

长盛盛康纯债债券型证券投资基金 2022 年第 3 季度报告

2022 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：交通银行股份有限公司

报告送出日期：2022 年 10 月 26 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 10 月 25 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 2022 年 07 月 01 日起至 09 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	长盛盛康纯债		
基金主代码	003922		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2018 年 12 月 20 日		
报告期末基金份额总额	731,246,078.76 份		
投资目标	在控制风险和保持资产流动性的基础上，追求基金资产的长期稳健增值，并力争获得超过业绩比较基准的投资业绩。		
投资策略	<p>（一）大类资产配置策略</p> <p>本基金将在综合判断宏观经济周期、市场资金供需状况、大类资产估值水平对比的基础上，结合政策分析，确定不同投资期限内的大类金融资产配置和债券类属配置。同时通过严格风险评估，及时调整资产组合比例，保持资产配置风险、收益平衡，以稳健提升投资组合回报。</p> <p>（二）债券组合管理策略</p> <p>本基金债券组合管理策略包含：利率策略、类属配置策略、信用策略、相对价值策略、债券选择策略。</p>		
业绩比较基准	中债综合指数(全价)收益率		
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。		
基金管理人	长盛基金管理有限公司		
基金托管人	交通银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	长盛盛康纯债 A	长盛盛康纯债 C	长盛盛康纯债 D

下属分级基金的交易代码	003922	003923	013468
报告期末下属分级基金的份额总额	665,541,436.47 份	65,704,642.29 份	0.00 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（2022 年 7 月 1 日-2022 年 9 月 30 日）		
	长盛盛康纯债 A	长盛盛康纯债 C	长盛盛康纯债 D
1. 本期已实现收益	9,024,580.66	180,593.84	-
2. 本期利润	12,010,768.22	-77,322.27	-
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0182	-0.0055	-
4. 期末基金资产净值	741,135,196.80	72,376,068.77	-
5. 期末基金份额净值	1.1136	1.1015	1.1136

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 2022 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。

4、长盛盛康纯债债券型证券投资基金由长盛盛康灵活配置混合型证券投资基金转型而来，转型日期为 2018 年 12 月 20 日（即基金合同生效日）。

5、本基金自 2021 年 9 月 2 日起增加 D 类基金份额，并自该日起接受投资者对 D 类基金份额的申购和赎回。

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

长盛盛康纯债 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④	①-③	②-④
过去三个月	1.67%	0.06%	0.73%	0.05%	0.94%	0.01%
过去六个月	3.14%	0.05%	1.03%	0.04%	2.11%	0.01%
过去一年	5.52%	0.05%	1.73%	0.05%	3.79%	0.00%
过去三年	8.92%	0.10%	3.81%	0.07%	5.11%	0.03%

自基金转型 起至今	11.28%	0.09%	4.97%	0.06%	6.31%	0.03%
--------------	--------	-------	-------	-------	-------	-------

长盛盛康纯债 C

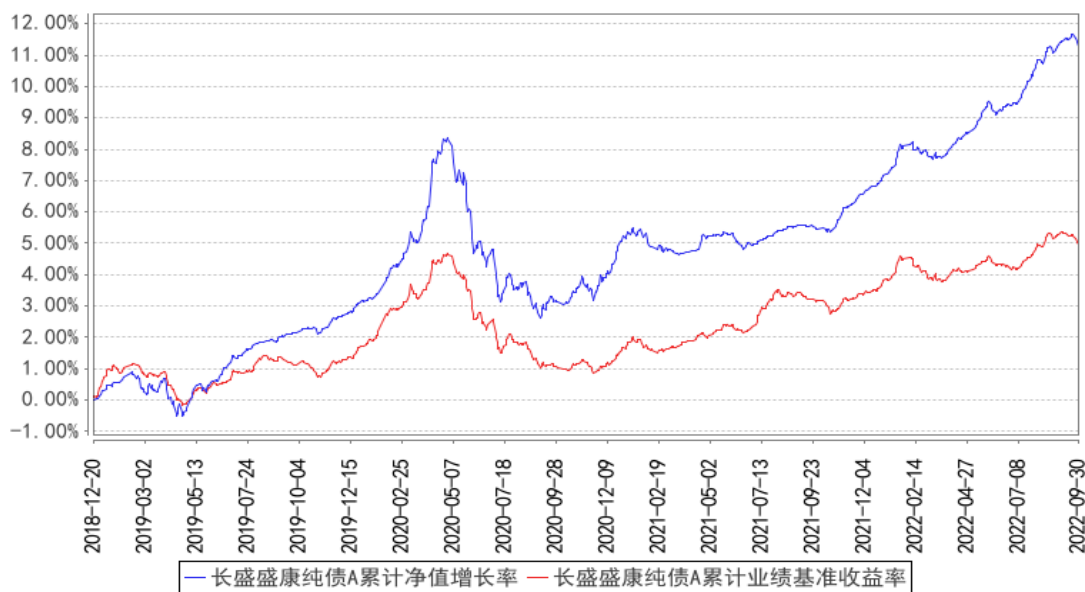
阶段	净值增长率①	净值增长率标准 差②	业绩比较基准 收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①—③	②—④
过去三个月	1.63%	0.06%	0.73%	0.05%	0.90%	0.01%
过去六个月	3.07%	0.05%	1.03%	0.04%	2.04%	0.01%
过去一年	5.40%	0.05%	1.73%	0.05%	3.67%	0.00%
过去三年	8.41%	0.10%	3.81%	0.07%	4.60%	0.03%
自基金转型 起至今	10.08%	0.33%	4.97%	0.06%	5.11%	0.27%

长盛盛康纯债 D

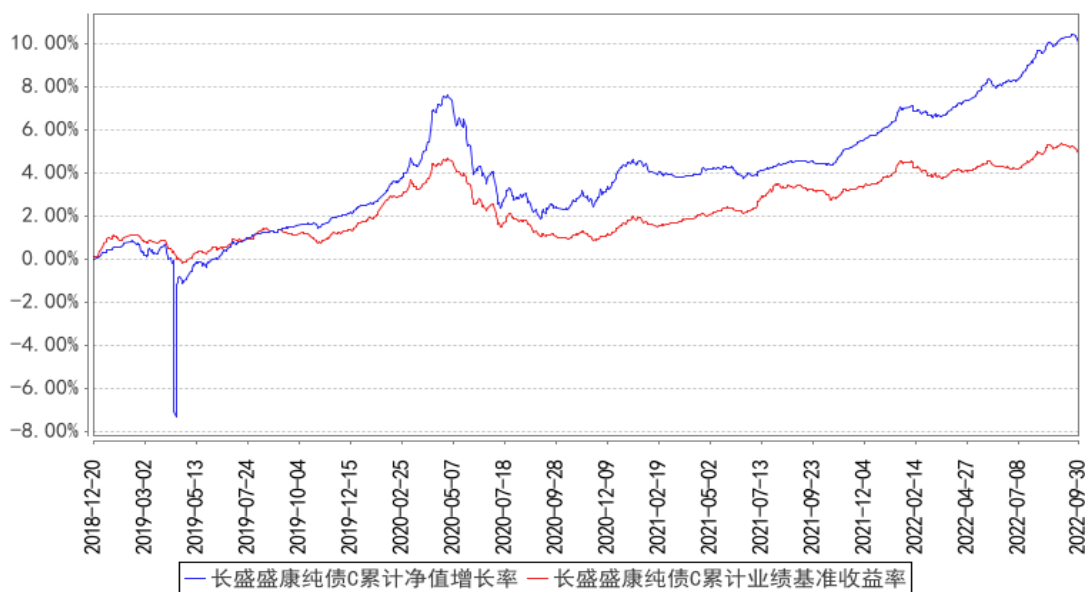
阶段	净值增长率①	净值增长率标准 差②	业绩比较基准 收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①—③	②—④
过去三个月	1.67%	0.06%	0.73%	0.05%	0.94%	0.01%
过去六个月	3.14%	0.05%	1.03%	0.04%	2.11%	0.01%
过去一年	5.52%	0.05%	1.73%	0.05%	3.79%	0.00%
自基金新增 本类份额起 至今	5.39%	0.05%	1.49%	0.05%	3.90%	0.00%

3.2.2 自基金转型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

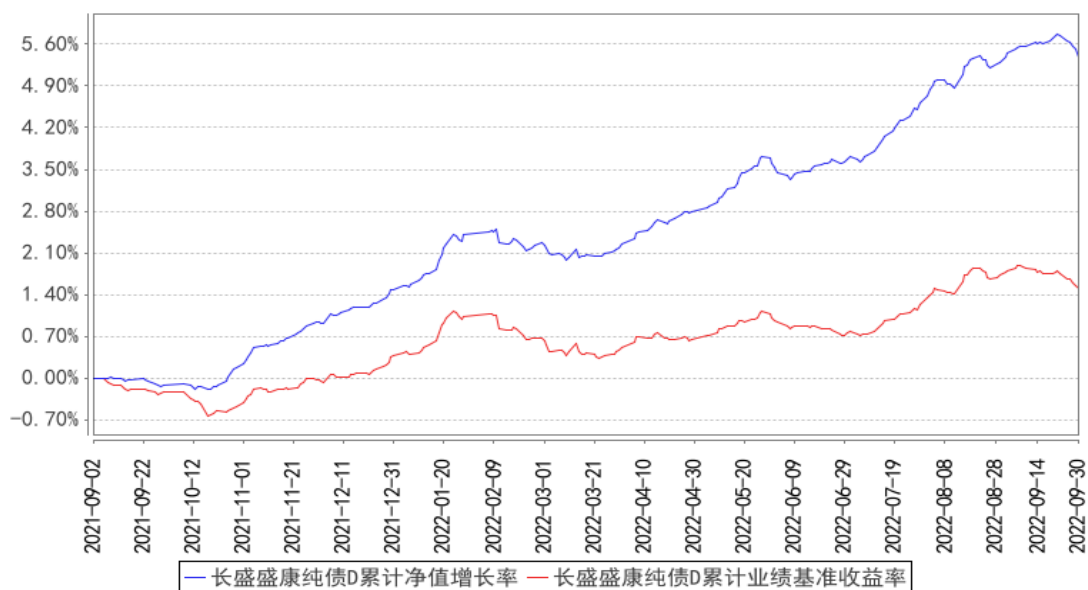
长盛盛康纯债A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



长盛盛康纯债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



长盛盛康纯债D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：1、长盛盛康纯债债券型证券投资基金由长盛盛康灵活配置混合型证券投资基金转型而来，转型日期为 2018 年 12 月 20 日（即基金合同生效日）。

2、按照本基金合同规定，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		
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，长盛盛世灵活配置混合型证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。	2019年11月25日	-	17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。

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

三季度，债市先扬后抑。7 月至 8 月上旬，资金面极度宽松，经济修复偏弱，地产风波发酵，叠加多地疫情反复，债市表现偏强，10 年期国债收益率由 7 月初 2.8% 上方下行至 2.7% 附近。8 月中旬，公布的 7 月金融和经济数据明显低于预期，央行超预期降息 10bp，债市表现强势，10 年期国债收益率快速下行突破 2.7% 至 2.6% 附近。8 月下旬以来，国内疫情边际好转，稳增长接续政策陆续推出带动宽信用预期升温，资金面持续收敛，美联储激进加息预期令 10 年期美债收益率快速攀升逼近 4%，人民币汇率快速贬值令国内货币政策承压，多重利空因素共振令债市回调，10 年期国债收益率上行至 2.75% 附近。

2、报告期内本基金投资策略分析

报告期内，本基金主要投资于中高等级信用债，并根据市场形势变化择时参与利率债波段交易，适时调整组合久期和仓位，以实现组合收益的稳健增长。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末长盛盛康纯债 A 的基金份额净值为 1.1136 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.67%，同期业绩比较基准收益率为 0.73%；截至本报告期末长盛盛康纯债 C 的基金份额净值为 1.1015 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.63%，同期业绩比较基准收益率为 0.73%；截至本报告期末长盛盛康纯债 D 的基金份额净值为 1.1136 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.67%，同期业绩比较基准收益率为 0.73%。

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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,099,215,515.21	97.13
	其中：债券	1,081,030,221.80	95.52
	资产支持证券	18,185,293.41	1.61
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	8,879,239.07	0.78
8	其他资产	23,633,073.05	2.09
9	合计	1,131,727,827.33	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

本基金本报告期末未持有境内投资股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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	107,258,529.19	13.18
2	央行票据	-	-
3	金融债券	384,376,852.31	47.25
	其中：政策性金融债	41,711,195.87	5.13
4	企业债券	223,563,538.86	27.48
5	企业短期融资券	10,381,726.03	1.28
6	中期票据	355,449,575.41	43.69
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,081,030,221.80	132.88

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	2020044	20 宁波银行二级	600,000	62,482,372.60	7.68
2	188153	21 首创 01	590,000	60,374,897.21	7.42
3	188854	21 兴业 C1	500,000	52,735,164.39	6.48
4	220008	22 附息国债 08	500,000	52,151,502.73	6.41
5	102280679	22 鲁能源 MTN003A(可持续挂钩)	500,000	51,662,424.66	6.35

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

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	135450	龙知 3A1	130,000	13,027,025.75	1.60
2	136356	度小满 5A	100,000	5,158,267.66	0.63

注：本基金本报告期末仅持有上述 2 只资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

一、20 宁波银行二级

2021 年 12 月 31 日，甬银保监罚决字（2021）81 号显示，宁波银行股份有限公司存在信用卡业务管理不到位的违法违规事实，被处罚款 30 万元。2022 年 4 月 18 日，甬银保监罚决字（2022）28 号显示，宁波银行股份有限公司存在信贷资金违规流入房地产领域等违法违规事实，被处罚款 220 万元；甬银保监罚决字（2022）30 号显示，宁波银行股份有限公司存在代理保险销售不规范等违法违规事实，被处罚款 30 万元。2022 年 4 月 23 日，甬银保监罚决字（2022）35 号显示，宁波银行股份有限公司存在薪酬管理不到位等违法违规事实，被处罚款 270 万元。2022 年 5 月 27 日，甬银保监罚决字（2022）44 号显示，宁波银行股份有限公司存在非标投资业务管理不审慎等

违法违规事实，被处罚款 290 万元。2022 年 9 月 9 日，甬银保监罚决字〔2022〕60 号显示，宁波银行股份有限公司存在柜面业务内控管理不到位等违法违规事实，被处罚款 25 万元。对以上事件，本基金判断，宁波银行股份有限公司经营稳健，上述处罚对公司影响可控。后续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。

二、21 兴业 C1

2021 年 10 月，中国证券监督管理委员会福建监管局关于对兴业证券股份有限公司采取出具警示函措施的决定：经查，你公司发布的研究报告《医美行业深度：举重若“轻”，求美有方》存在以下问题：一是研究报告个别内容数据列示错误、文字表述不严谨，未准确标明个别数据出处，就同一数据的列示或预测，你公司同期发布的不同研究报告存在差异。二是存在具体判断或观点论述不够严密的情况，表现为个别具体观点分析依据不充分、以偏概全，个别行业发展趋势的结论基于一家公司的财务数据推论而出、不够严密。三是底稿未记录个别数据的演算方法与过程。上述问题违反了《发布证券研究报告暂行规定(2020 年修订)》(证监会公告〔2020〕20 号，以下简称《暂行规定》)第三条、第八条第(六)项、第九条、第十八条，以及《证券、期货投资咨询管理暂行办法》(证委发〔1997〕96 号)第二十五条第一款的相关规定，反映了你公司对该研究报告的质量控制和合规审查不到位。根据《暂行规定》第二十二条的规定，我局决定对你公司采取出具警示函的行政监管措施。你公司应采取切实有效的措施对上述问题进行整改，完善内部控制，重视研究报告质量控制工作，切实提升研究质量和专业服务水平。你公司应于 2021 年 11 月 15 日前向我局提交书面整改报告。

对以上事件，本基金判断，兴业证券在行业内仍排名靠前，规模优势显著，上述处罚对公司影响可控。

三、22 东北 01

2022 年 6 月 29 日，东北证券股份有限公司（以下简称“公司”）收到中国证券监督管理委员会吉林监管局《关于对东北证券股份有限公司采取责令改正措施的决定》（吉证监决〔2022〕5 号），具体内容如下：“经查，你公司存在以下行为：一是在部分证券交易单元租用协议未明确约定提供研究成果义务的情况下，将部分证券交易席位租赁收入确认为投资咨询业务收入；二是未在 2021 年年报中披露投资咨询业务收入变动异常的原因。上述行为不符合《关于证券公司会计核算有关问题的通知》（会计部函〔2010〕1 号）《证券公司年度报告内容与格式准则》《证券公司监督管理条例》第六十九条和《证券公司内部控制指引》第二十二条的规定。根据《证券公司监督管理条例》第七十条的规定，决定对你公司采取责令改正的行政监管措施。你公司应对上述问题予以整改，并于收到本决定之日起 1 个月内向我局提交书面整改报告。对以上事件，本基金判断，东北证券

经营相对稳健，行业内竞争优势仍在，上述处罚对公司影响可控。

四、20 广发银行二级 01

2022 年 3 月 25 日，银保监罚决字（2022）23 号显示，广发银行股份有限公司存在逾期 90 天以上贷款余额 EAST 数据存在偏差等 16 项违法违规事实，被处罚款 420 万元。对以上事件，本基金判断，广发银行股份有限公司经营稳健，上述处罚对公司影响可控。后续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。

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

本基金本报告期末未持有股票。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	10,298.61
2	应收证券清算款	22,862,430.91
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	760,343.53
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	23,633,073.05

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

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	长盛盛康纯债 A	长盛盛康纯债 C	长盛盛康纯债 D
报告期期初基金份额总额	656,915,203.87	3,103,127.48	-

报告期期间基金总申购份额	8,948,694.98	70,608,435.31	-
减:报告期期间基金总赎回份额	322,462.38	8,006,920.50	-
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	665,541,436.47	65,704,642.29	-

§ 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	20220701~20220930	656,646,679.48	-	-	656,646,679.48	89.80

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、长盛盛康纯债债券型证券投资基金相关批准文件;
- 2、《长盛盛康纯债债券型证券投资基金基金合同》;
- 3、《长盛盛康纯债债券型证券投资基金托管协议》;
- 4、《长盛盛康纯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和/或基金托管人的办公地址。

9.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公地址和/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

2022 年 10 月 26 日