

长盛盛逸 9 个月持有期债券型证券投资基金
金
2023 年中期报告

2023 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：2023 年 8 月 30 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，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 2023 年 08 月 29 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 2023 年 04 月 26 日（基金合同生效日）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	5
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	10
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	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§ 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内容的真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
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	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	40
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	40

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	40
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	40
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	40
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	41
§ 8 基金份额持有人信息	42
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	42
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	42
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	43
§ 9 开放式基金份额变动	43
§ 10 重大事件揭示	43
10.1 基金份额持有人大会决议	43
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	43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	44
10.4 基金投资策略的改变	44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	44
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	44
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	44
10.8 其他重大事件	46
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	47
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	47
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	47
§ 12 备查文件目录	47
12.1 备查文件目录	47
12.2 存放地点	48
12.3 查阅方式	48

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长盛盛逸 9 个月持有期债券型证券投资基金	
基金简称	长盛盛逸 9 个月持有期债券	
基金主代码	017137	
基金运作方式	本基金为契约型开放式，但对每份基金份额设置 9 个月的最短持有期限	
基金合同生效日	2023 年 4 月 26 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	1,954,003,579.21 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	长盛盛逸 9 个月持有期债券 A	长盛盛逸 9 个月持有期债券 C
下属分级基金的交易代码	017137	017138
报告期末下属分级基金的 份额总额	1,022,465,537.15 份	931,538,042.06 份

2.2 基金产品说明

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</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括利率策略、类属配置策略、信用策略、相对价值策略、债券选择策略、可转换债券及可交换债券投资策略。</p> <p>（三）国债期货投资策略</p> <p>本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对债券交易市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。</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，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。

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	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.csfunds.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人的办公地址及基金托管人住所

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	2023 年 4 月 26 日（基金合同生效日）-2023 年 6 月 30 日	
	长盛盛逸 9 个月持有期债券 A	长盛盛逸 9 个月持有期债券 C
本期已实现收益	5,272,572.67	4,597,790.92
本期利润	4,957,932.50	4,300,912.40
加权平均基金份额本期利润	0.0052	0.0047
本期加权平均净值利润率	0.51%	0.47%
本期基金份额净值增长率	0.50%	0.47%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	5,154,162.31	4,366,032.33
期末可供分配基金份额利润	0.0050	0.0047
期末基金资产净值	1,027,619,699.46	935,904,074.39
期末基金份额净值	1.0050	1.0047
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	0.50%	0.47%

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。

4、本基金基金合同生效日为 2023 年 4 月 26 日，截至本报告期末本基金成立未满一年。

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

长盛盛逸 9 个月持有期债券 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	0.28%	0.03%	0.18%	0.05%	0.10%	-0.02%
自基金合同生效起至今	0.50%	0.03%	0.69%	0.04%	-0.19%	-0.01%

长盛盛逸 9 个月持有期债券 C

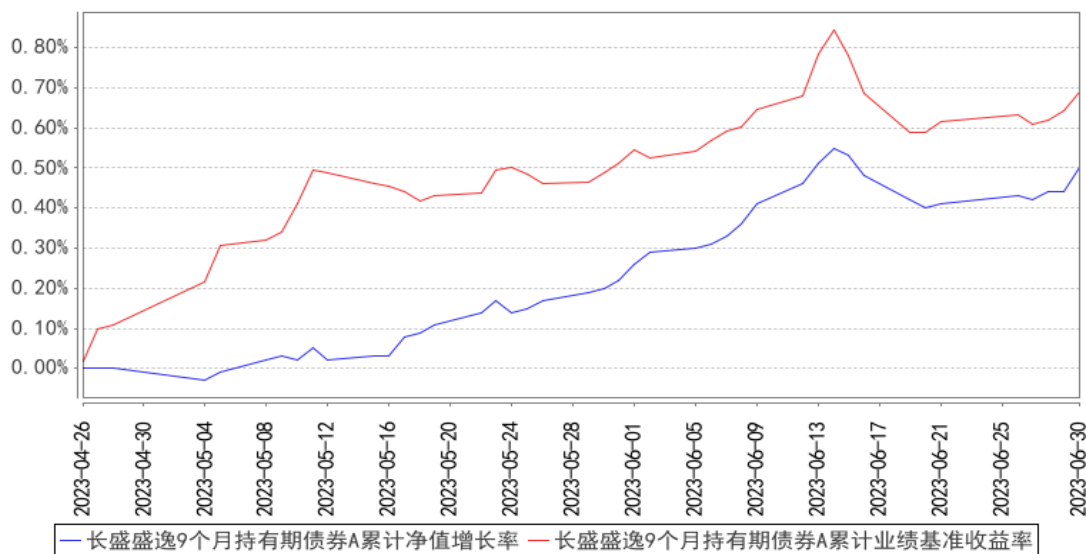
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.27%	0.03%	0.18%	0.05%	0.09%	-0.02%
自基金合同生效起至今	0.47%	0.03%	0.69%	0.04%	-0.22%	-0.01%

注：本基金业绩比较基准为：中债综合指数（全价）收益率

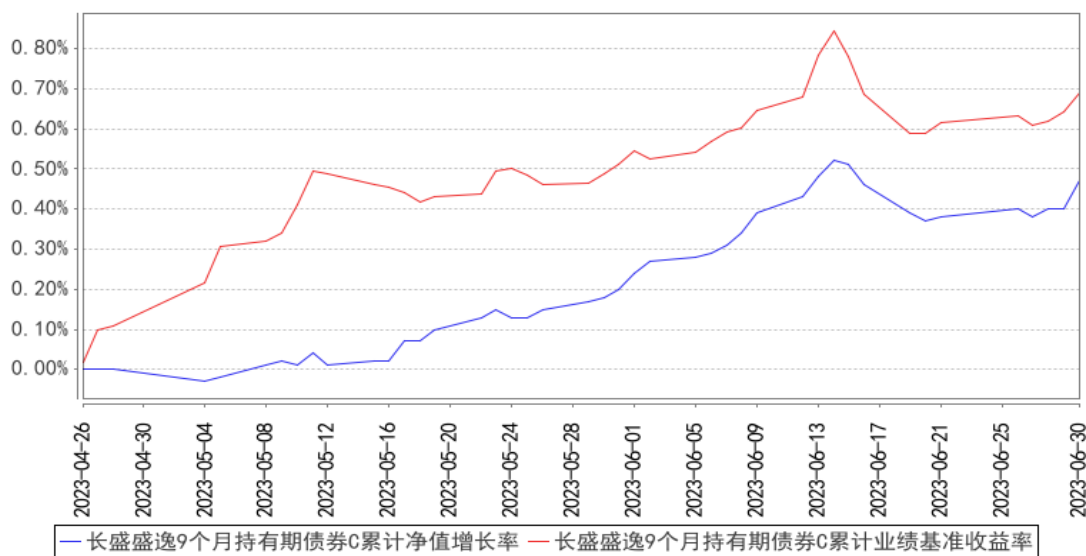
中债综合指数（全价）由中央国债登记结算有限责任公司编制并发布，该指数样本具有广泛的市场代表性，涵盖了主要交易市场（银行间市场、交易所市场等）、不同发行主体（政府、企业等）和期限（长期、中期、短期等）。鉴于中债综合指数（全价）能够反映债券全市场的整体价格和投资回报情况，所以以其收益率作为本基金的业绩比较基准。

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

长盛盛逸9个月持有期债券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



长盛盛逸9个月持有期债券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：1、本基金基金合同生效日为 2023 年 4 月 26 日，截至本报告期末本基金成立未满一年。

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有关约定。截止本报告期末本基金仍处于建仓期。

3、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%；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。国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。如法律法规或监管机

构以后允许基金投资其他品种或对投资比例要求有变更的，基金管理人在履行适当程序后，可以做出相应调整。

§ 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。长盛基金总部办公地位于北京，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（DBS）有限公司占注册资本的 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 2023 年 6 月 30 日，基金管理人共管理七十只开放式基金，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		
王贵君	本基金基金经理 长盛盛裕纯债债券型证券投资基金基金经理 长盛安逸纯债债券型证券投资基金基金经理 长盛盛和纯债债券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 长盛稳益 6 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理 长盛稳鑫 63 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。	2023 年 4 月 26 日	-	11 年	王贵君先生，硕士。曾任中债资信评估有限责任公司评级分析师，上投摩根基金管理有限公司债券研究员，2017 年 6 月加入长盛基金管理有限公司，历任投资经理、专户理财部副总监、基金经理等。

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

上半年，债市收益率先上后下，整体震荡走强，基本分为三个阶段：

第一阶段：春节前，受资金面边际收紧和经济复苏预期的压制，收益率震荡上行；

第二阶段：春节后至一季度末，经济复苏斜率不及预期，欠配压力普遍存在，债市收益率见顶回落，但仍处于窄幅震荡行情。

第三阶段：二季度市场环境整体有利于债市。宏观方面，PMI 连续低于荣枯线，社融、CPI 等数据接连低于预期，显示内生需求明显转弱；同时，人民币汇率贬值压力有所加大，压制市场风险偏好。流动性方面，货币政策维持合理充裕的基调，狭义流动性中枢相比于一季度边际有所改善。政策方面，国有大行牵头下调存款挂牌利率，6 月央行行长重提“逆周期调节”后降息快速落地。期间，收益率快速下行，10 年国债收益率最低触及 2.6% 整数关口，期限利差温和走扩。

信用债方面，一季度信用债市场呈现较明显的修复行情，信用利差大幅压缩，信用债表现好于利率债。二季度信用利差略有上行，整体处于低位水平，市场走势相对均衡。

报告期内，本基金在操作中严格遵守基金合同要求构建投资组合。二季度基金成立以来，组合根据市场环境变化控制建仓节奏，当前组合配置较高比例的高等级信用债，持有少量可转债仓位且以顺周期板块为主。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末长盛盛逸 9 个月持有期债券 A 的基金份额净值为 1.0050 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.50%，同期业绩比较基准收益率为 0.69%；截至本报告期末长盛盛逸 9 个月持有期债券 C 的基金份额净值为 1.0047 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.47%，同期业绩比较基准收益率为 0.69%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

7 月政治局会议基调整体略超市场预期，地产、资本市场、地方债务问题受到市场广泛关注，密切关注政策后续落地情况。

短期看，由于股市信心提振、对地产政策预期的担忧，债市有一定调整压力。考虑到经济基本面出现实质扭转仍待观察，货币政策层面大概率稳中偏松，同时考虑到防风险方面，地方政府债务防范化解也需要低利率环境配合，债市趋势走熊的概率不高。

信用债方面，本次政治局会议提及“制定实施一揽子化债方案”，有望出台再融资债发行、存量债务展期降息、贷款置换等政策，城投债短期的风险大概率得到一定缓解。

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、公司业务运营部分管领导、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。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已分别与中债金融估值中心有限公司和中证指数有限公司签署服务协议，由其分别按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种和在交易所市场交易或挂牌的部分债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同对基金利润分配原则的约定，本基金于本报告期内未进行利润分配。

本基金截至 2023 年 06 月 30 日期末可供分配利润为 9,520,194.64 元，其中：长盛盛逸 9 个月持有期债券 A 期末可供分配利润为 5,154,162.31 元（长盛盛逸 9 个月持有期债券 A 的未分配利润已实现部分为 5,477,046.76 元，未分配利润未实现部分为 -322,884.45 元），长盛盛逸 9 个月持有期债券 C 期末可供分配利润为 4,366,032.33 元（长盛盛逸 9 个月持有期债券 C 的未分配利润已实现部分为 4,659,881.10 元，未分配利润未实现部分为 -293,848.77 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”）在长盛盛逸 9 个月持有期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：长盛盛逸 9 个月持有期债券型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日
资产：		
银行存款	6.4.7.1	710,272.31
结算备付金		26,287,225.64
存出保证金		101,568.12
交易性金融资产	6.4.7.2	2,654,825,190.39
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		2,654,825,190.39
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	-
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		-
应收股利		-
应收申购款		80,451.15
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.8	-
资产总计		2,682,004,707.61
负债和净资产	附注号	本期末 2023年6月30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		717,210,257.49
应付清算款		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		640,940.07
应付托管费		160,235.03
应付销售服务费		153,106.23
应付投资顾问费		-
应交税费		267,880.74
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.9	48,514.20
负债合计		718,480,933.76
净资产：		
实收基金	6.4.7.10	1,954,003,579.21
其他综合收益	6.4.7.11	-
未分配利润	6.4.7.12	9,520,194.64
净资产合计		1,963,523,773.85
负债和净资产总计		2,682,004,707.61

注：1、报告截止日 2023 年 06 月 30 日，长盛盛逸 9 个月持有期债券 A 的基金份额净值为 1.0050 元，份额总额为 1,022,465,537.15 份；长盛盛逸 9 个月持有期债券 C 的基金份额净值为 1.0047

元，份额总额为 931,538,042.06 份。基金份额总额 1,954,003,579.21 份。

2、本基金基金合同生效日为 2023 年 4 月 26 日，无上年度可比期间。

6.2 利润表

会计主体：长盛盛逸 9 个月持有期债券型证券投资基金

本报告期：2023 年 4 月 26 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2023 年 4 月 26 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		12,853,301.61
1. 利息收入		1,636,357.03
其中：存款利息收入	6.4.7.13	107,596.14
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		1,528,760.89
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		11,828,463.27
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.15	11,828,463.27
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-
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	-
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-
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	-611,518.69
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	-
减：二、营业总支出		3,594,456.71
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,335,788.80
2. 托管费	6.4.10.2.2	333,947.19
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	325,227.29
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		1,536,437.83
其中：卖出回购金融资产支出		1,536,437.83
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-
7. 税金及附加		37,896.99

8. 其他费用	6.4.7.23	25,158.61
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		9,258,844.90
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		9,258,844.90
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		9,258,844.90

注：本基金基金合同生效日为 2023 年 4 月 26 日，无上年度可比期间。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：长盛盛逸 9 个月持有期债券型证券投资基金

本报告期：2023 年 4 月 26 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 4 月 26 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、基金合同生效日净资产（基金净值）	1,755,175,425.48	-	-	1,755,175,425.48
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	198,828,153.73	-	9,520,194.64	208,348,348.37
（一）、综合收益总额	-	-	9,258,844.90	9,258,844.90
（二）、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）	198,828,153.73	-	261,349.74	199,089,503.47
其中：1. 基金申购款	198,828,153.73	-	261,349.74	199,089,503.47
2. 基金赎回款	-	-	-	-
（三）、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）				
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	1,954,003,579.21	-	9,520,194.64	1,963,523,773.85

注：本基金基金合同生效日为 2023 年 4 月 26 日，无上年度可比期间。

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

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

长盛盛逸 9 个月持有期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（2022）2537 号的注册，由长盛基金管理有限公司于自 2023 年 4 月 6 日至 2023 年 4 月 24 日向社会公开募集。募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验资并出具（2023）验字第 60468688_A02 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2023 年 4 月 26 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。截至 2023 年 4 月 26 日止，长盛盛逸 9 个月持有期债券 A 类基金份额已收到首次募集扣除认购费后的有效净认购金额为人民币 869,653,355.88 元，折合 869,653,355.88 份长盛盛逸 9 个月持有期债券 A 类基金份额；有效认购款项在募集期间产生的利息为人民币 233,574.97 元，折合 233,574.97 份长盛盛逸 9 个月持有期债券 A 类基金份额；以上收到的实收基金共计人民币 869,886,930.85 元，折合 869,886,930.85 份长盛盛逸 9 个月持有期债券 A 类基金份额。长盛盛逸 9 个月持有期债券 C 类基金份额已收到首次募集扣除认购费后的有效净认购金额为人民币 885,069,062.30 元，折合 885,069,062.30 份长盛盛逸 9 个月持有期债券 C 类基金份额；有效认购款项在募集期间产生的利息为人民币 219,432.33 元，折合 219,432.33 份长盛盛逸 9 个月持有期债券 C 类基金份额；以上收到的实收基金共计人民币 885,288,494.63 元，折合 885,288,494.63 份长盛盛逸 9 个月持有期债券 C 类基金份额。长盛盛逸 9 个月持有期债券 A 类基金份额和 C 类基金份额收到的实收基金合计人民币 1,755,175,425.48 元，分别折合成 A 类及 C 类基金份额，合计折合 1,755,175,425.48 份长盛盛逸 9 个月持有期债券基金份额。本基金的基金管理人和注册登记机构为长盛基金管理有

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。在投资者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。

本基金主要投资于固定收益类金融工具，包括债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、证券公司短期公司债券、政府支持机构债券及政府支持债、可转换债券(含可分离交易可转债)、可交换债券等债券及其他经中国证监会允许基金投资的债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款、通知存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具、国债期货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相关规定)。本基金不直接投资于股票等资产，但可参与可转换债券(含可分离交易可转债)、可交换债券的投资。因所持可转换债券转股或可交换债券换股形成的股票，本基金将在其可交易之日起的 10 个交易日内卖出。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：本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%；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。国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种或对投资比例要求有变更的，基金管理人在履行适当程序后，可以做出相应调整。本基金的业绩比较基准为：中债综合指数（全价）收益率。

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《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》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半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〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和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 2023 年 06 月 30 日的财务状况以及 2023 年 04 月 26 日（基金合同生效日）至 2023 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本期财务报表的实际编制期间系自 2023 年 4 月 26 日（基金合同生效日）起至 2023 年 6 月 30 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

(2) 金融负债分类

除由于金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债以外，本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，其公

允价值变动形成的利得或损失计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具），按照公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具

体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或预期收益率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除

适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致本基金资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时予以确认。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- (2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- (3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

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 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；

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；

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。

6.4.6.2 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。

6.4.6.3 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；

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	710,272.31
等于：本金	709,766.82
加：应计利息	505.49
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	710,272.31

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 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	673,059,417.46	6,624,318.09	678,775,734.82	-908,000.73
	银行间市场	1,950,405,017.96	25,347,955.57	1,976,049,455.57	296,482.04
	合计	2,623,464,435.42	31,972,273.66	2,654,825,190.39	-611,518.69
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	2,623,464,435.42	31,972,273.66	2,654,825,190.39	-611,518.69	

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

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 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	29,674.20
其中：交易所市场	-
银行间市场	29,674.20
应付利息	-
预提费用	18,840.00
合计	48,514.20

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

长盛盛逸 9 个月持有期债券 A

项目	本期 2023 年 4 月 26 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	869,886,930.85	869,886,930.85
本期申购	152,578,606.30	152,578,606.30
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
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	1,022,465,537.15	1,022,465,537.15

长盛盛逸 9 个月持有期债券 C

项目	本期 2023 年 4 月 26 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	885,288,494.63	885,288,494.63
本期申购	46,249,547.43	46,249,547.43
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
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	931,538,042.06	931,538,042.06

注：1、本基金合同生效日为 2023 年 4 月 26 日。

2、本基金设立时，长盛盛逸 9 个月持有期债券 A 类基金份额已收到首次募集扣除认购费后的有效净认购金额为人民币 869,653,355.88 元，折合 869,653,355.88 份长盛盛逸 9 个月持有期债

券 A 类基金份额；有效认购款项在募集期间产生的利息为人民币 233,574.97 元，折合 233,574.97 份长盛盛逸 9 个月持有期债券 A 类基金份额；以上收到的实收基金共计人民币 869,886,930.85 元，折合 869,886,930.85 份长盛盛逸 9 个月持有期债券 A 类基金份额。长盛盛逸 9 个月持有期债券 C 类基金份额已收到首次募集扣除认购费后的有效净认购金额为人民币 885,069,062.30 元，折合 885,069,062.30 份长盛盛逸 9 个月持有期债券 C 类基金份额；有效认购款项在募集期间产生的利息为人民币 219,432.33 元，折合 219,432.33 份长盛盛逸 9 个月持有期债券 C 类基金份额；以上收到的实收基金共计人民币 885,288,494.63 元，折合 885,288,494.63 份长盛盛逸 9 个月持有期债券 C 类基金份额。长盛盛逸 9 个月持有期债券 A 类基金份额和 C 类基金份额收到的实收基金合计人民币 1,755,175,425.48 元，分别折合成 A 类及 C 类基金份额，合计折合 1,755,175,425.48 份长盛盛逸 9 个月持有期债券基金份额。

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

长盛盛逸 9 个月持有期债券 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	5,272,572.67	-314,640.17	4,957,932.50
本期基金份额交易产生的变动数	204,474.09	-8,244.28	196,229.81
其中：基金申购款	204,474.09	-8,244.28	196,229.81
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,477,046.76	-322,884.45	5,154,162.31

长盛盛逸 9 个月持有期债券 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	4,597,790.92	-296,878.52	4,300,912.40
本期基金份额交易产生的变动数	62,090.18	3,029.75	65,119.93
其中：基金申购款	62,090.18	3,029.75	65,119.93
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,659,881.10	-293,848.77	4,366,032.33

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期

	2023 年 4 月 26 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	67,620.83
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	39,823.57
其他	151.74
合计	107,596.14

6.4.7.14 股票投资收益

无。

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 2023年4月26日（基金合同生效日）至2023年6月 30日
债券投资收益——利息收入	11,999,658.96
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-171,195.69
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	11,828,463.27

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 2023年4月26日（基金合同生效日）至2023年6月 30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	215,586,654.24
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	212,781,120.97
减：应计利息总额	2,953,499.39
减：交易费用	23,229.57
买卖债券差价收入	-171,195.69

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

无。

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023 年 4 月 26 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-611,518.69
股票投资	-
债券投资	-611,518.69
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	-611,518.69

6.4.7.21 其他收入

无。

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
	2023 年 4 月 26 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	15,840.00
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行费用	5,918.61
账户维护费	3,000.00
开户费	400.00
合计	25,158.61

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

截至财务报表批准日，本基金无需要说明的重大资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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”）	基金管理人的股东、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
	2023 年 4 月 26 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,335,788.80
其中：支付销售机构的客户维护费	637,237.05

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 0.40% 的年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% / \text{当年天数}$$

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
	2023 年 4 月 26 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	333,947.19

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日基金资产净值的 0.1% 的年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% / \text{当年天数}$$

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 2023 年 4 月 26 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长盛盛逸 9 个月持有期 债券 A	长盛盛逸 9 个月持有期 债券 C	合计
长盛基金公司	-	3.55	3.55
中国银行	-	284,181.29	284,181.29
国元证券	-	36,381.26	36,381.26
合计	-	320,566.10	320,566.10

注：基金销售服务费每日计提，按月支付。基金销售服务费可用于本基金的市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。本基金分为不同的类别，适用不同的销售服务费率。其中，本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

H 为 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

6.4.10.3 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自有资金投资本基金的情况

本基金本报告期无基金管理人运用自有资金投资本基金的情况。

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 2023 年 4 月 26 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行	710,272.31	67,620.83
合计	710,272.31	67,620.83

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。

6.4.10.7 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

无。

6.4.12 期末（2023 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

无。

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

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 697,203,528.73 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
101801419	18 鲁钢铁 MTN007	2023 年 7 月 3 日	106.03	650,000	68,916,650.69
102280338	22 首钢 MTN002	2023 年 7 月 3 日	102.24	600,000	61,342,816.44
102281773	22 首钢 MTN005	2023 年 7 月 3 日	103.29	1,200,000	123,942,930.41
2028051	20 浦发银行 永续债	2023 年 7 月 3 日	106.91	250,000	26,727,602.74
102101057	21 淄博城资 MTN001	2023 年 7 月 4 日	100.40	500,000	50,201,524.59
102380953	23 河钢股 MTN001	2023 年 7 月 4 日	101.90	430,000	43,815,928.53
102381077	23 河钢集 MTN006	2023 年 7 月 4 日	101.31	480,000	48,626,643.94
102381212	23 淄博城运 MTN002A	2023 年 7 月 4 日	100.64	100,000	10,064,393.44
102381213	23 淄博城运 MTN002B	2023 年 7 月 4 日	100.18	500,000	50,088,590.16
2080136	20 海国资 01	2023 年 7 月 4 日	101.67	500,000	50,837,185.79
101901629	19 吉林高速 MTN003	2023 年 7 月 6 日	104.82	400,000	41,929,797.26
102280908	22 济南城建 MTN002	2023 年 7 月 6 日	101.08	500,000	50,539,699.45
101901607	19 甘公投 MTN004	2023 年 7 月 7 日	103.27	600,000	61,964,189.59
102280315	22 首创集 MTN001	2023 年 7 月 7 日	101.76	1,000,000	101,757,890.41
合计				7,710,000	790,755,843.44

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 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 20,006,728.76 元，于 2023 年 7 月 3 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。

6.4.12.4 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

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基

金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以董事会风险控制委员会为核心的，由董事会风险控制委员会、经营管理层及各具体业务部门组成的三道风险监控防线；并在后两道监控防线中，由独立于公司管理层和其他业务部门的督察长和监察稽核部对公司合规风险状况及各部门风险控制措施进行检查、监督及报告。

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 2023 年 6 月 30 日
A-1	-
A-1 以下	-
未评级	186,516,169.75
合计	186,516,169.75

注：表中所列示的未评级债券投资为短期融资券、超短期融资券、国债。

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 2023 年 6 月 30 日
--------	------------------------

AAA	1,692,296,662.45
AAA 以下	295,953,179.00
未评级	480,059,179.19
合计	2,468,309,020.64

注：长期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由债券发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。表中所列示的债券投资为除短期融资券、超短期融资券以外的债券，未评级部分为政策性金融债、公司债和中期票据。

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 2023 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	709,766.82	-	-	505.49	710,272.31
结算备付金	26,276,583.59	-	-	10,642.05	26,287,225.64
存出保证金	101,526.99	-	-	41.13	101,568.12
交易性金融资产	597,195,000.00	1,857,004,771.90	168,653,144.83	31,972,273.66	2,654,825,190.39
应收申购款	-	-	-	80,451.15	80,451.15
资产总计	624,282,877.40	1,857,004,771.90	168,653,144.83	32,063,913.48	2,682,004,707.61
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	640,940.07	640,940.07
应付托管费	-	-	-	160,235.03	160,235.03
卖出回购金融资产款	716,997,674.50	-	-	212,582.99	717,210,257.49
应付销售服务费	-	-	-	153,106.23	153,106.23
应交税费	-	-	-	267,880.74	267,880.74
其他负债	-	-	-	48,514.20	48,514.20
负债总计	716,997,674.50	-	-	1,483,259.26	718,480,933.76
利率敏感度缺口	-92,714,797.10	1,857,004,771.90	168,653,144.83	30,580,654.22	1,963,523,773.85

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约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

于本报告期末，本基金成立未满一年，尚无充足的经验数据。

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。本基金投资于固定收益类品种，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 2023年6月30日
第一层次	194,838,686.58
第二层次	2,459,986,503.81
第三层次	-
合计	2,654,825,190.39

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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。本基金本报告期持有的持续以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

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	2,654,825,190.39	98.99
	其中：债券	2,654,825,190.39	98.99
	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	26,997,497.95	1.01
8	其他各项资产	182,019.27	0.01
9	合计	2,682,004,707.61	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末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细**

本基金本报告期内未进行股票投资。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未进行股票投资。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未进行股票投资。

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	106,165,126.03	5.41
2	央行票据	-	-
3	金融债券	270,076,685.07	13.75
	其中：政策性金融债	20,192,950.82	1.03
4	企业债券	317,776,568.27	16.18
5	企业短期融资券	80,351,043.72	4.09
6	中期票据	1,685,617,080.72	85.85
7	可转债（可交换债）	194,838,686.58	9.92
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,654,825,190.39	135.21

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	102281773	22 首钢 MTN005	1,200,000	123,942,930.41	6.31
2	019694	23 国债 01	1,050,000	106,165,126.03	5.41
3	102280315	22 首创集 MTN001	1,000,000	101,757,890.41	5.18
4	102381026	23 海淀国资 MTN002	1,000,000	101,393,595.63	5.16
5	102381077	23 河钢集 MTN006	1,000,000	101,305,508.20	5.16

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

22 东莞 01:

东莞证券股份有限公司（以下简称“公司”）于 2022 年 9 月 30 日收到中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）2022 年 9 月 29 日出具的《关于对东莞证券采取责令改正措施的决定》对以上事件，本基金判断，东莞证券经营相对稳健，股东支持能力较强，上述处罚对公司影响可控。

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，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规定的备选股票库

本基金报告期末未持有股票。

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	101,568.12
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	80,451.15
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	182,019.27

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	110059	浦发转债	54,046,136.99	2.75
2	113042	上银转债	43,286,465.75	2.20
3	110081	闻泰转债	14,726,889.35	0.75
4	127018	本钢转债	14,162,945.52	0.72
5	113037	紫银转债	12,375,066.69	0.63
6	127049	希望转 2	11,125,128.77	0.57
7	113043	财通转债	10,683,695.89	0.54
8	113065	齐鲁转债	9,875,380.82	0.50

9	113044	大秦转债	5,775,808.22	0.29
10	113049	长汽转债	5,691,880.82	0.29
11	127017	万青转债	3,731,952.59	0.19
12	127022	恒逸转债	3,436,415.10	0.18

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 (%)
长盛盛逸 9 个月持有期债券 A	4,021	254,281.41	9,668,238.89	0.95	1,012,797,298.26	99.05
长盛盛逸 9 个月持有期债券 C	4,537	205,320.26	2,581,274.15	0.28	928,956,767.91	99.72
合计	8,558	228,324.79	12,249,513.04	0.63	1,941,754,066.17	99.37

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	长盛盛逸 9 个月持有期债券 A	62,203.98	0.0061
	长盛盛逸 9 个月持有期债券 C	15,145.84	0.0016
	合计	77,349.82	0.0040

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

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	长盛盛逸 9 个月持有期债券 A	0
	长盛盛逸 9 个月持有期债券 C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	长盛盛逸 9 个月持有期债券 A	0
	长盛盛逸 9 个月持有期债券 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长盛盛逸 9 个月持有期债券 A	长盛盛逸 9 个月持有期债券 C
基金合同生效日 (2023 年 4 月 26 日) 基金份额总额	869,886,930.85	885,288,494.63
基金合同生效日起至 报告期期末基金总申 购份额	152,578,606.30	46,249,547.43
减：基金合同生效日 起至报告期期末基金 总赎回份额	-	-
基金合同生效日起至 报告期期末基金拆分 变动份额	-	-
本报告期末基金份 额总额	1,022,465,537.15	931,538,042.06

§ 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

根据公司第八届董事会相关会议决议，选举胡甲先生担任公司董事长，同时代行公司总经理职务，代行总经理职务期限不超 6 个月；高民和先生不再担任公司董事长，周兵先生不再担

任公司总经理职务。公司已按规定向相关监管机构报备并进行公告。

10.2.2 基金经理变动情况

本报告期内本基金基金经理未发生变动。

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、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人
受到稽查或处罚等措施的时间	2023 年 5 月 11 日
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证监会北京监管局
受到的具体措施类型	责令改正
受到稽查或处罚等措施的原因	内控管理不完善
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司已完成整改，整改措施主要包括完善内部制度、优化管控流程等
其他	-

10.6.2 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 (%)	
安信证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-

第一创业	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	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(%)
安信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
光大证券	139,467,115.92	16.33	-	-	-	-
国金证券	714,454,256.01	83.67	6,820,760,000.00	100.00	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-

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、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、本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：无。

(2) 本基金报告期内停止租用交易单元情况：

序号	证券公司名称	交易单元所属市场	数量
1	平安证券	上海	1
2	天风证券	上海	1

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	长盛盛逸 9 个月持有期债券型证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 3 月 29 日
2	长盛盛逸 9 个月持有期债券型证券投资基金基金份额发售公告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 3 月 29 日
3	长盛盛逸 9 个月持有期债券型证券投资基金托管协议	中国证监会指定披露媒介	2023 年 3 月 29 日
4	长盛盛逸 9 个月持有期债券型证券投资基金招募说明书	中国证监会指定披露媒介	2023 年 3 月 29 日
5	长盛盛逸 9 个月持有期债券型证券投资基金基金合同	中国证监会指定披露媒介	2023 年 3 月 29 日
6	长盛盛逸 9 个月持有期债券型证券投资基金基金产品资料概要	中国证监会指定披露媒介	2023 年 3 月 29 日
7	长盛基金管理有限公司关于增加长盛盛逸 9 个月持有期债券型证券投资基金代销机构的公告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 4 月 6 日
8	长盛基金管理有限公司关于长盛盛逸 9 个月持有期债券型证券投资基金增加代销机构的公告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 4 月 6 日
9	长盛基金管理有限公司关于增加长盛盛逸 9 个月持有期债券型证券投资基金	中国证监会指定披露媒介	2023 年 4 月 7 日

	金代销机构的公告		
10	长盛基金管理有限公司关于长盛盛逸 9 个月持有期债券型证券投资基金增加代销机构的公告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 4 月 14 日
11	长盛基金管理有限公司关于旗下基金参与平安银行股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 4 月 17 日
12	长盛盛逸 9 个月持有期债券型证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 4 月 27 日
13	长盛基金管理有限公司关于旗下基金参与平安银行股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 5 月 5 日
14	长盛盛逸 9 个月持有期债券型证券投资基金开放日常申购转换转入及定期定额投资业务的公告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 5 月 5 日
15	长盛基金管理有限公司关于增加东方财富证券为旗下部分开放式基金代销机构及开通基金定投业务与转换业务的公告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 6 月 2 日
16	长盛基金管理有限公司关于旗下基金增加招商银行为代销机构的公告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 6 月 20 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、长盛盛逸 9 个月持有期债券型证券投资基金相关批准文件；
- 2、《长盛盛逸 9 个月持有期债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长盛盛逸 9 个月持有期债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、《长盛盛逸 9 个月持有期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.csfunds.com.cn>。

长盛基金管理有限公司

2023 年 8 月 30 日