

长盛中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证
券投资基金
2024 年第 2 季度报告

2024 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：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 7 月 19 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 07 月 18 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 04 月 01 日起至 06 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长盛中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期
基金主代码	017136
基金运作方式	契约型开放式，但本基金对每份基金份额设置 7 天的最短持有期限
基金合同生效日	2022 年 12 月 23 日
报告期末基金份额总额	3,576,677,475.05 份
投资目标	本基金通过指数化投资，争取在扣除各项费用之前获得与标的指数相似的总回报，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投资策略	<p>本基金为指数基金，主要采用抽样复制和动态最优化的方法，投资于标的指数中具有代表性和流动性的成份券和备选成份券，或选择非成份券作为替代，构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合，以实现对标指数的有效跟踪。</p> <p>在正常市场情况下，本基金力争追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。</p> <p>1、优化抽样复制策略：本基金将采用抽样复制和动态最优化的方法，主要以标的指数的成份券构成为基础，综合考虑指数成份券流动性、基金日常申购赎回以及银行间和交易所成份券交易特性及交易惯例等情况进行优化，以保证对标指数的有效跟踪。</p> <p>2、替代性策略：当由于市场流动性不足或因法规规定等其他原因，导致标的指数成份券和备选成份券无法满足投资需求时，基金管理人可以在成份券和备选成份券外寻找其他证券构建替代组合，对指数进行跟踪复制。替代组合的构建将以流动性为约束条件，按照与被替代成份券久期相近、信用评级相似、到期收益率及剩余期限基本匹配为</p>

	<p>主要原则，控制替代组合与被替代成份券的跟踪偏离度和跟踪误差最小化。</p> <p>3、资产支持证券的投资策略：本基金将在综合考虑市场利率、发行条款、支持资产的构成和质量等因素的基础上，对资产证券化产品的收益和风险匹配情况等进行定性和定量的全方面分析，评估其相对投资价值并作出相应的投资决策，力求在控制投资风险的前提下尽可能的提高本基金的收益。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。</p>
业绩比较基准	中证同业存单 AAA 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金风险与收益低于股票型基金、偏股混合型基金，高于货币市场基金。主要投资于标的指数成份券及备选成份券，具有与标的指数以及标的指数所代表的市场相似的风险收益特征。
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2024 年 4 月 1 日-2024 年 6 月 30 日）
1. 本期已实现收益	4,254,273.52
2. 本期利润	3,914,431.92
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0026
4. 期末基金资产净值	3,690,764,689.79
5. 期末基金份额净值	1.0319

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、所列数据截止到 2024 年 06 月 30 日。

3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

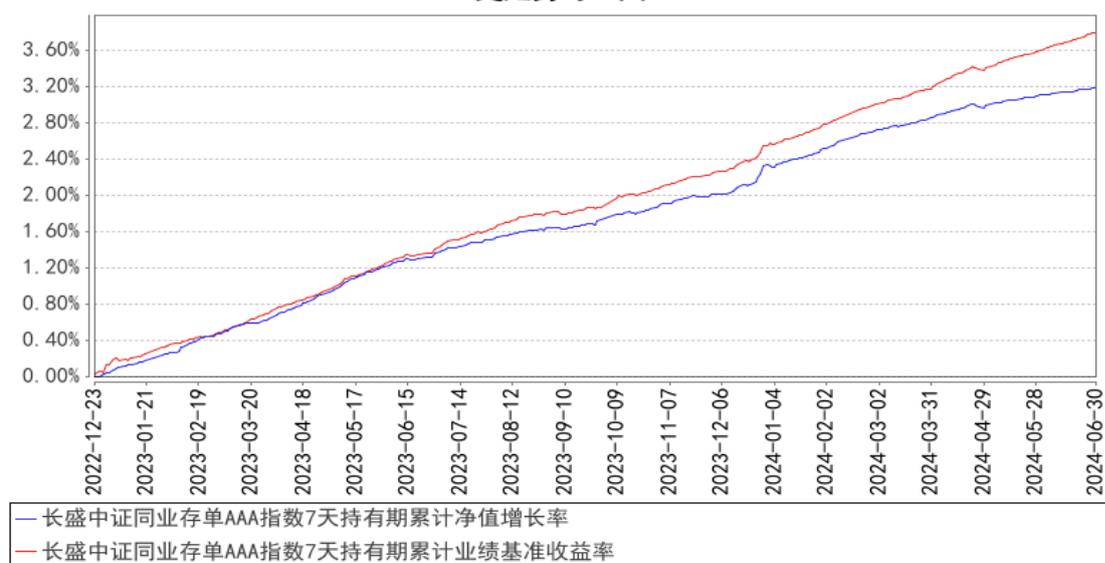
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.32%	0.01%	0.60%	0.01%	-0.28%	0.00%
过去六个月	0.83%	0.01%	1.22%	0.01%	-0.39%	0.00%

过去一年	1.81%	0.01%	2.36%	0.01%	-0.55%	0.00%
自基金合同 生效起至今	3.19%	0.01%	3.80%	0.01%	-0.61%	0.00%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

长盛中证同业存单AAA指数7天持有期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本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		
段鹏	本基金基金经理，长盛货币市场基金基金经理，长盛添利宝货币市场基金基金经理，长盛稳益6个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。	2022年12月23日	-	17年	段鹏先生，硕士。曾在中信银行股份有限公司从事人民币货币市场交易、债券投资及流动性管理等工作。2013年12月加入长盛基金管理有限公司。

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

二季度，经济继续保持增长但不确定性因素依然存在，出口和制造业为支撑经济的重要增长点，地产拖累依旧。货币政策持续保驾护航，资金面整体合理充裕，同时地方债、城投债等发行供给节奏依然偏慢，各期限品种债券市场收益率整体下行，绝对收益水平、期限利差、信用利差等相关指标处于历史较低分位。

2、报告期内本基金投资策略分析

在报告期内，本基金根据规模波动和市场环境，结合相关指数基准，动态调整资产配置节奏，合理安排组合期限结构，努力提高组合收益，同时在规模出现变化的情况下保证季末等关键时点组合运作平稳。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末基金份额净值为 1.0319 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.32%，同期业绩比较基准收益率为 0.60%。

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	3,320,954,179.64	89.05
	其中：债券	3,320,954,179.64	89.05
	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	100,026,780.12	2.68
	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	6,798,500.50	0.18
8	其他资产	301,367,584.80	8.08
9	合计	3,729,147,045.06	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	191,306,796.69	5.18
2	央行票据	-	-
3	金融债券	30,511,698.25	0.83
	其中：政策性金融债	30,511,698.25	0.83
4	企业债券	51,299,775.35	1.39
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	5,159,439.34	0.14
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	3,042,676,470.01	82.44
9	其他	-	-
10	合计	3,320,954,179.64	89.98

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	112418012	24 华夏银行 CD012	3,000,000	299,747,465.93	8.12
2	112408027	24 中信银行 CD027	2,700,000	269,772,719.34	7.31
3	112402021	24 工商银行 CD021	2,000,000	199,782,109.89	5.41
4	112317174	23 光大银行 CD174	2,000,000	199,772,020.22	5.41
5	112310312	23 兴业银行 CD312	2,000,000	199,757,843.07	5.41

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货投资。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

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

(1) 24 中信银行 CD027

2023 年 12 月 1 日，金罚决字（2023）15 号显示，中信银行股份有限公司存在违反高管准入管理相关规定等 56 项违法违规事实，没收违法所得并处罚款合计 22,475.18 万元。2024 年 1 月 5 日，金罚决字（2023）69 号显示，中信银行股份有限公司存在部分重要信息系统应认定未认定，相关系统未建灾备或灾难恢复能力不符合监管要求等 6 项违法违规事实，被处罚款 400 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。

(2) 24 工商银行 CD021、24 工商银行 CD004

2023 年 11 月 17 日，国家金融监督管理总局上海监管局行政处罚显示，工商银行因存在八项违规行为，被罚款 740 万。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。

(3) 23 光大银行 CD174

2024 年 5 月 23 日，金罚决字（2024）24 号显示，中国光大银行股份有限公司存在投诉处理内部控制不严行为等违法违规事实，被处罚款 20 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。

(4) 23 兴业银行 CD312、23 兴业银行 CD210

2023 年 9 月 11 日，兴业银行任丘支行存在“贷款尽职调查不到位”的违法违规事实，被国家金融监督管理总局沧州监管分局处罚款 30 万元。

2023 年 12 月 22 日，兴业银行深圳分行因未按规定承担小微企业押品评估费，未区分押品风险状况、统一要求小微企业购买抵押物财产保险，被国家金融监督管理总局深圳监管局罚款 100 万元。

2024 年 2 月 18 日，国家金融监督管理总局北京监管局发布的处罚信息显示，兴业银行北京分行因存贷挂钩，流动资金贷款挪用于股权投资，个人按揭贷款业务严重违反审慎经营规则，项目融资业务合规要件不全及未从严审核项目资本金，发放贷款用于为违规领域垫资等五项违法违规事实，被处以罚款 210 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。

(5) 24 交通银行 CD015

2024 年 6 月 21 日，金罚决字（2024）29 号显示，交通银行股份有限公司存在安全测试存在薄弱环节等 4 项违法违规事实，被处罚款 160 万元。本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合法律法规、基金合同和公司投资制度的规定。

除上述事项外，本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查，无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.11.2 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

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	20,992,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	280,375,584.80
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	301,367,584.80

5.11.4 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。

5.11.5 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。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	217,302,278.42
报告期期间基金总申购份额	8,991,072,232.86
减：报告期期间基金总赎回份额	5,631,697,036.23
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	3,576,677,475.05

§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

本基金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。

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、长盛中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金相关批准文件；
- 2、《长盛中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金合同》；
- 3、《长盛中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金托管协议》；
- 4、《长盛中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期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

2024 年 7 月 19 日