

长盛可转债债券型证券投资基金

2026 年中期报告

2026 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：2026 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 08 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	37
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	39
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	39

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	39
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	39
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	39
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	40
7.11 投资组合报告附注	40
§ 8 基金份额持有人信息	45
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	45
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	45
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情况	45
§ 9 开放式基金份额变动	46
§ 10 重大事件揭示	46
10.1 基金份额持有人大会决议	46
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	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	46
10.4 基金投资策略的改变	46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	47
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	47
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	47
10.8 其他重大事件	48
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	49
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	49
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	49
§ 12 备查文件目录	49
12.1 备查文件目录	49
12.2 存放地点	49
12.3 查阅方式	49

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长盛可转债债券型证券投资基金	
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	54,869,248.79 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	23,740,798.38 份	31,128,450.41 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	1、大类资产配置 本基金综合运用定性和定量的分析手段，在对宏观经济因素进行充分研究的基础上，判断宏观经济周期所处阶段。基金将依据经济周期理论，结合对证券市场的系统性风险以及未来一段时期内各大类资产风险和预期收益率的评估，制定本基金在股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例、调整原则。 2、固定收益类资产投资策略 （1）可转债投资策略：本基金可投资可转债、分离交易可转债或含赎回或回售权的债券等，这类债券赋予债权人或债务人某种期权，比普通的债券更为灵活。本基金将采用专业的分析和计算方法，综合考虑可转债的久期、票面利率、风险等债券因素以及期权价格，力求选择被市场低估的品种，获得超额收益。分离交易可转债与传统可转债的不同点主要体现在分离交易可转债在上市后分离为债券部分跟权证部分分别独自进行交易。 （2）普通债券投资策略：本基金的债券投资将主要采取久期策略、类属配置策略、收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略、债券选择策略等积极投资策略。
业绩比较基准	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	许俊
	联系电话	010-86497608	010-66596688
	电子邮箱	zhangln@csfunds.com.cn	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		400-888-2666、010-86497888	95566
传真		010-86497999	010-66594942
注册地址		深圳市福田区中心区福中三路诺德金融中心主楼 10D	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		北京市朝阳区安定路 5 号院 3 号楼中建财富国际中心 3-5 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		100029	100818
法定代表人		胡甲	葛海蛟

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.csfunds.com.cn
基金中期报告置备地点	基金管理人的办公地址及基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	长盛基金管理有限公司	北京市朝阳区安定路 5 号院 3 号楼中建财富国际中心 3-5 层

§ 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

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)	
	长盛可转债 A	长盛可转债 C
本期已实现收益	2,918,194.69	3,853,085.59
本期利润	1,601,575.64	2,333,992.40
加权平均基金份额本期利润	0.0575	0.0629
本期加权平均净值利润率	4.52%	4.98%
本期基金份额净值增长率	4.78%	4.63%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	1,281,974.24	1,519,723.38

期末可供分配基金份额利润	0.0540	0.0488
期末基金资产净值	29,483,744.06	38,575,025.85
期末基金份额净值	1.2419	1.2392
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	74.93%	74.27%

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、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
过去三个月	3.61%	1.04%	3.80%	0.61%	-0.19%	0.43%
过去六个月	4.78%	1.11%	3.01%	0.66%	1.77%	0.45%
过去一年	18.78%	0.92%	11.35%	0.56%	7.43%	0.36%
过去三年	22.71%	0.89%	21.98%	0.48%	0.73%	0.41%
过去五年	17.17%	1.06%	26.19%	0.46%	-9.02%	0.60%
过去七年	62.85%	1.13%	49.92%	0.47%	12.93%	0.66%
自基金合同生效起至今	74.93%	1.02%	64.54%	0.47%	10.39%	0.55%

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	3.53%	1.04%	3.80%	0.61%	-0.27%	0.43%
过去六个月	4.63%	1.11%	3.01%	0.66%	1.62%	0.45%

过去一年	18.41%	0.92%	11.35%	0.56%	7.06%	0.36%
过去三年	21.62%	0.89%	21.98%	0.48%	-0.36%	0.41%
过去五年	15.42%	1.06%	26.19%	0.46%	-10.77%	0.60%
过去七年	59.82%	1.13%	49.92%	0.47%	9.90%	0.66%
自基金合同生效起至今	74.27%	1.02%	64.54%	0.47%	9.73%	0.55%

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。

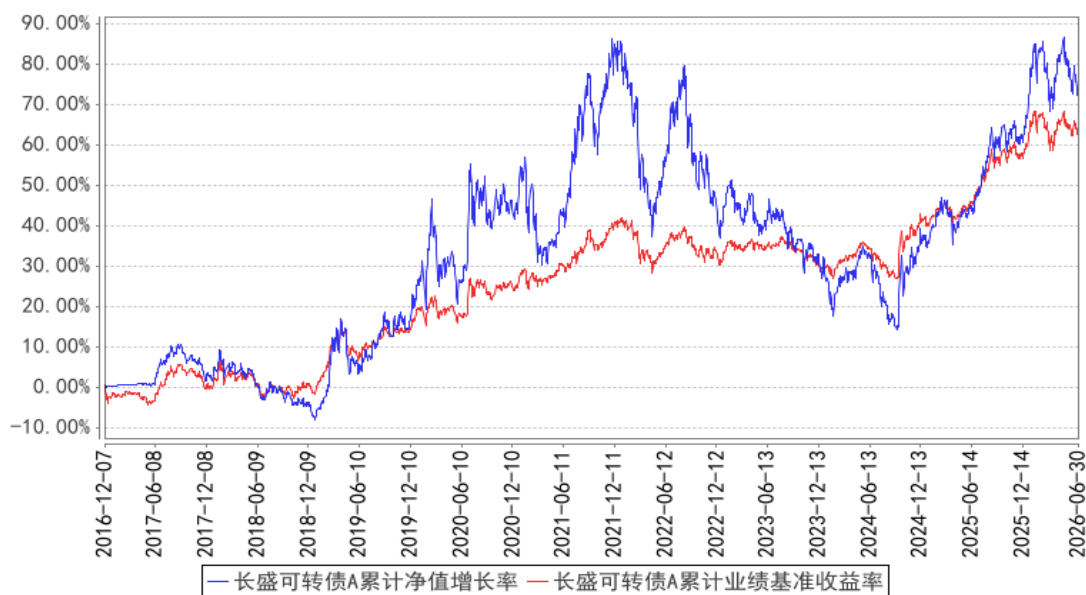
中证综合债券指数是综合反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央票及短融整体走势的跨市场债券指数，其选样是在中证全债指数样本的基础上，增加了央行票据、短期融资券以及一年期以下的国债、金融债和企业债，更全面地反映我国债券市场的整体价格变动趋势，为债券投资者提供更切合的市场基准。

沪深 300 指数是中证指数公司编制的包含上海、深圳两个证券交易所流动性好、规模最大的 300 只 A 股为样本的成分股指数，是目前中国证券市场中市值覆盖率高、代表性强、流动性好，同时公信力较好的股票指数，适合作为本基金股票投资的比较基准。

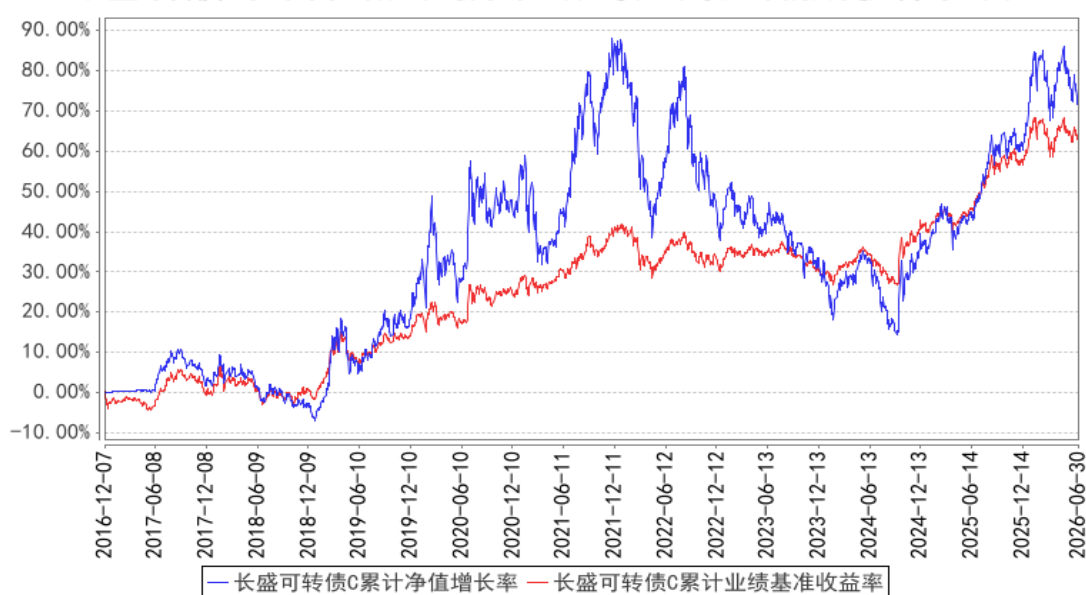
由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照 60%、30%、10%的比例采取再平衡，再用连锁计算的方式得到基准指数的时间序列。

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

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

首批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。长盛基金注册地为深圳，总部办公地位于北京，在北京、上海、成都等地设有分支机构，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（DBS Bank Ltd.）占注册资本的 33%，安徽省信用融资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，同时可担任私募资产管理计划和境外 QFII 基金的投资顾问。截至 2026 年 6 月 30 日，基金管理人共管理七十八只开放式基金，并管理多个全国社保基金组合和私募资产管理计划。

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		
杨哲	本基金基金经理，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。	2018 年 6 月 11 日	-	16 年	杨哲先生，硕士。曾任大公国际资信评估有限公司公司信用分析师、信用评审委员会委员。2013 年 9 月加入长盛基金管理有限公司。
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，长盛元赢六个月定期开放债券型证券投资基金基金经理，长盛聚利债券型证券投资基金基金经理。	2024 年 9 月 20 日	-	12 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。

4.1.3 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

第 10 页 共 50 页

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、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 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

债券方面，上半年债券收益率震荡下行，收益率曲线变陡。一季度市场交易主线围绕股债跷

跷板、中东战事、通胀等因素。年初权益市场延续强势表现，长债收益率有所上行，随后随着权益市场的降温和结构性降息工具的落地，债市开始修复。2 月底美以伊战争以来，市场先交易避险后交易通胀，债券收益率先下后上。二季度债市收益率整体震荡下行，交易主要围绕资金面展开。4 月资金面超预期宽松，债券收益率下行为主。5 月、6 月，资金利率中枢上移，债市收益率偏震荡。

转债方面，上半年中证转债指数呈“M”形走势。年初权益市场延续去年末热度，同时转债 ETF 份额持续增长，在流动性驱动下转债随正股上涨。2 月底中东开战以来，“固收+”资金赎回，叠加年报陆续披露，市场风险偏好快速下行，高估值环境下转债相对脆弱，同时超预期强赎拖累转债表现，高价和临近强赎转债调整幅度较大，中证转债指数回吐年内全部涨幅。4 月随着中东局势缓和，以及流动性持续宽松，市场开始修复。5 月中旬触及阶段高点后开始回落，半年末略有反弹。受权益市场结构性行情带动，转债估值有所扩张，转债整体跟涨弹性受到一定压制。结构方面分化显著，小盘及主题驱动个券涨幅较大，大盘转债以及部分正股基本面承压或存在信用风险的个券则表现较弱。

2、报告期内本基金投资策略分析

报告期内，本基金结合权益市场行情，动态优化了行业配置，并通过波段交易积极增厚收益。整体看，本基金止盈了部分高价转债和临期转债，减持了部分大盘和低价转债。

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 的基金份额净值为 1.2419 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.78%，同期业绩比较基准收益率为 3.01%；截至本报告期末长盛可转债 C 的基金份额净值为 1.2392 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.63%，同期业绩比较基准收益率为 3.01%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，内需偏弱格局短期或难扭转，但在低基数、财政发力等因素支撑下，经济增速大概率环比回升，年内实现经济增长目标难度不大，因此总量强刺激政策出台的概率偏低，增量工具或聚焦结构性领域。资金价格方面，下半年预计流动性维持平稳态势。整体看，债券市场风险可控，或延续震荡格局，收益率曲线有望走平。

下半年转债退出加剧存量收缩，低利率环境下“固收+”资金配置需求仍旺，支撑转债估值维持高位。配置方面，盈利回升、政策宽松与产业趋势是核心支撑，科技成长或仍为主线，但市场有望更加均衡，次新、低溢价转债以及偏债型品种存在交易性机会。风险上需警惕高估值转债回落、正股波动加大，下半年精选基本面扎实、溢价率合理的个券更为关键。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引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。

本基金管理人设有估值工作小组，负责制定、评估、复核和修订基金估值程序和技术，适时更新估值相关制度，指导并监督各类投资品种的估值程序，评估会计政策变更的影响，对证券投资基金估值方法进行最终决策等。估值工作小组由总经理担任组长，督察长担任副组长，小组成员均具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可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。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，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据和流通受限股票的折扣率数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的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

本报告期内，本基金实施了利润分配，符合法律法规和基金合同的相关约定。具体参见本报告“6.4.11 利润分配情况”。

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 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 托管人对本中期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”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等财务数据真实、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：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	276,213.42	459,321.06
结算备付金		251,898.62	531,169.66
存出保证金		16,578.33	6,288.71
交易性金融资产	6.4.7.2	69,924,810.81	87,935,771.99
其中：股票投资		-	165,501.00
基金投资		-	-
债券投资		69,924,810.81	87,770,270.99
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	3,310,000.00
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		1,280,079.21	215,843.09
应收股利		-	-
应收申购款		546,021.40	108,664.56
递延所得税资产		-	-

其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		72,295,601.79	92,567,059.07
负债和净资产	附注号	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	8,997,806.58
应付清算款		805,545.50	385,094.57
应付赎回款		3,277,148.20	459,955.59
应付管理人报酬		47,883.02	56,940.91
应付托管费		11,970.76	14,235.22
应付销售服务费		10,024.12	12,692.07
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1,645.23	4,171.88
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	82,615.05	129,834.17
负债合计		4,236,831.88	10,060,730.99
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	54,869,248.79	69,421,129.02
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	13,189,521.12	13,085,199.06
净资产合计		68,058,769.91	82,506,328.08
负债和净资产总计		72,295,601.79	92,567,059.07

注： 报告截止日 2026 年 06 月 30 日，长盛可转债 A 的基金份额净值为 1.2419 元，份额总额为 23,740,798.38 份;长盛可转债 C 的基金份额净值为 1.2392 元，份额总额为 31,128,450.41 份。基金份额总额 54,869,248.79 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：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026年1月1日至2026 年6月30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025 年6月30日
一、营业总收入		4,533,839.06	7,060,067.47
1. 利息收入		2,013.95	2,826.51
其中：存款利息收入	6.4.7.13	1,652.31	2,779.52
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息		-	-

收入			
买入返售金融资产收入		361.64	46.99
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		7,357,945.44	5,168,896.86
其中：股票投资收益	6.4.7.14	169,523.96	-142,636.84
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	7,132,899.83	5,279,216.14
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	55,521.65	32,317.56
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-2,835,712.24	1,881,917.48
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	9,591.91	6,426.62
减：二、营业总支出		598,271.02	725,392.08
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	327,704.49	349,258.88
2. 托管费	6.4.10.2.2	81,926.15	87,314.80
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	70,069.41	77,842.18
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		52,680.10	145,502.44
其中：卖出回购金融资产支出		52,680.10	145,502.44
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		1,151.51	1,221.79
8. 其他费用	6.4.7.23	64,739.36	64,251.99
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,935,568.04	6,334,675.39
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,935,568.04	6,334,675.39
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		3,935,568.04	6,334,675.39

6.3 净资产变动表

会计主体：长盛可转债债券型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	69,421,129.02	13,085,199.06	82,506,328.08
二、本期期初净资产	69,421,129.02	13,085,199.06	82,506,328.08
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填列）	-14,551,880.23	104,322.06	-14,447,558.17
（一）、综合收益总额	-	3,935,568.04	3,935,568.04
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数 （净资产减少以“-”号填列）	-14,551,880.23	-3,561,430.93	-18,113,311.16
其中：1. 基金申购款	21,876,683.55	6,087,323.28	27,964,006.83
2. 基金赎回款	-36,428,563.78	-9,648,754.21	-46,077,317.99
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-269,815.05	-269,815.05
四、本期期末净资产	54,869,248.79	13,189,521.12	68,058,769.91
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	86,980,640.34	-2,299,508.81	84,681,131.53
二、本期期初净资产	86,980,640.34	-2,299,508.81	84,681,131.53
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填列）	-3,177,980.86	6,438,487.08	3,260,506.22
（一）、综合收益总额	-	6,334,675.39	6,334,675.39
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数 （净资产减少以“-”号填列）	-3,177,980.86	103,811.69	-3,074,169.17
其中：1. 基金申购款	18,642,872.94	443,677.38	19,086,550.32

2. 基金赎回款	-21,820,853.80	-339,865.69	-22,160,719.49
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	83,802,659.48	4,138,978.27	87,941,637.75

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：

胡甲

基金管理人负责人

张壬午

主管会计工作负责人

龚珉

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，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金根据申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人申购时收取申购费用、但不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资者申购时不收取申购费用、而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类和 C 类基金份额将分别计算并公告基金份额净值。

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 $\times$ 60%+中证综合债券指数收益 $\times$ 30%+沪深 300 指数收益率 $\times$ 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、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号—定期报告的内容与格式》、《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〉》，以及中国证券投资基金业协会颁布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号——年度报告和中期报告》和中国证监会、中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

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 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及 2026 年 1 月 1 日至 2026 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

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

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；

根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

6.4.6.2 增值税

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令 826 号文《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号文《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定，资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人；自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，对公募证券投资基金（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、债券取得的收入及金融同业往来利息收入免征增值税；金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入；取得存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号文《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》的规定，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期；

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》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号文《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定，自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下称资管产品运营业务）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；

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 号文《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 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	276,213.42
等于：本金	276,190.78
加：应计利息	22.64
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-

减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	276,213.42

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		-	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	64,439,138.86	290,716.07	69,924,810.81	5,194,955.88
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	64,439,138.86	290,716.07	69,924,810.81	5,194,955.88
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		64,439,138.86	290,716.07	69,924,810.81	5,194,955.88

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 债权投资

无。

6.4.7.6 其他债权投资

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	4,199.31
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	20,359.65
其中：交易所市场	20,359.65
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	58,056.09
合计	82,615.05

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

长盛可转债 A

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	28,522,772.76	28,522,772.76
本期申购	7,301,775.54	7,301,775.54
本期赎回（以“-”号填列）	-12,083,749.92	-12,083,749.92
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	23,740,798.38	23,740,798.38

长盛可转债 C

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	40,898,356.26	40,898,356.26
本期申购	14,574,908.01	14,574,908.01
本期赎回（以“-”号填列）	-24,344,813.86	-24,344,813.86
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	31,128,450.41	31,128,450.41

注：若本基金有分红及转换业务，申购含红利再投、转换入；赎回含转换出。

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

长盛可转债 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,106,683.79	6,649,698.55	5,543,014.76
本期期初	-1,106,683.79	6,649,698.55	5,543,014.76
本期利润	2,918,194.69	-1,316,619.05	1,601,575.64
本期基金份额交易产生的变动数	-259,721.61	-872,108.06	-1,131,829.67
其中：基金申购款	76,231.05	1,994,494.71	2,070,725.76
基金赎回款	-335,952.66	-2,866,602.77	-3,202,555.43
本期已分配利润	-269,815.05	-	-269,815.05
本期末	1,281,974.24	4,460,971.44	5,742,945.68

长盛可转债 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-2,087,793.05	9,629,977.35	7,542,184.30
本期期初	-2,087,793.05	9,629,977.35	7,542,184.30
本期利润	3,853,085.59	-1,519,093.19	2,333,992.40
本期基金份额交易产生的变动数	-245,569.16	-2,184,032.10	-2,429,601.26
其中：基金申购款	-18,415.17	4,035,012.69	4,016,597.52
基金赎回款	-227,153.99	-6,219,044.79	-6,446,198.78
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,519,723.38	5,926,852.06	7,446,575.44

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	1,019.18
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	604.65
其他	28.48
合计	1,652.31

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
----	----------------------------

股票投资收益——买卖股票差价收入	169,523.96
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	169,523.96

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	42,481,084.28
减：卖出股票成本总额	42,249,290.46
减：交易费用	62,269.86
买卖股票差价收入	169,523.96

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	401,805.16
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	6,731,094.67
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	7,132,899.83

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	68,799,550.96
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	61,709,983.14
减：应计利息总额	354,432.81
减：交易费用	4,040.34
买卖债券差价收入	6,731,094.67

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	55,521.65
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	55,521.65

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-2,835,712.24
股票投资	25,809.00
债券投资	-2,861,521.24
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-2,835,712.24

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	9,416.02
基金转换费收入	175.89
合计	9,591.91

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	13,884.51
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
银行费用	2,183.27
账户维护费	9,000.00
合计	64,739.36

6.4.7.24 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金的管理人于 2026 年 7 月 9 日发布分红公告，向截至 2026 年 7 月 10 日止本基金登记注册的份额持有人进行利润分配，长盛可转债 A 类按每 10 份基金份额分配红利人民币 0.2800 元；长盛可转债 C 类按每 10 份基金份额分配红利人民币 0.2500 元。

除以上情况外，无其他需要说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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（“长盛基金公司”）	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、基金销售机构
国元证券股份有限公司（“国元证券”）	基金管理人股东、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	327,704.49	349,258.88
其中：应支付销售机构的客户维护费	155,481.98	153,281.66
应支付基金管理人的净管理费	172,222.51	195,977.22

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 0.80%的年管理费率计提。计算方法如下：

$$H=E\times\text{年管理费率}/\text{当年天数}$$

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	81,926.15	87,314.80

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%的年托管费率计提。计算方法如下：

$$H=E\times\text{年托管费率}/\text{当年天数}$$

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

6.4.10.2.3 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 2026 年 1 月 1 日至 2026 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
长盛基金公司	-	288.73	288.73
中国银行	-	7,927.53	7,927.53
国元证券	-	578.53	578.53
合计	-	8,794.79	8,794.79
获得销售服务费的各关联方	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		

方名称	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
长盛基金公司	-	223.66	223.66
中国银行	-	8,347.93	8,347.93
国元证券	-	770.18	770.18
合计	-	9,341.77	9,341.77

注：基金销售服务费每日计提，按月支付。本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的年销售服务费费率为 0.30%。销售服务费计提的计算公式如下：

$$H = E \times \text{年销售服务费率} / \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 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

无。

6.4.10.6 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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	276,213.42	1,019.18	344,994.09	664.87
合计	276,213.42	1,019.18	344,994.09	664.87

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

长盛可转债 A								
序号	权益 登记日	除息日		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	本期利润 分配合计	备 注
		场内	场外					
1	2026 年 4 月 13 日	-	2026 年 4 月 13 日	0.0960	164,531.18	105,283.87	269,815.05	-
合计	-	-	-	0.0960	164,531.18	105,283.87	269,815.05	-

注：本基金于资产负债表日之后、中期报告批准报出日之前批准、公告或实施的利润分配情况请参见资产负债表日后事项。

6.4.12 期末（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券 代码	证 券 名 称	成功 认购 日	受限 期	流通 受限 类型	认购 价格	期末 估值 单价	数量 （单 位： 张）	期末 成本总额	期末估值总 额	备注
110101	宝 钛 转 债	2026 年 6 月 29 日	1 个月 内（含）	新债 未上 市	100.00	100.00	1,020	102,000.00	102,001.56	配债
110101	宝 钛 转 债	2026 年 6 月 25 日	1 个月 内（含）	新债 未上 市	100.00	100.00	10	1,000.00	1,000.02	-
111025	圣 泉 转 债	2026 年 6 月 26 日	1 个月 内（含）	新债 未上 市	100.00	100.00	70	7,000.00	7,000.09	-
113703	翔 26 转 债	2026 年 6 月 9 日	1 个月 内（含）	新债 未上 市	100.00	100.01	1,720	172,000.00	172,017.34	-
113705	豪	2026	1 个月	新债	100.00	100.01	1,430	143,000.00	143,010.03	-

	26 转债	年 6 月 16 日	内(含)	未上 市						
113706	金 帝 转 债	2026 年 6 月 16 日	1 个月 内(含)	新债 未上 市	100.00	100.01	1,060	106,000.00	106,007.43	-
123274	维 科 转 债	2026 年 6 月 26 日	1 个月 内(含)	新债 未上 市	100.00	100.00	392	39,200.00	39,200.86	-
127114	宜 化 转 债	2026 年 6 月 26 日	1 个月 内(含)	新债 未上 市	100.00	100.00	643	64,300.00	64,301.41	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设,建立了以风险控制管理委员会为核心的、由风险控制管理委员会、风险控制委员会、监察稽核部与风险管理部、相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制管理委员会,负责制定风险管理的宏观政策,审议通过风险控制的总体措施等;在管理层层面设立风险控制委员会,讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施;监察稽核部和风险管理部负责监察公司风险管理措施的执行;各职能部门在一定范围内负责本部门的风险评估和监控。

本基金在日常经营活动中面临的風險主要包括信用風險、流动性風險及市場風險。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上風險控制在限定的范围之内,使本基金在風險和收益之间取得最佳的平衡以实现“風險和收益相匹配”的風險收益目标。本基金的基金管理人

对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	3,938,112.80	4,347,331.61
合计	3,938,112.80	4,347,331.61

注：上述评级均取自第三方评级机构。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
AAA	10,551,715.95	13,308,707.24

AAA 以下	55,434,982.06	70,114,232.14
未评级	—	—
合计	65,986,698.01	83,422,939.38

注：上述评级均取自第三方评级机构。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控流动性受限资产比例、流动性资产比例及压力测试等方式防范流动性风险，并对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市或在银行间同业市场交易，因此，除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，本基金所持大部分资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动

而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的公允价值和未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	276,190.78	-	-	22.64	276,213.42
结算备付金	251,876.57	-	-	22.05	251,898.62
存出保证金	16,576.80	-	-	1.53	16,578.33
交易性金融资产	15,952,844.70	45,449,387.22	8,231,862.82	290,716.07	69,924,810.81
应收申购款	-	-	-	546,021.40	546,021.40
应收清算款	-	-	-	1,280,079.21	1,280,079.21
资产总计	16,497,488.85	45,449,387.22	8,231,862.82	2,116,862.90	72,295,601.79
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,277,148.20	3,277,148.20
应付管理人报酬	-	-	-	47,883.02	47,883.02
应付托管费	-	-	-	11,970.76	11,970.76
应付清算款	-	-	-	805,545.50	805,545.50
应付销售服务费	-	-	-	10,024.12	10,024.12
应交税费	-	-	-	1,645.23	1,645.23
其他负债	-	-	-	82,615.05	82,615.05
负债总计	-	-	-	4,236,831.88	4,236,831.88
利率敏感度缺口	16,497,488.85	45,449,387.22	8,231,862.82	-2,119,968.98	68,058,769.91
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	459,292.50	-	-	28.56	459,321.06
结算备付金	531,118.06	-	-	51.60	531,169.66
存出保证金	6,288.11	-	-	0.60	6,288.71
交易性金融资产	13,924,555.90	67,448,017.04	5,962,641.50	600,557.55	87,935,771.99
买入返售金融资产	3,310,000.00	-	-	-	3,310,000.00
应收申购款	-	-	-	108,664.56	108,664.56
应收清算款	-	-	-	215,843.09	215,843.09
资产总计	18,231,254.57	67,448,017.04	5,962,641.50	925,145.96	92,567,059.07

负债					
应付赎回款	-	-	-	459,955.59	459,955.59
应付管理人报酬	-	-	-	56,940.91	56,940.91
应付托管费	-	-	-	14,235.22	14,235.22
应付清算款	-	-	-	385,094.57	385,094.57
卖出回购金融资产款	9,000,000.00	-	-	-2,193.42	8,997,806.58
应付销售服务费	-	-	-	12,692.07	12,692.07
应交税费	-	-	-	4,171.88	4,171.88
其他负债	-	-	-	129,834.17	129,834.17
负债总计	9,000,000.00	-	-	1,060,730.99	10,060,730.99
利率敏感度缺口	9,231,254.57	67,448,017.04	5,962,641.50	-135,585.03	82,506,328.08

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026年6月30日）	上年度末（2025年12月31日）
	1. 市场利率下降 25 个基点	437,844.27	525,085.60
	2. 市场利率上升 25 个基点	-437,844.27	-525,085.60

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于上市交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。并且，基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，动态、及时地跟踪和控制其他价格风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	-	-	165,501.00	0.20
合计	-	-	165,501.00	0.20

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金于本报告期末及上年度末持有的非固定收益类投资占比并不重大，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对本基金资产净值无重大影响。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由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决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	65,055,996.15	83,025,112.09
第二层次	4,868,814.66	4,910,659.90
第三层次	-	-
合计	69,924,810.81	87,935,771.99

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、境内股票证券涨跌停等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	69,924,810.81	96.72
	其中：债券	69,924,810.81	96.72
	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	528,112.04	0.73
8	其他各项资产	1,842,678.94	2.55
9	合计	72,295,601.79	100.00

7.2 报告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**

本基金本报告期末未持有境内投资股票。

7.2.2 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。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

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	601231	环旭电子	1,688,124.65	2.05
2	603112	华翔股份	1,453,870.00	1.76
3	002452	长高电气	1,268,892.00	1.54
4	688208	道通科技	1,229,683.81	1.49
5	605116	奥锐特	1,139,389.00	1.38
6	301215	中汽股份	984,096.00	1.19
7	603290	斯达半导	983,799.00	1.19
8	688798	艾为电子	963,540.00	1.17
9	603799	华友钴业	925,889.00	1.12
10	003009	中天火箭	891,140.49	1.08
11	688223	晶科能源	856,031.68	1.04
12	600029	南方航空	848,764.00	1.03
13	603596	伯特利	836,257.00	1.01
14	300037	新宙邦	821,517.00	1.00
15	603809	豪能股份	770,228.00	0.93
16	002850	科达利	765,943.00	0.93
17	301611	珂玛科技	732,850.00	0.89
18	603270	金帝股份	711,246.00	0.86
19	688002	睿创微纳	695,833.00	0.84
20	601778	晶科科技	658,319.82	0.80

7.4.2 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	601231	环旭电子	2,010,981.49	2.44
2	002452	长高电气	1,305,183.00	1.58
3	603112	华翔股份	1,183,268.00	1.43
4	688208	道通科技	1,077,829.62	1.31
5	605116	奥锐特	1,047,470.00	1.27
6	300037	新宙邦	1,035,806.00	1.26
7	603290	斯达半导	1,012,908.00	1.23
8	688798	艾为电子	936,305.60	1.13
9	301215	中汽股份	896,840.00	1.09
10	301611	珂玛科技	866,006.22	1.05
11	003009	中天火箭	836,912.30	1.01
12	002850	科达利	821,509.00	1.00
13	688002	睿创微纳	815,474.10	0.99
14	601778	晶科科技	813,230.55	0.99
15	600029	南方航空	767,599.00	0.93
16	688401	路维光电	759,687.00	0.92
17	603799	华友钴业	731,920.00	0.89
18	603270	金帝股份	726,230.00	0.88
19	603596	伯特利	721,064.44	0.87

20	300567	精测电子	696,535.00	0.84
----	--------	------	------------	------

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	42,057,980.46
卖出股票收入（成交）总额	42,481,084.28

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	3,938,112.80	5.79
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）	65,986,698.01	96.96
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	69,924,810.81	102.74

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	113042	上银转债	29,200	3,373,372.00	4.96
2	019792	25 国债 19	16,000	1,616,787.73	2.38
2	102317	国债 2519	16,000	1,616,787.73	2.38
3	123272	中汽转债	7,699	1,211,043.21	1.78
4	113681	镇洋转债	8,000	1,047,141.04	1.54
5	118030	睿创转债	1,830	932,424.61	1.37

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

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

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

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 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 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、上银转债

2025 年 8 月 1 日，银罚决字(2025)10 号显示，上海银行股份有限公司存在违反账户管理规定等 8 项违法违规事实，被处警告，没收违法所得 46.95195 万元，罚款 2,874.8 万元。2026 年 1 月 28 日，国家金融监督管理总局上海监管局行政处罚信息公开表显示，上海银行股份有限公司存在以贷收费等多项违法违规事实，被处罚款 450 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、起帆转债

2026 年 2 月 4 日，公司收到中国证券监督管理委员会上海监管局责令整改函，主要涉及问题包括：1. 公司章程不合规；2. 公司聘任财务负责人未经审计委员会前置审议。3 . 公司内幕信息知情人制度执行不到位。为维护市场秩序，促进上市公司规范运作，根据《 中华人民共和国证券法 》第一百七十条第二款、《上市公司独立董事管理办法》(证监会令第 227 号)第四十四条 的规定，上海监管局决定对起帆电缆采取责令改正的行政监管措施 。起帆电缆应采取有效措施进行改正，并于收到本决定书之日起 30 日内向上海监管局提交书面整改报告。经评估，上述事项对公司可转债整体影响可控。

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。

7.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金投资的前十名股票，均为基金合同约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	16,578.33
2	应收清算款	1,280,079.21
3	应收股利	-

4	应收利息	-
5	应收申购款	546,021.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,842,678.94

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	113042	上银转债	3,373,372.00	4.96
2	113681	镇洋转债	1,047,141.04	1.54
3	118030	睿创转债	932,424.61	1.37
4	123241	欧通转债	876,398.16	1.29
5	111000	起帆转债	776,525.37	1.14
6	118042	奥维转债	720,059.25	1.06
7	118051	皓元转债	702,236.38	1.03
8	127070	大中转债	640,178.32	0.94
9	123247	万凯转债	630,502.85	0.93
10	111021	奥锐转债	628,691.67	0.92
11	127049	希望转 2	625,508.07	0.92
12	113673	岱美转债	620,264.77	0.91
13	113667	春 23 转债	613,716.14	0.90
14	127030	盛虹转债	612,058.52	0.90
15	110093	神马转债	587,507.12	0.86
16	118053	正帆转债	566,337.34	0.83
17	110075	南航转债	548,426.71	0.81
18	123176	精测转 2	537,277.81	0.79
19	110090	爱迪转债	536,002.63	0.79
20	118024	冠宇转债	519,647.67	0.76
21	113058	友发转债	510,987.62	0.75
22	113677	华懋转债	504,446.30	0.74
23	127103	东南转债	504,218.15	0.74
24	118005	天奈转债	494,046.03	0.73
25	113679	芯能转债	489,587.57	0.72
26	127092	运机转债	488,960.52	0.72
27	118059	顾中转债	487,397.89	0.72
28	127082	亚科转债	478,501.74	0.70
29	113661	福 22 转债	475,614.36	0.70
30	113652	伟 22 转债	450,068.36	0.66
31	113692	保隆转债	438,549.23	0.64
32	127067	恒逸转 2	433,662.74	0.64
33	113699	金 25 转债	431,322.45	0.63
34	110087	天业转债	417,275.47	0.61

35	127031	洋丰转债	407,923.56	0.60
36	123107	温氏转债	391,907.85	0.58
37	127027	能化转债	389,724.52	0.57
38	123262	神宇转债	385,848.51	0.57
39	123253	永贵转债	385,774.03	0.57
40	123113	仙乐转债	384,064.00	0.56
41	123257	安克转债	381,948.19	0.56
42	127050	麒麟转债	379,305.86	0.56
43	123213	天源转债	370,320.99	0.54
44	127045	牧原转债	369,914.83	0.54
45	113686	泰瑞转债	369,720.25	0.54
46	113666	爱玛转债	369,252.72	0.54
47	118037	上声转债	368,152.22	0.54
48	127040	国泰转债	366,618.99	0.54
49	123193	海能转债	363,422.40	0.53
50	113059	福莱转债	357,407.10	0.53
51	123194	百洋转债	355,702.03	0.52
52	123224	宇邦转债	355,008.95	0.52
53	123104	卫宁转债	353,357.32	0.52
54	127056	中特转债	353,255.59	0.52
55	118022	锂科转债	352,513.97	0.52
56	118052	浩瀚转债	349,149.28	0.51
57	111024	澳弘转债	347,678.24	0.51
58	127064	杭氧转债	347,220.39	0.51
59	127083	山路转债	346,136.39	0.51
60	118036	力合转债	345,024.66	0.51
61	127088	赫达转债	343,392.55	0.50
62	123192	科思转债	343,363.23	0.50
63	113067	燃 23 转债	343,152.35	0.50
64	111020	合顺转债	342,928.97	0.50
65	110085	通 22 转债	335,853.12	0.49
66	127099	盛航转债	330,009.25	0.48
67	113636	甬金转债	328,764.73	0.48
68	127096	泰坦转债	327,242.59	0.48
69	123183	海顺转债	326,397.04	0.48
70	123149	通裕转债	324,040.29	0.48
71	110099	福能转债	322,976.15	0.47
72	118056	路维转债	320,086.03	0.47
73	127105	龙星转债	319,507.53	0.47
74	110076	华海转债	318,238.03	0.47
75	113650	博 22 转债	317,775.00	0.47
76	127069	小熊转债	317,081.78	0.47
77	113062	常银转债	317,008.56	0.47

78	113640	苏利转债	316,504.45	0.47
79	127068	顺博转债	315,556.78	0.46
80	113644	艾迪转债	315,343.84	0.46
81	113631	皖天转债	315,281.10	0.46
82	111009	盛泰转债	314,782.61	0.46
83	113638	台 21 转债	310,871.39	0.46
84	127108	太能转债	310,287.09	0.46
85	127095	广泰转债	309,757.53	0.46
86	113070	渝水转债	309,504.18	0.45
87	118035	国力转债	308,004.93	0.45
88	113670	金 23 转债	307,857.10	0.45
89	123168	惠云转债	306,933.22	0.45
90	113648	巨星转债	305,787.07	0.45
91	110098	南药转债	303,979.09	0.45
92	123211	阳谷转债	303,948.12	0.45
93	118031	天 23 转债	303,334.25	0.45
94	111004	明新转债	302,598.97	0.44
95	127038	国微转债	301,252.20	0.44
96	111018	华康转债	300,849.11	0.44
97	113647	禾丰转债	300,524.03	0.44
98	123119	康泰转 2	299,881.67	0.44
99	123178	花园转债	298,340.38	0.44
100	123158	宙邦转债	297,993.97	0.44
101	123109	昌红转债	297,876.38	0.44
102	113053	隆 22 转债	297,726.78	0.44
103	132026	G 三峡 EB2	296,163.12	0.44
104	111014	李子转债	296,015.41	0.43
105	110086	精工转债	294,990.41	0.43
106	127054	双箭转债	294,229.24	0.43
107	123133	佩蒂转债	293,726.70	0.43
108	118010	洁特转债	293,500.41	0.43
109	113656	嘉诚转债	289,740.41	0.43
110	113658	密卫转债	288,510.54	0.42
111	113052	兴业转债	287,719.11	0.42
112	113605	大参转债	287,423.12	0.42
113	123150	九强转债	285,989.09	0.42
114	110077	洪城转债	285,881.30	0.42
115	123090	三诺转债	285,502.19	0.42
116	123172	漱玉转债	283,120.11	0.42
117	123252	银邦转债	282,906.85	0.42
118	113066	平煤转债	282,682.85	0.42
119	123117	健帆转债	281,082.52	0.41
120	123216	科顺转债	280,754.05	0.41

121	113655	欧 22 转债	280,427.84	0.41
122	123091	长海转债	279,503.74	0.41
123	127061	美锦转债	275,353.56	0.40
124	113632	鹤 21 转债	274,023.23	0.40
125	113688	国检转债	273,676.84	0.40
126	113627	太平转债	273,179.44	0.40
127	113682	益丰转债	272,052.82	0.40
128	111002	特纸转债	271,277.53	0.40
129	111022	锡振转债	271,082.52	0.40
130	118032	建龙转债	269,759.78	0.40
131	113696	伯 25 转债	269,100.00	0.40
132	123064	万孚转债	268,627.73	0.39
133	113049	长汽转债	267,805.14	0.39
134	113697	应流转债	264,952.47	0.39
135	123179	立高转债	264,311.01	0.39
136	110097	天润转债	263,187.95	0.39
137	127084	柳工转 2	261,260.67	0.38
138	123144	裕兴转债	260,689.15	0.38
139	113043	财通转债	260,364.66	0.38
140	127053	豪美转债	259,512.05	0.38
141	123076	强力转债	259,510.86	0.38
142	123263	鼎捷转债	257,604.12	0.38
143	113659	莱克转债	255,219.34	0.37
144	113674	华设转债	252,592.33	0.37
145	113660	寿 22 转债	251,649.33	0.37
146	123180	浙矿转债	251,259.64	0.37
147	123215	铭利转债	245,735.34	0.36
148	118050	航宇转债	245,628.23	0.36
149	127089	晶澳转债	244,035.29	0.36
150	127102	浙建转债	236,954.47	0.35
151	113633	科沃转债	235,660.66	0.35
152	127098	欧晶转债	235,228.00	0.35
153	128142	新乳转债	226,289.59	0.33
154	113051	节能转债	203,720.75	0.30
155	110084	贵燃转债	190,955.71	0.28
156	128134	鸿路转债	178,082.47	0.26
157	123071	天能转债	173,165.34	0.25
158	118012	微芯转债	144,654.22	0.21
159	113671	武进转债	126,543.18	0.19
160	123157	科蓝转债	125,454.87	0.18
161	113616	韦尔转债	112,290.96	0.16
162	123259	锦浪转 02	18,700.27	0.03
163	118013	道通转债	16,536.70	0.02

164	118015	芯海转债	1,340.01	0.00
165	113643	风语转债	1,322.80	0.00

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

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	2,396	9,908.51	101,162.07	0.43	23,639,636.31	99.57
长盛可转债 C	2,850	10,922.26	106,969.26	0.34	31,021,481.15	99.66
合计	5,246	10,459.25	208,131.33	0.38	54,661,117.46	99.62

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（即期末基金份额总额），户均持有的基金份额的合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

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	4.29	0.0000
	长盛可转债 C	0.00	0.0000
	合计	4.29	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。

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	28,522,772.76	40,898,356.26
本报告期基金总申购份额	7,301,775.54	14,574,908.01
减：本报告期基金总赎回份额	12,083,749.92	24,344,813.86
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	23,740,798.38	31,128,450.41

§ 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 2026 年 1 月 13 日第九届董事会第十五次会议决议，公司副总经理郭堃同志不再担任公司高级管理人员。郭堃同志目前是公司“首席投研专家”，专注于投研工作。公司已按规定向相关监管机构报告并发布变更公告。

10.2.2 基金经理变动情况

本报告期内本基金基金经理未曾变动。

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

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

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

本报告期内本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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人未受到调查或处罚。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人相关从业人员未受到调查或处罚。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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(%)	
华创证券	1	51,779,416.63	64.37	23,088.19	64.37	-
光大证券	1	28,665,186.46	35.63	12,781.85	35.63	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-

10.7.2 基金租用或者通过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(%)
华创证券	64,096,231.13	60.30	173,340,000.00	70.92	-	-
光大证券	42,197,941.63	39.70	71,080,000.00	29.08	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-

注：1、交易单元的选择标准

- (1) 具备监管机构规定的相关资质、财务状况良好、经营行为规范、合规风控能力较强。
 - (2) 具有较强的研究服务能力、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。
 - (3) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合证券交易的需要。
- 2、 交易单元的选择程序：
- (1) 基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。
 - (2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订协议。
- 3、本报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：
- (1) 报告期内，本基金新增租用：无。
 - (2) 报告期内，本基金停止租用：无。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长盛基金管理有限公司高级管理人员变更的公告	中国证监会指定披露媒介	2026 年 1 月 15 日
2	长盛基金管理有限公司旗下基金 2025 年 4 季度报告提示性公告	中国证监会指定披露媒介	2026 年 1 月 22 日
3	长盛可转债债券型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	中国证监会指定披露媒介	2026 年 1 月 22 日
4	长盛基金管理有限公司旗下基金 2025 年年度报告提示性公告	中国证监会指定披露媒介	2026 年 3 月 28 日
5	长盛可转债债券型证券投资基金 2025 年年度报告	中国证监会指定披露媒介	2026 年 3 月 28 日
6	长盛可转债债券型证券投资基金暂停大额申购（转换转入、定期定额投资）业务的公告	中国证监会指定披露媒介	2026 年 4 月 7 日
7	长盛可转债债券型证券投资基金收益分配公告	中国证监会指定披露媒介	2026 年 4 月 9 日
8	长盛基金管理有限公司关于旗下部分基金增加易方达财富为销售机构并参加费率优惠活动的公告	中国证监会指定披露媒介	2026 年 4 月 15 日
9	长盛基金管理有限公司关于旗下基金增加东莞农商行为销售机构并参加费率优惠的公告	中国证监会指定披露媒介	2026 年 4 月 22 日
10	长盛可转债债券型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	中国证监会指定披露媒介	2026 年 4 月 22 日
11	长盛基金管理有限公司旗下基金 2026 年 1 季度报告提示性公告	中国证监会指定披露媒介	2026 年 4 月 22 日

12	长盛可转债债券型证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会指定披露媒介	2026 年 6 月 12 日
13	长盛可转债债券型证券投资基金（长盛可转债 A 份额）基金产品资料概要更新	中国证监会指定披露媒介	2026 年 6 月 12 日
14	长盛可转债债券型证券投资基金（长盛可转债 C 份额）基金产品资料概要更新	中国证监会指定披露媒介	2026 年 6 月 12 日

§ 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

本基金本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。

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。

§ 12 备查文件目录

12.1 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。

12.2 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。

12.3 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.csfund.com.cn>。

长盛基金管理有限公司

2026 年 8 月 29 日