 844,637.20 元（长盛可转债 A 的未分配利润已实现部分为 844,637.20 元，未分配利润未实现部分为 344,465.05 元），长盛可转债 C 期末可供分配利润为 1,171,206.06 元（长盛可转债 C 的未分配利润已实现部分为 1,171,206.06 元，未分配利润未实现部分为 371,382.79 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 10 月 23 日至 2019 年 01 月 10 日、2019 年 01 月 18 日至 2019 年 04 月 10 日、2019 年 04 月 18 日至 2019 年 06 月 30 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 托管人对本半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 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：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	4,012,031.07	1,160,576.33
结算备付金	169,569.09	7,314.64
存出保证金	14,187.24	2,219.04
交易性金融资产	39,811,989.46	12,677,589.56
其中：股票投资	5,067,599.00	411,750.00
基金投资	-	-
债券投资	34,744,390.46	12,265,839.56
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	-	-
应收证券清算款	-	1,177,939.19
应收利息	91,589.34	61,711.59
应收股利	-	-
应收申购款	52,460.67	7,738.82
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	44,151,826.87	15,095,089.17
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2019 年 6 月 30 日	2018 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	3,100,000.00	-
应付证券清算款	66,245.41	-
应付赎回款	262,668.88	3,902.07
应付管理人报酬	25,383.25	10,487.14
应付托管费	6,345.81	2,621.78
应付销售服务费	5,819.86	1,221.95
应付交易费用	27,753.97	2,614.87
应交税费	262.27	98.21

应付利息	1,133.85	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	29,333.50	134,500.55
负债合计	3,524,946.80	155,446.57
所有者权益：		
实收基金	37,895,188.97	16,235,097.93
未分配利润	2,731,691.10	-1,295,455.33
所有者权益合计	40,626,880.07	14,939,642.60
负债和所有者权益总计	44,151,826.87	15,095,089.17

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，长盛可转债 A 类基金份额净值人民币 1.0639 元，长盛可转债 C 类基金份额净值人民币 1.0800 元；基金份额总额 37,895,188.97 份，其中长盛可转债 A 类基金份额 18,617,110.29 份，长盛可转债 C 类基金份额 19,278,078.68 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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入	2,065,118.00	851,957.65
1.利息收入	106,326.31	130,013.63
其中：存款利息收入	17,722.86	13,262.88
债券利息收入	86,651.65	72,036.73
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	1,951.80	44,714.02
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	994,529.12	-139,147.11
其中：股票投资收益	279,296.80	42.00
基金投资收益	-	-
债券投资收益	691,591.21	-139,189.11
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	23,641.11	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	839,490.25	795,570.68
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	124,772.32	65,520.45
减：二、费用	339,685.72	235,133.24

1. 管理人报酬	123,236.72	108,012.82
2. 托管费	30,809.15	27,003.23
3. 销售服务费	26,361.88	17,322.32
4. 交易费用	84,868.61	1,954.32
5. 利息支出	37,198.41	304.28
其中：卖出回购金融资产支出	37,198.41	304.28
6. 税金及附加	158.28	124.24
7. 其他费用	37,052.67	80,412.03
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	1,725,432.28	616,824.41
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	1,725,432.28	616,824.41

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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 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）	16,235,097.93	-1,295,455.33	14,939,642.60
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,725,432.28	1,725,432.28
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）	21,660,091.04	2,301,714.15	23,961,805.19
其中：1. 基金申购款	121,172,585.07	6,639,004.65	127,811,589.72
2. 基金赎回款	-99,512,494.03	-4,337,290.50	-103,849,784.53
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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	37,895,188.97	2,731,691.10	40,626,880.07

项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 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)	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)	-	616,824.41	616,824.41
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)	4,634,248.84	-2,584,638.75	2,049,610.09
其中：1.基金申购款	97,543,487.25	1,660,382.94	99,203,870.19
2.基金赎回款	-92,909,238.41	-4,245,021.69	-97,154,260.10
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)	53,670,342.60	-1,384,811.49	52,285,531.11

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：

林培富	刁俊东	龚珉
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》、《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。

6.4.3 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 2019 年 6 月 30 日的财

务状况以及 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

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 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

注：无。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	123,236.72	108,012.82
其中：支付销售机构的客户维护费	35,057.98	31,242.98

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日基金资产净值的 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

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	30,809.15	27,003.23

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

6.4.8.2.3 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		
	2019 年 1 月 1 日至 2019 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	-	4,839.14	4,839.14
中国银行	-	778.63	778.63
国元证券	-	168.50	168.50
合计	-	5,786.27	5,786.27
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2018 年 1 月 1 日至 2018 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	-	2,964.42	2,964.42
中国银行	-	295.96	295.96
国元证券	-	-	-
合计	-	3,260.38	3,260.38

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

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 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。

6.4.8.4.2 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。

6.4.8.5 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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 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	4,012,031.07	14,064.85	29,154,368.82	8,637.78

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。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9 期末（2019 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：无。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止，本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为人民币 3,100,000.00 元，于 2019 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和在新质押式回购下转入质押库的债券，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。

6.4.10 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 37,498,089.46 元，属于第二层次的余额为人民币 2,313,900.00 元，无属于第三层次的余额（2018 年 12 月 31 日：第一层次 11,304,999.56 元，第二层次 1,372,590.00 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）。

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

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 10 月 23 日至 2019 年 01 月 10 日、2019 年 01 月 18 日至 2019 年 04 月 10 日、2019 年 04 月 18 日至 2019 年 06 月 30 日。

6.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2019 年 8 月 26 日经本基金的基金管理人批准。

§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	5,067,599.00	11.48
	其中：股票	5,067,599.00	11.48
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	34,744,390.46	78.69
	其中：债券	34,744,390.46	78.69
	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	4,181,600.16	9.47
8	其他各项资产	158,237.25	0.36
9	合计	44,151,826.87	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	2,154,880.00	5.30
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,785,690.00	4.40
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	204,200.00	0.50
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	919,250.00	2.26
K	房地产业	3,579.00	0.01
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	5,067,599.00	12.47

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	300498	温氏股份	35,500	1,273,030.00	3.13
2	000063	中兴通讯	30,000	975,900.00	2.40
3	002714	牧原股份	15,000	881,850.00	2.17
4	600030	中信证券	20,000	476,200.00	1.17
5	601318	中国平安	5,000	443,050.00	1.09
6	000876	新希望	17,000	295,290.00	0.73
7	600498	烽火通信	10,000	278,600.00	0.69
8	000858	五粮液	2,000	235,900.00	0.58
9	601933	永辉超市	20,000	204,200.00	0.50
10	600383	金地集团	300	3,579.00	0.01

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	300498	温氏股份	3,233,953.00	21.65
2	002714	牧原股份	2,591,121.00	17.34
3	000063	中兴通讯	2,571,773.29	17.21
4	601128	常熟银行	2,210,975.24	14.80
5	002157	正邦科技	1,825,822.00	12.22
6	300059	东方财富	1,772,932.45	11.87
7	002100	天康生物	1,615,799.78	10.82
8	600031	三一重工	1,241,491.62	8.31
9	600383	金地集团	1,052,367.00	7.04
10	000001	平安银行	1,036,336.00	6.94
11	000651	格力电器	845,974.00	5.66

12	600498	烽火通信	798,890.00	5.35
13	000876	新希望	722,278.00	4.83
14	001979	招商蛇口	683,864.00	4.58
15	603019	中科曙光	636,385.00	4.26
16	603517	绝味食品	634,979.00	4.25
17	600104	上汽集团	627,522.00	4.20
18	600197	伊力特	524,416.00	3.51
19	002916	深南电路	519,225.00	3.48
20	600919	江苏银行	516,868.00	3.46
21	600585	海螺水泥	510,930.00	3.42
22	002597	金禾实业	453,125.00	3.03
23	600030	中信证券	445,361.00	2.98
24	002727	一心堂	425,473.00	2.85
25	601318	中国平安	422,100.00	2.83
26	601336	新华保险	408,079.00	2.73
27	000802	北京文化	349,434.00	2.34
28	002304	洋河股份	336,954.00	2.26
29	601328	交通银行	322,300.00	2.16

7.4.2 累计卖出金额超初期基金资产净值 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	601128	常熟银行	2,254,184.06	15.09
2	300498	温氏股份	2,141,784.00	14.34
3	000063	中兴通讯	2,098,450.00	14.05
4	002157	正邦科技	1,941,464.00	13.00
5	300059	东方财富	1,711,640.10	11.46
6	002714	牧原股份	1,703,178.00	11.40
7	002100	天康生物	1,516,547.01	10.15
8	600031	三一重工	1,313,765.14	8.79
9	000001	平安银行	1,042,563.35	6.98
10	600383	金地集团	1,035,103.00	6.93
11	000651	格力电器	831,410.00	5.57
12	001979	招商蛇口	666,062.00	4.46
13	603517	绝味食品	654,148.00	4.38
14	600104	上汽集团	647,700.00	4.34

15	603019	中科曙光	592,064.75	3.96
16	600197	伊力特	561,669.00	3.76
17	002916	深南电路	537,764.00	3.60
18	600585	海螺水泥	528,150.00	3.54
19	600498	烽火通信	515,963.00	3.45
20	600919	江苏银行	503,100.00	3.37
21	601336	新华保险	408,750.00	2.74
22	002597	金禾实业	401,797.00	2.69
23	002727	一心堂	392,475.00	2.63
24	000876	新希望	382,050.00	2.56
25	000802	北京文化	346,416.00	2.32
26	601328	交通银行	321,800.00	2.15
27	002304	洋河股份	321,012.00	2.15

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	32,422,148.58
卖出股票收入（成交）总额	28,091,496.41

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	900,180.00	2.22
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,413,720.00	3.48
	其中：政策性金融债	1,413,720.00	3.48
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）	32,430,490.46	79.83
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	34,744,390.46	85.52

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	127005	长证转债	27,190	3,153,496.20	7.76
2	110053	苏银转债	27,000	2,879,550.00	7.09
3	110033	国贸转债	24,460	2,726,067.00	6.71
4	113519	长久转债	16,530	1,782,099.30	4.39
5	128058	拓邦转债	14,035	1,578,376.10	3.89

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

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）长证转债

2019年6月，湖北省证监局在日常监管中发现，公司在对境外子公司管理方面存在以下问题：一是未按规定履行报告义务；二是对境外子公司管控不到位，未有效督促境外子公司强化风险管理及审慎开展业务；三是对境外子公司的绩效考核存在不足。依照《证券公司监督管理条例》第七十条第一款规定，决定对公司采取责令改正的行政监管措施，公司应于2019年9月30日前予以改正，并向湖北省证监局提交书面整改报告。后续本基金将密切关注公司风险管理、内部控制以及企业的经营状况。

（二）苏银转债

2019年1月25日，苏银保监罚决字〔2019〕11号行政处罚信息公开表显示，公司因未按业务实质准确计量风险资产、理财产品之间未能实现相分离、理财投资非标资产未严格比照自营

贷款管理、对授信资金未按约定用途使用监督不力等事项被处以罚款 90 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。

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	14,187.24
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	91,589.34
5	应收申购款	52,460.67
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	158,237.25

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	127005	长证转债	3,153,496.20	7.76
2	110033	国贸转债	2,726,067.00	6.71
3	113519	长久转债	1,782,099.30	4.39
4	110040	生益转债	1,469,981.50	3.62
5	113508	新风转债	1,265,925.40	3.12
6	110041	蒙电转债	1,231,485.00	3.03
7	113009	广汽转债	1,170,400.00	2.88
8	110046	圆通转债	953,615.20	2.35
9	113019	玲珑转债	755,733.20	1.86
10	128024	宁行转债	745,421.30	1.83
11	127008	特发转债	601,931.20	1.48
12	110049	海尔转债	481,280.00	1.18
13	113013	国君转债	452,960.00	1.11
14	128044	岭南转债	412,029.50	1.01

15	110042	航电转债	363,053.90	0.89
16	128030	天康转债	350,877.10	0.86
17	128027	崇达转债	346,770.00	0.85
18	128045	机电转债	164,640.00	0.41
19	113525	台华转债	106,530.00	0.26
20	128016	雨虹转债	21,603.00	0.05

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	1,612	11,549.08	5,646,568.05	30.33%	12,970,542.24	69.67%
长盛可转债 C	1,272	15,155.72	4,700,131.60	24.38%	14,577,947.08	75.62%
合计	2,884	13,139.80	10,346,699.65	27.30%	27,548,489.32	72.70%

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	106.52	0.0006%
	长盛可转债 C	4,129.27	0.0214%
	合计	4,235.79	0.0112%

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

§ 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	11,269,677.75	4,965,420.18
本报告期期间基金总申购份额	19,070,750.93	102,101,834.14
减：本报告期期间基金总赎回份额	11,723,318.39	87,789,175.64
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	18,617,110.29	19,278,078.68

§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

根据公司 2019 年第一次临时股东大会决议，同意钱力不再担任公司第七届董事会董事，选举严琛担任公司第七届董事会董事。以上董事人员变更，已向中国证监会北京监管局报备。

因个人原因，杨思乐向公司申请辞去副总经理职务，根据公司第七届董事会第十二次会议决议，杨思乐不再担任公司副总经理职务。以上公司高级管理人员变更，已向中国证监会北京监管局报备。

根据公司第七届董事会第十三次会议决议，聘任张壬午担任首席信息官。以上公司高级管理人员变更，已向中国证监会北京监管局报备。

10.2.2 基金经理变动情况

本报告期本基金经理未曾变动。

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

2019 年 5 月，陈四清先生因工作调动，辞去中国银行股份有限公司董事长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

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

报告期内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	37,170,368.98	61.42%	32,171.61	63.67%	-
银河证券	1	20,960,882.01	34.64%	16,305.71	32.27%	-
国金证券	1	1,544,622.00	2.55%	1,438.54	2.85%	-
天风证券	1	837,772.00	1.38%	612.69	1.21%	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	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	36,380,075.84	42.11%	41,749,000.00	24.21%	-	-
银河证券	40,646,208.66	47.05%	102,700,000.00	59.55%	-	-
国金证券	7,620,096.90	8.82%	23,400,000.00	13.57%	-	-
天风证券	1,743,791.50	2.02%	4,600,000.00	2.67%	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
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情况：

序号	证券公司名称	交易单元所属市场	数量
1	天风证券	上海	1

(2) 本基金报告期内停止租用交易单元情况：无。

§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

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	20190111~20190117	0.00	21,074,815.60	21,074,815.60	0.00	0.00%
个人	1	20190118~20190121	0.00	6,322,444.68	6,322,444.68	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 万元的风险、基金份额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>							

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。

长盛基金管理有限公司

2019 年 8 月 27 日