

长盛稳益 6 个月定期开放债券型证券投资基金 2021 年年度报告

2021 年 7 月 8 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：2022 年 3 月 31 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。本年度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 2022 年 3 月 30 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。

本基金已于 2021 年 7 月 8 日发布《关于长盛稳益 6 个月定期开放债券型证券投资基金第三个封闭期到期后暂停运作、不开放申购及转换转入等安排的公告》，并于 2021 年 7 月 9 日对全部基金份额进行自动赎回并暂停运作。

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。

本年度报告财务资料已经审计，安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了带强调事项段的无保留意见的审计报告，基金管理人在本报告中对相关事项亦有详细说明，请投资者注意阅读。

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 07 月 08 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、基金净值表现及利润分配情况 | 8 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 8 |
| 3.2 基金净值表现..... | 9 |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况..... | 13 |
| § 4 管理人报告 | 14 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况..... | 14 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明..... | 15 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 15 |
| 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..... | 16 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 17 |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况..... | 17 |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 18 |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 18 |
| 4.9 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..... | 19 |
| § 5 托管人报告 | 20 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... | 20 |
| 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..... | 20 |
| 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见..... | 20 |
| § 6 审计报告 | 21 |
| 6.1 审计报告基本信息..... | 21 |
| 6.2 审计报告的基本内容..... | 21 |
| § 7 年度财务报表 | 23 |
| 7.1 资产负债表..... | 23 |
| 7.2 利润表..... | 24 |
| 7.3 所有者权益（基金净值）变动表..... | 25 |
| 7.4 报表附注..... | 26 |
| § 8 投资组合报告 | 48 |
| 8.1 期末（2021 年 7 月 8 日）基金资产组合情况..... | 48 |
| 8.2 期末（2021 年 7 月 8 日）按行业分类的股票投资组合..... | 48 |
| 8.3 期末（2021 年 7 月 8 日）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..... | 48 |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 48 |
| 8.5 期末（2021 年 7 月 8 日）按债券品种分类的债券投资组合..... | 49 |
| 8.6 期末（2021 年 7 月 8 日）按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明 | |

| | |
|---|-----------|
| 细..... | 49 |
| 8.7 期末（2021 年 7 月 8 日）按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细..... | 49 |
| 8.8 报告期末（2021 年 7 月 8 日）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..... | 49 |
| 8.9 期末（2021 年 7 月 8 日）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..... | 49 |
| 8.10 报告期末（2021 年 7 月 8 日）本基金投资的国债期货交易情况说明 | 49 |
| 8.11 投资组合报告附注..... | 49 |
| § 9 基金份额持有人信息..... | 51 |
| 9.1 期末（2021 年 7 月 8 日）基金份额持有人户数及持有人结构 | 51 |
| 9.2 期末（2021 年 7 月 8 日）基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 51 |
| 9.3 期末（2021 年 7 月 8 日）基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 | 51 |
| § 10 开放式基金份额变动..... | 52 |
| § 11 重大事件揭示..... | 53 |
| 11.1 基金份额持有人大会决议 | 53 |
| 11.2 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 | 53 |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 53 |
| 11.4 基金投资策略的改变 | 53 |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 53 |
| 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 | 53 |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 54 |
| 11.8 其他重大事件..... | 55 |
| § 12 影响投资者决策的其他重要信息..... | 59 |
| 12.1 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 | 59 |
| 12.2 影响投资者决策的其他重要信息..... | 59 |
| § 13 备查文件目录..... | 60 |
| 13.1 备查文件目录..... | 60 |
| 13.2 存放地点..... | 60 |
| 13.3 查阅方式..... | 60 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|-------------------------|-----------------|
| 基金名称 | 长盛稳益 6 个月定期开放债券型证券投资基金 | |
| 基金简称 | 长盛稳益 6 个月 | |
| 基金主代码 | 007653 | |
| 交易代码 | 007653 | |
| 基金运作方式 | 本基金为契约型开放式基金，以定期开放方式运作。 | |
| 基金合同生效日 | 2019 年 7 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 | 61,124,556.12 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称: | 长盛稳益 6 个月 A | 长盛稳益 6 个月 C |
| 下属分级基金的交易代码: | 007653 | 007654 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 41,970,511.24 份 | 19,154,044.88 份 |

注：报告期内，本基金根据 2021 年 7 月 8 日发布的《关于长盛稳益 6 个月定期开放债券型证券投资基金第三个封闭期到期后暂停运作、不开放申购及转换转入等安排的公告》，已于第三个封闭期到期后暂停运作，暂不开放申购及转换转入业务。本基金基金份额已于第三个封闭期结束之日的下一个工作日（即 2021 年 7 月 9 日）全部自动赎回。

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|---|
| 投资目标 | 本基金封闭期内采取买入持有到期投资策略，投资于剩余期限(或回售期限)不超过基金剩余封闭期的固定收益类工具，在力求本金安全的基础上，追求稳健的当期收益。 |
| 投资策略 | <p>本基金主要投资于固定收益类金融工具，不直接买入股票等权益类金融工具。本基金的投资策略包括：</p> <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：封闭期配置策略、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、资产支持证券等品种投资策略。</p> <p>（三）开放期投资策略</p> <p>开放期内，为了保证组合具有较高的流动性，本基金将在遵守有关投资限制与投资比例的前提下，投资于具有较高流动性的投资品种，积极防范流动性风险。</p> |
| 业绩比较基准 | 中国人民银行公布的六个月银行定期整存整取存款利率(税后)+0.6% |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型证券投资基金，属于证券投资基金中预期较低风险、较低收益的品种，其预期收益和风险水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。 |

注：1、本基金已于 2020 年 8 月 13 日发布《关于长盛稳益 6 个月定期开放债券型证券投资基金第二个封闭期到期后暂停运作、不开放申购及转换转入等安排的公告》，基金管理人决定本基金第二个封闭期到期后暂停运作，暂不开放申购及转换转入业务。本基金 A 类和 C 类基金份额将于本期封闭期结束之日的下一个工作日（即 2020 年 8 月 17 日）全部自动赎回。

2、本基金已于 2020 年 12 月 25 日发布《长盛稳益 6 个月定期开放债券型证券投资基金重启运作并开放申购的公告》，基金管理人决定自 2020 年 12 月 25 日起重启本基金的运作并开放申购、转换转入业务。

3、根据 2021 年 7 月 8 日发布的《关于长盛稳益 6 个月定期开放债券型证券投资基金第三个封闭期到期后暂停运作、不开放申购及转换转入等安排的公告》，本基金自第三个封闭期到期后暂停运作，暂不开放申购及转换转入业务。本基金基金份额于第三个封闭期结束之日的下一个工作日（即 2021 年 7 月 9 日）全部自动赎回。

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 | fcid@bankofchina.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 | | 高民和 | 刘连舸 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 《证券时报》 |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | http://www.csfunds.com.cn |
| 基金年度报告备置地点 | 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 |
|--------|--------------------|------------------------------------|
| 会计师事务所 | 安永华明会计师事务所（特殊普通合伙） | 中国北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城安永大楼 16 层 |
| 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、基金净值表现及利润分配情况

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 | 2021 年 1 月 1 日-2021 年 7 月 8 日 | | 2020 年 | | 2019 年 7 月 26 日(基金合同生效日)-2019 年 12 月 31 日 | |
|---------------|-------------------------------|---------------|--------------|--------------|---|----------------|
| | 长盛稳益 6 个月 A | 长盛稳益 6 个月 C | 长盛稳益 6 个月 A | 长盛稳益 6 个月 C | 长盛稳益 6 个月 A | 长盛稳益 6 个月 C |
| 本期已实现收益 | 477,172.83 | 188,589.39 | 5,483,655.12 | 2,608,709.58 | 5,489,964.75 | 2,149,053.29 |
| 本期利润 | 477,172.83 | 188,589.39 | 5,483,655.12 | 2,608,709.58 | 5,489,964.75 | 2,149,053.29 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0119 | 0.0100 | 0.0358 | 0.0302 | 0.0083 | 0.0066 |
| 本期加权平均净值利润率 | 1.19% | 0.99% | 3.53% | 2.99% | 0.83% | 0.66% |
| 本期基金份额净值增长率 | 1.21% | 1.00% | 1.97% | 1.70% | 0.83% | 0.66% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2021 年 7 月 8 日 | | 2020 年末 | | 2019 年末 | |
| | 长盛稳益 6 个月 A | 长盛稳益 6 个月 C | 长盛稳益 6 个月 A | 长盛稳益 6 个月 C | 长盛稳益 6 个月 A | 长盛稳益 6 个月 C |
| 期末可供分配利润 | 514,939.55 | 195,115.41 | 2.35 | 1,797.37 | 5,489,964.75 | 2,149,053.29 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0123 | 0.0102 | 0.0002 | 0.0002 | 0.0083 | 0.0066 |
| 期末基金资产净值 | 42,485,450.79 | 19,349,160.29 | 10,074.15 | 8,555,272.97 | 665,664,201.05 | 329,169,430.02 |
| 期末基金份额净值 | 1.0123 | 1.0102 | 1.0002 | 1.0002 | 1.0083 | 1.0066 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 2021 年 7 月 8 日 | | 2020 年末 | | 2019 年末 | |
| | 长盛稳益 6 个月 A | 长盛稳益 6 个月 C | 长盛稳益 6 个月 A | 长盛稳益 6 个月 C | 长盛稳益 6 个月 A | 长盛稳益 6 个月 C |
| 基金份额累计净值增长率 | 4.06% | 3.39% | 2.82% | 2.37% | 0.83% | 0.66% |

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。由于本基金采用摊余成本法核算，因此公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

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 7 月 8 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

长盛稳益 6 个月 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 |
|----------------------------------|----------|-------------|------------|---------------|-------|-------|
| 2021 年 7 月 1 日至 2021 年 7 月 8 日 | 0.39% | 0.07% | 0.04% | 0.00% | 0.35% | 0.07% |
| 2021 年 4 月 1 日至 2021 年 7 月 8 日 | 0.85% | 0.03% | 0.52% | 0.01% | 0.33% | 0.02% |
| 2020 年 12 月 28 日至 2021 年 7 月 8 日 | 1.23% | 0.02% | 1.00% | 0.01% | 0.23% | 0.01% |
| 自基金合同生效起至 2021 年 7 月 8 日 | 4.06% | 0.02% | 3.04% | 0.01% | 1.02% | 0.01% |

长盛稳益 6 个月 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 |
|----------------------------------|----------|-------------|------------|---------------|-------|-------|
| 2021 年 7 月 1 日至 2021 年 7 月 8 日 | 0.38% | 0.07% | 0.04% | 0.00% | 0.34% | 0.07% |
| 2021 年 4 月 1 日至 2021 年 7 月 8 日 | 0.74% | 0.03% | 0.52% | 0.01% | 0.22% | 0.02% |
| 2020 年 12 月 28 日至 2021 年 7 月 8 日 | 1.02% | 0.02% | 1.00% | 0.01% | 0.02% | 0.01% |
| 自基金合同生效起至 2021 年 7 月 8 日 | 3.39% | 0.02% | 3.04% | 0.01% | 0.35% | 0.01% |

注：1、本基金已于 2020 年 8 月 13 日发布《关于长盛稳益 6 个月定期开放债券型证券投资基金第二个封闭期到期后暂停运作、不开放申购及转换转入等安排的公告》，基金管理人决定本基金第二个封闭期到期后暂停运作，暂不开放申购及转换转入业务。本基金 A 类和 C 类基金份额将于本期封闭期结束之日的下一个工作日（即 2020 年 8 月 17 日）全部自动赎回。

2、本基金已于 2020 年 12 月 25 日发布《长盛稳益 6 个月定期开放债券型证券投资基金重启运作并开放申购的公告》，基金管理人决定自 2020 年 12 月 25 日起重启本基金的运作并开放申购、转换转入业务。

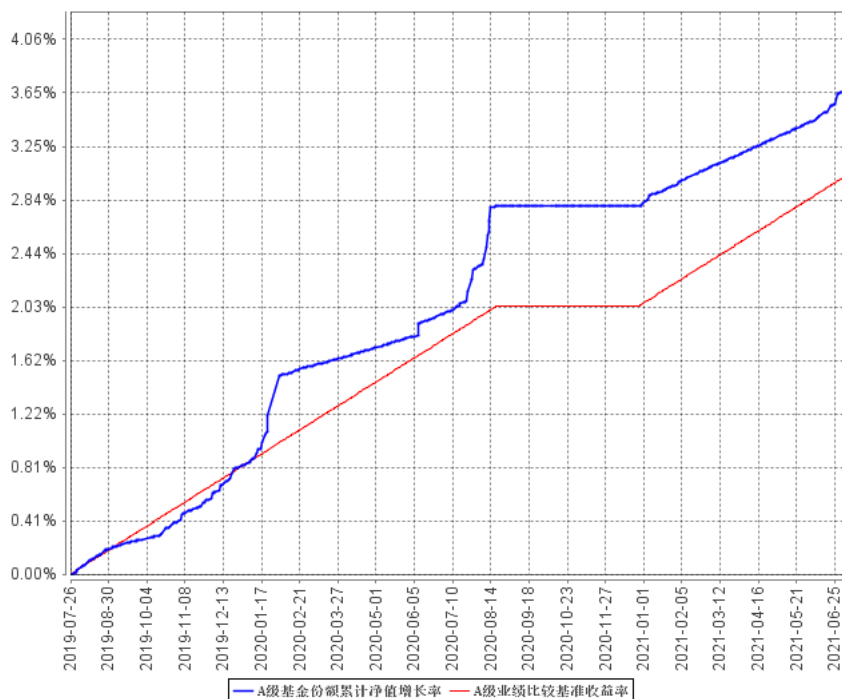
3、根据 2021 年 7 月 8 日发布的《关于长盛稳益 6 个月定期开放债券型证券投资基金第三个封闭期到期后暂停运作、不开放申购及转换转入等安排的公告》，本基金自第三个封闭期到期后暂停运作，暂不开放申购及转换转入业务。本基金基金份额于第三个封闭期结束之日的下一个工作日（即 2021 年 7 月 9 日）全部自动赎回。

4、本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

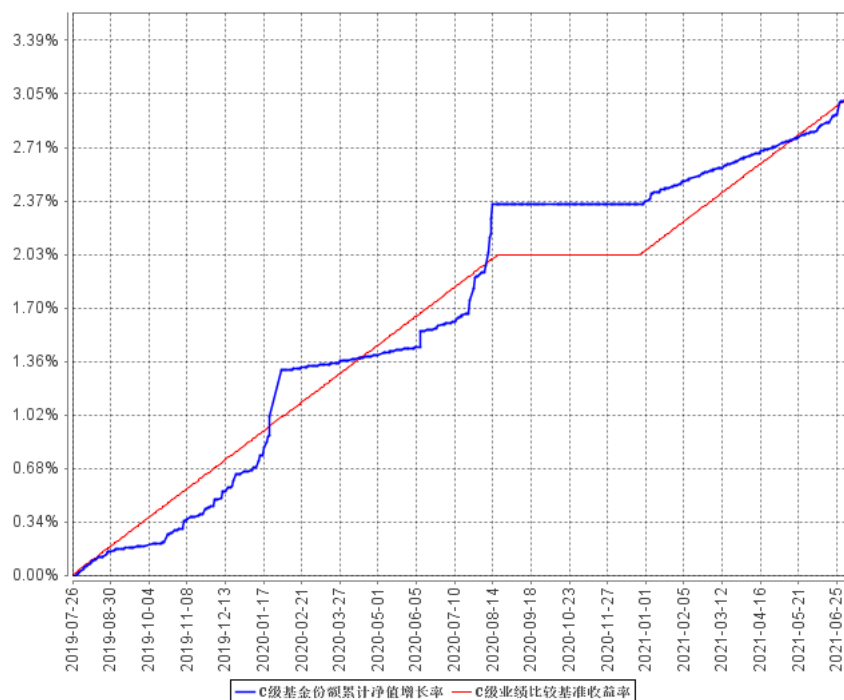
本基金的业绩比较基准为：中国人民银行公布的六个月银行定期整存整取存款利率（税后）+0.6%。本基金以每个封闭期为周期进行投资运作，每个封闭期为六个月，期间投资人无法进行基金份额申购与赎回。以与封闭期同期对应的六个月定期存款利率（税后）+0.6%作为本基金的业绩比较基准符合产品特性，能够使本基金投资人理性判断本基金产品的风险收益特征和流动性特征，合理衡量本基金的业绩表现。六个月定期存款利率采用每个封闭期起始日中国人民银行公布的金融机构人民币六个月存款基准利率。

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

A级基金份额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



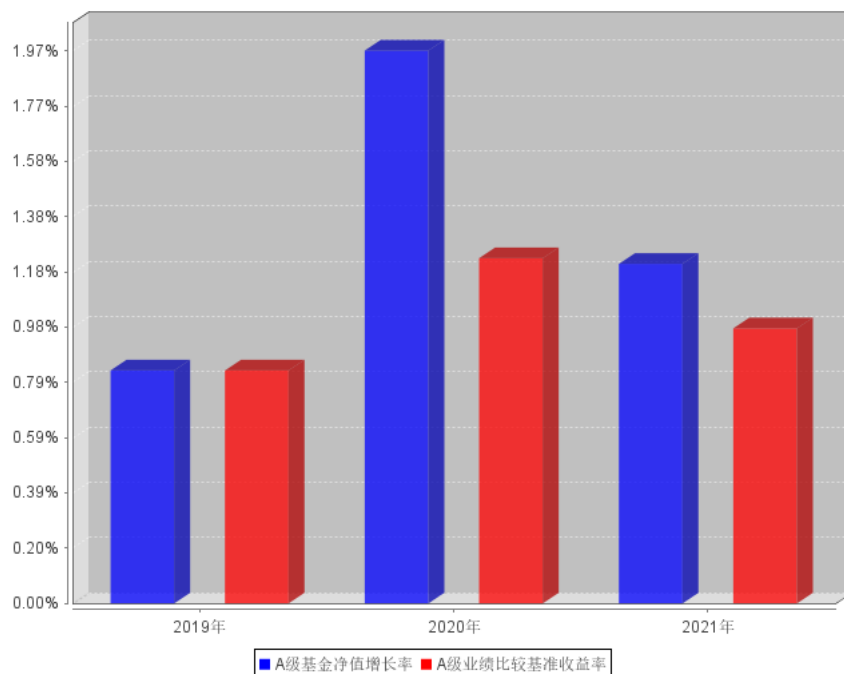
C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



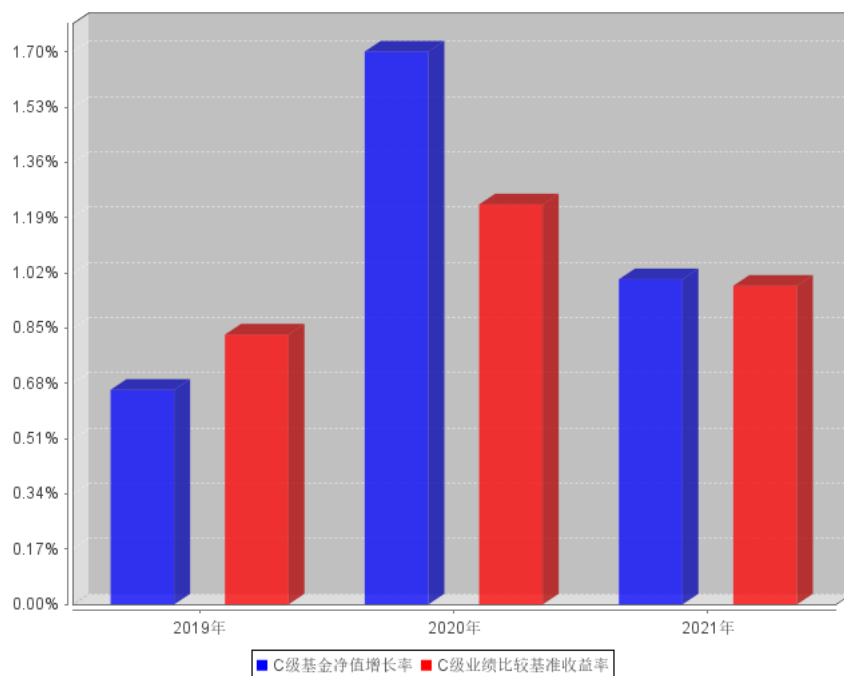
注：按照本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。本基金于2020年8月17日起暂停运作，自2020年12月25日起重启本基金的运作并开放申购业务。根据2021年7月8日发布的《关于长盛稳益6个月定期开放债券型证券投资基金第三个封闭期到期后暂停运作、不开放申购及转换转入等安排的公告》，本基金自第三个封闭期到期后暂停运作，暂不开放申购及转换转入业务。本基金基金份额于第三个封闭期结束之日的下一个工作日（即2021年7月9日）全部自动赎回。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

A级自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



C级自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：长盛稳益 6 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同于 2019 年 7 月 26 日生效，合同生效当年按照实际存续期计算，未按整个自然年度折算。2021 年收益率计算区间为 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 7 月 8 日。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金基金合同生效日为 2019 年 7 月 26 日，本基金于 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 7 月 8 日、2020 年度及 2019 年度未进行利润分配。

§ 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 2021 年 12 月 31 日，基金管理人共管理六十八只开放式基金，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 | | |
| 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。 | 2019 年 7 月 26 日 | - | 14 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。 |
| 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。 | 2021 年 6 月 25 日 | - | 9 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《证券业从业人员资格管理办法》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

注：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。

4.1.4 基金经理薪酬机制

本基金基金经理薪酬激励不存在与私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩表现挂钩的情况。

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、本基金的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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《公司公平交易细则》，从投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格把关，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行，确保公平对待不同投资组合，包括公募基金、社保组合、私募资产管理计划等，切实防范利益输送，保护投资者的合法权益。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。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度等规定，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行，确保公平对待不

同投资组合，切实防范利益输送，保护投资者的合法权益。

公司对管理的不同投资组合过去 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原则及利益输送的行为。

4.3.3 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，本基金未发生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

2021 年，除疫情外，影响宏观经济和市场的主要变量包括上游大宗商品涨价、地产调整、能耗双控等。总的来看，疫情对消费需求、供给瓶颈影响较大；由于供需错配等原因，上游大宗商品量缩价升，价格全年基本处于上行通道，获取了产业链中相当部分利润，对中下游影响巨大；在前期地产政策的基础上，以个别大型企业的暴雷为导火索，地产行业、企业面临较大冲击，地产基本面逐步走弱；在前述因素的基础上，能耗双控等政策执行中的偏差，进一步拖累了经济。

从经济增速看，呈现逐季下行趋势，到四季度，同比增长降幅明显。从增长动力来看，出口和制造业投资为经济稳定发挥了重要作用。从政策层面看，财政政策相对克制，货币政策逐步加大宽松力度，保持稳健偏宽松，逆周期操作和总量工具重归台前。

全年来看，受经济走势和政策等影响，债券市场各期限品种收益率基本呈现震荡下行走势，短端利率和资金价格亦同频共振。

2、报告期内本基金投资策略分析

在报告期内，本基金坚持在不发生风险的前提下，通过积极挖掘绝对收益较高的板块和标的，为投资人创造最大化回报，同时平稳度过年中打开阶段。下半年，本基金进入休眠阶段，暂停投资运作。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末（2021 年 7 月 8 日），长盛稳益 6 个月 A 基金份额净值为 1.0123 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.21%；截至本报告期末长盛稳益 6 个月 C 基金份额净值为 1.0102 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.00%；同期业绩比较基准收益率为 0.98%。

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 2022 年，一方面，基建投资、制造业投资将发挥逆周期调节作用，预计投资增速有所上升；另一方面，地产政策将出现有条件放松，预计地产基本面将会逐步改善。同时，PPI 预计逐步下行，CPI 有所上行但幅度应该可控。

在前述背景下，随着政策加大发力，预计效果将逐步显现，经济基本面有望逐步回升，债券市场收益率整体处于低位、震荡走势，资金利率围绕政策利率中枢波动。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人遵循合规运作、保护基金投资者利益的原则，结合监管要求、市场形势及自身业务发展需要，由独立于业务部门的监察稽核部对公司经营、受托资产的运作及员工行为的合规性进行监督、检查，发现问题及时督促相关部门改进，并定期制作检查报告报送公司管理层。具体工作情况如下：

1、加强合规宣导与培训，持续推动公司合规文化建设。报告期内，监察稽核部通过外请专业机构、内部自学、岗前培训、基金经理合规谈话、合规考试等多种形式，有重点、有针对性地开展合规培训工作，及时组织学习法律法规与监管文件，深化员工合规理念，提升员工合规工作技能。

2、持续完善公司制度规章体系建设。根据新法规、新监管要求，以及公司业务发展实际，及时督促、提示业务部门进行相关制度、流程的新订、修订与完善，保证公司制度规章的合法合规、全面、适时、有效。报告期内，公司除完成有关制度的新订、修订工作外，还要求业务部门就制度、流程变化内容与其他相关执行部门进行沟通，确保各相关部门对新订、修订内容的理解保持一致，保证制度、流程被严格执行。

3、加强合规监督，确保受托资产投资运作合法合规。紧密跟踪与投资运作相关的法律、法规、受托资产合同及公司制度等的规定，全面把控受托资产投资运作风险点，并以前述风险点为依据，检查、监督各受托资产投资运作合规情况。根据《公司公平交易细则》的规定，通过量化分析、日常合规监督及事后专项检查评估等，确保公司旗下各受托资产被公平对待，防范非公平交易和利益输送。

4、加强专项稽核与检查力度，完善发现问题与改进情况的跟踪、落实机制，保障公司运营及受托资产投资运作合规。报告期内，公司监察稽核部开展定期、临时专项稽核，内容涵盖受托资产投资、研究、交易、销售、清算、产品开发、员工行为等。此外，根据业务发展需要、监管机构通报的业内问题，以及公司在日常监督中发现的问题，临时增加多个检查项目。稽核、检查工作中，监察稽核部重视对发现问题改进完成情况的跟踪，强调问题改进效率与效果，合理保障公

司及受托资产合规、稳健运作。

5、参与新产品设计、新业务、新流程的合规论证工作，提供合规意见或建议，确保依法合规开展相关业务。

本基金管理人承诺：在今后的工作中，我们将继续以保护基金投资者的利益为宗旨，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，保障公司、受托资产合规运作。

4.7 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。

4.8 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，本基金本报告期内未进行利润分配。

本基金截至 2021 年 7 月 8 日，期末可供分配利润为 710,054.96 元，其中：长盛稳益 6 个月 A 期末可供分配利润为 514,939.55 元，长盛稳益 6 个月 C 期末可供分配利润 195,115.41 元。

4.9 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”）在长盛稳益 6 个月定期开放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 托管人对本年度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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

| | |
|------------|------------------------------|
| 财务报表是否经过审计 | 是 |
| 审计意见类型 | 带强调事项段的无保留意见 |
| 审计报告编号 | 安永华明（2022）专字第 60468688_A08 号 |

6.2 审计报告的基本内容

| | |
|------------------|--|
| 审计报告标题 | 审计报告 |
| 审计报告收件人 | 长盛稳益 6 个月定期开放债券型证券投资基金全体基金份额持有人 |
| 审计意见 | <p>我们审计了长盛稳益 6 个月定期开放债券型证券投资基金的财务报表,包括 2021 年 7 月 8 日的资产负债表,2021 年 1 月 1 日至 2021 年 7 月 8 日止期间的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为,后附的长盛稳益 6 个月定期开放债券型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照财务报表 7.4.2 所述编制基础编制。</p> |
| 形成审计意见的基础 | <p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于长盛稳益 6 个月定期开放债券型证券投资基金,并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> |
| 强调事项——编制基础 | <p>我们提醒财务报表使用者关注财务报表附注 7.4.2 对编制基础的说明。长盛稳益 6 个月定期开放债券型证券投资基金管理层编制财务报表是为了向基金份额持有人、中国证券监督管理委员会及其派出机构披露及报送。因此,财务报表不适用于其他用途。本段内容不影响已发表的审计意见。</p> |
| 其他事项——对审计报告使用的限制 | <p>我们的报告仅供基金份额持有人、中国证券监督管理委员会及其派出机构使用,而不应为除基金份额持有人、中国证券监督管理委员会及其派出机构以外的其他方使用。</p> |
| 其他信息 | <p>长盛稳益 6 个月定期开放债券型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作,如果我们确定其他信息存在重大错报,我们应当报告该事实。在这方面,我们无任何事项需要报告。</p> |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | <p>管理层负责按照财务报表附注 7.4.2 所述编制基础编制财务报表(包括确定该编制基础对于在具体情况下编制财务报表是可接受的),并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在</p> |

| | | |
|-----------------|---|-----|
| | <p>由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>治理层负责监督长盛稳益 6 个月定期开放债券型证券投资基金的财务报告过程。</p> | |
| 注册会计师对财务报表审计的责任 | <p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p> | |
| 会计师事务所的名称 | 安永华明会计师事务所（特殊普通合伙） | |
| 注册会计师的姓名 | 王珊珊 | 王海彦 |
| 会计师事务所的地址 | 中国 北京 | |
| 审计报告日期 | 2022 年 3 月 28 日 | |

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：长盛稳益 6 个月定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2021 年 7 月 8 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2021 年 7 月 8 日 | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 |
|-----------------|------------|-------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 7.4.7.1 | 61,830,722.27 | 2,264,444.42 |
| 结算备付金 | | 47,142.86 | - |
| 存出保证金 | | 4,319.26 | - |
| 交易性金融资产 | 7.4.7.2 | - | - |
| 其中：股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 7.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 7.4.7.4 | - | 500,000.00 |
| 应收证券清算款 | | - | - |
| 应收利息 | 7.4.7.5 | 1,457.47 | 197,040.11 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | - | 1,723,542.04 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 7.4.7.6 | - | 5,936,769.76 |
| 资产总计 | | 61,883,641.86 | 10,621,796.33 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2021 年 7 月 8 日 | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 |
| 负债： | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 7.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付证券清算款 | | - | 1,833,789.42 |
| 应付赎回款 | | - | 96,527.25 |
| 应付管理人报酬 | | 2,281.45 | 49.98 |
| 应付托管费 | | 760.49 | 16.67 |
| 应付销售服务费 | | 1,903.82 | 133.06 |
| 应付交易费用 | 7.4.7.7 | 468.00 | 160.50 |
| 应交税费 | | 7,943.35 | - |
| 应付利息 | | - | - |

| | | | |
|---------------|----------|---------------|---------------|
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 7.4.7.8 | 35,673.67 | 125,772.33 |
| 负债合计 | | 49,030.78 | 2,056,449.21 |
| 所有者权益： | | - | - |
| 实收基金 | 7.4.7.9 | 61,124,556.12 | 8,563,547.40 |
| 未分配利润 | 7.4.7.10 | 710,054.96 | 1,799.72 |
| 所有者权益合计 | | 61,834,611.08 | 8,565,347.12 |
| 负债和所有者权益总计 | | 61,883,641.86 | 10,621,796.33 |

注：报告截止日 2021 年 7 月 8 日，长盛稳益 6 个月 A 基金份额净值 1.0123 元，基金份额总额 41,970,511.24 份；长盛稳益 6 个月 C 基金份额净值 1.0102 元，基金份额总额 19,154,044.88 份。长盛稳益 6 个月份额总额合计为 61,124,556.12 份。

7.2 利润表

会计主体：长盛稳益 6 个月定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 7 月 8 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 7 月 8 日 | 上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 |
|-----------------------|------------|---|--|
| 一、收入 | | 816,388.84 | 9,048,008.10 |
| 1.利息收入 | | 807,229.33 | 9,045,144.32 |
| 其中：存款利息收入 | 7.4.7.11 | 4,416.04 | 251,916.35 |
| 债券利息收入 | | 781,992.53 | 7,163,105.67 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | 812,148.87 |
| 买入返售金融资产收入 | | 20,820.76 | 817,973.43 |
| 证券出借利息收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | - | - |
| 其中：股票投资收益 | 7.4.7.12 | - | - |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 7.4.7.13 | - | - |
| 资产支持证券投资收益 | 7.4.7.13.3 | - | - |
| 贵金属投资收益 | 7.4.7.14 | - | - |
| 衍生工具收益 | 7.4.7.15 | - | - |
| 股利收益 | 7.4.7.16 | - | - |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.17 | - | - |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 7.4.7.18 | 9,159.51 | 2,863.78 |

| | | | |
|----------------------------|------------|------------|--------------|
| 列) | | | |
| 减：二、费用 | | 150,626.62 | 955,643.40 |
| 1. 管理人报酬 | 7.4.10.2.1 | 45,742.70 | 259,672.90 |
| 2. 托管费 | 7.4.10.2.2 | 15,247.52 | 86,557.64 |
| 3. 销售服务费 | 7.4.10.2.3 | 39,289.84 | 246,539.46 |
| 4. 交易费用 | 7.4.7.19 | - | - |
| 5. 利息支出 | | 296.90 | 224,693.43 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 296.90 | 224,693.43 |
| 6. 税金及附加 | | 2,732.92 | 28,708.87 |
| 7. 其他费用 | 7.4.7.20 | 47,316.74 | 109,471.10 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 665,762.22 | 8,092,364.70 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 665,762.22 | 8,092,364.70 |

注：自 2021 年 7 月 9 日起，本基金暂停运作。本报告期自 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 7 月 8 日。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长盛稳益 6 个月定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 7 月 8 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 7 月 8 日 | | |
|-----------------------------------|--------------------------------------|------------|---------------|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 8,563,547.40 | 1,799.72 | 8,565,347.12 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 665,762.22 | 665,762.22 |
| 三、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） | 52,561,008.72 | 42,493.02 | 52,603,501.74 |
| 其中：1. 基金申购款 | 53,877,330.20 | 43,256.19 | 53,920,586.39 |
| 2. 基金赎回款 | -1,316,321.48 | -763.17 | -1,317,084.65 |
| 四、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) | | | |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 61,124,556.12 | 710,054.96 | 61,834,611.08 |
| 项目 | 上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日 | | |
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益(基金净值) | 987,194,613.03 | 7,639,018.04 | 994,833,631.07 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 8,092,364.70 | 8,092,364.70 |
| 三、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) | -978,631,065.63 | -15,729,583.02 | -994,360,648.65 |
| 其中：1. 基金申购款 | 8,783,219.86 | 1,833.13 | 8,785,052.99 |
| 2. 基金赎回款 | -987,414,285.49 | -15,731,416.15 | -1,003,145,701.64 |
| 四、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) | - | - | - |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 8,563,547.40 | 1,799.72 | 8,565,347.12 |

注：自 2021 年 7 月 9 日起，本基金暂停运作。本报告期自 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 7 月 8 日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

| | | |
|-----------|------------|-----------|
| <u>周兵</u> | <u>刁俊东</u> | <u>龚珉</u> |
| 基金管理人负责人 | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人 |

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

长盛稳益 6 个月定期开放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[2019]1037 号文《关于准予长盛稳益 6 个月定期开放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于 2019 年 7 月 15 日至

2019 年 7 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（2019）验字 60468688_A05 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 2019 年 7 月 26 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。截至 2019 年 7 月 26 日，长盛稳益 6 个月 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 660,027,498.08 元，折合 660,027,498.08 份长盛稳益 6 个月 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 146,738.22 元，折合 146,738.22 份长盛稳益 6 个月 A 类基金份额；以上收到的实收基金共计人民币 660,174,236.30 元，折合 660,174,236.30 份长盛稳益 6 个月 A 类基金份额。长盛稳益 6 个月 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 326,956,368.39 元，折合 326,956,368.39 份长盛稳益 6 个月 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 64,008.34 元，折合 64,008.34 份长盛稳益 6 个月 C 类基金份额；以上收到的实收基金共计人民币 327,020,376.73 元，折合 327,020,376.73 份长盛稳益 6 个月 C 类基金份额。长盛稳益 6 个月 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 987,194,613.03 元，分别折合成 A 类及 C 类基金份额，合计折合 987,194,613.03 份长盛稳益 6 个月基金份额。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 A 类基金份额在投资者认购、申购基金时收取认购、申购费用，C 类基金份额在投资者认购、申购基金份额时不收取认购、申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额仅对在同一开放期内申购后又赎回的份额收取赎回费。

根据基金管理人公布的《关于长盛稳益 6 个月定期开放债券型证券投资基金第三个封闭期到期后暂停运作、不开放申购及转换转入等安排的公告》，本基金的第三个封闭期为 2021 年 1 月 9 日至 2021 年 7 月 8 日。根据基金合同约定，经向中国证监会备案，基金管理人决定本基金第三个封闭期到期后暂停运作，暂不开放申购及转换转入业务。本基金管理人已于 2021 年 7 月 9 日对本基金基金份额全部进行自动赎回，基金暂停运作期间，基金管理人与基金托管人协商一致，可以决定终止基金合同，报中国证监会备案并公告，无须召开基金份额持有人大会。暂停运作期间的所有费用，由基金管理人承担。暂停运作期间，基金不收取管理费、托管费和销售服务费。截止 2022 年 3 月 28 日，本基金仍处于暂停运作。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、资产支持证券、次级债券、可分离交易可转债的纯债部分、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的

相关规定。本基金不投资股票、可转换债券和可交换债券，但可以投资可分离交易可转债的纯债部分。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，并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。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%，但应开放期流动性需要，为保护基金份额持有人利益，在每次开放期前 10 个工作日、开放期及开放期结束后 10 个工作日的期间内，本基金投资不受上述比例限制。在封闭期内，本基金所投金融资产以获取合同现金流量为目的并持有到期，且资产到期日不晚于封闭运作期到期日。在开放期，本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不得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；在封闭期内，本基金不受上述 5% 的限制。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。此基金的业绩比较基准为：中国人民银行公布的六个月银行定期整存整取存款利率（税后）+0.6%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照《长盛稳益 6 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》约定的资产估值和会计核算方法及财务报表 7.4.4 所述的重要会计政策和会计估计编制。

7.4.3 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 2021 年 7 月 8 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 7 月 8 日止期间的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 7 月 8 日止期间。

7.4.4.2 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。

7.4.4.3 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分类为：贷款和应收款项及持有至到期投资。金融资产的分

类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。

本基金以持有至到期为目的的债券投资、资产支持证券投资分类为持有至到期投资，在资产负债表中以“其他资产”列示。持有至到期投资是指到期日固定、回收金额固定或可确定，且管理层有明确意图和能力持有至到期的非衍生金融资产。

本基金目前持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、结算备付金、买入返售金融资产和各类应收款项等。

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

7.4.4.4 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。

对于取得债券投资支付的价款中包含债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。持有至到期投资、贷款和应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

债券投资按票面利率或商定利率每日计提应收利息，按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价，其摊销或减值产生的利得或损失，计入当期损益。

对于贷款和应收款项及其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，其摊销或减值产生的利得或损失，计入当期损益。

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；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

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；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。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金于资产负债表日对金融资产的账面价值进行检查，如果有客观证据表明某项金融资产发生减值的，计提减值准备。表明金融资产发生减值的客观证据，是指金融资产初始确认后实际

发生的、对该金融资产的预计未来现金流量有影响，且本基金能够对该影响进行可靠计量的事项。

以摊余成本计量的金融资产发生减值时，按预计未来现金流量（不包括尚未发生的未来信用损失）现值低于账面价值的差额，计提减值准备。如果有客观证据表明该金融资产价值已恢复，且客观上与确认该损失后发生的事项有关，原确认的减值损失予以转回，计入当期损益。

7.4.4.6 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。

7.4.4.7 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份额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。

7.4.4.8 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）”。

7.4.4.9 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实际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帐面已确认的利息收入的差额确认利息收入损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按实际持有期内逐日计提。付息债券、贴现券购买时采用实际支付价款（包含交易费用）确定初始成本，每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入；

(3) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(4) 债券投资收益/损失于卖出债券成交日确认，并按卖出债券成交金额与其成本、应收利息及相关费用的差额入账。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他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。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 本基金同一类别的每份基金份额享有同等分配权；

(2) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额该次可供分配利润的 20%，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(3) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(4) 基金收益分配后任一类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的任一类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(5) 投资者的现金红利保留到小数点后第 2 位，由此误差产生的收益或损失由基金资产承担；

(6) 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在指定媒介公告。

7.4.4.12 分部报告

无。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

无。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 税项

7.4.6.1 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。

7.4.6.2 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。

7.4.6.3 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021 年 7 月 8 日 | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 |
|----------------|-----------------------|--------------------------|
| 活期存款 | 61,830,722.27 | 2,264,444.42 |
| 定期存款 | - | - |
| 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 | - | - |
| 合计： | 61,830,722.27 | 2,264,444.42 |

7.4.7.2 交易性金融资产

注：无。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无。

7.4.7.4 买入返售金融资产**7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021 年 7 月 8 日 | |
|-------|--------------------------|-----------|
| | 账面余额 | 其中；买断式逆回购 |
| 交易所市场 | - | - |
| 银行间市场 | - | - |
| 合计 | - | - |
| 项目 | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 | |
| | 账面余额 | 其中；买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 500,000.00 | - |
| 银行间市场 | - | - |
| 合计 | 500,000.00 | - |

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021 年 7 月 8 日 | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 |
|------------|-----------------------|--------------------------|
| 应收活期存款利息 | 1,438.99 | 27.20 |
| 应收定期存款利息 | - | - |
| 应收其他存款利息 | - | - |
| 应收结算备付金利息 | 14.84 | - |
| 应收债券利息 | - | 196,991.10 |
| 应收资产支持证券利息 | - | - |
| 应收买入返售证券利息 | - | 21.81 |
| 应收申购款利息 | - | - |
| 应收黄金合约拆借孳息 | - | - |
| 应收出借证券利息 | - | - |
| 其他 | 3.64 | - |
| 合计 | 1,457.47 | 197,040.11 |

7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 | 上年度末 |
|----|-----|------|
|----|-----|------|

| | 2021 年 7 月 8 日 | 2020 年 12 月 31 日 |
|---------|----------------|------------------|
| 其他应收款 | - | - |
| 待摊费用 | - | - |
| 持有至到期投资 | - | 5,936,769.76 |
| 合计 | - | 5,936,769.76 |

注：本基金本期末及上年度末持有至到期投资列示如下，本报告期内及上年度可比期间持有至到期投资未发生减值损失。

单位：人民币元

| 项目 | | 本期末 2021 年 7 月 8 日 | | |
|--------|-------|--------------------------|------|--------------|
| | | 成本 | 减值损失 | 账面价值 |
| 债券 | 交易所市场 | - | - | - |
| | 银行间市场 | - | - | - |
| | 合计 | - | - | - |
| 资产支持证券 | | - | - | - |
| 合计 | | - | - | - |
| 项目 | | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 | | |
| | | 成本 | 减值损失 | 账面价值 |
| 债券 | 交易所市场 | 1,720,026.50 | - | 1,720,026.50 |
| | 银行间市场 | 4,216,743.26 | - | 4,216,743.26 |
| | 合计 | 5,936,769.76 | - | 5,936,769.76 |
| 资产支持证券 | | - | - | - |
| 合计 | | 5,936,769.76 | - | 5,936,769.76 |

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021 年 7 月 8 日 | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 |
|-------------|-----------------------|--------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | - | - |
| 银行间市场应付交易费用 | 468.00 | 160.50 |
| 合计 | 468.00 | 160.50 |

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021 年 7 月 8 日 | 上年度末 2020 年 12 月 31 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 | - | - |
| 预提费用 | 35,673.67 | 75,082.23 |
| 其他 | - | 50,690.10 |

| | | |
|----|-----------|------------|
| 合计 | 35,673.67 | 125,772.33 |
|----|-----------|------------|

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 长盛稳益 6 个月 A | | |
|---------------|--------------------------------------|---------------|
| 项目 | 本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 7 月 8 日 | |
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 10,071.80 | 10,071.80 |
| 本期申购 | 41,960,439.44 | 41,960,439.44 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | - | - |
| - 基金拆分/份额折算前 | - | - |
| 基金拆分/份额折算变动份额 | - | - |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回（以“-”号填列） | - | - |
| 本期末 | 41,970,511.24 | 41,970,511.24 |

金额单位：人民币元

| 长盛稳益 6 个月 C | | |
|---------------|--------------------------------------|---------------|
| 项目 | 本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 7 月 8 日 | |
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 8,553,475.60 | 8,553,475.60 |
| 本期申购 | 11,916,890.76 | 11,916,890.76 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -1,316,321.48 | -1,316,321.48 |
| - 基金拆分/份额折算前 | - | - |
| 基金拆分/份额折算变动份额 | - | - |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回（以“-”号填列） | - | - |
| 本期末 | 19,154,044.88 | 19,154,044.88 |

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 长盛稳益 6 个月 A | | | |
|----------------|------------|-------|------------|
| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
| 上年度末 | 2.35 | - | 2.35 |
| 本期利润 | 477,172.83 | - | 477,172.83 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 37,764.37 | - | 37,764.37 |
| 其中：基金申购款 | 37,764.37 | - | 37,764.37 |
| 基金赎回款 | - | - | - |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 514,939.55 | - | 514,939.55 |

单位：人民币元

| 长盛稳益 6 个月 C | | | |
|----------------|------------|-------|------------|
| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
| 上年度末 | 1,797.37 | - | 1,797.37 |
| 本期利润 | 188,589.39 | - | 188,589.39 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 4,728.65 | - | 4,728.65 |
| 其中：基金申购款 | 5,491.82 | - | 5,491.82 |
| 基金赎回款 | -763.17 | - | -763.17 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 195,115.41 | - | 195,115.41 |

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|-----------|--------------------------------|----------------------------------|
| | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 7 月 8 日 | 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 |
| 活期存款利息收入 | 3,937.16 | 244,137.42 |
| 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 | 446.81 | 7,730.86 |
| 其他 | 32.07 | 48.07 |
| 合计 | 4,416.04 | 251,916.35 |

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

注：无。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

注：无。

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|-------------------------|--------------------------------|----------------------------------|
| | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 7 月 8 日 | 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 |
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额 | 85,838,011.08 | 1,069,889,398.75 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 84,120,000.00 | 1,045,000,000.00 |

| | | |
|----------|--------------|---------------|
| 减：应收利息总额 | 1,718,011.08 | 24,889,398.75 |
| 买卖债券差价收入 | - | - |

7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年1月1日至2021 年7月8日 | 上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 12月31日 |
|----------------|-------------------------------|--------------------------------------|
| 卖出资产支持证券成交总额 | - | 112,862,299.17 |
| 减：卖出资产支持证券成本总额 | - | 110,000,000.00 |
| 减：应收利息总额 | - | 2,862,299.17 |
| 资产支持证券投资收益 | - | - |

7.4.7.14 贵金属投资收益

注：无。

7.4.7.15 衍生工具收益

注：无。

7.4.7.16 股利收益

注：无。

7.4.7.17 公允价值变动收益

注：无。

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年1月1日至2021年 7月8日 | 上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12 月31日 |
|---------|-------------------------------|--------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 9,159.51 | 2,863.78 |
| 合计 | 9,159.51 | 2,863.78 |

7.4.7.19 交易费用

注：无。

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年1月1日至2021 年7月8日 | 上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 12月31日 |
|------|-------------------------------|--------------------------------------|
| 审计费用 | 25,891.11 | - |

| | | |
|---------|-----------|------------|
| 信息披露费 | - | 75,082.23 |
| 证券出借违约金 | - | - |
| 银行汇划费 | 2,343.07 | 9,288.87 |
| 账户维护费 | 18,782.56 | 24,000.00 |
| 其他 | 300.00 | 1,100.00 |
| 合计 | 47,316.74 | 109,471.10 |

7.4.7.21 分部报告

无。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|--------------------|-----------------------|
| 长盛基金管理有限公司 | 基金管理人、基金注册登记机构、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、基金代销机构 |
| 国元证券股份有限公司（“国元证券”） | 基金管理人股东、基金代销机构 |
| 新加坡星展银行有限公司 | 基金管理人股东 |
| 安徽省信用融资担保集团有限公司 | 基金管理人股东 |
| 安徽省投资集团控股有限公司 | 基金管理人股东 |
| 长盛创富资产管理有限公司 | 基金管理人子公司 |
| 长盛基金（香港）有限公司 | 基金管理人子公司 |

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

注：无。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年1月1日至2021年7 月8日 | 上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31 日 |
|----------------|-------------------------------|--------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 45,742.70 | 259,672.90 |

| | | |
|-----------------|-----------|------------|
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 12,540.68 | 191,448.62 |
|-----------------|-----------|------------|

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 0.15% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% / \text{当年天数}$$

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

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------------|--------------------------------|----------------------------------|
| | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 7 月 8 日 | 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 15,247.52 | 86,557.64 |

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 0.05% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% / \text{当年天数}$$

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

7.4.10.2.3 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 | | |
|----------------|----------------------------------|-------------|------------|
| | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 7 月 8 日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 长盛稳益 6 个月 A | 长盛稳益 6 个月 C | 合计 |
| 中国银行 | - | - | - |
| 合计 | - | - | - |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 | | |
| | 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 长盛稳益 6 个月 A | 长盛稳益 6 个月 C | 合计 |
| 中国银行 | - | 245,975.06 | 245,975.06 |
| 合计 | - | 245,975.06 | 245,975.06 |

注：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年费率为 0.40%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务基金管理人将在基金年度报告中对该

项费用的列支情况作专项说明。销售服务费计提的计算公式如下：

$$H=E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

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

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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

注：无。

7.4.10.4.2 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

注：无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无。

7.4.10.5.2 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

注：无。

7.4.10.6 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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 7 月 8 日 | | 上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 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 | 61,830,722.27 | 3,937.16 | 2,264,444.42 | 244,137.42 |

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。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

注：无。

7.4.11 利润分配情况

注：无。

7.4.12 期末（2021 年 7 月 8 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：无。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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发行的证券，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。

7.4.13.2.1 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 2021 年 7 月 8 日 | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 |
|--------|-----------------------|--------------------------|
| A-1 | - | - |
| A-1 以下 | - | - |
| 未评级 | - | 1,419,966.19 |
| 合计 | - | 1,419,966.19 |

注：未评级部分为国债。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

7.4.13.2.4 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 2021 年 7 月 8 日 | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 |
|--------|-----------------------|--------------------------|
| AAA | - | - |
| AAA 以下 | - | - |
| 未评级 | - | 4,516,803.57 |
| 合计 | - | 4,516,803.57 |

注：未评级部分为国债和政策性金融债。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

7.4.13.3 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。

7.4.13.3.1 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 7.4.12 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 7.4.12.3 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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2021 年 7 月 8 日 | 6 个月以内 | 6 个月-1 年 | 1 年以上 | 不计息 | 合计 |
|--------------------------|---------------|----------|-------|--------------|---------------|
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 61,830,722.27 | - | - | - | 61,830,722.27 |
| 结算备付金 | 47,142.86 | - | - | - | 47,142.86 |
| 存出保证金 | 4,319.26 | - | - | - | 4,319.26 |
| 应收利息 | - | - | - | 1,457.47 | 1,457.47 |
| 资产总计 | 61,882,184.39 | - | - | 1,457.47 | 61,883,641.86 |
| 负债 | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 2,281.45 | 2,281.45 |
| 应付托管费 | - | - | - | 760.49 | 760.49 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 1,903.82 | 1,903.82 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 468.00 | 468.00 |
| 应交税费 | - | - | - | 7,943.35 | 7,943.35 |
| 其他负债 | - | - | - | 35,673.67 | 35,673.67 |
| 负债总计 | - | - | - | 49,030.78 | 49,030.78 |
| 利率敏感度缺口 | 61,882,184.39 | - | - | -47,573.31 | 61,834,611.08 |
| 上年度末 2020 年 12 月 31 日 | 6 个月以内 | 6 个月-1 年 | 1 年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 2,264,444.42 | - | - | - | 2,264,444.42 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | - | - |
| 买入返售金融资产 | 500,000.00 | - | - | - | 500,000.00 |
| 应收利息 | - | - | - | 197,040.11 | 197,040.11 |
| 应收申购款 | - | - | - | 1,723,542.04 | 1,723,542.04 |
| 其他资产 | 5,936,769.76 | - | - | - | 5,936,769.76 |
| 资产总计 | 8,701,214.18 | - | - | 1,920,582.15 | 10,621,796.33 |
| 负债 | | | | | |
| 应付证券清算款 | - | - | - | 1,833,789.42 | 1,833,789.42 |
| 应付赎回款 | - | - | - | 96,527.25 | 96,527.25 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 49.98 | 49.98 |
| 应付托管费 | - | - | - | 16.67 | 16.67 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 133.06 | 133.06 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 160.50 | 160.50 |
| 其他负债 | - | - | - | 125,772.33 | 125,772.33 |
| 负债总计 | - | - | - | 2,056,449.21 | 2,056,449.21 |
| 利率敏感度缺口 | 8,701,214.18 | - | - | -135,867.06 | 8,565,347.12 |

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金本报告期末未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 公允价值

7.4.14.1.1 不以公允价值计量的金融工具

本基金不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项、持有至到期投资和其他金融负债等。除持有至到期投资以外，其他不以公允价值计量的金融资产和金融负债的账面价值与公允价值差异很小。

| 项目 | 本期末 2021年7月8日 | |
|---------|---------------------|--------------|
| | 账面价值 | 公允价值 |
| 持有至到期投资 | - | - |
| 项目 | 上年度末 2020年12月31日 | |
| | 账面价值 | 公允价值 |
| 持有至到期投资 | 5,936,769.76 | 5,937,558.00 |

7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

(1) 各层次金融工具公允价值

本基金本报告期末未持有以公允价值计量的金融工具。

(2) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金持有的以公允价值计量的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

7.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.14.3 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。

7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2022 年 3 月 28 日经本基金的基金管理人批准。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末（2021 年 7 月 8 日）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 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 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 | 61,877,865.13 | 99.99 |
| 8 | 其他各项资产 | 5,776.73 | 0.01 |
| 9 | 合计 | 61,883,641.86 | 100.00 |

8.2 期末（2021 年 7 月 8 日）按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末（2021 年 7 月 8 日）按行业分类的境内股票投资组合

注：根据合同约定本基金不投资于股票等权益类资产。

8.2.2 报告期末（2021 年 7 月 8 日）按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：根据合同约定本基金不投资于股票等权益类资产。

8.3 期末（2021 年 7 月 8 日）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

注：根据合同约定本基金不投资于股票等权益类资产。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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

注：根据合同约定本基金不投资于股票等权益类资产。

8.4.2 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

注：根据合同约定本基金不投资于股票等权益类资产。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注：根据合同约定本基金不投资于股票等权益类资产。

8.5 期末（2021 年 7 月 8 日）按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末（2021 年 7 月 8 日）按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末（2021 年 7 月 8 日）按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末（2021 年 7 月 8 日）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

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末（2021 年 7 月 8 日）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

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末（2021 年 7 月 8 日）本基金投资的国债期货交易情况说明

8.10.1 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。

8.10.2 报告期末（2021 年 7 月 8 日）本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末无国债期货投资。

8.10.3 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。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

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。

8.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

根据合同约定本基金不投资于股票等权益类资产。

8.11.3 期末（2021 年 7 月 8 日）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 | 4,319.26 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 1,457.47 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 5,776.73 |

8.11.4 期末（2021 年 7 月 8 日）持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券（可交换债券）。

8.11.5 期末（2021 年 7 月 8 日）前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：根据合同约定本基金不投资于股票等权益类资产。

8.11.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末（2021 年 7 月 8 日）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 |
| 长盛稳益 6 个月 A | 8 | 5,246,313.91 | 41,960,235.79 | 99.98% | 10,275.45 | 0.02% |
| 长盛稳益 6 个月 C | 4,181 | 4,581.21 | - | 0.00% | 19,154,044.88 | 100.00% |
| 合计 | 4,189 | 14,591.68 | 41,960,235.79 | 68.65% | 19,164,320.33 | 31.35% |

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。

9.2 期末（2021 年 7 月 8 日）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 | 长盛稳益 6 个月 A | 0.00 | 0.0000% |
| | 长盛稳益 6 个月 C | 0.00 | 0.0000% |
| | 合计 | 0.00 | 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。

9.3 期末（2021 年 7 月 8 日）基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 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、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金 | 长盛稳益 6 个月 A | 0 |
| | 长盛稳益 6 个月 C | 0 |
| | 合计 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 长盛稳益 6 个月 A | 0 |
| | 长盛稳益 6 个月 C | 0 |
| | 合计 | 0 |

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 长盛稳益 6 个月 A | 长盛稳益 6 个月 C |
|--------------------------------|----------------|----------------|
| 基金合同生效日（2019 年 7 月 26 日）基金份额总额 | 660,174,236.30 | 327,020,376.73 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 10,071.80 | 8,553,475.60 |
| 本报告期基金总申购份额 | 41,960,439.44 | 11,916,890.76 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | - | 1,316,321.48 |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - | - |
| 本报告期期末（2021 年 7 月 8 日）基金份额总额 | 41,970,511.24 | 19,154,044.88 |

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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

11.2.1 本基金管理人的高级管理人员重大人事变动情况

2021 年 6 月 6 日, 根据我公司第八届董事会第一次会议决议, 会议选举高民和先生担任公司董事长, 周兵先生不再担任公司董事长; 根据第八届董事会第二次会议决议, 同意聘任周兵先生为公司总经理, 林培富先生不再担任公司总经理, 聘任郭堃同志为公司副总经理, 王宁先生不再担任公司副总经理职务。

2021 年 7 月 12 日, 根据公司第八届董事会第三次会议决议, 聘任吴达同志为任公司副总经理。

11.2.2 基金经理的变动情况

报经中国证券投资基金业协会同意, 自 2021 年 6 月 25 日起, 王贵君同志担任长盛稳益 6 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。

11.2.3 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。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 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, 本报告期应支付给该会计师事务所的报酬 25,891.11 元, 已连续提供审计服务 3 年。

11.6 管理人、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, 本基金管理人、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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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 | |
| 国金证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华创证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 第一创业 | 1 | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 平安证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 天风证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 安信证券 | 1 | - | - | - | - | - |

11.7.2 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 |
| 国金证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华创证券 | 26,255,389.00 | 100.00% | 43,500,000.00 | 100.00% | - | - |
| 第一创业 | - | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | - | - | - | - | - | - |
| 平安证券 | - | - | - | - | - | - |
| 天风证券 | - | - | - | - | - | - |
| 安信证券 | - | - | - | - | - | - |

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) 研究发展部、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深圳交易单元为共用交易单元。

4、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 | 银河证券 | 上海 | 1 |

11.8 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关于工商银行快捷支付渠道升级上线的公告 | 中国证监会指定披露媒介 | 2021年11月26日 |
| 2 | 长盛基金管理有限公司旗下全部基金2021年3季度报告提示性公告 | 中国证监会指定披露媒介 | 2021年10月27日 |
| 3 | 长盛稳益6个月定期开放债券型证券投资基金2021年第3季度报告 | 中国证监会指定披露媒介 | 2021年10月27日 |
| 4 | 长盛基金管理有限公司关于暂停使用工行快捷服务办理直销网上交易部分业务的公 | 中国证监会指定披露媒介 | 2021年10月26日 |

| | | | |
|----|--|-------------|------------------|
| | 告 | | |
| 5 | 长盛基金管理有限公司关于旗下基金增加意才基金为销售机构并开通定投和转换业务及参加费率优惠活动的公告 | 中国证监会指定披露媒介 | 2021 年 10 月 12 日 |
| 6 | 长盛基金管理有限公司关于旗下基金增加泰信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 | 2021 年 9 月 30 日 |
| 7 | 长盛基金管理有限公司旗下全部基金 2021 年中期报告提示性公告 | 中国证监会指定披露媒介 | 2021 年 8 月 28 日 |
| 8 | 长盛稳益 6 个月定期开放债券型证券投资基金 2021 年中期报告 | 中国证监会指定披露媒介 | 2021 年 8 月 28 日 |
| 9 | 长盛基金管理有限公司高级管理人员副总经理变更的公告 | 中国证监会指定披露媒介 | 2021 年 7 月 27 日 |
| 10 | 长盛基金管理有限公司关于旗下由中国银行股份有限公司托管的 26 只公募基金引入侧袋机制并修改基金合同等法律文件的公告 | 中国证监会指定披露媒介 | 2021 年 7 月 26 日 |
| 11 | 长盛稳益 6 个月定期开放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 | 2021 年 7 月 26 日 |
| 12 | 长盛稳益 6 个月定期开放债券型证券投资基金托管协议 | 中国证监会指定披露媒介 | 2021 年 7 月 26 日 |
| 13 | 长盛稳益 6 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同 | 中国证监会指定披露媒介 | 2021 年 7 月 26 日 |
| 14 | 长盛稳益 6 个月定期开放债券型证券投资基金（长盛稳益 6 个月 C 份额）基金产品资料概要（更新） | 中国证监会指定披露媒介 | 2021 年 7 月 26 日 |
| 15 | 长盛稳益 6 个月定期开放债券型证券投资基金（长盛稳益 6 个月 A 份额）基金产品资料概要（更新） | 中国证监会指定披露媒介 | 2021 年 7 月 26 日 |
| 16 | 长盛基金管理有限公司高级管理人员董事长变更的公告 | 中国证监会指定披露媒介 | 2021 年 7 月 22 日 |
| 17 | 长盛稳益 6 个月定期开放债券型证券投资基金 2021 年第 2 季度报告 | 中国证监会指定披露媒介 | 2021 年 7 月 21 日 |

| | | | |
|----|--|-------------|-----------------|
| 18 | 长盛基金管理有限公司旗下全部基金 2021 年 2 季度报告提示性公告 | 中国证监会指定披露媒介 | 2021 年 7 月 21 日 |
| 19 | 长盛基金管理有限公司关于董事变更的公告 | 中国证监会指定披露媒介 | 2021 年 7 月 17 日 |
| 20 | 关于长盛稳益 6 个月定期开放债券型证券投资基金第三个封闭期到期后暂停运作、不开放申购及转换转入等安排的公告 | 中国证监会指定披露媒介 | 2021 年 7 月 8 日 |
| 21 | 长盛稳益 6 个月定期开放债券型基金招募说明书（更新） | 中国证监会指定披露媒介 | 2021 年 6 月 30 日 |
| 22 | 长盛基金管理有限公司关于调整长盛稳益 6 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理的公告 | 中国证监会指定披露媒介 | 2021 年 6 月 26 日 |
| 23 | 长盛基金管理有限公司高级管理人员总经理变更的公告 | 中国证监会指定披露媒介 | 2021 年 6 月 18 日 |
| 24 | 长盛基金管理有限公司关于旗下基金增加销售机构并开通定投和转换业务及参加费率优惠活动的公告 | 中国证监会指定披露媒介 | 2021 年 6 月 10 日 |
| 25 | 长盛基金管理有限公司旗下全部基金 2021 年 1 季度报告提示性公告 | 中国证监会指定披露媒介 | 2021 年 4 月 22 日 |
| 26 | 长盛稳益 6 个月定期开放债券型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告 | 中国证监会指定披露媒介 | 2021 年 4 月 22 日 |
| 27 | 长盛基金管理有限公司旗下全部基金 2020 年年度报告提示性公告 | 中国证监会指定披露媒介 | 2021 年 3 月 31 日 |
| 28 | 长盛稳益 6 个月定期开放债券型证券投资基金 2020 年年度报告 | 中国证监会指定披露媒介 | 2021 年 3 月 31 日 |
| 29 | 长盛稳益 6 个月定期开放债券型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告 | 中国证监会指定披露媒介 | 2021 年 1 月 22 日 |
| 30 | 长盛基金管理有限公司旗下全部基金 2020 年 4 季度报告提示性公告 | 中国证监会指定披露媒介 | 2021 年 1 月 22 日 |
| 31 | 长盛基金管理有限公司关于增加恒天明泽为旗下部分开放式基金代销机构并推出定期定额投资业务及费率优惠 | 中国证监会指定披露媒介 | 2021 年 1 月 20 日 |

| | | | |
|--|-------|--|--|
| | 活动的公告 | | |
|--|-------|--|--|

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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 | 20210111~20210708 | 0.00 | 29,972,025.18 | 0.00 | 29,972,025.18 | 49.03% |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| <p>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。</p> | | | | | | | |

12.2 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。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、长盛稳益 6 个月定期开放债券型证券投资基金相关批准文件；
- 2、《长盛稳益 6 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长盛稳益 6 个月定期开放债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、《长盛稳益 6 个月定期开放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。

13.2 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。

13.3 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

2022 年 3 月 31 日