

长盛安鑫中短债债券型证券投资基金 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：长盛基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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。

报告期内，本基金自 2021 年 12 月 10 日起增加 D 类基金份额，并自该日起接受投资者对 D 类基金份额的申购和赎回。D 类基金份额代码：014465，简称：长盛安鑫中短债 D。详情参阅本基金管理人于 2021 年 12 月 10 日披露的相关公告。

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）为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	11
§ 4 管理人报告	13
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
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.....	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	17
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.....	18
§ 5 托管人报告	19
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	19
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.....	19
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.....	19
§ 6 审计报告	20
6.1 审计报告基本信息.....	20
6.2 审计报告的基本内容.....	20
§ 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	52
8.1 期末基金资产组合情况.....	52
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	52
8.3 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.....	52
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	52
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	53
8.6 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.....	53
8.7 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.....	53

8.8 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	53
8.9 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	53
8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54
8.11 市场中性策略执行情况	54
8.12 投资组合报告附注	54
§9 基金份额持有人信息	56
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	56
9.3 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的情况	56
§10 开放式基金份额变动	57
§ 11 重大事件揭示	58
11.1 基金份额持有人大会决议	58
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	58
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	58
11.4 基金投资策略的改变	58
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	58
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	59
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	59
11.8 其他重大事件	60
§12 影响投资者决策的其他重要信息	64
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	64
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	64
§13 备查文件目录	65
13.1 备查文件目录	65
13.2 存放地点	65
13.3 查阅方式	65

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长盛安鑫中短债债券型证券投资基金		
基金简称	长盛安鑫中短债		
基金主代码	006902		
交易代码	006902		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2019年2月20日		
基金管理人	长盛基金管理有限公司		
基金托管人	中国工商银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	4,544,747,017.34份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	长盛安鑫中短债 A	长盛安鑫中短债 C	长盛安鑫中短债 D
下属分级基金的交易代码	006902	006903	014465
报告期末下属分级基金份额总额	3,219,725,560.95份	508,194,148.83份	816,827,307.56份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险和保持良好流动性的前提下，重点投资中短债，力争获得持续稳定的投资收益。
投资策略	<p>(一) 大类资产配置策略</p> <p>本基金将在综合判断宏观经济周期、市场资金供需状况、大类资产估值水平对比的基础上，结合政策分析，确定不同投资期限内的大类金融资产配置和债券类属配置。同时通过严格风险评估，及时调整资产组合比例，保持资产配置风险、收益平衡，以稳健提升投资组合回报。</p> <p>(二) 债券组合管理策略</p> <p>本基金的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、中小企业私募债投资策略、资产支持证券等品种投资策略、证券公司短期公司债券投资策略、国债期货投资策略。</p>
业绩比较基准	中债综合财富(1-3年)指数收益率*80%+一年期定期存款利率(税后)*20%
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。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人 姓名	张利宁	郭明

	联系电话	010-86497608	010-66105799
	电子邮箱	zhangln@csfunds.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-2666 010-86497888	95588
传真		010-86497999	010-66105798
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 55 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 55 号
邮政编码		100029	100140
法定代表人		周兵	陈四清

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	基金管理人和基金托管人的办公地址

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）	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			2020 年		2019 年 2 月 20 日 (基金合同生效日) - 2019 年 12 月 31 日	
	长盛安鑫中短债 A	长盛安鑫中短债 C	长盛安鑫中短债 D	长盛安鑫中短债 A	长盛安鑫中短债 C	长盛安鑫中短债 A	长盛安鑫中短债 C
本期已实现收益	8,883,161.44	791,065.80	310,370.39	5,588,997.14	1,238,599.29	12,186,976.37	7,012,536.70
本期利润	9,426,081.24	955,971.02	495,037.90	5,098,705.79	1,402,165.08	12,563,508.60	6,776,298.08
加权平均 基金份额 本期利润	0.0281	0.0257	0.0028	0.0244	0.0268	0.0247	0.0191
本期加权 平均净值 利润率	2.65%	2.44%	0.26%	2.38%	2.63%	2.45%	1.90%
本期基金 份额净值 增长率	3.74%	3.32%	0.13%	2.51%	2.10%	3.06%	2.70%
3.1.2 期末数据 和指标	2021 年末			2020 年末		2019 年末	
	200,803,305.99	26,872,648.69	50,960,961.89	16,949,687.17	3,086,849.60	2,006,238.98	600,398.98
期末可供 分配利润	0.0624	0.0529	0.0624	0.0335	0.0283	0.0074	0.0065
期末基金 资产净值	3,454,803,760.35	540,436,455.87	876,485,037.90	524,041,287.69	112,177,001.84	273,817,851.04	93,535,506.15
期末基金 份额净值	1.0730	1.0634	1.0730	1.0343	1.0292	1.0090	1.0080
3.1.3 累计期末 指标	2021 年末			2020 年末		2019 年末	
	9.60%	8.35%	0.13%	5.65%	4.86%	3.06%	2.70%
基金份额 累计净值 增长率							

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。

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。表中的“期末”均指本报告期最后一日，即 12 月 31 日。

3.2 基金净值表现

3.1.1 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

长盛安鑫中短债 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.70%	0.02%	0.81%	0.02%	-0.11%	0.00%
过去六个月	2.05%	0.02%	1.79%	0.02%	0.26%	0.00%
过去一年	3.74%	0.03%	3.51%	0.02%	0.23%	0.01%
自基金合同生效起至今	9.60%	0.03%	9.25%	0.03%	0.35%	0.00%

长盛安鑫中短债 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.62%	0.02%	0.81%	0.02%	-0.19%	0.00%
过去六个月	1.85%	0.02%	1.79%	0.02%	0.06%	0.00%
过去一年	3.32%	0.03%	3.51%	0.02%	-0.19%	0.01%
自基金合同生效起至今	8.35%	0.03%	9.25%	0.03%	-0.90%	0.00%

长盛安鑫中短债 D

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
自基金新增本类份额起至今	0.13%	0.01%	0.21%	0.01%	-0.08%	0.00%

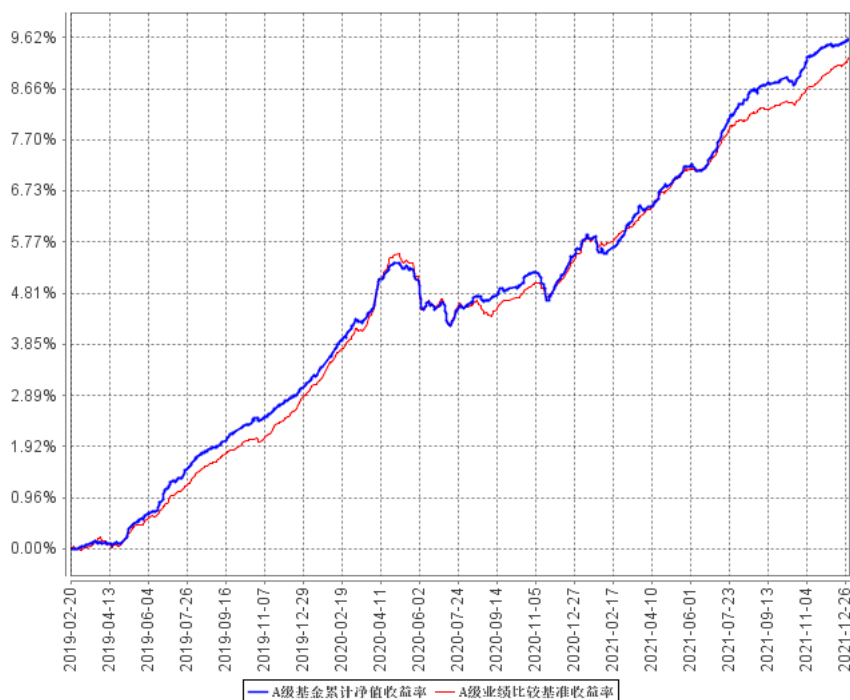
注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

本基金业绩比较基准为中债综合财富（1-3 年）指数收益率*80%+一年期定期存款利率（税后）*20%。本基金为债券型证券投资基金，重点投资中短债，所以本基金选取中债综合财富（1-3 年）指数收益率作为业绩比较基准。中债综合财富（1-3 年）指数对中短期债券价格变动趋势有较强的代表性，能较为科学、合理的评价本基金的业绩表现。

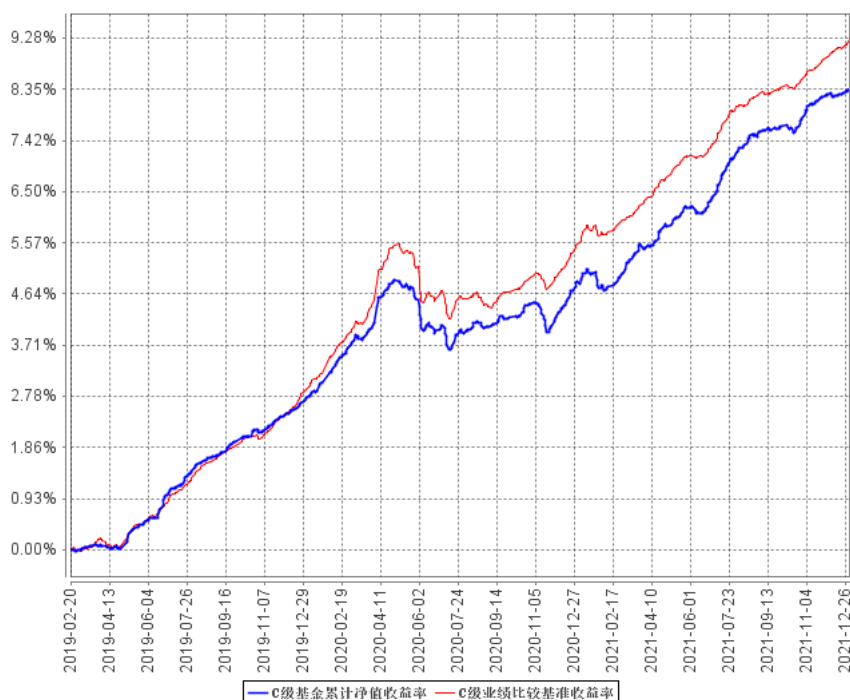
再平衡：由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，业绩比较基准中中债综合财富（1-3 年）指数、一年期定期存款利率（税后）每日按照 80%、20%的比例采取再平衡，再用连锁计算的方式得到基准指数的时间序列。

3.1.2 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

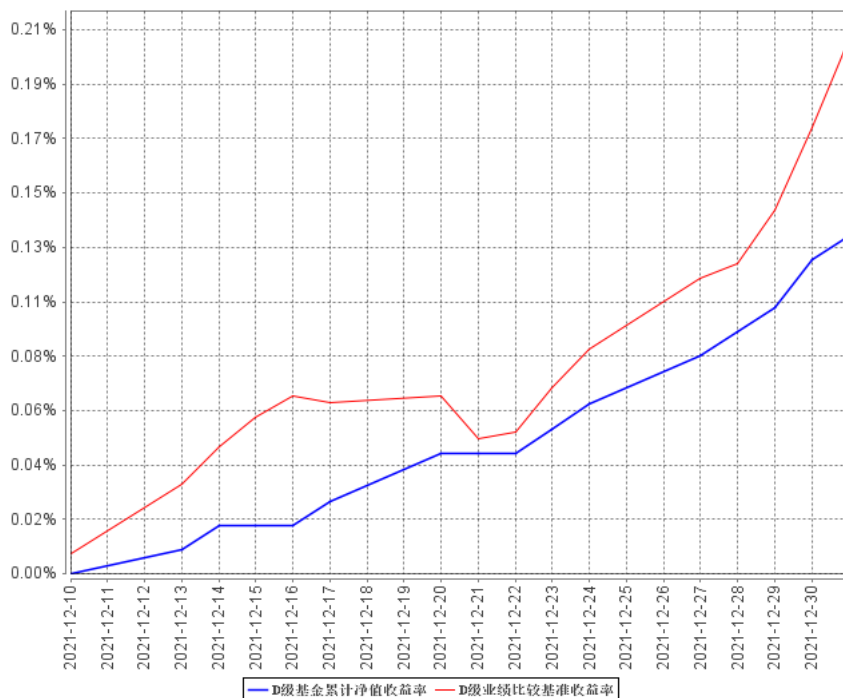
A级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



C级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



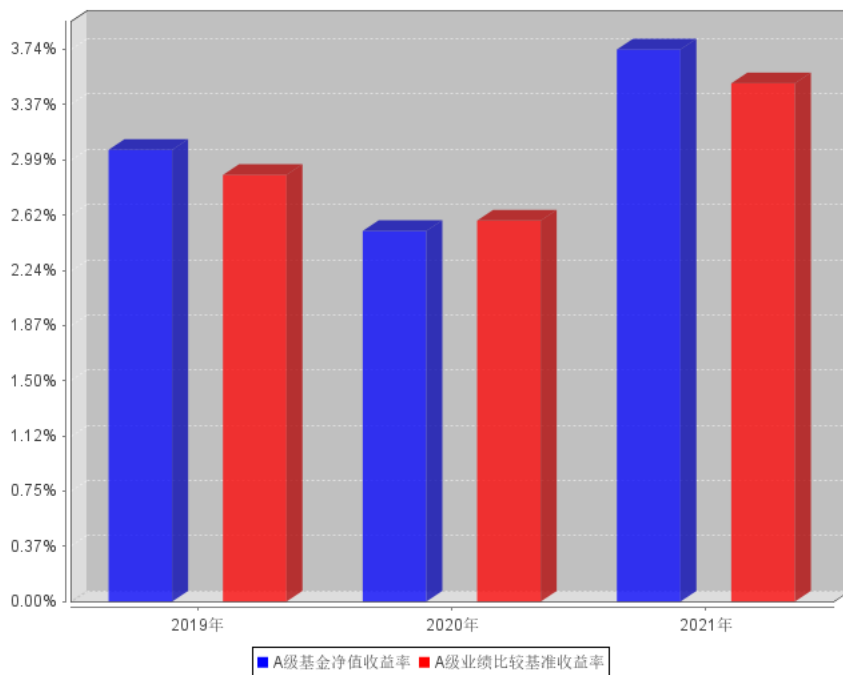
D级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



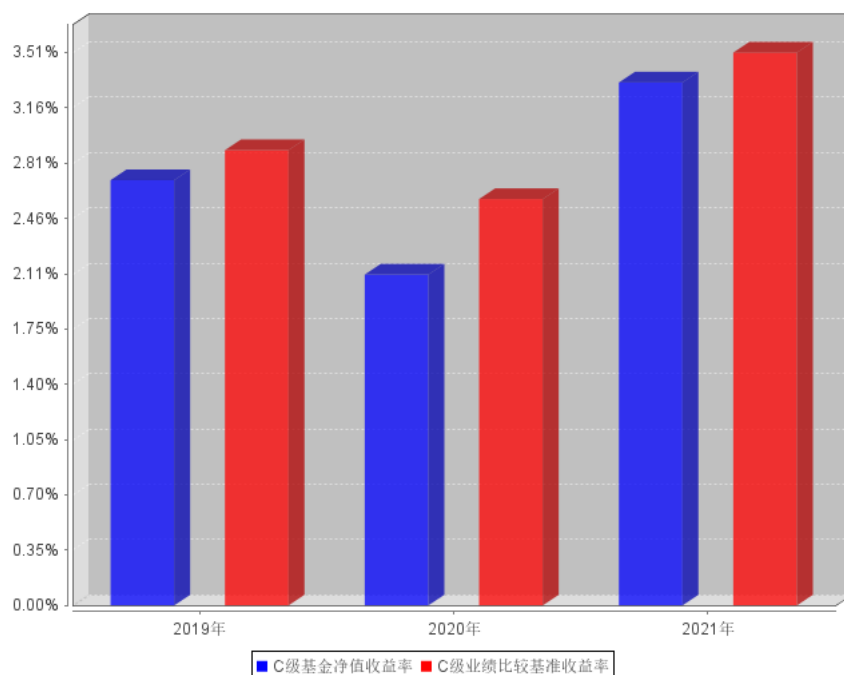
注：按照本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。建仓期结束时，本基金的各项资产配置比例符合本基金合同的有关约定。截至报告日，本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.1.3 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

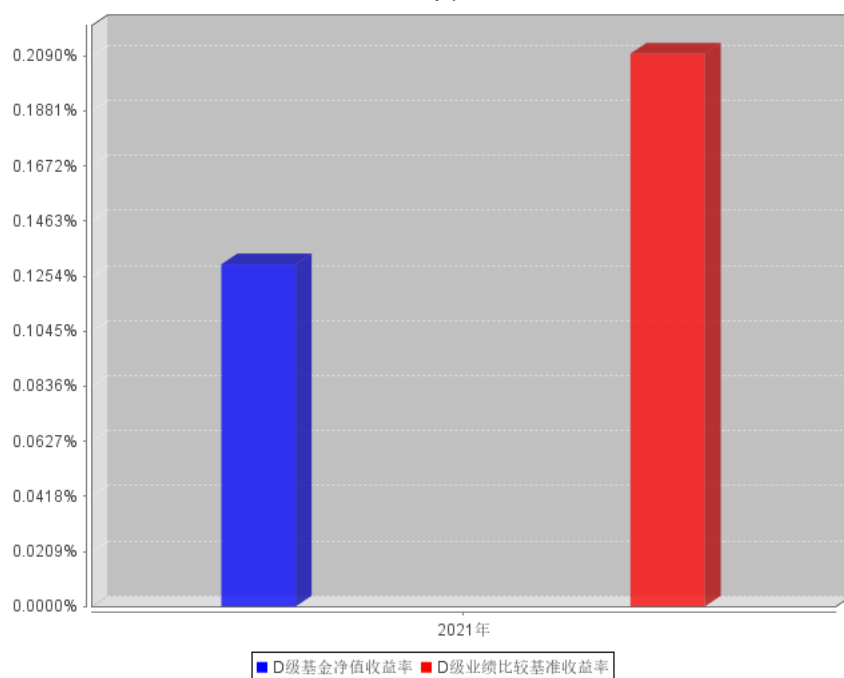
A级自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



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



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



注：本基金基金合同生效日为 2019 年 2 月 20 日，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。本基金 D 类基金份额自 2021 年 12 月 10 日起接受投资者的申购和赎回，当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

长盛安鑫中短债 A					
年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2021	-	-	-	-	
2020	-	-	-	-	
2019	0.2160	4,073,614.75	429,423.80	4,503,038.55	
合计	0.2160	4,073,614.75	429,423.80	4,503,038.55	

单位：人民币元

长盛安鑫中短债 C					
年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2021	-	-	-	-	
2020	-	-	-	-	
2019	0.1900	1,618,138.23	227,355.74	1,845,493.97	
合计	0.1900	1,618,138.23	227,355.74	1,845,493.97	

单位：人民币元

长盛安鑫中短债 D					
年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2021	-	-	-	-	
合计	-	-	-	-	

§ 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		
王赛飞	本基金基金经理，长盛添利宝货币市场基金基金经理，长盛盛琪一年期定期开放债券型证券投资基金基金经理。	2021 年 11 月 2 日	-	9 年	王赛飞女士，硕士。曾任大公国际资信评估有限公司分析师、信用评审委员会委员。2015 年 7 月加入长盛基金管理有限公司固定收益部，曾任信用研究员、基金经理助理等职务。
张建	本基金基金经理。	2021 年 12 月 2 日	-	8 年	张建先生，硕士。曾任中国银河证券股份有限公司交易员/投资助理、银河金汇证券资产管理有限公司投资助理/投资主办人。2021 年 11 月加入长盛基金管理有限公司固定收益部。
葛鹤军	本基金基金经理。	2019 年 2 月 20 日	2021 年 11 月 2 日	13 年	葛鹤军先生，博士。曾就职于中诚信证券评估有限公司，中诚信国际信用评级有限公司。曾任银华基金管理股份有限公司研究员、基金经理助理、基金经理。2018 年 7 月加入长盛

					基金管理有限公司。目前已离任。
--	--	--	--	--	-----------------

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”的含义遵从行业协会《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遵规守信情况的说明

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，债券市场收益率呈现震荡下行的走势。全年来看，经济增长面临较大压力，国内外疫情扰动贯穿全年，尤其国外，先后经历德尔塔和奥密克戎变异株的扰动，对国内外经济增长的恢复产生较大干扰。大宗商品价格上涨，拉闸限电、能源荒等问题困扰经济增长。在此背景下，货币政策积极应对，先后两次调降存款准备金率，调降 LPR，置换到期的 MLF，降低银行负债成本，整体资金成本稳定在较低水平，以稳定经济增长预期。同时，通过及时合理的 OMO 操作，保障市场流动性合理充裕，稳定市场预期。

在此背景下，债券市场收益率震荡下行，以国开债为例，10 年国开下行 45.04BP 至 3.0834%，5 年国开下行 47.97BP 至 2.7834%，1 年下行 24.23BP 至 2.3154%。期限利差缩窄，曲线呈现平坦化趋势。

2、报告期内本基金投资策略分析

报告期内，本基金主要投资于流动性较好的中短期债券，在防范信用风险的前提下根据市场情况不断调整资产结构。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末长盛安鑫中短债 A 基金份额净值为 1.0730 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.74%，同期业绩比较基准收益率为 3.51%；截至本报告期末长盛安鑫中短债 C 基金份额净值为 1.0634 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.32%，同期业绩比较基准收益率为 3.51%；截至本

报告期末长盛安鑫中短债 D 基金份额净值为 1.0730 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.13%；同期业绩比较基准收益率为 0.21%。

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，疫情对经济增长的扰动或仍将存续一段时间，在需求收缩、供给冲击、预期转弱三重压力下，经济增长仍将面临较大压力。投资方面，在稳增长的大背景下，基建会有较大程度发力，制造业会是未来一段时间投资的主要增长点，房地产受产业调控的影响，料全年增长依旧乏力。消费保持相对稳定，对外贸易在前年高增长的基础上或有所回落。

以美国为首的西方发达国家面临较大的通胀压力，货币政策的收紧已基本确认，taper 提前，多次加息，甚至缩表都可能在政策考虑范围内，对国内政策或形成一定掣肘。国内货币政策坚持“以我为主”，部分政策或提前。

预计 2022 年，债券市场收益呈现低位震荡格局，整体收益率或有小幅下行，债券市场结构性行情或是全年主线。在此背景下，2022 年，我们将坚持短久期+票息策略，在保障资产安全和流动性充裕的前提下，合理使用杠杆，努力为投资人创造稳健的收益。

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，本报告期内未实施利润分配。

本基金截至 2021 年 12 月 31 日，期末可供分配利润为 278,636,916.57 元，其中：长盛安鑫中短债 A 期末可供分配利润为 200,803,305.99 元（长盛安鑫中短债 A 的未分配利润已实现部分为 200,803,305.99 元，未分配利润未实现部分为 34,274,893.41），长盛安鑫中短债 C 期末可供分配利润为 26,872,648.69 元（长盛安鑫中短债 C 的未分配利润已实现部分为 26,872,648.69 元，未分配利润未实现部分为 5,369,658.35 元），长盛安鑫中短债 D 期末可供分配利润为 50,960,961.89 元（长盛安鑫中短债 D 的未分配利润已实现部分为 50,960,961.89 元，未分配利润未实现部分为 8,696,768.45 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，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。本报告期内，本基金托管人在对长盛安鑫中短债债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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，本基金的管理人——长盛基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人依法对长盛基金管理有限公司编制和披露的本基金 2021 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、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	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2022）审字第 60468688_A23 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	长盛安鑫中短债债券型证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	<p>我们审计了长盛安鑫中短债债券型证券投资基金的财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表，2021 年度的利润表、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，后附的长盛安鑫中短债债券型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了长盛安鑫中短债债券型证券投资基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和净值变动情况。</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，我们独立于长盛安鑫中短债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>
其他信息	<p>长盛安鑫中短债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>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估长盛安鑫中短债债券型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督长盛安鑫中短债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>（4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对长盛安鑫中短债债券型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致长盛安鑫中短债债券型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>（5）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</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：长盛安鑫中短债债券型证券投资基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	11,429,000.61	52,157,114.55
结算备付金		1,185,692.90	5,086,532.94
存出保证金		3,900.56	11,280.77
交易性金融资产	7.4.7.2	3,965,680,606.10	610,350,467.60
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		3,965,680,606.10	610,350,467.60
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	840,352,195.53	-
应收证券清算款		10,084,949.48	-
应收利息	7.4.7.5	70,764,343.68	9,066,875.63
应收股利		-	-
应收申购款		3,974,909.05	24,883,970.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		4,903,475,597.91	701,556,241.49
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 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		19,999,870.00	15,000,000.00
应付证券清算款		10,234,226.85	50,031,306.68
应付赎回款		318,785.35	123,504.83
应付管理人报酬		559,975.85	77,449.68
应付托管费		149,326.88	20,653.25
应付销售服务费		73,348.33	14,865.34
应付交易费用	7.4.7.7	46,295.16	2,225.00
应交税费		178,150.25	22,427.09
应付利息		1,363.99	-23,480.03

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	189,001.13	69,000.12
负债合计		31,750,343.79	65,337,951.96
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	4,544,747,017.34	615,646,020.54
未分配利润	7.4.7.10	326,978,236.78	20,572,268.99
所有者权益合计		4,871,725,254.12	636,218,289.53
负债和所有者权益总计		4,903,475,597.91	701,556,241.49

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额总额 4,544,747,017.34 份，其中长盛安鑫中短债 A 基金份额净值 1.0730 元，份额总额 3,219,725,560.95 份；长盛安鑫中短债 C 基金份额净值 1.0634 元，份额总额 508,194,148.83 份；长盛安鑫中短债 D 基金份额净值 1.0730 元，份额总额 816,827,307.56 份；

7.2 利润表

会计主体：长盛安鑫中短债债券型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		13,987,952.36	9,502,990.89
1. 利息收入		13,744,174.86	11,913,807.42
其中：存款利息收入	7.4.7.11	67,603.66	69,531.25
债券利息收入		13,067,020.32	11,835,309.18
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		609,550.88	8,966.99
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-743,633.10	-2,097,941.07
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	-743,633.10	-2,097,941.07
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
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	892,492.53	-326,725.56
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	94,918.07	13,850.10

减：二、费用		3,110,862.20	3,002,120.02
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,160,101.06	803,046.08
2. 托管费	7.4.10.2.2	309,360.29	214,145.64
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	148,226.32	215,429.22
4. 交易费用	7.4.7.19	45,571.65	8,894.23
5. 利息支出		1,174,555.26	1,493,877.19
其中：卖出回购金融资产支出		1,174,555.26	1,493,877.19
6. 税金及附加		40,759.69	37,556.94
7. 其他费用	7.4.7.20	232,287.93	229,170.72
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		10,877,090.16	6,500,870.87
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		10,877,090.16	6,500,870.87

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长盛安鑫中短债债券型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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）	615,646,020.54	20,572,268.99	636,218,289.53
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	10,877,090.16	10,877,090.16
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）	3,929,100,996.80	295,528,877.63	4,224,629,874.43
其中：1. 基金申购款	4,429,508,469.41	313,970,842.04	4,743,479,311.45
2. 基金赎回款	-500,407,472.61	-18,441,964.41	-518,849,437.02
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）	4,544,747,017.34	326,978,236.78	4,871,725,254.12

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）	364,178,666.32	3,174,690.87	367,353,357.19
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	6,500,870.87	6,500,870.87
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）	251,467,354.22	10,896,707.25	262,364,061.47
其中：1. 基金申购款	619,601,204.25	18,491,501.75	638,092,706.00
2. 基金赎回款	-368,133,850.03	-7,594,794.50	-375,728,644.53
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）	615,646,020.54	20,572,268.99	636,218,289.53

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：

_____周兵_____	_____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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

长盛安鑫中短债债券型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2019]12号《关于准予长盛安鑫中短债债券型证券投资基金注册的批复》的注册，由长盛基金管理有限公司于2019年1月21日至2019年2月15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_A01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2月20日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。截至2019年2月19日止，长盛安鑫中短债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1,276,820,424.07元，折合1,276,820,424.07份长盛安鑫中短债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383,208.40元，折合383,208.40份长盛安鑫中短债A类基金份额；以上收到的实收基金共计人民币1,277,203,632.47元，折合1,277,203,632.47份长盛安鑫中短债A类基金份额。长盛安

鑫中短债 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 1,049,129,806.42 元,折合 1,049,129,806.42 份长盛安鑫中短债 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 382,653.18 元,折合 382,653.18 份长盛安鑫中短债 C 类基金份额;以上收到的实收基金共计人民币 1,049,512,459.60 元,折合 1,049,512,459.60 份长盛安鑫中短债 C 类基金份额。长盛安鑫中短债 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 2,326,716,092.07 元,分别折合成 A 类及 C 类基金份额,合计折合 2,326,716,092.07 份长盛安鑫中短债基金份额。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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

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,包括 A 类基金份额和 D 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、C 类和 D 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、C 类和 D 类基金份额将分别计算并公告基金份额净值。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括国债、地方政府债、央行票据、金融债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可分离交易可转债的纯债部分、次级债、中小企业私募债、证券公司短期公司债券、政府支持机构债券及政府支持债、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、国债期货等法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金不投资于股票、权证等权益类资产,也不投资于可转换债券(可分离交易可转债的纯债部分除外)、可交换债券。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。本基金债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%,其中投资于中短债的比例不低于非现金基金资产的 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,本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计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。本基金所指的中短债是指剩余期限不超过三年的债券资产,主要包括国债、地方政府债、央行票据、金融债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可分离交易可转债的纯债部分、次级债、中小企业私募债、证券公司短期公司债券、政府支持机构债券及政府支持债等债券。当法律法规的相关规定变更时,基金管理人在履行适当程序后可对上述资产配置比例进行适当调整。本基金业绩比较基准:中债综合财富(1-3 年)指数收益率 \times 80%+一年期定期存款利率(税后) \times 20%。

7.4.2 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、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《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 2 号《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〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定及参考意见。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

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 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度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。

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为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

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主要为债券投资；

(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。

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的债券等，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；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

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；

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(2) 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

7.4.4.5 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。

本基金持有的债券投资等投资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。

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) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 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；

(5) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(6) 公允价值变动收益/（损失）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。

7.4.4.10 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) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每份基金份额每年收益分配次数最多为 4 次，每次收益分配比例不得低于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；

(2) 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按除权日经除权后的该类基金份额净值自动转为该类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；

(3) 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。

(4) 由于基金费用的不同，本基金各类基金份额在可供分配利润上有所不同；本基金同一类别的每份基金份额享有同等分配权；

(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) 法律法规或监管机关另有规定的，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。

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 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	11,429,000.61	52,157,114.55
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：	11,429,000.61	52,157,114.55

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2021 年 12 月 31 日		
		成本	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	178,476,081.85	177,930,706.10	-545,375.75
	银行间市场	3,786,498,463.67	3,787,749,900.00	1,251,436.33
	合计	3,964,974,545.52	3,965,680,606.10	706,060.58
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		3,964,974,545.52	3,965,680,606.10	706,060.58
项目		上年度末 2020 年 12 月 31 日		
		成本	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	212,099,916.87	211,692,467.60	-407,449.27
	银行间市场	398,436,982.68	398,658,000.00	221,017.32
	合计	610,536,899.55	610,350,467.60	-186,431.95
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		610,536,899.55	610,350,467.60	-186,431.95

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 12 月 31 日	
		账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场		70,000,000.00	-
银行间市场		770,352,195.53	-
合计		840,352,195.53	-
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	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-

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 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	2,218.76	3,289.99
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	533.60	2,288.90
应收债券利息	70,300,730.33	9,061,291.64
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	460,859.19	-
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	1.80	5.10
合计	70,764,343.68	9,066,875.63

7.4.7.6 其他资产

注：无。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 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	46,295.16	2,225.00
合计	46,295.16	2,225.00

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 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	1.13	0.12
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	189,000.00	69,000.00
合计	189,001.13	69,000.12

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

长盛安鑫中短债 A		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	506,647,338.32	506,647,338.32
本期申购	3,109,863,527.01	3,109,863,527.01
本期赎回(以“-”号填列)	-396,785,304.38	-396,785,304.38
- 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	3,219,725,560.95	3,219,725,560.95

金额单位：人民币元

长盛安鑫中短债 C		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	108,998,682.22	108,998,682.22
本期申购	502,817,634.84	502,817,634.84
本期赎回(以“-”号填列)	-103,622,168.23	-103,622,168.23
- 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	508,194,148.83	508,194,148.83

金额单位：人民币元

长盛安鑫中短债 D

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	816,827,307.56	816,827,307.56
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	816,827,307.56	816,827,307.56

注：申购含转换入，赎回含转换出。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

长盛安鑫中短债 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	16,949,687.17	444,262.20	17,393,949.37
本期利润	8,883,161.44	542,919.80	9,426,081.24
本期基金份额交易产生的变动数	174,970,457.38	33,287,711.41	208,258,168.79
其中：基金申购款	190,019,995.71	33,324,509.88	223,344,505.59
基金赎回款	-15,049,538.33	-36,798.47	-15,086,336.80
本期已分配利润	-	-	-
本期末	200,803,305.99	34,274,893.41	235,078,199.40

单位：人民币元

长盛安鑫中短债 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,086,849.60	91,470.02	3,178,319.62
本期利润	791,065.80	164,905.22	955,971.02
本期基金份额交易产生的变动数	22,994,733.29	5,113,283.11	28,108,016.40
其中：基金申购款	26,164,615.85	5,299,028.16	31,463,644.01
基金赎回款	-3,169,882.56	-185,745.05	-3,355,627.61
本期已分配利润	-	-	-
本期末	26,872,648.69	5,369,658.35	32,242,307.04

单位：人民币元

长盛安鑫中短债 D			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-

本期利润	310,370.39	184,667.51	495,037.90
本期基金份额交易产生的变动数	50,650,591.50	8,512,100.94	59,162,692.44
其中：基金申购款	50,650,591.50	8,512,100.94	59,162,692.44
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	50,960,961.89	8,696,768.45	59,657,730.34

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12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
活期存款利息收入	23,750.89	28,441.12
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	43,691.88	41,008.39
其他	160.89	81.74
合计	67,603.66	69,531.25

7.4.7.12 股票投资收益

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

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12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-743,633.10	-2,097,941.07
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	-743,633.10	-2,097,941.07

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	2020年1月1日至2020年

	年12月31日	12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	961,141,978.06	577,871,037.61
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	946,766,910.44	568,525,515.67
减：应收利息总额	15,118,700.72	11,443,463.01
买卖债券差价收入	-743,633.10	-2,097,941.07

7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

注：无。

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

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021 年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 12月31日
1. 交易性金融资产	892,492.53	-326,725.56
——股票投资	-	-
——债券投资	892,492.53	-326,725.56
——资产支持证券投资	-	-
——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	892,492.53	-326,725.56

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12月31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	94,431.58	13,246.45
基金转换费收入	486.49	603.65
合计	94,918.07	13,850.10

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
交易所市场交易费用	1,296.65	346.73
银行间市场交易费用	44,275.00	8,547.50
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	45,571.65	8,894.23

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12月31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	60,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费	15,237.93	11,970.72
其他	1,200.00	1,200.00
中债登账户维护费	18,000.00	18,000.00
上清所账户维护费	17,850.00	18,000.00
合计	232,287.93	229,170.72

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

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。

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
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人、基金销售机构
国元证券股份有限公司（“国元证券”）	基金管理人股东
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

无。

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

注：无。

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日	
	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 成交总额的比 例
国元证券	10,115,697.26	2.58%	-	-

7.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

7.4.10.1.4 权证交易

注：无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

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	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31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管理费	1,160,101.06	803,046.08
其中：支付销售机构的客户维护费	81,960.17	134,140.41

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 0.30% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% / \text{当年天数}$$

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12月31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	309,360.29	214,145.64

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 0.08% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.08\% / \text{当年天数}$$

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12月31日 当期发生的基金应支付的销售服务费			
	长盛安鑫中短债 A	长盛安鑫中短债 C	长盛安鑫中短债 D	合计
	长盛基金管理有限公司	-	45,686.95	-
中国工商银行	-	56,678.23	-	56,678.23
国元证券	-	300.03	-	300.03
合计	-	102,665.21	-	102,665.21
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			
	长盛安鑫中短债 A	长盛安鑫中短债 C	长盛安鑫中短债 D	合计
	长盛基金管理有限公司	-	45,042.60	-
中国工商银行	-	143,144.30	-	143,144.30
国元证券	-	1,290.01	-	1,290.01
合计	-	189,476.91	-	189,476.91

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 类和 D 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 0.40% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% / \text{当年天数}$$

H 为 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

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12月31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
中国工商银行	11,429,000.61	23,750.89	52,157,114.55	28,441.12

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国工商银行保管，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

无。

7.4.11 利润分配情况

注：无。

7.4.12 期末（2021年12月31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

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 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 19,999,870.00 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
120206	12 国开 06	2022 年 1 月 4 日	100.01	300,000	30,003,000.00
合计				300,000	30,003,000.00

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

注：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 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
A-1	463,430,000.00	-
A-1 以下	-	-
未评级	2,565,380,800.00	61,905,467.60
合计	3,028,810,800.00	61,905,467.60

注：表中所列示的未评级债券投资为国债、政策性金融债及短期融资券。

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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	48,705,000.00	-
合计	48,705,000.00	-

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 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	506,068,800.00	250,416,000.00
AAA 以下	207,239,900.00	-
未评级	174,856,106.10	298,029,000.00
合计	888,164,806.10	548,445,000.00

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。以上按长期信用评级未评级的债券投资为政策性金融债。

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 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	11,429,000.61	-	-	-	11,429,000.61
结算备付金	1,185,692.90	-	-	-	1,185,692.90
存出保证金	3,900.56	-	-	-	3,900.56
交易性金融资产	3,906,715,200.00	54,262,300.00	4,703,106.10	-	3,965,680,606.10
买入返售金融资产	840,352,195.53	-	-	-	840,352,195.53
应收证券清算款	-	-	-	10,084,949.48	10,084,949.48
应收利息	-	-	-	70,764,343.68	70,764,343.68
应收申购款	-	-	-	3,974,909.05	3,974,909.05
资产总计	4,759,685,989.60	54,262,300.00	4,703,106.10	84,824,202.21	4,903,475,597.91
负债					
卖出回购金融资产款	19,999,870.00	-	-	-	19,999,870.00
应付证券清算款	-	-	-	10,234,226.85	10,234,226.85
应付赎回款	-	-	-	318,785.35	318,785.35
应付管理人报酬	-	-	-	559,975.85	559,975.85
应付托管费	-	-	-	149,326.88	149,326.88
应付销售服务费	-	-	-	73,348.33	73,348.33
应付交易费用	-	-	-	46,295.16	46,295.16
应付利息	-	-	-	1,363.99	1,363.99
应交税费	-	-	-	178,150.25	178,150.25
其他负债	-	-	-	189,001.13	189,001.13
负债总计	19,999,870.00	-	-	11,750,473.79	31,750,343.79
利率敏感度缺口	4,739,686,119.60	54,262,300.00	4,703,106.10	73,073,728.42	4,871,725,254.12
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	52,157,114.55	-	-	-	52,157,114.55
结算备付金	5,086,532.94	-	-	-	5,086,532.94

存出保证金	11,280.77	-	-	11,280.77
交易性金融资产	142,526,467.60	467,824,000.00	-	610,350,467.60
应收利息	-	-	9,066,875.63	9,066,875.63
应收申购款	-	-	24,883,970.00	24,883,970.00
资产总计	199,781,395.86	467,824,000.00	33,950,845.63	701,556,241.49
负债				
卖出回购金融资产款	15,000,000.00	-	-	15,000,000.00
应付证券清算款	-	-	50,031,306.68	50,031,306.68
应付赎回款	-	-	123,504.83	123,504.83
应付管理人报酬	-	-	77,449.68	77,449.68
应付托管费	-	-	20,653.25	20,653.25
应付销售服务费	-	-	14,865.34	14,865.34
应付交易费用	-	-	2,225.00	2,225.00
应付利息	-	-	-23,480.03	-23,480.03
应交税费	-	-	22,427.09	22,427.09
其他负债	-	-	69,000.12	69,000.12
负债总计	15,000,000.00	-	50,337,951.96	65,337,951.96
利率敏感度缺口	184,781,395.86	467,824,000.00	-16,387,106.33	636,218,289.53

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021年12月31日）	上年度末（2020年12月31日）
	+25个基准点	-985,938.59	-2,410,779.52
-25个基准点	985,938.59	2,410,779.52	

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

本基金非以公允价值计量的金融工具，因其剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

(1) 各层次金融工具公允价值

本基金本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中无属于第一层次的余额（2020 年度：人民币零元），属于第二层次的余额为人民币 3,965,680,606.10 元（2020 年度：人民币 610,350,467.60 元），无属于第三层次的余额（2020 年度：人民币零元）。

(2) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具，在第一层次和第二层次之间无重大转移（2020 年度：无）。本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具未发生转入或转出第三层次公允价值的情况（2020 年度：无）。

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	3,965,680,606.10	80.87
	其中：债券	3,965,680,606.10	80.87
	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	840,352,195.53	17.14
	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	12,614,693.51	0.26
8	其他各项资产	84,828,102.77	1.73
9	合计	4,903,475,597.91	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有境内投资股票。

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

8.3 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

注：本基金本报告期末未持有股票。

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：本基金本报告期内未进行股票投资。

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：本基金本报告期内未进行股票投资。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注：本基金本报告期内未进行股票投资。

8.5 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	14,716,106.10	0.30
2	央行票据	-	-
3	金融债券	290,110,000.00	5.95
	其中：政策性金融债	290,110,000.00	5.95
4	企业债券	177,285,600.00	3.64
5	企业短期融资券	2,848,830,800.00	58.48
6	中期票据	586,033,100.00	12.03
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	48,705,000.00	1.00
9	其他	-	-
10	合计	3,965,680,606.10	81.40

8.6 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	012102501	21 格力电器 SCP009	1,000,000	100,250,000.00	2.06
2	190202	19 国开 02	1,000,000	100,040,000.00	2.05
3	012101496	21 山东重工 SCP001	800,000	80,368,000.00	1.65
4	012102668	21 晋能电力 SCP005	700,000	70,427,000.00	1.45
5	101901321	19 汇金 MTN015	700,000	70,364,000.00	1.44

8.7 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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 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

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 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

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末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 市场中性策略执行情况

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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

19 国开 02:

2021 年 1 月 8 日，银保监会银保监罚决字〔2020〕67 号显示，国家开发银行存在为违规的政府购买服务项目提供融资等 24 项违法违规事实，对其处以罚款 4880 万元。对以上事件，本基金判断，国家开发银行经营稳健，上述处罚对公司影响可控。后续关注其制度建设与执行等公司基础性建设问题的合规性以及企业的经营状况。

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

8.12.2 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

本基金本报告期内未进行股票投资。

8.12.3 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	3,900.56
2	应收证券清算款	10,084,949.48
3	应收股利	-
4	应收利息	70,764,343.68
5	应收申购款	3,974,909.05
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	84,828,102.77

8.12.4 期末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）。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有股票。

8.12.6 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
长盛安鑫中短债 A	1,912	1,683,956.88	2,684,036,537.70	83.36%	535,689,023.25	16.64%
长盛安鑫中短债 C	1,630	311,775.55	226,324,297.98	44.54%	281,869,850.85	55.46%
长盛安鑫中短债 D	9	90,758,589.73	816,827,307.56	100.00%	-	-
合计	3,551	1,279,849.91	3,727,188,143.24	82.01%	817,558,874.10	17.99%

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	长盛安鑫中短债 A	0.00	0.0000%
	长盛安鑫中短债 C	111.67	0.0000%
	长盛安鑫中短债 D	0.00	0.0000%
	合计	111.67	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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	长盛安鑫中短债 A	0
	长盛安鑫中短债 C	0
	长盛安鑫中短债 D	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	长盛安鑫中短债 A	0
	长盛安鑫中短债 C	0
	长盛安鑫中短债 D	0
	合计	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长盛安鑫中短债 A	长盛安鑫中短债 C	长盛安鑫中短债 D
基金合同生效日（2019 年 2 月 20 日）基金份额总额	1,277,203,632.47	1,049,512,459.60	-
本报告期期初基金份额总额	506,647,338.32	108,998,682.22	-
本报告期基金总申购份额	3,109,863,527.01	502,817,634.84	816,827,307.56
减:本报告期基金总赎回份额	396,785,304.38	103,622,168.23	-
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-	-
本报告期末基金份额总额	3,219,725,560.95	508,194,148.83	816,827,307.56

§ 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 11 月 2 日起, 王赛飞同志担任长盛安鑫中短债债券型证券投资基金基金经理; 葛鹤军同志不再担任该基金基金经理。自 2021 年 12 月 2 日起, 张建同志担任长盛安鑫中短债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

中国工商银行股份有限公司(以下简称“本公司”)根据工作需要, 任命刘彤女士担任本公司资产托管部总经理, 全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任本公司资产托管部总经理职务。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、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), 本报告期内基金未更换会计师事务所, 本报告期内应支付给该会计师事务所的报酬为 60,000.00 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

基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

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	
招商证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
国元证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	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
招商证券	331,492,558.15	84.57%	5,406,900,000.00	99.39%	-	-
申万宏源	50,373,483.56	12.85%	33,219,000.00	0.61%	-	-
国元证券	10,115,697.26	2.58%	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-

中信建投	-	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---	---

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交易单元均为共用交易单元。

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：无。

(2) 本基金报告期内停止租用交易单元：无。

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旗下基金增加百信银行为销售机构并	中国证监会指定披露媒介	2021年12月27日

	参加费率优惠活动的公告		
2	长盛基金管理有限公司关于增加长盛安鑫中短债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	2021 年 12 月 14 日
3	长盛安鑫中短债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 12 月 10 日
4	长盛安鑫中短债债券型证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会指定披露媒介	2021 年 12 月 10 日
5	长盛安鑫中短债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 12 月 10 日
6	长盛安鑫中短债债券型证券投资基金（长盛安鑫中短债 D 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 12 月 10 日
7	关于长盛安鑫中短债债券型证券投资基金增加 D 类基金份额 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 12 月 10 日
8	长盛安鑫中短债债券型证券投资基金（长盛安鑫中短债 C 份额）基金产品资料概要（更新）	中国证监会指定披露媒介	2021 年 12 月 7 日
9	长盛安鑫中短债债券型证券投资基金（长盛安鑫中短债 A 份额）基金产品资料概要（更新）	中国证监会指定披露媒介	2021 年 12 月 7 日
10	长盛基金管理有限公司关于调整长盛安鑫中短债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 12 月 4 日
11	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
12	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
13	长盛安鑫中短债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
14	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告	中国证监会指定披露媒介	2021 年 10 月 26 日
15	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
16	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
17	长盛基金管理有限公司旗下全部	中国证监会指定披	2021 年 8 月 28 日

	基金 2021 年中期报告提示性公告	露媒介	
18	长盛安鑫中短债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
19	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
20	长盛基金管理有限公司关于旗下基金参加招商证券费率优惠活动的公告	中国证监会指定披露媒介	2021 年 7 月 26 日
21	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
22	长盛安鑫中短债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
23	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
24	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
25	长盛基金管理有限公司关于增加华西证券为旗下部分开放式基金代销机构及开通基金定投和转换业务的公告	中国证监会指定披露媒介	2021 年 6 月 29 日
26	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
27	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
28	关于旗下由中国工商银行股份有限公司托管的 7 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 6 月 3 日
29	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
30	长盛安鑫中短债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
31	长盛基金管理有限公司关于增加中国中金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的公告	中国证监会指定披露媒介	2021 年 4 月 12 日
32	长盛基金管理有限公司关于旗下部分基金增加江苏江南农村商业银行作为代销机构的公告	中国证监会指定披露媒介	2021 年 4 月 9 日

33	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
34	长盛安鑫中短债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
35	长盛安鑫中短债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
36	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

§ 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	20210202~20211124	48,486,229.64	-	-	48,486,229.64	1.07%
	2	20211125~20211202	-	186,705,563.85	-	186,705,563.85	4.11%
	3	20210126~20211124	97,388,975.46	65,285,394.52	20,000,000.00	142,674,369.98	3.14%
	4	20210202~20210309	49,562,846.95	-	49,562,846.95	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
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、长盛安鑫中短债债券型证券投资基金相关批准文件；
- 2、《长盛安鑫中短债债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长盛安鑫中短债债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、《长盛安鑫中短债债券型证券投资基金招募说明书》；
- 5、法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照。

13.2 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。

13.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公地址和/或基金管理人互联网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人长盛基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-888-2666、010-86497888。

网址：<http://www.csfunds.com.cn>。

长盛基金管理有限公司

2022 年 3 月 31 日