

长盛可转债债券型证券投资基金

2024 年第 3 季度报告

2024 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：2024 年 10 月 25 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 10 月 24 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 07 月 01 日起至 09 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	123,330,238.97 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	65,839,688.47 份	57,490,550.50 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 7 月 1 日-2024 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	-2,567,158.86	-2,619,985.42
2. 本期利润	437,589.32	-680,239.66
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0078	-0.0117
4. 期末基金资产净值	60,162,293.07	52,292,143.42
5. 期末基金份额净值	0.9138	0.9096

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 09 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

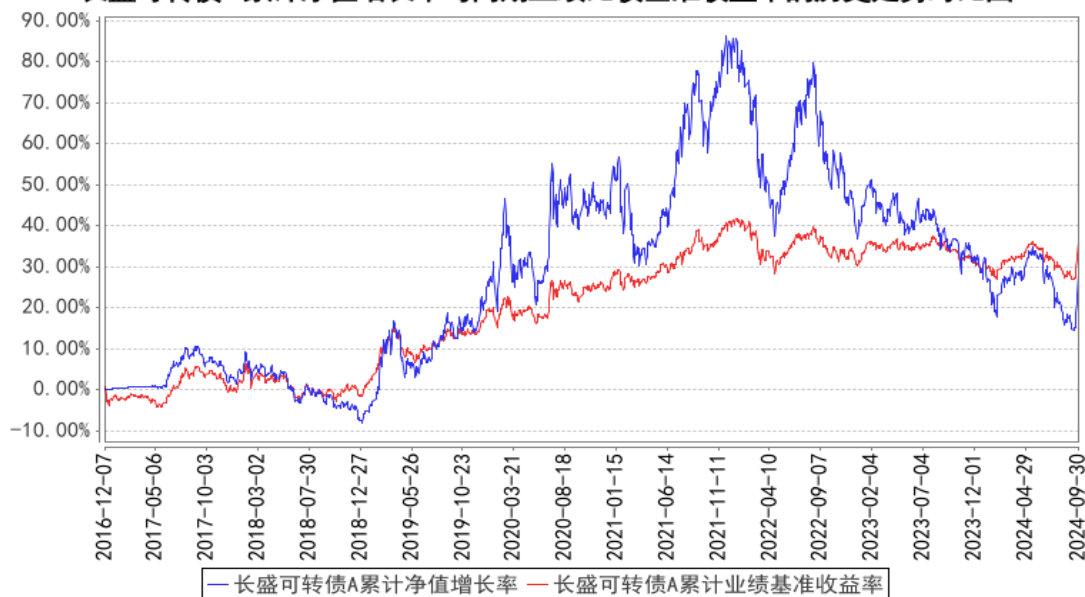
				④		
过去三个月	-1.11%	1.02%	2.28%	0.54%	-3.39%	0.48%
过去六个月	0.31%	0.88%	3.07%	0.44%	-2.76%	0.44%
过去一年	-6.52%	0.86%	1.23%	0.40%	-7.75%	0.46%
过去三年	-22.66%	1.07%	0.56%	0.41%	-23.22%	0.66%
过去五年	13.63%	1.20%	20.70%	0.44%	-7.07%	0.76%
自基金合同 生效起至今	27.74%	1.04%	35.88%	0.46%	-8.14%	0.58%

长盛可转债 C

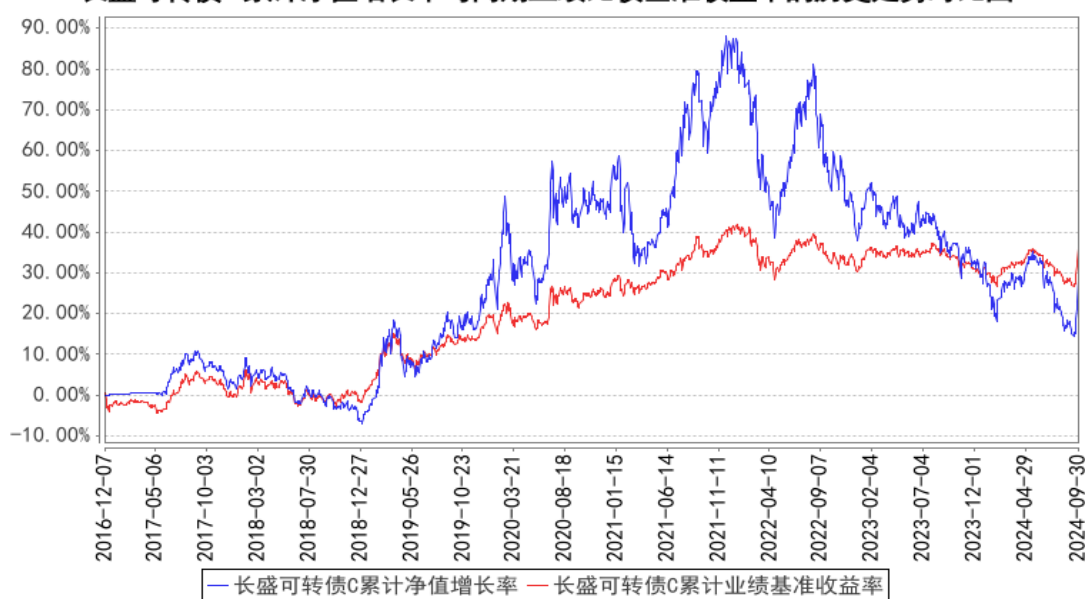
阶段	净值增长率①	净值增长率标准 差②	业绩比较基准 收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	-1.19%	1.02%	2.28%	0.54%	-3.47%	0.48%
过去六个月	0.15%	0.88%	3.07%	0.44%	-2.92%	0.44%
过去一年	-6.80%	0.86%	1.23%	0.40%	-8.03%	0.46%
过去三年	-23.35%	1.07%	0.56%	0.41%	-23.91%	0.66%
过去五年	11.98%	1.20%	20.70%	0.44%	-8.72%	0.76%
自基金合同 生效起至今	27.92%	1.04%	35.88%	0.46%	-7.96%	0.58%

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。
历剑	本基金基金经理，长盛盛逸 9 个月持有期债券型证券投资基金基金经理。	2024 年 9 月 20 日	-	10 年	历剑先生，硕士，特许金融分析师 CFA。曾任联合资信评估股份有限公司分析师、高级分析师、信用评级委员会委员。2018 年 11 月加入长盛基金管理有限公司，历任信用研究员、基金经理助理。

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，但内需增长有所放缓，房地产和投资增速均延续下行态势。物价方面，CPI 总体平稳，受大宗商品价格下跌影响，PPI 降幅或进一步走阔。货币政策方面，央行实施了降息、降准、降低存量房贷利率等政策，并创设了互换便利和股票回购贷款等工具支持资本市场；9 月末政治局会议也强调将采取措施支持房地产市场止跌企稳。

报告期内，债券市场呈现先涨后跌的走势。7 月至 9 月中旬，受内需疲弱、债券配置需求旺盛等因素影响，债券收益率延续下行；但 9 月下旬，央行创设新工具支持资本市场，叠加政治局会议关于促使房地产止跌企稳的表述大超市场预期，后续一揽子支持经济政策或陆续推出，债券收益率出现快速上行。

报告期内，A 股市场先跌后涨。9 月末，央行货币政策和政治局会议关于支持房地产企稳的表态大超预期，股市风险偏好大幅提升，股指出现快速上涨。从申万一级行业指数看，所有行业指数均为上涨，其中非银、房地产、商贸、社服、计算机等行业涨幅较大，银行、农业、公用、石

油、煤炭等行业涨幅较小。

可转债方面，转债市场整体跟随股市先跌后涨。7 月至 9 月中旬，受内需偏弱、个券评级下调、违约事件冲击等因素影响，可转债市场整体下跌，绝对价格、转股溢价率均达到近年低位；9 月下旬，受政策超预期影响，跟随正股快速反弹。

2、报告期内本基金投资策略分析

报告期内，在经济动能放缓局面下，结合逆周期调节政策，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 0.9138 元，本报告期基金份额净值增长率为 -1.11%，同期业绩比较基准收益率为 2.28%；截至本报告期末长盛可转债 C 的基金份额净值为 0.9096 元，本报告期基金份额净值增长率为 -1.19%，同期业绩比较基准收益率为 2.28%。

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	7,941,697.80	5.93
	其中：股票	7,941,697.80	5.93
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	123,020,145.32	91.85
	其中：债券	123,020,145.32	91.85
	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	1,285,484.58	0.96
8	其他资产	1,684,993.47	1.26
9	合计	133,932,321.17	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	621,976.00	0.55
C	制造业	3,435,371.80	3.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	278,750.00	0.25
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,074,900.00	1.85
J	金融业	1,530,700.00	1.36
K	房地产业	-	-
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	7,941,697.80	7.06

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	31,000	993,550.00	0.88
2	300033	同花顺	5,000	966,550.00	0.86
3	000333	美的集团	9,000	684,540.00	0.61
4	600941	中国移动	6,000	658,200.00	0.59
5	600036	招商银行	15,000	564,150.00	0.50
6	601225	陕西煤业	19,000	524,020.00	0.47
7	601138	工业富联	17,000	428,230.00	0.38
8	300308	中际旭创	2,580	399,538.80	0.36
9	002475	立讯精密	9,000	391,140.00	0.35
10	600150	中国船舶	9,000	375,930.00	0.33

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	5,543,044.66	4.93
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）	117,477,100.66	104.47
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	123,020,145.32	109.40

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	113050	南银转债	56,000	7,039,427.07	6.26
2	019740	24 国债 09	55,000	5,543,044.66	4.93
3	110062	烽火转债	42,000	4,748,746.68	4.22
4	127101	豪鹏转债	36,520	4,082,792.92	3.63
5	113639	华正转债	34,000	3,617,558.08	3.22

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

1、华正转债：

监管警示：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。经评估，对公司经营无实质性影响。

2、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。2024 年 8 月 12 日，浙金罚决字（2024）24 号显示，杭州银行股份有限公司存在违规向借款人收取委托贷款手续费等 2 项违法违规事实，被处罚款 110 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，本报告期内本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，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	6,280.06
2	应收证券清算款	1,544,501.76
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	134,211.65

6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	1,684,993.47

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	113050	南银转债	7,039,427.07	6.26
2	110062	烽火转债	4,748,746.68	4.22
3	127101	豪鹏转债	4,082,792.92	3.63
4	113639	华正转债	3,617,558.08	3.22
5	127015	希望转债	3,456,011.40	3.07
6	110079	杭银转债	3,283,448.55	2.92
7	132026	G 三峡 EB2	2,842,108.27	2.53
8	123076	强力转债	2,560,335.89	2.28
9	113641	华友转债	2,290,816.00	2.04
10	127070	大中转债	2,048,375.34	1.82
11	111016	神通转债	1,828,683.48	1.63
12	113667	春 23 转债	1,794,766.30	1.60
13	110067	华安转债	1,705,400.84	1.52
14	118024	冠宇转债	1,599,564.52	1.42
15	127086	恒邦转债	1,551,515.10	1.38
16	113065	齐鲁转债	1,367,259.29	1.22
17	113062	常银转债	1,358,087.30	1.21
18	123208	孩王转债	1,349,437.93	1.20
19	127105	龙星转债	1,332,961.55	1.19
20	113052	兴业转债	1,313,511.78	1.17
21	110081	闻泰转债	1,231,278.08	1.09
22	123216	科顺转债	1,178,442.74	1.05
23	113043	财通转债	1,172,765.75	1.04
24	110073	国投转债	1,152,168.49	1.02
25	127068	顺博转债	1,129,435.07	1.00
26	113049	长汽转债	1,128,081.37	1.00
27	123190	道氏转 02	1,099,893.51	0.98
28	123194	百洋转债	1,022,109.04	0.91
29	113656	嘉诚转债	917,483.42	0.82
30	127074	麦米转 2	903,501.37	0.80
31	113033	利群转债	898,335.78	0.80
32	113069	博 23 转债	865,242.58	0.77
33	113549	白电转债	857,690.78	0.76
34	128109	楚江转债	844,756.36	0.75
35	113066	平煤转债	844,406.79	0.75
36	113615	金诚转债	834,134.25	0.74

37	110064	建工转债	815,981.08	0.73
38	123176	精测转 2	755,920.44	0.67
39	127100	神码转债	724,840.44	0.64
40	127045	牧原转债	694,257.26	0.62
41	113563	柳药转债	683,807.18	0.61
42	118028	会通转债	674,686.03	0.60
43	128144	利民转债	664,014.25	0.59
44	123184	天阳转债	649,991.64	0.58
45	127020	中金转债	609,950.00	0.54
46	113060	浙 22 转债	590,373.37	0.52
47	127035	濮耐转债	590,308.22	0.52
48	123147	中辰转债	580,728.36	0.52
49	111013	新港转债	569,034.25	0.51
50	113644	艾迪转债	545,402.05	0.48
51	127075	百川转 2	537,001.37	0.48
52	123191	智尚转债	534,476.47	0.48
53	128136	立讯转债	522,546.78	0.46
54	113055	成银转债	515,661.04	0.46
55	127081	中旗转债	487,929.32	0.43
56	113058	友发转债	482,301.92	0.43
57	127018	本钢转债	476,131.62	0.42
58	127069	小熊转债	470,838.36	0.42
59	123234	中能转债	465,075.51	0.41
60	123117	健帆转债	463,555.07	0.41
61	123213	天源转债	452,204.32	0.40
62	123149	通裕转债	439,731.00	0.39
63	128137	洁美转债	414,389.59	0.37
64	118013	道通转债	412,357.05	0.37
65	123090	三诺转债	411,390.76	0.37
66	123170	南电转债	408,007.97	0.36
67	123227	雅创转债	404,792.02	0.36
68	123212	立中转债	396,908.15	0.35
69	113669	景 23 转债	388,551.78	0.35
70	113631	皖天转债	385,500.08	0.34
71	127032	苏行转债	380,180.73	0.34
72	123157	科蓝转债	377,988.33	0.34
73	123107	温氏转债	369,274.52	0.33
74	113061	拓普转债	366,101.67	0.33
75	123150	九强转债	364,844.27	0.32
76	127039	北港转债	363,297.12	0.32
77	127099	盛航转债	360,460.15	0.32
78	113666	爱玛转债	358,143.29	0.32

79	128141	旺能转债	356,210.55	0.32
80	123174	精锻转债	355,079.55	0.32
81	127052	西子转债	353,597.67	0.31
82	127022	恒逸转债	346,571.92	0.31
83	127090	兴瑞转债	344,881.48	0.31
84	113530	大丰转债	341,178.49	0.30
85	127031	洋丰转债	339,013.97	0.30
86	123133	佩蒂转债	338,400.82	0.30
87	113637	华翔转债	337,446.74	0.30
88	113652	伟 22 转债	328,153.48	0.29
89	123078	飞凯转债	326,767.29	0.29
90	123240	楚天转债	324,779.34	0.29
91	118036	力合转债	324,252.33	0.29
92	127102	浙建转债	322,740.45	0.29
93	127083	山路转债	319,202.83	0.28
94	127042	嘉美转债	318,612.74	0.28
95	118003	华兴转债	318,526.71	0.28
96	111010	立昂转债	312,935.34	0.28
97	123145	药石转债	304,123.63	0.27
98	113067	燃 23 转债	303,844.66	0.27
99	113675	新 23 转债	301,139.73	0.27
100	127041	弘亚转债	298,240.75	0.27
101	111002	特纸转债	298,052.40	0.27
102	113632	鹤 21 转债	297,492.47	0.26
103	118033	华特转债	297,007.03	0.26
104	128133	奇正转债	295,309.22	0.26
105	123132	回盛转债	292,833.70	0.26
106	123059	银信转债	291,274.27	0.26
107	123169	正海转债	289,503.54	0.26
108	113051	节能转债	289,488.36	0.26
109	110090	爱迪转债	287,593.84	0.26
110	123217	富仕转债	276,493.36	0.25
111	127066	科利转债	276,240.75	0.25
112	113658	密卫转债	269,088.33	0.24
113	118037	上声转债	267,025.75	0.24
114	113621	彤程转债	263,810.68	0.23
115	128083	新北转债	256,811.89	0.23
116	123224	宇邦转债	249,481.15	0.22
117	123219	宇瞳转债	246,042.40	0.22
118	127051	博杰转债	241,393.97	0.21
119	123204	金丹转债	239,400.27	0.21
120	127027	能化转债	238,119.73	0.21

121	118030	睿创转债	237,942.74	0.21
122	127082	亚科转债	237,411.51	0.21
123	110084	贵燃转债	231,118.63	0.21
124	113045	环旭转债	231,002.41	0.21
125	127088	赫达转债	229,597.26	0.20
126	123048	应急转债	229,313.64	0.20
127	113623	凤 21 转债	227,537.26	0.20
128	123121	帝尔转债	224,994.79	0.20
129	123236	家联转债	224,208.11	0.20
130	128101	联创转债	222,590.19	0.20
131	127016	鲁泰转债	222,420.82	0.20
132	127085	韵达转债	219,363.34	0.20
133	118038	金宏转债	219,057.25	0.19
134	128095	恩捷转债	219,030.58	0.19
135	128130	景兴转债	217,664.60	0.19
136	127026	超声转债	217,652.88	0.19
137	113663	新化转债	216,879.95	0.19
138	127043	川恒转债	214,853.45	0.19
139	128129	青农转债	213,934.30	0.19
140	113676	荣 23 转债	209,265.44	0.19
141	111000	起帆转债	208,777.32	0.19
142	128121	宏川转债	208,659.67	0.19
143	123178	花园转债	208,656.37	0.19
144	128105	长集转债	207,080.82	0.18
145	110093	神马转债	206,216.04	0.18
146	110085	通 22 转债	205,956.00	0.18
147	113606	荣泰转债	200,942.38	0.18
148	113659	莱克转债	200,350.36	0.18
149	110089	兴发转债	199,655.51	0.18
150	113647	禾丰转债	199,270.14	0.18
151	127054	双箭转债	198,616.50	0.18
152	118035	国力转债	198,223.29	0.18
153	127028	英特转债	196,711.01	0.17
154	113030	东风转债	187,181.76	0.17
155	127077	华宏转债	186,583.90	0.17
156	113679	芯能转债	185,928.41	0.17
157	127053	豪美转债	185,804.71	0.17
158	123185	能辉转债	184,466.37	0.16
159	127072	博实转债	181,349.59	0.16
160	127076	中宠转 2	173,203.44	0.15
161	123115	捷捷转债	171,012.12	0.15
162	118041	星球转债	169,506.53	0.15

163	113653	永 22 转债	164,105.19	0.15
164	113660	寿 22 转债	161,996.38	0.14
165	127056	中特转债	160,905.04	0.14
166	113064	东材转债	151,899.42	0.14
167	123158	宙邦转债	140,281.15	0.12
168	128128	齐翔转 2	135,654.19	0.12
169	127095	广泰转债	132,482.55	0.12
170	123233	凯盛转债	132,020.38	0.12
171	110094	众和转债	123,735.75	0.11
172	128132	交建转债	122,843.12	0.11
173	123101	拓斯转债	116,593.97	0.10
174	113674	华设转债	116,058.90	0.10
175	128142	新乳转债	111,653.56	0.10
176	123025	精测转债	111,191.34	0.10
177	110070	凌钢转债	111,180.38	0.10
178	113037	紫银转债	107,886.85	0.10
179	123159	崧盛转债	106,158.77	0.09
180	113047	旗滨转债	105,903.56	0.09
181	127073	天赐转债	104,084.03	0.09
182	123193	海能转债	102,482.07	0.09
183	113651	松霖转债	100,776.00	0.09
184	110087	天业转债	100,391.51	0.09
185	118034	晶能转债	94,503.78	0.08
186	111017	蓝天转债	76,030.75	0.07
187	113582	火炬转债	64,110.52	0.06
188	118004	博瑞转债	61,030.89	0.05
189	127038	国微转债	56,900.75	0.05
190	113638	台 21 转债	56,327.47	0.05
191	118012	微芯转债	55,985.73	0.05
192	113673	岱美转债	42,823.27	0.04
193	113056	重银转债	38,718.30	0.03
194	127064	杭氧转债	29,999.38	0.03
195	123085	万顺转 2	22,364.28	0.02
196	113634	珀莱转债	13,434.10	0.01
197	113616	韦尔转债	11,204.07	0.01
198	127025	冀东转债	10,353.79	0.01
199	113059	福莱转债	10,271.37	0.01
200	113048	晶科转债	9,640.93	0.01
201	123183	海顺转债	5,251.52	0.00
202	113579	健友转债	2,178.30	0.00
203	128116	瑞达转债	2,140.03	0.00
204	113650	博 22 转债	2,023.43	0.00

205	118005	天奈转债	2,003.83	0.00
206	123192	科思转债	1,401.37	0.00
207	127050	麒麟转债	1,378.70	0.00
208	123143	胜蓝转债	1,376.03	0.00
209	113598	法兰转债	1,312.90	0.00
210	111011	冠盛转债	1,306.68	0.00
211	110075	南航转债	1,226.35	0.00
212	123119	康泰转 2	1,156.96	0.00
213	113636	甬金转债	1,142.62	0.00
214	123091	长海转债	1,141.17	0.00
215	128135	洽洽转债	1,135.38	0.00
216	127040	国泰转债	1,135.03	0.00
217	127091	科数转债	1,133.03	0.00
218	123211	阳谷转债	1,132.02	0.00
219	127071	天箭转债	1,128.05	0.00
220	118025	奕瑞转债	1,127.30	0.00
221	113671	武进转债	1,122.81	0.00
222	127017	万青转债	1,120.56	0.00
223	123104	卫宁转债	1,116.04	0.00
224	111018	华康转债	1,110.23	0.00
225	110082	宏发转债	1,109.11	0.00
226	128117	道恩转债	1,108.49	0.00
227	113682	益丰转债	1,105.39	0.00
228	123235	亿田转债	1,100.57	0.00
229	123071	天能转债	1,099.10	0.00
230	128125	华阳转债	1,098.86	0.00
231	111001	山玻转债	1,095.17	0.00
232	127046	百润转债	1,092.27	0.00
233	128131	崇达转 2	1,089.05	0.00
234	110076	华海转债	1,083.55	0.00
235	127024	盈峰转债	1,072.88	0.00
236	113542	好客转债	1,072.57	0.00
237	123168	惠云转债	1,070.00	0.00
238	113661	福 22 转债	1,068.56	0.00
239	113655	欧 22 转债	1,064.55	0.00
240	113545	金能转债	1,064.19	0.00
241	113605	大参转债	1,063.11	0.00
242	113627	太平转债	1,051.56	0.00
243	113643	风语转债	1,051.56	0.00
244	123210	信服转债	1,047.98	0.00
245	113054	绿动转债	1,045.97	0.00
246	128134	鸿路转债	1,045.04	0.00

247	113677	华懋转债	1,044.59	0.00
248	113654	永 02 转债	1,040.87	0.00
249	118015	芯海转债	1,036.99	0.00
250	111014	李子转债	1,035.73	0.00
251	123154	火星转债	1,031.65	0.00
252	127098	欧晶转债	1,027.76	0.00
253	127030	盛虹转债	1,025.65	0.00
254	118042	奥维转债	1,024.36	0.00
255	123179	立高转债	1,020.02	0.00
256	113053	隆 22 转债	1,018.32	0.00
257	123172	漱玉转债	1,013.18	0.00
258	128124	科华转债	1,012.04	0.00
259	113657	再 22 转债	998.54	0.00
260	123180	浙矿转债	996.81	0.00
261	118000	嘉元转债	979.53	0.00
262	118010	洁特转债	978.78	0.00
263	127067	恒逸转 2	964.03	0.00
264	123161	强联转债	959.99	0.00
265	123215	铭利转债	958.35	0.00
266	111004	明新转债	954.85	0.00
267	113640	苏利转债	951.18	0.00
268	123144	裕兴转债	937.59	0.00
269	111009	盛泰转债	931.69	0.00
270	127089	晶澳转债	890.96	0.00
271	118031	天 23 转债	856.12	0.00
272	118008	海优转债	807.95	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	41,496,055.26	59,076,427.85
报告期期间基金总申购份额	26,660,926.28	2,185,103.83
减：报告期期间基金总赎回份额	2,317,293.07	3,770,981.18
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	65,839,688.47	57,490,550.50

§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

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	20240910~20240930	0.00	26,219,214.74	0.00	26,219,214.74	21.26

产品特有风险

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。

8.2 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。

§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 10 月 25 日